

**【表紙】**

**【提出書類】** 有価証券届出書

**【提出先】** 関東財務局長

**【提出日】** 平成30年10月11日

**【発行者名】** アセットマネジメントOne株式会社

**【代表者の役職氏名】** 取締役社長 菅野 暁

**【本店の所在の場所】** 東京都千代田区丸の内一丁目8番2号

**【事務連絡者氏名】** 三木谷 正直

**【電話番号】** 03-6774-5100

**【届出の対象とした募集内国投資信託受 益証券に係るファンドの名称】** D I A M 8 資産バランスファンドN < D C 年金 >

**【届出の対象とした募集内国投資信託受 益証券の金額】** 200億円を上限とします。

**【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】

DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>  
（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】

200億円を上限とします。

### （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。

なお、収益分配金を再投資する場合は、各計算期間終了日の基準価額とします。

「基準価額」とは、純資産総額（ファンドの資産総額から負債総額を控除した金額）を計算日の受益権総口数で除した価額をいいます。（ただし、便宜上1万口当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。

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）

### （５）【申込手数料】

ありません。

（ 6 ） 【 申込単位 】

1口以上1口単位または1円以上1円単位(当初元本1口 = 1円)

収益分配金を再投資する場合は、1口単位となります。

（ 7 ） 【 申込期間 】

継続申込期間：平成30年10月12日から平成31年4月11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、香港証券取引所、韓国取引所、ニューヨークの銀行、ロンドンの銀行、フランクフルトの銀行、香港の銀行、韓国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

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

（ 9 ） 【 払込期日 】

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

（ 1 0 ） 【 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、

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

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）

（ 1 1 ） 【 振替機関に関する事項 】

振替機関は以下の通りです。

・株式会社証券保管振替機構

（ 1 2 ） 【 その他 】

お申込みの際は、販売会社所定の方法でお申込みください。

当ファンドは、原則として確定拠出年金制度によるお申込みのみの取扱いとなります。ただし、委託会社または販売会社が取得する場合はこの限りではありません。

当ファンドは、収益の分配が行われた場合、収益分配金を無手数料で再投資する「累積投資（自動けいぞく投資）」専用ファンドです。このためお申込みの際、受益権の取得申込者は販売会社との間で、「自動けいぞく投資約款」にしたがって分配金累積投資に関する契約を締結します。なお、販売会社によっては、当該契約または規定については、同様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約または規定を使用することがあり、この場合、当該別の名称に読み替えるものとします。

当ファンドのお申込みは、原則として販売会社の毎営業日に行われます。お申込みの受付は、原則として午後3時までにお申込みが行われ、かつ、お申込みの受付にかかる販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。ただし、海外休業日にはお申込みの受付は行いません。

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

受益権の取得申込者は、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この信託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、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざ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>

**主としてマザーファンド<sup>※1</sup>への投資を通じて、実質的に国内外の株式、公社債および不動産投資信託証券<sup>※2</sup>に投資します。**

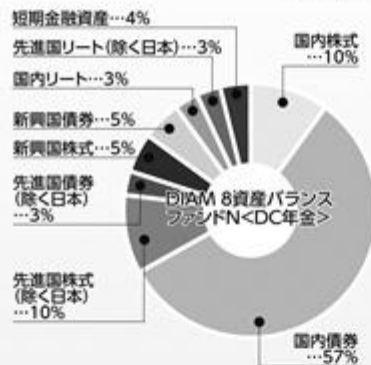
※1 当ファンドが投資するマザーファンドは下記のとおりです。(以下を総称して「マザーファンド」あるいは個別に「各マザーファンド」といいます。)

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	
国内債券パッシブ・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	
外国債券パッシブ・ファンド・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	
エマージング債券パッシブ・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	

※2 「不動産投資信託証券」(以下「リート(REIT)」)という場合があります。)とは、不動産投資法人または不動産投資信託を総称した一般呼称です。多くの投資者から集めた資金などで、商業施設、マンション、倉庫などの様々な不動産を保有し、そこから生じる賃料収入等などが投資者に分配される商品をいいます。

**次に掲げる基本アロケーションによる合成ベンチマークに概ね連動した投資成果をめざして運用を行います。**

#### <基本アロケーション>



※マザーファンドへの投資比率の基本アロケーションからの乖離については、乖離許容範囲を定めてその範囲内に維持するよう運用を行います。なお、時価変動等により乖離許容範囲を超えた場合、リバランスを実施します。

経済環境、運用環境見通しの大きな変更等により委託会社が必要と判断した場合には、基本アロケーションの見直しを行うことがあります。

なお、合成ベンチマークの各資産のベンチマークはそれぞれ以下のとおりです。

資産	ベンチマーク
国内株式	東証株価指数(TOPIX)(配当込み)
国内債券	NOMURA-BPI総合
先進国株式(除く日本)	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)
先進国債券(除く日本)	FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース、為替ヘッジなし)
新興国株式	MSCIエマージング・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)
新興国債券	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)
国内リート	東証REIT指数(配当込み)
先進国リート(除く日本)	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)
短期金融資産	コール・ローン(オーバーナイト物)

※合成ベンチマークとは、各資産ごとのベンチマークの騰落率を基本アロケーションに乗じて指数化したものです。

### 3 実質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。

#### < 分配方針 >

年1回の決算時(毎年1月11日(休業日の場合は翌営業日))に、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。)等の全額を対象として、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して、分配金額を決定します。

- ・将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。
- ・分配金額は、分配方針に基づいて委託会社が決定します。あらかじめ一定の額の分配をお約束するものではありません。分配金が支払われない場合もあります。

#### 商品分類表

単位型投信 追加型投信	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	補足分類
単位型投信	国内	株式	インデックス型
	海外	債券	
追加型投信	内外	不動産投信	特殊型
		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。
インデックス型	目論見書または投資信託約款において、各種指数に連動する運用成果をめざす旨の記載があるものをいいます。

## 属性区分表

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

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

## 属性区分定義

その他資産 （投資信託証券 （資産複合 （株式、債券、 不動産投信） 資産配分固定型））	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（株式、債券、不動産投信）を実質的な投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるものをいいます。 (注)商品分類表の投資対象資産は資産複合に分類され、属性区分表の投資対象資産はその他資産（投資信託証券（資産複合（株式、債券、不動産投信）資産配分固定型））に分類されます。
年1回	目論見書または投資信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。
グローバル （日本を含む）	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。
為替ヘッジなし	目論見書または投資信託約款において、対円での為替のヘッジを行なわない旨の記載があるものまたは対円での為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいいます。
その他	日経225またはTOPIXにあてはまらない全てのものをいいます。

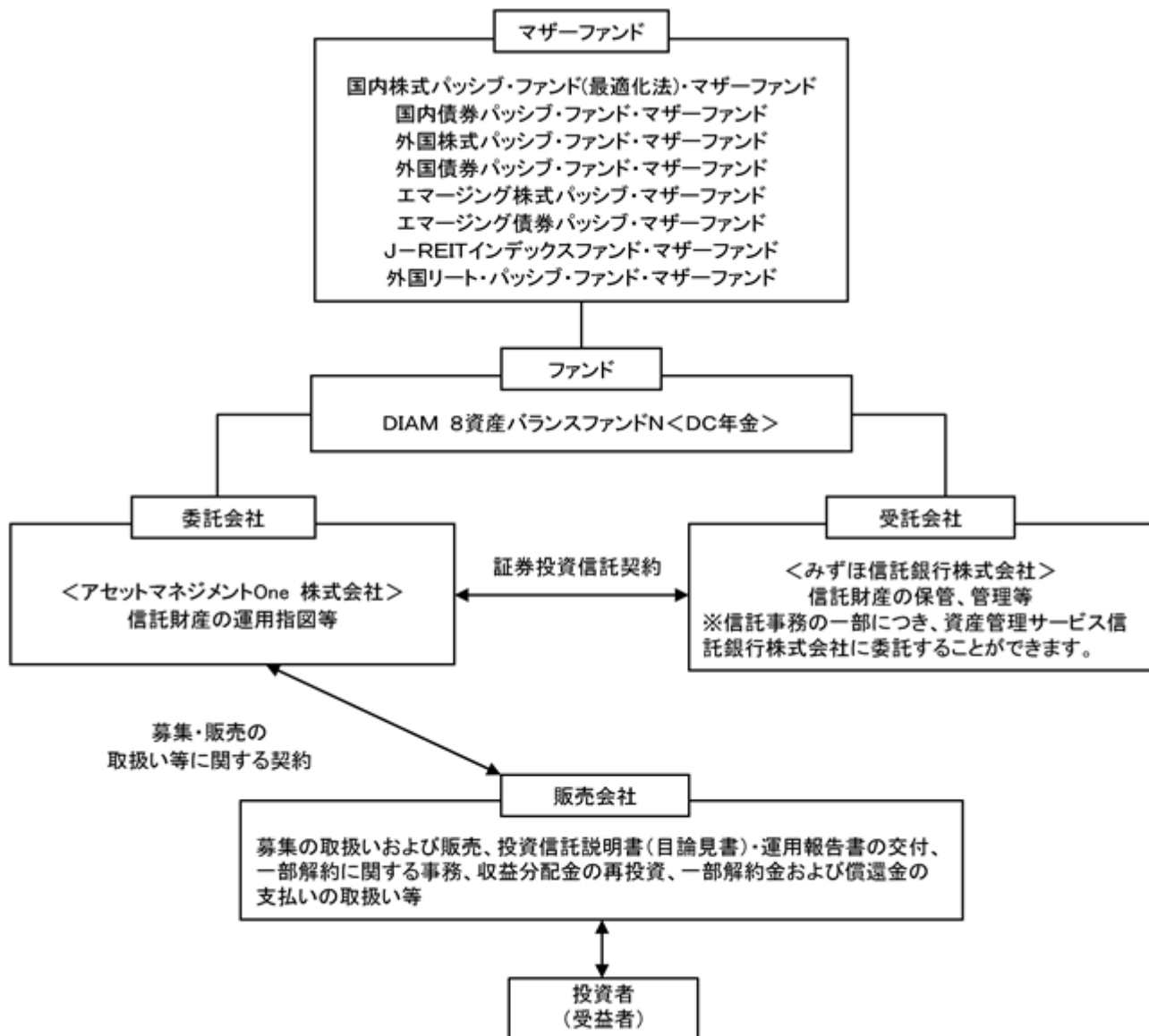
上記の分類は、一般社団法人投資信託協会の商品分類に関する指針に基づき記載しております。上記以外の商品分類および属性区分の定義については、一般社団法人投資信託協会ホームページ（<http://www.toushin.or.jp/>）をご覧ください。

## （２）【ファンドの沿革】

平成25年11月8日 信託契約締結、ファンドの設定、ファンドの運用開始



## (3) 【ファンドの仕組み】



## ・「証券投資信託契約」の概要

委託会社と受託会社との間においては、当ファンド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

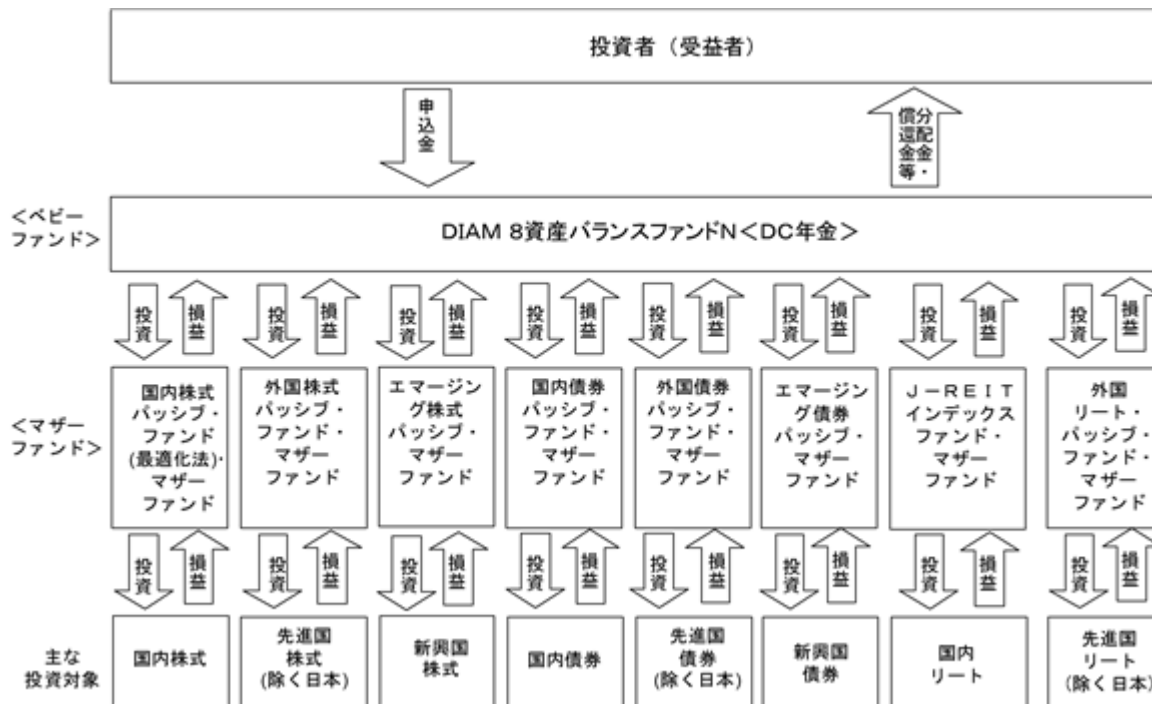
委託会社と販売会社との間においては、募集・販売の取扱い等に関する契約を締結します。

当該契約の内容は、証券投資信託の募集・販売の取扱い、一部解約に関する事務、収益分配金の再投資、一部解約金および償還金の受益者への支払い等に関する包括的な規則を定めたものです。

## ファミリーファンド方式とは

当ファンドは「ファミリーファンド方式」により運用を行います。

「ファミリーファンド方式」とは、複数のファンドを合同運用する仕組みで、投資者からの資金をまとめてベビーファンド（当ファンド）とし、その資金の全部または一部をマザーファンド受益証券に投資して、その実質的な運用を各マザーファンドにて行います。



#### 委託会社の概況

名称：アセットマネジメントOne株式会社

本店の所在の場所：東京都千代田区丸の内一丁目8番2号

#### 資本金の額

20億円（平成30年7月31日現在）

#### 委託会社の沿革

昭和60年7月1日	会社設立
平成10年3月31日	「証券投資信託法」に基づく証券投資信託の委託会社の免許取得
平成10年12月1日	証券投資信託法の改正に伴う証券投資信託委託業のみなし認可
平成11年10月1日	第一ライフ投信投資顧問株式会社を存続会社として興銀エヌダブリュ・アセットマネジメント株式会社及び日本興業投信株式会社と合併し、社名を興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社とする。
平成20年1月1日	「興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社」から「DIAMアセットマネジメント株式会社」に商号変更
平成28年10月1日	DIAMアセットマネジメント株式会社、みずほ投信投資顧問株式会社、新光投信株式会社、みずほ信託銀行株式会社（資産運用部門）が統合し、商号をアセットマネジメントOne株式会社に変更

## 大株主の状況

（平成30年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 <sup>1</sup>	70.0% <sup>2</sup>
第一生命ホールディングス株式会社	東京都千代田区有楽町一丁目13番1号	12,000株	30.0% <sup>2</sup>

1：A種種類株式（15,510株）を含みます。

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

## 2【投資方針】

## (1)【投資方針】

## &lt;基本方針&gt;

この投資信託は、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行います。

## &lt;投資対象&gt;

主として、以下のマザーファンド受益証券（以下「マザーファンド」といいます。）を主要投資対象とします。

- 1.国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド
- 2.国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
- 3.外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
- 4.外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
- 5.エマージング株式パッシブ・マザーファンド
- 6.エマージング債券パッシブ・マザーファンド
- 7.J-REITインデックスファンド・マザーファンド
- 8.外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

## &lt;投資態度&gt;

主としてマザーファンドへの投資を通じて、実質的に国内外の株式、公社債および不動産投資信託証券に投資します。

次に掲げる基本アロケーションによる合成ベンチマークに概ね連動した投資成果を目指して運用を行います。

## &lt;基本アロケーション&gt;

国内株式 10%+国内債券57%+先進国株式（除く日本） 10%+先進国債券（除く日本） 3%+新興国株式5%+新興国債券 5%+国内不動産投資信託証券 3%+先進国不動産投資信託証券3%+短期金融資産 4%

経済環境、運用環境見通しの大きな変更等により委託会社が必要と判断した場合には、基本アロケーションの見直しを行うことがあります。

なお、合成ベンチマークの各資産のベンチマークはそれぞれ以下の通りです。

- ・ 国内株式：東証株価指数(T O P I X)(配当込み)
- ・ 国内債券：N O M U R A - B P I 総合
- ・ 先進国株式(除く日本)：M S C I 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)
- ・ 先進国債券(除く日本)：F T S E 世界国債インデックス(除く日本、円ベース、為替ヘッジなし)
- ・ 新興国株式：M S C I エマージング・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)
- ・ 新興国債券：J P 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)
- ・ 国内R E I T：東証R E I T 指数(配当込み)
- ・ 海外R E I T：S & P 先進国 R E I T 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)
- ・ 短期金融資産：コール・ローン(オーバーナイト物)

マザーファンドへの投資比率の基本アロケーションからの乖離については、乖離許容範囲を定めてその範囲内に維持するよう運用を行います。なお、時価変動等により乖離許容範囲を超えた場合、リバランスを実施します。

実質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。

上記にかかわらず、ファンドの資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、ならびに純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合等、やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用が出来ない場合があります。

対象指数の変動をその基準価額の変動に適正に反映するための手法に関する事項

ファンドは合成ベンチマークに連動させるため、以下の対応を行います。

各マザーファンドへの投資比率と基本アロケーションとの乖離について乖離許容範囲を定めその範囲内に維持するよう運用を行うことにより、合成ベンチマークに概ね連動させます。なお、乖離距離範囲を超えた場合にはリバランスを実施いたします。

なお、投資対象とする各マザーファンドにおける対象指数の変動をその基準価額の変動に適正に反映するための手法に関する事項については、下記2投資方針 (2)投資対象 (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をご参照ください。

## (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。)

ハ.金銭債権

ニ.約束手形

## 2.次に掲げる特定資産以外の資産

### イ.為替手形

#### 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株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド、国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド、外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド、外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド、エマージング株式パッシブ・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、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（以下それぞれを「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。）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	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド
基本方針	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。
主な投資対象	東京証券取引所第1部に上場されている株式を主要投資対象とします。

投資態度	<ol style="list-style-type: none"><li>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。</li><li>2.最適化法によるポートフォリオ構築を行い、運用コストの最小化と徹底したリスク管理を行います。</li><li>3.株式(株価指数先物取引を含みます。)の組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</li><li>4.株式の組入比率の調整には、株価指数先物取引等を活用します。</li><li>5.非株式割合は原則として信託財産総額の50%以下とします。また、外貨建資産割合は原則として信託財産総額の10%以下とします。</li></ol> <div style="border: 1px solid black; padding: 10px; margin-top: 10px;"><p>東証株価指数(TOPIX)の指数値およびTOPIXの商標は、株式会社東京証券取引所(以下「株東京証券取引所」といいます。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など東証株価指数(TOPIX)に関するすべての権利・ノウハウおよびTOPIXの商標に関するすべての権利は株東京証券取引所が有しています。</p><p>株東京証券取引所は、東証株価指数(TOPIX)の指数値の算出もしくは公表の方法の変更、東証株価指数(TOPIX)の指数値の算出もしくは公表の停止またはTOPIXの商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。</p><p>株東京証券取引所は、東証株価指数(TOPIX)の指数値およびTOPIXの商標の使用に関して得られる結果ならびに特定日の東証株価指数(TOPIX)の指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。</p><p>株東京証券取引所は、東証株価指数(TOPIX)の指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、株東京証券取引所は、東証株価指数(TOPIX)の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。</p><p>当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドは、株東京証券取引所により提供、保証または販売されるものではありません。</p><p>株東京証券取引所は、当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドの購入者または公衆に対し、当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を持ちません。</p><p>株東京証券取引所は、委託会社または当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドの購入者のニーズを、東証株価指数(TOPIX)の指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。</p><p>以上の項目に限らず、株東京証券取引所は当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドの発行または売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を負いません。</p></div>
------	---

## 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

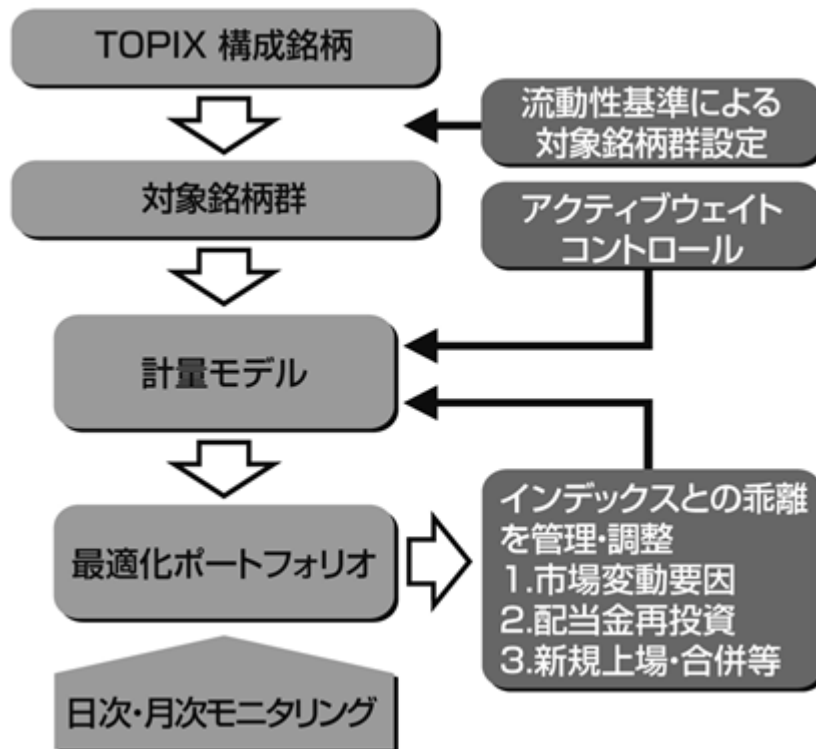
インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差（アクティブウェイト）を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。

## 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



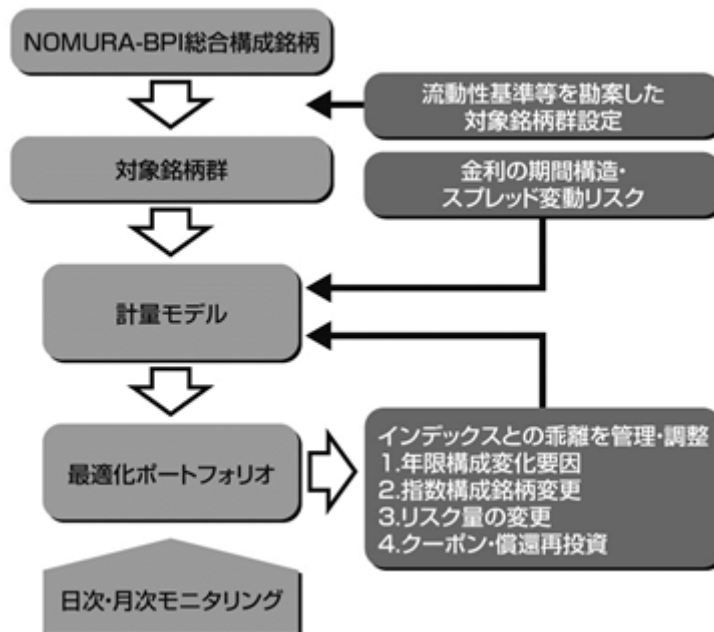


主な投資制限	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. 株式への投資割合には、制限を設けません。</li> <li>2. デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</li> <li>3. 外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。</li> <li>4. 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券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。</li> </ol>
--------	--

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"> <li>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。</li> <li>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。</li> <li>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。</li> </ol> <div style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin-top: 10px;"> <p>NOMURA - B P I 総合の知的財産権その他一切の権利は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。</p> </div>

## 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



主な投資制限	<ol style="list-style-type: none"><li>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、ます。</li><li>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。</li><li>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。</li><li>4. 同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</li><li>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。</li><li>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。</li><li>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。</li><li>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。</li></ol>
--------	--

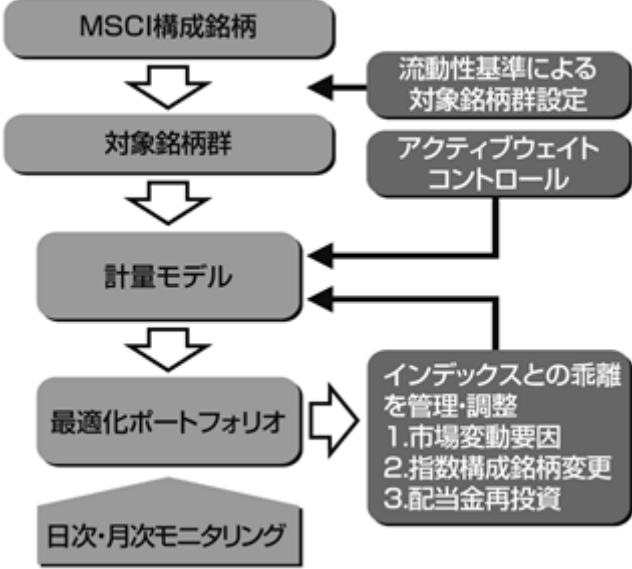
ファンド名	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。
主な投資対象	海外の株式を主要投資対象とします。

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

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對して、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對りなく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對して、本ファンドの管理、マーケティングまたは募集に関するいかなる義務または責任も負いません。

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

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

	<p>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"> <li>・市場変動に伴うもの：推定トラッキングエラーの増加に伴い実施</li> <li>・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</li> <li>・配当金再投資に伴うもの：キャッシュ比率の上昇に伴い実施</li> </ul>  <pre> graph TD     A[MSCI構成銘柄] --&gt; B[対象銘柄群]     C[流動性基準による対象銘柄群設定] --&gt; B     B --&gt; D[計量モデル]     E[アクティブウェイトコントロール] --&gt; D     D --&gt; 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] --&gt; F     F --&gt; H[日次・月次モニタリング]   </pre>

主な投資制限	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. 株式への投資割合には、制限を設けません。</li> <li>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。</li> <li>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。</li> <li>4. 外貨建資産への投資には、制限を設けません。</li> <li>5. デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</li> <li>6. 外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。</li> <li>7. 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</li> </ol>
--------	--

ファンド名	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。
主な投資対象	海外の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	<ol style="list-style-type: none"> <li>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、為替ヘッジなし）」に連動する投資成果をめざして運用を行います。</li> <li>2. 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。</li> <li>3. 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。</li> </ol> <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。</p> <p>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

## 1.流動性基準等による対象銘柄群設定

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

## 2.最適化法によるポートフォリオの構築

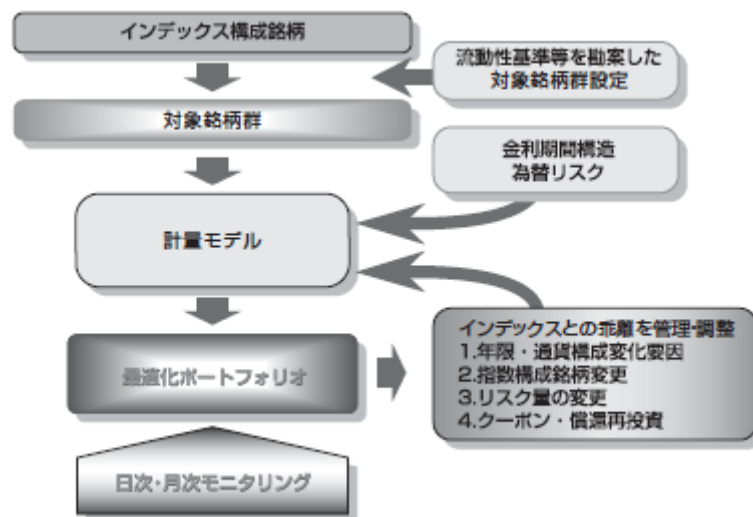
金利の期間構造、通貨エクスポージャーから発生するベンチマーク乖離要因が最小となるポートフォリオを構築します。

## 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、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。

インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。

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





主な投資制限	<p>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。</p> <p>株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>2. 同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>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、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>4. 外貨建資産への投資には、制限を設けません。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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>
--------	--

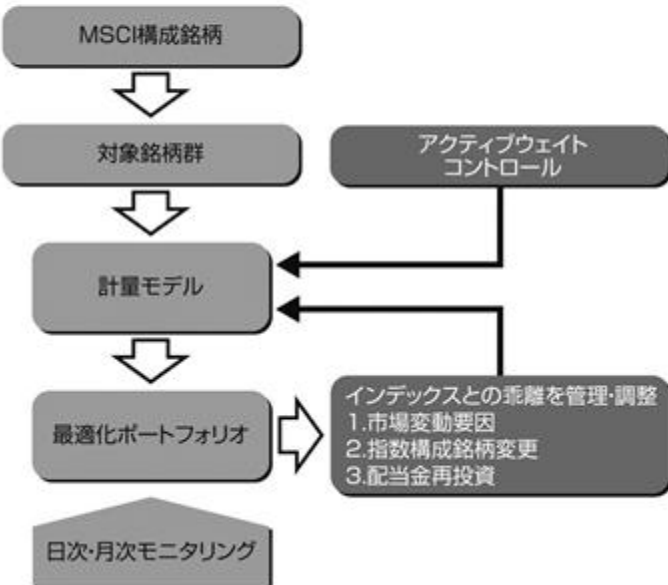
ファンド名	エマージング株式パッシブ・マザーファンド
基本方針	<p>この投資信託は、主として海外の証券取引所に上場している株式<sup>(*)</sup>に投資し、MSCIEマージング・マーケット・インデックス(円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>(*)DR(預託証券)もしくは株式と同等の投資効果が得られる権利を表示する証券および証書等を含みます。</p>
主な投資対象	海外の証券取引所に上場している株式を主要投資対象とします。

投資態度	<ol style="list-style-type: none"><li>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、MSCIエマージング・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。</li><li>2.原則として、株式の組入比率は高位を維持します。</li><li>3.外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。</li></ol>
------	---

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

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

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

	<p>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>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] --&gt; B[対象銘柄群]     B --&gt; C[計量モデル]     C --&gt; 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] --&gt; C     E --&gt; D     D --&gt; 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]     F --&gt; G[日次・月次モニタリング]   </pre>
主な投資制限	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. 株式への投資割合には、制限を設けません。</li> <li>2. 外貨建資産への投資には、制限を設けません。</li> <li>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。</li> <li>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。</li> <li>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。</li> <li>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。</li> </ol>

ファンド名	エマージング債券パッシブ・マザーファンド
基本方針	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。
主な投資対象	新興国の公社債を主要投資対象とします。

<p>投資態度</p>	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>3.組入債券は、当初組入時において、S&amp;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。</p> <p>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。</p> <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>
<p>運用プロセス</p>	<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> <pre> graph TD     A[インデックス構成銘柄] --&gt; B[対象銘柄群]     B --&gt; C[計量モデル]     C --&gt; D[最適化ポートフォリオ]     E[信用格付基準等を勘案した対象銘柄群設定] --&gt; B     F[金利期間構造] --&gt; C     D --&gt; G[インデックスとの乖離を管理・調整]     G --&gt; H[日次・月次モニタリング]     </pre>

主な投資制限	<ol style="list-style-type: none"> <li>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。</li> <li>2. 外貨建資産への投資には、制限を設けません。</li> <li>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。</li> <li>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。</li> <li>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。</li> <li>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。</li> </ol>
--------	--

ファンド名	J-REITインデックスファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、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。
主な投資対象	東京証券取引所に上場し、東証REIT指数に採用されている(または採用予定の)不動産投資信託証券(一般社団法人投資信託協会規則に定める不動産投信等をいいます。以下同じ。)を主要投資対象とします。
投資態度	<ol style="list-style-type: none"> <li>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。</li> <li>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。</li> <li>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。</li> </ol>

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。

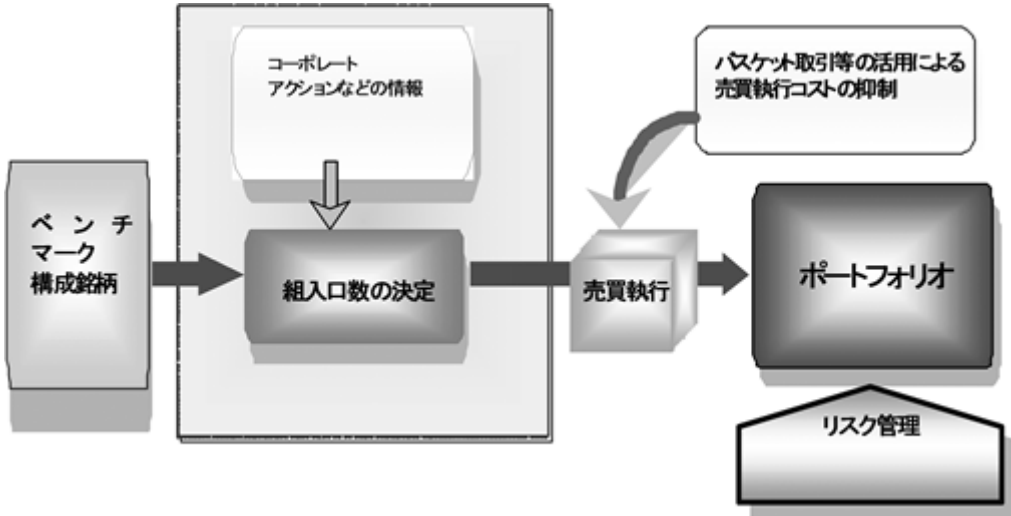
㈱東京証券取引所は、東証REIT指数の指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、㈱東京証券取引所は、東証REIT指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。

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。

運用プロセス	<ul style="list-style-type: none"> <li>・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。</li> <li>・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得し、最適な執行方法によりリバランスを実施します。</li> <li>・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。</li> </ul> 
主な投資制限	<p>投資信託証券への投資割合には制限を設けません。</p> <p>同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として信託財産の純資産総額の30%を超えないものとします。ただし、東証REIT指数採用の不動産投資信託証券の上場時価総額の合計額に占める同一銘柄の不動産投資信託証券の時価総額の割合が30%を超えている場合、当該同一銘柄の不動産投資信託証券への投資割合は、原則として当該同一銘柄の不動産投資信託証券の時価総額が東証REIT指数採用の不動産投資信託証券の上場時価総額の合計額に占める割合の範囲で投資することができるものとします。</p> <p>株式への投資は行いません。</p> <p>外貨建資産への投資は行いません。</p> <p>デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動および金利変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>

ファンド名	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、S & P 先進国 REIT インデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）に連動する投資成果をめざして運用を行います。

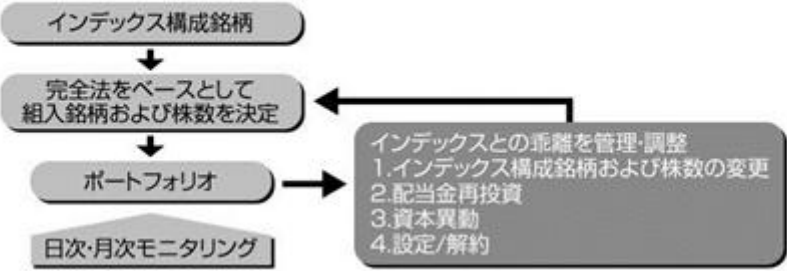


主な投資対象	<p>日本を除く世界各国の不動産投資信託証券<sup>*</sup>を主要投資対象とします。</p> <p><sup>*</sup> 海外の証券取引所に上場(これに準ずるものを含みます。)されている不動産投資信託証券とします。</p>
--------	---

投資態度	<ol style="list-style-type: none"><li>1.主に日本を除く世界各国の不動産投資信託証券を主要投資対象とし、S &amp; P 先進国 REITインデックス(除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし) に連動する投資成果をめざして運用を行います。</li><li>2.不動産投資信託証券への投資割合は、原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</li><li>3.外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。ただし、金利・為替状況によってはヘッジを行う場合があります。</li></ol>
------	--

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

	<p>先進国 REITインデックスを使用することによって、またはそれに関連するデータに関して、委託会社、本商品の所有者、またはその他の人物や組織が得られる結果について、一切の保証を明示的に否認します。上記を制限することなく、いかなる場合においても、S&amp;P Dow Jones Indicesは、利益の逸失、営業損失、時間または信用の喪失を含むがこれらに限定されない、間接的、特別、懲罰的、または派生的損害に対して、たとえその可能性について知らされていたとしても、契約の記述、不法行為、または厳格責任の有無を問わず、一切の責任を負わないものとします。S&amp;P Dow Jones Indicesのライセンサーを除き、S&amp;P Dow Jones Indicesと委託会社との間の契約または取り決めの第三者受益者は存在しません。</p>
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&amp;P先進国REITインデックス(除く日本)」を構成する全ての銘柄を、その時価構成比で組み入れることをめざします。インデックスに対する運動性を随時確認し、必要に応じてポートフォリオのリバランスを実施します。</p>  <pre> graph TD     A[インデックス構成銘柄] --&gt; B[完全法をベースとして 組入銘柄および株数を決定]     B --&gt; C[ポートフォリオ]     C --&gt; D[日々・月次モニタリング]     D --&gt; E[インデックスとの乖離を管理・調整 1.インデックス構成銘柄および株数の変更 2.配当金再投資 3.資本異動 4.設定/解約]     E --&gt; B   </pre>
主な投資制限	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. 投資信託証券への投資割合には制限を設けません。</li> <li>2. 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</li> <li>3. 株式への直接投資は行いません。</li> <li>4. 同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として信託財産の純資産総額の30%以内とします。ただし、S &amp; P 先進国 REITインデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）における時価の構成割合が30%を超える不動産投資信託証券がある場合には、指数との運動性を維持するために当該不動産投資信託証券をS &amp; P 先進国 REITインデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）の構成割合の範囲で組入れることができるものとします。</li> <li>5. デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</li> <li>6. 外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。</li> <li>7. 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</li> </ol>

資金動向、市況動向等によっては、上記の運用ができない場合があります。

## (3) 【運用体制】

## a. ファンドの運用体制



## 投資環境見通しおよび運用方針の策定

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

## 運用計画の決定

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

## 売買執行の実施

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

## モニタリング

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

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

#### 内部管理等のモニタリング

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

#### b．ファンドの関係法人に関する管理

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

#### c．運用体制に関する社内規則

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

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

運用体制は平成30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。

#### 収益分配金の再投資

収益分配金は、原則として自動的に再投資されます。

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

#### (5) 【投資制限】

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

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)

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実質比率は、原則として、それぞれ10%、合計で20%を超えないものとし、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します。



#### 信用取引の指図範囲（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るものとします。
- 2) 上記1)の信用取引の指図は、次の1.～6.に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行うことができるものとし、かつ次の1.～6.に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。
  1. 信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
  2. 株式分割により取得する株券
  3. 有償増資により取得する株券
  4. 売出しにより取得する株券
  5. 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）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。）、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。）、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。）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、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、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。

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、および為替変動リスクを回避するため、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および運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て(一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。)を目的として、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

当ファンドが実質的に投資する各資産の配分比率は、基本アロケーションの比率に準じ、一定範囲内の変動に抑えます。この資産配分が当ファンドの収益の源泉となる場合もありますが、収益率の悪い資産への配分が大きい場合、複数または全ての資産価値が下落する場合には、各資産の投資成果が各資産のベンチマークと同等あるいはそれ以上のものであったとしても、当ファンドの基準価額が下がる要因となる可能性があります。

#### 株価変動リスク

株式の価格は、国内外の政治・経済情勢、発行会社の業績・財務状況、または市場の需給や流動性等の影響を受けます。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

金利リスクとは、金利の変動を受けて債券・リートの価格が変動するリスクをいいます。一般的に金利が上昇した場合には、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

為替リスクとは、外国為替相場の変動により外貨建資産の価格が変動するリスクをいいます。外貨建資産への投資は、その国の政治経済情勢、通貨規制、資本規制等の要因による影響を受けて損失を被る可能性もあります。当ファンドは、実質組入外貨建資産について原則として対円で為替ヘッジを行わないため為替変動の影響を受けます。このため為替相場が当該実質組入資産の通貨に対して円高になった場合には基準価額が下がる要因となります。

## 信用リスク

当ファンドが実質的に投資する株式・債券の発行者が経営不安・倒産に陥った場合、当ファンドが実質的に投資するリートが収益性の悪化や資金繰り悪化等により清算される場合、またこうした状況に陥ると予想される場合等には、投資した資産の価格が下落したりその価値がなくなることがあり、基準価額が下がる要因となります。

## 流動性リスク

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

## カントリーリスク

投資対象国・地域において、政治・経済情勢の変化等によって市場に混乱が生じた場合、もしくは取引に対して規制が変更となる場合、または新たな規制が設けられた場合には、基準価額は予想外に下落する場合があります。また、実質的に投資を行う新興国の通貨や有価証券等の発行者が属する国の経済状況は、先進国経済と比較して一般的に脆弱である可能性があります。そのため、当該国のインフレ、国際収支、外貨準備高等の悪化などが為替市場や株式、債券市場におよぼす影響は、先進国以上に大きいものになることが予想されます。さらに、政府当局による海外からの投資規制や課徴的な税制、海外への送金規制などの種々な規制の導入や政策の変更等の要因も為替市場や株式、債券市場に著しい影響をおよぼす可能性があります。

基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

## <その他の留意点>

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

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

収益分配金に関する留意点として、以下の事項にご留意ください。

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

受益者の個別元本の状況によっては、分配金の全額または一部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。個別元本とは、追加型投資信託を保有する受益者毎の取得元本のことと、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、各マザーファンドへの投資を通じて合成ベンチマークに概ね連動する投資成果をめざして運用を行いますが、各マザーファンドが各対象ベンチマーク採用全銘柄を組入れないこと、資金流入から組入銘柄の売買執行までのタイミングにずれが生じること、売買時のコストや信託報酬等の費用を負担すること等により、基準価額と合成ベンチマークが乖離する場合があります。

当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行います。そのため、当ファンドが投資対象とするマザーファンドを投資対象とする他のベビーファンドに追加設定・解約等があった場合、資金変動が起これ、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。

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

資金動向、市場動向等によっては、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10億口を下回る事となった場合、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、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も信託を終了(繰上償還)する場合があります。

#### 注意事項

- ・当ファンドは、実質的に株式、債券、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 >

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

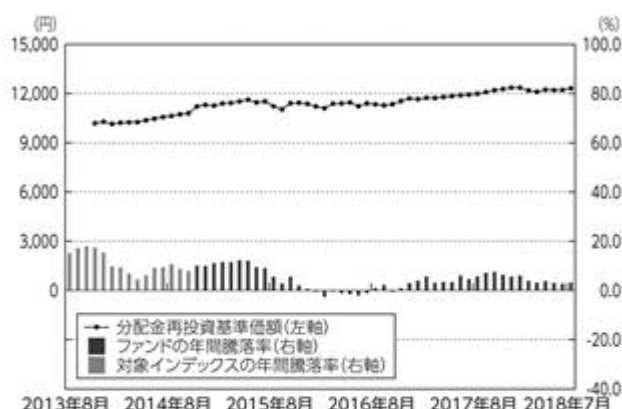
- ・運用リスクの管理：運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。
- ・運用パフォーマンス評価：運用担当部署から独立したリスク管理担当部署が、ファンドの運用パフォーマンスについて定期的に分析を行い、結果の評価を行います。
- ・リスク管理に関する委員会等：上記のとおり運用リスクの管理状況、運用パフォーマンス評価等の報告を受け、リスク管理に関する委員会等は総合的な見地から運用状況全般の管理・評価を行います。



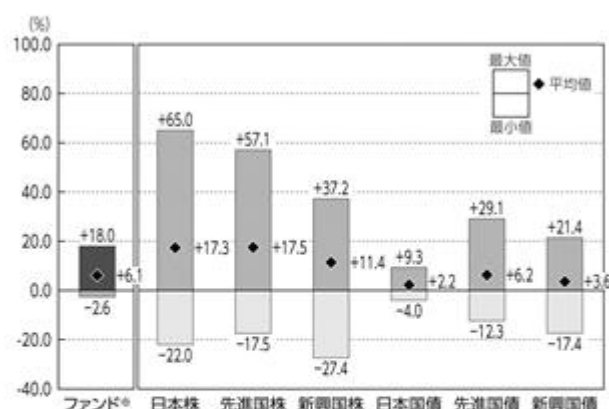
上記体制は平成30年7月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

## <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:2013年8月~2018年7月(2013年8月~2014年10月は対象インデックスのデータ)  
 代表的な資産クラス:2013年8月~2018年7月

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

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

\*ファンドの年間騰落率がない期間については、連動する投資成果を目指す対象インデックスの年間騰落率を表示しており、ファンドの実績ではありません。

\*ファンドの対象インデックスは当ファンドが投資する各マザーファンドのベンチマークを基本アロケーションで委託会社が合成したものです。対象インデックスについては、ファンドの特色をご参照ください。

\*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。

\*ファンドの年間騰落率がない期間については、ファンドの年間騰落率に代えて対象インデックスの年間騰落率を用いて算出・表示していますので、ファンドの実績ではありません。

\*全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

#### \*各資産クラスの指数

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

- 「東証株価指数(TOPIX)」は、東京証券取引所第一部に上場されているすべての株式の時価総額を指数化したものです。同指数は、株式会社東京証券取引所(株東京証券取引所)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、株東京証券取引所が有しています。
- 「MSCIコクサイ・インデックス」は、MSCI Inc.が開発した株価指数で、日本を除く世界の主要先進国の株価指数を、各国の株式時価総額をベースに合成したものです。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
- 「MSCIエマージング・マーケット・インデックス」は、MSCI Inc.が開発した株価指数で、新興国の株価指数を、各国の株式時価総額をベースに合成したものです。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
- 「NOMURA-BPI国債」は、野村證券株式会社が国内で発行された公募利付国債の市場全体の動向を表すために開発した投資収益指数です。同指数の知的財産権その他一切の権利は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。
- 「FTSE世界国債インデックス(除く日本)」は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。
- 「JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイド」は、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが公表している新興国の現地通貨建ての国債で構成されている時価総額加重平均指数です。同指数に関する著作権等の知的財産その他一切の権利はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。また、同社は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。



## 4【手数料等及び税金】

## (1)【申込手数料】

ありません。

## (2)【換金(解約)手数料】

ありません。

## (3)【信託報酬等】

ファンドの日々の純資産総額に対して年率0.2646%(税抜0.245%)

支払先	内訳(税抜)	主な役務
委託会社	年率0.120%	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0.100%	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0.025%	運用財産の保管・管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率

信託報酬は、毎日計上され、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日(休業日の場合は翌営業日)および毎計算期末または信託終了のときに信託報酬にかかる消費税等相当額とともに信託財産から支払われます。

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

## (4)【その他の手数料等】

## ・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、毎日計上され、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日(休業日の場合は翌営業日)および毎計算期末または信託終了のとき、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。

法人の受益者に対する課税

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

なお、益金不算入制度の適用はありません。

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

上記は、平成30年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、個別元本の算出が行われる場合があります。

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

##### < 収益分配金の課税について >

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

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

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

税法が改正された場合等は、上記内容が変更になることがあります。

## 5【運用状況】

## (1)【投資状況】

平成30年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	4,590,964,296	96.00
内 日本	4,590,964,296	96.00
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	191,089,663	4.00
純資産総額	4,782,053,959	100.00

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

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

(参考)

## 国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

平成30年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	290,442,666,020	96.36
内 日本	290,442,666,020	96.36
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	10,963,109,662	3.64
純資産総額	301,405,775,682	100.00

## その他資産の投資状況

平成30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）	10,767,680,000	3.57
内 日本	10,767,680,000	3.57

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

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

(注3) 先物取引の時価は、原則として計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

## 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	284,473,597,300	82.87
内 日本	284,473,597,300	82.87
地方債証券	22,407,273,145	6.53
内 日本	22,407,273,145	6.53
特殊債券	16,808,892,217	4.90
内 日本	16,808,892,217	4.90
社債券	15,482,006,470	4.51
内 日本	15,281,148,470	4.45
内 オランダ	200,858,000	0.06
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	4,100,823,474	1.19
純資産総額	343,272,592,606	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

## J-REITインデックスファンド・マザーファンド

平成30年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	36,703,968,650	97.90
内 日本	36,703,968,650	97.90
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	788,977,385	2.10
純資産総額	37,492,946,035	100.00

## その他資産の投資状況

平成30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）	617,058,000	1.65
内 日本	617,058,000	1.65

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

（注3）先物取引の時価は、原則として計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

## 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	302,012,547,573	95.38
内 アメリカ	191,517,411,682	60.48
内 イギリス	20,142,770,666	6.36
内 フランス	11,960,117,691	3.78
内 カナダ	11,740,119,075	3.71
内 ドイツ	11,716,700,729	3.70
内 スイス	10,733,398,636	3.39
内 オーストラリア	7,609,895,896	2.40
内 オランダ	5,997,575,826	1.89
内 アイルランド	4,492,778,951	1.42
内 スペイン	3,728,316,042	1.18
内 スウェーデン	3,154,966,969	1.00
内 香港	2,939,024,255	0.93
内 イタリア	2,371,642,425	0.75
内 デンマーク	2,087,550,692	0.66
内 ジャージー	1,589,400,324	0.50
内 シンガポール	1,429,354,300	0.45
内 バミューダ	1,418,762,002	0.45
内 ベルギー	1,299,944,397	0.41
内 フィンランド	1,238,398,426	0.39
内 ノルウェー	890,319,699	0.28
内 ケイマン諸島	779,153,406	0.25
内 オランダ領キュラソー	773,454,450	0.24
内 イスラエル	645,154,978	0.20
内 ルクセンブルグ	411,436,749	0.13
内 オーストリア	289,151,141	0.09
内 ニュージーランド	258,433,379	0.08
内 パナマ	206,776,182	0.07
内 ポルトガル	204,985,775	0.06
内 リベリア	151,516,637	0.05
内 イギリス領バージン諸島	89,160,063	0.03
内 パプアニューギニア	68,260,187	0.02
内 マン島	60,525,453	0.02
内 モーリシャス	16,090,490	0.01
投資信託受益証券	739,566,117	0.23
内 オーストラリア	600,869,665	0.19
内 シンガポール	138,696,452	0.04
投資証券	6,597,126,346	2.08
内 アメリカ	5,652,526,952	1.79
内 イギリス	273,393,121	0.09
内 オランダ	254,405,174	0.08
内 フランス	191,594,860	0.06
内 香港	179,749,447	0.06
内 カナダ	45,456,792	0.01
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	7,304,494,041	2.31

純資産総額	316,653,734,077	100.00
-------	-----------------	--------

## その他資産の投資状況

平成30年7月31日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引(買建)	26,399,600	0.01
-	26,399,600	0.01
為替予約取引(売建)	68,685,380	0.02
-	68,685,380	0.02
株価指数先物取引(買建)	7,138,544,354	2.25
内 アメリカ	4,901,223,324	1.55
内 ドイツ	1,290,633,669	0.41
内 イギリス	489,943,814	0.15
内 カナダ	264,803,750	0.08
内 オーストラリア	191,939,797	0.06

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

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

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

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

## 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	207,679,997,437	97.38
内 アメリカ	92,172,535,401	43.22
内 フランス	22,104,893,376	10.36
内 イタリア	18,918,093,133	8.87
内 イギリス	14,298,363,571	6.70
内 ドイツ	14,158,597,967	6.64
内 スペイン	12,812,339,403	6.01
内 ベルギー	5,514,839,960	2.59
内 オーストラリア	4,458,911,593	2.09
内 オランダ	4,445,794,673	2.08
内 カナダ	3,937,518,609	1.85
内 オーストリア	3,448,650,513	1.62
内 メキシコ	1,803,144,008	0.85
内 アイルランド	1,701,305,946	0.80
内 ポーランド	1,333,839,251	0.63
内 フィンランド	1,275,829,721	0.60
内 デンマーク	1,265,411,646	0.59
内 南アフリカ	1,233,817,873	0.58
内 マレーシア	910,470,556	0.43
内 シンガポール	809,504,069	0.38
内 スウェーデン	692,326,470	0.32
内 ノルウェー	383,809,698	0.18
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	5,585,380,147	2.62
純資産総額	213,265,377,584	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。



## 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30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	5,427,852,894	10.19
内 オーストラリア	3,630,924,227	6.82
内 シンガポール	1,777,204,940	3.34
内 カナダ	19,723,727	0.04
投資証券	47,561,505,903	89.31
内 アメリカ	37,801,547,393	70.99
内 イギリス	2,948,264,980	5.54
内 オランダ	1,626,983,727	3.06
内 フランス	1,292,668,999	2.43
内 香港	1,163,740,040	2.19
内 カナダ	950,326,775	1.78
内 スペイン	552,947,120	1.04
内 ベルギー	429,749,755	0.81
内 ニュージーランド	231,383,237	0.43
内 ドイツ	144,802,336	0.27
内 アイルランド	137,405,994	0.26
内 シンガポール	127,631,202	0.24
内 イタリア	60,576,424	0.11
内 ガーンジー	36,317,125	0.07
内 イスラエル	30,115,308	0.06
内 マン島	27,045,488	0.05
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	263,167,870	0.49
純資産総額	53,252,526,667	100.00

## その他資産の投資状況

平成30年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引（買建）	42,349,680	0.08
-	42,349,680	0.08
為替予約取引（売建）	22,200,000	0.04
-	22,200,000	0.04

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

## エマージング株式パッシブ・マザーファンド

平成30年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	64,019,055,927	94.60
内 ケイマン諸島	10,857,165,239	16.04
内 韓国	9,063,802,870	13.39
内 台湾	7,499,655,887	11.08
内 中国	6,471,665,732	9.56
内 インド	5,806,005,055	8.58
内 南アフリカ	4,204,620,910	6.21
内 ブラジル	4,200,473,048	6.21
内 香港	2,286,458,290	3.38
内 ロシア	2,201,871,977	3.25
内 メキシコ	1,610,622,603	2.38
内 マレーシア	1,538,741,711	2.27
内 タイ	1,475,992,251	2.18
内 インドネシア	1,263,326,988	1.87
内 ポーランド	772,358,099	1.14
内 チリ	731,875,250	1.08
内 バミューダ	666,960,490	0.99
内 フィリピン	647,593,668	0.96
内 カタール	566,323,317	0.84
内 トルコ	434,282,508	0.64
内 アラブ首長国連邦	425,356,701	0.63
内 コロンビア	300,345,176	0.44
内 アメリカ	208,129,274	0.31
内 ギリシャ	196,723,995	0.29
内 ハンガリー	169,960,448	0.25
内 チェコ	120,448,325	0.18
内 エジプト	66,638,930	0.10
内 オランダ	48,741,524	0.07
内 ルクセンブルグ	46,955,966	0.07
内 マン島	43,579,086	0.06
内 パキスタン	41,428,400	0.06
内 ペルー	28,549,995	0.04
内 シンガポール	22,402,214	0.03
投資信託受益証券	352,792,363	0.52
内 メキシコ	352,792,363	0.52
投資証券	120,828,327	0.18
内 メキシコ	62,023,377	0.09
内 南アフリカ	49,722,566	0.07
内 トルコ	9,082,384	0.01
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	3,180,928,390	4.70
純資産総額	67,673,605,007	100.00

## その他資産の投資状況

平成30年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引（買建）	317,682,000	0.47
-	317,682,000	0.47
株価指数先物取引（買建）	3,154,965,255	4.66
内 アメリカ	3,154,965,255	4.66

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

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

## エマージング債券パッシブ・マザーファンド

平成30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	108,514,885,215	96.60
内 メキシコ	15,278,023,887	13.60
内 トルコ	13,952,010,652	12.42
内 ロシア	12,554,631,515	11.18
内 ブラジル	12,052,992,339	10.73
内 インドネシア	11,087,522,047	9.87
内 コロンビア	9,872,591,645	8.79
内 フィリピン	7,974,208,411	7.10
内 パナマ	5,584,811,413	4.97
内 ハンガリー	5,196,316,709	4.63
内 ペルー	4,971,306,434	4.43
内 南アフリカ	4,349,297,420	3.87
内 クロアチア	3,193,115,394	2.84
内 ルーマニア	2,448,057,349	2.18
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	3,815,894,173	3.40
純資産総額	112,330,779,388	100.00

## その他資産の投資状況

平成30年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引（買建）	166,500,000	0.15
-	166,500,000	0.15
為替予約取引（売建）	166,485,000	0.15
-	166,485,000	0.15

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

## (2) 【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

平成30年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	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	2,090,590,665	1.2834 2,683,248,621	1.2901 2,697,071,016	- -	56.40%
2	外国株式パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	137,113,884	3.4992 479,797,699	3.5743 490,086,155	- -	10.25%
3	国内株式パッシブ・ファン ド（最適化法）・マザーファン ド 日本	親投資信託受 益証券	180,201,550	2.8076 505,948,162	2.6787 482,705,891	- -	10.09%
4	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	206,973,919	1.2796 264,855,773	1.1979 247,934,057	- -	5.18%
5	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	132,733,848	1.8773 249,189,353	1.8309 243,022,402	- -	5.08%
6	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	119,024,804	1.1714 139,432,183	1.2163 144,769,869	- -	3.03%
7	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	79,179,510	1.8296 144,869,023	1.8060 142,998,195	- -	2.99%
8	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	76,468,506	1.7478 133,654,239	1.8619 142,376,711	- -	2.98%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 投資有価証券の種類別投資比率

平成30年7月31日現在

種類	投資比率
親投資信託受益証券	96.00%
合計	96.00%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

(参考)

## 国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

平成30年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	1,411,200	7,353.87 10,377,786,345	7,305.00 10,308,816,000	- -	3.42%
2	三菱UFJフィナンシャル・ グループ 日本	株式 銀行業	8,017,300	789.07 6,326,237,988	689.40 5,527,126,620	- -	1.83%
3	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	515,800	8,663.60 4,468,688,360	9,260.00 4,776,308,000	- -	1.58%
4	ソニー 日本	株式 電気機器	777,600	5,411.76 4,208,186,809	5,828.00 4,531,852,800	- -	1.50%
5	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	817,500	4,995.06 4,083,466,930	5,168.00 4,224,840,000	- -	1.40%
6	三井住友フィナンシャルグ ループ 日本	株式 銀行業	866,800	4,791.32 4,153,117,332	4,445.00 3,852,926,000	- -	1.28%
7	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	1,044,500	3,838.03 4,008,829,431	3,355.00 3,504,297,500	- -	1.16%
8	キーエンス 日本	株式 電気機器	57,000	64,031.51 3,649,796,094	58,910.00 3,357,870,000	- -	1.11%
9	KDDI 日本	株式 情報・通信業	1,003,900	2,674.23 2,684,662,699	3,113.00 3,125,140,700	- -	1.04%
10	みずほフィナンシャルグルー プ 日本	株式 銀行業	15,556,900	199.50 3,103,658,490	194.60 3,027,372,740	- -	1.00%
11	任天堂 日本	株式 その他製品	71,500	44,902.63 3,210,538,396	36,760.00 2,628,340,000	- -	0.87%
12	リクルートホールディングス 日本	株式 サービス業	856,100	2,477.02 2,120,583,308	3,055.00 2,615,385,500	- -	0.87%
13	三菱商事 日本	株式 卸売業	802,300	2,958.44 2,373,562,664	3,117.00 2,500,769,100	- -	0.83%
14	ファナック 日本	株式 電気機器	110,300	27,144.55 2,994,044,085	21,920.00 2,417,776,000	- -	0.80%
15	東海旅客鉄道 日本	株式 陸運業	104,000	20,244.20 2,105,397,760	23,245.00 2,417,480,000	- -	0.80%
16	村田製作所 日本	株式 電気機器	121,800	15,196.94 1,850,987,684	19,500.00 2,375,100,000	- -	0.79%
17	NTTドコモ 日本	株式 情報・通信業	817,600	2,668.82 2,182,031,540	2,873.00 2,348,964,800	- -	0.78%
18	花王 日本	株式 化学	285,500	7,687.57 2,194,801,419	8,137.00 2,323,113,500	- -	0.77%
19	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	431,400	4,965.41 2,142,078,650	5,301.00 2,286,851,400	- -	0.76%
20	日本電産 日本	株式 電気機器	139,700	16,216.97 2,265,510,748	16,180.00 2,260,346,000	- -	0.75%

21	キヤノン 日本	株式 電気機器	624,600	4,052.58 2,531,245,392	3,617.00 2,259,178,200	- -	0.75%
22	信越化学工業 日本	株式 化学	200,400	11,520.24 2,308,656,944	11,270.00 2,258,508,000	- -	0.75%
23	セブン&アイ・ホールディングス 日本	株式 小売業	479,200	4,463.47 2,138,896,768	4,555.00 2,182,756,000	- -	0.72%
24	東日本旅客鉄道 日本	株式 陸運業	208,500	10,438.62 2,176,454,112	10,440.00 2,176,740,000	- -	0.72%
25	日立製作所 日本	株式 電気機器	2,787,000	811.45 2,261,513,650	778.60 2,169,958,200	- -	0.72%
26	日本たばこ産業 日本	株式 食料品	672,700	3,289.46 2,212,826,210	3,176.00 2,136,495,200	- -	0.71%
27	ダイキン工業 日本	株式 機械	158,500	12,218.86 1,936,690,552	13,320.00 2,111,220,000	- -	0.70%
28	アステラス製薬 日本	株式 医薬品	1,141,800	1,468.95 1,677,252,355	1,817.50 2,075,221,500	- -	0.69%
29	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	427,800	5,994.30 2,564,363,530	4,675.00 1,999,965,000	- -	0.66%
30	パナソニック 日本	株式 電気機器	1,326,200	1,597.31 2,118,356,926	1,438.00 1,907,075,600	- -	0.63%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

平成30年7月31日現在

種類	投資比率
株式	96.36%
合計	96.36%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 投資株式の業種別投資比率

平成30年7月31日現在

業種	国内/外国	投資比率
電気機器	国内	13.08%
輸送用機器		8.37%
情報・通信業		7.48%
化学		7.22%
銀行業		6.68%
機械		4.98%
小売業		4.65%
医薬品		4.62%
卸売業		4.58%
サービス業		4.37%
陸運業		4.15%
食料品		4.07%
建設業		3.07%
不動産業		2.31%
保険業		2.20%
その他製品		1.97%
精密機器		1.69%
電気・ガス業		1.68%
その他金融業		1.16%
鉄鋼		1.01%
ガラス・土石製品		0.98%
証券、商品先物取引業		0.88%
非鉄金属		0.82%
石油・石炭製品		0.80%
ゴム製品		0.74%
金属製品		0.63%
繊維製品		0.61%
空運業		0.57%
鉱業		0.29%
パルプ・紙		0.26%
海運業	0.19%	
倉庫・運輸関連業	0.18%	
水産・農林業	0.11%	
合計		96.36%

(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。

## 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30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	122回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	4,000,000,000	100.42 4,016,960,000	100.31 4,012,480,000	0.100000 2019/12/20	1.17%
2	348回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,250,000,000	100.47 3,265,450,000	100.72 3,273,692,500	0.100000 2027/9/20	0.95%
3	340回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,100,000,000	103.16 3,198,092,000	103.18 3,198,766,000	0.400000 2025/9/20	0.93%
4	339回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,100,000,000	103.17 3,198,423,500	103.07 3,195,263,000	0.400000 2025/6/20	0.93%
5	341回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,060,000,000	102.43 3,134,418,000	102.48 3,135,888,000	0.300000 2025/12/20	0.91%
6	342回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,000,000,000	100.80 3,024,240,000	100.99 3,029,820,000	0.100000 2026/3/20	0.88%
7	343回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,000,000,000	100.74 3,022,470,000	100.94 3,028,410,000	0.100000 2026/6/20	0.88%
8	346回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,000,000,000	100.54 3,016,290,000	100.81 3,024,570,000	0.100000 2027/3/20	0.88%
9	130回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	3,000,000,000	100.77 3,023,130,000	100.71 3,021,390,000	0.100000 2021/12/20	0.88%
10	128回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	3,000,000,000	100.70 3,021,090,000	100.62 3,018,660,000	0.100000 2021/6/20	0.88%
11	127回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	3,000,000,000	100.65 3,019,500,000	100.58 3,017,430,000	0.100000 2021/3/20	0.88%
12	125回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	3,000,000,000	100.54 3,016,350,000	100.47 3,014,130,000	0.100000 2020/9/20	0.88%
13	123回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	3,000,000,000	100.47 3,014,100,000	100.35 3,010,770,000	0.100000 2020/3/20	0.88%
14	325回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,900,000,000	104.00 3,016,047,000	103.73 3,008,402,000	0.800000 2022/9/20	0.88%
15	335回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,900,000,000	103.58 3,004,037,000	103.44 3,000,021,000	0.500000 2024/9/20	0.87%



16	347回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	2,900,000,000	100.51 2,914,810,000	100.79 2,923,142,000	0.100000 2027/6/20	0.85%
17	133回 利付国庫債券（5年） 日本	国債証券	2,860,000,000	100.89 2,885,679,000	100.85 2,884,338,600	0.100000 2022/9/20	0.84%
18	344回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	2,800,000,000	100.68 2,819,100,000	100.93 2,826,208,000	0.100000 2026/9/20	0.82%
19	338回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	2,650,000,000	103.10 2,732,346,000	103.02 2,730,268,500	0.400000 2025/3/20	0.80%
20	345回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	2,700,000,000	100.61 2,716,610,000	100.88 2,723,760,000	0.100000 2026/12/20	0.79%
21	350回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	2,700,000,000	100.65 2,717,783,500	100.57 2,715,525,000	0.100000 2028/3/20	0.79%
22	334回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	2,600,000,000	104.11 2,706,919,000	103.92 2,702,128,000	0.600000 2024/6/20	0.79%
23	333回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	2,500,000,000	103.99 2,599,920,000	103.78 2,594,700,000	0.600000 2024/3/20	0.76%
24	305回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	2,500,000,000	102.64 2,566,200,000	101.97 2,549,275,000	1.300000 2019/12/20	0.74%
25	126回 利付国庫債券（5年） 日本	国債証券	2,500,000,000	100.59 2,514,950,000	100.52 2,513,150,000	0.100000 2020/12/20	0.73%
26	329回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	2,270,000,000	104.73 2,377,375,100	104.36 2,369,108,200	0.800000 2023/6/20	0.69%
27	310回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	2,300,000,000	102.89 2,366,654,000	102.39 2,355,177,000	1.000000 2020/9/20	0.69%
28	332回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	2,210,000,000	103.92 2,296,693,300	103.65 2,290,665,000	0.600000 2023/12/20	0.67%
29	312回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	2,200,000,000	103.74 2,282,456,000	103.15 2,269,476,000	1.200000 2020/12/20	0.66%
30	124回 利付国庫債券（5年） 日本	国債証券	2,200,000,000	100.50 2,211,060,000	100.41 2,209,130,000	0.100000 2020/6/20	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

平成30年7月31日現在

種類	投資比率
国債証券	82.87%
地方債証券	6.53%
特殊債券	4.90%
社債券	4.51%
合計	98.81%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

## J-REITインデックスファンド・マザーファンド

平成30年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	4,197	620,605.54 2,604,681,459	622,000.00 2,610,534,000	- -	6.96%
2	ジャパンリアルエステイト投資法人 日本	投資証券	4,334	568,292.14 2,462,978,143	585,000.00 2,535,390,000	- -	6.76%
3	野村不動産マスターファンド投資法人 日本	投資証券	12,845	153,353.43 1,969,824,932	158,400.00 2,034,648,000	- -	5.43%
4	日本リテールファンド投資法人 日本	投資証券	8,191	198,997.47 1,629,988,278	203,900.00 1,670,144,900	- -	4.45%
5	ユナイテッド・アーバン投資法人 日本	投資証券	9,558	170,445.86 1,629,121,620	173,400.00 1,657,357,200	- -	4.42%
6	オリックス不動産投資法人 日本	投資証券	8,635	172,647.35 1,490,809,893	174,200.00 1,504,217,000	- -	4.01%
7	大和ハウスリート投資法人 日本	投資証券	5,426	260,714.16 1,414,635,082	276,000.00 1,497,576,000	- -	3.99%
8	日本プロロジスリート投資法人 日本	投資証券	5,813	228,836.15 1,330,224,557	226,100.00 1,314,319,300	- -	3.51%
9	アドバンス・レジデンス投資法人 日本	投資証券	4,224	285,002.94 1,203,852,436	290,900.00 1,228,761,600	- -	3.28%
10	GLP投資法人 日本	投資証券	9,581	120,830.17 1,157,673,902	119,400.00 1,143,971,400	- -	3.05%
11	日本プライムリアルティ投資法人 日本	投資証券	2,743	400,370.40 1,098,216,032	402,500.00 1,104,057,500	- -	2.94%
12	アクティピア・プロパティーズ投資法人 日本	投資証券	2,077	486,989.21 1,011,476,603	499,000.00 1,036,423,000	- -	2.76%

13	ジャパン・ホテル・リート投資法人 日本	投資証券	12,548	82,157.21 1,030,908,708	81,900.00 1,027,681,200	- -	2.74%
14	ケネディクス・オフィス投資法人 日本	投資証券	1,341	671,155.00 900,018,860	678,000.00 909,198,000	- -	2.42%
15	積水ハウス・リート投資法人 日本	投資証券	11,181	71,225.71 796,374,676	72,200.00 807,268,200	- -	2.15%
16	日本アコモデーションファンド投資法人 日本	投資証券	1,440	494,190.85 711,634,828	529,000.00 761,760,000	- -	2.03%
17	大和証券オフィス投資法人 日本	投資証券	1,000	639,220.09 639,220,096	681,000.00 681,000,000	- -	1.82%
18	フロンティア不動産投資法人 日本	投資証券	1,474	451,788.25 665,935,893	450,000.00 663,300,000	- -	1.77%
19	森ヒルズリート投資法人 日本	投資証券	4,655	138,765.69 645,954,315	138,100.00 642,855,500	- -	1.71%
20	インヴィンシブル投資法人 日本	投資証券	12,746	50,266.69 640,699,294	49,350.00 629,015,100	- -	1.68%
21	日本ロジスティクスファンド投資法人 日本	投資証券	2,894	224,182.78 648,784,971	216,000.00 625,104,000	- -	1.67%
22	産業ファンド投資法人 日本	投資証券	5,049	120,700.57 609,417,228	120,600.00 608,909,400	- -	1.62%
23	ジャパンエクセレント投資法人 日本	投資証券	3,881	143,782.26 558,018,962	143,700.00 557,699,700	- -	1.49%
24	ヒューリックリート投資法人 日本	投資証券	3,125	168,097.48 525,304,640	172,900.00 540,312,500	- -	1.44%
25	イオンリート投資法人 日本	投資証券	4,448	122,800.99 546,218,828	119,500.00 531,536,000	- -	1.42%
26	森トラスト総合リート投資法人 日本	投資証券	3,097	160,218.55 496,196,853	162,100.00 502,023,700	- -	1.34%
27	日本リート投資法人 日本	投資証券	1,399	328,776.94 459,958,943	346,500.00 484,753,500	- -	1.29%
28	プレミア投資法人 日本	投資証券	4,120	105,902.21 436,317,120	112,800.00 464,736,000	- -	1.24%
29	日本賃貸住宅投資法人 日本	投資証券	4,874	86,856.33 423,337,794	91,000.00 443,534,000	- -	1.18%
30	東急リアル・エステート投資法人 日本	投資証券	2,906	148,931.16 432,793,968	152,500.00 443,165,000	- -	1.18%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 投資有価証券の種類別投資比率

平成30年7月31日現在

種類	投資比率
投資証券	97.90%
合計	97.90%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

## 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年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	376,469	18,631.21 7,014,073,621	21,081.90 7,936,685,236	- -	2.51%
2	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフトウェア	542,300	10,098.60 5,476,472,135	11,697.12 6,343,350,182	- -	2.00%
3	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 インターネット販売・通信販売	30,466	161,428.67 4,918,086,047	197,511.21 6,017,376,590	- -	1.90%
4	FACEBOOK INC アメリカ	株式 インターネットソフトウェア・サービス	177,316	19,936.39 3,535,041,995	18,989.37 3,367,119,237	- -	1.06%
5	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	254,725	12,773.62 3,253,761,679	12,958.19 3,300,776,807	- -	1.04%
6	ALPHABET INC-CL C アメリカ	株式 インターネットソフトウェア・サービス	23,300	118,964.56 2,771,874,259	135,403.33 3,154,897,761	- -	1.00%
7	ALPHABET INC-CL A アメリカ	株式 インターネットソフトウェア・サービス	22,200	119,293.94 2,648,325,679	136,546.74 3,031,337,636	- -	0.96%
8	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	198,834	14,402.27 2,863,662,351	14,672.19 2,917,330,564	- -	0.92%
9	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 石油・ガス・消耗燃料	315,280	8,491.67 2,677,256,039	9,073.95 2,860,837,289	- -	0.90%
10	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 銀行	722,337	3,552.92 2,566,408,296	3,475.72 2,510,643,396	- -	0.79%
11	WELLS FARGO & CO アメリカ	株式 銀行	348,201	6,606.72 2,300,468,036	6,492.97 2,260,860,353	- -	0.71%
12	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	231,295	8,676.04 2,006,726,621	9,112.39 2,107,651,632	- -	0.67%
13	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 各種金融サービス	94,579	22,294.89 2,108,628,727	22,100.98 2,090,288,672	- -	0.66%
14	VISA INC アメリカ	株式 情報技術サービス	134,179	13,422.13 1,800,968,377	15,150.64 2,032,898,368	- -	0.64%

15	UNITEDHEALTH GROUP INC アメリカ	株式 ヘルスケア・ プロバイ ダー/ヘルス ケア・サービ ス	71,700	25,416.15 1,822,338,070	28,178.77 2,020,418,411	- -	0.64%
16	CHEVRON CORP アメリカ	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	141,261	12,611.28 1,781,483,017	14,190.40 2,004,551,266	- -	0.63%
17	AT&T INC アメリカ	株式 各種電気通信 サービス	540,606	3,904.38 2,110,732,550	3,552.31 1,920,405,505	- -	0.61%
18	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 専門小売り	86,514	20,503.60 1,773,849,245	21,900.05 1,894,661,167	- -	0.60%
19	PFIZER INC アメリカ	株式 医薬品	440,510	3,915.85 1,724,974,646	4,283.87 1,887,090,172	- -	0.60%
20	INTEL CORP アメリカ	株式 半導体・半導 体製造装置	348,219	5,060.96 1,762,324,671	5,294.06 1,843,494,681	- -	0.58%
21	VERIZON COMM INC アメリカ	株式 各種電気通信 サービス	306,879	5,486.30 1,683,630,746	5,826.91 1,788,157,817	- -	0.56%
22	CISCO SYSTEMS INC アメリカ	株式 通信機器	357,260	4,681.70 1,672,586,320	4,681.29 1,672,438,272	- -	0.53%
23	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品	186,535	8,955.75 1,670,561,306	8,903.00 1,660,721,478	- -	0.52%
24	BOEING CO アメリカ	株式 航空宇宙・防 衛	41,469	38,398.80 1,592,360,081	38,971.17 1,616,095,473	- -	0.51%
25	HSBC HOLDINGS PLC イギリス	株式 銀行	1,488,734	1,090.63 1,623,658,627	1,057.41 1,574,214,158	- -	0.50%
26	COCA-COLA CO/THE アメリカ	株式 飲料	298,559	4,893.35 1,460,954,645	5,131.99 1,532,202,489	- -	0.48%
27	NOVARTIS AG-REG SHS スイス	株式 医薬品	164,138	8,913.21 1,462,996,741	9,332.62 1,531,837,844	- -	0.48%
28	CITIGROUP INC アメリカ	株式 銀行	190,608	8,510.01 1,622,077,658	8,024.91 1,529,612,598	- -	0.48%
29	MASTERCARD INC アメリカ	株式 情報技術サー ビス	69,052	19,165.80 1,323,437,282	21,965.54 1,516,765,068	- -	0.48%
30	MERCK & CO. INC. アメリカ	株式 医薬品	201,289	6,093.64 1,226,584,120	7,194.55 1,448,185,405	- -	0.46%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 投資有価証券の種類別投資比率

平成30年7月31日現在

種類	投資比率
株式	95.38%
投資信託受益証券	0.23%
投資証券	2.08%
合計	97.69%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 投資株式の業種別投資比率

平成30年7月31日現在

業種	国内/外国	投資比率
銀行	外国	8.93%
石油・ガス・消耗燃料		6.50%
医薬品		5.29%
ソフトウェア		4.59%
保険		3.75%
インターネットソフトウェア・サービス		3.42%
情報技術サービス		3.30%
半導体・半導体製造装置		2.96%
資本市場		2.91%
コンピュータ・周辺機器		2.83%
インターネット販売・通信販売		2.64%
化学		2.47%
ヘルスケア機器・用品		2.37%
航空宇宙・防衛		2.29%
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス		2.18%
バイオテクノロジー		2.08%
各種電気通信サービス		2.01%
メディア		1.94%
飲料		1.89%
食品		1.75%
電力		1.74%
ホテル・レストラン・レジャー		1.74%
専門小売り		1.60%
機械		1.53%
コングロマリット		1.49%
食品・生活必需品小売り		1.49%
金属・鉱業		1.48%
繊維・アパレル・贅沢品		1.36%
家庭用品		1.14%
タバコ		1.08%
陸運・鉄道		1.02%
総合公益事業		0.96%
各種金融サービス		0.94%
自動車		0.90%
通信機器		0.87%
電気設備		0.73%
パーソナル用品		0.69%
専門サービス		0.67%

ライフサイエンス・ツール/サービス	0.64%
航空貨物・物流サービス	0.58%
不動産管理・開発	0.52%
エネルギー設備・サービス	0.52%
電子装置・機器・部品	0.49%
消費者金融	0.46%
自動車部品	0.42%
商業サービス・用品	0.42%
複合小売り	0.41%
家庭用耐久財	0.39%
建設関連製品	0.37%
建設・土木	0.35%
商社・流通業	0.34%
無線通信サービス	0.31%
建設資材	0.30%
容器・包装	0.29%
運送インフラ	0.20%
ガス	0.15%
旅客航空輸送業	0.13%
紙製品・林産品	0.12%
ヘルスケア・テクノロジー	0.07%
水道	0.07%
販売	0.07%
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.07%
レジャー用品	0.06%
海運業	0.06%
各種消費者サービス	0.01%
貯蓄・抵当・不動産金融	0.01%
合計	95.38%

(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。



## 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30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 2.625 08/15/20 アメリカ	国債証券	1,831,665,000	100.65 1,843,607,455	99.91 1,830,089,768	2.625000 2020/8/15	0.86%
2	US T N/B 3.625 02/15/20 アメリカ	国債証券	1,698,453,000	102.61 1,742,901,515	101.52 1,724,388,377	3.625000 2020/2/15	0.81%
3	US T N/B 2.0 02/15/22 アメリカ	国債証券	1,708,443,900	97.89 1,672,532,409	97.33 1,662,862,616	2.000000 2022/2/15	0.78%
4	US T N/B 0.875 07/31/19 アメリカ	国債証券	1,665,150,000	98.16 1,634,627,800	98.44 1,639,256,917	0.875000 2019/7/31	0.77%
5	US T N/B 1.25 10/31/19 アメリカ	国債証券	1,665,150,000	98.41 1,638,740,721	98.43 1,639,057,099	1.250000 2019/10/31	0.77%
6	US T N/B 1.0 09/30/19 アメリカ	国債証券	1,665,150,000	98.12 1,633,978,392	98.28 1,636,526,071	1.000000 2019/9/30	0.77%
7	US T N/B 3.5 05/15/20 アメリカ	国債証券	1,554,140,000	102.59 1,594,438,850	101.47 1,577,016,940	3.500000 2020/5/15	0.74%
8	US T N/B 1.0 08/31/19 アメリカ	国債証券	1,498,635,000	98.22 1,471,989,269	98.41 1,474,911,607	1.000000 2019/8/31	0.69%
9	US T N/B 2.125 12/31/21 アメリカ	国債証券	1,429,808,800	98.43 1,407,460,888	97.84 1,398,967,824	2.125000 2021/12/31	0.66%
10	US T N/B 1.75 09/30/22 アメリカ	国債証券	1,387,625,000	96.20 1,335,034,012	95.81 1,329,511,265	1.750000 2022/9/30	0.62%
11	US T N/B 2.0 05/31/21 アメリカ	国債証券	1,332,120,000	98.51 1,312,284,733	97.94 1,304,798,218	2.000000 2021/5/31	0.61%
12	US T N/B 1.375 04/30/20 アメリカ	国債証券	1,332,120,000	98.01 1,305,677,418	97.85 1,303,492,741	1.375000 2020/4/30	0.61%
13	US T N/B 1.875 08/31/22 アメリカ	国債証券	1,332,120,000	96.83 1,289,958,402	96.37 1,283,830,650	1.875000 2022/8/31	0.60%
14	US T N/B 2.25 03/31/21 アメリカ	国債証券	1,276,615,000	99.41 1,269,134,036	98.71 1,260,248,795	2.250000 2021/3/31	0.59%
15	US T N/B 1.75 03/31/22 アメリカ	国債証券	1,298,817,000	96.79 1,257,202,903	96.35 1,251,423,167	1.750000 2022/3/31	0.59%
16	US T N/B 1.75 05/15/22 アメリカ	国債証券	1,287,716,000	96.67 1,244,950,951	96.20 1,238,911,563	1.750000 2022/5/15	0.58%
17	US T N/B 1.875 06/30/20 アメリカ	国債証券	1,221,110,000	98.95 1,208,373,822	98.54 1,203,306,216	1.875000 2020/6/30	0.56%
18	US T N/B 1.375 04/30/21 アメリカ	国債証券	1,244,422,100	96.34 1,198,958,731	96.36 1,199,212,245	1.375000 2021/4/30	0.56%
19	US T N/B 2.125 08/15/21 アメリカ	国債証券	1,221,110,000	98.74 1,205,748,436	98.12 1,198,165,343	2.125000 2021/8/15	0.56%
20	US T N/B 1.25 01/31/20 アメリカ	国債証券	1,198,908,000	98.10 1,176,140,737	98.04 1,175,481,337	1.250000 2020/1/31	0.55%
21	US T N/B 1.625 11/15/22 アメリカ	国債証券	1,226,660,500	95.67 1,173,659,614	95.15 1,167,290,131	1.625000 2022/11/15	0.55%
22	US T N/B 2.0 11/30/20 アメリカ	国債証券	1,165,605,000	98.96 1,153,482,708	98.38 1,146,745,511	2.000000 2020/11/30	0.54%
23	US T N/B 2.25 11/15/24 アメリカ	国債証券	1,176,706,000	96.53 1,135,980,205	96.17 1,131,744,063	2.250000 2024/11/15	0.53%

24	US T N/B 2.0 11/15/21 アメリカ	国債証券	1,154,504,000	98.12 1,132,891,685	97.55 1,126,264,832	2.000000 2021/11/15	0.53%
25	US T N/B 2.75 11/15/23 アメリカ	国債証券	1,110,100,000	100.15 1,111,831,756	99.43 1,103,850,137	2.750000 2023/11/15	0.52%
26	US T N/B 2.125 09/30/21 アメリカ	国債証券	1,110,100,000	98.62 1,094,836,125	98.03 1,088,330,939	2.125000 2021/9/30	0.51%
27	FRANCE OAT 2.5 10/25/20 フランス	国債証券	1,013,454,000	107.59 1,090,415,696	106.70 1,081,426,359	2.500000 2020/10/25	0.51%
28	US T N/B 1.75 01/31/23 アメリカ	国債証券	1,110,100,000	95.85 1,064,110,033	95.45 1,059,623,753	1.750000 2023/1/31	0.50%
29	US T N/B 2.125 05/15/25 アメリカ	国債証券	1,107,879,800	95.63 1,059,479,264	95.05 1,053,084,065	2.125000 2025/5/15	0.49%
30	US T N/B 2.75 02/15/24 アメリカ	国債証券	1,043,494,000	99.99 1,043,410,520	99.33 1,036,554,764	2.750000 2024/2/15	0.49%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

平成30年7月31日現在

種類	投資比率
国債証券	97.38%
合計	97.38%

(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。

## 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30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	SIMON PROPERTY GROUP INC アメリカ	投資証券	129,967	18,828.73 2,447,114,448	19,078.17 2,479,533,638	- -	4.66%
2	PROLOGIS INC アメリカ	投資証券	223,407	7,105.26 1,587,364,875	7,215.64 1,612,026,719	- -	3.03%
3	PUBLIC STORAGE アメリカ	投資証券	62,778	24,674.44 1,549,012,445	23,811.64 1,494,847,449	- -	2.81%
4	UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD オランダ	投資証券	56,584	24,517.16 1,387,279,140	24,608.74 1,392,461,057	- -	2.61%
5	DIGITAL REALTY TRUST INC アメリカ	投資証券	86,317	11,945.88 1,031,133,174	13,404.45 1,157,032,558	- -	2.17%
6	AVALONBAY COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	57,925	18,871.47 1,093,130,391	19,112.59 1,107,096,874	- -	2.08%
7	EQUITY RESIDENTIAL アメリカ	投資証券	154,324	6,983.47 1,077,718,160	7,079.10 1,092,476,216	- -	2.05%
8	WELLTOWER INC アメリカ	投資証券	155,903	6,553.44 1,021,702,461	6,849.31 1,067,829,068	- -	2.01%
9	LINK REIT 香港	投資証券	900,020	985.23 886,732,906	1,099.38 989,468,487	- -	1.86%
10	VENTAS INC アメリカ	投資証券	149,362	6,129.66 915,538,796	6,152.17 918,901,042	- -	1.73%
11	BOSTON PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	64,714	13,600.75 880,159,150	13,550.99 876,938,812	- -	1.65%
12	SCENTRE GROUP オーストラリア	投資信託受益 証券	2,240,058	358.74 803,618,622	349.39 782,659,464	- -	1.47%
13	REALTY INCOME CORP アメリカ	投資証券	119,262	5,947.99 709,369,549	6,146.62 733,058,635	- -	1.38%
14	ESSEX PROPERTY TRUST INC アメリカ	投資証券	27,699	26,051.61 721,603,678	25,954.13 718,903,668	- -	1.35%
15	HOST HOTELS & RESORTS INC アメリカ	投資証券	310,901	2,396.45 745,060,948	2,296.79 714,076,453	- -	1.34%
16	GGP INC アメリカ	投資証券	265,349	2,302.38 610,936,690	2,348.97 623,297,265	- -	1.17%
17	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT アメリカ	投資証券	43,207	14,029.63 606,178,586	13,634.24 589,094,961	- -	1.11%
18	VORNADO REALTY TRUST アメリカ	投資証券	72,609	8,122.99 589,802,534	7,777.36 564,706,375	- -	1.06%
19	HCP INC アメリカ	投資証券	197,118	2,742.34 540,565,276	2,828.53 557,555,122	- -	1.05%
20	EXTRA SPACE STORAGE INC アメリカ	投資証券	52,918	11,060.86 585,319,052	10,380.54 549,317,685	- -	1.03%
21	GOODMAN GROUP オーストラリア	投資信託受益 証券	672,647	813.59 547,263,647	798.25 536,946,588	- -	1.01%
22	MID AMERICA アメリカ	投資証券	47,756	10,976.67 524,202,285	10,951.13 522,982,474	- -	0.98%

23	DUKE REALTY TRUST アメリカ	投資証券	149,884	3,192.01 478,432,555	3,171.55 475,365,454	- -	0.89%
24	UDR INC アメリカ	投資証券	112,343	4,093.49 459,875,897	4,112.92 462,057,827	- -	0.87%
25	IRON MOUNTAIN INC アメリカ	投資証券	118,152	3,857.50 455,771,988	3,875.35 457,881,428	- -	0.86%
26	REGENCY CENTERS CORP アメリカ	投資証券	61,888	6,809.62 421,433,798	6,960.32 430,760,717	- -	0.81%
27	LAND SECURITIES GROUP PLC イギリス	投資証券	315,475	1,375.46 433,925,185	1,357.39 428,223,786	- -	0.80%
28	FEDERAL REALTY INVS TRUST アメリカ	投資証券	30,747	13,739.22 422,439,995	13,592.06 417,915,204	- -	0.78%
29	SL GREEN アメリカ	投資証券	37,133	11,130.83 413,321,295	11,159.83 414,398,164	- -	0.78%
30	SEGRO PLC イギリス	投資証券	423,888	962.92 408,172,248	970.58 411,420,088	- -	0.77%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

平成30年7月31日現在

種類	投資比率
投資信託受益証券	10.19%
投資証券	89.31%
合計	99.51%

(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

平成30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	TENCENT HOLDINGS LTD ケイマン諸島	株式 インターネット ソフトウェア・サービス	620,300	5,629.67 3,492,086,696	5,192.20 3,220,726,622	- -	4.76%
2	ALIBABA GROUP HOLDING LTD- ADR ケイマン諸島	株式 インターネット ソフトウェア・サービス	125,780	20,051.13 2,522,032,366	20,516.86 2,580,611,682	- -	3.81%
3	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD 韓国	株式 コンピュータ・周辺機器	523,300	4,955.77 2,593,355,821	4,617.45 2,416,311,585	- -	3.57%
4	TAIWAN SEMICONDUCTOR 台湾	株式 半導体・半導 体製造装置	2,673,083	858.59 2,295,095,683	891.16 2,382,158,011	- -	3.52%
5	NASPERS LTD 南アフリカ	株式 メディア	47,680	25,719.95 1,226,327,504	27,946.12 1,332,471,211	- -	1.97%
6	CHINA CONSTRUCTION BANK 中国	株式 銀行	10,455,530	111.21 1,162,818,244	100.67 1,052,629,302	- -	1.56%
7	BAIDU INC -SPON ADR ケイマン諸島	株式 インターネット ソフトウェア・サービス	30,000	26,500.54 795,016,340	27,907.91 837,237,420	- -	1.24%
8	CHINA MOBILE LIMITED 香港	株式 無線通信サー ビス	666,500	1,023.94 682,461,911	989.09 659,230,484	- -	0.97%
9	IND & COMM BK OF CHINA - H 中国	株式 銀行	7,577,235	92.61 701,735,532	82.29 623,567,038	- -	0.92%
10	PING AN INSURANCE GROUP CO-H 中国	株式 保険	563,000	1,137.66 640,503,500	1,042.82 587,110,475	- -	0.87%
11	RELIANCE INDUSTRIES LTD インド	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	309,113	1,552.73 479,969,346	1,876.78 580,137,714	- -	0.86%
12	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP インド	株式 貯蓄・抵当・ 不動産金融	171,720	3,084.29 529,635,808	3,306.86 567,854,428	- -	0.84%
13	VALE SA ブラジル	株式 金属・鉱業	346,221	1,389.51 481,080,216	1,616.31 559,603,061	- -	0.83%
14	HON HAI PRECISION INDUSTRY 台湾	株式 電子装置・機 器・部品	1,789,532	314.04 562,001,485	305.64 546,963,297	- -	0.81%
15	SK HYNIX INC 韓国	株式 半導体・半導 体製造装置	63,598	8,305.35 528,203,927	8,529.86 542,482,672	- -	0.80%

16	ITAU UNIBANCO HOLDING SA ブラジル	株式 銀行	350,298	1,481.14 518,840,819	1,397.35 489,491,537	- -	0.72%
17	SBERBANK ADR ロシア	株式 銀行	300,890	1,576.90 474,474,587	1,535.26 461,946,878	- -	0.68%
18	BANK OF CHINA LTD 中国	株式 銀行	8,631,200	58.02 500,824,103	52.31 451,567,121	- -	0.67%
19	INFOSYS LTD インド	株式 情報技術サービス	190,912	1,864.25 355,907,815	2,202.12 420,413,042	- -	0.62%
20	LUKOIL SPON ADR ロシア	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	47,903	7,111.71 340,672,355	7,832.86 375,217,760	- -	0.55%
21	CNOOC LTD 香港	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	1,953,000	177.24 346,151,652	182.68 356,791,226	- -	0.53%
22	SAMSUNG ELECTRONICS-PFD 韓国	株式 コンピュータ・周辺機器	93,419	4,016.11 375,181,593	3,808.15 355,754,031	- -	0.53%
23	AMERICA MOVIL SAB DE CV メキシコ	株式 無線通信サービス	3,644,478	105.64 385,011,973	95.54 348,195,250	- -	0.51%
24	BANCO BRADESCO SA PREF ブラジル	株式 銀行	365,225	988.55 361,043,193	926.11 338,241,263	- -	0.50%
25	TATA CONSULTANCY SERVICES LTD インド	株式 情報技術サービス	100,131	2,636.98 264,044,353	3,169.69 317,385,030	- -	0.47%
26	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	79,200	4,397.71 348,299,394	3,903.11 309,126,438	- -	0.46%
27	AMBEV SA ブラジル	株式 飲料	513,995	675.66 347,290,813	586.07 301,239,619	- -	0.45%
28	GAZPROM PAO ADR ロシア	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	603,820	504.95 304,902,529	492.10 297,144,248	- -	0.44%
29	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL COR 中国	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	2,727,200	104.16 284,082,112	106.19 289,605,186	- -	0.43%
30	POSCO 韓国	株式 金属・鉱業	8,590	33,293.36 285,990,042	32,620.04 280,206,229	- -	0.41%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 投資有価証券の種類別投資比率

平成30年7月31日現在

種類	投資比率
株式	94.60%
投資信託受益証券	0.52%
投資証券	0.18%
合計	95.30%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 投資株式の業種別投資比率

平成30年7月31日現在

業種	国内/外国	投資比率
銀行	外国	15.37%
インターネットソフトウェア・サービス		11.13%
石油・ガス・消耗燃料		7.02%
半導体・半導体製造装置		5.34%
コンピュータ・周辺機器		4.95%
保険		3.45%
金属・鉱業		3.20%
無線通信サービス		2.85%
電子装置・機器・部品		2.65%
不動産管理・開発		2.43%
化学		2.41%
メディア		2.35%
自動車		1.91%
食品・生活必需品小売り		1.74%
情報技術サービス		1.69%
食品		1.67%
医薬品		1.47%
コングロマリット		1.42%
各種電気通信サービス		1.21%
各種金融サービス		1.16%
資本市場		1.11%
建設資材		0.99%
貯蓄・抵当・不動産金融		0.99%
電力		0.95%
インターネット販売・通信販売		0.87%
飲料		0.87%
運送インフラ		0.86%
パーソナル用品		0.74%
建設・土木		0.73%
ホテル・レストラン・レジャー		0.72%
機械		0.71%
ガス		0.61%
繊維・アパレル・贅沢品		0.60%
自動車部品		0.59%
タバコ		0.57%
複合小売り		0.57%
バイオテクノロジー		0.54%
独立系発電事業者・エネルギー販売業者		0.54%

紙製品・林産品	0.53%
各種消費者サービス	0.50%
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	0.44%
家庭用品	0.42%
専門小売り	0.41%
ソフトウェア	0.35%
家庭用耐久財	0.34%
旅客航空輸送業	0.26%
消費者金融	0.25%
陸運・鉄道	0.24%
水道	0.22%
ライフサイエンス・ツール/サービス	0.22%
エクイティ不動産投資信託(REITs)	0.20%
電気設備	0.19%
航空宇宙・防衛	0.17%
海運業	0.10%
商業サービス・用品	0.10%
ヘルスケア機器・用品	0.09%
エネルギー設備・サービス	0.08%
容器・包装	0.07%
総合公益事業	0.07%
ヘルスケア・テクノロジー	0.06%
航空貨物・物流サービス	0.06%
商社・流通業	0.05%
レジャー用品	0.05%
専門サービス	0.05%
販売	0.04%
通信機器	0.04%
建設関連製品	0.03%
合計	94.60%

(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。



## エマージング債券パッシブ・マザーファンド

平成30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	2,708,644,000	96.14 2,604,206,902	99.07 2,683,616,129	5.250000 2047/6/23	2.39%
2	RUSSIA FOREIGN BOND 5.0 04/29/20 ロシア	国債証券	1,798,362,000	102.18 1,837,715,267	102.75 1,847,816,955	5.000000 2020/4/29	1.64%
3	PERU 5.625 11/18/50 ペルー	国債証券	1,509,736,000	120.52 1,819,672,589	118.48 1,788,810,699	5.625000 2050/11/18	1.59%
4	COLOMBIA 5.0 06/15/45 コロンビア	国債証券	1,731,756,000	101.63 1,760,130,156	100.02 1,732,188,939	5.000000 2045/6/15	1.54%
5	BRAZIL 4.25 01/07/25 ブラジル	国債証券	1,765,059,000	99.53 1,756,785,979	97.32 1,717,843,671	4.250000 2025/1/7	1.53%
6	UNITED MEXICAN STATES 4.75 03/08/44 メキシコ	国債証券	1,731,756,000	97.64 1,690,959,825	94.75 1,640,838,810	4.750000 2044/3/8	1.46%
7	RUSSIAN FEDERATION 03/31/30 ロシア	国債証券	1,427,644,105	111.93 1,598,006,555	111.54 1,592,536,999	7.500000 2030/3/31	1.42%
8	PERU 7.35 07/21/25 ペルー	国債証券	1,221,110,000	124.22 1,516,896,145	122.20 1,492,257,475	7.350000 2025/7/21	1.33%
9	UNITED MEXICAN STATES 6.05 01/11/40 メキシコ	国債証券	1,321,019,000	113.92 1,504,970,895	110.94 1,465,670,580	6.050000 2040/1/11	1.30%
10	UNITED MEXICAN STATES 4.0 10/02/23 メキシコ	国債証券	1,343,221,000	102.40 1,375,531,459	100.73 1,353,120,538	4.000000 2023/10/2	1.20%
11	PANAMA 6.7 01/26/36 パナマ	国債証券	1,087,898,000	125.71 1,367,632,099	123.66 1,345,403,456	6.700000 2036/1/26	1.20%
12	UNITED MEXICAN STATES 4.15 03/28/27 メキシコ	国債証券	1,287,716,000	100.80 1,298,106,536	99.13 1,276,603,010	4.150000 2027/3/28	1.14%
13	RUSSIAN FEDERATION 4.75 05/27/26 ロシア	国債証券	1,243,312,000	100.68 1,251,863,322	101.49 1,261,862,215	4.750000 2026/5/27	1.12%
14	COLOMBIA 6.125 01/18/41 コロンビア	国債証券	1,110,100,000	115.02 1,276,837,020	113.37 1,258,575,875	6.125000 2041/1/18	1.12%
15	BRAZIL 5.0 01/27/45 ブラジル	国債証券	1,465,332,000	87.93 1,288,561,230	85.60 1,254,324,192	5.000000 2045/1/27	1.12%
16	UNITED MEXICAN STATES 5.55 01/21/45 メキシコ	国債証券	1,154,504,000	109.71 1,266,635,423	107.12 1,236,762,410	5.550000 2045/1/21	1.10%
17	COLOMBIA 4.375 07/12/21 コロンビア	国債証券	1,198,908,000	103.39 1,239,593,165	102.57 1,229,779,881	4.375000 2021/7/12	1.09%
18	RUSSIAN FEDERATION 5.625 04/04/42 ロシア	国債証券	1,132,302,000	104.71 1,185,689,817	107.43 1,216,454,684	5.625000 2042/4/4	1.08%

19	RUSSIAN FEDERATION 4.875 09/16/23 ロシア	国債証券	1,154,504,000	103.04 1,189,670,635	104.44 1,205,821,702	4.875000 2023/9/16	1.07%
20	INDONESIA 4.125 01/15/25 インドネシア	国債証券	1,198,908,000	101.00 1,210,970,346	99.52 1,193,273,132	4.125000 2025/1/15	1.06%
21	TURKEY 6.0 03/25/27 トルコ	国債証券	1,265,514,000	100.38 1,270,362,472	92.24 1,167,373,389	6.000000 2027/3/25	1.04%
22	TURKEY 7.375 02/05/25 トルコ	国債証券	1,143,403,000	109.41 1,251,066,048	101.97 1,166,042,379	7.375000 2025/2/5	1.04%
23	BRAZIL 4.625 01/13/28 ブラジル	国債証券	1,221,110,000	94.63 1,155,558,595	94.27 1,151,201,452	4.625000 2028/1/13	1.02%
24	BRAZIL 4.875 01/22/21 ブラジル	国債証券	1,110,100,000	103.90 1,153,438,304	102.57 1,138,629,570	4.875000 2021/1/22	1.01%
25	HUNGARY 6.375 03/29/21 ハンガリー	国債証券	1,043,494,000	108.58 1,133,114,371	107.41 1,120,858,645	6.375000 2021/3/29	1.00%
26	UNITED MEXICAN STATES 4.6 01/23/46 メキシコ	国債証券	1,176,706,000	95.78 1,127,073,429	93.25 1,097,278,345	4.600000 2046/1/23	0.98%
27	HUNGARY 5.75 11/22/23 ハンガリー	国債証券	999,090,000	110.41 1,103,140,561	109.08 1,089,847,335	5.750000 2023/11/22	0.97%
28	PHILIPPINES 9.5 02/02/30 フィリピン	国債証券	732,666,000	149.81 1,097,643,567	147.63 1,081,671,449	9.500000 2030/2/2	0.96%
29	COLOMBIA 5.625 02/26/44 コロンビア	国債証券	999,090,000	109.44 1,093,437,399	108.10 1,080,016,290	5.625000 2044/2/26	0.96%
30	UNITED MEXICAN STATES 5.75 10/12/2110 メキシコ	国債証券	1,065,696,000	102.89 1,096,512,376	100.42 1,070,193,237	5.750000 2110/10/12	0.95%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

平成30年7月31日現在

種類	投資比率
国債証券	96.60%
合計	96.60%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(参考)

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

平成30年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 3009月	買建	616	10,686,219,584	10,767,680,000	3.57%

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

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

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

J-REITインデックスファンド・マザーファンド

平成30年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	TREIT 先物 3009月	買建	351	602,140,500	617,058,000	1.65%

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

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

## 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年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
為替予約取引	-	カナダ・ドル買/円売 2018年08月	買建	310,000	26,372,940	26,399,600	0.01%
		アメリカ・ドル売/円 買2018年08月	売建	232,000	25,759,916	25,752,000	0.01%
		ユーロ売/円買201 8年08月	売建	186,000	24,111,556	24,166,980	0.01%
		イギリス・ポンド売/ 円買2018年08月	売建	113,000	16,458,140	16,461,840	0.01%
		オーストラリア・ドル 売/円買2018年0 8月	売建	27,000	2,219,497	2,219,400	0.00%
		カナダ・ドル売/円買 2018年08月	売建	1,000	85,168	85,160	0.00%
株価指数先物 取引	シカゴ商品 取引所	S&P500 EMI NI FUT Sep 18	買建	315	4,838,120,799	4,901,223,324	1.55%
	EUREX 取引所	DJ EURO ST OXX 50 Sep 18	買建	283	1,259,342,627	1,290,633,669	0.41%
	ICE-E EU	FTSE 100 I NDEX FUTUR E Sep18	買建	44	485,835,356	489,943,814	0.15%
	モン トリ オール取引 所	S&P/TSE 6 0 IX FUT S ep18	買建	16	262,290,213	264,803,750	0.08%
	シド ニー先 物取引所	SPI 200 FU TURES Sep1 8	買建	15	188,606,182	191,939,797	0.06%

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

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

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

## 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

## 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年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
為替予約取引	-	シンガポール・ドル 買/円売2018年0 8月	買建	172,000	14,011,403	14,027,870	0.03%
		ユーロ買/円売201 8年08月	買建	60,000	7,796,004	7,795,800	0.01%
		オーストラリア・ドル 買/円売2018年0 8月	買建	86,000	7,069,372	7,068,340	0.01%
		イギリス・ポンド買/ 円売2018年08月	買建	39,000	5,681,910	5,681,520	0.01%
		ニュージーランド・ド ル買/円売2018年 08月	買建	40,000	3,031,280	3,031,200	0.01%
		カナダ・ドル買/円売 2018年08月	買建	30,000	2,555,064	2,554,800	0.00%
		香港・ドル買/円売2 018年08月	買建	155,000	2,191,700	2,190,150	0.00%
		アメリカ・ドル売/円 買2018年08月	売建	200,000	22,201,120	22,200,000	0.04%

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

(注2) 為替予約取引の時価は、原則としてわが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しています。

為替予約取引の数量は、現地通貨建契約金額です。

## エマージング株式パッシブ・マザーファンド

平成30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
為替予約取引	-	アメリカ・ドル買/円 売2018年08月	買建	2,862,000	317,936,415	317,682,000	0.47%
株価指数先物 取引	ICE-U S	MINI MSCI EMG MKT Se p18	買建	521	3,094,282,194	3,154,965,255	4.66%

(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場で評価しています。

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

為替予約取引の数量は、現地通貨建契約金額です。

## エマージング債券パッシブ・マザーファンド

平成30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
為替予約取引	-	アメリカ・ドル買/円 売2018年08月	買建	1,500,000	166,646,250	166,500,000	0.15%
		アメリカ・ドル売/円 買2018年08月	売建	1,500,000	166,497,000	166,485,000	0.15%

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

(注2) 為替予約取引の時価は、原則としてわが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しています。

為替予約取引の数量は、現地通貨建契約金額です。

## (3) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

直近日(平成30年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計算期間末 (平成26年1月14日)	10	10	1.0217	1.0217
第2計算期間末 (平成27年1月13日)	625	625	1.1240	1.1240
第3計算期間末 (平成28年1月12日)	1,480	1,480	1.1046	1.1046
第4計算期間末 (平成29年1月11日)	2,532	2,532	1.1738	1.1738
第5計算期間末 (平成30年1月11日)	4,033	4,033	1.2395	1.2395
平成29年7月末日	3,380	-	1.1934	-
8月末日	3,572	-	1.1986	-
9月末日	3,594	-	1.2090	-
10月末日	3,713	-	1.2204	-
11月末日	3,901	-	1.2269	-
12月末日	3,933	-	1.2362	-
平成30年1月末日	4,033	-	1.2356	-
2月末日	4,076	-	1.2192	-
3月末日	4,291	-	1.2102	-
4月末日	4,377	-	1.2231	-
5月末日	4,564	-	1.2210	-
6月末日	4,637	-	1.2218	-
7月末日	4,782	-	1.2318	-

## 【分配の推移】

	1口当たりの分配金(円)
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
平成30年1月12日～ 平成30年7月11日	-

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	2.2
第2計算期間	10.0
第3計算期間	1.7
第4計算期間	6.3
第5計算期間	5.6
平成30年1月12日～ 平成30年7月11日	0.8

(注) 各計算期間の収益率は、計算期間末の基準価額（分配落の額）に当該計算期間の分配金を加算し、当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額（分配落の額。以下「前期末基準価額」といいます。）を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じた数です。ただし、第1計算期間については、前期末基準価額の代わりに、設定時の基準価額10,000円（1万口当たり）を用いております。

なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。



## (4) 【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数
第1計算期間	10,000,000	0
第2計算期間	559,142,709	12,674,655
第3計算期間	804,196,031	20,449,035
第4計算期間	864,393,144	47,536,729
第5計算期間	1,198,404,787	101,758,125
平成30年1月12日～ 平成30年7月11日	695,173,048	74,399,070

(注1) 本邦外における設定及び解約はございません。

(注2) 第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

&lt;&lt; 参考情報 &gt;&gt;

データの基準日:2018年7月31日

## 基準価額・純資産の推移

(2013年11月8日～2018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:2013年11月8日)

※設定時から10年以上経過した場合は、直近10年分を記載しています。

## 分配の推移(税引前)

第1期 (2014.01.14)	0円
第2期 (2015.01.13)	0円
第3期 (2016.01.12)	0円
第4期 (2017.01.11)	0円
第5期 (2018.01.11)	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たりです。

## 主要な資産の状況

## 組入銘柄

※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

順位	銘柄名	比率
1	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	56.40%
2	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	10.25%
3	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	10.09%
4	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	5.18%
5	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	5.08%
6	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	3.03%
7	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	2.99%
8	J-REITインデックスファンド・マザーファンド	2.98%

## 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	3.42%
2	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	日本	銀行業	1.83%
3	ソフトバンクグループ	株式	日本	情報・通信業	1.58%
4	ソニー	株式	日本	電気機器	1.50%
5	日本電信電話	株式	日本	情報・通信業	1.40%

## 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

※比率(%)は、当該マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

## 組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還期限	比率
1	122回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.100000	2019/12/20	1.17%
2	348回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.100000	2027/9/20	0.95%
3	340回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.400000	2025/9/20	0.93%
4	339回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.400000	2025/6/20	0.93%
5	341回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.300000	2025/12/20	0.91%

○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。

○ベンチマークの情報はあくまで参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。

○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。

### ■外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

※比率(%)は、当該マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

#### 組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	業種	比率
1	APPLE INC	株式	アメリカ	コンピュータ・周辺機器	2.51%
2	MICROSOFT CORP	株式	アメリカ	ソフトウェア	2.00%
3	AMAZON.COM INC	株式	アメリカ	インターネット販売・通信販売	1.90%
4	FACEBOOK INC	株式	アメリカ	インターネットソフトウェア・サービス	1.06%
5	JPMORGAN CHASE & CO	株式	アメリカ	銀行	1.04%

### ■外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

※比率(%)は、当該マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

#### 組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還期限	比率
1	US T N/B 2.625 08/15/20	国債証券	アメリカ	2.625000	2020/8/15	0.86%
2	US T N/B 3.625 02/15/20	国債証券	アメリカ	3.625000	2020/2/15	0.81%
3	US T N/B 2.0 02/15/22	国債証券	アメリカ	2.000000	2022/2/15	0.78%
4	US T N/B 0.875 07/31/19	国債証券	アメリカ	0.875000	2019/7/31	0.77%
5	US T N/B 1.25 10/31/19	国債証券	アメリカ	1.250000	2019/10/31	0.77%

### ■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	TENCENT HOLDINGS LTD	株式	ケイマン諸島	インターネットソフトウェア・サービス	4.76%
2	ALIBABA GROUP HOLDING LTD-ADR	株式	ケイマン諸島	インターネットソフトウェア・サービス	3.81%
3	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	株式	韓国	コンピュータ・周辺機器	3.57%
4	TAIWAN SEMICONDUCTOR	株式	台湾	半導体・半導体製造装置	3.52%
5	NASPERS LTD	株式	南アフリカ	メディア	1.97%

### ■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(%)	償還期限	比率
1	RUSSIAN FEDERATION 5.25 06/23/47	国債証券	ロシア	5.250000	2047/6/23	2.39%
2	RUSSIA FOREIGN BOND 5.0 04/29/20	国債証券	ロシア	5.000000	2020/4/29	1.64%
3	PERU 5.625 11/18/50	国債証券	ペルー	5.625000	2050/11/18	1.59%
4	COLOMBIA 5.0 06/15/45	国債証券	コロンビア	5.000000	2045/6/15	1.54%
5	BRAZIL 4.25 01/07/25	国債証券	ブラジル	4.250000	2025/1/7	1.53%

○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。

○ベンチマークの情報はあくまで参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。

○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。

### ■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	6.96%
2	ジャパンリアルエステイト投資法人	投資証券	日本	6.76%
3	野村不動産マスターファンド投資法人	投資証券	日本	5.43%
4	日本リテールファンド投資法人	投資証券	日本	4.45%
5	ユナイテッド・アーバン投資法人	投資証券	日本	4.42%

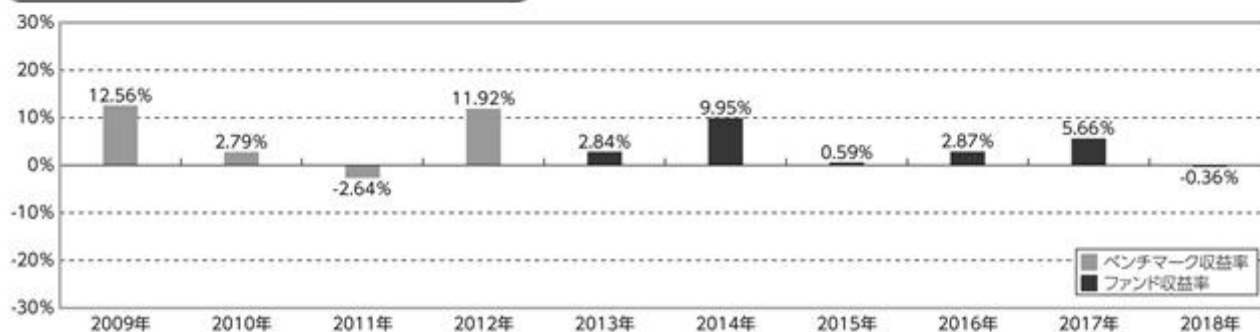
### ■外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

※比率(%)は、当該マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

#### 組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	比率
1	SIMON PROPERTY GROUP INC	投資証券	アメリカ	4.66%
2	PROLOGIS INC	投資証券	アメリカ	3.03%
3	PUBLIC STORAGE	投資証券	アメリカ	2.81%
4	UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	投資証券	オランダ	2.61%
5	DIGITAL REALTY TRUST INC	投資証券	アメリカ	2.17%

### 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。

※2013年は設定日から年末までの収益率、および2018年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

※2012年以前は、ベンチマークの収益率を表示しています。当ファンドのベンチマークは、合成ベンチマークであり、当ファンドが投資する各マザーファンドのベンチマークを基本アロケーションで委託会社が合成したものです。合成ベンチマークについては、ファンドの特色をご参照ください。

○掲載データ等はい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。

○ベンチマークの情報はあくまで参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。

○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。

当ファンドは原則として確定拠出年金制度によるお申込みのみの取扱いとなります。ただし、委託会社または販売会社が取得する場合はこの限りではありません。

当ファンドは、収益の分配が行われた場合、収益分配金を無手数料で再投資する「累積投資（自動けいぞく投資）」専用ファンドです。このためお申込みの際、取得申込者は販売会社との間で、「自動けいぞく投資約款」にしたがって分配金累積投資に関する契約を締結します。なお、販売会社によっては、当該契約または規定については、同様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約または規定を使用することがあり、この場合、当該別の名称に読み替えるものとします。

当ファンドのお申込みは、原則として販売会社の毎営業日に行われます。お申込みの受付は、原則として午後3時までにお申込みが行われ、かつ、お申込みの受付にかかる販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。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、香港証券取引所、韓国取引所、ニューヨークの銀行、ロンドンの銀行、フランクフルトの銀行、香港の銀行、韓国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、お申込みの受付は行いません。

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

受益権の取得申込者は、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この信託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。

なお、収益分配金を再投資する場合は、各計算期間終了日の基準価額とします。

「基準価額」とは、純資産総額（ファンドの資産総額から負債総額を控除した金額）を計算日の受益権総口数で除した価額をいいます。（ただし、便宜上1万口当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）

・お申込単位

1口以上1口単位または1円以上1円単位(当初元本1口 = 1円)

収益分配金を再投資する場合は、1口単位となります。

・お申込手数料

ありません。

・払込期日

取得申込者は、お申込みをされた販売会社が定める所定の日までに買付代金を販売会社に支払うものとし、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請求の受付を取り消すことができます。解約の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の解約の請求を撤回できます。ただし、受益者がその解約の請求を撤回しない場合には、当該受益権の解約価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に解約の請求を受付けたものとして、下記に準じて計算した価額とします。

・解約価額

解約価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

1口単位とします。

・解約代金の受渡日

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

### 3【資産管理等の概要】

#### (1)【資産の評価】

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

#### < 主な投資対象の時価評価方法の原則 >

投資対象	評価方法
マザーファンド 受益証券	計算日の基準価額
株式	計算日における金融商品取引所等の最終相場
公社債等	計算日における以下のいずれかの価額 ・日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値） ・金融商品取引業者、銀行などの提示する価額（売り気配相場を除きます。） ・価格情報会社の提供する価額
不動産投資信託証券	計算日における金融商品取引所等の最終相場
外貨建資産の円換算	計算日の国内における対顧客電信売買相場の仲値
外国為替予約の円換算	計算日の国内における対顧客先物売買相場の仲値

外国で取引されているものについては、計算時に知りうる直近の日

基準価額（1万口当たり）は、委託会社の毎営業日において、委託会社により計算され、公表されま

す。

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

(2)【保管】

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

(3)【信託期間】

信託期間は、平成25年11月8日(設定日)から原則として無期限です。

下記(5)その他イ.償還規定の場合には、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10億口を下回るようになった場合、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發します。

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にも適用しません。

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。

#### 八. 関係法人との契約の更改

証券投資信託の募集・販売の取扱い等に関する契約について、委託会社と販売会社との間の当該契約は、原則として期間満了の3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。

#### 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(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

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

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

##### (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) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第5期計算期間(平成29年1月12日から平成30年1月11日まで)の財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人による監査を受けております。

## 1【財務諸表】

## 【DIAM 8資産バランスファンドN&lt;DC年金&gt;】

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第4期 平成29年1月11日現在	第5期 平成30年1月11日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	104,661,528	167,605,207
親投資信託受益証券	2,431,136,062	3,871,629,217
未収入金	181,000	2,268,000
流動資産合計	2,535,978,590	4,041,502,424
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	976,072	3,457,030
未払受託者報酬	298,534	500,817
未払委託者報酬	2,627,454	4,407,576
その他未払費用	53,656	90,062
流動負債合計	3,955,716	8,455,485
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,215,071,465	1,325,718,127
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	374,951,409	779,328,812
(分配準備積立金)	112,302,015	296,313,023
元本等合計	2,532,022,874	4,033,046,939
純資産合計	2,532,022,874	4,033,046,939
負債純資産合計	2,535,978,590	4,041,502,424

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第4期		第5期	
	自	平成28年1月13日 平成29年1月11日	自	平成29年1月12日 平成30年1月11日
営業収益				
受取利息		3,106		90
有価証券売買等損益		128,663,168		199,267,155
営業収益合計		128,666,274		199,267,245
営業費用				
支払利息		47,524		96,839
受託者報酬		528,512		873,627
委託者報酬		4,651,551		7,688,674
その他費用		95,960		157,089
営業費用合計		5,323,547		8,816,229
営業利益又は営業損失( )		123,342,727		190,451,016
経常利益又は経常損失( )		123,342,727		190,451,016
当期純利益又は当期純損失( )		123,342,727		190,451,016
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額( )		1,041,600		2,307,061
期首剰余金又は期首欠損金( )		140,187,655		374,951,409
剰余金増加額又は欠損金減少額		117,722,761		234,179,286
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		117,722,761		234,179,286
剰余金減少額又は欠損金増加額		5,260,134		17,945,838
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		5,260,134		17,945,838
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金( )		374,951,409		779,328,812

## (3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	第4期	第5期
	平成29年1月11日現在	平成30年1月11日現在
1. 1 期首元本額	1,340,215,050円	2,157,071,465円
期中追加設定元本額	864,393,144円	1,198,404,787円
期中一部解約元本額	47,536,729円	101,758,125円
2. 受益権の総数	2,157,071,465口	3,253,718,127口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第4期	第5期
	自 平成28年1月13日 至 平成29年1月11日	自 平成29年1月12日 至 平成30年1月11日
1. 1 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(32,574,683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(37,266,086円)、信託約款に規定される収益調整金(262,649,394円)及び分配準備積立金(42,461,246円)より分配対象収益は374,951,409円(1万口当たり1,738.24円)ですが、分配を行っておりません。なお、分配金の計算過程においては、親投資信託の配当等収益及び収益調整金相当額を充当する方法によっております。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(51,639,199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(136,504,756円)、信託約款に規定される収益調整金(483,015,789円)及び分配準備積立金(108,169,068円)より分配対象収益は779,328,812円(1万口当たり2,395.19円)ですが、分配を行っておりません。なお、分配金の計算過程においては、親投資信託の配当等収益及び収益調整金相当額を充当する方法によっております。

## (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4期 自 平成28年1月13日 至 平成29年1月11日	第5期 自 平成29年1月12日 至 平成30年1月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、主要投資対象である親投資信託受益証券が保有する金融商品に係る、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左



## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第4期 平成29年1月11日現在	第5期 平成30年1月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第4期 平成29年1月11日現在	第5期 平成30年1月11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	127,433,510	194,637,440
合計	127,433,510	194,637,440

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	第4期 平成29年1月11日現在	第5期 平成30年1月11日現在
1口当たり純資産額	1.1738円	1.2395円
(1万口当たり純資産額)	(11,738円)	(12,395円)

## (4) 【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

平成30年1月11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	145,551,548	415,069,349	
	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	1,785,743,778	2,290,037,820	
	J-REITインデックスファンド・マザーファンド	70,215,123	122,476,239	
	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	114,876,755	407,111,732	
	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	64,088,822	117,917,023	
	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	96,943,349	115,323,807	
	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	157,925,647	206,250,894	
	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	103,835,053	197,442,353	
親投資信託受益証券 合計		2,539,180,075	3,871,629,217	
合計		2,539,180,075	3,871,629,217	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

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

「国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

(単位:円)

科 目	注記 番号	平成29年1月11日現在	平成30年1月11日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		9,742,283,611	9,174,734,961
株式	2	290,967,130,996	312,504,179,760
派生商品評価勘定		48,038,424	176,588,080
未収入金		723,088	131,159,280
未収配当金		382,674,497	394,538,223
流動資産合計		301,140,850,616	322,381,200,304
資産合計		301,140,850,616	322,381,200,304
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		3,123,328	706,480
前受金		7,256,000	349,245,000
未払解約金		230,382,000	262,677,000
流動負債合計		240,761,328	612,628,480
負債合計		240,761,328	612,628,480
純資産の部			
元本等			
元本	1	131,210,790,341	112,835,531,288
剰余金			
剰余金又は欠損金( )		169,689,298,947	208,933,040,536
元本等合計		300,900,089,288	321,768,571,824
純資産合計		300,900,089,288	321,768,571,824
負債純資産合計		301,140,850,616	322,381,200,304

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1 . 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2 . デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3 . 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

## （貸借対照表に関する注記）

項目	平成29年1月11日現在	平成30年1月11日現在
1 . 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	137,895,802,136円	131,210,790,341円
同期中追加設定元本額	39,407,792,190円	20,348,712,984円
同期中一部解約元本額	46,092,803,985円	38,723,972,037円
元本の内訳		
ファンド名		
DIAM DC 国内株式インデックスファンド	6,264,153,363円	8,226,196,501円
DIAM国内株式パッシブ・ファンド	1,939,783,051円	1,839,482,555円
MITO ラップ型ファンド（安定型）	4,829,084円	4,123,447円
MITO ラップ型ファンド（中立型）	12,125,194円	9,291,815円
MITO ラップ型ファンド（積極型）	25,790,682円	16,267,567円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	14,387,127円	17,474,561円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	11,695,488円	13,210,945円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	13,446,785円	11,886,882円
たわらノーロード TOPIX	- 円	105,629,384円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	- 円	9,120,978円
たわらノーロード バランス（堅実型）	- 円	62,731円
たわらノーロード バランス（標準型）	- 円	457,256円

たわらノーロード バランス (積極型)	- 円	1,941,760円
たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(保守型)	- 円	14,568円
たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(安定型)	- 円	18,634円
たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(安定成長 型)	- 円	22,365円
たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(成長型)	- 円	33,208円
たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(積極型)	- 円	44,401円
D I A M国内株式インデックス ファンド< D C年金>	37,202,520,698円	36,033,477,757円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 1 安定型	834,342,825円	755,786,995円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 2 安定・成長型	2,934,010,309円	2,674,104,581円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 3 成長型	2,972,946,997円	2,772,861,201円
D I A M D C バランス3 0 インデックスファンド	388,762,191円	328,683,164円
D I A M D C バランス5 0 インデックスファンド	1,259,504,097円	1,127,448,779円
D I A M D C バランス7 0 インデックスファンド	1,110,130,669円	1,054,085,428円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型>	59,701,755円	47,522,960円
マネックス資産設計ファンド< 育成型>	1,326,073,224円	1,171,577,546円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	31,399,302円	24,024,004円
D I A M D C 8 資産バラン スファンド(新興国1 0)	34,624,546円	37,610,795円
D I A M D C 8 資産バラン スファンド(新興国2 0)	67,708,056円	93,210,788円
D I A M D C 8 資産バラン スファンド(新興国3 0)	135,592,368円	185,672,845円
投資のソムリエ	1,657,754,563円	2,476,860,905円
クルーズコントロール	2,114,151,120円	2,066,117,052円
投資のソムリエ< D C年金>	49,029,800円	157,129,259円
D I A M 8 資産バランスファ ンドN< D C年金>	111,573,577円	145,551,548円
D I A M D C バランス・F (成長型)	117,305,991円	190,593,286円
クルーズコントロール< D C年 金>	834,609円	721,180円
D I A Mコア資産設計ファンド (堅実型)	23,449,979円	11,905,936円
D I A Mコア資産設計ファンド (積極型)	52,178,275円	27,115,492円

投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	14,041,767円	41,009,745円
ダイナミック・ナビゲーション リスク抑制世界8資産バランス ファンド	1,946,192円 308,417円	2,126,231円 566,776,687円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2045)	-円	507,000円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2055)	-円	507,000円
リスク抑制世界8資産バランス ファンド(DC)	-円	194,381円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2035)	-円	467,415円
DIAMアクティブアロケー ション私募ファンド(適格機関 投資家限定)	297,550,647円	-円
DIAMワールドバランス25 VA(適格機関投資家限定)	89,036,727円	71,627,508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)	221,073,539円	139,026,202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)	420,742,486円	305,156,483円
DIAM国際分散バランスファ ンド30VA(適格機関投資家 限定)	28,397,862円	16,481,224円
DIAM国際分散バランスファ ンド50VA(適格機関投資家 限定)	123,576,045円	73,774,906円
DIAM国内重視バランスファ ンド30VA(適格機関投資家 限定)	30,732,422円	20,065,167円
DIAM国内重視バランスファ ンド50VA(適格機関投資家 限定)	34,193,002円	24,943,302円
DIAM世界バランスファンド 40VA(適格機関投資家限 定)	1,475,082,939円	33,391,434円
DIAM世界バランスファンド 50VA(適格機関投資家限 定)	565,911,402円	59,453,532円
DIAMバランスファンド25 VA(適格機関投資家限定)	1,538,646,735円	1,110,380,656円
DIAMバランスファンド3 7.5VA(適格機関投資家限 定)	1,345,964,796円	1,056,123,054円
DIAMバランスファンド50 VA(適格機関投資家限定)	3,664,912,196円	2,858,693,114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)	286,143,893円	203,597,030円

D I A Mグローバル・アセ ト・バランスV A 2 ( 適格機 関投資家限定)	524,618,280円	103,572,859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)	833,834,770円	614,329,833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)	3,287,226,831円	1,931,779,617円
D I A Mグローバル 私募ファ ンド( 適格機関投資家向け)	51,147,517円	10,313,671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)	1,122,253,720円	50,384,094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)	4,941,715,812円	1,341,418,363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)	19,074,904,863円	15,452,034,881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)	705,123,751円	551,734,251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)	2,158,376,756円	1,768,841,652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)	12,087,103,172円	10,058,436,721円
D I A Mバランス3 0 V A ( 適 格機関投資家限定)	6,771,701円	523,029円
D I A Mバランス5 0 V A ( 適 格機関投資家限定)	563,380円	9,153,617円
D I A Mバランス7 0 V A ( 適 格機関投資家限定)	5,160,286円	3,719,126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)	10,838,905,774円	8,946,206,418円
D I A M世界バランス2 5 V A ( 適格機関投資家限定)	97,767,082円	72,553,517円
D I A M国内バランス3 0 V A ( 適格機関投資家限定)	34,287,827円	27,930,610円
D I A Mバランス2 0 V A ( 適 格機関投資家限定)	37,297,374円	23,981,894円
D I A Mバランス4 0 V A ( 適 格機関投資家限定)	73,509円	5,401,067円
D I A Mバランス6 0 V A ( 適 格機関投資家限定)	119,094円	109,957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)	621,830,741円	477,777,807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 )	1,622,373,744円	1,323,021,834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 )	2,159,696,264円	1,764,382,103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 )	91,571,301円	76,281,237円
	計	131,210,790,341円	112,835,531,288円
2 .	受益権の総数	131,210,790,341口	112,835,531,288口
3 .	2 差入代用有価証券	株式 3,456,000,000円	株式 3,814,500,000円

## （金融商品に関する注記）

## 1．金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成28年1月13日 至 平成29年1月11日	自 平成29年1月12日 至 平成30年1月11日
1． 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2． 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価の変動によるリスクを有しております。	同左
3． 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成29年1月11日現在	平成30年1月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	平成29年1月11日現在	平成30年1月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
株式	32,981,281,426	60,868,980,291
合計	32,981,281,426	60,868,980,291

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成28年2月9日から平成29年1月11日まで及び平成29年2月8日から平成30年1月11日まで）に対応する金額であります。

## （デリバティブ取引等に関する注記）

## 株式関連

種類	平成29年1月11日 現在				平成30年1月11日 現在			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引								
先物取引								
買建	8,412,448,000	-	8,457,540,000	45,092,000	6,418,005,000	-	6,594,000,000	175,995,000
合計	8,412,448,000	-	8,457,540,000	45,092,000	6,418,005,000	-	6,594,000,000	175,995,000

## （注）1．時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2．先物取引の残高表示は、契約額によっております。

3．契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （1口当たり情報に関する注記）

	平成29年1月11日現在	平成30年1月11日現在
1口当たり純資産額	2.2933円	2.8517円
（1万口当たり純資産額）	(22,933円)	(28,517円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

平成30年1月11日現在

銘柄	株式数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
極洋	5,100	4,350.00	22,185,000	
日本水産	146,300	604.00	88,365,200	
マルハニチロ	24,700	3,325.00	82,127,500	
ハウスイ	900	1,229.00	1,106,100	
カネコ種苗	4,500	1,754.00	7,893,000	
サカタのタネ	19,200	3,925.00	75,360,000	
ホクト	13,200	2,052.00	27,086,400	
ホクリヨウ	1,600	1,325.00	2,120,000	
ショーボンドホールディングス	12,300	8,250.00	101,475,000	
ミライト・ホールディングス	40,000	1,660.00	66,400,000	
タマホーム	9,700	883.00	8,565,100	
サンヨーホームズ	2,300	988.00	2,272,400	
ファーストコーポレーション	2,900	1,598.00	4,634,200	
ベステラ	1,800	2,272.00	4,089,600	
インベスターズクラウド	11,400	1,603.00	18,274,200	
住石ホールディングス	34,200	181.00	6,190,200	
日鉄鉱業	3,600	8,160.00	29,376,000	
三井松島産業	6,600	1,672.00	11,035,200	
国際石油開発帝石	632,100	1,506.00	951,942,600	
日本海洋掘削	4,500	3,175.00	14,287,500	
石油資源開発	20,600	3,255.00	67,053,000	
K&Oエナジーグループ	7,600	1,895.00	14,402,000	
ダイセキ環境ソリューション	3,000	1,380.00	4,140,000	
安藤・間	100,100	886.00	88,688,600	
東急建設	50,000	1,158.00	57,900,000	
コムシスホールディングス	45,700	3,225.00	147,382,500	
ミサワホーム	10,900	1,018.00	11,096,200	
ビーアールホールディングス	12,900	487.00	6,282,300	
高松コンストラクショングループ	8,400	3,110.00	26,124,000	
東建コーポレーション	4,900	13,480.00	66,052,000	
ソネック	1,600	826.00	1,321,600	
ヤマウラ	6,100	927.00	5,654,700	
大成建設	129,400	5,740.00	742,756,000	
大林組	389,800	1,380.00	537,924,000	
清水建設	397,700	1,185.00	471,274,500	
飛鳥建設	118,300	192.00	22,713,600	
長谷工コーポレーション	151,700	1,799.00	272,908,300	
松井建設	14,300	996.00	14,242,800	
銭高組	1,900	6,480.00	12,312,000	
鹿島建設	571,000	1,097.00	626,387,000	
不動テトラ	98,400	185.00	18,204,000	
大末建設	4,200	1,169.00	4,909,800	
鉄建建設	7,900	3,390.00	26,781,000	

西松建設	30,000	3,185.00	95,550,000
三井住友建設	93,700	642.00	60,155,400
大豊建設	47,000	562.00	26,414,000
前田建設工業	92,700	1,590.00	147,393,000
佐田建設	8,400	468.00	3,931,200
ナカノフドー建設	10,000	709.00	7,090,000
奥村組	21,400	4,855.00	103,897,000
東鉄工業	15,600	3,685.00	57,486,000
イチケン	2,400	2,447.00	5,872,800
浅沼組	46,000	410.00	18,860,000
戸田建設	151,000	913.00	137,863,000
熊谷組	20,400	3,225.00	65,790,000
青木あすなる建設	8,400	1,035.00	8,694,000
北野建設	27,000	429.00	11,583,000
植木組	1,600	2,757.00	4,411,200
三井ホーム	17,000	784.00	13,328,000
矢作建設工業	17,700	934.00	16,531,800
ピーエス三菱	15,400	959.00	14,768,600
日本ハウスホールディングス	24,800	724.00	17,955,200
大東建託	47,100	21,365.00	1,006,291,500
新日本建設	15,500	1,016.00	15,748,000
NIPPO	30,000	2,679.00	80,370,000
東亜道路工業	2,600	4,590.00	11,934,000
前田道路	41,000	2,651.00	108,691,000
日本道路	3,500	6,490.00	22,715,000
東亜建設工業	10,500	3,120.00	32,760,000
若築建設	7,000	1,809.00	12,663,000
東洋建設	40,800	657.00	26,805,600
五洋建設	154,500	858.00	132,561,000
世紀東急工業	17,500	671.00	11,742,500
福田組	4,200	7,210.00	30,282,000
日本ドライケミカル	1,600	2,617.00	4,187,200
住友林業	83,100	2,013.00	167,280,300
日本基礎技術	14,500	423.00	6,133,500
日成ビルド工業	19,200	1,441.00	27,667,200
ヤマダ・エスバイエルホーム	59,000	88.00	5,192,000
巴コーポレーション	16,200	641.00	10,384,200
大和ハウス工業	384,000	4,465.00	1,714,560,000
ライト工業	25,000	1,301.00	32,525,000
積水ハウス	423,000	2,126.00	899,298,000
日特建設	11,100	713.00	7,914,300
北陸電気工事	7,200	1,156.00	8,323,200
ユアテック	20,500	907.00	18,593,500
西部電気工業	2,200	3,015.00	6,633,000
四電工	2,000	2,995.00	5,990,000
中電工	16,800	3,260.00	54,768,000
関電工	51,800	1,190.00	61,642,000
きんでん	86,400	1,874.00	161,913,600
東京エネシス	14,800	1,291.00	19,106,800
トーエネック	3,700	3,380.00	12,506,000

住友電設	10,300	2,459.00	25,327,700
日本電設工業	19,900	2,465.00	49,053,500
協和エクシオ	46,700	2,936.00	137,111,200
新日本空調	10,000	1,521.00	15,210,000
日本工営	7,400	3,525.00	26,085,000
N D S	2,000	4,215.00	8,430,000
九電工	25,600	5,590.00	143,104,000
三機工業	27,500	1,336.00	36,740,000
日揮	112,000	2,338.00	261,856,000
中外炉工業	3,900	2,542.00	9,913,800
ヤマト	10,700	853.00	9,127,100
太平電業	8,800	2,780.00	24,464,000
高砂熱学工業	35,800	2,125.00	76,075,000
三晃金属工業	1,400	4,245.00	5,943,000
N E C ネットズエスアイ	12,500	3,015.00	37,687,500
朝日工業社	2,700	3,530.00	9,531,000
明星工業	23,500	842.00	19,787,000
大気社	17,200	3,940.00	67,768,000
ダイダン	8,700	2,906.00	25,282,200
日比谷総合設備	14,500	2,649.00	38,410,500
東芝プラントシステム	28,100	2,127.00	59,768,700
日本製粉	38,600	1,736.00	67,009,600
日清製粉グループ本社	142,500	2,256.00	321,480,000
日東富士製粉	800	4,930.00	3,944,000
昭和産業	10,700	2,906.00	31,094,200
鳥越製粉	10,300	1,019.00	10,495,700
中部飼料	14,200	2,445.00	34,719,000
フィード・ワン	78,300	262.00	20,514,600
東洋精糖	2,000	1,224.00	2,448,000
日本甜菜製糖	6,600	2,721.00	17,958,600
三井製糖	9,200	4,670.00	42,964,000
塩水港精糖	13,900	267.00	3,711,300
日新製糖	5,500	2,284.00	12,562,000
L I F U L L	38,500	950.00	36,575,000
ジェイエイシーリクルートメント	8,900	2,149.00	19,126,100
日本M&Aセンター	38,400	5,490.00	210,816,000
メンバーズ	2,700	762.00	2,057,400
中広	1,200	763.00	915,600
タケエイ	11,500	1,363.00	15,674,500
トラスト・テック	4,900	3,280.00	16,072,000
コシダカホールディングス	5,800	5,540.00	32,132,000
パソナグループ	9,000	2,211.00	19,899,000
C D S	3,000	1,355.00	4,065,000
リンクアンドモチベーション	20,400	907.00	18,502,800
G C A	12,600	1,148.00	14,464,800
エス・エム・エス	21,900	3,540.00	77,526,000
パーソルホールディングス	102,300	2,791.00	285,519,300
リニカル	7,100	1,612.00	11,445,200
クックパッド	34,800	615.00	21,402,000
エスクリ	3,900	1,067.00	4,161,300

アイ・ケイ・ケイ	6,500	816.00	5,304,000
森永製菓	27,300	5,860.00	159,978,000
中村屋	3,000	5,130.00	15,390,000
江崎グリコ	32,500	5,710.00	185,575,000
名糖産業	5,600	1,595.00	8,932,000
不二家	7,400	2,604.00	19,269,600
山崎製パン	95,200	2,197.00	209,154,400
第一屋製パン	2,000	1,231.00	2,462,000
モロゾフ	2,000	7,670.00	15,340,000
亀田製菓	7,200	5,310.00	38,232,000
寿スピリッツ	11,200	6,420.00	71,904,000
カルビー	53,000	3,780.00	200,340,000
森永乳業	23,300	5,220.00	121,626,000
六甲バター	5,800	2,785.00	16,153,000
ヤクルト本社	69,700	8,530.00	594,541,000
明治ホールディングス	77,000	9,550.00	735,350,000
雪印メグミルク	28,000	3,270.00	91,560,000
プリマハム	82,000	835.00	68,470,000
日本ハム	100,000	2,734.00	273,400,000
林兼産業	4,200	892.00	3,746,400
丸大食品	62,000	505.00	31,310,000
S Foods	8,100	5,010.00	40,581,000
伊藤ハム米久ホールディングス	75,000	1,041.00	78,075,000
学情	5,100	1,812.00	9,241,200
スタジオアリス	5,600	2,869.00	16,066,400
シミックホールディングス	6,100	2,098.00	12,797,800
システナ	9,100	3,485.00	31,713,500
N J S	2,700	1,599.00	4,317,300
デジタルアーツ	5,600	4,800.00	26,880,000
新日鉄住金ソリューションズ	17,900	3,070.00	54,953,000
総合警備保障	44,100	6,320.00	278,712,000
キューブシステム	6,600	870.00	5,742,000
いちご	163,500	458.00	74,883,000
日本駐車場開発	138,100	198.00	27,343,800
コア	4,800	1,574.00	7,555,200
カカクコム	85,200	1,906.00	162,391,200
アイロムグループ	3,800	1,872.00	7,113,600
セントケア・ホールディング	4,700	823.00	3,868,100
サイネックス	1,600	963.00	1,540,800
ルネサンス	5,400	1,956.00	10,562,400
ディップ	15,600	3,060.00	47,736,000
S B Sホールディングス	11,500	1,129.00	12,983,500
オプトホールディング	7,700	1,311.00	10,094,700
新日本科学	13,500	607.00	8,194,500
ツクイ	26,100	1,030.00	26,883,000
キャリアデザインセンター	2,600	2,263.00	5,883,800
エムスリー	116,700	3,930.00	458,631,000
ツカダ・グローバルホールディング	8,800	662.00	5,825,600
プラス	600	1,080.00	648,000
アウトソーシング	33,000	1,931.00	63,723,000



ウェルネット	9,100	1,204.00	10,956,400
ワールドホールディングス	3,700	3,290.00	12,173,000
ディー・エヌ・エー	59,800	2,396.00	143,280,800
博報堂DYホールディングス	154,000	1,570.00	241,780,000
ぐるなび	17,500	1,372.00	24,010,000
エスアールジータカミヤ	13,100	688.00	9,012,800
ジャパンベストレスキューシステム	13,800	774.00	10,681,200
ファンコミュニケーションズ	30,900	900.00	27,810,000
ライク	4,400	2,176.00	9,574,400
ビジネス・ブレークスルー	5,200	521.00	2,709,200
WDBホールディングス	5,100	3,775.00	19,252,500
ティア	5,800	1,167.00	6,768,600
CDG	1,000	1,913.00	1,913,000
バリューコマース	9,900	762.00	7,543,800
インフォマート	56,100	681.00	38,204,100
サッポロホールディングス	42,600	3,420.00	145,692,000
アサヒグループホールディングス	243,900	5,693.00	1,388,522,700
キリンホールディングス	559,700	2,736.00	1,531,339,200
宝ホールディングス	94,100	1,342.00	126,282,200
オエノンホールディングス	33,100	372.00	12,313,200
養命酒製造	3,600	2,588.00	9,316,800
コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールディングス	81,700	4,050.00	330,885,000
サントリー食品インターナショナル	89,000	4,975.00	442,775,000
ダイドーグループホールディングス	6,000	5,890.00	35,340,000
伊藤園	38,600	4,320.00	166,752,000
キーコーヒー	11,400	2,177.00	24,817,800
ユニカフェ	3,500	1,220.00	4,270,000
ジャパンフーズ	1,700	1,558.00	2,648,600
日清オイリオグループ	13,700	3,400.00	46,580,000
不二製油グループ本社	31,500	3,350.00	105,525,000
かどや製油	1,300	6,900.00	8,970,000
J・オイルミルズ	6,000	3,950.00	23,700,000
ローソン	28,900	7,420.00	214,438,000
サンエー	8,600	5,320.00	45,752,000
カワチ薬品	8,900	2,812.00	25,026,800
エービーシー・マート	20,800	6,800.00	141,440,000
ハードオフコーポレーション	5,000	1,281.00	6,405,000
高千穂交易	4,400	1,219.00	5,363,600
アスクル	11,900	3,300.00	39,270,000
ゲオホールディングス	20,900	2,184.00	45,645,600
アダストリア	17,600	2,245.00	39,512,000
ジーフット	6,900	796.00	5,492,400
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	1,500	714.00	1,071,000
伊藤忠食品	2,800	6,410.00	17,948,000
くらコーポレーション	6,700	6,730.00	45,091,000
キャンドウ	5,500	1,824.00	10,032,000
エレマテック	5,300	2,707.00	14,347,100
パルグループホールディングス	5,800	3,210.00	18,618,000
JALUX	3,200	3,085.00	9,872,000

エディオン	44,400	1,316.00	58,430,400
あらた	5,600	5,860.00	32,816,000
サーラコーポレーション	19,600	714.00	13,994,400
ワッツ	4,600	1,238.00	5,694,800
トーメンデバイス	1,700	3,505.00	5,958,500
ハローズ	4,300	2,608.00	11,214,400
J Pホールディングス	34,800	330.00	11,484,000
あみやき亭	2,500	5,210.00	13,025,000
東京エレクトロン デバイス	4,100	2,122.00	8,700,200
ひらまつ	15,800	574.00	9,069,200
フィールズ	8,700	1,249.00	10,866,300
双日	676,100	367.00	248,128,700
アルフレッサ ホールディングス	127,000	2,703.00	343,281,000
大黒天物産	2,700	5,000.00	13,500,000
ハニーズホールディングス	11,100	1,173.00	13,020,300
ファーマライズホールディングス	2,600	605.00	1,573,000
キッコーマン	90,900	4,615.00	419,503,500
味の素	267,800	2,123.50	568,673,300
キューピー	64,800	2,920.00	189,216,000
ハウス食品グループ本社	44,400	3,745.00	166,278,000
カゴメ	46,600	4,145.00	193,157,000
焼津水産化学工業	5,600	1,245.00	6,972,000
アリアケジャパン	10,600	9,400.00	99,640,000
ピエトロ	1,500	1,685.00	2,527,500
エバラ食品工業	2,500	2,160.00	5,400,000
ニチレイ	55,400	3,100.00	171,740,000
横浜冷凍	27,100	1,193.00	32,330,300
東洋水産	63,900	4,810.00	307,359,000
イートアンド	3,200	2,223.00	7,113,600
大冷	1,300	2,110.00	2,743,000
ヨシムラ・フード・ホールディングス	400	6,830.00	2,732,000
日清食品ホールディングス	50,800	8,260.00	419,608,000
永谷園ホールディングス	12,000	1,465.00	17,580,000
一正蒲鉾	4,500	1,299.00	5,845,500
フジッコ	12,600	2,545.00	32,067,000
ロック・フィールド	12,500	2,415.00	30,187,500
日本たばこ産業	720,400	3,646.00	2,626,578,400
ケンコーマヨネーズ	7,700	3,940.00	30,338,000
わらべや日洋ホールディングス	7,600	2,847.00	21,637,200
なとり	6,500	2,042.00	13,273,000
イフジ産業	2,000	803.00	1,606,000
ピククルスコーポレーション	1,700	2,067.00	3,513,900
北の達人コーポレーション	11,200	1,401.00	15,691,200
ユーグレナ	44,900	1,127.00	50,602,300
片倉工業	14,000	1,596.00	22,344,000
ゲンゼ	9,100	6,800.00	61,880,000
ヒューリック	238,900	1,349.00	322,276,100
神栄	1,600	1,556.00	2,489,600
ラサ商事	5,100	1,031.00	5,258,100
アルペン	8,800	2,544.00	22,387,200

ラクーン	7,300	814.00	5,942,200
クオール	12,600	2,154.00	27,140,400
アルコニックス	12,100	2,426.00	29,354,600
神戸物産	7,400	4,435.00	32,819,000
ソリトンシステムズ	3,700	1,725.00	6,382,500
ジーンズ	7,800	5,260.00	41,028,000
ピックカメラ	65,900	1,671.00	110,118,900
D C Mホールディングス	61,600	1,058.00	65,172,800
ペッパーフードサービス	6,100	4,940.00	30,134,000
M o n o t a R O	40,600	3,655.00	148,393,000
東京一番フーズ	2,400	621.00	1,490,400
D Dホールディングス	2,500	5,400.00	13,500,000
あい ホールディングス	16,300	2,830.00	46,129,000
ディーブイエックス	4,100	1,336.00	5,477,600
きちり	3,100	804.00	2,492,400
アークランドサービスホールディングス	9,500	2,653.00	25,203,500
J . フロント リテイリング	136,500	2,113.00	288,424,500
ドトール・日レスホールディングス	20,100	2,731.00	54,893,100
マツモトキヨシホールディングス	47,200	4,465.00	210,748,000
ブロンコビリー	6,000	3,295.00	19,770,000
スタートトゥデイ	112,300	3,325.00	373,397,500
トレジャー・ファクトリー	3,300	999.00	3,296,700
物語コーポレーション	3,200	10,120.00	32,384,000
ココカラファイン	11,900	6,950.00	82,705,000
三越伊勢丹ホールディングス	213,600	1,383.00	295,408,800
東洋紡	44,900	2,136.00	95,906,400
ユニチカ	35,400	843.00	29,842,200
富士紡ホールディングス	6,800	3,885.00	26,418,000
日清紡ホールディングス	70,900	1,611.00	114,219,900
倉敷紡績	123,000	372.00	45,756,000
ダイワボウホールディングス	9,700	4,840.00	46,948,000
シキボウ	6,100	1,435.00	8,753,500
日東紡績	17,300	3,430.00	59,339,000
トヨタ紡織	33,800	2,431.00	82,167,800
マクニカ・富士エレホールディングス	21,200	2,487.00	52,724,400
H a m e e	3,400	2,042.00	6,942,800
ラクト・ジャパン	1,600	4,450.00	7,120,000
ウエルシアホールディングス	30,200	4,650.00	140,430,000
クリエイトSDホールディングス	16,900	2,788.00	47,117,200
バイタルケーエスケー・ホールディングス	21,500	1,026.00	22,059,000
八洲電機	8,800	1,018.00	8,958,400
メディアスホールディングス	1,800	2,571.00	4,627,800
U K Cホールディングス	7,300	2,373.00	17,322,900
ジュテックホールディングス	2,600	1,356.00	3,525,600
丸善C H Iホールディングス	13,300	349.00	4,641,700
大光	2,600	946.00	2,459,600
O C H Iホールディングス	3,300	1,515.00	4,999,500
T O K A Iホールディングス	60,400	978.00	59,071,200

ミサワ	1,800	514.00	925,200
ティーライフ	1,500	1,381.00	2,071,500
大阪工機	1,800	1,199.00	2,158,200
エー・ピーカンパニー	2,200	855.00	1,881,000
三洋貿易	6,300	2,807.00	17,684,100
チムニー	3,500	2,921.00	10,223,500
シュッピン	6,900	1,482.00	10,225,800
ビューティガレージ	1,500	2,161.00	3,241,500
ウイン・パートナーズ	8,300	1,467.00	12,176,100
ネクステージ	11,400	888.00	10,123,200
ジョイフル本田	18,600	3,680.00	68,448,000
鳥貴族	4,200	3,610.00	15,162,000
キリン堂ホールディングス	3,900	2,237.00	8,724,300
ホットランド	6,600	1,411.00	9,312,600
すかいらーく	70,900	1,591.00	112,801,900
綿半ホールディングス	4,300	3,785.00	16,275,500
日本毛織	34,300	1,099.00	37,695,700
ダイトウボウ	18,800	114.00	2,143,200
トーア紡コーポレーション	5,200	609.00	3,166,800
ガイドーリミテッド	13,500	473.00	6,385,500
ヨシックス	1,900	3,475.00	6,602,500
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	38,000	1,097.00	41,686,000
三栄建築設計	4,600	2,703.00	12,433,800
スター・マイカ	4,200	1,824.00	7,660,800
野村不動産ホールディングス	76,100	2,721.00	207,068,100
三重交通グループホールディングス	23,200	489.00	11,344,800
サムティ	9,700	1,814.00	17,595,800
ディア・ライフ	11,500	708.00	8,142,000
コーセーアールイー	1,900	1,351.00	2,566,900
エー・ディー・ワークス	152,400	43.00	6,553,200
日本商業開発	6,400	1,824.00	11,673,600
プレサンスコーポレーション	15,700	1,530.00	24,021,000
ユニゾホールディングス	13,400	3,190.00	42,746,000
THEグローバル社	5,400	1,040.00	5,616,000
日本管理センター	7,600	1,721.00	13,079,600
サンセイランディック	3,300	1,324.00	4,369,200
エストラスト	1,600	1,329.00	2,126,400
フージャースホールディングス	14,800	1,269.00	18,781,200
オープンハウス	18,600	6,260.00	116,436,000
東急不動産ホールディングス	277,000	890.00	246,530,000
飯田グループホールディングス	95,500	2,241.00	214,015,500
ムゲンエステート	7,000	1,219.00	8,533,000
帝国繊維	12,700	2,360.00	29,972,000
ブックオフコーポレーション	6,500	846.00	5,499,000
日本コークス工業	98,200	135.00	13,257,000
ゴルフダイジェスト・オンライン	4,600	1,053.00	4,843,800
ミタチ産業	2,700	2,044.00	5,518,800
BEENOS	1,500	1,886.00	2,829,000
あさひ	8,500	1,342.00	11,407,000

日本調剤	4,000	3,460.00	13,840,000
コスモス薬品	5,800	23,070.00	133,806,000
シップヘルスケアホールディングス	23,800	3,810.00	90,678,000
トーエル	5,500	1,063.00	5,846,500
一六堂	2,500	516.00	1,290,000
ソフトクリエイイトホールディングス	5,500	1,570.00	8,635,000
オンリー	1,700	1,054.00	1,791,800
セブン&アイ・ホールディングス	479,000	4,652.00	2,228,308,000
薬王堂	5,000	3,000.00	15,000,000
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	30,700	1,340.00	41,138,000
明治電機工業	3,900	1,962.00	7,651,800
ツルハホールディングス	23,000	15,410.00	354,430,000
デリカフーズホールディングス	2,200	1,529.00	3,363,800
スターティア	2,600	1,322.00	3,437,200
サンマルクホールディングス	8,200	3,090.00	25,338,000
フェリシモ	2,900	1,369.00	3,970,100
トリドールホールディングス	14,100	4,110.00	57,951,000
帝人	99,300	2,546.00	252,817,800
東レ	881,500	1,119.50	986,839,250
クラレ	204,500	2,194.00	448,673,000
旭化成	757,900	1,514.00	1,147,460,600
サカイオーベックス	3,100	2,745.00	8,509,500
TOKYO BASE	2,200	5,520.00	12,144,000
稲葉製作所	6,400	1,460.00	9,344,000
宮地エンジニアリンググループ	3,200	2,711.00	8,675,200
トーカロ	8,000	5,770.00	46,160,000
アルファ	4,000	2,399.00	9,596,000
SUMCO	105,600	2,967.00	313,315,200
川田テクノロジーズ	2,300	6,490.00	14,927,000
RS Technologies	1,600	6,630.00	10,608,000
ファーストブラザーズ	3,100	1,278.00	3,961,800
ハウスドゥ	1,800	2,868.00	5,162,400
シーアールイー	1,800	1,603.00	2,885,400
ケイアイスター不動産	4,100	3,015.00	12,361,500
住江織物	3,300	3,140.00	10,362,000
日本フェルト	6,400	519.00	3,321,600
イチカワ	8,000	389.00	3,112,000
エコナックホールディングス	21,700	127.00	2,755,900
日東製網	1,300	1,902.00	2,472,600
芦森工業	2,400	2,930.00	7,032,000
アツギ	8,100	1,344.00	10,886,400
コメダホールディングス	21,100	2,156.00	45,491,600
サッドラホールディングス	1,500	2,033.00	3,049,500
ダイユー・リックホールディングス	5,300	1,373.00	7,276,900
パロックジャパンリミテッド	9,100	1,067.00	9,709,700
クスリのアオキホールディングス	9,100	5,990.00	54,509,000
ダイニック	4,600	1,157.00	5,322,200
共和レザー	7,100	1,030.00	7,313,000
スシローグローバルホールディングス	11,000	4,340.00	47,740,000

LIXILビバ	10,900	2,006.00	21,865,400
セーレン	27,900	2,262.00	63,109,800
ソトー	4,400	1,136.00	4,998,400
東海染工	1,700	1,488.00	2,529,600
小松精練	18,700	937.00	17,521,900
ワコールホールディングス	33,600	3,550.00	119,280,000
ホギメディカル	7,700	8,700.00	66,990,000
レナウン	32,900	200.00	6,580,000
クラウドIAホールディングス	2,900	601.00	1,742,900
T S Iホールディングス	45,900	833.00	38,234,700
T I S	37,900	4,020.00	152,358,000
ネオス	3,400	446.00	1,516,400
電算システム	4,000	2,084.00	8,336,000
グリー	69,700	732.00	51,020,400
コーエーテクモホールディングス	19,400	2,429.00	47,122,600
三菱総合研究所	4,900	3,995.00	19,575,500
ボルテージ	2,100	1,079.00	2,265,900
電算	1,300	2,646.00	3,439,800
A G S	6,400	903.00	5,779,200
ファインデックス	9,400	803.00	7,548,200
ヒト・コミュニケーションズ	2,600	2,999.00	7,797,400
ブレインパッド	2,400	1,346.00	3,230,400
K L a b	22,000	1,882.00	41,404,000
ポルトウウィン・ピットクルーホールディングス	8,200	2,106.00	17,269,200
イーブックイニシアティブジャパン	1,800	1,174.00	2,113,200
ネクソン	127,700	3,300.00	421,410,000
アイスタイル	26,100	1,055.00	27,535,500
エムアップ	3,800	1,307.00	4,966,600
エイチーム	7,800	2,763.00	21,551,400
テクノスジャパン	10,300	949.00	9,774,700
e n i s h	3,400	1,329.00	4,518,600
コロブラ	36,700	1,000.00	36,700,000
モバイルクリエイト	8,600	372.00	3,199,200
オルトプラス	5,500	1,075.00	5,912,500
ブロードリーフ	28,200	1,084.00	30,568,800
ハーツユナイテッドグループ	6,000	1,805.00	10,830,000
メディアドゥホールディングス	3,700	2,603.00	9,631,100
ブイキューブ	6,900	572.00	3,946,800
サイバーリンクス	1,800	1,354.00	2,437,200
ディー・エル・イー	5,100	478.00	2,437,800
フィックスターズ	1,900	6,500.00	12,350,000
VOYAGE GROUP	5,800	1,493.00	8,659,400
オブティム	1,900	2,740.00	5,206,000
セレス	3,500	2,480.00	8,680,000
特種東海製紙	6,700	4,385.00	29,379,500
ベリサーブ	1,400	3,830.00	5,362,000
ティーガイア	11,400	2,659.00	30,312,600
セック	1,100	2,732.00	3,005,200
日本アジアグループ	12,000	562.00	6,744,000

豆蔵ホールディングス	8,500	1,311.00	11,143,500
テクマトリックス	6,200	2,148.00	13,317,600
プロシップ	1,600	2,420.00	3,872,000
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	308,700	312.00	96,314,400
GMOペイメントゲートウェイ	8,000	9,770.00	78,160,000
ザッパラス	5,900	408.00	2,407,200
システムリサーチ	1,100	2,214.00	2,435,400
インターネットイニシアティブ	18,500	2,111.00	39,053,500
さくらインターネット	13,600	881.00	11,981,600
GMOクラウド	2,500	2,393.00	5,982,500
SRAホールディングス	6,000	3,905.00	23,430,000
MINORIソリューションズ	2,200	1,455.00	3,201,000
システムインテグレータ	1,600	1,027.00	1,643,200
朝日ネット	10,400	549.00	5,709,600
アドソル日進	4,400	1,240.00	5,456,000
フリービット	8,400	1,064.00	8,937,600
コムチュア	5,800	3,030.00	17,574,000
サイバーコム	2,000	1,218.00	2,436,000
王子ホールディングス	512,000	792.00	405,504,000
日本製紙	54,400	2,132.00	115,980,800
三菱製紙	17,300	740.00	12,802,000
北越紀州製紙	67,800	687.00	46,578,600
中越バルブ工業	4,800	2,089.00	10,027,200
巴川製紙所	19,000	321.00	6,099,000
大王製紙	48,400	1,534.00	74,245,600
阿波製紙	2,900	731.00	2,119,900
メディカル・データ・ビジョン	4,300	2,461.00	10,582,300
gumi	13,100	1,127.00	14,763,700
ショーケース・ティービー	2,200	1,534.00	3,374,800
モバイルファクトリー	2,100	1,352.00	2,839,200
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	1,700	2,828.00	4,807,600
PCIホールディングス	1,900	3,780.00	7,182,000
パイブドHD	1,800	1,163.00	2,093,400
アイビーシー	1,200	1,304.00	1,564,800
オープンドア	1,500	7,220.00	10,830,000
アカツキ	2,200	7,150.00	15,730,000
LINE	32,500	4,990.00	162,175,000
レンゴー	117,200	839.00	98,330,800
トーモク	7,000	2,385.00	16,695,000
ザ・バック	8,600	3,810.00	32,766,000
シンクロ・フード	900	3,180.00	2,862,000
オークネット	3,600	1,495.00	5,382,000
AOI TYO HOLDINGS	9,300	1,358.00	12,629,400
マクロミル	14,900	2,739.00	40,811,100
昭和電工	80,900	5,190.00	419,871,000
住友化学	894,000	859.00	767,946,000
住友精化	5,000	6,360.00	31,800,000
日産化学工業	70,700	4,640.00	328,048,000

ラサ工業	4,300	2,396.00	10,302,800
クレハ	10,400	8,070.00	83,928,000
多木化学	1,700	5,950.00	10,115,000
テイカ	9,300	3,250.00	30,225,000
石原産業	21,800	2,246.00	48,962,800
片倉コープアグリ	2,900	1,410.00	4,089,000
日東エフシー	7,100	831.00	5,900,100
日本曹達	84,000	801.00	67,284,000
東ソー	175,700	2,620.00	460,334,000
トクヤマ	35,300	3,660.00	129,198,000
セントラル硝子	24,800	2,420.00	60,016,000
東亜合成	71,300	1,480.00	105,524,000
大阪ソーダ	10,800	2,938.00	31,730,400
関東電化工業	29,000	1,364.00	39,556,000
デンカ	44,700	4,540.00	202,938,000
イビデン	71,000	1,730.00	122,830,000
信越化学工業	202,300	11,960.00	2,419,508,000
日本カーバイド工業	3,900	2,231.00	8,700,900
堺化学工業	8,300	3,085.00	25,605,500
エア・ウォーター	100,200	2,502.00	250,700,400
大陽日酸	93,600	1,690.00	158,184,000
日本化学工業	4,500	2,608.00	11,736,000
東邦アセチレン	1,700	1,625.00	2,762,500
日本パーカライジング	62,100	2,015.00	125,131,500
高圧ガス工業	18,000	970.00	17,460,000
チタン工業	1,300	3,085.00	4,010,500
四国化成工業	17,500	1,874.00	32,795,000
戸田工業	2,400	4,860.00	11,664,000
ステラ ケミファ	6,200	3,920.00	24,304,000
保土谷化学工業	3,900	6,350.00	24,765,000
日本触媒	19,100	8,080.00	154,328,000
大日精化工業	9,400	5,790.00	54,426,000
カネカ	164,000	1,087.00	178,268,000
協和発酵キリン	145,400	2,256.00	328,022,400
三菱瓦斯化学	100,200	3,390.00	339,678,000
三井化学	110,500	3,770.00	416,585,000
J S R	122,200	2,296.00	280,571,200
東京応化工業	21,100	5,130.00	108,243,000
大阪有機化学工業	7,900	1,367.00	10,799,300
三菱ケミカルホールディングス	813,900	1,288.50	1,048,710,150
K Hネオケム	18,600	2,861.00	53,214,600
ダイセル	163,900	1,369.00	224,379,100
住友ベークライト	98,000	980.00	96,040,000
積水化学工業	252,400	2,280.00	575,472,000
日本ゼオン	102,500	1,741.00	178,452,500
アイカ工業	34,100	4,200.00	143,220,000
宇部興産	61,200	3,450.00	211,140,000
積水樹脂	18,700	2,408.00	45,029,600
タキロンシーアイ	25,000	802.00	20,050,000
旭有機材	7,100	2,143.00	15,215,300



日立化成	60,000	3,035.00	182,100,000
ニチバン	6,000	3,030.00	18,180,000
リケンテクノス	26,200	630.00	16,506,000
大倉工業	29,000	699.00	20,271,000
積水化成品工業	15,200	1,484.00	22,556,800
群栄化学工業	2,900	3,985.00	11,556,500
タイガースポリマー	6,000	848.00	5,088,000
ミライアル	4,000	1,951.00	7,804,000
ダイキアクシス	4,000	1,618.00	6,472,000
ダイキョーニシカワ	24,000	1,888.00	45,312,000
竹本容器	1,400	2,299.00	3,218,600
日本化薬	78,900	1,717.00	135,471,300
カーリットホールディングス	11,300	1,335.00	15,085,500
E P Sホールディングス	16,700	2,717.00	45,373,900
ソルクシーズ	4,400	1,591.00	7,000,400
レグス	2,800	878.00	2,458,400
プレステージ・インターナショナル	23,000	1,361.00	31,303,000
フェイス	4,000	1,333.00	5,332,000
ハイマックス	1,500	1,886.00	2,829,000
アミューズ	7,400	3,410.00	25,234,000
野村総合研究所	76,100	5,270.00	401,047,000
ドリームインキュベータ	3,700	2,453.00	9,076,100
サイバネットシステム	9,300	737.00	6,854,100
クイック	6,900	1,770.00	12,213,000
T A C	6,700	366.00	2,452,200
C Eホールディングス	3,200	918.00	2,937,600
ケネディクス	153,700	722.00	110,971,400
日本システム技術	1,400	1,390.00	1,946,000
電通	135,100	4,985.00	673,473,500
インタージホールディングス	13,100	1,418.00	18,575,800
テイクアンドギヴ・ニーズ	5,200	1,143.00	5,943,600
東邦システムサイエンス	3,800	827.00	3,142,600
ぴあ	3,700	7,070.00	26,159,000
イオンファンタジー	3,600	5,230.00	18,828,000
ソースネクスト	8,000	1,380.00	11,040,000
シーティーエス	11,300	840.00	9,492,000
ネクシィーズグループ	4,400	2,126.00	9,354,400
メディカルシステムネットワーク	13,000	624.00	8,112,000
日本精化	10,100	1,187.00	11,988,700
扶桑化学工業	8,600	3,200.00	27,520,000
A D E K A	52,300	1,988.00	103,972,400
日油	46,900	3,115.00	146,093,500
ミヨシ油脂	4,500	1,515.00	6,817,500
新日本理化	19,200	280.00	5,376,000
ハリマ化成グループ	9,400	926.00	8,704,400
花王	285,300	7,610.00	2,171,133,000
第一工業製薬	23,000	919.00	21,137,000
日華化学	3,800	1,312.00	4,985,600
ニイタカ	1,800	1,858.00	3,344,400
三洋化成工業	7,600	6,010.00	45,676,000

武田薬品工業	427,400	6,545.00	2,797,333,000
アステラス製薬	1,192,300	1,454.00	1,733,604,200
大日本住友製薬	86,000	1,685.00	144,910,000
塩野義製薬	166,000	6,181.00	1,026,046,000
田辺三菱製薬	141,600	2,351.00	332,901,600
わかもと製薬	14,000	283.00	3,962,000
あすか製薬	13,200	2,055.00	27,126,000
日本新薬	30,400	8,000.00	243,200,000
ピオフェルミン製薬	2,000	3,095.00	6,190,000
中外製薬	121,000	5,880.00	711,480,000
科研製薬	20,900	5,850.00	122,265,000
エーザイ	138,900	6,610.00	918,129,000
理研ビタミン	4,400	4,335.00	19,074,000
ロート製薬	63,700	3,075.00	195,877,500
小野薬品工業	274,000	2,661.00	729,114,000
久光製薬	34,300	7,010.00	240,443,000
有機合成薬品工業	8,000	306.00	2,448,000
持田製薬	8,100	8,940.00	72,414,000
参天製薬	219,600	1,810.00	397,476,000
扶桑薬品工業	4,100	2,922.00	11,980,200
日本ケミファ	1,500	4,825.00	7,237,500
ツムラ	41,500	3,765.00	156,247,500
日医工	30,600	1,744.00	53,366,400
テルモ	177,800	5,560.00	988,568,000
みらかホールディングス	33,000	5,060.00	166,980,000
キッセイ薬品工業	21,500	3,355.00	72,132,500
生化学工業	22,500	1,740.00	39,150,000
栄研化学	9,400	5,180.00	48,692,000
日水製薬	4,900	1,545.00	7,570,500
鳥居薬品	7,300	3,065.00	22,374,500
JCRファーマ	8,200	5,650.00	46,330,000
東和薬品	5,600	6,400.00	35,840,000
富士製薬工業	3,900	4,335.00	16,906,500
沢井製薬	23,300	5,110.00	119,063,000
ゼリア新薬工業	24,900	2,327.00	57,942,300
第一三共	332,000	3,157.00	1,048,124,000
キョーリン製薬ホールディングス	32,400	2,190.00	70,956,000
大幸薬品	6,100	2,376.00	14,493,600
ダイト	7,200	3,140.00	22,608,000
大塚ホールディングス	241,100	5,022.00	1,210,804,200
大正製薬ホールディングス	26,000	9,150.00	237,900,000
ペプチドリーム	47,600	4,265.00	203,014,000
大日本塗料	13,900	1,813.00	25,200,700
日本ペイントホールディングス	93,800	3,745.00	351,281,000
関西ペイント	127,700	2,972.00	379,524,400
神東塗料	9,000	276.00	2,484,000
中国塗料	34,900	972.00	33,922,800
日本特殊塗料	7,700	2,387.00	18,379,900
藤倉化成	15,300	735.00	11,245,500
太陽ホールディングス	9,300	5,190.00	48,267,000

D I C	48,000	4,405.00	211,440,000
サカティクス	24,800	1,849.00	45,855,200
東洋インキS Cホールディングス	120,000	688.00	82,560,000
T & K T O K A	8,100	1,498.00	12,133,800
アルプス技研	9,700	2,153.00	20,884,100
サニックス	17,700	238.00	4,212,600
ダイオーズ	2,200	1,460.00	3,212,000
日本空調サービス	11,600	815.00	9,454,000
オリエンタルランド	131,000	10,945.00	1,433,795,000
フォーカスシステムズ	6,500	941.00	6,116,500
ダスキン	29,800	3,065.00	91,337,000
パーク24	63,400	2,764.00	175,237,600
明光ネットワークジャパン	14,000	1,305.00	18,270,000
ファルコホールディングス	5,700	1,843.00	10,505,100
クレスコ	2,600	4,685.00	12,181,000
フジ・メディア・ホールディングス	119,200	1,900.00	226,480,000
秀英予備校	2,400	498.00	1,195,200
田谷	2,000	677.00	1,354,000
ラウンドワン	34,400	2,043.00	70,279,200
リゾートトラスト	46,900	2,602.00	122,033,800
オービック	35,900	8,450.00	303,355,000
ジャストシステム	18,500	2,162.00	39,997,000
T D C ソフト	5,000	1,228.00	6,140,000
ヤフー	820,800	531.00	435,844,800
ビー・エム・エル	14,300	2,961.00	42,342,300
ワタベウェディング	1,800	668.00	1,202,400
トレンドマイクロ	55,600	6,500.00	361,400,000
りらいあコミュニケーションズ	17,500	1,357.00	23,747,500
インフォメーション・ディベロプメント	3,500	1,373.00	4,805,500
リソー教育	18,700	838.00	15,670,600
日本オラクル	18,400	9,510.00	174,984,000
早稲田アカデミー	1,600	1,726.00	2,761,600
アルファシステムズ	3,700	2,529.00	9,357,300
フューチャー	15,500	1,180.00	18,290,000
C A C H o l d i n g s	8,500	1,081.00	9,188,500
ソフトバンク・テクノロジー	4,700	1,984.00	9,324,800
トーセ	3,100	2,178.00	6,751,800
ユー・エス・エス	135,400	2,465.00	333,761,000
オービックビジネスコンサルタント	5,800	6,720.00	38,976,000
伊藤忠テクノソリューションズ	25,900	4,990.00	129,241,000
アイティフォー	13,800	931.00	12,847,800
東京個別指導学院	3,900	1,020.00	3,978,000
東計電算	2,000	3,385.00	6,770,000
サイバーエージェント	72,900	4,260.00	310,554,000
楽天	568,400	1,008.50	573,231,400
エクスネット	1,800	929.00	1,672,200
クリーク・アンド・リバー社	5,700	1,209.00	6,891,300
テー・オー・ダブリュー	9,700	955.00	9,263,500
大塚商会	34,200	8,850.00	302,670,000

総合メディカル	5,000	5,980.00	29,900,000
サイボウズ	15,200	574.00	8,724,800
ソフトブレーン	8,900	418.00	3,720,200
セントラルスポーツ	4,100	4,285.00	17,568,500
パラカ	3,700	2,567.00	9,497,900
電通国際情報サービス	7,000	2,570.00	17,990,000
デジタルガレージ	20,500	3,160.00	64,780,000
イーエムシステムズ	3,900	2,579.00	10,058,100
ウェザーニューズ	3,800	3,385.00	12,863,000
C I J	9,700	753.00	7,304,100
東洋ビジネスエンジニアリング	1,100	1,825.00	2,007,500
日本エンタープライズ	11,700	242.00	2,831,400
WOWOW	5,500	3,355.00	18,452,500
スカラ	7,800	754.00	5,881,200
フルキャストホールディングス	9,700	2,279.00	22,106,300
富士フイルムホールディングス	241,000	4,724.00	1,138,484,000
コニカミノルタ	271,600	1,134.00	307,994,400
資生堂	216,100	5,403.00	1,167,588,300
ライオン	161,600	2,110.00	340,976,000
高砂香料工業	7,300	3,645.00	26,608,500
マンダム	22,600	3,795.00	85,767,000
ミルボン	15,500	3,700.00	57,350,000
ファンケル	28,200	3,385.00	95,457,000
コーセー	19,600	17,790.00	348,684,000
コタ	5,000	1,720.00	8,600,000
シーズ・ホールディングス	15,800	5,850.00	92,430,000
シーボン	1,400	3,950.00	5,530,000
ポーラ・オルビスホールディングス	49,500	4,080.00	201,960,000
ノエビアホールディングス	7,400	8,600.00	63,640,000
アジュバンコスメジャパン	2,600	1,159.00	3,013,400
エステー	8,300	2,845.00	23,613,500
アグロ カネショウ	4,700	2,253.00	10,589,100
コニシ	19,100	2,116.00	40,415,600
長谷川香料	15,400	2,364.00	36,405,600
星光PMC	6,700	1,155.00	7,738,500
小林製薬	32,500	7,430.00	241,475,000
荒川化学工業	10,400	2,287.00	23,784,800
メック	8,000	2,466.00	19,728,000
日本高純度化学	3,200	2,729.00	8,732,800
タカラバイオ	30,400	1,733.00	52,683,200
J C U	7,100	5,530.00	39,263,000
新田ゼラチン	7,900	865.00	6,833,500
O A T アグリオ	1,600	2,759.00	4,414,400
デクセリアルズ	29,700	1,579.00	46,896,300
アース製薬	8,700	5,560.00	48,372,000
北興化学工業	11,900	698.00	8,306,200
大成ラミック	3,600	3,290.00	11,844,000
クミアイ化学工業	52,800	761.00	40,180,800
日本農薬	30,300	665.00	20,149,500
昭和シェル石油	108,600	1,674.00	181,796,400

富士興産	4,100	607.00	2,488,700
ニチレキ	14,800	1,444.00	21,371,200
ユシロ化学工業	6,500	1,752.00	11,388,000
ビービー・カストロール	5,000	2,154.00	10,770,000
富士石油	28,200	613.00	17,286,600
MORESCO	4,200	2,252.00	9,458,400
出光興産	97,400	4,480.00	436,352,000
JXTGホールディングス	1,851,700	784.10	1,451,917,970
コスモエネルギーホールディングス	33,600	4,755.00	159,768,000
横浜ゴム	67,200	2,808.00	188,697,600
東洋ゴム工業	68,700	2,318.00	159,246,600
ブリヂストン	410,000	5,296.00	2,171,360,000
住友ゴム工業	119,480	2,093.00	250,071,640
藤倉ゴム工業	10,200	967.00	9,863,400
オカモト	40,000	1,157.00	46,280,000
アキレス	8,800	2,400.00	21,120,000
フコク	5,100	1,120.00	5,712,000
ニッタ	12,000	4,560.00	54,720,000
クリエートメディック	3,800	1,327.00	5,042,600
住友理工	22,500	1,304.00	29,340,000
三ツ星ベルト	28,000	1,563.00	43,764,000
バンドー化学	22,100	1,369.00	30,254,900
旭硝子	118,600	4,985.00	591,221,000
日本板硝子	58,600	1,064.00	62,350,400
石塚硝子	1,600	2,967.00	4,747,200
有沢製作所	19,400	1,264.00	24,521,600
日本山村硝子	48,000	197.00	9,456,000
日本電気硝子	50,200	4,510.00	226,402,000
オハラ	4,600	4,070.00	18,722,000
住友大阪セメント	226,000	574.00	129,724,000
太平洋セメント	73,300	4,840.00	354,772,000
リソルホールディングス	1,200	4,675.00	5,610,000
日本ヒューム	11,600	825.00	9,570,000
日本コンクリート工業	25,000	503.00	12,575,000
三谷セキサン	6,100	2,724.00	16,616,400
アジアパイルホールディングス	14,900	755.00	11,249,500
東海カーボン	105,300	1,680.00	176,904,000
日本カーボン	6,000	5,470.00	32,820,000
東洋炭素	7,500	3,815.00	28,612,500
ノリタケカンパニーリミテド	6,900	5,910.00	40,779,000
TOTO	89,200	6,820.00	608,344,000
日本碍子	141,600	2,253.00	319,024,800
日本特殊陶業	99,500	2,818.00	280,391,000
ダントーホールディングス	9,000	151.00	1,359,000
MARUWA	4,000	7,890.00	31,560,000
品川リフラクトリーズ	3,100	3,335.00	10,338,500
黒崎播磨	2,300	4,845.00	11,143,500
ヨータイ	6,800	648.00	4,406,400
イソライト工業	6,000	1,178.00	7,068,000
東京窯業	14,800	464.00	6,867,200

ニッカトー	3,900	1,134.00	4,422,600
フジインコーポレーテッド	10,300	2,465.00	25,389,500
エーアンドエーマテリアル	2,500	1,411.00	3,527,500
ニチアス	64,000	1,520.00	97,280,000
新日鐵住金	513,500	3,068.00	1,575,418,000
神戸製鋼所	210,000	1,131.00	237,510,000
中山製鋼所	15,900	756.00	12,020,400
合同製鐵	6,200	2,386.00	14,793,200
ジェイ エフ イー ホールディングス	309,900	2,793.50	865,705,650
日新製鋼	31,700	1,990.00	63,083,000
東京製鐵	61,500	992.00	61,008,000
共英製鋼	12,900	2,213.00	28,547,700
大和工業	24,400	3,500.00	85,400,000
東京鐵鋼	4,700	2,026.00	9,522,200
大阪製鐵	7,600	2,384.00	18,118,400
淀川製鋼所	16,800	3,580.00	60,144,000
東洋鋼鈑	29,100	494.00	14,375,400
丸一鋼管	40,600	3,360.00	136,416,000
モリ工業	3,800	3,945.00	14,991,000
大同特殊鋼	20,300	7,150.00	145,145,000
日本高周波鋼業	4,300	967.00	4,158,100
日本冶金工業	95,000	276.00	26,220,000
山陽特殊製鋼	13,300	2,940.00	39,102,000
愛知製鋼	6,500	4,580.00	29,770,000
日立金属	123,600	1,640.00	202,704,000
日本金属	2,900	2,903.00	8,418,700
大平洋金属	7,100	3,330.00	23,643,000
新日本電工	68,800	500.00	34,400,000
栗本鐵工所	5,800	2,484.00	14,407,200
虹 技	1,700	2,241.00	3,809,700
日本鑄鉄管	12,000	185.00	2,220,000
日本製鋼所	37,500	3,765.00	141,187,500
三菱製鋼	8,500	2,878.00	24,463,000
日亜鋼業	16,900	349.00	5,898,100
日本精線	1,900	5,450.00	10,355,000
大紀アルミニウム工業所	18,900	906.00	17,123,400
日本軽金属ホールディングス	335,100	324.00	108,572,400
三井金属鉱業	31,000	7,010.00	217,310,000
東邦亜鉛	6,400	6,730.00	43,072,000
三菱マテリアル	75,800	4,165.00	315,707,000
住友金属鉱山	146,700	5,491.00	805,529,700
DOWAホールディングス	29,000	4,710.00	136,590,000
古河機械金属	18,900	2,627.00	49,650,300
エス・サイエンス	54,400	92.00	5,004,800
大阪チタニウムテクノロジーズ	11,900	2,333.00	27,762,700
東邦チタニウム	20,600	1,356.00	27,933,600
UACJ	17,400	3,020.00	52,548,000
古河電気工業	38,200	6,150.00	234,930,000
住友電気工業	429,000	1,967.50	844,057,500

フジクラ	138,500	1,109.00	153,596,500
昭和電線ホールディングス	14,400	985.00	14,184,000
東京特殊電線	1,500	2,894.00	4,341,000
タツタ電線	22,700	943.00	21,406,100
カナレ電気	1,900	2,535.00	4,816,500
平河ヒューテック	5,700	1,327.00	7,563,900
リョービ	14,100	3,220.00	45,402,000
アーレスティ	14,100	942.00	13,282,200
アサヒホールディングス	18,800	2,199.00	41,341,200
東洋製罐グループホールディングス	78,400	1,885.00	147,784,000
ホッカンホールディングス	29,000	449.00	13,021,000
コロナ	6,300	1,500.00	9,450,000
横河ブリッジホールディングス	21,300	2,703.00	57,573,900
OSJBホールディングス	57,400	333.00	19,114,200
駒井ハルテック	2,500	2,629.00	6,572,500
高田機工	1,100	3,355.00	3,690,500
三和ホールディングス	110,000	1,564.00	172,040,000
文化シャッター	33,800	1,045.00	35,321,000
三協立山	15,900	1,597.00	25,392,300
アルインコ	8,400	1,313.00	11,029,200
東洋シャッター	3,000	634.00	1,902,000
LIXILグループ	169,100	3,080.00	520,828,000
日本ファイルコン	8,800	774.00	6,811,200
ノーリツ	25,600	2,216.00	56,729,600
長府製作所	12,900	2,581.00	33,294,900
リンナイ	20,400	10,410.00	212,364,000
ユニプレス	22,400	3,135.00	70,224,000
ダイニチ工業	6,200	856.00	5,307,200
日東精工	15,900	688.00	10,939,200
三洋工業	1,400	2,223.00	3,112,200
岡部	23,200	1,110.00	25,752,000
ジーテクト	12,700	2,351.00	29,857,700
中国工業	1,700	892.00	1,516,400
東プレ	21,400	3,305.00	70,727,000
高周波熱錬	22,100	1,244.00	27,492,400
東京製綱	8,200	1,898.00	15,563,600
サンコール	6,500	745.00	4,842,500
モリテックスチール	6,600	1,030.00	6,798,000
バイオラックス	17,000	3,450.00	58,650,000
エイチワン	8,400	1,765.00	14,826,000
日本発条	114,300	1,264.00	144,475,200
中央発條	1,400	3,685.00	5,159,000
アドバネクス	1,800	3,665.00	6,597,000
三浦工業	49,600	3,165.00	156,984,000
タクマ	38,900	1,590.00	61,851,000
テクノプロ・ホールディングス	19,700	6,150.00	121,155,000
アトラ	1,900	710.00	1,349,000
インターワークス	2,500	1,224.00	3,060,000
Keepertech 技研	3,600	1,469.00	5,288,400
ファーストロジック	1,700	1,018.00	1,730,600

三機サービス	1,200	1,527.00	1,832,400
デザインワン・ジャパン	2,200	1,306.00	2,873,200
イー・ガーディアン	5,600	2,671.00	14,957,600
リブセンス	7,100	559.00	3,968,900
ジャパンマテリアル	10,100	4,150.00	41,915,000
ベクトル	13,300	1,628.00	21,652,400
ウチヤマホールディングス	5,500	602.00	3,311,000
ライクキッズネクスト	1,100	2,236.00	2,459,600
キャリアリンク	3,100	568.00	1,760,800
I B J	8,600	1,087.00	9,348,200
アサンテ	4,000	1,923.00	7,692,000
N・フィールド	6,200	1,558.00	9,659,600
バリューHR	2,500	2,385.00	5,962,500
M&Aキャピタルパートナーズ	2,200	8,000.00	17,600,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	4,500	1,120.00	5,040,000
E R Iホールディングス	3,100	976.00	3,025,600
アビスト	1,600	5,310.00	8,496,000
シグマクシス	4,400	1,353.00	5,953,200
ウィルグループ	4,800	1,718.00	8,246,400
エスクロー・エージェント・ジャパン	15,200	538.00	8,177,600
日本ビューホテル	2,400	1,433.00	3,439,200
リクルートホールディングス	855,300	2,782.50	2,379,872,250
エラン	2,700	1,402.00	3,785,400
ツガミ	30,000	1,545.00	46,350,000
オークマ	13,400	7,930.00	106,262,000
東芝機械	65,000	890.00	57,850,000
アマダホールディングス	177,000	1,649.00	291,873,000
アイダエンジニアリング	29,200	1,495.00	43,654,000
滝澤鉄工所	3,600	2,249.00	8,096,400
富士機械製造	34,400	2,350.00	80,840,000
牧野フライス製作所	56,000	1,199.00	67,144,000
オーエスジー	52,900	2,531.00	133,889,900
ダイジェット工業	1,400	1,898.00	2,657,200
旭ダイヤモンド工業	34,100	1,345.00	45,864,500
D M G森精機	63,500	2,491.00	158,178,500
ソディック	25,000	1,532.00	38,300,000
ディスコ	15,500	25,910.00	401,605,000
日東工器	7,100	2,952.00	20,959,200
日進工具	3,000	2,598.00	7,794,000
パンチ工業	9,600	1,440.00	13,824,000
富士ダイス	4,300	1,194.00	5,134,200
土木管理総合試験所	3,300	730.00	2,409,000
日本郵政	629,000	1,323.00	832,167,000
ベルシステム24ホールディングス	18,600	1,594.00	29,648,400
鎌倉新書	1,500	1,989.00	2,983,500
一蔵	1,400	1,203.00	1,684,200
L I T A L I C O	1,900	1,962.00	3,727,800
グローバルグループ	1,200	1,656.00	1,987,200
エボラブルアジア	2,300	2,457.00	5,651,100



ストライク	1,000	5,710.00	5,710,000
ソラスト	6,600	2,849.00	18,803,400
セラク	1,900	829.00	1,575,100
インソース	1,300	3,845.00	4,998,500
豊田自動織機	93,900	7,660.00	719,274,000
豊和工業	6,300	1,535.00	9,670,500
OKK	4,400	1,338.00	5,887,200
石川製作所	3,000	3,035.00	9,105,000
東洋機械金属	9,000	1,003.00	9,027,000
津田駒工業	27,000	233.00	6,291,000
エンシュウ	30,000	165.00	4,950,000
島精機製作所	14,500	7,480.00	108,460,000
NCホールディングス	3,700	819.00	3,030,300
フリー	8,200	1,132.00	9,282,400
ヤマシンフィルタ	15,700	1,552.00	24,366,400
日阪製作所	16,500	1,203.00	19,849,500
やまびこ	22,200	1,970.00	43,734,000
平田機工	3,200	12,290.00	39,328,000
ペガサスミシン製造	10,800	795.00	8,586,000
ナプテスコ	63,100	4,935.00	311,398,500
三井海洋開発	12,200	3,070.00	37,454,000
レオン自動機	10,200	2,347.00	23,939,400
SMC	36,400	49,870.00	1,815,268,000
新川	9,400	1,166.00	10,960,400
ホソカワミクロン	4,300	8,290.00	35,647,000
ユニオンツール	5,200	4,150.00	21,580,000
オイレス工業	14,800	2,306.00	34,128,800
日精エー・エス・ビー機械	3,900	7,160.00	27,924,000
サトーホールディングス	15,100	3,535.00	53,378,500
技研製作所	5,800	3,160.00	18,328,000
日本エアーテック	3,900	958.00	3,736,200
日精樹脂工業	9,600	1,733.00	16,636,800
オカダアイオン	3,400	2,254.00	7,663,600
ワイエイシイホールディングス	3,900	1,112.00	4,336,800
小松製作所	560,200	4,445.00	2,490,089,000
住友重機械工業	66,400	5,080.00	337,312,000
日立建機	54,200	4,440.00	240,648,000
日工	3,200	2,428.00	7,769,600
巴工業	4,900	2,123.00	10,402,700
井関農機	11,600	2,991.00	34,695,600
TOWA	9,000	2,255.00	20,295,000
丸山製作所	2,500	2,067.00	5,167,500
北川鉄工所	5,600	3,235.00	18,116,000
シンニッタン	8,900	855.00	7,609,500
ローツェ	5,700	2,945.00	16,786,500
タカキタ	3,600	998.00	3,592,800
クボタ	625,900	2,293.50	1,435,501,650
荏原実業	3,400	2,027.00	6,891,800
東洋エンジニアリング	15,300	1,356.00	20,746,800
三菱化工機	4,000	2,438.00	9,752,000

月島機械	23,000	1,427.00	32,821,000
帝国電機製作所	8,100	1,564.00	12,668,400
東京機械製作所	4,600	597.00	2,746,200
新東工業	27,500	1,528.00	42,020,000
澁谷工業	10,100	4,900.00	49,490,000
アイチコーポレーション	20,100	843.00	16,944,300
小森コーポレーション	29,200	1,630.00	47,596,000
鶴見製作所	9,800	2,157.00	21,138,600
住友精密工業	19,000	405.00	7,695,000
酒井重工業	2,200	4,325.00	9,515,000
荏原製作所	47,700	4,550.00	217,035,000
石井鐵工所	1,800	1,922.00	3,459,600
西島製作所	11,800	1,177.00	13,888,600
北越工業	13,100	1,309.00	17,147,900
千代田化工建設	84,400	876.00	73,934,400
ダイキン工業	158,400	13,815.00	2,188,296,000
オルガノ	4,200	3,620.00	15,204,000
トーヨーカネツ	4,900	4,600.00	22,540,000
栗田工業	62,800	3,805.00	238,954,000
椿本チエイン	69,000	951.00	65,619,000
大同工業	4,400	1,783.00	7,845,200
日機装	40,100	1,284.00	51,488,400
木村化工機	9,700	626.00	6,072,200
新興プランテック	25,000	1,192.00	29,800,000
アネスト岩田	19,500	1,298.00	25,311,000
ダイフク	59,000	6,860.00	404,740,000
サムコ	3,200	1,424.00	4,556,800
加藤製作所	5,500	3,545.00	19,497,500
油研工業	2,300	2,838.00	6,527,400
タダノ	56,000	2,100.00	117,600,000
フジテック	37,200	1,663.00	61,863,600
C K D	32,300	2,808.00	90,698,400
キトー	8,800	1,796.00	15,804,800
平和	36,000	2,091.00	75,276,000
理想科学工業	11,500	2,135.00	24,552,500
SANKYO	29,000	3,615.00	104,835,000
日本金銭機械	10,700	1,208.00	12,925,600
マースエンジニアリング	7,400	2,513.00	18,596,200
福島工業	7,200	4,990.00	35,928,000
オーイズミ	4,900	540.00	2,646,000
ダイコク電機	5,300	1,853.00	9,820,900
竹内製作所	19,400	2,851.00	55,309,400
アマノ	35,900	3,065.00	110,033,500
JUKI	17,200	2,001.00	34,417,200
サンデンホールディングス	14,200	2,360.00	33,512,000
蛇の目ミシン工業	10,600	854.00	9,052,400
ブラザー工業	141,700	2,910.00	412,347,000
マックス	17,800	1,603.00	28,533,400
モリタホールディングス	18,600	2,152.00	40,027,200
グローリー	34,600	4,335.00	149,991,000

新晃工業	11,800	2,197.00	25,924,600
大和冷機工業	18,600	1,435.00	26,691,000
セガサミーホールディングス	115,100	1,456.00	167,585,600
日本ピストンリング	4,200	2,294.00	9,634,800
リケン	5,400	6,580.00	35,532,000
T P R	13,000	3,800.00	49,400,000
ツバキ・ナカシマ	11,600	2,772.00	32,155,200
ホシザキ	36,500	10,120.00	369,380,000
大豊工業	9,400	1,727.00	16,233,800
日本精工	238,300	1,863.00	443,952,900
N T N	268,500	588.00	157,878,000
ジェイテクト	123,600	2,058.00	254,368,800
不二越	108,000	787.00	84,996,000
ミネベアミツミ	215,400	2,484.00	535,053,600
日本トムソン	37,100	869.00	32,239,900
T H K	72,300	4,390.00	317,397,000
ユーシン精機	5,100	3,465.00	17,671,500
前澤給装工業	4,500	2,055.00	9,247,500
イーグル工業	14,300	2,219.00	31,731,700
前澤工業	7,800	444.00	3,463,200
日本ビラー工業	11,700	1,831.00	21,422,700
キッツ	51,700	922.00	47,667,400
日立製作所	2,786,000	914.30	2,547,239,800
三菱電機	1,160,200	2,012.00	2,334,322,400
富士電機	350,000	897.00	313,950,000
東洋電機製造	4,900	1,972.00	9,662,800
安川電機	134,500	5,340.00	718,230,000
シンフォニア テクノロジー	75,000	468.00	35,100,000
明電舎	98,000	489.00	47,922,000
オリジン電気	3,400	1,809.00	6,150,600
山洋電気	5,600	8,750.00	49,000,000
デンヨー	10,700	2,022.00	21,635,400
三櫻工業	14,700	921.00	13,538,700
マキタ	151,300	5,110.00	773,143,000
東芝テック	83,000	741.00	61,503,000
芝浦メカトロニクス	17,000	476.00	8,092,000
マブチモーター	32,400	6,390.00	207,036,000
日本電産	139,600	16,730.00	2,335,508,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	4,200	3,065.00	12,873,000
東光高岳	5,900	1,950.00	11,505,000
ダブル・スコープ	16,800	2,250.00	37,800,000
宮越ホールディングス	4,300	691.00	2,971,300
ダイヘン	63,000	1,089.00	68,607,000
田淵電機	16,100	321.00	5,168,100
ヤーマン	14,700	1,900.00	27,930,000
J V C ケンウッド	85,200	404.00	34,420,800
ミマキエンジニアリング	10,400	1,131.00	11,762,400
第一精工	5,400	3,225.00	17,415,000
日新電機	27,200	1,366.00	37,155,200
大崎電気工業	24,900	851.00	21,189,900

オムロン	123,300	7,220.00	890,226,000
日東工業	18,600	1,830.00	34,038,000
I D E C	14,800	2,857.00	42,283,600
不二電機工業	1,300	1,449.00	1,883,700
ジーエス・ユアサ コーポレーション	209,000	610.00	127,490,000
サクサホールディングス	2,900	2,170.00	6,293,000
メルコホールディングス	5,600	4,080.00	22,848,000
テクノメディカ	2,700	2,014.00	5,437,800
日本電気	150,100	3,150.00	472,815,000
富士通	1,193,000	825.40	984,702,200
沖電気工業	47,100	1,626.00	76,584,600
岩崎通信機	5,100	839.00	4,278,900
電気興業	6,600	3,185.00	21,021,000
サンケン電気	68,000	833.00	56,644,000
ナカヨ	2,200	2,108.00	4,637,600
アイホン	6,600	1,994.00	13,160,400
ルネサスエレクトロニクス	60,100	1,322.00	79,452,200
セイコーエプソン	172,700	2,757.00	476,133,900
ワコム	90,000	634.00	57,060,000
アルバック	19,600	7,390.00	144,844,000
アクセル	4,800	867.00	4,161,600
E I Z O	10,600	5,360.00	56,816,000
ジャパンディスプレイ	238,400	235.00	56,024,000
日本信号	32,000	1,207.00	38,624,000
京三製作所	27,000	760.00	20,520,000
能美防災	15,300	2,080.00	31,824,000
ホーチキ	8,400	2,497.00	20,974,800
エレコム	10,000	2,583.00	25,830,000
パナソニック	1,325,400	1,728.50	2,290,953,900
アンリツ	84,600	1,356.00	114,717,600
富士通ゼネラル	35,400	2,463.00	87,190,200
ソニー	774,800	5,584.00	4,326,483,200
T D K	60,700	9,720.00	590,004,000
帝国通信工業	5,100	1,325.00	6,757,500
タムラ製作所	44,700	879.00	39,291,300
アルプス電気	100,000	3,280.00	328,000,000
池上通信機	37,000	179.00	6,623,000
パイオニア	193,400	249.00	48,156,600
日本電波工業	10,500	774.00	8,127,000
鈴木	4,500	1,181.00	5,314,500
日本トリム	2,500	5,280.00	13,200,000
ローランド ディー . ジー .	5,900	3,135.00	18,496,500
フォスター電機	13,600	2,951.00	40,133,600
クラリオン	61,000	426.00	25,986,000
S M K	30,000	599.00	17,970,000
ヨコオ	7,500	1,678.00	12,585,000
ティアック	84,000	47.00	3,948,000
ホシデン	29,300	1,704.00	49,927,200
ヒロセ電機	18,700	16,970.00	317,339,000
日本航空電子工業	30,000	1,908.00	57,240,000

TOA	12,400	1,451.00	17,992,400
マクセルホールディングス	23,100	2,548.00	58,858,800
古野電気	13,800	868.00	11,978,400
ユニデンホールディングス	32,000	327.00	10,464,000
アルパイン	27,700	2,420.00	67,034,000
スミダコーポレーション	11,900	2,051.00	24,406,900
アイコム	6,400	2,649.00	16,953,600
リオン	4,900	2,356.00	11,544,400
本多通信工業	9,000	1,258.00	11,322,000
船井電機	11,700	896.00	10,483,200
横河電機	116,100	2,253.00	261,573,300
新電元工業	4,100	9,170.00	37,597,000
アズビル	34,800	5,150.00	179,220,000
東亜ディーケーケー	5,700	1,080.00	6,156,000
日本光電工業	48,500	2,653.00	128,670,500
チノー	4,000	1,785.00	7,140,000
共和電業	13,200	464.00	6,124,800
日本電子材料	4,600	618.00	2,842,800
堀場製作所	23,000	7,020.00	161,460,000
アドバンテスト	64,700	2,187.00	141,498,900
小野測器	4,800	753.00	3,614,400
エスベック	10,300	2,873.00	29,591,900
キーエンス	56,900	65,960.00	3,753,124,000
日置電機	6,100	2,934.00	17,897,400
シスメックス	90,300	8,910.00	804,573,000
日本マイクロニクス	20,200	1,197.00	24,179,400
メガチップス	9,100	3,450.00	31,395,000
OBARA GROUP	6,800	7,850.00	53,380,000
イマジカ・ロボットホールディングス	9,600	1,210.00	11,616,000
澤藤電機	1,200	2,363.00	2,835,600
デンソー	257,400	7,060.00	1,817,244,000
コーセル	16,100	1,908.00	30,718,800
イリソ電子工業	9,700	7,130.00	69,161,000
新日本無線	7,100	1,014.00	7,199,400
オプテックスグループ	9,400	6,380.00	59,972,000
千代田インテグレ	5,600	2,624.00	14,694,400
アイ・オー・データ機器	4,800	1,128.00	5,414,400
レーザーテック	25,500	3,435.00	87,592,500
スタンレー電気	88,800	4,645.00	412,476,000
岩崎電気	4,400	1,709.00	7,519,600
ウシオ電機	70,400	1,680.00	118,272,000
岡谷電機産業	6,200	627.00	3,887,400
ヘリオス テクノホールディング	9,900	1,155.00	11,434,500
日本セラミック	11,800	3,030.00	35,754,000
遠藤照明	5,900	1,300.00	7,670,000
古河電池	8,300	1,183.00	9,818,900
双信電機	5,100	797.00	4,064,700
山一電機	8,400	2,194.00	18,429,600
図研	7,500	1,950.00	14,625,000

日本電子	42,000	649.00	27,258,000	
カシオ計算機	93,300	1,707.00	159,263,100	
ファナック	110,300	30,740.00	3,390,622,000	
日本シイエムケイ	20,500	1,045.00	21,422,500	
エンプラス	5,300	4,700.00	24,910,000	
大真空	4,200	1,723.00	7,236,600	
ローム	52,100	12,510.00	651,771,000	
浜松ホトニクス	84,500	4,060.00	343,070,000	
三井ハイテック	15,300	2,134.00	32,650,200	
新光電気工業	43,800	935.00	40,953,000	
京セラ	190,400	7,713.00	1,468,555,200	
協栄産業	1,400	2,215.00	3,101,000	
太陽誘電	52,100	1,874.00	97,635,400	
村田製作所	121,700	15,595.00	1,897,911,500	
ユーシン	17,500	774.00	13,545,000	
双葉電子工業	19,000	2,455.00	46,645,000	
日東電工	87,600	10,375.00	908,850,000	
北陸電気工業	4,700	1,756.00	8,253,200	
東海理化電機製作所	30,500	2,437.00	74,328,500	
ニチコン	36,500	1,543.00	56,319,500	
日本ケミコン	9,400	3,715.00	34,921,000	
K O A	16,000	2,355.00	37,680,000	
三井造船	41,900	2,044.00	85,643,600	
日立造船	92,000	621.00	57,132,000	
三菱重工業	194,400	4,320.00	839,808,000	
川崎重工業	90,300	4,225.00	381,517,500	
I H I	89,100	3,910.00	348,381,000	
名村造船所	34,800	760.00	26,448,000	
サノヤスホールディングス	14,100	314.00	4,427,400	
日本車輛製造	42,000	370.00	15,540,000	
三菱ロジスネクスト	13,800	1,031.00	14,227,800	
近畿車輛	1,700	3,175.00	5,397,500	
F P G	39,900	1,494.00	59,610,600	
島根銀行	2,400	1,382.00	3,316,800	
じもとホールディングス	77,300	197.00	15,228,100	
全国保証	32,200	4,970.00	160,034,000	
めぶきフィナンシャルグループ	594,600	511.00	303,840,600	
東京ＴＹフィナンシャルグループ	15,500	3,475.00	53,862,500	
九州フィナンシャルグループ	187,800	718.00	134,840,400	
かんぽ生命保険	43,200	2,765.00	119,448,000	
ゆうちょ銀行	324,200	1,527.00	495,053,400	
富山第一銀行	29,100	545.00	15,859,500	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	695,700	721.00	501,599,700	
西日本フィナンシャルホールディングス	77,600	1,466.00	113,761,600	
日産自動車	1,368,300	1,157.50	1,583,807,250	
いすゞ自動車	336,200	1,986.50	667,861,300	
トヨタ自動車	1,410,400	7,629.00	10,759,941,600	*
日野自動車	165,600	1,515.00	250,884,000	

三菱自動車工業	429,400	883.00	379,160,200
エフテック	7,400	1,695.00	12,543,000
レシップホールディングス	4,200	934.00	3,922,800
GMB	1,900	2,258.00	4,290,200
ファルテック	2,000	1,504.00	3,008,000
武蔵精密工業	12,400	3,780.00	46,872,000
日産車体	45,300	1,179.00	53,408,700
新明和工業	50,400	1,110.00	55,944,000
極東開発工業	21,600	2,025.00	43,740,000
日信工業	23,600	2,245.00	52,982,000
トビー工業	9,500	3,475.00	33,012,500
ティラド	4,200	4,135.00	17,367,000
曙ブレーキ工業	53,900	338.00	18,218,200
タチエス	19,700	2,150.00	42,355,000
NOK	62,400	2,758.00	172,099,200
フタバ産業	35,500	1,084.00	38,482,000
KYB	12,100	6,860.00	83,006,000
市光工業	17,300	1,086.00	18,787,800
大同メタル工業	14,600	1,039.00	15,169,400
プレス工業	61,600	697.00	42,935,200
ミクニ	14,700	754.00	11,083,800
太平洋工業	24,200	1,776.00	42,979,200
ケーシン	26,700	2,357.00	62,931,900
河西工業	14,200	1,927.00	27,363,400
アイシン精機	95,500	6,650.00	635,075,000
マツダ	364,200	1,583.50	576,710,700
今仙電機製作所	10,800	1,385.00	14,958,000
本田技研工業	1,044,000	4,026.00	4,203,144,000
スズキ	229,900	6,564.00	1,509,063,600
SUBARU	360,200	3,712.00	1,337,062,400
安永	5,600	3,050.00	17,080,000
ヤマハ発動機	163,900	3,875.00	635,112,500
ショーワ	30,100	1,372.00	41,297,200
小糸製作所	69,500	8,160.00	567,120,000
TBK	13,800	553.00	7,631,400
エクセディ	14,000	3,520.00	49,280,000
ミツバ	21,400	1,684.00	36,037,600
豊田合成	42,100	3,015.00	126,931,500
愛三工業	20,400	1,337.00	27,274,800
盟和産業	1,800	1,387.00	2,496,600
ヨロズ	11,700	2,460.00	28,782,000
エフ・シー・シー	19,000	2,979.00	56,601,000
新家工業	2,600	2,250.00	5,850,000
シマノ	46,800	16,000.00	748,800,000
テイ・エス テック	26,900	4,990.00	134,231,000
ジャムコ	5,800	2,881.00	16,709,800
小野建	10,000	2,105.00	21,050,000
はるやまホールディングス	5,200	1,115.00	5,798,000
ノジマ	20,000	2,830.00	56,600,000
佐島電機	8,400	1,223.00	10,273,200

カップバ・クリエイト	14,200	1,270.00	18,034,000
エコトレーディング	2,600	793.00	2,061,800
伯東	7,000	1,995.00	13,965,000
コンドーテック	9,100	1,110.00	10,101,000
中山福	6,600	802.00	5,293,200
ライトオン	9,600	940.00	9,024,000
ナガイレーベン	15,100	2,829.00	42,717,900
ジーンズメイト	3,500	1,056.00	3,696,000
三菱食品	12,600	3,295.00	41,517,000
良品計画	15,200	35,300.00	536,560,000
三城ホールディングス	14,000	502.00	7,028,000
松田産業	8,300	2,085.00	17,305,500
第一興商	17,000	5,960.00	101,320,000
メディカルホールディングス	114,500	2,290.00	262,205,000
アドヴァン	11,600	1,075.00	12,470,000
S P K	2,500	3,295.00	8,237,500
萩原電気	3,900	3,620.00	14,118,000
アルビス	2,600	4,005.00	10,413,000
アズワン	8,900	7,130.00	63,457,000
スズデン	4,000	1,675.00	6,700,000
尾家産業	3,300	1,463.00	4,827,900
シモジマ	7,000	1,265.00	8,855,000
ドウシシャ	12,100	2,570.00	31,097,000
小津産業	2,500	2,248.00	5,620,000
コナカ	14,600	656.00	9,577,600
高速	6,800	1,384.00	9,411,200
ハウス オブ ローゼ	1,400	1,869.00	2,616,600
G - 7ホールディングス	3,400	2,601.00	8,843,400
たけびし	4,000	1,922.00	7,688,000
イオン北海道	11,500	786.00	9,039,000
コジマ	19,700	389.00	7,663,300
ヒマラヤ	3,100	1,399.00	4,336,900
コーナン商事	16,200	2,517.00	40,775,400
ネットワンシステムズ	46,500	1,666.00	77,469,000
エコス	4,700	1,310.00	6,157,000
ワタミ	13,500	1,629.00	21,991,500
マルシェ	3,000	817.00	2,451,000
リックス	2,600	2,030.00	5,278,000
システムソフト	27,000	149.00	4,023,000
ドンキホーテホールディングス	74,100	6,110.00	452,751,000
丸文	10,100	1,165.00	11,766,500
西松屋チェーン	25,100	1,280.00	32,128,000
ゼンショーホールディングス	59,300	1,989.00	117,947,700
ハピネット	7,800	2,150.00	16,770,000
幸楽苑ホールディングス	7,300	1,920.00	14,016,000
ハークスレイ	2,800	1,198.00	3,354,400
橋本総業ホールディングス	2,400	1,890.00	4,536,000
日本ライフライン	32,600	2,413.00	78,663,800
サイゼリヤ	16,900	3,185.00	53,826,500
エクセル	4,600	2,830.00	13,018,000



V Tホールディングス	38,700	557.00	21,555,900
マルカキカイ	3,700	2,167.00	8,017,900
アルゴグラフィックス	5,200	3,440.00	17,888,000
魚力	3,200	1,223.00	3,913,600
I D O M	34,700	799.00	27,725,300
日本エム・ディ・エム	7,700	929.00	7,153,300
ポプラ	3,000	742.00	2,226,000
フジ・コーポレーション	1,900	2,450.00	4,655,000
ユナイテッドアローズ	14,100	4,655.00	65,635,500
進和	6,700	2,880.00	19,296,000
エスケイジャパン	2,400	482.00	1,156,800
ダイトロン	5,200	2,356.00	12,251,200
ハイデイ日高	12,500	3,470.00	43,375,000
シークス	7,300	4,855.00	35,441,500
京都きもの友禅	7,300	765.00	5,584,500
コロワイド	38,000	2,290.00	87,020,000
ピーシーデポコーポレーション	17,100	815.00	13,936,500
田中商事	3,500	870.00	3,045,000
オーハシテクニカ	6,400	1,789.00	11,449,600
壱番屋	8,000	4,595.00	36,760,000
白銅	4,100	2,647.00	10,852,700
トップカルチャー	4,100	505.00	2,070,500
P L A N T	2,700	1,402.00	3,785,400
スギホールディングス	25,100	5,630.00	141,313,000
島津製作所	138,600	2,733.00	378,793,800
J M S	10,700	647.00	6,922,900
クボテック	2,500	586.00	1,465,000
長野計器	9,100	1,311.00	11,930,100
バイ・テクノロジー	2,700	19,670.00	53,109,000
スター精密	18,600	2,351.00	43,728,600
東京計器	7,400	1,415.00	10,471,000
愛知時計電機	1,500	4,740.00	7,110,000
インターアクション	4,400	995.00	4,378,000
オーバル	11,400	320.00	3,648,000
東京精密	21,000	4,785.00	100,485,000
マニー	14,100	3,615.00	50,971,500
ニコン	202,100	2,308.00	466,446,800
トプコン	62,300	2,573.00	160,297,900
オリンパス	172,800	4,405.00	761,184,000
理研計器	11,100	2,525.00	28,027,500
S C R E E Nホールディングス	22,000	9,580.00	210,760,000
キヤノン電子	10,600	2,525.00	26,765,000
タムロン	9,300	2,515.00	23,389,500
H O Y A	236,200	5,654.00	1,335,474,800
シード	1,200	5,180.00	6,216,000
ノーリツ鋼機	11,700	2,504.00	29,296,800
エー・アンド・デイ	10,600	862.00	9,137,200
キヤノン	624,600	4,336.00	2,708,265,600
リコー	348,800	1,111.00	387,516,800
シチズン時計	138,500	881.00	122,018,500

リズム時計工業	4,400	2,359.00	10,379,600
大研医器	10,300	778.00	8,013,400
メニコン	15,900	3,070.00	48,813,000
中本ボックス	1,100	4,640.00	5,104,000
スノーピーク	3,600	1,500.00	5,400,000
パラマウントベッドホールディングス	12,200	5,590.00	68,198,000
トランザクション	5,200	1,061.00	5,517,200
SHOBI	3,900	443.00	1,727,700
ニホンフラッシュ	5,400	2,938.00	15,865,200
前田工織	11,600	2,154.00	24,986,400
永大産業	15,000	582.00	8,730,000
アートネイチャー	12,400	788.00	9,771,200
バンダイナムコホールディングス	120,000	3,820.00	458,400,000
アイフィスジャパン	2,400	631.00	1,514,400
共立印刷	19,300	396.00	7,642,800
SHOEI	5,200	4,920.00	25,584,000
フランスベッドホールディングス	13,700	1,087.00	14,891,900
マーベラス	19,300	1,059.00	20,438,700
パイロットコーポレーション	20,200	5,550.00	112,110,000
萩原工業	6,400	1,998.00	12,787,200
エイベックス	21,100	1,645.00	34,709,500
トッパン・フォームズ	24,900	1,288.00	32,071,200
フジシールインターナショナル	26,000	3,965.00	103,090,000
タカラトミー	48,600	1,626.00	79,023,600
廣濟堂	10,800	474.00	5,119,200
As-meエステール	3,400	1,059.00	3,600,600
アーク	48,900	127.00	6,210,300
レック	6,900	3,110.00	21,459,000
タカノ	5,100	1,156.00	5,895,600
プロネクサス	10,800	1,521.00	16,426,800
ホクシン	8,200	203.00	1,664,600
ウッドワン	3,900	1,759.00	6,860,100
大建工業	9,100	2,955.00	26,890,500
きもと	19,800	330.00	6,534,000
凸版印刷	328,000	1,044.00	342,432,000
大日本印刷	151,800	2,558.00	388,304,400
図書印刷	7,800	1,013.00	7,901,400
共同印刷	3,600	3,665.00	13,194,000
NISSHA	23,800	3,530.00	84,014,000
光村印刷	1,000	2,414.00	2,414,000
藤森工業	9,700	4,065.00	39,430,500
ヴィア・ホールディングス	10,000	759.00	7,590,000
宝印刷	6,100	1,780.00	10,858,000
前澤化成工業	7,900	1,240.00	9,796,000
アシックス	115,200	1,821.00	209,779,200
ツツミ	3,600	2,284.00	8,222,400
JSP	6,800	3,970.00	26,996,000
ニチハ	17,500	4,760.00	83,300,000
エフピコ	9,600	6,000.00	57,600,000
小松ウオール工業	3,900	2,433.00	9,488,700

ヤマハ	78,200	4,540.00	355,028,000
河合楽器製作所	3,900	3,355.00	13,084,500
クリナップ	10,800	919.00	9,925,200
ビジョン	70,100	4,385.00	307,388,500
天馬	9,000	2,218.00	19,962,000
兼松サステック	900	2,215.00	1,993,500
キングジム	9,700	1,030.00	9,991,000
リンテック	27,600	3,225.00	89,010,000
信越ポリマー	23,800	1,306.00	31,082,800
東リ	28,900	437.00	12,629,300
イトーキ	24,400	837.00	20,422,800
任天堂	71,400	44,120.00	3,150,168,000
三菱鉛筆	19,100	2,492.00	47,597,200
松風	5,700	1,460.00	8,322,000
タカラスタンダード	24,000	1,851.00	44,424,000
コクヨ	55,600	2,126.00	118,205,600
ナカバヤシ	11,400	742.00	8,458,800
ニフコ	21,300	7,800.00	166,140,000
立川ブラインド工業	5,100	1,555.00	7,930,500
グローブライド	5,200	2,461.00	12,797,200
岡村製作所	40,500	1,591.00	64,435,500
日本バルカー工業	9,400	3,280.00	30,832,000
MUTOHホールディングス	1,600	2,529.00	4,046,400
伊藤忠商事	838,600	2,231.00	1,870,916,600
丸紅	939,100	855.00	802,930,500
スクロール	17,600	546.00	9,609,600
高島	2,000	2,308.00	4,616,000
ヨンドシーホールディングス	11,600	2,834.00	32,874,400
三陽商会	6,400	2,282.00	14,604,800
長瀬産業	68,800	2,146.00	147,644,800
ナイガイ	4,500	621.00	2,794,500
蝶理	7,300	2,080.00	15,184,000
豊田通商	127,500	4,810.00	613,275,000
オンワードホールディングス	72,600	975.00	70,785,000
三共生興	19,400	495.00	9,603,000
兼松	48,700	1,582.00	77,043,400
美津濃	11,500	3,340.00	38,410,000
ツカモトコーポレーション	2,100	1,403.00	2,946,300
ユニー・ファミリーマートホールディングス	36,500	7,750.00	282,875,000
ルックホールディングス	21,000	401.00	8,421,000
三井物産	970,600	1,956.50	1,898,978,900
日本紙パルプ商事	6,000	4,380.00	26,280,000
東京エレクトロン	77,400	21,865.00	1,692,351,000
日立ハイテクノロジーズ	39,700	4,805.00	190,758,500
カメイ	14,900	1,977.00	29,457,300
東都水産	1,700	2,060.00	3,502,000
OUGホールディングス	1,800	2,696.00	4,852,800
スターゼン	4,500	5,680.00	25,560,000
セイコーホールディングス	17,900	3,300.00	59,070,000

山善	44,600	1,373.00	61,235,800
椿本興業	2,600	3,200.00	8,320,000
住友商事	720,800	2,019.50	1,455,655,600
日本ユニシス	31,600	2,362.00	74,639,200
内田洋行	5,300	3,320.00	17,596,000
三菱商事	801,900	3,271.00	2,623,014,900
第一実業	5,200	3,510.00	18,252,000
キヤノンマーケティングジャパン	32,700	3,070.00	100,389,000
西華産業	7,100	3,145.00	22,329,500
佐藤商事	10,200	1,326.00	13,525,200
菱洋エレクトロ	10,600	2,117.00	22,440,200
東京産業	11,300	579.00	6,542,700
ユアサ商事	10,800	4,120.00	44,496,000
神鋼商事	2,600	3,410.00	8,866,000
小林産業	7,600	370.00	2,812,000
阪和興業	21,300	5,510.00	117,363,000
正栄食品工業	6,300	4,560.00	28,728,000
カナデン	10,900	1,538.00	16,764,200
菱電商事	8,200	1,895.00	15,539,000
ニプロ	80,300	1,671.00	134,181,300
フルサト工業	6,300	1,954.00	12,310,200
岩谷産業	25,300	3,845.00	97,278,500
すてきなイスグループ	4,900	1,567.00	7,678,300
昭光通商	41,000	149.00	6,109,000
ニチモウ	1,700	1,965.00	3,340,500
極東貿易	16,000	511.00	8,176,000
イワキ	16,000	544.00	8,704,000
兼松エレクトロニクス	7,200	3,420.00	24,624,000
三愛石油	30,700	1,673.00	51,361,100
稲畑産業	27,400	1,756.00	48,114,400
G S Iクレオス	3,000	1,642.00	4,926,000
明和産業	10,600	498.00	5,278,800
キムラタン	55,500	48.00	2,664,000
ゴールドウイン	3,400	10,790.00	36,686,000
ユニ・チャーム	246,000	3,041.00	748,086,000
デザート	27,700	1,964.00	54,402,800
キング	5,800	652.00	3,781,600
ワキタ	24,400	1,367.00	33,354,800
ヤマトインターナショナル	8,100	449.00	3,636,900
東邦ホールディングス	33,800	2,620.00	88,556,000
サンゲツ	38,600	2,115.00	81,639,000
ミツウロコグループホールディングス	16,600	904.00	15,006,400
シナネンホールディングス	5,500	2,765.00	15,207,500
伊藤忠エネクス	25,300	1,133.00	28,664,900
サンリオ	32,100	1,902.00	61,054,200
サンワテクノス	6,800	2,398.00	16,306,400
リョーサン	14,400	4,370.00	62,928,000
新光商事	12,500	2,166.00	27,075,000
トーヨー	5,200	2,844.00	14,788,800
三信電気	10,500	1,974.00	20,727,000

東陽テクニカ	13,200	1,011.00	13,345,200
モスフードサービス	15,000	3,410.00	51,150,000
加賀電子	10,300	3,060.00	31,518,000
三益半導体工業	10,200	2,191.00	22,348,200
ソーダニッカ	11,800	630.00	7,434,000
立花エレテック	7,700	2,108.00	16,231,600
木曽路	14,000	2,766.00	38,724,000
S R Sホールディングス	13,500	946.00	12,771,000
千趣会	20,700	630.00	13,041,000
タカキュー	9,000	242.00	2,178,000
ケーヨー	21,200	687.00	14,564,400
上新電機	13,500	3,925.00	52,987,500
日本瓦斯	21,000	4,380.00	91,980,000
ロイヤルホールディングス	20,300	3,125.00	63,437,500
東天紅	800	2,189.00	1,751,200
いなげや	12,700	1,893.00	24,041,100
島忠	27,600	3,075.00	84,870,000
チヨダ	13,500	2,760.00	37,260,000
ライフコーポレーション	8,700	3,005.00	26,143,500
リンガーハット	14,100	2,562.00	36,124,200
さが美グループホールディングス	10,000	127.00	1,270,000
MrMaxHD	14,300	876.00	12,526,800
テンアライド	10,600	493.00	5,225,800
AOKIホールディングス	22,900	1,697.00	38,861,300
オークワ	16,000	1,156.00	18,496,000
コメリ	17,600	3,390.00	59,664,000
青山商事	22,000	4,290.00	94,380,000
しまむら	13,300	12,530.00	166,649,000
はせがわ	6,000	510.00	3,060,000
高島屋	179,000	1,162.00	207,998,000
松屋	23,000	1,479.00	34,017,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	54,100	2,359.00	127,621,900
近鉄百貨店	4,400	4,200.00	18,480,000
パルコ	11,000	1,516.00	16,676,000
丸井グループ	109,400	2,074.00	226,895,600
クレディセゾン	86,900	2,214.00	192,396,600
アクシアル リテイリング	9,500	4,110.00	39,045,000
井筒屋	6,300	468.00	2,948,400
イオン	439,700	1,939.50	852,798,150
イズミ	20,700	6,740.00	139,518,000
東武ストア	1,400	3,060.00	4,284,000
フォーバル	5,000	927.00	4,635,000
平和堂	23,200	2,449.00	56,816,800
フジ	13,100	2,438.00	31,937,800
ヤオコー	13,000	5,520.00	71,760,000
ゼビオホールディングス	15,500	2,277.00	35,293,500
ケーズホールディングス	48,400	3,045.00	147,378,000
PALTAC	16,000	5,270.00	84,320,000
三谷産業	12,400	462.00	5,728,800
Olympicグループ	6,800	619.00	4,209,200

日産東京販売ホールディングス	16,800	411.00	6,904,800
新生銀行	99,100	2,081.00	206,227,100
あおぞら銀行	68,200	4,610.00	314,402,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	8,084,700	881.90	7,129,896,930
りそなホールディングス	1,255,800	723.60	908,696,880
三井住友トラスト・ホールディングス	225,000	4,709.00	1,059,525,000
三井住友フィナンシャルグループ	866,100	5,228.00	4,527,970,800
第四銀行	14,000	5,400.00	75,600,000
北越銀行	11,500	2,714.00	31,211,000
千葉銀行	410,000	993.00	407,130,000
群馬銀行	232,400	709.00	164,771,600
武蔵野銀行	18,300	3,970.00	72,651,000
千葉興業銀行	31,400	600.00	18,840,000
筑波銀行	47,700	404.00	19,270,800
七十七銀行	35,900	3,080.00	110,572,000
青森銀行	8,900	3,625.00	32,262,500
秋田銀行	7,300	3,190.00	23,287,000
山形銀行	12,900	2,529.00	32,624,100
岩手銀行	8,000	4,680.00	37,440,000
東邦銀行	102,300	411.00	42,045,300
東北銀行	5,800	1,551.00	8,995,800
みちのく銀行	7,400	1,879.00	13,904,600
ふくおかフィナンシャルグループ	465,000	685.00	318,525,000
静岡銀行	302,000	1,233.00	372,366,000
十六銀行	15,400	3,360.00	51,744,000
スルガ銀行	117,100	2,530.00	296,263,000
八十二銀行	207,100	696.00	144,141,600
山梨中央銀行	71,000	520.00	36,920,000
大垣共立銀行	18,100	2,971.00	53,775,100
福井銀行	9,800	2,849.00	27,920,200
北國銀行	13,000	4,710.00	61,230,000
清水銀行	3,900	3,335.00	13,006,500
富山銀行	2,200	4,520.00	9,944,000
滋賀銀行	108,000	624.00	67,392,000
南都銀行	13,400	3,270.00	43,818,000
百五銀行	109,800	576.00	63,244,800
京都銀行	43,700	6,510.00	284,487,000
紀陽銀行	43,000	1,944.00	83,592,000
三重銀行	5,100	2,633.00	13,428,300
ほくほくフィナンシャルグループ	76,200	1,823.00	138,912,600
広島銀行	168,900	1,013.00	171,095,700
山陰合同銀行	67,800	1,172.00	79,461,600
中国銀行	79,100	1,574.00	124,503,400
鳥取銀行	3,600	1,849.00	6,656,400
伊予銀行	163,300	982.00	160,360,600
百十四銀行	122,000	395.00	48,190,000
四国銀行	17,500	1,720.00	30,100,000
阿波銀行	92,000	758.00	69,736,000
大分銀行	6,600	4,610.00	30,426,000
宮崎銀行	7,600	3,910.00	29,716,000

佐賀銀行	6,900	2,703.00	18,650,700
十八銀行	70,000	317.00	22,190,000
沖縄銀行	11,100	4,620.00	51,282,000
琉球銀行	22,200	1,791.00	39,760,200
セブン銀行	429,200	396.00	169,963,200
みずほフィナンシャルグループ	15,547,500	216.00	3,358,260,000
高知銀行	4,200	1,369.00	5,749,800
山口フィナンシャルグループ	107,000	1,398.00	149,586,000
アクリーティブ	6,300	394.00	2,482,200
芙蓉総合リース	13,100	7,590.00	99,429,000
興銀リース	21,500	2,945.00	63,317,500
東京センチュリー	23,000	5,670.00	130,410,000
SBIホールディングス	129,400	2,609.00	337,604,600
日本証券金融	46,800	677.00	31,683,600
アイフル	192,100	405.00	77,800,500
日本アジア投資	10,300	427.00	4,398,100
長野銀行	3,800	1,965.00	7,467,000
名古屋銀行	9,200	4,555.00	41,906,000
北洋銀行	172,500	414.00	71,415,000
愛知銀行	3,800	5,800.00	22,040,000
第三銀行	6,500	1,852.00	12,038,000
中京銀行	4,700	2,349.00	11,040,300
大光銀行	3,900	2,585.00	10,081,500
愛媛銀行	15,900	1,413.00	22,466,700
トマト銀行	4,400	1,583.00	6,965,200
みなと銀行	10,400	2,156.00	22,422,400
京葉銀行	101,000	548.00	55,348,000
関西アーバン銀行	15,900	1,477.00	23,484,300
栃木銀行	59,300	473.00	28,048,900
北日本銀行	3,600	3,240.00	11,664,000
東和銀行	20,100	1,640.00	32,964,000
福島銀行	10,800	935.00	10,098,000
大東銀行	5,500	1,698.00	9,339,000
リコーリース	9,000	3,975.00	35,775,000
イオンフィナンシャルサービス	81,200	2,837.00	230,364,400
アコム	230,000	486.00	111,780,000
ジャックス	13,900	2,820.00	39,198,000
オリエントコーポレーション	247,400	186.00	46,016,400
日立キャピタル	31,500	3,095.00	97,492,500
アプラスフィナンシャル	55,200	122.00	6,734,400
オリックス	763,200	2,065.50	1,576,389,600
三菱UFJリース	290,400	709.00	205,893,600
ジャフコ	16,400	6,620.00	108,568,000
トモニホールディングス	94,400	620.00	58,528,000
大和証券グループ本社	979,000	764.40	748,347,600
野村ホールディングス	2,065,300	731.30	1,510,353,890
岡三証券グループ	98,000	761.00	74,578,000
丸三証券	36,400	1,069.00	38,911,600
東洋証券	41,000	360.00	14,760,000

東海東京フィナンシャル・ホールディングス	126,700	783.00	99,206,100
光世証券	2,700	1,652.00	4,460,400
水戸証券	35,500	438.00	15,549,000
いちよし証券	24,000	1,436.00	34,464,000
松井証券	56,000	1,012.00	56,672,000
SOMP Oホールディングス	224,400	4,534.00	1,017,429,600
だいこう証券ビジネス	5,600	784.00	4,390,400
日本取引所グループ	336,200	2,048.00	688,537,600
マネックスグループ	121,300	348.00	42,212,400
カブドットコム証券	73,200	369.00	27,010,800
極東証券	15,400	1,740.00	26,796,000
岩井コスモホールディングス	11,700	1,513.00	17,702,100
藍澤證券	21,400	810.00	17,334,000
フィデアホールディングス	111,100	210.00	23,331,000
池田泉州ホールディングス	121,400	429.00	52,080,600
アニコム ホールディングス	7,800	3,575.00	27,885,000
MS & ADインシュアランスグループ ホールディングス	299,200	3,805.00	1,138,456,000
ソニーフィナンシャルホールディング ス	94,000	2,155.00	202,570,000
マネーパートナーズグループ	14,600	431.00	6,292,600
小林洋行	3,300	299.00	986,700
第一生命ホールディングス	647,300	2,470.50	1,599,154,650
東京海上ホールディングス	431,100	5,397.00	2,326,646,700
イー・ギャランティ	3,000	3,715.00	11,145,000
アサックス	1,600	1,955.00	3,128,000
NECキャピタルソリューション	4,700	2,333.00	10,965,100
T & Dホールディングス	353,900	2,044.50	723,548,550
アドバンスクリエイト	2,700	1,975.00	5,332,500
三井不動産	571,400	2,871.00	1,640,489,400
三菱地所	851,800	2,102.50	1,790,909,500
平和不動産	20,200	2,166.00	43,753,200
東京建物	125,100	1,708.00	213,670,800
ダイビル	29,500	1,407.00	41,506,500
京阪神ビルディング	19,000	887.00	16,853,000
住友不動産	274,000	4,201.00	1,151,074,000
太平洋興発	4,800	1,082.00	5,193,600
大京	18,200	2,259.00	41,113,800
テーオーシー	39,500	978.00	38,631,000
東京楽天地	1,900	6,120.00	11,628,000
レオパレス21	136,600	887.00	121,164,200
スターツコーポレーション	15,600	3,025.00	47,190,000
フジ住宅	14,600	910.00	13,286,000
空港施設	11,900	669.00	7,961,100
明和地所	6,300	890.00	5,607,000
ゴールドクレスト	9,000	2,395.00	21,555,000
リログループ	60,600	3,240.00	196,344,000
日本エスリード	4,500	2,625.00	11,812,500
日神不動産	15,300	989.00	15,131,700



日本エスコン	20,200	668.00	13,493,600
タカラレーベン	53,600	533.00	28,568,800
サンヨーハウジング名古屋	5,900	1,224.00	7,221,600
イオンモール	73,700	2,282.00	168,183,400
ファースト住建	4,300	1,777.00	7,641,100
ランド	241,400	18.00	4,345,200
東祥	6,900	3,760.00	25,944,000
トーセイ	14,000	1,221.00	17,094,000
穴吹興産	1,300	3,215.00	4,179,500
エヌ・ティ・ティ都市開発	71,100	1,406.00	99,966,600
サンフロンティア不動産	12,600	1,407.00	17,728,200
エフ・ジェー・ネクスト	8,800	1,002.00	8,817,600
インテリックス	3,500	1,090.00	3,815,000
ランドビジネス	6,900	325.00	2,242,500
グランディハウス	10,100	598.00	6,039,800
東武鉄道	124,000	3,835.00	475,540,000
相鉄ホールディングス	37,100	3,055.00	113,340,500
東京急行電鉄	315,100	1,869.00	588,921,900
京浜急行電鉄	158,900	2,229.00	354,188,100
小田急電鉄	172,600	2,506.00	432,535,600
京王電鉄	64,800	5,160.00	334,368,000
京成電鉄	80,700	3,820.00	308,274,000
富士急行	15,800	3,320.00	52,456,000
新京成電鉄	2,900	2,194.00	6,362,600
東日本旅客鉄道	208,400	11,480.00	2,392,432,000
西日本旅客鉄道	104,700	8,543.00	894,452,100
東海旅客鉄道	103,900	21,090.00	2,191,251,000
西武ホールディングス	147,900	2,181.00	322,569,900
鴻池運輸	16,400	1,964.00	32,209,600
西日本鉄道	32,200	3,140.00	101,108,000
ハマキョウレックス	8,200	3,260.00	26,732,000
サカイ引越センター	6,100	5,680.00	34,648,000
近鉄グループホールディングス	109,900	4,445.00	488,505,500
阪急阪神ホールディングス	146,600	4,605.00	675,093,000
南海電気鉄道	52,100	2,924.00	152,340,400
京阪ホールディングス	48,900	3,435.00	167,971,500
神戸電鉄	2,600	4,050.00	10,530,000
名古屋鉄道	84,800	2,924.00	247,955,200
山陽電気鉄道	8,500	2,876.00	24,446,000
ランコム	3,100	7,990.00	24,769,000
日本通運	43,100	7,570.00	326,267,000
ヤマトホールディングス	192,600	2,473.50	476,396,100
山九	28,200	5,050.00	142,410,000
日新	9,500	3,125.00	29,687,500
丸運	6,000	346.00	2,076,000
丸全昭和運輸	39,000	507.00	19,773,000
センコーグループホールディングス	66,100	817.00	54,003,700
トナミホールディングス	2,600	5,780.00	15,028,000
ニッコンホールディングス	41,800	3,200.00	133,760,000
日本石油輸送	1,300	3,865.00	5,024,500

福山通運	16,100	4,275.00	68,827,500
セイノーホールディングス	82,300	1,900.00	156,370,000
神奈川中央交通	2,700	3,700.00	9,990,000
日立物流	24,200	2,885.00	69,817,000
丸和運輸機関	5,800	3,580.00	20,764,000
C & F ロジホールディングス	12,000	1,618.00	19,416,000
日本郵船	91,900	3,015.00	277,078,500
商船三井	69,500	4,065.00	282,517,500
川崎汽船	50,700	3,030.00	153,621,000
NSユナイテッド海運	5,200	2,915.00	15,158,000
明治海運	11,400	472.00	5,380,800
飯野海運	56,000	645.00	36,120,000
共栄タンカー	800	2,209.00	1,767,200
九州旅客鉄道	92,200	3,635.00	335,147,000
日本航空	203,900	4,425.00	902,257,500
ANAホールディングス	215,300	4,742.00	1,020,952,600
パスコ	11,000	346.00	3,806,000
西本Wismettacホールディングス	2,300	4,895.00	11,258,500
ヤマシタヘルスケアホールディングス	900	1,618.00	1,456,200
Genky DrugStores	5,000	4,020.00	20,100,000
三菱倉庫	38,000	3,105.00	117,990,000
三井倉庫ホールディングス	63,000	396.00	24,948,000
住友倉庫	76,000	849.00	64,524,000
澁澤倉庫	6,000	2,073.00	12,438,000
ヤマタネ	5,700	2,141.00	12,203,700
東陽倉庫	19,900	343.00	6,825,700
乾汽船	8,500	840.00	7,140,000
日本トランスシティ	27,000	500.00	13,500,000
ケイヒン	2,100	1,742.00	3,658,200
中央倉庫	6,700	1,222.00	8,187,400
川西倉庫	2,200	2,351.00	5,172,200
安田倉庫	9,800	1,026.00	10,054,800
東洋埠頭	3,400	1,872.00	6,364,800
宇徳	9,400	554.00	5,207,600
上組	69,200	2,548.00	176,321,600
サンリツ	2,800	904.00	2,531,200
キムラユニティー	2,900	1,198.00	3,474,200
キューソー流通システム	3,200	3,205.00	10,256,000
近鉄エクスプレス	20,700	2,433.00	50,363,100
東海運	6,300	418.00	2,633,400
エーアイティー	7,800	1,303.00	10,163,400
内外トランスライン	3,800	2,035.00	7,733,000
日本コンセプト	2,100	1,404.00	2,948,400
東京放送ホールディングス	68,600	2,812.00	192,903,200
日本テレビホールディングス	104,500	1,976.00	206,492,000
朝日放送	11,300	928.00	10,486,400
テレビ朝日ホールディングス	31,300	2,335.00	73,085,500
スカパーJ S A Tホールディングス	86,900	519.00	45,101,100
テレビ東京ホールディングス	9,300	2,502.00	23,268,600

日本BS放送	3,900	1,380.00	5,382,000
ビジョン	2,900	3,045.00	8,830,500
USEN-NEXT HOLDINGS	3,000	1,016.00	3,048,000
ワイヤレスゲート	5,300	1,364.00	7,229,200
コネクシオ	8,100	2,302.00	18,646,200
日本通信	102,700	123.00	12,632,100
クロップス	2,400	1,111.00	2,666,400
日本電信電話	817,000	5,375.00	4,391,375,000
KDDI	1,025,100	2,807.50	2,877,968,250
光通信	13,800	15,890.00	219,282,000
NTTドコモ	842,800	2,673.50	2,253,225,800
エムティーアイ	15,300	646.00	9,883,800
GMOインターネット	41,500	1,991.00	82,626,500
アйдママーケティングコミュニケーション	1,800	728.00	1,310,400
カドカワ	33,200	1,427.00	47,376,400
学研ホールディングス	3,800	5,670.00	21,546,000
ゼンリン	13,800	4,035.00	55,683,000
昭文社	5,200	767.00	3,988,400
インプレスホールディングス	9,500	161.00	1,529,500
東京電力ホールディングス	926,200	467.00	432,535,400
中部電力	355,000	1,423.00	505,165,000
関西電力	473,400	1,436.50	680,039,100
中国電力	160,300	1,253.00	200,855,900
北陸電力	113,700	927.00	105,399,900
東北電力	271,700	1,506.00	409,180,200
四国電力	104,500	1,311.00	136,999,500
九州電力	256,200	1,226.00	314,101,200
北海道電力	116,300	750.00	87,225,000
沖縄電力	18,700	2,871.00	53,687,700
電源開発	92,300	3,195.00	294,898,500
エフオン	5,800	1,440.00	8,352,000
イーレックス	18,200	1,082.00	19,692,400
東京瓦斯	247,500	2,719.00	672,952,500
大阪瓦斯	225,100	2,288.00	515,028,800
東邦瓦斯	57,500	3,180.00	182,850,000
北海道瓦斯	31,000	300.00	9,300,000
広島ガス	23,900	379.00	9,058,100
西部瓦斯	14,100	2,867.00	40,424,700
静岡ガス	32,900	1,008.00	33,163,200
メタウォーター	6,500	3,040.00	19,760,000
アイネット	6,400	1,809.00	11,577,600
松竹	7,500	19,370.00	145,275,000
東宝	74,900	3,935.00	294,731,500
エイチ・アイ・エス	17,300	4,000.00	69,200,000
東映	4,300	11,630.00	50,009,000
ラックランド	2,100	2,194.00	4,607,400
エヌ・ティ・ティ・データ	353,600	1,394.00	492,918,400
共立メンテナンス	19,800	4,735.00	93,753,000

イチネンホールディングス	12,400	1,759.00	21,811,600
建設技術研究所	7,700	1,168.00	8,993,600
スペース	7,150	1,623.00	11,604,450
長 大	3,300	945.00	3,118,500
アインホールディングス	16,300	6,660.00	108,558,000
燦ホールディングス	2,600	3,095.00	8,047,000
ピー・シー・エー	1,700	1,821.00	3,095,700
スバル興業	800	7,640.00	6,112,000
東京テアトル	4,600	1,507.00	6,932,200
タナベ経営	2,100	1,798.00	3,775,800
ビジネスブレイン太田昭和	2,000	1,799.00	3,598,000
ナガワ	2,200	4,930.00	10,846,000
よみうりランド	2,400	4,995.00	11,988,000
東京都競馬	8,300	4,405.00	36,561,500
常磐興産	4,400	1,892.00	8,324,800
カナモト	16,900	3,505.00	59,234,500
東京ドーム	44,900	1,145.00	51,410,500
D T S	11,800	3,745.00	44,191,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	52,900	5,480.00	289,892,000
シーイーシー	6,800	3,165.00	21,522,000
カプコン	24,400	3,910.00	95,404,000
西尾レントオール	9,800	3,800.00	37,240,000
アイ・エス・ビー	2,200	1,358.00	2,987,600
アゴーラ・ホスピタリティ・グループ	62,000	36.00	2,232,000
日本空港ビルデング	33,500	4,350.00	145,725,000
トランス・コスモス	12,300	2,909.00	35,780,700
乃村工藝社	25,900	2,541.00	65,811,900
ジャステック	6,600	1,314.00	8,672,400
S C S K	26,300	5,210.00	137,023,000
藤田観光	4,400	3,555.00	15,642,000
K N T - C Tホールディングス	6,900	1,806.00	12,461,400
日本管財	11,900	2,091.00	24,882,900
トーカイ	10,700	2,699.00	28,879,300
白洋舎	1,300	4,365.00	5,674,500
セコム	117,600	8,573.00	1,008,184,800
日本システムウエア	3,800	2,695.00	10,241,000
セントラル警備保障	5,300	2,472.00	13,101,600
アイネス	14,400	1,178.00	16,963,200
丹青社	22,700	1,280.00	29,056,000
メイテック	13,000	5,900.00	76,700,000
T K C	10,600	4,090.00	43,354,000
富士ソフト	15,800	3,640.00	57,512,000
応用地質	12,500	1,465.00	18,312,500
船井総研ホールディングス	23,000	2,478.00	56,994,000
N S D	18,700	2,406.00	44,992,200
進学会ホールディングス	5,100	673.00	3,432,300
丸紅建材リース	11,000	252.00	2,772,000
オオバ	9,400	532.00	5,000,800

コナミホールディングス	46,500	6,380.00	296,670,000
いであ	2,300	1,195.00	2,748,500
学究社	3,000	1,653.00	4,959,000
ベネッセホールディングス	40,600	4,275.00	173,565,000
イオンディライト	13,700	4,065.00	55,690,500
ナック	7,500	1,003.00	7,522,500
福井コンピュータホールディングス	3,300	3,155.00	10,411,500
ニチイ学館	21,000	1,469.00	30,849,000
ダイセキ	18,600	3,290.00	61,194,000
ステップ	4,000	1,828.00	7,312,000
日鉄住金物産	8,900	6,850.00	60,965,000
泉州電業	3,800	3,540.00	13,452,000
元気寿司	2,900	3,630.00	10,527,000
トラスコ中山	23,800	3,425.00	81,515,000
ヤマダ電機	383,000	630.00	241,290,000
オートバックスセブン	45,400	2,198.00	99,789,200
モリト	9,100	1,029.00	9,363,900
アークランドサカモト	19,400	1,880.00	36,472,000
ニトリホールディングス	45,300	16,600.00	751,980,000
グルメ杵屋	8,000	1,162.00	9,296,000
愛眼	9,100	628.00	5,714,800
ケーユーホールディングス	6,000	1,197.00	7,182,000
吉野家ホールディングス	37,500	1,926.00	72,225,000
加藤産業	17,900	4,045.00	72,405,500
イノテック	9,900	1,141.00	11,295,900
イエローハット	10,800	3,460.00	37,368,000
松屋フーズ	5,500	4,120.00	22,660,000
JBCホールディングス	9,000	1,223.00	11,007,000
JKホールディングス	11,500	997.00	11,465,500
サガミチェーン	15,300	1,418.00	21,695,400
日伝	9,500	2,324.00	22,078,000
関西スーパーマーケット	8,600	1,251.00	10,758,600
ミロク情報サービス	10,000	2,970.00	29,700,000
北沢産業	9,500	310.00	2,945,000
杉本商事	6,200	1,877.00	11,637,400
因幡電機産業	15,100	5,320.00	80,332,000
王将フードサービス	8,400	5,510.00	46,284,000
プレナス	12,800	2,420.00	30,976,000
ミニストップ	8,500	2,306.00	19,601,000
アークス	21,400	2,522.00	53,970,800
パローホールディングス	26,600	2,658.00	70,702,800
バイテックホールディングス	5,200	1,850.00	9,620,000
ミスミグループ本社	132,600	3,470.00	460,122,000
藤久	900	1,730.00	1,557,000
アルテック	9,800	391.00	3,831,800
ベルク	5,100	6,530.00	33,303,000
大庄	6,100	1,762.00	10,748,200
タキヒヨー	3,800	2,362.00	8,975,600
ファーストリテイリング	19,100	46,800.00	893,880,000
ソフトバンクグループ	515,400	9,120.00	4,700,448,000

蔵王産業	1,900	2,033.00	3,862,700	
スズケン	52,100	4,840.00	252,164,000	
サンドラッグ	48,400	5,300.00	256,520,000	
サックスパー ホールディングス	10,800	1,265.00	13,662,000	
ジェコス	7,900	1,401.00	11,067,900	
ヤマザワ	2,300	1,761.00	4,050,300	
やまや	2,400	3,455.00	8,292,000	
ルネサスイーストン	10,500	744.00	7,812,000	
ペルーナ	28,000	1,358.00	38,024,000	
合計	140,419,630		312,504,179,760	

\*担保として以下の有価証券が差し入れられております。

銘柄	株式数
トヨタ自動車	500,000

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

## 「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

(単位:円)

科 目	注記 番号	平成29年1月11日現在	平成30年1月11日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		1,810,993,822	1,225,455,365
国債証券		322,898,743,100	303,128,208,700
地方債証券		23,972,716,425	22,902,738,657
特殊債券		18,970,399,799	15,780,383,842
社債券		17,116,038,660	16,879,127,400
未収入金		1,722,720,000	1,447,832,100
未収利息		853,274,556	770,154,466
前払費用		16,404,130	8,463,736
流動資産合計		387,361,290,492	362,142,364,266
資産合計		387,361,290,492	362,142,364,266
負債の部			
流動負債			
未払解約金		187,691,000	315,300,000
流動負債合計		187,691,000	315,300,000
負債合計		187,691,000	315,300,000
純資産の部			
元本等			
元本	1	302,351,149,022	282,148,441,520
剰余金			
剰余金又は欠損金( )		84,822,450,470	79,678,622,746
元本等合計		387,173,599,492	361,827,064,266
純資産合計		387,173,599,492	361,827,064,266
負債純資産合計		387,361,290,492	362,142,364,266



## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。
--------------------	--

## （貸借対照表に関する注記）

項目	平成29年1月11日現在	平成30年1月11日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額 同期中追加設定元本額 同期中一部解約元本額	332,334,674,604円 66,369,325,599円 96,352,851,181円	302,351,149,022円 60,393,037,069円 80,595,744,571円
元本の内訳 ファンド名		
D I A M国内債券パッシブ・ファンド	10,854,182,784円	14,044,050,293円
M I T O ラップ型ファンド（安定型）	136,287,516円	137,430,777円
M I T O ラップ型ファンド（中立型）	123,830,945円	112,114,796円
M I T O ラップ型ファンド（積極型）	46,215,676円	34,436,660円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	406,021,206円	583,451,400円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	119,424,698円	159,609,573円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	24,093,768円	25,188,228円
たわらノーロード 国内債券	901,143,539円	2,792,034,873円
たわらノーロード 国内債券<ラップ向け>	755,274円	754,493円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	- 円	19,455,389円
たわらノーロード バランス（堅実型）	- 円	1,243,754円
たわらノーロード バランス（標準型）	- 円	2,399,845円
たわらノーロード バランス（積極型）	- 円	826,692円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（保守型）	- 円	440,066円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（安定型）	- 円	234,451円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（安定成長型）	- 円	164,351円

たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(成長型)	- 円	90,351円
たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(積極型)	- 円	19,472円
D I A M国内債券インデックス ファンド< D C年金>	12,171,985,997円	12,427,315,535円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 1 安定型	4,811,241,049円	5,528,653,854円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 2 安定・成長型	6,822,072,744円	7,985,672,600円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 3 成長型	2,649,526,618円	3,263,681,041円
D I A M D C バランス3 0 インデックスファンド	1,641,032,476円	1,826,494,969円
D I A M D C バランス5 0 インデックスファンド	1,722,626,088円	2,010,449,233円
D I A M D C バランス7 0 インデックスファンド	244,923,243円	309,647,783円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型>	98,797,552円	89,820,576円
マネックス資産設計ファンド< 育成型>	2,195,866,560円	2,234,726,830円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	4,978,002円	2,224,336円
D I A M D C 8 資産バラン スファンド(新興国1 0)	353,017,386円	470,102,235円
D I A M D C 8 資産バラン スファンド(新興国2 0)	250,995,189円	421,003,073円
D I A M D C 8 資産バラン スファンド(新興国3 0)	60,859,020円	99,634,072円
投資のソムリエ	8,918,982,259円	5,412,751,268円
クルーズコントロール	4,082,782,511円	4,127,957,852円
投資のソムリエ< D C年金>	263,430,477円	343,120,269円
D I A M 8 資産バランスマ ンドN< D C年金>	1,121,552,998円	1,785,743,778円
D I A M D C バランス・F (成長型)	114,156,112円	228,300,610円
クルーズコントロール< D C年 金>	1,612,582円	1,441,246円
D I A Mコア資産設計ファンド (堅実型)	12,066,843円	9,543,074円
D I A Mコア資産設計ファンド (積極型)	26,868,545円	21,666,572円
投資のソムリエ< D C年金>リ スク抑制型	113,106,192円	296,996,808円
ダイナミック・ナビゲーション	462,426円	559,152円
リスク抑制世界8 資産バラン スファンド	2,413,062円	4,119,995,045円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2 0 4 5)	- 円	721,386円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2 0 5 5)	- 円	721,391円

リスク抑制世界8資産バランス ファンド(DC)	- 円	1,382,114円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2035)	- 円	708,794円
みずほエマージングボンドオー プン	10,801,911円	- 円
DIAM高金利通貨ファンド	9,608,918円	9,608,918円
DIAMエマージング債券ファ ンド	9,450,010円	9,450,010円
DIAM国内債券パッシブファ ンド(適格機関投資家向け)	31,050,583,696円	22,732,301,633円
DIAMアクティブアローケー ション私募ファンド(適格機関 投資家限定)	720,300,635円	- 円
DIAMワールドバランス25 VA(適格機関投資家限定)	512,582,948円	502,918,166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)	464,509,485円	356,392,042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)	294,451,872円	260,572,513円
DIAM国際分散バランスファ ンド30VA(適格機関投資家 限定)	116,088,208円	82,170,787円
DIAM国際分散バランスファ ンド50VA(適格機関投資家 限定)	324,560,165円	236,417,399円
DIAM国内重視バランスファ ンド30VA(適格機関投資家 限定)	134,546,633円	107,172,904円
DIAM国内重視バランスファ ンド50VA(適格機関投資家 限定)	79,812,989円	71,047,134円
DIAM世界バランスファンド 40VA(適格機関投資家限 定)	3,873,885,819円	107,073,029円
DIAM世界バランスファンド 50VA(適格機関投資家限 定)	1,486,248,373円	190,740,120円
DIAMバランスファンド25 VA(適格機関投資家限定)	7,186,488,246円	6,327,385,858円
DIAMバランスファンド3 7.5VA(適格機関投資家限 定)	3,535,321,999円	3,384,413,398円
DIAMバランスファンド50 VA(適格機関投資家限定)	6,415,378,240円	6,106,252,901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)	751,554,552円	652,541,797円

D I A Mグローバル・アセ ト・バランスV A 2 ( 適格機 関投資家限定)	2,297,736,149円	553,747,291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)	4,381,704,478円	3,945,456,574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)	5,754,159,456円	4,127,295,962円
D I A Mグローバル 私募ファ ンド( 適格機関投資家向け)	812,385,968円	194,752,933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)	5,909,722,696円	322,047,228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)	6,745,903,203円	2,383,950,442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)	89,058,950,692円	88,035,522,422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)	1,234,322,032円	1,178,525,546円
D I A M世界アセットバラン スファンド2 5 V A ( 適格機関投 資家限定)	7,560,187,206円	7,559,824,166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)	28,217,510,574円	28,649,485,500円
D I A Mバランス3 0 V A ( 適 格機関投資家限定)	94,990,409円	8,960,230円
D I A Mバランス5 0 V A ( 適 格機関投資家限定)	2,469,333円	48,915,437円
D I A Mバランス7 0 V A ( 適 格機関投資家限定)	9,097,607円	7,941,011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)	31,637,535,869円	31,857,319,666円
D I A M世界バランス2 5 V A ( 適格機関投資家限定)	562,537,512円	509,422,227円
D I A M国内バランス3 0 V A ( 適格機関投資家限定)	140,361,156円	139,681,767円
D I A Mバランス2 0 V A ( 適 格機関投資家限定)	657,286,245円	513,354,007円
D I A Mバランス4 0 V A ( 適 格機関投資家限定)	453,278円	40,409,042円
D I A Mバランス6 0 V A ( 適 格機関投資家限定)	349,123円	390,500円
計	302,351,149,022円	282,148,441,520円
2 . 受益権の総数	302,351,149,022口	282,148,441,520口



## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成28年1月13日 至 平成29年1月11日	自 平成29年1月12日 至 平成30年1月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成29年1月11日現在	平成30年1月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成29年1月11日現在	平成30年1月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
国債証券	1,960,142,200	117,176,300
地方債証券	126,766,942	147,619,176
特殊債証券	131,484,282	114,681,960
社債証券	123,096,030	133,148,070
合計	1,578,794,946	512,625,506

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(平成28年2月16日から平成29年1月11日まで及び平成29年2月15日から平成30年1月11日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成29年1月11日現在	平成30年1月11日現在
1口当たり純資産額	1.2805円	1.2824円
(1万口当たり純資産額)	(12,805円)	(12,824円)



## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

平成30年1月11日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
国債証券	373回 利付国庫債券(2年)	1,500,000,000	1,503,825,000	
	375回 利付国庫債券(2年)	1,000,000,000	1,002,930,000	
	376回 利付国庫債券(2年)	2,000,000,000	2,006,240,000	
	377回 利付国庫債券(2年)	1,500,000,000	1,504,980,000	
	378回 利付国庫債券(2年)	1,000,000,000	1,003,520,000	
	379回 利付国庫債券(2年)	1,500,000,000	1,505,580,000	
	381回 利付国庫債券(2年)	1,000,000,000	1,004,110,000	
	117回 利付国庫債券(5年)	4,000,000,000	4,015,280,000	
	118回 利付国庫債券(5年)	3,700,000,000	3,716,909,000	
	120回 利付国庫債券(5年)	1,500,000,000	1,508,070,000	
	121回 利付国庫債券(5年)	2,000,000,000	2,007,400,000	
	122回 利付国庫債券(5年)	4,000,000,000	4,016,600,000	
	123回 利付国庫債券(5年)	3,000,000,000	3,014,040,000	
	124回 利付国庫債券(5年)	4,000,000,000	4,019,920,000	
	125回 利付国庫債券(5年)	3,000,000,000	3,016,110,000	
	126回 利付国庫債券(5年)	2,500,000,000	2,514,675,000	
	127回 利付国庫債券(5年)	3,000,000,000	3,018,630,000	
	128回 利付国庫債券(5年)	3,000,000,000	3,019,590,000	
	129回 利付国庫債券(5年)	3,500,000,000	3,523,870,000	
	130回 利付国庫債券(5年)	3,000,000,000	3,021,870,000	
	131回 利付国庫債券(5年)	3,500,000,000	3,527,125,000	
	132回 利付国庫債券(5年)	2,000,000,000	2,016,880,000	
	133回 利付国庫債券(5年)	3,500,000,000	3,531,220,000	
	134回 利付国庫債券(5年)	1,000,000,000	1,009,150,000	
	2回 利付国庫債券(40年)	600,000,000	818,790,000	
	3回 利付国庫債券(40年)	600,000,000	821,244,000	
	4回 利付国庫債券(40年)	800,000,000	1,097,944,000	
	5回 利付国庫債券(40年)	700,000,000	921,725,000	
	6回 利付国庫債券(40年)	700,000,000	902,692,000	
	7回 利付国庫債券(40年)	800,000,000	984,056,000	
	8回 利付国庫債券(40年)	900,000,000	1,022,499,000	
	9回 利付国庫債券(40年)	1,300,000,000	1,061,047,000	
	10回 利付国庫債券(40年)	900,000,000	872,208,000	
	299回 利付国庫債券(10年)	900,000,000	915,093,000	
	301回 利付国庫債券(10年)	2,300,000,000	2,353,268,000	
	303回 利付国庫債券(10年)	1,300,000,000	1,333,241,000	
305回 利付国庫債券(10年)	2,500,000,000	2,568,375,000		
306回 利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,549,545,000		
308回 利付国庫債券(10年)	800,000,000	827,448,000		
309回 利付国庫債券(10年)	1,000,000,000	1,029,450,000		

310回	利付国庫債券(10年)	2,300,000,000	2,368,287,000	
312回	利付国庫債券(10年)	2,200,000,000	2,284,326,000	
313回	利付国庫債券(10年)	3,000,000,000	3,133,770,000	
315回	利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,567,320,000	
317回	利付国庫債券(10年)	1,000,000,000	1,044,310,000	
318回	利付国庫債券(10年)	1,000,000,000	1,040,620,000	
319回	利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,570,680,000	
320回	利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,564,770,000	
321回	利付国庫債券(10年)	2,500,000,000	2,614,200,000	
324回	利付国庫債券(10年)	2,000,000,000	2,079,120,000	
325回	利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,562,355,000	
326回	利付国庫債券(10年)	500,000,000	519,425,000	
328回	利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,552,995,000	
329回	利付国庫債券(10年)	1,800,000,000	1,885,824,000	
330回	利付国庫債券(10年)	1,200,000,000	1,259,160,000	
332回	利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,558,890,000	
333回	利付国庫債券(10年)	2,000,000,000	2,081,160,000	
334回	利付国庫債券(10年)	2,100,000,000	2,188,011,000	
335回	利付国庫債券(10年)	2,000,000,000	2,072,320,000	
336回	利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,555,725,000	
337回	利付国庫債券(10年)	1,300,000,000	1,330,238,000	
338回	利付国庫債券(10年)	2,000,000,000	2,061,100,000	
339回	利付国庫債券(10年)	1,800,000,000	1,854,846,000	
340回	利付国庫債券(10年)	2,500,000,000	2,576,775,000	
341回	利付国庫債券(10年)	3,500,000,000	3,583,230,000	
342回	利付国庫債券(10年)	3,000,000,000	3,022,050,000	
343回	利付国庫債券(10年)	3,000,000,000	3,020,190,000	
344回	利付国庫債券(10年)	3,500,000,000	3,521,175,000	
345回	利付国庫債券(10年)	3,500,000,000	3,518,655,000	
346回	利付国庫債券(10年)	3,000,000,000	3,015,060,000	
347回	利付国庫債券(10年)	3,500,000,000	3,516,415,000	
348回	利付国庫債券(10年)	3,500,000,000	3,515,155,000	
1回	利付国庫債券(30年)	100,000,000	130,567,000	
2回	利付国庫債券(30年)	100,000,000	126,661,000	
3回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	251,650,000	
4回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	268,136,000	
5回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	251,654,000	
6回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	257,892,000	
7回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	384,885,000	
8回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	243,000,000	
11回	利付国庫債券(30年)	400,000,000	481,152,000	
12回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	379,161,000	
13回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	374,964,000	
14回	利付国庫債券(30年)	500,000,000	656,910,000	
15回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	266,382,000	
16回	利付国庫債券(30年)	400,000,000	533,848,000	
17回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	264,258,000	
18回	利付国庫債券(30年)	820,000,000	1,070,387,000	
19回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	261,482,000	
20回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	403,023,000	

2 1 回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	393,054,000	
2 2 回	利付国庫債券(30年)	470,000,000	632,939,600	
2 3 回	利付国庫債券(30年)	600,000,000	808,608,000	
2 4 回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	405,270,000	
2 5 回	利付国庫債券(30年)	400,000,000	526,320,000	
2 6 回	利付国庫債券(30年)	700,000,000	934,353,000	
2 7 回	利付国庫債券(30年)	700,000,000	949,130,000	
2 8 回	利付国庫債券(30年)	900,000,000	1,223,154,000	
2 9 回	利付国庫債券(30年)	900,000,000	1,210,266,000	
3 0 回	利付国庫債券(30年)	900,000,000	1,196,451,000	
3 1 回	利付国庫債券(30年)	900,000,000	1,181,916,000	
3 2 回	利付国庫債券(30年)	1,100,000,000	1,471,734,000	
3 3 回	利付国庫債券(30年)	1,300,000,000	1,663,324,000	
3 4 回	利付国庫債券(30年)	1,200,000,000	1,589,028,000	
3 5 回	利付国庫債券(30年)	1,300,000,000	1,668,693,000	
3 6 回	利付国庫債券(30年)	1,300,000,000	1,671,891,000	
3 7 回	利付国庫債券(30年)	1,400,000,000	1,772,176,000	
3 8 回	利付国庫債券(30年)	900,000,000	1,120,284,000	
3 9 回	利付国庫債券(30年)	800,000,000	1,014,880,000	
4 0 回	利付国庫債券(30年)	800,000,000	996,968,000	
4 1 回	利付国庫債券(30年)	800,000,000	978,784,000	
4 2 回	利付国庫債券(30年)	800,000,000	979,136,000	
4 3 回	利付国庫債券(30年)	800,000,000	979,504,000	
4 4 回	利付国庫債券(30年)	800,000,000	979,840,000	
4 5 回	利付国庫債券(30年)	1,000,000,000	1,177,260,000	
4 6 回	利付国庫債券(30年)	900,000,000	1,059,552,000	
4 7 回	利付国庫債券(30年)	1,000,000,000	1,201,550,000	
4 8 回	利付国庫債券(30年)	1,100,000,000	1,266,782,000	
4 9 回	利付国庫債券(30年)	1,100,000,000	1,266,562,000	
5 0 回	利付国庫債券(30年)	1,000,000,000	1,000,000,000	
5 1 回	利付国庫債券(30年)	1,100,000,000	959,277,000	
5 2 回	利付国庫債券(30年)	1,100,000,000	1,012,385,000	
5 3 回	利付国庫債券(30年)	820,000,000	774,194,800	
5 4 回	利付国庫債券(30年)	1,100,000,000	1,093,532,000	
5 5 回	利付国庫債券(30年)	800,000,000	794,320,000	
5 6 回	利付国庫債券(30年)	900,000,000	892,503,000	
5 7 回	利付国庫債券(30年)	150,000,000	148,564,500	
4 2 回	利付国庫債券(20年)	800,000,000	825,704,000	
4 3 回	利付国庫債券(20年)	860,000,000	903,705,200	
4 5 回	利付国庫債券(20年)	900,000,000	949,356,000	
4 6 回	利付国庫債券(20年)	500,000,000	528,235,000	
4 7 回	利付国庫債券(20年)	950,000,000	1,009,166,000	
4 8 回	利付国庫債券(20年)	500,000,000	538,455,000	
5 0 回	利付国庫債券(20年)	780,000,000	830,169,600	
5 1 回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	643,476,000	
5 2 回	利付国庫債券(20年)	550,000,000	594,605,000	
5 4 回	利付国庫債券(20年)	700,000,000	763,196,000	
5 5 回	利付国庫債券(20年)	810,000,000	880,996,500	
5 7 回	利付国庫債券(20年)	1,130,000,000	1,229,677,300	
5 8 回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	655,950,000	

60回	利付国庫債券(20年)	590,000,000	633,365,000	
61回	利付国庫債券(20年)	800,000,000	844,896,000	
62回	利付国庫債券(20年)	800,000,000	838,144,000	
64回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	667,206,000	
65回	利付国庫債券(20年)	1,100,000,000	1,227,908,000	
67回	利付国庫債券(20年)	1,900,000,000	2,129,501,000	
70回	利付国庫債券(20年)	1,250,000,000	1,447,000,000	
72回	利付国庫債券(20年)	1,250,000,000	1,429,150,000	
73回	利付国庫債券(20年)	790,000,000	901,658,600	
75回	利付国庫債券(20年)	870,000,000	1,002,527,100	
78回	利付国庫債券(20年)	890,000,000	1,016,344,400	
81回	利付国庫債券(20年)	1,030,000,000	1,188,187,400	
83回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,632,456,000	
85回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,639,008,000	
88回	利付国庫債券(20年)	1,200,000,000	1,430,184,000	
90回	利付国庫債券(20年)	1,200,000,000	1,425,420,000	
92回	利付国庫債券(20年)	1,300,000,000	1,538,251,000	
93回	利付国庫債券(20年)	700,000,000	825,419,000	
94回	利付国庫債券(20年)	800,000,000	950,656,000	
95回	利付国庫債券(20年)	1,200,000,000	1,454,016,000	
97回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,689,940,000	
99回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,681,876,000	
100回	利付国庫債券(20年)	1,300,000,000	1,578,954,000	
102回	利付国庫債券(20年)	1,060,000,000	1,313,626,200	
105回	利付国庫債券(20年)	1,300,000,000	1,575,561,000	
107回	利付国庫債券(20年)	1,500,000,000	1,823,325,000	
109回	利付国庫債券(20年)	1,600,000,000	1,915,104,000	
111回	利付国庫債券(20年)	1,170,000,000	1,443,510,900	
113回	利付国庫債券(20年)	1,500,000,000	1,837,845,000	
114回	利付国庫債券(20年)	1,500,000,000	1,842,780,000	
116回	利付国庫債券(20年)	1,600,000,000	1,989,808,000	
118回	利付国庫債券(20年)	1,000,000,000	1,222,710,000	
119回	利付国庫債券(20年)	900,000,000	1,078,533,000	
121回	利付国庫債券(20年)	1,500,000,000	1,818,690,000	
123回	利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	2,108,391,000	
125回	利付国庫債券(20年)	1,600,000,000	2,009,488,000	
128回	利付国庫債券(20年)	700,000,000	853,370,000	
129回	利付国庫債券(20年)	700,000,000	844,242,000	
130回	利付国庫債券(20年)	1,500,000,000	1,811,115,000	
132回	利付国庫債券(20年)	1,600,000,000	1,913,552,000	
134回	利付国庫債券(20年)	900,000,000	1,090,224,000	
135回	利付国庫債券(20年)	800,000,000	957,488,000	
137回	利付国庫債券(20年)	1,420,000,000	1,701,969,400	
140回	利付国庫債券(20年)	1,600,000,000	1,920,336,000	
141回	利付国庫債券(20年)	1,900,000,000	2,281,710,000	
142回	利付国庫債券(20年)	250,000,000	303,800,000	
143回	利付国庫債券(20年)	2,100,000,000	2,492,616,000	
144回	利付国庫債券(20年)	260,000,000	304,842,200	
145回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,684,032,000	
146回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,685,936,000	

147回	利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	2,022,133,000	
148回	利付国庫債券(20年)	1,300,000,000	1,525,355,000	
149回	利付国庫債券(20年)	1,900,000,000	2,230,752,000	
150回	利付国庫債券(20年)	1,500,000,000	1,737,255,000	
151回	利付国庫債券(20年)	1,800,000,000	2,026,692,000	
152回	利付国庫債券(20年)	1,300,000,000	1,462,435,000	
153回	利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	1,938,204,000	
154回	利付国庫債券(20年)	1,500,000,000	1,684,230,000	
155回	利付国庫債券(20年)	1,600,000,000	1,741,648,000	
156回	利付国庫債券(20年)	1,500,000,000	1,474,995,000	
157回	利付国庫債券(20年)	1,300,000,000	1,229,007,000	
158回	利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	1,692,758,000	
159回	利付国庫債券(20年)	1,500,000,000	1,516,755,000	
160回	利付国庫債券(20年)	1,300,000,000	1,334,970,000	
161回	利付国庫債券(20年)	1,600,000,000	1,609,792,000	
162回	利付国庫債券(20年)	1,200,000,000	1,205,292,000	
163回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	601,068,000	
国債証券 合計		277,370,000,000	303,128,208,700	
地方債証券				
680回	東京都公募公債	200,000,000	205,956,000	
685回	東京都公募公債	500,000,000	513,445,000	
688回	東京都公募公債	200,000,000	204,910,000	
697回	東京都公募公債	500,000,000	518,605,000	
701回	東京都公募公債	700,000,000	724,843,000	
708回	東京都公募公債	500,000,000	518,825,000	
720回	東京都公募公債	300,000,000	313,338,000	
726回	東京都公募公債	400,000,000	415,612,000	
5回	東京都公募公債 20年	100,000,000	114,369,000	
9回	東京都公募公債 20年	200,000,000	238,238,000	
10回	東京都公募公債 20年	300,000,000	355,896,000	
21年度6回	北海道公募公債	200,000,000	205,108,000	
22年度12回	北海道公募公債	200,000,000	207,668,000	
166回	神奈川県公募公債	300,000,000	306,741,000	
194回	神奈川県公募公債	300,000,000	310,875,000	
208回	神奈川県公募公債	300,000,000	308,850,000	
336回	大阪府公募公債	200,000,000	206,346,000	
345回	大阪府公募公債	300,000,000	310,887,000	
356回	大阪府公募公債	200,000,000	207,976,000	
364回	大阪府公募公債	300,000,000	310,284,000	
374回	大阪府公募公債	300,000,000	314,286,000	
26年度11回	京都府公募公債	350,000,000	358,939,000	
26年度17回	兵庫県公募公債	200,000,000	204,784,000	
1回	兵庫県公募公債(12年)	300,000,000	319,233,000	
21年度5回	静岡県公募公債	197,000,000	201,594,040	
22年度8回	静岡県公募公債	200,000,000	205,412,000	
23年度9回	静岡県公募公債	200,000,000	207,768,000	
1回	静岡県公募公債 20年	100,000,000	115,467,000	
22年度6回	愛知県公募公債	200,000,000	205,870,000	
23年度20回	愛知県公募公債	500,000,000	521,690,000	
25年度4回	愛知県公募公債	300,000,000	312,786,000	
22年度1回	広島県公募公債	200,000,000	206,378,000	

21年度4回	埼玉県公募公債	200,000,000	204,416,000		
23年度2回	埼玉県公募公債	200,000,000	207,838,000		
26年度5回	埼玉県公募公債	400,000,000	413,420,000		
21年度3回	福岡県公募公債	200,000,000	204,936,000		
25年度11回	福岡県公募公債	200,000,000	207,420,000		
21年度6回	千葉県公募公債	200,000,000	204,700,000		
24年度7回	千葉県公募公債	300,000,000	310,131,000		
25年度5回	千葉県公募公債	200,000,000	208,676,000		
80回	共同発行市場公募地方債	200,000,000	205,650,000		
94回	共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,688,000		
99回	共同発行市場公募地方債	700,000,000	727,517,000		
106回	共同発行市場公募地方債	300,000,000	311,160,000		
109回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	521,420,000		
111回	共同発行市場公募地方債	700,000,000	726,096,000		
119回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	518,885,000		
121回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	513,480,000		
126回	共同発行市場公募地方債	793,900,000	827,267,617		
127回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	517,420,000		
128回	共同発行市場公募地方債	300,000,000	310,161,000		
137回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	515,470,000		
139回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	514,785,000		
142回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	508,270,000		
144回	共同発行市場公募地方債	400,000,000	410,272,000		
146回	共同発行市場公募地方債	400,000,000	412,528,000		
148回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	515,200,000		
166回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	499,335,000		
488回	名古屋市公募公債 10年	450,000,000	464,886,000		
4回	京都市公募公債 20年	100,000,000	119,968,000		
22年度3回	横浜市公募公債	200,000,000	206,132,000		
22年度5回	横浜市公募公債	200,000,000	207,222,000		
23年度4回	横浜市公募公債	450,000,000	467,316,000		
25年度2回	横浜市公募公債	400,000,000	418,164,000		
25年度4回	札幌市公募公債	200,000,000	208,020,000		
2回	川崎市公募公債 15年	100,000,000	103,920,000		
21年度2回	北九州市公募公債	200,000,000	205,190,000		
23年度1回	千葉市公募公債	200,000,000	208,800,000		
地方債証券 合計		22,040,900,000	22,902,738,657		
特殊債券	48回	高速道路機構債	700,000,000	714,161,000	
	96回	高速道路機構債	700,000,000	724,262,000	
	116回	高速道路機構債	100,000,000	103,518,000	
	9回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	106,203,000	
	18回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	324,207,000	
	78回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	700,000,000	712,999,000	
	82回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	102,234,000	
	89回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	306,855,000	

149回政保日本高速道路保有・債務返済機構	400,000,000	415,776,000	
180回政保日本高速道路保有・債務返済機構	1,000,000,000	1,036,150,000	
189回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	513,965,000	
193回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	523,815,000	
195回政保日本高速道路保有・債務返済機構	330,000,000	346,394,400	
241回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	513,795,000	
309回政保日本高速道路保有・債務返済機構	800,000,000	800,000,000	
8回 政保地方公営企業金融機構債券	651,000,000	664,586,370	
3回 政保地方公共団体金融機構債券	101,000,000	103,464,400	
5回 地方公共団体金融機構債券	500,000,000	512,485,000	
8回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	308,094,000	
10回 政保地方公共団体金融機構債券	500,000,000	514,465,000	
15回 政保地方公共団体金融機構債券	200,000,000	205,362,000	
20回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	311,217,000	
24回 地方公共団体金融機構債券	300,000,000	311,967,000	
36回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	311,751,000	
44回 政保地方公共団体金融機構債券	400,000,000	416,652,000	
50回 政保地方公共団体金融機構債券	500,000,000	524,630,000	
56回 政保地方公共団体金融機構債券	542,000,000	565,349,360	
64回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	309,849,000	
37回 住宅金融支援機構債券	300,000,000	307,074,000	
6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	48,990,000	51,956,344	
8回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	34,466,000	36,527,066	
9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	51,606,000	54,714,745	
2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	54,354,000	57,993,000	
13回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	21,622,000	22,413,148	
14回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	109,360,000	112,708,603	
4回貸付債権担保住宅金融公庫債券	32,379,000	32,719,303	
43回貸付債権担保住宅金融公庫債券	18,465,000	19,665,225	
44回貸付債権担保住宅金融公庫債券	69,724,000	74,078,263	
51回貸付債権担保住宅金融公庫債券	52,044,000	55,109,912	
1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,240,000	95,104,838	
29回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	181,405,000	194,593,143	
36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	320,536,000	340,104,722	
い第769号 利付商工債	200,000,000	200,436,000	
い第779号 利付商工債	200,000,000	200,478,000	
293回 利附信金中金債	400,000,000	401,052,000	
302回 利附信金中金債	300,000,000	300,840,000	
325回 利附信金中金債	400,000,000	399,204,000	
55回 鉄道建設運輸施設債	500,000,000	519,405,000	

特殊債券 合計		15,309,191,000	15,780,383,842	
社債券	337回 東京交通債	200,000,000	213,754,000	
	27回 ラボバンク・ネダーランド円貨社債	200,000,000	200,996,000	
	22回 中日本高速道路債券	300,000,000	308,220,000	
	7回 キリンホールディングス社債	100,000,000	102,758,000	
	9回 日本たばこ産業社債	200,000,000	200,610,000	
	41回 住友化学社債	100,000,000	102,630,000	
	19回 三菱ケミカルホールディングス社債	100,000,000	101,272,000	
	6回 JXホールディングス社債	100,000,000	104,547,000	
	8回 プリヂストン社債	200,000,000	200,550,000	
	23回 ジェイ エフ イー ホールディングス社債	100,000,000	99,570,000	
	30回 豊田自動織機社債	200,000,000	199,674,000	
	12回 パナソニック社債	200,000,000	201,132,000	
	13回 パナソニック社債	100,000,000	101,464,000	
	56回 日産自動車社債	100,000,000	100,798,000	
	14回 トヨタ自動車社債	200,000,000	208,366,000	
	16回 トヨタ自動車社債	200,000,000	205,498,000	
	94回 丸紅社債	100,000,000	104,058,000	
	45回 住友商事社債	100,000,000	103,557,000	
	47回 住友商事社債	100,000,000	103,162,000	
	48回 クレディセゾン社債	100,000,000	103,416,000	
	7回 みずほコーポレート銀行劣後社債	100,000,000	103,216,000	
	57回 東京三菱銀行社債	200,000,000	220,164,000	
	7回 東京三菱銀行劣後社債	200,000,000	207,444,000	
	25回 三菱東京UFJ銀行劣後社債	200,000,000	206,258,000	
	28回 三菱東京UFJ銀行劣後社債	200,000,000	208,176,000	
	32回 三菱東京UFJ銀行劣後社債	300,000,000	313,569,000	
	4回 りそな銀行劣後社債	100,000,000	103,660,000	
	6回 りそな銀行劣後社債	100,000,000	103,992,000	
	7回 三菱UFJ信託銀行劣後債	200,000,000	206,646,000	
	9回 三菱UFJ信託銀行劣後債	100,000,000	104,565,000	
	12回 住友信託銀行劣後債	100,000,000	103,271,000	
	10回 三井住友信託銀行社債	200,000,000	204,484,000	
	10回 セブン銀行社債	100,000,000	103,213,000	
	20回 三井住友銀行劣後社債	200,000,000	206,190,000	
	22回 三井住友銀行劣後社債	200,000,000	206,628,000	
	23回 三井住友銀行劣後社債	400,000,000	416,424,000	
	14回 みずほ銀行劣後特約付社債	200,000,000	206,672,000	
	15回 トヨタファイナンス社債	200,000,000	208,654,000	
	47回 日立キャピタル社債	200,000,000	205,834,000	
	164回 オリックス社債	100,000,000	101,531,000	
	14回 大和証券グループ本社社債	100,000,000	102,492,000	
	26回 野村ホールディングス社債	100,000,000	103,685,000	
	42回 野村ホールディングス社債	200,000,000	205,032,000	
	46回 野村ホールディングス社債	200,000,000	200,774,000	
	38回 三井不動産社債	200,000,000	205,876,000	
	72回 三菱地所社債	100,000,000	113,246,000	



96回	三菱地所社債	200,000,000	204,476,000	
87回	住友不動産社債	100,000,000	101,346,000	
15回	東日本旅客鉄道社債	300,000,000	320,526,000	
19回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	109,308,000	
21回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	108,988,000	
39回	東日本旅客鉄道社債	300,000,000	340,914,000	
42回	東日本旅客鉄道社債	200,000,000	228,912,000	
9回	西日本旅客鉄道社債	200,000,000	218,282,000	
10回	西日本旅客鉄道社債	300,000,000	332,265,000	
5回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	105,251,000	
6回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	109,371,000	
11回	東海旅客鉄道社債	300,000,000	315,249,000	
13回	東海旅客鉄道社債	200,000,000	222,018,000	
14回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	112,556,000	
15回	東海旅客鉄道社債	200,000,000	205,098,000	
4回	東京地下鉄社債	120,000,000	141,342,000	
60回	日本電信電話社債	300,000,000	310,164,000	
496回	中部電力社債	500,000,000	514,940,000	
518回	中部電力社債	200,000,000	199,800,000	
492回	関西電力社債	200,000,000	201,324,000	
493回	関西電力社債	200,000,000	201,456,000	
377回	中国電力社債	400,000,000	419,416,000	
379回	中国電力社債	300,000,000	304,899,000	
260回	北陸電力社債	100,000,000	105,327,000	
301回	北陸電力社債	100,000,000	104,847,000	
307回	北陸電力社債	100,000,000	105,613,000	
471回	東北電力社債	400,000,000	420,672,000	
473回	東北電力社債	300,000,000	304,623,000	
253回	四国電力社債	200,000,000	208,450,000	
423回	九州電力社債	200,000,000	203,026,000	
424回	九州電力社債	200,000,000	210,880,000	
426回	九州電力社債	400,000,000	418,104,000	
320回	北海道電力社債	200,000,000	202,936,000	
321回	北海道電力社債	161,000,000	166,860,400	
340回	北海道電力社債	300,000,000	300,537,000	
13回	電源開発社債	200,000,000	224,764,000	
38回	電源開発社債	300,000,000	312,303,000	
23回	東京瓦斯社債	300,000,000	314,247,000	
18回	大阪ガス社債	100,000,000	106,628,000	
27回	NTTデータ社債	100,000,000	103,681,000	
社債券 合計		16,181,000,000	16,879,127,400	
合計		330,901,091,000	358,690,458,599	

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 「J-REITインデックスファンド・マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成29年1月11日現在	平成30年1月11日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		416,711,515	957,714,377
投資証券		29,785,016,500	33,647,153,300
派生商品評価勘定		-	14,948,352
未収配当金		244,430,214	323,661,804
差入委託証拠金		-	6,500,352
流動資産合計		30,446,158,229	34,949,978,185
資産合計		30,446,158,229	34,949,978,185
負債の部			
流動負債			
前受金		-	13,412,352
未払金		346,446,495	673,826,209
未払解約金		10,447,000	28,461,800
流動負債合計		356,893,495	715,700,361
負債合計		356,893,495	715,700,361
純資産の部			
元本等			
元本	1	16,468,770,229	19,626,564,592
剰余金			
剰余金又は欠損金( )		13,620,494,505	14,607,713,232
元本等合計		30,089,264,734	34,234,277,824
純資産合計		30,089,264,734	34,234,277,824
負債純資産合計		30,446,158,229	34,949,978,185

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1 . 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2 . デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3 . 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

## （貸借対照表に関する注記）

項目	平成29年1月11日現在	平成30年1月11日現在
1 . 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	15,337,732,833円	16,468,770,229円
同期中追加設定元本額	12,657,176,222円	13,353,736,969円
同期中一部解約元本額	11,526,138,826円	10,195,942,606円
元本の内訳		
ファンド名		
MITO ラップ型ファンド（安定型）	557,314円	361,083円
MITO ラップ型ファンド（中立型）	1,611,236円	912,903円
MITO ラップ型ファンド（積極型）	3,753,394円	2,407,898円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	1,659,417円	1,532,660円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	1,554,325円	1,298,870円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	1,957,290円	1,761,249円
たわらノーロード 国内リート	477,367,537円	1,064,897,610円
たわらノーロード 国内リート<ラップ向け>	58,995,435円	292,610,032円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	- 円	14,983,358円
たわらノーロード バランス（堅実型）	- 円	51,544円
たわらノーロード バランス（標準型）	- 円	1,073,973円
たわらノーロード バランス（積極型）	- 円	3,189,831円

たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(安定型)	- 円	35,677円
たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(安定成長 型)	- 円	53,803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)	- 円	64,927円
たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(積極型)	- 円	77,218円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型>	14,829,308円	13,914,114円
マネックス資産設計ファンド< 育成型>	335,652,444円	343,011,189円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	3,962,722円	3,270,978円
DIAM DC 8資産 balan スファンド(新興国10)	13,096,570円	18,476,325円
DIAM DC 8資産 balan スファンド(新興国20)	33,814,651円	60,982,941円
DIAM DC 8資産 balan スファンド(新興国30)	76,095,479円	134,732,676円
投資のソムリエ	1,043,453,876円	1,515,538,797円
投資のソムリエ<DC年金>	30,812,192円	96,091,039円
DIAM 8資産 balan スファンドN<DC年金>	40,650,681円	70,215,123円
投資のソムリエ<DC年金>リ スク抑制型	8,656,798円	55,236,473円
ダイナミック・ナビゲーシ ョン	164,273円	207,978円
リスク抑制世界8資産 balan スファンド	188,090円	764,041,600円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤ-2045)	- 円	237,910円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤ-2055)	- 円	237,910円
リスク抑制世界8資産 balan スファンド(DC)	- 円	256,978円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤ-2035)	- 円	234,001円
Jリートインデックスファンド (DC)	- 円	6,728,716円
DIAM J-REITイン デックス私募ファンド2012 10(適格機関投資家限定)	977,920,018円	- 円
DIAM J-REITイン デックス私募ファンド2012 12(適格機関投資家限定)	1,052,894,526円	94,383,939円
DIAM J-REITイン デックス私募ファンド2014 01(適格機関投資家限定)	1,888,734,682円	1,819,511,382円
DIAM J-REITイン デックスファンド(適格機関投 資家向け)	8,041,376,195円	9,605,103,606円

	D I A Mグローバル 私募ファンド(適格機関投資家向け)	57,813,260円	14,402,370円
	D I A Mグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンド(適格機関投資家限定)	909,317,488円	1,779,304,967円
	D I A Mグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンドII(適格機関投資家限定)	1,354,403,360円	1,845,130,944円
	D I A M リスクコントロールJ-REITファンド(適格機関投資家限定)	37,477,668円	- 円
	計	16,468,770,229円	19,626,564,592円
2 .	受益権の総数	16,468,770,229口	19,626,564,592口

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成28年1月13日 至 平成29年1月11日	自 平成29年1月12日 至 平成30年1月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、不動産投信指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、不動産投資信託証券の価格の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成29年1月11日現在	平成30年1月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 該当事項はありませぬ。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	平成29年1月11日現在	平成30年1月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
投資証券	137,177,093	472,451,364
合計	137,177,093	472,451,364

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成28年6月7日から平成29年1月11日まで及び平成29年6月7日から平成30年1月11日まで）に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

## 不動産投信関連

種類	平成29年1月11日 現在				平成30年1月11日 現在			
	契約額等 （円）		時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）		時価 （円）	評価損益 （円）
		うち 1年超				うち 1年超		
市場取引								
不動産投信指数 先物取引								
買 建	-	-	-	-	414,592,000	-	429,568,000	14,976,000
合計	-	-	-	-	414,592,000	-	429,568,000	14,976,000

(注) 1. 時価の算定方法

不動産投信指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成29年1月11日現在	平成30年1月11日現在
1口当たり純資産額	1.8270円	1.7443円
(1万口当たり純資産額)	(18,270円)	(17,443円)



## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

平成30年1月11日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
投資証券	GLP投資法人	7,638	961,624,200	
	MCUBS MidCity投資法人	4,415	347,019,000	
	Oneリート投資法人	477	121,110,300	
	いちごオフィスリート投資法人	3,378	270,240,000	
	いちごホテルリート投資法人	690	87,354,000	
	さくら総合リート投資法人	1,049	102,277,500	
	アクティブ・プロパティーズ投資法人	1,974	942,585,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人	4,039	1,136,170,700	
	イオンリート投資法人	4,143	500,888,700	
	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	2,417	269,495,500	
	インヴィンシブル投資法人	11,966	583,940,800	
	オリックス不動産投資法人	8,417	1,347,561,700	
	グローバル・ワン不動産投資法人	700	283,150,000	
	ケネディクス・オフィス投資法人	1,275	841,500,000	
	ケネディクス・レジデンシャル投資法人	990	318,780,000	
	ケネディクス商業リート投資法人	1,586	387,935,600	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	1,591	386,135,700	
	サムティ・レジデンシャル投資法人	758	70,418,200	
	ジャパン・シニアリビング投資法人	240	38,328,000	
	ジャパン・ホテル・リート投資法人	12,592	997,286,400	
	ジャパンエクセレント投資法人	3,907	521,584,500	
	ジャパンリアルエステイト投資法人	4,124	2,214,588,000	
	スターアジア不動産投資法人	906	106,364,400	
	スターツプロシード投資法人	687	115,484,700	
	トーセイ・リート投資法人	701	77,039,900	
	ヒューリックリート投資法人	2,963	488,006,100	
	フロンティア不動産投資法人	1,484	657,412,000	
	プレミア投資法人	3,941	439,815,600	
	ヘルスケア&メディカル投資法人	538	58,803,400	
	マリモ地方創生リート投資法人	244	27,450,000	
	ユナイテッド・アーバン投資法人	9,622	1,598,214,200	
	ラサールロジポート投資法人	3,291	382,085,100	
	阪急リート投資法人	1,788	235,658,400	
	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	706	258,043,000	
三菱地所物流リート投資法人	404	110,736,400		
産業ファンド投資法人	1,185	590,722,500		
森トラスト・ホテルリート投資法人	945	136,930,500		
森トラスト総合リート投資法人	3,118	502,309,800		
森ヒルズリート投資法人	4,687	654,305,200		

星野リゾート・リート投資法人	662	371,382,000	
積水ハウス・リート投資法人	2,737	366,484,300	
積水ハウス・レジデンシャル投資法人	3,308	379,758,400	
大江戸温泉リート投資法人	732	63,684,000	
大和ハウスリート投資法人	4,487	1,200,721,200	
大和証券オフィス投資法人	941	563,659,000	
投資法人みらい	555	101,176,500	
東急リアル・エステート投資法人	2,925	417,105,000	
日本アコモデーションファンド投資法人	1,450	684,400,000	
日本ビルファンド投資法人	4,225	2,378,675,000	
日本プライムリアルティ投資法人	2,754	1,012,095,000	
日本プロロジスリート投資法人	5,487	1,327,854,000	
日本ヘルスケア投資法人	212	36,421,600	
日本リート投資法人	1,172	390,862,000	
日本リテールファンド投資法人	8,393	1,743,226,100	
日本ロジスティクスファンド投資法人	2,906	614,037,800	
日本賃貸住宅投資法人	4,907	406,790,300	
福岡リート投資法人	2,117	376,190,900	
平和不動産リート投資法人	2,717	259,745,200	
野村不動産マスターファンド投資法人	12,516	1,783,530,000	
投資証券 合計	180,779	33,647,153,300	
合計	180,779	33,647,153,300	

投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

## 「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

(単位:円)

科 目	注記 番号	平成29年1月11日現在	平成30年1月11日現在
資産の部			
流動資産			
預金		4,450,881,435	5,822,987,447
コール・ローン		136,302,820	726,764,720
株式		263,044,401,726	292,877,407,767
投資信託受益証券		833,914,594	801,364,202
投資証券		6,182,633,954	6,273,413,009
派生商品評価勘定		29,766,443	175,170,660
未収入金		2,788,032	2,663,502
未収配当金		330,630,621	323,899,180
差入委託証拠金		1,428,687,077	2,025,207,755
流動資産合計		276,440,006,702	309,028,878,242
資産合計		276,440,006,702	309,028,878,242
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		880,817	3,689,542
未払解約金		229,401,000	331,777,000
流動負債合計		230,281,817	335,466,542
負債合計		230,281,817	335,466,542
純資産の部			
元本等			
元本	1	92,727,414,724	87,104,816,912
剰余金			
剰余金又は欠損金( )		183,482,310,161	221,588,594,788
元本等合計		276,209,724,885	308,693,411,700
純資産合計		276,209,724,885	308,693,411,700
負債純資産合計		276,440,006,702	309,028,878,242

## 注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

## (貸借対照表に関する注記)

項目	平成29年1月11日現在	平成30年1月11日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	97,735,137,391円	92,727,414,724円
同期中追加設定元本額	21,141,186,664円	20,058,442,109円
同期中一部解約元本額	26,148,909,331円	25,681,039,921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	1,946,959,402円	1,822,423,973円
M I T O ラップ型ファンド(安定型)	4,434,740円	3,191,830円
M I T O ラップ型ファンド(中立型)	12,888,567円	7,279,030円
M I T O ラップ型ファンド(積極型)	29,749,544円	18,898,552円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	13,210,663円	13,544,215円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	12,430,317円	10,359,460円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	15,508,554円	13,818,783円
たわらノーロード 先進国株式	2,079,682,896円	5,502,154,955円
たわらノーロード 先進国株式<ラップ向け>	425,695円	424,744円
たわらノーロード 先進国株式<為替ヘッジあり>	61,132,652円	463,445,507円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	- 円	7,231,042円
たわらノーロード バランス(堅実型)	- 円	150,198円
たわらノーロード バランス(標準型)	- 円	1,404,580円
たわらノーロード バランス(積極型)	- 円	4,751,015円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(保守型)	- 円	14,227円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定型)	- 円	57,189円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定成長型)	- 円	80,559円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(成長型)	- 円	103,944円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(積極型)	- 円	127,326円
D I A M外国株式インデックスファンド<DC年金>	35,568,884,895円	36,937,428,806円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 1 安定型	179,962,215円	157,435,724円

DIAMバランス・ファンド< DC年金> 2 安定・成長型	953,771,814円	857,026,223円
DIAMバランス・ファンド< DC年金> 3 成長型	1,115,778,433円	1,043,554,352円
DIAM DC バランス30 インデックスファンド	153,484,704円	130,707,011円
DIAM DC バランス50 インデックスファンド	427,386,666円	385,930,973円
DIAM DC バランス70 インデックスファンド	346,239,329円	330,441,705円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型>	42,363,606円	33,185,995円
マネックス資産設計ファンド< 育成型>	938,046,218円	817,871,261円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	228,756,848円	187,072,304円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	26,508,121円	29,811,822円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	51,983,023円	73,885,125円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	104,518,603円	145,725,386円
投資のソムリエ	826,420,611円	970,425,131円
クルーズコントロール	827,877,963円	790,811,166円
投資のソムリエ< DC年金>	24,426,190円	61,679,304円
DIAM 8資産バランスファンドN< DC年金>	87,168,309円	114,876,755円
DIAM DC バランス・F (成長型)	42,666,319円	70,873,790円
クルーズコントロール< DC年金>	325,530円	275,806円
DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)	6,117,616円	3,642,956円
DIAMコア資産設計ファンド(積極型)	13,598,018円	8,318,622円
投資のソムリエ< DC年金> リスク抑制型	2,348,013円	27,153,058円
ダイナミック・ナビゲーション	1,595,132円	1,144,316円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	49,988円	373,981,024円
ワールドアセットバランス(基本コース)	- 円	588,185,085円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	- 円	2,227,897,121円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	- 円	517,823円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	- 円	517,846円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	- 円	126,045円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	- 円	365,458円

D I A M外国株式インデックス ファンドV A (適格機関投資家 専用)	173,737,690円	95,685,592円
D I A M外国株式パッシブ私募 ファンド(適格機関投資家向 け)	3,216,630,874円	2,953,403,840円
D I A Mアクティブアローケー ション私募ファンド(適格機関 投資家限定)	172,145,175円	- 円
D I A M先進国株式パッシブ ファンド(適格機関投資家限 定)	392,000円	161,207,978円
外国株式パッシブ・ファンド2 (適格機関投資家限定)	- 円	208,789,234円
D I A Mワールドバランス2 5 V A (適格機関投資家限定)	29,023,964円	23,987,145円
D I A Mグローバル・バランス ファンド2 5 V A (適格機関投 資家限定)	168,073,193円	108,709,025円
D I A Mグローバル・バランス ファンド5 0 V A (適格機関投 資家限定)	320,310,030円	238,629,259円
D I A M国際分散バランスファ ンド3 0 V A (適格機関投資家 限定)	21,588,870円	12,888,459円
D I A M国際分散バランスファ ンド5 0 V A (適格機関投資家 限定)	140,963,619円	86,550,378円
D I A M国内重視バランスファ ンド3 0 V A (適格機関投資家 限定)	11,674,565円	7,842,084円
D I A M国内重視バランスファ ンド5 0 V A (適格機関投資家 限定)	17,327,751円	13,001,598円
D I A M世界バランスファンド 4 0 V A (適格機関投資家限 定)	1,121,411,686円	26,103,100円
D I A M世界バランスファンド 5 0 V A (適格機関投資家限 定)	645,440,187円	69,758,648円
D I A Mバランスファンド2 5 V A (適格機関投資家限定)	779,496,270円	578,673,845円
D I A Mバランスファンド3 7 . 5 V A (適格機関投資家限 定)	895,242,912円	722,585,419円
D I A Mバランスファンド5 0 V A (適格機関投資家限定)	2,786,274,684円	2,235,486,581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)	1,077,755,283円	794,469,102円

D I A Mグローバル・アセ ト・バランスV A 2 ( 適格機関 投資家限定)	1,185,802,464円	242,322,969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)	1,269,093,076円	962,367,378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)	831,466,203円	499,820,780円
D I A Mグローバル 私募ファ ンド( 適格機関投資家向け)	13,494,600円	2,754,975円
D I A M世界バランスファンド 5 5 V A ( 適格機関投資家限 定)	3,822,906,387円	176,485,295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)	1,523,731,124円	424,964,949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)	9,666,114,191円	8,054,309,887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)	536,552,271円	431,455,488円
D I A M世界アセットバランス ファンド2 5 V A ( 適格機関投 資家限定)	1,642,532,401円	1,383,217,436円
D I A M世界アセットバランス ファンド3 V A ( 適格機関投資 家限定)	6,133,183,873円	5,242,924,377円
D I A Mバランス3 0 V A ( 適 格機関投資家限定)	25,699,340円	2,048,915円
D I A Mバランス5 0 V A ( 適 格機関投資家限定)	1,714,626円	28,490,332円
D I A Mバランス7 0 V A ( 適 格機関投資家限定)	14,483,642円	10,665,941円
D I A M世界アセットバランス ファンド4 V A ( 適格機関投資 家限定)	8,250,573,365円	6,995,839,213円
D I A Mバランス2 0 V A ( 適 格機関投資家限定)	85,433,865円	56,125,154円
D I A Mバランス4 0 V A ( 適 格機関投資家限定)	169,337円	12,665,761円
D I A Mバランス6 0 V A ( 適 格機関投資家限定)	274,012円	257,653円
計	92,727,414,724円	87,104,816,912円
2 . 受益権の総数	92,727,414,724口	87,104,816,912口



## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成28年1月13日 至 平成29年1月11日	自 平成29年1月12日 至 平成30年1月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。</p> <p>また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。</p>	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成29年1月11日現在	平成30年1月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	平成29年1月11日現在	平成30年1月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
株式	45,803,894,661	38,008,423,503
投資信託受益証券	57,863,895	21,791,655
投資証券	572,776,282	100,610,106
合計	46,434,534,838	38,130,825,264

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成28年2月16日から平成29年1月11日まで及び平成29年2月16日から平成30年1月11日まで）に対応する金額であります。

## （デリバティブ取引等に関する注記）

## 通貨関連

種類	平成29年1月11日 現在				平成30年1月11日 現在			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	968,141,605	-	968,068,200	73,405	1,026,890,881	-	1,026,860,650	30,231
アメリカ・ドル	643,540,875	-	643,522,500	18,375	723,398,115	-	723,375,400	22,715
イギリス・債券	74,870,980	-	74,867,800	3,180	74,535,466	-	74,532,150	3,316
オーストラリア・ドル	40,968,420	-	40,978,200	9,780	29,758,776	-	29,757,420	1,356
カナダ・ドル	38,533,800	-	38,522,000	11,800	44,107,048	-	44,104,320	2,728
ユーロ	170,227,530	-	170,177,700	49,830	155,091,476	-	155,091,360	116
買 建	-	-	-	-	368,878,305	-	365,713,490	3,164,815
アメリカ・ドル	-	-	-	-	250,403,880	-	248,221,420	2,182,460
イギリス・債券	-	-	-	-	28,149,045	-	27,855,450	293,595
オーストラリア・ドル	-	-	-	-	11,862,585	-	11,850,300	12,285
カナダ・ドル	-	-	-	-	17,942,835	-	17,695,080	247,755
ユーロ	-	-	-	-	60,519,960	-	60,091,240	428,720
合計	968,141,605	-	968,068,200	73,405	1,395,769,186	-	1,392,574,140	3,134,584

## (注) 時価の算定方法

1. 計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。  
 計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。  
 計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。
  - ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算しております。
  - ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。
2. 計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。
3. 換算において円未満の端数は切捨てております。  
 上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 株式関連

種類	平成29年1月11日 現在				平成30年1月11日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								
先物取引								
買 建	5,114,184,278	-	5,142,996,499	28,812,221	7,434,733,565	-	7,609,349,267	174,615,702
合計	5,114,184,278	-	5,142,996,499	28,812,221	7,434,733,565	-	7,609,349,267	174,615,702

## (注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (1口当たり情報に関する注記)

	平成29年1月11日現在	平成30年1月11日現在
1口当たり純資産額	2.9787円	3.5439円
(1万口当たり純資産額)	(29,787円)	(35,439円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

平成30年1月11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	29,076	1,254.330	36,470,899.080	
	ABBOTT LABORATORIES	124,816	58.830	7,342,925.280	
	AES CORP	45,579	10.780	491,341.620	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	62,373	164.180	10,240,399.140	
	ADVANCED MICRO DEVICES	59,529	11.960	711,966.840	
	ADOBE SYSTEMS INC	35,138	187.110	6,574,671.180	
	CHUBB LTD	33,654	145.290	4,889,589.660	
	AGCO CORP	5,610	72.240	405,266.400	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	15,019	168.350	2,528,448.650	
	ALLEGHANY CORP	1,054	577.210	608,379.340	
	RALPH LAUREN CORP	4,703	104.980	493,720.940	
	ALLSTATE CORP	25,754	100.430	2,586,474.220	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	52,300	157.090	8,215,807.000	
	AMGEN INC	51,512	182.860	9,419,484.320	
	HESS CORP	20,421	53.000	1,082,313.000	
	AMERICAN EXPRESS CO	54,985	101.220	5,565,581.700	
	AMERICAN ELECTRIC POWER	34,859	69.500	2,422,700.500	
	AFLAC INC	28,218	90.740	2,560,501.320	
	AMERICAN INTL GROUP	65,596	61.000	4,001,356.000	
	AMERCO	551	372.960	205,500.960	
	ANALOG DEVICES	27,391	90.110	2,468,203.010	
	ANADARKO PETROLEUM CORP	41,003	55.410	2,271,976.230	
	ALEXION PHARMACEUTICALS INC	16,015	121.460	1,945,181.900	
	JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	64,578	39.060	2,522,416.680	
	TIME WARNER	56,495	92.090	5,202,624.550	
	JONES LANG LASALLE INC	2,818	152.560	429,914.080	
	VALERO ENERGY CORP	32,105	94.150	3,022,685.750	
	APACHE CORP	28,309	43.990	1,245,312.910	
	ANSYS INC	5,619	152.110	854,706.090	
	APPLE INC	368,126	174.290	64,160,680.540	
	APPLIED MATERIALS INC	78,309	53.300	4,173,869.700	
	ALBEMARLE CORP	7,904	132.960	1,050,915.840	
	ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	41,382	39.910	1,651,555.620	
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	7,831	80.570	630,943.670		
AMEREN CORP	17,312	56.480	977,781.760		
ARROW ELECTRONICS INC	5,756	82.350	474,006.600		

AUTOLIV INC	6,197	131.690	816,082.930
AUTODESK INC	14,259	111.470	1,589,450.730
AUTOMATIC DATA PROCESSING	31,205	117.650	3,671,268.250
AUTOZONE INC	2,015	767.780	1,547,076.700
AVERY DENNISON CORP	6,262	118.590	742,610.580
AVNET INC	10,288	41.300	424,894.400
BALL CORP	24,324	37.850	920,663.400
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	90,365	205.610	18,579,947.650
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	73,749	57.300	4,225,817.700
BAXTER INTERNATIONAL INC	34,876	68.430	2,386,564.680
BECTON DICKINSON & CO	18,586	224.560	4,173,672.160
AMETEK INC	16,775	73.720	1,236,653.000
VERIZON COMM INC	290,013	51.690	14,990,771.970
WR BERKLEY CORP	8,134	67.950	552,705.300
BEST BUY CO INC	21,033	70.340	1,479,461.220
YUM! BRANDS INC	23,738	82.550	1,959,571.900
FIRSTENERGY CORP	30,796	29.820	918,336.720
H&R BLOCK INC	16,114	25.970	418,480.580
BOEING CO	39,919	320.260	12,784,458.940
ROBERT HALF INTL INC	8,158	55.790	455,134.820
BORGWARNER INC	14,648	54.510	798,462.480
BOSTON SCIENTIFIC CORP	102,476	27.520	2,820,139.520
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	9,894	91.440	904,707.360
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	7,233	115.550	835,773.150
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	1,838	646.190	1,187,697.220
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	116,634	62.010	7,232,474.340
AFFILIATED MANAGERS GROUP INC	3,788	198.380	751,463.440
INGREDION INC	5,305	137.680	730,392.400
ONEOK INC	28,473	56.740	1,615,558.020
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	4,418	107.570	475,244.260
UNITED RENTALS INC	6,332	173.200	1,096,702.400
SEMPRA ENERGY	16,912	107.190	1,812,797.280
FEDEX CORP	18,719	268.010	5,016,879.190
VERISIGN INC	6,321	111.960	707,699.160
AMPHENOL CORP	21,490	89.510	1,923,569.900
BROWN-FORMAN CORP	13,612	67.890	924,118.680
SIRIUS XM HOLDINGS INC	127,092	5.555	705,996.060
CSX CORP	66,444	58.480	3,885,645.120
CABOT OIL & GAS CORP	32,261	27.960	902,017.560
CAMPBELL SOUP CO	14,050	45.820	643,771.000
SEAGATE TECHNOLOGY	23,239	47.070	1,093,859.730
CONSTELLATION BRANDS INC	12,240	219.360	2,684,966.400

CARDINAL HEALTH INC	22,125	68.060	1,505,827.500
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	24,916	67.950	1,693,042.200
CATERPILLAR INC	42,278	165.870	7,012,651.860
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	9,832	103.140	1,014,072.480
CELGENE CORP	54,731	105.460	5,771,931.260
CITRIX SYSTEMS INC	10,896	90.820	989,574.720
CENTURYLINK INC	71,294	17.480	1,246,219.120
CERNER CORP	20,809	72.350	1,505,531.150
JPMORGAN CHASE & CO	250,678	110.250	27,637,249.500
CHURCH & DWIGHT CO INC	18,822	49.790	937,147.380
CIGNA CORP	17,595	207.090	3,643,748.550
CINCINNATI FINANCIAL CORP	10,982	72.190	792,790.580
CINTAS CORP	6,282	160.330	1,007,193.060
CISCO SYSTEMS INC	354,512	39.910	14,148,573.920
CLOROX COMPANY	9,331	144.430	1,347,676.330
COCA-COLA CO/THE	289,171	46.070	13,322,107.970
COGNEX CORP	11,508	67.020	771,266.160
COLGATE-PALMOLIVE CO	59,819	74.820	4,475,657.580
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	23,366	137.700	3,217,498.200
COMERICA INC	12,068	91.310	1,101,929.080
COMCAST CORP-CL A	333,255	41.090	13,693,447.950
CA INC	22,732	33.480	761,067.360
CONAGRA BRANDS INC	31,942	36.830	1,176,423.860
CONSOLIDATED EDISON INC	21,750	80.920	1,760,010.000
CMS ENERGY CORP	22,372	44.980	1,006,292.560
COOPER COS INC	3,794	230.990	876,376.060
MOLSON COORS BREWING CO	13,855	85.210	1,180,584.550
CORNING INC	65,641	33.330	2,187,814.530
WR GRACE & CO	3,314	72.490	240,231.860
SEALED AIR CORP	13,870	48.660	674,914.200
CUMMINS INC	11,239	180.560	2,029,313.840
DR HORTON INC	24,498	50.970	1,248,663.060
DANAHER CORP	44,524	98.240	4,374,037.760
MOODY'S CORP	11,822	154.810	1,830,163.820
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	43,287	73.970	3,201,939.390
TARGET CORP	37,486	70.730	2,651,384.780
DEERE & CO	19,364	164.940	3,193,898.160
MORGAN STANLEY	96,261	53.930	5,191,355.730
REPUBLIC SERVICES INC	17,375	67.530	1,173,333.750
COSTAR GROUP INC	2,278	314.440	716,294.320
THE WALT DISNEY CO	108,774	109.470	11,907,489.780
DOLLAR TREE INC	17,493	109.630	1,917,757.590
DOVER CORP	10,736	102.700	1,102,587.200
OMNICOM GROUP	16,993	72.700	1,235,391.100
DTE ENERGY CO	13,122	104.640	1,373,086.080

DUKE ENERGY CORP	49,292	80.110	3,948,782.120
FLOWSERVE CORP	8,406	42.470	357,002.820
DARDEN RESTAURANTS INC	9,436	96.790	913,310.440
EBAY INC	73,800	37.700	2,782,260.000
BANK OF AMERICA CORP	719,642	30.550	21,985,063.100
CITIGROUP INC	193,450	75.650	14,634,492.500
EASTMAN CHEMICAL CO	10,193	97.250	991,269.250
E*TRADE FINANCIAL CORP	18,740	52.690	987,410.600
EATON CORP PLC	32,234	82.470	2,658,337.980
EATON VANCE CORP	9,184	59.150	543,233.600
CADENCE DESIGN SYS INC	20,877	44.840	936,124.680
DISH NETWORK CORP	16,150	48.410	781,821.500
ECOLAB INC	19,009	135.120	2,568,496.080
ELECTRONIC ARTS INC	23,241	112.250	2,608,802.250
SALESFORCE.COM INC	48,240	108.800	5,248,512.000
EMERSON ELECTRIC CO	45,625	72.590	3,311,918.750
ATMOS ENERGY CORP	8,221	80.800	664,256.800
ENTERGY CORP	13,984	79.480	1,111,448.320
EOG RESOURCES INC	39,963	112.010	4,476,255.630
EQUIFAX INC	8,495	121.180	1,029,424.100
EQT CORP	19,875	57.990	1,152,551.250
ESTEE LAUDER COS INC/THE	16,134	130.320	2,102,582.880
EXPEDITORS INTERNATIONAL	14,641	65.440	958,107.040
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	38,911	80.350	3,126,498.850
EXXON MOBIL CORP	300,424	86.080	25,860,497.920
FMC CORP	8,970	97.520	874,754.400
NEXTERA ENERGY INC	33,513	150.590	5,046,722.670
ASSURANT INC	4,089	96.490	394,547.610
FASTENAL CO	21,654	54.410	1,178,194.140
FIFTH THIRD BANCORP	52,173	31.580	1,647,623.340
M&T BANK CORP	9,799	176.750	1,731,973.250
FISERV INC	14,095	137.010	1,931,155.950
FLIR SYSTEMS INC	11,623	49.710	577,779.330
MACY'S INC	24,512	25.600	627,507.200
FORD MOTOR CO	261,895	13.030	3,412,491.850
FRANKLIN RESOURCES INC	22,314	43.270	965,526.780
FREEPORT-MCMORAN INC	96,812	19.510	1,888,802.120
FLEX LTD	35,913	18.640	669,418.320
ARTHUR J GALLAGHER & CO	12,176	63.570	774,028.320
GAP INC/THE	18,295	32.030	585,988.850
DENTSPLY SIRONA INC	17,477	62.760	1,096,856.520
GENERAL DYNAMICS CORP	18,563	204.750	3,800,774.250
GENERAL MILLS INC	38,727	58.630	2,270,564.010
GENUINE PARTS CO	11,094	99.400	1,102,743.600
GILEAD SCIENCES INC	94,012	78.710	7,399,684.520
GARTNER INC	7,153	128.160	916,728.480
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	18,097	33.470	605,706.590
MCKESSON CORP	15,054	160.670	2,418,726.180



NVIDIA CORP	42,645	223.680	9,538,833.600
GENERAL ELECTRIC CO	608,018	18.920	11,503,700.560
WW GRAINGER INC	3,832	231.750	888,066.000
HALLIBURTON CO	61,528	52.470	3,228,374.160
MONSTER BEVERAGE CORP	29,522	63.590	1,877,303.980
GOLDMAN SACHS GROUP INC	25,381	254.330	6,455,149.730
HARLEY-DAVIDSON INC	12,901	52.150	672,787.150
HARRIS CORP	8,954	145.150	1,299,673.100
HASBRO INC	7,736	92.310	714,110.160
HENRY SCHEIN INC	11,426	72.790	831,698.540
HELMERICH & PAYNE INC	7,213	68.270	492,431.510
HERSHEY FOODS CORP	10,132	110.820	1,122,828.240
HP INC	122,725	22.050	2,706,086.250
F5 NETWORKS INC	4,874	139.000	677,486.000
CROWN HOLDINGS INC NPR	7,781	56.580	440,248.980
UNITED THERAPEUTICS CORP	3,447	146.590	505,295.730
JUNIPER NETWORKS INC	27,740	28.400	787,816.000
HOLLYFRONTIER CORP	13,888	51.280	712,176.640
HOLOGIC INC	22,344	43.560	973,304.640
UNUM GROUP	16,000	57.520	920,320.000
HOME DEPOT INC	83,442	191.800	16,004,175.600
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	12,887	88.370	1,138,824.190
HORMEL FOODS CORP	19,345	35.390	684,619.550
CENTERPOINT ENERGY INC	31,952	27.260	871,011.520
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,337	204.950	478,968.150
HUMANA INC	10,468	263.100	2,754,130.800
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	5,927	120.110	711,891.970
HUNTINGTON BANCSHARES INC	75,161	15.480	1,163,492.280
RED HAT INC	12,098	124.510	1,506,321.980
BIOGEN INC	15,267	336.720	5,140,704.240
IDEX CORP	4,699	134.940	634,083.060
ILLINOIS TOOL WORKS	22,032	167.310	3,686,173.920
INTUIT INC	17,739	163.510	2,900,503.890
IDEXX LABORATORIES INC	6,255	166.140	1,039,205.700
INGERSOLL-RAND PLC	16,730	90.980	1,522,095.400
INTEL CORP	334,110	42.500	14,199,675.000
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	5,578	153.780	857,784.840
INTERNATIONAL PAPER CO	28,375	61.620	1,748,467.500
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	29,157	20.900	609,381.300
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	7,931	67.810	537,801.110
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	4,173	122.330	510,483.090
INCYTE CORP	12,360	96.620	1,194,223.200
JOHNSON & JOHNSON	191,449	143.970	27,562,912.530

HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	25,530	55.040	1,405,171.200	
KLA-TENCOR CORP	11,724	106.280	1,246,026.720	
DEVON ENERGY CORP	34,184	42.180	1,441,881.120	
WESTAR ENERGY INC	9,911	51.000	505,461.000	
KELLOGG CO	18,922	67.020	1,268,152.440	
EAST WEST BANCORP INC	8,509	65.900	560,743.100	
KEYCORP	71,550	21.010	1,503,265.500	
KIMBERLY-CLARK CORP	25,358	114.960	2,915,155.680	
BLACKROCK INC/NEW YORK	8,616	531.570	4,580,007.120	
KOHL'S CORP	11,357	58.840	668,245.880	
KROGER CO	66,588	27.990	1,863,798.120	
LAM RESEARCH CORP	11,522	191.660	2,208,306.520	
PACKAGING CORP OF AMERICA	6,157	128.000	788,096.000	
AKAMA I TECHNOLOGIES	12,622	66.330	837,217.260	
LEGGETT & PLATT INC	9,588	47.480	455,238.240	
LENNAR CORP	14,850	68.260	1,013,661.000	
LEUCADIA NATIONAL CORP	21,462	27.840	597,502.080	
ELI LILLY & CO	70,283	86.100	6,051,366.300	
L BRANDS INC	16,262	48.330	785,942.460	
LINCOLN NATIONAL CORP	14,163	82.790	1,172,554.770	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	47,982	129.790	6,227,583.780	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	24,266	70.790	1,717,790.140	
LOCKHEED MARTIN CORP	18,240	331.050	6,038,352.000	
LOEWS CORP	21,346	51.210	1,093,128.660	
RANGE RESOURCES CORP	13,697	16.780	229,835.660	
LOWE'S COS INC	58,178	94.170	5,478,622.260	
DOMINION ENERGY INC	45,131	76.210	3,439,433.510	
SCANA CORP	10,902	44.260	482,522.520	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	32,198	33.920	1,092,156.160	
MCCORMICK & CO INC	7,476	101.580	759,412.080	
MCDONALD'S CORPORATION	57,515	173.510	9,979,427.650	
S&P GLOBAL INC	18,409	175.610	3,232,804.490	
EVEREST RE GROUP LTD	3,382	219.970	743,938.540	
MANPOWERGROUP INC	4,257	129.140	549,748.980	
MARKEL CORPORATION	989	1,106.330	1,094,160.370	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	15,776	118.500	1,869,456.000	
MARSH & MCLENNAN COS	35,821	81.160	2,907,232.360	
MASCO CORP	23,043	44.710	1,030,252.530	
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	4,387	226.630	994,225.810	
MATTEL INC	24,003	15.680	376,367.040	
METLIFE INC	64,937	53.030	3,443,609.110	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	20,342	53.600	1,090,331.200	
MEDTRONIC PLC	95,177	85.490	8,136,681.730	
ACTIVISION BLIZZARD INC	50,052	66.830	3,344,975.160	
CVS HEALTH CORP	73,660	77.440	5,704,230.400	

MERCK & CO. INC.	193,111	57.300	11,065,260.300
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	7,176	170.470	1,223,292.720
MICROSOFT CORP	521,379	87.820	45,787,503.780
MICRON TECH INC	76,146	43.310	3,297,883.260
MIDDLEBY CORP	4,100	131.580	539,478.000
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	15,331	90.950	1,394,354.450
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	26,463	23.140	612,353.820
3M CO	42,407	241.140	10,226,023.980
MOHAWK INDUSTRIES INC	4,042	272.090	1,099,787.780
MOTOROLA SOLUTIONS INC	10,582	92.380	977,565.160
KANSAS CITY SOUTHERN	7,247	106.540	772,095.380
MYLAN NV	31,344	44.390	1,391,360.160
ILLUMINA INC	10,453	242.590	2,535,793.270
XCEL ENERGY INC	37,554	46.130	1,732,366.020
NATIONAL OILWELL VARCO INC	26,938	37.930	1,021,758.340
NETAPP INC	20,641	60.650	1,251,876.650
NEWFIELD EXPLORATION CO	13,740	34.030	467,572.200
NEWELL BRANDS INC	36,206	31.150	1,127,816.900
NEWMONT MINING CORP	38,093	38.340	1,460,485.620
NVR INC	236	3,515.850	829,740.600
NIKE INC-CL B	94,901	64.220	6,094,542.220
NOBLE ENERGY INC	31,005	31.340	971,696.700
NORDSTROM INC	9,487	49.200	466,760.400
NORFOLK SOUTHERN CORP	19,973	151.610	3,028,106.530
EVERSOURCE ENERGY	23,085	61.320	1,415,572.200
NISOURCE INC	22,198	24.130	535,637.740
TAPESTRY INC	19,175	45.230	867,285.250
NORTHERN TRUST CORP	16,090	105.760	1,701,678.400
NORTHROP GRUMMAN CORP	11,954	307.610	3,677,169.940
WELLS FARGO & CO	334,953	63.120	21,142,233.360
NUCOR CORP	23,780	68.940	1,639,393.200
MONSANTO CO	30,856	118.830	3,666,618.480
CHENIERE ENERGY INC	15,927	53.880	858,146.760
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	33,007	103.140	3,404,341.980
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	54,121	74.250	4,018,484.250
OLD DOMINION FREIGHT LINE	3,814	137.890	525,912.460
OGE ENERGY CORP	16,028	30.890	495,104.920
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	6,375	258.450	1,647,618.750
ORACLE CORP	222,369	48.800	10,851,607.200
PACCAR INC	24,457	74.110	1,812,508.270
EXELON CORP	69,910	37.950	2,653,084.500
PARKER HANNIFIN CORP	8,808	206.610	1,819,820.880
PAYCHEX INC	23,141	67.540	1,562,943.140
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	6,526	48.380	315,727.880
ALIGN TECHNOLOGY INC	5,255	248.310	1,304,869.050

PPL CORPORATION	49,957	30.900	1,543,671.300
PEPSICO INC	101,450	117.480	11,918,346.000
PENTAIR PLC	11,775	73.410	864,402.750
PFIZER INC	423,943	36.470	15,461,201.210
CONOCOPHILLIPS	88,450	57.650	5,099,142.500
PVH CORP	5,387	140.940	759,243.780
PG&E CORP	37,651	44.550	1,677,352.050
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	12,158	178.700	2,172,634.600
ALTRIA GROUP INC	135,928	70.290	9,554,379.120
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	34,538	149.620	5,167,575.560
POLARIS INDUSTRIES INC	5,010	124.720	624,847.200
GARMIN LTD	7,795	60.470	471,363.650
AETNA INC	23,744	183.480	4,356,549.120
FLUOR CORP (NEW)	9,821	54.060	530,923.260
PPG INDUSTRIES INC	17,674	116.610	2,060,965.140
IPG PHOTONICS CORP	2,441	254.530	621,307.730
PRAXAIR INC	20,519	162.620	3,336,799.780
COSTCO WHOLESALE CORP	31,578	185.420	5,855,192.760
T ROWE PRICE GROUP INC	16,303	112.270	1,830,337.810
QUEST DIAGNOSTICS	10,378	100.370	1,041,639.860
PROCTER & GAMBLE CO	181,559	90.470	16,425,642.730
PROGRESSIVE CORP	41,336	55.680	2,301,588.480
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	37,115	49.400	1,833,481.000
PULTE GROUP INC	21,209	33.670	714,107.030
NEW YORK COMMUNITY BANCORP INC	30,388	13.550	411,757.400
GLOBAL PAYMENTS INC	10,769	103.570	1,115,345.330
QUALCOMM INC	104,228	65.260	6,801,919.280
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	10,187	94.400	961,652.800
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	3,535	116.610	412,216.350
REGENERON PHARMACEUTICALS	5,659	366.460	2,073,797.140
REINSURANCE GROUP OF AMERICA INC	4,642	161.890	751,493.380
AUTONATION INC	5,772	56.100	323,809.200
RESMED INC	9,394	87.100	818,217.400
US BANCORP	122,040	56.200	6,858,648.000
SEATTLE GENETICS INC /WA	7,317	53.380	390,581.460
ARCH CAPITAL GROUP LTD	8,674	86.750	752,469.500
ROSS STORES INC	28,189	80.680	2,274,288.520
ROLLINS INC	5,357	47.190	252,796.830
ROPER TECHNOLOGIES INC	6,983	268.770	1,876,820.910
ROCKWELL AUTOMATION INC	8,867	202.130	1,792,286.710
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	12,293	123.060	1,512,776.580

RAYTHEON COMPANY	21,099	193.480	4,082,234.520
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	3,848	272.090	1,047,002.320
ACCENTURE PLC-CL A	44,729	158.900	7,107,438.100
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	109,427	42.630	4,664,873.010
WILLIS TOWERS WATSON PLC	8,849	153.610	1,359,294.890
ROCKWELL COLLINS INC	12,086	137.950	1,667,263.700
THE TRAVELERS COMPANIES INC	19,755	132.110	2,609,833.050
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	22,718	97.280	2,210,007.040
PRICELINE GROUP INC	3,542	1,872.910	6,633,847.220
SCHLUMBERGER LTD	100,396	75.600	7,589,937.600
SCHWAB (CHARLES) CORP	83,988	53.560	4,498,397.280
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	14,175	122.530	1,736,862.750
BUNGE LTD	10,334	69.390	717,076.260
SEI INVESTMENTS CO	11,107	75.000	833,025.000
ANTHEM INC	18,448	233.890	4,314,802.720
AMERISOURCEBERGEN CORP	12,257	97.210	1,191,502.970
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	21,442	73.380	1,573,413.960
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	5,958	419.530	2,499,559.740
CENTENE CORP	12,713	105.800	1,345,035.400
SVB FINANCIAL GROUP	3,468	249.650	865,786.200
IAC INTERACTIVE CORP	5,050	132.100	667,105.000
SMITH (A.O.) CORP	9,565	63.410	606,516.650
ACUITY BRANDS INC	3,087	158.990	490,802.130
SNAP-ON INC	3,932	180.390	709,293.480
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	30,203	121.510	3,669,966.530
ADVANCE AUTO PARTS	5,273	110.590	583,141.070
EDISON INTERNATIONAL	24,139	62.840	1,516,894.760
SOUTHERN CO	70,353	45.960	3,233,423.880
BB&T CORP	55,828	52.710	2,942,693.880
SOUTHWEST AIRLINES	11,352	62.960	714,721.920
AT&T INC	435,922	36.620	15,963,463.640
CHEVRON CORP	134,596	128.660	17,317,121.360
STANLEY BLACK & DECKER INC	10,528	171.040	1,800,709.120
STATE STREET CORP	27,099	104.250	2,825,070.750
STARBUCKS CORP	103,854	59.820	6,212,546.280
STEEL DYNAMICS INC	15,309	46.050	704,979.450
STRYKER CORP	24,985	159.540	3,986,106.900
NETFLIX INC	30,587	212.520	6,500,349.240
STERICYCLE INC	6,853	70.270	481,560.310
SUNTRUST BANKS INC	34,756	67.700	2,352,981.200
SYMANTEC CORP	46,581	28.660	1,335,011.460

KNIGHT SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	9,793	44.400	434,809.200	
SYNOPSIS INC	10,656	89.340	952,007.040	
SYSCO CORP	35,926	61.350	2,204,060.100	
INTUITIVE SURGICAL INC	7,788	423.760	3,300,242.880	
TELEFLEX INC	3,203	257.920	826,117.760	
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	63,853	20.040	1,279,614.120	
ANDEAVOR	11,500	116.480	1,339,520.000	
TEXAS INSTRUMENTS INC	70,900	109.700	7,777,730.000	
TEXTRON INC	19,076	58.400	1,114,038.400	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	28,065	206.290	5,789,528.850	
TIFFANY & CO	8,733	105.840	924,300.720	
TOLL BROTHERS INC	9,526	50.570	481,729.820	
TORCHMARK CORP	7,699	92.760	714,159.240	
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	11,279	81.490	919,125.710	
DAVITA INC	12,618	78.070	985,087.260	
TRACTOR SUPPLY CO	9,276	78.530	728,444.280	
TRIMBLE INC	20,073	42.680	856,715.640	
TYSON FOODS INC	21,621	81.000	1,751,301.000	
UGI CORP	12,068	47.350	571,419.800	
MARATHON OIL CORP	66,702	17.900	1,193,965.800	
UNION PACIFIC CORP	56,617	139.700	7,909,394.900	
UNITED TECHNOLOGIES CORP	54,787	134.900	7,390,766.300	
UNITEDHEALTH GROUP INC	69,757	224.200	15,639,519.400	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	6,351	110.360	700,896.360	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	6,848	111.680	764,784.640	
VF CORP	24,309	76.120	1,850,401.080	
CBS CORP	26,212	56.660	1,485,171.920	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	17,742	157.380	2,792,235.960	
VULCAN MATERIALS CO	9,977	132.400	1,320,954.800	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	63,286	74.080	4,688,226.880	
WAL-MART STORES INC	106,126	99.670	10,577,578.420	
WASTE MANAGEMENT INC	32,216	87.270	2,811,490.320	
WATERS CORP	5,963	207.320	1,236,249.160	
ALLERGAN PLC	23,313	173.990	4,056,228.870	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	8,755	124.160	1,087,020.800	
VAIL RESORTS INC	2,598	213.510	554,698.980	
WESTERN DIGITAL CORP	20,516	80.910	1,659,949.560	
WABTEC CORP	5,497	82.380	452,842.860	
WHIRLPOOL CORP	5,553	166.210	922,964.130	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	13,529	98.600	1,333,959.400	
WYNN RESORTS LTD	6,279	162.000	1,017,198.000	

NASDAQ INC	9,132	81.230	741,792.360
CME GROUP INC	25,327	152.900	3,872,498.300
WILLIAMS COS INC	61,081	32.750	2,000,402.750
LKQ CORP	22,948	42.240	969,323.520
ALLIANT ENERGY CORP	16,383	40.190	658,432.770
WEC ENERGY GROUP INC	23,117	63.670	1,471,859.390
TD AMERITRADE HOLDING CORP	18,631	53.720	1,000,857.320
CARMAX INC	13,513	70.300	949,963.900
XEROX CORP	17,455	30.350	529,759.250
XILINX INC	18,777	74.100	1,391,375.700
CIMAREX ENERGY CO	7,003	125.550	879,226.650
TJX COMPANIES INC	43,999	76.270	3,355,803.730
ZIONS BANCORP	16,584	52.350	868,172.400
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	94,700	7.120	674,264.000
JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	15,700	61.000	957,700.000
JARDINE STRATEGIC HOLDINGS LTD	17,100	39.830	681,093.000
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	6,051	128.600	778,158.600
SIGNATURE BANK	4,171	144.620	603,210.020
CBRE GROUP INC	20,976	44.270	928,607.520
LIBERTY GLOBAL PLC	16,073	34.900	560,947.700
REGIONS FINANCIAL CORP	84,486	18.080	1,527,506.880
DOMINO'S PIZZA INC	3,256	200.090	651,493.040
T-MOBILE US INC	21,188	63.890	1,353,701.320
LAS VEGAS SANDS CORP	28,387	70.040	1,988,225.480
MOSAIC CO/THE	26,525	25.910	687,262.750
TWENTY-FIRST CENTURY FOX NEWS	27,332	35.320	965,366.240
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC	75,340	35.600	2,682,104.000
MACQUARIE INFRASTRUCTURE CORP	5,473	65.340	357,605.820
CELANESE CORP	10,766	108.170	1,164,558.220
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	10,423	22.830	237,957.090
EXPEDIA INC	8,709	127.180	1,107,610.620
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	18,475	42.420	783,709.500
AMERIPRISE FINANCIAL INC	10,578	175.830	1,859,929.740
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	41,818	33.340	1,394,212.120
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	42,085	74.460	3,133,649.100
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	14,696	15.060	221,321.760
VIACOM INC-CLASS B	24,612	29.160	717,685.920
LIVE NATION	8,864	43.590	386,381.760

CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,807	321.800	581,492.600	
UNITED CONTINENTAL HOLIDINGS INC	6,191	73.080	452,438.280	
TRANSDIGM GROUP INC	3,812	281.230	1,072,048.760	
MASTERCARD INC	67,015	159.860	10,713,017.900	
LIBERTY INTERACTIVE CORP QVC GROUP	29,531	26.150	772,235.650	
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	7,436	112.710	838,111.560	
HANESBRANDS INC	27,619	21.650	597,951.350	
WESTERN UNION CO	35,222	21.230	747,763.060	
OWENS CORNING	7,333	93.500	685,635.500	
LEIDOS HOLDINGS INC	9,322	66.580	620,658.760	
AERCAP HOLDINGS NV	11,586	53.400	618,692.400	
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLDINGS INC	7,576	92.710	702,370.960	
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT-ADR	18,099	27.600	499,532.400	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	8,330	92.980	774,523.400	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	30,910	19.250	595,017.500	
DELTA AIR LINES INC	9,473	55.860	529,161.780	
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	6,354	56.520	359,128.080	
DISCOVER FINANCIAL	27,177	79.470	2,159,756.190	
TE CONNECTIVITY LTD	24,311	98.520	2,395,119.720	
CONCHO RESOURCES INC/MIDLAND TX	10,552	154.510	1,630,389.520	
WABCO HOLDING INC	3,176	149.140	473,668.640	
LULULEMON ATHLETICA INC	6,683	78.860	527,021.380	
VMWARE INC	5,491	129.220	709,547.020	
MERCADOLIBRE INC	2,861	339.550	971,452.550	
ULTA BEAUTY INC	4,332	230.450	998,309.400	
INVESCO LTD	29,824	36.820	1,098,119.680	
MSCI INC	6,462	133.750	864,292.500	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	110,262	105.630	11,646,975.060	
VISA INC	130,002	118.980	15,467,637.960	
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	12,572	95.670	1,202,763.240	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	11,992	85.700	1,027,714.400	
SCRIPPS NETWORKS INTERACTIVE	6,585	86.850	571,907.250	
DISCOVERY COMMUNICATIONS- C	16,085	21.690	348,883.650	
MARATHON PETROLEUM CORP	36,673	69.510	2,549,140.230	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	11,624	69.080	802,985.920	



SPECTRUM BRANDS HOLDINGS INC	1,826	120.000	219,120.000	
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	133,961	18.880	2,529,183.680	
XYLEM INC	14,682	69.000	1,013,058.000	
ALKERMES PLC	12,053	58.710	707,631.630	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	23,062	115.030	2,652,821.860	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,479	237.330	825,671.070	
SPLUNK INC	10,674	88.970	949,665.780	
HCA HEALTHCARE INC	21,493	84.960	1,826,045.280	
VERISK ANALYTICS INC	10,053	96.340	968,506.020	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	3,987	142.140	566,712.180	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	6,544	200.910	1,314,755.040	
FIRST REPUBLIC BANK/SAN FRANCISCO CA	10,668	89.990	960,013.320	
CIT GROUP INC	9,287	51.200	475,494.400	
NXP SEMICONDUCTOR NV	22,652	119.150	2,698,985.800	
TARGA RESOURCES CORP	16,445	49.520	814,356.400	
HUTCHISON PORT HOLDINGS TRUST	405,600	0.420	170,352.000	
LEAR CORP	5,132	182.510	936,641.320	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	8,174	132.330	1,081,665.420	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	10,633	47.690	507,087.770	
DOLLAR GENERAL CORP	19,355	94.780	1,834,466.900	
FORTINET INC	11,399	44.100	502,695.900	
AON PLC	19,411	136.660	2,652,707.260	
TESLA INC	9,357	334.800	3,132,723.600	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING NV	11,392	52.300	595,801.600	
GENERAL MOTORS CO	91,138	43.000	3,918,934.000	
VANTIV INC	12,141	75.710	919,195.110	
TRIPADVISOR INC	9,263	34.490	319,480.870	
ALLY FINANCIAL INC	31,409	30.060	944,154.540	
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	11,923	63.920	762,118.160	
VOYA FINANCIAL INC	13,525	53.570	724,534.250	
APTIV PLC	19,069	90.460	1,724,981.740	
PHILLIPS 66	30,976	102.080	3,162,030.080	
FACEBOOK INC	168,961	187.840	31,737,634.240	
IQVIA HOLDINGS INC	10,051	98.870	993,742.370	
DIAMONDBACK ENERGY INC	7,054	127.290	897,903.660	
SERVICENOW INC	13,054	136.230	1,778,346.420	
PALO ALTO NETWORKS INC	7,048	153.060	1,078,766.880	
TESARO INC	2,646	75.990	201,069.540	
WORKDAY INC	10,290	114.140	1,174,500.600	
ABBVIE INC	113,442	99.690	11,309,032.980	
ZOETIS INC	34,425	73.910	2,544,351.750	

NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDINGS LTD	12,224	55.600	679,654.400
COTY INC	38,871	20.520	797,632.920
NEWS CORP/NEW-CL A	30,263	16.850	509,931.550
HD SUPPLY HOLDINGS INC	12,891	38.500	496,303.500
CDW CORP	12,723	72.340	920,381.820
SPRINT CORP	63,882	5.620	359,016.840
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	10,199	53.780	548,502.220
ARCONIC INC	27,513	29.790	819,612.270
ENVISION HEALTHCARE CORP	8,692	35.070	304,828.440
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	13,175	33.310	438,859.250
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	5,006	40.990	205,195.940
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-C	13,368	40.720	544,344.960
XL GROUP LTD	20,259	34.230	693,465.570
BROADCOM LTD	29,284	262.830	7,696,713.720
DELL TECHNOLOGIES INC	15,074	84.610	1,275,411.140
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	15,410	13.940	214,815.400
BAKER HUGHES A GE CO	28,404	35.470	1,007,489.880
TECHNIPFMC LTD	32,556	32.830	1,068,813.480
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	6,291	64.000	402,624.000
ANTERO RESOURCES CORP	13,163	19.120	251,676.560
VEEVA SYSTEMS INC	6,980	57.680	402,606.400
TWITTER INC	43,692	24.250	1,059,531.000
PLAINS GP HOLDINGS LP	7,837	23.460	183,856.020
COMMScope HOLDING CO INC	12,920	38.210	493,673.200
ALLEGION PLC	5,402	82.600	446,205.200
PERRIGO CO PLC	8,553	90.080	770,454.240
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	14,796	81.650	1,208,093.400
ARAMARK	17,307	43.660	755,623.620
SABRE CORP	17,624	20.410	359,705.840
PARSLEY ENERGY INC	17,454	29.310	511,576.740
ARISTA NETWORKS INC	3,158	252.280	796,700.240
IHS MARKIT LTD	27,511	46.970	1,292,191.670
FNF GROUP	17,760	40.840	725,318.400
SYNCHRONY FINANCIAL	57,485	39.660	2,279,855.100
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	34,845	44.900	1,564,540.500
CDK GLOBAL INC	8,309	71.590	594,841.310
QORVO INC	8,784	67.740	595,028.160
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	11,389	36.360	414,104.040
LIBERTY BROADBAND CORP-C W/I	7,818	88.720	693,612.960
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	14,710	32.550	478,810.500
NIELSEN HOLDINGS PLC	26,840	36.260	973,218.400
TRANSUNION	10,341	56.790	587,265.390

	SQUARE INC	17,376	40.840	709,635.840	
	DOWDUPONT INC	168,213	74.200	12,481,404.600	
	COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS PLC	14,000	38.800	543,200.000	
	WESTROCK CO	17,744	67.410	1,196,123.040	
	KRAFT HEINZ CO	43,818	77.890	3,412,984.020	
	FORTIVE CORP	21,682	73.020	1,583,219.640	
	WASTE CONNECTIONS INC	18,879	70.000	1,321,530.000	
	ALPHABET INC-CL A	21,134	1,110.140	23,461,698.760	
	HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	121,590	15.190	1,846,952.100	
	PAYPAL HOLDINGS INC	81,079	79.370	6,435,240.230	
	FIRST DATA CORP	22,035	17.620	388,256.700	
	DXC TECHNOLOGY CO	21,001	101.230	2,125,931.230	
	ZILLOW GROUP INC-C	8,134	42.500	345,695.000	
	ALPHABET INC-CL C	22,444	1,102.610	24,746,978.840	
	L3 TECHNOLOGIES INC	5,892	205.730	1,212,161.160	
	CHEMOURS CO	12,723	51.200	651,417.600	
	ATHENE HOLDING LTD	8,984	51.260	460,519.840	
	CHARTER COMMUNICATIONS INC	13,583	350.830	4,765,323.890	
	VISTRA ENERGY CORP	15,825	18.350	290,388.750	
	アメリカ・ドル 小計	22,254,598		1,715,434,447.950 (191,219,477,913)	
イギリス・ポンド	ANTOFAGASTA PLC	25,905	10.145	262,806.220	
	ASHTED GROUP	35,233	20.530	723,333.490	
	SEVERN TRENT PLC	14,897	20.480	305,090.560	
	BHP BILLITON PLC	153,323	15.994	2,452,248.060	
	BARCLAYS PLC	1,164,260	2.012	2,342,491.120	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	64,682	6.342	410,213.240	
	BT GROUP PLC	631,894	2.728	1,723,806.830	
	SKY PLC	72,210	10.185	735,458.850	
	BUNZL PLC	22,241	20.050	445,932.050	
	EASYJET PLC	13,628	14.790	201,558.120	
	CAPITA PLC	54,894	4.035	221,497.290	
	AVIVA PLC	277,861	5.250	1,458,770.250	
	CRODA INTERNATIONAL	8,407	44.360	372,934.520	
	DIAGEO PLC	179,703	26.490	4,760,332.470	
	SCHRODERS PLC	6,697	36.180	242,297.460	
	DCC PLC	5,936	77.200	458,259.200	
	NATIONAL GRID PLC	229,884	8.385	1,927,577.340	
	GKN PLC	134,180	3.310	444,135.800	
	KINGFISHER PLC	165,680	3.417	566,128.560	
	BAE SYSTEMS PLC	225,176	5.778	1,301,066.920	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	162,930	49.650	8,089,474.500	
	COBHAM PLC	142,739	1.235	176,282.660	
	NEXT PLC	9,731	50.400	490,442.400	
	IMPERIAL BRANDS PLC	65,739	31.335	2,059,931.560	

IMI PLC	21,218	14.050	298,112.900
JOHNSON MATTHEY PLC	12,527	31.320	392,345.640
ANGLO AMERICAN PLC	93,573	17.004	1,591,115.290
COMPASS GROUP PLC	115,111	15.465	1,780,191.610
HSBC HOLDINGS PLC	1,445,842	7.955	11,501,673.110
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	423,649	2.729	1,156,138.120
CENTRICA PLC	392,766	1.405	551,836.230
UNILEVER PLC	89,305	40.055	3,577,111.770
MEGGITT PLC	62,181	4.747	295,173.200
MORRISON <WM.> SUPERMARKETS	155,682	2.295	357,290.190
UNITED UTILITIES GROUP PLC	34,714	7.686	266,811.800
RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	80,864	6.252	505,561.720
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	25,308	28.410	719,000.280
PEARSON PLC	65,009	7.272	472,745.440
PERSIMMON PLC	23,150	26.730	618,799.500
PRUDENTIAL PLC	182,973	19.705	3,605,482.960
RIO TINTO PLC	85,976	40.890	3,515,558.640
VODAFONE GROUP PLC	1,906,594	2.326	4,434,737.640
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	47,231	67.860	3,205,095.660
RELX PLC	80,689	16.785	1,354,364.860
OLD MUTUAL PLC	339,296	2.260	766,808.960
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	116,966	8.390	981,344.740
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	279,442	2.934	819,882.820
ST JAMES'S PLACE PLC	40,884	12.575	514,116.300
TRAVIS PERKINS PLC	20,357	15.655	318,688.830
SSE PLC	73,043	13.050	953,211.150
BP PLC	1,412,206	5.305	7,491,752.830
SHIRE PLC	65,457	36.610	2,396,380.770
SAGE GROUP PLC(THE)	85,271	7.992	681,485.830
SMITHS GROUP PLC	31,720	15.620	495,466.400
STANDARD CHARTERED PLC	237,533	8.187	1,944,682.670
LLOYDS BANKING GROUP PLC	5,055,136	0.689	3,482,988.700
TAYLOR WIMPLEY PLC	253,022	2.002	506,550.040
TESCO PLC	562,988	2.119	1,192,971.570
3I GROUP PLC	66,784	9.464	632,043.770
SMITH & NEPHEW PLC	66,155	12.560	830,906.800
GLAXOSMITHKLINE PLC	345,537	13.310	4,599,097.470
WEIR GROUP	18,336	22.560	413,660.160
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	21,888	37.000	809,856.000
BABCOCK INT'L GROUP	21,302	7.124	151,755.440
WPP PLC	90,628	13.270	1,202,633.560
FERGUSON PLC	18,238	54.940	1,001,995.720
ASTRAZENECA PLC	90,878	51.360	4,667,494.080

WHITBREAD PLC	12,159	39.000	474,201.000	
CARNIVAL PLC	13,153	50.600	665,541.800	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	120,290	3.240	389,739.600	
JOHN WOOD GROUP PLC	48,988	6.784	332,334.590	
INTERTEK GROUP PLC	13,339	52.180	696,029.020	
BURBERRY GROUP PLC	29,893	17.795	531,945.930	
INVESTEC PLC	50,655	5.342	270,599.010	
INTERCONTINENTAL HOTELS	12,362	46.970	580,643.140	
ITV PLC	247,210	1.682	415,807.220	
SAINSBURY (J) PLC	109,410	2.539	277,791.990	
RANDGOLD RESOURCES LTD NPR	6,998	72.600	508,054.800	
G4S PLC	122,250	2.824	345,234.000	
ADMIRAL GROUP PLC	15,893	19.060	302,920.580	
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	10,726	42.150	452,100.900	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	319,445	25.570	8,168,208.650	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	266,594	25.945	6,916,781.330	
TUI AG-DI	30,153	15.685	472,949.800	
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	184,183	4.388	808,195.000	
EXPERIAN PLC	62,214	16.765	1,043,017.710	
MONDI PLC	24,061	18.970	456,437.170	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	21,290	18.115	385,668.350	
FRESNILLO PLC NPR	15,639	14.175	221,682.820	
GLENCORE PLC	900,291	4.053	3,648,879.420	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP PLC	112,694	3.747	422,264.410	
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	30,616	6.160	188,594.560	
COCA-COLA HBC AG	13,406	23.810	319,196.860	
CONVATEC GROUP PLC	118,400	1.915	226,736.000	
ROYAL MAIL PLC	55,060	4.590	252,725.400	
MERLIN ENTERTAINMENTS PLC	50,037	3.533	176,780.720	
MICRO FOCUS INTERNATIONAL PLC	32,342	22.690	733,839.980	
AUTO TRADER GROUP PLC	76,348	3.464	264,469.470	
WORLDPAY GROUP PLC	160,354	4.368	700,426.270	
イギリス・ポンド 小計	21,811,712		140,876,788.140 (21,213,226,757)	
イスラエル・シユケル				
BANK HAPOLIM BM	78,428	25.130	1,970,895.640	
BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	124,270	21.150	2,628,310.500	
BEZEQ ISRAELI TELECOMMUNICATION CORP LTD	188,230	5.230	984,442.900	
ELBIT SYSTEMS LTD	1,760	453.300	797,808.000	

	FRUTAROM INDUSTRIES LTD	2,600	310.000	806,000.000	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	49,411	14.070	695,212.770	
	NICE LTD	4,035	319.900	1,290,796.500	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	10,444	66.200	691,392.800	
イスラエル・シュケル 小計		459,178		9,864,859.110 (321,101,164)	
オーストラリア・ ドル	RAMSAY HEALTH CARE LTD	11,115	70.220	780,495.300	
	AUST AND NZ BANKING GROUP LT	203,883	28.800	5,871,830.400	
	AMCOR LTD	80,741	14.950	1,207,077.950	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	239,994	31.600	7,583,810.400	
	BANK OF QUEENSLAND LTD	30,569	12.700	388,226.300	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	114,125	5.270	601,438.750	
	TELSTRA CORP LTD	272,919	3.710	1,012,529.490	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD	39,014	11.730	457,634.220	
	AMP LTD	200,498	5.230	1,048,604.540	
	ASX LTD	10,290	55.710	573,255.900	
	BHP BILLITON LTD	232,053	30.960	7,184,360.880	
	CALTEX AUSTRALIA LTD	20,946	34.670	726,197.820	
	HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	60,838	4.320	262,820.160	
	COMPUTERSHARE LT	38,040	16.430	624,997.200	
	CSL LIMITED	32,212	142.000	4,574,104.000	
	REA GROUP LTD	4,119	76.620	315,597.780	
	TRANSURBAN GROUP	149,591	11.970	1,790,604.270	
	COCA-COLA AMATIL LTD	48,601	8.420	409,220.420	
	COCHLEAR LTD	3,992	173.000	690,616.000	
	ORIGIN ENERGY LTD	121,721	9.530	1,160,001.130	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	121,208	81.610	9,891,784.880	
	BORAL LIMITED	86,101	7.760	668,143.760	
	RIO TINTO LIMITED	26,822	79.260	2,125,911.720	
	APA GROUP	73,253	8.150	597,011.950	
	ARISTOCRAT LEISU	44,406	22.770	1,011,124.620	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	171,471	7.190	1,232,876.490	
	TPG TELECOM LTD	28,719	6.640	190,694.160	
	FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	6,557	43.440	284,836.080	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	35,790	21.970	786,306.300	
	ORICA LTD	25,308	18.780	475,284.240	
	CIMIC GROUP LTD	8,709	51.270	446,510.430	
	BLUESCOPE STEEL LTD	36,941	15.920	588,100.720	
SYDNEY AIRPORT	85,130	6.930	589,950.900		

MACQUARIE GROUP LTD	21,627	101.930	2,204,440.110	
SUNCORP GROUP LTD	93,181	13.730	1,279,375.130	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	192,882	29.500	5,690,019.000	
NEWCREST MINING LTD	51,533	22.650	1,167,222.450	
OIL SEARCH LTD	93,715	7.970	746,908.550	
INCITEC PIVOT LTD	136,426	3.920	534,789.920	
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	95,390	10.570	1,008,272.300	
CHALLENGER FINANCIAL SERVICES	45,707	13.920	636,241.440	
SANTOS LTD	133,862	5.600	749,627.200	
SONIC HEALTHCARE	26,192	23.430	613,678.560	
TABCORP HOLDINGS LTD	158,725	5.250	833,306.250	
WESFARMERS LTD	81,021	44.350	3,593,281.350	
ALUMINA LIMITED	184,613	2.520	465,224.760	
WOODSIDE PETROLEUM LTD	60,249	34.470	2,076,783.030	
WOOLWORTHS GROUP LTD	97,477	27.280	2,659,172.560	
SEEK LTD	25,899	19.060	493,634.940	
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES LTD	4,581	45.640	209,076.840	
AUSNET SERVICES	165,066	1.760	290,516.160	
AGL ENERGY LTD	46,315	24.590	1,138,885.850	
BRAMBLES LTD	115,255	10.070	1,160,617.850	
CROWN RESORTS LTD	32,861	12.950	425,549.950	
AURIZON HOLDINGS LTD	139,184	4.770	663,907.680	
TREASURY WINE ESTATES LTD	50,789	15.210	772,500.690	
TRANSURBAN GROUP-RTS	12,129	0.540	6,549.660	
HEALTHSCOPE LTD	149,047	2.020	301,074.940	
MEDIBANK PVT LTD	177,176	3.220	570,506.720	
SOUTH32 LTD(AUD)	367,057	3.690	1,354,440.330	
オーストラリア・ドル 小計	5,423,635		87,797,563.380 (7,707,748,089)	
カナダ・ドル				
AGNICO EAGLE MINES LTD	16,141	58.410	942,795.810	
ALIMENTATION COUCHE TARD INC	30,728	66.430	2,041,261.040	
BARRICK GOLD CORP	83,648	18.280	1,529,085.440	
ATCO LTD	7,193	44.270	318,434.110	
BANK OF MONTREAL	45,451	102.590	4,662,818.090	
BANK OF NOVA SCOTIA	86,583	82.600	7,151,755.800	
NATIONAL BANK OF CANADA	23,756	63.800	1,515,632.800	
BCE INC	11,568	58.290	674,298.720	
BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT	57,500	52.910	3,042,325.000	
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERN	25,819	29.480	761,144.120	
BOMBARDIER INC 'B'	151,615	2.970	450,296.550	
SAPUTO INC	14,101	42.720	602,394.720	
BLACKBERRY LTD	39,652	17.170	680,824.840	

CGI GROUP INC	15,228	66.550	1,013,423.400
CCL INDUSTRIES INC	11,340	57.100	647,514.000
CAE INC	23,000	23.500	540,500.000
CAMECO CORP	32,627	11.930	389,240.110
ROGERS COMM-CL B	25,967	62.430	1,621,119.810
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	29,471	123.100	3,627,880.100
CANADIAN NATURAL RESOURCES	79,420	45.800	3,637,436.000
CANADIAN TIRE CORP-CL A	4,862	167.070	812,294.340
CANADIAN UTILITIES LTD	9,119	36.560	333,390.640
CANADIAN NATL RAILWAY CO	54,387	101.870	5,540,403.690
FIRST CAPITAL REALTY INC	11,417	20.730	236,674.410
GILDAN ACTIVEWEAR INC	13,930	40.320	561,657.600
OPEN TEXT CORP	19,756	41.990	829,554.440
EMPIRE CO LTD	15,093	24.540	370,382.220
KINROSS GOLD CORP	99,741	5.180	516,658.380
FINNING INTERNATIONAL INC	9,892	32.870	325,150.040
FORTIS INC	29,002	44.300	1,284,788.600
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	55,296	18.970	1,048,965.120
TELUS CORP	15,945	46.580	742,718.100
GREAT WEST LIFECO INC	19,248	35.280	679,069.440
IMPERIAL OIL LTD	21,542	39.730	855,863.660
ENBRIDGE INC	112,614	49.110	5,530,473.540
IGM FINANCIAL INC	8,426	43.700	368,216.200
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	87,995	4.310	379,258.450
MANULIFE FINANCIAL CORP	136,517	26.830	3,662,751.110
LINAMAR CORP	3,827	73.340	280,672.180
LOBLAW CO LTD	15,354	67.530	1,036,855.620
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANCE AND FINANCIAL SERVICES INC	6,524	61.320	400,051.680
MAGNA INTERNATIONAL INC	25,339	71.440	1,810,218.160
SUN LIFE FINANCIAL INC	40,842	51.930	2,120,925.060
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,245	651.000	1,461,495.000
METRO INC	12,389	41.200	510,426.800
HUSKY ENERGY INC	28,749	18.750	539,043.750
CRESCENT POINT ENERGY CORP	39,992	10.940	437,512.480
METHANEX CORP	7,381	76.250	562,801.250
ONEX CORP	6,646	88.950	591,161.700
GOLDCORP INC	51,066	17.280	882,420.480
POWER CORP OF CANADA	25,052	32.560	815,693.120
POWER FINANCIAL CORP	17,484	34.800	608,443.200
ROYAL BANK OF CANADA	106,285	105.010	11,160,987.850
SNC-LAVALIN GROUP INC	13,134	56.640	743,909.760



CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	10,607	225.520	2,392,090.640	
SHAW COMM INC-B	27,548	27.940	769,691.120	
SUNCOR ENERGY INC	120,732	47.000	5,674,404.000	
LUNDIN MINING CORP	35,268	8.690	306,478.920	
ENCANA CORP	69,257	17.300	1,198,146.100	
TECK RESOURCES LTD-CL B	41,016	36.520	1,497,904.320	
THOMSON REUTERS CORP	20,469	54.860	1,122,929.340	
TORONTO DOMINION BANK (THE) C\$	133,609	73.970	9,883,057.730	
TRANSCANADA CORP	62,895	59.570	3,746,655.150	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	5,696	81.330	463,255.680	
WESTON (GEORGE) LTD	3,105	107.970	335,246.850	
INTACT FINANCIAL CORP	10,785	103.300	1,114,090.500	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	33,943	26.410	896,434.630	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,494	727.170	1,086,391.980	
FRANCO-NEVADA CORP NPR	14,627	97.470	1,425,693.690	
CI FINANCIAL CORP	20,695	29.200	604,294.000	
TOURMALINE OIL CORP	15,779	20.770	327,729.830	
KEYERA CORP	13,728	35.700	490,089.600	
ALTAGAS LTD	12,538	28.730	360,216.740	
PEMBINA PIPELINE CORP	30,850	43.890	1,354,006.500	
DOLLARAMA INC	7,504	155.010	1,163,195.040	
CENOVUS ENERGY INC W/I	80,545	13.110	1,055,944.950	
VERMILION ENERGY INC	8,291	47.250	391,749.750	
ARC RESOURCES LTD	22,997	13.910	319,888.270	
ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP	30,631	9.480	290,381.880	
INTER PIPELINE LTD	24,083	25.780	620,859.740	
NUTRIEN LTD	45,351	65.150	2,954,617.650	
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	14,961	32.030	479,200.830	
SEVEN GENERATIONS ENERGY LTD	17,231	17.260	297,407.060	
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	15,353	76.650	1,176,807.450	
SHOPIFY INC	5,021	139.290	699,375.090	
HYDRO ONE LTD	13,354	21.900	292,452.600	
カナダ・ドル 小計	2,907,862		128,681,756.160 (11,443,668,575)	
シンガポール・ドル				
SINGAPORE TECH ENG	125,000	3.320	415,000.000	
SEBACORP INDUSTRIES	81,400	3.180	258,852.000	
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	123,700	2.680	331,516.000	
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	692,140	0.385	266,473.900	
DBS GROUP HOLDINGS LTD	124,200	26.560	3,298,752.000	
CITY DEVELOPMENTS LTD	29,000	12.990	376,710.000	

	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	5,944	40.650	241,623.600	
	SINGAPORE AIRPORT TERMINAL SERVICES LTD	42,300	5.480	231,804.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	68,900	7.630	525,707.000	
	CAPITALAND LTD	192,415	3.770	725,404.550	
	GENTING SINGAPORE PLC	416,400	1.330	553,812.000	
	KEPPEL CORP LTD	119,300	7.920	944,856.000	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	177,900	1.990	354,021.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	225,453	12.860	2,899,325.580	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	591,922	3.620	2,142,757.640	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	47,500	10.910	518,225.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	94,500	27.680	2,615,760.000	
	UOL GROUP LIMITED	40,500	9.340	378,270.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	92,000	3.200	294,400.000	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	188,800	1.560	294,528.000	
	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES LTD	172,100	3.370	579,977.000	
シンガポール・ドル	小計	3,651,374		18,247,775.270 (1,526,061,446)	
スイス・フラン	CREDIT SUISSE GROUP AG	167,395	17.850	2,988,000.750	
	NESTLE SA-REGISTERED	221,279	83.200	18,410,412.800	
	CIE FINANC RICHEMONT	37,438	89.100	3,335,725.800	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	50,677	247.200	12,527,354.400	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2,835	233.600	662,256.000	
	SIKA INHABER	151	8,270.000	1,248,770.000	
	SGS SA-REG	405	2,586.000	1,047,330.000	
	NOVARTIS AG-REG SHS	160,610	83.800	13,459,118.000	
	BALOISE HOLDING AG -R	4,127	156.200	644,637.400	
	BARRY CALLEBAUT AG	144	2,028.000	292,032.000	
	CLARIANT AG-REG	12,888	27.760	357,770.880	
	SWISSCOM AG-REG	1,795	520.800	934,836.000	
	ABB LTD	126,278	26.880	3,394,352.640	
	ADECCO GROUP AG-REG	12,341	78.400	967,534.400	
	GEBERIT AG	2,801	431.700	1,209,191.700	
	LONZA GROUP AG-REG	5,901	266.500	1,572,616.500	
	LINDT & SPRUENGLI PART	75	5,945.000	445,875.000	
	LINDT & SPRUENGLI NAMEN	9	70,300.000	632,700.000	
	GIVAUDAN-REG	692	2,247.000	1,554,924.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	11,250	308.600	3,471,750.000	
	LAFARGEHOLCIM LTD	32,676	58.500	1,911,546.000	
	SONOVA HOLDING AG	3,168	153.250	485,496.000	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG	3,687	178.750	659,051.250	
	STRAUMANN HOLDING AG	600	702.000	421,200.000	

	THE SWATCH GROUP AG-B	1,955	408.300	798,226.500	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	4,592	77.350	355,191.200	
	SCHINDLER NAMEN	1,663	227.600	378,498.800	
	SWISS LIFE HOLDING AG	2,225	353.000	785,425.000	
	VIFOR PHARMA AG	3,050	135.950	414,647.500	
	EMS-CHEMIE HOLDING	553	688.000	380,464.000	
	SWISS PRIME SITE AG	5,990	89.700	537,303.000	
	DUFREY GROUP	2,390	148.500	354,915.000	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,272	691.000	878,952.000	
	JULIUS BAER GROUP LTD	15,227	62.580	952,905.660	
	SWISS RE LTD	20,638	91.560	1,889,615.280	
	UBS GROUP AG	268,881	18.590	4,998,497.790	
スイス・フラン 小計		1,187,658		85,359,123.250 (9,726,672,094)	
スウェーデン・ク ローナ	ATLAS COPCO AB-A SHS	48,377	375.600	18,170,401.200	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	29,157	332.600	9,697,618.200	
	ERICSSON LM-B SHS	221,748	55.300	12,262,664.400	
	GETINGE AB-B SHS	13,153	117.500	1,545,477.500	
	LUNDBERGS B	3,691	640.000	2,362,240.000	
	SKF AB-B SHS	24,866	187.500	4,662,375.000	
	SANDVIK AB	76,781	152.550	11,712,941.550	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	95,918	102.200	9,802,819.600	
	SKANSKA AB-B SHS	21,179	174.600	3,697,853.400	
	SWEDBANK AB	66,507	205.100	13,640,585.700	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	108,388	118.300	12,822,300.400	
	VOLVO AB-B SHS	113,672	159.050	18,079,531.600	
	SWEDISH MATCH AB	11,481	323.600	3,715,251.600	
	TELE2 AB-B SHS	26,976	97.140	2,620,448.640	
	NORDEA AB	218,620	102.450	22,397,619.000	
	INDUSTRIVARDEN C	11,403	214.500	2,445,943.500	
	ELECTROLUX AB-SER B	19,191	265.300	5,091,372.300	
	SECURITAS AB-B SHS	24,098	147.950	3,565,299.100	
	INVESTOR AB-B SHS	33,412	394.200	13,171,010.400	
	HENNES&MAURITZ AB-B SHS	66,448	160.800	10,684,838.400	
	ASSA ABLOY AB-B	68,613	175.250	12,024,428.250	
	TELIA CO AB	184,927	37.980	7,023,527.460	
	LUNDIN PETROLEUM AB	16,790	201.900	3,389,901.000	
	BOLIDEN AB	21,855	299.900	6,554,314.500	
	ALFA LAVAL AB	17,411	203.600	3,544,879.600	
	KINNEVIK AB-B	18,310	288.000	5,273,280.000	
	MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR SA	5,332	578.000	3,081,896.000	
ICA GRUPPEN AB	5,920	299.200	1,771,264.000		
HUSQVARNA AB-B SHS	33,692	81.880	2,758,700.960		
HEXAGON AB	20,529	422.800	8,679,661.200		
ESSITY AB-B	39,797	234.700	9,340,355.900		

スウェーデン・クローナ 小計		1,668,242		245,590,800.360 (3,342,490,793)	
デンマーク・クローネ	CARLSBERG AS-B	7,330	764.000	5,600,120.000	
	A P MOLLER A/S	481	11,115.000	5,346,315.000	
	AP MOLLER MAERSK A	273	10,690.000	2,918,370.000	
	DANSKE BANK A/S	50,188	248.400	12,466,699.200	
	GENMAB A/S	4,633	1,172.000	5,429,876.000	
	NOVOZYMES-B SHS	15,904	346.100	5,504,374.400	
	NOVO NORDISK A/S-B	134,315	340.300	45,707,394.500	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	15,808	423.600	6,696,268.800	
	TDC A/S	68,939	39.200	2,702,408.800	
	COLOPLAST-B	8,286	512.200	4,244,089.200	
	DSV A/S	13,040	508.400	6,629,536.000	
	WILLIAM DEMANT	6,537	174.300	1,139,399.100	
	H LUNDBECK A/S	4,840	316.300	1,530,892.000	
	TRYG A/S	11,107	156.900	1,742,688.300	
	PANDORA A/S	8,251	667.000	5,503,417.000	
	CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S	7,708	584.000	4,501,472.000	
ISS A/S	11,125	241.600	2,687,800.000		
ORSTED A/S	11,600	346.000	4,013,600.000		
デンマーク・クローネ 小計		380,365		124,364,720.300 (2,224,884,846)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	97,992	6.560	642,827.520	
	FISHER & PAYKEL	37,249	13.420	499,881.580	
	FLETCHER BUILDING LTD	75,281	7.710	580,416.510	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	210,161	3.630	762,884.430	
ニュージーランド・ドル 小計		420,683		2,486,010.040 (199,576,885)	
ノルウェー・クローネ	MARINE HARVEST	24,816	139.100	3,451,905.600	
	DNB ASA	70,426	157.850	11,116,744.100	
	NORSK HYDRO ASA	91,879	62.120	5,707,523.480	
	TELENOR ASA	53,178	187.000	9,944,286.000	
	ORKLA ASA	61,421	82.500	5,067,232.500	
	STATOIL ASA	81,414	184.400	15,012,741.600	
	YARA INTERNATIONAL ASA	11,279	387.000	4,364,973.000	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	16,683	160.000	2,669,280.000	
ノルウェー・クローネ 小計		411,096		57,334,686.280 (791,792,018)	
ユーロ	CRH PLC	58,956	31.030	1,829,404.680	
	PADDY POWER BETFAIR PLC	6,246	96.400	602,114.400	
	KERRY GROUP PLC-A	11,576	88.750	1,027,370.000	
	UMICORE	15,320	43.615	668,181.800	
	AIR LIQUIDE	29,845	108.550	3,239,674.750	
	AIRBUS SE	42,646	90.270	3,849,654.420	
	AXA	139,550	26.385	3,682,026.750	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	34,622	20.950	725,330.900	

ADIDAS AG	13,503	167.700	2,264,453.100
ASSICURAZIONI GENERALI	85,995	15.740	1,353,561.300
ABERTIS INFRASTRUCTURAS SA	38,521	18.760	722,653.960
DASSAULT AVIATION SA	157	1,357.000	213,049.000
DANONE	43,686	69.040	3,016,081.440
SAFRAN SA	22,050	89.580	1,975,239.000
INTESA SANPAOLO	934,915	2.970	2,776,697.550
INTESA SANPAOLO-RNC	51,178	2.870	146,880.860
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	22,705	89.400	2,029,827.000
ACCOR SA	10,552	45.140	476,317.280
BOSKALIS WESTMINSTER CT	7,563	31.730	239,973.990
BOUYGUES	13,996	44.830	627,440.680
BNP PARIBAS	80,451	66.430	5,344,359.930
RELX NV	70,826	18.665	1,321,967.290
THALES SA	8,128	90.860	738,510.080
CAPGEMINI SA	11,481	104.150	1,195,746.150
CASINO GUICHARD PERRACHON	4,264	51.040	217,634.560
INGENICO GROUP	4,334	91.060	394,654.040
UNICREDIT SPA	142,664	17.000	2,425,288.000
NATIXIS	70,166	7.040	493,968.640
KONINKLIJKE DSM NV	14,525	81.500	1,183,787.500
COMMERZBANK AG	72,573	13.258	962,172.830
EIFFAGE	4,777	94.480	451,330.960
FRESENIUS SE & CO KGAA	30,156	65.820	1,984,867.920
UNITED INTERNET	9,882	57.980	572,958.360
FUCHS PETROLUB SE PREF	5,546	44.300	245,687.800
PUBLICIS GROUPE	15,068	55.760	840,191.680
MAN SE	3,396	95.950	325,846.200
FAURECIA	3,831	70.520	270,162.120
IBERDROLA SA	407,950	6.532	2,664,729.400
ENI SPA	177,297	14.520	2,574,352.440
IMERYS SA	2,256	83.950	189,391.200
JERONIMO MARTINS	19,517	16.760	327,104.920
KBC GROUPE	18,378	75.500	1,387,539.000
HANNOVER RUECK SE	3,642	107.700	392,243.400
WARTSILA OYJ	11,645	54.180	630,926.100
L'OREAL	18,067	186.900	3,376,722.300
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	19,742	242.000	4,777,564.000
LAGARDERE S.C.A.	9,600	26.460	254,016.000
GEA GROUP AG	14,635	40.500	592,717.500
BOLLORE	71,347	4.740	338,184.780
MEDIOBANCA SPA	42,404	9.800	415,559.200
MICHELIN(CGDE) -B	12,118	128.850	1,561,404.300
CONTINENTAL AG	7,776	242.400	1,884,902.400
DEUTSCHE POST AG-REG	69,944	40.630	2,841,824.720

SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	14,426	12.005	173,184.130
NOKIAN RENKAAT OYJ	9,399	38.440	361,297.560
AXEL SPRINGER SE	3,067	67.500	207,022.500
OMV AG	9,766	56.240	549,239.840
PERNOD-RICARD	16,249	131.850	2,142,430.650
PEUGEOT SA	42,232	17.900	755,952.800
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	12,066	75.400	909,776.400
RENAULT SA	12,442	88.090	1,096,015.780
REPSOL SA	80,598	15.730	1,267,806.540
REMY COINTREAU	1,860	112.300	208,878.000
MERCK KGAA	9,551	92.700	885,377.700
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	35,706	48.180	1,720,315.080
RWE AG	39,183	17.700	693,539.100
SEB SA	1,405	167.000	234,635.000
LUXOTTICA GROUP SPA	11,602	50.650	587,641.300
SOCIETE GENERALE-A	56,596	46.130	2,610,773.480
VINCI S.A.	35,362	87.580	3,097,003.960
SODEXO	6,286	110.350	693,660.100
SOLVAY SA	5,036	118.200	595,255.200
SCHNEIDER ELECTRIC SE	38,899	73.760	2,869,190.240
VIVENDI SA	77,297	24.840	1,920,057.480
SAP SE	69,054	94.580	6,531,127.320
TELEFONICA S.A	322,715	8.274	2,670,143.910
TOTAL SA	168,622	48.150	8,119,149.300
VALEO	17,731	65.680	1,164,572.080
E.ON SE	164,012	8.931	1,464,791.170
VOEST-ALPINE AG	9,875	53.600	529,300.000
ZODIAC AEROSPACE	15,282	24.990	381,897.180
HENKEL AG & CO KGAA	7,525	103.400	778,085.000
SIEMENS AG-REG	53,706	120.400	6,466,202.400
UPM-KYMMENE OYJ	36,917	26.330	972,024.610
ING GROEP NV-CVA	272,880	16.460	4,491,604.800
BAYER AG	58,437	105.540	6,167,440.980
STORA ENSO OYJ-R SHS	42,303	13.745	581,454.730
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	13,173	112.700	1,484,597.100
DAIMLER AG	68,086	74.150	5,048,576.900
BASF SE	65,128	93.280	6,075,139.840
BEIERSDORF AG	6,780	98.020	664,575.600
HOCHTIEF AG	1,707	146.100	249,392.700
HEIDELBERGCEMENT AG	11,009	94.500	1,040,350.500
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	15,048	90.980	1,369,067.040
ORANGE	141,819	14.430	2,046,448.170
SAMPO OYJ-A SHS	28,897	47.370	1,368,850.890
RANDSTAD HOLDINGS	7,794	55.680	433,969.920
ALLIANZ SE	32,540	200.600	6,527,524.000

ENERGIAS DE PORTUGAL SA	191,094	2.920	557,994.480
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	91,426	18.148	1,659,199.040
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	17,602	28.450	500,776.900
HERMES INTL	2,285	449.700	1,027,564.500
ENDESA S.A.	21,037	18.265	384,240.800
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	19,748	30.730	606,856.040
ERSTE GROUP BANK AG	23,324	38.720	903,105.280
MUENCHENER RUECKVER AG- REG	11,346	185.950	2,109,788.700
ARCELOR MITTAL (NL)	51,058	29.830	1,523,060.140
SOCIETE BIC SA	2,478	94.800	234,914.400
DASSAULT SYSTEMES SA	8,961	90.760	813,300.360
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	15,049	33.930	510,612.570
HEINEKEN NV	17,373	88.040	1,529,518.920
AKZO NOBEL	18,209	74.320	1,353,292.880
ASML HOLDING NV	27,421	150.350	4,122,747.350
AEGON NV	120,404	5.632	678,115.320
BANKINTER S.A.	57,960	8.300	481,068.000
VOLKSWAGEN AG	2,794	179.500	501,523.000
VOLKSWAGEN AG PFD	13,134	178.200	2,340,478.800
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	464,350	7.350	3,412,972.500
KERING	5,479	412.500	2,260,087.500
CNP ASSURANCES	13,987	20.380	285,055.060
FORTUM OYJ	29,739	17.075	507,793.420
AGEAS	12,993	42.470	551,812.710
UCB SA	8,747	68.320	597,595.040
THYSSENKRUPP AG	29,903	25.000	747,575.000
UNILEVER NV-CVA	115,530	46.100	5,325,933.000
CARREFOUR SA	39,144	17.575	687,955.800
GAS NATURAL SDG SA	29,010	20.300	588,903.000
ATOS SE	7,050	125.100	881,955.000
NOKIA OYJ	417,248	4.028	1,680,674.940
KONINKLIJKE PHILIPS NV	70,960	33.145	2,351,969.200
WOLTERS KLUWER-CVA	20,558	43.960	903,729.680
SANOFI	81,462	73.340	5,974,423.080
STMICROELECTRONICS NV	45,866	19.590	898,514.940
ELISA OYJ	9,517	32.360	307,970.120
BANCO SANTANDER SA	1,164,128	5.840	6,798,507.520
METSO OYJ	8,585	29.630	254,373.550
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	34,596	18.190	629,301.240
QIAGEN N.V.	13,642	26.600	362,877.200
DRILLISCH AG	3,149	70.150	220,902.350
DEUTSCHE BANK AG-REG	149,244	15.558	2,321,938.150
BMW VORZUG	4,116	76.800	316,108.800
K & S	14,982	21.900	328,105.800

ENEL SPA	600,898	5.225	3,139,692.050
COLRUYT NV	4,673	44.260	206,826.980
VOPAK (KON.)	5,364	37.560	201,471.840
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	232,897	14.740	3,432,901.780
LEONARDO SPA	26,269	10.900	286,332.100
UBISOFT ENTERTAINMENT	3,930	69.980	275,021.400
INFINEON TECHNOLOGIES AG	81,774	24.570	2,009,187.180
KONINKLIJKE KPN NV	228,967	2.850	652,555.950
EUROFINS SCIENTIFIC	794	530.000	420,820.000
UNIPOLSAI SPA	91,992	2.034	187,111.720
TELEPERFORMANCE	3,607	127.200	458,810.400
DEUTSCHE BOERSE AG	13,844	100.700	1,394,090.800
EURAZEO	2,427	82.150	199,378.050
BANCO SABADELL	367,753	1.866	686,227.090
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	5,814	94.140	547,329.960
FRAPORT AG	3,149	93.780	295,313.220
HEINEKEN HOLDING NV-A	8,014	83.700	670,771.800
INDITEX	79,821	28.850	2,302,835.850
JC DECAUX SA	6,058	35.380	214,332.040
ANDRITZ AG	6,265	48.000	300,720.000
MAPFRE SA	84,474	2.854	241,088.790
ESSILOR INTL	14,632	111.750	1,635,126.000
SNAM SPA	158,419	4.054	642,230.620
CREDIT AGRICOLE SA	85,585	15.160	1,297,468.600
ENAGAS	18,095	23.700	428,851.500
WENDEL	2,220	146.000	324,120.000
WIRECARD AG	7,990	103.250	824,967.500
TENARIS SA	38,237	13.720	524,611.640
TELECOM ITALIA SPA	792,163	0.752	595,706.570
TELECOM ITALIA-RNC	497,596	0.627	311,992.690
ATLANTIA SPA	34,969	26.700	933,672.300
ILIAD SA	2,102	205.200	431,330.400
PROXIMUS	8,922	27.480	245,176.560
SES FDR	24,585	12.970	318,867.450
TERNA SPA	81,915	4.874	399,253.710
GRIFOLS SA	18,800	26.550	499,140.000
FERROVIAL SA	36,997	19.590	724,771.230
LANXESS AG	6,856	68.940	472,652.640
NESTE OYJ	10,692	55.100	589,129.200
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	9,641	33.000	318,153.000
RECORDATI SPA	6,859	38.420	263,522.780
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	35,583	6.340	225,596.220
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	3,134	154.900	485,456.600
KONE OYJ	23,717	46.560	1,104,263.520
ENGIE	129,539	14.650	1,897,746.350
ALSTOM	12,046	36.000	433,656.000



TELENET GROUP HOLDING NV	3,634	60.850	221,128.900
EUTELSAT COMMUNICATIONS	12,542	18.635	233,720.170
ELECTRICITE DE FRANCE	34,756	10.490	364,590.440
IPSEN SA	2,487	105.200	261,632.400
DEUTSCHE WOHNEN	26,714	36.790	982,808.060
ARKEMA SA	3,796	103.900	394,404.400
LEGRAND SA	19,920	65.680	1,308,345.600
ADP	2,313	163.600	378,406.800
ORION OYJ	8,051	31.490	253,525.990
RTL GROUP SA	3,446	69.000	237,774.000
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	37,921	16.095	610,338.490
SYMRISE AG	7,926	70.000	554,820.000
SCOR SE	13,875	35.280	489,510.000
REXEL SA	23,245	15.235	354,137.570
PRYSMIAN SPA	14,925	28.540	425,959.500
CAIXABANK	262,372	4.242	1,112,982.020
BUREAU VERITAS SA	21,480	23.660	508,216.800
GETLINK	37,646	11.060	416,364.760
SUEZ SA	25,406	14.100	358,224.600
AMADEUS IT GROUP SA	30,169	63.160	1,905,474.040
BRENNTAG AG	9,600	53.920	517,632.000
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GROUP SA	44,747	7.424	332,201.720
EVONIK INDUSTRIES AG	11,575	31.420	363,686.500
EDENRED	13,195	24.640	325,124.800
BANKIA SA	63,197	4.230	267,323.310
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	61,541	4.170	256,625.970
HUGO BOSS AG -ORD	5,218	72.280	377,157.040
OSRAM LICHT AG	7,017	78.000	547,326.000
KION GROUP AG	6,125	75.720	463,785.000
VONOVIA SE	35,308	41.220	1,455,395.760
BANK OF IRELAND GROUP PLC	73,287	7.825	573,470.770
FERRARI NV	8,338	95.650	797,529.700
METRO AG	10,774	16.990	183,050.260
INNOGY SE	9,769	33.130	323,646.970
CNH INDUSTRIAL NV	78,645	12.010	944,526.450
AIB GROUP PLC	52,322	5.480	286,724.560
LINDE AG-TENDER	13,375	210.000	2,808,750.000
REPSOL SA-RTS	80,598	0.402	32,400.390
NN GROUP NV	21,965	37.850	831,375.250
ZALANDO SE	6,674	43.900	292,988.600
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	82,323	18.580	1,529,561.340
AENA SME SA	5,256	175.500	922,428.000
ABN AMRO GROUP NV	29,129	28.170	820,563.930
EXOR NV	9,441	59.250	559,379.250

	ALTICE NV-A	43,403	9.684	420,314.650	
	COVESTRO AG	8,603	88.460	761,021.380	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	54,880	95.270	5,228,417.600	
	POSTE ITALIANE SPA	40,015	6.470	258,897.050	
	AMUNDI SA	3,894	73.500	286,209.000	
	SCHAEFFLER AG	12,644	15.275	193,137.100	
	UNIPER SE	13,897	25.500	354,373.500	
ユーロ 小計		14,128,181		294,622,450.110 (39,255,495,252)	
香港・ドル	ASM PACIFIC TECH	16,600	110.300	1,830,980.000	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	164,000	20.000	3,280,000.000	
	BANK OF EAST ASIA	76,260	34.000	2,592,840.000	
	CLP HOLDINGS LTD	119,500	79.450	9,494,275.000	
	PCCW LTD	331,000	4.770	1,578,870.000	
	LI & FUNG LTD	532,400	4.300	2,289,320.000	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	49,000	66.600	3,263,400.000	
	HONG KONG EXCHANGES &CLEAR	79,040	271.800	21,483,072.000	
	MTR CORP	118,500	46.250	5,480,625.000	
	HANG LUNG GROUP LTD	63,000	30.850	1,943,550.000	
	HANG SENG BANK LTD	56,000	192.100	10,757,600.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	83,844	52.550	4,406,002.200	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	96,500	66.550	6,422,075.000	
	(THE) WHARF HOLDINGS LTD	95,750	33.350	3,193,262.500	
	HONG KONG & CHINA GAS	610,046	15.420	9,406,909.320	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	50,000	43.950	2,197,500.000	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	164,000	60.500	9,922,000.000	
	KERRY PROPERTIES LTD	33,000	36.150	1,192,950.000	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	289,000	39.800	11,502,200.000	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HOLDINGS	50,500	30.500	1,540,250.000	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	441,266	12.420	5,480,523.720	
	SINO LAND CO	255,400	14.560	3,718,624.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	103,000	133.100	13,709,300.000	
	SWIRE PACIFIC LTD A	30,000	77.800	2,334,000.000	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	113,500	52.300	5,936,050.000	
	WHEELLOCK & CO LTD	56,000	60.000	3,360,000.000	
	KINGSTON FINANCIAL GROUP LTD	258,000	8.230	2,123,340.000	
	MINTH GROUP LTD	44,000	48.750	2,145,000.000	
	SJM HOLDINGS LTD	299,000	7.390	2,209,610.000	
	WYNN MACAU LTD	124,400	23.800	2,960,720.000	
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	64,800	22.950	1,487,160.000	
	AIA GROUP LTD	849,627	66.600	56,585,158.200	

HKT TRUST / HKT LTD	282,000	10.000	2,820,000.000	
SANDS CHINA LTD	169,200	41.450	7,013,340.000	
SWIRE PROPERTIES LTD	104,200	26.300	2,740,460.000	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT CO LTD	95,750	52.800	5,055,600.000	
HK ELECTRIC INVESTMENTS & HK ELECTRIC INVESTMENTS LTD	230,000	7.150	1,644,500.000	
WH GROUP LTD	530,500	9.160	4,859,380.000	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	199,332	98.950	19,723,901.400	
CK ASSET HOLDINGS LTD	198,832	72.250	14,365,612.000	
香港・ドル 小計	7,526,747		274,049,960.340 (3,905,211,935)	
合計	82,231,331		292,877,407,767 (292,877,407,767)	

## (2) 株式以外の有価証券

平成30年1月11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	63,819.000	636,275.430	
		GOODMAN GROUP	121,619.000	996,059.610	
		GPT GROUP	144,955.000	734,921.850	
		LENDLEASE GROUP	37,363.000	594,071.700	
		MIRVAC GROUP	295,783.000	671,427.410	
		SCENTRE GROUP	383,688.000	1,576,957.680	
		STOCKLAND	126,459.000	551,361.240	
		VICINITY CENTRES	270,443.000	722,082.810	
		WESTFIELD CORP	140,035.000	1,310,727.600	
	オーストラリア・ドル 小計		1,584,164.000	7,793,885.330 (684,225,193)	
シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	200,806.000	558,240.680		
	CAPITALAND MALL TRUST	199,000.000	417,900.000		
	SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	192,100.000	424,541.000		
シンガポール・ドル 小計		591,906.000	1,400,681.680 (117,139,009)		
投資信託受益証券 合計			2,176,070	801,364,202 (801,364,202)	
投資証券	アメリカ・ドル	AGNC INVESTMENT CORP	25,741.000	506,068.060	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	7,304.000	915,045.120	
		AMERICAN TOWER CORP	30,693.000	4,223,663.730	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	77,528.000	881,493.360	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	10,463.000	1,788,754.480	
		BOSTON PROPERTIES INC	11,168.000	1,392,091.200	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	21,975.000	374,893.500	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	6,285.000	544,343.850	
		COLONY NORTHSTAR INC	39,311.000	430,455.450	

	CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	28,166.000	2,955,176.720	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	15,118.000	1,656,025.720	
	DUKE REALTY TRUST	24,470.000	633,038.900	
	EQUINIX INC	5,753.000	2,548,579.000	
	EQUITY RESIDENTIAL	27,070.000	1,663,722.200	
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	4,524.000	1,050,563.280	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	8,141.000	670,492.760	
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	4,144.000	513,192.960	
	GGP INC	43,463.000	1,013,557.160	
	HCP INC	34,130.000	831,406.800	
	HOST HOTELS & RESORTS INC	51,147.000	1,056,185.550	
	INVITATION HOMES INC	22,567.000	516,332.960	
	IRON MOUNTAIN INC	19,265.000	704,135.750	
	KIMCO REALTY	32,980.000	564,947.400	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	11,649.000	480,404.760	
	MID AMERICA	8,123.000	762,830.930	
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	10,544.000	425,661.280	
	PROLOGIS INC	38,966.000	2,394,071.040	
	PUBLIC STORAGE	11,151.000	2,186,822.610	
	REALTY INCOME CORP	21,640.000	1,148,218.400	
	REGENCY CENTERS CORP	11,294.000	737,949.960	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	8,169.000	1,314,310.410	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	22,664.000	3,739,106.720	
	SL GREEN	5,382.000	517,102.560	
	THE MACERICH COMPANY	9,014.000	568,152.420	
	UDR INC	17,458.000	635,645.780	
	VENTAS INC	25,041.000	1,423,330.440	
	VEREIT INC	72,429.000	543,941.790	
	VORNADO REALTY TRUST	12,211.000	887,251.260	
	WELLTOWER INC	26,516.000	1,609,786.360	
	WEYERHAEUSER CO	51,939.000	1,809,035.370	
アメリカ・ドル 小計		915,596.000	48,617,788.000 (5,419,424,829)	
イギリス・ポンド	BRITISH LAND CO PLC	71,871.000	484,841.760	
	HAMMERSON PLC	58,616.000	307,382.300	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	37,974.000	373,436.310	
	SEGRO PLC	61,113.000	351,399.750	
イギリス・ポンド 小計		229,574.000	1,517,060.120 (228,438,913)	
カナダ・ドル	H & R REAL ESTATE INVESTMENT	10,748.000	228,824.920	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	9,675.000	232,683.750	
	SMARTCENTRES REIT	2,582.000	78,983.380	
カナダ・ドル 小計		23,005.000	540,492.050 (48,065,958)	
ユーロ	FONCIERE DES REGIONS	2,343.000	213,213.000	

	GECINA SA	3,670.000	568,850.000	
	ICADE	2,234.000	183,746.500	
	KLEPIERRE	17,042.000	610,103.600	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	7,221.000	1,498,357.500	
	ユーロ 小計	32,510.000	3,074,270.600 (409,615,815)	
	香港・ドル LINK REIT	163,500.000	11,780,175.000	
	香港・ドル 小計	163,500.000	11,780,175.000 (167,867,494)	
投資証券 合計		1,364,185	6,273,413,009 (6,273,413,009)	
合計			7,074,777,211 (7,074,777,211)	

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

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入 投資信託受益 証券 時価比率	組入 投資証券 時価比率	有価証券の 合計金額 に対する比 率
アメリカ・ドル	株式 602銘柄	61.94%	-%	-%	65.56%
	投資証券 40銘柄	-%	-%	1.76%	
イギリス・ポンド	株式 99銘柄	6.87%	-%	-%	7.15%
	投資証券 4銘柄	-%	-%	0.07%	
イスラエル・シケル	株式 8銘柄	0.10%	-%	-%	0.11%
オーストラリア・ドル	株式 60銘柄	2.50%	-%	-%	2.80%
	投資信託 受益証券 9銘柄	-%	0.22%	-%	
カナダ・ドル	株式 86銘柄	3.71%	-%	-%	3.83%
	投資証券 3銘柄	-%	-%	0.02%	
シンガポール・ドル	株式 21銘柄	0.49%	-%	-%	0.55%
	投資信託 受益証券 3銘柄	-%	0.04%	-%	
スイス・フラン	株式 36銘柄	3.15%	-%	-%	3.24%
スウェーデン・クローナ	株式 31銘柄	1.08%	-%	-%	1.11%
デンマーク・クローネ	株式 18銘柄	0.72%	-%	-%	0.74%
ニュージーランド・ドル	株式 4銘柄	0.06%	-%	-%	0.07%
ノルウェー・クローネ	株式 8銘柄	0.26%	-%	-%	0.26%
ユーロ	株式 239銘柄	12.72%	-%	-%	13.22%
	投資証券 5銘柄	-%	-%	0.13%	
香港・ドル	株式 40銘柄	1.27%	-%	-%	1.36%
	投資証券 1銘柄	-%	-%	0.05%	

(注) 「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

## 「外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

(単位:円)

科 目	注記 番号	平成29年1月11日現在	平成30年1月11日現在
資産の部			
流動資産			
預金		4,688,604,432	3,717,332,670
コール・ローン		446,562,725	254,275,738
国債証券		252,171,615,963	222,177,369,816
派生商品評価勘定		30,346	2,180,614
未収入金		-	3,113,657,238
未収利息		2,328,790,839	2,011,358,256
前払費用		39,280,294	47,148,515
流動資産合計		259,674,884,599	231,323,322,847
資産合計		259,674,884,599	231,323,322,847
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		-	12,998
未払解約金		292,699,000	366,282,000
流動負債合計		292,699,000	366,294,998
負債合計		292,699,000	366,294,998
純資産の部			
元本等			
元本	1	146,373,971,356	125,530,104,029
剰余金			
剰余金又は欠損金( )		113,008,214,243	105,426,923,820
元本等合計		259,382,185,599	230,957,027,849
純資産合計		259,382,185,599	230,957,027,849
負債純資産合計		259,674,884,599	231,323,322,847

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建資産及び負債は、決算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

項目	平成29年1月11日現在	平成30年1月11日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	157,146,877,456円	146,373,971,356円
同期中追加設定元本額	29,422,628,944円	23,047,727,819円
同期中一部解約元本額	40,195,535,044円	43,891,595,146円
元本の内訳		
ファンド名		
D I A M外国債券パッシブ・	5,040,953,548円	7,132,425,010円
ファンド		
M I T O ラップ型ファンド	13,192,943円	17,026,383円
（安定型）		
M I T O ラップ型ファンド	44,974,467円	43,780,396円
（中立型）		
M I T O ラップ型ファンド	68,941,452円	49,388,910円
（積極型）		
グローバル8資産ラップファン	39,306,534円	72,275,459円
ド（安定型）		
グローバル8資産ラップファン	43,503,107円	62,320,881円
ド（中立型）		
グローバル8資産ラップファン	35,942,474円	36,122,260円
ド（積極型）		
たわらノーロード 先進国債券	471,375,852円	1,355,092,120円
たわらノーロード 先進国債券	606,412円	606,412円
<ラップ向け>		
たわらノーロード バランス	- 円	13,868,205円
（8資産均等型）		
たわらノーロード バランス	- 円	71,706円
（堅実型）		



たわらノーロード バランス (標準型)	- 円	397,672円
たわらノーロード バランス (積極型)	- 円	224,963円
たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(保守型)	- 円	21,628円
たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(安定型)	- 円	38,388円
たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(安定成長 型)	- 円	21,628円
D I A M外国債券インデックス ファンド< D C年金>	4,806,701,175円	5,000,335,109円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 1 安定型	447,249,853円	465,467,784円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 2 安定・成長型	1,429,659,466円	1,493,783,080円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 3 成長型	1,468,558,554円	1,625,017,909円
D I A M D C バランス3 0 インデックスファンド	361,249,152円	358,729,368円
D I A M D C バランス5 0 インデックスファンド	744,657,416円	770,825,404円
D I A M D C バランス7 0 インデックスファンド	543,187,678円	615,670,534円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型>	25,724,429円	23,857,963円
マネックス資産設計ファンド< 育成型>	566,630,602円	590,083,690円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	12,108,735円	8,124,972円
D I A M D C 8 資産バラン スファンド(新興国1 0)	13,202,419円	16,890,765円
D I A M D C 8 資産バラン スファンド(新興国2 0)	23,247,466円	37,165,229円
D I A M D C 8 資産バラン スファンド(新興国3 0)	43,834,058円	68,111,461円
クルーズコントロール D I A M 8 資産バランスファ ンドN< D C年金>	3,171,032,527円	4,310,597,545円
D I A M D C バランス・F (成長型)	41,442,826円	64,088,822円
クルーズコントロール< D C年 金>	59,799,525円	113,195,260円
D I A Mコア資産設計ファンド (堅実型)	1,247,813円	1,504,754円
D I A Mコア資産設計ファンド (積極型)	18,741,599円	13,258,543円
D I A Mコア資産設計ファンド (積極型)	41,611,504円	30,164,786円
ダイナミック・ナビゲーション	333,384円	387,823円
D I A Mパッシブ資産分散ファ ンド	1,588,029,486円	1,427,367,462円

D I A M為替フルヘッジ型外国債券パッシブ私募ファンド(適格機関投資家向け)	7,019,389,220円	6,914,807,354円
D I A M外国債券パッシブファンド(適格機関投資家向け)	4,329,960,127円	4,015,164,258円
外国債券パッシブファンド(適格機関投資家限定)	4,774,687,969円	3,769,097,133円
D I A Mアクティブアロケーション私募ファンド(適格機関投資家限定)	345,326,925円	- 円
先進国債券パッシブファンド(適格機関投資家限定)	- 円	576,382,992円
D I A Mワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	112,336,075円	105,167,751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)	1,338,912,580円	980,291,866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)	849,585,326円	716,967,111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)	83,610,208円	56,481,829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)	155,742,527円	108,319,378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)	38,716,013円	29,458,898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)	14,338,581円	12,199,263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)	2,785,838,183円	73,537,596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)	712,401,380円	87,294,718円
D I A Mバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	4,524,007,417円	3,805,445,836円
D I A Mバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	2,758,132,476円	2,520,252,961円
D I A Mバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	4,613,589,990円	4,197,266,896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)	902,807,235円	747,764,373円
D I A Mグローバル・アセット・バランスVA2(適格機関投資家限定)	2,314,812,702円	532,270,006円

D I A M アクサ グローバル バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	4,189,811,725円	3,622,086,116円
D I A M世界アセットバランス ファンドVA(適格機関投資家 向け)	15,122,406,437円	10,441,980,855円
D I A Mグローバル 私募ファ ンド(適格機関投資家向け)	64,131,288円	13,975,529円
D I A M世界バランスファンド 55VA(適格機関投資家限 定)	2,126,670,676円	110,717,358円
D I A M世界バランスファンド 35VA(適格機関投資家限 定)	11,186,558,463円	3,669,493,348円
D I A M世界アセットバランス ファンド2VA(適格機関投資 家限定)	16,005,578,546円	15,122,513,442円
D I A M世界アセットバランス ファンド3VA(適格機関投資 家限定)	20,316,219,428円	19,692,761,593円
D I A Mバランス30VA(適 格機関投資家限定)	25,650,753円	2,307,939円
D I A Mバランス50VA(適 格機関投資家限定)	1,779,956円	33,620,094円
D I A Mバランス70VA(適 格機関投資家限定)	6,543,483円	5,459,009円
D I A M世界アセットバランス ファンド4VA(適格機関投資 家限定)	18,222,174,819円	17,516,462,651円
D I A M世界バランス25VA (適格機関投資家限定)	123,265,543円	106,474,190円
D I A Mバランス20VA(適 格機関投資家限定)	141,553,653円	105,797,212円
D I A Mバランス40VA(適 格機関投資家限定)	234,433円	19,813,336円
D I A Mバランス60VA(適 格機関投資家限定)	150,763円	160,854円
計	146,373,971,356円	125,530,104,029円
2. 受益権の総数	146,373,971,356口	125,530,104,029口

## （金融商品に関する注記）

## 1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成28年1月13日 至 平成29年1月11日	自 平成29年1月12日 至 平成30年1月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成29年1月11日現在	平成30年1月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	平成29年1月11日現在	平成30年1月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
国債証券	6,836,814,082	1,586,668,810
合計	6,836,814,082	1,586,668,810

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成28年2月23日から平成29年1月11日まで及び平成29年2月22日から平成30年1月11日まで）に対応する金額であります。

## （デリバティブ取引等に関する注記）

## 通貨関連

種類	平成29年1月11日 現在				平成30年1月11日 現在			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	1,355,543,776	-	1,355,513,430	30,346	3,566,821,676	-	3,564,654,060	2,167,616
アメリカ・ドル	705,228,471	-	705,207,900	20,571	1,585,098,722	-	1,583,921,020	1,177,702
イギリス・ポンド	130,105,986	-	130,100,460	5,526	263,487,000	-	263,480,000	7,000
オーストラリア・ドル	-	-	-	-	99,168,800	-	99,168,800	-
カナダ・ドル	-	-	-	-	65,971,220	-	65,971,220	-
スウェーデン・クローナ	-	-	-	-	65,954,060	-	65,954,060	-
ユーロ	520,209,319	-	520,205,070	4,249	1,487,141,874	-	1,486,158,960	982,914
合計	1,355,543,776	-	1,355,513,430	30,346	3,566,821,676	-	3,564,654,060	2,167,616

## （注）時価の算定方法

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

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

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

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

- 2．計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

- 3．換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （1口当たり情報に関する注記）

	平成29年1月11日現在	平成30年1月11日現在
1口当たり純資産額	1,7721円	1,8399円
（1万口当たり純資産額）	（17,721円）	（18,399円）

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

平成30年1月11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 0.875 07/31/19	15,000,000.000	14,760,900.000	
		US T N/B 1.0 08/31/19	13,500,000.000	13,297,500.000	
		US T N/B 1.0 09/30/19	15,000,000.000	14,760,300.000	
		US T N/B 1.0 11/30/19	6,500,000.000	6,384,950.000	
		US T N/B 1.125 05/31/19	11,000,000.000	10,880,870.000	
		US T N/B 1.25 01/31/20	10,800,000.000	10,641,348.000	
		US T N/B 1.25 10/31/19	15,000,000.000	14,811,900.000	
		US T N/B 1.375 01/31/20	8,600,000.000	8,496,456.000	
		US T N/B 1.375 02/28/19	13,000,000.000	12,927,850.000	
		US T N/B 1.375 03/31/20	6,300,000.000	6,215,328.000	
		US T N/B 1.375 04/30/20	12,000,000.000	11,831,160.000	
		US T N/B 1.375 05/31/20	3,500,000.000	3,448,025.000	
		US T N/B 1.375 06/30/23	7,000,000.000	6,645,590.000	
		US T N/B 1.375 09/30/23	11,000,000.000	10,404,350.000	
		US T N/B 1.5 08/15/26	7,000,000.000	6,443,220.000	
		US T N/B 1.5 12/31/18	1,600,000.000	1,594,992.000	
		US T N/B 1.625 02/15/26	5,500,000.000	5,141,620.000	
		US T N/B 1.625 03/31/19	15,000,000.000	14,950,650.000	
		US T N/B 1.625 05/15/26	8,500,000.000	7,924,210.000	
		US T N/B 1.625 08/15/22	9,500,000.000	9,229,820.000	
		US T N/B 1.625 11/15/22	7,500,000.000	7,267,050.000	
		US T N/B 1.75 01/31/23	5,000,000.000	4,860,500.000	
		US T N/B 1.75 03/31/22	11,700,000.000	11,461,320.000	
		US T N/B 1.75 05/15/22	11,600,000.000	11,358,024.000	
		US T N/B 1.75 05/15/23	7,000,000.000	6,787,760.000	
		US T N/B 1.75 09/30/22	12,500,000.000	12,188,375.000	
		US T N/B 1.75 10/31/20	6,000,000.000	5,950,260.000	
		US T N/B 1.75 12/31/20	9,000,000.000	8,912,790.000	
		US T N/B 1.875 06/30/20	11,000,000.000	10,960,400.000	
		US T N/B 1.875 08/31/22	12,000,000.000	11,777,760.000	
		US T N/B 1.875 08/31/24	10,000,000.000	9,650,000.000	
		US T N/B 2.0 02/15/22	17,500,000.000	17,345,475.000	
		US T N/B 2.0 02/15/23	9,500,000.000	9,347,050.000	
		US T N/B 2.0 02/15/25	9,500,000.000	9,206,070.000	
US T N/B 2.0 05/31/21	12,000,000.000	11,939,040.000			
US T N/B 2.0 05/31/24	10,000,000.000	9,739,800.000			
US T N/B 2.0 08/15/25	9,000,000.000	8,693,370.000			
US T N/B 2.0 09/30/20	6,000,000.000	5,992,920.000			
US T N/B 2.0 11/15/21	10,400,000.000	10,326,368.000			
US T N/B 2.0 11/15/26	11,000,000.000	10,529,860.000			



US T N/B 2.0 11/30/20	10,500,000.000	10,480,260.000	
US T N/B 2.125 01/31/21	8,000,000.000	8,005,600.000	
US T N/B 2.125 05/15/25	5,000,000.000	4,880,850.000	
US T N/B 2.125 06/30/22	9,500,000.000	9,438,345.000	
US T N/B 2.125 08/15/21	11,000,000.000	10,978,440.000	
US T N/B 2.125 08/31/20	3,000,000.000	3,006,090.000	
US T N/B 2.125 09/30/21	10,000,000.000	9,972,600.000	
US T N/B 2.125 09/30/24	10,000,000.000	9,792,100.000	
US T N/B 2.125 12/31/21	15,700,000.000	15,643,480.000	
US T N/B 2.125 12/31/22	8,000,000.000	7,924,320.000	
US T N/B 2.25 02/15/27	12,000,000.000	11,705,520.000	
US T N/B 2.25 03/31/21	11,500,000.000	11,542,205.000	
US T N/B 2.25 08/15/27	8,000,000.000	7,795,600.000	
US T N/B 2.25 08/15/46	5,500,000.000	4,811,620.000	
US T N/B 2.25 11/15/24	10,600,000.000	10,456,688.000	
US T N/B 2.25 11/15/25	10,000,000.000	9,817,100.000	
US T N/B 2.375 05/15/27	6,000,000.000	5,915,580.000	
US T N/B 2.375 08/15/24	8,900,000.000	8,857,547.000	
US T N/B 2.375 12/31/20	8,300,000.000	8,369,969.000	
US T N/B 2.5 02/15/45	5,500,000.000	5,100,370.000	
US T N/B 2.5 02/15/46	5,000,000.000	4,622,650.000	
US T N/B 2.5 05/15/24	9,000,000.000	9,032,310.000	
US T N/B 2.5 05/15/46	4,400,000.000	4,066,216.000	
US T N/B 2.5 08/15/23	8,000,000.000	8,054,960.000	
US T N/B 2.625 08/15/20	16,500,000.000	16,744,860.000	
US T N/B 2.625 11/15/20	6,000,000.000	6,091,140.000	
US T N/B 2.75 02/15/19	12,000,000.000	12,115,200.000	
US T N/B 2.75 02/15/24	9,400,000.000	9,573,994.000	
US T N/B 2.75 08/15/42	2,800,000.000	2,744,196.000	
US T N/B 2.75 08/15/47	4,100,000.000	3,977,000.000	
US T N/B 2.75 11/15/23	10,000,000.000	10,197,600.000	
US T N/B 2.75 11/15/42	3,400,000.000	3,330,402.000	
US T N/B 2.875 05/15/43	4,700,000.000	4,703,290.000	
US T N/B 2.875 08/15/45	4,900,000.000	4,887,750.000	
US T N/B 2.875 11/15/46	4,400,000.000	4,385,524.000	
US T N/B 3.0 02/15/47	5,200,000.000	5,312,528.000	
US T N/B 3.0 05/15/42	2,270,000.000	2,327,090.500	
US T N/B 3.0 05/15/45	4,700,000.000	4,804,622.000	
US T N/B 3.0 05/15/47	6,900,000.000	7,035,792.000	
US T N/B 3.0 11/15/44	5,100,000.000	5,215,107.000	
US T N/B 3.0 11/15/45	4,900,000.000	5,006,771.000	
US T N/B 3.125 02/15/42	1,800,000.000	1,885,356.000	
US T N/B 3.125 02/15/43	3,600,000.000	3,767,904.000	
US T N/B 3.125 05/15/19	13,000,000.000	13,208,130.000	
US T N/B 3.125 05/15/21	8,000,000.000	8,250,880.000	
US T N/B 3.125 08/15/44	4,600,000.000	4,813,072.000	
US T N/B 3.125 11/15/41	1,800,000.000	1,886,616.000	
US T N/B 3.375 05/15/44	5,200,000.000	5,683,028.000	
US T N/B 3.375 11/15/19	4,000,000.000	4,102,800.000	

	US T N/B 3.5 02/15/39	1,300,000.000	1,450,917.000	
	US T N/B 3.5 05/15/20	14,000,000.000	14,475,720.000	
	US T N/B 3.625 02/15/20	17,000,000.000	17,571,030.000	
	US T N/B 3.625 02/15/21	5,500,000.000	5,748,545.000	
	US T N/B 3.625 02/15/44	5,000,000.000	5,692,150.000	
	US T N/B 3.625 08/15/19	5,000,000.000	5,131,400.000	
	US T N/B 3.625 08/15/43	4,200,000.000	4,775,526.000	
	US T N/B 3.75 08/15/41	2,000,000.000	2,313,280.000	
	US T N/B 3.75 11/15/43	4,900,000.000	5,686,254.000	
	US T N/B 3.875 08/15/40	2,100,000.000	2,471,091.000	
	US T N/B 4.25 05/15/39	1,630,000.000	2,014,060.600	
	US T N/B 4.25 11/15/40	2,000,000.000	2,480,920.000	
	US T N/B 4.375 02/15/38	750,000.000	938,437.500	
	US T N/B 4.375 05/15/40	2,000,000.000	2,519,200.000	
	US T N/B 4.375 05/15/41	2,000,000.000	2,527,340.000	
	US T N/B 4.375 11/15/39	1,660,000.000	2,087,450.000	
	US T N/B 4.5 02/15/36	2,000,000.000	2,526,080.000	
	US T N/B 4.5 05/15/38	1,100,000.000	1,399,233.000	
	US T N/B 4.5 08/15/39	1,400,000.000	1,788,598.000	
	US T N/B 4.625 02/15/40	2,800,000.000	3,639,776.000	
	US T N/B 4.75 02/15/41	1,800,000.000	2,388,078.000	
	US T N/B 5.0 05/15/37	800,000.000	1,075,120.000	
	US T N/B 5.25 11/15/28	1,500,000.000	1,878,975.000	
	US T N/B 5.375 02/15/31	1,500,000.000	1,964,400.000	
	US T N/B 5.5 08/15/28	1,800,000.000	2,288,952.000	
	US T N/B 6.0 02/15/26	3,200,000.000	4,022,976.000	
	US T N/B 6.125 11/15/27	1,400,000.000	1,835,638.000	
	US T N/B 6.25 05/15/30	1,400,000.000	1,941,674.000	
	US T N/B 6.25 08/15/23	1,000,000.000	1,203,350.000	
	US T N/B 8.0 11/15/21	6,000,000.000	7,275,900.000	
	US T N/B 8.125 08/15/19	4,000,000.000	4,389,200.000	
	US T N/B 8.875 02/15/19	4,000,000.000	4,307,640.000	
	アメリカ・ドル 小計	852,910,000.000 (95,073,877,700)	859,215,214.600 (95,776,719,971)	
イギリス・ポンド	UK TREASURY 0.5 07/22/22	2,350,000.000	2,318,862.500	
	UK TREASURY 1.25 07/22/27	2,000,000.000	1,986,140.000	
	UK TREASURY 1.5 01/22/21	2,700,000.000	2,771,415.000	
	UK TREASURY 1.5 07/22/26	2,400,000.000	2,458,272.000	
	UK TREASURY 1.5 07/22/47	2,000,000.000	1,853,200.000	
	UK TREASURY 1.75 07/22/19	4,400,000.000	4,481,136.000	
	UK TREASURY 1.75 07/22/57	1,000,000.000	1,022,700.000	
	UK TREASURY 1.75 09/07/22	3,150,000.000	3,285,355.500	
	UK TREASURY 1.75 09/07/37	900,000.000	889,920.000	
	UK TREASURY 2.0 07/22/20	1,700,000.000	1,760,962.000	

UK TREASURY 2.0 09/07/25	2,400,000.000	2,559,000.000	
UK TREASURY 2.25 09/07/23	2,800,000.000	3,006,500.000	
UK TREASURY 2.5 07/22/65	1,650,000.000	2,135,892.000	
UK TREASURY 2.75 09/07/24	2,000,000.000	2,223,900.000	
UK TREASURY 3.25 01/22/44	2,800,000.000	3,599,680.000	
UK TREASURY 3.5 01/22/45	2,650,000.000	3,572,995.000	
UK TREASURY 3.5 07/22/68	2,000,000.000	3,305,000.000	
UK TREASURY 3.75 07/22/52	2,100,000.000	3,195,780.000	
UK TREASURY 3.75 09/07/19	2,200,000.000	2,316,644.000	
UK TREASURY 3.75 09/07/20	2,900,000.000	3,142,063.000	
UK TREASURY 3.75 09/07/21	1,850,000.000	2,056,127.000	
UK TREASURY 4.0 01/22/60	1,700,000.000	2,911,080.000	
UK TREASURY 4.0 03/07/22	2,300,000.000	2,609,419.000	
UK TREASURY 4.25 03/07/36	2,700,000.000	3,751,380.000	
UK TREASURY 4.25 06/07/32	1,850,000.000	2,479,925.000	
UK TREASURY 4.25 09/07/39	1,700,000.000	2,441,030.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/27	1,700,000.000	2,166,582.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/40	1,980,000.000	2,878,524.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/46	2,080,000.000	3,199,664.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/49	2,070,000.000	3,307,032.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/55	2,040,000.000	3,501,660.000	
UK TREASURY 4.5 03/07/19	400,000.000	418,288.000	
UK TREASURY 4.5 09/07/34	2,650,000.000	3,725,635.000	
UK TREASURY 4.5 12/07/42	2,200,000.000	3,368,420.000	
UK TREASURY 4.75 03/07/20	1,850,000.000	2,017,036.500	
UK TREASURY 4.75 12/07/30	1,700,000.000	2,345,320.000	
UK TREASURY 4.75 12/07/38	1,800,000.000	2,729,700.000	
UK TREASURY 5.0 03/07/25	2,030,000.000	2,582,281.800	
UK TREASURY 6.0 12/07/28	1,350,000.000	1,983,960.000	
UK TREASURY 8.0 06/07/21	1,700,000.000	2,120,529.000	
イギリス・ポンド 小計	83,750,000.000 (12,611,075,000)	104,479,010.300 (15,732,449,371)	

オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN 4.5 04/15/20	3,800,000.000	4,007,252.000	
	AUSTRALIAN 5.25 03/15/19	2,900,000.000	3,015,710.000	
	AUSTRALIAN 5.75 05/15/21	3,700,000.000	4,125,870.000	
	AUSTRALIAN 1.75 11/21/20	2,400,000.000	2,376,216.000	
	AUSTRALIAN 2.0 12/21/21	1,000,000.000	991,050.000	
	AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	2,400,000.000	2,288,160.000	
	AUSTRALIAN 2.75 04/21/24	3,100,000.000	3,147,616.000	
	AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	900,000.000	858,942.000	
	AUSTRALIAN 2.75 10/21/19	1,500,000.000	1,521,660.000	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	3,200,000.000	3,208,448.000	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/28	2,700,000.000	2,699,109.000	
	AUSTRALIAN 3.0 03/21/47	1,100,000.000	1,019,667.000	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	3,500,000.000	3,657,955.000	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	2,500,000.000	2,615,725.000	
	AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	900,000.000	902,574.000	
	AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	1,500,000.000	1,630,950.000	
	AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	4,000,000.000	4,480,240.000	
	AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	1,500,000.000	1,782,390.000	
	AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	3,600,000.000	4,212,144.000	
	AUSTRALIAN 5.5 04/21/23	3,000,000.000	3,462,780.000	
AUSTRALIAN 5.75 07/15/22	4,000,000.000	4,592,320.000		
オーストラリア・ドル 小計		53,200,000.000 (4,670,428,000)	56,596,778.000 (4,968,631,141)	
カナダ・ドル	CANADA 8.0 06/01/27	1,000,000.000	1,496,390.000	
	CANADA 0.75 08/01/19	7,200,000.000	7,094,088.000	
	CANADA 0.75 09/01/20	2,400,000.000	2,336,616.000	
	CANADA 0.75 09/01/21	600,000.000	576,534.000	
	CANADA 1.0 06/01/27	800,000.000	722,760.000	
	CANADA 1.0 09/01/22	800,000.000	767,000.000	
	CANADA 1.5 03/01/20	2,300,000.000	2,288,661.000	
	CANADA 1.5 06/01/23	2,300,000.000	2,244,685.000	
	CANADA 1.5 06/01/26	1,700,000.000	1,619,947.000	
	CANADA 1.75 03/01/19	1,500,000.000	1,503,270.000	
	CANADA 2.25 06/01/25	1,800,000.000	1,821,384.000	
	CANADA 2.5 06/01/24	1,600,000.000	1,645,216.000	
	CANADA 2.75 06/01/22	3,900,000.000	4,039,776.000	
	CANADA 2.75 12/01/48	1,450,000.000	1,566,870.000	
	CANADA 2.75 12/01/64	900,000.000	1,001,277.000	
	CANADA 3.25 06/01/21	4,700,000.000	4,917,657.000	
	CANADA 3.5 06/01/20	3,800,000.000	3,954,090.000	
	CANADA 3.5 12/01/45	1,900,000.000	2,325,087.000	
	CANADA 3.75 06/01/19	3,700,000.000	3,806,005.000	
	CANADA 4.0 06/01/41	1,800,000.000	2,317,698.000	
CANADA 5.0 06/01/37	1,600,000.000	2,262,736.000		
CANADA 5.75 06/01/29	1,600,000.000	2,170,384.000		
CANADA 5.75 06/01/33	1,550,000.000	2,247,965.000		
カナダ・ドル 小計		50,900,000.000	54,726,096.000	

		(4,526,537,000)	(4,866,791,717)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE 1.25 10/01/21	1,000,000.000	984,500.000	
	SINGAPORE 2.0 07/01/20	800,000.000	808,560.000	
	SINGAPORE 2.375 06/01/25	500,000.000	511,750.000	
	SINGAPORE 2.75 03/01/46	410,000.000	423,460.300	
	SINGAPORE 2.75 04/01/42	550,000.000	568,150.000	
	SINGAPORE 2.875 07/01/29	400,000.000	425,400.000	
	SINGAPORE 2.875 09/01/30	460,000.000	487,370.000	
	SINGAPORE 3.0 09/01/24	810,000.000	861,030.000	
	SINGAPORE 3.125 09/01/22	1,600,000.000	1,696,800.000	
	SINGAPORE 3.25 09/01/20	1,340,000.000	1,397,888.000	
	SINGAPORE 3.375 09/01/33	480,000.000	540,700.800	
	SINGAPORE 3.5 03/01/27	900,000.000	1,002,645.000	
シンガポール・ドル 小計		9,250,000.000 (773,577,500)	9,708,254.100 (811,901,290)	
スウェーデン・クローナ	SWEDEN 1.0 11/12/26	7,000,000.000	7,233,590.000	
	SWEDEN 1.5 11/13/23	9,700,000.000	10,437,103.000	
	SWEDEN 2.5 05/12/25	10,300,000.000	11,863,540.000	
	SWEDEN 3.5 03/30/39	6,200,000.000	8,385,686.000	
	SWEDEN 3.5 06/01/22	12,870,000.000	14,899,084.200	
	SWEDEN 4.25 03/12/19	8,800,000.000	9,319,904.000	
	SWEDEN 5.0 12/01/20	11,410,000.000	13,200,000.800	
スウェーデン・クローナ 小計		66,280,000.000 (902,070,800)	75,338,908.000 (1,025,362,538)	
デンマーク・クローネ	DENMARK 0.5 11/15/27	3,000,000.000	2,988,150.000	
	DENMARK 1.5 11/15/23	5,500,000.000	5,973,990.000	
	DENMARK 1.75 11/15/25	13,470,000.000	15,013,662.000	
	DENMARK 3.0 11/15/21	13,000,000.000	14,625,000.000	
	DENMARK 4.0 11/15/19	7,900,000.000	8,566,760.000	
	DENMARK 4.5 11/15/39	14,900,000.000	24,888,811.000	
デンマーク・クローネ 小計		57,770,000.000 (1,033,505,300)	72,056,373.000 (1,289,088,513)	
ノルウェー・クローネ	NORWAY 1.5 02/19/26	6,000,000.000	6,003,000.000	
	NORWAY 1.75 02/17/27	500,000.000	506,735.000	
	NORWAY 1.75 03/13/25	3,800,000.000	3,890,744.000	
	NORWAY 2.0 05/24/23	7,600,000.000	7,922,088.000	
	NORWAY 3.0 03/14/24	7,400,000.000	8,153,098.000	
	NORWAY 3.75 05/25/21	11,500,000.000	12,595,145.000	
	NORWAY 4.5 05/22/19	6,560,000.000	6,918,832.000	
ノルウェー・クローネ 小計		43,360,000.000 (598,801,600)	45,989,642.000 (635,116,956)	
ポーランド・ズロチ	POLAND 1.5 04/25/20	3,000,000.000	2,980,800.000	
	POLAND 1.75 07/25/21	2,200,000.000	2,167,440.000	
	POLAND 2.25 04/25/22	4,000,000.000	3,974,000.000	
	POLAND 2.5 07/25/26	4,200,000.000	3,971,310.000	
	POLAND 2.5 07/25/27	2,300,000.000	2,147,326.000	
	POLAND 3.25 07/25/19	2,500,000.000	2,566,100.000	
	POLAND 3.25 07/25/25	4,700,000.000	4,739,245.000	
	POLAND 4.0 10/25/23	3,100,000.000	3,310,335.000	

	POLAND 5.25 10/25/20	6,890,000.000	7,508,033.000	
	POLAND 5.5 10/25/19	2,690,000.000	2,864,850.000	
	POLAND 5.75 04/25/29	1,440,000.000	1,784,563.200	
	POLAND 5.75 09/23/22	3,200,000.000	3,660,800.000	
	POLAND 5.75 10/25/21	3,680,000.000	4,148,832.000	
ポーランド・ズロチ 小計		43,900,000.000 (1,402,166,000)	45,823,634.200 (1,463,606,876)	
マレーシア・リングgit	MALAYSIA 3.418 08/15/22	3,000,000.000	2,966,070.000	
	MALAYSIA 3.48 03/15/23	1,220,000.000	1,205,225.800	
	MALAYSIA 3.492 03/31/20	2,200,000.000	2,209,900.000	
	MALAYSIA 3.502 05/31/27	2,570,000.000	2,424,024.000	
	MALAYSIA 3.733 06/15/28	2,000,000.000	1,916,620.000	
	MALAYSIA 3.844 04/15/33	1,210,000.000	1,134,447.600	
	MALAYSIA 3.892 03/15/27	800,000.000	785,176.000	
	MALAYSIA 4.127 04/15/32	1,850,000.000	1,790,041.500	
	MALAYSIA 4.16 07/15/21	5,500,000.000	5,627,655.000	
	MALAYSIA 4.181 07/15/24	1,430,000.000	1,456,998.400	
	MALAYSIA 4.378 11/29/19	3,680,000.000	3,762,505.600	
	MALAYSIA 4.392 04/15/26	3,070,000.000	3,140,763.500	
	MALAYSIA 4.498 04/15/30	1,800,000.000	1,820,574.000	
	MALAYSIA 4.935 09/30/43	1,500,000.000	1,526,940.000	
	MALAYSIA 5.248 09/15/28	1,600,000.000	1,729,520.000	
マレーシア・リングgit 小計		33,430,000.000 (931,359,800)	33,496,461.400 (933,211,415)	
メキシコ・ペソ	MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	13,000,000.000	15,917,330.000	
	MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	35,000,000.000	39,701,900.000	
	MEXICAN BONDS 5.0 12/11/19	26,000,000.000	24,815,440.000	
	MEXICAN BONDS 5.75 03/05/26	5,000,000.000	4,459,700.000	
	MEXICAN BONDS 6.5 06/09/22	26,000,000.000	25,025,000.000	
	MEXICAN BONDS 6.5 06/10/21	38,000,000.000	36,853,540.000	
	MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	10,000,000.000	9,969,600.000	
	MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	10,000,000.000	10,080,300.000	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	22,000,000.000	21,955,120.000	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	7,000,000.000	7,029,120.000	
	MEXICAN BONDS 8.0 06/11/20	30,000,000.000	30,295,800.000	
	MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47	5,000,000.000	5,116,850.000	
	MEXICAN BONDS 8.0 12/07/23	14,000,000.000	14,336,980.000	

	MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	31,000,000.000	33,124,740.000	
	MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	15,000,000.000	16,175,400.000	
	メキシコ・ペソ 小計	287,000,000.000 (1,658,860,000)	294,856,820.000 (1,704,272,420)	
ユーロ	AUSTRIA 0.25 10/18/19	250,000.000	253,590.000	
	AUSTRIA 0.75 10/20/26	1,300,000.000	1,325,610.000	
	AUSTRIA 07/15/23	350,000.000	348,652.500	
	AUSTRIA 1.2 10/20/25	1,300,000.000	1,384,019.000	
	AUSTRIA 1.5 02/20/47	230,000.000	227,861.000	
	AUSTRIA 1.5 11/02/86	400,000.000	340,536.000	
	AUSTRIA 1.65 10/21/24	1,250,000.000	1,371,525.000	
	AUSTRIA 1.75 10/20/23	1,400,000.000	1,536,920.000	
	AUSTRIA 1.95 06/18/19	1,400,000.000	1,450,960.000	
	AUSTRIA 2.1 09/20/17	100,000.000	103,850.000	
	AUSTRIA 2.4 05/23/34	900,000.000	1,074,501.000	
	AUSTRIA 3.15 06/20/44	810,000.000	1,118,780.100	
	AUSTRIA 3.4 11/22/22	1,500,000.000	1,756,230.000	
	AUSTRIA 3.5 09/15/21	1,900,000.000	2,166,950.000	
	AUSTRIA 3.65 04/20/22	1,200,000.000	1,397,340.000	
	AUSTRIA 3.8 01/26/62	820,000.000	1,358,772.800	
	AUSTRIA 3.9 07/15/20	1,700,000.000	1,885,725.000	
	AUSTRIA 4.15 03/15/37	1,650,000.000	2,484,075.000	
	AUSTRIA 4.35 03/15/19	1,050,000.000	1,111,005.000	
	AUSTRIA 4.85 03/15/26	1,300,000.000	1,774,747.000	
	AUSTRIA 6.25 07/15/27	1,150,000.000	1,760,960.500	
	BELGIUM 0.2 10/22/23	150,000.000	150,930.000	
	BELGIUM 0.8 06/22/25	2,000,000.000	2,062,160.000	
	BELGIUM 0.8 06/22/27	800,000.000	821,680.000	
	BELGIUM 1.0 06/22/26	1,500,000.000	1,558,710.000	
	BELGIUM 1.0 06/22/31	1,300,000.000	1,289,405.000	
	BELGIUM 1.45 06/22/37	150,000.000	151,389.000	
	BELGIUM 1.6 06/22/47	900,000.000	872,379.000	
	BELGIUM 1.9 06/22/38	1,050,000.000	1,137,696.000	
	BELGIUM 2.15 06/22/66	700,000.000	728,210.000	
	BELGIUM 2.25 06/22/23	1,700,000.000	1,909,355.000	
	BELGIUM 2.6 06/22/24	2,600,000.000	3,004,170.000	
	BELGIUM 3.0 06/22/34	850,000.000	1,075,488.000	
	BELGIUM 3.0 09/28/19	1,300,000.000	1,378,715.000	
	BELGIUM 3.75 06/22/45	1,130,000.000	1,662,941.900	
	BELGIUM 3.75 09/28/20	2,200,000.000	2,450,294.000	
	BELGIUM 4.0 03/28/19	1,050,000.000	1,107,970.500	
	BELGIUM 4.0 03/28/22	1,800,000.000	2,123,406.000	
	BELGIUM 4.0 03/28/32	950,000.000	1,322,989.000	
	BELGIUM 4.25 03/28/41	2,000,000.000	3,094,740.000	
	BELGIUM 4.25 09/28/21	2,150,000.000	2,515,349.500	
	BELGIUM 4.25 09/28/22	1,950,000.000	2,354,293.500	
	BELGIUM 4.5 03/28/26	1,600,000.000	2,130,224.000	

BELGIUM 5.0 03/28/35	2,500,000.000	3,986,475.000	
BELGIUM 5.5 03/28/28	2,700,000.000	3,991,005.000	
BUNDESUBL 0.25 10/16/20	1,000,000.000	1,021,680.000	
BUNDESUBL 0.5 04/12/19	3,100,000.000	3,145,818.000	
BUNDESUBL 04/08/22	1,700,000.000	1,720,417.000	
BUNDESUBL 04/09/21	2,200,000.000	2,231,966.000	
BUNDESSCHAT 03/15/19	2,600,000.000	2,620,748.000	
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27	3,500,000.000	3,451,805.000	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25	2,700,000.000	2,767,608.000	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26	3,200,000.000	3,261,696.000	
DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27	1,700,000.000	1,704,097.000	
DEUTSCHLAND 08/15/26	3,300,000.000	3,208,326.000	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/24	2,600,000.000	2,758,912.000	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25	3,200,000.000	3,393,728.000	
DEUTSCHLAND 1.5 02/15/23	2,100,000.000	2,276,799.000	
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/23	2,500,000.000	2,715,150.000	
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/24	2,000,000.000	2,185,040.000	
DEUTSCHLAND 1.5 09/04/22	3,400,000.000	3,675,332.000	
DEUTSCHLAND 1.75 02/15/24	1,500,000.000	1,659,540.000	
DEUTSCHLAND 1.75 07/04/22	2,400,000.000	2,618,376.000	
DEUTSCHLAND 2.0 01/04/22	4,400,000.000	4,810,740.000	
DEUTSCHLAND 2.0 08/15/23	2,500,000.000	2,790,000.000	
DEUTSCHLAND 2.25 09/04/20	4,200,000.000	4,513,194.000	
DEUTSCHLAND 2.25 09/04/21	3,100,000.000	3,400,018.000	
DEUTSCHLAND 2.5 01/04/21	2,200,000.000	2,397,648.000	
DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	2,700,000.000	3,459,753.000	
DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	2,900,000.000	3,752,658.000	
DEUTSCHLAND 3.0 07/04/20	3,000,000.000	3,266,820.000	
DEUTSCHLAND 3.25 01/04/20	3,600,000.000	3,879,288.000	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/21	3,150,000.000	3,555,342.000	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	1,850,000.000	2,663,186.000	
DEUTSCHLAND 3.5 07/04/19	4,400,000.000	4,673,196.000	
DEUTSCHLAND 3.75 01/04/19	3,900,000.000	4,070,547.000	
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	2,800,000.000	4,245,892.000	
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	1,660,000.000	2,666,889.600	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	1,420,000.000	2,024,834.800	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	2,400,000.000	3,809,616.000	



DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	2,000,000.000	3,451,480.000	
DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	2,050,000.000	3,263,723.000	
DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	1,600,000.000	2,398,544.000	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/24	1,700,000.000	2,336,412.000	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	1,100,000.000	1,810,798.000	
DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	1,750,000.000	2,732,292.500	
FINLAND 0.375 09/15/20	500,000.000	510,985.000	
FINLAND 0.5 04/15/26	600,000.000	603,384.000	
FINLAND 0.75 04/15/31	450,000.000	440,212.500	
FINLAND 0.875 09/15/25	300,000.000	312,057.000	
FINLAND 09/15/23	230,000.000	228,935.100	
FINLAND 1.5 04/15/23	1,150,000.000	1,239,987.500	
FINLAND 1.625 09/15/22	400,000.000	432,832.000	
FINLAND 2.0 04/15/24	680,000.000	758,111.600	
FINLAND 2.625 07/04/42	660,000.000	855,775.800	
FINLAND 2.75 07/04/28	630,000.000	762,722.100	
FINLAND 3.375 04/15/20	980,000.000	1,065,661.800	
FINLAND 3.5 04/15/21	800,000.000	900,336.000	
FINLAND 4.0 07/04/25	800,000.000	1,017,192.000	
FINLAND 4.375 07/04/19	620,000.000	665,805.600	
FRANCE BTAN 8.5 04/25/23	1,700,000.000	2,466,632.000	
FRANCE OAT 0.25 11/25/26	3,000,000.000	2,916,660.000	
FRANCE OAT 0.5 05/25/25	3,700,000.000	3,746,324.000	
FRANCE OAT 0.5 05/25/26	2,200,000.000	2,202,860.000	
FRANCE OAT 0.5 11/25/19	500,000.000	509,645.000	
FRANCE OAT 0.75 05/25/28	1,000,000.000	993,510.000	
FRANCE OAT 05/25/22	3,000,000.000	3,017,610.000	
FRANCE OAT 1.0 05/25/19	1,700,000.000	1,736,397.000	
FRANCE OAT 1.0 05/25/27	4,000,000.000	4,122,080.000	
FRANCE OAT 1.0 11/25/25	3,700,000.000	3,870,237.000	
FRANCE OAT 1.25 05/25/36	2,900,000.000	2,831,270.000	
FRANCE OAT 1.5 05/25/31	4,200,000.000	4,422,012.000	
FRANCE OAT 1.75 05/25/23	4,400,000.000	4,810,916.000	
FRANCE OAT 1.75 05/25/66	1,250,000.000	1,177,150.000	
FRANCE OAT 1.75 06/25/39	1,000,000.000	1,062,900.000	
FRANCE OAT 1.75 11/25/24	4,500,000.000	4,960,215.000	
FRANCE OAT 2.25 05/25/24	4,000,000.000	4,529,640.000	
FRANCE OAT 2.25 10/25/22	4,000,000.000	4,448,520.000	
FRANCE OAT 2.5 05/25/30	3,900,000.000	4,590,612.000	
FRANCE OAT 2.5 10/25/20	8,700,000.000	9,412,095.000	
FRANCE OAT 2.75 10/25/27	4,940,000.000	5,901,126.400	
FRANCE OAT 3.0 04/25/22	5,300,000.000	6,025,040.000	
FRANCE OAT 3.25 05/25/45	3,000,000.000	4,029,990.000	
FRANCE OAT 3.25 10/25/21	5,200,000.000	5,896,644.000	
FRANCE OAT 3.5 04/25/20	8,300,000.000	9,061,276.000	

FRANCE OAT 3.5 04/25/26	4,840,000.000	6,052,904.000	
FRANCE OAT 3.75 04/25/21	6,300,000.000	7,152,516.000	
FRANCE OAT 3.75 10/25/19	6,600,000.000	7,114,206.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/55	2,400,000.000	3,770,880.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/60	1,840,000.000	2,970,643.200	
FRANCE OAT 4.0 10/25/38	3,200,000.000	4,700,672.000	
FRANCE OAT 4.25 04/25/19	2,600,000.000	2,761,746.000	
FRANCE OAT 4.25 10/25/23	5,900,000.000	7,331,399.000	
FRANCE OAT 4.5 04/25/41	3,900,000.000	6,195,969.000	
FRANCE OAT 4.75 04/25/35	3,100,000.000	4,794,212.000	
FRANCE OAT 5.5 04/25/29	3,650,000.000	5,488,760.500	
FRANCE OAT 5.75 10/25/32	3,800,000.000	6,214,406.000	
FRANCE OAT 6.0 10/25/25	3,590,000.000	5,164,394.500	
FRANCE OAT 8.5 10/25/19	4,200,000.000	4,886,406.000	
IRISH 0.8 03/15/22	1,150,000.000	1,194,551.000	
IRISH 1.0 05/15/26	1,350,000.000	1,388,961.000	
IRISH 1.7 05/15/37	550,000.000	563,986.500	
IRISH 2.0 02/18/45	890,000.000	929,996.600	
IRISH 2.4 05/15/30	1,100,000.000	1,263,042.000	
IRISH 3.4 03/18/24	930,000.000	1,109,183.100	
IRISH 3.9 03/20/23	650,000.000	778,609.000	
IRISH 4.4 06/18/19	480,000.000	513,902.400	
IRISH 4.5 04/18/20	1,130,000.000	1,259,882.200	
IRISH 5.0 10/18/20	1,000,000.000	1,152,030.000	
IRISH 5.4 03/13/25	1,260,000.000	1,699,840.800	
IRISH 5.9 10/18/19	950,000.000	1,058,224.000	
ITALY BTPS 0.35 11/01/21	1,700,000.000	1,698,453.000	
ITALY BTPS 0.65 10/15/23	2,100,000.000	2,052,708.000	
ITALY BTPS 0.65 11/01/20	3,600,000.000	3,655,440.000	
ITALY BTPS 0.95 03/15/23	2,500,000.000	2,510,250.000	
ITALY BTPS 1.05 12/01/19	2,000,000.000	2,045,740.000	
ITALY BTPS 1.25 12/01/26	2,000,000.000	1,901,540.000	
ITALY BTPS 1.35 04/15/22	2,500,000.000	2,578,350.000	
ITALY BTPS 1.45 09/15/22	1,500,000.000	1,550,715.000	
ITALY BTPS 1.5 06/01/25	2,500,000.000	2,488,325.000	
ITALY BTPS 1.6 06/01/26	1,500,000.000	1,477,950.000	
ITALY BTPS 1.65 03/01/32	2,800,000.000	2,524,116.000	
ITALY BTPS 1.85 05/15/24	600,000.000	621,000.000	
ITALY BTPS 2.0 12/01/25	2,700,000.000	2,764,098.000	
ITALY BTPS 2.05 08/01/27	1,000,000.000	1,002,160.000	
ITALY BTPS 2.15 12/15/21	2,200,000.000	2,344,980.000	
ITALY BTPS 2.2 06/01/27	2,800,000.000	2,850,680.000	
ITALY BTPS 2.25 09/01/36	1,500,000.000	1,382,250.000	
ITALY BTPS 2.45 09/01/33	1,100,000.000	1,072,632.000	
ITALY BTPS 2.5 12/01/24	4,000,000.000	4,280,680.000	
ITALY BTPS 2.7 03/01/47	1,650,000.000	1,489,620.000	
ITALY BTPS 2.8 03/01/67	1,400,000.000	1,196,020.000	
ITALY BTPS 3.25 09/01/46	2,000,000.000	2,025,460.000	
ITALY BTPS 3.5 03/01/30	2,950,000.000	3,292,701.500	

ITALY BTPS 3.75 03/01/21	3,300,000.000	3,666,597.000	
ITALY BTPS 3.75 05/01/21	2,300,000.000	2,564,270.000	
ITALY BTPS 3.75 08/01/21	2,700,000.000	3,025,890.000	
ITALY BTPS 3.75 09/01/24	1,900,000.000	2,189,465.000	
ITALY BTPS 4.0 02/01/37	3,500,000.000	4,100,250.000	
ITALY BTPS 4.0 09/01/20	3,700,000.000	4,084,800.000	
ITALY BTPS 4.25 03/01/20	4,600,000.000	5,028,260.000	
ITALY BTPS 4.25 09/01/19	6,400,000.000	6,868,288.000	
ITALY BTPS 4.5 02/01/20	4,500,000.000	4,927,950.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/19	5,600,000.000	5,905,760.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/24	3,700,000.000	4,418,244.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/26	2,900,000.000	3,513,640.000	
ITALY BTPS 4.5 05/01/23	1,400,000.000	1,660,148.000	
ITALY BTPS 4.75 08/01/23	2,900,000.000	3,495,950.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/21	3,900,000.000	4,519,710.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/28	2,900,000.000	3,606,556.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/44	2,050,000.000	2,613,750.000	
ITALY BTPS 5.0 03/01/22	4,400,000.000	5,205,640.000	
ITALY BTPS 5.0 03/01/25	2,400,000.000	2,972,136.000	
ITALY BTPS 5.0 08/01/34	3,200,000.000	4,184,320.000	
ITALY BTPS 5.0 08/01/39	2,700,000.000	3,544,830.000	
ITALY BTPS 5.0 09/01/40	2,750,000.000	3,586,000.000	
ITALY BTPS 5.25 11/01/29	3,500,000.000	4,567,850.000	
ITALY BTPS 5.5 09/01/22	3,900,000.000	4,758,585.000	
ITALY BTPS 5.5 11/01/22	2,500,000.000	3,061,000.000	
ITALY BTPS 5.75 02/01/33	2,400,000.000	3,330,720.000	
ITALY BTPS 6.0 05/01/31	3,700,000.000	5,192,580.000	
ITALY BTPS 6.5 11/01/27	3,300,000.000	4,611,090.000	
ITALY BTPS 7.25 11/01/26	1,800,000.000	2,592,180.000	
ITALY BTPS 9.0 11/01/23	1,900,000.000	2,744,170.000	
NETHERLANDS 0.25 01/15/20	2,150,000.000	2,187,281.000	
NETHERLANDS 0.25 07/15/25	1,700,000.000	1,695,631.000	
NETHERLANDS 0.5 07/15/26	1,900,000.000	1,912,350.000	
NETHERLANDS 0.75 07/15/27	1,450,000.000	1,473,954.000	
NETHERLANDS 01/15/22	1,900,000.000	1,919,209.000	
NETHERLANDS 1.25 01/15/19	560,000.000	570,802.400	
NETHERLANDS 1.75 07/15/23	2,000,000.000	2,195,860.000	
NETHERLANDS 2.0 07/15/24	2,000,000.000	2,242,240.000	
NETHERLANDS 2.25 07/15/22	1,550,000.000	1,722,530.500	
NETHERLANDS 2.5 01/15/33	1,740,000.000	2,125,305.600	
NETHERLANDS 2.75 01/15/47	1,540,000.000	2,070,560.800	

NETHERLANDS 3.25 07/15/21	2,060,000.000	2,327,594.000	
NETHERLANDS 3.5 07/15/20	1,670,000.000	1,840,173.000	
NETHERLANDS 3.75 01/15/23	1,700,000.000	2,029,970.000	
NETHERLANDS 3.75 01/15/42	1,800,000.000	2,764,026.000	
NETHERLANDS 4.0 01/15/37	1,850,000.000	2,792,760.000	
NETHERLANDS 4.0 07/15/19	2,750,000.000	2,943,875.000	
NETHERLANDS 5.5 01/15/28	1,600,000.000	2,376,000.000	
SPAIN 0.05 01/31/21	400,000.000	400,996.000	
SPAIN 0.4 04/30/22	1,900,000.000	1,913,775.000	
SPAIN 0.75 07/30/21	1,700,000.000	1,743,061.000	
SPAIN 1.15 07/30/20	2,100,000.000	2,170,560.000	
SPAIN 1.3 10/31/26	2,600,000.000	2,595,346.000	
SPAIN 1.4 01/31/20	400,000.000	413,592.000	
SPAIN 1.45 10/31/27	1,400,000.000	1,386,896.000	
SPAIN 1.5 04/30/27	2,600,000.000	2,610,140.000	
SPAIN 1.6 04/30/25	2,500,000.000	2,609,550.000	
SPAIN 1.95 04/30/26	2,500,000.000	2,636,425.000	
SPAIN 1.95 07/30/30	2,700,000.000	2,719,278.000	
SPAIN 2.15 10/31/25	2,600,000.000	2,795,988.000	
SPAIN 2.35 07/30/33	800,000.000	813,200.000	
SPAIN 2.75 04/30/19	1,400,000.000	1,457,750.000	
SPAIN 2.75 10/31/24	2,700,000.000	3,038,445.000	
SPAIN 2.9 10/31/46	1,500,000.000	1,521,150.000	
SPAIN 3.45 07/30/66	950,000.000	1,019,920.000	
SPAIN 3.8 04/30/24	2,700,000.000	3,208,815.000	
SPAIN 4.0 04/30/20	4,000,000.000	4,388,560.000	
SPAIN 4.2 01/31/37	2,380,000.000	3,054,777.600	
SPAIN 4.3 10/31/19	4,200,000.000	4,551,792.000	
SPAIN 4.4 10/31/23	2,300,000.000	2,798,525.000	
SPAIN 4.6 07/30/19	4,100,000.000	4,417,914.000	
SPAIN 4.65 07/30/25	2,600,000.000	3,283,644.000	
SPAIN 4.7 07/30/41	2,100,000.000	2,879,310.000	
SPAIN 4.8 01/31/24	2,200,000.000	2,739,946.000	
SPAIN 4.85 10/31/20	2,900,000.000	3,304,492.000	
SPAIN 4.9 07/30/40	2,000,000.000	2,793,000.000	
SPAIN 5.15 10/31/28	2,100,000.000	2,818,830.000	
SPAIN 5.15 10/31/44	1,700,000.000	2,470,559.000	
SPAIN 5.4 01/31/23	2,800,000.000	3,497,620.000	
SPAIN 5.5 04/30/21	3,600,000.000	4,251,060.000	
SPAIN 5.75 07/30/32	2,400,000.000	3,527,880.000	
SPAIN 5.85 01/31/22	3,700,000.000	4,553,220.000	
SPAIN 5.9 07/30/26	2,500,000.000	3,436,475.000	
SPAIN 6.0 01/31/29	3,000,000.000	4,299,330.000	
グーロ 小計	589,570,000.000 (78,554,306,800)	688,207,618.800 (91,696,783,129)	

南アフリカ・ランド	SOUTH AFRICA 10.5 12/21/26	25,000,000.000	27,859,000.000	
	SOUTH AFRICA 6.25 03/31/36	14,700,000.000	10,607,226.000	
	SOUTH AFRICA 6.5 02/28/41	11,760,000.000	8,336,546.400	
	SOUTH AFRICA 6.75 03/31/21	10,160,000.000	9,920,732.000	
	SOUTH AFRICA 7.0 02/28/31	11,600,000.000	9,621,040.000	
	SOUTH AFRICA 7.75 02/28/23	10,000,000.000	9,924,300.000	
	SOUTH AFRICA 8.0 01/31/30	13,110,000.000	12,004,302.600	
	SOUTH AFRICA 8.25 03/31/32	10,000,000.000	9,138,100.000	
	SOUTH AFRICA 8.5 01/31/37	10,910,000.000	9,859,367.000	
	SOUTH AFRICA 8.75 01/31/44	10,000,000.000	9,078,800.000	
	SOUTH AFRICA 8.75 02/28/48	17,000,000.000	15,447,560.000	
	SOUTH AFRICA 8.875 02/28/35	3,000,000.000	2,833,170.000	
	SOUTH AFRICA 9.0 01/31/40	8,000,000.000	7,494,240.000	
	南アフリカ・ランド 小計		155,240,000.000 (1,390,950,400)	142,124,384.000 (1,273,434,481)
国債証券 合計		204,127,515,900 (204,127,515,900)	222,177,369,816 (222,177,369,816)	
合計		204,127,515,900 (204,127,515,900)	222,177,369,816 (222,177,369,816)	

- (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 121銘柄	41.47%	43.11%
イギリス・ポンド	国債証券 40銘柄	6.81%	7.08%
オーストラリア・ドル	国債証券 21銘柄	2.15%	2.24%
カナダ・ドル	国債証券 23銘柄	2.11%	2.19%
シンガポール・ドル	国債証券 12銘柄	0.35%	0.37%
スウェーデン・クローナ	国債証券 7銘柄	0.44%	0.46%
デンマーク・クローネ	国債証券 6銘柄	0.56%	0.58%
ノルウェー・クローネ	国債証券 7銘柄	0.27%	0.29%
ポーランド・ズロチ	国債証券 13銘柄	0.63%	0.66%
マレーシア・リンギット	国債証券 15銘柄	0.40%	0.42%
メキシコ・ペソ	国債証券 15銘柄	0.74%	0.77%
ユーロ	国債証券 258銘柄	39.70%	41.27%
南アフリカ・ランド	国債証券 13銘柄	0.55%	0.57%

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

## 「外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

(単位:円)

科 目	注記 番号	平成29年1月11日現在	平成30年1月11日現在
資産の部			
流動資産			
預金		118,148,434	409,027,141
コール・ローン		56,903,374	81,777,811
投資信託受益証券		3,992,465,480	6,493,687,842
投資証券		32,056,893,880	48,340,326,547
派生商品評価勘定		4,380	-
未収入金		227,989,108	28,955
未収配当金		168,213,526	276,841,525
流動資産合計		36,620,618,182	55,601,689,821
資産合計		36,620,618,182	55,601,689,821
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		1,085	167,021
未払金		271,160,938	392,565,351
未払解約金		30,410,000	6,842,000
流動負債合計		301,572,023	399,574,372
負債合計		301,572,023	399,574,372
純資産の部			
元本等			
元本	1	30,797,163,241	46,402,765,697
剰余金			
剰余金又は欠損金( )		5,521,882,918	8,799,349,752
元本等合計		36,319,046,159	55,202,115,449
純資産合計		36,319,046,159	55,202,115,449
負債純資産合計		36,620,618,182	55,601,689,821

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

## （貸借対照表に関する注記）

項目	平成29年1月11日現在	平成30年1月11日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	26,797,491,574円	30,797,163,241円
同期中追加設定元本額	25,575,258,367円	32,142,557,355円
同期中一部解約元本額	21,575,586,700円	16,536,954,899円
元本の内訳		
ファンド名		
DIAM先進国REITインデックスファンド<為替ヘッジなし>（ファンドラップ）	109,705,308円	274,804,177円
DIAM先進国REITインデックスファンド<為替ヘッジあり>（ファンドラップ）	32,710,640円	67,370,416円
MITO ラップ型ファンド（安定型）	9,243,698円	5,909,943円
MITO ラップ型ファンド（中立型）	27,008,013円	15,182,713円
MITO ラップ型ファンド（積極型）	62,645,962円	39,369,153円



グローバル8資産ラップファンド(安定型)	27,539,180円	25,105,584円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	26,049,440円	21,627,261円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	32,662,026円	28,808,725円
たわらノーロード 先進国リート	1,048,687,394円	1,721,168,125円
たわらノーロード 先進国リート<ラップ向け>	92,960,487円	400,970,948円
たわらノーロード 先進国リート<為替ヘッジあり>	- 円	125,946,635円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	- 円	21,115,226円
たわらノーロード バランス(堅実型)	- 円	35,727円
たわらノーロード バランス(標準型)	- 円	758,305円
たわらノーロード バランス(積極型)	- 円	4,154,380円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定成長型)	- 円	50,006円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(成長型)	- 円	90,164円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(積極型)	- 円	122,951円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	24,182,932円	22,174,404円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	535,960,685円	539,811,573円
マネックス資産設計ファンドエボリューション	65,018,582円	78,019,353円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	20,292,719円	25,595,252円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	52,151,631円	84,478,084円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	117,262,106円	189,120,828円
投資のソムリエ	1,450,999,269円	6,351,242,412円
投資のソムリエ<DC年金>	42,813,620円	402,574,454円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	66,829,184円	96,943,349円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	17,460,669円	186,280,072円
ダイナミック・ナビゲーション	254,314円	286,863円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	385,174円	2,578,280,510円
ワールドアセットバランス(基本コース)	- 円	1,100,032,739円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	- 円	4,194,614,874円

投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2045)	- 円	840,948円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2055)	- 円	840,948円
リスク抑制世界8資産バランス ファンド(DC)	- 円	865,578円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2035)	- 円	820,132円
DIAMパッシブ資産分散ファ ンド	1,464,781,548円	1,113,784,191円
DIAM外国リートインデック スファンド<DC年金>	10,551,392円	20,739,627円
為替フルヘッジ型外国リート・ パッシブ・ファンド(適格機関 投資家限定)	624,304,901円	- 円
DIAMアクティブアローケー ション私募ファンド(適格機関 投資家限定)	138,121,629円	- 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)	4,222,058,627円	2,834,824,826円
DIAMグローバル 私募ファ ンド(適格機関投資家向け)	50,484,750円	11,580,328円
DIAM世界アセットバランス ファンド2VA(適格機関投資 家限定)	12,251,558,343円	11,354,337,336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)	3,059,696,034円	4,236,813,769円
DIAMグローバル・リスク ファクター・パリティ戦略ファ ンドII(適格機関投資家限 定)	4,551,175,471円	4,407,569,364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)	- 円	3,257,586,698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)	561,607,513円	560,116,746円
計	30,797,163,241円	46,402,765,697円
2. 受益権の総数	30,797,163,241口	46,402,765,697口

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成28年1月13日 至 平成29年1月11日	自 平成29年1月12日 至 平成30年1月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成29年1月11日現在	平成30年1月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	平成29年1月11日現在	平成30年1月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
投資信託受益証券	62,005,197	175,410,396
投資証券	579,946,476	1,673,572,217
合計	641,951,673	1,498,161,821

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成28年6月23日から平成29年1月11日まで及び平成29年6月23日から平成30年1月11日まで）に対応する金額であります。

## （デリバティブ取引等に関する注記）

## 通貨関連

種類	平成29年1月11日 現在				平成30年1月11日 現在			
	契約額等	うち 1年超	時価	評価損益	契約額等	うち 1年超	時価	評価損益
	（円）		（円）	（円）	（円）		（円）	（円）
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	43,419,880	-	43,415,500	4,380	-	-	-	-
イギリス・bond	7,063,525	-	7,063,000	525	-	-	-	-
オーストラリア・ドル	11,953,900	-	11,953,200	700	-	-	-	-
カナダ・ドル	3,502,200	-	3,502,000	200	-	-	-	-
シンガポール・ドル	4,518,976	-	4,518,640	336	-	-	-	-
ニュージーランド・ドル	2,264,304	-	2,264,080	224	-	-	-	-
ユーロ	10,529,023	-	10,528,980	43	-	-	-	-
香港・ドル	3,587,952	-	3,585,600	2,352	-	-	-	-
買 建	35,945,585	-	35,944,500	1,085	114,761,091	-	114,594,070	167,021
アメリカ・ドル	35,945,585	-	35,944,500	1,085	49,601,257	-	49,599,700	1,557
オーストラリア・ドル	-	-	-	-	32,503,570	-	32,478,600	24,970
カナダ・ドル	-	-	-	-	1,778,510	-	1,778,400	110
シンガポール・ドル	-	-	-	-	11,768,880	-	11,706,800	62,080
ニュージーランド・ドル	-	-	-	-	2,813,335	-	2,809,450	3,885
ユーロ	-	-	-	-	6,395,524	-	6,395,520	4
香港・ドル	-	-	-	-	9,900,015	-	9,825,600	74,415
合計	79,365,465	-	79,360,000	3,295	114,761,091	-	114,594,070	167,021

## （注）時価の算定方法

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

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

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

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

2. 計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （1口当たり情報に関する注記）

	平成29年1月11日現在	平成30年1月11日現在
1口当たり純資産額	1.1793円	1.1896円
（1万口当たり純資産額）	（11,793円）	（11,896円）

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

平成30年1月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	オーストラリア・ドル	ABACUS PROPERTY GROUP	136,265.000	535,521.450	
		ARENA REIT	112,770.000	248,094.000	
		BWP TRUST	210,558.000	644,307.480	
		CHARTER HALL GROUP	200,477.000	1,208,876.310	
		CHARTER HALL LONG WALE REIT	73,570.000	298,694.200	
		CHARTER HALL RETAIL REIT	139,186.000	563,703.300	
		CROMWELL PROPERTY GROUP	559,935.000	557,135.320	
		DEXUS	438,387.000	4,370,718.390	
		FOLKESTONE EDUCATION TRUST	90,510.000	254,333.100	
		GDI PROPERTY GROUP	228,315.000	285,393.750	
		GOODMAN GROUP	695,802.000	5,698,618.380	
		GPT GROUP	779,893.000	3,954,057.510	
		GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA	108,140.000	362,269.000	
		HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD	56,730.000	188,910.900	
		INDUSTRIA REIT	41,950.000	107,392.000	
		INGENIA COMMUNITIES GROUP	88,080.000	243,981.600	
		INVESTA OFFICE FUND	215,739.000	977,297.670	
		MIRVAC GROUP	1,597,370.000	3,626,029.900	
		NATIONAL STORAGE REIT	241,099.000	367,675.970	
		PROPERTYLINK GROUP	170,770.000	170,770.000	
		RURAL FUNDS GROUP	108,070.000	245,318.900	
		SCENTRE GROUP	2,309,238.000	9,490,968.180	
		SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	303,304.000	688,500.080	
		STOCKLAND	1,057,383.000	4,610,189.880	
		VICINITY CENTRES	1,385,410.000	3,699,044.700	
		VIVA ENERGY REIT	184,125.000	410,598.750	
		WESTFIELD CORP	829,396.000	7,763,146.560	
		オーストラリア・ドル 小計			12,362,472.000
カナダ・ドル		KILLAM APARTMENT REIT	17,754.000	255,480.060	
カナダ・ドル 小計			17,754.000	255,480.060 (22,719,842)	
シンガポール・ドル		AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL REIT	270,095.000	367,329.200	

		ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	320,000.000	283,200.000	
		ASCENDAS REAL ESTATE INVT	1,036,160.000	2,880,524.800	
		ASCOTT RESIDENCE TRUST	553,715.000	686,606.600	
		CACHE LOGISTICS TRUST	470,680.000	409,491.600	
		CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	1,122,679.000	2,245,358.000	
		CAPITALAND MALL TRUST	1,164,260.000	2,444,946.000	
		CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST	246,480.000	409,156.800	
		CDL HOSPITALITY TRUSTS	334,900.000	599,471.000	
		ESR REIT	477,000.000	274,275.000	
		FAR EAST HOSPITALITY TRUST	380,900.000	274,248.000	
		FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	242,800.000	339,920.000	
		FRASERS CENTREPOINT TRUST	251,200.000	570,224.000	
		FRASERS COMMERCIAL TRUST	240,080.000	360,120.000	
		FRASERS LOGISTICS & INDUSTRIAL TRUST	470,600.000	555,308.000	
		KEPPEL DC REIT	300,400.000	438,584.000	
		KEPPEL REIT	780,100.000	998,528.000	
		LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST	820,300.000	332,221.500	
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	823,400.000	1,375,078.000	
		MAPLETREE GREATER CHINA COMMERCIAL TRUST	772,200.000	988,416.000	
		MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	509,020.000	1,068,942.000	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	887,520.000	1,198,152.000	
		QUE HOSPITALITY TRUST	493,420.000	434,209.600	
		PARKWAY LIFE REIT	169,900.000	501,205.000	
		SABANA SHARIAH COMP IND REIT	335,900.000	136,039.500	
		SOILBUILD BUSINESS SPACE REIT	281,000.000	199,510.000	
		SPH REIT	266,300.000	287,604.000	
		STARHILL GLOBAL REIT	594,700.000	451,972.000	
		SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	963,190.000	2,128,649.900	
		シンガポール・ドル 小計	15,578,899.000	23,239,290.500 (1,943,501,864)	
		投資信託受益証券 合計	27,959,125	6,493,687,842 (6,493,687,842)	
投資証券	アメリカ・ドル	ACADIA REALTY TRUST	36,149.000	930,113.770	
		AGREE REALTY CORP	12,643.000	628,989.250	



ALEXANDER & BALDWIN INC	20,183.000	555,436.160	
ALEXANDER'S INC.	1,635.000	620,776.800	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	41,539.000	5,204,005.920	
AMERICAN ASSETS TRUST INC	17,937.000	652,009.950	
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	59,446.000	2,333,849.960	
AMERICAN HOMES 4 RENT	109,723.000	2,278,946.710	
APARTMENT INVT & MGMT CO-A	68,250.000	2,829,645.000	
APPLE HOSPITALITY REIT INC	91,485.000	1,782,127.800	
ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC	19,135.000	274,969.950	
ASHFORD HOSPITALITY PRIME INC	13,350.000	129,094.500	
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	36,770.000	246,359.000	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	59,972.000	10,252,813.120	
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH REIT INC	9,570.000	88,426.800	
BOSTON PROPERTIES INC	66,920.000	8,341,578.000	
BRANDYWINE REALTY TRUST	75,701.000	1,317,197.400	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	132,869.000	2,266,745.140	
CAMDEN PROPERTY TRUST	40,250.000	3,486,052.500	
CARETRUST REIT INC	33,160.000	526,249.200	
CBL & ASSOCIATES	75,036.000	423,953.400	
CEDAR REALTY TRUST INC	34,500.000	189,750.000	
CHATHAM LODGING TRUST	19,687.000	444,926.200	
CHESAPEAKE LODGING TRUST	25,992.000	706,982.400	
CITY OFFICE REIT INC	15,774.000	195,597.600	
CLIPPER REALTY INC	5,515.000	53,440.350	
COLONY NORTHSTAR INC	237,220.000	2,597,559.000	
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	51,707.000	1,132,900.370	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	7,520.000	197,024.000	
CORECIVIC INC	51,018.000	1,107,090.600	
CORESITE REALTY CORP	14,744.000	1,618,891.200	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	42,984.000	1,188,937.440	
COUSINS PROPERTIES INC	181,093.000	1,631,647.930	
CUBESMART	78,839.000	2,184,628.690	
CYRUSONE INC	39,781.000	2,271,892.910	
DCT INDUSTRIAL TRUST INC	40,584.000	2,289,343.440	
DDR CORP	131,985.000	1,131,111.450	

DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	86,509.000	990,528.050	
DIGITAL REALTY TRUST INC	89,230.000	9,774,254.200	
DOUGLAS EMMETT INC	69,278.000	2,697,685.320	
DUKE REALTY TRUST	154,642.000	4,000,588.540	
EAST GROUP	14,853.000	1,237,254.900	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	19,261.000	397,161.820	
EDUCATION REALTY TRUST INC	32,699.000	1,096,070.480	
EMPIRE STATE REALTY TRUST INC	55,460.000	1,067,605.000	
EPR PROPERTIES	27,630.000	1,657,247.400	
EQUITY COMMONWEALTH	53,509.000	1,588,682.210	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	38,162.000	3,252,928.880	
EQUITY RESIDENTIAL	159,611.000	9,809,692.060	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	28,645.000	6,651,941.900	
EXTRA SPACE STORAGE INC	54,656.000	4,501,468.160	
FARMLAND PARTNERS INC	14,870.000	128,625.500	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	31,501.000	3,901,083.840	
FIRST INDUSTRIAL RT	51,681.000	1,550,946.810	
FOREST CITY REALTY TRUST INC	115,961.000	2,759,871.800	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST INC	26,473.000	648,323.770	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	47,414.000	490,260.760	
GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	86,793.000	3,147,982.110	
GEO GROUP INC	53,519.000	1,218,092.440	
GETTY REALTY CORP	13,824.000	355,138.560	
GGP INC	270,856.000	6,316,361.920	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	11,770.000	234,105.300	
GLADSTONE LAND CORP	4,860.000	66,922.200	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	6,945.000	57,712.950	
GLOBAL NET LEASE INC	29,132.000	568,656.640	
GOVERNMENT PROPERTIES INCOME TRUST	42,862.000	762,943.600	
GRAMERCY PROPERTY TRSUT	70,085.000	1,864,261.000	
HCP INC	203,593.000	4,959,525.480	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	53,848.000	1,634,825.280	
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA INC	89,097.000	2,490,261.150	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	16,280.000	293,691.200	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	45,004.000	2,163,792.320	

HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	71,654.000	2,075,099.840	
HOST HOTELS & RESORTS INC	321,039.000	6,629,455.350	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	67,683.000	2,256,551.220	
INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	37,196.000	361,545.120	
INFREAREIT INC	17,452.000	319,546.120	
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	51,302.000	288,317.240	
INVITATION HOMES INC	123,947.000	2,835,907.360	
IRON MOUNTAIN INC	122,175.000	4,465,496.250	
ISTAR INC	30,049.000	335,947.820	
JBG SMITH PROPERTIES	40,282.000	1,343,807.520	
KILROY REALTY CORP	42,753.000	3,049,571.490	
KIMCO REALTY	184,939.000	3,168,005.070	
KITE REALTY GROUP TRUST	36,155.000	659,828.750	
LASALLE HOTEL PROPERTIES	48,843.000	1,386,652.770	
LEXINGTON REALTY TRUST	93,561.000	862,632.420	
LIBERTY PROPERTY TRUST	64,095.000	2,643,277.800	
LIFE STORAGE INC	20,309.000	1,717,532.130	
LTC PROPERTIES INC	17,111.000	704,973.200	
MACK CALI	38,828.000	812,281.760	
MANULIFE US REIT	407,100.000	390,816.000	
MEDEQUITIES REALTY TRUST INC	14,060.000	154,378.800	
MEDICAL PROPERTIES TRUST	158,767.000	2,051,269.640	
MID AMERICA	49,321.000	4,631,735.110	
MONMOUTH RE INVEST CP - CL A	32,449.000	562,665.660	
NATIONAL HEALTH INVS INC	17,918.000	1,274,865.700	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	66,104.000	2,668,618.480	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUST	21,843.000	569,665.440	
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP INC	33,990.000	255,264.900	
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	7,970.000	218,298.300	
NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP	24,752.000	314,597.920	
OMEGA HEALTHCARE INVS INC	86,316.000	2,296,868.760	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	6,990.000	175,099.500	
PARAMOUNT GROUP INC	88,030.000	1,338,936.300	
PARK HOTELS & RESORTS INC	70,243.000	2,025,808.120	

PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	29,765.000	1,122,735.800	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	30,759.000	359,572.710	
PHYSICIANS REALTY TRUST	77,315.000	1,294,253.100	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC	62,304.000	1,193,121.600	
PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES INC	16,202.000	304,435.580	
PROLOGIS INC	231,029.000	14,194,421.760	
PS BUSINESS PARKS	8,589.000	1,005,686.010	
PUBLIC STORAGE	64,993.000	12,745,777.230	
QTS REALTY TRUST INC	21,710.000	1,139,992.100	
QUALITY CARE PROPERTIES INC	40,954.000	552,469.460	
RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES	34,710.000	481,427.700	
REALTY INCOME CORP	122,234.000	6,485,736.040	
REGENCY CENTERS CORP	64,241.000	4,197,506.940	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	47,397.000	900,543.000	
RETAIL PROPERTIES OF AMERICA INC	97,989.000	1,241,520.630	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	33,644.000	957,508.240	
RLJ LODGING TRUST	75,347.000	1,676,470.750	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	22,077.000	1,595,284.020	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	76,876.000	1,400,680.720	
SAUL CENTERS INC	5,316.000	306,786.360	
SELECT INCOME REIT	27,842.000	646,212.820	
SENIOR HOUSING PPTYS TRUST	103,659.000	1,847,203.380	
SERITAGE GROWTH PROPERTIES	11,194.000	450,446.560	
SIMON PROPERTY GROUP INC	134,931.000	22,260,916.380	
SL GREEN	42,665.000	4,099,253.200	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	196,584.000	1,596,262.080	
STAG INDUSTRIAL INC	40,615.000	1,037,713.250	
STORE CAPITAL CORP	72,119.000	1,781,339.300	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	45,091.000	683,579.560	
SUN COMMUNITIES INC	34,478.000	3,055,785.140	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	97,175.000	1,620,879.000	
TANGER FACTORY OUTLET	40,811.000	1,003,950.600	
TAUBMAN CENTERS INC	26,178.000	1,605,758.520	
TERRENO REALTY CORP	23,577.000	801,853.770	
THE MACERICH COMPANY	47,106.000	2,969,091.180	

	TIER REIT INC	21,243.000	412,539.060	
	UDR INC	116,166.000	4,229,604.060	
	UMH PROPERTIES INC	14,218.000	197,772.380	
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	5,550.000	372,793.500	
	URBAN EDGE PROPERTIES	45,686.000	1,101,032.600	
	URSTADT BIDDLE PROPERTIES	12,820.000	259,092.200	
	VENTAS INC	154,433.000	8,777,971.720	
	VEREIT INC	423,299.000	3,178,975.490	
	VORNADO REALTY TRUST	74,814.000	5,435,985.240	
	WASHINGTON PRIME GROUP INC	81,089.000	560,324.990	
	WASHINGTON REIT	33,882.000	979,528.620	
	WEINGARTEN REALTY INVST	51,496.000	1,606,675.200	
	WELLTOWER INC	160,860.000	9,765,810.600	
	WHEELER REIT INC	3,490.000	27,291.800	
	WHITESTONE REIT	16,000.000	218,240.000	
	WP CAREY INC	46,457.000	3,042,468.930	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	46,089.000	1,002,896.640	
	アメリカ・ドル 小計	10,101,473.000	343,078,052.840 (38,242,910,550)	
	イギリス・ポンド			
	AEW UK LONG LEASE REIT PLC	37,060.000	37,430.600	
	ASSURA PLC	1,033,075.000	658,068.770	
	BIG YELLOW GROUP PLC	65,047.000	544,768.620	
	BRITISH LAND CO PLC	441,092.000	2,975,606.630	
	CAPITAL & REGIONAL PLC	209,340.000	121,417.200	
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	91,683.000	101,309.710	
	DERWENT LONDON PLC	47,897.000	1,446,489.400	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	256,161.000	233,106.510	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	141,566.000	946,368.710	
	HAMMERSON PLC	342,500.000	1,796,070.000	
	HANSTEEN HOLDINGS PLC	184,098.000	265,469.310	
	INTU PROPERTIES PLC	378,693.000	916,058.360	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	326,155.000	3,207,408.270	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	295,866.000	542,322.370	
	LXI REIT PLC	89,980.000	94,029.100	
	NEWRIVER REIT PLC	133,855.000	422,981.800	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC	252,225.000	290,058.750	
	RDI REIT PLC	568,540.000	205,811.480	
	REGIONAL REIT LTD	120,720.000	122,892.960	

	SAFESTORE HOLDINGS LTD	91,465.000	445,251.620	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT TRUST LTD	229,020.000	141,992.400	
	SEGRO PLC	432,334.000	2,485,920.500	
	SHAFTESBURY PLC	106,416.000	1,093,956.480	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	591,007.000	880,009.420	
	UNITE GROUP PLC	104,433.000	842,774.310	
	WORKSPACE GROUP PLC	50,770.000	508,715.400	
イギリス・ポンド 小計		6,620,998.000	21,326,288.680 (3,211,312,549)	
イスラエル・シェケル	REIT 1 LTD	74,038.000	1,152,031.280	
イスラエル・シェケル 小計		74,038.000	1,152,031.280 (37,498,618)	
カナダ・ドル	AGELLAN COMMERCIAL REIT	7,030.000	83,867.900	
	ALLIED PROPERTIES REIT	19,786.000	826,659.080	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	32,442.000	456,458.940	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	10,068.000	453,060.000	
	CANADIAN APT PPTYS REIT	29,216.000	1,050,607.360	
	CANADIAN REAL ESTATE INV TRUST	15,679.000	696,304.390	
	CHOICE PROPERTIES REIT	20,892.000	274,103.040	
	COMINAR REAL ESTATE INVT TR	39,731.000	571,331.780	
	CROMBIE REAL ESTATE INV	18,634.000	249,509.260	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	13,492.000	195,566.540	
	DREAM GLOBAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	37,760.000	451,609.600	
	DREAM INDUSTRIAL REIT	15,704.000	145,419.040	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV TRUST	16,280.000	361,741.600	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	10,170.000	504,126.900	
	H & R REAL ESTATE INVESTMENT	61,838.000	1,316,531.020	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	16,990.000	160,725.400	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT	6,120.000	93,636.000	
	MORGUARD REAL ESTATE INVT TR	9,085.000	127,916.800	
	NORTHVIEW APARTMENT REIT	10,535.000	259,582.400	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	21,789.000	246,869.370	
PURE INDUSTRIAL REAL ESTATE TRUST	65,936.000	533,422.240		

	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	69,234.000	1,665,077.700	
	SLATE OFFICE REIT	11,022.000	91,372.380	
	SLATE RETAIL REIT	7,890.000	102,017.700	
	SMARTCENTRES REIT	28,212.000	863,005.080	
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	13,569.000	108,144.930	
カナダ・ドル 小計		609,104.000	11,888,666.450 (1,057,259,107)	
ニュージーランド・ドル	ARGOSY PROPERTY LTD	347,267.000	371,575.690	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	456,596.000	623,253.540	
	INVESTORE PROPERTY LTD	82,700.000	122,396.000	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	620,095.000	846,429.670	
	PRECINCT PROPERTIES	412,285.000	560,707.600	
	STRIDE STAPLED GROUP	165,119.000	292,260.630	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	146,649.000	325,560.780	
ニュージーランド・ドル 小計		2,230,711.000	3,142,183.910 (252,254,524)	
ユーロ	AEDIFICA	7,760.000	605,280.000	
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	53,940.000	692,589.600	
	ALTAREA	1,629.000	340,461.000	
	AXIARE PATRIMONIO SOCIMI SA	29,138.000	535,556.440	
	BEFIMMO	9,943.000	533,939.100	
	BENI STABILI SPA	444,358.000	335,045.930	
	COFINIMMO SA	8,579.000	934,253.100	
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	21,204.000	784,548.000	
	FONCIERE DES REGIONS	23,134.000	2,105,194.000	
	GECINA SA	20,905.000	3,240,275.000	
	GREEN REIT PLC	301,033.000	487,673.460	
	HAMBORNER REIT AG	34,716.000	344,382.720	
	HIBERNIA REIT PLC	301,930.000	452,895.000	
	HISPANIA ACTIVOS INMOBILIARIOS SOCIMI SA	46,896.000	761,122.080	
	ICADE	19,423.000	1,597,541.750	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE	149,220.000	148,772.340	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA	139,086.000	1,169,713.260	
	INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	6,733.000	154,522.350	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES REIT PLC	147,360.000	221,629.440	
	KLEPIERRE	90,093.000	3,225,329.400	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA	40,885.000	366,329.600	
	MERCIALYS	23,851.000	435,519.260	

	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	145,191.000	1,650,821.670	
	NSI NV	8,080.000	283,204.000	
	RETAIL ESTATES	2,658.000	194,831.400	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	43,056.000	8,934,120.000	
	VASTNED RETAIL	6,681.000	271,582.650	
	WAREHOUSES DE PAUW	7,069.000	696,296.500	
	WERELDHAVE NV	17,479.000	714,891.100	
	ユーロ 小計	2,152,030.000	32,218,320.150 (4,292,768,977)	
香港・ドル	CHAMPION REIT	887,070.000	5,038,557.600	
	FORTUNE REAL ESTATE (HK)	598,000.000	5,818,540.000	
	LINK REIT	954,020.000	68,737,141.000	
	PROSPERITY REIT	521,000.000	1,797,450.000	
	SPRING REIT	402,000.000	1,354,740.000	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	429,000.000	2,325,180.000	
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	464,000.000	2,389,600.000	
	香港・ドル 小計	4,255,090.000	87,461,208.600 (1,246,322,222)	
投資証券 合計		26,043,444	48,340,326,547 (48,340,326,547)	
合計			54,834,014,389 (54,834,014,389)	

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



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

通貨	銘柄数	組入 投資信託受益証券 時価比率	組入 投資証券 時価比率	有価証券の合計 金額 に対する比率
アメリカ・ドル	投資証券 158銘柄	-%	69.28%	69.74%
イギリス・ポンド	投資証券 26銘柄	-%	5.82%	5.86%
イスラエル・シケル	投資証券 1銘柄	-%	0.07%	0.07%
オーストラリア・ドル	投資信託受益証券 27銘柄	8.20%	-%	8.26%
カナダ・ドル	投資信託受益証券 1銘柄	0.04%	-%	1.97%
	投資証券 26銘柄	-%	1.92%	
シンガポール・ドル	投資信託受益証券 29銘柄	3.52%	-%	3.54%
ニュージーランド・ドル	投資証券 7銘柄	-%	0.46%	0.46%
ユーロ	投資証券 29銘柄	-%	7.78%	7.83%
香港・ドル	投資証券 7銘柄	-%	2.26%	2.27%

(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」の状況

## 貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成29年1月11日現在	平成30年1月11日現在
資産の部			
流動資産			
預金		1,415,085,713	3,319,230,119
コール・ローン		36,818,327	107,218,956
株式		38,892,263,440	56,566,691,714
投資信託受益証券		237,553,412	291,974,467
投資証券		93,373,243	112,860,012
派生商品評価勘定		19,708,307	256,498,285
未収入金		269,818	704,406
未収配当金		35,348,958	80,996,576
差入委託証拠金		593,122,646	1,115,971,723
流動資産合計		41,323,543,864	61,852,146,258
資産合計		41,323,543,864	61,852,146,258
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		-	692,746
未払金		7,137	4,986
未払解約金		17,413,000	34,717,000
流動負債合計		17,420,137	35,414,732
負債合計		17,420,137	35,414,732
純資産の部			
元本等			
元本	1	42,090,393,658	47,332,729,770
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）	2	784,269,931	14,484,001,756
元本等合計		41,306,123,727	61,816,731,526
純資産合計		41,306,123,727	61,816,731,526
負債純資産合計		41,323,543,864	61,852,146,258

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

## (貸借対照表に関する注記)

項目	平成29年1月11日現在	平成30年1月11日現在
1 . 1 本報告書における開示対象ファ ンドの期首における当該親投資 信託の元本額	39,843,963,916円	42,090,393,658円
同期中追加設定元本額	21,379,188,384円	24,968,507,853円
同期中一部解約元本額	19,132,758,642円	19,726,171,741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 >	1,586,101,353円	2,967,430,561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)	123,401,986円	249,749,689円
M I T O ラップ型ファンド (安定型)	5,258,828円	6,258,056円
M I T O ラップ型ファンド (中立型)	17,811,790円	16,063,826円
M I T O ラップ型ファンド (積極型)	27,031,131円	18,157,927円
グローバル8資産ラップファン ド(安定型)	15,666,314円	26,539,962円
グローバル8資産ラップファン ド(中立型)	17,178,142円	22,849,313円
グローバル8資産ラップファン ド(積極型)	13,966,414円	13,271,449円
たわらノーロード 新興国株式	860,025,858円	3,190,937,167円
たわらノーロード 新興国株式 <ラップ向け>	302,701,465円	968,725,817円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	- 円	19,503,319円
たわらノーロード バランス (堅実型)	- 円	33,387円
たわらノーロード バランス (標準型)	- 円	138,526円
たわらノーロード バランス (積極型)	- 円	635,967円
たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(保守型)	- 円	7,956円
たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(安定型)	- 円	15,911円
たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(安定成長 型)	- 円	23,867円
たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(成長型)	- 円	39,778円
たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(積極型)	- 円	47,733円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	514,845,440円	462,876,236円
D I A M D C 8資産バラン スファンド(新興国10)	40,980,588円	40,575,086円

	DIAM DC 8資産バ ランスファンド(新興国20)	105,968,606円	133,439,313円
	DIAM DC 8資産バ ランスファンド(新興国30)	239,780,908円	298,885,378円
	投資のソムリエ クルーズコントロール	2,342,354,016円	1,371,356,428円
	投資のソムリエ<DC年金> クルーズコントロール	2,326,917,948円	2,170,535,683円
	投資のソムリエ<DC年金> DIAM 8資産バ ランスファ ンドN<DC年金> クルーズコントロール<DC年 金>	69,207,042円	87,148,003円
	DIAM 8資産バ ランスファ ンドN<DC年金> クルーズコントロール<DC年 金>	129,816,015円	157,925,647円
	DIAMコア資産設計ファンド (堅実型)	916,238円	757,609円
	DIAMコア資産設計ファンド (積極型)	34,356,782円	24,975,794円
	投資のソムリエ<DC年金>リ スク抑制型	76,409,693円	57,019,939円
	ダイナミック・ナビゲーション リスク抑制世界8資産バ ランス ファンド	11,904,041円	89,462,427円
	ワールドアセットバランス(基 本コース)	624,782円	1,743,533円
	ワールドアセットバランス(リ スク抑制コース)	260,124円	1,214,158,639円
	投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2045)	-円	1,627,105,199円
	投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2055)	-円	6,091,354,580円
	リスク抑制世界8資産バ ランス ファンド(DC)	-円	230,203円
	投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2035)	-円	230,203円
	エマージング株式パッシブファ ンドVA(適格機関投資家専 用)	-円	415,873円
	新興国株式パッシブ私募ファン ド(適格機関投資家限定)	6,552,597,287円	5,065,986,468円
	エマージング株式パッシブファ ンド(適格機関投資家限定)	189,946,132円	-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)	2,135,654,775円	2,638,488,353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)	14,887,853,093円	11,082,972,525円
	計	9,460,856,867円	7,214,416,019円
2.	受益権の総数	42,090,393,658円	47,332,729,770円
3.	2 元本の欠損	42,090,393,658円	47,332,729,770円
		貸借対照表上の純資産額が元本 総額を下回っており、その差額 は784,269,931円であります。	



## (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	自 平成28年1月13日 至 平成29年1月11日	自 平成29年1月12日 至 平成30年1月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。</p> <p>また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。</p>	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成29年1月11日現在	平成30年1月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左



## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	平成29年1月11日現在	平成30年1月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
株式	2,210,152,396	9,392,239,360
投資信託受益証券	28,280,754	281,450
投資証券	14,817,383	3,539,125
合計	2,223,615,767	9,388,981,685

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成28年4月19日から平成29年1月11日まで及び平成29年4月19日から平成30年1月11日まで）に対応する金額であります。

## （デリバティブ取引等に関する注記）

## 通貨関連

種類	平成29年1月11日 現在				平成30年1月11日 現在			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	510,195,400	-	510,180,000	15,400	1,161,449,670	-	1,161,413,200	36,470
アメリカ・ドル	510,195,400	-	510,180,000	15,400	1,161,449,670	-	1,161,413,200	36,470
買 建	-	-	-	-	39,578,880	-	39,233,920	344,960
アメリカ・ドル	-	-	-	-	39,578,880	-	39,233,920	344,960
合計	510,195,400	-	510,180,000	15,400	1,201,028,550	-	1,200,647,120	308,490

## (注) 時価の算定方法

1. 計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。  
 計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。  
 計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。
  - ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算しております。
  - ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。
2. 計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。
3. 換算において円未満の端数は切捨てております。  
 上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 株式関連

種類	平成29年1月11日 現在				平成30年1月11日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								
先物取引								
買 建	1,523,154,893	-	1,542,847,800	19,692,907	3,403,250,998	-	3,659,365,027	256,114,029
合計	1,523,154,893	-	1,542,847,800	19,692,907	3,403,250,998	-	3,659,365,027	256,114,029

## (注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (1口当たり情報に関する注記)

	平成29年1月11日現在	平成30年1月11日現在
1口当たり純資産額	0.9814円	1.3060円
(1万口当たり純資産額)	(9,814円)	(13,060円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

平成30年1月11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	CTIP.COM INTERNATIONAL LTD ADR	35,100	47.150	1,654,965.000	
	CIA DE MINAS BUENAVENTURA SA ADR	21,000	14.190	297,990.000	
	SURGUTNEFTEGAZ SP ADR PREF	81,000	5.080	411,480.000	
	CREDICORP LTD	5,949	220.220	1,310,088.780	
	SINA CORP	5,600	112.820	631,792.000	
	MOBILE TELESYSTEMS PJSC ADR	49,625	10.670	529,498.750	
	NETEASE INC-ADR	7,200	334.900	2,411,280.000	
	SOUTHERN COPPER CORP	7,680	49.460	379,852.800	
	LUKOIL SPON ADR	40,294	63.760	2,569,145.440	
	GAZPROM PAO ADR	504,750	4.989	2,518,197.750	
	COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK SP GDR	106,998	4.500	481,491.000	
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRADE	96,280	1.483	142,783.240	
	EFG-HERMES HOLDINGS GDR	26,843	2.390	64,154.770	
	SURGUTNEFTEGAZ ADR	76,317	4.914	375,021.730	
	NOVATEK PJSC GDR	9,006	125.000	1,125,750.000	
	BAIDU INC -SPON ADR	24,900	248.950	6,198,855.000	
	NOVOLIPETSK STEEL GDR	14,700	26.250	385,875.000	
	MMC NORILSK NICKEL ADR	62,046	20.500	1,271,943.000	
	ROSNEFT OIL CO GDR	125,900	5.582	702,773.800	
	NEW ORIENTAL EDUCATION & TECH	12,000	103.230	1,238,760.000	
	SEVERSTAL GDR	25,347	16.700	423,294.900	
	TATNEFT ADR	25,100	53.640	1,346,364.000	
	VTB BANK OJSC GDR	272,000	1.973	536,656.000	
	DP WORLD LTD	15,640	26.700	417,588.000	
	MAGNIT PJSC GDR	34,000	29.250	994,500.000	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD ADR	37,700	13.090	493,493.000	
	RUSHYDRO PJSC ADR	128,960	1.308	168,679.680	
	TAL EDUCATION GROUP-ADR	27,200	33.260	904,672.000	
	SBERBANK ADR	250,760	18.160	4,553,801.600	
	PHOSAGRO PJSC GDR	16,500	16.250	268,125.000	
YY INC-ADR	4,000	127.480	509,920.000		
58.COM INC ADR	8,000	83.300	666,400.000		
AUTOHOME INC ADR	5,100	78.280	399,228.000		
WEIBO CORP ADR	4,600	120.100	552,460.000		
JD.COM INC ADR	59,000	46.450	2,740,550.000		

	ALIBABA GROUP HOLDING LTD-ADR	104,580	189.790	19,848,238.200	
	MOMO INC SPON ADR	9,800	26.790	262,542.000	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	34,300	42.680	1,463,924.000	
アメリカ・ドル 小計		2,375,775		61,252,134.440 (6,827,775,427)	
アラブ首長国連邦・ディルハム	DUBAI ISLAMIC BANK PJSC	126,000	6.500	819,000.000	
	EMIRATES TELECOMMUNICATIONS GROUP CO PJSC	150,000	17.900	2,685,000.000	
	DUBAI INVESTMENTS PJSC	72,000	2.520	181,440.000	
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK PJSC	197,247	7.390	1,457,655.330	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	129,990	11.000	1,429,890.000	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	303,000	7.230	2,190,690.000	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	330,000	2.260	745,800.000	
	EMAAR MALLS PJSC	178,166	2.210	393,746.860	
	DXB ENTERTAINMENTS PJSC	272,783	0.705	192,312.010	
	DAMAC PROPERTIES DUBAI CO PJSC	190,235	3.420	650,603.700	
アラブ首長国連邦・ディルハム 小計		1,949,421		10,746,137.900 (326,682,592)	
インド・ルピー	RELIANCE INDUSTRIES LTD	235,083	942.350	221,530,465.050	
	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	65,542	494.300	32,397,410.600	
	ASIAN PAINTS LTD	26,800	1,177.400	31,554,320.000	
	EICHER MOTORS LTD	1,161	28,097.500	32,621,197.500	
	GRASIM INDUSTRIES LTD	32,060	1,235.500	39,610,130.000	
	MAHINDRA & MAHINDRA LTD	64,588	759.850	49,077,191.800	
	SHREE CEMENT LTD	830	19,501.800	16,186,494.000	
	ICICI BANK LTD	210,349	312.000	65,628,888.000	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP LTD	56,690	424.550	24,067,739.500	
	STATE BANK OF INDIA LTD	151,072	301.100	45,487,779.200	
	CONTAINER CORP OF INDIA LTD	3,657	1,476.300	5,398,829.100	
	LIC HOUSING FINANCE LTD	28,660	575.200	16,485,232.000	
	TATA STEEL LTD	29,170	772.850	22,544,034.500	
	TATA MOTORS LTD	141,957	433.300	61,509,968.100	
	JSW STEEL LTD	78,900	282.800	22,312,920.000	
	TATA POWER CO LTD	114,770	98.250	11,276,152.500	
	BRITANNIA INDUSTRIES LTD	2,210	4,674.750	10,331,197.500	
	NESTLE INDIA LTD	2,310	7,846.650	18,125,761.500	
	BHARAT HEAVY ELECTRICALS LTD	73,648	103.800	7,644,662.400	
	GAIL INDIA LTD	49,700	496.100	24,656,170.000	
VEDANTA LTD	127,673	334.800	42,744,920.400		
AXIS BANK LTD	160,000	562.800	90,048,000.000		
TITAN COMPANY LTD	29,500	917.600	27,069,200.000		

OIL & NATURAL GAS CORP LTD	123,780	197.900	24,496,062.000	
LUPIN LTD	21,100	925.800	19,534,380.000	
ACC LTD	2,211	1,816.550	4,016,392.050	
BAJAJ FINANCE LTD	15,400	1,802.200	27,753,880.000	
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP	136,505	1,726.450	235,669,057.250	
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISES LTD	44,098	580.500	25,598,889.000	
INFOSYS LTD	164,519	1,052.250	173,115,117.750	
WIPRO LTD	107,093	326.700	34,987,283.100	
INDIAN OIL CORP LTD	56,340	389.550	21,947,247.000	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	57,892	1,365.800	79,068,893.600	
HCL TECHNOLOGIES LTD	48,972	915.850	44,851,006.200	
DABUR INDIA LTD	52,800	357.800	18,891,840.000	
HERO MOTOCORP LTD	4,790	3,736.900	17,899,751.000	
DR REDDYS LABORATORIES LTD	10,700	2,425.800	25,956,060.000	
BHARTI AIRTEL LTD	106,556	506.400	53,959,958.400	
UNITED SPIRITS LTD	5,444	3,830.400	20,852,697.600	
SUN PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD	83,734	585.100	48,992,763.400	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	9,431	9,375.850	88,423,641.350	
GLENMARK PHARMACEUTICALS LTD	11,618	617.250	7,171,210.500	
AUROBINDO PHARMA LTD	25,500	672.700	17,153,850.000	
HAVELLS INDIA LTD	24,800	549.700	13,632,560.000	
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	62,550	378.650	23,684,557.500	
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE CO LTD	14,810	1,521.100	22,527,491.000	
PETRONET LNG LTD	36,378	251.000	9,130,878.000	
CIPLA LTD/INDIA	33,400	619.750	20,699,650.000	
LARSEN & TOUBRO LTD	41,040	1,323.750	54,326,700.000	
ULTRATECH CEMENT LTD	7,286	4,403.200	32,081,715.200	
ASHOK LEYLAND LTD	113,820	127.950	14,563,269.000	
BOSCH LTD	730	19,811.150	14,462,139.500	
TATA CONSULTANCY SERVICES LTD	41,405	2,806.600	116,207,273.000	
NTPC LTD	155,200	173.950	26,997,040.000	
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	7,680	2,857.350	21,944,448.000	
YES BANK LTD	149,825	339.800	50,910,535.000	
AMBUJA CEMENTS LTD	59,360	276.100	16,389,296.000	
BHARAT FORGE LTD	17,572	726.550	12,766,936.600	
HINDALCO INDUSTRIES LTD	109,900	268.800	29,541,120.000	
ITC LTD	304,671	269.400	82,078,367.400	
UNITED PHOSPHORUS LTD	33,000	778.850	25,702,050.000	
SIEMENS INDIA LTD	6,219	1,299.750	8,083,145.250	

	GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	22,600	978.450	22,112,970.000	
	TECH MAHINDRA LTD	43,655	542.100	23,665,375.500	
	IDEA CELLULAR LTD	133,167	107.350	14,295,477.450	
	MARICO LTD	45,380	321.650	14,596,477.000	
	POWER FINANCE CORP LTD	65,910	124.800	8,225,568.000	
	ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	68,449	423.450	28,984,729.050	
	RURAL ELECTRIFICATION CORP LTD	59,932	162.350	9,729,960.200	
	BAJAJ FINSERV LTD	3,720	5,199.550	19,342,326.000	
	BAJAJ AUTO LTD	8,000	3,207.400	25,659,200.000	
	COAL INDIA LTD	64,200	308.300	19,792,860.000	
	TATA MOTORS LTD	31,568	254.000	8,018,272.000	
	VAKRANGEE LTD	35,954	435.550	15,659,764.700	
	MAHINDRA & MAHINDRA FINANCIAL SERVICES LTD	23,715	476.300	11,295,454.500	
	BHARTI INFRATEL LTD	54,580	370.800	20,238,264.000	
	INDIABULLS HOUSING FINANCE LTD	31,030	1,204.200	37,366,326.000	
	CADILA HEALTHCARE LTD	18,146	443.700	8,051,380.200	
	IDFC BANK LTD	114,421	63.250	7,237,128.250	
	インド・ルピー 小計	4,818,886		2,798,649,348.150 (4,953,609,347)	
インドネシア・ルピア	AKR CORPORINDO TBK PT	150,400	6,225.000	936,240,000.000	
	UNITED TRACTORS TBK PT	157,801	36,900.000	5,822,856,900.000	
	INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK PT	432,000	7,825.000	3,380,400,000.000	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	142,600	54,200.000	7,728,920,000.000	
	PT ASTRA INTERNATIONAL TBK	1,769,600	8,275.000	14,643,440,000.000	
	TELEKOMUNIKASI INDONESIA PERSERO TBK	4,489,600	4,190.000	18,811,424,000.000	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA TBK PT	753,200	3,250.000	2,447,900,000.000	
	GUDANG GARAM TBK PT	48,100	83,000.000	3,992,300,000.000	
	HANJAYA MANDALA SAMPOERNA TBK	926,100	4,860.000	4,500,846,000.000	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA TBK PT	185,100	23,150.000	4,285,065,000.000	
	BANK DANAMON INDONESIA TBK PT	290,416	6,900.000	2,003,870,400.000	
	BANK MANDIRI	1,618,800	7,900.000	12,788,520,000.000	
	MATAHARI DEPARTMENT STORE TBK	251,900	11,025.000	2,777,197,500.000	
	BANK RAKYAT INDONESIA	4,851,200	3,530.000	17,124,736,000.000	
	PERUSAHAAN GAS NEGARA PT	1,064,100	1,825.000	1,941,982,500.000	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSERO TBK PT	702,200	9,275.000	6,512,905,000.000	

	KALBE FARMA TBK PT	2,086,600	1,740.000	3,630,684,000.000	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK PT	286,500	10,825.000	3,101,362,500.000	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	872,700	22,450.000	19,592,115,000.000	
	XL AXIATA TBK PT	290,700	3,230.000	938,961,000.000	
	JASA MARGA PERSERO TBK PT	200,125	6,300.000	1,260,787,500.000	
	BUMI SERPONG DAMAI PT	851,700	1,665.000	1,418,080,500.000	
	ADARO ENERGY PT	1,434,500	2,210.000	3,170,245,000.000	
	PAKUWON JATI TBK	1,912,800	680.000	1,300,704,000.000	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR TBK PT	239,000	8,725.000	2,085,275,000.000	
	TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE TBK PT	180,800	6,650.000	1,202,320,000.000	
	BANK TABUNGAN NEGARA TBK PT	289,200	3,610.000	1,044,012,000.000	
	WASKITA KARYA PERSERO TBK PT	392,000	2,510.000	983,920,000.000	
	PT SURYA CITRA MEDIA TBK	511,300	2,420.000	1,237,346,000.000	
インドネシア・ルビア 小計		27,381,042		150,664,415,800.000 (1,250,514,651)	
カタール・リアル	QATAR INSURANCE CO SAQ	13,800	59.970	827,586.000	
	QATAR NATIONAL BANK	21,430	131.000	2,807,330.000	
	COMMERCIAL BANK OF QATAR QSC	16,651	28.900	481,213.900	
	OORED00 QSC	8,410	96.000	807,360.000	
	DOHA BANK QSC	11,963	30.370	363,316.310	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	2,406	183.000	440,298.000	
	INDUSTRIES QATAR QSC	12,500	104.010	1,300,125.000	
	QATAR ISLAMIC BANK SAQ	5,054	97.810	494,331.740	
	QATAR GAS TRANSPORT CO LTD	12,000	18.000	216,000.000	
	MASRAF AL RAYAN	37,100	42.200	1,565,620.000	
	BARWA REAL ESTATE CO	7,916	34.800	275,476.800	
	EZDAN HOLDING GROUP QSC	81,350	12.670	1,030,704.500	
カタール・リアル 小計		230,580		10,609,362.250 (325,389,140)	
コロンビア・ペソ	INTERCONEXION ELECTRICA SA ESP	31,123	14,280.000	444,436,440.000	
	ECOPETROL SA	413,049	2,535.000	1,047,079,215.000	
	GRUPO DE INVERSIONES SURAMERICANA SA-PREF	10,138	39,400.000	399,437,200.000	
	GRUPO AVAL ACCIONES Y VALORES SA-PREF	247,861	1,275.000	316,022,775.000	
	CEMENTOS ARGOS SA	31,255	11,400.000	356,307,000.000	
	GRUPO ARGOS SA	27,199	20,600.000	560,299,400.000	
	BANCOLOMBIA SA	17,700	30,400.000	538,080,000.000	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	45,900	30,520.000	1,400,868,000.000	

	GRUPO DE INVERSIONES SURAMERICANA SA	24,660	40,380.000	995,770,800.000	
コロンビア・ペソ	小計	848,885		6,058,300,830.000 (233,850,412)	
タイ・パーツ	BANGKOK BANK PCL	19,700	219.000	4,314,300.000	
	BERLI JUCKER PCL NVDR	121,000	58.750	7,108,750.000	
	KRUNG THAI BANK PCL NVDR	348,000	20.300	7,064,400.000	
	ROBINSON PCL-NVDR	39,400	73.500	2,895,900.000	
	SIAM COMMERCIAL BANK PCL NVDR	172,000	150.000	25,800,000.000	
	TRUE CORP PCL NVDR	1,023,055	6.650	6,803,315.750	
	KASIKORNBANK PCL NVDR	57,000	233.000	13,281,000.000	
	TMB BANK PCL -NVDR	1,010,000	3.020	3,050,200.000	
	IRPC PCL NVDR	863,400	7.200	6,216,480.000	
	BANPU PCL PUBLIC CO LTD NVDR	169,100	21.700	3,669,470.000	
	ELECTRICITY GENERATING PCL NVDR	7,800	218.000	1,700,400.000	
	CHAROEN POKPHAND FOODS PCL	293,200	24.600	7,212,720.000	
	ADVANCED INFO SERVICE PCL	97,500	194.000	18,915,000.000	
	HOME PRODUCT CENTER PCL- NVDR	280,320	13.600	3,812,352.000	
	DELTA ELECTRONICS THAI PCL NVDR	44,200	75.000	3,315,000.000	
	PTT PCL	93,300	470.000	43,851,000.000	
	THAI UNION GROUP PCL-NVDR	164,100	20.900	3,429,690.000	
	SIAM CEMENT PCL NVDR	11,650	504.000	5,871,600.000	
	KCE ELECTRONICS PCL-NVDR	24,900	80.750	2,010,675.000	
	AIRPORTS OF THAILAND PCL- NVDR	418,000	71.250	29,782,500.000	
	SIAM CEMENT PCL FOREIGN	26,500	504.000	13,356,000.000	
	KASIKORNBANK PCL - FOREIGN	105,700	235.000	24,839,500.000	
	CENTRAL PATTANA PCL NVDR	131,400	82.000	10,774,800.000	
	BANGKOK DUSIT MEDICAL SERVICES NVDR	397,000	21.100	8,376,700.000	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL- NVDR	37,000	200.000	7,400,000.000	
	MINOR INTERNATIONAL PCL- NVDR	168,210	42.750	7,190,977.500	
	THAI OIL PCL NVDR	81,000	99.500	8,059,500.000	
	GLOW ENERGY PCL NVDR	54,000	83.750	4,522,500.000	
	CP ALL PCL NVDR	440,100	77.500	34,107,750.000	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL	544,800	8.350	4,549,080.000	
	PTT EXPLORATION & PRODUCTION PCL NVDR	136,045	107.000	14,556,815.000	
	INDORAMA VENTURES PCL NVDR	142,022	56.000	7,953,232.000	



	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	203,308	92.750	18,856,817.000	
	ENERGY ABSOLUTE PCL NVDR	93,000	53.250	4,952,250.000	
	BANGKOK EXPRESSWAY & METRO PCL NVDR	740,700	7.700	5,703,390.000	
タイ・パーツ 小計		8,558,410		375,304,064.250 (1,302,305,102)	
チェコ・コルナ	KOMERCNI BANKA AS	7,100	925.000	6,567,500.000	
	O2 CZECH REPUBLIC AS	5,677	275.000	1,561,175.000	
	CEZ	15,000	505.000	7,575,000.000	
	MONETA MONEY BANK AS	35,965	81.650	2,936,542.250	
チェコ・コルナ 小計		63,742		18,640,217.250 (97,301,934)	
チリ・ペソ	BANCO SANTANDER CHILE	6,514,000	50.220	327,133,080.000	
	BANCO DE CREDITO E INVERSIONES	3,640	43,679.000	158,991,560.000	
	BANCO DE CHILE	2,348,850	101.170	237,633,154.500	
	EMPRESAS CMPC SA	116,370	2,228.700	259,353,819.000	
	EMPRESAS COPEC SA	43,910	9,711.800	426,445,138.000	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	15,170	8,713.500	132,183,795.000	
	ENTEL CHILE SA	15,970	7,079.600	113,061,212.000	
	ENEL GENERACION CHILE SA	322,190	556.360	179,253,628.400	
	ENEL AMERICAS SA	2,717,380	137.010	372,308,233.800	
	COLBUN SA	405,312	148.280	60,099,663.360	
	AGUAS ANDINAS SA	224,116	411.050	92,122,881.800	
	EMBOTELLADORA ANDINA SA	27,270	2,957.000	80,637,390.000	
	LATAM AIRLINES GROUP SA	27,396	9,195.100	251,908,959.600	
	SOCIEDAD QUIMICA Y MINERA DE CHILE SA	9,000	37,779.000	340,011,000.000	
	SACI FALABELLA	60,913	6,233.300	379,689,002.900	
	ITAU CORPBANCA	4,838,793	5.681	27,489,183.030	
	CENCOSUD SA	132,780	1,869.900	248,285,322.000	
	AES GENER SA	257,135	204.000	52,455,540.000	
ENEL CHILE SA	1,934,010	73.640	142,420,496.400		
チリ・ペソ 小計		20,014,205		3,881,483,059.790 (709,923,252)	
トルコ・リラ	AKBANK TAS	213,480	9.630	2,055,812.400	
	ANADOLU EFES BIRACILIK VE MALT SANAYII AS	21,520	25.500	548,760.000	
	ARCELIK	20,062	20.660	414,480.920	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	17,677	31.720	560,714.440	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIKALARI TAS	128,570	9.700	1,247,129.000	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	5,584	57.800	322,755.200	
	KOC HOLDING AS	70,650	18.330	1,295,014.500	
	PETKIM PETROKIMYA HOLDING	80,700	7.860	634,302.000	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI AS	46,897	4.920	230,733.240	

	TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKASI AS	10,370	32.640	338,476.800	
	TURK HAVA YOLLARI	44,695	15.250	681,598.750	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	93,210	14.580	1,359,001.800	
	TURKIYE GARANTI BANKASI AS	198,350	10.380	2,058,873.000	
	TURKIYE IS BANKASI	120,899	6.790	820,904.210	
	TUPRAS TURKIYE PETROL RAFINE	12,180	119.100	1,450,638.000	
	ULKER BISKUVI SANAYI AS	13,121	22.340	293,123.140	
	YAPI VE KREDI BANKASI AS	73,599	4.350	320,155.650	
	HACI OMER SABANCI HOLDING AS	93,430	10.930	1,021,189.900	
	COCA-COLA ICECEK AS	6,451	36.240	233,784.240	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	20,710	76.000	1,573,960.000	
	TURKIYE VAKIFLAR BANKASI TAO	63,608	6.730	428,081.840	
	TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	13,735	21.500	295,302.500	
	TURKIYE HALK BANKASI AS	61,970	10.220	633,333.400	
	TURK TELEKOMUNIKASYON AS	56,200	6.220	349,564.000	
トルコ・リラ 小計		1,487,668		19,167,688.930 (562,763,346)	
ハンガリー・フォロント	RICHTER GEDEON NYRT	13,930	6,760.000	94,166,800.000	
	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NYRT	27,417	3,030.000	83,073,510.000	
	OTP BANK NYRT	23,000	10,790.000	248,170,000.000	
ハンガリー・フォロント 小計		64,347		425,410,310.000 (183,309,302)	
パキスタン・ルピー	LUCKY CEMENT LTD	9,900	583.890	5,780,511.000	
	MCB BANK LTD	39,000	224.670	8,762,130.000	
	OIL & GAS DEVELOPMENT CO LTD	42,300	171.270	7,244,721.000	
	UNITED BANK LTD	51,400	215.160	11,059,224.000	
	HABIB BANK LTD	54,400	192.090	10,449,696.000	
パキスタン・ルピー 小計		197,000		43,296,282.000 (43,729,245)	
フィリピン・ペソ	AYALA LAND INC	694,400	45.650	31,699,360.000	
	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	149,280	75.950	11,337,816.000	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAND	77,686	119.500	9,283,477.000	
	AYALA CORP	20,368	1,060.000	21,590,080.000	
	ALLIANCE GLOBAL GROUP INC	340,600	16.280	5,544,968.000	
	DMCI HOLDINGS INC	351,850	14.980	5,270,713.000	
	GLOBE TELECOM INC	2,785	1,720.000	4,790,200.000	

	INTERNATIONAL CONTAINER TERM SERVICES INC	40,680	112.000	4,556,160.000	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	271,380	79.100	21,466,158.000	
	JOLLIBEE FOODS CORP	44,130	255.400	11,270,802.000	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	65,551	107.800	7,066,397.800	
	BDO UNIBANK INC	165,113	164.800	27,210,622.400	
	MEGAWORLD CORP	962,000	5.200	5,002,400.000	
	PLDT INC	7,900	1,450.000	11,455,000.000	
	ROBINSONS LAND CORP	172,400	21.100	3,637,640.000	
	SECURITY BANK CORP	23,420	253.000	5,925,260.000	
	SM PRIME HOLDINGS INC	819,075	39.100	32,025,832.500	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	88,660	172.000	15,249,520.000	
	SM INVESTMENTS CORP	23,688	1,046.000	24,777,648.000	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CORP	979,300	6.830	6,688,619.000	
	ABOITIZ POWER CORP	122,900	41.450	5,094,205.000	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	16,600	334.000	5,544,400.000	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	8,940	1,382.000	12,355,080.000	
フィリピン・ペソ	小計	5,448,706		288,842,358.700 (638,341,613)	
ブラジル・リアル	BRF SA	38,492	39.090	1,504,652.280	
	VALE SA	286,321	42.470	12,160,052.870	
	RAIA DROGASIL SA	21,600	85.360	1,843,776.000	
	TIM PARTICIPACOES SA	81,700	12.790	1,044,943.000	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	19,450	19.560	380,442.000	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	24,500	16.940	415,030.000	
	BANCO DO BRASIL SA	77,100	33.290	2,566,659.000	
	INVESTIMENTOS ITAU SA	354,286	11.200	3,968,003.200	
	LOJAS AMERICANAS SA	68,974	16.000	1,103,584.000	
	GERDAU SA	84,430	13.840	1,168,511.200	
	CIA BRASILEIRA DE DISTRIBUICAO GRUPO PAO DE ACUCAR	14,906	73.310	1,092,758.860	
	PETROLEO BRASILEIRO SA	261,410	17.780	4,647,869.800	
	PETROLEO BRASILEIRO SA	356,912	16.800	5,996,121.600	
	KROTON EDUCACIONAL SA	123,168	18.450	2,272,449.600	
	CCR SA	103,920	15.950	1,657,524.000	
	WEG SA	53,540	24.900	1,333,146.000	
	BANCO BRADESCO SA PREF	277,596	34.800	9,660,340.800	
	BANCO BRADESCO SA	81,835	32.540	2,662,910.900	
	NATURA COSMETICOS SA	14,800	32.540	481,592.000	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	61,606	10.250	631,461.500	
	SUZANO PAPEL E CELULOSE SA	37,900	19.410	735,639.000	
	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	293,598	44.440	13,047,495.120	
	PORTO SEGURO SA	9,400	38.700	363,780.000	

FIBRIA CELULOSE SA	24,390	49.890	1,216,817.100	
BRASKEM SA	17,030	44.910	764,817.300	
ENGIE BRASIL SA	11,270	35.270	397,492.900	
LOCALIZA RENT A CAR	47,880	22.710	1,087,354.800	
TELEFONICA BRASIL S.A.	39,728	49.360	1,960,974.080	
LOJAS RENNER SA	62,370	34.850	2,173,594.500	
EDP - ENERGIAS DO BRASIL SA	31,864	13.520	430,801.280	
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	31,352	76.900	2,410,968.800	
COSAN SA INDUSTRIA E COMERCIO	16,500	40.550	669,075.000	
EQUATORIAL ENERGIA SA	18,800	65.990	1,240,612.000	
EMBRAER SA	62,560	20.290	1,269,342.400	
M DIAS BRANCO SA	10,400	48.870	508,248.000	
TRANSMISSORA ALIANCA DE ENERGIA ELETRICA SA	16,300	20.480	333,824.000	
ODONTOPREV SA	22,300	15.670	349,441.000	
BR MALLS PARTICIPACOES SA	78,065	12.200	952,393.000	
JBS SA	81,500	9.680	788,920.000	
CIA ENERGETICA DE MINAS GERAIS	75,749	6.810	515,850.690	
CIA DE SANEAMENTO BASICO DO ESTADO DE SAO PAULO	33,798	33.240	1,123,445.520	
MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS IMOBILIARIOS SA	6,080	71.910	437,212.800	
SUL AMERICA SA	17,869	19.000	339,511.000	
HYPERMARCAS SA	34,900	35.660	1,244,534.000	
B3 SA-BRASIL BOLSA BAICAO	185,316	23.350	4,327,128.600	
QUALICORP SA	22,000	30.520	671,440.000	
BANCO SANTANDER BRASIL SA	40,500	32.190	1,303,695.000	
CIELO SA	108,507	24.200	2,625,869.400	
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	68,400	28.920	1,978,128.000	
ATACADAO DISTRIBUICAO COMERCIO E INDUSTRIA LTDA	32,300	14.200	458,660.000	
AMBEV SA	425,095	21.600	9,182,052.000	
KLABIN SA	55,200	17.600	971,520.000	
RUMO SA	106,000	12.320	1,305,920.000	
ブラジル・リアル 小計	4,531,467		113,778,385.900 (3,919,665,395)	
ポーランド・ズロチ				
BANK MILLENNIUM SA	52,647	9.070	477,508.290	
MBANK	1,530	486.000	743,580.000	
BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA	2,596	81.800	212,352.800	
KGHM POLSKA MIEDZ SA	11,456	113.850	1,304,265.600	
BANK PEKAO SA	14,880	132.000	1,964,160.000	
ORANGE POLSKA SA	58,600	6.020	352,772.000	

	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	26,869	106.050	2,849,457.450	
	LPP SA	130	9,400.000	1,222,000.000	
	BANK ZACHODNI WBK SA	3,200	402.600	1,288,320.000	
	CD PROJEKT RED SA	5,817	98.150	570,938.550	
	POWSZECHNA KASA OSZCZEDNOSCI BANK POLSKI SA	84,184	44.750	3,767,234.000	
	CCC SA	2,638	299.600	790,344.800	
	GRUPA LOTOS SA	9,480	56.160	532,396.800	
	POLSKIE GORNICtwo NAFTOWE I GAZOWNICTWO SA	132,742	6.220	825,655.240	
	CYFROWY POLSAT SA	22,810	23.580	537,859.800	
	GRUPA AZOTY SA	3,853	71.850	276,838.050	
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	81,100	12.600	1,021,860.000	
	TAURON POLSKA ENERGIA SA	89,318	3.150	281,351.700	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZEN SA	53,943	44.550	2,403,160.650	
	JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA SA	4,403	104.500	460,113.500	
	ALIOR BANK SA	9,250	76.700	709,475.000	
	DINO POLSKA SA	3,757	78.500	294,924.500	
	PLAY COMMUNICATIONS SA	8,612	34.800	299,697.600	
ポーランド・ズロチ	小計	683,815		23,186,266.330 (740,569,347)	
マレーシア・リンギット	AMMB HOLDINGS BHD	138,900	4.560	633,384.000	
	GENTING PLANTATIONS BHD	22,600	10.620	240,012.000	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	438,000	6.740	2,952,120.000	
	DIGI.COM BHD	289,900	4.800	1,391,520.000	
	MALAYSIA AIRPORTS HOLDINGS BHD	84,220	9.010	758,822.200	
	RHB BANK BHD	68,080	5.120	348,569.600	
	HAP SENG CONSOLIDATED BHD	54,700	9.550	522,385.000	
	GAMUDA BHD	109,600	5.060	554,576.000	
	GENTING BHD	220,900	9.400	2,076,460.000	
	YTL CORP BHD	377,410	1.460	551,018.600	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP BHD	12,756	17.760	226,546.560	
	HONG LEONG BANK BHD	63,008	17.340	1,092,558.720	
	IJM CORP BHD	184,560	3.030	559,216.800	
	IOI CORP BHD	229,013	4.660	1,067,200.580	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	46,000	25.140	1,156,440.000	
	MALAYAN BANKING BHD	384,875	9.840	3,787,170.000	
	ALLIANCE BANK MALAYSIA BHD	86,100	4.120	354,732.000	
	MISC BHD	131,080	7.530	987,032.400	
	NESTLE MALAYSIA BHD	3,500	103.200	361,200.000	

	PPB GROUP BHD	47,800	17.380	830,764.000	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	17,500	25.040	438,200.000	
	PETRONAS GAS BHD	68,000	19.000	1,292,000.000	
	GENTING MALAYSIA BHD	249,500	5.570	1,389,715.000	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD	14,700	35.000	514,500.000	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	95,000	6.030	572,850.000	
	SP SETIA BHD	77,900	3.410	265,639.000	
	TENAGA NASIONAL BHD	311,050	15.860	4,933,253.000	
	UMW HOLDINGS BHD	39,000	6.420	250,380.000	
	DIALOG GROUP BHD	243,444	2.700	657,298.800	
	PUBLIC BANK BHD(LOCAL)	272,030	20.840	5,669,105.200	
	YTL POWER INTERNATIONAL BHD	148,780	1.290	191,926.200	
	AIRASIA BHD	147,900	3.780	559,062.000	
	SIME DARBY BERHAD	232,700	2.700	628,290.000	
	HARTALEGA HOLDINGS BHD	57,600	10.880	626,688.000	
	AXIATA GROUP BERHAD	256,000	5.620	1,438,720.000	
	MAXIS BHD	188,600	5.990	1,129,714.000	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	224,000	8.110	1,816,640.000	
	SAPURA ENERGY BHD	319,200	0.905	288,876.000	
	ASTRO MALAYSIA HOLDINGS BHD	95,500	2.680	255,940.000	
	IHH HEALTHCARE BHD	207,300	5.850	1,212,705.000	
	FELDA GLOBAL VENTURES HOLDINGS BHD	126,400	2.040	257,856.000	
	WESTPORTS HOLDINGS BHD	83,500	3.410	284,735.000	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDINGS BHD	107,800	5.530	596,134.000	
	SIME DARBY PROPERTY BHD	232,700	1.630	379,301.000	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	232,700	5.580	1,298,466.000	
	IOI PROPERTIES GROUP SDN BHD	174,548	1.940	338,623.120	
	マレーシア・リンギット 小計	7,216,354		47,738,345.780 (1,329,990,314)	
メキシコ・ペソ	ALFA SAB DE CV	287,100	22.220	6,379,362.000	
	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	47,600	134.580	6,406,008.000	
	EL PUERTO DE LIVERPOOL SAB DE CV	19,100	125.210	2,391,511.000	
	GRUPO FINANCIERO SANTANDER MEXICO	178,000	29.050	5,170,900.000	
	GRUPO TELEVISIA SAB	215,100	72.670	15,631,317.000	
	GRUPO BIMBO SAB DE CV	156,500	43.070	6,740,455.000	
	GRUMA SAB DE CV	20,805	247.650	5,152,358.250	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INFRAESTRUCTURA	22,030	193.180	4,255,755.400	
	GRUPO CARSO SAB DE CV	37,900	65.090	2,466,911.000	

	GRUPO FINANCIERO BANORTE SAB DE CV	222,200	107.850	23,964,270.000	
	MEXICHEM SAB DE CV	79,825	49.810	3,976,083.250	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	14,700	410.630	6,036,261.000	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO SAB DE CV	153,700	33.210	5,104,377.000	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL SURESTE SAB DE CV	19,575	363.200	7,109,640.000	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV	339,352	65.400	22,193,620.800	
	AMERICA MOVIL SAB DE CV	3,043,478	16.480	50,156,517.440	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA SA	214,700	33.780	7,252,566.000	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	43,800	133.880	5,863,944.000	
	WAL-MART DE MEXICO SAB DE CV	467,900	45.140	21,121,006.000	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL PACIFICO SAB DE CV	33,500	198.490	6,649,415.000	
	GENTERA SAB DE CV	103,000	16.870	1,737,610.000	
	INFRAESTRUCTURA ENERGETICA NOVA SAB DE CV	53,200	92.970	4,946,004.000	
	GRUPO LALA SAB DE CV	50,400	27.680	1,395,072.000	
メキシコ・ペソ 小計		5,823,465		222,100,964.140 (1,283,743,573)	
ユーロ	PIRAEUS BANK S.A	25,000	3.468	86,700.000	
	ALPHA BANK A.E.	121,000	1.910	231,110.000	
	NATIONAL BANK OF GREECE	552,000	0.333	183,816.000	
	TITAN CEMENT CO. S.A.	3,518	23.400	82,321.200	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	22,000	11.480	252,560.000	
	FF GROUP	3,130	18.700	58,531.000	
	EUROBANK ERGASIAS	151,630	0.860	130,401.800	
	OPAP SA	20,000	10.850	217,000.000	
	JUMBO SA	10,420	15.300	159,426.000	
ユーロ 小計		908,698		1,401,866.000 (186,784,625)	
韓国・ウォン	CHEIL WORLDWIDE INC	7,097	20,400.000	144,778,800.000	
	HANMI SCIENCE CO LTD	1,164	108,500.000	126,294,000.000	
	HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	3,710	105,000.000	389,550,000.000	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANC	2,685	274,000.000	735,690,000.000	
	DB INSURANCE CO LTD	4,750	70,000.000	332,500,000.000	
	COWAY CO LTD	4,980	97,800.000	487,044,000.000	
	KT&G CORP	10,362	105,500.000	1,093,191,000.000	
	S-1 CORPORATION	1,579	102,000.000	161,058,000.000	
	KOREA GAS CORP	2,997	45,100.000	135,164,700.000	
	CJ CORP	1,108	180,000.000	199,440,000.000	
	KAKAO CORP	3,370	149,500.000	503,815,000.000	

SK TELECOM CO LTD	1,900	268,500.000	510,150,000.000	
DAELIM INDUSTRIAL CO	2,890	87,200.000	252,008,000.000	
MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD	35,200	9,640.000	339,328,000.000	
NCISOFT CORPORATION	1,557	436,000.000	678,852,000.000	
DOOSAN HEAVY INDUSTRIES AND CONSTRUCTION CO LTD	4,050	17,200.000	69,660,000.000	
DAEWOO ENGINEERING & CONSTRUCT	13,540	6,080.000	82,323,200.000	
POSCO DAEWOO CORP	3,600	21,550.000	77,580,000.000	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD	835	1,222,000.000	1,020,370,000.000	
LG CHEM LTD	4,137	416,500.000	1,723,060,500.000	
LG CHEM LTD	641	251,000.000	160,891,000.000	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD	177	720,000.000	127,440,000.000	
SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD	38,041	52,500.000	1,997,152,500.000	
HYUNDAI DEVELOPMENT CO	5,910	43,150.000	255,016,500.000	
S-OIL CORP	4,230	117,500.000	497,025,000.000	
HANWHA CHEMICAL CORPORATION	7,771	33,750.000	262,271,250.000	
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	6,600	38,050.000	251,130,000.000	
LOTTE CHEMICAL CORPORATION	1,450	380,500.000	551,725,000.000	
HOTEL SHILLA CO LTD	2,955	93,300.000	275,701,500.000	
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	3,080	128,000.000	394,240,000.000	
HYUNDAI MOBIS	6,104	255,000.000	1,556,520,000.000	
SK HYNIX INC	52,740	72,900.000	3,844,746,000.000	
HYUNDAI ENGINEERING & CONSTRUCTION CO LTD	7,478	40,450.000	302,485,100.000	
HYUNDAI MOTOR CO	2,370	92,200.000	218,514,000.000	
HYUNDAI MOTOR CO	13,601	155,500.000	2,114,955,500.000	
HYUNDAI STEEL CO	7,580	60,500.000	458,590,000.000	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	23,903	16,900.000	403,960,700.000	
KCC CORP	399	407,500.000	162,592,500.000	
KIA MOTORS CORP	22,905	33,050.000	757,010,250.000	
KOREA ZINC CO LTD	810	537,000.000	434,970,000.000	
KOREA ELECTRIC POWER CORP	22,642	37,400.000	846,810,800.000	
HANWHA CORP	3,785	46,000.000	174,110,000.000	
KOREAN AIR CO LTD	4,930	35,750.000	176,247,500.000	
OCI COMPANY LTD	1,500	186,500.000	279,750,000.000	
CJ LOGISTICS	860	139,000.000	119,540,000.000	
KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	1,930	107,000.000	206,510,000.000	
KT CORP	2,048	30,200.000	61,849,600.000	
LG ELECTRONICS INC	9,433	109,000.000	1,028,197,000.000	
LOTTE CORP	2,351	68,800.000	161,748,800.000	
HANSSEM CO LTD	1,100	171,000.000	188,100,000.000	
LG CORP	8,224	92,300.000	759,075,200.000	



NH INVESTMENT & SECURITIES CO LTD	10,100	15,250.000	154,025,000.000	
GS ENGINEERING & CONSTRUCTION	5,290	31,250.000	165,312,500.000	
NAVER CORP	2,512	928,000.000	2,331,136,000.000	
HYUNDAI DEPARTMENT STORE CO LTD	1,187	108,000.000	128,196,000.000	
DONGSUH CO INC	2,798	28,550.000	79,882,900.000	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO LTD	4,030	76,300.000	307,489,000.000	
OTTOGI CORP	112	796,000.000	89,152,000.000	
AMOREPACIFIC GROUP	2,750	143,500.000	394,625,000.000	
KANGWON LAND INC	11,170	31,650.000	353,530,500.000	
POSCO	6,635	372,500.000	2,471,537,500.000	
SAMSUNG SDI CO LTD	4,894	213,500.000	1,044,869,000.000	
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO LTD	5,260	103,000.000	541,780,000.000	
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	8,837	2,442,000.000	21,579,954,000.000	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES CO LTD	23,331	8,930.000	208,345,830.000	
HANWHA TECHWIN CO LTD	3,141	34,900.000	109,620,900.000	
SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	1,583	1,954,000.000	3,093,182,000.000	
SHINSEGAE CO LTD	669	312,500.000	209,062,500.000	
HYOSUNG CORP	2,120	137,500.000	291,500,000.000	
YUHAN CORP	769	219,000.000	168,411,000.000	
HANON SYSTEMS	18,967	12,850.000	243,725,950.000	
HYUNDAI MARINE & FIRE INSURANCE CO LTD	6,280	44,600.000	280,088,000.000	
GS HOLDINGS CORP	4,910	65,300.000	320,623,000.000	
LG DISPLAY CO LTD	20,395	29,800.000	607,771,000.000	
SK NETWORKS CO LTD	14,810	6,530.000	96,709,300.000	
CELLTRION INC	7,290	296,000.000	2,157,840,000.000	
HANA FINANCIAL GROUP	26,350	54,400.000	1,433,440,000.000	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	1,753	139,000.000	243,667,000.000	
LOTTE SHOPPING CO	944	222,000.000	209,568,000.000	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LTD	6,195	125,000.000	774,375,000.000	
AMOREPACIFIC CORP	2,852	305,500.000	871,286,000.000	
AMOREPACIFIC CORP-PREF	752	169,000.000	127,088,000.000	
SAMSUNG CARD CO	2,877	38,300.000	110,189,100.000	
SK INNOVATION CO LTD	5,739	203,000.000	1,165,017,000.000	
CJ CHEILJEDANG CORP	770	385,000.000	296,450,000.000	
STX PAN OCEAN CO LTD	18,395	5,930.000	109,082,350.000	
KEPCO PLANT SERVICE & ENGINEERING CO LTD	1,825	40,200.000	73,365,000.000	
LG INNOTEK CO LTD	1,440	149,000.000	214,560,000.000	
SK HOLDINGS CO LTD	2,773	291,000.000	806,943,000.000	
KB FINANCIAL GROUP INC	35,627	66,000.000	2,351,382,000.000	

MEDY-TOX INC	430	470,900.000	202,487,000.000	
HYUNDAI WIA CORP	1,454	65,800.000	95,673,200.000	
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES LTD	6,800	48,150.000	327,420,000.000	
BNK FINANCIAL GROUP INC	26,470	9,640.000	255,170,800.000	
HANMI PHARM CO LTD	567	589,000.000	333,963,000.000	
HANWHA LIFE INSURANCE CO LTD	26,430	7,090.000	187,388,700.000	
O MEDIA HOLDINGS CO LTD	1,950	91,700.000	178,815,000.000	
E-MART CO LTD	1,970	278,500.000	548,645,000.000	
DGB FINANCIAL GROUP INC	17,915	11,050.000	197,960,750.000	
GS RETAIL CO LTD	2,482	40,850.000	101,389,700.000	
HANKOOK TIRE CO LTD NEW	7,070	55,600.000	393,092,000.000	
HYUNDAI ROBOTICS CO LTD	930	455,000.000	423,150,000.000	
BGF RETAIL CO LTD	854	210,500.000	179,767,000.000	
ORION CORP REPUBLIC OF KOREA	1,748	104,500.000	182,666,000.000	
ING LIFE INSURANCE KOREA LTD	2,625	52,000.000	136,500,000.000	
NETMARBLE GAMES CORP	1,710	168,000.000	287,280,000.000	
SAMSUNG SDS CO LTD	3,260	251,000.000	818,260,000.000	
WOORI BANK	32,025	16,800.000	538,020,000.000	
SAMSUNG C&T CORP	6,690	133,500.000	893,115,000.000	
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	1,550	401,000.000	621,550,000.000	
DOOSAN BOBCAT INC	2,980	35,350.000	105,343,000.000	
SILLAJEN INC	4,737	98,000.000	464,226,000.000	
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	2,973	109,000.000	324,057,000.000	
韓国・ウォン 小計	812,811		82,101,453,380.000 (8,571,391,732)	
香港・ドル				
JIANGXI COPPER CO LTD	122,000	13.300	1,622,600.000	
JIANGSU EXPRESS	124,000	12.280	1,522,720.000	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD	162,000	8.420	1,364,040.000	
CHINA MOBILE LIMITED	557,000	77.400	43,111,800.000	
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	106,500	42.900	4,568,850.000	
BEIJING ENTERPRISES	48,500	44.950	2,180,075.000	
HUANENG POWER INTERNATIONAL IN	424,000	5.090	2,158,160.000	
ALIBABA HEALTH INFORMATION TECHNOLOGY	276,000	4.100	1,131,600.000	
YANZHOU COAL MINING CO LTD	186,000	11.760	2,187,360.000	
HENGAN INTERNATIONAL GROUP	63,000	81.050	5,106,150.000	
CNOOC LTD	1,594,000	12.220	19,478,680.000	
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	268,000	20.200	5,413,600.000	

CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LTD	416,000	17.980	7,479,680.000	
CHINA OVERSEAS LAND & INVESTME	337,120	29.050	9,793,336.000	
CHINA RESOURCES LAND LTD	234,888	26.800	6,294,998.400	
CITIC LTD	497,000	11.580	5,755,260.000	
BEIJING CAPITAL INTERNATIONAL	150,000	12.580	1,887,000.000	
LENOVO GROUP LTD	682,000	4.590	3,130,380.000	
PETRO CHINA CO LTD	1,840,000	5.820	10,708,800.000	
CHINA UNICOM HONG KONG LTD	526,742	11.040	5,815,231.680	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS CO LTD	151,990	30.900	4,696,491.000	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL COR	2,267,200	6.390	14,487,408.000	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	92,000	26.150	2,405,800.000	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	74,000	51.500	3,811,000.000	
KUNLUN ENERGY COMPANY LTD	306,000	7.880	2,411,280.000	
COSCO SHIPPING PORTS LTD	162,000	8.150	1,320,300.000	
CHINA MERCHANTS PORT HOLDINGS CO LTD	96,000	20.300	1,948,800.000	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	374,000	5.520	2,064,480.000	
CHINA EVERBRIGHT LTD	56,000	18.140	1,015,840.000	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	164,000	20.800	3,411,200.000	
KINGBOARD CHEMICALS HOLDINGS	55,000	43.200	2,376,000.000	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LTD	442,000	26.700	11,801,400.000	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LTD	88,000	24.700	2,173,600.000	
BYD CO LTD	63,000	68.850	4,337,550.000	
CHINA TELECOM CORP LTD	1,208,000	3.760	4,542,080.000	
CHINA OILFIELD SERVICES LTD	120,000	9.550	1,146,000.000	
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	1,170,000	1.070	1,251,900.000	
CHINA EVERBRIGHT INTERNATIONAL	235,000	11.080	2,603,800.000	
LEE & MAN PAPER MANUFACTURING LTD	124,000	9.460	1,173,040.000	
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	407,192	15.580	6,344,051.360	
AVICHINA INDUSTRY & TECHNOLOGY	225,000	4.220	949,500.000	
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS	159,200	14.180	2,257,456.000	

GREAT WALL MOTOR COMPANY LTD	290,000	9.450	2,740,500.000	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	668,000	24.400	16,299,200.000	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD	583,000	3.470	2,023,010.000	
SHANDONG WEIGAO GROUP MEDICAL-H	160,000	5.630	900,800.000	
SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	275,700	12.340	3,402,138.000	
WEICHAI POWER CO LTD	194,440	9.700	1,886,068.000	
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEMICAL	353,000	4.650	1,641,450.000	
SHANGHAI INDUSTRIAL	43,000	22.850	982,550.000	
TINGYI HOLDING CORP	186,000	15.560	2,894,160.000	
TSINGTAO BREWERY CO LTD	24,000	45.850	1,100,400.000	
GUANGDONG INVESTMENTS LTD	278,000	10.660	2,963,480.000	
CHINA RESOURCES BEER HOLDINGS	153,333	30.200	4,630,656.600	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO LTD	146,000	9.340	1,363,640.000	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	418,000	14.600	6,102,800.000	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	239,000	24.200	5,783,800.000	
TENCENT HOLDINGS LTD	516,900	440.400	227,642,760.000	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	471,000	83.150	39,163,650.000	
BEIJING ENTERPRISES WATER GROUP LTD	456,000	6.060	2,763,360.000	
GOME RETAIL HOLDINGS LTD	970,240	0.980	950,835.200	
AIR CHINA / HONG KONG	162,000	9.940	1,610,280.000	
ZTE CORP	71,288	29.600	2,110,124.800	
SHANGHAI ELECTRIC GROUP CO LTD	250,000	3.210	802,500.000	
CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD	302,500	22.300	6,745,750.000	
BANK OF COMMUNICATIONS	851,205	6.030	5,132,766.150	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT HOLDINGS LTD	210,250	11.800	2,480,950.000	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	66,000	142.400	9,398,400.000	
CHINA CONSTRUCTION BANK	7,625,530	7.650	58,335,304.500	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP HOLDINGS LTD	66,000	77.800	5,134,800.000	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	256,000	9.420	2,411,520.000	
AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	124,000	14.400	1,785,600.000	
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS LTD	167,000	12.840	2,144,280.000	
CHINA NATIONAL BLDG MATERIAL	290,000	8.310	2,409,900.000	

BANK OF CHINA LTD	7,173,200	4.020	28,836,264.000	
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	118,500	22.450	2,660,325.000	
GUANGZHOU R&F PROPERTIES CO LTD	96,800	21.900	2,119,920.000	
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	349,970	33.800	11,828,986.000	
IND & COMM BK OF CHINA - H	6,680,235	6.540	43,688,736.900	
CHINA COMMUNICATIONS SERVICES	199,600	5.110	1,019,956.000	
CHINA COMMUNICATIONS CONSTRUCTION CO LTD	366,000	9.170	3,356,220.000	
HAITIAN INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	64,000	23.700	1,516,800.000	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC CO LTD	52,500	50.650	2,659,125.000	
HAIER ELECTRONICS GROUP CO LTD	118,000	24.800	2,926,400.000	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD	475,142	18.480	8,780,624.160	
CHINA MOLYBDENUM CO LTD	306,000	5.520	1,689,120.000	
CHINA CITIC BANK-H	750,800	5.350	4,016,780.000	
SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	64,000	103.000	6,592,000.000	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	99,000	37.450	3,707,550.000	
FOSUN INTERNATIONAL	241,528	18.580	4,487,590.240	
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP LTD	376,000	3.980	1,496,480.000	
SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD	302,000	6.340	1,914,680.000	
SOHO CHINA LTD	178,000	4.950	881,100.000	
KINGSOFT CORP LTD	80,000	27.400	2,192,000.000	
GCL POLY ENERGY HOLDINGS LTD	1,314,000	1.440	1,892,160.000	
CHINA RAILWAY GROUP LTD	376,000	5.900	2,218,400.000	
BYD ELECTRONIC INTERNATIONAL CO LTD	53,000	18.520	981,560.000	
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION CORP	187,500	9.260	1,736,250.000	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	475,000	6.450	3,063,750.000	
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	233,200	36.950	8,616,740.000	
CHINA EVERGRANDE GROUP	295,000	29.450	8,687,750.000	
CRRC CORP LTD - H	387,450	8.170	3,165,466.500	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDINGS LTD	127,000	19.960	2,534,920.000	
SUN ART RETAIL GROUP LTD	235,500	8.200	1,931,100.000	
SINOPHARM GROUP CO	98,400	33.650	3,311,160.000	

GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD	205,805	18.600	3,827,973.000	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL BANK	212,000	5.960	1,263,520.000	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP CORP	317,000	5.680	1,800,560.000	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD	71,800	21.050	1,511,390.000	
HUANENG RENEWABLES CORP LTD	472,000	2.640	1,246,080.000	
SIHUA PHARMACEUTICAL HOLDINGS GROUP LTD	325,000	3.100	1,007,500.000	
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	213,000	38.650	8,232,450.000	
LONGFOR PROPERTIES CO LTD	139,000	24.250	3,370,750.000	
NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	72,700	53.050	3,856,735.000	
CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	477,380	8.140	3,885,873.200	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD	257,000	3.770	968,890.000	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA	2,359,000	3.970	9,365,230.000	
FAR EAST HORIZON LTD	202,000	7.500	1,515,000.000	
CITIC SECURITIES CO LTD	215,500	17.740	3,822,970.000	
HAITONG SECURITIES CO LTD	306,400	12.100	3,707,440.000	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROUP OF CHINA LTD	670,000	4.020	2,693,400.000	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	49,000	48.700	2,386,300.000	
CHINA GALAXY SECURITIES CO LTD	335,000	6.060	2,030,100.000	
HANERGY THIN FILM POWER GROUP	986,000	0.000	0.000	
NEXTEER AUTOMOTIVE GROUP LTD	71,000	19.540	1,387,340.000	
CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS CO LTD	323,000	0.210	67,830.000	
CHINA CINDA ASSET MANAGEMENT CO LTD	842,000	3.030	2,551,260.000	
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS LTD	157,000	21.200	3,328,400.000	
CHINA VANKE CO LTD-H	110,961	39.000	4,327,479.000	
CGN POWER CO LTD	780,000	2.140	1,669,200.000	
FULLSHARE HOLDINGS LTD	677,500	3.580	2,425,450.000	
GF SECURITIES CO LTD	133,200	16.340	2,176,488.000	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD	51,200	34.700	1,776,640.000	
HUATAI SECURITIES CO LTD	155,600	17.060	2,654,536.000	
3SBIO INC	90,000	16.480	1,483,200.000	

	CHINA RESOURCES PHARMACEUTICAL GROUP LTD	147,500	10.360	1,528,100.000	
	CHINA HUARONG ASSET MANAGEMENT CO LTD	850,000	3.810	3,238,500.000	
	MEITU INC	105,000	12.000	1,260,000.000	
香港・ドル	小計	67,774,589		905,853,228.690 (12,908,408,509)	
台湾・ドル	ACER INC	304,532	25.100	7,643,753.200	
	ASUSTEK COMPUTER INC	61,554	264.000	16,250,256.000	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	46,616	113.000	5,267,608.000	
	ADVANCED SEMICONDUCTOR ENGINEERING INC	595,806	39.000	23,236,434.000	
	ASIA CEMENT CORP	167,928	30.500	5,121,804.000	
	TAIWAN BUSINESS BANK	336,171	8.530	2,867,538.630	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMICONDUCTOR CORP	78,000	62.800	4,898,400.000	
	MICRO-STAR INTERNATIONAL CO LTD	57,000	85.100	4,850,700.000	
	CHICONY ELECTRONICS CO LTD	46,543	74.700	3,476,762.100	
	QUANTA COMPUTER INC	235,858	61.900	14,599,610.200	
	HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	90,070	42.750	3,850,492.500	
	EVA AIRWAYS CORP	158,161	16.050	2,538,484.050	
	CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	58,760	319.000	18,744,440.000	
	CHANG HWA COMMERCIAL BANK	431,755	17.050	7,361,422.750	
	CHINA AIRLINES	232,156	12.550	2,913,557.800	
	CHENG SHIN RUBBER INDUSTRY CO	186,169	51.500	9,587,703.500	
	CHINA STEEL CORP	1,111,058	25.300	28,109,767.400	
	CHINA LIFE INSURANCE CO LTD/TAIWAN	254,146	30.500	7,751,453.000	
	ADVANTECH CO LTD	33,889	225.500	7,641,969.500	
	COMPAL ELECTRONICS INC	405,304	20.750	8,410,058.000	
	DELTA ELECTRONICS INC	170,663	138.500	23,636,825.500	
	NANYA TECHNOLOGY CORP	68,000	78.300	5,324,400.000	
	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	350,327	108.500	38,010,479.500	
	AU OPTRONICS CORP	814,194	12.400	10,096,005.600	
	TAIWAN MOBILE CO LTD	159,800	110.000	17,578,000.000	
	EVERGREEN MARINE CORP	178,658	17.750	3,171,179.500	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	234,824	27.000	6,340,248.000	
	FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	29,825	139.500	4,160,587.500	
	ECLAT TEXTILE CO LTD	18,322	294.000	5,386,668.000	
	NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	43,285	115.500	4,999,417.500	
	FORMOSA PLASTICS CORP	370,633	101.000	37,433,933.000	

FORMOSA TAFFETA CO LTD	65,000	32.400	2,106,000.000	
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE CO	260,594	108.000	28,144,152.000	
GIANT MANUFACTURING	30,151	167.000	5,035,217.000	
MEDIATEK INC	135,507	309.500	41,939,416.500	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD	595,936	53.000	31,584,608.000	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	700,313	17.300	12,115,414.900	
HOTAI MOTOR CO LTD	25,000	355.000	8,875,000.000	
FAR EASTONE TELECOMMUNICATIONS CO LTD	150,000	76.400	11,460,000.000	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	850,141	13.950	11,859,466.950	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	734,920	55.600	40,861,552.000	
CHINA DEPT FINANCIAL HOLDING	1,278,403	10.650	13,614,991.950	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO LTD	854,028	19.600	16,738,948.800	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	1,414,532	90.800	128,439,505.600	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LTD	967,495	25.350	24,525,998.250	
LARGAN PRECISION CO LTD	9,220	3,775.000	34,805,500.000	
TAISHIN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	769,977	14.550	11,203,165.350	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING CO	813,724	10.850	8,828,905.400	
INVENTEC CO LTD	254,005	23.450	5,956,417.250	
HTC CORPORATION	56,832	70.800	4,023,705.600	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	210,845	39.900	8,412,715.500	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	810,533	9.970	8,081,014.010	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,566,048	21.700	33,983,241.600	
MACRONIX INTERNATIONAL	158,000	41.100	6,493,800.000	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO LTD	882,327	19.850	17,514,190.950	
POWERTECH TECHNOLOGY INC	68,560	90.600	6,211,536.000	
NAN YA PLASTICS CORP	425,828	82.700	35,215,975.600	
WISTRON CORP	259,301	23.300	6,041,713.300	
POU CHEN CORP	210,990	38.400	8,102,016.000	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CORP	427,297	67.600	28,885,277.200	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	56,392	283.000	15,958,936.000	
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	119,480	120.000	14,337,600.000	
PHISON ELECTRONICS CORP	12,658	315.500	3,993,599.000	



	RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	90,656	33.300	3,018,844.800	
	RUENTEX INDUSTRIES LTD	47,715	51.500	2,457,322.500	
	FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	88,588	84.100	7,450,250.800	
	SILICONWARE PRECISION INDS	191,743	50.300	9,644,672.900	
	STANDARD FOODS CORP	35,639	74.800	2,665,797.200	
	SYNNEX TECHNOLOGY INTERNATIONAL CORP	144,899	41.600	6,027,798.400	
	TAIWAN CEMENT CORP	327,874	38.450	12,606,755.300	
	TECO ELECTRIC AND MACHINERY CO LTD	118,000	28.700	3,386,600.000	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR	2,239,083	236.500	529,543,129.500	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	1,122,525	14.200	15,939,855.000	
	WINBOND ELECTRONICS CORP	254,000	24.050	6,108,700.000	
	YAGEO CORP	17,000	379.500	6,451,500.000	
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	142,000	23.800	3,379,600.000	
	INNOLUX CORPORATION	821,345	12.400	10,184,678.000	
	WPG HOLDINGS CO LTD	156,526	40.050	6,268,866.300	
	HIWIN TECHNOLOGIES CORP	20,560	339.000	6,969,840.000	
	TAI MED BIOLOGICS INC	18,000	194.000	3,492,000.000	
	PEGATRON CORP	189,554	72.500	13,742,665.000	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	10,000	498.000	4,980,000.000	
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	29,000	270.000	7,830,000.000	
	CHAI LEASE HOLDING CO LTD	112,076	92.800	10,400,652.800	
	ASIA PACIFIC TELECOM CO LTD	188,000	10.100	1,898,800.000	
	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING LTD	48,385	68.200	3,299,857.000	
	TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL HOLDING	732,828	17.350	12,714,565.800	
	GLOBALWAFERS CO LTD	21,000	417.000	8,757,000.000	
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	15,000	306.500	4,597,500.000	
	GENERAL INTERFACE SOLUTION HOLDING LTD	18,000	192.000	3,456,000.000	
	台湾・ドル 小計	29,704,040		1,683,882,790.740 (6,348,238,121)	
南アフリカ・ランド	BIDVEST GROUP LTD	31,400	208.500	6,546,900.000	
	TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	43,580	89.500	3,900,410.000	
	DISCOVERY LTD	34,030	180.000	6,125,400.000	
	REDEFINE PROPERTIES LTD	487,300	10.460	5,097,158.000	
	GOLD FIELDS LTD	85,000	52.450	4,458,250.000	
	REMGRO LTD	44,220	231.900	10,254,618.000	
	THE FOSCHINI GROUP LTD	21,500	179.050	3,849,575.000	

MMI HOLDINGS LTD	82,706	20.070	1,659,909.420	
GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	207,700	26.500	5,504,050.000	
EXXARO RESOURCES LTD	19,985	165.500	3,307,517.500	
CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	3,850	1,033.580	3,979,283.000	
LIBERTY HOLDINGS LTD	14,449	120.000	1,733,880.000	
MTN GROUP LTD	151,513	135.640	20,551,223.320	
ANGLOGOLD ASHANTI LTD	34,938	133.500	4,664,223.000	
TELKOM SA SOC LTD	20,227	46.650	943,589.550	
FIRSTRAND LTD	299,334	63.000	18,858,042.000	
PSG GROUP LTD	8,084	255.100	2,062,228.400	
NASPERS LTD	39,745	3,615.020	143,678,969.900	
CORONATION FUND MANAGERS LTD	19,000	71.030	1,349,570.000	
NEDBANK GROUP LTD	21,600	254.200	5,490,720.000	
NETCARE LTD	105,400	23.740	2,502,196.000	
PICK'N PAY STORES LTD	30,212	67.560	2,041,122.720	
RMB HOLDINGS LTD	53,867	74.140	3,993,699.380	
ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	6,200	378.840	2,348,808.000	
SAPPI LTD	53,960	85.560	4,616,817.600	
SASOL LTD	49,590	444.630	22,049,201.700	
SHOPRITE HOLDINGS LTD	39,325	216.680	8,520,941.000	
MR PRICE GROUP LTD	23,720	243.300	5,771,076.000	
BRAIT SE	37,060	40.880	1,515,012.800	
STANDARD BANK GROUP LTD	115,586	190.960	22,072,302.560	
SPAR GROUP LTD/THE	13,937	193.800	2,700,990.600	
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	93,400	64.800	6,052,320.000	
IMPERIAL HOLDINGS LTD	13,278	246.000	3,266,388.000	
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LTD	34,131	243.810	8,321,479.110	
BARCLAYS AFRICA GROUP LTD	59,024	174.460	10,297,327.040	
TIGER BRANDS LTD	15,100	442.210	6,677,371.000	
SANLAM LTD	121,400	82.800	10,051,920.000	
INVESTEC LTD	30,200	88.650	2,677,230.000	
KUMBA IRON ORE LTD	5,327	402.470	2,143,957.690	
PIONEER FOODS LTD	10,707	136.710	1,463,753.970	
MONDI LTD	11,520	319.750	3,683,520.000	
LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDINGS LTD	130,000	26.750	3,477,500.000	
RMI HOLDINGS	63,840	44.600	2,847,264.000	
VODACOM GROUP PTY LTD	58,000	143.000	8,294,000.000	
SIBANYE GOLD LTD	172,000	16.200	2,786,400.000	
NEPI ROCKCASTLE PLC	36,000	188.500	6,786,000.000	
FORTRESS REIT LTD-A	102,950	18.030	1,856,188.500	
FORTRESS REIT LTD-B	57,876	35.910	2,078,327.160	
STEINHOFF INTERNATIONAL HOLDINGS NV	267,866	7.550	2,022,388.300	
BID CORP LTD	32,520	297.560	9,676,651.200	

南アフリカ・ランド 小計	3,514,157		426,607,671.420 (3,822,404,735)	
合計	194,408,063		56,566,691,714 (56,566,691,714)	

## (2) 株式以外の有価証券

平成30年1月11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	メキシコ・ペソ	CEMEX SAB DE CV	1,291,375.000	19,383,538.750	
		FOMENTO ECONOMICO MEXICANO SAB DE CV	172,500.000	31,131,075.000	
	メキシコ・ペソ	小計	1,463,875.000	50,514,613.750 (291,974,467)	
投資信託受益証券 合計			1,463,875	291,974,467 (291,974,467)	
投資証券	トルコ・リラ	EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATIRIM	162,734.000	447,518.500	
		トルコ・リラ 小計	162,734.000	447,518.500 (13,139,143)	
	メキシコ・ペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	245,200.000	6,944,064.000	
	メキシコ・ペソ	小計	245,200.000	6,944,064.000 (40,136,689)	
	南アフリカ・ランド	HYPROP INVESTMENTS LTD	25,100.000	2,806,180.000	
		RESILIENT REIT LTD	28,600.000	3,843,840.000	
	南アフリカ・ランド	小計	53,700.000	6,650,020.000 (59,584,180)	
投資証券 合計			461,634	112,860,012 (112,860,012)	
合計				404,834,479 (404,834,479)	

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 38銘柄	11.05%	-%	-%	11.98%
アラブ首長国連邦・ディ ルハム	株式 10銘柄	0.53%	-%	-%	0.57%
インド・ルピー	株式 79銘柄	8.01%	-%	-%	8.69%
インドネシア・ルピア	株式 29銘柄	2.02%	-%	-%	2.19%
カタール・リアル	株式 12銘柄	0.53%	-%	-%	0.57%
コロンビア・ペソ	株式 9銘柄	0.38%	-%	-%	0.41%
タイ・バーツ	株式 35銘柄	2.11%	-%	-%	2.29%
チェコ・コルナ	株式 4銘柄	0.16%	-%	-%	0.17%
チリ・ペソ	株式 19銘柄	1.15%	-%	-%	1.25%
トルコ・リラ	株式 24銘柄 投資証券 1銘柄	0.91% -%	-% -%	-% 0.02%	1.01%
ハンガリー・フォリント	株式 3銘柄	0.30%	-%	-%	0.32%
パキスタン・ルピー	株式 5銘柄	0.07%	-%	-%	0.08%
フィリピン・ペソ	株式 23銘柄	1.03%	-%	-%	1.12%
ブラジル・リアル	株式 53銘柄	6.34%	-%	-%	6.88%
ポーランド・ズロチ	株式 23銘柄	1.20%	-%	-%	1.30%
マレーシア・リングgit	株式 46銘柄	2.15%	-%	-%	2.33%
メキシコ・ペソ	株式 23銘柄 投資信託 受益証券 2銘柄 投資証券 1銘柄	2.08% -% -%	-% 0.47% -%	-% -% 0.06%	2.84%
ユーロ	株式 9銘柄	0.30%	-%	-%	0.33%
韓国・ウォン	株式 113銘柄	13.87%	-%	-%	15.05%
香港・ドル	株式 138銘柄	20.88%	-%	-%	22.66%
台湾・ドル	株式 90銘柄	10.27%	-%	-%	11.14%
南アフリカ・ランド	株式 50銘柄 投資証券 2銘柄	6.18% -%	-% -%	-% 0.10%	6.81%

(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」の状況

## 貸借対照表

(単位:円)

科 目	注記 番号	平成29年1月11日現在	平成30年1月11日現在
資産の部			
流動資産			
預金		1,392,947,346	2,451,465,696
コール・ローン		40,367,352	395,982,514
国債証券		59,705,345,865	98,971,707,355
派生商品評価勘定		15,050	-
未収入金		799,207,916	418,714,761
未収利息		889,379,035	1,507,428,223
前払費用		212,084,575	95,331,659
流動資産合計		63,039,347,139	103,840,630,208
資産合計		63,039,347,139	103,840,630,208
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		-	2,556,800
未払金		449,924,800	602,479,744
未払解約金		8,724,000	68,895,000
流動負債合計		458,648,800	673,931,544
負債合計		458,648,800	673,931,544
純資産の部			
元本等			
元本	1	34,034,697,085	54,256,447,518
剰余金			
剰余金又は欠損金( )		28,546,001,254	48,910,251,146
元本等合計		62,580,698,339	103,166,698,664
純資産合計		62,580,698,339	103,166,698,664
負債純資産合計		63,039,347,139	103,840,630,208

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1 . 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 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期間末日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
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、決算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

## （貸借対照表に関する注記）

項目		平成29年1月11日現在	平成30年1月11日現在
1 .	1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	32,117,451,125円	34,034,697,085円
	同期中追加設定元本額	30,255,950,796円	36,324,035,709円
	同期中一部解約元本額	28,338,704,836円	16,102,285,276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）	107,754,586円	231,736,287円
	たわらノーロード バランス（8資産均等型）	- 円	13,439,320円
	たわらノーロード バランス（堅実型）	- 円	185,533円
	たわらノーロード バランス（標準型）	- 円	578,044円
	たわらノーロード バランス（積極型）	- 円	658,928円
	マネックス資産設計ファンドエボリューション	62,904,586円	75,944,530円
	D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国10）	21,415,594円	27,320,395円
	D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国20）	56,453,241円	90,077,700円
	D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国30）	127,202,886円	200,732,596円
	投資のソムリエ	2,270,942,339円	5,386,829,880円
	クルーズコントロール	1,232,756,282円	1,391,418,497円
	投資のソムリエ<DC年金>	67,005,956円	341,339,293円
	D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	68,279,113円	103,835,053円
	クルーズコントロール<DC年金>	484,717円	485,809円
	D I A Mコア資産設計ファンド（堅実型）	9,088,948円	6,404,568円
	D I A Mコア資産設計ファンド（積極型）	20,186,811円	14,622,181円
	投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	5,239,965円	137,701,694円
	ダイナミック・ナビゲーション	161,183円	188,968円
	リスク抑制世界8資産バランスファンド	113,191円	1,912,437,568円
	ワールドアセットバランス（基本コース）	- 円	704,245,670円
	ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）	- 円	2,707,059,809円
	投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2045）	- 円	802,092円
	投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2055）	- 円	802,092円
	リスク抑制世界8資産バランスファンド（DC）	- 円	641,925円



投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2035)	- 円	680,332円
エマージング債券リスク抑制型 (適格機関投資家限定)	6,452,299,432円	12,745,371,625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)	3,492,792,856円	3,284,400,424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)	7,824,353,289円	7,316,952,369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)	4,959,932,756円	4,762,929,633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)	2,913,975,455円	4,695,478,120円
DIAMグローバル・リスク ファクター・パリティ戦略ファ ンドII(適格機関投資家限 定)	4,341,353,899円	4,875,707,169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)	- 円	3,225,439,414円
計	34,034,697,085円	54,256,447,518円
2. 受益権の総数	34,034,697,085口	54,256,447,518口

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成28年1月13日 至 平成29年1月11日	自 平成29年1月12日 至 平成30年1月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成29年1月11日現在	平成30年1月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	平成29年1月11日現在	平成30年1月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
国債証券	2,083,575,977	248,212,144
合計	2,083,575,977	248,212,144

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(平成28年4月19日から平成29年1月11日まで及び平成29年4月19日から平成30年1月11日まで)に対応する金額であります。

## (デリバティブ取引等に関する注記)

## 通貨関連

種類	平成29年1月11日 現在				平成30年1月11日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	498,600,050	-	498,585,000	15,050	980,663,200	-	980,672,000	8,800
アメリカ・ドル	498,600,050	-	498,585,000	15,050	980,663,200	-	980,672,000	8,800
買 建	-	-	-	-	292,344,000	-	289,796,000	2,548,000
アメリカ・ドル	-	-	-	-	292,344,000	-	289,796,000	2,548,000
合計	498,600,050	-	498,585,000	15,050	1,273,007,200	-	1,270,468,000	2,556,800

## （注）時価の算定方法

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

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

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

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

2. 計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （1口当たり情報に関する注記）

	平成29年1月11日現在	平成30年1月11日現在
1口当たり純資産額	1.8387円	1.9015円
（1万口当たり純資産額）	（18,387円）	（19,015円）

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

平成30年1月11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	7,400,000.000	7,159,500.000	
		BRAZIL 4.25 01/07/25	14,100,000.000	14,434,875.000	
		BRAZIL 4.875 01/22/21	9,400,000.000	9,982,800.000	
		BRAZIL 5.0 01/27/45	11,000,000.000	10,340,000.000	
		BRAZIL 5.625 01/07/41	8,300,000.000	8,528,250.000	
		BRAZIL 5.625 02/21/47	4,600,000.000	4,726,500.000	
		BRAZIL 6.0 04/07/26	7,000,000.000	7,857,500.000	
		BRAZIL 7.125 01/20/37	6,700,000.000	8,140,500.000	
		BRAZIL 8.25 01/20/34	4,800,000.000	6,308,160.000	
		BRAZIL 8.75 02/04/25	2,600,000.000	3,365,700.000	
		BRAZIL 8.875 10/14/19	3,800,000.000	4,240,800.000	
		COLOMBIA 2.625 03/15/23	3,300,000.000	3,219,546.000	
		COLOMBIA 3.875 04/25/27	8,000,000.000	8,105,600.000	
		COLOMBIA 4.0 02/26/24	6,900,000.000	7,136,325.000	
		COLOMBIA 4.375 07/12/21	7,800,000.000	8,229,000.000	
		COLOMBIA 4.5 01/28/26	5,000,000.000	5,326,850.000	
		COLOMBIA 5.0 06/15/45	12,600,000.000	13,245,750.000	
		COLOMBIA 5.625 02/26/44	8,200,000.000	9,360,300.000	
		COLOMBIA 6.125 01/18/41	8,000,000.000	9,624,000.000	
		COLOMBIA 7.375 03/18/19	7,900,000.000	8,354,250.000	
		COLOMBIA 7.375 09/18/37	5,400,000.000	7,254,900.000	
		COLOMBIA 8.125 05/21/24	3,100,000.000	3,931,110.000	
		CROATIA 5.5 04/04/23	4,400,000.000	4,843,124.000	
		CROATIA 6.0 01/26/24	4,200,000.000	4,776,618.000	
		CROATIA 6.375 03/24/21	3,300,000.000	3,619,605.000	
		CROATIA 6.625 07/14/20	5,200,000.000	5,654,428.000	
		CROATIA 6.75 11/05/19	6,600,000.000	7,059,294.000	
		HUNGARY 4.0 03/25/19	3,800,000.000	3,874,062.000	
		HUNGARY 5.375 02/21/23	4,900,000.000	5,425,574.000	
		HUNGARY 5.375 03/25/24	3,600,000.000	4,044,348.000	
		HUNGARY 5.75 11/22/23	8,200,000.000	9,334,142.000	
		HUNGARY 6.25 01/29/20	4,900,000.000	5,241,334.000	
		HUNGARY 6.375 03/29/21	8,000,000.000	8,851,680.000	
		HUNGARY 7.625 03/29/41	3,400,000.000	5,255,414.000	
INDONESIA 11.625 03/04/19	7,400,000.000	8,178,036.000			
INDONESIA 3.375 04/15/23	4,500,000.000	4,548,735.000			
INDONESIA 3.75 04/25/22	6,600,000.000	6,798,330.000			
INDONESIA 4.125 01/15/25	8,200,000.000	8,540,464.000			
INDONESIA 4.35 01/08/27	4,000,000.000	4,229,000.000			
INDONESIA 4.625 04/15/43	4,000,000.000	4,132,640.000			

INDONESIA 4.75 01/08/26	6,600,000.000	7,178,028.000	
INDONESIA 4.875 05/05/21	6,500,000.000	6,927,765.000	
INDONESIA 5.125 01/15/45	5,200,000.000	5,699,304.000	
INDONESIA 5.25 01/08/47	4,000,000.000	4,499,240.000	
INDONESIA 5.25 01/17/42	5,900,000.000	6,566,877.000	
INDONESIA 5.375 10/17/23	1,500,000.000	1,670,625.000	
INDONESIA 5.875 01/15/24	7,000,000.000	8,005,550.000	
INDONESIA 5.95 01/08/46	3,200,000.000	3,945,856.000	
INDONESIA 6.75 01/15/44	5,300,000.000	7,074,705.000	
INDONESIA 7.75 01/17/38	5,300,000.000	7,502,839.000	
PANAMA 3.75 03/16/25	5,000,000.000	5,216,250.000	
PANAMA 3.875 03/17/28	4,200,000.000	4,407,900.000	
PANAMA 5.2 01/30/20	6,400,000.000	6,745,600.000	
PANAMA 6.7 01/26/36	8,200,000.000	10,921,580.000	
PANAMA 7.125 01/29/26	4,800,000.000	6,177,600.000	
PANAMA 9.375 04/01/29	4,700,000.000	7,141,650.000	
PERU 4.125 08/25/27	5,600,000.000	6,120,800.000	
PERU 5.625 11/18/50	10,800,000.000	13,905,540.000	
PERU 6.55 03/14/37	5,200,000.000	7,035,600.000	
PERU 7.35 07/21/25	9,000,000.000	11,626,200.000	
PHILIPPINES 3.7 02/02/42	5,400,000.000	5,362,092.000	
PHILIPPINES 3.7 03/01/41	5,200,000.000	5,183,152.000	
PHILIPPINES 3.95 01/20/40	5,200,000.000	5,387,980.000	
PHILIPPINES 4.0 01/15/21	5,600,000.000	5,858,720.000	
PHILIPPINES 4.2 01/21/24	4,200,000.000	4,560,780.000	
PHILIPPINES 5.0 01/13/37	3,800,000.000	4,528,308.000	
PHILIPPINES 5.5 03/30/26	3,000,000.000	3,555,120.000	
PHILIPPINES 6.375 01/15/32	3,000,000.000	3,945,120.000	
PHILIPPINES 6.375 10/23/34	5,800,000.000	7,819,966.000	
PHILIPPINES 6.5 01/20/20	1,800,000.000	1,957,734.000	
PHILIPPINES 7.75 01/14/31	5,300,000.000	7,611,436.000	
PHILIPPINES 8.375 06/17/19	4,300,000.000	4,683,775.000	
PHILIPPINES 9.5 02/02/30	5,800,000.000	9,214,576.000	
ROMANIA 4.375 08/22/23	5,600,000.000	5,942,272.000	
ROMANIA 4.875 01/22/24	2,400,000.000	2,614,488.000	
ROMANIA 6.125 01/22/44	2,800,000.000	3,557,120.000	
ROMANIA 6.75 02/07/22	7,300,000.000	8,317,182.000	
RUSSIA FOREIGN BOND 5.0 04/29/20	11,400,000.000	11,976,954.000	
RUSSIAN FEDERATION 03/31/30	22,467,500.000	25,832,232.800	
RUSSIAN FEDERATION 4.25 06/23/27	6,000,000.000	6,195,840.000	
RUSSIAN FEDERATION 4.5 04/04/22	6,600,000.000	6,997,386.000	
RUSSIAN FEDERATION 4.75 05/27/26	10,000,000.000	10,648,600.000	
RUSSIAN FEDERATION 4.875 09/16/23	10,200,000.000	11,069,754.000	

RUSSIAN FEDERATION 5.25 06/23/47	13,000,000.000	13,668,200.000	
RUSSIAN FEDERATION 5.625 04/04/42	9,000,000.000	10,136,700.000	
RUSSIAN FEDERATION 5.875 09/16/43	3,600,000.000	4,196,520.000	
SOUTH AFRICA 4.3 10/12/28	6,200,000.000	6,026,090.000	
SOUTH AFRICA 4.665 01/17/24	4,500,000.000	4,635,225.000	
SOUTH AFRICA 4.875 04/14/26	3,600,000.000	3,709,728.000	
SOUTH AFRICA 5.0 10/12/46	2,400,000.000	2,311,200.000	
SOUTH AFRICA 5.375 07/24/44	2,600,000.000	2,646,280.000	
SOUTH AFRICA 5.5 03/09/20	5,000,000.000	5,260,950.000	
SOUTH AFRICA 5.875 05/30/22	2,600,000.000	2,846,116.000	
SOUTH AFRICA 5.875 09/16/25	6,000,000.000	6,591,120.000	
SOUTH AFRICA 6.875 05/27/19	6,300,000.000	6,635,601.000	
TURKEY 11.875 01/15/30	4,300,000.000	6,765,620.000	
TURKEY 3.25 03/23/23	4,100,000.000	3,899,879.000	
TURKEY 4.25 04/14/26	4,400,000.000	4,191,000.000	
TURKEY 4.875 04/16/43	7,700,000.000	6,706,623.000	
TURKEY 4.875 10/09/26	9,600,000.000	9,440,352.000	
TURKEY 5.125 03/25/22	4,700,000.000	4,876,485.000	
TURKEY 5.625 03/30/21	6,300,000.000	6,650,595.000	
TURKEY 5.75 03/22/24	8,100,000.000	8,588,997.000	
TURKEY 5.75 05/11/47	9,000,000.000	8,713,890.000	
TURKEY 6.0 01/14/41	8,500,000.000	8,591,375.000	
TURKEY 6.0 03/25/27	9,400,000.000	9,951,874.000	
TURKEY 6.25 09/26/22	5,500,000.000	5,983,340.000	
TURKEY 6.625 02/17/45	7,900,000.000	8,541,322.000	
TURKEY 6.75 05/30/40	6,100,000.000	6,717,991.000	
TURKEY 7.0 03/11/19	6,100,000.000	6,374,500.000	
TURKEY 7.0 06/05/20	5,700,000.000	6,160,047.000	
TURKEY 7.375 02/05/25	9,300,000.000	10,681,050.000	
TURKEY 7.5 11/07/19	5,400,000.000	5,801,436.000	
UNITED MEXICAN STATES 3.5 01/21/21	4,600,000.000	4,756,400.000	
UNITED MEXICAN STATES 3.6 01/30/25	8,200,000.000	8,257,400.000	
UNITED MEXICAN STATES 3.625 03/15/22	8,900,000.000	9,224,850.000	
UNITED MEXICAN STATES 4.0 10/02/23	10,300,000.000	10,758,350.000	
UNITED MEXICAN STATES 4.125 01/21/26	9,000,000.000	9,312,750.000	



	UNITED MEXICAN STATES 4.15 03/28/27	9,200,000.000	9,469,100.000	
	UNITED MEXICAN STATES 4.35 01/15/47	5,800,000.000	5,449,100.000	
	UNITED MEXICAN STATES 4.6 01/23/46	8,800,000.000	8,562,400.000	
	UNITED MEXICAN STATES 4.75 03/08/44	13,000,000.000	12,987,000.000	
	UNITED MEXICAN STATES 5.55 01/21/45	9,000,000.000	10,037,250.000	
	UNITED MEXICAN STATES 5.75 10/12/2110	7,800,000.000	8,264,100.000	
	UNITED MEXICAN STATES 6.05 01/11/40	9,900,000.000	11,535,975.000	
	UNITED MEXICAN STATES 6.75 09/27/34	5,800,000.000	7,493,600.000	
	アメリカ・ドル 小計	805,867,500.000 (89,830,050,225)	887,877,521.800 (98,971,707,355)	
国債証券 合計		89,830,050,225 (89,830,050,225)	98,971,707,355 (98,971,707,355)	
合計		89,830,050,225 (89,830,050,225)	98,971,707,355 (98,971,707,355)	

- (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 126銘柄	95.93%	100%

(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。

- (1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)並びに同規則第38条の3及び第57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、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間(平成30年1月12日から平成30年7月11日まで)の中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による中間監査を受けております。

## 【中間財務諸表】

## 【DIAM 8資産バランスファンドN&lt;DC年金&gt;】

## (1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第5期 平成30年1月11日現在	第6期中間計算期間末 平成30年7月11日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	167,605,207	199,769,459
親投資信託受益証券	3,871,629,217	4,572,604,235
未収入金	2,268,000	-
流動資産合計	4,041,502,424	4,772,373,694
<b>資産合計</b>	4,041,502,424	4,772,373,694
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	3,457,030	4,105,197
未払受託者報酬	500,817	578,285
未払委託者報酬	4,407,576	5,089,301
その他未払費用	90,062	92,606
流動負債合計	8,455,485	9,865,389
<b>負債合計</b>	8,455,485	9,865,389
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,325,718,127	1,387,492,105
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )	779,328,812	888,016,200
(分配準備積立金)	296,313,023	290,125,392
元本等合計	4,033,046,939	4,762,508,305
<b>純資産合計</b>	4,033,046,939	4,762,508,305
<b>負債純資産合計</b>	4,041,502,424	4,772,373,694

## (2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第5期中間計算期間		第6期中間計算期間	
	自	平成29年1月12日 至 平成29年7月11日	自	平成30年1月12日 至 平成30年7月11日
<b>営業収益</b>				
受取利息		13		-
有価証券売買等損益		49,781,732		21,385,982
営業収益合計		49,781,745		21,385,982
<b>営業費用</b>				
支払利息		44,223		67,814
受託者報酬		372,810		578,285
委託者報酬		3,281,098		5,089,301
その他費用		67,027		92,606
営業費用合計		3,765,158		5,828,006
営業利益又は営業損失( )		46,016,587		27,213,988
経常利益又は経常損失( )		46,016,587		27,213,988
中間純利益又は中間純損失( )		46,016,587		27,213,988
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額( )		255,116		1,055,110
期首剰余金又は期首欠損金( )		374,951,409		779,328,812
剰余金増加額又は欠損金減少額		131,826,810		152,542,027
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		131,826,810		152,542,027
剰余金減少額又は欠損金増加額		7,516,489		17,695,761
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		7,516,489		17,695,761
分配金		-		-
中間剰余金又は中間欠損金( )		545,023,201		888,016,200

## (3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第5期 平成30年1月11日現在	第6期中間計算期間末 平成30年7月11日現在
1. 1 期首元本額 期中追加設定元本額 期中一部解約元本額	2,157,071,465円 1,198,404,787円 101,758,125円	3,253,718,127円 695,173,048円 74,399,070円
2. 受益権の総数	3,253,718,127口	3,874,492,105口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	第5期 平成30年1月11日現在	第6期中間計算期間末 平成30年7月11日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間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、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

## (有価証券に関する注記)

該当事項はありません。

## (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。

## (1口当たり情報に関する注記)

	第5期 平成30年1月11日現在	第6期中間計算期間末 平成30年7月11日現在
1口当たり純資産額	1,2395円	1,2292円
(1万口当たり純資産額)	(12,395円)	(12,292円)

(参考)

当ファンドは、「国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド」受益証券、「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「J-REITインデックスファンド・マザーファンド」受益証券、「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「エマージング株式パッシブ・マザーファンド」受益証券及び「エマージング債券パッシブ・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同親投資信託の受益証券であります。

同親投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

「国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成30年1月11日現在	平成30年7月11日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		9,174,734,961	10,665,436,367
株式	2	312,504,179,760	282,144,702,720
派生商品評価勘定		176,588,080	8,365,980
未収入金		131,159,280	100,920
未収配当金		394,538,223	366,832,129
前払金		-	174,520,000
流動資産合計		322,381,200,304	293,359,958,116
資産合計		322,381,200,304	293,359,958,116
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		706,480	289,828,244
前受金		349,245,000	-
未払解約金		262,677,000	259,340,000
その他未払費用		-	6,516
流動負債合計		612,628,480	549,174,760
負債合計		612,628,480	549,174,760
純資産の部			
元本等			
元本	1	112,835,531,288	112,611,312,358
剰余金			
剰余金又は欠損金( )		208,933,040,536	180,199,470,998
元本等合計		321,768,571,824	292,810,783,356
純資産合計		321,768,571,824	292,810,783,356
負債純資産合計		322,381,200,304	293,359,958,116

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1 . 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2 . デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3 . 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

## （貸借対照表に関する注記）

項目	平成30年1月11日現在	平成30年7月11日現在
1 . 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	131,210,790,341円	112,835,531,288円
同期中追加設定元本額	20,348,712,984円	15,428,145,401円
同期中一部解約元本額	38,723,972,037円	15,652,364,331円
元本の内訳		
ファンド名		
DIAM DC 国内株式インデックスファンド	8,226,196,501円	10,490,531,830円
DIAM国内株式パッシブ・ファンド	1,839,482,555円	1,713,154,194円
MITO ラップ型ファンド（安定型）	4,123,447円	3,224,211円
MITO ラップ型ファンド（中立型）	9,291,815円	7,430,828円
MITO ラップ型ファンド（積極型）	16,267,567円	12,062,772円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	17,474,561円	20,617,488円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	13,210,945円	16,876,583円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	11,886,882円	13,636,876円
たわらノーロード TOPIX	105,629,384円	225,832,229円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	9,120,978円	36,972,701円
たわらノーロード バランス（堅実型）	62,731円	937,272円
たわらノーロード バランス（標準型）	457,256円	6,377,820円



たわらノーロード バランス(積極型)	1,941,760円	19,376,137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)	14,568円	76,147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)	18,634円	3,799,772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)	22,365円	9,844,007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)	33,208円	8,202,675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)	44,401円	20,496,624円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	- 円	37,020円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	- 円	57,120円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	- 円	424,614円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	- 円	494,006円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	- 円	1,469,719円
DIAM国内株式インデックスファンド<DC年金>	36,033,477,757円	37,556,666,205円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	755,786,995円	816,478,301円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	2,674,104,581円	2,799,587,690円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	2,772,861,201円	2,935,668,071円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	328,683,164円	339,960,129円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	1,127,448,779円	1,137,824,023円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	1,054,085,428円	1,071,695,738円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	47,522,960円	42,726,996円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	1,171,577,546円	1,084,829,283円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	24,024,004円	25,558,900円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	37,610,795円	265,421,853円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	93,210,788円	162,872,234円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	185,672,845円	289,200,624円
投資のソムリエ	2,476,860,905円	2,778,985,406円
クルーズコントロール	2,066,117,052円	748,682,483円
投資のソムリエ<DC年金>	157,129,259円	238,954,842円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	145,551,548円	180,201,550円

D I A M D C バランス・F (成長型)	190,593,286円	235,254,342円
クルーズコントロール< D C 年金 >	721,180円	322,728円
D I A M コア資産設計ファンド (堅実型)	11,905,936円	3,389,986円
D I A M コア資産設計ファンド (積極型)	27,115,492円	11,950,050円
投資のソムリエ< D C 年金>リス ク抑制型	41,009,745円	61,660,132円
ダイナミック・ナビゲーション リスク抑制世界8資産バランス ファンド	2,126,231円 566,776,687円	1,327,768円 1,115,244,286円
投資のソムリエ(ターゲット・イ ヤー2045)	507,000円	860,331円
投資のソムリエ(ターゲット・イ ヤー2055)	507,000円	558,617円
リスク抑制世界8資産バランス ファンド(D C)	194,381円	298,341円
投資のソムリエ(ターゲット・イ ヤー2035)	467,415円	1,391,944円
4資産分散投資・スタンダード< D C 年金>	- 円	9,596,986円
リスクコントロール世界資産分散 ファンド	- 円	90,755,943円
D I A M ワールドバランス25V A(適格機関投資家限定)	71,627,508円	71,166,805円
日米資産配分戦略ファンド(イン カム重視型)(為替ヘッジあり) (適格機関投資家限定)	- 円	49,226,969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)	139,026,202円	123,348,352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)	305,156,483円	287,819,155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)	16,481,224円	15,695,993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)	73,774,906円	65,253,990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)	20,065,167円	17,155,486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)	24,943,302円	16,665,826円
D I A M 世界バランスファンド4 0VA(適格機関投資家限定)	33,391,434円	30,178,653円
D I A M 世界バランスファンド5 0VA(適格機関投資家限定)	59,453,532円	53,846,130円

D I A Mバランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	1,110,380,656円	1,046,472,592円
D I A Mバランスファンド37.5VA (適格機関投資家限定)	1,056,123,054円	983,224,632円
D I A Mバランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	2,858,693,114円	2,714,455,678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)	203,597,030円	198,321,837円
D I A Mグローバル・アセット・バランスVA2 (適格機関投資家限定)	103,572,859円	65,450,833円
D I A M アクサ グローバル バランスファンド30VA (適格 機関投資家限定)	614,329,833円	567,866,288円
D I A M世界アセットバランス ファンドVA (適格機関投資家向 け)	1,931,779,617円	825,365,195円
D I A Mグローバル 私募ファン ド (適格機関投資家向け)	10,313,671円	10,313,671円
D I A M世界バランスファンド5 5VA (適格機関投資家限定)	50,384,094円	10,377,565円
D I A M世界バランスファンド3 5VA (適格機関投資家限定)	1,341,418,363円	216,564,142円
D I A M世界アセットバランス ファンド2VA (適格機関投資家 限定)	15,452,034,881円	13,917,581,515円
D I A M世界アセットバランス ファンド40VA (適格機関投資 家限定)	551,734,251円	537,147,427円
D I A M世界アセットバランス ファンド25VA (適格機関投資 家限定)	1,768,841,652円	1,729,869,171円
D I A M世界アセットバランス ファンド3VA (適格機関投資家 限定)	10,058,436,721円	9,902,704,806円
D I A Mバランス30VA (適格 機関投資家限定)	523,029円	3,950,183円
D I A Mバランス50VA (適格 機関投資家限定)	9,153,617円	1,486,405円
D I A Mバランス70VA (適格 機関投資家限定)	3,719,126円	3,718,648円
D I A M世界アセットバランス ファンド4VA (適格機関投資家 限定)	8,946,206,418円	8,852,811,603円
D I A M世界バランス25VA (適格機関投資家限定)	72,553,517円	70,212,939円
D I A M国内バランス30VA (適格機関投資家限定)	27,930,610円	27,957,494円
D I A Mバランス20VA (適格 機関投資家限定)	23,981,894円	25,126,872円
D I A Mバランス40VA (適格 機関投資家限定)	5,401,067円	98,256円

	D I A Mバランス60VA(適格 機関投資家限定)	109,957円	111,158円
	D I A M世界アセットバランス ファンド7VA(1212)(適 格機関投資家限定)	477,777,807円	426,902,115円
	D I A M世界アセットバランス ファンド7VA(1303)(適 格機関投資家限定)	1,323,021,834円	1,311,785,878円
	D I A M世界アセットバランス ファンド7VA(1306)(適 格機関投資家限定)	1,764,382,103円	1,737,262,933円
	D I A M世界アセットバランス ファンド7VA(1309)(適 格機関投資家限定)	76,281,237円	73,956,736円
	計	112,835,531,288円	112,611,312,358円
2 .	受益権の総数	112,835,531,288口	112,611,312,358口
3 .	2 差入代用有価証券	株式 3,814,500,000円	株式 3,566,000,000円

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成30年1月11日現在	平成30年7月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、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）

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

## 株式関連

種類	平成30年1月11日 現在				平成30年7月11日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
先物取引								
買 建	6,418,005,000	-	6,594,000,000	175,995,000	11,943,240,000	-	11,662,000,000	281,240,000
合計	6,418,005,000	-	6,594,000,000	175,995,000	11,943,240,000	-	11,662,000,000	281,240,000

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成30年1月11日現在	平成30年7月11日現在
1口当たり純資産額	2.8517円	2.6002円
(1万口当たり純資産額)	(28,517円)	(26,002円)

## 「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成30年1月11日現在	平成30年7月11日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		1,225,455,365	966,723,779
国債証券		303,128,208,700	287,019,186,400
地方債証券		22,902,738,657	22,636,622,741
特殊債券		15,780,383,842	16,939,931,173
社債券		16,879,127,400	15,597,661,260
未収入金		1,447,832,100	-
未収利息		770,154,466	677,408,888
前払費用		8,463,736	37,503,723
流動資産合計		362,142,364,266	343,875,037,964
資産合計		362,142,364,266	343,875,037,964
負債の部			
流動負債			
未払解約金		315,300,000	594,780,000
その他未払費用		-	18,879
流動負債合計		315,300,000	594,798,879
負債合計		315,300,000	594,798,879
純資産の部			
元本等			
元本	1	282,148,441,520	265,317,226,510
剰余金			
剰余金又は欠損金( )		79,678,622,746	77,963,012,575
元本等合計		361,827,064,266	343,280,239,085
純資産合計		361,827,064,266	343,280,239,085
負債純資産合計		362,142,364,266	343,875,037,964

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。
--------------------	--

## （貸借対照表に関する注記）

項目	平成30年1月11日現在	平成30年7月11日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額 同期中追加設定元本額 同期中一部解約元本額	302,351,149,022円 60,393,037,069円 80,595,744,571円	282,148,441,520円 41,959,884,341円 58,791,099,351円
元本の内訳 ファンド名		
D I A M国内債券パッシブ・ファンド	14,044,050,293円	16,224,206,425円
M I T O ラップ型ファンド（安定型）	137,430,777円	119,440,378円
M I T O ラップ型ファンド（中立型）	112,114,796円	99,280,528円
M I T O ラップ型ファンド（積極型）	34,436,660円	28,462,744円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	583,451,400円	763,832,586円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	159,609,573円	225,487,668円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	25,188,228円	32,175,332円
たわらノーロード 国内債券	2,792,034,873円	4,001,571,429円
たわらノーロード 国内債券<ラップ向け>	754,493円	- 円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	19,455,389円	71,690,226円
たわらノーロード バランス（堅実型）	1,243,754円	16,608,904円
たわらノーロード バランス（標準型）	2,399,845円	30,151,049円
たわらノーロード バランス（積極型）	826,692円	7,497,259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）	440,066円	2,091,676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）	234,451円	47,434,738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）	164,351円	51,623,317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)	90,351円	17,549,563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)	19,472円	6,990,884円
たわらノーロード 最適化バラン ス(保守型)	- 円	1,095,674円
たわらノーロード 最適化バラン ス(安定型)	- 円	499,774円
たわらノーロード 最適化バラン ス(安定成長型)	- 円	1,901,101円
たわらノーロード 最適化バラン ス(成長型)	- 円	583,204円
たわらノーロード 最適化バラン ス(積極型)	- 円	17,517円
D I A M国内債券インデックス ファンド<DC年金>	12,427,315,535円	12,684,931,274円
D I A Mバランス・ファンド<D C年金> 1 安定型	5,528,653,854円	5,690,893,884円
D I A Mバランス・ファンド<D C年金> 2 安定・成長型	7,985,672,600円	8,205,370,620円
D I A Mバランス・ファンド<D C年金> 3 成長型	3,263,681,041円	3,314,885,808円
D I A M DC バランス30イ ンデックスファンド	1,826,494,969円	1,809,651,883円
D I A M DC バランス50イ ンデックスファンド	2,010,449,233円	1,998,122,354円
D I A M DC バランス70イ ンデックスファンド	309,647,783円	306,027,282円
マネックス資産設計ファンド<隔 月分配型>	89,820,576円	91,445,749円
マネックス資産設計ファンド<育 成型>	2,234,726,830円	2,325,174,416円
マネックス資産設計ファンド エ ボリューション	2,224,336円	1,190,857円
D I A M DC 8資産バランス ファンド(新興国10)	470,102,235円	3,055,951,673円
D I A M DC 8資産バランス ファンド(新興国20)	421,003,073円	678,388,474円
D I A M DC 8資産バランス ファンド(新興国30)	99,634,072円	144,557,730円
投資のソムリエ	5,412,751,268円	3,987,876,892円
クルーズコントロール	4,127,957,852円	1,525,094,843円
投資のソムリエ<DC年金>	343,120,269円	342,717,792円
D I A M 8資産バランスファン ドN<DC年金>	1,785,743,778円	2,082,220,286円
D I A M DC バランス・F (成長型)	228,300,610円	261,874,420円
クルーズコントロール<DC年金 >	1,441,246円	657,425円
D I A Mコア資産設計ファンド (堅実型)	9,543,074円	2,750,846円
D I A Mコア資産設計ファンド (積極型)	21,666,572円	9,712,567円

投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	296,996,808円	330,393,586円
ダイナミック・ナビゲーション	559,152円	499,073円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	4,119,995,045円	5,976,301,988円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	721,386円	790,930円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	721,391円	511,048円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	1,382,114円	1,593,754円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	708,794円	1,215,365円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	-円	49,940,747円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	-円	688,041,623円
DIAM高金利通貨ファンド	9,608,918円	9,608,918円
DIAMエマージング債券ファンド	9,450,010円	9,450,010円
DIAM国内債券パッシブファンド(適格機関投資家向け)	22,732,301,633円	22,720,102,763円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	502,918,166円	478,855,501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)	356,392,042円	302,954,413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)	260,572,513円	235,425,892円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	82,170,787円	75,007,625円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	236,417,399円	200,309,903円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	107,172,904円	87,815,729円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	71,047,134円	45,459,172円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	107,073,029円	92,633,774円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	190,740,120円	165,279,639円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	6,327,385,858円	5,712,289,546円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	3,384,413,398円	3,018,178,605円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	6,106,252,901円	5,554,071,577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)	652,541,797円	608,905,631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)	553,747,291円	335,834,392円
D I A M アクサ グローバル バランスファンド30V A (適格 機関投資家限定)	3,945,456,574円	3,493,068,225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)	4,127,295,962円	1,688,402,829円
D I A Mグローバル 私募ファン ド(適格機関投資家向け)	194,752,933円	194,752,933円
D I A M世界バランスファンド5 5V A (適格機関投資家限定)	322,047,228円	63,734,156円
D I A M世界バランスファンド3 5V A (適格機関投資家限定)	2,383,950,442円	349,979,409円
D I A M世界アセットバランス ファンド2V A (適格機関投資家 限定)	88,035,522,422円	75,947,212,793円
D I A M世界アセットバランス ファンド40V A (適格機関投資 家限定)	1,178,525,546円	1,099,071,813円
D I A M世界アセットバランス ファンド25V A (適格機関投資 家限定)	7,559,824,166円	7,081,932,609円
D I A M世界アセットバランス ファンド3V A (適格機関投資家 限定)	28,649,485,500円	27,020,064,564円
D I A Mバランス30V A (適格 機関投資家限定)	8,960,230円	65,311,006円
D I A Mバランス50V A (適格 機関投資家限定)	48,915,437円	7,670,416円
D I A Mバランス70V A (適格 機関投資家限定)	7,941,011円	7,651,356円
D I A M世界アセットバランス ファンド4V A (適格機関投資家 限定)	31,857,319,666円	30,198,164,977円
D I A M世界バランス25V A (適格機関投資家限定)	509,422,227円	472,394,738円
D I A M国内バランス30V A (適格機関投資家限定)	139,681,767円	133,504,178円
D I A Mバランス20V A (適格 機関投資家限定)	513,354,007円	522,054,954円
D I A Mバランス40V A (適格 機関投資家限定)	40,409,042円	711,766円
D I A Mバランス60V A (適格 機関投資家限定)	390,500円	383,533円
計	282,148,441,520円	265,317,226,510円
2 . 受益権の総数	282,148,441,520口	265,317,226,510口

--	--	--

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成30年1月11日現在	平成30年7月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

## （有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

## （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。

## （1口当たり情報に関する注記）

	平成30年1月11日現在	平成30年7月11日現在
1口当たり純資産額	1,2824円	1,2938円
（1万口当たり純資産額）	（12,824円）	（12,938円）

## 「J-REITインデックスファンド・マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

(単位:円)

科 目	注記 番号	平成30年1月11日現在	平成30年7月11日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		957,714,377	916,946,623
投資証券		33,647,153,300	36,133,137,650
派生商品評価勘定		14,948,352	14,914,692
未収配当金		323,661,804	274,456,379
差入委託証拠金		6,500,352	13,300,092
流動資産合計		34,949,978,185	37,352,755,436
資産合計		34,949,978,185	37,352,755,436
負債の部			
流動負債			
前受金		13,412,352	14,388,192
未払金		673,826,209	434,571,807
未払解約金		28,461,800	14,400
その他未払費用		-	922
流動負債合計		715,700,361	448,975,321
負債合計		715,700,361	448,975,321
純資産の部			
元本等			
元本	1	19,626,564,592	19,870,219,702
剰余金			
剰余金又は欠損金( )		14,607,713,232	17,033,560,413
元本等合計		34,234,277,824	36,903,780,115
純資産合計		34,234,277,824	36,903,780,115
負債純資産合計		34,949,978,185	37,352,755,436

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1 . 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2 . デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3 . 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

## （貸借対照表に関する注記）

項目	平成30年1月11日現在	平成30年7月11日現在
1 . 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	16,468,770,229円	19,626,564,592円
同期中追加設定元本額	13,353,736,969円	8,047,686,881円
同期中一部解約元本額	10,195,942,606円	7,804,031,771円
元本の内訳		
ファンド名		
MITO ラップ型ファンド（安定型）	361,083円	291,165円
MITO ラップ型ファンド（中立型）	912,903円	1,177,517円
MITO ラップ型ファンド（積極型）	2,407,898円	2,133,850円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	1,532,660円	1,861,536円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	1,298,870円	2,675,656円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	1,761,249円	2,412,687円
たわらノーロード 国内リート	1,064,897,610円	1,326,980,470円
たわらノーロード 国内リート<ラップ向け>	292,610,032円	543,464,524円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	14,983,358円	51,810,705円
たわらノーロード バランス（堅実型）	51,544円	648,759円
たわらノーロード バランス（標準型）	1,073,973円	12,675,912円
たわらノーロード バランス（積極型）	3,189,831円	27,046,487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)	35,677円	6,509,363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)	53,803円	17,569,696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)	64,927円	13,840,858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)	77,218円	27,313,897円
たわらノーロード 最適化バラン ス(安定型)	- 円	122,931円
たわらノーロード 最適化バラン ス(安定成長型)	- 円	909,269円
たわらノーロード 最適化バラン ス(成長型)	- 円	813,819円
たわらノーロード 最適化バラン ス(積極型)	- 円	2,221,234円
マネックス資産設計ファンド<隔 月分配型>	13,914,114円	14,493,488円
マネックス資産設計ファンド<育 成型>	343,011,189円	368,359,319円
マネックス資産設計ファンド エ ボリューション	3,270,978円	3,505,986円
D I A M D C 8資産バランス ファンド(新興国10)	18,476,325円	112,321,672円
D I A M D C 8資産バランス ファンド(新興国20)	60,982,941円	91,483,915円
D I A M D C 8資産バランス ファンド(新興国30)	134,732,676円	181,623,980円
投資のソムリエ	1,515,538,797円	2,503,597,271円
投資のソムリエ<DC年金>	96,091,039円	215,305,365円
D I A M 8資産バランスファン ドN<DC年金>	70,215,123円	76,468,506円
投資のソムリエ<DC年金>リス ク抑制型	55,236,473円	72,005,293円
ダイナミック・ナビゲーション リスク抑制世界8資産バランス ファンド	207,978円	515,717円
投資のソムリエ(ターゲット・イ ヤー2045)	764,041,600円	1,303,583,907円
投資のソムリエ(ターゲット・イ ヤー2055)	237,910円	551,661円
投資のソムリエ(ターゲット・イ ヤー2035)	237,910円	355,076円
リスク抑制世界8資産バランス ファンド(DC)	256,978円	347,948円
投資のソムリエ(ターゲット・イ ヤー2035)	234,001円	852,031円
リスクコントロール世界資産分散 ファンド	- 円	149,965,158円
Jリートインデックスファンド (DC)	6,728,716円	7,942,356円
D I A M J - R E I Tインデッ クス私募ファンド201212 (適格機関投資家限定)	94,383,939円	92,393,600円



D I A M J - R E I Tインデックス 私募ファンド201401 (適格機関投資家限定)	1,819,511,382円	829,830,093円
D I A M J - R E I Tインデックス ファンド(適格機関投資家向け)	9,605,103,606円	9,215,244,946円
日米資産配分戦略ファンド(インカム重視型)(為替ヘッジあり) (適格機関投資家限定)	- 円	65,219,763円
D I A Mグローバル 私募ファンド (適格機関投資家向け)	14,402,370円	14,402,370円
D I A Mグローバル・リスクファクター・ パリティ戦略ファンド (適格機関投資家限定)	1,779,304,967円	1,410,548,883円
D I A Mグローバル・リスクファクター・ パリティ戦略ファンドI I(適格機関投資家限定)	1,845,130,944円	1,096,821,063円
計	19,626,564,592円	19,870,219,702円
2 . 受益権の総数	19,626,564,592口	19,870,219,702口

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成30年1月11日現在	平成30年7月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、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）

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

## 不動産投信関連

種類	平成30年1月11日 現在				平成30年7月11日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
不動産投信指数 先物取引								
買 建	414,592,000	-	429,568,000	14,976,000	600,525,900	-	615,478,500	14,952,600
合計	414,592,000	-	429,568,000	14,976,000	600,525,900	-	615,478,500	14,952,600

(注) 1. 時価の算定方法

不動産投信指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成30年1月11日現在	平成30年7月11日現在
1口当たり純資産額	1.7443円	1.8572円
(1万口当たり純資産額)	(17,443円)	(18,572円)

## 「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成30年1月11日現在	平成30年7月11日現在
資産の部			
流動資産			
預金		5,822,987,447	5,489,104,287
コール・ローン		726,764,720	171,476,639
株式		292,877,407,767	300,454,985,072
投資信託受益証券		801,364,202	739,626,667
投資証券		6,273,413,009	6,712,692,366
派生商品評価勘定		175,170,660	100,811,148
未収入金		2,663,502	36,167,920
未収配当金		323,899,180	345,526,103
差入委託証拠金		2,025,207,755	2,635,621,046
流動資産合計		309,028,878,242	316,686,011,248
資産合計		309,028,878,242	316,686,011,248
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		3,689,542	1,589,537
未払解約金		331,777,000	213,332,000
その他未払費用		-	1,578
流動負債合計		335,466,542	214,923,115
負債合計		335,466,542	214,923,115
純資産の部			
元本等			
元本	1	87,104,816,912	88,975,107,871
剰余金			
剰余金又は欠損金( )		221,588,594,788	227,495,980,262
元本等合計		308,693,411,700	316,471,088,133
純資産合計		308,693,411,700	316,471,088,133
負債純資産合計		309,028,878,242	316,686,011,248

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

## （貸借対照表に関する注記）

項目	平成30年1月11日現在	平成30年7月11日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	92,727,414,724円	87,104,816,912円
同期中追加設定元本額	20,058,442,109円	14,038,234,344円
同期中一部解約元本額	25,681,039,921円	12,167,943,385円
元本の内訳		
ファンド名		
DIAM外国株式パッシブ・ファンド	1,822,423,973円	1,906,729,848円
MITO ラップ型ファンド（安定型）	3,191,830円	2,423,710円
MITO ラップ型ファンド（中立型）	7,279,030円	7,682,928円
MITO ラップ型ファンド（積極型）	18,898,552円	14,007,544円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	13,544,215円	15,500,550円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	10,359,460円	17,451,481円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	13,818,783円	15,792,642円
たわらノーロード 先進国株式	5,502,154,955円	6,928,447,314円
たわらノーロード 先進国株式<ラップ向け>	424,744円	424,449円
たわらノーロード 先進国株式<為替ヘッジあり>	463,445,507円	799,442,282円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	7,231,042円	27,581,489円
たわらノーロード バランス（堅実型）	150,198円	2,000,495円
たわらノーロード バランス（標準型）	1,404,580円	17,911,257円
たわらノーロード バランス（積極型）	4,751,015円	43,580,554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）	14,227円	71,283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）	57,189円	9,209,178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）	80,559円	21,668,159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）	103,944円	17,376,355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）	127,326円	41,908,829円
たわらノーロード 最適化バランス（保守型）	- 円	14,099円
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	- 円	51,366円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	- 円	449,195円

たわらノーロード 最適化バ ランス(成長型)	- 円	526,371円
たわらノーロード 最適化バ ランス(積極型)	- 円	1,728,931円
D I A M外国株式インデックス ファンド< D C年金>	36,937,428,806円	38,861,551,807円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 1 安定型	157,435,724円	164,512,028円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 2 安定・成長型	857,026,223円	860,798,975円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 3 成長型	1,043,554,352円	1,073,184,906円
D I A M D C バランス30イ ンデックスファンド	130,707,011円	130,817,408円
D I A M D C バランス50イ ンデックスファンド	385,930,973円	375,234,201円
D I A M D C バランス70イ ンデックスファンド	330,441,705円	332,100,058円
マネックス資産設計ファンド<隔 月分配型>	33,185,995円	31,471,673円
マネックス資産設計ファンド<育 成型>	817,871,261円	799,032,499円
マネックス資産設計ファンド エ ボリューション	187,072,304円	206,676,091円
D I A M D C 8資産バランス ファンド(新興国10)	29,811,822円	200,171,509円
D I A M D C 8資産バランス ファンド(新興国20)	73,885,125円	123,404,993円
D I A M D C 8資産バランス ファンド(新興国30)	145,725,386円	218,118,529円
投資のソムリエ	970,425,131円	750,874,606円
クルーズコントロール	790,811,166円	297,563,297円
投資のソムリエ< D C年金>	61,679,304円	64,456,556円
D I A M 8資産バランスファン ドN< D C年金>	114,876,755円	138,048,807円
D I A M D C バランス・F (成長型)	70,873,790円	85,069,990円
クルーズコントロール< D C年金 >	275,806円	128,297円
D I A Mコア資産設計ファンド (堅実型)	3,642,956円	1,072,569円
D I A Mコア資産設計ファンド (積極型)	8,318,622円	3,761,847円
投資のソムリエ< D C年金>リス ク抑制型	27,153,058円	38,658,184円
ダイナミック・ナビゲーション	1,144,316円	1,495,747円
リスク抑制世界8資産バランス ファンド	373,981,024円	698,390,564円
ワールドアセットバランス(基本 コース)	588,185,085円	696,288,960円
ワールドアセットバランス(リス ク抑制コース)	2,227,897,121円	2,732,686,672円

投資のソムリエ(ターゲット・イ ヤー2045)	517,823円	822,489円
投資のソムリエ(ターゲット・イ ヤー2055)	517,846円	534,290円
リスク抑制世界8資産バランス ファンド(DC)	126,045円	184,512円
投資のソムリエ(ターゲット・イ ヤー2035)	365,458円	1,088,499円
4資産分散投資・スタンダード< DC年金>	-円	3,568,737円
リスクコントロール世界資産分散 ファンド	-円	80,898,377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)	95,685,592円	91,764,770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)	2,953,403,840円	2,879,034,337円
DIAM先進国株式パッシブファ ンド(適格機関投資家限定)	161,207,978円	158,419,668円
外国株式パッシブ・ファンド2 (適格機関投資家限定)	208,789,234円	208,685,890円
DIAMワールドバランス25V A(適格機関投資家限定)	23,987,145円	23,469,497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)	108,709,025円	94,957,427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)	238,629,259円	221,387,243円
DIAM国際分散バランスファン ド30VA(適格機関投資家限 定)	12,888,459円	12,087,592円
DIAM国際分散バランスファン ド50VA(適格機関投資家限 定)	86,550,378円	75,185,426円
DIAM国内重視バランスファン ド30VA(適格機関投資家限 定)	7,842,084円	6,601,997円
DIAM国内重視バランスファン ド50VA(適格機関投資家限 定)	13,001,598円	8,545,004円
DIAM世界バランスファンド4 0VA(適格機関投資家限定)	26,103,100円	23,213,482円
DIAM世界バランスファンド5 0VA(適格機関投資家限定)	69,758,648円	62,137,695円
DIAMバランスファンド25V A(適格機関投資家限定)	578,673,845円	536,449,917円
DIAMバランスファンド37. 5VA(適格機関投資家限定)	722,585,419円	661,713,592円
DIAMバランスファンド50V A(適格機関投資家限定)	2,235,486,581円	2,087,932,927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)	794,469,102円	759,101,003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)	242,322,969円	149,974,052円
D I A M アクサ グローバル バランスファンド30V A (適格 機関投資家限定)	962,367,378円	874,971,079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)	499,820,780円	211,701,890円
D I A Mグローバル 私募ファン ド(適格機関投資家向け)	2,754,975円	2,754,975円
D I A M世界バランスファンド5 5V A (適格機関投資家限定)	176,485,295円	35,747,427円
D I A M世界バランスファンド3 5V A (適格機関投資家限定)	424,964,949円	64,609,302円
D I A M世界アセットバランス ファンド2V A (適格機関投資家 限定)	8,054,309,887円	7,135,559,831円
D I A M世界アセットバランス ファンド40V A (適格機関投資 家限定)	431,455,488円	413,163,240円
D I A M世界アセットバランス ファンド25V A (適格機関投資 家限定)	1,383,217,436円	1,330,611,491円
D I A M世界アセットバランス ファンド3V A (適格機関投資家 限定)	5,242,924,377円	5,080,681,959円
D I A Mバランス30V A (適格 機関投資家限定)	2,048,915円	15,441,869円
D I A Mバランス50V A (適格 機関投資家限定)	28,490,332円	4,637,511円
D I A Mバランス70V A (適格 機関投資家限定)	10,665,941円	10,592,510円
D I A M世界アセットバランス ファンド4V A (適格機関投資家 限定)	6,995,839,213円	6,809,630,311円
D I A Mバランス20V A (適格 機関投資家限定)	56,125,154円	59,204,056円
D I A Mバランス40V A (適格 機関投資家限定)	12,665,761円	230,745円
D I A Mバランス60V A (適格 機関投資家限定)	257,653円	260,170円
計	87,104,816,912円	88,975,107,871円
2 . 受益権の総数	87,104,816,912口	88,975,107,871口

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成30年1月11日現在	平成30年7月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、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）

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

## 通貨関連

種類	平成30年1月11日 現在				平成30年7月11日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	1,026,890,881	-	1,026,860,650	30,231	66,848,488	-	66,773,840	74,648
アメリカ・ドル	723,398,115	-	723,375,400	22,715	66,848,488	-	66,773,840	74,648
イギリス・ポンド	74,535,466	-	74,532,150	3,316	-	-	-	-
オーストラリア・ドル	29,758,776	-	29,757,420	1,356	-	-	-	-
カナダ・ドル	44,107,048	-	44,104,320	2,728	-	-	-	-
ユーロ	155,091,476	-	155,091,360	116	-	-	-	-
買 建	368,878,305	-	365,713,490	3,164,815	466,776,268	-	466,760,440	15,828
アメリカ・ドル	250,403,880	-	248,221,420	2,182,460	316,797,801	-	316,787,520	10,281
イギリス・ポンド	28,149,045	-	27,855,450	293,595	32,339,714	-	32,337,800	1,914
オーストラリア・ドル	11,862,585	-	11,850,300	12,285	15,634,416	-	15,633,200	1,216
カナダ・ドル	17,942,835	-	17,695,080	247,755	14,089,456	-	14,088,120	1,336
ユーロ	60,519,960	-	60,091,240	428,720	87,914,881	-	87,913,800	1,081
合計	1,395,769,186	-	1,392,574,140	3,134,584	533,624,756	-	533,534,280	58,820

(注) 時価の算定方法

1. 計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。  
計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。  
計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。  
・計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算しております。  
・計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。
2. 計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。
3. 換算において円未満の端数は切捨てております。  
上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 株式関連

種類	平成30年1月11日 現在				平成30年7月11日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
先物取引								
買 建	7,434,733,565	-	7,609,349,267	174,615,702	8,823,316,081	-	8,922,478,872	99,162,791
合計	7,434,733,565	-	7,609,349,267	174,615,702	8,823,316,081	-	8,922,478,872	99,162,791

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成30年1月11日現在	平成30年7月11日現在
1口当たり純資産額	3.5439円	3.5568円
(1万口当たり純資産額)	(35,439円)	(35,568円)

## 「外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成30年1月11日現在	平成30年7月11日現在
資産の部			
流動資産			
預金		3,717,332,670	1,716,618,741
コール・ローン		254,275,738	345,599,720
国債証券		222,177,369,816	210,268,205,338
派生商品評価勘定		2,180,614	926,554
未収入金		3,113,657,238	-
未収利息		2,011,358,256	1,757,456,486
前払費用		47,148,515	39,941,377
流動資産合計		231,323,322,847	214,128,748,216
資産合計		231,323,322,847	214,128,748,216
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		12,998	60,269
未払金		-	373,074,254
未払解約金		366,282,000	310,381,000
その他未払費用		-	3,048
流動負債合計		366,294,998	683,518,571
負債合計		366,294,998	683,518,571
純資産の部			
元本等			
元本	1	125,530,104,029	117,601,828,446
剰余金			
剰余金又は欠損金( )		105,426,923,820	95,843,401,199
元本等合計		230,957,027,849	213,445,229,645
純資産合計		230,957,027,849	213,445,229,645
負債純資産合計		231,323,322,847	214,128,748,216

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1 . 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 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期間末日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
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、決算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

## （貸借対照表に関する注記）

項目	平成30年1月11日現在	平成30年7月11日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	146,373,971,356円	125,530,104,029円
同期中追加設定元本額	23,047,727,819円	17,781,160,633円
同期中一部解約元本額	43,891,595,146円	25,709,436,216円
元本の内訳		
ファンド名		
DIAM外国債券パッシブ・ファンド	7,132,425,010円	7,370,471,447円
MITO ラップ型ファンド（安定型）	17,026,383円	12,728,976円
MITO ラップ型ファンド（中立型）	43,780,396円	36,346,946円
MITO ラップ型ファンド（積極型）	49,388,910円	41,646,430円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	72,275,459円	80,998,408円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	62,320,881円	82,639,195円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	36,122,260円	47,071,012円
たわらノーロード 先進国債券	1,355,092,120円	2,120,491,637円
たわらノーロード 先進国債券<ラップ向け>	606,412円	606,412円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	13,868,205円	53,361,033円
たわらノーロード バランス（堅実型）	71,706円	1,002,765円
たわらノーロード バランス（標準型）	397,672円	5,222,705円
たわらノーロード バランス（積極型）	224,963円	2,142,626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）	21,628円	140,593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）	38,388円	8,972,914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）	21,628円	9,079,160円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（成長型）	- 円	2,200,512円
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	- 円	98,460円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	- 円	626,518円
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	- 円	392,605円
たわらノーロード 最適化バランス（積極型）	- 円	637,620円
DIAM外国債券インデックスファンド<DC年金>	5,000,335,109円	5,081,097,229円

D I A M バランス・ファンド< D C 年金> 1 安定型	465,467,784円	505,957,556円
D I A M バランス・ファンド< D C 年金> 2 安定・成長型	1,493,783,080円	1,659,201,042円
D I A M バランス・ファンド< D C 年金> 3 成長型	1,625,017,909円	1,737,417,498円
D I A M D C バランス 3 0 イ ンデックスファンド	358,729,368円	375,880,904円
D I A M D C バランス 5 0 イ ンデックスファンド	770,825,404円	818,524,847円
D I A M D C バランス 7 0 イ ンデックスファンド	615,670,534円	637,961,618円
マネックス資産設計ファンド< 隔 月分配型>	23,857,963円	23,582,221円
マネックス資産設計ファンド< 育 成型>	590,083,690円	599,670,192円
マネックス資産設計ファンド エ ボリューション	8,124,972円	17,303,931円
D I A M D C 8 資産バランス ファンド(新興国10)	16,890,765円	116,343,233円
D I A M D C 8 資産バランス ファンド(新興国20)	37,165,229円	63,100,649円
D I A M D C 8 資産バランス ファンド(新興国30)	68,111,461円	104,367,523円
クルーズコントロール	4,310,597,545円	1,636,314,396円
D I A M 8 資産バランスファン ドN< D C 年金>	64,088,822円	79,179,510円
D I A M D C バランス・F (成長型)	113,195,260円	137,529,305円
クルーズコントロール< D C 年金 >	1,504,754円	705,473円
D I A M コア資産設計ファンド (堅実型)	13,258,543円	3,917,751円
D I A M コア資産設計ファンド (積極型)	30,164,786円	13,925,116円
ダイナミック・ナビゲーション	387,823円	362,192円
4 資産分散投資・スタンダード< D C 年金>	- 円	10,290,126円
D I A M パッシブ資産分散ファン ド	1,427,367,462円	1,370,643,849円
D I A M 為替フルヘッジ型外国債 券パッシブ私募ファンド(適格機 関投資家向け)	6,914,807,354円	6,985,443,158円
D I A M 外国債券パッシブファン ド(適格機関投資家向け)	4,015,164,258円	4,065,671,104円
外国債券パッシブファンド(適格 機関投資家限定)	3,769,097,133円	3,312,147,806円
先進国債券パッシブファンド(適 格機関投資家限定)	576,382,992円	6,090,533,213円
D I A M ワールドバランス 2 5 V A (適格機関投資家限定)	105,167,751円	105,203,775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)	980,291,866円	875,467,726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)	716,967,111円	679,773,131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)	56,481,829円	54,163,606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)	108,319,378円	96,169,004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)	29,458,898円	25,359,586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)	12,199,263円	8,193,529円
D I A M世界バランスファンド4 0VA(適格機関投資家限定)	73,537,596円	66,817,243円
D I A M世界バランスファンド5 0VA(適格機関投資家限定)	87,294,718円	79,464,966円
D I A Mバランスファンド25V A(適格機関投資家限定)	3,805,445,836円	3,605,201,925円
D I A Mバランスファンド37. 5VA(適格機関投資家限定)	2,520,252,961円	2,358,564,937円
D I A Mバランスファンド50V A(適格機関投資家限定)	4,197,266,896円	4,006,261,030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)	747,764,373円	732,217,804円
D I A Mグローバル・アセット・ バランスVA2(適格機関投資家 限定)	532,270,006円	339,039,492円
D I A M アクサ グローバル バランスファンド30VA(適格 機関投資家限定)	3,622,086,116円	3,356,615,841円
D I A M世界アセットバランス ファンドVA(適格機関投資家向 け)	10,441,980,855円	4,430,116,595円
D I A Mグローバル 私募ファン ド(適格機関投資家向け)	13,975,529円	13,975,529円
D I A M世界バランスファンド5 5VA(適格機関投資家限定)	110,717,358円	22,980,591円
D I A M世界バランスファンド3 5VA(適格機関投資家限定)	3,669,493,348円	562,888,132円
D I A M世界アセットバランス ファンド2VA(適格機関投資家 限定)	15,122,513,442円	13,690,978,145円
D I A M世界アセットバランス ファンド3VA(適格機関投資家 限定)	19,692,761,593円	19,497,803,365円

D I A Mバランス30 V A ( 適格 機関投資家限定 )	2,307,939円	17,634,980円
D I A Mバランス50 V A ( 適格 機関投資家限定 )	33,620,094円	5,550,982円
D I A Mバランス70 V A ( 適格 機関投資家限定 )	5,459,009円	5,518,264円
D I A M世界アセットバランス ファンド4 V A ( 適格機関投資家 限定 )	17,516,462,651円	17,424,449,927円
D I A M世界バランス25 V A ( 適格機関投資家限定 )	106,474,190円	103,731,458円
D I A Mバランス20 V A ( 適格 機関投資家限定 )	105,797,212円	113,204,188円
D I A Mバランス40 V A ( 適格 機関投資家限定 )	19,813,336円	367,428円
D I A Mバランス60 V A ( 適格 機関投資家限定 )	160,854円	165,851円
計	125,530,104,029円	117,601,828,446円
2 . 受益権の総数	125,530,104,029口	117,601,828,446口

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成30年1月11日現在	平成30年7月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、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）

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

## 通貨関連

種類	平成30年1月11日 現在				平成30年7月11日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	3,566,821,676	-	3,564,654,060	2,167,616	177,940,000	-	177,013,446	926,554
アメリカ・ドル	1,585,098,722	-	1,583,921,020	1,177,702	-	-	-	-
イギリス・ポンド	263,487,000	-	263,480,000	7,000	-	-	-	-
オーストラリア・ドル	99,168,800	-	99,168,800	-	22,970,000	-	22,758,403	211,597
カナダ・ドル	65,971,220	-	65,971,220	-	154,970,000	-	154,255,043	714,957
スウェーデン・クローナ	65,954,060	-	65,954,060	-	-	-	-	-
ユーロ	1,487,141,874	-	1,486,158,960	982,914	-	-	-	-
買 建	-	-	-	-	1,507,900,000	-	1,507,839,731	60,269
アメリカ・ドル	-	-	-	-	656,300,000	-	656,259,763	40,237
イギリス・ポンド	-	-	-	-	169,150,000	-	169,143,095	6,905
カナダ・ドル	-	-	-	-	18,380,000	-	18,379,128	872
ユーロ	-	-	-	-	664,070,000	-	664,057,745	12,255
合計	3,566,821,676	-	3,564,654,060	2,167,616	1,685,840,000	-	1,684,853,177	866,285

(注) 時価の算定方法

1. 計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。  
 計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。  
 計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。  
 ・計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算しております。  
 ・計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。
2. 計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。
3. 換算において円未満の端数は切捨てております。  
 上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成30年1月11日現在	平成30年7月11日現在
1口当たり純資産額	1.8399円	1.8150円
(1万口当たり純資産額)	(18,399円)	(18,150円)

## 「外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成30年1月11日現在	平成30年7月11日現在
資産の部			
流動資産			
預金		409,027,141	124,946,716
コール・ローン		81,777,811	92,805,011
投資信託受益証券		6,493,687,842	5,393,315,131
投資証券		48,340,326,547	48,157,425,564
派生商品評価勘定		-	33,672
未収入金		28,955	84,591
未収配当金		276,841,525	226,329,480
流動資産合計		55,601,689,821	53,994,940,165
資産合計		55,601,689,821	53,994,940,165
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		167,021	-
未払金		392,565,351	-
未払解約金		6,842,000	82,839,000
その他未払費用		-	510
流動負債合計		399,574,372	82,839,510
負債合計		399,574,372	82,839,510
純資産の部			
元本等			
元本	1	46,402,765,697	43,633,295,638
剰余金			
剰余金又は欠損金( )		8,799,349,752	10,278,805,017
元本等合計		55,202,115,449	53,912,100,655
純資産合計		55,202,115,449	53,912,100,655
負債純資産合計		55,601,689,821	53,994,940,165

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

## （貸借対照表に関する注記）

項目	平成30年1月11日現在	平成30年7月11日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額 同期中追加設定元本額 同期中一部解約元本額	30,797,163,241円  32,142,557,355円 16,536,954,899円	46,402,765,697円  21,142,191,108円 23,911,661,167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） 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） M I T O ラップ型ファンド（安定型） M I T O ラップ型ファンド（中立型） M I T O ラップ型ファンド（積極型）	274,804,177円 67,370,416円 5,909,943円 15,182,713円 39,369,153円	249,613,727円 88,143,324円 4,670,633円 18,688,067円 34,131,064円

グローバル8資産ラップファンド (安定型)	25,105,584円	29,869,389円
グローバル8資産ラップファンド (中立型)	21,627,261円	42,445,575円
グローバル8資産ラップファンド (積極型)	28,808,725円	38,483,563円
たわらノーロード 先進国リート	1,721,168,125円	2,624,670,911円
たわらノーロード 先進国リート <ラップ向け>	400,970,948円	423,148,632円
たわらノーロード 先進国リート <為替ヘッジあり>	125,946,635円	132,514,847円
たわらノーロード バランス(8 資産均等型)	21,115,226円	78,215,071円
たわらノーロード バランス(堅 実型)	35,727円	492,806円
たわらノーロード バランス(標 準型)	758,305円	9,618,471円
たわらノーロード バランス(積 極型)	4,154,380円	37,694,667円
たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(安定型)	- 円	3,317,352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)	50,006円	18,801,373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)	90,164円	19,531,977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)	122,951円	47,722,952円
たわらノーロード 最適化 balan ス(安定型)	- 円	83,168円
たわらノーロード 最適化 balan ス(安定成長型)	- 円	927,094円
たわらノーロード 最適化 balan ス(成長型)	- 円	1,078,234円
たわらノーロード 最適化 balan ス(積極型)	- 円	3,584,707円
マネックス資産設計ファンド<隔 月分配型>	22,174,404円	23,851,883円
マネックス資産設計ファンド<育 成型>	539,811,573円	605,308,573円
マネックス資産設計ファンド エ ボリューション	78,019,353円	64,548,816円
D I A M D C 8資産バランス ファンド(新興国10)	25,595,252円	172,886,995円
D I A M D C 8資産バランス ファンド(新興国20)	84,478,084円	140,494,274円
D I A M D C 8資産バランス ファンド(新興国30)	189,120,828円	279,034,664円
投資のソムリエ	6,351,242,412円	7,653,588,468円
投資のソムリエ<DC年金>	402,574,454円	658,457,526円
D I A M 8資産バランスファン ドN<DC年金>	96,943,349円	119,024,804円
投資のソムリエ<DC年金>リス ク抑制型	186,280,072円	176,208,238円



ダイナミック・ナビゲーション リスク抑制世界8資産バランス ファンド	286,863円 2,578,280,510円	800,409円 3,190,006,461円
ワールドアセットバランス(基本 コース)	1,100,032,739円	1,316,609,921円
ワールドアセットバランス(リス ク抑制コース)	4,194,614,874円	5,166,081,673円
投資のソムリエ(ターゲット・イ ヤー2045)	840,948円	1,679,621円
投資のソムリエ(ターゲット・イ ヤー2055)	840,948円	1,086,889円
リスク抑制世界8資産バランス ファンド(DC)	865,578円	832,318円
投資のソムリエ(ターゲット・イ ヤー2035)	820,132円	2,592,506円
リスクコントロール世界資産分散 ファンド	-円	365,824,903円
DIAMパッシブ資産分散ファン ド	1,113,784,191円	1,151,911,524円
DIAM外国リートインデックス ファンド<DC年金>	20,739,627円	26,553,198円
DIAM世界アセットバランス ファンドVA(適格機関投資家向 け)	2,834,824,826円	1,201,030,785円
DIAMグローバル 私募ファン ド(適格機関投資家向け)	11,580,328円	11,580,328円
DIAM世界アセットバランス ファンド2VA(適格機関投資家 限定)	11,354,337,336円	10,118,289,327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)	4,236,813,769円	1,956,002,974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I I(適格機関投資家限定)	4,407,569,364円	1,521,041,521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)	3,257,586,698円	3,241,156,712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)	560,116,746円	559,362,723円
計	46,402,765,697円	43,633,295,638円
2. 受益権の総数	46,402,765,697口	43,633,295,638口

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成30年1月11日現在	平成30年7月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、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）

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

## 通貨関連

種類	平成30年1月11日 現在				平成30年7月11日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	-	-	-	-	22,829,922	-	22,796,250	33,672
ユーロ	-	-	-	-	5,852,322	-	5,852,250	72
香港・ドル	-	-	-	-	16,977,600	-	16,944,000	33,600
買 建	114,761,091	-	114,594,070	167,021	-	-	-	-
アメリカ・ドル	49,601,257	-	49,599,700	1,557	-	-	-	-
オーストラリア・ドル	32,503,570	-	32,478,600	24,970	-	-	-	-
カナダ・ドル	1,778,510	-	1,778,400	110	-	-	-	-
シンガポール・ドル	11,768,880	-	11,706,800	62,080	-	-	-	-
ニュージーランド・ドル	2,813,335	-	2,809,450	3,885	-	-	-	-
ユーロ	6,395,524	-	6,395,520	4	-	-	-	-
香港・ドル	9,900,015	-	9,825,600	74,415	-	-	-	-
合計	114,761,091	-	114,594,070	167,021	22,829,922	-	22,796,250	33,672

(注) 時価の算定方法

- 計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。  
 計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。  
 計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。
  - 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算しております。
  - 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。
- 計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。
- 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。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成30年1月11日現在	平成30年7月11日現在
1口当たり純資産額	1.1896円	1.2356円
(1万口当たり純資産額)	(11,896円)	(12,356円)

## 「エマージング株式パッシブ・マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成30年1月11日現在	平成30年7月11日現在
資産の部			
流動資産			
預金		3,319,230,119	3,892,823,539
コール・ローン		107,218,956	70,784,507
株式		56,566,691,714	60,051,084,522
投資信託受益証券		291,974,467	333,504,522
投資証券		112,860,012	110,826,746
派生商品評価勘定		256,498,285	57,714,352
未収入金		704,406	10,620,636
未収配当金		80,996,576	383,537,405
差入委託証拠金		1,115,971,723	887,654,636
流動資産合計		61,852,146,258	65,798,550,865
資産合計		61,852,146,258	65,798,550,865
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		692,746	92,849,183
未払金		4,986	31,886
未払解約金		34,717,000	98,701,000
その他未払費用		-	2,527
流動負債合計		35,414,732	191,584,596
負債合計		35,414,732	191,584,596
純資産の部			
元本等			
元本	1	47,332,729,770	55,614,868,236
剰余金			
剰余金又は欠損金( )		14,484,001,756	9,992,098,033
元本等合計		61,816,731,526	65,606,966,269
純資産合計		61,816,731,526	65,606,966,269
負債純資産合計		61,852,146,258	65,798,550,865

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</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期間末日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建資産及び負債は、決算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

項目		平成30年1月11日現在	平成30年7月11日現在
1.	1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	42,090,393,658円	47,332,729,770円
	同期中追加設定元本額	24,968,507,853円	24,152,026,162円
	同期中一部解約元本額	19,726,171,741円	15,869,887,696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 >	2,967,430,561円	3,814,828,710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)	249,749,689円	529,402,030円
	M I T O ラップ型ファンド(安 定型)	6,258,056円	4,288,618円
	M I T O ラップ型ファンド(中 立型)	16,063,826円	12,271,117円
	M I T O ラップ型ファンド(積 極型)	18,157,927円	14,095,680円
	グローバル8資産ラップファンド (安定型)	26,539,962円	27,418,980円
	グローバル8資産ラップファンド (中立型)	22,849,313円	27,881,386円
	グローバル8資産ラップファンド (積極型)	13,271,449円	15,897,153円
	たわらノーロード 新興国株式	3,190,937,167円	3,816,064,629円
	たわらノーロード 新興国株式< ラップ向け>	968,725,817円	1,286,861,968円
	たわらノーロード バランス(8 資産均等型)	19,503,319円	83,666,789円
	たわらノーロード バランス(堅 実型)	33,387円	524,251円
	たわらノーロード バランス(標 準型)	138,526円	2,047,579円
	たわらノーロード バランス(積 極型)	635,967円	6,720,786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)	7,956円	44,009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)	15,911円	3,528,590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)	23,867円	8,565,767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)	39,778円	6,922,321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)	47,733円	15,855,916円
	たわらノーロード 最適化バラン ス(安定型)	- 円	21,957円
	たわらノーロード 最適化バラン ス(安定成長型)	- 円	245,719円

たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	- 円	264,312円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	- 円	601,308円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	462,876,236円	429,132,057円
D I A M D C 8資産バランスファンド(新興国10)	40,575,086円	303,871,969円
D I A M D C 8資産バランスファンド(新興国20)	133,439,313円	247,921,075円
D I A M D C 8資産バランスファンド(新興国30)	298,885,378円	491,090,199円
投資のソムリエ	1,371,356,428円	5,354,318,675円
クルーズコントロール	2,170,535,683円	801,287,245円
投資のソムリエ<DC年金>	87,148,003円	460,011,200円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	157,925,647円	206,973,919円
クルーズコントロール<DC年金>	757,609円	345,566円
D I A Mコア資産設計ファンド(堅実型)	24,975,794円	7,218,206円
D I A Mコア資産設計ファンド(積極型)	57,019,939円	25,339,484円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	89,462,427円	141,819,914円
ダイナミック・ナビゲーション	1,743,533円	552,053円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	1,214,158,639円	2,556,846,801円
ワールドアセットバランス(基本コース)	1,627,105,199円	1,964,816,977円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	6,091,354,580円	7,712,821,183円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	230,203円	1,586,206円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	230,203円	1,026,335円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	415,873円	670,375円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	240,421円	2,441,711円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	- 円	218,814,040円
エマージング株式パッシブファンドVA(適格機関投資家専用)	5,065,986,468円	4,462,150,674円
エマージング株式パッシブファンド(適格機関投資家限定)	2,638,488,353円	2,127,490,579円
D I A M世界アセットバランスファンド2VA(適格機関投資家限定)	11,082,972,525円	10,762,265,811円
D I A M世界アセットバランスファンド3VA(適格機関投資家限定)	7,214,416,019円	7,656,036,407円
計	47,332,729,770円	55,614,868,236円



2 . 受益権の総数	47,332,729,770口	55,614,868,236口
------------	-----------------	-----------------

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成30年1月11日現在	平成30年7月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、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）

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

## 通貨関連

種類	平成30年1月11日 現在				平成30年7月11日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	1,161,449,670	-	1,161,413,200	36,470	64,294,476	-	64,222,680	71,796
アメリカ・ドル	1,161,449,670	-	1,161,413,200	36,470	64,294,476	-	64,222,680	71,796
買 建	39,578,880	-	39,233,920	344,960	809,964,127	-	809,937,840	26,287
アメリカ・ドル	39,578,880	-	39,233,920	344,960	809,964,127	-	809,937,840	26,287
合計	1,201,028,550	-	1,200,647,120	308,490	874,258,603	-	874,160,520	45,509

## (注) 時価の算定方法

1. 計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。  
 計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。  
 計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。
  - ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算しております。
  - ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。
2. 計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。
3. 換算において円未満の端数は切捨てております。  
 上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 株式関連

種類	平成30年1月11日 現在				平成30年7月11日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
先物取引								
買 建	3,403,250,998	-	3,659,365,027	256,114,029	5,874,056,322	-	5,838,875,982	35,180,340
合計	3,403,250,998	-	3,659,365,027	256,114,029	5,874,056,322	-	5,838,875,982	35,180,340

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成30年1月11日現在	平成30年7月11日現在
1口当たり純資産額	1.3060円	1.1797円
(1万口当たり純資産額)	(13,060円)	(11,797円)

## 「エマージング債券パッシブ・マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成30年1月11日現在	平成30年7月11日現在
資産の部			
流動資産			
預金		2,451,465,696	2,537,511,472
コール・ローン		395,982,514	56,693,775
国債証券		98,971,707,355	104,890,888,928
派生商品評価勘定		-	62,000
未収入金		418,714,761	-
未収利息		1,507,428,223	1,581,148,764
前払費用		95,331,659	187,533,628
流動資産合計		103,840,630,208	109,253,838,567
資産合計		103,840,630,208	109,253,838,567
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		2,556,800	30,600
未払金		602,479,744	-
未払解約金		68,895,000	79,080,000
その他未払費用		-	1,745
流動負債合計		673,931,544	79,112,345
負債合計		673,931,544	79,112,345
純資産の部			
元本等			
元本	1	54,256,447,518	59,857,001,615
剰余金			
剰余金又は欠損金( )		48,910,251,146	49,317,724,607
元本等合計		103,166,698,664	109,174,726,222
純資産合計		103,166,698,664	109,174,726,222
負債純資産合計		103,840,630,208	109,253,838,567

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建資産及び負債は、決算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

項目	平成30年1月11日現在	平成30年7月11日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額 同期中追加設定元本額 同期中一部解約元本額	34,034,697,085円  36,324,035,709円 16,102,285,276円	54,256,447,518円  30,954,967,707円 25,354,413,610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） たわらノーロード バランス（8 資産均等型） たわらノーロード バランス（堅 実型） たわらノーロード バランス（標 準型） たわらノーロード バランス（積 極型） たわらノーロード 最適化バラン ス（保守型） たわらノーロード 最適化バラン ス（安定型） たわらノーロード 最適化バラン ス（安定成長型） たわらノーロード 最適化バラン ス（成長型） たわらノーロード 最適化バラン ス（積極型）	231,736,287円  13,439,320円 185,533円 578,044円 658,928円 - 円 - 円 - 円 - 円 - 円	275,866,960円  53,295,171円 2,676,351円 7,841,375円 6,421,074円 82,384円 113,223円 549,653円 281,104円 383,324円

マネックス資産設計ファンド エ ボリューション	75,944,530円	59,295,344円
D I A M D C 8資産バランス ファンド(新興国10)	27,320,395円	194,638,292円
D I A M D C 8資産バランス ファンド(新興国20)	90,077,700円	158,127,730円
D I A M D C 8資産バランス ファンド(新興国30)	200,732,596円	314,777,396円
投資のソムリエ	5,386,829,880円	8,638,821,397円
クルーズコントロール	1,391,418,497円	554,599,758円
投資のソムリエ<DC年金>	341,339,293円	742,176,852円
D I A M 8資産バランスファン ドN<DC年金>	103,835,053円	132,733,848円
クルーズコントロール<DC年金 >	485,809円	239,129円
D I A Mコア資産設計ファンド (堅実型)	6,404,568円	1,969,496円
D I A Mコア資産設計ファンド (積極型)	14,622,181円	7,037,090円
投資のソムリエ<DC年金>リス ク抑制型	137,701,694円	326,852,267円
ダイナミック・ナビゲーション	188,968円	177,753円
リスク抑制世界8資産バランス ファンド	1,912,437,568円	5,911,347,738円
ワールドアセットバランス(基本 コース)	704,245,670円	891,800,567円
ワールドアセットバランス(リス ク抑制コース)	2,707,059,809円	3,500,161,418円
投資のソムリエ(ターゲット・イ ヤー2045)	802,092円	1,706,431円
投資のソムリエ(ターゲット・イ ヤー2055)	802,092円	1,105,582円
リスク抑制世界8資産バランス ファンド(DC)	641,925円	1,567,300円
投資のソムリエ(ターゲット・イ ヤー2035)	680,332円	2,621,503円
リスクコントロール世界資産分散 ファンド	- 円	510,274,666円
エマージング債券リスク抑制型 (適格機関投資家限定)	12,745,371,625円	11,559,148,690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)	3,284,400,424円	2,828,965,750円
D I A M世界アセットバランス ファンド2VA(適格機関投資家 限定)	7,316,952,369円	6,835,889,417円
D I A M世界アセットバランス ファンド3VA(適格機関投資家 限定)	4,762,929,633円	4,870,008,669円
D I A Mグローバル・リスクファ クター・パリティ戦略ファンド (適格機関投資家限定)	4,695,478,120円	3,682,541,666円

	D I A Mグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンドI (適格機関投資家限定)	4,875,707,169円	2,853,159,768円
	P - O n eマルチアセット戦略ファンド(適格機関投資家限定)	3,225,439,414円	4,927,745,479円
	計	54,256,447,518円	59,857,001,615円
2 .	受益権の総数	54,256,447,518口	59,857,001,615口



## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成30年1月11日現在	平成30年7月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、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）

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

## 通貨関連

種類	平成30年1月11日 現在				平成30年7月11日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	980,663,200	-	980,672,000	8,800	55,522,000	-	55,460,000	62,000
アメリカ・ドル	980,663,200	-	980,672,000	8,800	55,522,000	-	55,460,000	62,000
買 建	292,344,000	-	289,796,000	2,548,000	499,125,600	-	499,095,000	30,600
アメリカ・ドル	292,344,000	-	289,796,000	2,548,000	499,125,600	-	499,095,000	30,600
合計	1,273,007,200	-	1,270,468,000	2,556,800	554,647,600	-	554,555,000	31,400

(注) 時価の算定方法

1. 計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。  
 計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。  
 計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。
  - ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算しております。
  - ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。
2. 計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。
3. 換算において円未満の端数は切捨てております。  
 上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成30年1月11日現在	平成30年7月11日現在
1口当たり純資産額	1.9015円	1.8239円
(1万口当たり純資産額)	(19,015円)	(18,239円)

## 2【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

平成30年7月31日現在

資産総額	4,786,153,772円
負債総額	4,099,813円
純資産総額( - )	4,782,053,959円
発行済数量	3,882,043,754口
1口当たり純資産額( / )	1.2318円

(参考)

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

平成30年7月31日現在

資産総額	302,950,054,118円
負債総額	1,544,278,436円
純資産総額( - )	301,405,775,682円
発行済数量	112,517,950,310口
1口当たり純資産額( / )	2.6787円

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年7月31日現在

資産総額	343,546,052,606円
負債総額	273,460,000円
純資産総額( - )	343,272,592,606円
発行済数量	266,079,340,450口
1口当たり純資産額( / )	1.2901円

J-REITインデックスファンド・マザーファンド

平成30年7月31日現在

資産総額	38,320,354,307円
負債総額	827,408,272円
純資産総額( - )	37,492,946,035円
発行済数量	20,136,506,421口
1口当たり純資産額( / )	1.8619円

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年7月31日現在

資産総額	317,347,270,628円
負債総額	693,536,551円
純資産総額( - )	316,653,734,077円
発行済数量	88,591,962,950口
1口当たり純資産額( / )	3.5743円

## 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年7月31日現在

資産総額	213,601,312,584円
負債総額	335,935,000円
純資産総額( - )	213,265,377,584円
発行済数量	118,088,535,527口
1口当たり純資産額( / )	1.8060円

## 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年7月31日現在

資産総額	53,403,835,698円
負債総額	151,309,031円
純資産総額( - )	53,252,526,667円
発行済数量	43,781,008,664口
1口当たり純資産額( / )	1.2163円

## エマージング株式パッシブ・マザーファンド

平成30年7月31日現在

資産総額	67,677,861,222円
負債総額	4,256,215円
純資産総額( - )	67,673,605,007円
発行済数量	56,495,202,249口
1口当たり純資産額( / )	1.1979円

## エマージング債券パッシブ・マザーファンド

平成30年7月31日現在

資産総額	114,877,537,198円
負債総額	2,546,757,810円
純資産総額( - )	112,330,779,388円
発行済数量	61,352,365,759口
1口当たり純資産額( / )	1.8309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（平成30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（平成30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。

平成30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	38	1,264,102,345,784
追加型株式投資信託	850	12,950,854,953,959
単位型公社債投資信託	49	193,796,833,775
単位型株式投資信託	145	955,223,205,407
合計	1,082	15,363,977,338,925



### 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33期事業年度(自平成29年4月1日至平成30年3月31日)の財務諸表について、新日本有限責任監査法人の監査を受けております。

## (1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

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

（単位：千円）

	第32期 （平成29年3月31日現在）	第33期 （平成30年3月31日現在）
（負債の部）		
流動負債		
預り金	1,169,128	1,003,550
未払金	4,745,195	5,081,728
未払収益分配金	1,027	1,031
未払償還金	57,332	57,275
未払手数料	4,062,695	4,629,133
その他未払金	624,140	394,288
未払費用	7,030,589	7,711,038
未払法人税等	1,915,556	5,153,972
未払消費税等	891,476	1,660,259
賞与引当金	1,432,264	1,393,911
役員賞与引当金	27,495	49,986
本社移転費用引当金	-	156,587
流動負債計	17,211,706	22,211,034
固定負債		
退職給付引当金	1,305,273	1,637,133
時効後支払損引当金	216,466	199,026
本社移転費用引当金	942,315	-
固定負債計	2,464,055	1,836,160
負債合計	19,675,761	24,047,195
（純資産の部）		
株主資本		
資本金	2,000,000	2,000,000
資本剰余金	19,552,957	19,552,957
資本準備金	2,428,478	2,428,478
その他資本剰余金	17,124,479	17,124,479
利益剰余金	31,899,643	44,349,855
利益準備金	123,293	123,293
その他利益剰余金	31,776,350	44,226,562
別途積立金	24,580,000	24,580,000
研究開発積立金	300,000	300,000
運用責任準備積立金	200,000	200,000
繰越利益剰余金	6,696,350	19,146,562
株主資本計	53,452,601	65,902,812
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	517,864	795,002
評価・換算差額等計	517,864	795,002
純資産合計	53,970,465	66,697,815
負債・純資産合計	73,646,227	90,745,010

## (2) 【損益計算書】

(単位：千円)

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

（単位：千円）

	第32期 （自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）		第33期 （自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）	
営業外収益				
受取利息		537		1,430
受取配当金		51,036		74,278
時効成立分配金・償還金		103		256
為替差益		7,025		8,530
投資信託解約益		2		236,398
投資信託償還益		-		93,177
雑収入	1	18,213	1	10,306
時効後支払損引当金戻入額		-		17,429
営業外収益計		76,918		441,807
営業外費用				
投資信託解約損		31,945		4,138
投資信託償還損		47,201		17,065
金銭の信託運用損		552,635		99,303
時効成立後支払分配金・償還金		39		-
時効後支払損引当金繰入額		209,210		-
営業外費用計		841,031		120,507
経常利益		10,789,897		21,045,676
特別利益				
固定資産売却益	2	2,348	2	1
投資有価証券売却益		-		479,323
関係会社株式売却益	1	-	1	1,492,680
貸倒引当金戻入益		8,883		-
訴訟損失引当金戻入益		21,677		-
本社移転費用引当金戻入額		-		138,294
その他特別利益		746		350
特別利益計		33,655		2,110,649
特別損失				
固定資産除却損	3	23,600	3	36,992
固定資産売却損	4	10,323	4	134
投資有価証券評価損		12,085		-
ゴルフ会員権評価損		4,832		-
訴訟和解金		30,000		-
本社移転費用	5	1,511,622	5	-
退職給付制度終了損		-		690,899
システム移行損失		-		76,007
その他特別損失		-		50
特別損失計		1,592,463		804,083
税引前当期純利益		9,231,089		22,352,243
法人税、住民税及び事業税		2,965,061		6,951,863
法人税等調整額		177,275		249,832
法人税等合計		2,787,786		6,702,031
当期純利益		6,443,302		15,650,211

## （３）【株主資本等変動計算書】

第32期（自平成28年4月1日至平成29年3月31日）

（単位：千円）

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

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

第33期(自平成29年4月1日至平成30年3月31日)

(単位:千円)

	株主資本								
	資本金	資本剰余金			利益剰余金				
		資本準備金	その他 資本剰余金	資本剰余金 合計	利益 準備金	その他利益剰余金			
						別途 積立金	研究開発 積立金	運用責 任準備 積立金	繰越利益 剰余金
当期首残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	24,580,000	300,000	200,000	6,696,350
当期変動額									
剰余金の配当									3,200,000
当期純利益									15,650,211
株主資本以外の 項目の当期 変動額(純額)									
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	-	-	12,450,211
当期末残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	24,580,000	300,000	200,000	19,146,562

	株主資本		評価・換算差額等		純資産 合計
	利益剰余金	株主資本 合計	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
	利益剰余金 合計				
当期首残高	31,899,643	53,452,601	517,864	517,864	53,970,465
当期変動額					
剰余金の配当	3,200,000	3,200,000			3,200,000
当期純利益	15,650,211	15,650,211			15,650,211
株主資本以外の 項目の当期 変動額(純額)		-	277,137	277,137	277,137
当期変動額合計	12,450,211	12,450,211	277,137	277,137	12,727,349
当期末残高	44,349,855	65,902,812	795,002	795,002	66,697,815

## 重要な会計方針

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



## 会計上の見積りの変更

第33期 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)

当社は、当事業年度においてシステム統合計画を決定したことに伴い、利用不能となる固定資産について耐用年数を短縮し、将来にわたり変更しております。

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

## 追加情報

第33期 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)

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

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

## 注記事項

(貸借対照表関係)

### 1. 有形固定資産の減価償却累計額

(千円)

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

(損益計算書関係)

### 1. 関係会社に対する事項

(千円)

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

### 2. 固定資産売却益の内訳

(千円)

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

## 3. 固定資産除却損の内訳

(千円)

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

## 4. 固定資産売却損の内訳

(千円)

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

## 5. 本社移転費用の内訳

(千円)

	第32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)	第33期 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)
本社移転費用引当金繰入額	942,315	-
旧日本社不動産賃借料	418,583	-
賃貸借契約解約損	150,723	-

## (株主資本等変動計算書関係)

第32期(自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

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

## 2. 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

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

## (2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

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

## 第33期(自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2. 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

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

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの  
平成30年6月20日開催予定の定時株主総会において、以下のとおり決議を予定しております。

決議	株式の種類	配当の原資	配当金の総額(千円)	1株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
平成30年6月20日 定時株主総会	普通株式	利益 剰余金	12,520,000	313,000	平成30年3月31日	平成30年6月21日
	A種種類株式					

## (金融商品関係)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

## (1) 金融商品に対する取組方針

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

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

## (2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

営業債務である未払手数料は、1年以内の支払期日であります。

## (3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

## (4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

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

第32期（平成29年3月31日現在）

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

## 第33期(平成30年3月31日現在)

	貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1) 現金・預金	49,071,217	49,071,217	-
(2) 金銭の信託	12,083,824	12,083,824	-
(3) 未収委託者報酬	11,769,015	11,769,015	-
(4) 未収運用受託報酬	4,574,225	4,574,225	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	1,448,968	1,448,968	-
資産計	78,947,251	78,947,251	-
(1) 未払手数料	4,629,133	4,629,133	-
負債計	4,629,133	4,629,133	-

## (注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

## (1) 現金・預金

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

## (2) 金銭の信託

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

## (3) 未収委託者報酬及び(4) 未収運用受託報酬

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

## (5) 有価証券及び投資有価証券

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

負 債

## (1) 未払手数料

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

## (注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(千円)

区分	第32期 (平成29年3月31日現在)	第33期 (平成30年3月31日現在)
非上場株式	337,468	272,464
関係会社株式	3,306,296	3,229,196

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

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

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第32期(平成29年3月31日現在)

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

第33期(平成30年3月31日現在)

	1年以内 (千円)	1年超5年以内 (千円)	5年超10年以内 (千円)	10年超 (千円)
(1) 現金・預金	49,071,217	-	-	-
(2) 金銭の信託	12,083,824	-	-	-
(3) 未収委託者報酬	11,769,015	-	-	-
(4) 未収運用受託報酬	4,574,225	-	-	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券(投資信託)	-	3,995	-	-

(有価証券関係)

## 1. 子会社株式及び関連会社株式

関係会社株式(第32期の貸借対照表計上額3,306,296千円、第33期の貸借対照表計上額3,229,196千円)は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

## 2. その他有価証券

第32期(平成29年3月31日現在)

(千円)

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

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

## 第33期(平成30年3月31日現在)

(千円)

区分	貸借対照表日における 貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの			
株式	1,267,157	146,101	1,121,055
投資信託	177,815	153,000	24,815
小計	1,444,972	299,101	1,145,870
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
株式	-	-	-
投資信託	3,995	4,000	4
小計	3,995	4,000	4
合計	1,448,968	303,101	1,145,866

(注) 非上場株式(貸借対照表計上額272,464千円)については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

## 3. 当該事業年度中に売却したその他有価証券

## 第32期(自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)

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

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

## 第33期(自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)

区分	売却額 (千円)	売却益の合計額 (千円)	売却損の合計額 (千円)
株式	544,326	479,323	-
投資信託	2,480,288	329,576	21,204

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

## 4. 減損処理を行った有価証券

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

第33期において、該当事項はありません。

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

## （退職給付関係）

## 1. 採用している退職給付制度の概要

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

なお、当社は平成29年10月1日付で、確定給付企業年金制度を確定拠出年金制度等に移行するとともに、退職一時金制度を改定しました。

## 2. 確定給付制度

## （1）退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

（千円）

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

## （2）年金資産の期首残高と期末残高の調整表

（千円）

	第32期	第33期
	（自平成28年4月1日 至平成29年3月31日）	（自平成29年4月1日 至平成30年3月31日）
年金資産の期首残高	-	1,363,437
期待運用収益	16,033	17,042
数理計算上の差異の発生額	1,894	-
事業主からの拠出額	37,402	36,672
退職給付の支払額	28,876	-
合併による増加	1,336,984	-
確定拠出制度への移行に伴う減少額	-	1,417,152
年金資産の期末残高	1,363,437	-

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

（千円）

	第32期	第33期
	（平成29年3月31日現在）	（平成30年3月31日現在）
積立型制度の退職給付債務	1,275,346	-
年金資産	1,363,437	-
	88,090	-
非積立型制度の退職給付債務	1,443,026	2,154,607
未積立退職給付債務	1,354,935	2,154,607
未認識数理計算上の差異	430,203	204,636
未認識過去勤務費用	4,852	312,836
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	919,879	1,637,133
退職給付引当金	1,245,019	1,637,133
前払年金費用	325,140	-
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	919,879	1,637,133



## (4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(千円)

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

(注) 特別損失に計上しております。

## (5) 年金資産に関する事項

年金資産の主な内訳

年金資産合計に対する主な分類ごとの比率は、次のとおりであります。

	第32期 (平成29年3月31日現在)	第33期 (平成30年3月31日現在)
株式	31.5%	-
債券	29.0%	-
共同運用資産	24.1%	-
生命保険一般勘定	10.5%	-
現金及び預金	4.6%	-
合計	100.0%	-

長期期待運用収益率の設定方法

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

## (6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎

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

## 3. 簡便法を適用した確定給付制度

(1) 簡便法を適用した制度の、退職給付引当金の期首残高と期末残高の調整表

(千円)

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

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

(千円)

	第32期 (平成29年3月31日現在)	第33期 (平成30年3月31日現在)
積立型制度の退職給付債務	789,261	-
年金資産	1,150,443	-
	361,181	-
非積立型制度の退職給付債務	60,254	-
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	300,927	-
退職給付引当金	60,254	-
前払年金費用	361,181	-
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	300,927	-

## (3) 退職給付費用

簡便法で計算した退職給付費用 前事業年度 22,562千円 当事業年度53,156千円

## 4. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度61,817千円、当事業年度86,141千円であります。

## (税効果会計関係)

## 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	第32期 (平成29年3月31日現在)	第33期 (平成30年3月31日現在)
	(千円)	(千円)
繰延税金資産		
未払事業税	124,081	290,493
未払事業所税	11,054	11,683
賞与引当金	441,996	426,815
未払法定福利費	84,152	81,186
資産除去債務	86,421	90,524
減価償却超過額(一括償却資産)	10,666	11,331
減価償却超過額	116,920	176,791
繰延資産償却超過額(税法上)	32,949	34,977
退職給付引当金	399,808	501,290
時効後支払損引当金	66,282	60,941
ゴルフ会員権評価損	14,295	13,173
関係会社株式評価損	166,740	166,740
投資有価証券評価損	69,683	28,976
未払給与	12,344	9,186
本社移転費用引当金	289,865	47,947
その他	14,309	29,193
繰延税金資産小計	1,941,573	1,981,254
評価性引当額	-	-
繰延税金資産合計	1,941,573	1,981,254
繰延税金負債		
前払年金費用	210,151	-
その他有価証券評価差額金	159,429	281,720
繰延税金負債合計	369,581	281,720

繰延税金資産の純額

1,571,992

1,699,533

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

(企業結合等関係)

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

1. 結合当事企業

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

2. 企業結合日

平成28年10月1日

3. 企業結合の方法

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

4. 結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

5. 企業結合の主な目的

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

6. 合併比率

「3. 企業結合の方法」の吸収合併における合併比率は以下の通りであります。

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

(\*) 普通株式と種類株式を合算して算定しております。

7. 交付した株式数

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

## 8. 経済的持分比率(議決権比率)

MHFGが企業結合直前に所有していた当社に対する経済的持分比率	50.00%
MHFGが企業結合日に追加取得した当社に対する経済的持分比率	20.00%
MHFGの追加取得後の当社に対する経済的持分比率	70.00%

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

## 9. 取得企業を決定するに至った主な根拠

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

## 10. 会計処理

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

## 11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

## (1) 財務諸表に含まれる被取得企業の業績の期間

平成29年4月1日から平成30年3月31日まで

## (2) 被取得企業の取得原価及びその内訳

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

## (3) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

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

## (4) 企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

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

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

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

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

## 12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

## (1) 貸借対照表項目

流動資産	- 千円
固定資産	114,270,495千円
資産合計	114,270,495千円
流動負債	- 千円
固定負債	13,059,836千円
負債合計	13,059,836千円
純資産	101,210,659千円

(注) 固定資産及び資産合計には、のれんの金額70,507,975千円及び顧客関連資産の金額45,200,838千円が含まれております。

## (2) 損益計算書項目

営業収益	- 千円
営業利益	9,012,128千円
経常利益	9,012,128千円
税引前当期純利益	9,012,128千円
当期純利益	7,419,617千円
1株当たり当期純利益	185,490円43銭

(注) 営業利益には、のれんの償却額3,811,241千円及び顧客関連資産の償却額5,233,360千円が含まれております。

## (資産除去債務関係)

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

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

## (セグメント情報等)

## 1. セグメント情報

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

## 2. 関連情報

第32期（自平成28年4月1日 至平成29年3月31日）及び第33期（自平成29年4月1日 至平成30年3月31日）

## (1) サービスごとの情報

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

## (2) 地域ごとの情報

## 営業収益

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

## 有形固定資産

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

## (3) 主要な顧客ごとの情報

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

## ( 関連当事者情報 )

## 1. 関連当事者との取引

## (1) 親会社及び法人主要株主等

第32期(自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)

該当はありません。

第33期(自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)

該当はありません。

## (2) 子会社及び関連会社等

第32期(自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)

該当はありません。

第33期(自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)

該当はありません。

## (3) 兄弟会社等

第32期(自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は 出資金	事業の 内容又は 職業	議決権 等の所有 (被所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員 の兼任等	事業上 の関係				
親会社の子会社	株式会社みずほ銀行	東京都千代田区	14,040 億円	銀行業	-	-	当社設定投資信託の販売	投資信託の 販売代行手 数料	4,530,351	未払 手数料	767,732
	資産管理サービス信託銀行株式会社	東京都中央区	500 億円	資産管理 等	-	-	当社信託財産の運用	信託元本の 払戻(純額) 信託報酬の 支払	100,000  7,080	金銭の 信託	12,366,219
	みずほ証券株式会社	東京都千代田区	1,251 億円	証券業	-	-	当社設定投資信託の販売	投資信託の 販売代行手 数料	5,061,766	未払 手数料	1,166,212
	みずほ信託銀行株式会社	東京都中央区	2,473 億円	信託銀行 業	-	-	投資一任契約の締結	運用受託報 酬の受取	2,520,431	未収運 用受託 報酬	2,722,066

第33期(自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は 出資金	事業の 内容又は 職業	議決権 等の所有 (被所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員 の兼任等	事業上 の関係				
親会社の子会社	株式会社みずほ銀行	東京都千代田区	14,040 億円	銀行業	-	-	当社設定投資信託の販売	投資信託の 販売代行手 数料	6,470,802	未払 手数料	894,336
	みずほ証券株式会社	東京都千代田区	1,251 億円	証券業	-	-	当社設定投資信託の販売	投資信託の 販売代行手 数料	9,079,083	未払 手数料	1,549,208

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

- (注1) 投資信託の販売代行手数料は、一般的取引条件を勘案した個別契約により決定しております。
- (注2) 信託報酬は、一般的取引条件を勘案した料率が適用されております。
- (注3) 運用受託報酬は、一般的取引条件を勘案した個別契約により決定しております。
- (注4) 上記の取引金額には消費税等が含まれておりません。期末残高には、消費税等が含まれております。

## 2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

## (1) 親会社情報

株式会社みずほフィナンシャルグループ

(東京証券取引所及びニューヨーク証券取引所に上場)

## (2) 重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません。

## (1株当たり情報)

	第32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)	第33期 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)
1株当たり純資産額	1,349,261円64銭	1,667,445円37銭
1株当たり当期純利益金額	201,491円22銭	391,255円29銭

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

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

	第32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)	第33期 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)
当期純利益金額	6,443,302千円	15,650,211千円
普通株主及び普通株主と同等の株主に帰属しない金額	-	-
普通株式及び普通株式と同等の株式に係る当期純利益金額	6,443,302千円	15,650,211千円
普通株式及び普通株式と同等の株式の期中平均株式数	31,978株	40,000株
(うち普通株式)	(24,244株)	(24,490株)
(うちA種種類株式)	(7,734株)	(15,510株)

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

#### 4【利害関係人との取引制限】

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

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

#### 5【その他】

- (1) 定款の変更、事業譲渡又は事業譲受、出資の状況その他の重要事項  
平成30年6月20日付で、総則の「目的」に関する事項の定款の変更を行いました。
- (2) 訴訟事件その他の重要事項  
委託会社およびファンドに重要な影響を与えた事実、または与えると予想される事実はありません。



## 第2【その他の関係法人の概況】

### 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

#### (1)受託会社

##### a. 名称

みずほ信託銀行株式会社

##### b. 資本金の額

平成30年3月末日現在 247,369百万円

##### c. 事業の内容

日本において銀行業務および信託業務を営んでいます。

#### (2)販売会社

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

名 称	資本金の額 (単位:百万円)	事 業 の 内 容
株式会社みずほ銀行	1,404,065	日本において銀行業務を営んでおります。

(注) 資本金の額は平成30年3月末日現在

### 2【関係業務の概要】

「受託会社」は、以下の業務を行います。

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

「販売会社」は、以下の業務を行います。

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

### 3【資本関係】

該当事項はありません。

持株比率5%以上を記載します。

### 第3【その他】

- (1)目論見書の表紙等にロゴ・マークや図案を使用し、ファンドの基本的性格を記載することがあります。また目論見書には「目論見書の使用開始日」、「委託会社の金融商品取引業者登録番号」、「金融商品取引法の規定に基づく目論見書である旨」、「投資信託の取引はクーリングオフ適用外である旨」、「請求目論見書の内容やその照会先と請求方法」、「信託財産の管理方法」、「投資信託運用による損益は全て投資家に帰属する旨」、「投資信託の元本は保証されていない旨」等を記載することがあります。
- (2)目論見書には有価証券届出書の第一部「証券情報」、第二部「ファンド情報」の主要内容を要約し記載することがあります。第二部「ファンド情報」第1 ファンドの状況 5 運用状況 には、参考情報として 基準価額・純資産の推移 分配の推移 主要な資産の状況 年間収益率の推移等（ベンチマークを含む）を記載することがあります。（表示されるデータは適宜更新されます。）
- (3)請求目論見書の巻末に用語説明を掲載する場合があります。  
なお、請求目論見書の巻末に信託約款を掲載し参照することで、有価証券届出書の内容の記載とすることがあります。
- (4)ファンドの特色やリスク等について投資者に開示すべき情報のあるファンドは、交付目論見書に「追加的記載事項」と明記して当該情報の内容等を有価証券届出書の記載に従い記載することがあります。
- (5)交付目論見書の「お申込みメモ」に以下の内容を記載することがあります。  
基準価額は、販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。  
もしくは、計算日の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。

## 独立監査人の監査報告書

平成30年5月30日

アセットマネジメントOne株式会社  
取締役会 御中

## 新日本有限責任監査法人

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

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

## 財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

## 監査人の責任

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

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

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

## 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、アセットマネジメントOne株式会社の平成30年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 利害関係

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

以上

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

(注2) XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。

# 独立監査人の監査報告書

平成30年2月28日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

PwCあらた有限責任監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているD I A M 8資産バランスファンドN < D C年金 > の平成29年1月12日から平成30年1月11日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

## 財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

## 監査人の責任

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

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

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

## 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、D I A M 8資産バランスファンドN < D C年金 > の平成30年1月11日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 利害関係

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

以 上

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

2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

## 独立監査人の中間監査報告書

平成30年8月31日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 湯原 尚 印  
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>の平成30年1月12日から平成30年7月11日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

## 監査人の責任

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

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

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

## 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>の平成30年7月11日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成30年1月12日から平成30年7月11日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## その他の事項

ファンドの平成30年1月11日をもって終了した前計算期間の中間計算期間に係る中間財務諸表及び前計算期間の財務諸表は、それぞれ、前任監査人によって中間監査及び監査が実施されている。前任監査人は、当該中間財務諸表に対して平成29年8月30日付けで有用な情報を表示している旨の意見を表明しており、また、当該財務諸表に対して平成30年2月28日付けで無限定適正意見を表明している。

## 利害関係

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

以上

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

（注2）XBRLデータは監査の対象には含まれておりません。

