【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4月11日
【発行者名】	アセットマネジメント0ne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】	クルーズコントロール＜ＤＣ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】	5,000億円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

クルーズコントロール＜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」に記載の振替機関および当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含めます。）をいいます。以下同じ。）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託会社であるアセットマネジメントOne株式会社（以下、「委託会社」といいます。）は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

（３）【発行（売出）価額の総額】

5,000億円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

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

＜基準価額の照会方法等＞
基準価額は、委託会社の毎営業日において、委託会社により計算され、公表されます。
※当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。
・販売会社へのお問い合わせ
・委託会社への照会
ホームページ　URL　http://www.am-one.co.jp/
コールセンター：0120-104-694（受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで）

（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4月12日から平成30年10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、ニューヨークの銀行、ロンドンの銀行のいずれかの休業日に該当する日（以下、「海外休業日」という場合があります。）には、お申込みの受付を行いません。

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

（８）【申込取扱場所】

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ます。各取得申込日の発行価額の総額は、販売会社によって、追加信託が行われる日に、委託会社の指定する口座を経由して受託会社の指定するファンド口座（受託会社が信託事務の一部について委託を行っている場合は当該委託先の口座）に払込まれます。

（１０）【払込取扱場所】

取得申込者は、販売会社の定める方法により、販売会社に買付代金を支払うものとします。

払込取扱場所についてご不明な点は、以下の方法でご確認ください。

・委託会社への照会

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

（１１）【振替機関に関する事項】

振替機関は下記の通りです。

・株式会社証券保管振替機構

（１２）【その他】

お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

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

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

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

第二部【ファンド情報】

第１【ファンドの状況】

１【ファンドの性格】

（１）【ファンドの目的及び基本的性格】

①当ファンドは、信託財産の成長を図ることを目的として、運用を行います。

②当ファンドの信託金限度額は、5,000億円とします。ただし、委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

＜ファンドの特色＞

1 国内外の6資産に分散投資することにより、信託財産の成長を図ることを目的として、運用を行います。

●国内外の株式および公社債に、以下のマザーファンドを通じて実質的に投資します。
- ・国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
- ・国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド
- ・外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
- ・外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
- ・エマージング債券パッシブ・マザーファンド
- ・エマージング株式パッシブ・マザーファンド

●マザーファンドのほか、有価証券指数等先物取引等、指数に連動する投資成果をめざす上場している投資信託証券（ETF）、短期金融資産等へ投資する場合もあります。

●実質的な組入外貨建資産に対しては、原則として、対円での為替ヘッジを行いません。

●各資産への投資比率は、統計的手法により、原則として年1回見直すこととします。経済環境、運用環境の大きな変化などにより委託会社が必要と判断した場合には、適宜、投資比率の見直しを行うことがあります。

2 基準価額の下落を一定水準（下値目安値(*)）までに抑えることを目標とします。

●資産価値上昇時には、値上がり益を獲得することをめざします。

●資産価値下落時でも、基準価額の下落を一定水準までに抑えることをめざします。

●下値目安値は、3ヵ月毎に下値目安値の改定日（毎年1月、4月、7月、10月の各11日。休業日の場合には、翌営業日。）を設け、改定日における基準価額から−2.0%の水準とします。ただし、当該水準は、委託会社の判断により今後変更する場合があります。

●上記の運用目標は、現金等(**)を活用し、基準価額の水準や市場環境等に応じて投資対象資産の合計資産比率(***)を機動的に変更することで行います。

(*)基準価額が下値目安値を下回らないことを委託会社が保証等するものではありません（相場急落の場合などには、基準価額が下値目安値を下回る場合があります）。

(**)現金等とは、短期国債、コール・ローンなどの短期金融資産等をいい、当該資産へは、「DIAMマネーマザーファンド」を通じてまたは直接投資を行います。

(***)合計資産比率とは、「DIAMマネーマザーファンド」を除く6つのマザーファンドの投資比率の合計をいいます。

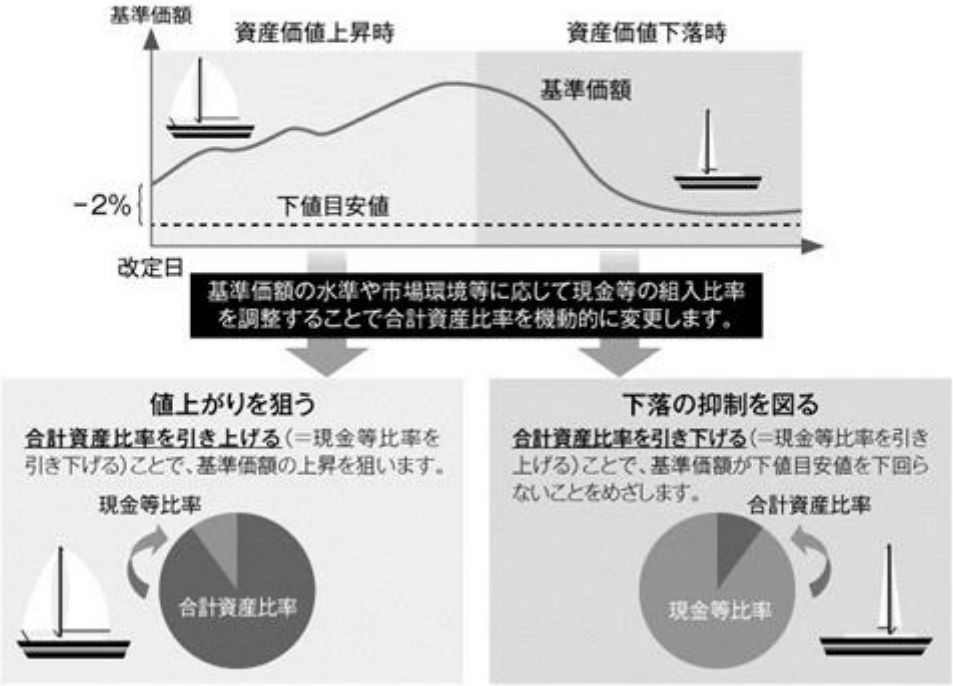
※各資産への投資比率および合計資産比率の決定にあたっては、みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社から投資助言を受けます。

当ファンドの合計資産比率の変更（イメージ）

●資産価値上昇時は、合計資産比率*1を増加（＝現金等*2比率の減少）させることで値上がり益の獲得をめざします。

●一方、資産価値下落時は、機動的に合計資産比率を減少（＝現金等比率の増加）させることで基準価額下落の抑制をめざします。

*1 合計資産比率とは、「DIAMマネーマザーファンド」を除く6つのマザーファンドの投資比率の合計をいいます。
*2 現金等とは、短期国債、コール・ローンなどの短期金融資産等をいい、当該資産へは、「DIAMマネーマザーファンド」を通じてまたは直接投資を行います。
※合計資産比率の決定にあたっては、みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社の投資助言を活用します。



※下値目安値は、基準価額がこれを下回らないように目標とされる水準であり、基準価額が下値目安値を下回らないことを委託会社が保証するものではありません。
※ただし、当該水準は委託会社の判断により今後変更する場合があります。
※上記はイメージ図であり、実際にはこれと異なる場合があります。
※資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。また、将来の運用成果等を示唆・保証するものではありません。

分配方針

年2回の決算時（毎年1月、7月の各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）
単位型投信 追加型投信	国　内 海　外 内　外	株　式 債　券 不動産投信 その他資産 （　　） 資産複合

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

○商品分類定義

追加型投信	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいいます。
内　外	目論見書または投資信託約款において、国内及び海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。
資 産 複 合	目論見書または投資信託約款において、株式、債券、不動産投信およびその他資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。

○属性区分表

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

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

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

○属性区分定義

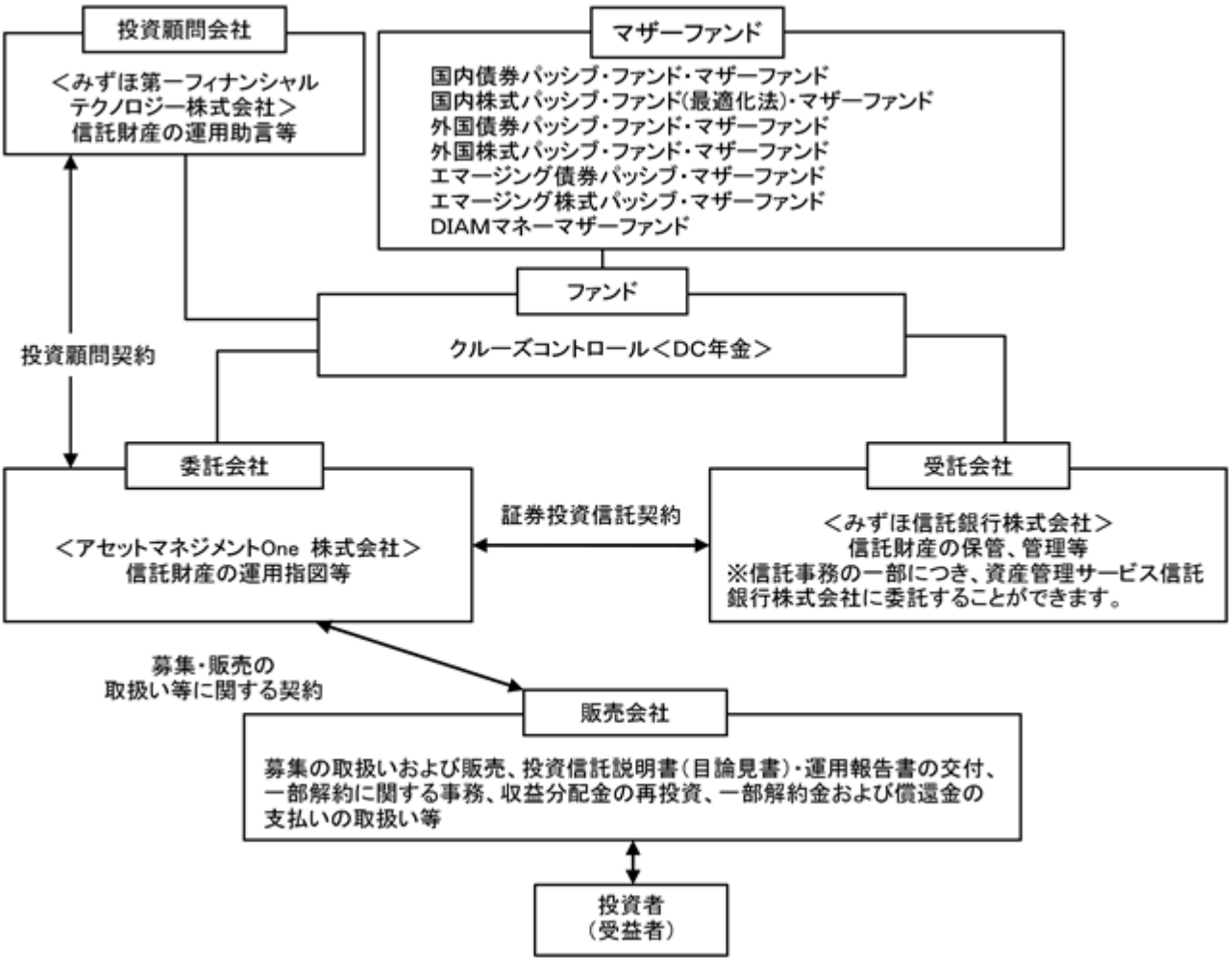
資産複合（投資信託証券（債券、株式）、先物、ＥＴＦ、短期金融資産）資産配分変更型	目論見書または投資信託約款において、複数資産（投資信託証券、先物、ＥＴＦ、短期金融資産）を投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行う旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないものをいいます。
年2回	目論見書または投資信託約款において、年2回決算する旨の記載があるものをいいます。
グローバル（日本を含む）	目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本を含む世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
ファミリーファンド	目論見書または投資信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。）を投資対象として投資するものをいいます。
為替ヘッジなし	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。

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

（２）【ファンドの沿革】

平成26年9月12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、ファンドの設定時に証券投資信託契約を締結しております。

当該契約の内容は、運用の基本方針、投資対象、投資制限、受益者の権利等を規定したものです。

・「募集・販売の取扱い等に関する契約」の概要

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

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。

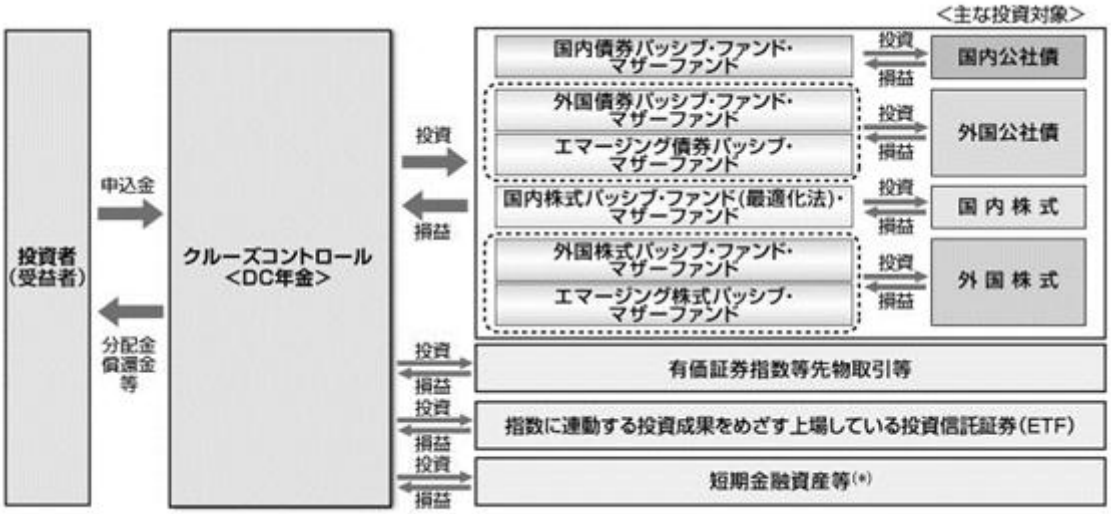
・「投資顧問契約」の概要

委託会社と投資顧問会社（みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社）との間においては、当ファンドの運用にかかる助言契約が締結されております。当該契約の内容は、投資顧問サービスの内容、助言の基本方針、運用の責任等について規定したものであります。

●「ファミリーファンド方式」とは●

当ファンドは「ファミリーファンド方式」により運用を行います。

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



○委託会社の概況

名称：アセットマネジメント0ne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

① 資本金の額

20億円（平成30年1月31日現在）

② 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0ne株式会社に変更

③ 大株主の状況

（平成30年1月31日現在）

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

※1：Ａ種種類株式（15,510株）を含みます。

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

2【投資方針】

（１）【投資方針】

＜基本方針＞

この投資信託は、信託財産の成長を図ることを目的として、運用を行います。

＜投資対象＞

「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」受益証券、「外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「エマージング債券パッシブ・マザーファンド」受益証券、「エマージング株式パッシブ・マザーファンド」受益証券を主要投資対象とします。なお、有価証券指数等先物取引等、指数に連動する投資成果を目指す上場している投資信託証券（ＥＴＦ）、「ＤＩＡＭマネーマザーファンド」受益証券や短期金融資産等に投資する場合もあります。

＜投資態度＞

①以下のマザーファンドへの投資を通じて、国内外の株式、公社債に実質的に分散投資を行います。

・国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
・国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド
・外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
・外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
・エマージング債券パッシブ・マザーファンド
・エマージング株式パッシブ・マザーファンド

（上記それぞれおよびＤＩＡＭマネーマザーファンドを「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。）

・上記のほか、有価証券指数等先物取引等、指数に連動する投資成果をめざす上場している投資信託証券（ＥＴＦ）、ＤＩＡＭマネーマザーファンドや短期金融資産等へ投資する場合もあります。

・実質的な組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。

②各資産への投資比率は、統計的手法により、原則として年１回見直すこととします。

・経済環境、運用環境の大きな変化などにより委託会社が必要と判断した場合には、適宜、投資比率の見直しを行うことがあります。

③基準価額の下落を一定水準（下値目安値(*)）までに抑えることを目標とします。

・資産価値上昇時には、値上がり益を獲得することをめざします。
・資産価値下落時でも、基準価額の下落を一定水準までに抑えることをめざします。
・下値目安値は、四半期毎に、委託会社の判断により基準価額から一定の水準に設定します。
・上記の運用目標は、基準価額の水準や市場環境等に応じて投資対象資産の合計資産比率(**)を機動的に変更することで行います。
（*）基準価額が下値目安値を下回らないことを委託会社が保証等するものではありません（相場急落の場合などには、基準価額が下値目安値を下回る場合があります）。
（**）合計資産比率とは、「ＤＩＡＭマネーマザーファンド」を除く６つのマザーファンドの投資比率の合計をいいます。
・各資産への投資比率および合計資産比率の決定にあたっては、みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社から投資助言を受けます。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用が出来ない場合があります。

＜運用プロセス＞

・**基本配分比率の決定**
委託会社は、年に一度、統計的手法を用いて現金等を除く各資産への基本配分比率を決定します。

・**下値目安値の決定**
委託会社は、３ヵ月に一度、下値目安値の改定日を設け、当日の基準価額の98%の水準を翌３ヵ月間の下値目安値とします。

・**リバランスの実施**
委託会社は、各資産の上昇益を享受しつつも基準価額が下値目安値を下回らないことを目標として、基準価額と下値目安値の水準、市況などを基に、日々の合計資産比率の推奨値を決定します。ファンドの合計資産比率と推奨値との乖離が一定以上となった場合にはリバランスを実施します。6資産への投資比率は、基本配分比率と合計資産比率から決定します。

・**みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社からの助言**
基本配分比率および合計資産比率の決定にあたっては、みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社から投資助言を受けます。

（２）【投資対象】

①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。

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

イ．有価証券

ロ．デリバティブ取引に係る権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第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

ｂ.次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

②運用の指図範囲等（約款第17条第1項）

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

1．株券または新株引受権証書

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。

③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②に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。)により運用することを指図することができます。

1.預金

2.指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)

3.コール・ローン

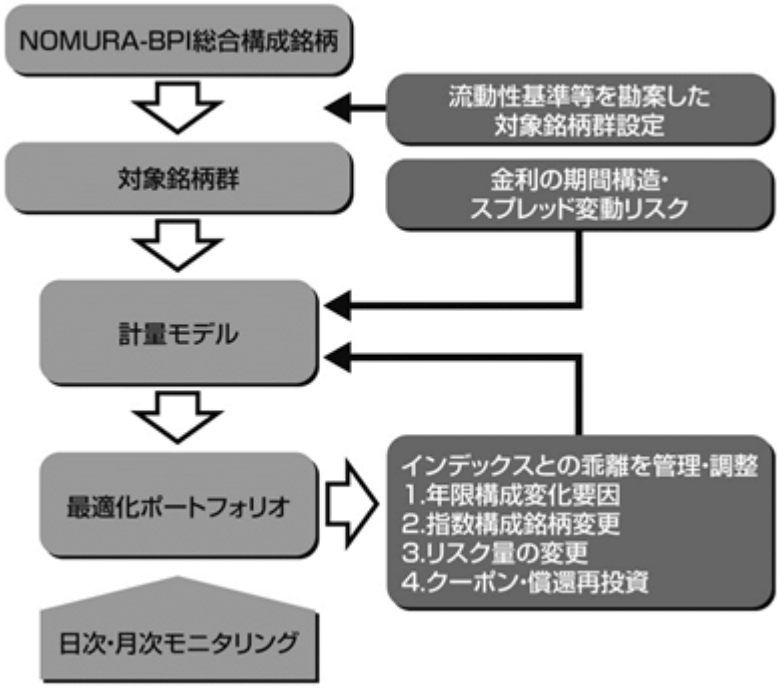
4.手形割引市場において売買される手形

5.貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

6.外国の者に対する権利で5.の権利の性質を有するもの

（参考）当ファンドが投資対象とするマザーファンドの概要

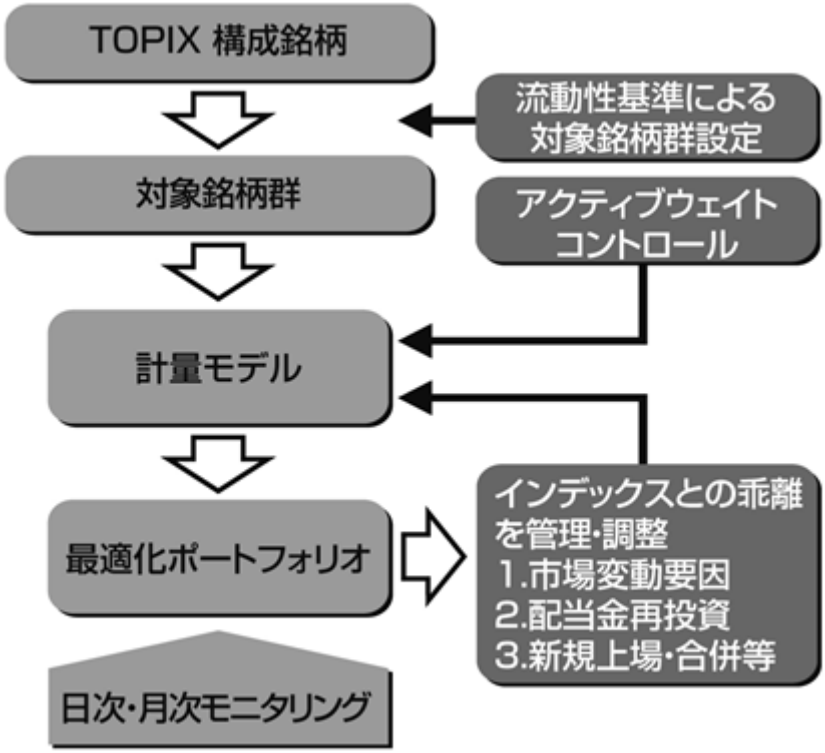
ファンド名	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主な投資対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。

投資態度	1.主としてわが国の公社債に投資し、「ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合」※に連動する投資成果をめざして運用を行います。 2.公社債（債券先物取引等を含みます。）の組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。 3.公社債の組入比率の調整には、債券先物取引等を活用する場合があります。 ※ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合の知的財産権その他一切の権利は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。
運用プロセス	1.流動性基準等による対象銘柄群設定 ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ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	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。 2.株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 3.同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 4.同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 5.外貨建資産への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 6.デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 7.外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。 8.一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

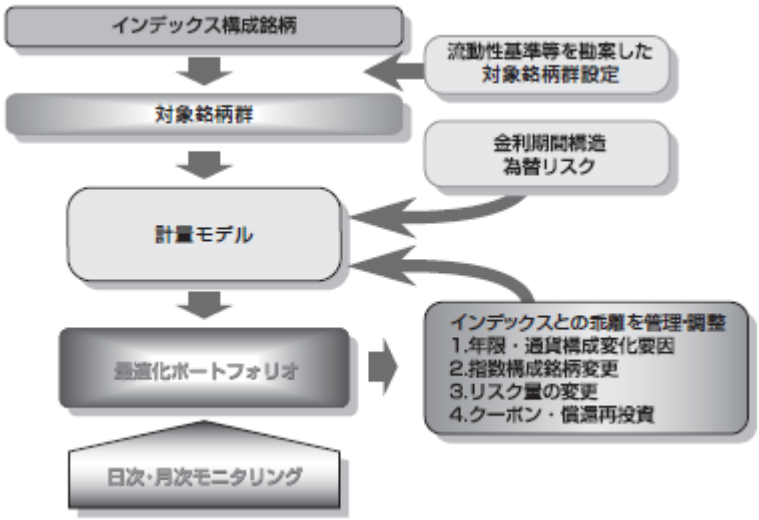
ファンド名	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、わが国の株式市場の動きをとらえることを目標に、東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）（配当込み）に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主な投資対象	東京証券取引所第1部に上場されている株式を主要投資対象とします。

投資態度	1.主として東京証券取引所第1部に上場されている株式に投資し、「東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）（配当込み）」※に連動する投資成果をめざして運用を行います。 2.最適化法によるポートフォリオ構築を行い、運用コストの最小化と徹底したリスク管理を行います。 3.株式（株価指数先物取引を含みます。）の組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。 4.株式の組入比率の調整には、株価指数先物取引等を活用します。 5.非株式割合は原則として信託財産総額の50%以下とします。また、外貨建資産割合は原則として信託財産総額の10%以下とします。 ※①東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）の指数値およびＴＯＰＩＸの商標は、株式会社東京証券取引所（以下「㈱東京証券取引所」といいます。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）に関するすべての権利・ノウハウおよびＴＯＰＩＸの商標に関するすべての権利は㈱東京証券取引所が有しています。 ②㈱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。 ③㈱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。 ④㈱東京証券取引所は、東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）の指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、㈱東京証券取引所は、東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。 ⑤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。 ⑥㈱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。 ⑦㈱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。 ⑧以上の項目に限らず、㈱東京証券取引所は当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドの発行または売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を負いません。

運用プロセス	1.流動性基準による対象銘柄群設定 マーケットインパクトの低減を図る為、ＴＯＰＩＸ採用銘柄のうち、流動性が低い銘柄を除外して投資対象銘柄群を設定します。 2.最適化法によるポートフォリオの構築 インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差（アクティブウェイト）を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。 3.インデックスとの乖離を管理 日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。 インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。 ・市場変動に伴うもの：推定トラッキングエラーの増加に伴い実施 ・新規上場、合併等に伴うもの：指数に与える影響を勘案し、決定 ・配当金再投資に伴うもの：キャッシュ比率の上昇に伴い実施 

主な投資制限	1.株式への投資割合には、制限を設けません。 2.デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 3.外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。 4.一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

ファンド名	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	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。 2.外国債券への投資は原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。 3.外貨建資産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。 ※FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

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	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。 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 2.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。 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。 4.外貨建資産への投資には、制限を設けません。 5.デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 6.外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。 7.一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

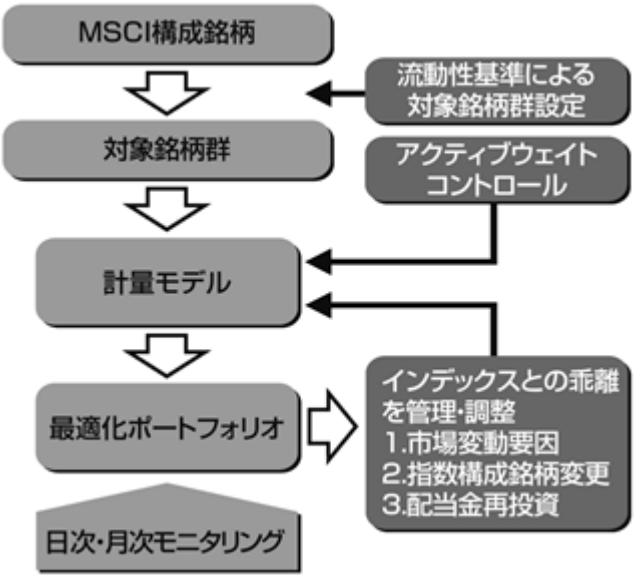
ファンド名	**外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド**
基本方針	**この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。**
主な投資対象	**海外の株式を主要投資対象とします。**

投資態度	**1.主に海外の株式に投資を行い、ＭＳＣＩコクサイ・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）※に連動する投資成果をめざして運用を行います。** **2.株式への投資は原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。** **3.組入外貨建資産については原則為替ヘッジは行いませんが、金利・為替状況によってはヘッジを実施する可能性があります。**

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

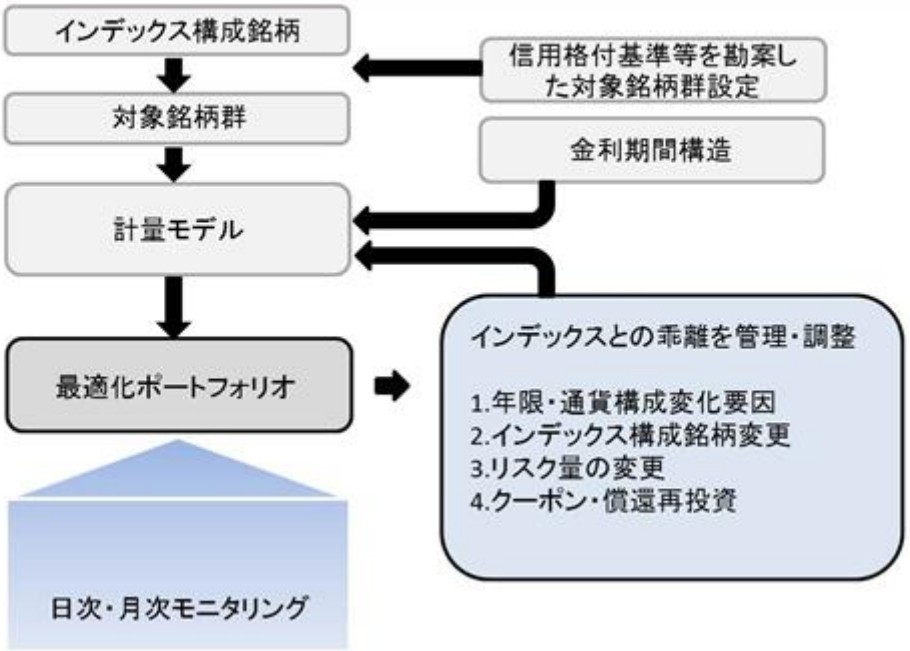
MSCIは、自らが信頼できると考える情報源からMSCI指数の計算に算入または使用するための情報を入手しますが、いかなるMSCI関係者も、MSCI指数またはそれに含まれるデータの独創性、正確性および／または完全性について保証するものではありません。いかなるMSCI関係者も、明示的か黙示的かを問わず、本ファンドの発行会社もしくは所有者、またはその他の者もしくは団体が、MSCI指数またはそれに含まれるデータを使用することにより得られる結果について保証を行いません。いかなるMSCI関係者も、MSCI指数またはそれに含まれるデータの、またはそれらに関連する過誤、脱漏または中断について責任を負いません。ま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

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

	事前にMSCIの書面による承認を得ることなくMSCIとの関係を主張することはできません。
運用プロセス	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。 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て、必要な場合は速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。 インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。 ・市場変動に伴うもの：推定トラッキングエラーの増加に伴い実施 ・ベンチマーク構成銘柄の変更に伴うもの：四半期に一度の銘柄入替、コーポレートアクションおよび指数構築手法の変更に伴い実施 ・配当金再投資に伴うもの：キャッシュ比率の上昇に伴い実施 

主な投資制限	1.株式への投資割合には、制限を設けません。 2.新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において、原則として信託財産の純資産総額の20%以下とします。 3.同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、原則として信託財産の純資産総額の10%以下とします。 4.外貨建資産への投資には、制限を設けません。 5.デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 6.外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。 7.一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

ファンド名	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。
投資態度	1.主として新興国の債券に投資し、ＪＰモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース・為替ヘッジなし）※の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。 2.原則として、新興国の債券の組入比率は高位を維持します。 3.組入債券は、当初組入時において、Ｓ＆ＰもしくはＭｏｏｄｙ’ｓの外貨建て長期格付がＢＢ－格もしくはＢａ３格以上を取得している債券とします。但し、両社が格付を付与している場合には、どちらか低い方の格付を基準とします。また、当ファンドが保有する債券の格付が上記基準未満となった場合は、当該債券を速やかに売却するものとします。 4.外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。 ※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。

運用プロセス	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。 
主な投資制限	1.株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 2.外貨建資産への投資には、制限を設けません。 3.投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 4.デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 5.外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。 6.一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

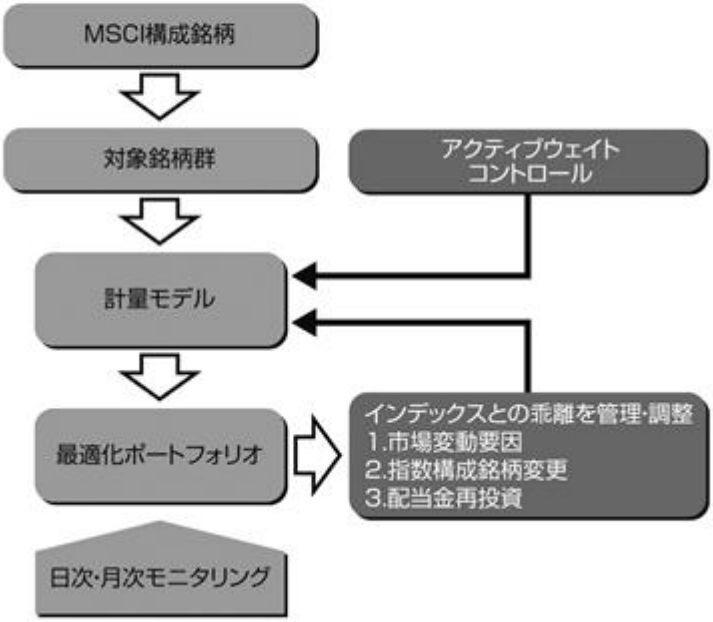
ファンド名	エマージング株式パッシブ・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、主として海外の証券取引所に上場している株式（＊）に投資し、ＭＳＣＩエマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。 （＊）ＤＲ（預託証券）もしくは株式と同等の投資効果が得られる権利を表示する証券および証書等を含みます。
主な投資対象	海外の証券取引所に上場している株式を主要投資対象とします。

投資態度	**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。** **2.原則として、株式の組入比率は高位を維持します。** **3.外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。**

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

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

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

	事前にMSCIの書面による承認を得ることなくMSCIとの関係を主張することはできません。
運用プロセス	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。 
主な投資制限	1.株式への投資割合には、制限を設けません。 2.外貨建資産への投資には、制限を設けません。 3.投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 4.デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 5.外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。 6.一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

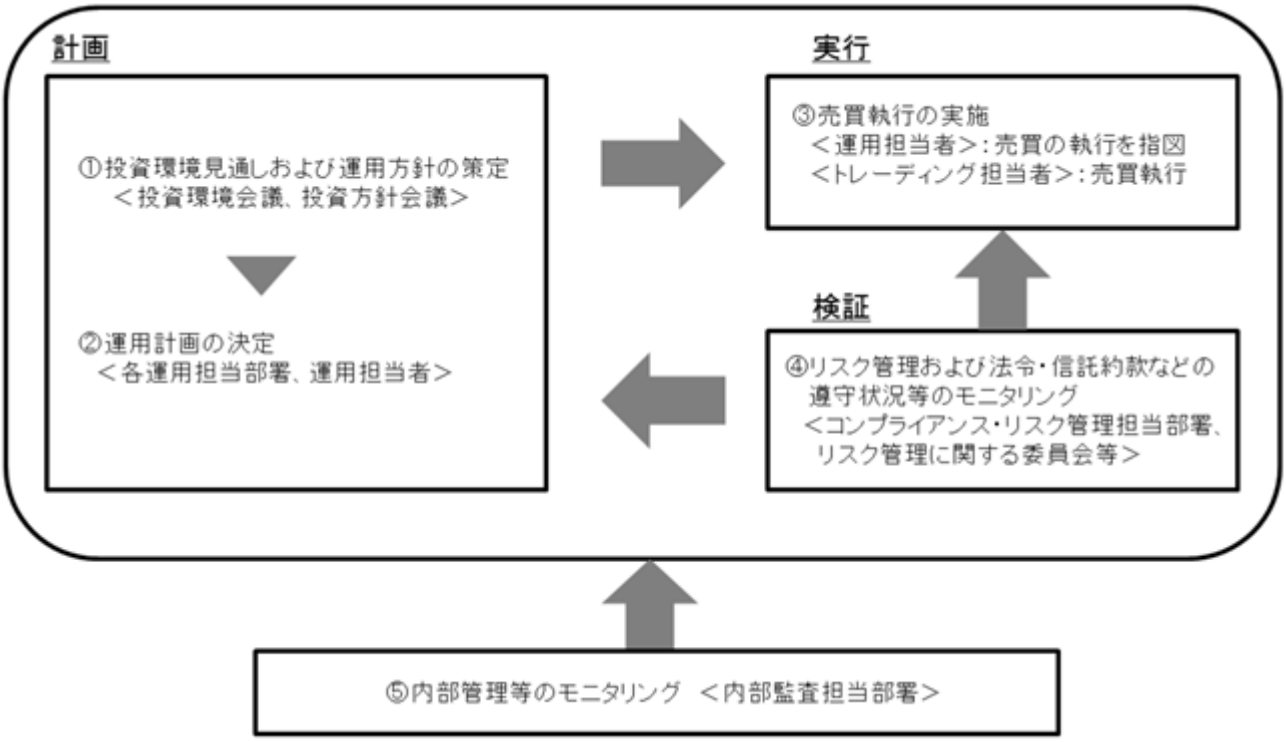
ファンド名	ＤＩＡＭマネーマザーファンド
基本方針	この投資信託は、安定した収益の確保をめざします。
主な投資対象	国内発行体の公社債、転換社債、ユーロ円債、資産担保証券ならびにＣＤ、ＣＰ、コールローン等の国内短期金融資産を主要投資対象とします。

投資態度	①国内の国債、政府保証債、政府機関債、地方債等のほか、取得時において主要格付機関（＊）の長期発行体格付（複数の格付機関が付与している場合は高い方の格付）がＡＡ-格相当以上の社債、転換社債、ユーロ円債、資産担保証券、さらに、国内格付機関の短期格付がa-1格相当以上のＣＤ、ＣＰを主要投資対象とします。 (＊)主要格付機関とは、Ｒ＆Ｉ、ＪＣＲ、Ｍｏｏｄｙ's、Ｓ＆Ｐとします。 ②国債および政府保証債を除き、原則として、ファンドの元本総額に対する1発行体当たりの有価証券の額面総額の割合は5%以内とします。 ③ポートフォリオ全体の修正デュレーションは1年未満を基本として運用します。
運用プロセス	マクロ経済分析を主体としたファンダメンタルズ分析、投資家の需給動向等分析および信用リスク市場の分析等に基づき、短期金利の方向性見通し、セクター別のクレジットスプレッドの拡縮等を予測し、ファンドのデュレーションおよびセクター配分を決定します（トップダウンアプローチ）。
主な投資制限	①株式への投資割合は、純資産総額の10%以下とします。 ②同一銘柄の株式への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ③同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ④新株引受権証券及び新株予約権証券への投資割合は、取得時において、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ⑤投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ⑥外貨建て資産への投資は行いません。 ⑦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。 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。

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



①　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。

②　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。

③　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。

④　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。

定期的に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。

⑤　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1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】

①収益分配方針

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

(1)分配対象額の範囲

経費控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。

(2)分配対象額についての分配方針

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

(3)留保益の運用方針

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

②収益の分配方式

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

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。

③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。

委託会社は受託会社から交付を受けた収益分配金を、原則として毎計算期間終了日の翌営業日に販売会社に交付します。

販売会社は、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。

（５）【投資制限】

①各マザーファンド受益証券への投資割合には、制限を設けません。（約款「運用の基本方針」2. 運用方法　(3) 投資制限）

②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）

③マザーファンド受益証券以外の投資信託証券（上場投資信託証券(金融商品取引所に上場等され、かつ当該取引所において常時売却可能(市場急変等により一時的に流動性が低下している場合を除きます。)な投資信託証券をいいます。以下同じ。)を除きます。）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）

④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）

⑤非株式割合（マザーファンドの信託財産に属する株式以外の資産のうち、この信託の信託財産に属するとみなした部分を含みます。）については制限を設けません。（約款「運用の基本方針」2. 運用方法　(3) 投資制限）

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。（約款「運用の基本方針」2. 運用方法　(3) 投資制限）

⑦投資する株式等の範囲（約款第20条）

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

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

2)上記1)の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、委託会社が投資することを指図することができるものとします。

⑧信用取引の指図および範囲（約款第21条）

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

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書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

⑨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。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）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。

⑩スワップ取引の運用指図（約款第23条）

1)委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利、または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。

2)スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

3)スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等を基に算出した価額で評価するものとします。

4)委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供または受入れが必要と認めたときは、担保の提供または受入れの指図を行うものとします。

⑪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たときは、担保の提供または受入れの指図を行うものとします。

⑫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。

⑬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たときは、担保の受け入れの指図を行うものとします。

⑭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。

⑮外国為替予約取引の指図（約款第27条）

1)委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

2)上記1)の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。

3)上記2)の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

⑯資金の借入れ（約款第33条）

1)委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、および運用の安定性を図るため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

2)一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は、借入れ指図を行う日の信託財産の純資産総額の10％以内における、当該有価証券等の売却代金または解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。

3)収益分配金の再投資にかかる借入期間は信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。

4)借入金の利息は信託財産中より支弁します。

⑰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

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

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

○株価変動リスク
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
一般的に金利が上昇すると債券の価格は下落します。当ファンドは、実質的に債券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。

○為替リスク
当ファンドは、実質組入外貨建資産について原則として対円で為替ヘッジを行わないため為替変動の影響を受けます。このため為替相場が当該実質組入資産の通貨に対して円高になった場合には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、またこうした状況に陥ると予想される場合等には、株式・債券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
当ファンドの実質的な投資対象国・地域における政治・経済情勢の変化等によっては、運用上の制約を受ける可能性があり、基準価額が下がる要因となります。

※基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

＜その他の留意点＞
○当ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用はありません。
○収益分配金に関する留意点として、以下の事項にご留意ください。
収益分配は、計算期間中に発生した運用収益（経費控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。））を超えて行われる場合があります。したがって、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。
受益者の個別元本の状況によっては、分配金の全額または一部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。個別元本とは、追加型投資信託を保有する受益者毎の取得元本のことで、受益者毎に異なります。

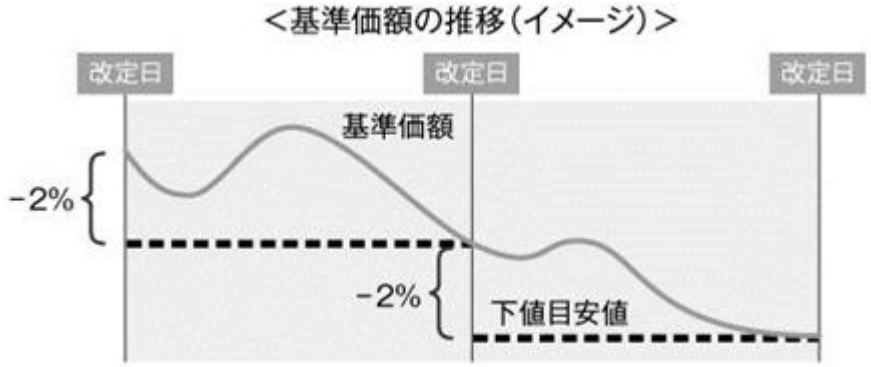
分配金は純資産総額から支払われます。このため、分配金支払い後の純資産総額は減少することとなり、基準価額が下落する要因となります。計算期間中の運用収益以上に分配金の支払いを行う場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。

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

○当ファンドは下値目安値を改定日の基準価額をもとに決定し、損失の抑制をめざして合計資産比率をコントロールします。ただし損失が常に一定範囲に限定されるわけではないことにご留意ください。

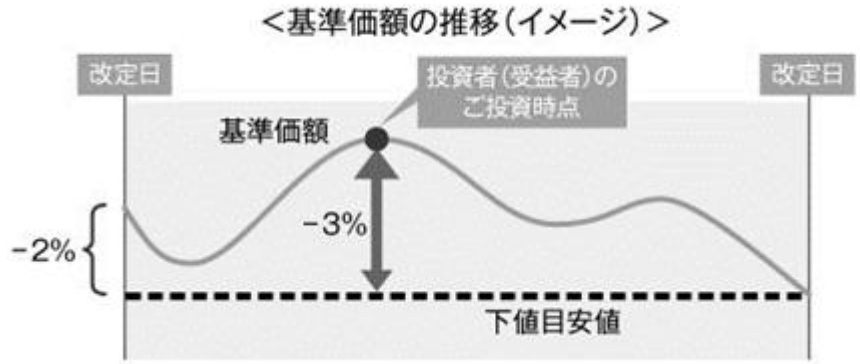
＜ケース①＞下値目安値の切下げについて

下値目安値は3ヵ月（四半期）毎の改定日にその時点の基準価額をもとに定められます。そのため、当ファンドの基準価額は長期的に2%以上下落する場合があります。



＜ケース②＞四半期途中の投資について

当ファンドの基準価額が直近の改定日の基準価額よりも上昇し、この時点でお客さまが当ファンドへ投資された場合、次回改定日までの基準価額の下落は2%以上となる場合があります。したがって、ご投資にあたっては、当該四半期の下値目安値にご留意いただきますようお願いいたします。



※下値目安値は、基準価額がこれを下回らないように目標とされる水準であり、基準価額が下値目安値を下回らないことを委託会社が保証するものではありません。

※上記はイメージ図であり、実際にはこれと異なる場合があります。また、将来の運用成果等を示唆・保証するものではありません。

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

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

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

○当ファンドは、信託契約を解約することが受益者のため有利であると認める場合、受益権口数が10億口を下回ることとなった場合、マザーファンドのベンチマークである対象インデックスが改廃された場合、その他やむを得ない事情が発生した場合は、当初定められていた信託期間の途中でも信託を終了（繰上償還）する場合があります。

○注意事項

イ．当ファンドは、実質的に債券および株式等など値動きのある有価証券（外貨建資産には為替リスクもあります。）に投資しますので、基準価額は変動します。

ロ．投資信託は、預金等や保険契約ではありません。また、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。加えて、証券会社を通して購入していない場合には投資者保護基金の対象にもなりません。

ハ．投資信託は、購入金額について元本保証および利回り保証のいずれもありません。

ニ．投資信託は、投資した資産の価値が減少して購入金額を下回る場合があり、これによる損失は購入者が負担することとなります。

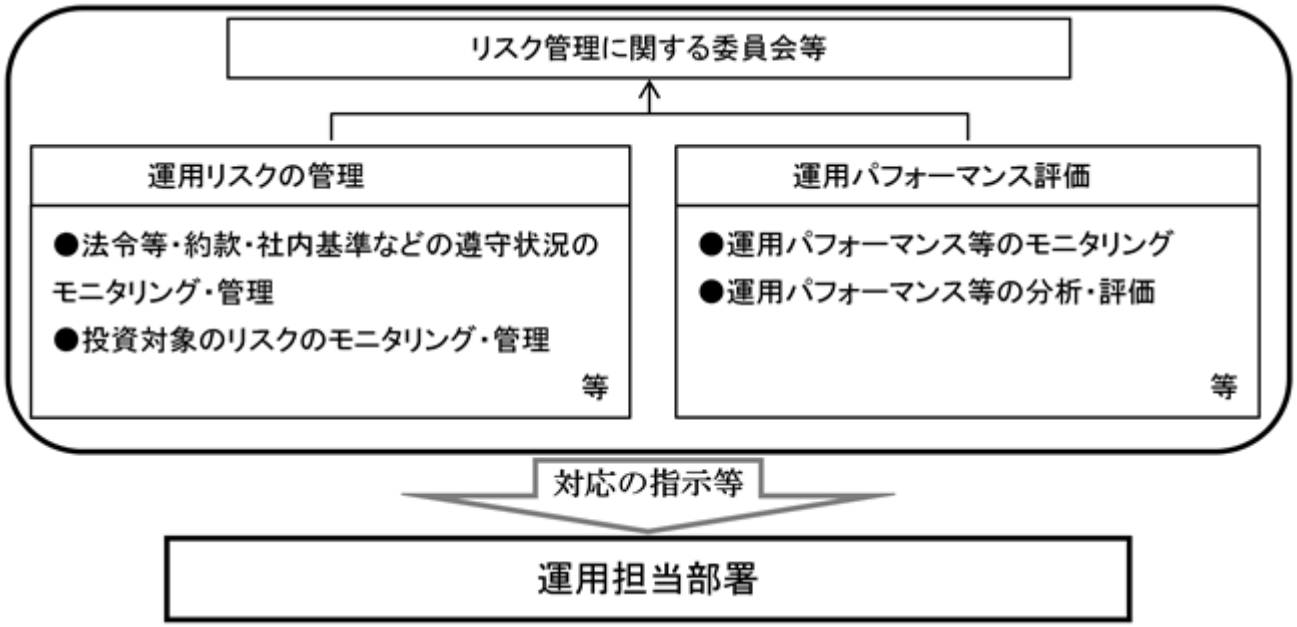
＜リスク管理体制＞

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。

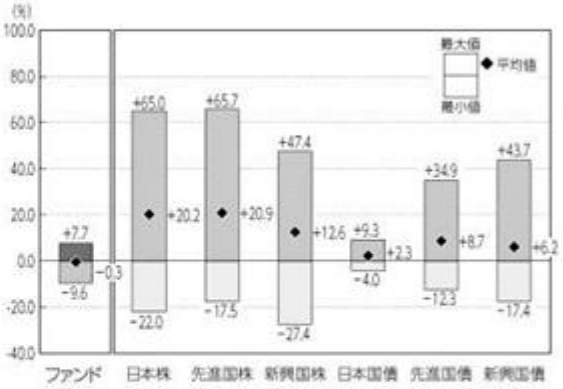


※上記体制は平成30年1月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

＜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：2015年9月～2018年1月
代表的な資産クラス：2013年2月～2018年1月

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

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

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

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

４【手数料等及び税金】

（１）【申込手数料】

ありません。

（２）【換金（解約）手数料】

ありません。

（３）【信託報酬等】

ファンドの日々の純資産総額に対して年率1.188%（税抜1.10%）

支払先	内訳（税抜）	主な役務
委託会社	年率0.525%	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0.525%	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0.050%	運用財産の保管・管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価

※信託報酬＝運用期間中の基準価額×信託報酬率

※信託報酬は、毎日計上され、毎計算期末または信託終了のときに信託報酬にかかる消費税等相当額とともに信託財産から支払われます。

※委託会社の信託報酬には、当ファンドの投資顧問会社（みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社）に対する投資顧問報酬が含まれます。

◆税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

（４）【その他の手数料等】

1.信託財産留保額

ありません。

2.その他の費用

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

①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。

②監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用は、受益者の負担とし、毎日計上され、毎計算期末または信託終了のとき、当該監査に要する費用にかかる消費税等相当額とともに信託財産から支払われます。

③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ならびに外貨建資産の保管等に要する費用は、受益者の負担とし、信託財産から支払われます。

④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ならびに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。

※上場投資信託は市場の需給により価格形成されるため、上場投資信託の費用は表示しておりません。

※税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

（５）【課税上の取扱い】

◇当ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

○個人の受益者に対する課税

①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。

②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。

③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ます。）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1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＞
①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。
②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ついて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。
③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、①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、②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1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		5,268,635	51.04
	内　日本	5,268,635	51.04
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		5,054,842	48.96
純資産総額		10,323,477	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1月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（％）
株式		304,694,083,950	99.08
	内　日本	304,694,083,950	99.08
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		2,814,339,897	0.92
純資産総額		307,508,423,847	100.00

その他資産の投資状況

平成30年1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）		2,777,645,000	0.90
	内　日本	2,777,645,000	0.90

（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1月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券		302,411,201,100	84.15
	内　日本	302,411,201,100	84.15
地方債証券		22,883,505,994	6.37
	内　日本	22,883,505,994	6.37
特殊債券		15,769,895,802	4.39
	内　日本	15,769,895,802	4.39
社債券		16,867,376,990	4.69
	内　日本	16,666,434,990	4.64
	内　オランダ	200,942,000	0.06
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		1,418,599,302	0.39
純資産総額		359,350,579,188	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。
（注2）資産の種類の内書は、当該資産の発行体又は上場金融商品取引所の国/地域別に表示しています。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年1月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
株式		293,606,231,986	94.67
	内　アメリカ	181,856,836,052	58.64
	内　イギリス	20,272,422,929	6.54
	内　ドイツ	12,169,404,198	3.92
	内　フランス	11,890,363,462	3.83
	内　カナダ	11,288,842,596	3.64
	内　スイス	10,763,060,299	3.47
	内　オーストラリア	7,491,572,826	2.42
	内　オランダ	6,064,285,299	1.96
	内　アイルランド	4,249,101,921	1.37
	内　スペイン	4,034,942,983	1.30
	内　スウェーデン	3,308,267,263	1.07
	内　香港	2,875,886,616	0.93
	内　イタリア	2,440,433,536	0.79
	内　シンガポール	2,271,187,458	0.73
	内　デンマーク	2,215,760,627	0.71
	内　ジャージィー	1,674,119,956	0.54
	内　ベルギー	1,363,500,721	0.44
	内　バミューダ	1,333,248,003	0.43
	内　フィンランド	1,163,778,809	0.38
	内　ケイマン諸島	921,104,502	0.30
	内　オランダ領キュラソー	814,131,905	0.26
	内　ノルウェー	778,044,836	0.25
	内　イスラエル	577,818,366	0.19
	内　ルクセンブルグ	448,445,352	0.14
	内　オーストリア	353,057,150	0.11
	内　ポルトガル	199,140,127	0.06
	内　ニュージーランド	195,315,232	0.06

	内　パナマ	194,594,809	0.06
	内　リベリア	178,242,737	0.06
	内　イギリス領バージン諸島	86,802,144	0.03
	内　パプアニューギニア	63,432,019	0.02
	内　マン島	46,980,579	0.02
	内　モーリシャス	22,106,674	0.01
投資信託受益証券		776,943,204	0.25
	内　オーストラリア	663,147,590	0.21
	内　シンガポール	113,795,614	0.04
投資証券		6,111,143,728	1.97
	内　アメリカ	5,259,470,150	1.70
	内　フランス	416,164,963	0.13
	内　イギリス	230,880,420	0.07
	内　香港	157,494,236	0.05
	内　カナダ	47,133,959	0.02
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		9,627,422,754	3.10
純資産総額		310,121,741,672	100.00

その他資産の投資状況

平成30年1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（売建）		554,524,930	△0.18
	―	554,524,930	△0.18
株価指数先物取引（買建）		9,411,152,706	3.03
	内　アメリカ	6,345,277,380	2.05
	内　ドイツ	1,781,297,258	0.57
	内　イギリス	673,564,860	0.22
	内　カナダ	349,399,008	0.11
	内　オーストラリア	261,614,200	0.08

（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1月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券		220,104,129,504	96.93
	内　アメリカ	92,711,898,905	40.83
	内　フランス	23,194,885,255	10.21
	内　イタリア	22,377,088,161	9.85
	内　ドイツ	16,386,431,050	7.22
	内　イギリス	15,882,356,659	6.99
	内　スペイン	13,369,668,883	5.89
	内　ベルギー	5,738,288,649	2.53
	内　オランダ	4,977,353,538	2.19
	内　オーストラリア	4,928,165,208	2.17
	内　カナダ	4,803,713,988	2.12
	内　オーストリア	3,504,298,020	1.54
	内　アイルランド	1,728,878,906	0.76
	内　メキシコ	1,706,417,826	0.75
	内　ポーランド	1,483,360,955	0.65
	内　フィンランド	1,310,228,093	0.58
	内　南アフリカ	1,299,531,354	0.57
	内　デンマーク	1,295,015,492	0.57
	内　スウェーデン	1,031,947,872	0.45
	内　マレーシア	933,793,497	0.41
	内　シンガポール	799,511,955	0.35
	内　ノルウェー	641,295,238	0.28
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		6,980,754,966	3.07
純資産総額		227,084,884,470	100.00

その他資産の投資状況

平成30年1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）		486,708,310	0.21
	―	486,708,310	0.21
為替予約取引（売建）		182,551,470	△0.08
	―	182,551,470	△0.08

（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1月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
株式		57,458,513,819	92.53
	内　ケイマン諸島	9,512,084,921	15.32
	内　韓国	8,515,156,129	13.71
	内　台湾	6,383,933,999	10.28
	内　中国	5,875,701,280	9.46
	内　インド	4,910,818,119	7.91
	内　ブラジル	4,221,669,001	6.80
	内　南アフリカ	3,761,824,231	6.06
	内　ロシア	2,046,311,120	3.30
	内　香港	1,916,598,760	3.09
	内　マレーシア	1,361,805,102	2.19
	内　メキシコ	1,336,973,041	2.15
	内　タイ	1,322,576,069	2.13
	内　インドネシア	1,235,621,210	1.99
	内　ポーランド	764,511,485	1.23
	内　チリ	714,603,987	1.15
	内　フィリピン	608,017,276	0.98
	内　トルコ	583,601,599	0.94
	内　バミューダ	533,257,289	0.86
	内　アラブ首長国連邦	360,711,183	0.58
	内　カタール	321,656,565	0.52
	内　コロンビア	241,010,728	0.39
	内　アメリカ	214,726,154	0.35
	内　ギリシャ	194,612,400	0.31
	内　ハンガリー	189,219,045	0.30
	内　チェコ	101,365,729	0.16
	内　エジプト	59,767,603	0.10
	内　マン島	53,359,891	0.09
	内　パキスタン	43,003,488	0.07
	内　ペルー	34,931,381	0.06
	内　オランダ	16,539,118	0.03
	内　マルタ	13,130,417	0.02
	内　ルクセンブルグ	9,415,499	0.02
投資信託受益証券		299,857,730	0.48
	内　メキシコ	299,857,730	0.48
投資証券		109,526,711	0.18
	内　南アフリカ	56,744,415	0.09
	内　メキシコ	40,460,452	0.07
	内　トルコ	12,321,844	0.02
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		4,228,824,824	6.81
純資産総額		62,096,723,084	100.00

その他資産の投資状況

平成30年1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）		28,497,740	0.05
	―	28,497,740	0.05
為替予約取引（売建）		491,903,160	△0.79
	―	491,903,160	△0.79
株価指数先物取引（買建）		4,226,860,842	6.81
	内　アメリカ	4,226,860,842	6.81

（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1月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券		99,829,338,964	96.28
	内　トルコ	14,759,127,955	14.24
	内　メキシコ	13,211,808,445	12.74
	内　ロシア	11,347,957,690	10.95
	内　インドネシア	10,467,408,474	10.10
	内　ブラジル	9,593,283,334	9.25
	内　コロンビア	9,525,048,177	9.19
	内　フィリピン	7,620,721,977	7.35
	内　パナマ	4,637,282,540	4.47
	内　ハンガリー	4,597,324,406	4.43
	内　南アフリカ	4,532,548,553	4.37
	内　ペルー	4,416,875,087	4.26
	内　クロアチア	2,854,447,357	2.75
	内　ルーマニア	2,265,504,969	2.19
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		3,852,264,683	3.72
純資産総額		103,681,603,647	100.00

その他資産の投資状況

平成30年1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（売建）		21,754,000	△0.02
	―	21,754,000	△0.02

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。
（注2）資産の種類の内書は、当該資産の発行体又は上場金融商品取引所の国/地域別に表示しています。
（注3）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】

①【投資有価証券の主要銘柄】

平成30年1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	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	867,662	1.8427 1,598,872	1.8258 1,584,177	－ －	15.35%
2	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	828,973	1.2824 1,063,100	1.2830 1,063,572	－ －	10.30%
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	371,519	2.8521 1,059,611	2.7744 1,030,742	－ －	9.98%
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	407,479	1.3108 534,132	1.3265 540,520	－ －	5.24%
5	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	150,053	3.5530 533,139	3.5522 533,018	－ －	5.16%
6	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	279,882	1.9001 531,808	1.8458 516,606	－ －	5.00%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成30年1月31日現在

種類	投資比率
親投資信託受益証券	51.04%
合計	51.04%

（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1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	1,410,400	6,359.91 8,970,026,897	7,480.00 10,549,792,000	－ －	3.43%
2	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	8,084,700	751.20 6,073,226,640	820.80 6,635,921,760	－ －	2.16%
3	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	515,400	8,697.30 4,482,589,460	8,980.00 4,628,292,000	－ －	1.51%
4	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	817,000	4,874.00 3,982,058,000	5,191.00 4,241,047,000	－ －	1.38%
5	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	866,100	4,479.00 3,879,261,900	4,878.00 4,224,835,800	－ －	1.37%
6	ソニー 日本	株式 電気機器	774,800	3,599.00 2,788,505,200	5,209.00 4,035,933,200	－ －	1.31%
7	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	1,044,000	3,541.01 3,696,824,180	3,826.00 3,994,344,000	－ －	1.30%
8	キーエンス 日本	株式 電気機器	56,900	45,657.42 2,597,907,644	66,430.00 3,779,867,000	－ －	1.23%
9	任天堂 日本	株式 その他製品	71,400	23,603.85 1,685,315,130	47,970.00 3,425,058,000	－ －	1.11%
10	ファナック 日本	株式 電気機器	110,300	21,565.00 2,378,619,500	29,475.00 3,251,092,500	－ －	1.06%
11	みずほフィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	15,547,500	208.49 3,241,505,921	205.30 3,191,901,750	－ －	1.04%
12	ＫＤＤＩ 日本	株式 情報・通信業	1,025,100	2,947.00 3,020,969,700	2,753.00 2,822,100,300	－ －	0.92%
13	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	427,400	5,021.00 2,145,975,400	6,415.00 2,741,771,000	－ －	0.89%
14	キヤノン 日本	株式 電気機器	624,600	3,270.93 2,043,026,837	4,349.00 2,716,385,400	－ －	0.88%
15	日本たばこ産業 日本	株式 食料品	720,400	3,634.65 2,618,408,235	3,612.00 2,602,084,800	－ －	0.85%
16	信越化学工業 日本	株式 化学	202,300	9,505.00 1,922,861,500	12,410.00 2,510,543,000	－ －	0.82%
17	三菱商事 日本	株式 卸売業	801,900	2,541.00 2,037,627,900	3,050.00 2,445,795,000	－ －	0.80%
18	日本電産 日本	株式 電気機器	139,600	10,405.00 1,452,538,000	17,450.00 2,436,020,000	－ －	0.79%
19	日立製作所 日本	株式 電気機器	2,786,000	676.62 1,885,074,100	866.40 2,413,790,400	－ －	0.78%
20	小松製作所 日本	株式 機械	560,200	2,790.18 1,563,064,104	4,235.00 2,372,447,000	－ －	0.77%
21	三菱電機 日本	株式 電気機器	1,160,200	1,608.50 1,866,181,700	1,992.50 2,311,698,500	－ －	0.75%

22	ＮＴＴドコモ 日本	株式 情報・通信業	842,800	2,691.22 2,268,162,802	2,704.50 2,279,352,600	－ －	0.74%
23	リクルートホールディングス 日本	株式 サービス業	855,300	1,796.98 1,536,960,705	2,659.00 2,274,242,700	－ －	0.74%
24	東日本旅客鉄道 日本	株式 陸運業	208,400	9,995.00 2,082,958,000	10,845.00 2,260,098,000	－ －	0.73%
25	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	431,100	4,705.00 2,028,325,500	5,140.00 2,215,854,000	－ －	0.72%
26	ブリヂストン 日本	株式 ゴム製品	410,000	4,081.44 1,673,394,256	5,306.00 2,175,460,000	－ －	0.71%
27	花王 日本	株式 化学	285,300	5,888.49 1,679,988,637	7,563.00 2,157,723,900	－ －	0.70%
28	セブン＆アイ・ホールディングス 日本	株式 小売業	479,000	4,430.29 2,122,109,937	4,486.00 2,148,794,000	－ －	0.70%
29	パナソニック 日本	株式 電気機器	1,325,400	1,182.93 1,567,868,125	1,619.00 2,145,822,600	－ －	0.70%
30	東海旅客鉄道 日本	株式 陸運業	103,900	18,230.38 1,894,136,884	20,650.00 2,145,535,000	－ －	0.70%

（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1月31日現在

種類	投資比率
株式	99.08%
合計	99.08%

（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1月31日現在

業種	国内/外国	投資比率
電気機器	国内	13.95%
輸送用機器		8.83%
銀行業		7.32%
情報・通信業		7.10%
化学		7.09%
機械		5.77%
卸売業		4.62%
小売業		4.54%
医薬品		4.37%
食料品		4.30%
サービス業		4.15%
陸運業		3.96%
建設業		3.13%
不動産業		2.40%
保険業		2.22%
その他製品		2.14%
精密機器		1.55%
電気・ガス業		1.47%
その他金融業		1.22%
鉄鋼		1.14%
証券、商品先物取引業		1.03%
ガラス・土石製品		1.02%
非鉄金属		0.99%
ゴム製品		0.97%
金属製品		0.70%
石油・石炭製品		0.69%
繊維製品		0.69%
空運業		0.58%
鉱業		0.34%
パルプ・紙		0.27%
海運業		0.24%
倉庫・運輸関連業		0.19%
水産・農林業		0.10%
合計		99.08%

（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1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	１２４回　利付国庫債券（５年） 日本	国債証券	4,000,000,000	100.77 4,031,175,000	100.47 4,019,040,000	0.100000 2020/6/20	1.12%
2	１２２回　利付国庫債券（５年） 日本	国債証券	4,000,000,000	100.72 4,029,104,000	100.40 4,016,160,000	0.100000 2019/12/20	1.12%
3	１１７回　利付国庫債券（５年） 日本	国債証券	4,000,000,000	100.84 4,033,960,000	100.37 4,014,880,000	0.200000 2019/3/20	1.12%
4	１１８回　利付国庫債券（５年） 日本	国債証券	3,700,000,000	100.91 3,733,892,000	100.44 3,716,576,000	0.200000 2019/6/20	1.03%
5	３４１回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	3,500,000,000	102.02 3,570,700,000	102.28 3,579,905,000	0.300000 2025/12/20	1.00%
6	１３３回　利付国庫債券（５年） 日本	国債証券	3,500,000,000	100.99 3,534,905,000	100.88 3,530,905,000	0.100000 2022/9/20	0.98%
7	１３１回　利付国庫債券（５年） 日本	国債証券	3,500,000,000	101.15 3,540,285,000	100.76 3,526,810,000	0.100000 2022/3/20	0.98%
8	１２９回　利付国庫債券（５年） 日本	国債証券	3,500,000,000	100.92 3,532,270,000	100.67 3,523,555,000	0.100000 2021/9/20	0.98%
9	３４４回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	3,500,000,000	100.14 3,504,970,000	100.51 3,518,060,000	0.100000 2026/9/20	0.98%
10	３４５回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	3,500,000,000	100.31 3,510,975,000	100.44 3,515,470,000	0.100000 2026/12/20	0.98%
11	３４８回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	3,500,000,000	100.56 3,519,730,000	100.33 3,511,690,000	0.100000 2027/9/20	0.98%
12	３４７回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	3,500,000,000	100.60 3,521,160,000	100.32 3,511,410,000	0.100000 2027/6/20	0.98%
13	３１３回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	3,000,000,000	105.76 3,173,010,000	104.39 3,131,700,000	1.300000 2021/3/20	0.87%
14	１３０回　利付国庫債券（５年） 日本	国債証券	3,000,000,000	101.06 3,031,845,000	100.72 3,021,600,000	0.100000 2021/12/20	0.84%
15	３４２回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	3,000,000,000	100.22 3,006,675,000	100.64 3,019,470,000	0.100000 2026/3/20	0.84%

16	１２８回　利付国庫債券（５年） 日本	国債証券	3,000,000,000	100.91 3,027,450,000	100.64 3,019,290,000	0.100000 2021/6/20	0.84%
17	１２７回　利付国庫債券（５年） 日本	国債証券	3,000,000,000	100.88 3,026,490,000	100.61 3,018,330,000	0.100000 2021/3/20	0.84%
18	３４３回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	3,000,000,000	100.18 3,005,525,000	100.58 3,017,520,000	0.100000 2026/6/20	0.84%
19	１２５回　利付国庫債券（５年） 日本	国債証券	3,000,000,000	100.81 3,024,330,000	100.51 3,015,420,000	0.100000 2020/9/20	0.84%
20	１２３回　利付国庫債券（５年） 日本	国債証券	3,000,000,000	100.74 3,022,490,000	100.44 3,013,410,000	0.100000 2020/3/20	0.84%
21	３４６回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	3,000,000,000	100.68 3,020,570,000	100.40 3,012,240,000	0.100000 2027/3/20	0.84%
22	３２１回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	2,500,000,000	105.49 2,637,250,000	104.53 2,613,375,000	1.000000 2022/3/20	0.73%
23	３４０回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	2,500,000,000	102.90 2,572,560,000	102.97 2,574,325,000	0.400000 2025/9/20	0.72%
24	３０５回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	2,500,000,000	104.15 2,603,800,000	102.66 2,566,625,000	1.300000 2019/12/20	0.71%
25	１２６回　利付国庫債券（５年） 日本	国債証券	2,500,000,000	100.84 2,521,160,000	100.56 2,514,075,000	0.100000 2020/12/20	0.70%
26	３１０回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	2,300,000,000	104.04 2,392,920,000	102.90 2,366,700,000	1.000000 2020/9/20	0.66%
27	３０１回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	2,300,000,000	103.95 2,391,057,000	102.24 2,351,589,000	1.500000 2019/6/20	0.65%
28	１４３回　利付国庫債券（２０年） 日本	国債証券	1,970,000,000	117.73 2,319,398,000	118.63 2,337,168,600	1.600000 2033/3/20	0.65%
29	３１２回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	2,200,000,000	105.07 2,311,606,000	103.75 2,282,588,000	1.200000 2020/12/20	0.64%
30	１４１回　利付国庫債券（２０年） 日本	国債証券	1,900,000,000	119.10 2,262,900,000	120.02 2,280,494,000	1.700000 2032/12/20	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1月31日現在

種類	投資比率
国債証券	84.15%
地方債証券	6.37%
特殊債券	4.39%
社債券	4.69%
合計	99.61%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資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1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	368,126	14,761.20 5,433,982,491	18,164.66 6,686,885,946	－ －	2.16%
2	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフトウェア	521,379	7,056.50 3,679,113,732	10,089.18 5,260,288,977	－ －	1.70%
3	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 インターネット販売・通信販売	29,076	91,619.28 2,663,922,300	156,420.43 4,548,080,649	－ －	1.47%
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	168,961	14,733.35 2,489,361,619	20,356.78 3,439,502,716	－ －	1.11%
5	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	250,678	9,751.47 2,444,481,238	12,522.81 3,139,194,694	－ －	1.01%
6	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	191,449	12,709.75 2,433,270,462	15,494.95 2,966,494,539	－ －	0.96%
7	ALPHABET INC-CL C アメリカ	株式 インターネットソフトウェア・サービス	22,444	89,703.70 2,013,310,045	126,597.83 2,841,361,810	－ －	0.92%
8	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 石油・ガス・消耗燃料	300,424	8,979.11 2,697,541,328	9,440.79 2,836,241,757	－ －	0.91%
9	ALPHABET INC-CL A アメリカ	株式 インターネットソフトウェア・サービス	21,134	91,868.40 1,941,546,964	128,086.08 2,706,971,263	－ －	0.87%
10	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 銀行	719,642	2,618.30 1,884,243,976	3,468.22 2,495,880,519	－ －	0.80%
11	WELLS FARGO & CO アメリカ	株式 銀行	334,953	6,287.63 2,106,062,679	7,101.81 2,378,772,966	－ －	0.77%
12	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 各種金融サービス	90,365	18,217.79 1,646,250,721	23,325.66 2,107,823,618	－ －	0.68%
13	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	221,279	8,537.21 1,889,106,695	9,367.15 2,072,754,292	－ －	0.67%
14	CHEVRON CORP アメリカ	株式 石油・ガス・消耗燃料	134,596	12,224.18 1,645,327,013	13,623.77 1,833,705,175	－ －	0.59%
15	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 専門小売り	83,442	15,410.81 1,285,909,484	21,954.90 1,831,961,591	－ －	0.59%

16	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	69,757	17,894.17 1,248,244,222	25,745.15 1,795,904,672	－ －	0.58%
17	AT&T INC アメリカ	株式 各種電気通信サービス	435,922	4,421.50 1,927,432,313	4,073.09 1,775,552,851	－ －	0.57%
18	INTEL CORP アメリカ	株式 半導体・半導体製造装置	334,110	3,910.46 1,306,525,648	5,307.86 1,773,410,474	－ －	0.57%
19	VISA INC アメリカ	株式 情報技術サービス	130,002	9,484.88 1,233,054,563	13,441.00 1,747,357,467	－ －	0.56%
20	PFIZER INC アメリカ	株式 医薬品	423,943	3,566.63 1,512,050,852	4,112.26 1,743,364,689	－ －	0.56%
21	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品	181,559	9,571.67 1,737,823,431	9,459.29 1,717,419,323	－ －	0.55%
22	VERIZON COMM INC アメリカ	株式 各種電気通信サービス	290,013	5,251.70 1,523,061,527	5,863.78 1,700,572,719	－ －	0.55%
23	HSBC HOLDINGS PLC イギリス	株式 銀行	1,445,842	1,077.95 1,558,549,219	1,171.09 1,693,219,522	－ －	0.55%
24	CITIGROUP INC アメリカ	株式 銀行	193,450	6,533.73 1,263,950,901	8,553.06 1,654,591,352	－ －	0.53%
25	CISCO SYSTEMS INC アメリカ	株式 通信機器	354,512	3,512.31 1,245,157,061	4,596.37 1,629,470,980	－ －	0.53%
26	NOVARTIS AG-REG SHS スイス	株式 医薬品	160,610	8,766.34 1,407,962,956	10,016.77 1,608,794,521	－ －	0.52%
27	COMCAST CORP-CL A アメリカ	株式 メディア	333,255	4,148.30 1,382,442,135	4,606.16 1,535,028,716	－ －	0.49%
28	COCA-COLA CO/THE アメリカ	株式 飲料	289,171	4,420.71 1,278,343,228	5,157.73 1,491,467,069	－ －	0.48%
29	BOEING CO アメリカ	株式 航空宇宙・防衛	39,919	18,557.62 740,801,644	36,739.47 1,466,602,938	－ －	0.47%
30	ABBVIE INC アメリカ	株式 バイオテクノロジー	113,442	6,653.10 754,741,336	12,606.58 1,430,116,238	－ －	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1月31日現在

種類	投資比率
株式	94.67%
投資信託受益証券	0.25%
投資証券	1.97%
合計	96.90%

（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

平成30年1月31日現在

業種	国内/外国	投資比率
銀行	外国	9.62%
石油・ガス・消耗燃料		5.94%
医薬品		5.14%
ソフトウェア		3.97%
保険		3.97%
インターネットソフトウェア・サービス		3.27%
資本市場		3.04%
情報技術サービス		3.00%
半導体・半導体製造装置		2.85%
化学		2.62%
コンピュータ・周辺機器		2.50%
航空宇宙・防衛		2.25%
メディア		2.24%
バイオテクノロジー		2.19%
インターネット販売・通信販売		2.10%
ヘルスケア機器・用品		2.09%
各種電気通信サービス		2.04%
飲料		1.95%
ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス		1.95%
食品		1.81%
ホテル・レストラン・レジャー		1.79%
機械		1.69%
食品・生活必需品小売り		1.69%
電力		1.62%
金属・鉱業		1.61%
コングロマリット		1.59%
専門小売り		1.58%
タバコ		1.25%
繊維・アパレル・贅沢品		1.22%
家庭用品		1.20%
自動車		1.05%
各種金融サービス		1.01%
総合公益事業		0.93%
陸運・鉄道		0.91%
通信機器		0.83%
電気設備		0.75%
パーソナル用品		0.69%
専門サービス		0.61%

航空貨物・物流サービス		0.60%
ライフサイエンス・ツール／サービス		0.58%
不動産管理・開発		0.55%
エネルギー設備・サービス		0.54%
自動車部品		0.52%
消費者金融		0.50%
電子装置・機器・部品		0.48%
家庭用耐久財		0.45%
複合小売り		0.42%
建設関連製品		0.41%
商業サービス・用品		0.37%
無線通信サービス		0.35%
建設資材		0.34%
建設・土木		0.34%
商社・流通業		0.33%
容器・包装		0.28%
運送インフラ		0.27%
旅客航空輸送業		0.14%
ガス		0.13%
紙製品・林産品		0.11%
販売		0.08%
海運業		0.07%
ヘルスケア・テクノロジー		0.07%
水道		0.06%
レジャー用品		0.06%
独立系発電事業者・エネルギー販売業者		0.04%
各種消費者サービス		0.01%
貯蓄・抵当・不動産金融		0.01%
合計		94.67%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年1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 3.625 02/15/20 アメリカ	国債証券	1,849,430,000	106.25 1,965,019,375	102.97 1,904,469,036	3.625000 2020/2/15	0.84%
2	US T N/B 2.0 02/15/22 アメリカ	国債証券	1,903,825,000	100.44 1,912,313,339	98.43 1,873,992,062	2.000000 2022/2/15	0.83%
3	US T N/B 2.625 08/15/20 アメリカ	国債証券	1,795,035,000	103.32 1,854,773,764	100.98 1,812,626,343	2.625000 2020/8/15	0.80%
4	US T N/B 2.125 12/31/21 アメリカ	国債証券	1,708,003,000	100.98 1,724,809,749	98.96 1,690,376,409	2.125000 2021/12/31	0.74%
5	US T N/B 1.625 03/31/19 アメリカ	国債証券	1,631,850,000	100.75 1,644,088,875	99.59 1,625,273,644	1.625000 2019/3/31	0.72%
6	US T N/B 1.25 10/31/19 アメリカ	国債証券	1,631,850,000	99.44 1,622,753,667	98.57 1,608,579,819	1.250000 2019/10/31	0.71%
7	US T N/B 0.875 07/31/19 アメリカ	国債証券	1,631,850,000	98.85 1,613,159,521	98.28 1,603,863,772	0.875000 2019/7/31	0.71%
8	US T N/B 1.0 09/30/19 アメリカ	国債証券	1,631,850,000	98.93 1,614,459,385	98.26 1,603,537,402	1.000000 2019/9/30	0.71%
9	US T N/B 3.5 05/15/20 アメリカ	国債証券	1,523,060,000	106.09 1,615,920,968	102.94 1,567,975,039	3.500000 2020/5/15	0.69%
10	US T N/B 1.0 08/31/19 アメリカ	国債証券	1,468,665,000	99.08 1,455,285,461	98.36 1,444,681,700	1.000000 2019/8/31	0.64%
11	US T N/B 3.125 05/15/19 アメリカ	国債証券	1,414,270,000	104.00 1,470,840,800	101.42 1,434,479,918	3.125000 2019/5/15	0.63%
12	US T N/B 1.375 02/28/19 アメリカ	国債証券	1,414,270,000	100.29 1,418,399,668	99.39 1,405,642,953	1.375000 2019/2/28	0.62%
13	US T N/B 2.75 02/15/19 アメリカ	国債証券	1,305,480,000	103.01 1,344,788,002	100.82 1,316,237,155	2.750000 2019/2/15	0.58%
14	US T N/B 1.75 09/30/22 アメリカ	国債証券	1,359,875,000	98.40 1,338,123,891	96.76 1,315,883,043	1.750000 2022/9/30	0.58%
15	US T N/B 2.0 05/31/21 アメリカ	国債証券	1,305,480,000	100.78 1,315,675,798	98.96 1,291,903,008	2.000000 2021/5/31	0.57%
16	US T N/B 1.375 04/30/20 アメリカ	国債証券	1,305,480,000	99.45 1,298,339,024	98.25 1,282,634,100	1.375000 2020/4/30	0.56%
17	US T N/B 1.875 08/31/22 アメリカ	国債証券	1,305,480,000	98.99 1,292,422,610	97.40 1,271,615,848	1.875000 2022/8/31	0.56%
18	FRANCE OAT 2.5 10/25/20 フランス	国債証券	1,175,196,000	110.01 1,292,950,639	107.69 1,265,674,340	2.500000 2020/10/25	0.56%
19	US T N/B 2.25 02/15/27 アメリカ	国債証券	1,305,480,000	100.06 1,306,361,199	96.25 1,256,524,500	2.250000 2027/2/15	0.55%
20	US T N/B 2.25 03/31/21 アメリカ	国債証券	1,251,085,000	101.85 1,274,342,670	99.82 1,248,833,047	2.250000 2021/3/31	0.55%
21	US T N/B 1.75 03/31/22 アメリカ	国債証券	1,272,843,000	99.15 1,262,068,873	97.32 1,238,832,635	1.750000 2022/3/31	0.55%
22	US T N/B 1.75 05/15/22 アメリカ	国債証券	1,261,964,000	98.98 1,249,168,555	97.21 1,226,856,161	1.750000 2022/5/15	0.54%
23	FRANCE OAT 3.5 04/25/20 フランス	国債証券	1,121,164,000	112.01 1,255,927,912	108.72 1,218,985,559	3.500000 2020/4/25	0.54%

24	US T N/B 1.875 06/30/20 アメリカ	国債証券	1,196,690,000	100.93 1,207,902,985	99.24 1,187,666,957	1.875000 2020/6/30	0.52%
25	US T N/B 2.125 08/15/21 アメリカ	国債証券	1,196,690,000	101.09 1,209,769,821	99.20 1,187,200,248	2.125000 2021/8/15	0.52%
26	US T N/B 1.125 05/31/19 アメリカ	国債証券	1,196,690,000	99.60 1,191,963,074	98.85 1,182,987,899	1.125000 2019/5/31	0.52%
27	US T N/B 1.25 01/31/20 アメリカ	国債証券	1,174,932,000	99.35 1,167,306,691	98.30 1,155,005,153	1.250000 2020/1/31	0.51%
28	US T N/B 2.0 11/30/20 アメリカ	国債証券	1,142,295,000	101.07 1,154,608,940	99.28 1,134,081,898	2.000000 2020/11/30	0.50%
29	US T N/B 2.0 11/15/26 アメリカ	国債証券	1,196,690,000	97.22 1,163,501,217	94.39 1,129,651,426	2.000000 2026/11/15	0.50%
30	US T N/B 2.25 11/15/24 アメリカ	国債証券	1,153,174,000	99.51 1,147,618,965	97.50 1,124,425,372	2.250000 2024/11/15	0.50%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成30年1月31日現在

種類	投資比率
国債証券	96.93%
合計	96.93%

（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1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	516,900	3,408.92 1,762,075,102	6,423.63 3,320,378,482	－ －	5.35%
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	104,580	13,091.57 1,369,116,551	21,721.01 2,271,583,372	－ －	3.66%
3	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD 韓国	株式 コンピュータ・周辺機器	8,837	217,827.55 1,924,942,131	252,984.00 2,235,619,608	－ －	3.60%
4	TAIWAN SEMICONDUCTOR 台湾	株式 半導体・半導体製造装置	2,239,083	714.70 1,600,276,208	941.15 2,107,335,356	－ －	3.39%
5	NASPERS LTD 南アフリカ	株式 メディア	39,745	23,067.73 916,827,119	31,192.06 1,239,728,822	－ －	2.00%
6	CHINA CONSTRUCTION BANK 中国	株式 銀行	7,625,530	87.96 670,812,021	123.24 939,790,143	－ －	1.51%
7	IND & COMM BK OF CHINA - H 中国	株式 銀行	6,680,235	71.62 478,495,736	101.12 675,543,440	－ －	1.09%
8	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	24,900	19,785.50 492,658,967	26,552.37 661,154,144	－ －	1.06%
9	CHINA MOBILE LIMITED 香港	株式 無線通信サービス	557,000	1,168.80 651,023,020	1,142.70 636,487,520	－ －	1.02%
10	PING AN INSURANCE GROUP CO-H 中国	株式 保険	471,000	622.95 293,414,125	1,254.68 590,955,222	－ －	0.95%
11	SBERBANK ADR ロシア	株式 銀行	250,760	1,216.78 305,121,146	2,128.47 533,736,729	－ －	0.86%
12	ITAU UNIBANCO HOLDING SA ブラジル	株式 銀行	293,598	1,340.87 393,676,923	1,760.95 517,013,746	－ －	0.83%
13	HON HAI PRECISION INDUSTRY 台湾	株式 電子装置・機器・部品	1,414,532	367.11 519,295,645	348.19 492,528,726	－ －	0.79%
14	BANK OF CHINA LTD 中国	株式 銀行	7,173,200	52.17 374,235,450	64.40 461,977,751	－ －	0.74%
15	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP インド	株式 貯蓄・抵当・不動産金融	136,505	2,608.44 356,065,696	3,332.49 454,902,912	－ －	0.73%
16	VALE SA ブラジル	株式 金属・鉱業	286,321	987.32 282,691,209	1,418.27 406,081,629	－ －	0.65%

17	SK HYNIX INC 韓国	株式 半導体・半導体製造装置	52,740	5,417.66 285,727,671	7,426.95 391,697,870	— —	0.63%
18	RELIANCE INDUSTRIES LTD インド	株式 石油・ガス・消耗燃料	235,083	1,222.29 287,341,557	1,634.68 384,287,359	— —	0.62%
19	BANCO BRADESCO SA PREF ブラジル	株式 銀行	277,596	1,021.66 283,609,759	1,381.67 383,548,841	— —	0.62%
20	SAMSUNG ELECTRONICS-PFD 韓国	株式 コンピュータ・周辺機器	1,583	168,305.63 266,427,818	208,280.00 329,707,240	— —	0.53%
21	INFOSYS LTD インド	株式 情報技術サービス	160,000	1,594.92 255,188,647	2,013.51 322,162,880	— —	0.52%
22	AMBEV SA ブラジル	株式 飲料	425,095	630.50 268,023,906	747.95 317,951,505	— —	0.51%
23	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	59,000	3,685.00 217,415,505	5,358.99 316,180,728	— —	0.51%
24	AMERICA MOVIL SAB DE CV メキシコ	株式 無線通信サービス	3,043,478	80.58 245,267,011	101.32 308,383,451	— —	0.50%
25	LUKOIL SPON ADR ロシア	株式 石油・ガス・消耗燃料	40,294	5,596.59 225,509,301	7,182.31 289,404,232	— —	0.47%
26	GAZPROM PAO ADR ロシア	株式 石油・ガス・消耗燃料	504,750	470.80 237,637,103	550.47 277,853,467	— —	0.45%
27	CNOOC LTD 香港	株式 石油・ガス・消耗燃料	1,594,000	131.07 208,931,000	171.37 273,165,692	— —	0.44%
28	POSCO 韓国	株式 金属・鉱業	6,635	27,480.76 182,334,903	38,557.20 255,827,022	— —	0.41%
29	NETEASE INC-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	7,200	29,204.57 210,272,905	35,117.41 252,845,366	— —	0.41%
30	KB FINANCIAL GROUP INC 韓国	株式 銀行	35,627	5,216.48 185,847,561	6,797.03 242,158,144	— —	0.39%

（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1月31日現在

種類	投資比率
株式	92.53%
投資信託受益証券	0.48%
投資証券	0.18%
合計	93.19%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

平成30年1月31日現在

業種	国内/外国	投資比率
銀行	外国	15.79%
インターネットソフトウェア・サービス		11.48%
石油・ガス・消耗燃料		6.51%
半導体・半導体製造装置		5.05%
コンピュータ・周辺機器		5.02%
保険		3.39%
金属・鉱業		3.13%
無線通信サービス		3.01%
メディア		2.36%
不動産管理・開発		2.31%
電子装置・機器・部品		2.27%
化学		2.20%
自動車		2.17%
情報技術サービス		1.57%
コングロマリット		1.55%
食品・生活必需品小売り		1.52%
食品		1.50%
医薬品		1.33%
各種電気通信サービス		1.28%
各種金融サービス		1.15%
資本市場		1.15%
電力		0.94%
インターネット販売・通信販売		0.91%
飲料		0.90%
貯蓄・抵当・不動産金融		0.90%
運送インフラ		0.89%
建設資材		0.83%
パーソナル用品		0.70%
機械		0.69%
ホテル・レストラン・レジャー		0.64%
建設・土木		0.63%
自動車部品		0.62%
バイオテクノロジー		0.57%
複合小売り		0.56%
タバコ		0.55%
繊維・アパレル・贅沢品		0.51%
ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス		0.47%
ガス		0.46%

各種消費者サービス		0.46%
独立系発電事業者・エネルギー販売業者		0.44%
専門小売り		0.41%
家庭用耐久財		0.41%
紙製品・林産品		0.39%
家庭用品		0.38%
旅客航空輸送業		0.28%
ソフトウェア		0.24%
水道		0.22%
エクイティ不動産投資信託（ＲＥＩＴｓ）		0.21%
陸運・鉄道		0.20%
航空宇宙・防衛		0.20%
消費者金融		0.19%
電気設備		0.16%
ライフサイエンス・ツール／サービス		0.11%
商業サービス・用品		0.10%
海運業		0.08%
通信機器		0.07%
エネルギー設備・サービス		0.06%
総合公益事業		0.06%
容器・包装		0.05%
販売		0.05%
ヘルスケア機器・用品		0.05%
商社・流通業		0.04%
航空貨物・物流サービス		0.04%
レジャー用品		0.03%
建設関連製品		0.03%
ヘルスケア・テクノロジー		0.03%
合計		92.53%

（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1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 03/31/30 ロシア	国債証券	2,444,239,325	120.36 2,942,060,493	114.45 2,797,554,118	7.500000 2030/3/31	2.70%
2	PERU 5.625 11/18/50 ペルー	国債証券	1,283,722,000	121.69 1,562,225,487	125.97 1,617,168,789	5.625000 2050/11/18	1.56%
3	BRAZIL 4.25 01/07/25 ブラジル	国債証券	1,533,939,000	100.04 1,534,575,421	101.07 1,550,428,844	4.250000 2025/1/7	1.50%
4	RUSSIAN FEDERATION 5.25 06/23/47 ロシア	国債証券	1,457,786,000	105.63 1,539,911,571	104.42 1,522,263,874	5.250000 2047/6/23	1.47%
5	COLOMBIA 5.0 06/15/45 コロンビア	国債証券	1,436,028,000	102.70 1,474,811,635	105.45 1,514,291,526	5.000000 2045/6/15	1.46%
6	RUSSIA FOREIGN BOND 5.0 04/29/20 ロシア	国債証券	1,392,512,000	106.33 1,480,680,855	104.40 1,453,907,854	5.000000 2020/4/29	1.40%
7	UNITED MEXICAN STATES 4.75 03/08/44 メキシコ	国債証券	1,414,270,000	99.90 1,412,942,762	99.70 1,410,027,190	4.750000 2044/3/8	1.36%
8	PERU 7.35 07/21/25 ペルー	国債証券	1,087,900,000	130.01 1,414,481,052	127.88 1,391,206,520	7.350000 2025/7/21	1.34%
9	UNITED MEXICAN STATES 6.05 01/11/40 メキシコ	国債証券	1,142,295,000	116.89 1,335,318,377	116.12 1,326,490,068	6.050000 2040/1/11	1.28%
10	UNITED MEXICAN STATES 5.55 01/21/45 メキシコ	国債証券	1,153,174,000	111.26 1,283,080,139	111.87 1,290,113,412	5.550000 2045/1/21	1.24%
11	UNITED MEXICAN STATES 4.0 10/02/23 メキシコ	国債証券	1,185,811,000	104.49 1,239,063,705	103.70 1,229,686,007	4.000000 2023/10/2	1.19%
12	PANAMA 6.7 01/26/36 パナマ	国債証券	913,836,000	128.06 1,170,319,304	131.55 1,202,151,258	6.700000 2036/1/26	1.16%
13	RUSSIAN FEDERATION 4.875 09/16/23 ロシア	国債証券	1,109,658,000	108.01 1,198,631,466	106.84 1,185,658,476	4.875000 2023/9/16	1.14%
14	TURKEY 6.0 03/25/27 トルコ	国債証券	1,131,416,000	107.64 1,217,876,852	104.78 1,185,610,826	6.000000 2027/3/25	1.14%
15	BRAZIL 5.0 01/27/45 ブラジル	国債証券	1,261,964,000	91.13 1,150,029,969	92.55 1,167,947,682	5.000000 2045/1/27	1.13%
16	TURKEY 7.375 02/05/25 トルコ	国債証券	1,011,747,000	114.97 1,163,258,833	114.50 1,158,450,315	7.375000 2025/2/5	1.12%
17	RUSSIAN FEDERATION 4.75 05/27/26 ロシア	国債証券	1,087,900,000	105.17 1,144,211,444	106.13 1,154,653,544	4.750000 2026/5/27	1.11%
18	UNITED MEXICAN STATES 4.15 03/28/27 メキシコ	国債証券	1,109,658,000	105.38 1,169,361,952	102.37 1,136,012,377	4.150000 2027/3/28	1.10%

19	UNITED MEXICAN STATES 3.625 03/15/22 メキシコ	国債証券	1,077,021,000	103.62 1,116,082,049	102.94 1,108,793,119	3.625000 2022/3/15	1.07%
20	RUSSIAN FEDERATION 5.625 04/04/42 ロシア	国債証券	979,110,000	110.54 1,082,380,865	111.25 1,089,269,666	5.625000 2042/4/4	1.05%
21	BRAZIL 4.875 01/22/21 ブラジル	国債証券	1,022,626,000	106.36 1,087,747,694	105.65 1,080,404,369	4.875000 2021/1/22	1.04%
22	COLOMBIA 6.125 01/18/41 コロンビア	国債証券	870,320,000	116.33 1,012,443,256	120.60 1,049,605,920	6.125000 2041/1/18	1.01%
23	TURKEY 5.75 03/22/24 トルコ	国債証券	989,989,000	105.42 1,043,737,896	105.52 1,044,656,192	5.750000 2024/3/22	1.01%
24	TURKEY 6.625 02/17/45 トルコ	国債証券	968,231,000	108.98 1,055,274,749	105.74 1,023,817,141	6.625000 2045/2/17	0.99%
25	COLOMBIA 5.625 02/26/44 コロンビア	国債証券	892,078,000	111.30 992,904,572	114.45 1,020,983,271	5.625000 2044/2/26	0.98%
26	TURKEY 4.875 10/09/26 トルコ	国債証券	1,044,384,000	98.13 1,024,893,836	97.45 1,017,783,539	4.875000 2026/10/9	0.98%
27	HUNGARY 5.75 11/22/23 ハンガリー	国債証券	892,078,000	114.40 1,020,568,998	113.21 1,009,948,266	5.750000 2023/11/22	0.97%
28	UNITED MEXICAN STATES 4.125 01/21/26 メキシコ	国債証券	979,110,000	104.20 1,020,254,378	103.12 1,009,707,187	4.125000 2026/1/21	0.97%
29	PHILIPPINES 9.5 02/02/30 フィリピン	国債証券	630,982,000	159.37 1,005,639,746	155.91 983,827,134	9.500000 2030/2/2	0.95%
30	UNITED MEXICAN STATES 5.75 10/12/2110 メキシコ	国債証券	913,836,000	103.31 944,125,311	105.25 961,812,390	5.750000 2110/10/12	0.93%

（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1月31日現在

種類	投資比率
国債証券	96.28%
合計	96.28%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率
該当事項はありません。

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③【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1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　３００３月	買建	151	2,844,810,324	2,777,645,000	0.90%

（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。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年1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・ドル売／円買２０１８年０２月	売建	3,365,000	366,773,830	366,039,650	△0.12%
		ユーロ売／円買２０１８年０２月	売建	778,000	105,006,052	105,092,240	△0.03%
		イギリス・ポンド売／円買２０１８年０２月	売建	365,000	55,999,661	56,195,400	△0.02%
		カナダ・ドル売／円買２０１８年０２月	売建	180,000	15,893,524	15,874,200	△0.01%
		オーストラリア・ドル売／円買２０１８年０２月	売建	129,000	11,371,239	11,323,440	△0.00%
株価指数先物取引	シカゴ商品取引所	Ｓ＆Ｐ５００ ＥＭＩＮＩ ＦＵＴ Ｍａｒ１８	買建	413	6,084,907,010	6,345,277,380	2.05%
	ＥＵＲＥＸ取引所	ＤＪ ＥＵＲＯ ＳＴＯＸＸ ５０ Ｍａｒ１８	買建	366	1,773,466,670	1,781,297,258	0.57%
	ＩＣＥ－ＥＵ	ＦＴＳＥ １００ ＩＮＤＥＸ ＦＵＴＵＲＥ Ｍａｒ１８	買建	58	668,921,125	673,564,860	0.22%
	モントリオール取引所	Ｓ＆Ｐ／ＴＳＥ ６０ ＩＸ ＦＵＴ Ｍａｒ１８	買建	21	354,850,297	349,399,008	0.11%
	シドニー先物取引所	ＳＰＩ ２００ ＦＵＴＵＲＥＳ Ｍａｒ１８	買建	20	263,021,034	261,614,200	0.08%

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。
（注2）先物取引の時価は、原則として計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。
（注3）為替予約取引の時価は、原則としてわが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しています。
為替予約取引の数量は、現地通貨建契約金額です。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年1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	－	ユーロ買／円売２０１８年０２月	買建	1,443,000	194,708,319	194,920,440	0.09%
		アメリカ・ドル買／円売２０１８年０２月	買建	1,787,000	194,847,332	194,389,860	0.09%
		イギリス・ポンド買／円売２０１８年０２月	買建	317,000	48,588,365	48,805,320	0.02%
		カナダ・ドル買／円売２０１８年０２月	買建	551,000	48,654,622	48,592,690	0.02%
		ユーロ売／円買２０１８年０２月	売建	541,000	73,077,739	73,078,280	△0.03%
		アメリカ・ドル売／円買２０１８年０２月	売建	671,000	72,987,354	72,984,670	△0.03%
		イギリス・ポンド売／円買２０１８年０２月	売建	237,000	36,488,520	36,488,520	△0.02%

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。
（注2）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1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０２月	買建	262,000	28,498,788	28,497,740	0.05%
		アメリカ・ドル売／円買２０１８年０２月	売建	4,522,000	493,060,792	491,903,160	△0.79%
株価指数先物取引	ＩＣＥ－ＵＳ	ＭＩＮＩ　ＭＳＣＩ　ＥＭＧ　ＭＫＴ　Ｍａｒ１８	買建	623	3,906,502,033	4,226,860,842	6.81%

（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。

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

平成30年1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・ドル売／円買２０１８年０２月	売建	200,000	21,754,800	21,754,000	△0.02%

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。
（注2）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】

①【純資産の推移】

直近日（平成30年1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27年1月13日)	1	1	1.0475	1.0475
第2計算期間末 (平成27年7月13日)	4	4	1.0599	1.0599
第3計算期間末 (平成28年1月12日)	6	6	1.0080	1.0080
第4計算期間末 (平成28年7月11日)	7	7	0.9741	0.9741
第5計算期間末 (平成29年1月11日)	10	10	1.0281	1.0281
第6計算期間末 (平成29年7月11日)	10	10	1.0463	1.0463
第7計算期間末 (平成30年1月11日)	10	10	1.0769	1.0769
平成29年1月末日	10	－	1.0211	－
2月末日	11	－	1.0212	－
3月末日	11	－	1.0211	－
4月末日	11	－	1.0227	－
5月末日	10	－	1.0285	－
6月末日	10	－	1.0390	－
7月末日	10	－	1.0430	－
8月末日	10	－	1.0442	－
9月末日	10	－	1.0505	－
10月末日	10	－	1.0612	－
11月末日	9	－	1.0628	－
12月末日	10	－	1.0727	－
平成30年1月末日	10	－	1.0702	－

②【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
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000

③【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	4.8
第2計算期間	1.2
第3計算期間	△4.9
第4計算期間	△3.4
第5計算期間	5.5
第6計算期間	1.8
第7計算期間	2.9

（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	1,672,022	4,000
第2計算期間	2,911,420	174,376
第3計算期間	2,494,725	145,687
第4計算期間	2,261,885	895,972
第5計算期間	2,145,720	0
第6計算期間	1,697,260	1,759,596
第7計算期間	1,552,687	2,348,840

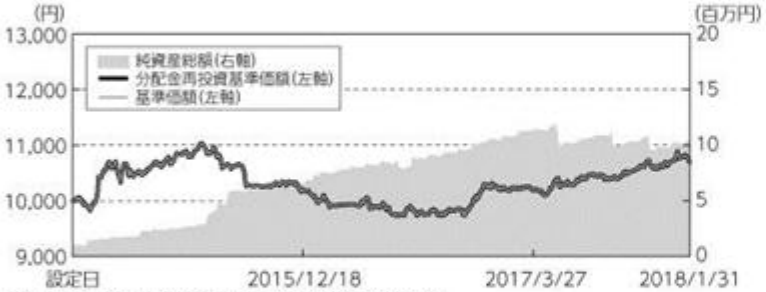
（注1）　本邦外における設定及び解約はございません。

（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。

＜＜参考情報＞＞

データの基準日：2018年1月31日

基準価額・純資産の推移 〈2014年9月12日～2018年1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:2014年9月12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3期	(2016.01.12)	0円
第4期	(2016.07.11)	0円
第5期	(2017.01.11)	0円
第6期	(2017.07.11)	0円
第7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	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	15.35%
2	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	10.30%
3	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	9.98%
4	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	5.24%
5	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	5.16%
6	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	5.00%

■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	124回　利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.100000	2020/6/20	1.12%
2	122回　利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.100000	2019/12/20	1.12%
3	117回　利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.200000	2019/3/20	1.12%
4	118回　利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.200000	2019/6/20	1.03%
5	341回　利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.300000	2025/12/20	1.00%

■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	3.43%
2	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	日本	銀行業	2.16%
3	ソフトバンクグループ	株式	日本	情報・通信業	1.51%
4	日本電信電話	株式	日本	情報・通信業	1.38%
5	三井住友フィナンシャルグループ	株式	日本	銀行業	1.37%

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

データの基準日：2018年1月31日

■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 3.625 02/15/20	国債証券	アメリカ	3.625000	2020/2/15	0.84%
2	US T N/B 2.0 02/15/22	国債証券	アメリカ	2.000000	2022/2/15	0.83%
3	US T N/B 2.625 08/15/20	国債証券	アメリカ	2.625000	2020/8/15	0.80%
4	US T N/B 2.125 12/31/21	国債証券	アメリカ	2.125000	2021/12/31	0.74%
5	US T N/B 1.625 03/31/19	国債証券	アメリカ	1.625000	2019/3/31	0.72%

■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	2.16%
2	MICROSOFT CORP	株式	アメリカ	ソフトウェア	1.70%
3	AMAZON.COM INC	株式	アメリカ	インターネット販売・通信販売	1.47%
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	1.11%
5	JPMORGAN CHASE & CO	株式	アメリカ	銀行	1.01%

■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 03/31/30	国債証券	ロシア	7.500000	2030/3/31	2.70%
2	PERU 5.625 11/18/50	国債証券	ペルー	5.625000	2050/11/18	1.56%
3	BRAZIL 4.25 01/07/25	国債証券	ブラジル	4.250000	2025/1/7	1.50%
4	RUSSIAN FEDERATION 5.25 06/23/47	国債証券	ロシア	5.250000	2047/6/23	1.47%
5	COLOMBIA 5.0 06/15/45	国債証券	コロンビア	5.000000	2045/6/15	1.46%

■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	5.35%
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	3.66%
3	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	株式	韓国	コンピュータ・周辺機器	3.60%
4	TAIWAN SEMICONDUCTOR	株式	台湾	半導体・半導体製造装置	3.39%
5	NASPERS LTD	株式	南アフリカ	メディア	2.00%

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。
※2014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。
※当ファンドにはベンチマークはありません。

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

第２【管理及び運営】

１【申込（販売）手続等】

お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

当ファンド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、ニューヨークの銀行、ロンドンの銀行のいずれかの休業日に該当する日（以下、「海外休業日」という場合があります。）にはお申込みの受付を行いません。

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

※受益権の取得申込者は委託会社または販売会社に、取得申込みと同時にまたはあらかじめ、自己のために開設されたファンドの受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録が行われます。

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

・お申込価額

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1万口当たりに換算した基準価額で表示することがあります。)

＜基準価額の照会方法等＞

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

※当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

・販売会社へのお問い合わせ

・委託会社への照会

ホームページ　URL　http://www.am-one.co.jp/

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

・お申込手数料

ありません。

・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。

・払込期日

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

2【換金（解約）手続等】

受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託会社に対し解約の請求をすることができます。委託会社は、解約の請求を受付けた場合には、信託契約の一部を解約します。

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

※海外休業日には、解約の受付を行いません。

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

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

※委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、解約の受付を中止することおよびすでに受付けた解約の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5営業日目から販売会社の営業所等において支払います。

３【資産管理等の概要】

（１）【資産の評価】

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

＜主な投資対象の時価評価方法の原則＞

投資対象	評価方法
マザーファンド受益証券	計算日の基準価額
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
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。
※ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。
・販売会社への問い合わせ
・委託会社への照会
ホームページ　URL　http://www.am-one.co.jp/

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

（２）【保管】

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26年9月12日（設定日）から原則として無期限です。

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

（４）【計算期間】

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

b.上記a.の規定にかかわらず、上記a.の原則により各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。ただし、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。

（５）【その他】

イ.償還規定

a.委託会社は、信託期間中において、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、受益権口数が10億口を下回ることとなった場合、マザーファンドのベンチマークである対象インデックスが改廃された場合、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.上記b.からd.までの規定は、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、信託契約にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって上記b.からd.までの手続きを行うことが困難な場合も同様とします。

f.委託会社は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し信託を終了させます。

g.委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が、信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、下記「ロ．信託約款の変更等 b.」の書面決議が否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。

h.受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社が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にあっても、当該併合にかかる一または複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。

h.委託会社は、監督官庁の命令に基づいて約款を変更しようとするときは、上記a.からg.の規定にしたがいます。

i.この信託は、受益者が一部解約請求を行ったときは、委託会社が信託契約の一部の解約をすることにより当該請求に応じ、当該受益権の公正な価格が当該受益者に一部解約金として支払われることとなる委託者指図型投資信託に該当するため、重大な約款の変更等を行う場合において、投資信託及び投資法人に関する法律第18条第1項に定める反対受益者による受益権買取請求の規定の適用を受けません。

ハ. 関係法人との契約の更改

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

投資顧問契約について、委託会社と投資顧問会社との間の当該契約は、原則として期間満了の1ヵ月前までに、当事者間の別段の意思表示がない限り、半年毎に自動的に更新されます。当該契約は、当事者間の合意により変更することができます。

ニ. 公告

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

（URL　http://www.am-one.co.jp/）

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

ホ. 運用報告書

・委託会社は、毎年1月11日、7月11日（休業日の場合は翌営業日とします。）および償還時に交付運用報告書を作成し、販売会社を通じて受益者に対して交付します。

・運用報告書（全体版）は、委託会社のホームページにおいて開示します。ただし、受益者から運用報告書（全体版）の請求があった場合には、これを交付します。

（URL　http://www.am-one.co.jp/）

４【受益者の権利等】

①収益分配金請求権

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、委託会社または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）当ファンドの計算期間は6ヵ月であるため、財務諸表は6ヵ月ごとに作成しております。

（３）当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第7期計算期間（平成29年7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】

【クルーズコントロール＜ＤＣ年金＞】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第6期 平成29年7月11日現在	第7期 平成30年1月11日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	2,269,171	628,058
親投資信託受益証券	8,471,259	9,564,068
流動資産合計	10,740,430	10,192,126
資産合計	10,740,430	10,192,126
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	2,880	2,762
未払委託者報酬	61,201	58,766
その他未払費用	181	184
流動負債合計	64,262	61,712
負債合計	64,262	61,712
純資産の部		
元本等		
元本	※1 10,203,401	※1 9,407,248
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	472,767	723,166
（分配準備積立金）	199,037	426,787
元本等合計	10,676,168	10,130,414
純資産合計	10,676,168	10,130,414
負債純資産合計	10,740,430	10,192,126

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第6期 自　平成29年1月12日 至　平成29年7月11日	第7期 自　平成29年7月12日 至　平成30年1月11日
営業収益		
受取利息	―	2
有価証券売買等損益	273,991	359,809
営業収益合計	273,991	359,811
営業費用		
支払利息	1,662	1,197
受託者報酬	2,880	2,762
委託者報酬	61,201	58,766
その他費用	181	184
営業費用合計	65,924	62,909
営業利益又は営業損失（△）	208,067	296,902
経常利益又は経常損失（△）	208,067	296,902
当期純利益又は当期純損失（△）	208,067	296,902
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（△）	18,135	26,577
期首剰余金又は期首欠損金（△）	288,529	472,767
剰余金増加額又は欠損金減少額	42,453	89,516
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	42,453	89,516
剰余金減少額又は欠損金増加額	48,147	109,442
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	48,147	109,442
分配金	※1　―	※1　―
期末剰余金又は期末欠損金（△）	472,767	723,166

（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6期 平成29年7月11日現在	第7期 平成30年1月11日現在
１．　※１　期首元本額	10,265,737円	10,203,401円
期中追加設定元本額	1,697,260円	1,552,687円
期中一部解約元本額	1,759,596円	2,348,840円
２．　受益権の総数	10,203,401口	9,407,248口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	第6期 自　平成29年1月12日 至　平成29年7月11日	第7期 自　平成29年7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（48,887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（36,132円）、信託約款に規定される収益調整金（421,417円）及び分配準備積立金（114,018円）より分配対象収益は620,454円（1万口当たり608.09円）でありますが、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（59,238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（211,087円）、信託約款に規定される収益調整金（416,818円）及び分配準備積立金（156,462円）より分配対象収益は843,605円（1万口当たり896.76円）でありますが、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6期 自　平成29年1月12日 至　平成29年7月11日	第7期 自　平成29年7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6期 平成29年7月11日現在	第7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6期 平成29年7月11日現在	第7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	323,128	278,231
合計	323,128	278,231

（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6期 平成29年7月11日現在	第7期 平成30年1月11日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.0463円 (10,463円)	1.0769円 (10,769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	721,180	2,056,589	
	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	1,441,246	1,848,253	
	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	275,806	977,428	
	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	1,504,754	2,768,596	
	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	757,609	989,437	
	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	485,809	923,765	
親投資信託受益証券　合計		5,186,404	9,564,068	
合計		5,186,404	9,564,068	

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、「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、「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7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		8,308,426,899	9,174,734,961
株式	※２	290,122,126,356	312,504,179,760
派生商品評価勘定		65,717,084	176,588,080
未収入金		22,253,197	131,159,280
未収配当金		336,309,264	394,538,223
流動資産合計		298,854,832,800	322,381,200,304
資産合計		298,854,832,800	322,381,200,304
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		－	706,480
前受金		24,817,800	349,245,000
未払解約金		204,812,000	262,677,000
流動負債合計		229,629,800	612,628,480
負債合計		229,629,800	612,628,480
純資産の部			
元本等			
元本	※１	122,668,273,869	112,835,531,288
剰余金			
剰余金又は欠損金（△）		175,956,929,131	208,933,040,536
元本等合計		298,625,203,000	321,768,571,824
純資産合計		298,625,203,000	321,768,571,824
負債純資産合計		298,854,832,800	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7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	131,210,790,341円	122,668,273,869円
同期中追加設定元本額	10,379,609,266円	9,969,103,718円
同期中一部解約元本額	18,922,125,738円	19,801,846,299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	7,006,673,259円	8,226,196,501円
ＤＩＡＭ国内株式パッシブ・ファンド	1,843,565,480円	1,839,482,555円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	5,597,963円	4,123,447円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	11,990,373円	9,291,815円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	22,375,409円	16,267,567円
グローバル８資産ラップファンド（安定型）	8,966,000円	17,474,561円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	11,580,263円	13,210,945円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	13,936,951円	11,886,882円
たわらノーロード　ＴＯＰＩＸ	46,143,437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
ＤＩＡＭ国内株式インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	36,008,858,667円	36,033,477,757円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型	810,191,291円	755,786,995円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型	2,788,293,656円	2,674,104,581円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型	2,873,686,385円	2,772,861,201円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド	364,567,248円	328,683,164円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド	1,210,122,602円	1,127,448,779円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０インデックスファンド	1,086,132,171円	1,054,085,428円
マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	52,752,566円	47,522,960円
マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	1,206,946,366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	25,954,176円	24,024,004円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	37,314,317円	37,610,795円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	82,116,400円	93,210,788円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	156,698,053円	185,672,845円
投資のソムリエ	2,687,057,437円	2,476,860,905円
クルーズコントロール	2,214,096,389円	2,066,117,052円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	136,995,504円	157,129,259円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	139,626,542円	145,551,548円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス・Ｆ（成長型）	157,708,328円	190,593,286円
クルーズコントロール＜ＤＣ年金＞	728,707円	721,180円
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（堅実型）	16,476,765円	11,905,936円
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（積極型）	41,470,353円	27,115,492円

投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	44,415,712円	41,009,745円	
ダイナミック・ナビゲーション	2,128,555円	2,126,231円	
リスク抑制世界８資産バランスファンド	454,683,015円	566,776,687円	
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	456,546円	507,000円	
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	456,546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ワールドバランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	82,861,084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）	173,481,565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）	354,034,785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）	24,122,899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）	104,399,878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）	26,973,517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）	29,124,667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）	56,321,645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）	100,680,200円	59,453,532円	
ＤＩＡＭバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,322,486,695円	1,110,380,656円	
ＤＩＡＭバランスファンド３７．５ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,213,438,243円	1,056,123,054円	
ＤＩＡＭバランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	3,301,428,688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）	250,524,274円	203,597,030円	
ＤＩＡＭグローバル・アセット・バランスＶＡ２（適格機関投資家限定）	234,382,934円	103,572,859円	

ＤＩＡＭ　アクサ　グローバル　バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	728,651,510円	614,329,833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）	2,876,453,894円	1,931,779,617円	
ＤＩＡＭグローバルβ私募ファンド（適格機関投資家向け）	31,157,719円	10,313,671円	
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	491,762,989円	50,384,094円	
ＤＩＡＭ世界バランスファンド３５ＶＡ（適格機関投資家限定）	3,817,964,843円	1,341,418,363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）	17,575,455,912円	15,452,034,881円	
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	632,594,356円	551,734,251円	
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,997,924,602円	1,768,841,652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）	11,250,348,248円	10,058,436,721円	
ＤＩＡＭバランス３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	5,294,136円	523,029円	
ＤＩＡＭバランス５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,959,932円	9,153,617円	
ＤＩＡＭバランス７０ＶＡ（適格機関投資家限定）	4,519,143円	3,719,126円	
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド４ＶＡ（適格機関投資家限定）	10,045,815,761円	8,946,206,418円	
ＤＩＡＭ世界バランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	81,098,112円	72,553,517円	
ＤＩＡＭ国内バランス３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	31,594,151円	27,930,610円	
ＤＩＡＭバランス２０ＶＡ（適格機関投資家限定）	32,623,114円	23,981,894円	
ＤＩＡＭバランス４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	71,462円	5,401,067円	
ＤＩＡＭバランス６０ＶＡ（適格機関投資家限定）	117,139円	109,957円	
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド７ＶＡ（１２１２）（適格機関投資家限定）	556,068,690円	477,777,807円	
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド７ＶＡ（１３０３）（適格機関投資家限定）	1,542,113,531円	1,323,021,834円	

	ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド７ＶＡ（１３０６）（適格機関投資家限定）	2,030,985,091円	1,764,382,103円
	ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド７ＶＡ（１３０９）（適格機関投資家限定）	88,675,028円	76,281,237円
	計	122,668,273,869円	112,835,531,288円
２．	受益権の総数	122,668,273,869口	112,835,531,288口
３．	※２　差入代用有価証券	株式 3,131,500,000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29年1月12日 至　平成29年7月11日	自　平成29年7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7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 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成29年7月11日現在 当期の損益に含まれた評価差額（円）	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）
株式	19,828,211,320	60,868,980,291
合計	19,828,211,320	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29年2月8日から平成29年7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7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	6,592,670,400	－	6,658,520,000	65,849,600	6,418,005,000	－	6,594,000,000	175,995,000
合計	6,592,670,400	－	6,658,520,000	65,849,600	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7月11日現在	平成30年1月11日現在
１口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	2.4344円 (24,344円)	2.8517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	
ホウスイ	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	
飛島建設	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	
錢高組	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	
淺沼組	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	
青木あすなろ建設	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	
ＮＤＳ	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	
ＮＥＣネッツエスアイ	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	
大氣社	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	
ＬＩＦＵＬＬ	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	
ＣＤＳ	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	
ＧＣＡ	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	
ＮＪＳ	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	
綜合警備保障	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	
ＳＢＳ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	
ブラス	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・ヴイ・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	
キャンドゥ	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	
ＪＰ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	
キユーピー	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	
ピッ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	
グンゼ	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	
ジンズ	7,800	5,260.00	41,028,000	
ビックカメラ	65,900	1,671.00	110,118,900	
ＤＣＭ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	
ＭｏｎｏｔａＲＯ	40,600	3,655.00	148,393,000	
東京一番フーズ	2,400	621.00	1,490,400	
ＤＤ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	
Ｈａｍｅｅ	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	
ＵＫＣホールディングス	7,300	2,373.00	17,322,900	
ジューテックホールディングス	2,600	1,356.00	3,525,600	
丸善ＣＨＩホールディングス	13,300	349.00	4,641,700	
大光	2,600	946.00	2,459,600	
ＯＣＨＩホールディングス	3,300	1,515.00	4,999,500	
ＴＯＫＡＩ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	
ダイドーリミテッド	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	
日本フエルト	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	
サツ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	
バ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	
クラウディアホールディングス	2,900	601.00	1,742,900	
ＴＳＩホールディングス	45,900	833.00	38,234,700	
ＴＩＳ	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	
ＡＧＳ	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	
ＫＬａｂ	22,000	1,882.00	41,404,000	
ポールトゥウィン・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	
ｅｎｉｓｈ	3,400	1,329.00	4,518,600	
コロプラ	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	
オプティム	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	
中越パルプ工業	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	
パイプド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・パック	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	
ＪＳＲ	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	
ＫＨ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	
ＥＰＳ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	
レッグス	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	
ＴＡＣ	6,700	366.00	2,452,200	
ＣＥ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	
インテ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	
ＡＤＥＫＡ	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	
ビオフェルミン製薬	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	

ＤＩＣ	48,000	4,405.00	211,440,000	
サカタインクス	24,800	1,849.00	45,855,200	
東洋インキＳＣホールディングス	120,000	688.00	82,560,000	
Ｔ＆Ｋ　ＴＯＫＡ	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	
ＴＤＣ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	
ＣＡＣ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	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	
エックスネット	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	
ＣＩＪ	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	
ＪＣＵ	7,100	5,530.00	39,263,000	
新田ゼラチン	7,900	865.00	6,833,500	
ＯＡＴ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	
ビーピー・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	
フジミ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	
日本鋳鉄管	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	
文化シヤッター	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	
東洋シヤッター	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	
パイオラックス	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	
ＫｅｅＰｅｒ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	
ＩＢＪ	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	
ＥＲＩ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	
ＤＭＧ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	
冨士ダイス	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	
ＬＩＴＡＬＩＣＯ	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	
フリュー	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	
ナブテスコ	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	
オカダアイヨン	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	
ＣＫＤ	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	
ＴＰＲ	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	
ＮＴＮ	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	
ＴＨＫ	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	
日本ピラー工業	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	
ＪＶＣ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	
ＩＤＥＣ	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	
ＥＩＺＯ	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	
ＴＤＫ	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	
ＳＭＫ	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	
エスペック	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	
ＫＯＡ	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	
ＩＨＩ	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	
日本車輌製造	42,000	370.00	15,540,000	
三菱ロジスネクスト	13,800	1,031.00	14,227,800	
近畿車輌	1,700	3,175.00	5,397,500	
ＦＰＧ	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	
トピー工業	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	
ケーヒン	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	
佐鳥電機	8,400	1,223.00	10,273,200	

カッパ・クリエイト	14,200	1,270.00	18,034,000	
エコートレーディング	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	
メディパ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	
ＳＰＫ	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	

ＶＴ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	
ＩＤＯＭ	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	
ＰＬＡＮＴ	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	
ＪＭＳ	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	
ブイ・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	
ＳＣＲＥＥＮ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	
ＨＯＹＡ	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	
中本パックス	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	
ＳＨＯ‐ＢＩ	3,900	443.00	1,727,700	
ニホンフラッシュ	5,400	2,938.00	15,865,200	
前田工繊	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	
廣済堂	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	
ピジョン	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	
すてきナイスグループ	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	
ＧＳＩ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	
デサント	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	
トーホー	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	
ＳＲＳ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	
ＳＯＭＰＯ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	
トランコム	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	
キユ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	
エーアイテイー	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ＪＳＡＴ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	
アイド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	
ＤＴＳ	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・ホスピタリティー・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	
ＳＣＳＫ	26,300	5,210.00	137,023,000	
藤田観光	4,400	3,555.00	15,642,000	
ＫＮＴ－ＣＴ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	
ＴＫＣ	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	
ＮＳＤ	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	
ＪＢＣＣ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	
バ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	
サックスバー　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	
ベルーナ	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7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		2,733,939,409	1,225,455,365
国債証券		315,235,633,300	303,128,208,700
地方債証券		23,569,195,453	22,902,738,657
特殊債券		17,537,725,708	15,780,383,842
社債券		17,020,874,690	16,879,127,400
未収入金		1,819,912,000	1,447,832,100
未収利息		810,514,107	770,154,466
前払費用		14,161,786	8,463,736
流動資産合計		378,741,956,453	362,142,364,266
資産合計		378,741,956,453	362,142,364,266
負債の部			
流動負債			
未払解約金		284,421,000	315,300,000
流動負債合計		284,421,000	315,300,000
負債合計		284,421,000	315,300,000
純資産の部			
元本等			
元本	※１	296,867,950,534	282,148,441,520
剰余金			
剰余金又は欠損金（△）		81,589,584,919	79,678,622,746
元本等合計		378,457,535,453	361,827,064,266
純資産合計		378,457,535,453	361,827,064,266
負債純資産合計		378,741,956,453	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7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	302,351,149,022円	296,867,950,534円
同期中追加設定元本額	32,910,113,444円	27,482,923,625円
同期中一部解約元本額	38,393,311,932円	42,202,432,639円
元本の内訳		
ファンド名		
ＤＩＡＭ国内債券パッシブ・ファンド	13,038,628,817円	14,044,050,293円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	166,033,507円	137,430,777円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	128,679,191円	112,114,796円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	42,150,616円	34,436,660円
グローバル８資産ラップファンド（安定型）	266,120,041円	583,451,400円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	124,253,065円	159,609,573円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	26,245,887円	25,188,228円
たわらノーロード　国内債券	1,713,963,026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	
ＤＩＡＭ国内債券インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	12,351,271,983円	12,427,315,535円	
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型	5,242,052,506円	5,528,653,854円	
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型	7,410,630,126円	7,985,672,600円	
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型	2,975,711,672円	3,263,681,041円	
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド	1,753,373,573円	1,826,494,969円	
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド	1,883,340,225円	2,010,449,233円	
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０インデックスファンド	285,745,922円	309,647,783円	
マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	100,041,145円	89,820,576円	
マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	2,305,194,406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	3,002,910円	2,224,336円	
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	402,253,149円	470,102,235円	
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	320,865,483円	421,003,073円	
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	73,889,276円	99,634,072円	
投資のソムリエ	11,584,189,540円	5,412,751,268円	
クルーズコントロール	4,826,077,677円	4,127,957,852円	
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	590,952,033円	343,120,269円	
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	1,503,527,064円	1,785,743,778円	
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス・Ｆ（成長型）	163,452,779円	228,300,610円	
クルーズコントロール＜ＤＣ年金＞	1,587,420円	1,441,246円	
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（堅実型）	9,566,746円	9,543,074円	
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（積極型）	24,077,080円	21,666,572円	
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	393,564,580円	296,996,808円	
ダイナミック・ナビゲーション	496,061円	559,152円	
リスク抑制世界８資産バランスファンド	4,024,193,337円	4,119,995,045円	
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	1,169,865円	721,386円	
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	1,169,865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）	25,692,996,057円	22,732,301,633円
ＤＩＡＭワールドバランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	513,649,805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）	392,653,115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）	266,891,766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）	106,189,311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）	295,373,799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）	127,210,758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）	73,240,699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）	159,355,831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）	284,854,614円	190,740,120円
ＤＩＡＭバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	6,653,603,488円	6,327,385,858円
ＤＩＡＭバランスファンド３７．５ＶＡ（適格機関投資家限定）	3,433,169,919円	3,384,413,398円
ＤＩＡＭバランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	6,226,075,124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）	709,120,313円	652,541,797円
ＤＩＡＭグローバル・アセット・バランスＶＡ２（適格機関投資家限定）	1,103,862,832円	553,747,291円
ＤＩＡＭ　アクサ　グローバル　バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	4,134,495,677円	3,945,456,574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）	5,402,651,790円	4,127,295,962円
ＤＩＡＭグローバルβ私募ファンド（適格機関投資家向け）	586,191,715円	194,752,933円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,779,451,418円	322,047,228円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド３５ＶＡ（適格機関投資家限定）	5,788,368,005円	2,383,950,442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）	88,405,762,905円	88,035,522,422円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,193,010,313円	1,178,525,546円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	7,538,718,182円	7,559,824,166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）	28,291,502,052円	28,649,485,500円

ＤＩＡＭバランス３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	80,114,698円	8,960,230円
ＤＩＡＭバランス５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	9,253,393円	48,915,437円
ＤＩＡＭバランス７０ＶＡ（適格機関投資家限定）	8,522,575円	7,941,011円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド４ＶＡ（適格機関投資家限定）	31,583,739,591円	31,857,319,666円
ＤＩＡＭ世界バランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	503,333,943円	509,422,227円
ＤＩＡＭ国内バランス３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	139,072,724円	139,681,767円
ＤＩＡＭバランス２０ＶＡ（適格機関投資家限定）	616,595,295円	513,354,007円
ＤＩＡＭバランス４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	468,148円	40,409,042円
ＤＩＡＭバランス６０ＶＡ（適格機関投資家限定）	363,993円	390,500円
計	296,867,950,534円	282,148,441,520円
２．　受益権の総数	296,867,950,534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29年1月12日 至　平成29年7月11日	自　平成29年7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7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7月11日現在 当期の損益に含まれた評価差額（円）	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）
国債証券	△727,487,800	△117,176,300
地方債証券	△121,555,380	△147,619,176
特殊債券	△81,351,955	△114,681,960
社債券	△84,452,780	△133,148,070
合計	△1,014,847,915	△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29年2月15日から平成29年7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7月11日現在	平成30年1月11日現在
１口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.2748円 (12,748円)	1.2824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	

２１回　利付国庫債券（３０年）	300,000,000	393,054,000	
２２回　利付国庫債券（３０年）	470,000,000	632,939,600	
２３回　利付国庫債券（３０年）	600,000,000	808,608,000	
２４回　利付国庫債券（３０年）	300,000,000	405,270,000	
２５回　利付国庫債券（３０年）	400,000,000	526,320,000	
２６回　利付国庫債券（３０年）	700,000,000	934,353,000	
２７回　利付国庫債券（３０年）	700,000,000	949,130,000	
２８回　利付国庫債券（３０年）	900,000,000	1,223,154,000	
２９回　利付国庫債券（３０年）	900,000,000	1,210,266,000	
３０回　利付国庫債券（３０年）	900,000,000	1,196,451,000	
３１回　利付国庫債券（３０年）	900,000,000	1,181,916,000	
３２回　利付国庫債券（３０年）	1,100,000,000	1,471,734,000	
３３回　利付国庫債券（３０年）	1,300,000,000	1,663,324,000	
３４回　利付国庫債券（３０年）	1,200,000,000	1,589,028,000	
３５回　利付国庫債券（３０年）	1,300,000,000	1,668,693,000	
３６回　利付国庫債券（３０年）	1,300,000,000	1,671,891,000	
３７回　利付国庫債券（３０年）	1,400,000,000	1,772,176,000	
３８回　利付国庫債券（３０年）	900,000,000	1,120,284,000	
３９回　利付国庫債券（３０年）	800,000,000	1,014,880,000	
４０回　利付国庫債券（３０年）	800,000,000	996,968,000	
４１回　利付国庫債券（３０年）	800,000,000	978,784,000	
４２回　利付国庫債券（３０年）	800,000,000	979,136,000	
４３回　利付国庫債券（３０年）	800,000,000	979,504,000	
４４回　利付国庫債券（３０年）	800,000,000	979,840,000	
４５回　利付国庫債券（３０年）	1,000,000,000	1,177,260,000	
４６回　利付国庫債券（３０年）	900,000,000	1,059,552,000	
４７回　利付国庫債券（３０年）	1,000,000,000	1,201,550,000	
４８回　利付国庫債券（３０年）	1,100,000,000	1,266,782,000	
４９回　利付国庫債券（３０年）	1,100,000,000	1,266,562,000	
５０回　利付国庫債券（３０年）	1,000,000,000	1,000,000,000	
５１回　利付国庫債券（３０年）	1,100,000,000	959,277,000	
５２回　利付国庫債券（３０年）	1,100,000,000	1,012,385,000	
５３回　利付国庫債券（３０年）	820,000,000	774,194,800	
５４回　利付国庫債券（３０年）	1,100,000,000	1,093,532,000	
５５回　利付国庫債券（３０年）	800,000,000	794,320,000	
５６回　利付国庫債券（３０年）	900,000,000	892,503,000	
５７回　利付国庫債券（３０年）	150,000,000	148,564,500	
４２回　利付国庫債券（２０年）	800,000,000	825,704,000	
４３回　利付国庫債券（２０年）	860,000,000	903,705,200	
４５回　利付国庫債券（２０年）	900,000,000	949,356,000	
４６回　利付国庫債券（２０年）	500,000,000	528,235,000	
４７回　利付国庫債券（２０年）	950,000,000	1,009,166,000	
４８回　利付国庫債券（２０年）	500,000,000	538,455,000	
５０回　利付国庫債券（２０年）	780,000,000	830,169,600	
５１回　利付国庫債券（２０年）	600,000,000	643,476,000	
５２回　利付国庫債券（２０年）	550,000,000	594,605,000	
５４回　利付国庫債券（２０年）	700,000,000	763,196,000	
５５回　利付国庫債券（２０年）	810,000,000	880,996,500	
５７回　利付国庫債券（２０年）	1,130,000,000	1,229,677,300	
５８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　ブリヂストン社債	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。

「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7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		1,373,181,531	5,822,987,447
コール・ローン		295,463,571	726,764,720
株式		266,449,034,455	292,877,407,767
投資信託受益証券		782,539,781	801,364,202
投資証券		6,208,747,500	6,273,413,009
派生商品評価勘定		8,351,358	175,170,660
未収入金		3,907,831,834	2,663,502
未収配当金		354,801,614	323,899,180
差入委託証拠金		1,509,869,771	2,025,207,755
流動資産合計		280,889,821,415	309,028,878,242
資産合計		280,889,821,415	309,028,878,242
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		18,229,577	3,689,542
未払金		72,542,744	－
未払解約金		286,716,000	331,777,000
流動負債合計		377,488,321	335,466,542
負債合計		377,488,321	335,466,542
純資産の部			
元本等			
元本	※１	87,299,647,391	87,104,816,912
剰余金			
剰余金又は欠損金（△）		193,212,685,703	221,588,594,788
元本等合計		280,512,333,094	308,693,411,700
純資産合計		280,512,333,094	308,693,411,700
負債純資産合計		280,889,821,415	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）

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。 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。 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。 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．　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。
４．　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7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	92,727,414,724円	87,299,647,391円
同期中追加設定元本額	8,240,138,339円	11,818,303,770円
同期中一部解約元本額	13,667,905,672円	12,013,134,249円
元本の内訳		
ファンド名		

	ＤＩＡＭ外国株式パッシブ・ファンド	1,723,540,607円	1,822,423,973円
	ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	4,289,933円	3,191,830円
	ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	9,294,293円	7,279,030円
	ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	25,738,997円	18,898,552円
	グローバル８資産ラップファンド（安定型）	6,875,628円	13,544,215円
	グローバル８資産ラップファンド（中立型）	8,976,791円	10,359,460円
	グローバル８資産ラップファンド（積極型）	16,029,732円	13,818,783円
	たわらノーロード　先進国株式	3,464,692,368円	5,502,154,955円
	たわらノーロード　先進国株式＜ラップ向け＞	425,349円	424,744円
	たわらノーロード　先進国株式＜為替ヘッジあり＞	230,220,421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
	ＤＩＡＭ外国株式インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	35,942,932,402円	36,937,428,806円
	ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型	162,797,612円	157,435,724円
	ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型	862,560,792円	857,026,223円
	ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型	1,037,287,668円	1,043,554,352円
	ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド	140,609,685円	130,707,011円
	ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド	403,652,231円	385,930,973円
	ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０インデックスファンド	332,027,035円	330,441,705円

マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	36,832,323円	33,185,995円	
マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	842,667,252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	202,455,387円	187,072,304円	
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	28,341,632円	29,811,822円	
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	62,916,427円	73,885,125円	
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	119,245,111円	145,725,386円	
投資のソムリエ	745,556,085円	970,425,131円	
クルーズコントロール	828,472,858円	790,811,166円	
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	38,054,738円	61,679,304円	
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	106,638,286円	114,876,755円	
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス・Ｆ（成長型）	56,800,596円	70,873,790円	
クルーズコントロール＜ＤＣ年金＞	272,914円	275,806円	
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（堅実型）	4,112,941円	3,642,956円	
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（積極型）	10,345,941円	8,318,622円	
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	16,927,745円	27,153,058円	
ダイナミック・ナビゲーション	1,126,359円	1,144,316円	
リスク抑制世界８資産バランスファンド	173,010,152円	373,981,024円	
ワールドアセットバランス（基本コース）	217,116,974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）	455,792,253円	2,227,897,121円	
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	255,225円	517,823円	
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	255,225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	
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）	131,042,986円	95,685,592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）	3,044,620,874円	2,953,403,840円	
ＤＩＡＭ先進国株式パッシブファンド（適格機関投資家限定）	161,378,648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）	129,110,721円	208,789,234円	

ＤＩＡＭワールドバランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	27,183,643円	23,987,145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）	132,896,884円	108,709,025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）	271,266,779円	238,629,259円	
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	18,479,680円	12,888,459円	
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	119,986,899円	86,550,378円	
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	10,326,645円	7,842,084円	
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	14,871,644円	13,001,598円	
ＤＩＡＭ世界バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	43,147,185円	26,103,100円	
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	115,710,354円	69,758,648円	
ＤＩＡＭバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	675,183,876円	578,673,845円	
ＤＩＡＭバランスファンド３７．５ＶＡ（適格機関投資家限定）	813,318,475円	722,585,419円	
ＤＩＡＭバランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,529,121,106円	2,235,486,581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）	958,009,943円	794,469,102円	
ＤＩＡＭグローバル・アセット・バランスＶＡ２（適格機関投資家限定）	534,497,016円	242,322,969円	
ＤＩＡＭ　アクサ　グローバル　バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,118,385,732円	962,367,378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）	731,975,233円	499,820,780円	
ＤＩＡＭグローバルβ私募ファンド（適格機関投資家向け）	8,099,193円	2,754,975円	
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,685,356,781円	176,485,295円	

ＤＩＡＭ世界バランスファンド３５ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,161,795,649円	424,964,949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）	8,974,479,105円	8,054,309,887円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	484,609,008円	431,455,488円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,530,544,524円	1,383,217,436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）	5,744,710,526円	5,242,924,377円
ＤＩＡＭバランス３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	20,339,477円	2,048,915円
ＤＩＡＭバランス５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	6,008,433円	28,490,332円
ＤＩＡＭバランス７０ＶＡ（適格機関投資家限定）	12,714,130円	10,665,941円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド４ＶＡ（適格機関投資家限定）	7,695,764,078円	6,995,839,213円
ＤＩＡＭバランス２０ＶＡ（適格機関投資家限定）	75,131,291円	56,125,154円
ＤＩＡＭバランス４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	164,106円	12,665,761円
ＤＩＡＭバランス６０ＶＡ（適格機関投資家限定）	268,799円	257,653円
計	87,299,647,391円	87,104,816,912円
２．　受益権の総数	87,299,647,391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29年1月12日 至　平成29年7月11日	自　平成29年7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、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
３．　金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	平成29年7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 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成29年7月11日現在 当期の損益に含まれた評価差額（円）	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）
株式	9,559,918,823	38,008,423,503
投資信託受益証券	△23,772,019	21,791,655
投資証券	65,176,451	100,610,106
合計	9,601,323,255	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29年2月16日から平成29年7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7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	1,246,742,268	－	1,246,404,200	338,068	1,026,890,881	－	1,026,860,650	30,231
アメリカ・ドル	601,858,400	－	601,837,700	20,700	723,398,115	－	723,375,400	22,715
イギリス・ポンド	82,372,640	－	82,370,400	2,240	74,535,466	－	74,532,150	3,316
オーストラリア・ドル	39,957,530	－	39,966,500	△8,970	29,758,776	－	29,757,420	1,356
カナダ・ドル	33,658,348	－	33,656,600	1,748	44,107,048	－	44,104,320	2,728
シンガポール・ドル	57,834,700	－	57,715,000	119,700	－	－	－	－
スイス・フラン	130,264,640	－	130,009,000	255,640	－	－	－	－
スウェーデン・クローナ	64,315,000	－	64,362,500	△47,500	－	－	－	－
デンマーク・クローネ	20,125,000	－	20,125,000	－	－	－	－	－
ノルウェー・クローネ	14,352,450	－	14,374,500	△22,050	－	－	－	－
ユーロ	175,689,000	－	175,689,000	－	155,091,476	－	155,091,360	116
香港・ドル	26,314,560	－	26,298,000	16,560	－	－	－	－
買　建	354,307,333	－	354,246,900	△60,433	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・ポンド	45,652,646	－	45,597,900	△54,746	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	10,631,568	－	10,628,400	△3,168	17,942,835	－	17,695,080	△247,755
ユーロ	298,023,119	－	298,020,600	△2,519	60,519,960	－	60,091,240	△428,720
合計	1,601,049,601	－	1,600,651,100	277,635	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。

①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。

②計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

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

・計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。

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

３．換算において円未満の端数は切捨てております。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

株式関連

種類	平成29年7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	6,121,614,687	－	6,111,458,833	△10,155,854	7,434,733,565	－	7,609,349,267	174,615,702
合計	6,121,614,687	－	6,111,458,833	△10,155,854	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7月11日現在	平成30年1月11日現在
１口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	3.2132円 (32,132円)	3.5439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 SOFTWRE	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	
KOHLS 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	
AKAMAI 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	
SYNOPSYS 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 COMMNUCATIONS-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	
	ASHTEAD 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・シュケル	BANK HAPOALIM 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	
	SEMBCORP 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	
	DUFRY 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 INFRAESTRUCTURAS 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	
	WHEELOCK & 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・シュケル	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7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		3,697,653,943	3,717,332,670
コール・ローン		258,701,457	254,275,738
国債証券		243,466,546,609	222,177,369,816
派生商品評価勘定		178,704	2,180,614
未収入金		3,022,073,632	3,113,657,238
未収利息		2,204,545,269	2,011,358,256
前払費用		43,884,984	47,148,515
流動資産合計		252,693,584,598	231,323,322,847
資産合計		252,693,584,598	231,323,322,847
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		13,150	12,998
未払金		752,170,591	―
未払解約金		186,420,000	366,282,000
流動負債合計		938,603,741	366,294,998
負債合計		938,603,741	366,294,998
純資産の部			
元本等			
元本	※１	138,073,675,228	125,530,104,029
剰余金			
剰余金又は欠損金（△）		113,681,305,629	105,426,923,820
元本等合計		251,754,980,857	230,957,027,849
純資産合計		251,754,980,857	230,957,027,849
負債純資産合計		252,693,584,598	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	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7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	146,373,971,356円	138,073,675,228円
		同期中追加設定元本額	12,390,222,146円	10,657,505,673円
		同期中一部解約元本額	20,690,518,274円	23,201,076,872円
		元本の内訳		
	ファンド名			
		ＤＩＡＭ外国債券パッシブ・ファンド	6,394,008,052円	7,132,425,010円
		ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	21,264,586円	17,026,383円
		ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	51,949,807円	43,780,396円
		ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	62,511,106円	49,388,910円
		グローバル８資産ラップファンド（安定型）	34,079,383円	72,275,459円
		グローバル８資産ラップファンド（中立型）	50,174,065円	62,320,881円
		グローバル８資産ラップファンド（積極型）	38,935,386円	36,122,260円
		たわらノーロード　先進国債券	772,890,455円	1,355,092,120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）	－円	13,868,205円
		たわらノーロード　バランス（堅実型）	－円	71,706円

	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
	ＤＩＡＭ外国債券インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	4,860,680,068円	5,000,335,109円
	ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型	456,097,573円	465,467,784円
	ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型	1,451,719,604円	1,493,783,080円
	ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型	1,539,258,791円	1,625,017,909円
	ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド	362,589,665円	358,729,368円
	ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド	753,146,978円	770,825,404円
	ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０インデックスファンド	582,069,069円	615,670,534円
	マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	26,552,439円	23,857,963円
	マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	608,571,372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	9,824,342円	8,124,972円
	ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	14,987,322円	16,890,765円
	ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	29,362,384円	37,165,229円
	ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	52,229,210円	68,111,461円
	クルーズコントロール	3,615,161,110円	4,310,597,545円
	ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	56,103,194円	64,088,822円
	ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス・Ｆ（成長型）	84,050,180円	113,195,260円
	クルーズコントロール＜ＤＣ年金＞	1,190,273円	1,504,754円
	ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（堅実型）	14,370,949円	13,258,543円
	ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（積極型）	36,146,881円	30,164,786円
	ダイナミック・ナビゲーション	357,654円	387,823円
	ＤＩＡＭパッシブ資産分散ファンド	1,541,959,665円	1,427,367,462円

ＤＩＡＭ為替フルヘッジ型外国債券パッシブ私募ファンド（適格機関投資家向け）	6,952,797,102円	6,914,807,354円	
ＤＩＡＭ外国債券パッシブファンド（適格機関投資家向け）	5,086,116,941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）	4,111,618,848円	3,769,097,133円	
先進国債券パッシブファンド（適格機関投資家限定）	576,831,075円	576,382,992円	
ＤＩＡＭワールドバランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	110,895,583円	105,167,751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）	1,115,249,382円	980,291,866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）	758,275,994円	716,967,111円	
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	75,358,933円	56,481,829円	
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	139,718,987円	108,319,378円	
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	36,099,673円	29,458,898円	
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	12,984,839円	12,199,263円	
ＤＩＡＭ世界バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	113,090,091円	73,537,596円	
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	134,748,784円	87,294,718円	
ＤＩＡＭバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	4,131,401,816円	3,805,445,836円	
ＤＩＡＭバランスファンド３７．５ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,639,479,293円	2,520,252,961円	
ＤＩＡＭバランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	4,418,411,743円	4,197,266,896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）	838,401,421円	747,764,373円	
ＤＩＡＭグローバル・アセット・バランスＶＡ２（適格機関投資家限定）	1,096,534,309円	532,270,006円	
ＤＩＡＭ　アクサ　グローバル　バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	3,916,082,912円	3,622,086,116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）	14,096,603,439円	10,441,980,855円
ＤＩＡＭグローバルβ私募ファンド（適格機関投資家向け）	43,088,324円	13,975,529円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	986,831,415円	110,717,358円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド３５ＶＡ（適格機関投資家限定）	9,200,798,447円	3,669,493,348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）	15,678,595,378円	15,122,513,442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）	20,077,290,142円	19,692,761,593円
ＤＩＡＭバランス３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	21,316,671円	2,307,939円
ＤＩＡＭバランス５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	6,564,723円	33,620,094円
ＤＩＡＭバランス７０ＶＡ（適格機関投資家限定）	6,059,557円	5,459,009円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド４ＶＡ（適格機関投資家限定）	17,929,177,407円	17,516,462,651円
ＤＩＡＭ世界バランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	108,741,024円	106,474,190円
ＤＩＡＭバランス２０ＶＡ（適格機関投資家限定）	131,267,827円	105,797,212円
ＤＩＡＭバランス４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	238,594円	19,813,336円
ＤＩＡＭバランス６０ＶＡ（適格機関投資家限定）	156,579円	160,854円
計	138,073,675,228円	125,530,104,029円
２．　受益権の総数	138,073,675,228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29年1月12日 至　平成29年7月11日	自　平成29年7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7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 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成29年7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	△596,083,231	△1,586,668,810
合計	△596,083,231	△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29年2月22日から平成29年7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7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	2,526,161,604	－	2,525,996,050	165,554	3,566,821,676	－	3,564,654,060	2,167,616
アメリカ・ドル	1,108,490,224	－	1,108,427,830	62,394	1,585,098,722	－	1,583,921,020	1,177,702
イギリス・ポンド	147,094,000	－	147,090,000	4,000	263,487,000	－	263,480,000	7,000
オーストラリア・ドル	73,592,442	－	73,587,360	5,082	99,168,800	－	99,168,800	－
カナダ・ドル	98,052,082	－	98,046,990	5,092	65,971,220	－	65,971,220	－
スウェーデン・クローナ	－	－	－	－	65,954,060	－	65,954,060	－
メキシコ・ペソ	49,076,836	－	49,022,880	53,956	－	－	－	－
ユーロ	1,000,907,120	－	1,000,906,740	380	1,487,141,874	－	1,486,158,960	982,914
南アフリカ・ランド	48,948,900	－	48,914,250	34,650	－	－	－	－
合計	2,526,161,604	－	2,525,996,050	165,554	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。

①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。

②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。

（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7月11日現在	平成30年1月11日現在
１口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.8233円 (18,233円)	1.8399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 (4,526,537,000)	54,726,096.000 (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・リンギット	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・リンギット　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	
BUNDESOBL 0.25 10/16/20	1,000,000.000	1,021,680.000	
BUNDESOBL 0.5 04/12/19	3,100,000.000	3,145,818.000	
BUNDESOBL 04/08/22	1,700,000.000	1,720,417.000	
BUNDESOBL 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	
	ユーロ　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。

「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7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		2,490,836,127	3,319,230,119
コール・ローン		168,912,074	107,218,956
株式		45,981,585,810	56,566,691,714
投資信託受益証券		340,807,963	291,974,467
投資証券		112,116,936	112,860,012
派生商品評価勘定		8,392,310	256,498,285
未収入金		1,025,737	704,406
未収配当金		282,265,682	80,996,576
差入委託証拠金		675,669,586	1,115,971,723
流動資産合計		50,061,612,225	61,852,146,258
資産合計		50,061,612,225	61,852,146,258
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		995,427	692,746
未払金		19,635	4,986
未払解約金		18,958,000	34,717,000
流動負債合計		19,973,062	35,414,732
負債合計		19,973,062	35,414,732
純資産の部			
元本等			
元本	※１	44,737,444,562	47,332,729,770
剰余金			
剰余金又は欠損金（△）		5,304,194,601	14,484,001,756
元本等合計		50,041,639,163	61,816,731,526
純資産合計		50,041,639,163	61,816,731,526
負債純資産合計		50,061,612,225	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）

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。 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。 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。 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．　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。
４．　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7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	42,090,393,658円	44,737,444,562円
		同期中追加設定元本額	10,966,220,714円	14,002,287,139円
		同期中一部解約元本額	8,319,169,810円	11,407,001,931円
		元本の内訳		
	ファンド名			

ＤＩＡＭ新興国株式インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	2,178,754,076円	2,967,430,561円
ＤＩＡＭ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）	192,151,872円	249,749,689円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	7,466,381円	6,258,056円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	18,186,641円	16,063,826円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	21,895,403円	18,157,927円
グローバル８資産ラップファンド（安定型）	11,946,529円	26,539,962円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	17,565,953円	22,849,313円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	13,629,484円	13,271,449円
たわらノーロード　新興国株式	1,806,128,062円	3,190,937,167円
たわらノーロード　新興国株式＜ラップ向け＞	522,994,736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	469,930,799円	462,876,236円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	40,732,199円	40,575,086円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	120,195,891円	133,439,313円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	257,059,652円	298,885,378円
投資のソムリエ	3,222,414,209円	1,371,356,428円
クルーズコントロール	2,416,961,015円	2,170,535,683円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	164,563,985円	87,148,003円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	153,252,738円	157,925,647円

クルーズコントロール＜ＤＣ年金＞	696,689円	757,609円
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（堅実型）	23,987,502円	24,975,794円
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（積極型）	60,486,233円	57,019,939円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	105,554,913円	89,462,427円
ダイナミック・ナビゲーション	1,767,449円	1,743,533円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	1,081,167,527円	1,214,158,639円
ワールドアセットバランス（基本コース）	904,388,986円	1,627,105,199円
ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）	1,915,470,465円	6,091,354,580円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	734,148円	230,203円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	734,148円	230,203円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	－円	415,873円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	－円	240,421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）	5,835,758,551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）	2,132,245,988円	2,638,488,353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）	12,825,644,398円	11,082,972,525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）	8,212,977,940円	7,214,416,019円
計	44,737,444,562円	47,332,729,770円
２．　受益権の総数	44,737,444,562口	47,332,729,770口

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

項目	自　平成29年1月12日 至　平成29年7月11日	自　平成29年7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、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
３．　金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	平成29年7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 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成29年7月11日現在 当期の損益に含まれた評価差額（円）	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）
株式	2,208,717,114	9,392,239,360
投資信託受益証券	20,784,849	281,450
投資証券	3,617,682	△3,539,125
合計	2,233,119,645	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29年4月19日から平成29年7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7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	821,294,840	－	821,222,500	72,340	1,161,449,670	－	1,161,413,200	36,470
アメリカ・ドル	797,171,840	－	797,116,000	55,840	1,161,449,670	－	1,161,413,200	36,470
香港・ドル	24,123,000	－	24,106,500	16,500	－	－	－	－
買　建	138,283,000	－	138,342,580	59,580	39,578,880	－	39,233,920	△344,960
アメリカ・ドル	138,283,000	－	138,342,580	59,580	39,578,880	－	39,233,920	△344,960
合計	959,577,840	－	959,565,080	131,920	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。

①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。

②計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

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

・計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。

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

３．換算において円未満の端数は切捨てております。
※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

株式関連

種類	平成29年7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	2,750,710,574	－	2,757,975,537	7,264,963	3,403,250,998	－	3,659,365,027	256,114,029
合計	2,750,710,574	－	2,757,975,537	7,264,963	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7月11日現在	平成30年1月11日現在
１口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.1186円 (11,186円)	1.3060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	CTRIP.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・ルピア　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	
	OOREDOO 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・バーツ	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・バーツ　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・フォリント	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・フォリント　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・レアル	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・レアル	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 TELEVISA 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	
NCSOFT 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	
SIHUAN 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 HUISHAN 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	
	TAIMED 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	
	CHAILEASE 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	0.91%	-%	-%	1.01%
	投資証券	1銘柄	-%	-%	0.02%	
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・レアル	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・リンギット	株式	46銘柄	2.15%	-%	-%	2.33%
メキシコ・ペソ	株式	23銘柄	2.08%	-%	-%	2.84%
	投資信託受益証券	2銘柄	-%	0.47%	-%	
	投資証券	1銘柄	-%	-%	0.06%	
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	6.18%	-%	-%	6.81%
	投資証券	2銘柄	-%	-%	0.10%	

(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7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		2,743,713,216	2,451,465,696
コール・ローン		95,513,339	395,982,514
国債証券		92,763,068,659	98,971,707,355
派生商品評価勘定		71,100	―
未収入金		―	418,714,761
未収利息		1,340,424,208	1,507,428,223
前払費用		261,933,792	95,331,659
流動資産合計		97,204,724,314	103,840,630,208
資産合計		97,204,724,314	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		231,633,591	602,479,744
未払解約金		24,098,000	68,895,000
流動負債合計		255,731,591	673,931,544
負債合計		255,731,591	673,931,544
純資産の部			
元本等			
元本	※１	51,535,631,842	54,256,447,518
剰余金			
剰余金又は欠損金（△）		45,413,360,881	48,910,251,146
元本等合計		96,948,992,723	103,166,698,664
純資産合計		96,948,992,723	103,166,698,664
負債純資産合計		97,204,724,314	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7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	34,034,697,085円	51,535,631,842円
同期中追加設定元本額	24,799,810,371円	11,524,225,338円
同期中一部解約元本額	7,298,875,614円	8,803,409,662円
元本の内訳		
ファンド名		
ＤＩＡＭ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）	162,717,269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	77,504,014円	75,944,530円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	24,163,020円	27,320,395円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	70,957,604円	90,077,700円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	152,040,199円	200,732,596円
投資のソムリエ	4,107,030,378円	5,386,829,880円
クルーズコントロール	1,367,148,340円	1,391,418,497円

	投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	209,788,209円	341,339,293円
	ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	90,528,248円	103,835,053円
	クルーズコントロール＜ＤＣ年金＞	450,343円	485,809円
	ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（堅実型）	6,785,171円	6,404,568円
	ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（積極型）	17,089,532円	14,622,181円
	投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	62,149,758円	137,701,694円
	ダイナミック・ナビゲーション	172,264円	188,968円
	リスク抑制世界８資産バランスファンド	636,779,072円	1,912,437,568円
	ワールドアセットバランス（基本コース）	367,568,621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）	771,903,890円	2,707,059,809円
	投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	807,798円	802,092円
	投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	807,798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）	15,959,293,077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）	3,377,799,990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）	7,590,587,891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）	4,858,868,638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）	3,739,653,302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）	4,657,598,002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）	3,225,439,414円	3,225,439,414円
計		51,535,631,842円	54,256,447,518円
２．	受益権の総数	51,535,631,842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29年1月12日 至　平成29年7月11日	自　平成29年7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7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 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成29年7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	△757,915,371	248,212,144
合計	△757,915,371	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29年4月19日から平成29年7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7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	765,193,600	－	765,140,000	53,600	980,663,200	－	980,672,000	△8,800
アメリカ・ドル	765,193,600	－	765,140,000	53,600	980,663,200	－	980,672,000	△8,800
買　建	39,956,000	－	39,973,500	17,500	292,344,000	－	289,796,000	△2,548,000
アメリカ・ドル	39,956,000	－	39,973,500	17,500	292,344,000	－	289,796,000	△2,548,000
合計	805,149,600	－	805,113,500	71,100	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。

①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。

②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。

（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7月11日現在	平成30年1月11日現在
１口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.8812円 (18,812円)	1.9015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。

２【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

平成30年1月31日現在

Ⅰ　資産総額	10,330,140円
Ⅱ　負債総額	6,663円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	10,323,477円
Ⅳ　発行済数量	9,646,147口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.0702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1月31日現在

Ⅰ　資産総額	309,608,121,471円
Ⅱ　負債総額	2,099,697,624円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	307,508,423,847円
Ⅳ　発行済数量	110,839,656,353口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.7744円

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年1月31日現在

Ⅰ　資産総額	361,382,140,588円
Ⅱ　負債総額	2,031,561,400円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	359,350,579,188円
Ⅳ　発行済数量	280,079,601,997口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.2830円

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年1月31日現在

Ⅰ　資産総額	311,084,701,274円
Ⅱ　負債総額	962,959,602円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	310,121,741,672円
Ⅳ　発行済数量	87,304,515,219口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	3.5522円

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年1月31日現在

Ⅰ　資産総額	228,937,325,415円
Ⅱ　負債総額	1,852,440,945円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	227,084,884,470円
Ⅳ　発行済数量	124,372,829,627口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.8258円

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

平成30年1月31日現在

Ⅰ　資産総額	62,708,130,768円
Ⅱ　負債総額	611,407,684円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	62,096,723,084円
Ⅳ　発行済数量	46,813,675,003口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.3265円

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

平成30年1月31日現在

Ⅰ　資産総額	105,107,981,527円
Ⅱ　負債総額	1,426,377,880円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	103,681,603,647円
Ⅳ　発行済数量	56,171,096,910口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.8458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。

①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。

②上記①の申請のある場合には、上記①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①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。

③上記①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た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1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1月31日現在）

①　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。

②　投資運用の意思決定機構

1.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。

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1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	1,299,472,617,932
追加型株式投資信託	859	12,649,025,738,391
単位型公社債投資信託	56	241,415,731,544
単位型株式投資信託	137	918,410,032,886
合計	1,090	15,108,324,120,753

３【委託会社等の経理状況】

１．委託会社であるアセットマネジメントOne株式会社（以下「委託会社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。
また、中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）、ならびに同規則第38条及び第57条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。

２．財務諸表及び中間財務諸表の金額は、千円未満の端数を切り捨てて記載しております。

３．委託会社は、第32期事業年度（自平成28年4月1日至平成29年3月31日）の財務諸表について、新日本有限責任監査法人の監査を受け、第33期中間会計期間（自平成29年4月1日至平成29年9月30日）の中間財務諸表について、新日本有限責任監査法人の中間監査を受けております。

（１）【貸借対照表】

（単位：千円）

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

（単位：千円）

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

（２）【損益計算書】

（単位：千円）

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

（単位：千円）

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

（３）【株主資本等変動計算書】

第31期（自平成27年4月1日至平成28年3月31日）

（単位：千円）

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

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

第32期（自平成28年4月1日至平成29年3月31日）

（単位：千円）

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

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

重要な会計方針

1．有価証券の評価基準及び評価方法	(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 (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
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	(1) 有形固定資産 定率法によっております。 ただし、平成28年4月1日以降に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。 (2) 無形固定資産 定額法によっております。 なお、自社利用のソフトウエアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。
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	(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。 (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。 (3) 退職給付引当金は、従業員の退職給付に備えるため、退職一時金制度及び確定給付型企業年金制度（キャッシュバランス型）について、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき計上しております。 ①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。 ②数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 過去勤務費用については、その発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年または10年）による定額法により按分した額を費用処理しております。 数理計算上の差異については、各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年または10年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌事業年度から費用処理しております。 なお、一部の確定給付企業年金制度については、退職給付引当金及び退職給付費用の計算に、退職給付に係る期末自己都合要支給額を退職給付債務とする方法を用いた簡便法を適用しております。 (4) 役員退職慰労引当金は、役員の退職慰労金の支払に備えるため、内規に基づく期末要支給額を計上しております。 (5) 時効後支払損引当金は、時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。 (6) 本社移転費用引当金は、本社移転に関連して発生する損失に備えるため、発生すると見込まれる額を計上しております。 なお、本社移転費用引当金繰入額は、本社移転費用に含めて表示しております。
6．消費税等の会計処理	消費税及び地方消費税の会計処理は税抜き方式によっております。

会計方針の変更

第32期　（自平成28年4月1日 至平成29年3月31日）
法人税法の改正に伴い、「平成28年度税制改正に係る減価償却方法の変更に関する実務上の取扱い」（実務対応報告第32号　平成28年6月17日）を当事業年度に適用し、平成28年4月1日以後に取得した建物附属設備に係る減価償却方法を定率法から定額法に変更しております。 この結果、当事業年度の営業利益、経常利益及び税引前当期純利益はそれぞれ42,532千円増加しております。

追加情報

第32期　（自平成28年4月1日 至平成29年3月31日）
1. 「繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第26号　平成28年3月28日）を当事業年度から適用しております。 2. 当社は、平成28年9月7日開催の臨時株主総会において、退任となる取締役及び監査役に対して、在任中の労に報いるため、当社所定の基準による相当額の範囲内で役員退職慰労金を支給することを決議しました。 これに伴い、当事業年度末日までに217,608千円を支給し、役員退職慰労引当金全額を取り崩しております。

注記事項

（貸借対照表関係）

※1. 有形固定資産の減価償却累計額

（千円）

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

（損益計算書関係）

※1. 関係会社項目

各科目に含まれている関係会社に対する営業外収益は、次のとおりであります。

（千円）

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

※2. 固定資産売却益の内訳

（千円）

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

※3. 固定資産除却損の内訳

（千円）

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

※4. 固定資産売却損の内訳

（千円）

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

※5. 本社移転費用の内訳

（千円）

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

（株主資本等変動計算書関係）

第31期（自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

（1）配当金支払額

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

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

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

第32期（自平成28年4月1日 至平成29年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

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

2. 配当に関する事項

（1）配当金支払額

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

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

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

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

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

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、株価指数先物取引及び債券先物取引）を利用して一部リスクを低減しております。

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

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

①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。

②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。

③資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

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

（4）金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。
なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは含まれておりません（（注2）参照）。

第31期（平成28年3月31日現在）

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

第32期（平成29年3月31日現在）

	貸借対照表計上額（千円）	時価（千円）	差額（千円）
（1）現金・預金	27,972,477	27,972,477	―
（2）金銭の信託	12,366,219	12,366,219	―
（3）未収委託者報酬	10,164,041	10,164,041	―
（4）未収運用受託報酬	7,250,239	7,250,239	―
（5）有価証券及び投資有価証券 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	―

（注1）金融商品の時価の算定方法

資　産

（1）現金・預金

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

（2）金銭の信託

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

（3）未収委託者報酬及び（4）未収運用受託報酬

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

（5）有価証券及び投資有価証券

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

負　債

（1）未払手数料

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

（注2）時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

（千円）

区分	第31期 （平成28年3月31日現在）	第32期 （平成29年3月31日現在）
①非上場株式	77,696	337,468
②関係会社株式	3,229,196	3,306,296

①非上場株式は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券」には含めておりません。
②関係会社株式は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載しておりません。

（注3）金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第31期（平成28年3月31日現在）

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

第32期（平成29年3月31日現在）

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

（有価証券関係）

1．子会社株式及び関連会社株式

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

2．その他有価証券

第31期（平成28年3月31日現在）

（千円）

区分	貸借対照表日における貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
①株式	365,683	146,101	219,581
②投資信託	15,322	13,000	2,322
小計	381,005	159,101	221,903
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
①株式	―	―	―
②投資信託	―	―	―
小計	―	―	―
合計	381,005	159,101	221,903

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

第32期（平成29年3月31日現在）

（千円）

区分	貸借対照表日における貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
①株式	609,710	146,101	463,608
②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			
①株式	―	―	―
②投資信託	231,889	241,951	△10,061
小計	231,889	241,951	△10,061
合計	3,225,878	2,479,440	746,438

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

3. 当該事業年度中に売却したその他有価証券

第31期（自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）

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

第32期（自平成28年4月1日 至平成29年3月31日）

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

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

4. 減損処理を行った有価証券

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

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

（退職給付関係）

1. 採用している退職給付制度の概要

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

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

2. 確定給付制度（複数事業主制度を含む）

（1）退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

（千円）

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

（2）年金資産の期首残高と期末残高の調整表

（千円）

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

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

（千円）

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

（4）退職給付費用及びその内訳項目の金額

（千円）

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

（5）年金資産に関する事項

①年金資産の主な内訳

年金資産合計に対する主な分類ごとの比率は、次のとおりであります。

（千円）

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

②長期期待運用収益率の設定方法

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

（6）数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎

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

3.簡便法を適用した確定給付制度

（1）簡便法を適用した制度の、退職給付引当金の期首残高と期末残高の調整表

（千円）

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

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

（千円）

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

（3）退職給付費用

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

4. 確定拠出制度

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

（税効果会計関係）

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主要な項目別の内訳

法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため、注記を省略しております。

（企業結合等関係）

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

1. 結合当事企業

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

2. 企業結合日

平成28年10月1日

3. 企業結合の方法

①MHAM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、②TB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、③DIAM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」③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」③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A種種類株式15,510株を交付しました。

8. 経済的持分比率（議決権比率）

MHFGが企業結合直前に所有していた当社に対する経済的持分比率　50.00%
MHFGが企業結合日に追加取得した当社に対する経済的持分比率　20.00%
MHFGの追加取得後の当社に対する経済的持分比率　70.00%
なお、MHFGが所有する議決権比率については50.00%から51.00%に異動しております。

9. 取得企業を決定するに至った主な根拠

「3. 企業結合の方法」③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」①の吸収合併及び②の吸収分割については共通支配下の取引として処理し、③の吸収合併については逆取得として処理しております。

11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

（1）財務諸表に含まれる被取得企業の業績の期間

平成28年10月1日から平成29年3月31日まで

（2）被取得企業の取得原価及びその内訳

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

（3）発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

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

（4）企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

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

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

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

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

12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

（1）貸借対照表項目

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

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

（2）損益計算書項目

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

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

（資産除去債務関係）

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

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

（セグメント情報等）

1. セグメント情報

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

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

（1）サービスごとの情報

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

（2）地域ごとの情報

①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。

②有形固定資産

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

（3）主要な顧客ごとの情報

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

（関連当事者情報）

１．関連当事者との取引

（1）親会社及び法人主要株主等

第31期（自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）

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

第32期（自平成28年4月1日 至平成29年3月31日）

該当はありません。

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

（2）子会社及び関連会社等

第31期（自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）

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

第32期（自平成28年4月1日 至平成29年3月31日）

該当はありません。

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

（注3）増資の引受は、子会社が行った増資を引き受けたものであります。

（3）兄弟会社等

第31期（自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関係内容		取引の内容	取引金額（千円）	科目	期末残高（千円）
						役員の兼任等	事業上の関係				
その他の関係会社の子会社	株式会社みずほ銀行	東京都千代田区	14,040億円	銀行業	―	兼務1名	当社設定投資信託の販売	投資信託の販売代行手数料	3,023,040	未払手数料	372,837
	みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社	東京都千代田区	2億円	金融技術研究等	―	兼務1名	当社預り資産の助言 金融技術の開発業務委託	当社預り資産の助言の顧問料の支払 業務委託料の支払	557,013 8,540	未払費用 未払金	292,861 7,581
	資産管理サービス信託銀行株式会社	東京都中央区	500億円	資産管理等	―	―	当社信託財産の運用	信託元本の払戻（純額） 信託報酬の支払	700,000 8,336	金銭の信託	13,094,914

第32期（自平成28年4月1日 至平成29年3月31日）

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1）投資信託の販売代行手数料は、一般的取引条件を勘案した個別契約により決定しております。

(注2）当社預り資産の助言の顧問料は、一般的取引条件を勘案した個別契約により決定しております。

(注3）業務委託料は、一般的取引条件を勘案した個別契約により決定しております。

(注4）信託報酬は、一般的取引条件を勘案した料率が適用されております。

(注5）運用受託報酬は、一般的取引条件を勘案した個別契約により決定しております。

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

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

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

(単位：千円)

株式会社みずほ証券リサーチ＆コンサルティング

	前事業年度	当事業年度
流動資産合計	―	7,449,532
固定資産合計	―	124,292
流動負債合計	―	1,665,547
固定負債合計	―	114,110
純資産合計	―	5,794,167
営業収益	―	1,093,658
税引前当期純利益	―	5,546,153
当期純利益	―	3,891,816

（1株当たり情報）

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

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

（注2）1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

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

（重要な後発事象）

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

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

(1) 中間貸借対照表

（単位：千円）

		第33期中間会計期間末 （平成29年9月30日現在）
（資産の部）		
流動資産		
現金・預金		38,311,736
金銭の信託		12,187,115
有価証券		10,007
未収委託者報酬		10,291,857
未収運用受託報酬		4,862,664
未収投資助言報酬		324,278
未収収益		55,950
前払費用		764,943
繰延税金資産		727,622
その他		498,289
流動資産計		68,034,465
固定資産		
有形固定資産		1,782,018
建物	※1	1,200,157
器具備品	※1	573,952
建設仮勘定		7,907
無形固定資産		1,557,565
ソフトウエア		1,050,789
ソフトウエア仮勘定		502,759
電話加入権		3,934
電信電話専用施設利用権		81
投資その他の資産		7,742,187
投資有価証券		1,939,084
関係会社株式		3,229,196
長期差入保証金		1,566,055
繰延税金資産		906,695
その他		101,155
固定資産計		11,081,771
資産合計		79,116,236

（単位：千円）

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

(2) 中間損益計算書

（単位：千円）

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

（単位：千円）

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

(3) 中間株主資本等変動計算書

第33期中間会計期間（自平成29年4月1日至平成29年9月30日）

（単位：千円）

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

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

重要な会計方針

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

５．引当金の計上基準	(1) 賞与引当金は、従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当中間会計期間に見合う分を計上しております。 (2) 役員賞与引当金は、役員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当中間会計期間に見合う分を計上しております。 (3) 退職給付引当金は、従業員の退職給付に備えるため、退職一時金制度及び確定給付型企業年金制度（キャッシュバランス型）について、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。 ①退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。 ②数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 過去勤務費用については、その発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年または10年）による定額法により按分した額を費用処理しております。 数理計算上の差異については、各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年または10年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌事業年度から費用処理しております。 なお、一部の確定給付企業年金制度については、退職給付引当金及び退職給付費用の計算に、退職給付に係る中間期末自己都合要支給額を退職給付債務とする方法を用いた簡便法を適用しております。 (4) 時効後支払損引当金は、時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。 (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。
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期中間会計期間 （自平成29年4月1日 至平成29年9月30日）
当社は、当中間会計期間においてシステム統合計画を決定したことに伴い、利用不能となる固定資産について耐用年数を短縮し、将来にわたり変更しております。 これにより、従来の方法と比べて、当中間会計期間の減価償却費が286,788千円増加し、営業利益、経常利益及び税引前中間純利益はそれぞれ同額減少しております。

追加情報

第33期中間会計期間 （自平成29年4月1日 至平成29年9月30日）

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

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

注記事項

（中間貸借対照表関係）

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

（中間損益計算書関係）

項目	第33期中間会計期間 （自平成29年4月1日 至平成29年9月30日）
※１．減価償却実施額	有形固定資産 … 142,272千円 無形固定資産 … 578,697千円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第33期中間会計期間（自平成29年4月1日 至平成29年9月30日）

１．発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

２．配当に関する事項

（1）配当金支払額

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

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

該当事項はありません。

（金融商品関係）

第33期中間会計期間末（平成29年9月30日現在）

金融商品の時価等に関する事項

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

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

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

（注1）金融商品の時価の算定方法

資　産

（1）現金・預金

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

（2）金銭の信託

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

（3）未収委託者報酬及び（4）未収運用受託報酬

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

（5）有価証券及び投資有価証券

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

負　債

（1）未払手数料

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

（注2）時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

区分	中間貸借対照表計上額 （千円）
①非上場株式	307,968
②関係会社株式	3,229,196

①非上場株式は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(5) 有価証券及び投資有価証券　その他有価証券」には含めておりません。

②関係会社株式は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載しておりません。

（有価証券関係）

第33期中間会計期間末
（平成29年9月30日現在）

１．子会社株式

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

２．その他有価証券

区　分	中間貸借対照表 計上額（千円）	取得原価 （千円）	差額 （千円）
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
①株式	1,189,247	146,101	1,043,145
②投資信託	423,152	385,910	37,242
小計	1,612,400	532,011	1,080,388
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
①株式	―	―	―
②投資信託	28,723	30,967	△2,244
小計	28,723	30,967	△2,244
合計	1,641,123	562,979	1,078,144

（注）非上場株式（中間貸借対照表計上額307,968千円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

（企業結合等関係）

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

1. 結合当事企業

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

2. 企業結合日
平成28年10月1日

3. 企業結合の方法
①MHAM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、②TB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、③DIAM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」③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」③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A種種類株式15,510株を交付しました。

8. 経済的持分比率（議決権比率）
MHFGが企業結合直前に所有していた当社に対する経済的持分比率　50.00%
MHFGが企業結合日に追加取得した当社に対する経済的持分比率　20.00%
MHFGの追加取得後の当社に対する経済的持分比率　70.00%
なお、MHFGが所有する議決権比率については50.00%から51.00%に異動しております。

9. 取得企業を決定するに至った主な根拠
「3. 企業結合の方法」③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」①の吸収合併及び②の吸収分割については共通支配下の取引として処理し、③の吸収合併については逆取得として処理しております。

11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

（1）中間財務諸表に含まれる被取得企業の業績の期間

平成29年4月1日から平成29年9月30日まで

（2）被取得企業の取得原価及びその内訳

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

（3）発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

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

（4）企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

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

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

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

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

12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

（1）貸借対照表項目

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

（注）固定資産及び資産合計には、のれんの金額72,413,595千円及び顧客関連資産の金額47,817,519千円が含まれております。

（2）損益計算書項目

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

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

（資産除去債務関係）

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

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

（セグメント情報等）

第33期中間会計期間（自平成29年4月1日 至平成29年9月30日）

１．セグメント情報

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

２．関連情報

（１）サービスごとの情報

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

（２）地域ごとの情報

①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。

②有形固定資産

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

（３）主要な顧客ごとの情報

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

（1株当たり情報）

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

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

1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

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

4【利害関係人との取引制限】

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

(1) 自己またはその取締役もしくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。

(2) 運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。

(3) 通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下（4）（5）において同じ。）または子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引または店頭デリバティブ取引を行うこと。

(4) 委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。

(5) 上記（3）（4）に掲げるもののほか、委託会社の親法人等または子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

5【その他】

(1) 定款の変更、事業譲渡又は事業譲受、出資の状況その他の重要事項

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

(2) 訴訟事件その他の重要事項

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

第２【その他の関係法人の概況】

１【名称、資本金の額及び事業の内容】

（1）受託会社

ａ．名称

みずほ信託銀行株式会社

ｂ．資本金の額

平成29年3月末現在　　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ＳＢＩ証券	48,323	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。

（注）資本金の額は平成29年3月末現在

（3）投資顧問会社

ａ．名称

みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社

ｂ．資本金の額

平成29年3月末現在　　200百万円

ｃ．事業の内容

日本において投資顧問業務を営んでいます。

２【関係業務の概要】

「受託会社」は、以下の業務を行います。

(1)委託会社の指図に基づく信託財産の管理、保管、処分

(2)信託財産の計算

(3)信託財産に関する報告書の作成

(4)その他上記に付帯する業務

「販売会社」は、以下の業務を行います。

(1)募集の取扱い

(2)追加設定の申込事務

(3)信託契約の一部解約事務

(4)受益者に対する一部解約金および償還金の支払い

(5)受益者に対する収益分配金の再投資

(6)受益者に対する投資信託説明書（目論見書）および運用報告書の交付

(7)その他上記に付帯する業務

「投資顧問会社」は、以下の業務を行います。

みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社は委託会社との投資顧問契約に基づき、当ファンドの信託財産の運用指図等について助言を行います。

３【資本関係】

該当事項はありません。

※持株比率5%以上を記載します。

第３【その他】

(1)目論見書の表紙等にロゴ・マークや図案を使用し、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 ①基準価額・純資産の推移 ②分配の推移 ③主要な資産の状況 ④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２９年６月７日

アセットマネジメントOne株式会社
取　締　役　会　御　中

新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　湯原　尚　印

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　山野　浩　印

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、アセットマネジメントOne株式会社の平成２９年３月３１日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

（注１）上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
（注２）ＸＢＲＬ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
業 務 執 行 社 員　公認会計士　佐々木　貴　司　印

指定有限責任社員
業 務 執 行 社 員　公認会計士　鶴　田　光　夫　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、「ファンドの経理状況」に掲げられているクルーズコントロール＜ＤＣ年金＞の平成29年７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、クルーズコントロール＜ＤＣ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２９年１１月２４日

アセットマネジメントOne株式会社
取　締　役　会　御　中

新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　湯原　尚　印

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　山野　浩　印

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

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

利害関係

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

以上

（注１）上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
（注２）ＸＢＲＬデータは中間監査の対象には含まれておりません。