

【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7月11日
【発行者名】	アセットマネジメントOne株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 菅野 暁
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目8番2号
【事務連絡者氏名】	三木谷 正直
【電話番号】	03-6774-5100
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	D I A Mコア資産設計ファンド（堅実型） D I A Mコア資産設計ファンド（積極型）
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】	D I A Mコア資産設計ファンド（堅実型） 5,000億円を上限とします。 D I A Mコア資産設計ファンド（積極型） 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】

DIAMコア資産設計ファンド（堅実型）

DIAMコア資産設計ファンド（積極型）

（以下、総称して「DIAMコア資産設計ファンド」、「DIAMコア資産設計ファンド（堅実型／積極型）」または「ファンド」という場合、あるいは個別に「各ファンド」という場合があります。また、「DIAMコア資産設計ファンド（堅実型）」は「（堅実型）」、「DIAMコア資産設計ファンド（積極型）」は「（積極型）」という場合があります。

各ファンドを総称した愛称として「まもラップ」または「まもラップ（堅実型／積極型）」という名称を用いる場合があります。また、「DIAMコア資産設計ファンド（堅実型）」の愛称として「まもラップ（堅実型）」、「DIAMコア資産設計ファンド（積極型）」の愛称として「まもラップ（積極型）」という名称を用いる場合があります。）

（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】

各ファンドにつき、5,000億円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

お申込日の翌営業日の基準価額 とします。

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

「基準価額」とは、純資産総額（ファンドの資産総額から負債総額を控除した金額）を計算日の受益権総口数で除した価額をいいます。（ただし、便宜上1万口あたりに換算した基準価額で表示することがあります。）

< 基準価額の照会方法等 >

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

各ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・ 販売会社へのお問い合わせ
- ・ 委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

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

（ 5 ） 【 申込手数料 】

お申込日の翌営業日の基準価額に、3.24%（税抜3.00%）を上限に各販売会社が定める手数料率を乗じて得た額とします。

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

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

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

（ 6 ） 【 申込単位 】

各販売会社が定める単位とします。

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

取扱コースおよびお申込単位は、販売会社にお問い合わせください。

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

当初元本は1口当たり1円です。

（ 7 ） 【 申込期間 】

継続申込期間：平成30年7月12日から平成31年1月11日まで

取得またはスイッチングの申込日が、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、取得またはスイッチングの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

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

（ 9 ） 【払込期日】

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

（ 1 0 ） 【払込取扱場所】

取得申込者は、販売会社の定める方法により、販売会社に買付代金を支払うものとします。払込取扱場所についてご不明な点は、以下の方法でご確認ください。

- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

（ 1 1 ） 【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

（ 1 2 ） 【その他】

お申込みの際は、販売会社所定の方法でお申込みください。

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

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

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、海外休業日には取得またはスイッチングの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（スイッチングのお申込みを含みます。）の受付を中止することおよびすでに受付けたお申込み（スイッチングのお申込みを含みます。）の受付を取り消すことができるものとします。

受益権の取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時にまたはあらかじめ、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、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。

<スイッチング>

(堅実型)(積極型)の2つのファンド間でスイッチングができます。スイッチングとは、すでに保有しているファンドを解約すると同時に他のファンドの取得の申込みを行うことをいい、ファンドの解約代金が買付代金に充当されます。

スイッチングの際には、税金および各販売会社が定めるお申込手数料がかかる場合があります。

販売会社によっては、スイッチングの取扱いを行わない場合があります。くわしくは販売会社にお問い合わせ下さい。

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】

各ファンドは、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。

各ファンドの信託金限度額は、各々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。

- 主として、日本、先進国および新興国の債券・株式にマザーファンドを通じて実質的に投資します。マザーファンドのほか、有価証券指数等先物取引等、上場投資信託証券(ETF)、短期金融資産等へ投資する場合があります。
- 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。
- 6資産の配分比率(以下、基本配分比率とします。)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、基本配分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の獲得をめざし、資産価値下落時には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。
 - 基準価額の水準や市場環境等に応じて、投資対象である6資産合計の投資比率(以下、合計資産比率とします。)を機動的に変更します。
 - 下値目安値は、3ヵ月毎に改定します(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)。
- (*)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。)

3 下値目安値の異なる堅実型と積極型から選択できます。なお、2ファンド間でスイッチングが可能です。

- 各ファンドの下値目安値は、以下の通りとします。ただし、委託会社の判断により今後変更する場合があります。
(堅実型)改定日の基準価額の-2.5%
(積極型)改定日の基準価額の-3.5%
- ※スイッチング時には、税金、購入時手数料がかかる場合があります。販売会社によっては、スイッチングの取扱いを行わない場合があります。くわしくは販売会社にお問い合わせください。
- ※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。

分配方針

年2回の決算時(毎年4月、10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

各ファンド

単位型投信 追加型投信	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)
単位型投信	国内	株式 債券
追加型投信	海外	不動産投信
	内外	その他資産 () 資産複合

(注) 各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

各ファンド

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ
株式 一般 大型株 中小型株	年1回 年2回 年4回	グローバル (日本を含む) 日本		
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ()	年6回 (隔月) 年12回 (毎月)	北米 欧州 アジア オセアニア	ファミリー ファンド	あり ()
不動産投信 その他資産 ()	日々 その他 ()	中南米 アフリカ 中近東 (中東)	ファンド・オ ブ・ファンズ	なし
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		エマージング		

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) 各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。

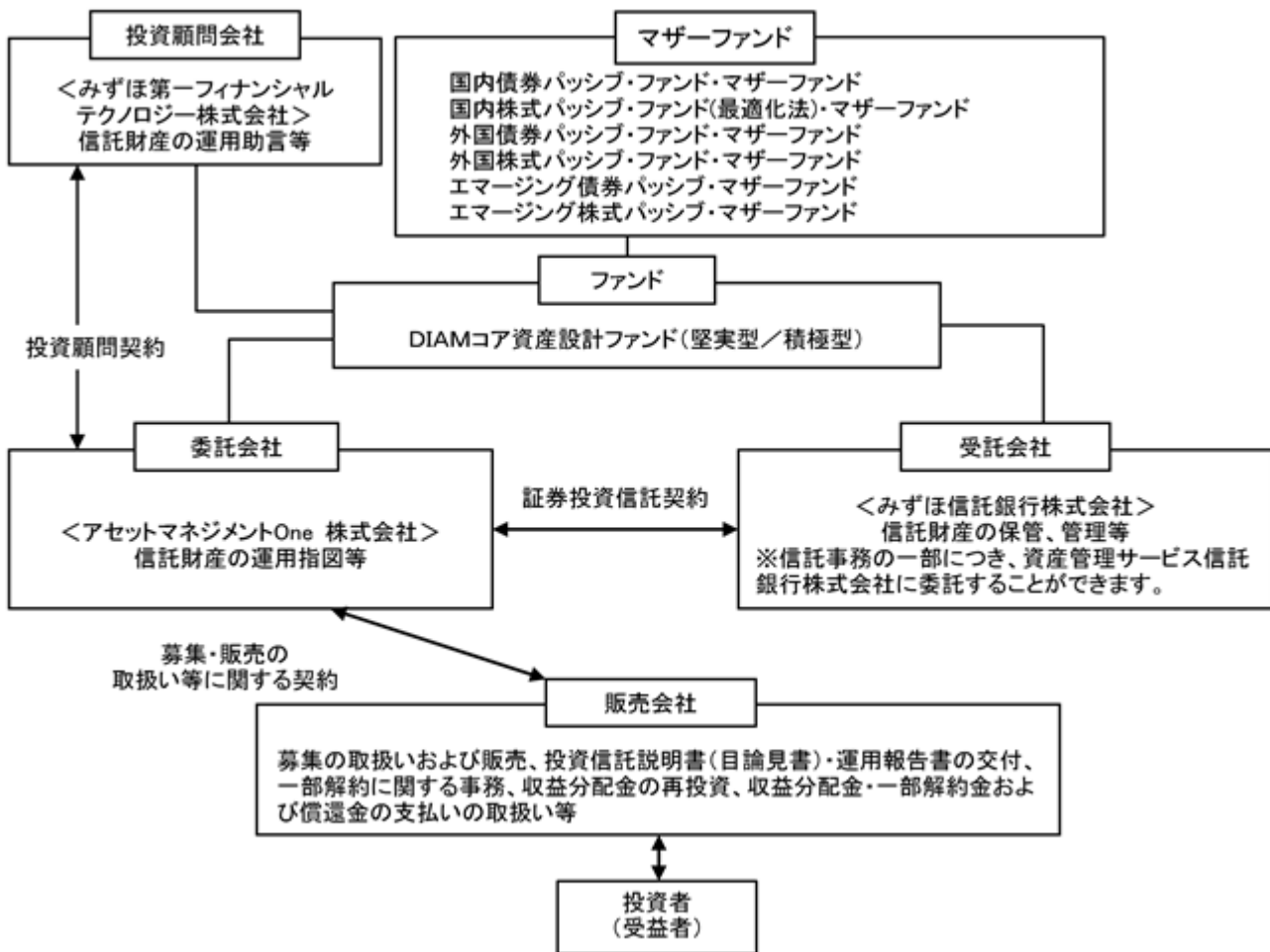
上記の分類は、一般社団法人投資信託協会の商品分類に関する指針に基づき記載しております。

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27年8月28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、各ファンドにかかる証券投資信託契約を締結しております。

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

・「募集・販売の取扱い等に関する契約」の概要

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

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

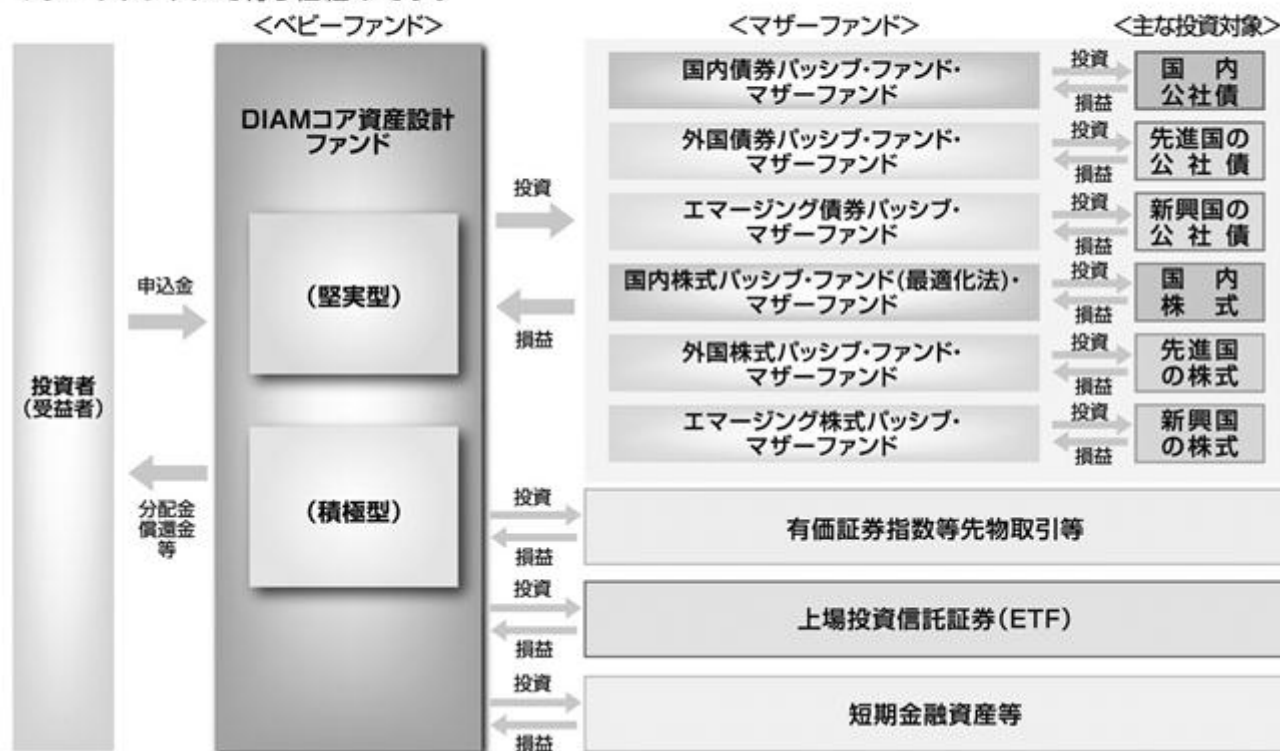
・「投資顧問契約」の概要

委託会社と投資顧問会社(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、各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

各ファンドは「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(各ファンド)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One株式会社

本店の所在の場所：東京都千代田区丸の内一丁目8番2号

資本金の額

20億円（平成30年4月27日現在）

委託会社の沿革

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

大株主の状況

（平成30年4月27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>

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、上場投資信託証券（ETF）、短期金融資産等に投資する場合があります。

<投資態度>

以下のマザーファンド受益証券（以下、それぞれを「各マザーファンド」、または総称して「マザーファンド」ということがあります。）への投資を通じて、日本、先進国および新興国の債券・株式の6資産に実質的に分散投資を行います。マザーファンドのほか、有価証券指数等先物取引等、上場投資信託証券（ETF）、短期金融資産等（*）に投資する場合があります。

（*）市場環境によっては、残存期間3年以下の債券に投資することがあります。

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

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。

6資産の配分比率（以下、基本配分比率とします。）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、基本配分比率の見直しを行うことがあります。

基準価額の水準や市場環境等に応じて、投資対象である6資産合計の投資比率(以下、合計資産比率といいます。)を機動的に変更することで、資産価値上昇時には値上がり益の獲得をめざし、資産価値下落時には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めざします。なお、下値目安値は、3ヵ月毎に改定します。

(*)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。)。

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。

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97.5%((堅実型) の場合) もしくは96.5%((積極型) の場合) 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】

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

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・マザーファンドの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、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。)、新株予約権証券および新投資口予約権証券
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せん。)
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せん。)

21. 抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)
22. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
23. 外国の者に対する権利で22.の有価証券の性質を有するもの

なお、1.の証券または証書、13.および18.の証券または証書のうち1.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、2.から7.までの証券ならびに13.および18.の証券または証書のうち2.から7.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、14.の証券および15.の証券を以下「投資信託証券」といいます。

運用の指図範囲等(約款第17条第2項)

委託会社は、信託金を、上記に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。)により運用すること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）各ファンドが投資対象とするマザーファンドの概要

ファンド名	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、NOMURA - B P I 総合に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主な投資対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	<p>1.主としてわが国の公社債に投資し、「NOMURA - B P I 総合」 に連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
	<p>NOMURA - B P I 総合の知的財産権その他一切の権利は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。</p>
運用プロセス	<p>1.流動性基準等による対象銘柄群設定 NOMURA - B P I 総合構成銘柄のうち、流動性基準等を勘案して投資対象銘柄群を設定します。</p> <p>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。</p> <p>3.インデックスとの乖離を管理 日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。 インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。 ・年限構成変化要因 ・指数構成銘柄変更 ・リスク量の変更 ・クーポン、償還再投資</p>

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

運用プロセス

1.流動性基準による対象銘柄群設定

マーケットインパクトの低減を図る為、TOPIX採用銘柄のうち、流動性が低い銘柄を除外して投資対象銘柄群を設定します。

2.最適化法によるポートフォリオの構築

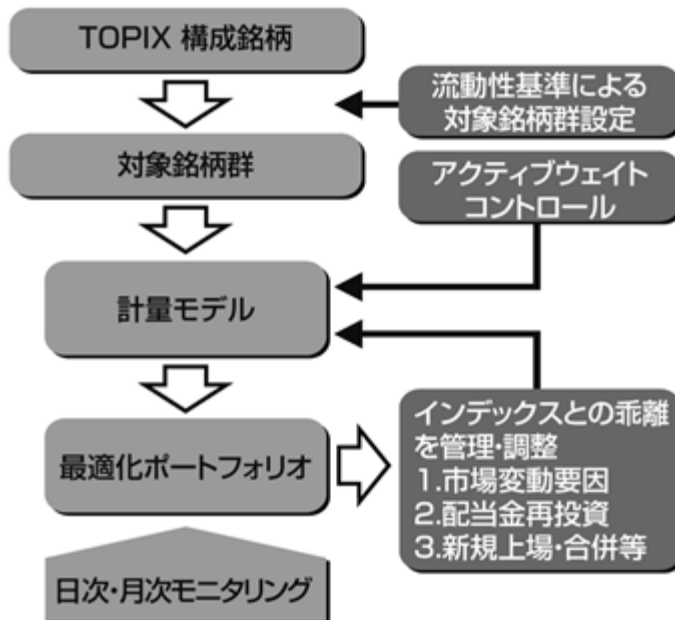
インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差(アクティブウェイト)を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。

3.インデックスとの乖離を管理

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

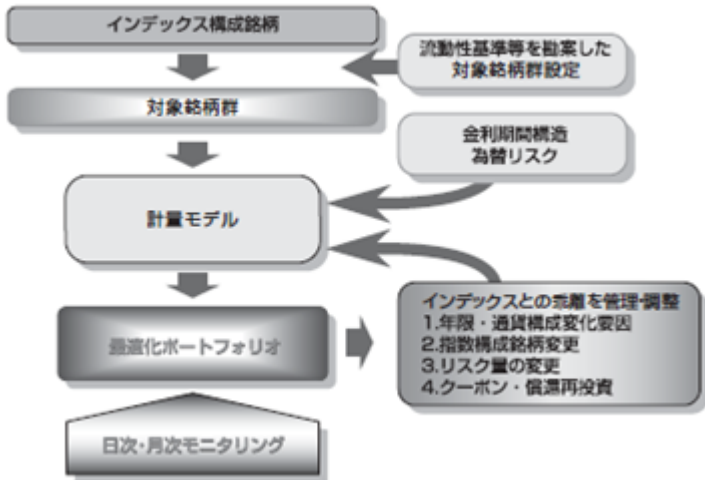
インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。

- ・市場変動に伴うもの：推定トラッキングエラーの増加に伴い実施
- ・新規上場、合併等に伴うもの：指数に与える影響を勘案し、決定
- ・配当金再投資に伴うもの：キャッシュ比率の上昇に伴い実施



主な投資制限	<ol style="list-style-type: none"> 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	<ol style="list-style-type: none"> 1. 主に日本を除く世界主要国の公社債に投資し、「FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）」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。 <div style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin-top: 10px;"> <p>FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。</p> <p>このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。</p> </div>

運用プロセス	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>3.インデックスとの乖離を管理 日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理して、必要な場合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。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・ 年限・通貨構成変化要因 ・ 指数構成銘柄変更 ・ リスク量の変更 ・ クーポン・償還再投資 
主な投資制限	<p>1. 株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限りします。 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。</p> <p>2. 同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>3. 同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>4. 外貨建資産への投資には、制限を設けません。</p> <p>5. デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</p> <p>6. 外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。</p> <p>7. 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>

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

投資態度	<ol style="list-style-type: none">1.主に海外の株式に投資を行い、MSCIコクサイ・インデックス(円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)に連動する投資成果をめざして運用を行います。2.株式への投資は原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。3.組入外貨建資産については原則為替ヘッジは行いませんが、金利・為替状況によってはヘッジを実施する可能性があります。
------	--

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

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

本証券、本商品もしくは本ファンドの購入者、販売者もしくは所有者、またはその他いかなる者もしくは団体も、MSCIの承認が必要か否かの確認を事前に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

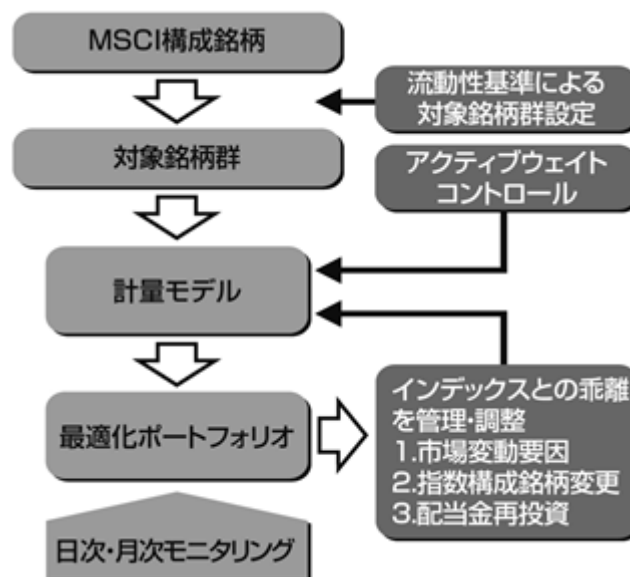
インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差(アクティブウェイト)を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。

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	<ol style="list-style-type: none"> 1. 株式への投資割合には、制限を設けません。 2. 新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において、原則として信託財産の純資産総額の20%以下とします。 3. 同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、原則として信託財産の純資産総額の10%以下とします。 4. 外貨建資産への投資には、制限を設けません。 5. デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます。)は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 6. 外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。 7. 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
--------	--

ファンド名	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	<ol style="list-style-type: none"> 1. 主として新興国の債券に投資し、JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス(円換算ベース・為替ヘッジなし)の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。 2. 原則として、新興国の債券の組入比率は高位を維持します。 3. 組入債券は、当初組入時において、S&PもしくはMoody'sの外貨建て長期格付がBB-格もしくはBa3格以上を取得している債券とします。但し、両社が格付を付与している場合には、どちらか低い方の格付を基準とします。また、当該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。 <div style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin-top: 10px;"> <p>JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラスに関する著作権等の知的財産その他一切の権利はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。</p> </div>

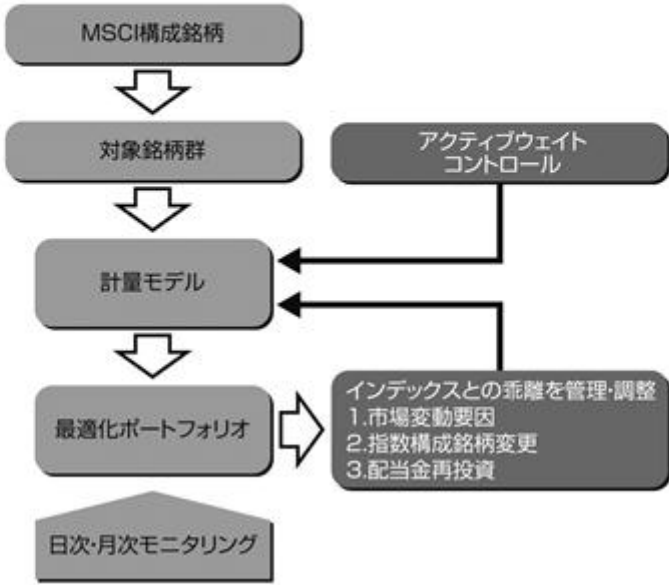
運用プロセス	<p>信用格付基準等を勘案した投資対象銘柄群を設定し、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。</p>
主な投資制限	<ol style="list-style-type: none"> 1. 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 2. 外貨建資産への投資には、制限を設けません。 3. 投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 4. デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 5. 外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。 6. 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

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

投資態度	<ol style="list-style-type: none">1.主として海外の証券取引所に上場している株式に投資し、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限りなく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。

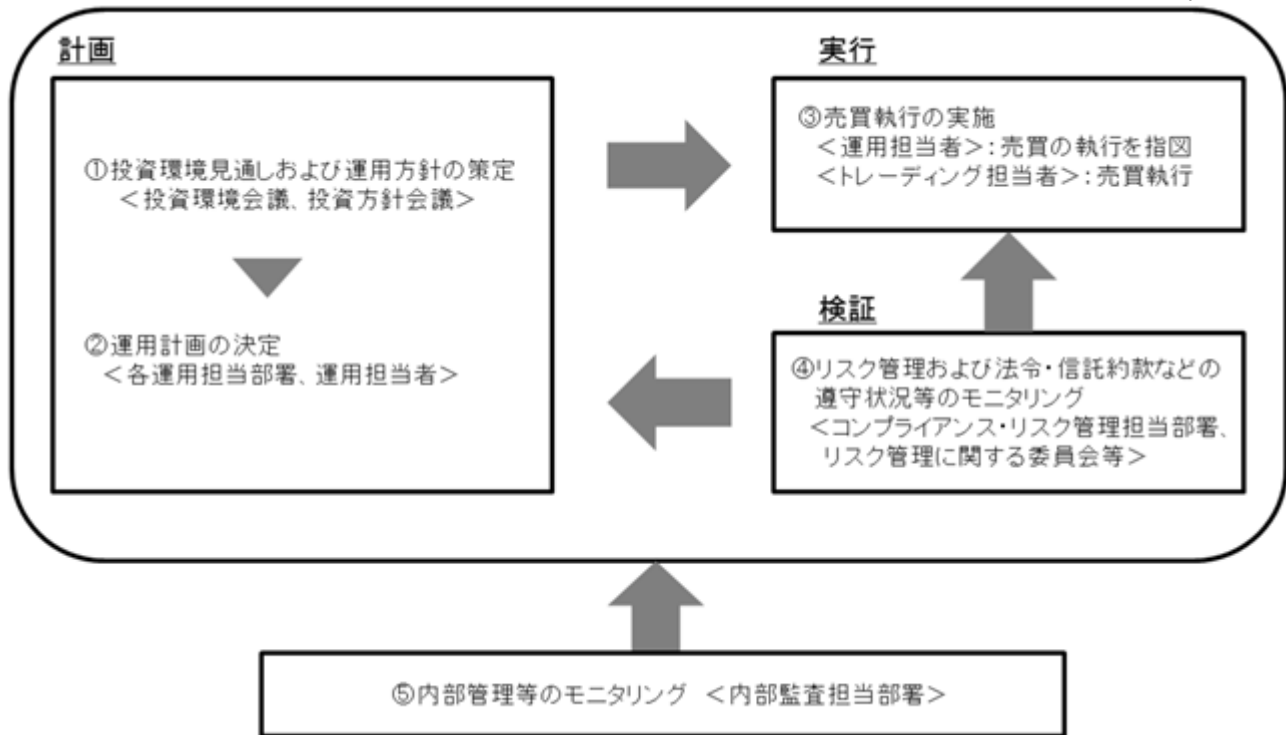
MSCIは、自らが信頼できると考える情報源からMSCI指数の計算に算入または使用するための情報を入手しますが、いかなるMSCI関係者も、MSCI指数またはそれに含まれるデータの独創性、正確性および/または完全性について保証するものではありません。いかなるMSCI関係者も、明示的か黙示的かを問わず、本ファンドの発行会社もしくは所有者、またはその他の者もしくは団体が、MSCI指数またはそれに含まれるデータを使用することにより得られる結果について保証を行いません。いかなるMSCI関係者も、MSCI指数またはそれに含まれるデータの、またはそれらに関連する過誤、脱漏または中断について責任を負いません。また、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	<p>現地口座の開設可否、預託証券の利用可否を基準に投資対象銘柄群を設定し、インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差(アクティブウェイト)を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用いて、インデックスとの乖離を抑えます。 日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理して、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。</p>  <pre> graph TD A[MSCI構成銘柄] --> B[対象銘柄群] B --> C[計量モデル] C --> D[最適化ポートフォリオ] E[アクティブウェイトコントロール] --> C E --> D D --> F[インデックスとの乖離を管理・調整 1.市場変動要因 2.指数構成銘柄変更 3.配当金再投資] F --> G[日次・月次モニタリング] </pre>
主な投資制限	<ol style="list-style-type: none"> 1. 株式への投資割合には、制限を設けません。 2. 外貨建資産への投資には、制限を設けません。 3. 投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 4. デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 5. 外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。 6. 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

資金動向、市況動向等によっては、上記の運用ができない場合があります。

（3）【運用体制】

a. ファンドの運用体制



投資環境見直しおよび運用方針の策定

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

運用計画の決定

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

売買執行の実施

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

モニタリング

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

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

内部管理等のモニタリング

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

b. ファンドの関係法人に関する管理

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

c. 運用体制に関する社内規則

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

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

運用体制は平成30年4月27日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

上記体制は、マザーファンドを通じた実質的な運用体制を記載しております。

（４）【分配方針】

収益分配方針

毎決算時（原則として毎年4月、10月の各11日。休業日の場合は翌営業日。）に、原則として次のとおり収益分配を行う方針です。

(1) 分配対象額の範囲

経費控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。

(2) 分配対象額についての分配方針

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

(3) 留保益の運用方針

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

収益の分配方式

(1) 信託財産から生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。

収益分配金の支払い

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

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

(5) 【投資制限】

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

株式への実質投資割合には、制限を設けません。(約款「運用の基本方針」2. 運用方法 (3) 投資制限)

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。)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)

スワップ取引、金利先渡取引、為替先渡取引、有価証券先物取引等の利用はヘッジ目的に限定します。(約款「運用の基本方針」2. 運用方法 (3) 投資制限)

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する実質比率は、原則として、それぞれ10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなっ

た場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。(約款「運用の基本方針」2.運用方法(3)投資制限)

外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。(約款「運用の基本方針」2.運用方法(3)投資制限)

非株式への実質投資割合には制限を設けません。(約款「運用の基本方針」2.運用方法(3)投資制限)

投資する株式等の範囲(約款第20条)

- 1)委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
- 2)上記1)の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、委託会社が投資することを指図することができるものとします。

信用取引の指図範囲(約款第21条)

- 1)委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引き渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができます。
- 2)上記1)の信用取引の指図は、次の1.~6.に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行うことができるものとし、かつ次の1.~6.に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。
 - 1.信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
 - 2.株式分割により取得する株券
 - 3.有償増資により取得する株券
 - 4.売出しにより取得する株券
 - 5.信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権(転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限りません。)の行使により取得可能な株券
 - 6.信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権(5.に定めるものを除きます。)の行使により取得可能な株券

先物取引等の運用指図(約款第22条)

- 1)委託会社は、信託財産に属する資産の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次の範囲で行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします(以下同じ。)
 - 1.先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする有価証券(以下「ヘッジ対象有価証券」といいます。)の時価総額とマザーファンドの信託財産に属するヘッジ対象有価証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額(信

託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占めるヘッジ対象有価証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。)との合計額の範囲内とします。

2. 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象有価証券の組入可能額(信託財産の組入ヘッジ対象有価証券およびマザーファンドの組入ヘッジ対象有価証券のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める組入ヘッジ対象有価証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。)を差し引いた額)に信託財産が限月までに受取る組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券および組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金とマザーファンドが限月までに受取る組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券および組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券および組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金の割合を乗じて得た額をいいます。)を加えた額を限度とし、かつ信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに上記(2)投資対象 運用の指図範囲等の1.~4.に掲げる金融商品で運用している額(以下「金融商品運用額」といいます。)とマザーファンドが限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに金融商品運用額のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占めるマザーファンドが限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに金融商品運用額の割合を乗じて得た額をいいます。)の合計額の範囲内とします。

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

2)委託会社は、信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、わが国の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次の範囲で行うことの指図をすることができます。

1. 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の売予約と合せてヘッジ対象とする外貨建資産の時価総額とマザーファンドの信託財産に属するヘッジ対象とする外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占めるヘッジ対象とする外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。)との合計額の範囲内とします。

2. 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の買予約と合せて、外貨建有価証券とマザーファンドの信託財産に属する外貨建有価証券のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める外貨建有価証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。)を加えた額の買付代金等実需の範囲内とします。

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

3)委託会社は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の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次の範囲で行うことの指図をすることができます。

1. 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする金利商品(信託財産が1年以内に受取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに上記(2)投資対象 運用の指図範囲等1.~4.に掲げる金融商品で運用されているものをいい、以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。)の時価総額とマザーファンドの信託財産に属するヘッジ対象金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占めるヘッジ対象金利商品の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。)の合計額の範囲内とします。
2. 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに上記(2)投資対象 運用の指図範囲等の1.~4.に掲げる金融商品で運用している額(以下2.において「金融商品運用額等」といいます。)とマザーファンドが限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに金融商品運用額のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占めるマザーファンドが限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに金融商品運用額の割合を乗じて得た額をいいます。)との合計額の範囲内とします。ただし、ヘッジ対象金利商品が外貨建で、信託財産の外貨建資産組入可能額(約款上の組入可能額から保有外貨建資産の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。))を加えた額を差引いた額をいいます。以下同じ。)に信託財産が限月までに受取る外貨建組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに外貨建組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額が当該金融商品運用額等の額より少ない場合には外貨建資産組入可能額に信託財産が限月までに受取る外貨建組入有価証券にかかる利払金および償還金等を加えた額を限度とします。
3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点のヘッジ対象金利商品の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ 規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

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価格変動リスクや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)スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。以下3)において同

じ。)が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、当該純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。

- 4)上記3)においてマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- 5)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。
- 6)委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供または受入れが必要と認めるときは、担保の提供または受入れの指図を行うものとします。

金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図(約款第24条)

- 1)委託会社は、信託財産に属する資産の価格変動リスクや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)金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(「金利先渡取引の想定元本の合計額」といいます。以下3)において同じ。)が、信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額とマザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(「ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額」といいます。以下3)において同じ。)を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額が減少して、金利先渡取引の想定元本の総額がヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかにその超える額に相当する金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
- 4)上記3)においてマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める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。
- 5)為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(「為替先渡取引の想定元本の合計額」といいます。以下5)において同じ。)が、信託財産にかかるヘッジ対象とする外貨建資産(「ヘッジ対象外貨建資産」といいます。以下5)において同じ。)の時価総額とマザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(「ヘッジ対象外貨建資産

の時価総額の合計額」といいます。以下5)において同じ。)を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、ヘッジ対象外貨建資産の時価総額の合計額が減少して、為替先渡取引の想定元本の合計額がヘッジ対象外貨建資産の時価総額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかにその超える額に相当する為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。

6)上記5)においてマザーファンドの信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象外貨建資産の時価総額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める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。

7)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。

8)委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供または受入れが必要と認めるときは、担保の提供または受入れの指図を行うものとします。

デリバティブ取引等にかかる投資制限(約款第25条)

デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところにしたがい、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。

有価証券の貸付の指図および範囲(約款第26条)

1)委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の1.~2.の範囲内で貸付の指図をすることができます。

1.株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。

2.公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。

2)上記1) 1.~2.に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。

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

特別な場合の外貨建有価証券への投資制限(約款第27条)

外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

外国為替予約取引の指図(約款第28条)

1)委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、または為替変動リスクを回避するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

2)上記1)の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約とマザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約のうち信託財産に属するとみなした額との合計額と、信託財産にかかる売予約とマザーファンドの信託財産にかかる為替の売予約のうち信託財産に属するとみなした額との合計額との差額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(マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に

属するとみなした額を含みます。)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)においてマザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産にかかる為替の売予約のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる為替の売予約の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- 4)上記2)の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

資金の借入れ(約款第34条)

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

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

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

3【投資リスク】

<基準価額の主な変動要因>

各ファンドは、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

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。

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

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。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

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

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

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

・カントリーリスク

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>

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

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

収益分配金に関する留意点として、以下の事項にご留意ください。

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

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

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

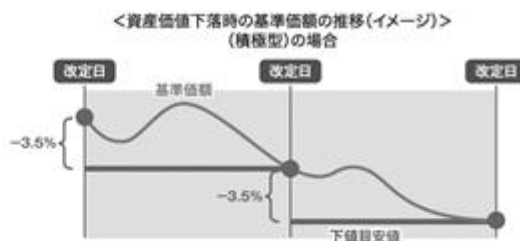
各ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行います。そのため、各ファンドが投資対象とするマザーファンドを投資対象とする他のベビーファンドに追加設定・解約等があった場合、資金変動等が起こり、その結果、当該マザーファンドにおいて売買等が生じた場合等には、各ファンドの基準価額に影響をおよぼす場合があります。

（堅実型）（積極型）の2つのファンド間でスイッチングを行うことができます。ただし、販売会社によっては、スイッチングの取扱いを行わない場合があります。くわしくは販売会社にお問い合わせください。

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調整します。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。

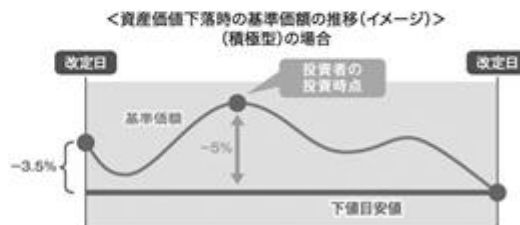
ケース① 下値目安値の切下げについて

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、ファンドの基準価額は長期的に2.5%((堅実型)の場合)もしくは3.5%((積極型)の場合)よりも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

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、この時点で投資者が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2.5%((堅実型)の場合)もしくは3.5%((積極型)の場合)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け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。

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（スイッチングのお申込みを含みます。）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（スイッチングのお申込みを含みます。）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。

各ファンドは、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、各ファンドにつき受益権口数が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．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ます、これによる損失は購入者が負担することとなります。

< リスク管理体制 >

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

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



上記体制は平成30年4月27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

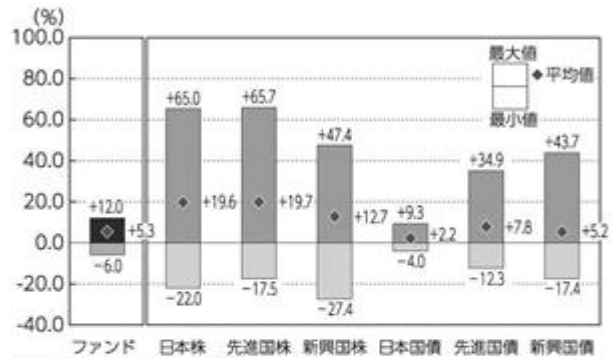
(堅実型)



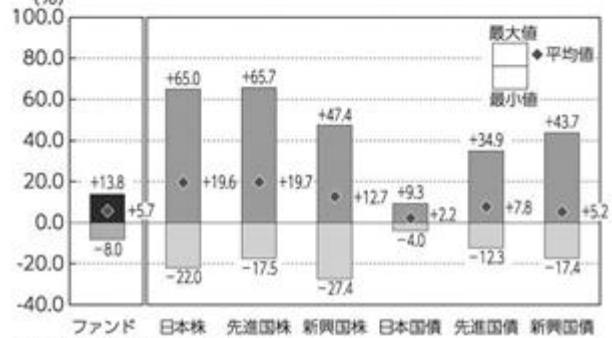
(積極型)



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：2016年8月～2018年4月
代表的な資産クラス：2013年5月～2018年4月



ファンド：2016年8月～2018年4月
代表的な資産クラス：2013年5月～2018年4月

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

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

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

*全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

*各資産クラスの指数

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

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

●[MSCIコクサイ・インデックス]は、MSCI Inc.が開発した株価指数で、日本を除く世界の主要先進国の株価指数を、各国の株式時価総額をベースに合成したものです。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

●[MSCIエマージング・マーケット・インデックス]は、MSCI Inc.が開発した株価指数で、新興国の株価指数を、各国の株式時価総額をベースに合成したものです。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

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

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

●[JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイド]は、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが公表している新興国の現地通貨建ての国債で構成されている時価総額加重平均指数です。同指数に関する著作権等の知的財産その他一切の権利はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。また、同社は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

お申込時に、お申込日の翌営業日の基準価額に、3.24%（税抜3.00%）を上限に各販売会社が定める手数料率を乗じて得た額とします。

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

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

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

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

(2)【換金（解約）手数料】

ありません。

(3)【信託報酬等】

各ファンドの日々の純資産総額に対して年率1.134%（税抜1.05%）

支払先	内訳（税抜）	主な役務
委託会社	年率0.50%	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0.50%	購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価
受託会社	年率0.05%	運用財産の保管・管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率

信託報酬は、毎日計上され、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、各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。

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

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

有価証券の売買時の売買委託手数料および有価証券取引にかかる手数料・税金、先物・オプション取引に要する費用、当該手数料にかかる消費税等相当額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。

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、間接的に各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】

各ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

個人の受益者に対する課税

収益分配時

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

詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

解約時および償還時

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

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

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

損益通算について

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

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

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

法人の受益者に対する課税

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

なお、益金不算入制度の適用はありません。

上記は、平成30年4月末現在のものです。税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。

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

個別元本方式について

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

< 個別元本について >

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

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

ただし、同一ファンドの受益権を複数の販売会社で取得する場合には販売会社毎に個別元本の算出が行われます。また、同一販売会社であっても複数支店等で同一ファンドの受益権を取得する場合は当該支店等毎に、「分配金受取コース」と「分配金自動けいぞく投資コース」の両コースで同一ファンドの受益権を取得する場合はコース別に個別元本の算出が行われる場合があります。

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

< 収益分配金の課税について >

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

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

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

税法が改正された場合等は、上記内容が変更になることがあります。

5【運用状況】

(1)【投資状況】

D I A Mコア資産設計ファンド（堅実型）

平成30年4月27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	75,170,534	55.88
内 日本	75,170,534	55.88
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	59,346,236	44.12
純資産総額	134,516,770	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。

D I A Mコア資産設計ファンド（積極型）

平成30年4月27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	271,930,875	90.69
内 日本	271,930,875	90.69
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	27,914,832	9.31
純資産総額	299,845,707	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4月27日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	298,337,310,120	98.42
内 日本	298,337,310,120	98.42
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	4,783,888,638	1.58
純資産総額	303,121,198,758	100.00

その他資産の投資状況

平成30年4月27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）	4,626,700,000	1.53
内 日本	4,626,700,000	1.53

（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4月27日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	289,165,936,100	83.81
内 日本	289,165,936,100	83.81
地方債証券	22,861,857,806	6.63
内 日本	22,861,857,806	6.63
特殊債券	14,869,558,465	4.31
内 日本	14,869,558,465	4.31
社債券	16,234,515,570	4.71
内 日本	16,033,595,570	4.65
内 オランダ	200,920,000	0.06
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	1,891,910,387	0.55
純資産総額	345,023,778,328	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4月27日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	289,825,801,783	95.22
内 アメリカ	180,587,452,216	59.33
内 イギリス	20,370,583,105	6.69
内 フランス	12,181,289,613	4.00
内 ドイツ	11,745,181,536	3.86
内 カナダ	11,138,098,468	3.66
内 スイス	10,074,696,705	3.31
内 オーストラリア	7,199,134,112	2.37
内 オランダ	5,980,435,245	1.96
内 アイルランド	4,121,072,826	1.35
内 スペイン	3,943,134,799	1.30
内 スウェーデン	3,107,981,339	1.02
内 香港	2,896,049,479	0.95
内 イタリア	2,633,672,051	0.87
内 デンマーク	2,071,652,575	0.68
内 ジャージー	1,656,441,669	0.54
内 シンガポール	1,524,801,641	0.50
内 バミューダ	1,346,105,197	0.44
内 ベルギー	1,317,750,992	0.43
内 フィンランド	1,251,231,230	0.41
内 ケイマン諸島	861,283,862	0.28
内 ノルウェー	829,882,282	0.27
内 オランダ領キュラソー	794,590,958	0.26
内 イスラエル	542,550,400	0.18
内 ルクセンブルグ	389,816,251	0.13
内 オーストリア	308,686,985	0.10
内 ニューージーランド	181,765,299	0.06
内 ポルトガル	180,974,659	0.06

	内 パナマ	175,216,749	0.06
	内 リベリア	151,804,972	0.05
	内 イギリス領バージン諸島	90,892,839	0.03
	内 マン島	90,274,421	0.03
	内 パプアニューギニア	61,082,771	0.02
	内 モーリシャス	20,214,537	0.01
投資信託受益証券		831,332,570	0.27
	内 オーストラリア	666,313,005	0.22
	内 シンガポール	165,019,565	0.05
投資証券		6,138,783,662	2.02
	内 アメリカ	5,231,945,408	1.72
	内 フランス	382,788,059	0.13
	内 イギリス	328,286,466	0.11
	内 香港	151,794,054	0.05
	内 カナダ	43,969,675	0.01
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		7,577,354,415	2.49
純資産総額		304,373,272,430	100.00

その他資産の投資状況

平成30年4月27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）	325,522,410	0.11
-	325,522,410	0.11
株価指数先物取引（買建）	7,729,929,356	2.54
内 アメリカ	5,220,349,863	1.72
内 ドイツ	1,471,867,007	0.48
内 イギリス	560,898,620	0.18
内 カナダ	282,052,530	0.09
内 オーストラリア	194,761,336	0.06

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

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

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年4月27日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	217,076,142,790	101.79
内 アメリカ	92,100,134,812	43.19
内 フランス	22,770,020,770	10.68
内 イタリア	21,658,155,756	10.16
内 ドイツ	15,773,469,218	7.40
内 イギリス	15,493,576,091	7.27
内 スペイン	14,032,519,839	6.58
内 ベルギー	5,708,826,486	2.68
内 オランダ	4,796,776,106	2.25
内 カナダ	4,537,068,365	2.13
内 オーストラリア	4,536,074,428	2.13
内 オーストリア	3,731,982,768	1.75
内 アイルランド	1,747,639,925	0.82
内 メキシコ	1,723,766,782	0.81
内 ポーランド	1,426,826,998	0.67
内 フィンランド	1,345,022,471	0.63
内 南アフリカ	1,308,242,645	0.61
内 デンマーク	1,275,850,273	0.60
内 マレーシア	923,285,660	0.43
内 シンガポール	811,654,854	0.38
内 スウェーデン	767,565,115	0.36
内 ノルウェー	607,683,428	0.28
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	3,815,170,134	1.79
純資産総額	213,260,972,656	100.00

その他資産の投資状況

平成30年4月27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)	9,568,445,762	4.49
-	9,568,445,762	4.49

(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4月27日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	59,546,145,041	92.25
内 ケイマン諸島	9,411,766,518	14.58
内 韓国	9,262,342,566	14.35
内 台湾	6,639,872,241	10.29
内 中国	5,971,244,698	9.25
内 インド	5,133,701,921	7.95
内 ブラジル	4,414,531,775	6.84
内 南アフリカ	3,907,975,116	6.05
内 ロシア	2,019,483,505	3.13
内 香港	1,982,041,724	3.07
内 マレーシア	1,518,425,496	2.35
内 タイ	1,470,688,862	2.28
内 メキシコ	1,456,394,086	2.26
内 インドネシア	1,161,116,750	1.80
内 チリ	757,491,911	1.17
内 ポーランド	740,331,443	1.15
内 フィリピン	590,318,687	0.91
内 バミューダ	535,296,518	0.83
内 トルコ	525,614,216	0.81
内 アラブ首長国連邦	402,749,319	0.62
内 カタール	383,546,596	0.59
内 コロンビア	270,795,741	0.42
内 アメリカ	237,345,442	0.37
内 ギリシャ	209,048,833	0.32
内 ハンガリー	186,215,286	0.29
内 チェコ	125,230,202	0.19
内 エジプト	69,124,290	0.11
内 マン島	50,738,496	0.08
内 パキスタン	45,641,311	0.07
内 ペルー	33,077,500	0.05
内 ルクセンブルグ	15,543,310	0.02
内 マルタ	13,820,029	0.02
内 オランダ	4,630,653	0.01
投資信託受益証券	304,660,028	0.47
内 メキシコ	304,660,028	0.47
投資証券	126,448,552	0.20
内 メキシコ	65,258,565	0.10
内 南アフリカ	46,232,161	0.07
内 トルコ	14,957,826	0.02
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	4,572,398,810	7.08
純資産総額	64,549,652,431	100.00

その他資産の投資状況

平成30年4月27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）	100,455,890	0.16
-	100,455,890	0.16
為替予約取引（売建）	787,956,000	1.22
-	787,956,000	1.22
株価指数先物取引（買建）	4,586,207,890	7.10
内 アメリカ	4,586,207,890	7.10

（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4月27日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	110,073,236,781	96.74
内 トルコ	16,215,000,718	14.25
内 メキシコ	14,524,984,118	12.77
内 ロシア	12,748,115,140	11.20
内 ブラジル	11,348,299,915	9.97
内 インドネシア	11,241,727,184	9.88
内 コロンビア	9,908,877,422	8.71
内 フィリピン	8,012,699,650	7.04
内 パナマ	5,695,217,218	5.01
内 ハンガリー	5,309,257,862	4.67
内 ペルー	4,957,454,421	4.36
内 南アフリカ	4,327,275,616	3.80
内 クロアチア	3,396,518,708	2.98
内 ルーマニア	2,387,808,809	2.10
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	3,713,403,189	3.26
純資産総額	113,786,639,970	100.00

その他資産の投資状況

平成30年4月27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）	81,982,500	0.07
-	81,982,500	0.07

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

(2) 【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

D I A Mコア資産設計ファンド(堅実型)

平成30年4月27日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	国内株式パッシブ・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	7,054,198	2.6310 18,560,298	2.7108 19,122,519	- -	14.22%
2	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	15,100,712	1.2341 18,637,298	1.2288 18,555,754	- -	13.79%
3	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	8,241,980	1.8074 14,897,377	1.8127 14,940,237	- -	11.11%
4	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	2,240,482	3.3181 7,434,364	3.3937 7,603,523	- -	5.65%
5	エマージング債券パッシブ・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	4,182,056	1.7805 7,446,568	1.7968 7,514,318	- -	5.59%
6	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	5,767,851	1.2918 7,451,485	1.2889 7,434,183	- -	5.53%

(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。

投資有価証券の種類別投資比率

平成30年4月27日現在

種類	投資比率
親投資信託受益証券	55.88%
合計	55.88%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

D I A Mコア資産設計ファンド(積極型)

平成30年4月27日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	国内株式パッシブ・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	25,565,287	2.6365 67,404,984	2.7108 69,302,379	- -	23.11%
2	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	54,503,707	1.2357 67,350,629	1.2288 66,974,155	- -	22.34%
3	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	29,777,513	1.8069 53,805,617	1.8127 53,977,697	- -	18.00%
4	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	8,129,259	3.3252 27,031,580	3.3937 27,588,266	- -	9.20%
5	エマージング債券パッシブ・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	15,143,335	1.7808 26,967,419	1.7968 27,209,544	- -	9.07%
6	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	20,854,088	1.2914 26,932,254	1.2889 26,878,834	- -	8.96%

(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4月27日現在

種類	投資比率
親投資信託受益証券	90.69%
合計	90.69%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

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4月27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	1,427,200	7,353.87 10,495,448,265	7,181.00 10,248,723,200	- -	3.38%
2	三菱UFJフィナンシャル・ グループ 日本	株式 銀行業	8,108,900	789.07 6,398,516,800	733.20 5,945,445,480	- -	1.96%
3	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	521,700	8,663.60 4,519,803,600	8,501.00 4,434,971,700	- -	1.46%
4	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	827,000	4,995.06 4,130,920,000	5,205.00 4,304,535,000	- -	1.42%
5	ソニー 日本	株式 電気機器	784,900	5,411.88 4,247,788,629	5,400.00 4,238,460,000	- -	1.40%
6	三井住友フィナンシャルグ ループ 日本	株式 銀行業	876,700	4,791.32 4,200,551,400	4,550.00 3,988,985,000	- -	1.32%
7	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	1,056,800	3,838.03 4,056,037,200	3,767.00 3,980,965,600	- -	1.31%
8	キーエンス 日本	株式 電気機器	57,600	64,031.51 3,688,215,000	66,970.00 3,857,472,000	- -	1.27%
9	任天堂 日本	株式 その他製品	72,300	44,902.63 3,246,460,500	46,170.00 3,338,091,000	- -	1.10%
10	みずほフィナンシャルグルー プ 日本	株式 銀行業	15,737,400	199.50 3,139,668,240	198.40 3,122,300,160	- -	1.03%
11	KDDI 日本	株式 情報・通信業	1,037,600	2,674.23 2,774,784,250	2,937.00 3,047,431,200	- -	1.01%
12	ファナック 日本	株式 電気機器	111,600	27,144.55 3,029,332,000	23,560.00 2,629,296,000	- -	0.87%
13	三菱商事 日本	株式 卸売業	811,700	2,958.44 2,401,372,000	3,027.00 2,457,015,900	- -	0.81%
14	日本電産 日本	株式 電気機器	141,300	16,216.97 2,291,457,900	17,140.00 2,421,882,000	- -	0.80%
15	キヤノン 日本	株式 電気機器	632,200	4,052.58 2,562,045,000	3,790.00 2,396,038,000	- -	0.79%
16	NTTドコモ 日本	株式 情報・通信業	827,200	2,668.82 2,207,652,212	2,835.00 2,345,112,000	- -	0.77%
17	セブン&アイ・ホールディン グス 日本	株式 小売業	484,800	4,463.47 2,163,892,200	4,805.00 2,329,464,000	- -	0.77%
18	東海旅客鉄道 日本	株式 陸運業	105,200	20,244.20 2,129,690,800	21,970.00 2,311,244,000	- -	0.76%
19	花王 日本	株式 化学	288,800	7,687.57 2,220,170,400	7,855.00 2,268,524,000	- -	0.75%
20	日立製作所 日本	株式 電気機器	2,820,000	811.45 2,288,291,500	801.60 2,260,512,000	- -	0.75%

21	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	436,400	4,965.41 2,166,905,700	5,172.00 2,257,060,800	- -	0.74%
22	信越化学工業 日本	株式 化学	204,800	11,520.24 2,359,346,000	11,005.00 2,253,824,000	- -	0.74%
23	東日本旅客鉄道 日本	株式 陸運業	210,900	10,438.62 2,201,506,800	10,490.00 2,212,341,000	- -	0.73%
24	パナソニック 日本	株式 電気機器	1,341,600	1,597.31 2,142,955,500	1,632.00 2,189,491,200	- -	0.72%
25	リクルートホールディングス 日本	株式 サービス業	865,700	2,477.02 2,144,362,700	2,527.00 2,187,623,900	- -	0.72%
26	日本たばこ産業 日本	株式 食料品	729,200	3,289.46 2,398,680,700	2,936.50 2,141,295,800	- -	0.71%
27	小松製作所 日本	株式 機械	567,000	4,041.55 2,291,563,500	3,750.00 2,126,250,000	- -	0.70%
28	ダイキン工業 日本	株式 機械	160,300	12,218.86 1,958,684,500	12,805.00 2,052,641,500	- -	0.68%
29	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	432,700	5,994.30 2,593,735,600	4,621.00 1,999,506,700	- -	0.66%
30	三菱電機 日本	株式 電気機器	1,174,300	1,859.66 2,183,807,500	1,680.50 1,973,411,150	- -	0.65%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成30年4月27日現在

種類	投資比率
株式	98.42%
合計	98.42%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

平成30年4月27日現在

業種	国内/外国	投資比率
電気機器	国内	13.39%
輸送用機器		8.66%
情報・通信業		7.26%
化学		7.09%
銀行業		7.02%
機械		5.29%
小売業		4.85%
卸売業		4.75%
医薬品		4.46%
食料品		4.30%
サービス業		4.19%
陸運業		4.08%
建設業		3.17%
不動産業		2.45%
保険業		2.26%
その他製品		2.19%
電気・ガス業		1.69%
精密機器		1.64%
その他金融業		1.22%
鉄鋼		1.06%
ガラス・土石製品		0.97%
証券、商品先物取引業		0.97%
非鉄金属		0.90%
ゴム製品		0.83%
石油・石炭製品		0.70%
繊維製品		0.68%
金属製品		0.66%
空運業		0.60%
鉱業		0.34%
パルプ・紙		0.28%
海運業	0.21%	
倉庫・運輸関連業	0.18%	
水産・農林業	0.10%	
合計		98.42%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年4月27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	100.50 4,020,160,000	100.48 4,019,240,000	0.100000 2020/6/20	1.16%
2	122回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	4,000,000,000	100.42 4,016,960,000	100.37 4,015,040,000	0.100000 2019/12/20	1.16%
3	118回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	3,700,000,000	100.45 3,716,872,000	100.38 3,714,282,000	0.200000 2019/6/20	1.08%
4	344回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,500,000,000	100.68 3,524,010,000	100.79 3,527,860,000	0.100000 2026/9/20	1.02%
5	345回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,500,000,000	100.61 3,521,595,000	100.73 3,525,655,000	0.100000 2026/12/20	1.02%
6	347回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,500,000,000	100.51 3,517,885,000	100.68 3,523,905,000	0.100000 2027/6/20	1.02%
7	348回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,360,000,000	100.47 3,375,967,000	100.65 3,382,008,000	0.100000 2027/9/20	0.98%
8	341回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,060,000,000	102.43 3,134,418,000	102.48 3,136,071,600	0.300000 2025/12/20	0.91%
9	342回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,000,000,000	100.80 3,024,240,000	100.90 3,027,210,000	0.100000 2026/3/20	0.88%
10	343回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,000,000,000	100.74 3,022,470,000	100.85 3,025,620,000	0.100000 2026/6/20	0.88%
11	130回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	3,000,000,000	100.77 3,023,130,000	100.80 3,024,090,000	0.100000 2021/12/20	0.88%
12	346回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,000,000,000	100.54 3,016,290,000	100.70 3,021,270,000	0.100000 2027/3/20	0.88%
13	128回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	3,000,000,000	100.70 3,021,090,000	100.70 3,021,210,000	0.100000 2021/6/20	0.88%
14	127回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	3,000,000,000	100.65 3,019,500,000	100.63 3,019,080,000	0.100000 2021/3/20	0.88%
15	125回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	3,000,000,000	100.54 3,016,350,000	100.52 3,015,780,000	0.100000 2020/9/20	0.87%

16	123回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	3,000,000,000	100.47 3,014,100,000	100.42 3,012,720,000	0.100000 2020/3/20	0.87%
17	133回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	2,860,000,000	100.89 2,885,679,000	100.90 2,885,825,800	0.100000 2022/9/20	0.84%
18	321回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,500,000,000	104.53 2,613,400,000	104.34 2,608,700,000	1.000000 2022/3/20	0.76%
19	340回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,500,000,000	103.15 2,578,850,000	103.14 2,578,600,000	0.400000 2025/9/20	0.75%
20	305回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,500,000,000	102.64 2,566,200,000	102.35 2,558,800,000	1.300000 2019/12/20	0.74%
21	126回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	2,500,000,000	100.59 2,514,950,000	100.58 2,514,525,000	0.100000 2020/12/20	0.73%
22	329回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,270,000,000	104.73 2,377,375,100	104.61 2,374,805,900	0.800000 2023/6/20	0.69%
23	310回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,300,000,000	102.89 2,366,654,000	102.68 2,361,640,000	1.000000 2020/9/20	0.68%
24	301回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,300,000,000	102.20 2,350,623,000	101.86 2,342,849,000	1.500000 2019/6/20	0.68%
25	339回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,250,000,000	103.17 2,321,451,000	103.11 2,319,997,500	0.400000 2025/6/20	0.67%
26	332回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,210,000,000	103.92 2,296,693,300	103.82 2,294,422,000	0.600000 2023/12/20	0.67%
27	312回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,200,000,000	103.74 2,282,456,000	103.49 2,276,780,000	1.200000 2020/12/20	0.66%
28	334回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,100,000,000	104.13 2,186,793,000	104.06 2,185,323,000	0.600000 2024/6/20	0.63%
29	123回 利付国庫債券(20年) 日本	国債証券	1,700,000,000	124.02 2,108,340,000	124.02 2,108,459,000	2.100000 2030/12/20	0.61%
30	129回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	2,070,000,000	100.73 2,085,291,000	100.76 2,085,835,500	0.100000 2021/9/20	0.60%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成30年4月27日現在

種類	投資比率
国債証券	83.81%
地方債証券	6.63%
特殊債券	4.31%
社債券	4.71%
合計	99.45%

(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4月27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	381,669	18,352.60 7,004,621,116	17,957.45 6,853,804,655	- -	2.25%
2	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフトウェア	544,500	9,947.59 5,416,463,772	10,307.33 5,612,341,729	- -	1.84%
3	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 インターネット販売・通信販売	30,466	159,014.73 4,844,542,917	165,988.92 5,057,018,619	- -	1.66%
4	FACEBOOK INC アメリカ	株式 インターネットソフトウェア・サービス	177,316	19,638.27 3,482,180,363	19,044.39 3,376,876,121	- -	1.11%
5	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	258,225	12,582.61 3,249,145,221	12,039.43 3,108,883,102	- -	1.02%
6	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	200,134	14,186.91 2,839,283,173	13,997.89 2,801,454,417	- -	0.92%
7	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 石油・ガス・消耗燃料	315,280	8,364.69 2,637,221,402	8,842.04 2,787,718,686	- -	0.92%
8	ALPHABET INC-CL C アメリカ	株式 インターネットソフトウェア・サービス	23,400	117,185.61 2,742,143,297	113,728.37 2,661,243,951	- -	0.87%
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	22,200	117,510.07 2,608,723,656	114,085.94 2,532,708,056	- -	0.83%
10	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 銀行	737,237	3,499.79 2,580,177,460	3,288.15 2,424,149,159	- -	0.80%
11	INTEL CORP アメリカ	株式 半導体・半導体製造装置	348,219	4,985.28 1,735,971,559	5,801.01 2,020,024,512	- -	0.66%
12	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 各種金融サービス	93,679	21,971.26 2,058,246,206	21,545.23 2,018,335,648	- -	0.66%
13	WELLS FARGO & CO アメリカ	株式 銀行	348,201	6,507.93 2,266,067,739	5,734.31 1,996,693,869	- -	0.66%
14	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	231,295	8,535.51 1,974,221,793	8,449.67 1,954,368,180	- -	0.64%
15	CHEVRON CORP アメリカ	株式 石油・ガス・消耗燃料	141,261	12,422.70 1,754,843,418	13,583.45 1,918,812,719	- -	0.63%

16	VISA INC アメリカ	株式 情報技術サービス	134,179	13,221.42 1,774,037,402	13,896.19 1,864,577,951	- -	0.61%
17	UNITEDHEALTH GROUP INC アメリカ	株式 ヘルスケア・ プロバイ ダー/ヘルス ケア・サービ ス	71,700	25,036.08 1,795,087,542	25,919.23 1,858,408,826	- -	0.61%
18	PFIZER INC アメリカ	株式 医薬品	446,210	3,857.30 1,721,166,160	4,029.54 1,798,024,389	- -	0.59%
19	CISCO SYSTEMS INC アメリカ	株式 通信機器	364,860	4,611.69 1,682,623,413	4,834.36 1,763,865,866	- -	0.58%
20	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 専門小売り	86,514	20,197.00 1,747,323,799	20,308.48 1,756,968,011	- -	0.58%
21	VERIZON COMM INC アメリカ	株式 各種電気通信 サービス	306,879	5,404.26 1,658,454,392	5,441.25 1,669,807,200	- -	0.55%
22	AT&T INC アメリカ	株式 各種電気通信 サービス	456,680	3,983.49 1,819,184,453	3,619.48 1,652,946,409	- -	0.54%
23	HSBC HOLDINGS PLC イギリス	株式 銀行	1,488,734	1,139.13 1,695,875,717	1,080.25 1,608,212,093	- -	0.53%
24	BOEING CO アメリカ	株式 航空宇宙・防 衛	41,769	37,824.60 1,579,895,933	37,484.08 1,565,672,809	- -	0.51%
25	CITIGROUP INC アメリカ	株式 銀行	196,708	8,382.76 1,648,955,981	7,564.83 1,488,063,169	- -	0.49%
26	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品	186,535	8,821.83 1,645,580,388	7,955.21 1,483,925,563	- -	0.49%
27	NOVARTIS AG-REG SHS スイス	株式 医薬品	166,499	8,768.83 1,460,002,366	8,412.09 1,400,605,238	- -	0.46%
28	COCA-COLA CO/THE アメリカ	株式 飲料	298,559	4,820.17 1,439,108,103	4,674.71 1,395,677,489	- -	0.46%
29	MASTERCARD INC アメリカ	株式 情報技術サー ビス	69,652	18,879.20 1,314,974,621	19,481.79 1,356,946,054	- -	0.45%
30	MERCK & CO. INC. アメリカ	株式 医薬品	201,289	6,002.52 1,208,242,262	6,496.48 1,307,670,667	- -	0.43%

（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4月27日現在

種類	投資比率
株式	95.22%
投資信託受益証券	0.27%
投資証券	2.02%
合計	97.51%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

平成30年4月27日現在

業種	国内/外国	投資比率
銀行	外国	9.29%
石油・ガス・消耗燃料		6.41%
医薬品		5.03%
ソフトウェア		4.30%
保険		4.03%
インターネットソフトウェア・サービス		3.19%
情報技術サービス		3.16%
資本市場		3.07%
半導体・半導体製造装置		2.92%
化学		2.60%
コンピュータ・周辺機器		2.60%
インターネット販売・通信販売		2.39%
航空宇宙・防衛		2.34%
ヘルスケア機器・用品		2.20%
メディア		2.09%
バイオテクノロジー		2.07%
各種電気通信サービス		2.01%
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス		1.95%
飲料		1.92%
ホテル・レストラン・レジャー		1.83%
電力		1.78%
食品		1.74%
食品・生活必需品小売り		1.63%
機械		1.60%
金属・鉱業		1.59%
専門小売り		1.52%
コングロマリット		1.48%
繊維・アパレル・贅沢品		1.35%
家庭用品		1.09%
タバコ		1.06%
自動車		1.05%
各種金融サービス		0.97%
総合公益事業		0.97%
陸運・鉄道		0.94%
通信機器		0.94%
電気設備		0.76%
パーソナル用品		0.72%
専門サービス		0.66%
ライフサイエンス・ツール/サービス		0.58%
航空貨物・物流サービス		0.58%
エネルギー設備・サービス		0.56%
不動産管理・開発		0.54%
消費者金融		0.49%
自動車部品		0.46%
家庭用耐久財		0.46%
電子装置・機器・部品		0.45%
複合小売り		0.40%

建設関連製品	0.39%
商業サービス・用品	0.37%
無線通信サービス	0.35%
建設・土木	0.34%
商社・流通業	0.32%
建設資材	0.31%
運送インフラ	0.28%
容器・包装	0.28%
ガス	0.14%
旅客航空輸送業	0.13%
紙製品・林産品	0.12%
水道	0.08%
ヘルスケア・テクノロジー	0.07%
販売	0.07%
海運業	0.06%
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.06%
レジャー用品	0.05%
各種消費者サービス	0.02%
貯蓄・抵当・不動産金融	0.01%
合計	95.22%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年4月27日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	US T N/B 2.0 02/15/22 アメリカ	国債証券	1,913,625,000	97.89 1,873,400,602	97.37 1,863,392,343	2.000000 2022/2/15	0.87%
2	US T N/B 2.625 08/15/20 アメリカ	国債証券	1,804,275,000	100.65 1,816,038,873	100.17 1,807,504,652	2.625000 2020/8/15	0.85%
3	US T N/B 3.625 02/15/20 アメリカ	国債証券	1,673,055,000	102.61 1,716,838,849	102.03 1,707,168,591	3.625000 2020/2/15	0.80%
4	US T N/B 2.125 12/31/21 アメリカ	国債証券	1,716,795,000	98.43 1,689,961,494	97.92 1,681,240,175	2.125000 2021/12/31	0.79%
5	US T N/B 1.25 10/31/19 アメリカ	国債証券	1,640,250,000	98.41 1,614,235,635	98.28 1,612,185,322	1.250000 2019/10/31	0.76%
6	US T N/B 0.875 07/31/19 アメリカ	国債証券	1,640,250,000	98.16 1,610,184,217	98.17 1,610,315,437	0.875000 2019/7/31	0.76%
7	US T N/B 1.0 09/30/19 アメリカ	国債証券	1,640,250,000	98.12 1,609,544,520	98.05 1,608,396,345	1.000000 2019/9/30	0.75%
8	US T N/B 3.5 05/15/20 アメリカ	国債証券	1,530,900,000	102.59 1,570,596,237	101.96 1,560,966,876	3.500000 2020/5/15	0.73%
9	US T N/B 1.0 08/31/19 アメリカ	国債証券	1,476,225,000	98.22 1,449,977,719	98.19 1,449,579,138	1.000000 2019/8/31	0.68%
10	US T N/B 3.125 05/15/19 アメリカ	国債証券	1,421,550,000	101.17 1,438,253,212	100.84 1,433,533,666	3.125000 2019/5/15	0.67%
11	US T N/B 1.625 11/15/22 アメリカ	国債証券	1,476,225,000	95.65 1,412,065,315	95.03 1,402,989,477	1.625000 2022/11/15	0.66%
12	US T N/B 1.75 09/30/22 アメリカ	国債証券	1,366,875,000	96.20 1,315,070,437	95.70 1,308,236,062	1.750000 2022/9/30	0.61%
13	US T N/B 2.0 05/31/21 アメリカ	国債証券	1,312,200,000	98.51 1,292,661,342	98.05 1,286,664,588	2.000000 2021/5/31	0.60%
14	US T N/B 1.375 04/30/20 アメリカ	国債証券	1,312,200,000	98.01 1,286,152,830	97.80 1,283,384,088	1.375000 2020/4/30	0.60%
15	US T N/B 1.875 08/31/22 アメリカ	国債証券	1,312,200,000	96.83 1,270,668,870	96.32 1,264,016,016	1.875000 2022/8/31	0.59%
16	US T N/B 2.25 03/31/21 アメリカ	国債証券	1,257,525,000	99.41 1,250,155,903	98.92 1,243,956,305	2.250000 2021/3/31	0.58%
17	US T N/B 1.75 03/31/22 アメリカ	国債証券	1,279,395,000	96.79 1,238,403,184	96.32 1,232,313,264	1.750000 2022/3/31	0.58%
18	US T N/B 1.75 05/15/22 アメリカ	国債証券	1,268,460,000	96.67 1,226,334,443	96.19 1,220,195,097	1.750000 2022/5/15	0.57%
19	US T N/B 1.125 05/31/19 アメリカ	国債証券	1,202,850,000	98.73 1,187,621,919	98.73 1,187,670,033	1.125000 2019/5/31	0.56%
20	US T N/B 1.875 06/30/20 アメリカ	国債証券	1,202,850,000	98.95 1,190,304,274	98.61 1,186,214,584	1.875000 2020/6/30	0.56%
21	US T N/B 2.125 08/15/21 アメリカ	国債証券	1,202,850,000	98.74 1,187,718,147	98.21 1,181,415,213	2.125000 2021/8/15	0.55%
22	US T N/B 1.375 04/30/21 アメリカ	国債証券	1,225,813,500	96.34 1,181,029,972	96.33 1,180,887,435	1.375000 2021/4/30	0.55%
23	US T N/B 1.25 01/31/20 アメリカ	国債証券	1,180,980,000	98.10 1,158,553,189	97.94 1,156,710,861	1.250000 2020/1/31	0.54%

24	US T N/B 2.0 11/30/20 アメリカ	国債証券	1,148,175,000	98.96 1,136,233,980	98.51 1,131,124,601	2.000000 2020/11/30	0.53%
25	US T N/B 1.375 09/30/23 アメリカ	国債証券	1,202,850,000	93.03 1,119,023,383	92.57 1,113,574,473	1.375000 2023/9/30	0.52%
26	US T N/B 2.25 11/15/24 アメリカ	国債証券	1,159,110,000	96.53 1,118,993,202	95.94 1,112,108,089	2.250000 2024/11/15	0.52%
27	US T N/B 2.0 11/15/21 アメリカ	国債証券	1,137,240,000	98.12 1,115,950,867	97.62 1,110,264,667	2.000000 2021/11/15	0.52%
28	FRANCE OAT 2.5 10/25/20 フランス	国債証券	1,032,642,000	107.59 1,111,060,833	107.30 1,108,097,150	2.500000 2020/10/25	0.52%
29	US T N/B 2.75 11/15/23 アメリカ	国債証券	1,093,500,000	100.15 1,095,205,860	99.40 1,087,004,610	2.750000 2023/11/15	0.51%
30	US T N/B 2.125 09/30/21 アメリカ	国債証券	1,093,500,000	98.62 1,078,464,375	98.11 1,072,909,395	2.125000 2021/9/30	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4月27日現在

種類	投資比率
国債証券	101.79%
合計	101.79%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

平成30年4月27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	576,800	5,538.90 3,194,841,387	5,327.86 3,073,114,262	- -	4.76%
2	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD 韓国	株式 コンピュータ・周辺機器	9,852	254,734.95 2,509,648,770	265,392.59 2,614,647,895	- -	4.05%
3	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	117,380	19,542.78 2,293,932,338	19,015.96 2,232,093,971	- -	3.46%
4	TAIWAN SEMICONDUCTOR 台湾	株式 半導体・半導 体製造装置	2,501,083	874.54 2,187,300,471	816.95 2,043,284,767	- -	3.17%
5	NASPERS LTD 南アフリカ	株式 メディア	44,143	26,552.82 1,172,121,535	26,415.89 1,166,077,073	- -	1.81%
6	CHINA CONSTRUCTION BANK 中国	株式 銀行	8,613,530	110.08 948,246,352	111.93 964,183,043	- -	1.49%
7	BAIDU INC -SPON ADR ケイマン諸島	株式 インターネット ソフトウェア・サービス	27,600	25,757.99 710,920,670	26,100.75 720,380,741	- -	1.12%
8	IND & COMM BK OF CHINA - H 中国	株式 銀行	7,577,235	91.97 696,896,826	94.09 712,979,927	- -	1.10%
9	CHINA MOBILE LIMITED 香港	株式 無線通信サー ビス	614,000	1,012.38 621,604,650	1,005.07 617,115,436	- -	0.96%
10	PING AN INSURANCE GROUP CO-H 中国	株式 保険	534,500	1,130.15 604,069,690	1,094.98 585,270,551	- -	0.91%
11	SK HYNIX INC 韓国	株式 半導体・半導 体製造装置	60,099	8,435.64 506,973,962	8,805.69 529,213,764	- -	0.82%
12	ITAU UNIBANCO HOLDING SA ブラジル	株式 銀行	321,998	1,588.39 511,461,325	1,621.78 522,212,492	- -	0.81%
13	VALE SA ブラジル	株式 金属・鉱業	321,221	1,445.54 464,339,229	1,530.64 491,674,032	- -	0.76%
14	HON HAI PRECISION INDUSTRY 台湾	株式 電子装置・機 器・部品	1,611,532	317.94 512,371,128	296.60 477,993,283	- -	0.74%
15	BANK OF CHINA LTD 中国	株式 銀行	8,212,200	57.46 471,909,593	58.12 477,373,543	- -	0.74%
16	RELIANCE INDUSTRIES LTD インド	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	292,811	1,557.09 455,935,372	1,609.32 471,228,794	- -	0.73%

17	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP インド	株式 貯蓄・抵当・ 不動産金融	150,810	3,114.77 469,739,380	3,053.24 460,459,501	- -	0.71%
18	SBERBANK ADR ロシア	株式 銀行	280,870	1,553.52 436,339,691	1,594.86 447,951,066	- -	0.69%
19	SAMSUNG ELECTRONICS-PFD 韓国	株式 コンピュー タ・周辺機器	1,800	206,601.97 371,883,554	214,696.20 386,453,160	- -	0.60%
20	BANCO BRADESCO SA PREF ブラジル	株式 銀行	332,425	1,059.55 352,222,076	1,091.56 362,863,129	- -	0.56%
21	AMBEV SA ブラジル	株式 飲料	490,295	726.80 356,347,444	732.63 359,206,443	- -	0.56%
22	AMERICA MOVIL SAB DE CV メキシコ	株式 無線通信サー ビス	3,324,278	103.55 344,255,817	101.84 338,577,714	- -	0.52%
23	INFOSYS LTD インド	株式 情報技術サー ビス	172,537	1,860.56 321,015,880	1,941.14 334,918,903	- -	0.52%
24	LUKOIL SPON ADR ロシア	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	44,852	6,951.26 311,778,149	7,112.12 318,992,985	- -	0.49%
25	CNOOC LTD 香港	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	1,761,000	174.24 306,839,510	178.98 315,200,685	- -	0.49%
26	GAZPROM PAO ADR ロシア	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	559,050	497.80 278,297,846	498.63 278,762,455	- -	0.43%
27	PETROLEO BRASILEIRO SA ブラジル	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	385,012	663.26 255,363,913	711.26 273,843,981	- -	0.42%
28	POSCO 韓国	株式 金属・鉱業	7,262	33,958.90 246,609,563	36,495.29 265,028,868	- -	0.41%
29	TATA CONSULTANCY SERVICES LTD インド	株式 情報技術サー ビス	44,975	5,242.54 235,783,253	5,839.76 262,643,318	- -	0.41%
30	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	64,400	4,391.93 282,840,578	3,991.27 257,038,110	- -	0.40%

(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4月27日現在

種類	投資比率
株式	92.25%
投資信託受益証券	0.47%
投資証券	0.20%
合計	92.92%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

平成30年4月27日現在

業種	国内/外国	投資比率
銀行	外国	15.65%
インターネットソフトウェア・サービス		10.63%
石油・ガス・消耗燃料		6.78%
コンピュータ・周辺機器		5.47%
半導体・半導体製造装置		5.10%
保険		3.23%
金属・鉱業		3.21%
無線通信サービス		2.97%
不動産管理・開発		2.28%
化学		2.24%
メディア		2.18%
電子装置・機器・部品		2.15%
自動車		2.13%
食品・生活必需品小売り		1.63%
情報技術サービス		1.59%
食品		1.55%
コングロマリット		1.54%
各種電気通信サービス		1.32%
医薬品		1.31%
各種金融サービス		1.15%
資本市場		1.10%
電力		1.04%
飲料		0.97%
貯蓄・抵当・不動産金融		0.88%
運送インフラ		0.86%
建設資材		0.82%
インターネット販売・通信販売		0.76%
パーソナル用品		0.76%
機械		0.71%
建設・土木		0.68%
ホテル・レストラン・レジャー		0.62%
自動車部品		0.59%
複合小売り		0.59%
繊維・アパレル・贅沢品		0.55%
バイオテクノロジー		0.52%
各種消費者サービス		0.51%
タバコ		0.50%
ガス		0.50%

紙製品・林産品	0.48%
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	0.48%
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.43%
専門小売り	0.40%
家庭用品	0.38%
家庭用耐久財	0.35%
旅客航空輸送業	0.30%
エクイティ不動産投資信託(REITs)	0.27%
ソフトウェア	0.25%
陸運・鉄道	0.22%
消費者金融	0.22%
水道	0.20%
航空宇宙・防衛	0.17%
電気設備	0.17%
ライフサイエンス・ツール/サービス	0.14%
商業サービス・用品	0.10%
エネルギー設備・サービス	0.09%
海運業	0.07%
総合公益事業	0.07%
容器・包装	0.06%
ヘルスケア機器・用品	0.06%
通信機器	0.06%
航空貨物・物流サービス	0.06%
販売	0.05%
建設関連製品	0.04%
商社・流通業	0.04%
ヘルスケア・テクノロジー	0.03%
レジャー用品	0.03%
合計	92.25%

(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4月27日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	RUSSIAN FEDERATION 5.25 06/23/47 ロシア	国債証券	2,821,230,000	96.09 2,711,168,787	95.90 2,705,587,782	5.250000 2047/6/23	2.38%
2	RUSSIAN FEDERATION 03/31/30 ロシア	国債証券	1,669,063,725	112.09 1,871,003,744	111.51 1,861,273,103	7.500000 2030/3/31	1.64%
3	RUSSIA FOREIGN BOND 5.0 04/29/20 ロシア	国債証券	1,771,470,000	102.18 1,810,234,793	102.35 1,813,223,547	5.000000 2020/4/29	1.59%
4	BRAZIL 4.25 01/07/25 ブラジル	国債証券	1,760,535,000	99.77 1,756,573,796	98.92 1,741,609,248	4.250000 2025/1/7	1.53%
5	PERU 5.625 11/18/50 ペルー	国債証券	1,487,160,000	120.69 1,794,974,782	116.78 1,736,779,806	5.625000 2050/11/18	1.53%
6	UNITED MEXICAN STATES 4.75 03/08/44 メキシコ	国債証券	1,793,340,000	97.74 1,752,924,240	94.25 1,690,222,950	4.750000 2044/3/8	1.49%
7	COLOMBIA 5.0 06/15/45 コロンビア	国債証券	1,662,120,000	101.70 1,690,529,130	98.50 1,637,188,200	5.000000 2045/6/15	1.44%
8	PERU 7.35 07/21/25 ペルー	国債証券	1,202,850,000	124.32 1,495,383,120	122.33 1,471,446,405	7.350000 2025/7/21	1.29%
9	UNITED MEXICAN STATES 6.05 01/11/40 メキシコ	国債証券	1,301,265,000	113.92 1,482,466,151	110.22 1,434,319,346	6.050000 2040/1/11	1.26%
10	UNITED MEXICAN STATES 4.0 10/02/23 メキシコ	国債証券	1,388,745,000	102.53 1,423,977,460	101.18 1,405,229,403	4.000000 2023/10/2	1.23%
11	PANAMA 6.7 01/26/36 パナマ	国債証券	1,115,370,000	125.80 1,403,135,460	123.57 1,378,262,709	6.700000 2036/1/26	1.21%
12	TURKEY 6.0 03/25/27 トルコ	国債証券	1,355,940,000	100.37 1,360,993,719	100.63 1,364,482,422	6.000000 2027/3/25	1.20%
13	TURKEY 7.375 02/05/25 トルコ	国債証券	1,235,655,000	110.14 1,361,073,982	110.10 1,360,456,155	7.375000 2025/2/5	1.20%
14	BRAZIL 4.875 01/22/21 ブラジル	国債証券	1,312,200,000	104.13 1,366,492,275	103.45 1,357,470,900	4.875000 2021/1/22	1.19%
15	UNITED MEXICAN STATES 5.55 01/21/45 メキシコ	国債証券	1,246,590,000	110.18 1,373,530,259	105.45 1,314,566,552	5.550000 2045/1/21	1.16%
16	RUSSIAN FEDERATION 4.75 05/27/26 ロシア	国債証券	1,290,330,000	100.65 1,298,768,758	101.18 1,305,633,313	4.750000 2026/5/27	1.15%
17	RUSSIAN FEDERATION 5.625 04/04/42 ロシア	国債証券	1,224,720,000	104.48 1,279,636,444	104.22 1,276,439,925	5.625000 2042/4/4	1.12%
18	UNITED MEXICAN STATES 4.15 03/28/27 メキシコ	国債証券	1,290,330,000	100.90 1,301,975,775	98.65 1,272,910,545	4.150000 2027/3/28	1.12%

19	BRAZIL 5.0 01/27/45 ブラジル	国債証券	1,443,420,000	88.55 1,278,162,844	87.10 1,257,218,820	5.000000 2045/1/27	1.10%
20	TURKEY 4.875 10/09/26 トルコ	国債証券	1,334,070,000	93.74 1,250,637,043	93.92 1,252,971,884	4.875000 2026/10/9	1.10%
21	RUSSIAN FEDERATION 4.875 09/16/23 ロシア	国債証券	1,202,850,000	102.98 1,238,812,809	103.45 1,244,384,410	4.875000 2023/9/16	1.09%
22	COLOMBIA 6.125 01/18/41 コロンビア	国債証券	1,093,500,000	115.25 1,260,258,750	113.00 1,235,655,000	6.125000 2041/1/18	1.09%
23	COLOMBIA 4.375 07/12/21 コロンビア	国債証券	1,180,980,000	103.42 1,221,428,565	102.67 1,212,571,215	4.375000 2021/7/12	1.07%
24	COLOMBIA 5.625 02/26/44 コロンビア	国債証券	1,115,370,000	109.85 1,225,233,945	107.00 1,193,445,900	5.625000 2044/2/26	1.05%
25	TURKEY 6.0 01/14/41 トルコ	国債証券	1,279,395,000	92.75 1,186,754,008	92.72 1,186,280,631	6.000000 2041/1/14	1.04%
26	BRAZIL 5.625 02/21/47 ブラジル	国債証券	1,246,590,000	96.32 1,200,777,817	94.90 1,183,013,910	5.625000 2047/2/21	1.04%
27	TURKEY 6.625 02/17/45 トルコ	国債証券	1,170,045,000	98.03 1,147,088,717	98.29 1,150,084,032	6.625000 2045/2/17	1.01%
28	INDONESIA 4.125 01/15/25 インドネシア	国債証券	1,115,370,000	101.08 1,127,415,996	99.24 1,106,915,495	4.125000 2025/1/15	0.97%
29	UNITED MEXICAN STATES 4.6 01/23/46 メキシコ	国債証券	1,202,850,000	95.85 1,152,931,725	91.50 1,100,607,750	4.600000 2046/1/23	0.97%
30	INDONESIA 4.875 05/05/21 インドネシア	国債証券	1,060,695,000	104.43 1,107,768,644	103.73 1,100,343,779	4.875000 2021/5/5	0.97%

(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4月27日現在

種類	投資比率
国債証券	96.74%
合計	96.74%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

D I A Mコア資産設計ファンド（堅実型）

該当事項はありません。

D I A Mコア資産設計ファンド（積極型）

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4月27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 3006月	買建	260	4,445,394,240	4,626,700,000	1.53%

（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4月27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05月	買建	2,241,000	244,986,120	244,963,710	0.08%
		ユーロ買/円売201 8年05月	買建	278,000	36,806,922	36,804,420	0.01%
		イギリス・ポンド買/ 円売2018年05月	買建	155,000	23,584,490	23,583,250	0.01%
		カナダ・ドル買/円売 2018年05月	買建	151,000	12,822,316	12,821,410	0.00%
		オーストラリア・ドル 買/円売2018年0 5月	買建	89,000	7,350,332	7,349,620	0.00%
株価指数先物 取引	シカゴ商品 取引所	S&P500 EMI NI FUT Jun 18	買建	357	5,184,034,728	5,220,349,863	1.72%
	EUREX 取引所	DJ EURO ST OXX 50 Jun 18	買建	323	1,433,100,567	1,471,867,007	0.48%
	ICE-E EU	FTSE 100 I NDEX FUTUR E Jun18	買建	50	542,885,496	560,898,620	0.18%
	モントリ オール取引 所	S&P/TSE 6 0 IX FUT J un18	買建	18	275,643,712	282,052,530	0.09%
	シドニー先 物取引所	SPI 200 FU TURES Jun1 8	買建	16	191,562,263	194,761,336	0.06%

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

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

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

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年4月27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05月	買建	37,880,076	4,141,050,000	4,140,671,199	1.94%
		ユーロ買/円売201 8年05月	買建	30,494,792	4,037,480,000	4,037,205,547	1.89%
		イギリス・ポンド買/ 円売2018年05月	買建	4,491,712	683,450,000	683,414,066	0.32%
		オーストラリア・ドル 買/円売2018年0 5月	買建	2,430,498	200,730,000	200,710,556	0.09%
		カナダ・ドル買/円売 2018年05月	買建	2,298,389	195,170,000	195,156,209	0.09%
		ポーランド・ズロチ 買/円売2018年0 5月	買建	3,358,037	105,120,000	105,072,987	0.05%
		デンマーク・クローネ 買/円売2018年0 5月	買建	5,248,438	93,270,000	93,264,751	0.04%
		スイス・フラン買/円 売2018年05月	買建	818,807	90,520,000	90,510,993	0.04%
		シンガポール・ドル 買/円売2018年0 5月	買建	272,853	22,440,000	22,439,454	0.01%

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

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

為替予約取引の数量は、現地通貨建契約金額です。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

平成30年4月27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05月	買建	919,000	100,465,080	100,455,890	0.16%
		アメリカ・ドル売/円 買2018年05月	売建	4,500,000	491,850,000	491,940,000	0.76%
		南アフリカ・ランド 売/円買2018年0 5月	売建	33,600,000	295,108,800	296,016,000	0.46%
株価指数先物 取引	ICE-US	MINI MSCI EMG MKT Ju n18	買建	727	4,655,303,968	4,586,207,890	7.10%

(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4月27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05月	売建	750,000	81,990,000	81,982,500	0.07%

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

(注2) 為替予約取引の時価は、原則としてわが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しています。
為替予約取引の数量は、現地通貨建契約金額です。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

直近日(平成30年4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。

D I A Mコア資産設計ファンド(堅実型)

	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10月13日)	301	301	0.9926	0.9926
第2計算期間末 (平成28年4月11日)	240	240	0.9460	0.9460
第3計算期間末 (平成28年10月11日)	233	233	0.9477	0.9477
第4計算期間末 (平成29年4月11日)	165	165	1.0000	1.0000
第5計算期間末 (平成29年10月11日)	141	141	1.0538	1.0538
第6計算期間末 (平成30年4月11日)	133	133	1.0645	1.0645
平成29年4月末日	166	-	1.0063	-
5月末日	156	-	1.0166	-
6月末日	158	-	1.0306	-
7月末日	145	-	1.0377	-
8月末日	144	-	1.0383	-
9月末日	140	-	1.0464	-
10月末日	136	-	1.0630	-
11月末日	135	-	1.0662	-
12月末日	137	-	1.0796	-
平成30年1月末日	137	-	1.0842	-
2月末日	133	-	1.0670	-
3月末日	133	-	1.0640	-
4月末日	134	-	1.0698	-

D I A Mコア資産設計ファンド(積極型)

	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10月13日)	519	519	0.9901	0.9901
第2計算期間末 (平成28年4月11日)	418	418	0.9230	0.9230
第3計算期間末 (平成28年10月11日)	404	404	0.9286	0.9286
第4計算期間末 (平成29年4月11日)	368	368	0.9691	0.9691
第5計算期間末 (平成29年10月11日)	312	312	1.0451	1.0451
第6計算期間末 (平成30年4月11日)	297	297	1.0571	1.0571
平成29年4月末日	367	-	0.9774	-
5月末日	348	-	0.9926	-
6月末日	347	-	1.0086	-
7月末日	346	-	1.0174	-
8月末日	341	-	1.0202	-
9月末日	327	-	1.0349	-
10月末日	295	-	1.0583	-
11月末日	293	-	1.0651	-
12月末日	297	-	1.0813	-
平成30年1月末日	297	-	1.0843	-
2月末日	289	-	1.0601	-
3月末日	295	-	1.0563	-
4月末日	299	-	1.0653	-

【分配の推移】

D I A Mコア資産設計ファンド(堅実型)

	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

D I A Mコア資産設計ファンド(積極型)

	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

【収益率の推移】

D I A Mコア資産設計ファンド（堅実型）

	収益率(%)
第1計算期間	0.7
第2計算期間	4.7
第3計算期間	0.2
第4計算期間	5.5
第5計算期間	5.4
第6計算期間	1.0

（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。

D I A Mコア資産設計ファンド（積極型）

	収益率(%)
第1計算期間	1.0
第2計算期間	6.8
第3計算期間	0.6
第4計算期間	4.4
第5計算期間	7.8
第6計算期間	1.1

（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】

D I A Mコア資産設計ファンド(堅実型)

	設定口数	解約口数
第1計算期間	312,448,290	8,299,019
第2計算期間	41,355,881	91,105,022
第3計算期間	7,228,942	14,873,920
第4計算期間	6,056,134	87,803,625
第5計算期間	10,207,312	41,322,402
第6計算期間	12,455,819	20,836,255

(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。

D I A Mコア資産設計ファンド(積極型)

	設定口数	解約口数
第1計算期間	538,147,596	13,046,804
第2計算期間	67,620,276	138,974,156
第3計算期間	13,958,010	31,768,621
第4計算期間	14,712,909	70,413,301
第5計算期間	38,653,832	119,655,755
第6計算期間	34,785,616	52,794,441

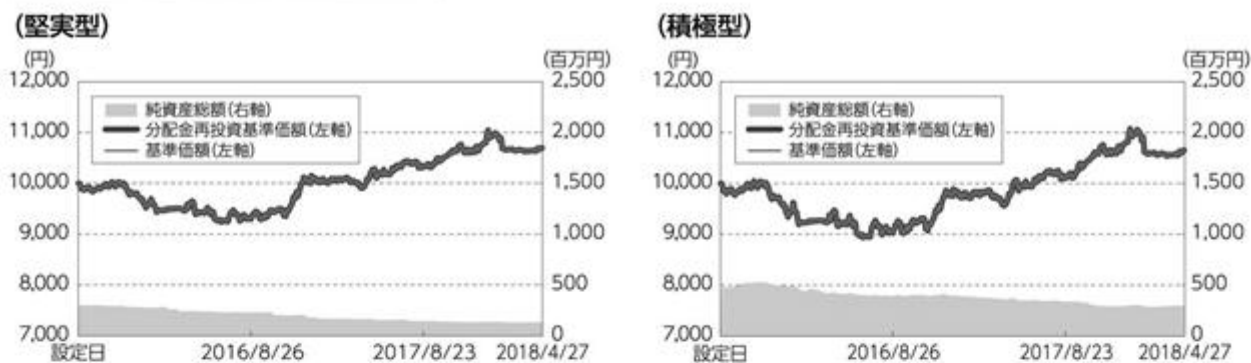
(注1) 本邦外における設定及び解約はございません。

(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4月27日

基準価額・純資産の推移 (2015年8月28日～2018年4月27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:2015年8月28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)

	(堅実型)	(積極型)
第2期(2016.04.11)	0円	0円
第3期(2016.10.11)	0円	0円
第4期(2017.04.11)	0円	0円
第5期(2017.10.11)	0円	0円
第6期(2018.04.11)	0円	0円
設定来累計	0円	0円

※分配金は1万口当たりです。

主要な資産の状況

■DIAMコア資産設計ファンド

※比率(%)は、各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。

(堅実型)

組入銘柄

順位	銘柄名	比率
1	国内株式/パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	14.22%
2	エマージング株式/パッシブ・マザーファンド	13.79%
3	外国債券/パッシブ・ファンド・マザーファンド	11.11%
4	外国株式/パッシブ・ファンド・マザーファンド	5.65%
5	エマージング債券/パッシブ・マザーファンド	5.59%
6	国内債券/パッシブ・ファンド・マザーファンド	5.53%

(積極型)

組入銘柄

順位	銘柄名	比率
1	国内株式/パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	23.11%
2	エマージング株式/パッシブ・マザーファンド	22.34%
3	外国債券/パッシブ・ファンド・マザーファンド	18.00%
4	外国株式/パッシブ・ファンド・マザーファンド	9.20%
5	エマージング債券/パッシブ・マザーファンド	9.07%
6	国内債券/パッシブ・ファンド・マザーファンド	8.96%

○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4月27日

■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	1.16%
2	122回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.100000	2019/12/20	1.16%
3	118回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.200000	2019/6/20	1.08%
4	344回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.100000	2026/9/20	1.02%
5	345回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.100000	2026/12/20	1.02%

■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	3.38%
2	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	日本	銀行業	1.96%
3	ソフトバンクグループ	株式	日本	情報・通信業	1.46%
4	日本電信電話	株式	日本	情報・通信業	1.42%
5	ソニー	株式	日本	電気機器	1.40%

■外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還期限	比率
1	US T N/B 2.0 02/15/22	国債証券	アメリカ	2.000000	2022/2/15	0.87%
2	US T N/B 2.625 08/15/20	国債証券	アメリカ	2.625000	2020/8/15	0.85%
3	US T N/B 3.625 02/15/20	国債証券	アメリカ	3.625000	2020/2/15	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	0.79%
5	US T N/B 1.25 10/31/19	国債証券	アメリカ	1.250000	2019/10/31	0.76%

■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	2.25%
2	MICROSOFT CORP	株式	アメリカ	ソフトウェア	1.84%
3	AMAZON.COM INC	株式	アメリカ	インターネット販売・通信販売	1.66%
4	FACEBOOK INC	株式	アメリカ	インターネットソフトウェア・サービス	1.11%
5	JPMORGAN CHASE & CO	株式	アメリカ	銀行	1.02%

○掲載データ等はあくまでも過去の実績であり、将来の運用成果を示唆、保証するものではありません。

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

データの基準日:2018年4月27日

■エマージング債券パッシブ・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還期限	比率
1	RUSSIAN FEDERATION 5.25 06/23/47	国債証券	ロシア	5.250000	2047/6/23	2.38%
2	RUSSIAN FEDERATION 03/31/30	国債証券	ロシア	7.500000	2030/3/31	1.64%
3	RUSSIA FOREIGN BOND 5.0 04/29/20	国債証券	ロシア	5.000000	2020/4/29	1.59%
4	BRAZIL 4.25 01/07/25	国債証券	ブラジル	4.250000	2025/1/7	1.53%
5	PERU 5.625 11/18/50	国債証券	ペルー	5.625000	2050/11/18	1.53%

■エマージング株式パッシブ・マザーファンド

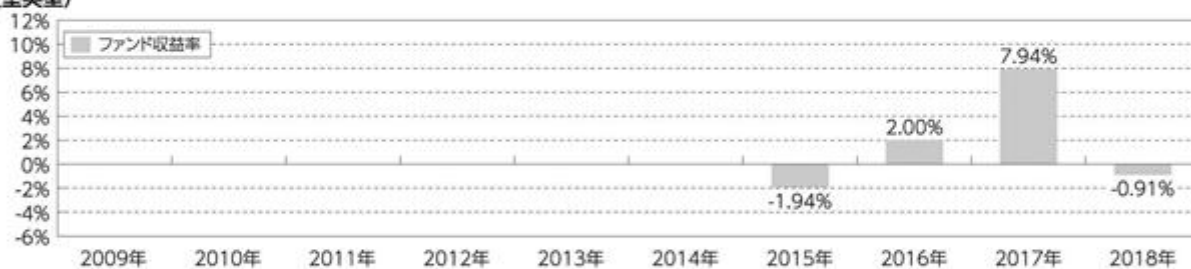
※比率(%)は、当該マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

組入上位5銘柄

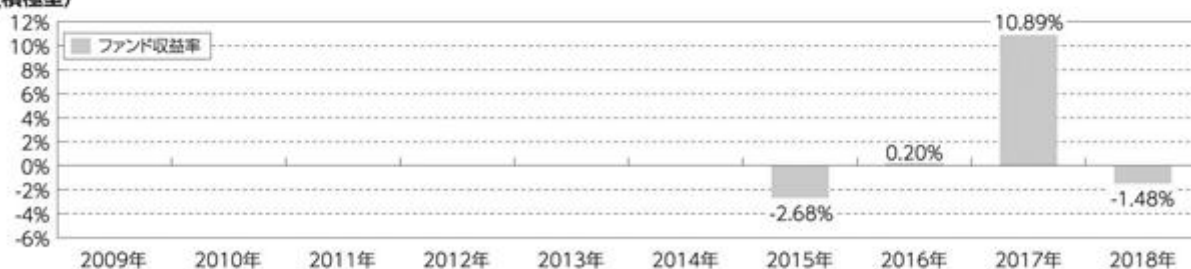
順位	銘柄名	種類	国/地域	業種	比率
1	TENCENT HOLDINGS LTD	株式	ケイマン諸島	インターネットソフトウェア・サービス	4.76%
2	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	株式	韓国	コンピュータ・周辺機器	4.05%
3	ALIBABA GROUP HOLDING LTD-ADR	株式	ケイマン諸島	インターネットソフトウェア・サービス	3.46%
4	TAIWAN SEMICONDUCTOR	株式	台湾	半導体・半導体製造装置	3.17%
5	NASPERS LTD	株式	南アフリカ	メディア	1.81%


年間収益率の推移(暦年ベース)

(堅実型)



(積極型)



※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。

※2015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。

※各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。

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

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

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。)には取得またはスイッチングの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、取得のお申込み(スイッチングのお申込みを含みます。)の受付を中止することおよびすでに受付けた取得のお申込み(スイッチングのお申込みを含みます。)の受付を取り消すことができるものとします。

受益権の取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時にまたはあらかじめ、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、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。委託会社は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権にかかる信託を設定した旨の通知を行います。

・お申込価額

お申込日の翌営業日の基準価額とします。

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

「基準価額」とは、純資産総額(ファンドの資産総額から負債総額を控除した金額)を計算日の受益権総口数で除した価額をいいます。(ただし、便宜上1万口あたりに換算した基準価額で表示することがあります。)

< 基準価額の照会方法等 >

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

各ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・ 販売会社へのお問い合わせ
- ・ 委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

・ お申込手数料

お申込日の翌営業日の基準価額に、3.24%（税抜3.00%）を上限に各販売会社が定める手数料率を乗じて得た額とします。

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

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

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

・ お申込単位

各販売会社が定める単位とします。

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

取扱コースおよびお申込単位は、販売会社にお問い合わせください。

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

当初元本は1口当たり1円です。

・ 払込期日

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

2【換金（解約）手続等】

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

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

海外休業日には、解約の受付を行いません。

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

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

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

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、解約の受付を中止することおよびすでに受付けた解約の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。

各ファンドの解約価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

・解約単位

各販売会社が定める単位とします。

解約単位は販売会社にお問い合わせください。

・解約代金の受渡日

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

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

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

<主な投資対象の時価評価方法の原則>

投資対象	評価方法
マザーファンド 受益証券	計算日の基準価額
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。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

（2）【保管】

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

（3）【信託期間】

信託期間は、平成27年8月28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4月12日から10月11日まで、および10月12日から翌年4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、各ファンドにつき受益権口数が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っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
- c. 上記b.の書面決議において、受益者(委託会社およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。イ.償還規定c.において同じ。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができません。なお、知っている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- d. 上記b.の書面決議は議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- e. 上記b.からd.までの規定は、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、信託契約にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって上記b.からd.までの手続きを行うことが困難な場合にも適用しません。
- f. 委託会社は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し信託を終了させます。
- g. 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が、信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、下記「ロ. 信託約款の変更等 b.」の書面決議が否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
- h. 受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を申立てることができます。受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は下記「ロ. 信託約款の変更等」の規定にしたがい、新受託会社を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託会社を解任することはできないものとします。委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は信託契約を解約し、信託を終了させます。
- i. この信託は、受益者が一部解約請求を行ったときは、委託会社が信託契約の一部の解約をすることにより当該請求に応じ、当該受益権の公正な価格が当該受益者に一部解約金として支払われることとなる委託者指図型投資信託に該当するため、信託契約の解約を行う場合において、投資信託及び投資法人に関する法律第18条第1項に定める反対受益者による受益権買取請求の規定の適用を受けません。

ロ. 信託約款の変更等

- a. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、約款を変更することまたはこの信託と他の投資信託との併合(投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。)を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合

しようとする旨およびその内容を監督官庁に届出ます。なお、約款はa.からg.に定める以外の方法によって変更することができないものとします。

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

八. 関係法人との契約の更改

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

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。

二．公告

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

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

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

ホ．運用報告書

・委託会社は、毎年4月11日、10月11日(休業日の場合は翌営業日とします。)および償還時に交付運用報告書を作成し、販売会社を通じて受益者に対して交付します。

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

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

4【受益者の権利等】

収益分配金請求権

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

受益者が収益分配金支払開始日から5年間支払いを請求しないときは、その権利を失い、委託会社が受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。

収益分配金は、決算日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者(当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者として)に、原則として決算日から起算して5営業日までにお支払いを開始します。

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

償還金請求権

受益者は、持ち分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

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

一部解約請求権

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

帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)

- (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6期計算期間(平成29年10月12日から平成30年4月11日まで)の財務諸表について、新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

1【財務諸表】

【DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)】

(1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第5期 平成29年10月11日現在	第6期 平成30年4月11日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	32,277,536	121,049,435
親投資信託受益証券	110,003,347	13,327,390
流動資産合計	142,280,883	134,376,825
資産合計	142,280,883	134,376,825
負債の部		
流動負債		
未払解約金	315,930	-
未払受託者報酬	41,409	36,566
未払委託者報酬	828,858	732,294
その他未払費用	3,635	2,851
流動負債合計	1,189,832	771,711
負債合計	1,189,832	771,711
純資産の部		
元本等		
元本	1 133,892,571	1 125,512,135
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	7,198,480	8,092,979
(分配準備積立金)	7,742,211	7,750,312
元本等合計	141,091,051	133,605,114
純資産合計	141,091,051	133,605,114
負債純資産合計	142,280,883	134,376,825

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第5期		第6期	
	自	平成29年4月12日 至 平成29年10月11日	自	平成29年10月12日 至 平成30年4月11日
営業収益				
受取利息		31		-
有価証券売買等損益		9,224,619		2,224,043
営業収益合計		9,224,650		2,224,043
営業費用				
支払利息		23,332		21,329
受託者報酬		41,409		36,566
委託者報酬		828,858		732,294
その他費用		14,435		2,851
営業費用合計		908,034		793,040
営業利益又は営業損失()		8,316,616		1,431,003
経常利益又は経常損失()		8,316,616		1,431,003
当期純利益又は当期純損失()		8,316,616		1,431,003
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約 に伴う当期純損失金額の分配額()		1,380,576		260,564
期首剰余金又は期首欠損金()		5,057		7,198,480
剰余金増加額又は欠損金減少額		297,947		852,632
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		297,947		852,632
剰余金減少額又は欠損金増加額		30,450		1,128,572
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		30,450		1,128,572
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金()		7,198,480		8,092,979

（ 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5期 平成29年10月11日現在	第6期 平成30年4月11日現在
1 . 1 期首元本額	165,007,661円	133,892,571円
期中追加設定元本額	10,207,312円	12,455,819円
期中一部解約元本額	41,322,402円	20,836,255円
2 . 受益権の総数	133,892,571口	125,512,135口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	第5期 自 平成29年4月12日 至 平成29年10月11日	第6期 自 平成29年10月12日 至 平成30年4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（991,860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（5,694,550円）、信託約款に規定される収益調整金（116,355円）及び分配準備積立金（1,055,801円）より分配対象収益は7,858,566円（1万口当たり586.93円）であります。なお、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（346,300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（824,139円）、信託約款に規定される収益調整金（791,923円）及び分配準備積立金（6,579,873円）より分配対象収益は8,542,235円（1万口当たり680.59円）であります。なお、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5期 自 平成29年4月12日 至 平成29年10月11日	第6期 自 平成29年10月12日 至 平成30年4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（親投資信託受益証券が保有する金融商品を含む）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。	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5期 平成29年10月11日現在	第6期 平成30年4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5期 平成29年10月11日現在	第6期 平成30年4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	4,088,946	420,149
合計	4,088,946	420,149

(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5期 平成29年10月11日現在	第6期 平成30年4月11日現在
	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0538円 (10,538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4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	1,239,139	3,260,298	
	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファ ンド	1,123,528	1,451,485	
	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファ ンド	402,135	1,334,364	
	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファ ンド	1,547,650	2,797,377	
	エマージング株式パッシブ・マザーファン ド	2,541,969	3,137,298	
	エマージング債券パッシブ・マザーファン ド	756,244	1,346,568	
親投資信託受益証券 合計		7,610,665	13,327,390	
合計		7,610,665	13,327,390	

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。

D I A Mコア資産設計ファンド(積極型)

- (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6期計算期間(平成29年10月12日から平成30年4月11日まで)の財務諸表について、新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

【DIAMコア資産設計ファンド(積極型)】

(1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第5期 平成29年10月11日現在	第6期 平成30年4月11日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	4,017,077	258,085,930
親投資信託受益証券	307,976,529	40,892,483
未収入金	15,450,000	-
流動資産合計	327,443,606	298,978,413
資産合計	327,443,606	298,978,413
負債の部		
流動負債		
未払解約金	12,728,484	-
未払受託者報酬	94,170	79,730
未払委託者報酬	1,884,324	1,595,654
その他未払費用	8,394	6,293
流動負債合計	14,715,372	1,681,677
負債合計	14,715,372	1,681,677
純資産の部		
元本等		
元本	1,299,233,986	1,281,225,161
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	13,494,248	16,071,575
(分配準備積立金)	15,931,678	15,726,208
元本等合計	312,728,234	297,296,736
純資産合計	312,728,234	297,296,736
負債純資産合計	327,443,606	298,978,413

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第5期		第6期	
	自	平成29年4月12日 至 平成29年10月11日	自	平成29年10月12日 至 平成30年4月11日
営業収益				
受取利息		43		-
有価証券売買等損益		28,654,180		5,315,954
営業収益合計		28,654,223		5,315,954
営業費用				
支払利息		23,508		35,162
受託者報酬		94,170		79,730
委託者報酬		1,884,324		1,595,654
その他費用		19,194		6,293
営業費用合計		2,021,196		1,716,839
営業利益又は営業損失()		26,633,027		3,599,115
経常利益又は経常損失()		26,633,027		3,599,115
当期純利益又は当期純損失()		26,633,027		3,599,115
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()		5,055,854		1,075,830
期首剰余金又は期首欠損金()		11,751,980		13,494,248
剰余金増加額又は欠損金減少額		3,669,055		2,480,937
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		3,465,449		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		203,606		2,480,937
剰余金減少額又は欠損金増加額		-		2,426,895
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		2,426,895
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金()		13,494,248		16,071,575

(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5期 平成29年10月11日現在	第6期 平成30年4月11日現在
1 . 1 期首元本額	380,235,909円	299,233,986円
期中追加設定元本額	38,653,832円	34,785,616円
期中一部解約元本額	119,655,755円	52,794,441円
2 . 受益権の総数	299,233,986口	281,225,161口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第5期 自 平成29年4月12日 至 平成29年10月11日	第6期 自 平成29年10月12日 至 平成30年4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(2,948,902円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(9,990,588円)、信託約款に規定される収益調整金(528,544円)及び分配準備積立金(2,992,188円)より分配対象収益は16,460,222円(1万口当たり550.08円)ですが、分配を行っておりません。なお、分配金の計算過程においては、親投資信託の配当等収益及び収益調整金相当額を充当する方法によっております。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(961,570円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(1,561,715円)、信託約款に規定される収益調整金(2,282,477円)及び分配準備積立金(13,202,923円)より分配対象収益は18,008,685円(1万口当たり640.37円)ですが、分配を行っておりません。なお、分配金の計算過程においては、親投資信託の配当等収益及び収益調整金相当額を充当する方法によっております。

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	第5期 自 平成29年4月12日 至 平成29年10月11日	第6期 自 平成29年10月12日 至 平成30年4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(親投資信託受益証券が保有する金融商品を含む)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。	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5期 平成29年10月11日現在	第6期 平成30年4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5期 平成29年10月11日現在	第6期 平成30年4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	14,894,744	775,093
合計	14,894,744	775,093

(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5期 平成29年10月11日現在	第6期 平成30年4月11日現在
	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0451円 (10,451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4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	3,802,586	10,004,984	
	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファ ンド	3,353,398	4,332,254	
	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファ ンド	1,245,127	4,131,580	
	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファ ンド	4,761,061	8,605,617	
	エマージング株式パッシブ・マザーファン ド	7,900,364	9,750,629	
	エマージング債券パッシブ・マザーファン ド	2,284,297	4,067,419	
親投資信託受益証券 合計		23,346,833	40,892,483	
合計		23,346,833	40,892,483	

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)

「DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)」、「DIAMコア資産設計ファンド(積極型)」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10月11日現在	平成30年4月11日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		6,030,481,728	10,828,232,932
株式	2	296,982,817,190	289,561,896,277
派生商品評価勘定		210,181,764	94,074,052
未収入金		51,891,488	166,835,521
未収配当金		2,352,054,867	2,641,772,683
流動資産合計		305,627,427,037	303,292,811,465
資産合計		305,627,427,037	303,292,811,465
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		-	203,240
前受金		253,244,000	341,690,000
未払金		-	9,984,484,244
未払解約金		174,916,000	175,074,000
流動負債合計		428,160,000	10,501,451,484
負債合計		428,160,000	10,501,451,484
純資産の部			
元本等			
元本	1	119,262,204,158	111,281,995,587
剰余金			
剰余金又は欠損金()		185,937,062,879	181,509,364,394
元本等合計		305,199,267,037	292,791,359,981
純資産合計		305,199,267,037	292,791,359,981
負債純資産合計		305,627,427,037	303,292,811,465

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10月11日現在	平成30年4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	126,432,339,583円	119,262,204,158円
同期中追加設定元本額	10,237,509,214円	12,307,585,270円
同期中一部解約元本額	17,407,644,639円	20,287,793,841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	7,372,866,010円	9,553,973,683円
DIAM国内株式パッシブ・ファンド	2,140,866,731円	1,934,519,101円
MITO ラップ型ファンド（安定型）	5,442,510円	4,115,683円
MITO ラップ型ファンド（中立型）	13,150,139円	9,042,847円
MITO ラップ型ファンド（積極型）	24,094,466円	16,007,723円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	13,228,825円	22,367,745円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	13,420,191円	18,721,655円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	16,133,738円	15,039,866円
たわらノーロード TOPIX	76,155,116円	170,149,558円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	5,374,417円	20,100,721円
たわらノーロード バランス（堅実型）	- 円	412,759円
たわらノーロード バランス（標準型）	- 円	2,586,944円

たわらノーロード バランス (積極型)	- 円	7,648,425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	41,970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	1,824,825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	2,727,260円
たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(成長型)	- 円	2,355,579円
たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(積極型)	- 円	5,700,586円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(保守型)	- 円	42,775円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定型)	- 円	57,341円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定成長型)	- 円	403,344円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(成長型)	- 円	422,453円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(積極型)	- 円	1,308,809円
D I A M国内株式インデックス ファンド< D C年金>	35,824,475,503円	37,286,881,966円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 1 安定型	797,265,541円	799,183,741円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 2 安定・成長型	2,772,479,361円	2,743,834,554円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 3 成長型	2,863,257,582円	2,857,763,553円
D I A M D C バランス3 0 インデックスファンド	352,045,452円	338,608,842円
D I A M D C バランス5 0 インデックスファンド	1,180,203,120円	1,131,085,619円
D I A M D C バランス7 0 インデックスファンド	1,082,667,693円	1,063,174,443円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型>	50,599,626円	43,373,703円
マネックス資産設計ファンド< 育成型>	1,191,234,103円	1,084,829,283円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	25,856,596円	25,558,900円
D I A M D C 8 資産バラ ンスファンド(新興国1 0)	40,016,978円	41,290,133円
D I A M D C 8 資産バラ ンスファンド(新興国2 0)	92,537,042円	107,162,699円
D I A M D C 8 資産バラ ンスファンド(新興国3 0)	173,232,288円	209,192,825円
投資のソムリエ	3,598,167,045円	1,456,346,648円
クルーズコントロール	1,595,263,316円	201,841,066円
投資のソムリエ< D C年金>	192,862,430円	104,068,746円

DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	147,713,938円	166,392,070円
DIAM DC バランス・F(成長型)	171,592,462円	216,687,941円
クルーズコントロール<DC年金>	635,277円	74,862円
DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)	13,350,602円	1,239,139円
DIAMコア資産設計ファンド(積極型)	36,000,731円	3,802,586円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	60,744,224円	34,252,346円
ダイナミック・ナビゲーション	1,486,477円	1,702,235円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	773,653,552円	565,736,630円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	592,766円	564,394円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	592,766円	412,164円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	238,256円	172,550円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	-円	585,580円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	-円	1,186,612円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	76,811,419円	71,978,721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)	156,029,386円	131,297,159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)	336,642,273円	293,628,160円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	19,939,130円	16,310,580円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	96,956,097円	71,472,546円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	21,537,117円	17,536,694円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	27,179,602円	20,478,291円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	40,415,290円	30,744,677円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	67,149,356円	55,943,767円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	1,227,658,919円	1,081,391,430円

D I A Mバランスファンド3 7.5 V A (適格機関投資家限 定)	1,159,850,522円	1,017,110,915円
D I A Mバランスファンド50 V A (適格機関投資家限定)	3,133,600,454円	2,787,488,555円
D I A Mグローバル・アセッ ト・バランスV A (適格機関投 資家限定)	230,574,235円	201,920,528円
D I A Mグローバル・アセッ ト・バランスV A 2 (適格機関 投資家限定)	156,302,608円	83,966,353円
D I A M アクサ グローバ ル バランスファンド30 V A (適格機関投資家限定)	676,430,709円	597,430,175円
D I A M世界アセットバランス ファンドV A (適格機関投資家 向け)	2,674,502,436円	1,313,335,435円
D I A Mグローバル 私募ファ ンド(適格機関投資家向け)	10,313,671円	10,313,671円
D I A M世界バランスファンド 55 V A (適格機関投資家限 定)	179,548,768円	21,943,421円
D I A M世界バランスファンド 35 V A (適格機関投資家限 定)	2,185,668,802円	687,744,704円
D I A M世界アセットバランス ファンド2 V A (適格機関投資 家限定)	16,807,954,256円	15,402,729,373円
D I A M世界アセットバランス ファンド40 V A (適格機関投 資家限定)	606,074,751円	550,455,348円
D I A M世界アセットバランス ファンド25 V A (適格機関投 資家限定)	1,916,590,776円	1,760,010,553円
D I A M世界アセットバランス ファンド3 V A (適格機関投資 家限定)	10,823,468,879円	10,095,461,362円
D I A Mバランス30 V A (適 格機関投資家限定)	3,553,157円	5,031,055円
D I A Mバランス50 V A (適 格機関投資家限定)	4,968,662円	273,573円
D I A Mバランス70 V A (適 格機関投資家限定)	4,468,394円	3,720,103円
D I A M世界アセットバランス ファンド4 V A (適格機関投資 家限定)	9,649,822,981円	8,987,350,006円
D I A M世界バランス25 V A (適格機関投資家限定)	77,974,896円	72,431,048円
D I A M国内バランス30 V A (適格機関投資家限定)	30,029,445円	28,338,107円
D I A Mバランス20 V A (適 格機関投資家限定)	30,306,394円	26,228,092円

	D I A Mバランス40VA(適格機関投資家限定)	69,877円	98,961円
	D I A Mバランス60VA(適格機関投資家限定)	114,762円	111,124円
	D I A M世界アセットバランス ファンド7VA(1212) (適格機関投資家限定)	547,756,483円	426,902,115円
	D I A M世界アセットバランス ファンド7VA(1303) (適格機関投資家限定)	1,500,552,498円	1,323,021,834円
	D I A M世界アセットバランス ファンド7VA(1306) (適格機関投資家限定)	1,976,540,138円	1,737,262,933円
	D I A M世界アセットバランス ファンド7VA(1309) (適格機関投資家限定)	85,350,145円	73,956,736円
	計	119,262,204,158円	111,281,995,587円
2 .	受益権の総数	119,262,204,158口	111,281,995,587口
3 .	2 差入代用有価証券	株式 3,466,000,000円	株式 3,422,500,000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4月12日 至 平成29年10月11日	自 平成29年10月12日 至 平成30年4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10月11日現在	平成30年4月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成29年10月11日現在	平成30年4月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
株式	31,591,136,957	3,985,062,194
合計	31,591,136,957	3,985,062,194

(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10月11日まで及び平成30年2月8日から平成30年4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10月11日 現在				平成30年4月11日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
先物取引								
買 建	7,241,701,000	-	7,452,025,000	210,324,000	5,717,585,000	-	5,811,565,000	93,980,000
合計	7,241,701,000	-	7,452,025,000	210,324,000	5,717,585,000	-	5,811,565,000	93,980,000

(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10月11日現在	平成30年4月11日現在
1口当たり純資産額	2.5591円	2.6311円
(1万口当たり純資産額)	(25,591円)	(26,311円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

平成30年4月11日現在

銘柄	株式数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
極洋	5,200	3,755.00	19,526,000	
日本水産	148,100	573.00	84,861,300	
マルハニチロ	25,000	3,560.00	89,000,000	
ハウスイ	900	1,131.00	1,017,900	
カネコ種苗	4,400	1,596.00	7,022,400	
サカタのタネ	19,400	3,930.00	76,242,000	
ホクト	13,400	2,053.00	27,510,200	
ホクリヨウ	1,900	1,340.00	2,546,000	
ショーボンドホールディングス	12,400	8,110.00	100,564,000	
ミライト・ホールディングス	40,500	1,717.00	69,538,500	
タマホーム	9,900	1,490.00	14,751,000	
サンヨーホームズ	2,300	843.00	1,938,900	
ファーストコーポレーション	4,400	1,161.00	5,108,400	
ベステラ	1,800	1,494.00	2,689,200	
TATERU	11,500	2,352.00	27,048,000	
住石ホールディングス	33,700	156.00	5,257,200	
日鉄鉱業	3,700	6,090.00	22,533,000	
三井松島産業	6,700	1,518.00	10,170,600	
国際石油開発帝石	639,800	1,373.00	878,445,400	
日本海洋掘削	4,600	2,110.00	9,706,000	
石油資源開発	20,800	2,505.00	52,104,000	
K&Oエナジーグループ	7,800	1,687.00	13,158,600	
ダイセキ環境ソリューション	3,100	1,124.00	3,484,400	
第一カッター興業	1,300	2,140.00	2,782,000	
安藤・間	102,300	830.00	84,909,000	
東急建設	50,600	1,120.00	56,672,000	
コムシスホールディングス	46,300	2,902.00	134,362,600	
ミサワホーム	11,000	926.00	10,186,000	
ピーアールホールディングス	13,100	398.00	5,213,800	
高松コンストラクショングループ	8,500	3,040.00	25,840,000	
東建コーポレーション	4,900	10,730.00	52,577,000	
ソネック	1,600	781.00	1,249,600	
ヤマウラ	6,200	870.00	5,394,000	
大成建設	131,000	5,450.00	713,950,000	
大林組	394,600	1,156.00	456,157,600	
清水建設	402,500	960.00	386,400,000	
飛島建設	119,800	171.00	20,485,800	
長谷工コーポレーション	153,500	1,632.00	250,512,000	
松井建設	14,600	826.00	12,059,600	
銭高組	1,800	5,230.00	9,414,000	
鹿島建設	578,000	992.00	573,376,000	
不動テトラ	99,600	183.00	18,226,800	
大末建設	4,300	1,013.00	4,355,900	

鉄建建設	8,000	3,025.00	24,200,000
西松建設	30,400	2,807.00	85,332,800
三井住友建設	94,900	638.00	60,546,200
大豊建設	48,000	615.00	29,520,000
前田建設工業	93,800	1,281.00	120,157,800
佐田建設	8,700	475.00	4,132,500
ナカノフドー建設	10,100	647.00	6,534,700
奥村組	21,600	4,300.00	92,880,000
東鉄工業	15,800	3,170.00	50,086,000
イチケン	2,400	2,363.00	5,671,200
浅沼組	47,000	388.00	18,236,000
戸田建設	153,000	790.00	120,870,000
熊谷組	20,600	3,400.00	70,040,000
青木あすなろ建設	8,700	976.00	8,491,200
北野建設	27,000	392.00	10,584,000
植木組	1,600	2,605.00	4,168,000
三井ホーム	16,000	674.00	10,784,000
矢作建設工業	18,000	793.00	14,274,000
ピーエス三菱	15,600	681.00	10,623,600
日本ハウスホールディングス	25,100	594.00	14,909,400
大東建託	47,600	19,210.00	914,396,000
新日本建設	15,700	1,184.00	18,588,800
N I P P O	30,500	2,401.00	73,230,500
東亜道路工業	2,700	4,085.00	11,029,500
前田道路	41,200	2,203.00	90,763,600
日本道路	3,600	5,140.00	18,504,000
東亜建設工業	10,700	2,431.00	26,011,700
若築建設	7,100	1,670.00	11,857,000
東洋建設	41,300	495.00	20,443,500
五洋建設	156,400	788.00	123,243,200
世紀東急工業	17,700	700.00	12,390,000
福田組	4,300	6,740.00	28,982,000
日本ドライケミカル	1,500	2,454.00	3,681,000
住友林業	84,100	1,714.00	144,147,400
日本基礎技術	14,700	397.00	5,835,900
日成ビルド工業	19,500	1,308.00	25,506,000
ヤマダ・エスバイエルホーム	60,000	83.00	4,980,000
巴コーポレーション	16,400	538.00	8,823,200
大和ハウス工業	388,700	4,021.00	1,562,962,700
ライト工業	25,300	1,133.00	28,664,900
積水ハウス	428,100	1,946.50	833,296,650
日特建設	11,300	618.00	6,983,400
北陸電気工事	7,300	1,238.00	9,037,400
ユアテック	20,800	853.00	17,742,400
西部電気工業	2,100	2,715.00	5,701,500
四電工	1,900	2,564.00	4,871,600
中電工	17,000	2,984.00	50,728,000
関電工	52,400	1,271.00	66,600,400
きんでん	87,500	1,785.00	156,187,500
東京エネシス	15,000	1,253.00	18,795,000

トーエネック	3,600	3,075.00	11,070,000
住友電設	10,400	2,199.00	22,869,600
日本電設工業	20,200	2,133.00	43,086,600
協和エクシオ	47,200	2,785.00	131,452,000
新日本空調	10,200	1,616.00	16,483,200
日本工営	7,500	3,220.00	24,150,000
N D S	2,000	4,510.00	9,020,000
九電工	25,900	5,370.00	139,083,000
三機工業	27,900	1,213.00	33,842,700
日揮	113,300	2,411.00	273,166,300
中外炉工業	4,000	2,874.00	11,496,000
ヤマト	10,800	763.00	8,240,400
太平電業	8,900	2,719.00	24,199,100
高砂熱学工業	36,200	1,992.00	72,110,400
三晃金属工業	1,500	3,540.00	5,310,000
N E C ネットズエスアイ	12,700	2,766.00	35,128,200
朝日工業社	2,600	3,470.00	9,022,000
明星工業	23,900	740.00	17,686,000
大気社	16,600	3,490.00	57,934,000
ダイダン	8,800	2,437.00	21,445,600
日比谷総合設備	14,700	2,029.00	29,826,300
東芝プラントシステム	28,500	2,225.00	63,412,500
日本製粉	39,200	1,704.00	66,796,800
日清製粉グループ本社	144,300	2,163.00	312,120,900
日東富士製粉	800	4,790.00	3,832,000
昭和産業	10,900	2,867.00	31,250,300
鳥越製粉	10,600	944.00	10,006,400
中部飼料	14,400	2,150.00	30,960,000
フィード・ワン	79,300	232.00	18,397,600
東洋精糖	2,000	1,201.00	2,402,000
日本甜菜製糖	6,700	2,317.00	15,523,900
三井製糖	9,300	4,170.00	38,781,000
塩水港精糖	14,500	262.00	3,799,000
日新製糖	5,600	2,069.00	11,586,400
L I F U L L	39,000	886.00	34,554,000
ジェイエイシーリクルートメント	9,000	2,243.00	20,187,000
日本M&Aセンター	77,600	3,515.00	272,764,000
メンバーズ	2,800	1,244.00	3,483,200
中広	1,200	734.00	880,800
タケエイ	11,600	1,278.00	14,824,800
トラスト・テック	5,100	3,460.00	17,646,000
コシダカホールディングス	5,900	7,130.00	42,067,000
パソナグループ	10,600	1,727.00	18,306,200
C D S	3,000	1,480.00	4,440,000
リンクアンドモチベーション	20,600	1,265.00	26,059,000
G C A	12,800	933.00	11,942,400
エス・エム・エス	22,200	4,645.00	103,119,000
パーソルホールディングス	103,500	2,905.00	300,667,500
リニカル	7,200	1,824.00	13,132,800
クックパッド	35,200	599.00	21,084,800

エスクリ	4,000	824.00	3,296,000	
アイ・ケイ・ケイ	6,600	836.00	5,517,600	
森永製菓	27,700	4,975.00	137,807,500	
中村屋	2,900	4,830.00	14,007,000	
江崎グリコ	32,900	5,610.00	184,569,000	
名糖産業	5,800	1,583.00	9,181,400	
井村屋グループ	4,700	3,635.00	17,084,500	
不二家	7,500	2,575.00	19,312,500	
山崎製パン	96,400	2,244.00	216,321,600	
第一屋製パン	2,000	1,217.00	2,434,000	
モロゾフ	1,900	6,600.00	12,540,000	
亀田製菓	7,300	5,220.00	38,106,000	
寿スピリッツ	11,300	5,310.00	60,003,000	
カルビー	53,700	3,590.00	192,783,000	
森永乳業	23,600	4,740.00	111,864,000	
六甲バター	5,900	2,514.00	14,832,600	
ヤクルト本社	70,600	7,950.00	561,270,000	
明治ホールディングス	77,900	8,130.00	633,327,000	
雪印メグミルク	28,400	3,130.00	88,892,000	
プリマハム	83,000	607.00	50,381,000	
日本ハム	51,000	4,570.00	233,070,000	
林兼産業	4,100	823.00	3,374,300	
丸大食品	63,000	529.00	33,327,000	
S Foods	8,200	4,530.00	37,146,000	
伊藤ハム米久ホールディングス	75,900	953.00	72,332,700	
学情	5,100	1,425.00	7,267,500	
スタジオアリス	5,600	2,606.00	14,593,600	
シミックホールディングス	6,200	2,604.00	16,144,800	
システナ	9,200	4,230.00	38,916,000	
N J S	2,700	1,592.00	4,298,400	
デジタルアーツ	5,700	4,185.00	23,854,500	
新日鉄住金ソリューションズ	17,300	3,050.00	52,765,000	
総合警備保障	44,600	5,190.00	231,474,000	
キューブシステム	6,700	800.00	5,360,000	
いちご	165,500	468.00	77,454,000	
エイジア	1,700	1,481.00	2,517,700	
日本駐車場開発	139,800	175.00	24,465,000	
コア	4,900	1,327.00	6,502,300	
カカクコム	84,500	1,914.00	161,733,000	
アイロムグループ	3,800	2,697.00	10,248,600	
セントケア・ホールディング	4,800	789.00	3,787,200	
サイネックス	1,600	822.00	1,315,200	
ルネサンス	5,500	1,938.00	10,659,000	
ディップ	15,800	3,285.00	51,903,000	
S B Sホールディングス	11,600	1,374.00	15,938,400	
オプトホールディング	7,800	1,745.00	13,611,000	
新日本科学	13,700	558.00	7,644,600	
ツクイ	26,400	852.00	22,492,800	
キャリアデザインセンター	2,600	2,095.00	5,447,000	
エムスリー	118,100	4,525.00	534,402,500	

ツカダ・グローバルホールディング	9,000	627.00	5,643,000
プラス	600	929.00	557,400
アウトソーシング	33,500	1,910.00	63,985,000
ウェルネット	11,300	1,100.00	12,430,000
ワールドホールディングス	3,700	4,510.00	16,687,000
ディー・エヌ・エー	60,500	2,004.00	121,242,000
博報堂DYホールディングス	155,900	1,442.00	224,807,800
ぐるなび	17,700	1,426.00	25,240,200
エスアールジータカミヤ	13,300	631.00	8,392,300
ジャパンベストレスキューシステム	13,900	906.00	12,593,400
ファンコミュニケーションズ	31,200	686.00	21,403,200
ライク	4,400	1,948.00	8,571,200
ビジネス・ブレイクスルー	5,200	463.00	2,407,600
WDBホールディングス	5,100	3,660.00	18,666,000
ティア	5,900	1,070.00	6,313,000
CDG	1,000	1,848.00	1,848,000
バリューコマース	10,100	1,441.00	14,554,100
インフォマート	56,700	1,048.00	59,421,600
サッポロホールディングス	43,100	3,050.00	131,455,000
アサヒグループホールディングス	246,900	5,624.00	1,388,565,600
キリンホールディングス	566,500	2,990.50	1,694,118,250
宝ホールディングス	88,300	1,227.00	108,344,100
オエノンホールディングス	33,500	452.00	15,142,000
養命酒製造	3,500	2,435.00	8,522,500
コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールディングス	82,700	4,475.00	370,082,500
サントリー食品インターナショナル	90,100	5,190.00	467,619,000
ダイドグループホールディングス	6,000	6,540.00	39,240,000
伊藤園	39,000	4,225.00	164,775,000
キーコーヒー	11,600	2,138.00	24,800,800
ユニカフェ	3,500	1,107.00	3,874,500
ジャパンフーズ	1,800	1,472.00	2,649,600
日清オイリオグループ	13,900	3,130.00	43,507,000
不二製油グループ本社	31,900	3,340.00	106,546,000
かどや製油	1,200	6,430.00	7,716,000
J-オイルミルズ	6,100	3,685.00	22,478,500
ローソン	29,300	7,090.00	207,737,000
サンエー	8,800	5,650.00	49,720,000
カワチ薬品	9,000	2,639.00	23,751,000
エービーシー・マート	21,100	6,780.00	143,058,000
ハードオフコーポレーション	5,100	1,083.00	5,523,300
高千穂交易	4,500	1,280.00	5,760,000
アスクル	10,100	3,385.00	34,188,500
ゲオホールディングス	21,200	1,644.00	34,852,800
アダストリア	17,800	2,029.00	36,116,200
ジーフット	7,100	775.00	5,502,500
シー・ヴィ・エス・バイエリア	1,500	738.00	1,107,000
伊藤忠食品	2,900	6,120.00	17,748,000
くらコーポレーション	6,800	7,410.00	50,388,000
キャンドウ	5,500	1,805.00	9,927,500

エレマテック	5,400	2,519.00	13,602,600
パルグループホールディングス	5,900	2,989.00	17,635,100
JALUX	3,300	3,095.00	10,213,500
エディオン	44,900	1,278.00	57,382,200
あらた	5,700	6,500.00	37,050,000
サーラコーポレーション	19,900	661.00	13,153,900
ワッツ	4,600	1,112.00	5,115,200
トーメンデバイス	1,700	2,768.00	4,705,600
ハローズ	4,200	2,524.00	10,600,800
J Pホールディングス	35,200	305.00	10,736,000
あみやき亭	2,500	5,520.00	13,800,000
東京エレクトロン デバイス	4,200	1,994.00	8,374,800
ひらまつ	16,000	502.00	8,032,000
フィールズ	8,900	1,165.00	10,368,500
双日	684,300	345.00	236,083,500
アルフレッサ ホールディングス	128,500	2,307.00	296,449,500
大黒天物産	2,700	5,090.00	13,743,000
ハニーズホールディングス	11,200	1,023.00	11,457,600
ファーマライズホールディングス	2,600	640.00	1,664,000
キッコーマン	92,100	4,280.00	394,188,000
味の素	271,100	1,923.50	521,460,850
キュービー	65,600	2,503.00	164,196,800
ハウス食品グループ本社	45,000	3,655.00	164,475,000
カゴメ	47,200	3,810.00	179,832,000
焼津水産化学工業	5,800	1,213.00	7,035,400
アリアケジャパン	10,800	8,740.00	94,392,000
ピエトロ	1,500	1,655.00	2,482,500
エバラ食品工業	2,500	2,078.00	5,195,000
ニチレイ	56,100	3,090.00	173,349,000
横浜冷凍	28,900	1,066.00	30,807,400
東洋水産	64,700	4,080.00	263,976,000
イートアンド	3,200	2,021.00	6,467,200
大冷	1,300	1,984.00	2,579,200
ヨシムラ・フード・ホールディングス	1,800	1,107.00	1,992,600
日清食品ホールディングス	51,400	7,360.00	378,304,000
永谷園ホールディングス	12,000	1,454.00	17,448,000
一正蒲鉾	4,400	1,268.00	5,579,200
フジッコ	12,800	2,330.00	29,824,000
ロック・フィールド	12,700	2,179.00	27,673,300
日本たばこ産業	729,200	2,965.00	2,162,078,000
ケンコーマヨネーズ	7,800	3,605.00	28,119,000
わらべや日洋ホールディングス	7,700	2,729.00	21,013,300
なとり	6,600	1,922.00	12,685,200
イフジ産業	2,000	780.00	1,560,000
ピククルスコーポレーション	1,800	1,975.00	3,555,000
北の達人コーポレーション	33,900	1,014.00	34,374,600
ユーグレナ	45,500	995.00	45,272,500
片倉工業	14,100	1,370.00	19,317,000
ゲンゼ	9,200	6,120.00	56,304,000
ヒューリック	241,800	1,157.00	279,762,600

神栄	1,500	1,455.00	2,182,500
ラサ商事	5,000	899.00	4,495,000
アルペン	8,900	2,356.00	20,968,400
ハブ	2,200	1,100.00	2,420,000
ラクーン	6,800	618.00	4,202,400
クオール	12,800	2,188.00	28,006,400
アルコニックス	12,300	2,018.00	24,821,400
神戸物産	7,500	5,100.00	38,250,000
ソリトンシステムズ	3,800	1,561.00	5,931,800
ジーンズ	7,900	5,670.00	44,793,000
ビックカメラ	68,300	1,863.00	127,242,900
DCMホールディングス	62,300	1,090.00	67,907,000
ペッパーフードサービス	6,200	6,390.00	39,618,000
Monotaro	41,100	3,905.00	160,495,500
東京一番フーズ	2,400	683.00	1,639,200
DDホールディングス	2,600	3,550.00	9,230,000
あいホールディングス	18,600	2,880.00	53,568,000
ディービーエクス	4,100	1,310.00	5,371,000
きちり	3,100	726.00	2,250,600
アークランドサービスホールディングス	9,700	2,386.00	23,144,200
J.フロントリテイリング	138,100	1,642.00	226,760,200
ドトール・日レスホールディングス	20,300	2,462.00	49,978,600
マツモトキヨシホールディングス	47,800	4,735.00	226,333,000
ブロンコビリー	6,000	3,760.00	22,560,000
スタートトゥデイ	113,600	3,000.00	340,800,000
トレジャー・ファクトリー	3,300	786.00	2,593,800
物語コーポレーション	3,300	11,520.00	38,016,000
ココカラファイン	12,100	7,290.00	88,209,000
三越伊勢丹ホールディングス	216,200	1,140.00	246,468,000
東洋紡	45,500	2,104.00	95,732,000
ユニチカ	35,800	696.00	24,916,800
富士紡ホールディングス	6,800	4,050.00	27,540,000
日清紡ホールディングス	71,700	1,439.00	103,176,300
倉敷紡績	124,000	347.00	43,028,000
ダイワボウホールディングス	9,800	4,640.00	45,472,000
シキボウ	6,200	1,323.00	8,202,600
日東紡績	17,500	2,302.00	40,285,000
トヨタ紡織	34,200	2,407.00	82,319,400
マクニカ・富士エレホールディングス	22,100	1,882.00	41,592,200
Hamee	2,900	1,576.00	4,570,400
ラクト・ジャパン	1,600	4,000.00	6,400,000
ウエルシアホールディングス	30,600	5,100.00	156,060,000
クリエイトSDホールディングス	17,100	2,835.00	48,478,500
バイタルケーエスケー・ホールディングス	21,800	1,069.00	23,304,200
八洲電機	9,000	889.00	8,001,000
メディアスホールディングス	6,400	999.00	6,393,600
UKCホールディングス	7,400	2,197.00	16,257,800
ジューテックホールディングス	2,700	1,123.00	3,032,100

丸善CHIホールディングス	13,000	351.00	4,563,000	
大光	2,900	860.00	2,494,000	
OCHIホールディングス	3,400	1,441.00	4,899,400	
TOKAIホールディングス	61,100	1,093.00	66,782,300	
ミサワ	1,800	420.00	756,000	
ティーライフ	1,600	1,260.00	2,016,000	
Cominix	1,700	954.00	1,621,800	
エー・ピーカンパニー	2,200	795.00	1,749,000	
三洋貿易	6,400	2,127.00	13,612,800	
チムニー	3,600	2,888.00	10,396,800	
シュッピン	7,000	1,236.00	8,652,000	
ビューティガレージ	1,500	2,861.00	4,291,500	
ウイン・パートナーズ	8,400	1,489.00	12,507,600	
ネクステージ	12,200	1,050.00	12,810,000	
ジョイフル本田	16,900	3,695.00	62,445,500	
鳥貴族	4,200	3,110.00	13,062,000	
キリン堂ホールディングス	4,100	1,800.00	7,380,000	
ホットランド	6,700	1,331.00	8,917,700	
すかいらく	71,800	1,570.00	112,726,000	
綿半ホールディングス	4,300	4,000.00	17,200,000	
日本毛織	34,700	1,071.00	37,163,700	
ダイトウボウ	18,800	101.00	1,898,800	
トーア紡コーポレーション	5,100	563.00	2,871,300	
ダイドーリミテッド	14,100	451.00	6,359,100	
ヨシックス	1,900	3,615.00	6,868,500	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	38,500	1,287.00	49,549,500	
三栄建築設計	4,600	2,206.00	10,147,600	
スター・マイカ	4,200	2,257.00	9,479,400	
野村不動産ホールディングス	77,000	2,538.00	195,426,000	
三重交通グループホールディングス	23,500	520.00	12,220,000	
サムティ	9,800	1,825.00	17,885,000	
ディア・ライフ	11,700	521.00	6,095,700	
コーセーアールイー	1,900	916.00	1,740,400	
エー・ディー・ワークス	153,500	41.00	6,293,500	
日本商業開発	6,500	1,791.00	11,641,500	
プレサンスコーポレーション	15,900	1,643.00	26,123,700	
ユニゾホールディングス	13,500	2,544.00	34,344,000	
THEグローバル社	5,300	827.00	4,383,100	
日本管理センター	7,600	1,691.00	12,851,600	
サンセイランディック	3,400	1,256.00	4,270,400	
エストラスト	1,600	922.00	1,475,200	
フージャースホールディングス	28,100	805.00	22,620,500	
オープンハウス	18,900	6,230.00	117,747,000	
東急不動産ホールディングス	280,400	752.00	210,860,800	
飯田グループホールディングス	96,600	2,025.00	195,615,000	
イーグランド	1,400	1,194.00	1,671,600	
ムゲンエステート	7,100	1,363.00	9,677,300	
帝国繊維	12,900	2,132.00	27,502,800	
ブックオフコーポレーション	6,800	812.00	5,521,600	

日本コークス工業	99,200	110.00	10,912,000
ゴルフダイジェスト・オンライン	4,700	984.00	4,624,800
ミタチ産業	2,700	1,188.00	3,207,600
B E E N O S	1,800	1,702.00	3,063,600
あさひ	8,600	1,392.00	11,971,200
日本調剤	4,100	3,335.00	13,673,500
コスモス薬品	5,800	20,490.00	118,842,000
シップヘルスケアホールディングス	24,100	3,765.00	90,736,500
トーエル	5,600	1,092.00	6,115,200
一六堂	2,500	424.00	1,060,000
ソフトクリエイイトホールディングス	5,500	1,509.00	8,299,500
オンリー	1,700	952.00	1,618,400
セブン&アイ・ホールディングス	484,800	4,700.00	2,278,560,000
薬王堂	5,000	3,770.00	18,850,000
クリエイイト・レストランツ・ホールディングス	31,100	1,276.00	39,683,600
明治電機工業	4,000	1,749.00	6,996,000
ツルハホールディングス	25,000	14,660.00	366,500,000
デリカフーズホールディングス	2,300	1,645.00	3,783,500
スターティアホールディングス	2,500	876.00	2,190,000
サンマルクホールディングス	8,300	3,155.00	26,186,500
フェリシモ	2,900	1,273.00	3,691,700
トリドールホールディングス	14,300	4,000.00	57,200,000
帝人	101,000	2,013.00	203,313,000
東レ	892,300	992.00	885,161,600
クラレ	207,000	1,801.00	372,807,000
旭化成	767,100	1,421.50	1,090,432,650
サカイオーベックス	3,200	2,460.00	7,872,000
T O K Y O B A S E	7,700	1,472.00	11,334,400
稲葉製作所	6,600	1,358.00	8,962,800
宮地エンジニアリンググループ	3,300	2,102.00	6,936,600
トーカロ	32,200	1,323.00	42,600,600
アルファ	4,100	1,706.00	6,994,600
S U M C O	106,900	2,646.00	282,857,400
川田テクノロジーズ	2,400	6,000.00	14,400,000
R S T e c h n o l o g i e s	1,800	7,090.00	12,762,000
ピーロット	1,800	2,120.00	3,816,000
ファーストブラザーズ	3,200	1,410.00	4,512,000
ハウズドゥ	1,900	4,050.00	7,695,000
シーアールイー	1,900	1,801.00	3,421,900
ケイアイスター不動産	4,200	2,729.00	11,461,800
住江織物	3,100	2,898.00	8,983,800
日本フェルト	6,400	518.00	3,315,200
イチカワ	8,000	366.00	2,928,000
エコナックホールディングス	21,700	121.00	2,625,700
日東製網	1,400	1,885.00	2,639,000
芦森工業	2,400	2,355.00	5,652,000
アツギ	8,200	1,217.00	9,979,400
ウイルプラスホールディングス	1,100	1,162.00	1,278,200
コメダホールディングス	21,400	1,987.00	42,521,800

サツドラホールディングス	1,900	2,215.00	4,208,500	
ダイユー・リックホールディングス	5,400	1,104.00	5,961,600	
パロックジャパンリミテッド	9,300	1,135.00	10,555,500	
クスリのアオキホールディングス	9,200	7,210.00	66,332,000	
ダイニック	4,600	1,048.00	4,820,800	
共和レザー	7,200	972.00	6,998,400	
スシローグローバルホールディングス	11,100	5,480.00	60,828,000	
L I X I L ビバ	11,000	2,066.00	22,726,000	
セーレン	28,300	1,972.00	55,807,600	
ソトー	4,400	1,005.00	4,422,000	
東海染工	1,700	1,460.00	2,482,000	
小松精練	18,900	1,056.00	19,958,400	
ワコールホールディングス	34,000	3,080.00	104,720,000	
ホギメディカル	15,500	4,215.00	65,332,500	
レナウン	33,200	174.00	5,776,800	
クラウドシアホールディングス	2,900	549.00	1,592,100	
T S I ホールディングス	42,400	788.00	33,411,200	
マツオカコーポレーション	2,200	3,380.00	7,436,000	
T I S	38,400	4,125.00	158,400,000	
ネオス	3,400	386.00	1,312,400	
電算システム	4,100	2,038.00	8,355,800	
グリー	61,700	574.00	35,415,800	
コーエーテクモホールディングス	19,600	2,102.00	41,199,200	
三菱総合研究所	5,000	3,295.00	16,475,000	
ボルテージ	2,300	915.00	2,104,500	
電算	1,300	2,359.00	3,066,700	
A G S	6,500	874.00	5,681,000	
ファインデックス	9,500	674.00	6,403,000	
ヒト・コミュニケーションズ	2,600	1,810.00	4,706,000	
ブレインパッド	2,500	2,913.00	7,282,500	
K L a b	22,300	1,794.00	40,006,200	
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	8,300	1,869.00	15,512,700	
イーブックイニシアティブジャパン	1,800	1,188.00	2,138,400	
ネクソン	257,400	1,645.00	423,423,000	
アイスタイル	29,200	1,389.00	40,558,800	
エムアップ	3,800	1,058.00	4,020,400	
エイチーム	7,900	2,485.00	19,631,500	
テクノスジャパン	10,400	922.00	9,588,800	
e n i s h	3,900	1,018.00	3,970,200	
コロプラ	37,600	829.00	31,170,400	
モバイルクリエイト	9,300	381.00	3,543,300	
オルトプラス	5,600	936.00	5,241,600	
ブロードリーフ	57,100	515.00	29,406,500	
ハーツユナイテッドグループ	6,100	1,757.00	10,717,700	
メディアドゥホールディングス	3,700	1,677.00	6,204,900	
ブイキューブ	7,100	610.00	4,331,000	
サイバーリンクス	1,800	1,155.00	2,079,000	
ディー・エル・イー	7,400	419.00	3,100,600	
フィックスターズ	9,800	1,545.00	15,141,000	

VOYAGE GROUP	5,700	1,296.00	7,387,200
オブティム	2,000	2,475.00	4,950,000
セレス	3,500	1,592.00	5,572,000
特種東海製紙	6,800	4,105.00	27,914,000
ベリサーブ	1,500	3,135.00	4,702,500
ティーガイア	11,500	3,085.00	35,477,500
セック	1,100	2,617.00	2,878,700
日本アジアグループ	12,100	560.00	6,776,000
豆蔵ホールディングス	8,500	1,210.00	10,285,000
テクマトリックス	6,300	1,619.00	10,199,700
プロシップ	1,700	2,702.00	4,593,400
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	312,400	350.00	109,340,000
GMOペイメントゲートウェイ	8,100	10,050.00	81,405,000
ザッパラス	5,500	394.00	2,167,000
システムリサーチ	1,200	2,304.00	2,764,800
インターネットイニシアティブ	18,700	2,041.00	38,166,700
さくらインターネット	13,700	750.00	10,275,000
ヴィンクス	2,400	2,008.00	4,819,200
GMOクラウド	2,600	2,230.00	5,798,000
SRAホールディングス	6,100	3,145.00	19,184,500
MINORIソリューションズ	2,200	1,477.00	3,249,400
システムインテグレータ	1,600	1,045.00	1,672,000
朝日ネット	10,600	503.00	5,331,800
eBASE	2,300	1,323.00	3,042,900
アドソル日進	4,400	1,321.00	5,812,400
フリービット	7,700	1,159.00	8,924,300
コムチュア	5,900	4,205.00	24,809,500
サイバーコム	2,000	2,488.00	4,976,000
王子ホールディングス	518,000	692.00	358,456,000
日本製紙	55,100	1,983.00	109,263,300
三菱製紙	17,600	659.00	11,598,400
北越紀州製紙	68,700	680.00	46,716,000
中越パルプ工業	4,900	1,936.00	9,486,400
巴川製紙所	18,000	285.00	5,130,000
大王製紙	49,000	1,468.00	71,932,000
阿波製紙	2,900	605.00	1,754,500
メディカル・データ・ビジョン	4,400	4,355.00	19,162,000
gumi	13,200	1,020.00	13,464,000
ショーケース・ティービー	2,200	1,505.00	3,311,000
モバイルファクトリー	2,100	1,470.00	3,087,000
デジタル・インフォメーション・テクノロジ	3,800	1,207.00	4,586,600
PCIホールディングス	1,900	3,055.00	5,804,500
パイブドHD	1,800	1,140.00	2,052,000
アイビーシー	1,200	1,379.00	1,654,800
ネオジャパン	2,000	1,321.00	2,642,000
オーブンドア	4,600	2,131.00	9,802,600
マイネット	2,300	1,266.00	2,911,800
アカツキ	2,300	4,520.00	10,396,000

Ubicomホールディングス	1,200	943.00	1,131,600
LINE	34,800	4,080.00	141,984,000
レンゴー	118,600	926.00	109,823,600
トモク	7,100	2,107.00	14,959,700
ザ・パック	8,700	4,145.00	36,061,500
シンクロ・フード	2,900	1,194.00	3,462,600
オークネット	3,700	1,451.00	5,368,700
AOI TYO HOLDINGS	9,400	1,584.00	14,889,600
マクロミル	10,800	2,953.00	31,892,400
昭和電工	81,900	3,870.00	316,953,000
住友化学	905,000	621.00	562,005,000
住友精化	5,100	5,050.00	25,755,000
日産化学工業	71,600	4,695.00	336,162,000
ラサ工業	4,400	2,138.00	9,407,200
クレハ	10,600	6,790.00	71,974,000
多木化学	1,600	4,205.00	6,728,000
テイカ	9,400	2,808.00	26,395,200
石原産業	22,100	1,246.00	27,536,600
片倉コープアグリ	3,000	1,242.00	3,726,000
日東エフシー	7,300	742.00	5,416,600
日本曹達	85,000	596.00	50,660,000
東ソー	177,800	1,962.00	348,843,600
トクヤマ	35,700	3,430.00	122,451,000
セントラル硝子	25,100	2,512.00	63,051,200
東亜合成	72,200	1,243.00	89,744,600
大阪ソーダ	11,300	2,888.00	32,634,400
関東電化工業	29,400	1,036.00	30,458,400
デンカ	45,200	3,835.00	173,342,000
イビデン	71,900	1,624.00	116,765,600
信越化学工業	204,800	10,960.00	2,244,608,000
日本カーバイド工業	3,900	1,961.00	7,647,900
堺化学工業	8,400	2,777.00	23,326,800
エア・ウォーター	101,400	2,040.00	206,856,000
大陽日酸	94,800	1,608.00	152,438,400
日本化学工業	4,600	3,340.00	15,364,000
東邦アセチレン	1,700	1,384.00	2,352,800
日本パーカライジング	62,900	1,710.00	107,559,000
高压ガス工業	18,300	955.00	17,476,500
チタン工業	1,300	2,466.00	3,205,800
四国化成工業	17,800	1,587.00	28,248,600
戸田工業	2,400	3,655.00	8,772,000
ステラ ケミファ	6,300	3,160.00	19,908,000
保土谷化学工業	4,000	4,635.00	18,540,000
日本触媒	19,300	7,130.00	137,609,000
大日精化工業	9,500	4,530.00	43,035,000
カネカ	166,000	1,087.00	180,442,000
協和発酵キリン	147,100	2,338.00	343,919,800
三菱瓦斯化学	101,400	2,553.00	258,874,200
三井化学	111,800	3,280.00	366,704,000
JSR	123,700	2,377.00	294,034,900

東京応化工業	21,400	3,810.00	81,534,000
大阪有機化学工業	8,000	1,629.00	13,032,000
三菱ケミカルホールディングス	823,800	1,021.50	841,511,700
KHネオケム	18,800	3,420.00	64,296,000
ダイセル	165,900	1,194.00	198,084,600
住友ベークライト	99,000	983.00	97,317,000
積水化学工業	255,500	1,882.00	480,851,000
日本ゼオン	103,700	1,516.00	157,209,200
アイカ工業	34,500	3,970.00	136,965,000
宇部興産	61,900	3,200.00	198,080,000
積水樹脂	19,000	2,304.00	43,776,000
タキロンシーアイ	24,900	666.00	16,583,400
旭有機材	7,200	1,731.00	12,463,200
日立化成	60,800	2,482.00	150,905,600
ニチバン	6,100	3,325.00	20,282,500
リケンテクノス	26,600	511.00	13,592,600
大倉工業	29,000	572.00	16,588,000
積水化成成品工業	15,400	1,239.00	19,080,600
群栄化学工業	2,800	3,545.00	9,926,000
タイガースポリマー	6,100	839.00	5,117,900
ミライアル	4,100	1,495.00	6,129,500
ダイキアクシス	4,100	1,464.00	6,002,400
ダイキョーニシカワ	24,300	1,859.00	45,173,700
竹本容器	1,400	2,623.00	3,672,200
森六ホールディングス	4,600	2,885.00	13,271,000
日本化薬	79,800	1,323.00	105,575,400
カーリットホールディングス	11,400	1,012.00	11,536,800
E P Sホールディングス	16,900	2,204.00	37,247,600
ソルクシーズ	4,400	1,085.00	4,774,000
レグス	2,800	961.00	2,690,800
プレステージ・インターナショナル	23,300	1,398.00	32,573,400
フェイス	3,900	1,189.00	4,637,100
ハイマックス	1,500	1,659.00	2,488,500
アミューズ	7,500	3,105.00	23,287,500
野村総合研究所	73,200	5,090.00	372,588,000
ドリームインキュベータ	3,700	2,897.00	10,718,900
サイバネットシステム	9,400	860.00	8,084,000
クイック	7,000	1,824.00	12,768,000
T A C	6,700	316.00	2,117,200
C Eホールディングス	3,200	844.00	2,700,800
ケネディクス	148,600	652.00	96,887,200
日本システム技術	1,400	1,283.00	1,796,200
電通	136,700	4,690.00	641,123,000
インテージホールディングス	13,500	1,173.00	15,835,500
テイクアンドギヴ・ニーズ	5,200	1,052.00	5,470,400
東邦システムサイエンス	3,800	865.00	3,287,000
ぴあ	3,700	5,810.00	21,497,000
イオンファンタジー	3,600	6,210.00	22,356,000
ソースネクスト	16,200	823.00	13,332,600
シーティーエス	11,100	760.00	8,436,000

ネクシィーズグループ	4,400	1,678.00	7,383,200	
メディカルシステムネットワーク	13,300	531.00	7,062,300	
日本精化	10,200	1,240.00	12,648,000	
扶桑化学工業	8,700	2,770.00	24,099,000	
トリケミカル研究所	2,100	4,810.00	10,101,000	
A D E K A	52,900	1,907.00	100,880,300	
日油	47,500	3,165.00	150,337,500	
ミヨシ油脂	4,600	1,409.00	6,481,400	
新日本理化	19,400	247.00	4,791,800	
ハリマ化成グループ	9,600	832.00	7,987,200	
花王	288,800	7,814.00	2,256,683,200	
第一工業製薬	23,000	876.00	20,148,000	
日華化学	3,900	1,223.00	4,769,700	
ニイタカ	1,700	1,800.00	3,060,000	
三洋化成工業	7,700	5,110.00	39,347,000	
武田薬品工業	432,700	5,055.00	2,187,298,500	
アステラス製薬	1,206,900	1,580.00	1,906,902,000	
大日本住友製薬	87,100	1,934.00	168,451,400	
塩野義製薬	168,000	5,501.00	924,168,000	
田辺三菱製薬	143,300	2,109.00	302,219,700	
わかもと製薬	14,000	289.00	4,046,000	
あすか製薬	13,400	1,726.00	23,128,400	
日本新薬	30,700	7,140.00	219,198,000	
ピオフェルミン製薬	1,900	2,826.00	5,369,400	
中外製薬	122,400	5,590.00	684,216,000	
科研製薬	21,200	6,350.00	134,620,000	
エーザイ	140,600	6,681.00	939,348,600	
理研ビタミン	4,500	4,085.00	18,382,500	
ロート製薬	64,500	3,110.00	200,595,000	
小野薬品工業	277,400	2,849.50	790,451,300	
久光製薬	34,700	8,060.00	279,682,000	
有機合成薬品工業	8,000	305.00	2,440,000	
持田製薬	8,200	7,440.00	61,008,000	
参天製薬	222,500	1,741.00	387,372,500	
扶桑薬品工業	4,000	2,900.00	11,600,000	
日本ケミファ	1,500	4,785.00	7,177,500	
ツムラ	42,000	3,710.00	155,820,000	
日医工	31,000	1,773.00	54,963,000	
テルモ	180,000	5,510.00	991,800,000	
みらかホールディングス	33,400	4,235.00	141,449,000	
キッセイ薬品工業	21,800	2,954.00	64,397,200	
生化学工業	22,800	1,915.00	43,662,000	
栄研化学	19,100	2,524.00	48,208,400	
日水製薬	5,000	1,380.00	6,900,000	
鳥居薬品	7,400	2,791.00	20,653,400	
J C R ファーマ	8,300	5,870.00	48,721,000	
東和薬品	5,600	7,000.00	39,200,000	
富士製薬工業	4,000	4,895.00	19,580,000	
沢井製薬	23,600	4,830.00	113,988,000	
ゼリア新薬工業	25,200	2,186.00	55,087,200	

第一三共	336,100	3,658.00	1,229,453,800
キョーリン製薬ホールディングス	32,800	2,087.00	68,453,600
大幸薬品	6,200	1,970.00	12,214,000
ダイト	6,800	4,125.00	28,050,000
大塚ホールディングス	244,100	5,332.00	1,301,541,200
大正製薬ホールディングス	26,300	10,030.00	263,789,000
ペプチドリーム	53,700	5,060.00	271,722,000
大日本塗料	14,100	1,546.00	21,798,600
日本ペイントホールディングス	94,900	3,980.00	377,702,000
関西ペイント	129,200	2,461.00	317,961,200
神東塗料	9,000	240.00	2,160,000
中国塗料	35,300	1,103.00	38,935,900
日本特殊塗料	7,800	2,204.00	17,191,200
藤倉化成	15,600	674.00	10,514,400
太陽ホールディングス	9,500	4,635.00	44,032,500
D I C	48,600	3,650.00	177,390,000
サカイクス	25,100	1,615.00	40,536,500
東洋インキS Cホールディングス	122,000	653.00	79,666,000
T & K T O K A	8,300	1,324.00	10,989,200
アルプス技研	9,800	2,547.00	24,960,600
サニックス	17,800	251.00	4,467,800
ダイオーズ	2,300	1,344.00	3,091,200
日本空調サービス	11,800	754.00	8,897,200
オリエンタルランド	132,600	10,735.00	1,423,461,000
フォーカスシステムズ	6,500	916.00	5,954,000
ダスキン	30,200	2,708.00	81,781,600
パーク24	64,200	2,912.00	186,950,400
明光ネットワークジャパン	14,200	1,289.00	18,303,800
ファルコホールディングス	5,800	1,816.00	10,532,800
クレスコ	2,600	3,605.00	9,373,000
フジ・メディア・ホールディングス	120,700	1,746.00	210,742,200
秀英予備校	2,400	481.00	1,154,400
田谷	2,000	680.00	1,360,000
ラウンドワン	34,800	1,577.00	54,879,600
リゾートトラスト	47,500	2,130.00	101,175,000
オービック	36,300	8,800.00	319,440,000
ジャストシステム	18,700	2,659.00	49,723,300
T D C ソフト	5,100	1,326.00	6,762,600
ヤフー	830,900	462.00	383,875,800
ビー・エム・エル	14,400	2,684.00	38,649,600
ワタベウェディング	1,800	540.00	972,000
トレンドマイクロ	56,300	6,240.00	351,312,000
りらいあコミュニケーションズ	17,700	1,339.00	23,700,300
インフォメーション・ディベロプメント	3,600	1,461.00	5,259,600
リソー教育	19,000	893.00	16,967,000
日本オラクル	18,700	8,770.00	163,999,000
早稲田アカデミー	1,600	1,621.00	2,593,600
アルファシステムズ	3,700	2,350.00	8,695,000
フューチャー	15,600	1,248.00	19,468,800

CAC Holdings	8,700	1,031.00	8,969,700
ソフトバンク・テクノロジー	4,800	1,824.00	8,755,200
トーセ	3,100	1,192.00	3,695,200
ユー・エス・エス	137,000	2,224.00	304,688,000
オービックビジネスコンサルタント	5,900	6,890.00	40,651,000
伊藤忠テクノソリューションズ	52,500	2,188.00	114,870,000
アイティフォー	13,900	893.00	12,412,700
東京個別指導学院	4,000	1,129.00	4,516,000
東計電算	2,000	3,160.00	6,320,000
サイバーエージェント	73,800	5,510.00	406,638,000
楽天	575,400	800.60	460,665,240
エクスネット	1,800	882.00	1,587,600
クリーク・アンド・リバー社	5,800	1,175.00	6,815,000
テー・オー・ダブリュー	10,700	959.00	10,261,300
大塚商会	69,300	5,000.00	346,500,000
総合メディカル	10,100	2,923.00	29,522,300
サイボウズ	15,400	520.00	8,008,000
ソフトブレーン	8,900	425.00	3,782,500
セントラルスポーツ	4,200	3,815.00	16,023,000
パラカ	3,700	2,353.00	8,706,100
電通国際情報サービス	7,100	2,881.00	20,455,100
デジタルガレージ	20,700	3,335.00	69,034,500
イーエムシステムズ	8,000	1,275.00	10,200,000
ウェザーニューズ	3,900	3,295.00	12,850,500
C I J	9,000	706.00	6,354,000
東洋ビジネスエンジニアリング	1,100	1,817.00	1,998,700
日本エンタープライズ	11,700	218.00	2,550,600
WOWOW	5,500	3,260.00	17,930,000
スカラ	9,200	790.00	7,268,000
フルキャストホールディングス	9,800	2,554.00	25,029,200
富士フイルムホールディングス	243,900	4,274.00	1,042,428,600
コニカミノルタ	274,900	925.00	254,282,500
資生堂	218,800	6,917.00	1,513,439,600
ライオン	163,600	2,214.00	362,210,400
高砂香料工業	7,400	3,375.00	24,975,000
マンダム	22,900	3,695.00	84,615,500
ミルボン	15,700	4,790.00	75,203,000
ファンケル	28,500	4,080.00	116,280,000
コーセー	19,900	21,370.00	425,263,000
コタ	5,590	1,692.00	9,458,280
シーズ・ホールディングス	16,000	5,250.00	84,000,000
シーボン	1,400	3,120.00	4,368,000
ポーラ・オルビスホールディングス	50,100	4,715.00	236,221,500
ノエビアホールディングス	7,500	7,560.00	56,700,000
アジュバンコスメジャパン	2,700	1,009.00	2,724,300
エステー	8,400	2,315.00	19,446,000
アグロ カネショウ	4,800	2,566.00	12,316,800
コニシ	19,300	1,744.00	33,659,200
長谷川香料	15,600	2,112.00	32,947,200
星光PMC	6,700	1,185.00	7,939,500

小林製薬	32,900	8,250.00	271,425,000
荒川化学工業	10,600	1,900.00	20,140,000
メック	8,000	1,774.00	14,192,000
日本高純度化学	3,100	2,511.00	7,784,100
タカラバイオ	30,700	2,140.00	65,698,000
JCU	14,400	2,445.00	35,208,000
新田ゼラチン	8,100	823.00	6,666,300
OATアグリオ	1,800	3,795.00	6,831,000
デクセリアルズ	30,100	1,183.00	35,608,300
アース製薬	8,800	5,490.00	48,312,000
北興化学工業	12,100	734.00	8,881,400
大成ラミック	3,500	3,125.00	10,937,500
クミアイ化学工業	53,400	643.00	34,336,200
日本農薬	30,600	674.00	20,624,400
昭和シェル石油	109,900	1,417.00	155,728,300
富士興産	4,500	602.00	2,709,000
ニチレキ	15,000	1,228.00	18,420,000
ユシロ化学工業	6,600	1,727.00	11,398,200
ビービー・カストロール	5,000	1,705.00	8,525,000
富士石油	28,500	443.00	12,625,500
MORESCO	4,300	1,800.00	7,740,000
出光興産	98,600	3,880.00	382,568,000
JXTGホールディングス	1,874,200	683.30	1,280,640,860
コスモエネルギーホールディングス	34,000	3,505.00	119,170,000
横浜ゴム	68,000	2,557.00	173,876,000
東洋ゴム工業	69,500	1,870.00	129,965,000
ブリヂストン	388,700	4,747.00	1,845,158,900
住友ゴム工業	120,900	2,010.00	243,009,000
藤倉ゴム工業	10,300	748.00	7,704,400
オカモト	41,000	1,049.00	43,009,000
アキレス	8,900	2,266.00	20,167,400
フコク	5,200	993.00	5,163,600
ニッタ	12,100	4,050.00	49,005,000
クリエートメディック	3,800	1,161.00	4,411,800
住友理工	22,800	1,116.00	25,444,800
三ツ星ベルト	29,000	1,196.00	34,684,000
バンドー化学	22,500	1,214.00	27,315,000
旭硝子	120,100	4,445.00	533,844,500
日本板硝子	59,400	875.00	51,975,000
石塚硝子	1,600	2,604.00	4,166,400
有沢製作所	19,700	1,013.00	19,956,100
日本山村硝子	49,000	185.00	9,065,000
日本電気硝子	50,800	3,095.00	157,226,000
オハラ	4,600	2,433.00	11,191,800
住友大阪セメント	228,000	481.00	109,668,000
太平洋セメント	74,200	3,920.00	290,864,000
リソルホールディングス	1,200	4,185.00	5,022,000
日本ヒューム	11,800	830.00	9,794,000
日本コンクリート工業	25,300	447.00	11,309,100
三谷セキサン	6,200	2,479.00	15,369,800

アジアパイルホールディングス	15,100	646.00	9,754,600
東海カーボン	106,600	1,372.00	146,255,200
日本カーボン	6,000	4,775.00	28,650,000
東洋炭素	7,600	2,997.00	22,777,200
ノリタケカンパニーリミテド	6,900	4,505.00	31,084,500
TOTO	90,300	6,040.00	545,412,000
日本碍子	143,300	1,869.00	267,827,700
日本特殊陶業	100,700	2,588.00	260,611,600
ダントーホールディングス	9,000	144.00	1,296,000
MARUWA	4,100	8,200.00	33,620,000
品川リフクトリーズ	3,100	2,980.00	9,238,000
黒崎播磨	2,300	4,985.00	11,465,500
ヨータイ	7,000	750.00	5,250,000
イソライト工業	6,000	797.00	4,782,000
東京窯業	14,900	404.00	6,019,600
ニッカトー	3,900	950.00	3,705,000
フジインコーポレーテッド	10,500	2,210.00	23,205,000
エーアンドエーマテリアル	2,600	1,254.00	3,260,400
ニチアス	64,000	1,356.00	86,784,000
新日鐵住金	519,800	2,354.00	1,223,609,200
神戸製鋼所	212,500	1,092.00	232,050,000
中山製鋼所	16,100	723.00	11,640,300
合同製鐵	6,200	2,136.00	13,243,200
ジェイ エフ イー ホールディングス	313,600	2,201.00	690,233,600
日新製鋼	32,000	1,236.00	39,552,000
東京製鐵	62,200	863.00	53,678,600
共英製鋼	13,100	1,940.00	25,414,000
大和工業	24,700	3,045.00	75,211,500
東京鐵鋼	4,800	1,579.00	7,579,200
大阪製鐵	7,700	2,318.00	17,848,600
淀川製鋼所	17,000	2,923.00	49,691,000
東洋鋼鈹	29,400	715.00	21,021,000
丸一鋼管	41,100	3,285.00	135,013,500
モリ工業	3,800	3,050.00	11,590,000
大同特殊鋼	20,600	5,460.00	112,476,000
日本高周波鋼業	4,200	817.00	3,431,400
日本冶金工業	96,000	282.00	27,072,000
山陽特殊製鋼	13,400	2,722.00	36,474,800
愛知製鋼	6,500	4,555.00	29,607,500
日立金属	125,100	1,287.00	161,003,700
日本金属	2,900	2,319.00	6,725,100
大平洋金属	7,100	3,465.00	24,601,500
新日本電工	69,500	350.00	24,325,000
栗本鐵工所	5,900	2,023.00	11,935,700
虹 技	1,700	2,001.00	3,401,700
日本鑄鉄管	12,000	162.00	1,944,000
日本製鋼所	37,900	3,270.00	123,933,000
三菱製鋼	8,600	2,482.00	21,345,200
日亜鋼業	17,200	347.00	5,968,400

日本精線	1,900	4,705.00	8,939,500
大紀アルミニウム工業所	19,100	735.00	14,038,500
日本軽金属ホールディングス	339,000	285.00	96,615,000
三井金属鉱業	31,300	4,755.00	148,831,500
東邦亜鉛	6,400	5,170.00	33,088,000
三菱マテリアル	76,700	3,260.00	250,042,000
住友金属鉱山	148,400	4,516.00	670,174,400
DOWAホールディングス	29,400	3,955.00	116,277,000
古河機械金属	19,200	2,063.00	39,609,600
エス・サイエンス	55,000	73.00	4,015,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	12,100	2,031.00	24,575,100
東邦チタニウム	20,800	1,314.00	27,331,200
UACJ	17,600	2,799.00	49,262,400
古河電気工業	38,600	4,920.00	189,912,000
住友電気工業	434,200	1,631.50	708,397,300
フジクラ	140,200	711.00	99,682,200
昭和電線ホールディングス	14,600	938.00	13,694,800
東京特殊電線	1,500	3,195.00	4,792,500
タツタ電線	23,000	656.00	15,088,000
カナレ電気	1,900	2,263.00	4,299,700
平河ヒューテック	5,800	1,407.00	8,160,600
リョービ	14,300	2,784.00	39,811,200
アーレスティ	14,200	977.00	13,873,400
アサヒホールディングス	19,900	1,953.00	38,864,700
東洋製罐グループホールディングス	79,400	1,594.00	126,563,600
ホッカンホールディングス	28,000	379.00	10,612,000
コロナ	6,500	1,247.00	8,105,500
横河ブリッジホールディングス	21,600	2,286.00	49,377,600
OSJBホールディングス	58,100	293.00	17,023,300
駒井ハルテック	2,500	2,488.00	6,220,000
高田機工	1,100	3,395.00	3,734,500
三和ホールディングス	111,400	1,384.00	154,177,600
文化シャッター	34,200	1,063.00	36,354,600
三協立山	16,100	1,616.00	26,017,600
アルインコ	8,500	1,095.00	9,307,500
東洋シャッター	2,900	645.00	1,870,500
LIXILグループ	171,200	2,376.00	406,771,200
日本フィルコン	9,000	626.00	5,634,000
ノーリツ	25,900	1,916.00	49,624,400
長府製作所	13,100	2,488.00	32,592,800
リンナイ	20,700	10,450.00	216,315,000
ユニプレス	22,700	2,516.00	57,113,200
ダイニチ工業	6,400	820.00	5,248,000
日東精工	16,100	768.00	12,364,800
三洋工業	1,400	2,095.00	2,933,000
岡部	23,500	1,047.00	24,604,500
ジーテクト	12,800	2,028.00	25,958,400
中国工業	1,700	756.00	1,285,200
東プレ	21,700	3,155.00	68,463,500
高周波熱錬	22,400	1,070.00	23,968,000

東京製綱	8,300	2,343.00	19,446,900
サンコール	6,600	720.00	4,752,000
モリテックスチール	6,800	707.00	4,807,600
パイオラックス	17,200	2,867.00	49,312,400
エイチワン	8,500	1,384.00	11,764,000
日本発条	115,700	1,143.00	132,245,100
中央発條	1,300	3,470.00	4,511,000
アドバネクス	1,800	2,900.00	5,220,000
三浦工業	50,200	3,185.00	159,887,000
タクマ	39,300	1,207.00	47,435,100
テクノプロ・ホールディングス	21,100	6,230.00	131,453,000
アトラ	1,900	1,150.00	2,185,000
インターワークス	2,500	998.00	2,495,000
Keep Per 技研	3,600	1,361.00	4,899,600
ファーストロジック	1,700	852.00	1,448,400
三機サービス	1,300	1,906.00	2,477,800
Gunosy	5,000	2,595.00	12,975,000
デザインワン・ジャパン	2,200	1,301.00	2,862,200
イー・ガーディアン	5,700	4,185.00	23,854,500
リブセンス	7,100	509.00	3,613,900
ジャパンマテリアル	30,700	1,374.00	42,181,800
ベクトル	13,500	2,473.00	33,385,500
ウチヤマホールディングス	5,600	626.00	3,505,600
ライクキッズネクスト	2,300	995.00	2,288,500
キャリアリンク	3,700	560.00	2,072,000
IBJ	9,000	948.00	8,532,000
アサンテ	4,100	2,050.00	8,405,000
N・フィールド	6,300	1,808.00	11,390,400
バリューHR	2,500	1,984.00	4,960,000
M&Aキャピタルパートナーズ	2,300	8,680.00	19,964,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	4,600	963.00	4,429,800
E R Iホールディングス	3,200	1,147.00	3,670,400
アビスト	1,600	4,870.00	7,792,000
シグマクシス	4,500	2,212.00	9,954,000
ウィルグループ	4,800	1,382.00	6,633,600
エスクロー・エージェント・ジャパン	15,400	421.00	6,483,400
日本ビューホテル	3,600	1,547.00	5,569,200
リクルートホールディングス	865,700	2,589.50	2,241,730,150
エラン	2,700	2,132.00	5,756,400
ツガミ	31,000	1,464.00	45,384,000
オークマ	13,500	6,040.00	81,540,000
東芝機械	66,000	737.00	48,642,000
アマダホールディングス	179,200	1,290.00	231,168,000
アイダエンジニアリング	29,500	1,287.00	37,966,500
滝澤鉄工所	3,600	1,948.00	7,012,800
F U J I	34,800	1,980.00	68,904,000
牧野フライス製作所	59,000	987.00	58,233,000
オーエスジー	53,500	2,449.00	131,021,500
ダイジェット工業	1,400	1,951.00	2,731,400

旭ダイヤモンド工業	34,500	1,106.00	38,157,000
D M G 森精機	64,300	1,953.00	125,577,900
ソディック	25,300	1,321.00	33,421,300
ディスコ	15,700	23,130.00	363,141,000
日東工器	7,200	2,932.00	21,110,400
日進工具	3,100	3,150.00	9,765,000
パンチ工業	9,700	1,156.00	11,213,200
富士ダイス	4,300	1,018.00	4,377,400
土木管理総合試験所	3,600	580.00	2,088,000
日本郵政	636,800	1,303.00	829,750,400
ベルシステム24ホールディングス	18,800	1,378.00	25,906,400
鎌倉新書	1,500	4,125.00	6,187,500
一蔵	1,400	975.00	1,365,000
L I T A L I C O	1,900	1,615.00	3,068,500
グローバルグループ	1,200	1,292.00	1,550,400
エボラブルアジア	2,300	2,084.00	4,793,200
ストライク	1,100	5,880.00	6,468,000
ソラスト	6,800	2,963.00	20,148,400
セラク	1,900	827.00	1,571,300
インソース	1,400	5,200.00	7,280,000
豊田自動織機	95,000	6,280.00	596,600,000
豊和工業	6,400	1,211.00	7,750,400
O K K	4,500	1,118.00	5,031,000
石川製作所	3,000	2,222.00	6,666,000
東洋機械金属	9,100	830.00	7,553,000
津田駒工業	27,000	229.00	6,183,000
エンシュウ	30,000	154.00	4,620,000
島精機製作所	14,700	6,940.00	102,018,000
オプトラン	8,500	3,370.00	28,645,000
N C ホールディングス	3,600	773.00	2,782,800
フリー	8,300	943.00	7,826,900
ヤマシンフィルタ	17,700	1,322.00	23,399,400
日阪製作所	16,700	1,131.00	18,887,700
やまびこ	22,500	1,469.00	33,052,500
平田機工	3,200	9,550.00	30,560,000
ペガサスミシン製造	10,900	765.00	8,338,500
ナブテスコ	63,900	3,985.00	254,641,500
三井海洋開発	12,300	2,785.00	34,255,500
レオン自動機	10,400	1,994.00	20,737,600
S M C	36,800	42,030.00	1,546,704,000
新川	9,500	1,041.00	9,889,500
ホソカワミクロン	4,400	7,240.00	31,856,000
ユニオンツール	5,300	3,655.00	19,371,500
オイレス工業	15,000	2,290.00	34,350,000
日精エー・エス・ビー機械	3,900	6,990.00	27,261,000
サトーホールディングス	15,300	3,200.00	48,960,000
技研製作所	5,900	2,702.00	15,941,800
日本エアテック	3,900	845.00	3,295,500
日精樹脂工業	9,700	1,446.00	14,026,200
オカダアイヨン	3,900	1,426.00	5,561,400

ワイエイシイホールディングス	3,800	1,047.00	3,978,600	
小松製作所	567,000	3,607.00	2,045,169,000	
住友重機械工業	67,200	4,070.00	273,504,000	
日立建機	54,900	4,070.00	223,443,000	
日工	3,200	2,307.00	7,382,400	
巴工業	5,000	2,080.00	10,400,000	
井関農機	11,700	2,086.00	24,406,200	
TOWA	9,100	1,464.00	13,322,400	
丸山製作所	2,500	1,837.00	4,592,500	
北川鉄工所	5,600	2,718.00	15,220,800	
シンニッタン	18,100	470.00	8,507,000	
ローツェ	5,800	2,145.00	12,441,000	
タカキタ	4,100	797.00	3,267,700	
クボタ	629,900	1,824.50	1,149,252,550	
荏原実業	3,400	2,188.00	7,439,200	
東洋エンジニアリング	15,500	1,026.00	15,903,000	
三菱化工機	4,100	2,224.00	9,118,400	
月島機械	23,300	1,499.00	34,926,700	
帝国電機製作所	8,200	1,554.00	12,742,800	
東京機械製作所	4,500	494.00	2,223,000	
新東工業	27,900	1,144.00	31,917,600	
澁谷工業	10,300	3,750.00	38,625,000	
アイチコーポレーション	20,300	759.00	15,407,700	
小森コーポレーション	29,500	1,361.00	40,149,500	
鶴見製作所	9,900	2,031.00	20,106,900	
住友精密工業	19,000	399.00	7,581,000	
酒井重工業	2,200	4,855.00	10,681,000	
荏原製作所	48,200	3,915.00	188,703,000	
石井鐵工所	1,800	1,977.00	3,558,600	
西島製作所	12,000	999.00	11,988,000	
北越工業	13,200	1,229.00	16,222,800	
千代田化工建設	85,400	1,011.00	86,339,400	
ダイキン工業	160,300	12,185.00	1,953,255,500	
オルガノ	4,200	3,190.00	13,398,000	
トーヨーカネツ	5,000	3,175.00	15,875,000	
栗田工業	63,500	3,460.00	219,710,000	
椿本チエイン	70,000	895.00	62,650,000	
大同工業	4,500	1,526.00	6,867,000	
日機装	40,600	1,164.00	47,258,400	
木村化工機	9,600	490.00	4,704,000	
新興プランテック	25,300	1,003.00	25,375,900	
アネスト岩田	19,800	1,155.00	22,869,000	
ダイフク	59,800	5,970.00	357,006,000	
サムコ	3,200	1,234.00	3,948,800	
加藤製作所	5,600	2,466.00	13,809,600	
油研工業	2,300	2,889.00	6,644,700	
タダノ	56,600	1,661.00	94,012,600	
フジテック	37,600	1,432.00	53,843,200	
C K D	32,700	2,347.00	76,746,900	
キトー	8,900	1,879.00	16,723,100	

平和	36,400	2,069.00	75,311,600
理想科学工業	11,700	2,077.00	24,300,900
SANKYO	29,400	3,715.00	109,221,000
日本金銭機械	10,800	1,226.00	13,240,800
マースエンジニアリング	7,500	2,384.00	17,880,000
福島工業	7,200	4,425.00	31,860,000
オーイズミ	4,800	545.00	2,616,000
ダイコク電機	5,400	1,718.00	9,277,200
竹内製作所	19,600	2,552.00	50,019,200
アマノ	36,300	2,901.00	105,306,300
JUKI	17,400	1,529.00	26,604,600
サンデンホールディングス	14,300	1,536.00	21,964,800
蛇の目ミシン工業	10,700	725.00	7,757,500
ブラザー工業	143,400	2,477.00	355,201,800
マックス	18,100	1,360.00	24,616,000
モリタホールディングス	18,800	2,130.00	40,044,000
グローリー	35,000	3,860.00	135,100,000
新晃工業	11,900	1,732.00	20,610,800
大和冷機工業	18,900	1,200.00	22,680,000
セガサミーホールディングス	116,500	1,629.00	189,778,500
日本ピストンリング	4,300	2,289.00	9,842,700
リケン	5,400	6,140.00	33,156,000
T P R	13,200	3,130.00	41,316,000
ツバキ・ナカシマ	11,800	2,649.00	31,258,200
ホシザキ	37,000	9,630.00	356,310,000
大豊工業	9,600	1,588.00	15,244,800
日本精工	241,200	1,359.00	327,790,800
NTN	271,800	451.00	122,581,800
ジェイテクト	125,200	1,617.00	202,448,400
不二越	109,000	542.00	59,078,000
ミネベアミツミ	218,000	2,228.00	485,704,000
日本トムソン	37,500	806.00	30,225,000
THK	73,200	3,965.00	290,238,000
ユーシン精機	10,400	1,604.00	16,681,600
前澤給装工業	4,600	1,944.00	8,942,400
イーグル工業	14,500	1,901.00	27,564,500
前澤工業	8,600	450.00	3,870,000
日本ピラー工業	11,900	1,574.00	18,730,600
キッツ	52,300	888.00	46,442,400
日立製作所	2,820,000	781.90	2,204,958,000
三菱電機	1,174,300	1,710.00	2,008,053,000
富士電機	354,000	721.00	255,234,000
東洋電機製造	4,600	1,838.00	8,454,800
安川電機	136,100	4,750.00	646,475,000
シンフォニアテクノロジー	76,000	361.00	27,436,000
明電舎	100,000	399.00	39,900,000
オリジン電気	3,400	1,729.00	5,878,600
山洋電気	5,700	8,300.00	47,310,000
デンヨー	10,800	1,938.00	20,930,400
キャリアインデックス	1,100	2,433.00	2,676,300

MS - Japan	800	6,650.00	5,320,000
船場	1,700	1,323.00	2,249,100
三櫻工業	14,900	762.00	11,353,800
マキタ	153,100	5,060.00	774,686,000
東芝テック	84,000	645.00	54,180,000
芝浦メカトロニクス	17,000	445.00	7,565,000
マブチモーター	32,800	5,300.00	173,840,000
日本電産	141,300	16,270.00	2,298,951,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	4,300	2,837.00	12,199,100
東光高岳	5,900	1,714.00	10,112,600
ダブル・スコープ	17,100	1,582.00	27,052,200
宮越ホールディングス	4,300	723.00	3,108,900
ダイヘン	64,000	820.00	52,480,000
田淵電機	16,300	282.00	4,596,600
ヤーマン	17,000	2,443.00	41,531,000
JVCケンウッド	86,100	370.00	31,857,000
ミマキエンジニアリング	10,500	802.00	8,421,000
第一精工	5,500	2,098.00	11,539,000
日新電機	27,500	1,071.00	29,452,500
大崎電気工業	25,100	783.00	19,653,300
オムロン	124,800	6,040.00	753,792,000
日東工業	18,800	1,734.00	32,599,200
I D E C	14,500	2,692.00	39,034,000
不二電機工業	1,300	1,384.00	1,799,200
ジーエス・ユアサ コーポレーション	211,000	575.00	121,325,000
サクサホールディングス	3,000	2,101.00	6,303,000
メルコホールディングス	5,700	3,575.00	20,377,500
テクノメディカ	2,700	2,018.00	5,448,600
日本電気	152,000	2,928.00	445,056,000
富士通	1,208,000	656.80	793,414,400
沖電気工業	47,700	1,428.00	68,115,600
岩崎通信機	5,200	759.00	3,946,800
電気興業	6,700	3,120.00	20,904,000
サンケン電気	69,000	724.00	49,956,000
ナカヨ	2,200	1,869.00	4,111,800
アイホン	6,700	1,861.00	12,468,700
ルネサスエレクトロニクス	60,800	1,019.00	61,955,200
セイコーエプソン	174,900	1,938.00	338,956,200
ワコム	91,100	542.00	49,376,200
アルバック	27,000	6,090.00	164,430,000
アクセル	4,900	927.00	4,542,300
E I Z O	10,800	5,050.00	54,540,000
ジャパンディスプレイ	241,100	158.00	38,093,800
日本信号	32,400	989.00	32,043,600
京三製作所	27,500	690.00	18,975,000
能美防災	15,500	2,242.00	34,751,000
ホーチキ	8,500	2,075.00	17,637,500
エレコム	10,200	2,466.00	25,153,200
パナソニック	1,341,600	1,535.50	2,060,026,800
シャープ	81,800	3,415.00	279,347,000

アンリツ	85,600	1,301.00	111,365,600
富士通ゼネラル	35,900	1,887.00	67,743,300
ソニー	784,900	5,272.00	4,137,992,800
T D K	61,400	9,520.00	584,528,000
帝国通信工業	5,200	1,255.00	6,526,000
タムラ製作所	45,300	814.00	36,874,200
アルプス電気	101,200	2,618.00	264,941,600
池上通信機	37,000	166.00	6,142,000
パイオニア	195,600	174.00	34,034,400
日本電波工業	10,600	694.00	7,356,400
鈴木	5,000	1,072.00	5,360,000
日本トリム	2,500	5,280.00	13,200,000
ローランド ディー . ジー .	6,000	2,463.00	14,778,000
フォスター電機	13,700	2,637.00	36,126,900
クラリオン	62,000	327.00	20,274,000
S M K	30,000	450.00	13,500,000
ヨコオ	7,600	1,838.00	13,968,800
ティアック	84,000	42.00	3,528,000
ホシデン	29,600	1,321.00	39,101,600
ヒロセ電機	19,915	14,800.00	294,742,000
日本航空電子工業	30,000	1,596.00	47,880,000
T O A	12,600	1,283.00	16,165,800
マクセルホールディングス	23,300	2,212.00	51,539,600
古野電気	14,000	784.00	10,976,000
ユニデンホールディングス	32,000	261.00	8,352,000
アルパイン	28,000	2,082.00	58,296,000
スミダコーポレーション	12,000	1,479.00	17,748,000
アイコム	6,500	2,678.00	17,407,000
リオン	4,900	2,591.00	12,695,900
本多通信工業	9,100	1,020.00	9,282,000
船井電機	11,900	782.00	9,305,800
横河電機	117,500	2,184.00	256,620,000
新電元工業	4,100	7,130.00	29,233,000
アズビル	35,200	4,895.00	172,304,000
東亜ディーケーケー	5,800	1,321.00	7,661,800
日本光電工業	49,100	2,902.00	142,488,200
チノー	4,100	1,507.00	6,178,700
共和電業	13,500	425.00	5,737,500
日本電子材料	4,700	730.00	3,431,000
堀場製作所	23,300	7,850.00	182,905,000
アドバンテスト	65,500	2,230.00	146,065,000
小野測器	5,100	877.00	4,472,700
エスベック	10,400	2,444.00	25,417,600
キーエンス	57,600	62,600.00	3,605,760,000
日置電機	6,100	3,315.00	20,221,500
シスメックス	91,400	9,420.00	860,988,000
日本マイクロニクス	20,400	1,103.00	22,501,200
メガチップス	9,200	3,445.00	31,694,000
O B A R A G R O U P	6,800	6,210.00	42,228,000

イマジカ・ロボット ホールディングス	9,700	1,154.00	11,193,800	
澤藤電機	1,200	1,958.00	2,349,600	
デンソー	260,600	5,800.00	1,511,480,000	
コーセル	16,300	1,433.00	23,357,900	
イリソ電子工業	9,900	6,470.00	64,053,000	
新日本無線	7,100	740.00	5,254,000	
オブテックスグループ	19,100	2,865.00	54,721,500	
千代田インテグレ	5,500	2,501.00	13,755,500	
アイ・オー・データ機器	4,900	1,139.00	5,581,100	
レーザーテック	24,100	3,850.00	92,785,000	
スタンレー電気	89,800	4,045.00	363,241,000	
岩崎電気	4,600	1,671.00	7,686,600	
ウシオ電機	71,300	1,457.00	103,884,100	
岡谷電機産業	6,300	597.00	3,761,100	
ヘリオス テクノ ホールディング	10,000	909.00	9,090,000	
日本セラミック	11,900	2,947.00	35,069,300	
遠藤照明	6,000	1,053.00	6,318,000	
古河電池	8,400	960.00	8,064,000	
双信電機	5,000	580.00	2,900,000	
山一電機	8,500	1,965.00	16,702,500	
図研	7,700	1,407.00	10,833,900	
日本電子	43,000	928.00	39,904,000	
カシオ計算機	94,400	1,667.00	157,364,800	
ファナック	111,600	26,985.00	3,011,526,000	
日本シイエムケイ	20,700	831.00	17,201,700	
エンプラス	5,300	3,535.00	18,735,500	
大真空	4,300	1,272.00	5,469,600	
ローム	52,700	9,690.00	510,663,000	
浜松ホトニクス	85,500	4,060.00	347,130,000	
三井ハイテック	15,500	1,555.00	24,102,500	
新光電気工業	44,400	787.00	34,942,800	
京セラ	192,800	6,049.00	1,166,247,200	
協栄産業	1,400	1,903.00	2,664,200	
太陽誘電	52,700	1,896.00	99,919,200	
村田製作所	123,200	14,400.00	1,774,080,000	
ユーシン	17,700	746.00	13,204,200	
双葉電子工業	19,200	2,212.00	42,470,400	
日東電工	88,700	8,217.00	728,847,900	
北陸電気工業	4,700	1,497.00	7,035,900	
東海理化電機製作所	30,900	2,161.00	66,774,900	
ニチコン	37,000	1,223.00	45,251,000	
日本ケミコン	9,500	2,573.00	24,443,500	
K O A	16,200	2,138.00	34,635,600	
三井E & Sホールディングス	42,400	1,712.00	72,588,800	
日立造船	93,000	552.00	51,336,000	
三菱重工業	196,800	4,091.00	805,108,800	
川崎重工業	91,400	3,350.00	306,190,000	
I H I	90,200	3,525.00	317,955,000	
名村造船所	35,200	644.00	22,668,800	

サノヤホールディングス	14,300	256.00	3,660,800	
日本車輛製造	43,000	320.00	13,760,000	
三菱ロジスネクスト	14,000	913.00	12,782,000	
近畿車輛	1,800	2,480.00	4,464,000	
F P G	40,400	1,346.00	54,378,400	
島根銀行	2,400	1,353.00	3,247,200	
じもとホールディングス	78,600	189.00	14,855,400	
全国保証	32,600	4,610.00	150,286,000	
めぶきフィナンシャルグループ	601,800	417.00	250,950,600	
東京ＴＹフィナンシャルグループ	15,600	2,764.00	43,118,400	
九州フィナンシャルグループ	190,100	524.00	99,612,400	
かんぽ生命保険	43,800	2,541.00	111,295,800	
ゆうちょ銀行	328,300	1,444.00	474,065,200	
富山第一銀行	29,600	496.00	14,681,600	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	704,200	591.00	416,182,200	
西日本フィナンシャルホールディングス	78,600	1,230.00	96,678,000	
マーキュリアインベストメント	2,400	1,060.00	2,544,000	
イントラスト	1,800	709.00	1,276,200	
アルヒ	9,900	1,473.00	14,582,700	
日産自動車	1,385,100	1,122.00	1,554,082,200	
いすゞ自動車	340,300	1,636.50	556,900,950	
トヨタ自動車	1,427,700	6,845.00	9,772,606,500	*
日野自動車	167,600	1,346.00	225,589,600	
三菱自動車工業	434,700	783.00	340,370,100	
エフテック	7,500	1,387.00	10,402,500	
レシップホールディングス	4,300	805.00	3,461,500	
G M B	1,900	1,784.00	3,389,600	
ファルテック	2,100	1,257.00	2,639,700	
武蔵精密工業	12,500	3,725.00	46,562,500	
日産車体	45,900	1,140.00	52,326,000	
新明和工業	51,000	1,023.00	52,173,000	
極東開発工業	21,800	1,596.00	34,792,800	
日信工業	23,900	1,889.00	45,147,100	
トビー工業	9,700	3,135.00	30,409,500	
ティラド	4,300	3,840.00	16,512,000	
曙ブレーキ工業	54,500	286.00	15,587,000	
タチエス	19,900	1,910.00	38,009,000	
N O K	63,100	2,140.00	135,034,000	
フタバ産業	35,900	902.00	32,381,800	
K Y B	12,200	5,180.00	63,196,000	
市光工業	17,500	1,126.00	19,705,000	
大同メタル工業	14,800	1,322.00	19,565,600	
プレス工業	62,400	628.00	39,187,200	
ミクニ	14,900	604.00	8,999,600	
太平洋工業	24,600	1,428.00	35,128,800	
ケーヒン	27,000	2,241.00	60,507,000	
河西工業	14,400	1,443.00	20,779,200	
アイシン精機	96,700	5,880.00	568,596,000	

マツダ	368,600	1,458.00	537,418,800
今仙電機製作所	10,900	1,195.00	13,025,500
本田技研工業	1,056,800	3,782.00	3,996,817,600
スズキ	232,700	5,904.00	1,373,860,800
S U B A R U	364,600	3,592.00	1,309,643,200
安永	5,700	2,230.00	12,711,000
ヤマハ発動機	165,900	3,320.00	550,788,000
ショーワ	30,500	1,753.00	53,466,500
小糸製作所	70,300	7,390.00	519,517,000
T B K	14,100	510.00	7,191,000
エクセディ	14,200	3,505.00	49,771,000
ミツバ	21,600	1,453.00	31,384,800
豊田合成	42,700	2,517.00	107,475,900
愛三工業	20,700	1,168.00	24,177,600
盟和産業	1,700	1,317.00	2,238,900
日本プラスト	4,800	952.00	4,569,600
ヨロズ	11,900	1,823.00	21,693,700
エフ・シー・シー	19,200	2,996.00	57,523,200
新家工業	2,700	2,048.00	5,529,600
シマノ	47,300	14,580.00	689,634,000
テイ・エス テック	27,300	4,300.00	117,390,000
関西みらいフィナンシャルグループ	50,797	841.00	42,720,277
三十三フィナンシャルグループ	9,810	2,456.00	24,093,360
ジャムコ	5,900	2,290.00	13,511,000
小野建	10,100	1,852.00	18,705,200
はるやまホールディングス	5,500	1,065.00	5,857,500
ノジマ	20,300	2,591.00	52,597,300
佐鳥電機	8,500	1,144.00	9,724,000
カッパ・クリエイト	14,400	1,281.00	18,446,400
エコートレーディング	2,500	721.00	1,802,500
伯東	7,000	1,661.00	11,627,000
コンドーテック	9,200	921.00	8,473,200
中山福	6,400	751.00	4,806,400
ライトオン	9,800	997.00	9,770,600
ナガイレーベン	15,300	3,035.00	46,435,500
ジーンズメイト	3,400	832.00	2,828,800
三菱食品	12,800	3,165.00	40,512,000
良品計画	15,400	34,500.00	531,300,000
三城ホールディングス	14,500	500.00	7,250,000
松田産業	8,400	1,872.00	15,724,800
第一興商	17,200	5,580.00	95,976,000
メディカルホールディングス	115,900	2,152.00	249,416,800
アドヴァン	11,800	955.00	11,269,000
S P K	2,400	2,890.00	6,936,000
萩原電気ホールディングス	4,100	3,150.00	12,915,000
アルピス	2,800	3,550.00	9,940,000
アズワン	9,100	7,070.00	64,337,000
スズデン	4,000	1,598.00	6,392,000
尾家産業	3,300	1,287.00	4,247,100
シモジマ	7,100	1,144.00	8,122,400

ドウシシャ	12,300	2,521.00	31,008,300
小津産業	2,500	2,354.00	5,885,000
コナカ	14,900	581.00	8,656,900
高速	6,900	1,377.00	9,501,300
ハウス オブ ローゼ	1,500	1,759.00	2,638,500
G - 7ホールディングス	3,400	2,500.00	8,500,000
たけびし	4,100	1,703.00	6,982,300
イオン北海道	11,800	804.00	9,487,200
コジマ	19,900	417.00	8,298,300
ヒマラヤ	3,200	1,155.00	3,696,000
コーナン商事	16,400	2,487.00	40,786,800
ネットワンシステムズ	47,000	1,556.00	73,132,000
エコス	4,700	1,509.00	7,092,300
ワタミ	13,700	1,448.00	19,837,600
マルシェ	3,200	803.00	2,569,600
リックス	2,600	2,099.00	5,457,400
システムソフト	27,300	139.00	3,794,700
ドンキホーテホールディングス	75,000	5,790.00	434,250,000
丸文	10,200	999.00	10,189,800
西松屋チェーン	25,400	1,224.00	31,089,600
ゼンショーホールディングス	60,000	2,546.00	152,760,000
ハビネット	7,900	1,501.00	11,857,900
幸楽苑ホールディングス	7,300	1,835.00	13,395,500
ハークスレイ	2,700	1,060.00	2,862,000
橋本総業ホールディングス	2,300	1,807.00	4,156,100
日本ライフライン	33,000	3,035.00	100,155,000
サイゼリヤ	17,100	3,060.00	52,326,000
エクセル	4,600	2,824.00	12,990,400
V Tホールディングス	39,200	509.00	19,952,800
マルカキカイ	3,800	2,124.00	8,071,200
アルゴグラフィックス	5,300	3,590.00	19,027,000
魚力	3,300	1,386.00	4,573,800
I D O M	35,100	786.00	27,588,600
日本エム・ディ・エム	7,700	1,010.00	7,777,000
ポプラ	3,000	877.00	2,631,000
フジ・コーポレーション	2,000	2,739.00	5,478,000
ユナイテッドアローズ	14,300	4,245.00	60,703,500
進和	6,900	2,276.00	15,704,400
エスケイジャパン	2,800	715.00	2,002,000
ダイترون	5,300	2,060.00	10,918,000
ハイデイ日高	15,200	2,891.00	43,943,200
シークス	14,700	2,232.00	32,810,400
京都きもの友禅	7,300	750.00	5,475,000
コロワイド	38,400	2,652.00	101,836,800
ピーシーデボコーポレーション	17,300	729.00	12,611,700
田中商事	3,700	682.00	2,523,400
オーハシテクニカ	6,600	1,768.00	11,668,800
壺番屋	8,200	4,525.00	37,105,000
白銅	4,200	2,126.00	8,929,200
トップカルチャー	4,100	500.00	2,050,000

PLANT	2,600	1,334.00	3,468,400
スギホールディングス	25,400	6,140.00	155,956,000
島津製作所	140,300	2,999.00	420,759,700
JMS	10,500	621.00	6,520,500
クボテック	2,500	529.00	1,322,500
長野計器	9,200	1,192.00	10,966,400
ブイ・テクノロジー	2,700	28,610.00	77,247,000
スター精密	18,800	2,051.00	38,558,800
東京計器	7,500	1,174.00	8,805,000
愛知時計電機	1,500	3,940.00	5,910,000
インターアクション	4,700	1,089.00	5,118,300
オーバル	11,200	304.00	3,404,800
東京精密	21,200	4,170.00	88,404,000
マニー	14,300	4,250.00	60,775,000
ニコン	204,600	1,867.00	381,988,200
トプコン	63,100	2,042.00	128,850,200
オリンパス	174,900	3,940.00	689,106,000
理研計器	11,200	2,378.00	26,633,600
SCREENホールディングス	22,200	9,360.00	207,792,000
キヤノン電子	10,800	2,410.00	26,028,000
タムロン	9,500	2,303.00	21,878,500
HOYA	236,400	5,550.00	1,312,020,000
シード	1,200	7,030.00	8,436,000
ノーリツ鋼機	11,900	2,746.00	32,677,400
エー・アンド・デイ	10,700	621.00	6,644,700
キヤノン	632,200	3,900.00	2,465,580,000
リコー	353,100	1,086.00	383,466,600
シチズン時計	140,100	786.00	110,118,600
リズム時計工業	4,300	2,337.00	10,049,100
大研医器	10,600	733.00	7,769,800
メニコン	16,100	2,698.00	43,437,800
シンシア	900	687.00	618,300
中本パックス	2,200	1,945.00	4,279,000
スノーピーク	3,600	1,413.00	5,086,800
パラマウントベッドホールディングス	12,400	5,420.00	67,208,000
トランザクション	5,300	973.00	5,156,900
SHOBI	3,900	425.00	1,657,500
ニホンフラッシュ	5,500	2,508.00	13,794,000
前田工織	11,800	1,673.00	19,741,400
永大産業	15,600	555.00	8,658,000
アートネイチャー	12,600	699.00	8,807,400
バンダイナムコホールディングス	121,400	3,460.00	420,044,000
アイフィスジャパン	2,400	684.00	1,641,600
共立印刷	19,800	355.00	7,029,000
SHOEI	5,300	4,100.00	21,730,000
フランスベッドホールディングス	14,000	976.00	13,664,000
マーベラス	19,500	898.00	17,511,000
パイロットコーポレーション	20,500	5,870.00	120,335,000
萩原工業	6,500	1,959.00	12,733,500
エイベックス	21,400	1,451.00	31,051,400

トッパン・フォームズ	25,200	1,176.00	29,635,200
フジシールインターナショナル	26,300	4,250.00	111,775,000
タカラトミー	49,100	1,061.00	52,095,100
廣済堂	10,900	538.00	5,864,200
As-meエステール	3,400	946.00	3,216,400
アーク	59,800	120.00	7,176,000
レック	7,000	3,905.00	27,335,000
タカノ	5,200	939.00	4,882,800
プロネクス	11,000	1,298.00	14,278,000
ホクシン	8,200	183.00	1,500,600
ウッドワン	3,800	1,421.00	5,399,800
大建工業	9,200	2,658.00	24,453,600
きもと	20,000	299.00	5,980,000
凸版印刷	331,000	866.00	286,646,000
大日本印刷	153,700	2,254.00	346,439,800
図書印刷	7,900	958.00	7,568,200
共同印刷	3,600	3,330.00	11,988,000
N I S S H A	24,100	2,808.00	67,672,800
光村印刷	1,000	2,329.00	2,329,000
藤森工業	9,800	3,695.00	36,211,000
ヴィア・ホールディングス	10,400	694.00	7,217,600
宝印刷	6,200	1,909.00	11,835,800
前澤化成工業	8,100	1,163.00	9,420,300
アシックス	116,600	2,017.00	235,182,200
ツツミ	3,700	2,018.00	7,466,600
J S P	6,900	3,430.00	23,667,000
ニチハ	17,700	4,135.00	73,189,500
エフピコ	9,700	6,610.00	64,117,000
小松ウオール工業	4,000	2,768.00	11,072,000
ヤマハ	79,100	4,875.00	385,612,500
河合楽器製作所	3,900	3,635.00	14,176,500
クリナップ	11,000	861.00	9,471,000
ピジョン	71,000	4,795.00	340,445,000
天馬	9,200	2,025.00	18,630,000
兼松サステック	900	2,003.00	1,802,700
キングジム	9,800	1,019.00	9,986,200
象印マホービン	21,800	1,349.00	29,408,200
リンテック	27,900	3,085.00	86,071,500
信越ポリマー	24,100	1,122.00	27,040,200
東リ	29,400	387.00	11,377,800
イトーキ	24,700	717.00	17,709,900
任天堂	72,300	44,690.00	3,231,087,000
三菱鉛筆	19,300	2,392.00	46,165,600
松風	5,800	1,418.00	8,224,400
タカラスタンダード	24,300	1,791.00	43,521,300
コクヨ	56,300	2,127.00	119,750,100
ナカバヤシ	11,600	620.00	7,192,000
ニフコ	43,100	3,635.00	156,668,500
立川ブラインド工業	5,100	1,522.00	7,762,200
グローブライド	5,300	2,950.00	15,635,000

オカムラ	41,000	1,490.00	61,090,000
日本バルカー工業	9,500	3,120.00	29,640,000
MUTOHホールディングス	1,600	2,439.00	3,902,400
伊藤忠商事	848,800	2,103.50	1,785,450,800
丸紅	950,500	789.30	750,229,650
スクロール	17,800	426.00	7,582,800
高島	1,900	2,144.00	4,073,600
ヨンドシーホールディングス	11,800	2,611.00	30,809,800
三陽商会	6,400	2,586.00	16,550,400
長瀬産業	69,700	1,833.00	127,760,100
ナイガイ	4,400	569.00	2,503,600
蝶理	7,400	2,090.00	15,466,000
豊田通商	129,100	3,645.00	470,569,500
オンワードホールディングス	73,500	805.00	59,167,500
三共生興	19,800	496.00	9,820,800
兼松	49,300	1,593.00	78,534,900
美津濃	11,600	3,130.00	36,308,000
ツカモトコーポレーション	2,100	1,250.00	2,625,000
ユニー・ファミリーマートホールディングス	37,000	8,970.00	331,890,000
ルックホールディングス	21,000	311.00	6,531,000
三井物産	982,600	1,851.50	1,819,283,900
日本紙パルプ商事	6,000	4,405.00	26,430,000
東京エレクトロン	78,300	20,045.00	1,569,523,500
日立ハイテクノロジーズ	40,200	4,975.00	199,995,000
カメイ	15,100	1,467.00	22,151,700
東都水産	1,700	1,977.00	3,360,900
OUGホールディングス	1,800	2,654.00	4,777,200
スターゼン	4,500	5,560.00	25,020,000
セイコーホールディングス	18,100	2,684.00	48,580,400
山善	45,200	1,085.00	49,042,000
椿本興業	2,600	3,350.00	8,710,000
住友商事	729,600	1,838.00	1,341,004,800
日本ユニシス	32,000	2,198.00	70,336,000
内田洋行	5,300	2,907.00	15,407,100
三菱商事	811,700	2,914.50	2,365,699,650
第一実業	5,300	3,125.00	16,562,500
キヤノンマーケティングジャパン	33,100	2,860.00	94,666,000
西華産業	7,200	2,730.00	19,656,000
佐藤商事	10,400	1,141.00	11,866,400
菱洋エレクトロ	10,800	1,745.00	18,846,000
東京産業	11,600	551.00	6,391,600
ユアサ商事	11,000	3,440.00	37,840,000
神鋼商事	2,600	3,735.00	9,711,000
小林産業	7,600	361.00	2,743,600
阪和興業	21,600	4,330.00	93,528,000
正栄食品工業	6,400	4,305.00	27,552,000
カナデン	11,100	1,386.00	15,384,600
菱電商事	8,300	1,763.00	14,632,900
ニプロ	81,300	1,527.00	124,145,100

フルサト工業	6,400	1,821.00	11,654,400
岩谷産業	25,700	3,990.00	102,543,000
すてきナイスグループ	4,800	1,466.00	7,036,800
昭光通商	41,000	107.00	4,387,000
ニチモウ	1,700	1,806.00	3,070,200
極東貿易	17,000	518.00	8,806,000
イワキ	16,300	439.00	7,155,700
兼松エレクトロニクス	7,300	3,240.00	23,652,000
三愛石油	31,100	1,669.00	51,905,900
稲畑産業	27,800	1,640.00	45,592,000
G S Iクレオス	3,100	1,534.00	4,755,400
明和産業	10,700	514.00	5,499,800
キムラタン	55,500	42.00	2,331,000
ゴールドウイン	6,900	6,360.00	43,884,000
ユニ・チャーム	249,000	2,964.00	738,036,000
デサント	28,100	1,731.00	48,641,100
キング	6,200	574.00	3,558,800
ワキタ	24,700	1,146.00	28,306,200
ヤマトインターナショナル	8,100	602.00	4,876,200
東邦ホールディングス	34,300	2,505.00	85,921,500
サンゲツ	38,500	2,221.00	85,508,500
ミツウロコグループホールディングス	16,800	837.00	14,061,600
シナネンホールディングス	4,800	2,734.00	13,123,200
伊藤忠エネクス	25,600	1,049.00	26,854,400
サンリオ	32,500	2,036.00	66,170,000
サンワテクノス	6,800	1,569.00	10,669,200
リョーサン	14,600	3,840.00	56,064,000
新光商事	12,700	1,810.00	22,987,000
トーヨー	5,300	2,457.00	13,022,100
三信電気	10,700	2,136.00	22,855,200
東陽テクニカ	13,400	959.00	12,850,600
モスフードサービス	15,200	3,245.00	49,324,000
加賀電子	10,500	2,613.00	27,436,500
三益半導体工業	9,100	1,960.00	17,836,000
ソーダニッカ	12,000	768.00	9,216,000
立花エレテック	7,800	2,051.00	15,997,800
木曽路	14,200	2,855.00	40,541,000
S R Sホールディングス	13,700	958.00	13,124,600
千趣会	21,000	568.00	11,928,000
タカキュー	9,000	204.00	1,836,000
ケーヨー	21,400	559.00	11,962,600
上新電機	13,600	4,190.00	56,984,000
日本瓦斯	21,200	5,220.00	110,664,000
ロイヤルホールディングス	20,500	2,878.00	58,999,000
東天紅	800	1,780.00	1,424,000
いなげや	12,900	1,766.00	22,781,400
島忠	27,900	3,405.00	94,999,500
チヨダ	13,700	2,699.00	36,976,300
ライフコーポレーション	8,800	2,741.00	24,120,800
リンガーハット	14,300	2,473.00	35,363,900

さが美グループホールディングス	11,000	119.00	1,309,000	
MrMaxHD	14,500	718.00	10,411,000	
テンアライド	10,900	477.00	5,199,300	
AOKIホールディングス	23,200	1,578.00	36,609,600	
オークワ	16,000	1,192.00	19,072,000	
コメリ	17,900	2,907.00	52,035,300	
青山商事	22,200	4,055.00	90,021,000	
しまむら	13,500	13,530.00	182,655,000	
はせがわ	5,900	481.00	2,837,900	
高島屋	181,000	915.00	165,615,000	
松屋	23,300	1,500.00	34,950,000	
エイチ・ツー・オー リテイリング	54,800	1,995.00	109,326,000	
近鉄百貨店	4,500	3,825.00	17,212,500	
パルコ	11,100	1,332.00	14,785,200	
丸井グループ	110,700	2,183.00	241,658,100	
クレディセゾン	87,900	1,794.00	157,692,600	
アクシアル リテイリング	9,600	4,090.00	39,264,000	
井筒屋	6,300	349.00	2,198,700	
イオン	445,100	1,933.50	860,600,850	
イズミ	20,900	7,310.00	152,779,000	
東武ストア	1,300	3,055.00	3,971,500	
フォーバル	5,100	875.00	4,462,500	
平和堂	23,500	2,405.00	56,517,500	
フジ	13,800	2,401.00	33,133,800	
ヤオコー	13,100	5,880.00	77,028,000	
ゼビオホールディングス	15,700	2,051.00	32,200,700	
ケーズホールディングス	98,000	1,557.00	152,586,000	
PALTAC	16,200	5,470.00	88,614,000	
三谷産業	12,700	431.00	5,473,700	
Olympicグループ	6,600	560.00	3,696,000	
日産東京販売ホールディングス	17,100	418.00	7,147,800	
新生銀行	100,300	1,643.00	164,792,900	
あおぞら銀行	69,000	4,260.00	293,940,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	8,108,900	707.20	5,734,614,080	
りそなホールディングス	1,271,000	575.70	731,714,700	
三井住友トラスト・ホールディングス	227,700	4,392.00	1,000,058,400	
三井住友フィナンシャルグループ	876,700	4,491.00	3,937,259,700	
第四銀行	14,200	4,860.00	69,012,000	
北越銀行	11,600	2,402.00	27,863,200	
千葉銀行	410,200	841.00	344,978,200	
群馬銀行	235,200	605.00	142,296,000	
武蔵野銀行	18,500	3,445.00	63,732,500	
千葉興業銀行	31,800	495.00	15,741,000	
筑波銀行	48,200	365.00	17,593,000	
七十七銀行	36,300	2,529.00	91,802,700	
青森銀行	9,000	3,355.00	30,195,000	
秋田銀行	7,400	2,871.00	21,245,400	
山形銀行	13,000	2,421.00	31,473,000	
岩手銀行	8,100	4,345.00	35,194,500	
東邦銀行	103,600	415.00	42,994,000	

東北銀行	6,000	1,464.00	8,784,000
みちのく銀行	7,500	1,792.00	13,440,000
ふくおかフィナンシャルグループ	470,000	564.00	265,080,000
静岡銀行	305,700	1,036.00	316,705,200
十六銀行	15,600	2,770.00	43,212,000
スルガ銀行	118,500	1,575.00	186,637,500
八十二銀行	209,600	555.00	116,328,000
山梨中央銀行	72,000	455.00	32,760,000
大垣共立銀行	18,300	2,652.00	48,531,600
福井銀行	9,900	2,352.00	23,284,800
北國銀行	13,100	4,250.00	55,675,000
清水銀行	3,800	2,944.00	11,187,200
富山銀行	2,200	3,805.00	8,371,000
滋賀銀行	109,000	543.00	59,187,000
南都銀行	13,600	2,980.00	40,528,000
百五銀行	111,200	503.00	55,933,600
京都銀行	44,200	6,010.00	265,642,000
紀陽銀行	43,600	1,716.00	74,817,600
ほくほくフィナンシャルグループ	77,100	1,498.00	115,495,800
広島銀行	171,000	814.00	139,194,000
山陰合同銀行	68,700	949.00	65,196,300
中国銀行	80,100	1,230.00	98,523,000
鳥取銀行	3,600	1,701.00	6,123,600
伊予銀行	165,200	822.00	135,794,400
百十四銀行	123,000	359.00	44,157,000
四国銀行	17,800	1,516.00	26,984,800
阿波銀行	93,000	710.00	66,030,000
大分銀行	6,700	3,925.00	26,297,500
宮崎銀行	7,700	3,440.00	26,488,000
佐賀銀行	7,100	2,375.00	16,862,500
十八銀行	71,000	273.00	19,383,000
沖縄銀行	11,300	4,585.00	51,810,500
琉球銀行	22,500	1,623.00	36,517,500
セブン銀行	434,400	350.00	152,040,000
みずほフィナンシャルグループ	15,737,400	193.90	3,051,481,860
高知銀行	4,100	1,284.00	5,264,400
山口フィナンシャルグループ	108,000	1,330.00	143,640,000
アクリーティブ	6,300	326.00	2,053,800
芙蓉総合リース	13,300	6,940.00	92,302,000
興銀リース	21,800	2,928.00	63,830,400
東京センチュリー	23,300	6,420.00	149,586,000
SBIホールディングス	131,000	2,615.00	342,565,000
日本証券金融	47,400	653.00	30,952,200
アイフル	194,200	338.00	65,639,600
日本アジア投資	10,400	341.00	3,546,400
長野銀行	3,900	1,835.00	7,156,500
名古屋銀行	9,400	4,015.00	37,741,000
北洋銀行	174,500	355.00	61,947,500
愛知銀行	3,900	5,320.00	20,748,000
中京銀行	4,800	2,325.00	11,160,000

大光銀行	3,800	2,283.00	8,675,400
愛媛銀行	16,200	1,287.00	20,849,400
トマト銀行	4,300	1,530.00	6,579,000
京葉銀行	102,000	483.00	49,266,000
栃木銀行	60,000	400.00	24,000,000
北日本銀行	3,600	2,865.00	10,314,000
東和銀行	20,300	1,457.00	29,577,100
福島銀行	11,000	788.00	8,668,000
大東銀行	5,600	1,264.00	7,078,400
リコーリース	9,100	3,550.00	32,305,000
イオンフィナンシャルサービス	82,200	2,407.00	197,855,400
アコム	232,800	489.00	113,839,200
ジャックス	14,100	2,343.00	33,036,300
オリエントコーポレーション	250,600	169.00	42,351,400
日立キャピタル	31,900	2,679.00	85,460,100
アプラスフィナンシャル	55,800	115.00	6,417,000
オリックス	772,700	1,863.00	1,439,540,100
三菱UFJリース	294,000	639.00	187,866,000
ジャフコ	16,600	4,815.00	79,929,000
九州リースサービス	5,000	786.00	3,930,000
トモニホールディングス	95,500	471.00	44,980,500
大和証券グループ本社	991,000	669.20	663,177,200
野村ホールディングス	1,992,700	634.60	1,264,567,420
岡三証券グループ	99,000	632.00	62,568,000
丸三証券	36,800	1,043.00	38,382,400
東洋証券	41,000	288.00	11,808,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	128,200	738.00	94,611,600
光世証券	2,800	1,398.00	3,914,400
水戸証券	34,700	422.00	14,643,400
いちよし証券	24,300	1,250.00	30,375,000
松井証券	56,700	988.00	56,019,600
SOMPOホールディングス	227,200	4,381.00	995,363,200
だいこう証券ビジネス	5,700	618.00	3,522,600
日本取引所グループ	332,400	1,977.00	657,154,800
マネックスグループ	122,700	535.00	65,644,500
カブドットコム証券	74,000	378.00	27,972,000
極東証券	15,500	1,563.00	24,226,500
岩井コスモホールディングス	11,800	1,415.00	16,697,000
藍澤証券	21,700	788.00	17,099,600
フィデアホールディングス	112,700	192.00	21,638,400
池田泉州ホールディングス	123,000	413.00	50,799,000
アニコムホールディングス	7,900	3,785.00	29,901,500
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	302,800	3,530.00	1,068,884,000
ソニーフィナンシャルホールディングス	95,100	1,980.00	188,298,000
マネーパートナーズグループ	14,800	413.00	6,112,400
小林洋行	3,300	278.00	917,400
第一生命ホールディングス	655,200	2,020.50	1,323,831,600

東京海上ホールディングス	436,400	4,948.00	2,159,307,200
アドバンテッジリスクマネジメント	2,800	1,473.00	4,124,400
イー・ギャランティ	6,100	2,156.00	13,151,600
アサックス	1,600	1,815.00	2,904,000
NECキャピタルソリューション	4,700	2,026.00	9,522,200
T&Dホールディングス	358,200	1,688.00	604,641,600
アドバンスクリエイト	2,700	1,939.00	5,235,300
三井不動産	578,400	2,704.50	1,564,282,800
三菱地所	862,100	1,823.50	1,572,039,350
平和不動産	20,400	2,107.00	42,982,800
東京建物	126,500	1,581.00	199,996,500
ダイビル	29,800	1,260.00	37,548,000
京阪神ビルディング	19,200	894.00	17,164,800
住友不動産	278,000	4,000.00	1,112,000,000
太平洋興発	4,900	1,035.00	5,071,500
大京	18,500	2,238.00	41,403,000
テーオーシー	40,000	977.00	39,080,000
東京楽天地	1,800	5,250.00	9,450,000
レオパレス21	138,200	957.00	132,257,400
スターツコーポレーション	15,800	2,856.00	45,124,800
フジ住宅	14,800	898.00	13,290,400
空港施設	11,700	629.00	7,359,300
明和地所	6,400	769.00	4,921,600
ゴールドクレスト	9,100	2,294.00	20,875,400
リログループ	61,300	2,759.00	169,126,700
日本エスリード	4,500	2,124.00	9,558,000
日神不動産	15,400	808.00	12,443,200
日本エスコン	20,900	940.00	19,646,000
タカラレーベン	54,200	423.00	22,926,600
サンヨーハウジング名古屋	6,000	1,235.00	7,410,000
イオンモール	74,600	2,219.00	165,537,400
ファースト住建	4,400	1,663.00	7,317,200
ランド	254,500	15.00	3,817,500
カチタス	11,800	3,580.00	42,244,000
東祥	7,000	4,150.00	29,050,000
トーセイ	14,100	1,492.00	21,037,200
穴吹興産	1,200	3,150.00	3,780,000
エヌ・ティ・ティ都市開発	72,000	1,253.00	90,216,000
サンフロンティア不動産	14,000	1,214.00	16,996,000
エフ・ジェー・ネクスト	8,900	838.00	7,458,200
インテリックス	3,300	1,008.00	3,326,400
ランドビジネス	6,900	334.00	2,304,600
グランディハウス	10,200	450.00	4,590,000
東武鉄道	125,500	3,220.00	404,110,000
相鉄ホールディングス	37,600	2,861.00	107,573,600
東京急行電鉄	319,000	1,720.00	548,680,000
京浜急行電鉄	160,900	1,859.00	299,113,100
小田急電鉄	174,700	2,170.00	379,099,000
京王電鉄	65,600	4,605.00	302,088,000
京成電鉄	81,700	3,335.00	272,469,500

富士急行	16,000	2,813.00	45,008,000
新京成電鉄	3,100	2,217.00	6,872,700
東日本旅客鉄道	210,900	9,832.00	2,073,568,800
西日本旅客鉄道	106,000	7,455.00	790,230,000
東海旅客鉄道	105,200	20,630.00	2,170,276,000
西武ホールディングス	149,700	1,790.00	267,963,000
鴻池運輸	16,600	1,895.00	31,457,000
西日本鉄道	32,600	2,855.00	93,073,000
ハマキョウレックス	8,300	3,655.00	30,336,500
サカイ引越センター	6,200	5,670.00	35,154,000
近鉄グループホールディングス	111,200	4,190.00	465,928,000
阪急阪神ホールディングス	148,300	3,965.00	588,009,500
南海電気鉄道	52,700	2,713.00	142,975,100
京阪ホールディングス	49,500	3,355.00	166,072,500
神戸電鉄	2,600	3,875.00	10,075,000
名古屋鉄道	87,900	2,701.00	237,417,900
山陽電気鉄道	8,600	2,744.00	23,598,400
トランコム	3,100	7,490.00	23,219,000
日本通運	43,700	7,590.00	331,683,000
ヤマトホールディングス	195,000	2,778.00	541,710,000
山九	28,500	5,110.00	145,635,000
日新	9,600	2,800.00	26,880,000
丸運	6,000	332.00	1,992,000
丸全昭和運輸	40,000	520.00	20,800,000
センコーグループホールディングス	66,900	814.00	54,456,600
トナミホールディングス	2,700	5,930.00	16,011,000
ニッコンホールディングス	42,300	2,890.00	122,247,000
日本石油輸送	1,300	3,135.00	4,075,500
福山通運	16,300	4,625.00	75,387,500
セイノーホールディングス	83,300	1,902.00	158,436,600
神奈川中央交通	2,800	3,820.00	10,696,000
日立物流	24,500	2,974.00	72,863,000
丸和運輸機関	5,900	3,070.00	18,113,000
C & F ロジホールディングス	12,200	1,515.00	18,483,000
日本郵船	93,000	2,164.00	201,252,000
商船三井	70,400	3,085.00	217,184,000
川崎汽船	51,400	2,429.00	124,850,600
NSユニテッド海運	5,200	2,066.00	10,743,200
明治海運	12,000	424.00	5,088,000
飯野海運	56,700	527.00	29,880,900
共栄タンカー	800	1,852.00	1,481,600
九州旅客鉄道	93,300	3,370.00	314,421,000
SGホールディングス	78,800	2,386.00	188,016,800
日本航空	206,300	4,270.00	880,901,000
ANAホールディングス	218,000	4,195.00	914,510,000
パスコ	11,000	329.00	3,619,000
西本Wismettacホールディングス	2,400	4,755.00	11,412,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	900	1,486.00	1,337,400
Genky DrugStores	4,500	3,620.00	16,290,000

三菱倉庫	38,500	2,333.00	89,820,500
三井倉庫ホールディングス	64,000	333.00	21,312,000
住友倉庫	77,000	741.00	57,057,000
澁澤倉庫	6,200	1,777.00	11,017,400
ヤマタネ	5,800	1,911.00	11,083,800
東陽倉庫	20,200	367.00	7,413,400
乾汽船	8,600	833.00	7,163,800
日本トランスシティ	27,000	485.00	13,095,000
ケイヒン	2,100	1,635.00	3,433,500
中央倉庫	6,900	1,091.00	7,527,900
川西倉庫	2,200	1,799.00	3,957,800
安田倉庫	10,000	998.00	9,980,000
東洋埠頭	3,200	1,698.00	5,433,600
宇徳	9,400	452.00	4,248,800
上組	68,600	2,282.00	156,545,200
サンリツ	2,800	749.00	2,097,200
キムラユニティー	3,100	1,115.00	3,456,500
キューソー流通システム	3,300	2,825.00	9,322,500
近鉄エクスプレス	21,000	1,998.00	41,958,000
東海運	6,100	392.00	2,391,200
エーアイティー	8,000	1,176.00	9,408,000
内外トランスライン	3,900	1,848.00	7,207,200
日本コンセプト	2,200	1,451.00	3,192,200
東京放送ホールディングス	63,700	2,211.00	140,840,700
日本テレビホールディングス	105,800	1,785.00	188,853,000
朝日放送グループホールディングス	11,500	882.00	10,143,000
テレビ朝日ホールディングス	31,600	2,400.00	75,840,000
スカパーJ S A Tホールディングス	87,900	479.00	42,104,100
テレビ東京ホールディングス	9,400	2,800.00	26,320,000
日本BS放送	3,900	1,359.00	5,300,100
ビジョン	3,000	3,425.00	10,275,000
USEN-NEXT HOLDINGS	2,900	852.00	2,470,800
ワイヤレスゲート	5,400	1,468.00	7,927,200
コネクシオ	8,200	2,417.00	19,819,400
日本通信	103,800	114.00	11,833,200
クロップス	2,400	943.00	2,263,200
日本電信電話	827,000	5,108.00	4,224,316,000
KDDI	1,037,600	2,778.00	2,882,452,800
光通信	13,900	17,510.00	243,389,000
NTTドコモ	853,100	2,789.50	2,379,722,450
エムティーアイ	15,600	636.00	9,921,600
GMOインターネット	42,000	1,856.00	77,952,000
アйдママーケティングコミュニケーション	1,800	690.00	1,242,000
カドカワ	33,600	1,123.00	37,732,800
学研ホールディングス	3,900	5,120.00	19,968,000
ゼンリン	20,800	2,189.00	45,531,200
昭文社	5,400	804.00	4,341,600
インプレスホールディングス	9,500	205.00	1,947,500

東京電力ホールディングス	937,400	423.00	396,520,200
中部電力	359,300	1,554.50	558,531,850
関西電力	479,200	1,437.50	688,850,000
中国電力	162,300	1,305.00	211,801,500
北陸電力	115,000	971.00	111,665,000
東北電力	275,000	1,431.00	393,525,000
四国電力	105,700	1,332.00	140,792,400
九州電力	259,300	1,268.00	328,792,400
北海道電力	117,700	707.00	83,213,900
沖縄電力	19,000	3,100.00	58,900,000
電源開発	93,400	2,831.00	264,415,400
エフオン	5,900	1,419.00	8,372,100
イーレックス	18,500	816.00	15,096,000
レノバ	3,000	2,892.00	8,676,000
東京瓦斯	250,500	2,786.50	698,018,250
大阪瓦斯	227,900	2,174.00	495,454,600
東邦瓦斯	58,200	3,250.00	189,150,000
北海道瓦斯	32,000	297.00	9,504,000
広島ガス	24,400	371.00	9,052,400
西部瓦斯	14,300	2,718.00	38,867,400
静岡ガス	33,300	940.00	31,302,000
メタウォーター	6,600	3,190.00	21,054,000
アイネット	6,500	1,624.00	10,556,000
松竹	7,600	15,290.00	116,204,000
東宝	75,800	3,600.00	272,880,000
エイチ・アイ・エス	17,500	3,750.00	65,625,000
東映	4,300	11,420.00	49,106,000
ラックランド	2,200	2,623.00	5,770,600
エヌ・ティ・ティ・データ	358,000	1,118.00	400,244,000
共立メンテナンス	20,000	4,955.00	99,100,000
イチネンホールディングス	12,600	1,502.00	18,925,200
建設技術研究所	7,800	1,449.00	11,302,200
スペース	7,300	1,465.00	10,694,500
長 大	3,300	764.00	2,521,200
アインホールディングス	15,500	7,610.00	117,955,000
燦ホールディングス	2,600	2,825.00	7,345,000
ピー・シー・エー	1,700	1,722.00	2,927,400
スバル興業	800	6,950.00	5,560,000
東京テアトル	4,700	1,424.00	6,692,800
タナベ経営	2,100	2,138.00	4,489,800
ビジネスブレイン太田昭和	2,000	2,317.00	4,634,000
ナガワ	2,200	4,560.00	10,032,000
よみうりランド	2,400	4,605.00	11,052,000
東京都競馬	8,400	3,960.00	33,264,000
常磐興産	4,500	1,892.00	8,514,000
カナモト	17,100	3,425.00	58,567,500
東京ドーム	45,400	1,017.00	46,171,800
D T S	12,000	3,825.00	45,900,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	53,600	4,520.00	242,272,000

シーイーシー	6,900	3,565.00	24,598,500
カブコン	49,400	2,211.00	109,223,400
西尾レントオール	10,200	3,205.00	32,691,000
アイ・エス・ビー	2,200	1,971.00	4,336,200
アゴラ・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	33,900	4,230.00	143,397,000
トランス・コスモス	12,500	2,866.00	35,825,000
乃村工藝社	26,200	2,243.00	58,766,600
ジャステック	6,700	1,300.00	8,710,000
S C S K	26,600	4,665.00	124,089,000
藤田観光	4,500	3,145.00	14,152,500
K N T - C Tホールディングス	7,000	1,697.00	11,879,000
日本管財	12,000	2,099.00	25,188,000
トーカイ	10,800	2,250.00	24,300,000
白洋舎	1,200	3,240.00	3,888,000
セコム	119,100	7,979.00	950,298,900
日本システムウエア	3,800	2,656.00	10,092,800
セントラル警備保障	5,400	2,835.00	15,309,000
アイネス	14,600	1,109.00	16,191,400
丹青社	22,900	1,264.00	28,945,600
メイテック	13,100	6,160.00	80,696,000
T K C	10,700	4,165.00	44,565,500
富士ソフト	16,000	4,205.00	67,280,000
応用地質	12,200	1,564.00	19,080,800
船井総研ホールディングス	23,300	2,536.00	59,088,800
N S D	18,900	2,198.00	41,542,200
進学会ホールディングス	5,000	603.00	3,015,000
丸紅建材リース	11,000	234.00	2,574,000
オオバ	8,800	666.00	5,860,800
コナミホールディングス	47,100	5,360.00	252,456,000
いであ	2,200	1,045.00	2,299,000
学究社	3,100	1,783.00	5,527,300
ベネッセホールディングス	41,100	3,790.00	155,769,000
イオンディライト	13,800	3,935.00	54,303,000
ナック	7,600	953.00	7,242,800
福井コンピュータホールディングス	3,400	2,249.00	7,646,600
ニチイ学館	21,300	1,188.00	25,304,400
ダイセキ	18,800	3,525.00	66,270,000
ステップ	4,100	1,729.00	7,088,900
日鉄住金物産	9,000	5,790.00	52,110,000
泉州電業	3,800	3,425.00	13,015,000
元気寿司	2,900	2,883.00	8,360,700
トラスコ中山	24,100	2,700.00	65,070,000
ヤマダ電機	387,600	652.00	252,715,200
オートバックスセブン	46,000	2,014.00	92,644,000
モリト	9,300	1,006.00	9,355,800
アークランドサカモト	19,600	1,728.00	33,868,800
ニトリホールディングス	45,900	18,475.00	848,002,500
グルメ杵屋	8,000	1,158.00	9,264,000

愛眼	9,100	434.00	3,949,400	
ケーユーホールディングス	6,100	1,069.00	6,520,900	
吉野家ホールディングス	38,000	2,164.00	82,232,000	
加藤産業	18,100	3,770.00	68,237,000	
イノテック	10,000	1,239.00	12,390,000	
イエローハット	10,900	3,160.00	34,444,000	
松屋フーズ	5,600	3,860.00	21,616,000	
JBCホールディングス	9,100	1,069.00	9,727,900	
JKホールディングス	11,700	920.00	10,764,000	
サガミチェーン	15,500	1,346.00	20,863,000	
日伝	9,600	2,092.00	20,083,200	
関西スーパーマーケット	8,800	1,177.00	10,357,600	
ミロク情報サービス	10,200	3,285.00	33,507,000	
北沢産業	9,500	288.00	2,736,000	
杉本商事	6,300	1,835.00	11,560,500	
因幡電機産業	15,300	4,710.00	72,063,000	
王将フードサービス	8,500	5,370.00	45,645,000	
プレナス	12,900	2,116.00	27,296,400	
ミニストップ	8,600	2,216.00	19,057,600	
アークス	21,700	2,709.00	58,785,300	
バローホールディングス	26,900	3,000.00	80,700,000	
パイテックホールディングス	5,200	2,576.00	13,395,200	
東テク	3,800	2,449.00	9,306,200	
ミスミグループ本社	134,300	3,000.00	402,900,000	
藤久	900	1,504.00	1,353,600	
アルテック	9,900	409.00	4,049,100	
ベルク	5,100	5,910.00	30,141,000	
大庄	6,200	1,691.00	10,484,200	
タキヒヨー	3,700	2,347.00	8,683,900	
ファーストリテイリング	19,300	45,950.00	886,835,000	
ソフトバンクグループ	521,700	7,980.00	4,163,166,000	
蔵王産業	1,800	1,728.00	3,110,400	
スズケン	52,800	4,340.00	229,152,000	
サンドラッグ	49,000	5,120.00	250,880,000	
サックスパーホールディングス	10,900	1,163.00	12,676,700	
ジェコス	8,000	1,162.00	9,296,000	
ヤマザワ	2,300	1,752.00	4,029,600	
やまや	2,400	3,190.00	7,656,000	
ルネサスイーストン	10,700	666.00	7,126,200	
ベルーナ	28,400	1,255.00	35,642,000	
合計	142,725,612		289,561,896,277	

*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10月11日現在	平成30年4月11日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		2,710,036,455	3,394,154,584
国債証券		297,733,581,500	293,957,311,600
地方債証券		23,372,471,051	22,888,894,339
特殊債券		16,354,488,189	14,890,973,814
社債券		17,027,969,070	16,253,711,810
未収入金		1,631,865,000	-
未収利息		603,738,481	559,477,340
前払費用		6,261,326	16,854,005
流動資産合計		359,440,411,072	351,961,377,492
資産合計		359,440,411,072	351,961,377,492
負債の部			
流動負債			
未払金		-	2,202,588,500
未払解約金		215,089,000	296,057,000
流動負債合計		215,089,000	2,498,645,500
負債合計		215,089,000	2,498,645,500
純資産の部			
元本等			
元本	1	280,484,560,925	270,498,995,615
剰余金			
剰余金又は欠損金()		78,740,761,147	78,963,736,377
元本等合計		359,225,322,072	349,462,731,992
純資産合計		359,225,322,072	349,462,731,992
負債純資産合計		359,440,411,072	351,961,377,492

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10月11日現在	平成30年4月11日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額 同期中追加設定元本額 同期中一部解約元本額	286,760,415,729円 33,386,208,076円 39,662,062,880円	280,484,560,925円 28,260,515,152円 38,246,080,462円
元本の内訳		
ファンド名		
D I A M国内債券パッシブ・ファンド	13,850,588,414円	15,270,651,926円
M I T O ラップ型ファンド（安定型）	146,803,412円	133,392,035円
M I T O ラップ型ファンド（中立型）	128,382,880円	103,531,902円
M I T O ラップ型ファンド（積極型）	41,300,175円	32,375,641円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	356,888,516円	711,138,730円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	131,016,573円	214,285,439円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	27,659,746円	30,402,668円
たわらノーロード 国内債券	2,250,997,154円	3,342,170,664円
たわらノーロード 国内債券<ラップ向け>	755,274円	- 円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	10,176,610円	39,377,237円
たわらノーロード バランス（堅実型）	- 円	7,477,877円
たわらノーロード バランス（標準型）	- 円	12,443,765円
たわらノーロード バランス（積極型）	- 円	3,001,388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	1,145,317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	22,600,854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	14,185,243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	4,997,652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	1,928,074円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(保守型)	- 円	998,019円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定型)	- 円	535,415円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定成長型)	- 円	1,682,510円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(成長型)	- 円	520,352円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(積極型)	- 円	77,886円
D I A M国内債券インデックス ファンド< D C年金>	12,432,515,170円	12,607,657,323円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 1 安定型	5,319,882,179円	5,535,324,397円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 2 安定・成長型	7,599,189,375円	8,050,703,820円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 3 成長型	3,046,531,363円	3,240,617,007円
D I A M D C バランス3 0 インデックスファンド	1,771,287,916円	1,802,466,064円
D I A M D C バランス5 0 インデックスファンド	1,932,538,404円	1,980,109,879円
D I A M D C バランス7 0 インデックスファンド	288,293,436円	307,549,092円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型>	95,832,674円	92,933,808円
マネックス資産設計ファンド< 育成型>	2,274,223,236円	2,325,174,416円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	3,002,910円	4,808,536円
D I A M D C 8資産 balan スファンド(新興国1 0)	443,556,811円	474,981,130円
D I A M D C 8資産 balan スファンド(新興国2 0)	374,339,983円	442,458,328円
D I A M D C 8資産 balan スファンド(新興国3 0)	84,829,995円	104,118,291円
投資のソムリエ	2,972,951,972円	3,656,031,803円
クルーズコントロール	3,807,951,517円	444,343,713円
投資のソムリエ< D C年金>	159,148,685円	261,049,297円
D I A M 8資産バランスファ ンドN< D C年金>	1,638,056,047円	1,910,445,810円
D I A M D C バランス・F (成長型)	186,217,089円	240,000,998円
クルーズコントロール< D C年 金>	1,517,327円	165,091円
D I A Mコア資産設計ファンド (堅実型)	8,531,255円	1,123,528円
D I A Mコア資産設計ファンド (積極型)	22,914,437円	3,353,398円

投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	180,955,925円	480,733,487円
ダイナミック・ナビゲーション	524,853円	415,602円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	2,301,784,603円	8,080,627,460円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	393,977円	627,520円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	393,982円	456,411円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	705,062円	2,438,657円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	-円	1,175,568円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	-円	6,297,633円
みずほエマージング債券オープン	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)	24,403,666,103円	22,725,657,792円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	497,874,165円	480,025,025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)	369,244,962円	319,735,201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)	265,311,376円	238,173,147円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	91,759,912円	77,264,771円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	286,802,833円	217,543,884円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	106,170,065円	88,973,434円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	71,450,932円	55,403,177円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	119,547,737円	93,566,153円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	198,613,276円	170,277,657円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	6,456,932,013円	5,854,117,326円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	3,430,489,520円	3,096,423,321円

D I A Mバランスファンド50 V A (適格機関投資家限定)	6,177,788,428円	5,656,419,674円
D I A Mグローバル・アセッ ト・バランスV A (適格機関投 資家限定)	682,354,166円	614,350,089円
D I A Mグローバル・アセッ ト・バランスV A 2 (適格機関 投資家限定)	771,068,622円	426,305,760円
D I A M アクサ グローバ ル バランスファンド30V A (適格機関投資家限定)	4,008,052,847円	3,640,139,105円
D I A M世界アセットバランス ファンドV A (適格機関投資家 向け)	5,261,214,044円	2,665,344,766円
D I A Mグローバル 私募ファ ンド(適格機関投資家向け)	194,752,933円	194,752,933円
D I A M世界バランスファンド 55V A (適格機関投資家限 定)	1,060,517,386円	133,416,665円
D I A M世界バランスファンド 35V A (適格機関投資家限 定)	3,465,525,311円	1,122,556,207円
D I A M世界アセットバランス ファンド2V A (適格機関投資 家限定)	88,383,416,640円	83,372,825,575円
D I A M世界アセットバランス ファンド40V A (適格機関投 資家限定)	1,194,859,753円	1,116,861,192円
D I A M世界アセットバランス ファンド25V A (適格機関投 資家限定)	7,560,042,009円	7,146,512,954円
D I A M世界アセットバランス ファンド3V A (適格機関投資 家限定)	28,454,653,961円	27,319,006,488円
D I A Mバランス30V A (適 格機関投資家限定)	56,158,235円	81,853,560円
D I A Mバランス50V A (適 格機関投資家限定)	24,509,134円	1,395,995円
D I A Mバランス70V A (適 格機関投資家限定)	8,808,986円	7,548,153円
D I A M世界アセットバランス ファンド4V A (適格機関投資 家限定)	31,716,982,809円	30,406,243,697円
D I A M世界バランス25V A (適格機関投資家限定)	505,447,523円	481,766,349円
D I A M国内バランス30V A (適格機関投資家限定)	138,180,160円	134,196,130円
D I A Mバランス20V A (適 格機関投資家限定)	599,008,976円	533,089,734円
D I A Mバランス40V A (適 格機関投資家限定)	479,853円	705,557円
D I A Mバランス60V A (適 格機関投資家限定)	376,479円	376,555円

計	280,484,560,925円	270,498,995,615円
2 . 受益権の総数	280,484,560,925口	270,498,995,615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4月12日 至 平成29年10月11日	自 平成29年10月12日 至 平成30年4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10月11日現在	平成30年4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10月11日現在	平成30年4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	136,624,800	1,226,238,700
地方債証券	97,174,782	1,296,716
特殊債券	81,243,371	459,275
社債券	88,493,400	9,458,440
合計	130,286,753	1,215,942,819

（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10月11日まで及び平成30年2月15日から平成30年4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10月11日現在	平成30年4月11日現在
1口当たり純資産額	1.2807円	1.2919円
（1万口当たり純資産額）	（12,807円）	（12,919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4月11日現在

種 類	銘 柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
国債証券	377回 利付国庫債券(2年)	1,500,000,000	1,504,575,000	
	378回 利付国庫債券(2年)	1,000,000,000	1,003,260,000	
	379回 利付国庫債券(2年)	1,500,000,000	1,505,235,000	
	381回 利付国庫債券(2年)	1,000,000,000	1,003,920,000	
	386回 利付国庫債券(2年)	1,000,000,000	1,005,000,000	
	118回 利付国庫債券(5年)	3,700,000,000	3,715,355,000	
	120回 利付国庫債券(5年)	1,500,000,000	1,507,560,000	
	121回 利付国庫債券(5年)	2,000,000,000	2,007,200,000	
	122回 利付国庫債券(5年)	4,000,000,000	4,016,880,000	
	123回 利付国庫債券(5年)	3,000,000,000	3,014,250,000	
	124回 利付国庫債券(5年)	4,000,000,000	4,020,600,000	
	125回 利付国庫債券(5年)	3,000,000,000	3,017,220,000	
	126回 利付国庫債券(5年)	2,500,000,000	2,515,825,000	
	127回 利付国庫債券(5年)	3,000,000,000	3,020,760,000	
	128回 利付国庫債券(5年)	3,000,000,000	3,022,050,000	
	129回 利付国庫債券(5年)	3,500,000,000	3,527,790,000	
	130回 利付国庫債券(5年)	3,000,000,000	3,024,990,000	
	131回 利付国庫債券(5年)	2,020,000,000	2,037,957,800	
	132回 利付国庫債券(5年)	2,000,000,000	2,018,920,000	
	133回 利付国庫債券(5年)	2,860,000,000	2,888,714,400	
	134回 利付国庫債券(5年)	1,790,000,000	1,809,403,600	
	2回 利付国庫債券(40年)	600,000,000	841,692,000	
	3回 利付国庫債券(40年)	600,000,000	845,934,000	
	4回 利付国庫債券(40年)	670,000,000	947,855,700	
	5回 利付国庫債券(40年)	700,000,000	952,133,000	
	6回 利付国庫債券(40年)	700,000,000	933,163,000	
	7回 利付国庫債券(40年)	800,000,000	1,019,448,000	
	8回 利付国庫債券(40年)	900,000,000	1,063,044,000	
	9回 利付国庫債券(40年)	1,210,000,000	1,034,513,700	
	10回 利付国庫債券(40年)	1,140,000,000	1,154,979,600	
	301回 利付国庫債券(10年)	2,300,000,000	2,345,080,000	
	303回 利付国庫債券(10年)	1,300,000,000	1,329,133,000	
	305回 利付国庫債券(10年)	2,500,000,000	2,561,325,000	
	306回 利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,545,090,000	
	308回 利付国庫債券(10年)	800,000,000	825,256,000	
	309回 利付国庫債券(10年)	1,000,000,000	1,027,190,000	
	310回 利付国庫債券(10年)	2,300,000,000	2,363,848,000	
	312回 利付国庫債券(10年)	2,200,000,000	2,279,222,000	
	313回 利付国庫債券(10年)	1,790,000,000	1,865,663,300	
	315回 利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,564,080,000	

317回	利付国庫債券(10年)	1,000,000,000	1,042,660,000	
318回	利付国庫債券(10年)	1,000,000,000	1,039,200,000	
319回	利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,568,355,000	
320回	利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,562,805,000	
321回	利付国庫債券(10年)	2,500,000,000	2,611,175,000	
324回	利付国庫債券(10年)	2,000,000,000	2,077,840,000	
325回	利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,561,575,000	
326回	利付国庫債券(10年)	500,000,000	519,205,000	
327回	利付国庫債券(10年)	1,450,000,000	1,512,524,000	
328回	利付国庫債券(10年)	1,890,000,000	1,957,057,200	
329回	利付国庫債券(10年)	2,270,000,000	2,377,734,200	
330回	利付国庫債券(10年)	1,200,000,000	1,259,388,000	
332回	利付国庫債券(10年)	2,210,000,000	2,298,488,400	
333回	利付国庫債券(10年)	2,000,000,000	2,082,940,000	
334回	利付国庫債券(10年)	2,100,000,000	2,190,132,000	
335回	利付国庫債券(10年)	2,000,000,000	2,075,740,000	
336回	利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,558,485,000	
337回	利付国庫債券(10年)	1,300,000,000	1,333,202,000	
338回	利付国庫債券(10年)	2,000,000,000	2,066,200,000	
339回	利付国庫債券(10年)	2,250,000,000	2,326,365,000	
340回	利付国庫債券(10年)	2,500,000,000	2,585,900,000	
341回	利付国庫債券(10年)	3,060,000,000	3,143,844,000	
342回	利付国庫債券(10年)	3,000,000,000	3,035,820,000	
343回	利付国庫債券(10年)	3,000,000,000	3,034,470,000	
344回	利付国庫債券(10年)	3,500,000,000	3,538,465,000	
345回	利付国庫債券(10年)	3,500,000,000	3,536,540,000	
346回	利付国庫債券(10年)	3,000,000,000	3,029,490,000	
347回	利付国庫債券(10年)	3,500,000,000	3,532,130,000	
348回	利付国庫債券(10年)	3,360,000,000	3,390,105,600	
349回	利付国庫債券(10年)	1,910,000,000	1,925,700,200	
350回	利付国庫債券(10年)	350,000,000	352,600,500	
1回	利付国庫債券(30年)	100,000,000	130,830,000	
2回	利付国庫債券(30年)	100,000,000	126,952,000	
3回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	252,306,000	
4回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	269,042,000	
5回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	252,842,000	
6回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	259,480,000	
7回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	386,931,000	
8回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	245,078,000	
11回	利付国庫債券(30年)	400,000,000	485,568,000	
12回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	382,782,000	
13回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	378,678,000	
14回	利付国庫債券(30年)	500,000,000	663,205,000	
15回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	268,958,000	
16回	利付国庫債券(30年)	400,000,000	539,124,000	
17回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	266,958,000	
18回	利付国庫債券(30年)	820,000,000	1,082,547,600	
19回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	264,508,000	
20回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	407,346,000	
21回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	397,440,000	

22回	利付国庫債券(30年)	470,000,000	639,980,200	
23回	利付国庫債券(30年)	600,000,000	818,460,000	
24回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	409,941,000	
25回	利付国庫債券(30年)	400,000,000	533,072,000	
26回	利付国庫債券(30年)	700,000,000	946,414,000	
27回	利付国庫債券(30年)	700,000,000	961,660,000	
28回	利付国庫債券(30年)	900,000,000	1,240,911,000	
29回	利付国庫債券(30年)	900,000,000	1,227,330,000	
30回	利付国庫債券(30年)	900,000,000	1,213,893,000	
31回	利付国庫債券(30年)	900,000,000	1,199,727,000	
32回	利付国庫債券(30年)	1,100,000,000	1,492,843,000	
33回	利付国庫債券(30年)	1,300,000,000	1,688,297,000	
34回	利付国庫債券(30年)	1,200,000,000	1,613,088,000	
35回	利付国庫債券(30年)	1,300,000,000	1,696,643,000	
36回	利付国庫債券(30年)	1,300,000,000	1,702,272,000	
37回	利付国庫債券(30年)	1,400,000,000	1,807,148,000	
38回	利付国庫債券(30年)	900,000,000	1,144,170,000	
39回	利付国庫債券(30年)	800,000,000	1,036,616,000	
40回	利付国庫債券(30年)	610,000,000	776,688,600	
41回	利付国庫債券(30年)	610,000,000	762,737,900	
42回	利付国庫債券(30年)	800,000,000	1,000,856,000	
43回	利付国庫債券(30年)	800,000,000	1,001,408,000	
44回	利付国庫債券(30年)	800,000,000	1,001,944,000	
45回	利付国庫債券(30年)	750,000,000	903,195,000	
46回	利付国庫債券(30年)	900,000,000	1,084,041,000	
47回	利付国庫債券(30年)	1,000,000,000	1,229,420,000	
48回	利付国庫債券(30年)	1,100,000,000	1,298,143,000	
49回	利付国庫債券(30年)	990,000,000	1,168,328,700	
50回	利付国庫債券(30年)	1,000,000,000	1,028,170,000	
51回	利付国庫債券(30年)	1,100,000,000	989,428,000	
52回	利付国庫債券(30年)	1,100,000,000	1,044,098,000	
53回	利付国庫債券(30年)	820,000,000	798,499,600	
54回	利付国庫債券(30年)	900,000,000	921,654,000	
55回	利付国庫債券(30年)	980,000,000	1,002,530,200	
56回	利付国庫債券(30年)	900,000,000	919,719,000	
57回	利付国庫債券(30年)	930,000,000	949,353,300	
58回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	305,910,000	
43回	利付国庫債券(20年)	860,000,000	897,805,600	
45回	利付国庫債券(20年)	900,000,000	944,514,000	
46回	利付国庫債券(20年)	500,000,000	525,720,000	
47回	利付国庫債券(20年)	950,000,000	1,004,321,000	
48回	利付国庫債券(20年)	500,000,000	535,575,000	
50回	利付国庫債券(20年)	780,000,000	826,722,000	
51回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	641,028,000	
52回	利付国庫債券(20年)	550,000,000	592,394,000	
54回	利付国庫債券(20年)	700,000,000	760,151,000	
55回	利付国庫債券(20年)	810,000,000	877,926,600	
57回	利付国庫債券(20年)	1,130,000,000	1,225,778,800	
58回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	653,934,000	
60回	利付国庫債券(20年)	590,000,000	632,126,000	

6 1 回	利付国庫債券(20年)	800,000,000	844,264,000	
6 2 回	利付国庫債券(20年)	800,000,000	837,968,000	
6 4 回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	665,616,000	
6 5 回	利付国庫債券(20年)	1,100,000,000	1,225,488,000	
6 7 回	利付国庫債券(20年)	870,000,000	973,286,400	
7 0 回	利付国庫債券(20年)	750,000,000	865,905,000	
7 2 回	利付国庫債券(20年)	1,250,000,000	1,426,350,000	
7 3 回	利付国庫債券(20年)	790,000,000	900,173,400	
7 5 回	利付国庫債券(20年)	870,000,000	1,001,544,000	
7 8 回	利付国庫債券(20年)	890,000,000	1,016,264,300	
8 1 回	利付国庫債券(20年)	1,030,000,000	1,188,084,400	
8 3 回	利付国庫債券(20年)	780,000,000	909,417,600	
8 5 回	利付国庫債券(20年)	1,040,000,000	1,217,621,600	
8 8 回	利付国庫債券(20年)	1,200,000,000	1,430,028,000	
9 0 回	利付国庫債券(20年)	1,200,000,000	1,425,780,000	
9 2 回	利付国庫債券(20年)	1,300,000,000	1,539,174,000	
9 3 回	利付国庫債券(20年)	700,000,000	825,447,000	
9 4 回	利付国庫債券(20年)	800,000,000	950,512,000	
9 5 回	利付国庫債券(20年)	1,200,000,000	1,452,864,000	
9 7 回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,689,100,000	
9 9 回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,682,366,000	
1 0 0 回	利付国庫債券(20年)	1,300,000,000	1,580,189,000	
1 0 2 回	利付国庫債券(20年)	1,060,000,000	1,314,453,000	
1 0 5 回	利付国庫債券(20年)	1,300,000,000	1,577,550,000	
1 0 7 回	利付国庫債券(20年)	1,500,000,000	1,825,920,000	
1 0 9 回	利付国庫債券(20年)	1,320,000,000	1,582,970,400	
1 1 1 回	利付国庫債券(20年)	1,170,000,000	1,445,804,100	
1 1 2 回	利付国庫債券(20年)	400,000,000	489,852,000	
1 1 3 回	利付国庫債券(20年)	1,500,000,000	1,842,390,000	
1 1 4 回	利付国庫債券(20年)	1,500,000,000	1,847,640,000	
1 1 6 回	利付国庫債券(20年)	1,140,000,000	1,421,488,800	
1 1 7 回	利付国庫債券(20年)	550,000,000	679,327,000	
1 1 8 回	利付国庫債券(20年)	1,000,000,000	1,226,530,000	
1 1 9 回	利付国庫債券(20年)	900,000,000	1,082,250,000	
1 2 1 回	利付国庫債券(20年)	1,500,000,000	1,826,100,000	
1 2 3 回	利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	2,116,687,000	
1 2 5 回	利付国庫債券(20年)	970,000,000	1,223,073,000	
1 2 8 回	利付国庫債券(20年)	700,000,000	857,843,000	
1 2 9 回	利付国庫債券(20年)	700,000,000	848,792,000	
1 3 0 回	利付国庫債券(20年)	1,500,000,000	1,822,425,000	
1 3 2 回	利付国庫債券(20年)	1,260,000,000	1,516,851,000	
1 3 3 回	利付国庫債券(20年)	510,000,000	620,782,200	
1 3 4 回	利付国庫債券(20年)	900,000,000	1,096,695,000	
1 3 5 回	利付国庫債券(20年)	800,000,000	963,984,000	
1 3 7 回	利付国庫債券(20年)	1,130,000,000	1,363,819,600	
1 3 8 回	利付国庫債券(20年)	340,000,000	400,972,200	
1 3 9 回	利付国庫債券(20年)	100,000,000	119,312,000	
1 4 0 回	利付国庫債券(20年)	1,600,000,000	1,935,424,000	
1 4 1 回	利付国庫債券(20年)	1,490,000,000	1,803,749,300	
1 4 2 回	利付国庫債券(20年)	250,000,000	306,417,500	

143回	利付国庫債券(20年)	1,270,000,000	1,521,206,000	
144回	利付国庫債券(20年)	260,000,000	307,673,600	
145回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,699,488,000	
146回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,700,482,000	
147回	利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	2,041,819,000	
148回	利付国庫債券(20年)	1,300,000,000	1,543,100,000	
149回	利付国庫債券(20年)	1,670,000,000	1,982,406,900	
150回	利付国庫債券(20年)	1,500,000,000	1,757,100,000	
151回	利付国庫債券(20年)	1,800,000,000	2,050,920,000	
152回	利付国庫債券(20年)	1,300,000,000	1,481,389,000	
153回	利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	1,964,979,000	
154回	利付国庫債券(20年)	1,500,000,000	1,708,140,000	
155回	利付国庫債券(20年)	1,600,000,000	1,765,872,000	
156回	利付国庫債券(20年)	1,500,000,000	1,498,740,000	
157回	利付国庫債券(20年)	1,300,000,000	1,250,613,000	
158回	利付国庫債券(20年)	1,500,000,000	1,519,230,000	
159回	利付国庫債券(20年)	1,420,000,000	1,460,484,200	
160回	利付国庫債券(20年)	1,300,000,000	1,357,889,000	
161回	利付国庫債券(20年)	1,140,000,000	1,168,135,200	
162回	利付国庫債券(20年)	1,200,000,000	1,226,688,000	
163回	利付国庫債券(20年)	1,210,000,000	1,234,998,600	
164回	利付国庫債券(20年)	360,000,000	360,000,000	
国債証券 合計		267,270,000,000	293,957,311,600	
地方債証券	680回 東京都公募公債	200,000,000	205,266,000	
	685回 東京都公募公債	500,000,000	512,030,000	
	688回 東京都公募公債	200,000,000	204,436,000	
	697回 東京都公募公債	500,000,000	517,190,000	
	701回 東京都公募公債	700,000,000	723,072,000	
	708回 東京都公募公債	500,000,000	517,990,000	
	720回 東京都公募公債	300,000,000	313,062,000	
	726回 東京都公募公債	400,000,000	415,912,000	
	5回 東京都公募公債 20年	100,000,000	114,191,000	
	9回 東京都公募公債 20年	200,000,000	238,296,000	
	10回 東京都公募公債 20年	300,000,000	356,118,000	
	21年度6回 北海道公募公債	200,000,000	204,332,000	
	22年度12回 北海道公募公債	200,000,000	207,050,000	
	166回 神奈川県公募公債	300,000,000	305,757,000	
	194回 神奈川県公募公債	300,000,000	310,698,000	
	208回 神奈川県公募公債	300,000,000	309,276,000	
	336回 大阪府公募公債	200,000,000	205,622,000	
	345回 大阪府公募公債	300,000,000	309,978,000	
	356回 大阪府公募公債	200,000,000	207,638,000	
	364回 大阪府公募公債	300,000,000	310,173,000	
	374回 大阪府公募公債	300,000,000	314,235,000	
	26年度11回 京都府公募公債	350,000,000	359,639,000	
	26年度17回 兵庫県公募公債	200,000,000	205,250,000	
	1回 兵庫県公募公債(12年)	300,000,000	319,287,000	
	21年度5回 静岡県公募公債	197,000,000	200,951,820	
	22年度8回 静岡県公募公債	200,000,000	204,880,000	
	23年度9回 静岡県公募公債	200,000,000	207,350,000	

1回 静岡県公募公債 20年	100,000,000	115,531,000	
22年度6回 愛知県公募公債	200,000,000	205,280,000	
23年度20回 愛知県公募公債	500,000,000	520,825,000	
25年度4回 愛知県公募公債	300,000,000	312,702,000	
22年度1回 広島県公募公債	200,000,000	205,694,000	
21年度4回 埼玉県公募公債	200,000,000	203,712,000	
23年度2回 埼玉県公募公債	200,000,000	207,232,000	
26年度5回 埼玉県公募公債	400,000,000	414,032,000	
21年度3回 福岡県公募公債	200,000,000	204,186,000	
25年度11回 福岡県公募公債	200,000,000	207,610,000	
21年度6回 千葉県公募公債	200,000,000	204,020,000	
24年度7回 千葉県公募公債	300,000,000	309,993,000	
25年度5回 千葉県公募公債	200,000,000	208,632,000	
80回 共同発行市場公募地方債	200,000,000	204,902,000	
94回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,375,000	
99回 共同発行市場公募地方債	700,000,000	725,557,000	
106回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	310,680,000	
109回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	520,565,000	
111回 共同発行市場公募地方債	700,000,000	725,256,000	
119回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	518,735,000	
121回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	513,580,000	
126回 共同発行市場公募地方債	793,900,000	827,410,519	
127回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	517,830,000	
128回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	310,431,000	
137回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	516,095,000	
139回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	515,795,000	
142回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	509,395,000	
144回 共同発行市場公募地方債	400,000,000	411,184,000	
146回 共同発行市場公募地方債	400,000,000	413,664,000	
148回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	517,130,000	
166回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	501,980,000	
488回 名古屋市公募公債 10年	450,000,000	465,538,500	
4回 京都市公募公債 20年	100,000,000	120,012,000	
22年度3回 横浜市公募公債	200,000,000	205,546,000	
22年度5回 横浜市公募公債	200,000,000	206,586,000	
23年度4回 横浜市公募公債	450,000,000	466,375,500	
25年度2回 横浜市公募公債	400,000,000	418,012,000	
25年度4回 札幌市公募公債	200,000,000	207,982,000	
2回 川崎市公募公債 15年	100,000,000	103,513,000	
21年度2回 北九州市公募公債	200,000,000	204,530,000	
23年度1回 千葉市公募公債	200,000,000	208,106,000	
地方債証券 合計	22,040,900,000	22,888,894,339	
特殊債券			
26回 高速道路機構債	200,000,000	273,892,000	
96回 高速道路機構債	700,000,000	723,023,000	
116回 高速道路機構債	100,000,000	103,507,000	
9回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	105,741,000	
18回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	322,788,000	

8 2 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	101,869,000	
8 9 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	305,916,000	
1 2 1 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	594,345,000	
1 4 9 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	400,000,000	415,156,000	
1 8 0 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	1,000,000,000	1,036,560,000	
1 8 9 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	514,425,000	
1 9 3 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	523,695,000	
1 9 5 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	330,000,000	346,311,900	
2 4 1 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	515,110,000	
3 0 9 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	800,000,000	803,952,000	
2 8 回 日本道路・機構承継債	400,000,000	542,684,000	
3 回 政保地方公共団体金融機構債券	101,000,000	103,096,760	
5 回 地方公共団体金融機構債券	500,000,000	510,560,000	
8 回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	307,152,000	
1 0 回 政保地方公共団体金融機構債券	500,000,000	512,875,000	
1 5 回 政保地方公共団体金融機構債券	200,000,000	204,876,000	
2 0 回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	310,344,000	
2 4 回 地方公共団体金融機構債券	300,000,000	310,899,000	
3 6 回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	311,607,000	
4 4 回 政保地方公共団体金融機構債券	400,000,000	416,632,000	
5 0 回 政保地方公共団体金融機構債券	500,000,000	524,495,000	
5 6 回 政保地方公共団体金融機構債券	542,000,000	565,707,080	
6 4 回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	310,293,000	
3 7 回 住宅金融支援機構債券	300,000,000	305,952,000	
3 9 回 住宅金融支援機構債券	200,000,000	241,596,000	
6 回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	47,424,000	50,215,850	
8 回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	33,374,000	35,342,398	
9 回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	50,010,000	52,982,594	
2 回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	52,866,000	56,355,684	
1 3 回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	20,371,000	21,087,244	
1 4 回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	102,715,000	105,743,038	
4 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	31,134,000	31,354,428	
4 3 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	17,826,000	18,964,368	
4 4 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	68,084,000	72,341,292	
5 1 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	50,484,000	53,384,305	
1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,310,000	90,814,518	
2 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	176,220,000	189,369,536	
3 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	309,144,000	328,205,819	

	い第769号 利付商工債	200,000,000	200,374,000	
	い第779号 利付商工債	200,000,000	200,406,000	
	302回 利附信金中金債	300,000,000	300,861,000	
	325回 利附信金中金債	400,000,000	399,112,000	
	55回 鉄道建設運輸施設債	500,000,000	519,000,000	
特殊債券	合計	14,118,962,000	14,890,973,814	
社債券	337回 東京交通債	200,000,000	212,816,000	
	27回 ラボバンク・ネダーランド円貨社債	200,000,000	200,946,000	
	22回 中日本高速道路債券	300,000,000	307,242,000	
	7回 キリンホールディングス社債	100,000,000	102,411,000	
	9回 日本たばこ産業社債	200,000,000	200,640,000	
	41回 住友化学社債	100,000,000	102,337,000	
	19回 三菱ケミカルホールディングス社債	100,000,000	101,486,000	
	6回 JXホールディングス社債	100,000,000	104,559,000	
	8回 プリヂストン社債	200,000,000	200,592,000	
	23回 ジェイ エフ イー ホールディングス社債	100,000,000	99,776,000	
	30回 豊田自動織機社債	200,000,000	199,810,000	
	12回 パナソニック社債	200,000,000	201,186,000	
	13回 パナソニック社債	100,000,000	101,654,000	
	56回 日産自動車社債	100,000,000	100,838,000	
	14回 トヨタ自動車社債	200,000,000	208,380,000	
	16回 トヨタ自動車社債	200,000,000	205,886,000	
	94回 丸紅社債	100,000,000	104,172,000	
	45回 住友商事社債	100,000,000	103,496,000	
	47回 住友商事社債	100,000,000	103,245,000	
	48回 クレディセゾン社債	100,000,000	103,516,000	
	7回 みずほコーポレート銀行劣後社債	100,000,000	102,721,000	
	57回 東京三菱銀行社債	200,000,000	219,090,000	
	7回 東京三菱銀行劣後社債	200,000,000	206,724,000	
	25回 三菱東京UFJ銀行劣後社債	200,000,000	205,904,000	
	28回 三菱東京UFJ銀行劣後社債	200,000,000	207,714,000	
	32回 三菱東京UFJ銀行劣後社債	300,000,000	313,185,000	
	4回 りそな銀行劣後社債	100,000,000	103,111,000	
	6回 りそな銀行劣後社債	100,000,000	103,646,000	
	7回 三菱UFJ信託銀行劣後債	200,000,000	206,130,000	
	9回 三菱UFJ信託銀行劣後債	100,000,000	104,418,000	
	12回 住友信託銀行劣後債	100,000,000	103,084,000	
	10回 三井住友信託銀行社債	200,000,000	204,870,000	
	10回 セブン銀行社債	100,000,000	103,312,000	
	20回 三井住友銀行劣後社債	200,000,000	205,360,000	
	22回 三井住友銀行劣後社債	200,000,000	206,212,000	
	23回 三井住友銀行劣後社債	400,000,000	415,448,000	
	14回 みずほ銀行劣後特約付社債	200,000,000	205,882,000	
	15回 トヨタファイナンス社債	200,000,000	207,938,000	
	47回 日立キャピタル社債	200,000,000	205,958,000	
	164回 オリックス社債	100,000,000	101,341,000	
	14回 大和証券グループ本社社債	100,000,000	102,281,000	

26回	野村ホールディングス社債	100,000,000	103,442,000	
42回	野村ホールディングス社債	200,000,000	204,754,000	
46回	野村ホールディングス社債	200,000,000	200,836,000	
38回	三井不動産社債	200,000,000	205,322,000	
72回	三菱地所社債	100,000,000	113,102,000	
96回	三菱地所社債	200,000,000	203,808,000	
87回	住友不動産社債	100,000,000	101,247,000	
15回	東日本旅客鉄道社債	300,000,000	318,714,000	
19回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	108,895,000	
21回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	108,667,000	
39回	東日本旅客鉄道社債	300,000,000	340,911,000	
42回	東日本旅客鉄道社債	200,000,000	229,094,000	
9回	西日本旅客鉄道社債	200,000,000	217,510,000	
10回	西日本旅客鉄道社債	300,000,000	331,509,000	
5回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	104,662,000	
6回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	108,948,000	
11回	東海旅客鉄道社債	300,000,000	315,081,000	
13回	東海旅客鉄道社債	200,000,000	221,618,000	
14回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	112,327,000	
4回	東京地下鉄社債	120,000,000	141,529,200	
60回	日本電信電話社債	300,000,000	309,480,000	
496回	中部電力社債	500,000,000	513,725,000	
518回	中部電力社債	200,000,000	200,236,000	
377回	中国電力社債	400,000,000	419,356,000	
379回	中国電力社債	300,000,000	304,674,000	
260回	北陸電力社債	100,000,000	104,818,000	
301回	北陸電力社債	100,000,000	104,824,000	
307回	北陸電力社債	100,000,000	106,003,000	
471回	東北電力社債	400,000,000	420,776,000	
473回	東北電力社債	300,000,000	304,506,000	
253回	四国電力社債	200,000,000	208,394,000	
423回	九州電力社債	200,000,000	202,720,000	
424回	九州電力社債	200,000,000	210,840,000	
426回	九州電力社債	400,000,000	418,352,000	
320回	北海道電力社債	200,000,000	202,980,000	
321回	北海道電力社債	161,000,000	167,119,610	
340回	北海道電力社債	300,000,000	301,962,000	
13回	電源開発社債	200,000,000	224,848,000	
38回	電源開発社債	300,000,000	312,558,000	
23回	東京瓦斯社債	300,000,000	314,097,000	
18回	大阪ガス社債	100,000,000	106,474,000	
27回	NTTデータ社債	100,000,000	103,676,000	
社債券	合計	15,581,000,000	16,253,711,810	
合計		319,010,862,000	347,990,891,563	

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10月11日現在	平成30年4月11日現在
資産の部			
流動資産			
預金		5,666,300,517	3,703,959,240
コール・ローン		184,929,128	118,630,552
株式		280,954,287,755	283,677,819,387
投資信託受益証券		793,834,421	836,893,845
投資証券		6,501,509,355	6,016,510,805
派生商品評価勘定		187,700,856	92,258,435
未収入金		8,497,457	2,633,604
未収配当金		309,997,278	463,874,593
差入委託証拠金		1,592,138,273	2,218,767,080
流動資産合計		296,199,195,040	297,131,347,541
資産合計		296,199,195,040	297,131,347,541
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		-	6,535,368
未払金		53,367,297	64,646,890
未払解約金		163,168,000	123,322,000
流動負債合計		216,535,297	194,504,258
負債合計		216,535,297	194,504,258
純資産の部			
元本等			
元本	1	88,520,951,451	89,487,416,345
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		207,461,708,292	207,449,426,938
元本等合計		295,982,659,743	296,936,843,283
純資産合計		295,982,659,743	296,936,843,283
負債純資産合計		296,199,195,040	297,131,347,541

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	平成29年10月11日現在	平成30年4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	90,869,820,134円	88,520,951,451円
同期中追加設定元本額	10,287,305,956円	14,261,302,685円
同期中一部解約元本額	12,636,174,639円	13,294,837,791円
元本の内訳 ファンド名		

D I A M外国株式パッシブ・ ファンド	1,501,399,246円	1,910,656,569円
M I T O ラップ型ファンド (安定型)	3,079,710円	2,858,059円
M I T O ラップ型ファンド (中立型)	7,528,234円	8,377,043円
M I T O ラップ型ファンド (積極型)	20,465,957円	16,819,159円
グローバル8資産ラップファン ド(安定型)	7,484,878円	15,228,505円
グローバル8資産ラップファン ド(中立型)	7,682,961円	17,580,421円
グローバル8資産ラップファン ド(積極型)	13,702,079円	15,817,157円
たわらノーロード 先進国株式	4,455,372,998円	6,210,258,461円
たわらノーロード 先進国株式 <ラップ向け>	425,029円	424,744円
たわらノーロード 先進国株式 <為替ヘッジあり>	339,594,736円	639,375,494円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	4,096,161円	16,286,862円
たわらノーロード バランス (堅実型)	- 円	995,457円
たわらノーロード バランス (標準型)	- 円	7,868,500円
たわらノーロード バランス (積極型)	- 円	18,783,300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	39,311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	4,702,845円
たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(安定成長 型)	- 円	6,274,398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	5,346,350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	12,203,677円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(保守型)	- 円	6,504円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定型)	- 円	53,876円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定成長型)	- 円	397,006円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(成長型)	- 円	413,060円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(積極型)	- 円	1,488,670円
D I A M外国株式インデックス ファンド<D C年金>	36,234,304,898円	37,970,672,107円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 1 安定型	163,816,147円	168,107,521円

DIAMバランス・ファンド< DC年金> 2安定・成長型	857,026,223円	862,558,503円
DIAMバランス・ファンド< DC年金> 3成長型	1,040,064,596円	1,070,957,443円
DIAM DC バランス30 インデックスファンド	135,530,066円	131,593,343円
DIAM DC バランス50 インデックスファンド	389,058,681円	385,116,497円
DIAM DC バランス70 インデックスファンド	330,441,705円	334,545,542円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型>	35,350,510円	31,943,791円
マネックス資産設計ファンド< 育成型>	831,794,009円	799,032,499円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	200,977,464円	206,676,091円
DIAM DC 8資産バラン スファンド(新興国10)	30,287,665円	33,634,872円
DIAM DC 8資産バラン スファンド(新興国20)	70,337,364円	86,430,217円
DIAM DC 8資産バラン スファンド(新興国30)	131,698,963円	168,111,819円
投資のソムリエ	3,198,792,059円	1,184,065,467円
クルーズコントロール	603,933,786円	81,781,664円
投資のソムリエ< DC年金>	171,372,681円	84,376,693円
DIAM 8資産バラン スファンドN< DC年金>	112,289,309円	135,297,788円
DIAM DC バランス・F (成長型)	61,949,596円	82,768,903円
クルーズコントロール< DC年 金>	240,625円	30,467円
DIAMコア資産設計ファンド (堅実型)	3,383,148円	402,135円
DIAMコア資産設計ファンド (積極型)	9,098,008円	1,245,127円
投資のソムリエ< DC年金>リ スク抑制型	30,709,737円	27,919,504円
ダイナミック・ナビゲーション リスク抑制世界8資産バラン スファンド	1,646,742円	765,335円
ワールドアセットバランス(基 本コース)	392,529,721円	458,443,471円
ワールドアセットバランス(リ スク抑制コース)	376,390,776円	679,300,871円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2045)	1,182,935,075円	2,591,259,411円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2055)	455,321円	355,096円
リスク抑制世界8資産バラン スファンド(DC)	455,344円	259,278円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2035)	120,612円	138,358円
	- 円	477,198円

4資産分散投資・スタンダード <DC年金>	- 円	480,719円
D I A M外国株式インデックス ファンドV A (適格機関投資家 専用)	112,421,369円	92,651,450円
D I A M外国株式パッシブ私募 ファンド(適格機関投資家向 け)	2,964,558,782円	2,893,521,103円
D I A M先進国株式パッシブ ファンド(適格機関投資家限 定)	161,291,968円	161,127,439円
外国株式パッシブ・ファンド2 (適格機関投資家限定)	171,807,118円	208,736,068円
D I A Mワールドバランス25 V A (適格機関投資家限定)	25,138,484円	24,820,525円
D I A Mグローバル・バランス ファンド25V A (適格機関投 資家限定)	119,155,473円	105,705,416円
D I A Mグローバル・バランス ファンド50V A (適格機関投 資家限定)	256,974,145円	236,509,944円
D I A M国際分散バランスファ ンド30V A (適格機関投資家 限定)	15,220,426円	13,138,864円
D I A M国際分散バランスファ ンド50V A (適格機関投資家 限定)	111,060,683円	86,357,971円
D I A M国内重視バランスファ ンド30V A (適格機関投資家 限定)	8,214,224円	7,056,458円
D I A M国内重視バランスファ ンド50V A (適格機関投資家 限定)	13,833,399円	10,993,104円
D I A M世界バランスファンド 40V A (適格機関投資家限 定)	30,862,374円	24,764,555円
D I A M世界バランスファンド 50V A (適格機関投資家限 定)	76,913,785円	67,594,843円
D I A Mバランスファンド25 V A (適格機関投資家限定)	624,564,051円	580,688,566円
D I A Mバランスファンド3 7.5V A (適格機関投資家限 定)	774,639,781円	717,031,720円
D I A Mバランスファンド50 V A (適格機関投資家限定)	2,392,016,450円	2,245,961,784円
D I A Mグローバル・アセッ ト・バランスV A (適格機関投 資家限定)	882,809,453円	809,803,654円
D I A Mグローバル・アセッ ト・バランスV A 2 (適格機関 投資家限定)	358,382,128円	202,250,282円

D I A M アクサ グローバル バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	1,034,110,504円	963,313,254円
D I A M世界アセットバランス ファンドVA(適格機関投資家 向け)	678,458,956円	353,184,647円
D I A Mグローバル 私募ファ ンド(適格機関投資家向け)	2,754,975円	2,754,975円
D I A M世界バランスファンド 55VA(適格機関投資家限 定)	614,773,286円	79,200,060円
D I A M世界バランスファンド 35VA(適格機関投資家限 定)	665,587,766円	222,757,374円
D I A M世界アセットバランス ファンド2VA(適格機関投資 家限定)	8,551,988,933円	8,270,191,957円
D I A M世界アセットバランス ファンド40VA(適格機関投 資家限定)	462,645,563円	443,354,165円
D I A M世界アセットバランス ファンド25VA(適格機関投 資家限定)	1,463,025,962円	1,417,828,929円
D I A M世界アセットバランス ファンド3VA(適格機関投資 家限定)	5,510,555,518円	5,420,120,223円
D I A Mバランス30VA(適 格機関投資家限定)	13,592,785円	20,095,866円
D I A Mバランス50VA(適 格機関投資家限定)	15,185,783円	896,839円
D I A Mバランス70VA(適 格機関投資家限定)	12,516,619円	10,943,816円
D I A M世界アセットバランス ファンド4VA(適格機関投資 家限定)	7,368,073,345円	7,239,924,939円
D I A Mバランス20VA(適 格機関投資家限定)	69,571,913円	62,627,089円
D I A Mバランス40VA(適 格機関投資家限定)	159,561円	238,391円
D I A Mバランス60VA(適 格機関投資家限定)	263,069円	266,917円
計	88,520,951,451円	89,487,416,345円
2 . 受益権の総数	88,520,951,451口	89,487,416,345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4月12日 至 平成29年10月11日	自 平成29年10月12日 至 平成30年4月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。</p> <p>また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。</p>	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成29年10月11日現在	平成30年4月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成29年10月11日現在	平成30年4月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
株式	20,953,315,359	2,449,182,350
投資信託受益証券	10,158,419	29,137,034
投資証券	230,714,043	81,195,533
合計	21,173,870,983	2,338,849,783

(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10月11日まで及び平成30年2月16日から平成30年4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10月11日 現在				平成30年4月11日 現在			
	契約額等	うち 1年超	時価	評価損益	契約額等	うち 1年超	時価	評価損益
	(円)		(円)	(円)	(円)		(円)	(円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	228,870,550	-	228,853,200	17,350	36,461,681	-	36,687,280	225,599
アメリカ・ドル	150,483,340	-	150,468,600	14,740	-	-	-	-
オーストラリア・ドル	10,511,760	-	10,510,800	960	-	-	-	-
カナダ・ドル	10,778,760	-	10,778,400	360	672,248	-	679,920	7,672
ユーロ	57,096,690	-	57,095,400	1,290	35,789,433	-	36,007,360	217,927
買 建	-	-	-	-	1,303,531,741	-	1,303,461,030	70,711
アメリカ・ドル	-	-	-	-	869,142,440	-	869,061,280	81,160
イギリス・ボンド	-	-	-	-	100,960,109	-	100,980,250	20,141
オーストラリア・ドル	-	-	-	-	35,493,081	-	35,496,510	3,429
カナダ・ドル	-	-	-	-	41,903,521	-	41,900,070	3,451
ユーロ	-	-	-	-	256,032,590	-	256,022,920	9,670
合計	228,870,550	-	228,853,200	17,350	1,339,993,422	-	1,340,148,310	296,310

(注) 時価の算定方法

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

株式関連

種類	平成29年10月11日 現在				平成30年4月11日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								
先物取引								
買 建	7,218,305,255	-	7,405,988,761	187,683,506	7,389,029,845	-	7,475,049,222	86,019,377
合計	7,218,305,255	-	7,405,988,761	187,683,506	7,389,029,845	-	7,475,049,222	86,019,377

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成29年10月11日現在	平成30年4月11日現在
1口当たり純資産額	3.3436円	3.3182円
(1万口当たり純資産額)	(33,436円)	(33,182円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

平成30年4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	30,466	1,436.220	43,755,878.520	
	ABBOTT LABORATORIES	129,962	59.140	7,685,952.680	
	AES CORP	45,579	11.430	520,967.970	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	64,775	155.390	10,065,387.250	
	ADVANCED MICRO DEVICES	59,529	9.980	594,099.420	
	ADOBE SYSTEMS INC	37,176	224.530	8,347,127.280	
	CHUBB LTD	34,634	135.180	4,681,824.120	
	AGCO CORP	5,610	65.430	367,062.300	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	17,580	163.190	2,868,880.200	
	ALLEGHANY CORP	1,054	591.240	623,166.960	
	RALPH LAUREN CORP	3,497	115.050	402,329.850	
	ALLSTATE CORP	25,754	97.120	2,501,228.480	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	53,723	145.630	7,823,680.490	
	AMGEN INC	51,600	173.130	8,933,508.000	
	HESS CORP	20,421	53.690	1,096,403.490	
	AMERICAN EXPRESS CO	53,581	93.000	4,983,033.000	
	AMERICAN ELECTRIC POWER	34,859	67.870	2,365,880.330	
	AFLAC INC	56,436	44.380	2,504,629.680	
	AMERICAN INTL GROUP	66,725	53.520	3,571,122.000	
	AMERCO	551	342.930	188,954.430	
	ANALOG DEVICES	27,711	90.030	2,494,821.330	
	ANADARKO PETROLEUM CORP	41,993	61.810	2,595,587.330	
	ALEXION PHARMACEUTICALS INC	16,015	113.460	1,817,061.900	
	JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	69,855	33.720	2,355,510.600	
	TIME WARNER	58,404	96.710	5,648,250.840	
	JONES LANG LASALLE INC	2,818	175.000	493,150.000	
	VALERO ENERGY CORP	32,105	98.890	3,174,863.450	
	APACHE CORP	30,595	39.280	1,201,771.600	
	ANSYS INC	5,619	157.920	887,352.480	
	APPLE INC	381,669	173.250	66,124,154.250	
APPLIED MATERIALS INC	80,070	54.800	4,387,836.000		
ALBEMARLE CORP	7,904	92.330	729,776.320		
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	42,401	44.140	1,871,580.140		
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	7,831	78.490	614,655.190		
AMEREN CORP	17,312	56.200	972,934.400		

ARROW ELECTRONICS INC	5,756	76.090	437,974.040	
AUTOLIV INC	6,197	150.370	931,842.890	
AUTODESK INC	14,259	131.730	1,878,338.070	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	33,092	115.910	3,835,693.720	
AUTOZONE INC	2,015	616.680	1,242,610.200	
AVERY DENNISON CORP	6,262	106.350	665,963.700	
AVNET INC	10,288	41.500	426,952.000	
BALL CORP	24,324	40.140	976,365.360	
BERKSHIRE HATHAWAY INC- CL B	93,679	197.800	18,529,706.200	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	73,749	51.380	3,789,223.620	
BAXTER INTERNATIONAL INC	34,876	66.200	2,308,791.200	
BECTON DICKINSON & CO	20,449	223.650	4,573,418.850	
AMETEK INC	16,775	74.530	1,250,240.750	
VERIZON COMM INC	306,879	48.270	14,813,049.330	
WR BERKLEY CORP	8,134	72.650	590,935.100	
BEST BUY CO INC	19,210	71.720	1,377,741.200	
YUM! BRANDS INC	23,738	85.580	2,031,498.040	
FIRSTENERGY CORP	30,796	34.390	1,059,074.440	
H&R BLOCK INC	16,114	25.780	415,418.920	
BOEING CO	41,769	334.830	13,985,514.270	
ROBERT HALF INTL INC	8,158	59.290	483,687.820	
BORGWARNER INC	14,648	53.010	776,490.480	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	97,541	27.900	2,721,393.900	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	9,894	94.120	931,223.280	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	8,731	97.640	852,494.840	
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	1,838	571.280	1,050,012.640	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	121,395	61.210	7,430,587.950	
AFFILIATED MANAGERS GROUP INC	3,788	176.280	667,748.640	
INGREDION INC	5,305	128.820	683,390.100	
ONEOK INC	28,887	58.310	1,684,400.970	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	8,000	110.740	885,920.000	
UNITED RENTALS INC	6,332	177.970	1,126,906.040	
SEMPRA ENERGY	16,912	111.680	1,888,732.160	
FEDEX CORP	18,964	238.000	4,513,432.000	
VERISIGN INC	6,321	120.530	761,870.130	
AMPHENOL CORP	24,700	85.370	2,108,639.000	
BROWN-FORMAN CORP	19,683	55.540	1,093,193.820	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	127,092	6.270	796,866.840	
CSX CORP	63,992	55.260	3,536,197.920	
CABOT OIL & GAS CORP	32,261	23.550	759,746.550	
CAMPBELL SOUP CO	14,050	42.590	598,389.500	

SEAGATE TECHNOLOGY	20,613	59.350	1,223,381.550	
CONSTELLATION BRANDS INC	12,969	226.070	2,931,901.830	
CARDINAL HEALTH INC	22,125	64.340	1,423,522.500	
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	24,916	63.100	1,572,199.600	
CATERPILLAR INC	44,558	148.090	6,598,594.220	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	9,832	102.510	1,007,878.320	
CELGENE CORP	59,186	89.440	5,293,595.840	
CITRIX SYSTEMS INC	10,896	93.400	1,017,686.400	
CENTURYLINK INC	73,540	17.690	1,300,922.600	
CERNER CORP	22,947	56.740	1,302,012.780	
JPMORGAN CHASE & CO	258,225	112.510	29,052,894.750	
CHURCH & DWIGHT CO INC	18,822	49.680	935,076.960	
CIGNA CORP	18,609	169.850	3,160,738.650	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	10,982	73.410	806,188.620	
CINTAS CORP	6,282	170.330	1,070,013.060	
CISCO SYSTEMS INC	364,860	42.510	15,510,198.600	
CLOROX COMPANY	9,331	126.990	1,184,943.690	
COCA-COLA CO/THE	298,559	43.990	13,133,610.410	
COGNEX CORP	11,508	50.460	580,693.680	
COLGATE-PALMOLIVE CO	62,296	71.730	4,468,492.080	
MARRIOTT INTERNATIONAL- CL A	23,444	129.840	3,043,968.960	
COMERICA INC	12,068	97.380	1,175,181.840	
COMCAST CORP-CL A	345,846	33.860	11,710,345.560	
CA INC	22,732	34.530	784,935.960	
CONAGRA BRANDS INC	28,323	36.850	1,043,702.550	
CONSOLIDATED EDISON INC	21,750	77.600	1,687,800.000	
CMS ENERGY CORP	19,291	44.630	860,957.330	
COOPER COS INC	3,794	223.340	847,351.960	
MOLSON COORS BREWING CO	13,855	73.990	1,025,131.450	
CORNING INC	65,641	27.340	1,794,624.940	
WR GRACE & CO	3,314	65.760	217,928.640	
SEALED AIR CORP	13,870	43.560	604,177.200	
CUMMINS INC	11,239	161.920	1,819,818.880	
DR HORTON INC	24,498	45.330	1,110,494.340	
DANAHER CORP	47,175	99.520	4,694,856.000	
MOODY'S CORP	12,963	162.640	2,108,302.320	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	43,966	80.400	3,534,866.400	
TARGET CORP	37,486	72.790	2,728,605.940	
DEERE & CO	20,401	148.010	3,019,552.010	
MORGAN STANLEY	102,643	54.140	5,557,092.020	
REPUBLIC SERVICES INC	17,375	67.550	1,173,681.250	
COSTAR GROUP INC	2,786	360.220	1,003,572.920	
THE WALT DISNEY CO	112,062	101.370	11,359,724.940	
DOLLAR TREE INC	17,493	99.070	1,733,031.510	

DOVER CORP	10,736	94.540	1,014,981.440	
OMNICOM GROUP	16,993	72.410	1,230,463.130	
DTE ENERGY CO	13,122	103.560	1,358,914.320	
DUKE ENERGY CORP	52,625	77.520	4,079,490.000	
FLOWSERVE CORP	8,406	44.580	374,739.480	
DARDEN RESTAURANTS INC	9,436	86.590	817,063.240	
EBAY INC	74,364	39.590	2,944,070.760	
BANK OF AMERICA CORP	737,237	30.480	22,470,983.760	
CITIGROUP INC	196,708	70.510	13,869,881.080	
EASTMAN CHEMICAL CO	10,193	106.260	1,083,108.180	
E*TRADE FINANCIAL CORP	18,740	57.260	1,073,052.400	
EATON CORP PLC	32,234	77.590	2,501,036.060	
EATON VANCE CORP	9,184	54.800	503,283.200	
CADENCE DESIGN SYS INC	20,877	37.010	772,657.770	
DISH NETWORK CORP	16,150	39.240	633,726.000	
ECOLAB INC	19,009	141.640	2,692,434.760	
ELECTRONIC ARTS INC	23,050	120.710	2,782,365.500	
SALESFORCE.COM INC	52,227	119.490	6,240,604.230	
EMERSON ELECTRIC CO	47,931	67.560	3,238,218.360	
ATMOS ENERGY CORP	8,221	84.060	691,057.260	
ENTERGY CORP	12,199	78.510	957,743.490	
EOG RESOURCES INC	45,000	107.660	4,844,700.000	
EQUIFAX INC	8,495	117.980	1,002,240.100	
EQT CORP	17,149	48.580	833,098.420	
ESTEE LAUDER COS INC/THE	16,134	152.300	2,457,208.200	
EXPEDITORS INTERNATIONAL	12,550	63.160	792,658.000	
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	43,633	69.820	3,046,456.060	
EXXON MOBIL CORP	315,280	77.070	24,298,629.600	
FMC CORP	8,970	79.250	710,872.500	
NEXTERA ENERGY INC	35,113	161.800	5,681,283.400	
ASSURANT INC	4,089	90.730	370,994.970	
FASTENAL CO	21,654	54.420	1,178,410.680	
FIFTH THIRD BANCORP	52,173	31.780	1,658,057.940	
M&T BANK CORP	9,799	186.440	1,826,925.560	
FISERV INC	33,804	71.130	2,404,478.520	
FLIR SYSTEMS INC	11,623	51.200	595,097.600	
MACY'S INC	24,741	29.300	724,911.300	
FORD MOTOR CO	278,818	11.450	3,192,466.100	
FRANKLIN RESOURCES INC	22,314	33.090	738,370.260	
FREEMPORT-MCMORAN INC	96,812	18.200	1,761,978.400	
FLEX LTD	35,913	16.450	590,768.850	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	12,176	68.370	832,473.120	
GAP INC/THE	18,295	30.780	563,120.100	
DENTSPLY SIRONA INC	17,477	49.750	869,480.750	
GENERAL DYNAMICS CORP	19,047	214.450	4,084,629.150	
GENERAL MILLS INC	44,775	44.510	1,992,935.250	
GENUINE PARTS CO	11,759	90.370	1,062,660.830	
GILEAD SCIENCES INC	97,302	75.020	7,299,596.040	

GARTNER INC	7,153	117.310	839,118.430	
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	18,097	27.800	503,096.600	
MCKESSON CORP	15,054	143.200	2,155,732.800	
NVIDIA CORP	44,765	227.910	10,202,391.150	
GENERAL ELECTRIC CO	641,549	13.050	8,372,214.450	
WW GRAINGER INC	3,832	292.000	1,118,944.000	
HALLIBURTON CO	68,865	48.820	3,361,989.300	
MONSTER BEVERAGE CORP	29,522	56.320	1,662,679.040	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	26,624	256.570	6,830,919.680	
HARLEY-DAVIDSON INC	12,901	42.380	546,744.380	
HARRIS CORP	8,954	162.390	1,454,040.060	
HASBRO INC	7,736	86.090	665,992.240	
HENRY SCHEIN INC	11,426	69.340	792,278.840	
HELMERICH & PAYNE INC	7,213	69.610	502,096.930	
HERSHEY FOODS CORP	10,132	95.860	971,253.520	
HP INC	122,725	21.750	2,669,268.750	
F5 NETWORKS INC	4,874	144.940	706,437.560	
CROWN HOLDINGS INC NPR	14,572	50.390	734,283.080	
UNITED THERAPEUTICS CORP	3,447	111.970	385,960.590	
JUNIPER NETWORKS INC	27,740	24.660	684,068.400	
HOLLYFRONTIER CORP	11,051	53.960	596,311.960	
HOLOGIC INC	19,133	37.010	708,112.330	
UNUM GROUP	16,000	47.630	762,080.000	
HOME DEPOT INC	86,514	173.490	15,009,313.860	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	12,887	79.830	1,028,769.210	
HORMEL FOODS CORP	19,345	35.340	683,652.300	
CENTERPOINT ENERGY INC	31,952	27.100	865,899.200	
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,337	200.980	469,690.260	
HUMANA INC	10,468	286.840	3,002,641.120	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	5,927	111.430	660,445.610	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	75,161	14.870	1,117,644.070	
RED HAT INC	14,447	156.750	2,264,567.250	
BIOGEN INC	15,971	265.090	4,233,752.390	
IDEX CORP	7,724	141.390	1,092,096.360	
ILLINOIS TOOL WORKS	22,895	156.260	3,577,572.700	
INTUIT INC	18,126	171.310	3,105,165.060	
IDEXX LABORATORIES INC	6,255	193.260	1,208,841.300	
INGERSOLL-RAND PLC	18,874	84.420	1,593,343.080	
INTEL CORP	348,219	51.270	17,853,188.130	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	5,578	137.030	764,353.340	
INTERNATIONAL PAPER CO	28,375	52.510	1,489,971.250	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	29,157	23.690	690,729.330	

JACOBS ENGINEERING GROUP INC	7,931	59.440	471,418.640	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	7,919	120.550	954,635.450	
INCYTE CORP	12,360	68.120	841,963.200	
JOHNSON & JOHNSON	200,134	130.250	26,067,453.500	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	25,530	51.900	1,325,007.000	
KLA-TENCOR CORP	11,724	108.570	1,272,874.680	
DEVON ENERGY CORP	34,184	33.600	1,148,582.400	
WESTAR ENERGY INC	9,911	51.380	509,227.180	
KELLOGG CO	18,922	63.620	1,203,817.640	
EAST WEST BANCORP INC	15,000	61.580	923,700.000	
KEYCORP	90,776	19.630	1,781,932.880	
KIMBERLY-CLARK CORP	27,356	108.470	2,967,305.320	
BLACKROCK INC/NEW YORK	8,949	533.960	4,778,408.040	
KOHL'S CORP	11,357	63.640	722,759.480	
KROGER CO	67,450	23.460	1,582,377.000	
LAM RESEARCH CORP	11,522	200.170	2,306,358.740	
PACKAGING CORP OF AMERICA	6,157	113.800	700,666.600	
AKAMA I TECHNOLOGIES	12,622	72.490	914,968.780	
LEGGETT & PLATT INC	9,588	44.480	426,474.240	
LENNAR CORP	24,033	60.090	1,444,142.970	
LEUCADIA NATIONAL CORP	21,462	24.380	523,243.560	
ELI LILLY & CO	74,839	79.220	5,928,745.580	
L BRANDS INC	16,262	38.320	623,159.840	
LINCOLN NATIONAL CORP	19,262	69.420	1,337,168.040	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	51,308	106.020	5,439,674.160	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	25,175	66.640	1,677,662.000	
LOCKHEED MARTIN CORP	19,173	339.360	6,506,549.280	
LOEWS CORP	21,346	50.430	1,076,478.780	
RANGE RESOURCES CORP	13,697	14.780	202,441.660	
LOWE'S COS INC	62,509	87.140	5,447,034.260	
DOMINION ENERGY INC	48,002	65.500	3,144,131.000	
SCANA CORP	10,902	36.300	395,742.600	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	32,198	34.670	1,116,304.660	
MCCORMICK & CO INC	11,107	105.720	1,174,232.040	
MCDONALD'S CORPORATION	59,447	162.770	9,676,188.190	
S&P GLOBAL INC	18,409	191.510	3,525,507.590	
EVEREST RE GROUP LTD	2,855	256.200	731,451.000	
MANPOWERGROUP INC	4,257	115.900	493,386.300	
MARKEL CORPORATION	989	1,156.670	1,143,946.630	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	16,081	140.300	2,256,164.300	
MARSH & MCLENNAN COS	39,653	81.710	3,240,046.630	
MASCO CORP	23,043	40.800	940,154.400	

MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	4,387	205.200	900,212.400	
MATTEL INC	24,003	13.520	324,520.560	
METLIFE INC	64,937	46.460	3,016,973.020	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	20,342	57.980	1,179,429.160	
MEDTRONIC PLC	100,647	79.290	7,980,300.630	
ACTIVISION BLIZZARD INC	54,568	66.520	3,629,863.360	
CVS HEALTH CORP	75,876	63.970	4,853,787.720	
MERCK & CO. INC.	201,289	56.490	11,370,815.610	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	7,176	165.140	1,185,044.640	
MICROSOFT CORP	544,500	92.880	50,573,160.000	
MICRON TECH INC	86,870	50.480	4,385,197.600	
MIDDLEBY CORP	4,100	124.300	509,630.000	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	19,829	88.730	1,759,427.170	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	26,463	21.480	568,425.240	
3M CO	44,134	216.980	9,576,195.320	
MOHAWK INDUSTRIES INC	5,573	238.830	1,330,999.590	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	13,562	107.550	1,458,593.100	
KANSAS CITY SOUTHERN	7,247	108.940	789,488.180	
MYLAN NV	31,344	41.520	1,301,402.880	
ILLUMINA INC	11,065	238.920	2,643,649.800	
XCEL ENERGY INC	37,554	45.030	1,691,056.620	
NATIONAL OILWELL VARCO INC	26,938	38.080	1,025,799.040	
NETAPP INC	18,387	66.060	1,214,645.220	
NEWFIELD EXPLORATION CO	13,740	25.930	356,278.200	
NEWELL BRANDS INC	36,206	25.830	935,200.980	
NEWMONT MINING CORP	38,093	39.470	1,503,530.710	
NVR INC	236	3,174.220	749,115.920	
NIKE INC-CL B	98,317	67.000	6,587,239.000	
NOBLE ENERGY INC	36,582	31.140	1,139,163.480	
NORDSTROM INC	9,487	49.470	469,321.890	
NORFOLK SOUTHERN CORP	22,159	130.000	2,880,670.000	
EVERSOURCE ENERGY	23,085	59.310	1,369,171.350	
NISOURCE INC	22,198	24.110	535,193.780	
TAPESTRY INC	22,269	53.070	1,181,815.830	
NORTHERN TRUST CORP	16,090	103.250	1,661,292.500	
NORTHROP GRUMMAN CORP	12,588	346.740	4,364,763.120	
WELLS FARGO & CO	348,201	52.620	18,322,336.620	
NUCOR CORP	23,780	62.160	1,478,164.800	
MONSANTO CO	32,713	125.010	4,089,452.130	
CHENIERE ENERGY INC	15,927	55.630	886,019.010	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	37,524	96.820	3,633,073.680	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	59,976	70.510	4,228,907.760	

OLD DOMINION FREIGHT LINE	4,917	142.570	701,016.690	
OGE ENERGY CORP	16,028	31.800	509,690.400	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	6,375	236.690	1,508,898.750	
ORACLE CORP	230,824	45.820	10,576,355.680	
PACCAR INC	26,537	67.740	1,797,616.380	
EXELON CORP	69,910	38.670	2,703,419.700	
PARKER HANNIFIN CORP	10,985	172.410	1,893,923.850	
PAYCHEX INC	23,141	61.970	1,434,047.770	
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	6,526	56.740	370,285.240	
ALIGN TECHNOLOGY INC	5,854	258.270	1,511,912.580	
PPL CORPORATION	57,183	27.690	1,583,397.270	
PEPSICO INC	104,692	109.400	11,453,304.800	
PENTAIR PLC	11,775	69.730	821,070.750	
PFIZER INC	446,210	35.950	16,041,249.500	
CONOCOPHILLIPS	89,973	62.340	5,608,916.820	
PVH CORP	5,387	157.950	850,876.650	
PG&E CORP	42,795	44.150	1,889,399.250	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	12,158	178.320	2,168,014.560	
ALTRIA GROUP INC	141,336	64.220	9,076,597.920	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	35,408	151.540	5,365,728.320	
POLARIS INDUSTRIES INC	3,845	121.200	466,014.000	
GARMIN LTD	7,795	59.370	462,789.150	
AETNA INC	23,744	173.870	4,128,369.280	
FLUOR CORP (NEW)	9,821	58.560	575,117.760	
PPG INDUSTRIES INC	19,079	110.360	2,105,558.440	
IPG PHOTONICS CORP	2,441	229.340	559,818.940	
PRAXAIR INC	20,519	146.690	3,009,932.110	
COSTCO WHOLESALE CORP	32,871	183.550	6,033,472.050	
T ROWE PRICE GROUP INC	19,663	106.740	2,098,828.620	
QUEST DIAGNOSTICS	10,378	98.940	1,026,799.320	
PROCTER & GAMBLE CO	186,535	78.370	14,618,747.950	
PROGRESSIVE CORP	43,996	60.390	2,656,918.440	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	37,115	49.850	1,850,182.750	
PULTE GROUP INC	21,209	29.830	632,664.470	
NEW YORK COMMUNITY BANCORP INC	30,388	12.710	386,231.480	
GLOBAL PAYMENTS INC	10,769	110.690	1,192,020.610	
QUALCOMM INC	109,843	54.770	6,016,101.110	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	10,187	86.690	883,111.030	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	2,550	137.520	350,676.000	
REGENERON PHARMACEUTICALS	5,659	328.040	1,856,378.360	

REINSURANCE GROUP OF AMERICA INC	4,642	151.570	703,587.940	
AUTONATION INC	5,772	47.580	274,631.760	
RESMED INC	9,394	96.660	908,024.040	
US BANCORP	123,678	51.080	6,317,472.240	
SEATTLE GENETICS INC /WA	7,317	51.690	378,215.730	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	8,674	78.770	683,250.980	
ROSS STORES INC	28,189	78.120	2,202,124.680	
ROLLINS INC	8,252	51.320	423,492.640	
ROPER TECHNOLOGIES INC	8,523	273.140	2,327,972.220	
ROCKWELL AUTOMATION INC	8,867	172.040	1,525,478.680	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	12,293	112.920	1,388,125.560	
RAYTHEON COMPANY	21,817	218.110	4,758,505.870	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	3,848	210.450	809,811.600	
ACCENTURE PLC-CL A	45,610	152.050	6,935,000.500	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	111,556	41.740	4,656,347.440	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	8,849	147.020	1,300,979.980	
ROCKWELL COLLINS INC	12,086	133.850	1,617,711.100	
THE TRAVELERS COMPANIES INC	19,755	137.860	2,723,424.300	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	26,562	96.830	2,571,998.460	
BOOKING HOLDINGS INC	3,645	2,077.590	7,572,815.550	
SCHLUMBERGER LTD	104,599	66.710	6,977,799.290	
SCHWAB (CHARLES) CORP	92,005	51.510	4,739,177.550	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	14,175	107.290	1,520,835.750	
BUNGE LTD	10,334	74.100	765,749.400	
SEI INVESTMENTS CO	9,315	72.040	671,052.600	
ANTHEM INC	19,325	224.950	4,347,158.750	
AMERISOURCEBERGEN CORP	12,257	88.910	1,089,769.870	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	21,442	61.070	1,309,462.940	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	6,319	388.170	2,452,846.230	
CENTENE CORP	12,713	107.960	1,372,495.480	
SVB FINANCIAL GROUP	4,107	245.660	1,008,925.620	
IAC INTERACTIVE CORP	5,050	156.070	788,153.500	
SMITH (A.O.) CORP	9,565	64.490	616,846.850	
ACUITY BRANDS INC	3,087	130.170	401,834.790	
SNAP-ON INC	3,932	146.920	577,689.440	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	31,808	104.700	3,330,297.600	
ADVANCE AUTO PARTS	5,273	112.140	591,314.220	
EDISON INTERNATIONAL	29,000	62.870	1,823,230.000	
SOUTHERN CO	75,642	44.300	3,350,940.600	
BB&T CORP	59,388	52.570	3,122,027.160	
SOUTHWEST AIRLINES	11,352	54.130	614,483.760	

AT&T INC	456,680	35.810	16,353,710.800	
CHEVRON CORP	141,261	118.850	16,788,869.850	
STANLEY BLACK & DECKER INC	12,829	151.810	1,947,570.490	
STATE STREET CORP	27,099	99.910	2,707,461.090	
STARBUCKS CORP	106,412	59.410	6,321,936.920	
STEEL DYNAMICS INC	19,030	45.150	859,204.500	
STRYKER CORP	25,320	160.380	4,060,821.600	
NETFLIX INC	32,015	298.070	9,542,711.050	
STERICYCLE INC	6,853	57.810	396,171.930	
SUNTRUST BANKS INC	34,756	68.140	2,368,273.840	
SYMANTEC CORP	47,004	26.450	1,243,255.800	
KNIGHT SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	9,793	43.500	425,995.500	
SYNOPSIS INC	10,656	82.630	880,505.280	
SYSCO CORP	35,926	60.620	2,177,834.120	
INTUITIVE SURGICAL INC	8,708	418.700	3,646,039.600	
TELEFLEX INC	3,203	255.620	818,750.860	
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	63,853	17.880	1,141,691.640	
ANDEAVOR	11,500	110.290	1,268,335.000	
TEXAS INSTRUMENTS INC	73,391	102.360	7,512,302.760	
TEXTRON INC	19,076	58.380	1,113,656.880	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	30,141	215.190	6,486,041.790	
TIFFANY & CO	8,733	97.520	851,642.160	
TOLL BROTHERS INC	9,526	43.300	412,475.800	
TORCHMARK CORP	7,699	84.170	648,024.830	
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	11,279	85.530	964,692.870	
DAVITA INC	10,878	63.180	687,272.040	
TRACTOR SUPPLY CO	9,276	61.450	570,010.200	
TRIMBLE INC	20,073	35.030	703,157.190	
TYSON FOODS INC	21,621	70.710	1,528,820.910	
UGI CORP	12,068	44.590	538,112.120	
MARATHON OIL CORP	58,747	17.060	1,002,223.820	
UNION PACIFIC CORP	58,589	130.120	7,623,600.680	
UNITED TECHNOLOGIES CORP	56,111	122.960	6,899,408.560	
UNITEDHEALTH GROUP INC	71,700	226.790	16,260,843.000	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	6,351	120.070	762,564.570	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	6,848	119.930	821,280.640	
VF CORP	24,309	77.920	1,894,157.280	
CBS CORP	27,376	52.120	1,426,837.120	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	19,280	161.170	3,107,357.600	
VULCAN MATERIALS CO	10,136	116.100	1,176,789.600	

WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	63,286	63.760	4,035,115.360	
WALMART INC	111,062	86.450	9,601,309.900	
WASTE MANAGEMENT INC	32,216	84.250	2,714,198.000	
WATERS CORP	5,963	203.320	1,212,397.160	
ALLERGAN PLC	25,196	164.310	4,139,954.760	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	8,855	124.390	1,101,473.450	
VAIL RESORTS INC	2,598	227.270	590,447.460	
WESTERN DIGITAL CORP	22,254	90.720	2,018,882.880	
WABTEC CORP	5,497	82.030	450,918.910	
WHIRLPOOL CORP	5,553	149.820	831,950.460	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	13,529	98.010	1,325,977.290	
WYNN RESORTS LTD	6,279	183.280	1,150,815.120	
NASDAQ INC	9,132	85.950	784,895.400	
CME GROUP INC	25,415	163.590	4,157,639.850	
WILLIAMS COS INC	61,081	25.070	1,531,300.670	
LKQ CORP	22,948	38.130	875,007.240	
ALLIANT ENERGY CORP	16,383	40.750	667,607.250	
WEC ENERGY GROUP INC	23,117	62.340	1,441,113.780	
TD AMERITRADE HOLDING CORP	21,581	59.920	1,293,133.520	
CARMAX INC	13,513	60.820	821,860.660	
XEROX CORP	17,455	28.320	494,325.600	
XILINX INC	19,197	68.060	1,306,547.820	
CIMAREX ENERGY CO	7,003	94.120	659,122.360	
TJX COMPANIES INC	49,771	82.370	4,099,637.270	
ZIONS BANCORP	16,584	52.400	869,001.600	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	76,400	7.140	545,496.000	
JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	15,700	61.330	962,881.000	
JARDINE STRATEGIC HOLDINGS LTD	17,100	38.500	658,350.000	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	6,051	98.080	593,482.080	
SIGNATURE BANK	4,171	136.840	570,759.640	
CBRE GROUP INC	20,976	47.870	1,004,121.120	
LIBERTY GLOBAL PLC	12,435	32.010	398,044.350	
REGIONS FINANCIAL CORP	84,486	18.600	1,571,439.600	
DOMINO'S PIZZA INC	3,256	231.700	754,415.200	
T-MOBILE US INC	21,188	63.130	1,337,598.440	
LAS VEGAS SANDS CORP	30,271	71.410	2,161,652.110	
MOSAIC CO/THE	26,525	25.030	663,920.750	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX NEWS	38,915	35.800	1,393,157.000	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC	75,340	36.270	2,732,581.800	
MACQUARIE INFRASTRUCTURE CORP	5,473	38.000	207,974.000	

CELANESE CORP	9,491	104.420	991,050.220	
DISCOVERY INC-A	10,423	22.600	235,559.800	
EXPEDIA GROUP INC	8,709	108.490	944,839.410	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	18,475	37.270	688,563.250	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	10,578	144.290	1,526,299.620	
LIBERTY GLOBAL PLC- SERIES C	41,818	31.210	1,305,139.780	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	42,085	72.470	3,049,899.950	
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	14,696	16.820	247,186.720	
VIACOM INC-CLASS B	24,612	31.040	763,956.480	
LIVE NATION	8,864	38.310	339,579.840	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,807	321.770	581,438.390	
UNITED CONTINENTAL HOLIDINGS INC	6,191	67.590	418,449.690	
TRANSDIGM GROUP INC	3,812	306.240	1,167,386.880	
MASTERCARD INC	69,652	174.720	12,169,597.440	
QURATE RETAIL GROUP INC	35,733	25.560	913,335.480	
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	7,436	109.360	813,200.960	
HANESBRANDS INC	27,619	18.810	519,513.390	
WESTERN UNION CO	35,222	19.040	670,626.880	
OWENS CORNING	7,333	81.200	595,439.600	
LEIDOS HOLDINGS INC	9,322	65.830	613,667.260	
AERCAP HOLDINGS NV	11,586	51.880	601,081.680	
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLDINGS INC	9,175	79.590	730,238.250	
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT-ADR	18,099	29.430	532,653.570	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	8,330	108.150	900,889.500	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	22,746	18.660	424,440.360	
DELTA AIR LINES INC	13,898	52.360	727,699.280	
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	6,354	60.990	387,530.460	
DISCOVER FINANCIAL	27,177	71.900	1,954,026.300	
TE CONNECTIVITY LTD	27,804	99.160	2,757,044.640	
CONCHO RESOURCES INC/MIDLAND TX	10,552	140.440	1,481,922.880	
WABCO HOLDING INC	3,176	131.220	416,754.720	
LULULEMON ATHLETICA INC	6,683	91.010	608,219.830	
VMWARE INC	5,491	121.750	668,529.250	
MERCADOLIBRE INC	3,215	347.830	1,118,273.450	
ULTA BEAUTY INC	4,332	221.060	957,631.920	
INVESCO LTD	29,824	31.270	932,596.480	
MSCI INC	6,462	149.050	963,161.100	

PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	114,627	101.100	11,588,789.700	
VISA INC	134,179	120.720	16,198,088.880	
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	15,000	120.340	1,805,100.000	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	11,992	81.800	980,945.600	
DISCOVERY INC-C	23,054	20.680	476,756.720	
MARATHON PETROLEUM CORP	36,673	73.700	2,702,800.100	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	11,624	58.710	682,445.040	
SPECTRUM BRANDS HOLDINGS INC	1,826	98.320	179,532.320	
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	155,757	15.610	2,431,366.770	
XYLEM INC	12,873	76.780	988,388.940	
ALKERMES PLC	12,053	43.250	521,292.250	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	26,384	102.340	2,700,138.560	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,479	254.800	886,449.200	
SPLUNK INC	10,674	101.790	1,086,506.460	
HCA HEALTHCARE INC	21,696	96.930	2,102,993.280	
VERISK ANALYTICS INC	14,159	106.470	1,507,508.730	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	3,987	155.940	621,732.780	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	6,544	200.190	1,310,043.360	
FIRST REPUBLIC BANK/SAN FRANCISCO CA	10,668	90.630	966,840.840	
CIT GROUP INC	9,287	51.940	482,366.780	
NXP SEMICONDUCTOR NV	22,652	116.610	2,641,449.720	
TARGA RESOURCES CORP	16,445	46.260	760,745.700	
HUTCHISON PORT HOLDINGS TRUST	405,600	0.335	135,876.000	
LEAR CORP	5,132	195.000	1,000,740.000	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	7,040	110.280	776,371.200	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	17,000	48.920	831,640.000	
DOLLAR GENERAL CORP	21,402	96.440	2,064,008.880	
FORTINET INC	11,399	56.230	640,965.770	
AON PLC	18,487	140.160	2,591,137.920	
TESLA INC	10,063	304.700	3,066,196.100	
GENERAL MOTORS CO	95,770	39.070	3,741,733.900	
WORLDPAY INC	10,448	81.340	849,840.320	
TRIPADVISOR INC	9,263	40.830	378,208.290	
ALLY FINANCIAL INC	31,409	27.490	863,433.410	
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	12,138	65.230	791,761.740	
VOYA FINANCIAL INC	13,525	50.810	687,205.250	

APTIV PLC	19,069	86.030	1,640,506.070	
PHILLIPS 66	30,976	100.250	3,105,344.000	
FACEBOOK INC	177,316	165.040	29,264,232.640	
IQVIA HOLDINGS INC	10,051	96.610	971,027.110	
DIAMONDBACK ENERGY INC	7,054	117.380	827,998.520	
SERVICENOW INC	12,206	166.580	2,033,275.480	
PALO ALTO NETWORKS INC	7,006	186.820	1,308,860.920	
TESARO INC	2,646	53.540	141,666.840	
WORKDAY INC	10,417	126.500	1,317,750.500	
ABBVIE INC	118,243	93.620	11,069,909.660	
ZOETIS INC	36,976	83.090	3,072,335.840	
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDINGS LTD	16,470	52.000	856,440.000	
COTY INC	38,541	18.130	698,748.330	
NEWS CORP/NEW-CL A	30,263	15.950	482,694.850	
HD SUPPLY HOLDINGS INC	12,891	38.790	500,041.890	
CDW CORP	10,824	70.120	758,978.880	
SPRINT CORP	63,882	6.020	384,569.640	
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	10,199	47.460	484,044.540	
ARCONIC INC	27,513	23.030	633,624.390	
ENVISION HEALTHCARE CORP	8,692	35.830	311,434.360	
LIBERTY MEDIA CORP- LIBERTY-C	13,175	29.620	390,243.500	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	5,006	40.810	204,294.860	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-C	13,368	40.730	544,478.640	
XL GROUP LTD	17,166	55.390	950,824.740	
DELL TECHNOLOGIES INC	15,074	72.790	1,097,236.460	
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	15,410	14.580	224,677.800	
BAKER HUGHES A GE CO	28,404	30.890	877,399.560	
TECHNIPFMC LTD	32,556	30.430	990,679.080	
BROADCOM INC	30,394	239.750	7,286,961.500	
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	6,291	51.150	321,784.650	
ANTERO RESOURCES CORP	13,163	20.540	270,368.020	
VEEVA SYSTEMS INC	9,087	71.860	652,991.820	
TWITTER INC	47,998	29.530	1,417,380.940	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING PLC	11,392	52.240	595,118.080	
PLAINS GP HOLDINGS LP	7,837	24.650	193,182.050	
COMMSCOPE HOLDING CO INC	12,920	39.370	508,660.400	
ALLEGION PLC	9,825	85.230	837,384.750	
PERRIGO CO PLC	8,553	84.000	718,452.000	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	14,796	75.010	1,109,847.960	
ARAMARK	17,307	38.300	662,858.100	
SABRE CORP	17,624	20.150	355,123.600	
PARSLEY ENERGY INC	17,454	27.630	482,254.020	
ARISTA NETWORKS INC	3,748	267.190	1,001,428.120	

IHS MARKIT LTD	34,553	48.480	1,675,129.440	
FNF GROUP	17,760	38.220	678,787.200	
SYNCHRONY FINANCIAL	57,485	34.460	1,980,933.100	
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	34,845	42.700	1,487,881.500	
CDK GLOBAL INC	8,309	64.760	538,090.840	
QORVO INC	8,784	71.240	625,772.160	
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	11,389	35.680	406,359.520	
LIBERTY BROADBAND CORP-C W/I	7,818	82.600	645,766.800	
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	14,710	32.150	472,926.500	
NIELSEN HOLDINGS PLC	26,840	32.500	872,300.000	
TRANSUNION	10,341	57.080	590,264.280	
SQUARE INC	20,423	47.800	976,219.400	
DOWDUPONT INC	173,668	65.890	11,442,984.520	
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS PLC	14,000	41.170	576,380.000	
WESTROCK CO	17,744	64.560	1,145,552.640	
KRAFT HEINZ CO	43,818	61.250	2,683,852.500	
FORTIVE CORP	23,630	75.800	1,791,154.000	
WASTE CONNECTIONS INC	18,879	72.070	1,360,609.530	
ALPHABET INC-CL A	22,200	1,036.500	23,010,300.000	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	113,242	17.250	1,953,424.500	
PAYPAL HOLDINGS INC	85,540	76.790	6,568,616.600	
FIRST DATA CORP	35,404	15.400	545,221.600	
DXC TECHNOLOGY CO	21,351	102.530	2,189,118.030	
ZILLOW GROUP INC-C	8,134	53.550	435,575.700	
ALPHABET INC-CL C	23,400	1,031.640	24,140,376.000	
L3 TECHNOLOGIES INC	5,892	210.710	1,241,503.320	
CHEMOURS CO	12,723	50.120	637,676.760	
ATHENE HOLDING LTD	8,984	47.990	431,142.160	
CHARTER COMMUNICATIONS INC	14,006	308.240	4,317,209.440	
VISTRA ENERGY CORP	30,000	21.320	639,600.000	
アメリカ・ドル 小計	23,076,260		1,725,575,294.650 (184,809,114,057)	
イギリス・ポンド				
ANTOFAGASTA PLC	25,905	9.528	246,822.840	
ASHTED GROUP	35,233	20.230	712,763.590	
SEVERN TRENT PLC	14,897	18.550	276,339.350	
BHP BILLITON PLC	153,323	14.342	2,198,958.460	
BARCLAYS PLC	1,292,957	2.147	2,775,978.670	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	64,682	5.528	357,562.090	
BT GROUP PLC	638,910	2.384	1,523,161.440	
SKY PLC	72,210	13.265	957,865.650	
BUNZL PLC	22,241	21.300	473,733.300	
EASYJET PLC	13,628	16.390	223,362.920	
CAPITA PLC	54,894	1.450	79,596.300	

AVIVA PLC	277,861	4.998	1,388,749.270	
CRODA INTERNATIONAL	8,407	46.730	392,859.110	
DIAGEO PLC	186,366	25.350	4,724,378.100	
SCHRODERS PLC	14,000	31.950	447,300.000	
DCC PLC	5,936	66.000	391,776.000	
NATIONAL GRID PLC	266,520	8.250	2,198,790.000	
GKN PLC	134,180	4.260	571,606.800	
KINGFISHER PLC	165,680	2.972	492,400.960	
BAE SYSTEMS PLC	225,176	6.024	1,356,460.220	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	169,676	42.605	7,229,045.980	
COBHAM PLC	142,739	1.211	172,856.920	
NEXT PLC	9,731	48.610	473,023.910	
IMPERIAL BRANDS PLC	72,328	25.245	1,825,920.360	
IMI PLC	21,218	10.420	221,091.560	
JOHNSON MATTHEY PLC	12,527	32.670	409,257.090	
ANGLO AMERICAN PLC	100,380	16.920	1,698,429.600	
COMPASS GROUP PLC	115,111	15.020	1,728,967.220	
HSBC HOLDINGS PLC	1,488,734	6.735	10,026,623.490	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	423,649	2.653	1,123,940.790	
CENTRICA PLC	392,766	1.425	559,691.550	
UNILEVER PLC	89,305	39.455	3,523,528.770	
MEGGITT PLC	62,181	4.350	270,487.350	
MORRISON <WM.> SUPERMARKETS	155,682	2.254	350,907.220	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	72,363	7.100	513,777.300	
RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	80,864	6.544	529,174.010	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	25,308	25.960	656,995.680	
PEARSON PLC	65,009	7.668	498,489.010	
PERSIMMON PLC	23,150	26.770	619,725.500	
PRUDENTIAL PLC	197,581	18.100	3,576,216.100	
RIO TINTO PLC	92,130	37.120	3,419,865.600	
VODAFONE GROUP PLC	1,993,578	2.056	4,098,796.360	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	50,208	62.080	3,116,912.640	
RELX PLC	82,464	15.425	1,272,007.200	
OLD MUTUAL PLC	339,296	2.379	807,185.180	
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	116,966	8.868	1,037,254.480	
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	246,107	2.629	647,015.300	
ST JAMES'S PLACE PLC	40,884	10.725	438,480.900	
TRAVIS PERKINS PLC	20,357	12.475	253,953.570	
SSE PLC	73,043	12.815	936,046.040	
BP PLC	1,455,889	5.052	7,355,151.220	
SHIRE PLC	69,636	36.530	2,543,803.080	

SAGE GROUP PLC(THE)	85,271	6.700	571,315.700	
SMITHS GROUP PLC	31,720	15.215	482,619.800	
STANDARD CHARTERED PLC	237,533	7.250	1,722,114.250	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	5,397,548	0.670	3,616,357.160	
TAYLOR WIMPLEY PLC	253,022	1.904	481,753.880	
TESCO PLC	740,567	2.103	1,557,412.400	
3I GROUP PLC	66,784	8.888	593,576.190	
SMITH & NEPHEW PLC	66,155	13.395	886,146.220	
GLAXOSMITHKLINE PLC	369,384	14.454	5,339,076.330	
WEIR GROUP	18,336	20.330	372,770.880	
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	21,888	43.050	942,278.400	
BABCOCK INT'L GROUP	21,302	6.876	146,472.550	
WPP PLC	90,628	11.995	1,087,082.860	
FERGUSON PLC	18,238	53.200	970,261.600	
ASTRAZENECA PLC	94,694	50.770	4,807,614.380	
WHITBREAD PLC	12,159	37.020	450,126.180	
CARNIVAL PLC	13,153	46.000	605,038.000	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	120,290	2.645	318,167.050	
JOHN WOOD GROUP PLC	48,988	5.360	262,575.680	
INTERTEK GROUP PLC	11,273	47.200	532,085.600	
BURBERRY GROUP PLC	29,893	17.150	512,664.950	
INVESTEC PLC	50,655	5.592	283,262.760	
INTERCONTINENTAL HOTELS	12,362	43.230	534,409.260	
ITV PLC	247,210	1.509	373,039.890	
SAINSBURY (J) PLC	109,410	2.486	271,993.260	
RANDGOLD RESOURCES LTD NPR	6,998	57.260	400,705.480	
G4S PLC	122,250	2.522	308,314.500	
ADMIRAL GROUP PLC	15,893	18.985	301,728.600	
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	10,726	39.000	418,314.000	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	341,563	23.805	8,130,907.210	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	275,246	24.190	6,658,200.740	
TUI AG-DI	30,153	15.990	482,146.470	
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	184,183	3.670	675,951.610	
EXPERIAN PLC	71,068	15.685	1,114,701.580	
MONDI PLC	24,061	19.155	460,888.450	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	21,290	16.700	355,543.000	
FRESNILLO PLC NPR	15,639	12.405	194,001.790	
GLENCORE PLC	923,290	3.465	3,199,199.850	
GVC HOLDINGS PLC	36,000	9.290	334,440.000	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP PLC	112,694	3.528	397,584.430	

	MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	30,616	5.802	177,634.030	
	COCA-COLA HBC AG	13,406	26.260	352,041.560	
	CONVATEC GROUP PLC	118,400	2.043	241,891.200	
	ROYAL MAIL PLC	55,060	5.670	312,190.200	
	MERLIN ENTERTAINMENTS PLC	50,037	3.472	173,728.460	
	WORLDPAY INC	10,775	57.130	615,575.750	
	MICRO FOCUS INTERNATIONAL PLC	32,342	11.600	375,167.200	
	AUTO TRADER GROUP PLC	76,348	3.531	269,584.780	
イギリス・ポンド	小計	22,720,367		137,395,742.170 (20,864,917,406)	
イスラエル・シュケル	BANK HAPOLIM BM	78,428	24.040	1,885,409.120	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	103,061	21.010	2,165,311.610	
	BEZEQ ISRAELI TELECOMMUNICATION CORP LTD	188,230	4.570	860,211.100	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,760	405.300	713,328.000	
	FRUTAROM INDUSTRIES LTD	2,600	320.500	833,300.000	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	49,411	15.640	772,788.040	
	NICE LTD	4,035	322.000	1,299,270.000	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	10,444	66.000	689,304.000	
	AZRIELI GROUP	4,428	168.800	747,446.400	
イスラエル・シュケル	小計	442,397		9,966,368.270 (304,771,541)	
オーストラリア・ドル	RAMSAY HEALTH CARE LTD	11,115	63.300	703,579.500	
	AUST AND NZ BANKING GROUP LT	218,921	27.200	5,954,651.200	
	AMCOR LTD	80,741	14.280	1,152,981.480	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	253,113	29.540	7,476,958.020	
	BANK OF QUEENSLAND LTD	30,569	10.980	335,647.620	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	114,125	4.440	506,715.000	
	TELSTRA CORP LTD	272,919	3.150	859,694.850	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD	39,014	10.210	398,332.940	
	AMP LTD	200,498	4.820	966,400.360	
	ASX LTD	19,891	56.000	1,113,896.000	
	BHP BILLITON LTD	239,570	28.880	6,918,781.600	
	CALTEX AUSTRALIA LTD	20,946	31.800	666,082.800	
	HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	22,182	3.510	77,858.820	
	COMPUTERSHARE LT	38,040	17.200	654,288.000	
	CSL LIMITED	34,057	158.290	5,390,882.530	
	REA GROUP LTD	4,119	77.700	320,046.300	
	TRANSURBAN GROUP	186,946	11.390	2,129,314.940	

COCA-COLA AMATIL LTD	48,601	8.990	436,922.990	
COCHLEAR LTD	3,992	182.050	726,743.600	
ORIGIN ENERGY LTD	121,721	8.810	1,072,362.010	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	129,233	74.360	9,609,765.880	
BORAL LIMITED	86,101	7.370	634,564.370	
RIO TINTO LIMITED	32,815	75.500	2,477,532.500	
APA GROUP	77,562	7.950	616,617.900	
ARISTOCRAT LEISU	37,393	23.500	878,735.500	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	171,471	7.670	1,315,182.570	
TPG TELECOM LTD	28,719	5.500	157,954.500	
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	3,275	56.630	185,463.250	
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	28,489	22.630	644,706.070	
ORICA LTD	25,308	18.640	471,741.120	
CIMIC GROUP LTD	8,709	44.300	385,808.700	
BLUESCOPE STEEL LTD	36,941	15.090	557,439.690	
SYDNEY AIRPORT	85,130	6.640	565,263.200	
MACQUARIE GROUP LTD	25,799	103.090	2,659,618.910	
SUNCORP GROUP LTD	93,181	13.570	1,264,466.170	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	192,882	29.150	5,622,510.300	
NEWCREST MINING LTD	59,818	19.720	1,179,610.960	
OIL SEARCH LTD	93,715	7.400	693,491.000	
INCITEC PIVOT LTD	136,426	3.600	491,133.600	
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	95,390	9.560	911,928.400	
CHALLENGER FINANCIAL SERVICES	45,707	11.500	525,630.500	
SANTOS LTD	133,862	5.940	795,140.280	
SONIC HEALTHCARE	26,192	22.970	601,630.240	
TABCORP HOLDINGS LTD	126,348	4.290	542,032.920	
WESFARMERS LTD	81,021	41.990	3,402,071.790	
ALUMINA LIMITED	184,613	2.590	478,147.670	
WOODSIDE PETROLEUM LTD	78,576	30.070	2,362,780.320	
WOOLWORTHS GROUP LTD	99,142	26.920	2,668,902.640	
SEEK LTD	25,899	18.690	484,052.310	
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES LTD	4,581	40.330	184,751.730	
AUSNET SERVICES	165,066	1.635	269,882.910	
AGL ENERGY LTD	46,315	21.100	977,246.500	
BRAMBLES LTD	115,255	9.890	1,139,871.950	
CROWN RESORTS LTD	32,861	12.700	417,334.700	
AURIZON HOLDINGS LTD	139,184	4.340	604,058.560	
TREASURY WINE ESTATES LTD	50,789	17.830	905,567.870	
HEALTHSCOPE LTD	149,047	1.905	283,934.530	

	MEDIBANK PVT LTD	177,176	2.880	510,266.880	
	SOUTH32 LTD(AUD)	367,057	3.480	1,277,358.360	
オーストラリア・ドル 小計		5,458,128		87,616,337.810 (7,284,422,325)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	16,141	54.640	881,944.240	
	ALIMENTATION COUCHE TARD INC	30,728	54.670	1,679,899.760	
	BARRICK GOLD CORP	83,648	16.090	1,345,896.320	
	ATCO LTD	7,193	40.960	294,625.280	
	BANK OF MONTREAL	47,406	96.270	4,563,775.620	
	BANK OF NOVA SCOTIA	87,876	77.600	6,819,177.600	
	NATIONAL BANK OF CANADA	23,756	60.050	1,426,547.800	
	BCE INC	11,568	54.430	629,646.240	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT	66,737	49.210	3,284,127.770	
	VALEANT PHARMACEUTICALS INTERN	25,819	20.120	519,478.280	
	BOMBARDIER INC 'B'	151,615	3.650	553,394.750	
	SAPUTO INC	14,101	41.270	581,948.270	
	BLACKBERRY LTD	39,652	13.440	532,922.880	
	CGI GROUP INC	21,767	73.560	1,601,180.520	
	CCL INDUSTRIES INC	11,340	63.300	717,822.000	
	CAE INC	23,000	23.920	550,160.000	
	CAMECO CORP	32,627	12.550	409,468.850	
	ROGERS COMM-CL B	25,967	57.620	1,496,218.540	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	33,880	111.950	3,792,866.000	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	79,420	42.380	3,365,819.600	
	CANADIAN TIRE CORP-CL A	4,862	169.280	823,039.360	
	CANADIAN UTILITIES LTD	9,119	34.610	315,608.590	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	54,813	93.620	5,131,593.060	
	FIRST CAPITAL REALTY INC	11,417	20.200	230,623.400	
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	13,930	37.220	518,474.600	
	OPEN TEXT CORP	19,756	43.670	862,744.520	
	EMPIRE CO LTD	15,093	24.730	373,249.890	
	KINROSS GOLD CORP	99,741	4.630	461,800.830	
	FINNING INTERNATIONAL INC	9,892	31.020	306,849.840	
	FORTIS INC	29,002	42.280	1,226,204.560	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	55,296	18.050	998,092.800	
	TELUS CORP	15,945	44.920	716,249.400	
GREAT WEST LIFECO INC	19,248	33.470	644,230.560		
IMPERIAL OIL LTD	21,542	35.800	771,203.600		
ENBRIDGE INC	125,330	40.420	5,065,838.600		
IGM FINANCIAL INC	8,426	37.400	315,132.400		
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	87,995	3.870	340,540.650		

MANULIFE FINANCIAL CORP	145,162	23.300	3,382,274.600	
LINAMAR CORP	3,827	71.730	274,510.710	
LOBLAW CO LTD	15,354	64.200	985,726.800	
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANCE AND FINANCIAL SERVICES INC	6,524	52.120	340,030.880	
MAGNA INTERNATIONAL INC	25,339	75.220	1,905,999.580	
SUN LIFE FINANCIAL INC	50,376	51.730	2,605,950.480	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,985	659.500	1,309,107.500	
METRO INC	24,226	41.210	998,353.460	
HUSKY ENERGY INC	28,749	18.170	522,369.330	
CRESCENT POINT ENERGY CORP	39,992	9.480	379,124.160	
EMERA INC	15,709	40.770	640,455.930	
METHANEX CORP	7,381	81.050	598,230.050	
ONEX CORP	6,646	91.200	606,115.200	
GOLDCORP INC	75,202	17.630	1,325,811.260	
POWER CORP OF CANADA	25,052	29.410	736,779.320	
POWER FINANCIAL CORP	17,484	31.960	558,788.640	
ROYAL BANK OF CANADA	106,200	98.050	10,412,910.000	
SNC-LAVALIN GROUP INC	13,134	54.310	713,307.540	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	10,607	222.800	2,363,239.600	
SHAW COMM INC-B	27,548	24.160	665,559.680	
SUNCOR ENERGY INC	122,908	46.330	5,694,327.640	
LUNDIN MINING CORP	35,268	8.360	294,840.480	
ENCANA CORP	69,257	14.330	992,452.810	
TECK RESOURCES LTD-CL B	41,016	34.540	1,416,692.640	
THOMSON REUTERS CORP	20,469	50.410	1,031,842.290	
TORONTO DOMINION BANK (THE) C\$	136,076	70.840	9,639,623.840	
TRANSCANADA CORP	62,895	53.020	3,334,692.900	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	5,696	91.080	518,791.680	
WESTON (GEORGE) LTD	3,105	103.220	320,498.100	
INTACT FINANCIAL CORP	10,785	96.820	1,044,203.700	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	33,943	26.210	889,646.030	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,494	844.410	1,261,548.540	
FRANCO-NEVADA CORP NPR	12,787	87.280	1,116,049.360	
CI FINANCIAL CORP	20,695	27.330	565,594.350	
TOURMALINE OIL CORP	15,779	22.560	355,974.240	
KEYERA CORP	13,728	35.030	480,891.840	
ALTAGAS LTD	12,538	24.540	307,682.520	
PEMBINA PIPELINE CORP	43,197	39.940	1,725,288.180	
DOLLARAMA INC	7,504	150.500	1,129,352.000	
CENOVUS ENERGY INC W/I	80,545	12.410	999,563.450	

	VERMILION ENERGY INC	8,291	42.150	349,465.650	
	ARC RESOURCES LTD	22,997	14.380	330,696.860	
	ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP	30,631	4.500	137,839.500	
	INTER PIPELINE LTD	24,083	22.960	552,945.680	
	NUTRIEN LTD	45,351	58.930	2,672,534.430	
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	14,961	29.150	436,113.150	
	SEVEN GENERATIONS ENERGY LTD	17,231	16.950	292,065.450	
	RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	15,353	70.810	1,087,145.930	
	SHOPIFY INC	6,500	154.650	1,005,225.000	
	HYDRO ONE LTD	38,140	21.210	808,949.400	
カナダ・ドル 小計		3,055,368		126,265,579.340 (10,732,574,244)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE TECH ENG	125,000	3.650	456,250.000	
	SENBCORP INDUSTRIES	81,400	3.090	251,526.000	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	123,700	2.490	308,013.000	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	692,140	0.350	242,249.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	134,800	27.990	3,773,052.000	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	29,000	12.730	369,170.000	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	5,944	35.510	211,071.440	
	SINGAPORE AIRPORT TERMINAL SERVICES LTD	42,300	5.220	220,806.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	68,900	7.360	507,104.000	
	CAPITALAND LTD	192,415	3.630	698,466.450	
	GENTING SINGAPORE PLC	416,400	1.140	474,696.000	
	KEPPEL CORP LTD	98,400	7.810	768,504.000	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	177,900	2.080	370,032.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	225,453	12.850	2,897,071.050	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	591,922	3.380	2,000,696.360	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	47,500	11.000	522,500.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	94,500	27.920	2,638,440.000	
	UOL GROUP LIMITED	40,500	8.640	349,920.000	
WILMAR INTERNATIONAL LTD	92,000	3.160	290,720.000		
YANGZIJANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	188,800	1.210	228,448.000		
シンガポール・ドル 小計		3,468,974		17,578,735.300 (1,437,764,761)	
スイス・フラン	CREDIT SUISSE GROUP AG	187,381	15.890	2,977,484.090	
	NESTLE SA-REGISTERED	231,295	76.700	17,740,326.500	
	CIE FINANC RICHEMONT	39,186	89.100	3,491,472.600	
	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN	52,431	218.000	11,429,958.000	

	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2,835	200.200	567,567.000	
	SIKA INHABER	151	7,415.000	1,119,665.000	
	SGS SA-REG	405	2,387.000	966,735.000	
	NOVARTIS AG-REG SHS	166,499	78.640	13,093,481.360	
	BALOISE HOLDING AG -R	4,127	146.900	606,256.300	
	BARRY CALLEBAUT AG	144	1,910.000	275,040.000	
	CLARIANT AG-REG	19,496	23.100	450,357.600	
	SWISSCOM AG-REG	1,795	452.100	811,519.500	
	ABB LTD	139,628	22.000	3,071,816.000	
	ADECCO GROUP AG-REG	12,341	68.500	845,358.500	
	GEBERIT AG	2,801	414.700	1,161,574.700	
	LONZA GROUP AG-REG	5,389	230.000	1,239,470.000	
	LINDT & SPRUENGLI PART	75	6,015.000	451,125.000	
	LINDT & SPRUENGLI NAMEN	9	71,200.000	640,800.000	
	GIVAUDAN-REG	692	2,156.000	1,491,952.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	10,843	298.300	3,234,466.900	
	LAFARGEHOLCIM LTD	32,676	52.600	1,718,757.600	
	SONOVA HOLDING AG	3,168	150.050	475,358.400	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG	3,687	150.600	555,262.200	
	STRAUMANN HOLDING AG	1,072	601.000	644,272.000	
	THE SWATCH GROUP AG-B	2,311	438.800	1,014,066.800	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	4,592	82.700	379,758.400	
	SCHINDLER NAMEN	1,663	193.800	322,289.400	
	SWISS LIFE HOLDING AG	2,225	341.400	759,615.000	
	VIFOR PHARMA AG	3,050	155.000	472,750.000	
	EMS-CHEMIE HOLDING	553	591.000	326,823.000	
	SWISS PRIME SITE AG	5,990	90.950	544,790.500	
	PARGESA HOLDING PORTEUR	3,000	88.000	264,000.000	
	DUFREY GROUP	2,390	128.100	306,159.000	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,272	710.000	903,120.000	
	JULIUS BAER GROUP LTD	15,227	57.880	881,338.760	
	SWISS RE LTD	24,162	95.040	2,296,356.480	
	UBS GROUP AG	272,409	16.715	4,553,316.430	
スイス・フラン	小計	1,256,970		82,084,460.020 (9,190,996,988)	
スウェーデン・ク ローナ	ATLAS COPCO AB-A SHS	48,377	354.000	17,125,458.000	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	30,899	320.100	9,890,769.900	
	ERICSSON LM-B SHS	221,748	53.140	11,783,688.720	
	GETINGE AB-B SHS	13,153	95.420	1,255,059.260	
	LUNDBERGS B	3,691	587.500	2,168,462.500	
	SKF AB-B SHS	24,866	174.650	4,342,846.900	
	SANDVIK AB	76,781	155.150	11,912,572.150	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	128,935	85.580	11,034,257.300	
	SKANSKA AB-B SHS	21,179	164.550	3,485,004.450	

	SWEDBANK AB	66,507	185.200	12,317,096.400	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	108,388	100.550	10,898,413.400	
	VOLVO AB-B SHS	113,672	149.900	17,039,432.800	
	SWEDISH MATCH AB	11,481	386.000	4,431,666.000	
	TELE2 AB-B SHS	26,976	100.900	2,721,878.400	
	NORDEA AB	218,620	86.260	18,858,161.200	
	INDUSTRIVARDEN C	11,403	189.750	2,163,719.250	
	ELECTROLUX AB-SER B	19,191	258.900	4,968,549.900	
	SECURITAS AB-B SHS	24,098	143.800	3,465,292.400	
	INVESTOR AB-B SHS	33,412	375.000	12,529,500.000	
	HENNES&MAURITZ AB-B SHS	66,448	128.000	8,505,344.000	
	ASSA ABLOY AB-B	77,223	180.200	13,915,584.600	
	TELIA CO AB	184,927	39.270	7,262,083.290	
	LUNDIN PETROLEUM AB	16,790	222.700	3,739,133.000	
	BOLIDEN AB	21,855	294.900	6,445,039.500	
	ALFA LAVAL AB	30,655	197.600	6,057,428.000	
	KINNEVIK AB-B	18,310	306.700	5,615,677.000	
	MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR SA	5,332	552.000	2,943,264.000	
	ICA GRUPPEN AB	5,920	296.900	1,757,648.000	
	HUSQVARNA AB-B SHS	33,692	78.060	2,629,997.520	
	HEXAGON AB	18,360	495.600	9,099,216.000	
	ESSITY AB-B	51,357	225.600	11,586,139.200	
スウェーデン・クローネ 小計		1,734,246		241,948,383.040 (3,121,134,141)	
デンマーク・ク ローネ	CARLSBERG AS-B	7,330	693.600	5,084,088.000	
	A P MOLLER A/S	481	9,426.000	4,533,906.000	
	AP MOLLER MAERSK A	273	8,875.000	2,422,875.000	
	DANSKE BANK A/S	59,087	224.800	13,282,757.600	
	GENMAB A/S	4,613	1,210.000	5,581,730.000	
	NOVOZYMES-B SHS	15,904	307.500	4,890,480.000	
	NOVO NORDISK A/S-B	139,017	305.550	42,476,644.350	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	15,808	432.500	6,836,960.000	
	COLOPLAST-B	8,286	519.000	4,300,434.000	
	DSV A/S	13,040	478.100	6,234,424.000	
	WILLIAM DEMANT	6,537	230.000	1,503,510.000	
	H LUNDBECK A/S	4,840	348.700	1,687,708.000	
	TRYG A/S	11,107	141.200	1,568,308.400	
	PANDORA A/S	8,251	685.000	5,651,935.000	
	CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S	7,708	536.400	4,134,571.200	
ISS A/S	11,125	217.300	2,417,462.500		
ORSTED A/S	15,020	390.800	5,869,816.000		
デンマーク・クローネ 小計		328,427		118,477,610.050 (2,106,531,907)	
ニュージーラン ド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	97,992	6.400	627,148.800	

	FISHER & PAYKEL	60,000	13.370	802,200.000	
	FLETCHER BUILDING LTD	75,281	6.010	452,438.810	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	159,623	3.385	540,323.850	
ニュージーランド・ドル 小計		392,896		2,422,111.460 (191,177,257)	
ノルウェー・ク ローネ	MARINE HARVEST	33,000	171.500	5,659,500.000	
	DNB ASA	70,426	152.000	10,704,752.000	
	NORSK HYDRO ASA	91,879	48.440	4,450,618.760	
	TELENOR ASA	53,178	183.050	9,734,232.900	
	ORKLA ASA	61,421	84.700	5,202,358.700	
	STATOIL ASA	87,000	196.900	17,130,300.000	
	YARA INTERNATIONAL ASA	16,000	321.900	5,150,400.000	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	16,683	134.200	2,238,858.600	
ノルウェー・クローネ 小計		429,587		60,271,020.960 (828,123,828)	
ユーロ	CRH PLC	65,287	27.490	1,794,739.630	
	PADDY POWER BETFAIR PLC	6,246	81.750	510,610.500	
	KERRY GROUP PLC-A	11,576	84.350	976,435.600	
	UMICORE	15,320	43.040	659,372.800	
	AIR LIQUIDE	32,310	101.150	3,268,156.500	
	AIRBUS SE	43,659	95.420	4,165,941.780	
	AXA	146,116	22.220	3,246,697.520	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	34,622	19.255	666,646.610	
	ADIDAS AG	14,139	205.500	2,905,564.500	
	ASSICURAZIONI GENERALI	95,795	16.030	1,535,593.850	
	ABERTIS INFRASTRUCTURAS SA	57,216	18.210	1,041,903.360	
	DASSAULT AVIATION SA	157	1,623.000	254,811.000	
	DANONE	43,686	64.990	2,839,153.140	
	SAFRAN SA	25,571	88.620	2,266,102.020	
	INTESA SANPAOLO	1,052,513	3.036	3,195,429.460	
	INTESA SANPAOLO-RNC	51,178	3.155	161,466.590	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	24,725	89.990	2,225,002.750	
	ACCOR SA	16,000	44.130	706,080.000	
	BOSKALIS WESTMINSTER CT	7,563	24.060	181,965.780	
	BOUYGUES	13,996	42.100	589,231.600	
	BNP PARIBAS	82,934	61.310	5,084,683.540	
	RELX NV	70,826	17.525	1,241,225.650	
	THALES SA	8,128	101.550	825,398.400	
	CAPGEMINI SA	11,481	104.400	1,198,616.400	
	CASINO GUICHARD PERRACHON	4,264	41.070	175,122.480	
	INGENICO GROUP	4,334	72.700	315,081.800	
UNICREDIT SPA	142,664	17.150	2,446,687.600		
NATIXIS	70,166	6.698	469,971.860		
KONINKLIJKE DSM NV	13,216	83.020	1,097,192.320		

COMMERZBANK AG	83,118	10.938	909,144.680	
EIFFAGE	4,777	94.600	451,904.200	
FRESENIUS SE & CO KGAA	32,777	63.960	2,096,416.920	
UNITED INTERNET	9,882	52.300	516,828.600	
FUCHS PETROLUB SE PREF	5,546	43.360	240,474.560	
PUBLICIS GROUPE	15,068	56.700	854,355.600	
MAN SE	3,396	96.150	326,525.400	
FAURECIA	8,000	67.660	541,280.000	
IBERDROLA SA	416,818	6.028	2,512,578.900	
ENI SPA	200,300	15.134	3,031,340.200	
IMERYS SA	2,256	80.000	180,480.000	
JERONIMO MARTINS	19,517	14.310	279,288.270	
KBC GROUPE	18,378	71.520	1,314,394.560	
HANNOVER RUECK SE	4,868	113.700	553,491.600	
WARTSILA OYJ	34,935	18.365	641,581.270	
L'OREAL	19,036	191.600	3,647,297.600	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	20,764	275.150	5,713,214.600	
LAGARDERE S.C.A.	9,600	23.260	223,296.000	
GEA GROUP AG	11,838	34.700	410,778.600	
BOLLORE	71,347	4.456	317,922.230	
MEDIOBANCA SPA	42,404	9.842	417,340.160	
MICHELIN(CGDE)-B	12,118	121.650	1,474,154.700	
CONTINENTAL AG	7,776	228.300	1,775,260.800	
DEUTSCHE POST AG-REG	69,944	36.520	2,554,354.880	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	14,426	13.680	197,347.680	
NOKIAN RENKAAT OYJ	9,399	34.710	326,239.290	
AXEL SPRINGER SE	3,067	68.650	210,549.550	
OMV AG	9,766	49.070	479,217.620	
PERNOD-RICARD	15,401	139.600	2,149,979.600	
PEUGEOT SA	42,232	20.390	861,110.480	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG- PFD	10,591	69.860	739,887.260	
RENAULT SA	15,632	96.020	1,500,984.640	
REPSOL SA	93,766	15.295	1,434,150.970	
REMY COINTREAU	1,860	118.100	219,666.000	
MERCK KGAA	9,551	80.680	770,574.680	
COMPAGNIE DE SAINT- GOBAIN	35,706	43.270	1,544,998.620	
RWE AG	39,183	20.090	787,186.470	
SEB SA	1,405	157.700	221,568.500	
LUXOTTICA GROUP SPA	11,602	52.160	605,160.320	
SOCIETE GENERALE-A	58,110	44.205	2,568,752.550	
VINCI S.A.	38,902	81.100	3,154,952.200	
SODEXO	6,286	79.420	499,234.120	
SOLVAY SA	5,036	113.350	570,830.600	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	42,631	70.760	3,016,569.560	
VIVENDI SA	79,680	21.440	1,708,339.200	

SAP SE	73,011	87.510	6,389,192.610	
TELEFONICA S.A	358,674	8.196	2,939,692.100	
TOTAL SA	177,111	48.810	8,644,787.910	
VALEO	17,731	53.980	957,119.380	
E.ON SE	164,012	8.911	1,461,510.930	
VOEST-ALPINE AG	9,875	43.140	426,007.500	
HENKEL AG & CO KGAA	9,142	99.000	905,058.000	
SIEMENS AG-REG	56,716	105.300	5,972,194.800	
UPM-KYMMENE OYJ	41,197	29.020	1,195,536.940	
ING GROEP NV-CVA	294,820	13.792	4,066,157.440	
BAYER AG	61,526	97.850	6,020,319.100	
STORA ENSO OYJ-R SHS	42,303	15.310	647,658.930	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	12,178	104.200	1,268,947.600	
DAIMLER AG	72,949	65.740	4,795,667.260	
BASF SE	69,380	84.040	5,830,695.200	
BEIERSDORF AG	6,780	92.760	628,912.800	
HOCHTIEF AG	1,707	150.000	256,050.000	
HEIDELBERGCEMENT AG	11,009	81.200	893,930.800	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	15,048	83.540	1,257,109.920	
ORANGE	141,819	14.160	2,008,157.040	
SAMPO OYJ-A SHS	36,533	45.170	1,650,195.610	
RANDSTAD HOLDINGS	7,794	55.840	435,216.960	
ALLIANZ SE	32,994	188.480	6,218,709.120	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	152,374	3.201	487,749.170	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	100,000	19.720	1,972,000.000	
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	17,602	29.540	519,963.080	
HERMES INTL	2,285	504.000	1,151,640.000	
ENDESA S.A.	21,037	18.030	379,297.110	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	15,963	26.880	429,085.440	
ERSTE GROUP BANK AG	20,754	40.240	835,140.960	
MUENCHENER RUECKVER AG- REG	11,602	194.200	2,253,108.400	
ARCELOR MITTAL (NL)	47,245	26.275	1,241,362.370	
SOCIETE BIC SA	2,478	81.700	202,452.600	
DASSAULT SYSTEMES SA	8,961	111.450	998,703.450	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	15,249	33.150	505,504.350	
HEINEKEN NV	20,425	90.080	1,839,884.000	
AKZO NOBEL	18,209	79.060	1,439,603.540	
ASML HOLDING NV	29,667	165.550	4,911,371.850	
AEGON NV	120,404	5.706	687,025.220	
BANKINTER S.A.	57,960	8.412	487,559.520	
VOLKSWAGEN AG	3,204	169.600	543,398.400	
VOLKSWAGEN AG PFD	13,134	171.580	2,253,531.720	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	504,414	6.421	3,238,842.290	

KERING	5,479	429.300	2,352,134.700	
CNP ASSURANCES	13,987	21.380	299,042.060	
FORTUM OYJ	29,739	17.175	510,767.320	
AGEAS	12,993	42.760	555,580.680	
UCB SA	8,747	67.720	592,346.840	
THYSSENKRUPP AG	29,903	22.160	662,650.480	
UNILEVER NV-CVA	121,914	46.010	5,609,263.140	
CARREFOUR SA	39,144	16.450	643,918.800	
GAS NATURAL SDG SA	29,010	19.750	572,947.500	
ATOS SE	7,050	112.850	795,592.500	
NOKIA OYJ	417,248	4.490	1,873,443.520	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	73,000	32.170	2,348,410.000	
WOLTERS KLUWER-CVA	20,558	43.980	904,140.840	
SANOFI	84,037	67.000	5,630,479.000	
STMICROELECTRONICS NV	45,866	17.885	820,313.410	
ELISA OYJ	9,517	37.880	360,503.960	
BANCO SANTANDER SA	1,201,199	5.349	6,425,213.450	
METSO OYJ	8,585	25.100	215,483.500	
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	34,596	16.340	565,298.640	
QIAGEN N.V.	13,642	25.980	354,419.160	
1&1 DRILLISCH AG	3,149	56.450	177,761.050	
DEUTSCHE BANK AG-REG	149,244	11.432	1,706,157.400	
BMW VORZUG	4,116	78.300	322,282.800	
K & S	14,982	24.250	363,313.500	
ENEL SPA	579,218	5.076	2,940,110.560	
COLRUYT NV	4,673	45.250	211,453.250	
VOPAK (KON.)	5,364	40.730	218,475.720	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	257,485	13.555	3,490,209.170	
LEONARDO SPA	26,269	9.524	250,185.950	
UBISOFT ENTERTAINMENT	3,930	73.300	288,069.000	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	81,774	21.390	1,749,145.860	
KONINKLIJKE KPN NV	228,967	2.432	556,847.740	
EUROFINS SCIENTIFIC	794	424.600	337,132.400	
UNIPOLSAI SPA	91,992	2.018	185,639.850	
TELEPERFORMANCE	3,607	126.100	454,842.700	
DEUTSCHE BOERSE AG	13,844	114.500	1,585,138.000	
EURAZEO	4,500	74.500	335,250.000	
BANCO SABADELL	367,753	1.693	622,605.820	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	5,814	95.020	552,446.280	
FRAPORT AG	3,149	80.000	251,920.000	
HEINEKEN HOLDING NV-A	8,014	87.550	701,625.700	
INDITEX	82,035	25.650	2,104,197.750	
JC DECAUX SA	6,058	28.240	171,077.920	
ANDRITZ AG	6,265	45.900	287,563.500	
MAPFRE SA	84,474	2.742	231,627.700	
ESSILOR INTL	14,632	113.000	1,653,416.000	
SNAM SPA	158,419	3.832	607,061.600	

CREDIT AGRICOLE SA	85,585	13.260	1,134,857.100	
ENAGAS	18,095	22.700	410,756.500	
WENDEL	2,220	124.000	275,280.000	
WIRECARD AG	7,990	102.650	820,173.500	
TENARIS SA	30,372	14.705	446,620.260	
TELECOM ITALIA SPA	792,163	0.880	697,103.440	
TELECOM ITALIA-RNC	497,596	0.750	373,197.000	
ATLANTIA SPA	34,969	26.800	937,169.200	
ILIAD SA	2,102	161.650	339,788.300	
PROXIMUS	14,283	25.400	362,788.200	
SES FDR	24,585	11.425	280,883.620	
TERNA SPA	142,206	4.777	679,318.060	
BIOMERIEUX	4,702	66.000	310,332.000	
GRIFOLS SA	18,800	23.120	434,656.000	
FERROVIAL SA	36,997	17.415	644,302.750	
LANXESS AG	6,856	61.800	423,700.800	
NESTE OYJ	8,839	56.680	500,994.520	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	9,641	27.600	266,091.600	
RECORDATI SPA	6,859	29.570	202,820.630	
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	35,583	6.385	227,197.450	
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	5,059	139.000	703,201.000	
KONE OYJ	23,717	40.140	952,000.380	
ENGIE	139,590	13.830	1,930,529.700	
ALSTOM	12,046	36.570	440,522.220	
TELENET GROUP HOLDING NV	3,634	53.350	193,873.900	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	12,542	17.455	218,920.610	
ELECTRICITE DE FRANCE	34,756	11.180	388,572.080	
IPSEN SA	2,487	126.850	315,475.950	
DEUTSCHE WOHNEN	26,714	38.090	1,017,536.260	
ARKEMA SA	6,507	106.150	690,718.050	
LEGRAND SA	19,920	62.400	1,243,008.000	
ADP	2,313	179.400	414,952.200	
ORION OYJ	8,051	25.070	201,838.570	
RTL GROUP SA	3,446	68.950	237,601.700	
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	37,921	16.025	607,684.020	
SYMRISE AG	12,199	64.200	783,175.800	
SCOR SE	13,875	34.390	477,161.250	
REXEL SA	23,245	13.530	314,504.850	
PRYSMIAN SPA	14,925	24.730	369,095.250	
CAIXABANK	262,372	3.981	1,044,502.930	
BUREAU VERITAS SA	21,480	21.050	452,154.000	
GETLINK	37,646	11.650	438,575.900	
SUEZ SA	25,406	11.845	300,934.070	
AMADEUS IT GROUP SA	32,520	62.020	2,016,890.400	
BRENNTAG AG	12,353	48.470	598,749.910	

	INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GROUP SA	44,747	7.202	322,267.890	
	EVONIK INDUSTRIES AG	11,575	29.110	336,948.250	
	EDENRED	18,306	29.090	532,521.540	
	BANKIA SA	100,675	3.722	374,712.350	
	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	61,541	3.779	232,563.430	
	HUGO BOSS AG -ORD	5,218	74.200	387,175.600	
	OSRAM LICHT AG	7,017	58.860	413,020.620	
	KION GROUP AG	4,686	78.140	366,164.040	
	VONOVIA SE	35,308	40.030	1,413,379.240	
	BANK OF IRELAND GROUP PLC	73,287	7.280	533,529.360	
	SIEMENS HEALTHINEERS AG	10,000	33.085	330,850.000	
	FERRARI NV	9,503	98.560	936,615.680	
	METRO AG	10,774	14.060	151,482.440	
	INNOGY SE	9,769	38.020	371,417.380	
	CNH INDUSTRIAL NV	78,645	9.808	771,350.160	
	AIB GROUP PLC	52,322	4.850	253,761.700	
	LINDE AG-TENDER	13,375	174.700	2,336,612.500	
	NN GROUP NV	21,965	37.030	813,363.950	
	ZALANDO SE	6,674	44.280	295,524.720	
	FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	76,719	18.780	1,440,782.820	
	AENA SME SA	5,256	170.100	894,045.600	
	ABN AMRO GROUP NV	29,129	25.130	732,011.770	
	EXOR NV	7,726	60.160	464,796.160	
	ALTICE NV-A	43,403	7.190	312,067.570	
	COVESTRO AG	12,239	81.360	995,765.040	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	57,180	88.340	5,051,281.200	
	POSTE ITALIANE SPA	40,015	7.684	307,475.260	
	AMUNDI SA	3,894	64.880	252,642.720	
	SCHAEFFLER AG	12,644	12.800	161,843.200	
	UNIPER SE	13,897	23.550	327,274.350	
ユーロ	小計	14,601,050		294,522,903.890 (38,988,942,017)	
香港・ドル	ASM PACIFIC TECH	16,600	109.400	1,816,040.000	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	164,000	18.500	3,034,000.000	
	BANK OF EAST ASIA	76,260	32.250	2,459,385.000	
	CLP HOLDINGS LTD	119,500	80.500	9,619,750.000	
	PCCW LTD	331,000	4.660	1,542,460.000	
	LI & FUNG LTD	532,400	3.970	2,113,628.000	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	49,000	62.900	3,082,100.000	
	HONG KONG EXCHANGES &CLEAR	94,340	260.800	24,603,872.000	
	MTR CORP	118,500	42.800	5,071,800.000	

HANG LUNG GROUP LTD	63,000	25.450	1,603,350.000	
HANG SENG BANK LTD	56,000	186.600	10,449,600.000	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	83,844	51.700	4,334,734.800	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	96,500	60.450	5,833,425.000	
(THE) WHARF HOLDINGS LTD	95,750	26.700	2,556,525.000	
HONG KONG & CHINA GAS	610,046	16.180	9,870,544.280	
HYSAN DEVELOPMENT CO	50,000	42.900	2,145,000.000	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	186,000	73.200	13,615,200.000	
KERRY PROPERTIES LTD	33,000	36.200	1,194,600.000	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	262,000	37.400	9,798,800.000	
YUE YUEN INDUSTRIAL HOLDINGS	50,500	28.000	1,414,000.000	
NEW WORLD DEVELOPMENT	441,266	11.460	5,056,908.360	
SHANGRI-LA ASIA LTD	172,000	15.840	2,724,480.000	
SINO LAND CO	255,400	13.340	3,407,036.000	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	114,000	128.700	14,671,800.000	
SWIRE PACIFIC LTD A	30,000	80.500	2,415,000.000	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	113,500	44.700	5,073,450.000	
WHEELLOCK & CO LTD	56,000	58.450	3,273,200.000	
KINGSTON FINANCIAL GROUP LTD	258,000	3.300	851,400.000	
MINTH GROUP LTD	44,000	37.600	1,654,400.000	
SJM HOLDINGS LTD	156,000	6.950	1,084,200.000	
WYNN MACAU LTD	124,400	28.450	3,539,180.000	
MGM CHINA HOLDINGS LTD	64,800	21.000	1,360,800.000	
AIA GROUP LTD	904,027	68.400	61,835,446.800	
HKT TRUST / HKT LTD	282,000	9.940	2,803,080.000	
SANDS CHINA LTD	169,200	43.850	7,419,420.000	
SWIRE PROPERTIES LTD	104,200	27.500	2,865,500.000	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT CO LTD	95,750	54.950	5,261,462.500	
HK ELECTRIC INVESTMENTS & HK ELECTRIC INVESTMENTS LTD	230,000	7.650	1,759,500.000	
WH GROUP LTD	701,500	8.660	6,074,990.000	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	199,332	92.350	18,408,310.200	
CK ASSET HOLDINGS LTD	184,332	66.000	12,165,912.000	
香港・ドル 小計	7,787,947		279,864,289.940 (3,817,348,915)	
合計	84,752,617		283,677,819,387 (283,677,819,387)	

(2) 株式以外の有価証券

平成30年4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	601,174.980	
		GOODMAN GROUP	121,619.000	1,047,139.590	
		GPT GROUP	144,955.000	694,334.450	
		LENLEASE GROUP	37,363.000	657,588.800	
		MIRVAC GROUP	295,783.000	653,680.430	
		SCENTRE GROUP	383,688.000	1,515,567.600	
		STOCKLAND	249,006.000	1,008,474.300	
		VICINITY CENTRES	270,443.000	657,176.490	
	WESTFIELD CORP	140,035.000	1,236,509.050		
	オーストラリア・ドル	小計	1,706,711.000	8,071,645.690 (671,076,622)	
	シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	200,806.000	544,184.260	
		CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	384,800.000	708,032.000	
		CAPITALAND MALL TRUST	199,000.000	415,910.000	
		SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	192,100.000	359,227.000	
	シンガポール・ドル	小計	976,706.000	2,027,353.260 (165,817,223)	
	投資信託受益証券	合計	2,683,417	836,893,845 (836,893,845)	
投資証券	アメリカ・ドル	AGNC INVESTMENT CORP	25,741.000	482,386.340	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	7,304.000	888,896.800	
		AMERICAN TOWER CORP	31,949.000	4,389,792.600	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	77,528.000	807,841.760	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	9,642.000	1,608,189.180	
		BOSTON PROPERTIES INC	11,168.000	1,356,353.600	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	21,975.000	328,526.250	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	6,285.000	534,916.350	
		COLONY NORTHSTAR INC	39,311.000	219,355.380	
		CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	30,388.000	3,149,412.320	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	15,118.000	1,564,410.640	
		DUKE REALTY TRUST	24,470.000	629,123.700	
		EQUINIX INC	5,887.000	2,387,708.330	
		EQUITY RESIDENTIAL	27,070.000	1,697,289.000	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	4,524.000	1,094,581.800	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	8,141.000	712,988.780	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	8,000.000	926,080.000	
		GGP INC	43,463.000	875,779.450	
		HCP INC	34,130.000	785,672.600	

	HOST HOTELS & RESORTS INC	51,147.000	933,432.750	
	INVITATION HOMES INC	22,567.000	513,173.580	
	IRON MOUNTAIN INC	19,265.000	644,606.900	
	KIMCO REALTY	32,980.000	471,943.800	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	11,649.000	457,106.760	
	MID AMERICA	8,123.000	748,778.140	
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	10,544.000	412,586.720	
	PROLOGIS INC	38,966.000	2,400,305.600	
	PUBLIC STORAGE	11,151.000	2,235,217.950	
	REALTY INCOME CORP	18,985.000	981,904.200	
	REGENCY CENTERS CORP	11,294.000	666,120.120	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	8,169.000	1,332,118.830	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	23,209.000	3,595,770.370	
	SL GREEN	9,397.000	894,500.430	
	THE MACERICH COMPANY	9,014.000	521,009.200	
	UDR INC	17,458.000	624,821.820	
	VENTAS INC	25,041.000	1,233,770.070	
	VEREIT INC	72,429.000	497,587.230	
	VORNADO REALTY TRUST	12,211.000	821,678.190	
	WELLTOWER INC	26,516.000	1,431,864.000	
	WEYERHAEUSER CO	56,867.000	2,014,229.140	
アメリカ・ドル 小計		929,076.000	47,871,830.680 (5,127,073,066)	
イギリス・ボンド	BRITISH LAND CO PLC	71,871.000	469,748.850	
	HAMMERSON PLC	58,616.000	307,734.000	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	71,358.000	677,544.210	
	SEGRO PLC	104,000.000	637,312.000	
イギリス・ボンド 小計		305,845.000	2,092,339.060 (317,742,609)	
カナダ・ドル	H & R REAL ESTATE INVESTMENT	10,748.000	224,203.280	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	9,675.000	226,782.000	
	SMARTCENTRES REIT	2,582.000	75,600.960	
カナダ・ドル 小計		23,005.000	526,586.240 (44,759,831)	
ユーロ	FONCIERE DES REGIONS	2,343.000	207,589.800	
	GECINA SA	3,670.000	518,571.000	
	ICADE	2,234.000	177,826.400	
	KLEPIERRE	17,042.000	561,704.320	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	7,221.000	1,365,852.150	
ユーロ 小計		32,510.000	2,831,543.670 (374,839,751)	
香港・ドル	LINK REIT	163,500.000	11,150,700.000	
香港・ドル 小計		163,500.000	11,150,700.000 (152,095,548)	

投資証券 合計	1,453,936	6,016,510,805 (6,016,510,805)	
合計		6,853,404,650 (6,853,404,650)	

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 601銘柄	62.24%	-%	-%	65.38%
	投資証券 40銘柄	-%	-%	1.73%	
イギリス・ポンド	株式 100銘柄	7.03%	-%	-%	7.29%
	投資証券 4銘柄	-%	-%	0.11%	
イスラエル・シェケル	株式 9銘柄	0.10%	-%	-%	0.10%
オーストラリア・ドル	株式 59銘柄	2.45%	-%	-%	2.74%
	投資信託 受益証券 9銘柄	-%	0.23%	-%	
カナダ・ドル	株式 87銘柄	3.61%	-%	-%	3.71%
	投資証券 3銘柄	-%	-%	0.02%	
シンガポール・ドル	株式 20銘柄	0.48%	-%	-%	0.55%
	投資信託 受益証券 4銘柄	-%	0.06%	-%	
スイス・フラン	株式 37銘柄	3.10%	-%	-%	3.16%
スウェーデン・クローナ	株式 31銘柄	1.05%	-%	-%	1.07%
デンマーク・クローネ	株式 17銘柄	0.71%	-%	-%	0.73%
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	0.28%	-%	-%	0.29%
ユーロ	株式 239銘柄	13.13%	-%	-%	13.55%
	投資証券 5銘柄	-%	-%	0.13%	
香港・ドル	株式 41銘柄	1.29%	-%	-%	1.37%
	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10月11日現在	平成30年4月11日現在
資産の部			
流動資産			
預金		4,395,152,469	2,570,263,021
コール・ローン		216,506,999	224,055,852
国債証券		232,183,105,825	207,030,932,658
未収利息		2,166,949,376	1,932,723,939
前払費用		37,495,376	29,899,314
流動資産合計		238,999,210,045	211,787,874,784
資産合計		238,999,210,045	211,787,874,784
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		212,098	1,135,127
未払金		-	2,178,181,339
未払解約金		115,111,000	258,963,000
流動負債合計		115,323,098	2,438,279,466
負債合計		115,323,098	2,438,279,466
純資産の部			
元本等			
元本	1	129,831,961,732	115,824,125,042
剰余金			
剰余金又は欠損金()		109,051,925,215	93,525,470,276
元本等合計		238,883,886,947	209,349,595,318
純資産合計		238,883,886,947	209,349,595,318
負債純資産合計		238,999,210,045	211,787,874,784

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	平成29年10月11日現在	平成30年4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	142,468,499,989円	129,831,961,732円
同期中追加設定元本額	10,223,926,086円	11,892,631,520円
同期中一部解約元本額	22,860,464,343円	25,900,468,210円
元本の内訳		
ファンド名		
DIAM外国債券パッシブ・ファンド	6,762,047,778円	6,942,722,213円
MITO ラップ型ファンド（安定型）	18,374,787円	14,295,981円
MITO ラップ型ファンド（中立型）	50,647,054円	38,214,549円
MITO ラップ型ファンド（積極型）	59,836,994円	47,727,917円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	44,669,472円	76,241,137円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	51,686,380円	79,108,387円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	40,073,250円	44,833,056円
たわらノーロード 先進国債券	1,033,700,681円	1,705,415,252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）	7,337,910円	29,415,133円
たわらノーロード バランス（堅実型）	-円	453,206円

たわらノーロード バランス (標準型)	- 円	2,163,239円
たわらノーロード バランス (積極型)	- 円	860,802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	76,538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	4,264,143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	2,488,857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	625,201円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定型)	- 円	83,913円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定成長型)	- 円	392,432円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(成長型)	- 円	220,283円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(積極型)	- 円	337,035円
D I A M外国債券インデックス ファンド< D C年金>	4,916,674,933円	5,079,413,296円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 1 安定型	455,372,807円	491,792,934円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 2 安定・成長型	1,489,280,019円	1,591,909,852円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 3 成長型	1,543,316,647円	1,690,571,535円
D I A M D C バランス3 0 インデックスファンド	358,729,368円	373,223,365円
D I A M D C バランス5 0 インデックスファンド	765,153,538円	794,591,614円
D I A M D C バランス7 0 インデックスファンド	582,487,469円	627,578,064円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型>	25,451,454円	23,962,825円
マネックス資産設計ファンド< 育成型>	600,460,341円	599,670,192円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	8,668,156円	17,303,931円
D I A M D C 8 資産バラ ンスファンド(新興国1 0)	16,036,948円	18,007,015円
D I A M D C 8 資産バラ ンスファンド(新興国2 0)	33,332,779円	40,891,423円
D I A M D C 8 資産バラ ンスファンド(新興国3 0)	58,832,904円	75,523,877円
クルーズコントロール D I A M 8 資産バランスファ ンドN< D C年金>	2,661,219,944円 59,102,207円	471,522,151円 72,533,521円
D I A M D C バランス・F (成長型)	94,013,808円	125,520,919円

クルーズコントロール<DC年金>	1,061,335円	175,031円
DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)	11,905,134円	1,547,650円
DIAMコア資産設計ファンド(積極型)	32,021,457円	4,761,061円
ダイナミック・ナビゲーション	365,719円	303,476円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	-円	1,302,909円
DIAMパッシブ資産分散ファンド	1,481,037,130円	1,370,643,849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)	7,003,675,809円	7,213,878,854円
DIAM外国債券パッシブファンド(適格機関投資家向け)	4,400,928,657円	4,074,076,473円
外国債券パッシブファンド(適格機関投資家限定)	4,149,925,792円	3,312,147,806円
先進国債券パッシブファンド(適格機関投資家限定)	576,382,992円	575,438,442円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	105,167,308円	105,085,382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)	1,024,861,880円	920,591,104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)	735,971,985円	685,875,564円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	63,587,907円	55,601,422円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	132,619,902円	104,345,750円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	29,420,321円	25,601,826円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	12,367,624円	9,958,112円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	82,917,602円	67,333,025円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	91,738,276円	81,674,125円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	3,915,033,559円	3,688,649,971円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	2,575,408,323円	2,415,722,822円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	4,281,038,520円	4,073,380,482円

D I A Mグローバル・アセ ト・バランスV A (適格機関投 資家限定)	789,374,611円	736,405,912円
D I A Mグローバル・アセ ト・バランスV A 2 (適格機関 投資家限定)	748,687,418円	429,854,135円
D I A M アクサ グローバ ル バランスファンド30V A (適格機関投資家限定)	3,711,066,612円	3,491,651,220円
D I A M世界アセットバランス ファンドV A (適格機関投資家 向け)	13,444,120,680円	7,013,788,927円
D I A Mグローバル 私募ファ ンド(適格機関投資家向け)	13,975,529円	13,975,529円
D I A M世界バランスファンド 55V A (適格機関投資家限 定)	367,681,699円	48,037,463円
D I A M世界バランスファンド 35V A (適格機関投資家限 定)	5,427,123,850円	1,811,767,262円
D I A M世界アセットバランス ファンド2V A (適格機関投資 家限定)	15,305,707,465円	14,993,606,270円
D I A M世界アセットバランス ファンド3V A (適格機関投資 家限定)	19,725,694,885円	19,659,509,959円
D I A Mバランス30V A (適 格機関投資家限定)	14,585,789円	22,077,367円
D I A Mバランス50V A (適 格機関投資家限定)	16,997,854円	1,004,502円
D I A Mバランス70V A (適 格機関投資家限定)	6,104,411円	5,430,556円
D I A M世界アセットバランス ファンド4V A (適格機関投資 家限定)	17,584,719,440円	17,503,085,704円
D I A M世界バランス25V A (適格機関投資家限定)	106,638,471円	105,728,406円
D I A Mバランス20V A (適 格機関投資家限定)	124,537,679円	115,018,539円
D I A Mバランス40V A (適 格機関投資家限定)	237,498円	362,917円
D I A Mバランス60V A (適 格機関投資家限定)	156,569円	163,038円
計	129,831,961,732円	115,824,125,042円
2 . 受益権の総数	129,831,961,732口	115,824,125,042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4月12日 至 平成29年10月11日	自 平成29年10月12日 至 平成30年4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10月11日現在	平成30年4月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成29年10月11日現在	平成30年4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	325,844,085	2,200,997,145
合計	325,844,085	2,200,997,145

(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10月11日まで及び平成30年2月22日から平成30年4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10月11日 現在				平成30年4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	64,890,994	-	65,062,200	171,206	190,235,030	-	191,127,930	892,900
アメリカ・ドル	-	-	-	-	95,103,558	-	95,417,190	313,632
ユーロ	64,890,994	-	65,062,200	171,206	95,131,472	-	95,710,740	579,268
買 建	668,376,422	-	668,335,530	40,892	3,774,409,887	-	3,774,167,660	242,227
アメリカ・ドル	300,629,777	-	300,600,330	29,447	1,622,948,950	-	1,622,797,400	151,550
イギリス・ポンド	100,188,900	-	100,183,500	5,400	301,893,704	-	301,877,800	15,904
オーストラリア・ドル	-	-	-	-	75,401,631	-	75,398,910	2,721
カナダ・ドル	-	-	-	-	113,131,007	-	113,121,690	9,317
ユーロ	267,557,745	-	267,551,700	6,045	1,661,034,595	-	1,660,971,860	62,735
合計	733,267,416	-	733,397,730	212,098	3,964,644,917	-	3,965,295,590	1,135,127

（注）時価の算定方法

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

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

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

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

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	平成29年10月11日現在	平成30年4月11日現在
1口当たり純資産額	1.8399円	1.8075円
（1万口当たり純資産額）	（18,399円）	（18,075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4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	14,737,950.000	
		US T N/B 1.0 08/31/19	13,500,000.000	13,269,960.000	
		US T N/B 1.0 09/30/19	15,000,000.000	14,728,650.000	
		US T N/B 1.0 11/30/19	6,500,000.000	6,365,645.000	
		US T N/B 1.125 05/31/19	11,000,000.000	10,871,520.000	
		US T N/B 1.25 01/31/20	10,800,000.000	10,597,500.000	
		US T N/B 1.25 10/31/19	15,000,000.000	14,767,350.000	
		US T N/B 1.375 01/31/20	8,600,000.000	8,459,562.000	
		US T N/B 1.375 03/31/20	6,300,000.000	6,182,820.000	
		US T N/B 1.375 04/30/20	12,000,000.000	11,763,720.000	
		US T N/B 1.375 05/31/20	3,500,000.000	3,427,235.000	
		US T N/B 1.375 06/30/23	7,000,000.000	6,567,960.000	
		US T N/B 1.375 09/30/23	11,000,000.000	10,281,480.000	
		US T N/B 1.5 08/15/26	7,000,000.000	6,330,590.000	
		US T N/B 1.625 02/15/26	5,500,000.000	5,053,950.000	
		US T N/B 1.625 03/31/19	3,700,000.000	3,682,055.000	
		US T N/B 1.625 05/15/26	8,500,000.000	7,790,760.000	
		US T N/B 1.625 08/15/22	9,500,000.000	9,127,030.000	
		US T N/B 1.625 11/15/22	13,500,000.000	12,930,435.000	
		US T N/B 1.75 01/31/23	10,000,000.000	9,607,800.000	
		US T N/B 1.75 03/31/22	11,700,000.000	11,348,064.000	
		US T N/B 1.75 05/15/22	11,600,000.000	11,236,572.000	
		US T N/B 1.75 05/15/23	7,000,000.000	6,702,990.000	
		US T N/B 1.75 09/30/22	12,500,000.000	12,051,750.000	
		US T N/B 1.75 10/31/20	6,000,000.000	5,902,020.000	
		US T N/B 1.75 12/31/20	9,000,000.000	8,840,340.000	
		US T N/B 1.875 06/30/20	11,000,000.000	10,879,220.000	
		US T N/B 1.875 08/31/22	12,000,000.000	11,645,520.000	
		US T N/B 1.875 08/31/24	8,000,000.000	7,610,000.000	
		US T N/B 2.0 02/15/22	17,500,000.000	17,154,025.000	
		US T N/B 2.0 02/15/23	9,500,000.000	9,232,005.000	
		US T N/B 2.0 02/15/25	9,500,000.000	9,060,625.000	
		US T N/B 2.0 05/31/21	12,000,000.000	11,826,480.000	
		US T N/B 2.0 05/31/24	10,000,000.000	9,599,200.000	
US T N/B 2.0 08/15/25	9,000,000.000	8,549,280.000			
US T N/B 2.0 09/30/20	6,000,000.000	5,940,900.000			
US T N/B 2.0 11/15/21	10,400,000.000	10,215,504.000			
US T N/B 2.0 11/15/26	7,000,000.000	6,575,590.000			
US T N/B 2.0 11/30/20	10,500,000.000	10,386,705.000			
US T N/B 2.125 01/31/21	5,000,000.000	4,957,400.000			

US T N/B 2.125 05/15/25	5,000,000.000	4,799,200.000	
US T N/B 2.125 06/30/22	9,500,000.000	9,330,710.000	
US T N/B 2.125 08/15/21	11,000,000.000	10,862,830.000	
US T N/B 2.125 08/31/20	3,000,000.000	2,980,530.000	
US T N/B 2.125 09/30/21	10,000,000.000	9,870,300.000	
US T N/B 2.125 09/30/24	8,000,000.000	7,718,080.000	
US T N/B 2.125 12/31/21	15,700,000.000	15,471,722.000	
US T N/B 2.125 12/31/22	8,000,000.000	7,825,600.000	
US T N/B 2.25 02/15/27	8,000,000.000	7,653,680.000	
US T N/B 2.25 03/31/21	11,500,000.000	11,432,610.000	
US T N/B 2.25 08/15/27	8,000,000.000	7,636,800.000	
US T N/B 2.25 08/15/46	4,500,000.000	3,840,075.000	
US T N/B 2.25 11/15/24	10,600,000.000	10,294,402.000	
US T N/B 2.25 11/15/25	7,000,000.000	6,753,880.000	
US T N/B 2.25 11/15/27	8,100,000.000	7,723,431.000	
US T N/B 2.25 12/31/23	8,000,000.000	7,817,440.000	
US T N/B 2.375 05/15/27	9,000,000.000	8,694,810.000	
US T N/B 2.375 08/15/24	8,900,000.000	8,723,335.000	
US T N/B 2.375 12/31/20	8,300,000.000	8,288,961.000	
US T N/B 2.5 02/15/45	4,500,000.000	4,076,010.000	
US T N/B 2.5 02/15/46	5,000,000.000	4,512,850.000	
US T N/B 2.5 05/15/24	9,000,000.000	8,896,590.000	
US T N/B 2.5 05/15/46	4,400,000.000	3,968,228.000	
US T N/B 2.5 08/15/23	8,000,000.000	7,940,560.000	
US T N/B 2.625 08/15/20	16,500,000.000	16,586,295.000	
US T N/B 2.625 11/15/20	6,000,000.000	6,030,660.000	
US T N/B 2.75 02/15/24	9,400,000.000	9,432,242.000	
US T N/B 2.75 08/15/42	2,800,000.000	2,686,460.000	
US T N/B 2.75 08/15/47	6,100,000.000	5,772,125.000	
US T N/B 2.75 11/15/23	10,000,000.000	10,042,900.000	
US T N/B 2.75 11/15/42	3,400,000.000	3,258,390.000	
US T N/B 2.75 11/15/47	1,300,000.000	1,231,334.000	
US T N/B 2.875 05/15/43	3,700,000.000	3,620,783.000	
US T N/B 2.875 08/15/45	4,900,000.000	4,774,413.000	
US T N/B 2.875 11/15/46	4,400,000.000	4,277,944.000	
US T N/B 3.0 02/15/47	5,200,000.000	5,180,864.000	
US T N/B 3.0 05/15/42	2,270,000.000	2,278,853.000	
US T N/B 3.0 05/15/45	5,000,000.000	4,992,550.000	
US T N/B 3.0 05/15/47	6,900,000.000	6,865,500.000	
US T N/B 3.0 11/15/44	5,100,000.000	5,094,798.000	
US T N/B 3.0 11/15/45	3,900,000.000	3,891,147.000	
US T N/B 3.125 02/15/42	1,800,000.000	1,846,674.000	
US T N/B 3.125 02/15/43	2,600,000.000	2,661,126.000	
US T N/B 3.125 05/15/19	13,000,000.000	13,133,510.000	
US T N/B 3.125 05/15/21	8,000,000.000	8,153,680.000	
US T N/B 3.125 08/15/44	4,600,000.000	4,700,602.000	
US T N/B 3.125 11/15/41	1,800,000.000	1,846,602.000	
US T N/B 3.375 05/15/44	5,200,000.000	5,549,752.000	
US T N/B 3.375 11/15/19	4,000,000.000	4,067,480.000	

US T N/B 3.5 02/15/39	1,300,000.000	1,419,938.000	
US T N/B 3.5 05/15/20	14,000,000.000	14,319,340.000	
US T N/B 3.625 02/15/20	15,300,000.000	15,656,796.000	
US T N/B 3.625 02/15/21	5,500,000.000	5,678,530.000	
US T N/B 3.625 02/15/44	5,000,000.000	5,559,750.000	
US T N/B 3.625 08/15/19	5,000,000.000	5,090,600.000	
US T N/B 3.625 08/15/43	4,200,000.000	4,667,880.000	
US T N/B 3.75 08/15/41	2,000,000.000	2,264,200.000	
US T N/B 3.75 11/15/43	4,900,000.000	5,556,110.000	
US T N/B 3.875 08/15/40	2,100,000.000	2,417,457.000	
US T N/B 4.25 05/15/39	1,630,000.000	1,971,908.800	
US T N/B 4.25 11/15/40	2,000,000.000	2,426,700.000	
US T N/B 4.375 02/15/38	750,000.000	917,812.500	
US T N/B 4.375 05/15/40	2,000,000.000	2,464,520.000	
US T N/B 4.375 05/15/41	2,000,000.000	2,473,740.000	
US T N/B 4.375 11/15/39	1,660,000.000	2,043,609.400	
US T N/B 4.5 02/15/36	2,000,000.000	2,458,280.000	
US T N/B 4.5 05/15/38	1,100,000.000	1,369,060.000	
US T N/B 4.5 08/15/39	1,400,000.000	1,750,322.000	
US T N/B 4.625 02/15/40	2,300,000.000	2,925,830.000	
US T N/B 4.75 02/15/41	1,800,000.000	2,335,626.000	
US T N/B 5.0 05/15/37	800,000.000	1,049,000.000	
US T N/B 5.25 02/15/29	1,000,000.000	1,227,100.000	
US T N/B 5.25 11/15/28	1,500,000.000	1,834,215.000	
US T N/B 5.375 02/15/31	1,500,000.000	1,911,615.000	
US T N/B 5.5 08/15/28	1,100,000.000	1,365,287.000	
US T N/B 6.0 02/15/26	3,200,000.000	3,933,728.000	
US T N/B 6.125 11/15/27	1,400,000.000	1,791,552.000	
US T N/B 6.25 05/15/30	1,400,000.000	1,890,644.000	
US T N/B 6.25 08/15/23	1,000,000.000	1,180,000.000	
US T N/B 8.0 11/15/21	6,000,000.000	7,127,760.000	
US T N/B 8.125 08/15/19	4,000,000.000	4,312,320.000	
アメリカ・ドル 小計	819,810,000.000 (87,801,651,000)	814,738,710.700 (87,258,515,916)	
イギリス・ボンド			
UK TREASURY 0.5 07/22/22	2,350,000.000	2,295,339.000	
UK TREASURY 1.25 07/22/27	2,000,000.000	1,964,960.000	
UK TREASURY 1.5 01/22/21	2,700,000.000	2,743,119.000	
UK TREASURY 1.5 07/22/26	2,400,000.000	2,427,000.000	
UK TREASURY 1.5 07/22/47	2,400,000.000	2,232,240.000	
UK TREASURY 1.75 07/22/19	1,700,000.000	1,720,485.000	
UK TREASURY 1.75 07/22/57	1,000,000.000	1,024,900.000	

UK TREASURY 1.75 09/07/22	3,000,000.000	3,088,680.000	
UK TREASURY 1.75 09/07/37	1,250,000.000	1,241,250.000	
UK TREASURY 2.0 07/22/20	1,700,000.000	1,742,806.000	
UK TREASURY 2.0 09/07/25	2,400,000.000	2,526,120.000	
UK TREASURY 2.25 09/07/23	2,800,000.000	2,962,400.000	
UK TREASURY 2.5 07/22/65	1,650,000.000	2,133,318.000	
UK TREASURY 2.75 09/07/24	2,000,000.000	2,188,920.000	
UK TREASURY 3.25 01/22/44	2,600,000.000	3,356,860.000	
UK TREASURY 3.5 01/22/45	2,520,000.000	3,406,032.000	
UK TREASURY 3.5 07/22/68	1,900,000.000	3,132,340.000	
UK TREASURY 3.75 07/22/52	2,100,000.000	3,191,160.000	
UK TREASURY 3.75 09/07/19	2,200,000.000	2,290,882.000	
UK TREASURY 3.75 09/07/20	2,900,000.000	3,099,143.000	
UK TREASURY 3.75 09/07/21	1,850,000.000	2,023,789.000	
UK TREASURY 4.0 01/22/60	1,600,000.000	2,740,800.000	
UK TREASURY 4.0 03/07/22	2,000,000.000	2,231,940.000	
UK TREASURY 4.25 03/07/36	2,450,000.000	3,390,310.000	
UK TREASURY 4.25 06/07/32	1,850,000.000	2,449,030.000	
UK TREASURY 4.25 09/07/39	1,550,000.000	2,225,335.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/27	1,700,000.000	2,133,993.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/40	1,980,000.000	2,878,524.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/46	1,930,000.000	2,974,130.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/49	1,970,000.000	3,148,454.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/55	1,940,000.000	3,322,638.000	
UK TREASURY 4.5 09/07/34	2,350,000.000	3,278,250.000	

	UK TREASURY 4.5 12/07/42	1,900,000.000	2,910,230.000	
	UK TREASURY 4.75 03/07/20	1,850,000.000	1,987,584.500	
	UK TREASURY 4.75 12/07/30	1,500,000.000	2,038,050.000	
	UK TREASURY 4.75 12/07/38	1,650,000.000	2,497,605.000	
	UK TREASURY 5.0 03/07/25	2,030,000.000	2,535,693.300	
	UK TREASURY 6.0 12/07/28	1,350,000.000	1,948,860.000	
	UK TREASURY 8.0 06/07/21	1,700,000.000	2,074,051.000	
	イギリス・ポンド 小計	78,720,000.000 (11,954,419,200)	97,557,220.800 (14,815,039,551)	
オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN 4.5 04/15/20	3,800,000.000	3,983,084.000	
	AUSTRALIAN 5.75 05/15/21	3,700,000.000	4,096,529.000	
	AUSTRALIAN 1.75 11/21/20	2,400,000.000	2,378,856.000	
	AUSTRALIAN 2.0 12/21/21	1,150,000.000	1,140,938.000	
	AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	2,400,000.000	2,304,960.000	
	AUSTRALIAN 2.75 04/21/24	3,100,000.000	3,146,624.000	
	AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	900,000.000	864,477.000	
	AUSTRALIAN 2.75 10/21/19	1,500,000.000	1,517,505.000	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	2,900,000.000	2,911,078.000	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/28	2,700,000.000	2,706,993.000	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/29	200,000.000	199,464.000	
	AUSTRALIAN 3.0 03/21/47	1,250,000.000	1,180,100.000	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	3,100,000.000	3,235,377.000	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	3,100,000.000	3,252,706.000	
	AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	900,000.000	911,502.000	
	AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	1,200,000.000	1,311,912.000	
	AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	3,600,000.000	4,019,256.000	
	AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	1,500,000.000	1,787,280.000	

	AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	3,600,000.000	4,196,808.000	
	AUSTRALIAN 5.5 04/21/23	3,000,000.000	3,442,080.000	
	AUSTRALIAN 5.75 07/15/22	3,500,000.000	3,991,855.000	
オーストラリア・ドル 小計		49,500,000.000 (4,115,430,000)	52,579,384.000 (4,371,449,986)	
カナダ・ドル	CANADA 8.0 06/01/27	1,000,000.000	1,479,990.000	
	CANADA 0.75 08/01/19	6,500,000.000	6,417,320.000	
	CANADA 0.75 09/01/20	2,400,000.000	2,336,088.000	
	CANADA 0.75 09/01/21	600,000.000	575,658.000	
	CANADA 1.0 06/01/27	800,000.000	722,200.000	
	CANADA 1.0 09/01/22	800,000.000	765,864.000	
	CANADA 1.5 03/01/20	2,300,000.000	2,285,441.000	
	CANADA 1.5 06/01/23	2,300,000.000	2,238,475.000	
	CANADA 1.5 06/01/26	1,700,000.000	1,616,632.000	
	CANADA 1.75 03/01/23	600,000.000	592,080.000	
	CANADA 2.25 06/01/25	1,500,000.000	1,510,860.000	
	CANADA 2.5 06/01/24	1,600,000.000	1,636,464.000	
	CANADA 2.75 06/01/22	3,900,000.000	4,013,919.000	
	CANADA 2.75 12/01/48	1,450,000.000	1,587,895.000	
	CANADA 2.75 12/01/64	750,000.000	850,552.500	
	CANADA 3.25 06/01/21	4,700,000.000	4,880,903.000	
	CANADA 3.5 06/01/20	2,800,000.000	2,894,500.000	
	CANADA 3.5 12/01/45	1,900,000.000	2,352,732.000	
	CANADA 3.75 06/01/19	3,700,000.000	3,785,988.000	
	CANADA 4.0 06/01/41	1,800,000.000	2,336,544.000	
CANADA 5.0 06/01/37	1,400,000.000	1,984,500.000		
CANADA 5.75 06/01/29	1,600,000.000	2,152,208.000		
CANADA 5.75 06/01/33	1,550,000.000	2,239,037.000		
カナダ・ドル 小計		47,650,000.000 (4,050,250,000)	51,255,850.500 (4,356,747,293)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE 1.25 10/01/21	1,000,000.000	975,000.000	
	SINGAPORE 2.0 07/01/20	800,000.000	802,152.000	
	SINGAPORE 2.375 06/01/25	500,000.000	503,000.000	
	SINGAPORE 2.75 03/01/46	410,000.000	403,895.100	
	SINGAPORE 2.75 04/01/42	550,000.000	542,850.000	
	SINGAPORE 2.875 07/01/29	400,000.000	415,000.000	
	SINGAPORE 2.875 09/01/30	460,000.000	475,640.000	
	SINGAPORE 3.0 09/01/24	810,000.000	847,260.000	
	SINGAPORE 3.125 09/01/22	1,600,000.000	1,674,720.000	
	SINGAPORE 3.25 09/01/20	1,340,000.000	1,381,406.000	
	SINGAPORE 3.375 09/01/33	480,000.000	524,054.400	
	SINGAPORE 3.5 03/01/27	900,000.000	981,063.000	

シンガポール・ドル 小計		9,250,000.000 (756,557,500)	9,526,040.500 (779,134,852)	
スウェーデン・クローナ	SWEDEN 1.0 11/12/26	7,000,000.000	7,290,990.000	
	SWEDEN 1.5 11/13/23	9,700,000.000	10,460,189.000	
	SWEDEN 2.5 05/12/25	7,300,000.000	8,419,820.000	
	SWEDEN 3.5 03/30/39	6,200,000.000	8,649,930.000	
	SWEDEN 3.5 06/01/22	12,870,000.000	14,835,635.100	
	SWEDEN 5.0 12/01/20	9,910,000.000	11,356,463.600	
スウェーデン・クローナ 小計		52,980,000.000 (683,442,000)	61,013,027.700 (787,068,057)	
デンマーク・クローネ	DENMARK 0.5 11/15/27	3,000,000.000	2,994,000.000	
	DENMARK 1.5 11/15/23	5,500,000.000	5,955,675.000	
	DENMARK 1.75 11/15/25	9,470,000.000	10,521,832.900	
	DENMARK 3.0 11/15/21	13,000,000.000	14,528,150.000	
	DENMARK 4.0 11/15/19	7,900,000.000	8,483,020.000	
	DENMARK 4.5 11/15/39	14,100,000.000	23,691,807.000	
デンマーク・クローネ 小計		52,970,000.000 (941,806,600)	66,174,484.900 (1,176,582,342)	
ノルウェー・クローネ	NORWAY 1.5 02/19/26	6,000,000.000	5,918,040.000	
	NORWAY 1.75 02/17/27	500,000.000	499,065.000	
	NORWAY 1.75 03/13/25	3,800,000.000	3,839,406.000	
	NORWAY 2.0 05/24/23	7,600,000.000	7,824,048.000	
	NORWAY 3.0 03/14/24	6,200,000.000	6,727,496.000	
	NORWAY 3.75 05/25/21	8,800,000.000	9,510,160.000	
	NORWAY 4.5 05/22/19	6,560,000.000	6,829,616.000	
ノルウェー・クローネ 小計		39,460,000.000 (542,180,400)	41,147,831.000 (565,371,198)	
ポーランド・ズロチ	POLAND 1.5 04/25/20	3,000,000.000	3,004,200.000	
	POLAND 1.75 07/25/21	2,200,000.000	2,200,660.000	
	POLAND 2.25 04/25/22	4,000,000.000	4,035,200.000	
	POLAND 2.5 07/25/26	4,200,000.000	4,091,010.000	
	POLAND 2.5 07/25/27	3,000,000.000	2,892,000.000	
	POLAND 3.25 07/25/19	2,500,000.000	2,560,700.000	
	POLAND 3.25 07/25/25	3,300,000.000	3,404,445.000	
	POLAND 4.0 10/25/23	3,100,000.000	3,354,045.000	
	POLAND 5.25 10/25/20	4,900,000.000	5,352,760.000	
	POLAND 5.5 10/25/19	2,690,000.000	2,860,008.000	
	POLAND 5.75 04/25/29	1,440,000.000	1,810,915.200	
	POLAND 5.75 09/23/22	3,200,000.000	3,686,720.000	
	POLAND 5.75 10/25/21	3,680,000.000	4,177,168.000	
ポーランド・ズロチ 小計		41,210,000.000 (1,302,648,100)	43,429,831.200 (1,372,816,964)	
マレーシア・リングギット	MALAYSIA 3.418 08/15/22	3,000,000.000	2,963,580.000	
	MALAYSIA 3.48 03/15/23	1,220,000.000	1,205,457.600	
	MALAYSIA 3.492 03/31/20	2,200,000.000	2,204,796.000	
	MALAYSIA 3.502 05/31/27	2,570,000.000	2,433,610.100	
	MALAYSIA 3.733 06/15/28	2,000,000.000	1,962,180.000	
	MALAYSIA 3.844 04/15/33	1,210,000.000	1,132,850.400	
	MALAYSIA 3.892 03/15/27	800,000.000	786,368.000	

	MALAYSIA 4.127 04/15/32	1,850,000.000	1,797,127.000	
	MALAYSIA 4.16 07/15/21	4,000,000.000	4,085,360.000	
	MALAYSIA 4.181 07/15/24	2,430,000.000	2,467,494.900	
	MALAYSIA 4.378 11/29/19	3,680,000.000	3,738,217.600	
	MALAYSIA 4.392 04/15/26	3,070,000.000	3,144,754.500	
	MALAYSIA 4.498 04/15/30	1,800,000.000	1,824,786.000	
	MALAYSIA 4.935 09/30/43	2,000,000.000	2,038,620.000	
	MALAYSIA 5.248 09/15/28	1,600,000.000	1,728,864.000	
マレーシア・リンギット	小計	33,430,000.000 (926,011,000)	33,514,066.100 (928,339,631)	
メキシコ・ペソ	MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	13,000,000.000	16,279,120.000	
	MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	35,000,000.000	40,240,900.000	
	MEXICAN BONDS 5.0 12/11/19	26,000,000.000	25,097,800.000	
	MEXICAN BONDS 5.75 03/05/26	5,000,000.000	4,551,800.000	
	MEXICAN BONDS 6.5 06/09/22	26,000,000.000	25,378,600.000	
	MEXICAN BONDS 6.5 06/10/21	38,000,000.000	37,290,160.000	
	MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	10,000,000.000	10,135,000.000	
	MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	10,000,000.000	10,273,800.000	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	22,000,000.000	22,555,720.000	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	7,000,000.000	7,189,280.000	
	MEXICAN BONDS 8.0 06/11/20	30,000,000.000	30,507,000.000	
	MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47	5,000,000.000	5,282,050.000	
	MEXICAN BONDS 8.0 12/07/23	14,000,000.000	14,540,400.000	
	MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	31,000,000.000	33,706,610.000	
	MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	15,000,000.000	16,543,500.000	
メキシコ・ペソ	小計	287,000,000.000 (1,684,690,000)	299,571,740.000 (1,758,486,114)	
ユーロ	AUSTRIA 0.25 10/18/19	250,000.000	253,082.500	
	AUSTRIA 0.5 04/20/27	500,000.000	494,670.000	
	AUSTRIA 0.75 10/20/26	1,300,000.000	1,322,438.000	
	AUSTRIA 07/15/23	350,000.000	347,970.000	
	AUSTRIA 1.2 10/20/25	1,000,000.000	1,058,760.000	
	AUSTRIA 1.5 02/20/47	230,000.000	234,997.900	
	AUSTRIA 1.5 11/02/86	290,000.000	264,079.800	
	AUSTRIA 1.65 10/21/24	1,250,000.000	1,361,237.500	

AUSTRIA 1.75 10/20/23	1,400,000.000	1,526,420.000	
AUSTRIA 1.95 06/18/19	830,000.000	854,783.800	
AUSTRIA 2.1 09/20/17	100,000.000	111,807.000	
AUSTRIA 2.4 05/23/34	900,000.000	1,075,590.000	
AUSTRIA 3.15 06/20/44	810,000.000	1,142,124.300	
AUSTRIA 3.4 11/22/22	1,500,000.000	1,739,640.000	
AUSTRIA 3.5 09/15/21	1,900,000.000	2,143,200.000	
AUSTRIA 3.65 04/20/22	1,200,000.000	1,382,580.000	
AUSTRIA 3.8 01/26/62	820,000.000	1,408,473.000	
AUSTRIA 3.9 07/15/20	1,700,000.000	1,865,750.000	
AUSTRIA 4.15 03/15/37	1,650,000.000	2,498,100.000	
AUSTRIA 4.85 03/15/26	1,100,000.000	1,481,821.000	
AUSTRIA 6.25 07/15/27	1,150,000.000	1,739,340.500	
BELGIUM 0.2 10/22/23	150,000.000	150,495.000	
BELGIUM 0.8 06/22/25	2,000,000.000	2,054,640.000	
BELGIUM 0.8 06/22/27	1,100,000.000	1,111,187.000	
BELGIUM 0.8 06/22/28	300,000.000	299,571.000	
BELGIUM 1.0 06/22/26	1,500,000.000	1,554,015.000	
BELGIUM 1.0 06/22/31	1,300,000.000	1,294,553.000	
BELGIUM 1.45 06/22/37	750,000.000	764,302.500	
BELGIUM 1.6 06/22/47	900,000.000	904,032.000	
BELGIUM 1.9 06/22/38	800,000.000	875,080.000	
BELGIUM 2.15 06/22/66	700,000.000	771,120.000	
BELGIUM 2.25 06/22/23	1,700,000.000	1,893,392.000	
BELGIUM 2.6 06/22/24	2,300,000.000	2,632,810.000	
BELGIUM 3.0 06/22/34	850,000.000	1,076,066.000	
BELGIUM 3.0 09/28/19	1,300,000.000	1,367,548.000	
BELGIUM 3.75 06/22/45	1,130,000.000	1,692,581.800	
BELGIUM 3.75 09/28/20	2,200,000.000	2,428,426.000	
BELGIUM 4.0 03/28/22	1,500,000.000	1,750,380.000	
BELGIUM 4.0 03/28/32	950,000.000	1,318,904.000	
BELGIUM 4.25 03/28/41	2,000,000.000	3,122,380.000	
BELGIUM 4.25 09/28/21	1,870,000.000	2,164,375.400	
BELGIUM 4.25 09/28/22	1,950,000.000	2,329,762.500	
BELGIUM 4.5 03/28/26	1,200,000.000	1,579,668.000	
BELGIUM 5.0 03/28/35	2,200,000.000	3,498,924.000	
BELGIUM 5.5 03/28/28	2,500,000.000	3,658,075.000	
BUNDESOBL 0.25 10/16/20	1,500,000.000	1,528,605.000	
BUNDESOBL 0.5 04/12/19	2,500,000.000	2,528,975.000	
BUNDESOBL 04/08/22	3,000,000.000	3,030,480.000	
BUNDESOBL 04/09/21	2,200,000.000	2,228,248.000	
BUNDESSCHAT 12/13/19	800,000.000	808,040.000	
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27	3,500,000.000	3,455,550.000	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25	2,200,000.000	2,250,116.000	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26	3,200,000.000	3,254,400.000	

DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28	900,000.000	898,632.000	
DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27	2,700,000.000	2,709,045.000	
DEUTSCHLAND 08/15/26	2,800,000.000	2,720,984.000	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/24	2,600,000.000	2,745,886.000	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25	2,500,000.000	2,642,375.000	
DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48	350,000.000	357,227.500	
DEUTSCHLAND 1.5 02/15/23	2,100,000.000	2,265,459.000	
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/23	2,500,000.000	2,700,675.000	
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/24	2,000,000.000	2,172,500.000	
DEUTSCHLAND 1.5 09/04/22	3,400,000.000	3,654,184.000	
DEUTSCHLAND 1.75 02/15/24	1,500,000.000	1,649,070.000	
DEUTSCHLAND 1.75 07/04/22	2,700,000.000	2,927,124.000	
DEUTSCHLAND 2.0 01/04/22	2,700,000.000	2,932,929.000	
DEUTSCHLAND 2.0 08/15/23	1,500,000.000	1,662,420.000	
DEUTSCHLAND 2.25 09/04/20	4,200,000.000	4,480,644.000	
DEUTSCHLAND 2.25 09/04/21	3,100,000.000	3,375,900.000	
DEUTSCHLAND 2.5 01/04/21	2,200,000.000	2,380,180.000	
DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	2,700,000.000	3,552,984.000	
DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	2,700,000.000	3,593,322.000	
DEUTSCHLAND 3.0 07/04/20	3,000,000.000	3,238,020.000	
DEUTSCHLAND 3.25 01/04/20	3,600,000.000	3,842,316.000	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/21	3,150,000.000	3,522,456.000	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	1,650,000.000	2,423,767.500	
DEUTSCHLAND 3.5 07/04/19	4,400,000.000	4,625,060.000	
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	2,600,000.000	3,971,890.000	

DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	1,660,000.000	2,699,292.800	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	1,420,000.000	2,019,737.000	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	2,200,000.000	3,505,282.000	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	1,900,000.000	3,320,573.000	
DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	2,050,000.000	3,259,725.500	
DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	1,600,000.000	2,385,024.000	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/24	1,700,000.000	2,306,492.000	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	1,100,000.000	1,805,793.000	
DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	1,750,000.000	2,718,030.000	
FINLAND 0.375 09/15/20	500,000.000	509,400.000	
FINLAND 0.5 04/15/26	600,000.000	601,704.000	
FINLAND 0.5 09/15/27	300,000.000	296,097.000	
FINLAND 0.75 04/15/31	450,000.000	441,279.000	
FINLAND 0.875 09/15/25	300,000.000	310,512.000	
FINLAND 09/15/23	230,000.000	228,707.400	
FINLAND 1.5 04/15/23	950,000.000	1,018,922.500	
FINLAND 1.625 09/15/22	400,000.000	430,160.000	
FINLAND 2.0 04/15/24	680,000.000	753,242.800	
FINLAND 2.625 07/04/42	660,000.000	867,642.600	
FINLAND 2.75 07/04/28	630,000.000	759,162.600	
FINLAND 3.375 04/15/20	980,000.000	1,056,400.800	
FINLAND 3.5 04/15/21	700,000.000	780,395.000	
FINLAND 4.0 07/04/25	800,000.000	1,007,632.000	
FINLAND 4.375 07/04/19	370,000.000	392,644.000	
FRANCE BTAN 8.5 04/25/23	1,700,000.000	2,427,209.000	
FRANCE OAT 0.25 11/25/26	3,000,000.000	2,921,790.000	
FRANCE OAT 0.5 05/25/25	3,700,000.000	3,740,145.000	
FRANCE OAT 0.5 05/25/26	2,200,000.000	2,202,574.000	
FRANCE OAT 0.5 11/25/19	500,000.000	508,345.000	
FRANCE OAT 0.75 05/25/28	2,200,000.000	2,197,250.000	
FRANCE OAT 03/25/23	1,900,000.000	1,894,984.000	
FRANCE OAT 05/25/22	3,000,000.000	3,013,470.000	
FRANCE OAT 1.0 05/25/19	1,700,000.000	1,729,529.000	
FRANCE OAT 1.0 05/25/27	4,000,000.000	4,129,000.000	
FRANCE OAT 1.0 11/25/25	3,700,000.000	3,861,542.000	
FRANCE OAT 1.25 05/25/34	400,000.000	405,168.000	

FRANCE OAT 1.25 05/25/36	2,900,000.000	2,900,000.000	
FRANCE OAT 1.5 05/25/31	4,200,000.000	4,460,526.000	
FRANCE OAT 1.75 05/25/23	4,400,000.000	4,782,888.000	
FRANCE OAT 1.75 05/25/66	1,250,000.000	1,249,250.000	
FRANCE OAT 1.75 06/25/39	1,200,000.000	1,286,472.000	
FRANCE OAT 1.75 11/25/24	4,500,000.000	4,935,375.000	
FRANCE OAT 2.25 05/25/24	4,000,000.000	4,499,680.000	
FRANCE OAT 2.25 10/25/22	3,400,000.000	3,757,170.000	
FRANCE OAT 2.5 05/25/30	3,900,000.000	4,614,714.000	
FRANCE OAT 2.5 10/25/20	7,800,000.000	8,378,058.000	
FRANCE OAT 2.75 10/25/27	4,000,000.000	4,776,760.000	
FRANCE OAT 3.0 04/25/22	5,300,000.000	5,975,379.000	
FRANCE OAT 3.25 05/25/45	2,700,000.000	3,742,983.000	
FRANCE OAT 3.25 10/25/21	5,200,000.000	5,841,316.000	
FRANCE OAT 3.5 04/25/20	6,500,000.000	7,028,385.000	
FRANCE OAT 3.5 04/25/26	4,840,000.000	6,019,024.000	
FRANCE OAT 3.75 04/25/21	6,300,000.000	7,082,901.000	
FRANCE OAT 3.75 10/25/19	6,600,000.000	7,038,900.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/55	2,400,000.000	3,952,080.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/60	1,940,000.000	3,281,354.800	
FRANCE OAT 4.0 10/25/38	3,100,000.000	4,618,969.000	
FRANCE OAT 4.25 04/25/19	1,600,000.000	1,680,080.000	
FRANCE OAT 4.25 10/25/23	5,000,000.000	6,151,150.000	
FRANCE OAT 4.5 04/25/41	3,600,000.000	5,828,976.000	
FRANCE OAT 4.75 04/25/35	3,100,000.000	4,836,465.000	
FRANCE OAT 5.5 04/25/29	3,650,000.000	5,469,598.000	
FRANCE OAT 5.75 10/25/32	3,800,000.000	6,238,194.000	
FRANCE OAT 6.0 10/25/25	2,900,000.000	4,122,640.000	
FRANCE OAT 8.5 10/25/19	4,200,000.000	4,790,184.000	
IRISH 0.8 03/15/22	950,000.000	984,067.000	
IRISH 0.9 05/15/28	100,000.000	99,688.000	
IRISH 1.0 05/15/26	1,200,000.000	1,233,876.000	
IRISH 1.7 05/15/37	750,000.000	779,250.000	
IRISH 2.0 02/18/45	890,000.000	958,254.100	

IRISH 2.4 05/15/30	1,100,000.000	1,266,408.000	
IRISH 3.4 03/18/24	930,000.000	1,101,798.900	
IRISH 3.9 03/20/23	700,000.000	831,579.000	
IRISH 4.4 06/18/19	480,000.000	507,816.000	
IRISH 4.5 04/18/20	1,130,000.000	1,243,711.900	
IRISH 5.0 10/18/20	850,000.000	966,526.500	
IRISH 5.4 03/13/25	1,260,000.000	1,684,242.000	
IRISH 5.9 10/18/19	950,000.000	1,042,245.000	
ITALY BTPS 0.35 11/01/21	1,700,000.000	1,709,758.000	
ITALY BTPS 0.65 10/15/23	2,100,000.000	2,080,239.000	
ITALY BTPS 0.65 11/01/20	3,600,000.000	3,667,680.000	
ITALY BTPS 0.95 03/15/23	2,500,000.000	2,534,750.000	
ITALY BTPS 1.05 12/01/19	2,000,000.000	2,043,820.000	
ITALY BTPS 1.25 12/01/26	2,000,000.000	1,951,660.000	
ITALY BTPS 1.35 04/15/22	2,500,000.000	2,594,200.000	
ITALY BTPS 1.45 09/15/22	1,500,000.000	1,560,885.000	
ITALY BTPS 1.5 06/01/25	2,500,000.000	2,534,750.000	
ITALY BTPS 1.6 06/01/26	1,500,000.000	1,511,250.000	
ITALY BTPS 1.65 03/01/32	2,800,000.000	2,638,104.000	
ITALY BTPS 1.85 05/15/24	2,100,000.000	2,203,740.000	
ITALY BTPS 2.0 12/01/25	2,700,000.000	2,816,424.000	
ITALY BTPS 2.05 08/01/27	1,300,000.000	1,337,635.000	
ITALY BTPS 2.15 12/15/21	2,200,000.000	2,352,460.000	
ITALY BTPS 2.2 06/01/27	2,800,000.000	2,926,560.000	
ITALY BTPS 2.25 09/01/36	1,500,000.000	1,463,100.000	
ITALY BTPS 2.45 09/01/33	1,100,000.000	1,124,200.000	
ITALY BTPS 2.5 12/01/24	4,000,000.000	4,340,600.000	
ITALY BTPS 2.7 03/01/47	1,650,000.000	1,628,715.000	
ITALY BTPS 2.8 03/01/67	1,200,000.000	1,137,720.000	
ITALY BTPS 2.95 09/01/38	800,000.000	846,872.000	
ITALY BTPS 3.25 09/01/46	2,000,000.000	2,193,600.000	
ITALY BTPS 3.45 03/01/48	250,000.000	280,002.500	
ITALY BTPS 3.5 03/01/30	2,950,000.000	3,402,264.500	

ITALY BTPS 3.75 03/01/21	3,300,000.000	3,655,971.000	
ITALY BTPS 3.75 05/01/21	2,300,000.000	2,557,370.000	
ITALY BTPS 3.75 08/01/21	3,200,000.000	3,580,480.000	
ITALY BTPS 3.75 09/01/24	1,900,000.000	2,211,410.000	
ITALY BTPS 4.0 02/01/37	3,500,000.000	4,323,550.000	
ITALY BTPS 4.0 09/01/20	3,700,000.000	4,063,710.000	
ITALY BTPS 4.25 03/01/20	4,600,000.000	4,990,402.000	
ITALY BTPS 4.25 09/01/19	5,500,000.000	5,852,165.000	
ITALY BTPS 4.5 02/01/20	4,500,000.000	4,887,900.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/24	3,700,000.000	4,448,325.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/26	2,900,000.000	3,566,420.000	
ITALY BTPS 4.5 05/01/23	1,400,000.000	1,664,012.000	
ITALY BTPS 4.75 08/01/23	1,900,000.000	2,294,820.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/21	3,900,000.000	4,502,550.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/28	2,400,000.000	3,054,192.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/44	2,050,000.000	2,804,400.000	
ITALY BTPS 5.0 03/01/22	3,600,000.000	4,248,720.000	
ITALY BTPS 5.0 03/01/25	2,400,000.000	2,999,640.000	
ITALY BTPS 5.0 08/01/34	2,800,000.000	3,818,360.000	
ITALY BTPS 5.0 08/01/39	3,000,000.000	4,171,200.000	
ITALY BTPS 5.0 09/01/40	2,750,000.000	3,815,350.000	
ITALY BTPS 5.25 11/01/29	2,900,000.000	3,886,870.000	
ITALY BTPS 5.5 09/01/22	3,900,000.000	4,748,874.000	
ITALY BTPS 5.5 11/01/22	2,500,000.000	3,055,900.000	
ITALY BTPS 5.75 02/01/33	2,400,000.000	3,451,440.000	
ITALY BTPS 6.0 05/01/31	3,100,000.000	4,471,130.000	
ITALY BTPS 6.5 11/01/27	3,300,000.000	4,697,220.000	
ITALY BTPS 7.25 11/01/26	1,800,000.000	2,625,840.000	
ITALY BTPS 9.0 11/01/23	1,900,000.000	2,740,180.000	
NETHERLANDS 0.25 01/15/20	2,150,000.000	2,182,572.500	
NETHERLANDS 0.25 07/15/25	1,700,000.000	1,690,548.000	
NETHERLANDS 0.5 07/15/26	1,700,000.000	1,708,840.000	
NETHERLANDS 0.75 07/15/27	1,450,000.000	1,474,795.000	

NETHERLANDS 01/15/22	1,900,000.000	1,916,701.000	
NETHERLANDS 01/15/24	200,000.000	198,490.000	
NETHERLANDS 1.75 07/15/23	2,000,000.000	2,182,740.000	
NETHERLANDS 2.0 07/15/24	2,000,000.000	2,226,500.000	
NETHERLANDS 2.25 07/15/22	1,550,000.000	1,710,657.500	
NETHERLANDS 2.5 01/15/33	1,480,000.000	1,807,524.000	
NETHERLANDS 2.75 01/15/47	1,540,000.000	2,134,578.600	
NETHERLANDS 3.25 07/15/21	1,860,000.000	2,101,614.000	
NETHERLANDS 3.5 07/15/20	1,670,000.000	1,823,139.000	
NETHERLANDS 3.75 01/15/23	1,700,000.000	2,013,650.000	
NETHERLANDS 3.75 01/15/42	1,750,000.000	2,733,220.000	
NETHERLANDS 4.0 01/15/37	1,700,000.000	2,585,530.000	
NETHERLANDS 4.0 07/15/19	1,000,000.000	1,058,650.000	
NETHERLANDS 5.5 01/15/28	1,600,000.000	2,361,280.000	
SPAIN 0.05 01/31/21	400,000.000	402,288.000	
SPAIN 0.4 04/30/22	2,200,000.000	2,229,788.000	
SPAIN 0.45 10/31/22	800,000.000	809,792.000	
SPAIN 0.75 07/30/21	1,700,000.000	1,747,906.000	
SPAIN 1.15 07/30/20	2,100,000.000	2,168,649.000	
SPAIN 1.3 10/31/26	2,000,000.000	2,043,540.000	
SPAIN 1.4 01/31/20	400,000.000	412,372.000	
SPAIN 1.45 10/31/27	1,800,000.000	1,843,110.000	
SPAIN 1.5 04/30/27	2,600,000.000	2,686,060.000	
SPAIN 1.6 04/30/25	2,500,000.000	2,649,525.000	
SPAIN 1.95 04/30/26	2,500,000.000	2,691,425.000	
SPAIN 1.95 07/30/30	2,700,000.000	2,836,053.000	
SPAIN 2.15 10/31/25	2,100,000.000	2,297,757.000	
SPAIN 2.35 07/30/33	1,350,000.000	1,457,325.000	
SPAIN 2.75 04/30/19	1,400,000.000	1,446,606.000	
SPAIN 2.75 10/31/24	2,700,000.000	3,070,710.000	
SPAIN 2.9 10/31/46	1,800,000.000	2,048,868.000	
SPAIN 3.45 07/30/66	1,400,000.000	1,733,060.000	
SPAIN 3.8 04/30/24	2,700,000.000	3,225,150.000	
SPAIN 4.0 04/30/20	2,400,000.000	2,611,104.000	
SPAIN 4.2 01/31/37	2,280,000.000	3,117,033.600	
SPAIN 4.3 10/31/19	4,200,000.000	4,504,920.000	
SPAIN 4.4 10/31/23	2,300,000.000	2,806,000.000	

	SPAIN 4.6 07/30/19	3,200,000.000	3,408,448.000	
	SPAIN 4.65 07/30/25	2,600,000.000	3,315,520.000	
	SPAIN 4.7 07/30/41	2,100,000.000	3,123,183.000	
	SPAIN 4.8 01/31/24	2,200,000.000	2,746,282.000	
	SPAIN 4.85 10/31/20	2,900,000.000	3,276,942.000	
	SPAIN 4.9 07/30/40	2,000,000.000	3,021,000.000	
	SPAIN 5.15 10/31/28	2,850,000.000	3,943,260.000	
	SPAIN 5.15 10/31/44	1,500,000.000	2,398,875.000	
	SPAIN 5.4 01/31/23	2,800,000.000	3,492,580.000	
	SPAIN 5.5 04/30/21	3,600,000.000	4,220,424.000	
	SPAIN 5.75 07/30/32	2,400,000.000	3,674,088.000	
	SPAIN 5.85 01/31/22	2,300,000.000	2,813,245.000	
	SPAIN 5.9 07/30/26	2,500,000.000	3,479,650.000	
	SPAIN 6.0 01/31/29	3,000,000.000	4,418,910.000	
	ユーロ 小計	562,910,000.000 (74,518,025,800)	661,424,276.900 (87,559,345,776)	
南アフリカ・ランド	SOUTH AFRICA 10.5 12/21/26	25,000,000.000	28,696,250.000	
	SOUTH AFRICA 6.25 03/31/36	14,700,000.000	11,281,221.000	
	SOUTH AFRICA 6.5 02/28/41	11,760,000.000	8,948,889.600	
	SOUTH AFRICA 6.75 03/31/21	7,000,000.000	6,923,350.000	
	SOUTH AFRICA 7.0 02/28/31	11,600,000.000	10,197,560.000	
	SOUTH AFRICA 7.75 02/28/23	10,000,000.000	10,090,400.000	
	SOUTH AFRICA 8.0 01/31/30	13,110,000.000	12,652,461.000	
	SOUTH AFRICA 8.25 03/31/32	10,000,000.000	9,700,300.000	
	SOUTH AFRICA 8.5 01/31/37	10,910,000.000	10,502,293.300	
	SOUTH AFRICA 8.75 01/31/44	10,000,000.000	9,722,000.000	
	SOUTH AFRICA 8.75 02/28/48	17,000,000.000	16,557,320.000	
	SOUTH AFRICA 8.875 02/28/35	3,000,000.000	3,013,380.000	
	SOUTH AFRICA 9.0 01/31/40	8,000,000.000	8,010,640.000	
	南アフリカ・ランド 小計	152,080,000.000 (1,353,512,000)	146,296,064.900 (1,302,034,978)	
国債証券 合計		190,630,623,600 (190,630,623,600)	207,030,932,658 (207,030,932,658)	
合計		190,630,623,600 (190,630,623,600)	207,030,932,658 (207,030,932,658)	

- (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	41.68%	42.15%
イギリス・ポンド	国債証券 39銘柄	7.08%	7.16%
オーストラリア・ドル	国債証券 21銘柄	2.09%	2.11%
カナダ・ドル	国債証券 23銘柄	2.08%	2.10%
シンガポール・ドル	国債証券 12銘柄	0.37%	0.38%
スウェーデン・クローナ	国債証券 6銘柄	0.38%	0.38%
デンマーク・クローネ	国債証券 6銘柄	0.56%	0.57%
ノルウェー・クローネ	国債証券 7銘柄	0.27%	0.27%
ポーランド・ズロチ	国債証券 13銘柄	0.66%	0.66%
マレーシア・リンギット	国債証券 15銘柄	0.44%	0.45%
メキシコ・ペソ	国債証券 15銘柄	0.84%	0.85%
ユーロ	国債証券 265銘柄	41.82%	42.29%
南アフリカ・ランド	国債証券 13銘柄	0.62%	0.63%

(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10月11日現在	平成30年4月11日現在
資産の部			
流動資産			
預金		4,021,053,446	6,042,625,735
コール・ローン		24,467,120	119,740,004
株式		55,690,068,152	61,744,203,468
投資信託受益証券		335,597,553	326,742,195
投資証券		122,440,323	117,102,504
派生商品評価勘定		75,833,601	32,355,163
未収入金		1,714,308	-
未収配当金		44,426,794	100,426,950
差入委託証拠金		952,716,501	1,562,062,581
流動資産合計		61,268,317,798	70,045,258,600
資産合計		61,268,317,798	70,045,258,600
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		1,484,421	2,924,185
未払金		3,239,095,058	4,504,623,909
未払解約金		909,000	3,675,000
流動負債合計		3,241,488,479	4,511,223,094
負債合計		3,241,488,479	4,511,223,094
純資産の部			
元本等			
元本	1	47,632,425,380	53,100,504,600
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		10,394,403,939	12,433,530,906
元本等合計		58,026,829,319	65,534,035,506
純資産合計		58,026,829,319	65,534,035,506
負債純資産合計		61,268,317,798	70,045,258,600

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	平成29年10月11日現在	平成30年4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	40,034,214,007円	47,632,425,380円
同期中追加設定元本額	15,108,398,125円	19,494,444,619円
同期中一部解約元本額	7,510,186,752円	14,026,365,399円
元本の内訳		
ファンド名		
D I A M新興国株式インデックスファンド<DC年金>	2,537,141,645円	3,436,204,969円
D I A M新興国株式インデックスファンド<為替ヘッジなし>(ファンドラップ)	204,380,562円	504,706,628円
M I T O ラップ型ファンド(安定型)	6,528,260円	6,013,938円
M I T O ラップ型ファンド(中立型)	17,759,449円	15,725,843円
M I T O ラップ型ファンド(積極型)	21,020,570円	18,210,990円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	15,580,253円	31,548,302円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	18,201,770円	33,302,831円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	13,671,265円	18,874,652円
たわらノーロード 新興国株式	2,491,996,151円	3,506,128,016円
たわらノーロード 新興国株式<ラップ向け>	732,034,254円	1,094,544,768円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	11,475,609円	43,471,037円
たわらノーロード バランス(堅実型)	- 円	223,011円
たわらノーロード バランス(標準型)	- 円	798,794円
たわらノーロード バランス(積極型)	- 円	2,544,706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	22,478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	1,568,583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	2,199,309円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(成長型)	- 円	1,842,053円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(積極型)	- 円	4,086,391円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	- 円	20,102円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	- 円	96,038円

たわらノーロード 最適化バ ランス(成長型)	- 円	129,047円
たわらノーロード 最適化バ ランス(積極型)	- 円	496,573円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	446,953,152円	429,132,057円
D I A M D C 8資産バラン スファンド(新興国10)	41,983,489円	43,983,763円
D I A M D C 8資産バラン スファンド(新興国20)	130,814,607円	150,861,940円
D I A M D C 8資産バラン スファンド(新興国30)	276,648,048円	331,857,161円
投資のソムリエ	4,244,262,094円	6,969,149,974円
クルーズコントロール	1,736,595,734円	209,411,663円
投資のソムリエ<DC年金>	226,317,122円	497,851,493円
D I A M 8資産バランスマ ン<DC年金>	154,446,565円	177,667,170円
クルーズコントロール<DC年 金>	596,735円	77,276円
D I A Mコア資産設計ファンド (堅実型)	17,047,274円	2,541,969円
D I A Mコア資産設計ファンド (積極型)	55,552,408円	7,900,364円
投資のソムリエ<DC年金>リ スク抑制型	64,542,888円	109,132,260円
ダイナミック・ナビゲーション	1,673,502円	1,336,412円
リスク抑制世界8資産バラン スファンド	816,227,059円	1,835,055,796円
ワールドアセットバランス(基 本コース)	1,496,560,495円	1,787,762,556円
ワールドアセットバランス(リ スク抑制コース)	4,750,542,159円	6,173,904,750円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2045)	429,929円	1,198,784円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2055)	429,929円	876,734円
リスク抑制世界8資産バラン スファンド(DC)	253,702円	557,334円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2035)	- 円	2,248,337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)	5,262,700,627円	4,783,607,576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)	2,131,163,308円	2,636,951,676円
D I A M世界アセットバラン スファンド2VA(適格機関投資 家限定)	11,985,248,658円	11,009,303,085円
D I A M世界アセットバラン スファンド3VA(適格機関投資 家限定)	7,721,646,108円	7,215,375,411円
計	47,632,425,380円	53,100,504,600円

2 . 受益権の総数	47,632,425,380口	53,100,504,600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4月12日 至 平成29年10月11日	自 平成29年10月12日 至 平成30年4月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。</p> <p>また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。</p>	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成29年10月11日現在	平成30年4月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。	同左
2. 時価の算定方法	(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つた場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成29年10月11日現在	平成30年4月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
株式	6,704,766,541	7,270,519,512
投資信託受益証券	4,369,491	19,590,662
投資証券	383,287	18,203,717
合計	6,709,519,319	7,232,725,133

（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10月11日まで及び平成29年4月19日から平成30年4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10月11日 現在				平成30年4月11日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	1,780,682,119	-	1,780,482,344	199,775	912,398,463	-	915,094,946	2,696,483
アメリカ・ドル	1,780,682,119	-	1,780,482,344	199,775	912,398,463	-	915,094,946	2,696,483
買 建	2,383,765,339	-	2,382,469,940	1,295,399	2,382,894,443	-	2,386,839,610	3,945,167
アメリカ・ドル	603,083,220	-	603,051,000	32,220	1,470,495,980	-	1,470,644,620	148,640
インドネシア・ ルピア	70,505,722	-	70,342,500	163,222	92,956,245	-	93,323,716	367,471
コロンビア・ペ ソ	-	-	-	-	20,388,954	-	20,405,071	16,117
タイ・バーツ	63,541,367	-	63,459,500	81,867	-	-	-	-
トルコ・リラ	32,796,108	-	32,784,600	11,508	-	-	-	-
ハンガリー・ フォリント	8,387,318	-	8,371,160	16,158	-	-	-	-
フィリピン・ペ ソ	27,995,546	-	27,925,800	69,746	47,980,882	-	47,892,940	87,942
ブラジル・レア ル	-	-	-	-	322,650,769	-	324,120,463	1,469,694
ポーランド・ズ ロチ	44,292,778	-	44,248,800	43,978	-	-	-	-
マレーシア・リ ンギット	63,319,464	-	63,264,180	55,284	116,092,698	-	116,298,000	205,302
メキシコ・ペソ	111,242,182	-	110,922,600	319,582	-	-	-	-
ユーロ	8,232,886	-	8,232,360	526	14,561,669	-	14,561,800	131
韓国・ウォン	483,356,418	-	483,545,440	189,022	-	-	-	-
香港・ドル	664,947,970	-	664,356,000	591,970	-	-	-	-
南アフリカ・ラ ンド	202,064,360	-	201,966,000	98,360	297,767,246	-	299,593,000	1,825,754
合計	4,164,447,458	-	4,162,952,284	1,095,624	3,295,292,906	-	3,301,934,556	1,248,684

(注) 時価の算定方法

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

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

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

- ・計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算しております。
 - ・計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。
2. 計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。
 3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

株式関連

種類	平成29年10月11日 現在				平成30年4月11日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								
先物取引								
買 建	2,384,353,654	-	2,459,798,458	75,444,804	4,656,503,439	-	4,684,685,733	28,182,294
合計	2,384,353,654	-	2,459,798,458	75,444,804	4,656,503,439	-	4,684,685,733	28,182,294

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成29年10月11日現在	平成30年4月11日現在
1口当たり純資産額	1.2182円	1.2342円
(1万口当たり純資産額)	(12,182円)	(12,342円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

平成30年4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	41,600	46.020	1,914,432.000	
	CIA DE MINAS BUENAVENTURA SA ADR	23,500	16.040	376,940.000	
	SURGUTNEFTEGAZ SP ADR PREF	75,500	4.810	363,155.000	
	CREDICORP LTD	7,049	237.090	1,671,247.410	
	SINA CORP	6,100	101.240	617,564.000	
	MOBILE TELESYSTEMS PJSC ADR	60,725	10.240	621,824.000	
	NETEASE INC-ADR	8,300	282.490	2,344,667.000	
	SOUTHERN COPPER CORP	8,780	56.180	493,260.400	
	LUKOIL SPON ADR	46,285	61.680	2,854,858.800	
	GAZPROM PAO ADR	582,660	4.419	2,574,774.540	
	COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK SP GDR	119,844	5.110	612,402.840	
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRADE	96,280	1.442	138,835.760	
	SURGUTNEFTEGAZ ADR	98,217	4.640	455,726.880	
	NOVATEK PJSC GDR	10,365	124.700	1,292,515.500	
	BAIDU INC -SPON ADR	28,900	231.500	6,690,350.000	
	NOVOLIPETSK STEEL GDR	13,970	24.200	338,074.000	
	MMC NORILSK NICKEL ADR	72,638	15.410	1,119,351.580	
	ROSNEFT OIL CO GDR	138,920	4.864	675,706.880	
	NEW ORIENTAL EDUCATION & TECH	14,200	95.390	1,354,538.000	
	SEVERSTAL GDR	26,957	14.220	383,328.540	
	TATNEFT ADR	28,470	60.940	1,734,961.800	
	VTB BANK OJSC GDR	322,000	1.814	584,108.000	
	DP WORLD LTD	18,320	23.000	421,360.000	
	MAGNIT PJSC GDR	38,847	17.765	690,116.950	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD ADR	43,400	17.030	739,102.000	
	RUSHYDRO PJSC ADR	193,960	1.110	215,295.600	
	TAL EDUCATION GROUP-ADR	33,900	36.870	1,249,893.000	
	SBERBANK ADR	289,020	14.155	4,091,078.100	
	PHOSAGRO PJSC GDR	19,972	13.560	270,820.320	
	YY INC-ADR	4,300	98.290	422,647.000	
58.COM INC ADR	9,700	79.700	773,090.000		
AUTOHOME INC ADR	5,600	94.610	529,816.000		
WEIBO CORP ADR	4,900	123.570	605,493.000		
JD.COM INC ADR	69,200	40.700	2,816,440.000		

	ALIBABA GROUP HOLDING LTD-ADR	120,880	177.100	21,407,848.000	
	MOMO INC SPON ADR	11,500	36.950	424,925.000	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	40,500	40.920	1,657,260.000	
アメリカ・ドル 小計		2,735,259		65,527,807.900 (7,018,028,226)	
アラブ首長国連邦・ディルハム	DUBAI ISLAMIC BANK PJSC	126,000	5.480	690,480.000	
	EMIRATES TELECOMMUNICATIONS GROUP CO PJSC	186,909	17.350	3,242,871.150	
	DUBAI INVESTMENTS PJSC	132,222	2.070	273,699.540	
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK PJSC	208,332	6.930	1,443,740.760	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	152,879	12.650	1,933,919.350	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	386,887	5.660	2,189,780.420	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	300,000	2.070	621,000.000	
	EMAAR MALLS PJSC	178,166	2.110	375,930.260	
	DXB ENTERTAINMENTS PJSC	272,783	0.439	119,751.730	
	DAMAC PROPERTIES DUBAI CO PJSC	190,235	3.000	570,705.000	
アラブ首長国連邦・ディルハム 小計		2,134,413		11,461,878.210 (334,801,463)	
インド・ルピー	RELIANCE INDUSTRIES LTD	298,436	917.050	273,680,733.800	
	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	74,855	451.150	33,770,833.250	
	ASIAN PAINTS LTD	28,621	1,156.750	33,107,341.750	
	EICHER MOTORS LTD	1,443	29,972.050	43,249,668.150	
	GRASIM INDUSTRIES LTD	35,629	1,081.900	38,547,015.100	
	MAHINDRA & MAHINDRA LTD	80,051	777.600	62,247,657.600	
	SHREE CEMENT LTD	830	16,996.150	14,106,804.500	
	ICICI BANK LTD	250,382	288.800	72,310,321.600	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP LTD	65,734	364.650	23,969,903.100	
	STATE BANK OF INDIA LTD	183,808	263.300	48,396,646.400	
	CONTAINER CORP OF INDIA LTD	3,657	1,276.700	4,668,891.900	
	LIC HOUSING FINANCE LTD	34,315	560.650	19,238,704.750	
	TATA STEEL LTD	37,427	601.900	22,527,311.300	
	TATA MOTORS LTD	174,654	353.250	61,696,525.500	
	JSW STEEL LTD	86,000	311.350	26,776,100.000	
	TATA POWER CO LTD	114,770	87.100	9,996,467.000	
	BRITANNIA INDUSTRIES LTD	3,339	5,134.250	17,143,260.750	
	NESTLE INDIA LTD	2,343	8,499.100	19,913,391.300	
	BHARAT HEAVY ELECTRICALS LTD	73,648	88.950	6,550,989.600	
	GAIL INDIA LTD	68,958	331.950	22,890,608.100	
VEDANTA LTD	160,388	284.100	45,566,230.800		
AXIS BANK LTD	189,545	546.150	103,520,001.750		

TITAN COMPANY LTD	31,153	962.250	29,976,974.250	
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	121,518	180.200	21,897,543.600	
LUPIN LTD	22,500	789.700	17,768,250.000	
ACC LTD	3,922	1,539.150	6,036,546.300	
BAJAJ FINANCE LTD	17,542	1,926.050	33,786,769.100	
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP	159,184	1,817.500	289,316,920.000	
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISES LTD	58,163	573.750	33,371,021.250	
INFOSYS LTD	183,301	1,113.400	204,087,333.400	
WIPRO LTD	121,545	286.000	34,761,870.000	
INDIAN OIL CORP LTD	116,692	179.300	20,922,875.600	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	68,393	1,391.500	95,168,859.500	
HCL TECHNOLOGIES LTD	59,250	948.450	56,195,662.500	
DABUR INDIA LTD	61,372	337.050	20,685,432.600	
HERO MOTOCORP LTD	4,790	3,718.300	17,810,657.000	
DR REDDYS LABORATORIES LTD	11,596	2,112.100	24,491,911.600	
BHARTI AIRTEL LTD	148,601	385.550	57,293,115.550	
UNITED SPIRITS LTD	6,366	3,350.150	21,327,054.900	
SUN PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD	102,777	508.250	52,236,410.250	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	11,221	9,273.450	104,057,382.450	
GLENMARK PHARMACEUTICALS LTD	17,084	568.200	9,707,128.800	
AUROBINDO PHARMA LTD	30,426	607.850	18,494,444.100	
HAVELLS INDIA LTD	24,800	534.650	13,259,320.000	
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	64,460	340.200	21,929,292.000	
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE CO LTD	15,042	1,561.050	23,481,314.100	
PETRONET LNG LTD	70,238	235.900	16,569,144.200	
CIPLA LTD/INDIA	35,500	558.150	19,814,325.000	
LARSEN & TOUBRO LTD	50,412	1,349.900	68,051,158.800	
ULTRATECH CEMENT LTD	9,616	3,931.200	37,802,419.200	
ASHOK LEYLAND LTD	113,820	145.300	16,538,046.000	
BOSCH LTD	774	19,747.950	15,284,913.300	
TATA CONSULTANCY SERVICES LTD	48,121	2,937.600	141,360,249.600	
NTPC LTD	180,333	168.400	30,368,077.200	
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	8,200	2,622.050	21,500,810.000	
YES BANK LTD	181,638	319.250	57,987,931.500	
AMBUJA CEMENTS LTD	72,216	235.000	16,970,760.000	
BHARAT FORGE LTD	23,740	731.000	17,353,940.000	
HINDALCO INDUSTRIES LTD	115,654	230.000	26,600,420.000	
ITC LTD	358,367	266.700	95,576,478.900	
UNITED PHOSPHORUS LTD	36,110	751.700	27,143,887.000	
SIEMENS INDIA LTD	6,219	1,114.250	6,929,520.750	

	GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	23,824	1,077.500	25,670,360.000	
	TECH MAHINDRA LTD	46,741	626.450	29,280,899.450	
	IDEA CELLULAR LTD	196,527	73.950	14,533,171.650	
	MARICO LTD	45,380	324.400	14,721,272.000	
	POWER FINANCE CORP LTD	65,910	88.300	5,819,853.000	
	ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	71,616	387.250	27,733,296.000	
	RURAL ELECTRIFICATION CORP LTD	85,677	128.500	11,009,494.500	
	BAJAJ FINSERV LTD	3,720	5,412.900	20,135,988.000	
	BAJAJ AUTO LTD	8,402	2,766.450	23,243,712.900	
	COAL INDIA LTD	75,901	280.900	21,320,590.900	
	TATA MOTORS LTD	31,568	198.850	6,277,296.800	
	VAKRANGEE LTD	35,954	154.750	5,563,881.500	
	MAHINDRA & MAHINDRA FINANCIAL SERVICES LTD	32,995	487.600	16,088,362.000	
	BHARTI INFRATEL LTD	28,364	335.450	9,514,703.800	
	INDIABULLS HOUSING FINANCE LTD	34,412	1,324.550	45,580,414.600	
	TATA STEEL LTD-PARTLY PAID	2,333	158.100	368,847.300	
	CADILA HEALTHCARE LTD	18,146	388.650	7,052,442.900	
	IDFC BANK LTD	114,421	49.600	5,675,281.600	
	インド・ルピー 小計	5,663,380		3,137,381,447.200 (5,208,053,202)	
インドネシア・ルピア	AKR CORPORINDO TBK PT	150,400	5,625.000	846,000,000.000	
	UNITED TRACTORS TBK PT	169,201	35,650.000	6,032,015,650.000	
	INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK PT	479,200	7,250.000	3,474,200,000.000	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	167,300	52,000.000	8,699,600,000.000	
	PT ASTRA INTERNATIONAL TBK	2,170,500	7,825.000	16,984,162,500.000	
	TELEKOMUNIKASI INDONESIA PERSERO TBK	5,361,500	3,860.000	20,695,390,000.000	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA TBK PT	845,600	3,750.000	3,171,000,000.000	
	GUDANG GARAM TBK PT	48,600	77,500.000	3,766,500,000.000	
	HANJAYA MANDALA SAMPOERNA TBK	924,800	4,140.000	3,828,672,000.000	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA TBK PT	185,600	18,900.000	3,507,840,000.000	
	BANK DANAMON INDONESIA TBK PT	290,416	6,525.000	1,894,964,400.000	
	BANK MANDIRI	1,991,800	7,875.000	15,685,425,000.000	
	MATAHARI DEPARTMENT STORE TBK	276,500	11,050.000	3,055,325,000.000	
	BANK RAKYAT INDONESIA	5,879,900	3,580.000	21,050,042,000.000	

	PERUSAHAAN GAS NEGARA PT	1,064,100	2,370.000	2,521,917,000.000	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSERO TBK PT	744,300	8,725.000	6,494,017,500.000	
	KALBE FARMA TBK PT	2,476,200	1,525.000	3,776,205,000.000	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK PT	330,300	10,250.000	3,385,575,000.000	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	1,039,000	23,300.000	24,208,700,000.000	
	XL AXIATA TBK PT	290,700	2,730.000	793,611,000.000	
	JASA MARGA PERSERO TBK PT	200,125	4,650.000	930,581,250.000	
	BUMI SERPONG DAMAI PT	851,700	1,760.000	1,498,992,000.000	
	ADARO ENERGY PT	1,434,500	2,110.000	3,026,795,000.000	
	PAKUWON JATI TBK	1,912,800	620.000	1,185,936,000.000	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR TBK PT	239,000	8,425.000	2,013,575,000.000	
	TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE TBK PT	180,800	5,675.000	1,026,040,000.000	
	BANK TABUNGAN NEGARA TBK PT	480,300	3,640.000	1,748,292,000.000	
	WASKITA KARYA PERSERO TBK PT	392,000	2,540.000	995,680,000.000	
	PT SURYA CITRA MEDIA TBK	511,300	2,620.000	1,339,606,000.000	
インドネシア・ルピア 小計		31,088,442		167,636,659,300.000 (1,307,565,943)	
カタール・リアル	QATAR INSURANCE CO SAQ	17,487	37.520	656,112.240	
	QATAR NATIONAL BANK	24,217	143.190	3,467,632.230	
	COMMERCIAL BANK OF QATAR QSC	21,711	33.990	737,956.890	
	OOREDOO QSC	8,410	84.200	708,122.000	
	DOHA BANK QSC	18,035	25.750	464,401.250	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	3,222	199.990	644,367.780	
	INDUSTRIES QATAR QSC	15,552	114.510	1,780,859.520	
	QATAR ISLAMIC BANK SAQ	6,965	105.800	736,897.000	
	QATAR GAS TRANSPORT CO LTD	28,529	15.140	431,929.060	
	MASRAF AL RAYAN	38,923	36.320	1,413,683.360	
	BARWA REAL ESTATE CO	7,916	33.530	265,423.480	
	EZDAN HOLDING GROUP QSC	84,431	10.460	883,148.260	
カタール・リアル 小計		275,398		12,190,533.070 (359,255,010)	
コロンビア・ペソ	INTERCONEXION ELECTRICA SA ESP	45,324	14,420.000	653,572,080.000	
	ECOPETROL SA	447,953	2,790.000	1,249,788,870.000	
	GRUPO DE INVERSIONES SURAMERICANA SA-PREF	10,138	36,700.000	372,064,600.000	
	GRUPO AVAL ACCIONES Y VALORES SA-PREF	373,694	1,230.000	459,643,620.000	
	CEMENTOS ARGOS SA	62,275	9,760.000	607,804,000.000	

	GRUPO ARGOS SA	27,199	20,240.000	550,507,760.000	
	BANCOLOMBIA SA	25,920	34,100.000	883,872,000.000	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	47,149	34,120.000	1,608,723,880.000	
	GRUPO DE INVERSIONES SURAMERICANA SA	25,428	37,980.000	965,755,440.000	
コロンビア・ペソ	小計	1,065,080		7,351,732,250.000 (283,776,866)	
タイ・パーツ	BANGKOK BANK PCL	27,700	205.000	5,678,500.000	
	BERLI JUCKER PCL NVDR	135,500	56.750	7,689,625.000	
	KRUNG THAI BANK PCL NVDR	348,000	18.100	6,298,800.000	
	ROBINSON PCL-NVDR	64,300	62.500	4,018,750.000	
	SIAM COMMERCIAL BANK PCL NVDR	192,700	140.500	27,074,350.000	
	TRUE CORP PCL NVDR	1,030,755	7.100	7,318,360.500	
	KASIKORNBANK PCL NVDR	71,200	197.000	14,026,400.000	
	TMB BANK PCL -NVDR	1,010,000	2.420	2,444,200.000	
	IRPC PCL NVDR	1,065,500	7.250	7,724,875.000	
	BANPU PCL PUBLIC CO LTD NVDR	255,900	20.100	5,143,590.000	
	ELECTRICITY GENERATING PCL NVDR	13,100	227.000	2,973,700.000	
	CHAROEN POKPHAND FOODS PCL	293,200	24.500	7,183,400.000	
	ADVANCED INFO SERVICE PCL	111,300	199.500	22,204,350.000	
	HOME PRODUCT CENTER PCL- NVDR	358,720	14.500	5,201,440.000	
	DELTA ELECTRONICS THAI PCL NVDR	44,200	70.000	3,094,000.000	
	PTT PCL	109,400	552.000	60,388,800.000	
	THAI UNION GROUP PCL- NVDR	261,300	17.900	4,677,270.000	
	SIAM CEMENT PCL NVDR	11,650	496.000	5,778,400.000	
	KCE ELECTRONICS PCL-NVDR	24,900	64.750	1,612,275.000	
	AIRPORTS OF THAILAND PCL-NVDR	455,600	72.000	32,803,200.000	
	SIAM CEMENT PCL FOREIGN	29,500	498.000	14,691,000.000	
	KASIKORNBANK PCL - FOREIGN	123,100	197.000	24,250,700.000	
	CENTRAL PATTANA PCL NVDR	139,000	81.000	11,259,000.000	
	BANGKOK DUSIT MEDICAL SERVICES NVDR	411,400	23.700	9,750,180.000	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL- NVDR	38,900	221.000	8,596,900.000	
	MINOR INTERNATIONAL PCL- NVDR	236,810	39.750	9,413,197.500	
	THAI OIL PCL NVDR	118,900	90.750	10,790,175.000	
	GLOW ENERGY PCL NVDR	54,000	86.250	4,657,500.000	
	CP ALL PCL NVDR	523,100	86.750	45,378,925.000	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL	544,800	8.600	4,685,280.000	

	PTT EXPLORATION & PRODUCTION PCL NVDR	134,345	115.000	15,449,675.000	
	INDORAMA VENTURES PCL NVDR	174,022	55.750	9,701,726.500	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	239,508	95.500	22,873,014.000	
	ENERGY ABSOLUTE PCL NVDR	118,000	36.000	4,248,000.000	
	BANGKOK EXPRESSWAY & METRO PCL NVDR	740,700	7.400	5,481,180.000	
タイ・パーツ 小計		9,511,010		434,560,738.500 (1,490,543,334)	
チェコ・コルナ	KOMERCNI BANKA AS	7,100	965.000	6,851,500.000	
	O2 CZECH REPUBLIC AS	5,677	284.000	1,612,268.000	
	CEZ	17,978	518.000	9,312,604.000	
	MONETA MONEY BANK AS	57,258	85.350	4,886,970.300	
チェコ・コルナ 小計		88,013		22,663,342.300 (118,529,281)	
チリ・ペソ	BANCO SANTANDER CHILE	7,029,170	51.470	361,791,379.900	
	BANCO DE CREDITO E INVERSIONES	4,534	45,444.000	206,043,096.000	
	BANCO DE CHILE	2,748,849	101.780	279,777,851.220	
	EMPRESAS CMPC SA	124,839	2,329.000	290,750,031.000	
	EMPRESAS COPEC SA	39,214	9,574.300	375,446,600.200	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	15,170	8,788.000	133,313,960.000	
	ENTEL CHILE SA	16,500	7,097.600	117,110,400.000	
	ENEL AMERICAS SA	3,087,120	143.810	443,958,727.200	
	COLBUN SA	936,535	146.210	136,930,782.350	
	AGUAS ANDINAS SA	325,357	402.480	130,949,685.360	
	EMBOTELLADORA ANDINA SA	27,270	2,995.000	81,673,650.000	
	LATAM AIRLINES GROUP SA	32,604	9,329.300	304,172,497.200	
	SOCIEDAD QUIMICA Y MINERA DE CHILE SA	9,343	31,841.000	297,490,463.000	
	SACI FALABELLA	77,428	5,910.600	457,645,936.800	
	ITAU CORPBANCA	19,416,226	6.021	116,905,096.740	
	CENCOSUD SA	148,398	1,846.000	273,942,708.000	
AES GENER SA	257,135	177.730	45,700,603.550		
ENEL CHILE SA	2,699,119	76.650	206,887,471.350		
チリ・ペソ 小計		36,994,811		4,260,490,939.870 (759,219,486)	
トルコ・リラ	AKBANK TAS	216,563	9.170	1,985,882.710	
	ANADOLU EFES BIRACILIK VE MALT SANAYII AS	21,520	26.900	578,888.000	
	ARCELIK	30,429	17.580	534,941.820	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	17,677	27.220	481,167.940	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIKALARI TAS	152,776	10.250	1,565,954.000	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	8,914	61.300	546,428.200	
	KOC HOLDING AS	84,507	15.560	1,314,928.920	

	PETKIM PETROKIMYA HOLDING	80,159	7.680	615,621.120	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI AS	79,624	4.990	397,323.760	
	TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKASI AS	17,797	26.680	474,823.960	
	TURK HAVA YOLLARI	57,827	19.220	1,111,434.940	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	110,841	14.320	1,587,243.120	
	TURKIYE GARANTI BANKASI AS	243,061	10.200	2,479,222.200	
	TURKIYE IS BANKASI	162,502	6.510	1,057,888.020	
	TUPRAS TURKIYE PETROL RAFINE	12,901	111.400	1,437,171.400	
	ULKER BISKUVI SANAYI AS	13,121	21.340	280,002.140	
	YAPI VE KREDI BANKASI AS	73,599	4.200	309,115.800	
	HACI OMER SABANCI HOLDING AS	98,354	10.200	1,003,210.800	
	COCA-COLA ICECEK AS	6,451	35.500	229,010.500	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	21,817	70.850	1,545,734.450	
	TURKIYE VAKIFLAR BANKASI TAO	90,731	6.290	570,697.990	
	TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	13,735	24.120	331,288.200	
	TURKIYE HALK BANKASI AS	61,970	8.790	544,716.300	
	TURK TELEKOMUNIKASYON AS	56,200	6.100	342,820.000	
トルコ・リラ 小計		1,733,076		21,325,516.290 (555,742,954)	
ハンガリー・フォロント	RICHTER GEDEON NYRT	14,830	5,380.000	79,785,400.000	
	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NYRT	33,762	2,916.000	98,449,992.000	
	OTP BANK NYRT	25,555	11,170.000	285,449,350.000	
ハンガリー・フォロント 小計		74,147		463,684,742.000 (197,112,384)	
パキスタン・ルピー	LUCKY CEMENT LTD	9,900	710.920	7,038,108.000	
	MCB BANK LTD	39,000	217.980	8,501,220.000	
	OIL & GAS DEVELOPMENT CO LTD	74,500	175.400	13,067,300.000	
	UNITED BANK LTD	51,400	210.390	10,814,046.000	
	HABIB BANK LTD	54,400	216.030	11,752,032.000	
パキスタン・ルピー 小計		229,200		51,172,706.000 (47,590,616)	
フィリピン・ペソ	AYALA LAND INC	796,400	41.250	32,851,500.000	
	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	230,940	66.000	15,242,040.000	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAND	104,086	105.000	10,929,030.000	

	AYALA CORP	24,803	938.500	23,277,615.500	
	ALLIANCE GLOBAL GROUP INC	340,600	13.820	4,707,092.000	
	DMCI HOLDINGS INC	351,850	12.200	4,292,570.000	
	GLOBE TELECOM INC	2,785	1,580.000	4,400,300.000	
	INTERNATIONAL CONTAINER TERM SERVICES INC	40,680	97.200	3,954,096.000	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	290,050	63.250	18,345,662.500	
	JOLLIBEE FOODS CORP	44,130	284.000	12,532,920.000	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	65,551	83.500	5,473,508.500	
	BDO UNIBANK INC	213,013	136.700	29,118,877.100	
	MEGAWORLD CORP	962,000	4.500	4,329,000.000	
	PLDT INC	9,520	1,442.000	13,727,840.000	
	ROBINSONS LAND CORP	218,722	19.100	4,177,590.200	
	SECURITY BANK CORP	23,420	231.000	5,410,020.000	
	SM PRIME HOLDINGS INC	936,975	33.850	31,716,603.750	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	90,210	145.000	13,080,450.000	
	SM INVESTMENTS CORP	24,158	983.000	23,747,314.000	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CORP	1,810,900	5.140	9,308,026.000	
	ABOITIZ POWER CORP	216,300	38.800	8,392,440.000	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	24,000	323.600	7,766,400.000	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	9,070	1,100.000	9,977,000.000	
フィリピン・ペソ	小計	6,830,163		296,757,895.550 (611,321,265)	
ブラジル・リアル	BRF SA	44,292	21.410	948,291.720	
	VALE SA	334,021	44.840	14,977,501.640	
	RAIA DROGASIL SA	23,400	69.000	1,614,600.000	
	TIM PARTICIPACOES SA	95,000	14.690	1,395,550.000	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	19,450	23.070	448,711.500	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	29,400	19.020	559,188.000	
	BANCO DO BRASIL SA	90,700	38.730	3,512,811.000	
	INVESTIMENTOS ITAU SA	416,686	13.290	5,537,756.940	
	LOJAS AMERICANAS SA	74,474	17.920	1,334,574.080	
	GERDAU SA	102,230	16.140	1,649,992.200	
	CIA BRASILEIRA DE DISTRIBUICAO GRUPO PAO DE ACUCAR	17,006	67.600	1,149,605.600	
	PETROLEO BRASILEIRO SA	307,510	23.800	7,318,738.000	
	PETROLEO BRASILEIRO SA	410,412	21.400	8,782,816.800	
	KROTON EDUCACIONAL SA	148,268	13.180	1,954,172.240	
	CCR SA	132,820	12.210	1,621,732.200	
	WEG SA	56,440	21.500	1,213,460.000	
	BANCO BRADESCO SA PREF	351,325	34.590	12,152,331.750	
	BANCO BRADESCO SA	107,918	32.450	3,501,939.100	
	NATURA COSMETICOS SA	19,400	31.490	610,906.000	

CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	61,606	8.550	526,731.300	
SUZANO PAPEL E CELULOSE SA	47,000	36.770	1,728,190.000	
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	338,698	50.360	17,056,831.280	
PORTO SEGURO SA	12,600	45.950	578,970.000	
FIBRIA CELULOSE SA	24,690	66.550	1,643,119.500	
BRASKEM SA	17,030	48.200	820,846.000	
ENGIE BRASIL SA	17,370	38.500	668,745.000	
LOCALIZA RENT A CAR	51,180	29.590	1,514,416.200	
TELEFONICA BRASIL S.A.	47,228	51.070	2,411,933.960	
LOJAS RENNER SA	77,270	32.610	2,519,774.700	
EDP - ENERGIAS DO BRASIL SA	31,864	13.770	438,767.280	
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	38,152	68.000	2,594,336.000	
COSAN SA INDUSTRIA E COMERCIO	16,500	38.910	642,015.000	
EQUATORIAL ENERGIA SA	22,400	72.000	1,612,800.000	
EMBRAER SA	67,060	22.400	1,502,144.000	
M DIAS BRANCO SA	10,400	47.150	490,360.000	
TRANSMISSORA ALIANCA DE ENERGIA ELETRICA SA	25,000	20.650	516,250.000	
ODONTOPREV SA	32,200	14.500	466,900.000	
BR MALLS PARTICIPACOES SA	85,565	11.450	979,719.250	
JBS SA	89,900	8.960	805,504.000	
CIA ENERGETICA DE MINAS GERAIS	96,249	8.050	774,804.450	
CIA DE SANEAMENTO BASICO DO ESTADO DE SAO PAULO	34,698	33.360	1,157,525.280	
MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS IMOBILIARIOS SA	10,380	66.370	688,920.600	
SUL AMERICA SA	17,869	21.350	381,503.150	
HYPERA SA	35,000	35.020	1,225,700.000	
B3 SA-BRASIL BOLSA BAICAO	218,116	26.280	5,732,088.480	
QUALICORP SA	22,000	21.440	471,680.000	
BANCO SANTANDER BRASIL SA	40,800	38.250	1,560,600.000	
CIELO SA	129,307	19.780	2,557,692.460	
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	74,000	28.650	2,120,100.000	
ITAUSA - INVESTIMENTOS ITAU SA-RCT	7,642	13.300	101,638.600	
ATACADAO DISTRIBUICAO COMERCIO E INDUSTRIA LTDA	44,500	14.400	640,800.000	
AMBEV SA	494,195	23.800	11,761,841.000	

	KLABIN SA	64,300	21.000	1,350,300.000	
	RUMO SA	108,200	13.750	1,487,750.000	
ブラジル・リアル	小計	5,291,721		141,815,976.260 (4,454,439,815)	
ポーランド・ズロチ	BANK MILLENNIUM SA	52,647	8.200	431,705.400	
	MBANK	1,595	437.000	697,015.000	
	BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA	2,596	77.400	200,930.400	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	14,190	91.340	1,296,114.600	
	BANK PEKAO SA	15,727	124.250	1,954,079.750	
	ORANGE POLSKA SA	58,600	5.900	345,740.000	
	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	31,767	89.040	2,828,533.680	
	LPP SA	130	8,705.000	1,131,650.000	
	BANK ZACHODNI WBK SA	3,888	375.800	1,461,110.400	
	CD PROJEKT RED SA	7,517	125.000	939,625.000	
	POWSZECHNA KASA OSZCZEDNOSCI BANK POLSKI SA	99,725	39.810	3,970,052.250	
	CCC SA	3,309	261.000	863,649.000	
	GRUPA LOTOS SA	9,480	57.900	548,892.000	
	POLSKIE GORNICtwo NAFTOWE I GAZOWNICTWO SA	167,192	6.010	1,004,823.920	
	CYFROWY POLSAT SA	22,810	25.020	570,706.200	
	GRUPA AZOTY SA	3,853	55.500	213,841.500	
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	81,100	10.560	856,416.000	
	TAURON POLSKA ENERGIA SA	89,318	2.520	225,081.360	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZEN SA	65,115	40.900	2,663,203.500	
	JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA SA	6,170	84.760	522,969.200	
	ALIOR BANK SA	9,405	72.900	685,624.500	
	DINO POLSKA SA	6,068	90.950	551,884.600	
	PLAY COMMUNICATIONS SA	15,228	32.500	494,910.000	
ポーランド・ズロチ	小計	767,430		24,458,558.260 (773,135,026)	
マレーシア・リン ギット	AMMB HOLDINGS BHD	190,200	3.920	745,584.000	
	GENTING PLANTATIONS BHD	43,400	10.000	434,000.000	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	484,700	7.040	3,412,288.000	
	DIGI.COM BHD	359,100	4.540	1,630,314.000	
	MALAYSIA AIRPORTS HOLDINGS BHD	87,820	9.000	790,380.000	
	RHB BANK BHD	68,080	5.250	357,420.000	
	HAP SENG CONSOLIDATED BHD	70,000	9.700	679,000.000	
	GAMUDA BHD	194,600	5.130	998,298.000	
	GENTING BHD	248,200	8.940	2,218,908.000	

YTL CORP BHD	519,110	1.420	737,136.200	
HONG LEONG FINANCIAL GROUP BHD	20,256	19.200	388,915.200	
HONG LEONG BANK BHD	63,008	18.680	1,176,989.440	
IJM CORP BHD	345,560	2.900	1,002,124.000	
IOI CORP BHD	240,213	4.740	1,138,609.620	
KUALA LUMPUR KEPONG BHD	55,500	25.580	1,419,690.000	
MALAYAN BANKING BHD	443,775	10.480	4,650,762.000	
ALLIANCE BANK MALAYSIA BHD	86,100	4.260	366,786.000	
MISC BHD	140,080	7.180	1,005,774.400	
NESTLE MALAYSIA BHD	5,800	150.100	870,580.000	
PPB GROUP BHD	47,800	18.540	886,212.000	
PETRONAS DAGANGAN BHD	31,400	25.360	796,304.000	
PETRONAS GAS BHD	73,200	18.100	1,324,920.000	
GENTING MALAYSIA BHD	301,900	4.950	1,494,405.000	
BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD	14,700	23.320	342,804.000	
TELEKOM MALAYSIA BHD	132,500	5.490	727,425.000	
SP SETIA BHD	178,500	2.810	501,585.000	
TENAGA NASIONAL BHD	356,650	15.900	5,670,735.000	
UMW HOLDINGS BHD	39,000	6.440	251,160.000	
DIALOG GROUP BHD	329,844	3.140	1,035,710.160	
PUBLIC BANK BHD(LOCAL)	303,830	23.960	7,279,766.800	
YTL POWER INTERNATIONAL BHD	148,780	0.980	145,804.400	
AIRASIA BHD	147,900	3.930	581,247.000	
SIME DARBY BERHAD	232,700	2.740	637,598.000	
HARTALEGA HOLDINGS BHD	145,400	6.470	940,738.000	
AXIATA GROUP BERHAD	269,700	5.320	1,434,804.000	
MAXIS BHD	188,600	5.840	1,101,424.000	
PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	236,200	8.450	1,995,890.000	
SAPURA ENERGY BHD	319,200	0.535	170,772.000	
ASTRO MALAYSIA HOLDINGS BHD	140,500	1.780	250,090.000	
IHH HEALTHCARE BHD	211,700	6.030	1,276,551.000	
FELDA GLOBAL VENTURES HOLDINGS BHD	126,400	1.900	240,160.000	
WESTPORTS HOLDINGS BHD	130,000	3.460	449,800.000	
PRESS METAL ALUMINIUM HOLDINGS BHD	153,100	4.670	714,977.000	
SIME DARBY PROPERTY BHD	232,700	1.450	337,415.000	
SIME DARBY PLANTATION BHD	262,800	5.800	1,524,240.000	
IOI PROPERTIES GROUP SDN BHD	174,548	1.500	261,822.000	
マレーシア・リンギット 小計	8,595,054		56,397,918.220 (1,562,222,334)	

メキシコ・ペソ	ALFA SAB DE CV	306,200	23.850	7,302,870.000	
	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	53,800	123.080	6,621,704.000	
	EL PUERTO DE LIVERPOOL SAB DE CV	19,100	139.950	2,673,045.000	
	GRUPO TELEVISA SAB	261,400	63.280	16,541,392.000	
	GRUPO BIMBO SAB DE CV	164,400	41.410	6,807,804.000	
	GRUMA SAB DE CV	24,570	223.610	5,494,097.700	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INFRAESTRUCTURA	22,030	183.400	4,040,302.000	
	GRUPO CARSO SAB DE CV	54,300	65.020	3,530,586.000	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE SAB DE CV	261,600	117.020	30,612,432.000	
	MEXICHEM SAB DE CV	108,225	57.310	6,202,374.750	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	14,700	390.640	5,742,408.000	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO SAB DE CV	156,700	33.480	5,246,316.000	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL SURESTE SAB DE CV	20,685	311.070	6,434,482.950	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV	411,052	63.820	26,233,338.640	
	AMERICA MOVIL SAB DE CV	3,527,878	17.870	63,043,179.860	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA SA	244,700	31.250	7,646,875.000	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	43,400	129.350	5,613,790.000	
	WAL-MART DE MEXICO SAB DE CV	546,200	49.420	26,993,204.000	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL PACIFICO SAB DE CV	39,700	192.230	7,631,531.000	
	GENTERA SAB DE CV	103,000	14.760	1,520,280.000	
INFRAESTRUCTURA ENERGETICA NOVA SAB DE CV	53,200	92.690	4,931,108.000		
BANCO SANTANDER MEXICO SA-B	195,390	26.800	5,236,452.000		
GRUPO LALA SAB DE CV	50,400	23.890	1,204,056.000		
メキシコ・ペソ 小計	6,682,630		257,303,628.900 (1,510,372,302)		
ユーロ	PIRAEUS BANK S.A	25,000	2.800	70,000.000	
	ALPHA BANK A.E.	154,071	1.860	286,572.060	
	NATIONAL BANK OF GREECE	660,069	0.285	188,119.660	
	TITAN CEMENT CO. S.A.	5,217	21.050	109,817.850	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	25,490	11.280	287,527.200	
	FF GROUP	3,130	16.980	53,147.400	
	EUROBANK ERGASIAS	194,100	0.855	165,955.500	
	OPAP SA	20,000	9.400	188,000.000	
JUMBO SA	10,420	14.980	156,091.600		
ユーロ 小計	1,097,497		1,505,231.270		

韓国・ウォン	CHEIL WORLDWIDE INC	7,097	18,600.000	132,004,200.000	
	HANMI SCIENCE CO LTD	1,164	97,100.000	113,024,400.000	
	HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	4,100	100,500.000	412,050,000.000	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANC	3,287	269,500.000	885,846,500.000	
	DB INSURANCE CO LTD	5,060	60,200.000	304,612,000.000	
	COWAY CO LTD	5,280	88,400.000	466,752,000.000	
	KT&G CORP	12,385	101,500.000	1,257,077,500.000	
	S-1 CORPORATION	2,126	97,100.000	206,434,600.000	
	KOREA GAS CORP	2,997	49,300.000	147,752,100.000	
	CJ CORP	1,547	159,000.000	245,973,000.000	
	KAKAO CORP	4,877	122,500.000	597,432,500.000	
	SK TELECOM CO LTD	2,030	232,500.000	471,975,000.000	
	DAELIM INDUSTRIAL CO	2,987	75,900.000	226,713,300.000	
	MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD	40,612	9,020.000	366,320,240.000	
	NCSOFT CORPORATION	1,870	398,000.000	744,260,000.000	
	DOOSAN HEAVY INDUSTRIES AND CONSTRUCTION CO LTD	4,050	14,900.000	60,345,000.000	
	DAEWOO ENGINEERING & CONSTRUCT	13,540	5,510.000	74,605,400.000	
	POSCO DAEWOO CORP	3,600	23,600.000	84,960,000.000	
	LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD	1,015	1,305,000.000	1,324,575,000.000	
	LG CHEM LTD	4,940	368,000.000	1,817,920,000.000	
	LG CHEM LTD	641	208,000.000	133,328,000.000	
	LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD	177	762,000.000	134,874,000.000	
	SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD	45,023	44,900.000	2,021,532,700.000	
	HYUNDAI DEVELOPMENT CO	5,910	44,050.000	260,335,500.000	
	S-OIL CORP	4,383	115,000.000	504,045,000.000	
	HANWHA CHEMICAL CORPORATION	7,771	29,350.000	228,078,850.000	
	SAMSUNG SECURITIES CO LTD	6,600	35,550.000	234,630,000.000	
	LOTTE CHEMICAL CORPORATION	1,665	430,000.000	715,950,000.000	
	HOTEL SHILLA CO LTD	2,955	105,500.000	311,752,500.000	
	HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	3,620	125,500.000	454,310,000.000	
	HYUNDAI MOBIS	7,183	263,000.000	1,889,129,000.000	
	SK HYNIX INC	61,213	80,400.000	4,921,525,200.000	
	HYUNDAI ENGINEERING & CONSTRUCTION CO LTD	7,926	43,400.000	343,988,400.000	
	HYUNDAI MOTOR CO	1,997	89,000.000	177,733,000.000	
	HYUNDAI MOTOR CO	16,375	151,000.000	2,472,625,000.000	
	HYUNDAI STEEL CO	8,009	50,200.000	402,051,800.000	

INDUSTRIAL BANK OF KOREA	25,079	15,800.000	396,248,200.000	
KCC CORP	670	362,000.000	242,540,000.000	
KIA MOTORS CORP	28,090	32,250.000	905,902,500.000	
KOREA ZINC CO LTD	827	458,000.000	378,766,000.000	
KOREA ELECTRIC POWER CORP	27,452	34,700.000	952,584,400.000	
HANWHA CORP	3,785	39,100.000	147,993,500.000	
KOREAN AIR CO LTD	5,301	35,950.000	190,570,950.000	
OCI COMPANY LTD	1,829	161,500.000	295,383,500.000	
CJ LOGISTICS	860	137,500.000	118,250,000.000	
KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	1,930	94,800.000	182,964,000.000	
KT CORP	2,048	27,650.000	56,627,200.000	
LG ELECTRONICS INC	11,315	107,000.000	1,210,705,000.000	
LOTTE CORP	3,366	64,100.000	215,760,600.000	
HANSSEM CO LTD	1,100	149,000.000	163,900,000.000	
LG CORP	10,215	86,100.000	879,511,500.000	
NH INVESTMENT & SECURITIES CO LTD	17,037	14,000.000	238,518,000.000	
GS ENGINEERING & CONSTRUCTION	5,490	33,750.000	185,287,500.000	
NAVER CORP	2,952	775,000.000	2,287,800,000.000	
HYUNDAI DEPARTMENT STORE CO LTD	1,187	91,700.000	108,847,900.000	
DONGSUH CO INC	2,798	27,000.000	75,546,000.000	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO LTD	4,061	80,700.000	327,722,700.000	
OTTOGI CORP	112	778,000.000	87,136,000.000	
AMOREPACIFIC GROUP	2,891	146,500.000	423,531,500.000	
KANGWON LAND INC	12,047	27,400.000	330,087,800.000	
POSCO	7,830	324,500.000	2,540,835,000.000	
SAMSUNG SDI CO LTD	5,831	186,000.000	1,084,566,000.000	
SAMSUNG ELECTRO- MECHANICS CO LTD	6,007	109,000.000	654,763,000.000	
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	10,145	2,444,000.000	24,794,380,000.000	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES CO LTD	29,901	7,750.000	231,732,750.000	
HANWHA TECHWIN CO LTD	3,141	26,900.000	84,492,900.000	
SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	1,833	2,016,000.000	3,695,328,000.000	
SHINSEGAE CO LTD	827	399,000.000	329,973,000.000	
HYOSUNG CORP	2,165	120,000.000	259,800,000.000	
YUHAN CORP	1,037	257,500.000	267,027,500.000	
HANON SYSTEMS	19,093	11,100.000	211,932,300.000	
HYUNDAI MARINE & FIRE INSURANCE CO LTD	6,480	36,700.000	237,816,000.000	
GS HOLDINGS CORP	5,269	61,100.000	321,935,900.000	
LG DISPLAY CO LTD	25,072	25,150.000	630,560,800.000	
SK NETWORKS CO LTD	14,810	5,660.000	83,824,600.000	

CELLTRION INC	8,557	303,000.000	2,592,771,000.000	
HANA FINANCIAL GROUP	31,314	42,800.000	1,340,239,200.000	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	2,057	182,500.000	375,402,500.000	
LOTTE SHOPPING CO	1,227	252,000.000	309,204,000.000	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LTD	7,458	114,000.000	850,212,000.000	
AMOREPACIFIC CORP	3,495	342,000.000	1,195,290,000.000	
AMOREPACIFIC CORP-PREF	752	172,500.000	129,720,000.000	
SAMSUNG CARD CO	2,877	35,650.000	102,565,050.000	
SK INNOVATION CO LTD	6,727	203,000.000	1,365,581,000.000	
CJ CHEILJEDANG CORP	870	320,500.000	278,835,000.000	
STX PAN OCEAN CO LTD	18,395	4,805.000	88,387,975.000	
KEPCO PLANT SERVICE & ENGINEERING CO LTD	1,825	46,100.000	84,132,500.000	
LG INNOTEK CO LTD	1,440	119,000.000	171,360,000.000	
SK HOLDINGS CO LTD	3,440	291,000.000	1,001,040,000.000	
KB FINANCIAL GROUP INC	41,935	58,600.000	2,457,391,000.000	
MEDY-TOX INC	464	722,000.000	335,008,000.000	
HYUNDAI WIA CORP	1,454	53,600.000	77,934,400.000	
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES LTD	6,872	47,850.000	328,825,200.000	
BNK FINANCIAL GROUP INC	30,024	10,300.000	309,247,200.000	
HANMI PHARM CO LTD	690	555,000.000	382,950,000.000	
HANWHA LIFE INSURANCE CO LTD	26,430	5,980.000	158,051,400.000	
O MEDIA HOLDINGS CO LTD	1,950	93,200.000	181,740,000.000	
E-MART CO LTD	2,247	290,500.000	652,753,500.000	
DGB FINANCIAL GROUP INC	18,575	11,200.000	208,040,000.000	
GS RETAIL CO LTD	2,482	35,250.000	87,490,500.000	
HANKOOK TIRE CO LTD NEW	7,517	52,400.000	393,890,800.000	
HYUNDAI ROBOTICS CO LTD	978	408,000.000	399,024,000.000	
BGF RETAIL CO LTD	854	178,000.000	152,012,000.000	
ORION CORP REPUBLIC OF KOREA	2,381	129,000.000	307,149,000.000	
ING LIFE INSURANCE KOREA LTD	3,735	43,800.000	163,593,000.000	
NETMARBLE GAMES CORP	2,766	139,000.000	384,474,000.000	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES CO LTD-RTS	12,301	1,850.000	22,756,850.000	
SAMSUNG SDS CO LTD	3,675	245,000.000	900,375,000.000	
WOORI BANK	50,829	14,250.000	724,313,250.000	
SAMSUNG C&T CORP	8,072	144,000.000	1,162,368,000.000	
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	1,759	583,000.000	1,025,497,000.000	
DOOSAN BOBCAT INC	4,679	32,200.000	150,663,800.000	
SILLAJEN INC	5,378	104,100.000	559,849,800.000	
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	3,490	102,000.000	355,980,000.000	
韓国・ウォン 小計	949,866		92,743,792,115.000 (9,330,025,486)	

香港・ドル	JIANGXI COPPER CO LTD	138,000	11.100	1,531,800.000	
	JIANGSU EXPRESS	124,000	11.020	1,366,480.000	
	CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD	162,000	8.570	1,388,340.000	
	CHINA MOBILE LIMITED	644,000	74.400	47,913,600.000	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	131,000	48.000	6,288,000.000	
	BEIJING ENTERPRISES	52,500	40.800	2,142,000.000	
	HUANENG POWER INTERNATIONAL IN	424,000	4.980	2,111,520.000	
	ALIBABA HEALTH INFORMATION TECHNOLOGY	372,000	4.030	1,499,160.000	
	YANZHOU COAL MINING CO LTD	188,000	10.060	1,891,280.000	
	HENGAN INTERNATIONAL GROUP	77,000	81.500	6,275,500.000	
	CNOOC LTD	1,877,000	11.540	21,660,580.000	
	BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	322,000	16.600	5,345,200.000	
	CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LTD	498,000	21.950	10,931,100.000	
	CHINA OVERSEAS LAND & INVESTME	405,120	28.050	11,363,616.000	
	CHINA RESOURCES LAND LTD	292,888	29.450	8,625,551.600	
	CITIC LTD	630,000	11.460	7,219,800.000	
	BEIJING CAPITAL INTERNATIONAL	188,000	11.140	2,094,320.000	
	LENOVO GROUP LTD	730,000	4.050	2,956,500.000	
	PETRO CHINA CO LTD	2,200,000	5.330	11,726,000.000	
	CHINA UNICOM HONG KONG LTD	648,742	10.200	6,617,168.400	
	CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS CO LTD	174,190	26.300	4,581,197.000	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL COR	2,665,200	7.380	19,669,176.000	
	TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	102,000	23.050	2,351,100.000	
	ENN ENERGY HOLDINGS LTD	80,000	69.850	5,588,000.000	
	KUNLUN ENERGY COMPANY LTD	366,000	6.750	2,470,500.000	
	COSCO SHIPPING PORTS LTD	162,000	6.890	1,116,180.000	
	CHINA MERCHANTS PORT HOLDINGS CO LTD	132,000	17.820	2,352,240.000	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	374,000	4.820	1,802,680.000	
	CHINA EVERBRIGHT LTD	112,000	17.120	1,917,440.000	
	CHINA GAS HOLDINGS LTD	185,800	28.500	5,295,300.000	
	KINGBOARD CHEMICALS HOLDINGS	66,000	35.850	2,366,100.000	

GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LTD	522,000	24.150	12,606,300.000	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LTD	86,000	28.150	2,420,900.000	
BYD CO LTD	68,000	62.850	4,273,800.000	
CHINA TELECOM CORP LTD	1,464,000	3.530	5,167,920.000	
CHINA OILFIELD SERVICES LTD	202,000	7.630	1,541,260.000	
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	1,170,000	0.970	1,134,900.000	
CHINA EVERBRIGHT INTERNATIONAL	249,000	11.000	2,739,000.000	
LEE & MAN PAPER MANUFACTURING LTD	170,000	8.880	1,509,600.000	
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	485,192	14.160	6,870,318.720	
AVICHINA INDUSTRY & TECHNOLOGY	225,000	5.420	1,219,500.000	
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS	195,200	14.160	2,764,032.000	
GREAT WALL MOTOR COMPANY LTD	290,000	7.880	2,285,200.000	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	779,000	22.000	17,138,000.000	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD	585,000	3.740	2,187,900.000	
SHANDONG WEIGAO GROUP MEDICAL-H	160,000	5.040	806,400.000	
SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	317,200	10.260	3,254,472.000	
WEICHAJ POWER CO LTD	215,440	9.630	2,074,687.200	
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEMICAL	353,000	4.900	1,729,700.000	
SHANGHAI INDUSTRIAL	43,000	20.750	892,250.000	
TINGYI HOLDING CORP	194,000	17.380	3,371,720.000	
TSINGTAO BREWERY CO LTD	40,000	44.000	1,760,000.000	
GUANGDONG INVESTMENTS LTD	298,000	12.560	3,742,880.000	
CHINA RESOURCES BEER HOLDINGS	173,333	37.400	6,482,654.200	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO LTD	146,000	8.270	1,207,420.000	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	474,000	16.760	7,944,240.000	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	292,000	28.050	8,190,600.000	
TENCENT HOLDINGS LTD	597,900	417.200	249,443,880.000	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	547,000	84.450	46,194,150.000	
BEIJING ENTERPRISES WATER GROUP LTD	566,000	4.380	2,479,080.000	
GOME RETAIL HOLDINGS LTD	970,240	0.890	863,513.600	

AIR CHINA / HONG KONG	198,000	10.700	2,118,600.000	
ZTE CORP	71,288	26.550	1,892,696.400	
SHANGHAI ELECTRIC GROUP CO LTD	250,000	2.740	685,000.000	
CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD	360,000	20.100	7,236,000.000	
BANK OF COMMUNICATIONS	917,205	6.320	5,796,735.600	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT HOLDINGS LTD	206,250	9.900	2,041,875.000	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	77,500	147.700	11,446,750.000	
CHINA CONSTRUCTION BANK	8,818,530	8.160	71,959,204.800	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP HOLDINGS LTD	80,000	83.000	6,640,000.000	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	294,000	8.740	2,569,560.000	
AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	160,000	16.980	2,716,800.000	
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS LTD	168,000	12.480	2,096,640.000	
CHINA NATIONAL BLDG MATERIAL	290,000	9.410	2,728,900.000	
BANK OF CHINA LTD	8,310,200	4.250	35,318,350.000	
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	120,000	22.750	2,730,000.000	
GUANGZHOU R&F PROPERTIES CO LTD	100,400	19.860	1,993,944.000	
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	408,970	33.700	13,782,289.000	
IND & COMM BK OF CHINA - H	7,730,235	6.820	52,720,202.700	
CHINA COMMUNICATIONS SERVICES	275,600	4.590	1,265,004.000	
CHINA COMMUNICATIONS CONSTRUCTION CO LTD	483,000	8.440	4,076,520.000	
HAITIAN INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	64,000	23.400	1,497,600.000	
ZHUZHOU CRRG TIMES ELECTRIC CO LTD	60,700	39.150	2,376,405.000	
HAIER ELECTRONICS GROUP CO LTD	125,000	28.700	3,587,500.000	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD	569,142	16.740	9,527,437.080	
CHINA MOLYBDENUM CO LTD	369,000	6.110	2,254,590.000	
CHINA CITIC BANK-H	938,800	5.510	5,172,788.000	
SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	75,700	158.200	11,975,740.000	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	115,000	41.000	4,715,000.000	
FOSUN INTERNATIONAL	279,528	17.920	5,009,141.760	

CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP LTD	568,000	4.590	2,607,120.000	
SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD	308,500	5.800	1,789,300.000	
SOHO CHINA LTD	178,000	4.130	735,140.000	
KINGSOFT CORP LTD	81,000	25.950	2,101,950.000	
GCL POLY ENERGY HOLDINGS LTD	1,362,000	1.010	1,375,620.000	
CHINA RAILWAY GROUP LTD	447,000	5.670	2,534,490.000	
BYD ELECTRONIC INTERNATIONAL CO LTD	79,000	13.760	1,087,040.000	
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION CORP	187,500	8.480	1,590,000.000	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	497,000	6.520	3,240,440.000	
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	276,800	35.400	9,798,720.000	
CHINA EVERGRANDE GROUP	349,000	27.800	9,702,200.000	
CRRC CORP LTD - H	403,450	6.690	2,699,080.500	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDINGS LTD	153,000	19.040	2,913,120.000	
SUN ART RETAIL GROUP LTD	240,000	9.530	2,287,200.000	
SINOPHARM GROUP CO	128,000	42.900	5,491,200.000	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD	207,805	15.140	3,146,167.700	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL BANK	285,000	6.290	1,792,650.000	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP CORP	317,000	6.640	2,104,880.000	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD	90,000	23.350	2,101,500.000	
HUANENG RENEWABLES CORP LTD	472,000	3.300	1,557,600.000	
SIHUAN PHARMACEUTICAL HOLDINGS GROUP LTD	325,000	2.250	731,250.000	
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	257,000	34.300	8,815,100.000	
LONGFOR PROPERTIES CO LTD	161,500	24.600	3,972,900.000	
NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	81,400	38.850	3,162,390.000	
CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	542,880	7.550	4,098,744.000	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD	257,000	3.880	997,160.000	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA	2,726,000	4.460	12,157,960.000	
FAR EAST HORIZON LTD	202,000	8.780	1,773,560.000	
CITIC SECURITIES CO LTD	242,500	19.340	4,689,950.000	
HAITONG SECURITIES CO LTD	363,600	10.920	3,970,512.000	

	PEOPLE'S INSURANCE CO GROUP OF CHINA LTD	691,000	3.860	2,667,260.000	
	SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	49,000	51.400	2,518,600.000	
	CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	382,000	6.960	2,658,720.000	
	CHINA GALAXY SECURITIES CO LTD	345,500	5.220	1,803,510.000	
	HANERGY THIN FILM POWER GROUP	986,000	0.000	0.000	
	NEXTEER AUTOMOTIVE GROUP LTD	100,000	12.700	1,270,000.000	
	CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS CO LTD	323,000	0.000	0.000	
	CHINA CINDA ASSET MANAGEMENT CO LTD	904,000	2.900	2,621,600.000	
	CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS LTD	164,000	24.900	4,083,600.000	
	CHINA VANKE CO LTD-H	125,461	35.000	4,391,135.000	
	CGN POWER CO LTD	1,213,000	2.070	2,510,910.000	
	FULLSHARE HOLDINGS LTD	702,500	4.160	2,922,400.000	
	GF SECURITIES CO LTD	133,200	14.940	1,990,008.000	
	FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD	51,200	30.700	1,571,840.000	
	HUATAI SECURITIES CO LTD	179,400	15.960	2,863,224.000	
	3SBIO INC	113,000	19.200	2,169,600.000	
	CHINA RESOURCES PHARMACEUTICAL GROUP LTD	212,000	12.440	2,637,280.000	
	CHINA HUARONG ASSET MANAGEMENT CO LTD	1,000,000	3.480	3,480,000.000	
	MEITU INC	105,000	8.870	931,350.000	
	香港・ドル 小計	77,885,189		1,040,800,961.260 (14,196,525,112)	
台湾・ドル	ACER INC	314,532	22.550	7,092,696.600	
	ASUSTEK COMPUTER INC	74,554	277.500	20,688,735.000	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	46,616	129.500	6,036,772.000	
	ADVANCED SEMICONDUCTOR ENGINEERING INC	737,806	43.000	31,725,658.000	
	ASIA CEMENT CORP	262,928	29.450	7,743,229.600	
	TAIWAN BUSINESS BANK	336,171	8.840	2,971,751.640	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMICONDUCTOR CORP	99,000	64.300	6,365,700.000	
	MICRO-STAR INTERNATIONAL CO LTD	73,000	98.600	7,197,800.000	
	CHICONY ELECTRONICS CO LTD	72,543	75.600	5,484,250.800	
	QUANTA COMPUTER INC	266,858	57.700	15,397,706.600	

HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	90,070	45.400	4,089,178.000	
EVA AIRWAYS CORP	286,161	15.250	4,363,955.250	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	68,760	364.000	25,028,640.000	
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	539,755	17.050	9,202,822.750	
CHINA AIRLINES	232,156	10.600	2,460,853.600	
CHENG SHIN RUBBER INDUSTRY CO	201,169	47.900	9,635,995.100	
CHINA STEEL CORP	1,350,058	23.750	32,063,877.500	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD/TAIWAN	264,146	30.800	8,135,696.800	
ADVANTECH CO LTD	36,889	206.000	7,599,134.000	
COMPAL ELECTRONICS INC	450,304	19.550	8,803,443.200	
DELTA ELECTRONICS INC	206,663	127.500	26,349,532.500	
NANYA TECHNOLOGY CORP	110,000	91.900	10,109,000.000	
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	390,327	114.500	44,692,441.500	
AU OPTRONICS CORP	880,194	13.300	11,706,580.200	
TAIWAN MOBILE CO LTD	171,800	110.000	18,898,000.000	
EVERGREEN MARINE CORP	178,658	15.100	2,697,735.800	
FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	341,824	27.200	9,297,612.800	
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	29,825	133.000	3,966,725.000	
ECLAT TEXTILE CO LTD	18,322	368.000	6,742,496.000	
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	61,285	130.500	7,997,692.500	
FORMOSA PLASTICS CORP	436,633	105.500	46,064,781.500	
FORMOSA TAFFETA CO LTD	65,000	32.250	2,096,250.000	
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE CO	310,594	112.500	34,941,825.000	
GIANT MANUFACTURING	30,151	148.500	4,477,423.500	
MEDIATEK INC	157,507	327.000	51,504,789.000	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD	703,936	51.000	35,900,736.000	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	709,313	17.800	12,625,771.400	
HOTAI MOTOR CO LTD	31,000	290.000	8,990,000.000	
FAR EASTONE TELECOMMUNICATIONS CO LTD	177,000	78.600	13,912,200.000	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,046,141	13.800	14,436,745.800	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	858,920	53.000	45,522,760.000	
CHINA DEPT FINANCIAL HOLDING	1,361,403	10.550	14,362,801.650	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO LTD	907,028	19.800	17,959,154.400	

HON HAI PRECISION INDUSTRY	1,634,532	87.000	142,204,284.000	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,137,495	25.650	29,176,746.750	
LARGAN PRECISION CO LTD	10,220	3,250.000	33,215,000.000	
TAISHIN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	998,977	14.300	14,285,371.100	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING CO	856,724	11.700	10,023,670.800	
INVENTEC CO LTD	268,005	23.050	6,177,515.250	
HTC CORPORATION	56,832	64.500	3,665,664.000	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	218,845	40.500	8,863,222.500	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	1,095,533	10.600	11,612,649.800	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,850,048	21.050	38,943,510.400	
MACRONIX INTERNATIONAL	193,000	50.400	9,727,200.000	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO LTD	891,327	20.300	18,093,938.100	
POWERTECH TECHNOLOGY INC	68,560	94.000	6,444,640.000	
NAN YA PLASTICS CORP	499,828	83.800	41,885,586.400	
WISTRON CORP	259,301	23.700	6,145,433.700	
POU CHEN CORP	236,990	38.100	9,029,319.000	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CORP	511,297	70.600	36,097,568.200	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	57,392	302.500	17,361,080.000	
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	137,480	117.500	16,153,900.000	
PHISON ELECTRONICS CORP	16,658	294.000	4,897,452.000	
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	90,656	35.600	3,227,353.600	
RUENTEX INDUSTRIES LTD	68,715	58.500	4,019,827.500	
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	94,588	77.700	7,349,487.600	
SILICONWARE PRECISION INDS	227,743	50.900	11,592,118.700	
STANDARD FOODS CORP	70,639	70.200	4,958,857.800	
SYNNEX TECHNOLOGY INTERNATIONAL CORP	144,899	44.250	6,411,780.750	
TAIWAN CEMENT CORP	389,874	38.200	14,893,186.800	
TECO ELECTRIC AND MACHINERY CO LTD	228,000	24.450	5,574,600.000	
TAIWAN SEMICONDUCTOR	2,580,083	245.500	633,410,376.500	
UNITED MICROELECTRONICS CORP	1,200,525	15.300	18,368,032.500	
WINBOND ELECTRONICS CORP	324,000	18.900	6,123,600.000	
YAGEO CORP	22,000	545.000	11,990,000.000	
TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	227,000	22.550	5,118,850.000	

	INNOLUX CORPORATION	964,345	12.700	12,247,181.500	
	WPG HOLDINGS CO LTD	199,526	38.950	7,771,537.700	
	HIWIN TECHNOLOGIES CORP	20,560	480.000	9,868,800.000	
	TAIMED BIOLOGICS INC	18,000	236.500	4,257,000.000	
	PEGATRON CORP	195,554	71.800	14,040,777.200	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	13,000	565.000	7,345,000.000	
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	34,000	306.000	10,404,000.000	
	CHAILEASE HOLDING CO LTD	130,076	103.500	13,462,866.000	
	ASIA PACIFIC TELECOM CO LTD	188,000	8.990	1,690,120.000	
	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING LTD	48,385	67.700	3,275,664.500	
	TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL HOLDING	852,828	17.300	14,753,924.400	
	GLOBALWAFERS CO LTD	21,000	458.500	9,628,500.000	
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	15,000	275.000	4,125,000.000	
	GENERAL INTERFACE SOLUTION HOLDING LTD	18,000	170.000	3,060,000.000	
台湾・ドル 小計		34,373,040		1,980,313,146.040 (7,267,749,246)	
南アフリカ・ランド	BIDVEST GROUP LTD	35,898	237.740	8,534,390.520	
	TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	44,326	100.260	4,444,124.760	
	DISCOVERY LTD	35,240	173.000	6,096,520.000	
	REDEFINE PROPERTIES LTD	510,000	11.630	5,931,300.000	
	GOLD FIELDS LTD	97,228	45.650	4,438,458.200	
	REMGRO LTD	56,329	225.000	12,674,025.000	
	THE FOSCHINI GROUP LTD	22,000	209.630	4,611,860.000	
	MMI HOLDINGS LTD	111,471	22.600	2,519,244.600	
	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	322,227	28.520	9,189,914.040	
	EXXARO RESOURCES LTD	25,340	111.890	2,835,292.600	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	3,850	871.460	3,355,121.000	
	LIBERTY HOLDINGS LTD	15,137	126.700	1,917,857.900	
	MTN GROUP LTD	178,439	118.000	21,055,802.000	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	47,774	111.360	5,320,112.640	
	TELKOM SA SOC LTD	31,588	57.100	1,803,674.800	
	FIRSTRAND LTD	353,355	66.480	23,491,040.400	
	PSG GROUP LTD	15,546	221.000	3,435,666.000	
	NASPERS LTD	46,010	3,050.000	140,330,500.000	
	CORONATION FUND MANAGERS LTD	26,700	84.180	2,247,606.000	
	NEDBANK GROUP LTD	22,070	287.000	6,334,090.000	
NETCARE LTD	106,707	27.800	2,966,454.600		
PICK'N PAY STORES LTD	43,375	66.180	2,870,557.500		

RMB HOLDINGS LTD	70,697	77.500	5,479,017.500	
ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	6,200	325.000	2,015,000.000	
SAPPI LTD	56,231	80.230	4,511,413.130	
SASOL LTD	58,419	424.560	24,802,370.640	
SHOPRITE HOLDINGS LTD	46,966	245.500	11,530,153.000	
MR PRICE GROUP LTD	25,911	276.000	7,151,436.000	
BRAIT SE	37,060	37.690	1,396,791.400	
STANDARD BANK GROUP LTD	135,546	216.340	29,324,021.640	
SPAR GROUP LTD/THE	21,808	201.650	4,397,583.200	
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	99,154	61.500	6,097,971.000	
IMPERIAL HOLDINGS LTD	16,774	240.750	4,038,340.500	
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LTD	41,188	264.470	10,892,990.360	
BARCLAYS AFRICA GROUP LTD	75,862	183.390	13,912,332.180	
TIGER BRANDS LTD	16,262	393.000	6,390,966.000	
SANLAM LTD	148,683	81.110	12,059,678.130	
INVESTEC LTD	29,312	94.400	2,767,052.800	
KUMBA IRON ORE LTD	5,327	292.390	1,557,561.530	
PIONEER FOODS LTD	15,500	125.270	1,941,685.000	
MONDI LTD	11,520	328.000	3,778,560.000	
LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDINGS LTD	135,845	27.570	3,745,246.650	
RMI HOLDINGS	63,840	40.300	2,572,752.000	
VODACOM GROUP PTY LTD	64,073	151.000	9,675,023.000	
SIBANYE GOLD LTD	172,000	11.000	1,892,000.000	
NEPI ROCKCASTLE PLC	37,546	137.500	5,162,575.000	
FORTRESS REIT LTD-A	102,950	16.400	1,688,380.000	
FORTRESS REIT LTD-B	95,302	16.520	1,574,389.040	
STEINHOFF INTERNATIONAL HOLDINGS NV	267,866	2.510	672,343.660	
BID CORP LTD	35,689	276.400	9,864,439.600	
南アフリカ・ランド 小計	4,044,141		467,295,685.520 (4,158,931,601)	
合計	238,108,960		61,744,203,468 (61,744,203,468)	

(2) 株式以外の有価証券

平成30年4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	1,546,875.000	20,078,437.500	
		FOMENTO ECONOMICO MEXICANO SAB DE CV	203,900.000	35,584,628.000	
	メキシコ・ペソ	小計	1,750,775.000	55,663,065.500 (326,742,195)	
投資信託受益証券	合計		1,750,775	326,742,195 (326,742,195)	
投資証券	トルコ・リラ	EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATIRIM	231,071.000	566,123.950	
	トルコ・リラ	小計	231,071.000	566,123.950 (14,753,190)	
	メキシコ・ペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	322,600.000	9,645,740.000	
	メキシコ・ペソ	小計	322,600.000	9,645,740.000 (56,620,494)	
	南アフリカ・ランド	HYPROP INVESTMENTS LTD	29,707.000	3,279,355.730	
		RESILIENT REIT LTD	28,600.000	1,858,714.000	
	南アフリカ・ランド	小計	58,307.000	5,138,069.730 (45,728,820)	
投資証券	合計		611,978	117,102,504 (117,102,504)	
合計				443,844,699 (443,844,699)	

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 37銘柄	10.71%	-%	-%	11.29%
アラブ首長国連邦・ディ ルハム	株式 10銘柄	0.51%	-%	-%	0.54%
インド・ルピー	株式 80銘柄	7.95%	-%	-%	8.37%
インドネシア・ルピア	株式 29銘柄	2.00%	-%	-%	2.10%
カタール・リアル	株式 12銘柄	0.55%	-%	-%	0.58%
コロンビア・ペソ	株式 9銘柄	0.43%	-%	-%	0.46%
タイ・バーツ	株式 35銘柄	2.27%	-%	-%	2.40%
チェコ・コルナ	株式 4銘柄	0.18%	-%	-%	0.19%
チリ・ペソ	株式 18銘柄	1.16%	-%	-%	1.22%
トルコ・リラ	株式 24銘柄 投資証券 1銘柄	0.85% -%	-% -%	-% 0.02%	0.92%
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	0.93%	-%	-%	0.98%
ブラジル・レアル	株式 54銘柄	6.80%	-%	-%	7.16%
ポーランド・ズロチ	株式 23銘柄	1.18%	-%	-%	1.24%
マレーシア・リンギット	株式 46銘柄	2.38%	-%	-%	2.51%
メキシコ・ペソ	株式 23銘柄 投資信託 受益証券 2銘柄 投資証券 1銘柄	2.30% -% -%	-% 0.50% -%	-% -% 0.09%	3.05%
ユーロ	株式 9銘柄	0.30%	-%	-%	0.32%
韓国・ウォン	株式 114銘柄	14.24%	-%	-%	15.00%
香港・ドル	株式 139銘柄	21.66%	-%	-%	22.83%
台湾・ドル	株式 90銘柄	11.09%	-%	-%	11.69%
南アフリカ・ランド	株式 50銘柄 投資証券 2銘柄	6.35% -%	-% -%	-% 0.07%	6.76%

(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10月11日現在	平成30年4月11日現在
資産の部			
流動資産			
預金		2,481,336,804	3,187,738,055
コール・ローン		28,939,282	267,666,351
国債証券		99,618,661,312	107,644,798,793
派生商品評価勘定		12,650	704,000
未収利息		946,107,887	936,989,196
前払費用		89,222,926	266,140,281
流動資産合計		103,164,280,861	112,304,036,676
資産合計		103,164,280,861	112,304,036,676
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		-	122,000
未払金		-	2,242,438,112
未払解約金		19,626,000	25,630,000
流動負債合計		19,626,000	2,268,190,112
負債合計		19,626,000	2,268,190,112
純資産の部			
元本等			
元本	1	54,294,770,403	61,796,728,209
剰余金			
剰余金又は欠損金()		48,849,884,458	48,239,118,355
元本等合計		103,144,654,861	110,035,846,564
純資産合計		103,144,654,861	110,035,846,564
負債純資産合計		103,164,280,861	112,304,036,676

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	平成29年10月11日現在	平成30年4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	44,434,003,569円	54,294,770,403円
同期中追加設定元本額	16,812,236,738円	27,291,507,415円
同期中一部解約元本額	6,951,469,904円	19,789,549,609円
元本の内訳		
ファンド名		
D I A M新興国債券インデックスファンド<為替ヘッジなし>（ファンドラップ）	181,792,492円	273,372,366円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	7,101,660円	29,655,552円
たわらノーロード バランス（堅実型）	- 円	1,218,192円
たわらノーロード バランス（標準型）	- 円	3,271,288円
たわらノーロード バランス（積極型）	- 円	2,604,196円
たわらノーロード 最適化バランス（保守型）	- 円	74,492円
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	- 円	113,229円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	- 円	464,224円
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	- 円	222,746円
たわらノーロード 最適化バランス（積極型）	- 円	341,580円

マネックス資産設計ファンド エボリューション	76,999,550円	59,295,344円
DIAM DC 8資産バラン スファンド(新興国10)	25,981,179円	30,468,731円
DIAM DC 8資産バラン スファンド(新興国20)	80,952,874円	104,407,098円
DIAM DC 8資産バラン スファンド(新興国30)	171,203,232円	230,214,662円
投資のソムリエ	5,961,147,296円	8,030,523,614円
クルーズコントロール	1,032,352,928円	151,309,039円
投資のソムリエ<DC年金>	319,596,305円	573,807,004円
DIAM 8資産バランスファ ンドN<DC年金>	95,839,422円	122,747,118円
クルーズコントロール<DC年 金>	411,496円	55,947円
DIAMコア資産設計ファンド (堅実型)	5,752,859円	756,244円
DIAMコア資産設計ファンド (積極型)	15,523,620円	2,284,297円
投資のソムリエ<DC年金>リ スク抑制型	107,240,403円	376,827,557円
ダイナミック・ナビゲーション リスク抑制世界8資産バラン スファンド	176,447円	154,706円
ワールドアセットバランス(基 本コース)	1,366,137,447円	6,260,192,014円
ワールドアセットバランス(リ スク抑制コース)	634,800,774円	859,189,179円
ワールドアセットバランス(リ スク抑制コース)	1,995,022,904円	3,176,151,984円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤ-2045)	838,425円	1,380,918円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤ-2055)	838,425円	1,009,901円
リスク抑制世界8資産バラン スファンド(DC)	418,204円	1,888,535円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤ-2035)	-円	2,591,303円
エマージング債券リスク抑制型 (適格機関投資家限定)	14,760,996,316円	16,514,634,587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)	3,337,792,260円	3,283,385,257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)	7,422,869,881円	7,585,869,299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)	4,778,146,569円	4,972,001,878円
DIAMグローバル・リスク ファクター・パリティ戦略ファ ンド(適格機関投資家限定)	4,108,792,653円	2,951,435,236円

	D I A Mグローバル・リスク ファクター・パリティ戦略ファ ンドI I (適格機関投資家限 定)	4,580,605,368円	2,324,514,542円
	P - O n eマルチアセット戦略 ファンド(適格機関投資家限 定)	3,225,439,414円	3,868,294,350円
計		54,294,770,403円	61,796,728,209円
2 .	受益権の総数	54,294,770,403口	61,796,728,209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4月12日 至 平成29年10月11日	自 平成29年10月12日 至 平成30年4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10月11日現在	平成30年4月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成29年10月11日現在	平成30年4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	622,207,695	2,882,542,372
合計	622,207,695	2,882,542,372

（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10月11日まで及び平成29年4月19日から平成30年4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10月11日 現在				平成30年4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	129,146,150	-	129,133,500	12,650	-	-	-	-
アメリカ・ドル	129,146,150	-	129,133,500	12,650	-	-	-	-
買 建	-	-	-	-	1,519,974,000	-	1,520,556,000	582,000
アメリカ・ドル	-	-	-	-	1,519,974,000	-	1,520,556,000	582,000
合計	129,146,150	-	129,133,500	12,650	1,519,974,000	-	1,520,556,000	582,000

（注）時価の算定方法

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

(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10月11日現在	平成30年4月11日現在
1口当たり純資産額	1.8997円	1.7806円
(1万口当たり純資産額)	(18,997円)	(17,806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4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	9,200,000.000	8,753,800.000	
		BRAZIL 4.25 01/07/25	16,100,000.000	16,071,825.000	
		BRAZIL 4.875 01/22/21	11,000,000.000	11,456,500.000	
		BRAZIL 5.0 01/27/45	13,200,000.000	11,840,400.000	
		BRAZIL 5.625 01/07/41	8,900,000.000	8,722,000.000	
		BRAZIL 5.625 02/21/47	11,400,000.000	11,080,800.000	
		BRAZIL 6.0 04/07/26	8,200,000.000	9,007,700.000	
		BRAZIL 7.125 01/20/37	8,100,000.000	9,446,625.000	
		BRAZIL 8.25 01/20/34	6,000,000.000	7,593,600.000	
		BRAZIL 8.75 02/04/25	3,000,000.000	3,793,500.000	
		BRAZIL 8.875 10/14/19	4,600,000.000	5,034,700.000	
		COLOMBIA 2.625 03/15/23	4,300,000.000	4,125,291.000	
		COLOMBIA 3.875 04/25/27	9,400,000.000	9,280,150.000	
		COLOMBIA 4.0 02/26/24	8,100,000.000	8,211,375.000	
		COLOMBIA 4.375 07/12/21	10,800,000.000	11,202,300.000	
		COLOMBIA 4.5 01/28/26	5,400,000.000	5,607,198.000	
		COLOMBIA 5.0 06/15/45	14,800,000.000	15,077,500.000	
		COLOMBIA 5.625 02/26/44	10,200,000.000	11,281,200.000	
		COLOMBIA 6.125 01/18/41	10,000,000.000	11,550,000.000	
		COLOMBIA 7.375 09/18/37	6,800,000.000	8,806,000.000	
		COLOMBIA 8.125 05/21/24	4,300,000.000	5,284,485.000	
		CROATIA 5.5 04/04/23	5,800,000.000	6,237,378.000	
		CROATIA 6.0 01/26/24	4,800,000.000	5,313,072.000	
		CROATIA 6.375 03/24/21	4,500,000.000	4,871,025.000	
		CROATIA 6.625 07/14/20	5,800,000.000	6,239,524.000	
		CROATIA 6.75 11/05/19	8,200,000.000	8,685,604.000	
		HUNGARY 5.375 02/21/23	8,100,000.000	8,762,580.000	
		HUNGARY 5.375 03/25/24	5,800,000.000	6,334,760.000	
		HUNGARY 5.75 11/22/23	8,200,000.000	9,080,516.000	
		HUNGARY 6.25 01/29/20	8,500,000.000	8,982,460.000	
		HUNGARY 6.375 03/29/21	8,600,000.000	9,368,926.000	
		HUNGARY 7.625 03/29/41	3,800,000.000	5,508,784.000	
		INDONESIA 3.375 04/15/23	4,500,000.000	4,430,430.000	
		INDONESIA 3.75 04/25/22	9,000,000.000	9,060,750.000	
		INDONESIA 3.85 07/18/27	4,000,000.000	3,940,480.000	
		INDONESIA 4.125 01/15/25	10,200,000.000	10,363,200.000	
INDONESIA 4.35 01/08/27	4,200,000.000	4,281,942.000			
INDONESIA 4.625 04/15/43	4,000,000.000	3,954,400.000			
INDONESIA 4.75 01/08/26	7,000,000.000	7,353,430.000			
INDONESIA 4.875 05/05/21	9,700,000.000	10,132,911.000			

INDONESIA 5.125 01/15/45	6,800,000.000	7,100,764.000	
INDONESIA 5.25 01/08/47	4,200,000.000	4,478,838.000	
INDONESIA 5.25 01/17/42	6,900,000.000	7,331,526.000	
INDONESIA 5.875 01/15/24	8,800,000.000	9,723,824.000	
INDONESIA 5.95 01/08/46	4,000,000.000	4,671,720.000	
INDONESIA 6.75 01/15/44	7,700,000.000	9,766,295.000	
INDONESIA 7.75 01/17/38	6,300,000.000	8,584,947.000	
PANAMA 3.75 03/16/25	6,000,000.000	6,042,000.000	
PANAMA 3.875 03/17/28	6,200,000.000	6,231,000.000	
PANAMA 4.5 05/15/47	5,000,000.000	5,059,100.000	
PANAMA 5.2 01/30/20	6,800,000.000	7,099,200.000	
PANAMA 6.7 01/26/36	10,200,000.000	12,766,320.000	
PANAMA 7.125 01/29/26	5,000,000.000	6,111,250.000	
PANAMA 9.375 04/01/29	4,900,000.000	7,117,250.000	
PERU 4.125 08/25/27	6,600,000.000	6,946,500.000	
PERU 5.625 11/18/50	13,000,000.000	15,689,700.000	
PERU 6.55 03/14/37	6,200,000.000	7,925,460.000	
PERU 7.35 07/21/25	11,000,000.000	13,697,200.000	
PHILIPPINES 3.7 02/02/42	5,000,000.000	4,783,100.000	
PHILIPPINES 3.7 03/01/41	7,400,000.000	7,114,952.000	
PHILIPPINES 3.95 01/20/40	6,200,000.000	6,195,970.000	
PHILIPPINES 4.0 01/15/21	5,200,000.000	5,323,552.000	
PHILIPPINES 4.2 01/21/24	5,000,000.000	5,218,950.000	
PHILIPPINES 5.0 01/13/37	4,000,000.000	4,524,280.000	
PHILIPPINES 5.5 03/30/26	3,800,000.000	4,320,942.000	
PHILIPPINES 6.375 01/15/32	3,000,000.000	3,760,140.000	
PHILIPPINES 6.375 10/23/34	6,200,000.000	7,962,660.000	
PHILIPPINES 6.5 01/20/20	2,800,000.000	2,978,024.000	
PHILIPPINES 7.75 01/14/31	5,900,000.000	8,091,909.000	
PHILIPPINES 8.375 06/17/19	4,300,000.000	4,588,788.000	
PHILIPPINES 9.5 02/02/30	6,600,000.000	10,017,546.000	
ROMANIA 4.375 08/22/23	5,600,000.000	5,760,216.000	
ROMANIA 4.875 01/22/24	2,400,000.000	2,533,296.000	
ROMANIA 6.125 01/22/44	3,000,000.000	3,611,340.000	
ROMANIA 6.75 02/07/22	8,300,000.000	9,233,833.000	
RUSSIA FOREIGN BOND 5.0 04/29/20	15,200,000.000	15,591,096.000	
RUSSIAN FEDERATION 03/31/30	15,263,500.000	17,195,706.460	
RUSSIAN FEDERATION 4.25 06/23/27	8,800,000.000	8,392,120.000	
RUSSIAN FEDERATION 4.5 04/04/22	9,000,000.000	9,143,640.000	

RUSSIAN FEDERATION 4.75 05/27/26	11,800,000.000	11,831,742.000	
RUSSIAN FEDERATION 4.875 09/16/23	10,200,000.000	10,525,074.000	
RUSSIAN FEDERATION 5.25 06/23/47	24,800,000.000	23,462,536.000	
RUSSIAN FEDERATION 5.625 04/04/42	11,200,000.000	11,533,760.000	
RUSSIAN FEDERATION 5.875 09/16/43	5,200,000.000	5,549,180.000	
SOUTH AFRICA 4.3 10/12/28	6,200,000.000	5,822,978.000	
SOUTH AFRICA 4.665 01/17/24	4,700,000.000	4,730,738.000	
SOUTH AFRICA 4.875 04/14/26	4,600,000.000	4,601,610.000	
SOUTH AFRICA 5.0 10/12/46	2,800,000.000	2,553,936.000	
SOUTH AFRICA 5.375 07/24/44	3,200,000.000	3,070,304.000	
SOUTH AFRICA 5.5 03/09/20	6,000,000.000	6,236,580.000	
SOUTH AFRICA 5.875 05/30/22	4,200,000.000	4,520,292.000	
SOUTH AFRICA 5.875 09/16/25	6,200,000.000	6,625,258.000	
SOUTH AFRICA 6.875 05/27/19	6,300,000.000	6,566,679.000	
TURKEY 11.875 01/15/30	5,100,000.000	7,578,600.000	
TURKEY 3.25 03/23/23	5,100,000.000	4,721,478.000	
TURKEY 4.25 04/14/26	6,000,000.000	5,449,680.000	
TURKEY 4.875 04/16/43	10,100,000.000	8,103,129.000	
TURKEY 4.875 10/09/26	10,600,000.000	9,961,350.000	
TURKEY 5.125 03/25/22	5,300,000.000	5,381,673.000	
TURKEY 5.625 03/30/21	6,700,000.000	6,932,021.000	
TURKEY 5.75 03/22/24	9,300,000.000	9,512,784.000	
TURKEY 5.75 05/11/47	10,400,000.000	9,135,880.000	
TURKEY 6.0 01/14/41	11,700,000.000	10,885,680.000	
TURKEY 6.0 03/25/27	10,400,000.000	10,484,032.000	
TURKEY 6.25 09/26/22	8,500,000.000	8,977,105.000	
TURKEY 6.625 02/17/45	10,700,000.000	10,486,000.000	
TURKEY 6.75 05/30/40	6,700,000.000	6,808,205.000	
TURKEY 7.0 06/05/20	8,700,000.000	9,219,564.000	
TURKEY 7.375 02/05/25	11,300,000.000	12,441,300.000	
TURKEY 7.5 11/07/19	8,400,000.000	8,891,148.000	
UNITED MEXICAN STATES 3.5 01/21/21	6,200,000.000	6,277,500.000	
UNITED MEXICAN STATES 3.6 01/30/25	9,200,000.000	9,108,000.000	

	UNITED MEXICAN STATES 3.625 03/15/22	8,900,000.000	9,040,442.000	
	UNITED MEXICAN STATES 4.0 10/02/23	12,700,000.000	13,041,249.000	
	UNITED MEXICAN STATES 4.125 01/21/26	10,000,000.000	10,187,500.000	
	UNITED MEXICAN STATES 4.15 03/28/27	10,600,000.000	10,721,900.000	
	UNITED MEXICAN STATES 4.35 01/15/47	7,000,000.000	6,473,880.000	
	UNITED MEXICAN STATES 4.6 01/23/46	10,600,000.000	10,167,732.000	
	UNITED MEXICAN STATES 4.75 03/08/44	16,000,000.000	15,720,000.000	
	UNITED MEXICAN STATES 5.55 01/21/45	11,400,000.000	12,516,174.000	
	UNITED MEXICAN STATES 5.75 10/12/2110	9,200,000.000	9,485,200.000	
	UNITED MEXICAN STATES 6.05 01/11/40	11,900,000.000	13,557,075.000	
	UNITED MEXICAN STATES 6.75 09/27/34	6,000,000.000	7,375,800.000	
	アメリカ・ドル 小計	949,163,500.000 (101,655,410,850)	1,005,086,823.460 (107,644,798,793)	
国債証券 合計		101,655,410,850 (101,655,410,850)	107,644,798,793 (107,644,798,793)	
合計		101,655,410,850 (101,655,410,850)	107,644,798,793 (107,644,798,793)	

(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 123銘柄	97.83%	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】

D I A Mコア資産設計ファンド(堅実型)

平成30年4月27日現在

資産総額	134,583,638円
負債総額	66,868円
純資産総額(-)	134,516,770円
発行済数量	125,735,157口
1口当たり純資産額(/)	1.0698円

D I A Mコア資産設計ファンド(積極型)

平成30年4月27日現在

資産総額	300,527,362円
負債総額	681,655円
純資産総額(-)	299,845,707円
発行済数量	281,472,142口
1口当たり純資産額(/)	1.0653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4月27日現在

資産総額	303,736,767,358円
負債総額	615,568,600円
純資産総額(-)	303,121,198,758円
発行済数量	111,821,522,746口
1口当たり純資産額(/)	2.7108円

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年4月27日現在

資産総額	352,601,388,328円
負債総額	7,577,610,000円
純資産総額(-)	345,023,778,328円
発行済数量	267,688,380,757口
1口当たり純資産額(/)	1.2889円

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年4月27日現在

資産総額	306,777,616,910円
負債総額	2,404,344,480円
純資産総額(-)	304,373,272,430円
発行済数量	89,687,429,989口
1口当たり純資産額(/)	3.3937円

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年4月27日現在

資産総額	223,180,922,433円
負債総額	9,919,949,777円
純資産総額（ - ）	213,260,972,656円
発行済数量	117,647,870,013口
1口当たり純資産額（ / ）	1.8127円

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

平成30年4月27日現在

資産総額	68,476,644,572円
負債総額	3,926,992,141円
純資産総額（ - ）	64,549,652,431円
発行済数量	52,530,906,460口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2288円

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

平成30年4月27日現在

資産総額	115,779,934,278円
負債総額	1,993,294,308円
純資産総額（ - ）	113,786,639,970円
発行済数量	63,327,454,581口
1口当たり純資産額（ / ）	1.7968円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 受益証券の名義書換

該当事項はありません。

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

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

(2) 受益者等名簿

該当事項はありません。

(3) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

(4) 受益権の譲渡制限

譲渡制限はありません。

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

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

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

(5) 受益権の譲渡の対抗要件

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

(6) 受益権の再分割

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

(7) 質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額(平成30年4月27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4月27日現在)

会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。

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

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

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

また、取締役会の決議によって、取締役社長を定めることができます。

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

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

投資運用の意思決定機構

1. 投資環境見直しおよび運用方針の策定

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

2.運用計画、売買計画の決定

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

2【事業の内容及び営業の概況】

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

平成30年4月27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	1,176,800,622,980
追加型株式投資信託	846	12,687,192,173,919
単位型公社債投資信託	53	203,165,104,513
単位型株式投資信託	143	896,110,306,509
合計	1,080	14,963,268,207,921

3【委託会社等の経理状況】

1. 委託会社であるアセットマネジメントOne株式会社（以下「委託会社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。
2. 財務諸表の金額は、千円未満の端数を切り捨てて記載しております。
3. 委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき第33期事業年度（自平成29年4月1日至平成30年3月31日）の財務諸表について、新日本有限責任監査法人の監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

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

（単位：千円）

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

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

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

（単位：千円）

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

（３）【株主資本等変動計算書】

第32期（自平成28年4月1日至平成29年3月31日）

（単位：千円）

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

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

第33期（自平成29年4月1日至平成30年3月31日）

（単位：千円）

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

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

重要な会計方針

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

会計上の見積りの変更

第33期 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)

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

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

追加情報

第33期 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)

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

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

注記事項

(貸借対照表関係)

1. 有形固定資産の減価償却累計額

(千円)

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

(損益計算書関係)

1. 関係会社に対する事項

(千円)

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

2. 固定資産売却益の内訳

(千円)

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

3. 固定資産除却損の内訳

(千円)

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

4. 固定資産売却損の内訳

(千円)

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

5. 本社移転費用の内訳

(千円)

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

(株主資本等変動計算書関係)

第32期(自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

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

第33期(自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

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

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

営業債務である未払手数料は、1年以内の支払期日であります。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

(4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

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

第32期（平成29年3月31日現在）

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

第33期(平成30年3月31日現在)

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

(注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3) 未収委託者報酬及び(4) 未収運用受託報酬

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

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

負 債

(1) 未払手数料

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

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(千円)

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

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

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

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第32期(平成29年3月31日現在)

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

第33期(平成30年3月31日現在)

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

(有価証券関係)

1. 子会社株式及び関連会社株式

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

2. その他有価証券

第32期(平成29年3月31日現在)

(千円)

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

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

第33期(平成30年3月31日現在)

(千円)

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

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

3. 当該事業年度中に売却したその他有価証券

第32期(自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)

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

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

第33期(自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)

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

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

4. 減損処理を行った有価証券

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

第33期において、該当事項はありません。

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

（退職給付関係）

1. 採用している退職給付制度の概要

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

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

2. 確定給付制度

（1）退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

（千円）

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

（2）年金資産の期首残高と期末残高の調整表

（千円）

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

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

（千円）

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

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(千円)

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

(注) 特別損失に計上しております。

(5) 年金資産に関する事項

年金資産の主な内訳

年金資産合計に対する主な分類ごとの比率は、次のとおりであります。

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

長期期待運用収益率の設定方法

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

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎

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

3. 簡便法を適用した確定給付制度

(1) 簡便法を適用した制度の、退職給付引当金の期首残高と期末残高の調整表

(千円)

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

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

(千円)

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

(3) 退職給付費用

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

4. 確定拠出制度

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

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

繰延税金資産の純額

1,571,992

1,699,533

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

(企業結合等関係)

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

1. 結合当事企業

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

2. 企業結合日

平成28年10月1日

3. 企業結合の方法

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

4. 結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

5. 企業結合の主な目的

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

6. 合併比率

「3. 企業結合の方法」の吸収合併における合併比率は以下の通りであります。

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

(*) 普通株式と種類株式を合算して算定しております。

7. 交付した株式数

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

8. 経済的持分比率（議決権比率）

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

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

9. 取得企業を決定するに至った主な根拠

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

10. 会計処理

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

11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

(1) 財務諸表に含まれる被取得企業の業績の期間

平成29年4月1日から平成30年3月31日まで

(2) 被取得企業の取得原価及びその内訳

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

(3) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

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

(4) 企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

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

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

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

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

12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

(1) 貸借対照表項目

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

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

(2) 損益計算書項目

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

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

(資産除去債務関係)

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

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

(セグメント情報等)

1. セグメント情報

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

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

(1) サービスごとの情報

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

(2) 地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

(1) 親会社及び法人主要株主等

第32期(自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)

該当はありません。

第33期(自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)

該当はありません。

(2) 子会社及び関連会社等

第32期(自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)

該当はありません。

第33期(自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)

該当はありません。

(3) 兄弟会社等

第32期(自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)

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

第33期(自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

株式会社みずほフィナンシャルグループ

(東京証券取引所及びニューヨーク証券取引所に上場)

(2) 重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません。

(1株当たり情報)

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

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

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

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

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

4【利害関係人との取引制限】

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

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

5【その他】

- (1) 定款の変更、事業譲渡又は事業譲受、出資の状況その他の重要事項

平成30年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
信金中央金庫	(1) 690,998	日本において全国の信用金庫の中央金融機関として、信用金庫の余裕資金の効率運用と信用金庫間の資金の受給調整、信用金庫業界の信用力の維持向上および業務機能の補完を図っております。
GMOクリック証券株式会社	4,346	「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。
高木証券株式会社	11,069	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
マネックス証券株式会社	12,200	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。

(注) 資本金の額は平成29年3月末現在

(1) 出資の総額

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

「投資顧問会社」は、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、各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 基準価額・純資産の推移 分配の推移 主要な資産の状況 年間収益率の推移等（ベンチマークを含む）を記載することがあります。（表示されるデータは適宜更新されま
す。）
- (3)請求目論見書の巻末に用語説明を掲載する場合があります。
なお、請求目論見書の巻末に信託約款を掲載し参照することで、有価証券届出書の内容の記載とすることがあります。
- (4)ファンドの特色やリスク等について投資者に開示すべき情報のあるファンドは、交付目論見書に「追加的記載事項」と明記して当該情報の内容等を有価証券届出書の記載に従い記載することがあります。
- (5)交付目論見書の「お申込みメモ」に以下の内容を記載することがあります。
基準価額は、販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。
もしくは、計算日の翌日付の日本経済新聞朝刊の「オープン基準価格」の欄をご参照ください。

独立監査人の監査報告書

平成30年5月30日

アセットマネジメントOne株式会社
取締役会 御中

新日本有限責任監査法人

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

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

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

利害関係

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

以上

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

(注2) XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

平成30年6月1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 公認会計士 湯原 尚 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDIAMコア資産設計ファンド（堅実型）の平成29年10月12日から平成30年4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、DIAMコア資産設計ファンド（堅実型）の平成30年4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。

その他の事項

ファンドの平成29年10月11日をもって終了した前計算期間の財務諸表は、前任監査人によって監査されている。前任監査人は、当該財務諸表に対して平成29年11月29日付けで無限定適正意見を表明している。

利害関係

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

以上

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

(注2) XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

平成30年6月1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 公認会計士 湯原 尚 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDIAMコア資産設計ファンド（積極型）の平成29年10月12日から平成30年4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、DIAMコア資産設計ファンド（積極型）の平成30年4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。

その他の事項

ファンドの平成29年10月11日をもって終了した前計算期間の財務諸表は、前任監査人によって監査されている。前任監査人は、当該財務諸表に対して平成29年11月29日付けで無限定適正意見を表明している。

利害関係

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

以上

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

（注2）XBRLデータは監査の対象には含まれておりません。