

【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】	2019年1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：2019年1月12日から2019年7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】

ファンドの受益権にかかる振替機関は以下の通りです。

株式会社証券保管振替機構

(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) 日々	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 ()	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。

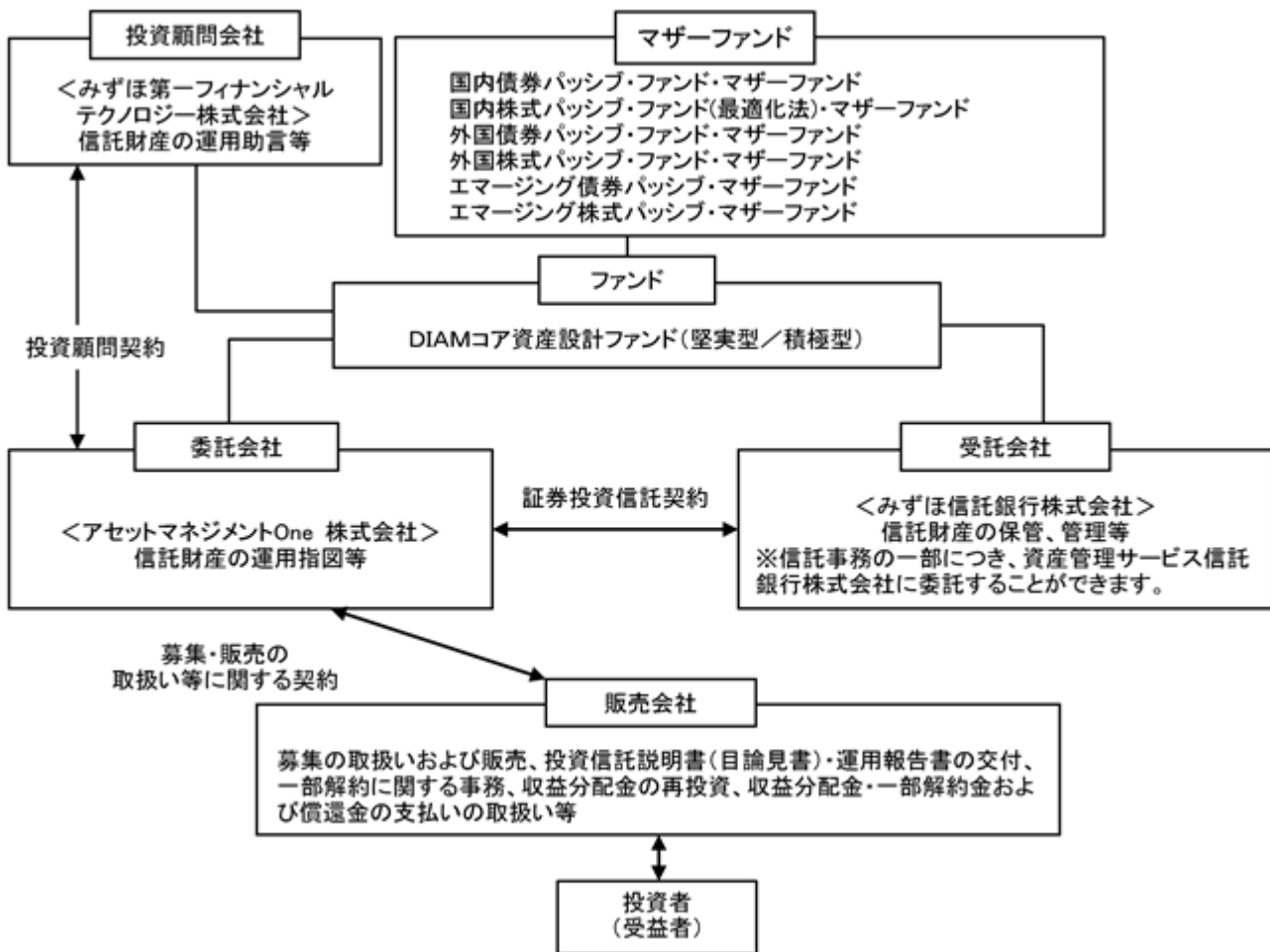
上記の分類は、一般社団法人投資信託協会の商品分類に関する指針に基づき記載しております。

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】

2015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。

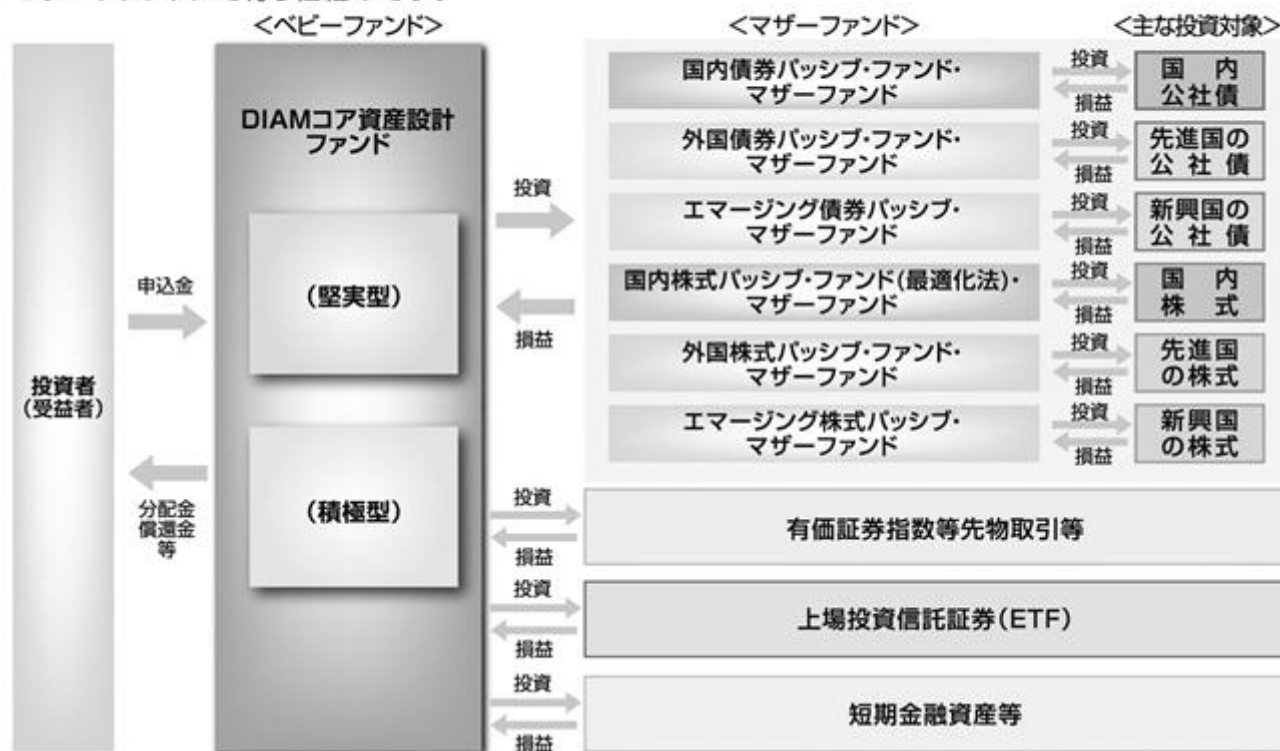
- ・「投資顧問契約」の概要

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（2018年10月31日現在）

委託会社の沿革

1985年7月1日	会社設立
1998年3月31日	「証券投資信託法」に基づく証券投資信託の委託会社の免許取得
1998年12月1日	証券投資信託法の改正に伴う証券投資信託委託業のみなし認可
1999年10月1日	第一ライフ投信投資顧問株式会社を存続会社として興銀エヌダブリュ・アセットマネジメント株式会社および日本興業投信株式会社と合併し、社名を興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社とする。
2008年1月1日	「興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社」から「DIAMアセットマネジメント株式会社」に商号変更
2016年10月1日	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

(2018年10月31日現在)

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

1：A種種類株式(15,510株)を含みます。

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

<基本方針>

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券
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券(新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。))の新株引受権証券を除きます。なお、社債券のうち、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

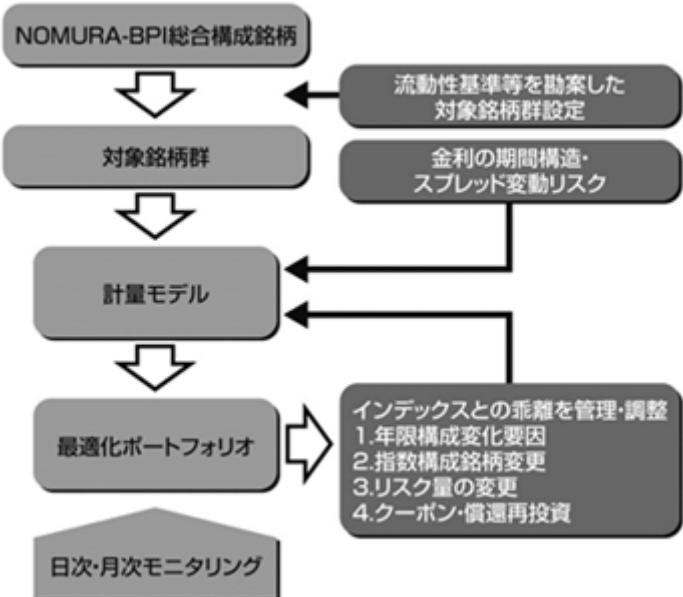
なお、1.の証券または証書、13.および18.の証券または証書のうち1.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、2.から7.までの証券ならびに13.および18.の証券または証書のうち2.から7.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、14.の証券および15.の証券を以下「投資信託証券」といいます。

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>  <p>日次・月次モニタリング</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します。 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

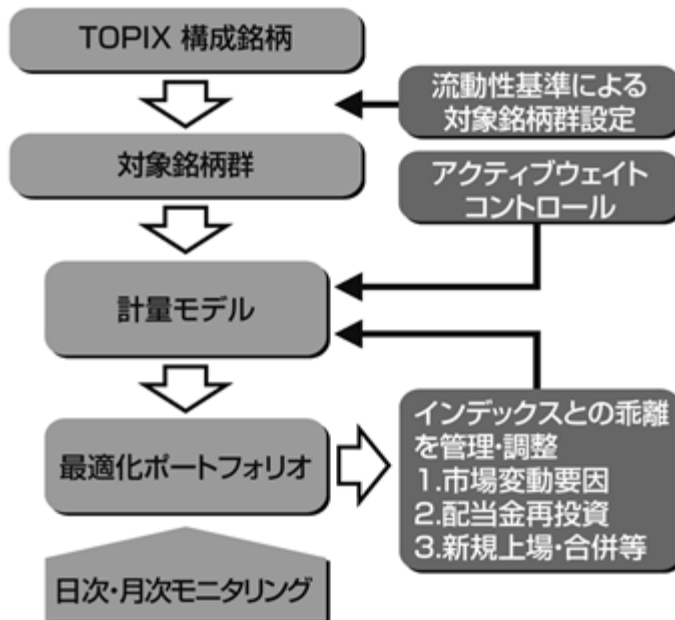
インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差(アクティブウェイト)を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。

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。

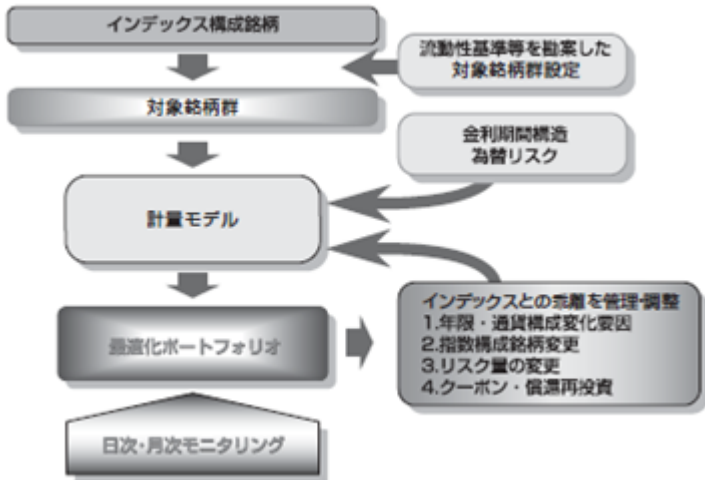
インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。

- ・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



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

<p>ファンド名</p>	<p>外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド</p>
<p>基本方針</p>	<p>この投資信託は、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。</p>
<p>主な投資対象</p>	<p>海外の公社債を主要投資対象とします。</p>
<p>投資態度</p>	<ol style="list-style-type: none"> 1. 主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

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

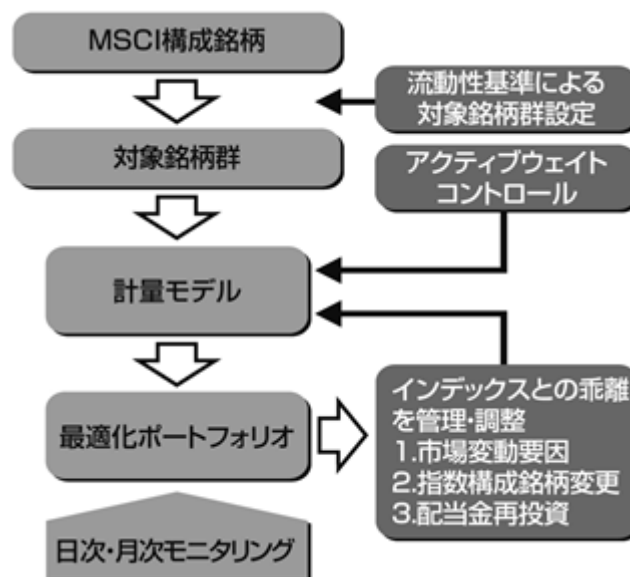
インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差(アクティブウェイト)を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。

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。

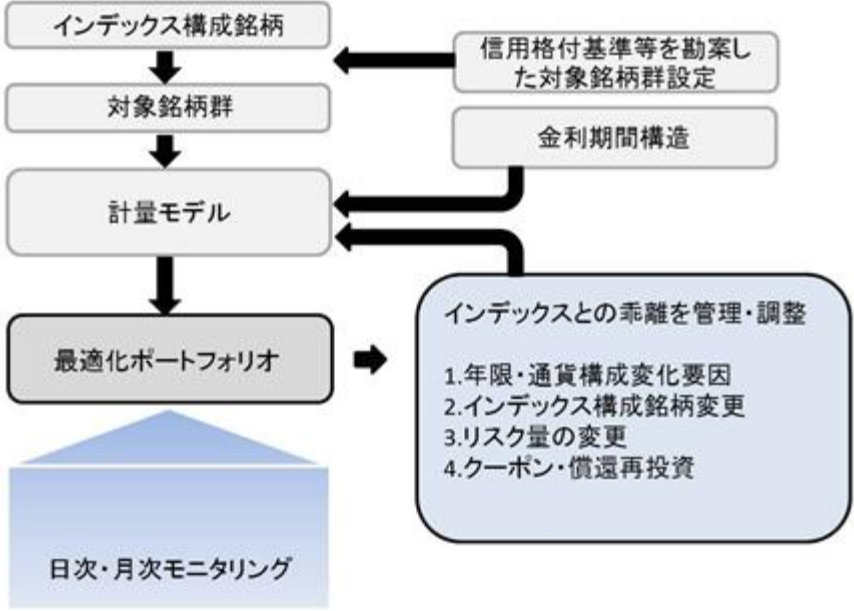
インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。

- ・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>

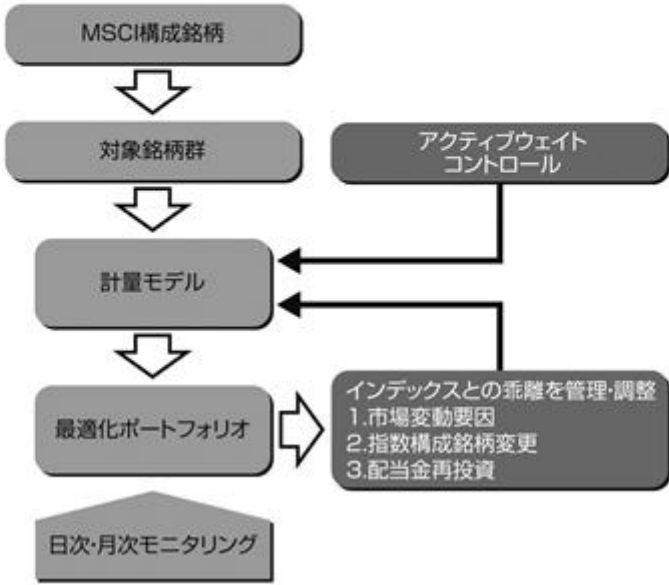
<p>運用プロセス</p>	<p>信用格付基準等を勘案した投資対象銘柄群を設定し、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。</p> 
<p>主な投資制限</p>	<ol style="list-style-type: none"> 1. 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 2. 外貨建資産への投資には、制限を設けません。 3. 投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 4. デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）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。

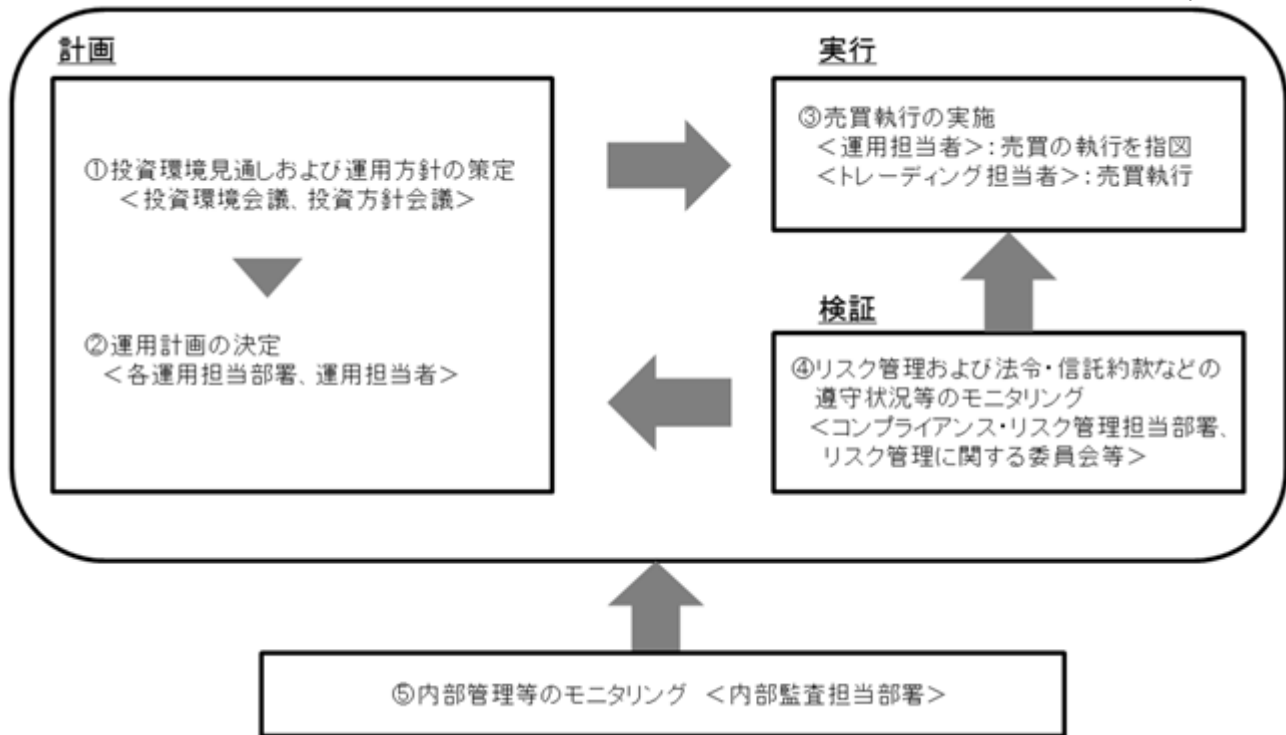
MSCIは、自らが信頼できると考える情報源からMSCI指数の計算に算入または使用するための情報を入手しますが、いかなるMSCI関係者も、MSCI指数またはそれに含まれるデータの独創性、正確性および/または完全性について保証するものではありません。いかなるMSCI関係者も、明示的か黙示的かを問わず、本ファンドの発行会社もしくは所有者、またはその他の者もしくは団体が、MSCI指数またはそれに含まれるデータを使用することにより得られる結果について保証を行いません。いかなるMSCI関係者も、MSCI指数またはそれに含まれるデータの、またはそれらに関連する過誤、脱漏または中断について責任を負いません。また、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2018年10月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

上記体制は、マザーファンドを通じた実質的な運用体制を記載しております。

（４）【分配方針】

収益分配方針

毎決算時（原則として毎年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。

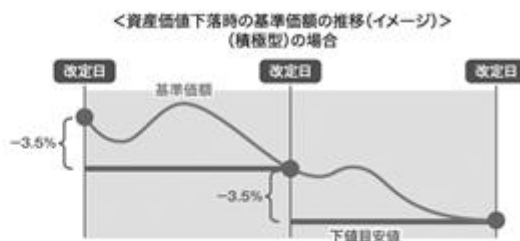
各ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行います。そのため、各ファンドが投資対象とするマザーファンドを投資対象とする他のベビーファンドに追加設定・解約等があった場合、資金変動等が起こり、その結果、当該マザーファンドにおいて売買等が生じた場合等には、各ファンドの基準価額に影響をおよぼす場合があります。

（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。

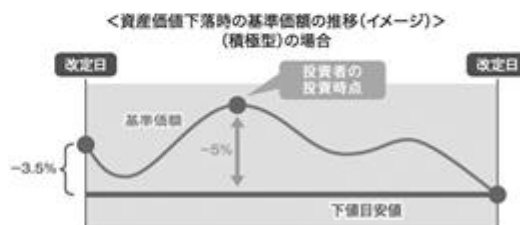
ケース① 下値目安値の切下げについて

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 四半期中途の投資について

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。

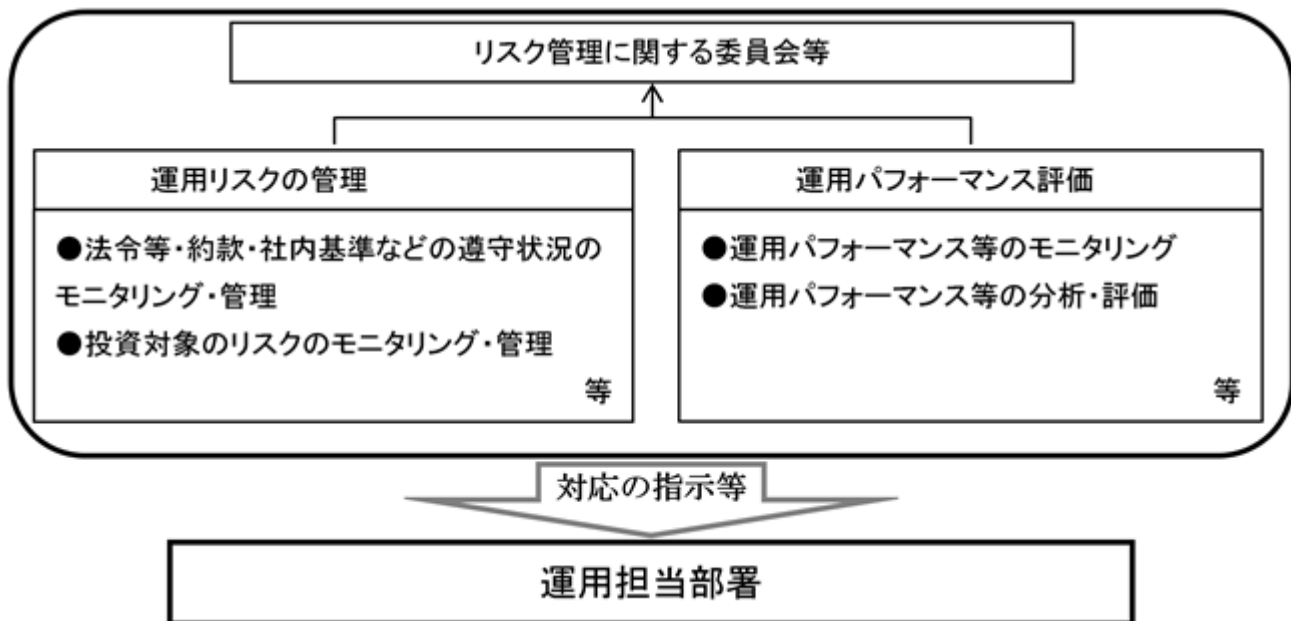
注意事項

- 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 >

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

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



リスク管理体制は2018年10月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

＜参考情報＞

ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移

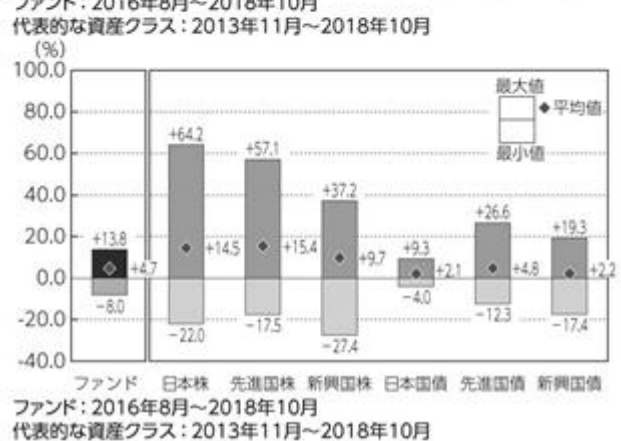
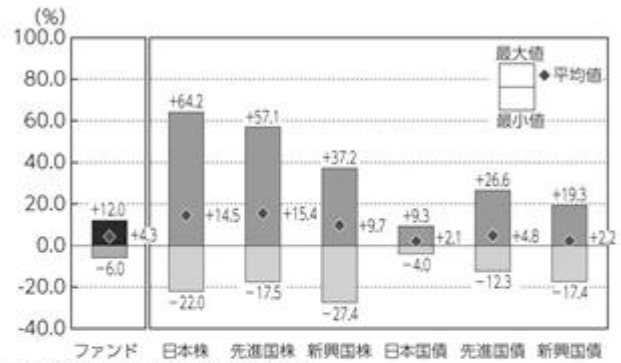
(堅実型)



(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



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

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

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

*各資産クラスの指数

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

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

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、2018年10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10月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	31,437,588	20.39
内 日本	31,437,588	20.39
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	122,732,832	79.61
純資産総額	154,170,420	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10月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	84,152,403	29.43
内 日本	84,152,403	29.43
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	201,823,800	70.57
純資産総額	285,976,203	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10月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	268,424,841,180	96.38
内 日本	268,424,841,180	96.38
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	10,078,124,415	3.62
純資産総額	278,502,965,595	100.00

その他資産の投資状況

平成30年10月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引（買建）	10,387,530,000	3.73
内 日本	10,387,530,000	3.73

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年10月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券		284,261,100,800	83.80
	内 日本	284,261,100,800	83.80
地方債証券		21,800,069,774	6.43
	内 日本	21,800,069,774	6.43
特殊債券		17,180,972,111	5.06
	内 日本	17,180,972,111	5.06
社債券		15,034,055,890	4.43
	内 日本	14,634,211,890	4.31
	内 オランダ	200,744,000	0.06
	内 フランス	199,100,000	0.06
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		936,234,209	0.28
純資産総額		339,212,432,784	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10月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（％）
株式		298,982,448,414	93.15
	内 アメリカ	194,588,081,245	60.62
	内 イギリス	19,054,175,902	5.94
	内 フランス	11,432,683,287	3.56
	内 カナダ	11,375,215,990	3.54
	内 スイス	10,774,253,060	3.36
	内 ドイツ	10,364,122,028	3.23
	内 オーストラリア	7,166,785,643	2.23
	内 オランダ	5,273,318,705	1.64
	内 アイルランド	4,909,992,354	1.53
	内 スペイン	3,452,035,639	1.08
	内 スウェーデン	2,767,082,552	0.86
	内 香港	2,647,518,136	0.82
	内 イタリア	2,157,110,526	0.67
	内 デンマーク	1,917,056,462	0.60
	内 ジャージー	1,560,970,632	0.49
	内 フィンランド	1,415,947,069	0.44
	内 シンガポール	1,306,866,169	0.41
	内 パミュダ	1,209,827,608	0.38
	内 ベルギー	1,130,962,988	0.35
	内 ノルウェー	865,664,721	0.27
	内 ケイマン諸島	749,854,631	0.23
	内 オランダ領キュラソー	660,242,609	0.21
	内 イスラエル	583,951,232	0.18
	内 ルクセンブルグ	381,635,708	0.12
	内 オーストリア	257,292,411	0.08
	内 ニューゼaland	242,501,908	0.08

	内 パナマ	194,479,226	0.06
	内 ポルトガル	177,560,541	0.06
	内 リベリア	141,750,590	0.04
	内 パプアニューギニア	85,872,387	0.03
	内 イギリス領バージン諸島	75,130,080	0.02
	内 マン島	48,359,034	0.02
	内 モーリシャス	14,147,341	0.00
投資信託受益証券		734,859,972	0.23
	内 オーストラリア	602,011,483	0.19
	内 シンガポール	132,848,489	0.04
投資証券		6,944,092,029	2.16
	内 アメリカ	6,095,664,613	1.90
	内 イギリス	245,383,025	0.08
	内 オランダ	212,964,578	0.07
	内 フランス	174,477,976	0.05
	内 香港	170,223,774	0.05
	内 カナダ	45,378,063	0.01
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		14,324,223,077	4.46
純資産総額		320,985,623,492	100.00

その他資産の投資状況

平成30年10月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（%）
為替予約取引（買建）	3,193,704,340	0.99
-	3,193,704,340	0.99
株価指数先物取引（買建）	14,335,604,118	4.47
内 アメリカ	10,036,336,695	3.13
内 ドイツ	2,454,225,379	0.76
内 イギリス	949,702,586	0.30
内 カナダ	536,401,866	0.17
内 オーストラリア	358,937,592	0.11

（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10月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	194,285,666,786	97.92
内 アメリカ	88,620,352,928	44.66
内 フランス	19,742,293,280	9.95
内 イタリア	17,241,831,976	8.69
内 ドイツ	13,435,788,040	6.77
内 イギリス	12,692,445,416	6.40
内 スペイン	12,216,474,315	6.16
内 ベルギー	4,954,912,045	2.50
内 オランダ	4,122,726,682	2.08
内 オーストラリア	4,046,607,136	2.04
内 カナダ	3,875,096,548	1.95
内 オーストリア	3,167,309,186	1.60
内 アイルランド	1,493,585,579	0.75
内 メキシコ	1,478,868,018	0.75
内 フィンランド	1,240,845,317	0.63
内 ポーランド	1,128,055,600	0.57
内 南アフリカ	1,072,254,080	0.54
内 デンマーク	1,068,443,863	0.54
内 マレーシア	899,325,481	0.45
内 シンガポール	741,019,574	0.37
内 スウェーデン	670,162,754	0.34
内 ノルウェー	377,268,968	0.19
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	4,125,653,679	2.08
純資産総額	198,411,320,465	100.00

その他資産の投資状況

平成30年10月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引（売建）	185,980,000	0.09
-	185,980,000	0.09

（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10月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	44,502,947,447	94.83
内 韓国	6,336,773,881	13.50
内 ケイマン諸島	6,260,881,149	13.34
内 台湾	5,184,989,500	11.05
内 中国	4,946,300,703	10.54
内 インド	3,916,914,245	8.35
内 ブラジル	3,649,569,184	7.78
内 南アフリカ	2,565,401,680	5.47
内 ロシア	1,728,943,708	3.68
内 香港	1,698,796,656	3.62
内 マレーシア	1,127,136,221	2.40
内 タイ	1,119,423,951	2.39
内 メキシコ	1,036,447,816	2.21
内 インドネシア	917,854,387	1.96
内 ポーランド	536,725,316	1.14
内 チリ	499,047,617	1.06
内 カタール	492,334,017	1.05
内 バミューダ	477,245,545	1.02
内 フィリピン	466,063,200	0.99
内 アラブ首長国連邦	327,008,364	0.70
内 トルコ	307,592,761	0.66
内 コロンビア	197,592,302	0.42
内 アメリカ	141,423,004	0.30
内 ハンガリー	135,371,060	0.29
内 ギリシャ	130,775,656	0.28
内 チェコ	88,572,975	0.19
内 エジプト	51,446,192	0.11
内 パキスタン	34,626,820	0.07
内 オランダ	33,298,344	0.07
内 マン島	32,211,468	0.07
内 ルクセンブルグ	26,655,709	0.06
内 ペルー	19,372,443	0.04
内 シンガポール	16,151,573	0.03
投資信託受益証券	227,945,850	0.49
内 メキシコ	227,945,850	0.49
投資証券	81,158,735	0.17
内 南アフリカ	39,499,760	0.08
内 メキシコ	38,806,087	0.08
内 トルコ	2,852,888	0.01
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	2,118,464,478	4.51
純資産総額	46,930,516,510	100.00

その他資産の投資状況

平成30年10月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引（買建）	114,266,290	0.24
-	114,266,290	0.24
株価指数先物取引（買建）	2,115,422,144	4.51
内 アメリカ	2,115,422,144	4.51

（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10月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	67,693,737,562	96.42
内 メキシコ	10,114,689,958	14.41
内 インドネシア	8,319,024,803	11.85
内 ロシア	8,127,996,720	11.58
内 ブラジル	7,902,097,870	11.25
内 コロンビア	6,553,053,481	9.33
内 フィリピン	5,788,842,275	8.25
内 ハンガリー	4,392,735,865	6.26
内 パナマ	4,077,872,385	5.81
内 南アフリカ	3,700,200,573	5.27
内 ペルー	3,692,821,912	5.26
内 ルーマニア	2,667,520,697	3.80
内 クロアチア	2,356,881,023	3.36
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	2,516,166,760	3.58
純資産総額	70,209,904,322	100.00

その他資産の投資状況

平成30年10月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引（買建）	28,312,500	0.04
-	28,312,500	0.04
為替予約取引（売建）	837,976,000	1.19
-	837,976,000	1.19

（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10月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	国内株式パッシブ・ファンド (最適化法)・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	3,652,120	2.6232 9,580,525	2.5366 9,263,967	- -	6.01%
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	7,317,019	1.0912 7,984,930	1.0537 7,709,942	- -	5.00%
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	2,690,479	1.7923 4,822,150	1.8016 4,847,166	- -	3.14%
4	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	1,795,482	1.8120 3,253,468	1.8112 3,251,976	- -	2.11%
5	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	2,486,506	1.2790 3,180,396	1.2822 3,188,197	- -	2.07%
6	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	930,196	3.5324 3,285,828	3.4147 3,176,340	- -	2.06%

(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10月31日現在

種類	投資比率
親投資信託受益証券	20.39%
合計	20.39%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資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10月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	国内株式パッシブ・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	9,824,004	2.6232 25,771,055	2.5366 24,919,568	- -	8.71%
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	19,586,659	1.0913 21,375,269	1.0537 20,638,462	- -	7.22%
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	7,200,936	1.7922 12,905,898	1.8016 12,973,206	- -	4.54%
4	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	6,731,445	1.2790 8,609,888	1.2822 8,631,058	- -	3.02%
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	4,735,221	1.8120 8,580,268	1.8112 8,576,432	- -	3.00%
6	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	2,463,958	3.5324 8,703,862	3.4147 8,413,677	- -	2.94%

(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10月31日現在

種類	投資比率
親投資信託受益証券	29.43%
合計	29.43%

(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10月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	1,282,900	7,335.10 9,410,209,145	6,615.00 8,486,383,500	- -	3.05%
2	三菱UFJフィナンシャル・ グループ 日本	株式 銀行業	7,907,500	782.12 6,184,658,820	684.80 5,415,056,000	- -	1.94%
3	ソニー 日本	株式 電気機器	771,700	5,449.30 4,205,232,422	6,140.00 4,738,238,000	- -	1.70%
4	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	472,100	8,700.09 4,107,313,931	9,048.00 4,271,560,800	- -	1.53%
5	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	772,600	4,987.62 3,853,436,532	4,750.00 3,669,850,000	- -	1.32%
6	三井住友フィナンシャルグ ループ 日本	株式 銀行業	800,300	4,778.79 3,824,467,079	4,414.00 3,532,524,200	- -	1.27%
7	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	971,200	3,820.07 3,710,054,235	3,241.00 3,147,659,200	- -	1.13%
8	キーエンス 日本	株式 電気機器	56,500	63,592.29 3,592,964,940	55,300.00 3,124,450,000	- -	1.12%
9	みずほフィナンシャルグル ープ 日本	株式 銀行業	15,428,600	199.05 3,071,211,246	194.00 2,993,148,400	- -	1.07%
10	KDDI 日本	株式 情報・通信業	995,500	2,682.23 2,670,160,955	2,814.50 2,801,834,750	- -	1.01%
11	三菱商事 日本	株式 卸売業	795,600	2,968.99 2,362,134,471	3,180.00 2,530,008,000	- -	0.91%
12	任天堂 日本	株式 その他製品	70,900	44,427.45 3,149,906,868	35,160.00 2,492,844,000	- -	0.90%
13	リクルートホールディングス 日本	株式 サービス業	788,000	2,502.18 1,971,723,884	3,037.00 2,393,156,000	- -	0.86%
14	セブン&アイ・ホールディ ングス 日本	株式 小売業	475,300	4,476.80 2,127,824,368	4,893.00 2,325,642,900	- -	0.84%
15	NTTドコモ 日本	株式 情報・通信業	811,100	2,676.67 2,171,047,953	2,844.50 2,307,173,950	- -	0.83%
16	東海旅客鉄道 日本	株式 陸運業	103,100	20,305.69 2,093,517,207	21,650.00 2,232,115,000	- -	0.80%
17	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	411,600	4,968.97 2,045,230,107	5,346.00 2,200,413,600	- -	0.79%
18	ファナック 日本	株式 電気機器	109,400	26,725.90 2,923,813,630	19,735.00 2,159,009,000	- -	0.78%
19	花王 日本	株式 化学	279,500	7,706.03 2,153,835,659	7,531.00 2,104,914,500	- -	0.76%
20	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	454,500	5,812.96 2,641,991,286	4,570.00 2,077,065,000	- -	0.75%

21	村田製作所 日本	株式 電気機器	120,800	15,312.32 1,849,728,581	17,165.00 2,073,532,000	- -	0.74%
22	ダイキン工業 日本	株式 機械	157,100	12,279.69 1,929,139,782	13,125.00 2,061,937,500	- -	0.74%
23	東日本旅客鉄道 日本	株式 陸運業	204,700	10,404.50 2,129,802,515	9,875.00 2,021,412,500	- -	0.73%
24	日本電産 日本	株式 電気機器	138,500	16,140.23 2,235,422,488	14,490.00 2,006,865,000	- -	0.72%
25	キヤノン 日本	株式 電気機器	619,800	4,011.23 2,486,161,024	3,222.00 1,996,995,600	- -	0.72%
26	日本たばこ産業 日本	株式 食料品	667,200	3,267.77 2,180,260,587	2,906.50 1,939,216,800	- -	0.70%
27	信越化学工業 日本	株式 化学	198,700	11,419.69 2,269,094,042	9,469.00 1,881,490,300	- -	0.68%
28	アステラス製薬 日本	株式 医薬品	1,061,400	1,478.49 1,569,275,928	1,747.00 1,854,265,800	- -	0.67%
29	日立製作所 日本	株式 電気機器	518,300	4,042.44 2,095,200,230	3,462.00 1,794,354,600	- -	0.64%
30	三井物産 日本	株式 卸売業	934,100	1,897.34 1,772,309,000	1,885.50 1,761,245,550	- -	0.63%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成30年10月31日現在

種類	投資比率
株式	96.38%
合計	96.38%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

平成30年10月31日現在

業種	国内/外国	投資比率
電気機器	国内	12.61%
輸送用機器		7.82%
情報・通信業		7.39%
化学		6.85%
銀行業		6.78%
小売業		5.01%
卸売業		4.93%
医薬品		4.89%
機械		4.81%
サービス業		4.57%
陸運業		4.28%
食料品		4.14%
建設業		2.84%
保険業		2.39%
不動産業		2.28%
その他製品		1.99%
電気・ガス業		1.78%
精密機器		1.76%
その他金融業		1.19%
鉄鋼		0.99%
証券、商品先物取引業		0.96%
石油・石炭製品		0.86%
ガラス・土石製品		0.85%
非鉄金属		0.78%
ゴム製品		0.78%
繊維製品		0.62%
金属製品		0.57%
空運業		0.56%
鉱業		0.33%
パルプ・紙		0.31%
倉庫・運輸関連業	0.18%	
海運業	0.16%	
水産・農林業	0.12%	
合計		96.38%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年10月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	122回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	4,000,000,000	100.42 4,016,960,000	100.27 4,010,880,000	0.100000 2019/12/20	1.18%
2	350回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,400,000,000	100.53 3,418,236,500	100.09 3,403,162,000	0.100000 2028/3/20	1.00%
3	340回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,100,000,000	103.16 3,198,092,000	102.93 3,190,861,000	0.400000 2025/9/20	0.94%
4	339回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,100,000,000	103.17 3,198,423,500	102.85 3,188,567,000	0.400000 2025/6/20	0.94%
5	338回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,100,000,000	103.03 3,194,050,500	102.81 3,187,234,000	0.400000 2025/3/20	0.94%
6	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	102.24 3,128,819,400	0.300000 2025/12/20	0.92%
7	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	100.77 3,023,250,000	0.100000 2026/3/20	0.89%
8	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	100.72 3,021,720,000	0.100000 2026/6/20	0.89%
9	130回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	3,000,000,000	100.77 3,023,130,000	100.69 3,020,760,000	0.100000 2021/12/20	0.89%
10	128回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	3,000,000,000	100.70 3,021,090,000	100.59 3,017,820,000	0.100000 2021/6/20	0.89%
11	127回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	3,000,000,000	100.65 3,019,500,000	100.54 3,016,470,000	0.100000 2021/3/20	0.89%
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	100.50 3,015,030,000	0.100000 2027/3/20	0.89%
13	125回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	3,000,000,000	100.54 3,016,350,000	100.44 3,013,320,000	0.100000 2020/9/20	0.89%
14	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	100.33 3,009,960,000	0.100000 2020/3/20	0.89%
15	325回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,900,000,000	104.00 3,016,047,000	103.53 3,002,370,000	0.800000 2022/9/20	0.89%

16	328回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	2,890,000,000	103.38 2,987,876,100	103.05 2,978,347,300	0.600000 2023/3/20	0.88%
17	347回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	2,900,000,000	100.51 2,914,810,000	100.38 2,911,194,000	0.100000 2027/6/20	0.86%
18	348回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	2,900,000,000	100.47 2,913,805,000	100.30 2,908,961,000	0.100000 2027/9/20	0.86%
19	335回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	2,750,000,000	103.45 2,844,882,000	103.27 2,840,090,000	0.500000 2024/9/20	0.84%
20	344回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	2,800,000,000	100.68 2,819,100,000	100.62 2,817,612,000	0.100000 2026/9/20	0.83%
21	351回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	2,740,000,000	99.97 2,739,208,400	99.95 2,738,684,800	0.100000 2028/6/20	0.81%
22	345回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	2,700,000,000	100.61 2,716,610,000	100.56 2,715,336,000	0.100000 2026/12/20	0.80%
23	334回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	2,600,000,000	104.11 2,706,919,000	103.73 2,696,980,000	0.600000 2024/6/20	0.80%
24	349回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	2,610,000,000	100.45 2,621,796,700	100.22 2,615,898,600	0.100000 2027/12/20	0.77%
25	333回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	2,500,000,000	103.99 2,599,920,000	103.61 2,590,450,000	0.600000 2024/3/20	0.76%
26	332回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	2,460,000,000	103.80 2,553,553,300	103.50 2,546,223,000	0.600000 2023/12/20	0.75%
27	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	100.51 2,512,825,000	0.100000 2020/12/20	0.74%
28	133回 利付国庫債券（5年） 日本	国債証券	2,460,000,000	100.89 2,481,984,000	100.81 2,480,147,400	0.100000 2022/9/20	0.73%
29	129回 利付国庫債券（5年） 日本	国債証券	2,420,000,000	100.72 2,437,464,500	100.63 2,435,391,200	0.100000 2021/9/20	0.72%
30	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	104.14 2,363,978,000	0.800000 2023/6/20	0.70%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成30年10月31日現在

種類	投資比率
国債証券	83.80%
地方債証券	6.43%
特殊債券	5.06%
社債券	4.43%
合計	99.72%

(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10月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	APPLE INC アメリカ	株式 コンピュー タ・周辺機器	381,975	19,263.15 7,358,045,502	24,158.35 9,227,888,797	- -	2.87%
2	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフトウェア	566,778	10,388.07 5,887,733,484	11,748.45 6,658,768,548	- -	2.07%
3	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 インターネッ ト販売・通信 販売	32,069	166,718.32 5,346,489,857	173,335.36 5,558,691,954	- -	1.73%
4	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	208,408	14,739.65 3,071,861,054	15,941.34 3,322,303,828	- -	1.04%
5	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	264,416	12,990.17 3,434,810,046	12,084.84 3,195,425,582	- -	1.00%
6	FACEBOOK INC アメリカ	株式 インタラク ティブ・メ ディアおよび サービス	186,815	20,192.64 3,772,288,071	16,560.87 3,093,820,274	- -	0.96%
7	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	329,168	8,672.48 2,854,703,370	8,922.62 2,937,041,901	- -	0.92%
8	ALPHABET INC-CL C アメリカ	株式 インタラク ティブ・メ ディアおよび サービス	24,139	121,470.11 2,932,167,111	117,361.14 2,832,980,669	- -	0.88%
9	ALPHABET INC-CL A アメリカ	株式 インタラク ティブ・メ ディアおよび サービス	23,463	121,888.74 2,859,875,725	118,867.50 2,788,988,213	- -	0.87%
10	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	241,753	8,730.16 2,110,542,538	9,496.96 2,295,918,957	- -	0.72%

11	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 各種金融サービス	99,513	22,753.24 2,264,243,759	23,031.42 2,291,925,797	- -	0.71%
12	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 銀行	749,074	3,603.04 2,698,949,648	3,033.10 2,272,018,446	- -	0.71%
13	PFIZER INC アメリカ	株式 医薬品	454,525	4,037.58 1,835,182,377	4,857.72 2,207,955,819	- -	0.69%
14	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	74,786	26,096.26 1,951,635,352	29,252.79 2,187,699,362	- -	0.68%
15	WELLS FARGO & CO アメリカ	株式 銀行	360,148	6,702.00 2,413,712,293	5,967.66 2,149,244,199	- -	0.67%
16	VERIZON COMM INC アメリカ	株式 各種電気通信 サービス	321,050	5,632.54 1,808,329,878	6,589.46 2,115,548,316	- -	0.66%
17	VISA INC アメリカ	株式 情報技術サー ビス	138,673	13,766.18 1,908,997,688	15,036.39 2,085,142,364	- -	0.65%
18	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品	195,804	9,181.92 1,797,857,914	10,101.65 1,977,945,317	- -	0.62%
19	INTEL CORP アメリカ	株式 半導体・半導 体製造装置	363,033	5,157.63 1,872,392,330	5,409.29 1,963,753,535	- -	0.61%
20	AT&T INC アメリカ	株式 各種電気通信 サービス	564,488	3,958.64 2,234,609,545	3,451.03 1,948,066,264	- -	0.61%
21	CHEVRON CORP アメリカ	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	148,453	12,855.81 1,908,484,171	12,554.87 1,863,808,264	- -	0.58%
22	CISCO SYSTEMS INC アメリカ	株式 通信機器	366,861	4,794.42 1,758,887,754	5,049.13 1,852,329,174	- -	0.58%
23	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 専門小売り	89,911	20,887.83 1,878,046,361	19,960.94 1,794,708,292	- -	0.56%
24	MERCK & CO. INC. アメリカ	株式 医薬品	209,263	6,282.19 1,314,631,194	8,253.25 1,727,101,152	- -	0.54%
25	BOEING CO アメリカ	株式 航空宇宙・防 衛	43,089	39,253.23 1,691,382,635	39,630.80 1,707,651,825	- -	0.53%
26	COCA-COLA CO/THE アメリカ	株式 飲料	312,988	5,005.23 1,566,577,237	5,394.57 1,688,436,864	- -	0.53%
27	NOVARTIS AG-REG SHS スイス	株式 医薬品	168,856	8,966.21 1,513,998,992	9,796.55 1,654,207,496	- -	0.52%
28	COMCAST CORP-CL A アメリカ	株式 メディア	360,207	4,438.67 1,598,842,724	4,271.03 1,538,456,560	- -	0.48%
29	MASTERCARD INC アメリカ	株式 情報技術サー ビス	72,090	19,704.90 1,420,526,318	21,262.29 1,532,799,192	- -	0.48%

30	THE WALT DISNEY CO アメリカ	株式 娯楽	115,943	11,884.13 1,377,882,787	12,997.71 1,506,994,371	- -	0.47%
----	----------------------------	----------	---------	----------------------------	----------------------------	--------	-------

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成30年10月31日現在

種類	投資比率
株式	93.15%
投資信託受益証券	0.23%
投資証券	2.16%
合計	95.54%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

平成30年10月31日現在

業種	国内/外国	投資比率
銀行	外国	8.22%
石油・ガス・消耗燃料		6.05%
医薬品		5.54%
ソフトウェア		4.41%
保険		3.62%
情報技術サービス		3.42%
コンピュータ・周辺機器		3.17%
インタラクティブ・メディアおよびサービス		2.87%
半導体・半導体製造装置		2.72%
資本市場		2.72%
ヘルスケア機器・用品		2.36%
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス		2.34%
化学		2.28%
航空宇宙・防衛		2.19%
インターネット販売・通信販売		2.17%
各種電気通信サービス		2.11%
バイオテクノロジー		2.03%
飲料		1.88%
食品		1.84%
電力		1.80%
ホテル・レストラン・レジャー		1.71%
専門小売り		1.61%
食品・生活必需品小売り		1.60%
機械		1.41%
娯楽		1.40%
コングロマリット		1.38%
金属・鉱業		1.34%
繊維・アパレル・贅沢品		1.27%
家庭用品		1.21%
メディア		1.19%
タバコ		1.13%
総合公益事業		1.03%
陸運・鉄道		1.03%
各種金融サービス		0.95%

通信機器	0.93%
自動車	0.86%
電気設備	0.70%
パーソナル用品	0.68%
ライフサイエンス・ツール/サービス	0.66%
専門サービス	0.61%
航空貨物・物流サービス	0.55%
不動産管理・開発	0.48%
消費者金融	0.48%
電子装置・機器・部品	0.45%
エネルギー設備・サービス	0.44%
複合小売り	0.43%
商業サービス・用品	0.42%
建設関連製品	0.36%
家庭用耐久財	0.35%
自動車部品	0.35%
建設・土木	0.32%
無線通信サービス	0.29%
商社・流通業	0.29%
容器・包装	0.26%
建設資材	0.25%
運送インフラ	0.19%
ガス	0.16%
旅客航空輸送業	0.12%
紙製品・林産品	0.10%
水道	0.08%
ヘルスケア・テクノロジー	0.07%
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.07%
販売	0.07%
レジャー用品	0.05%
海運業	0.05%
貯蓄・抵当・不動産金融	0.02%
各種消費者サービス	0.02%
合計	93.15%

(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10月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	US T N/B 2.625 08/15/20 アメリカ	国債証券	1,868,790,000	100.65 1,880,974,510	99.62 1,861,707,285	2.625000 2020/8/15	0.94%
2	US T N/B 3.625 02/15/20 アメリカ	国債証券	1,732,878,000	102.61 1,778,227,417	101.07 1,751,489,109	3.625000 2020/2/15	0.88%
3	US T N/B 1.25 10/31/19 アメリカ	国債証券	1,698,900,000	98.41 1,671,955,446	98.58 1,674,928,521	1.250000 2019/10/31	0.84%
4	US T N/B 3.5 05/15/20 アメリカ	国債証券	1,585,640,000	102.59 1,626,755,645	101.04 1,602,225,794	3.500000 2020/5/15	0.81%
5	US T N/B 2.125 12/31/21 アメリカ	国債証券	1,458,788,800	98.43 1,435,987,931	97.67 1,424,813,608	2.125000 2021/12/31	0.72%
6	US T N/B 1.375 04/30/20 アメリカ	国債証券	1,359,120,000	98.01 1,332,141,468	97.91 1,330,768,756	1.375000 2020/4/30	0.67%
7	US T N/B 2.0 05/31/21 アメリカ	国債証券	1,359,120,000	98.51 1,338,882,703	97.82 1,329,545,548	2.000000 2021/5/31	0.67%
8	US T N/B 1.875 08/31/22 アメリカ	国債証券	1,359,120,000	96.83 1,316,103,852	96.21 1,307,609,352	1.875000 2022/8/31	0.66%
9	US T N/B 2.0 02/15/22 アメリカ	国債証券	1,328,539,800	97.89 1,300,613,893	97.18 1,291,114,833	2.000000 2022/2/15	0.65%
10	US T N/B 2.25 03/31/21 アメリカ	国債証券	1,302,490,000	99.41 1,294,857,408	98.57 1,283,968,592	2.250000 2021/3/31	0.65%
11	US T N/B 1.75 03/31/22 アメリカ	国債証券	1,325,142,000	96.79 1,282,684,450	96.24 1,275,343,163	1.750000 2022/3/31	0.64%
12	US T N/B 1.75 05/15/22 アメリカ	国債証券	1,313,816,000	96.67 1,270,184,170	96.09 1,262,537,761	1.750000 2022/5/15	0.64%
13	US T N/B 1.875 06/30/20 アメリカ	国債証券	1,245,860,000	98.95 1,232,865,680	98.46 1,226,673,756	1.875000 2020/6/30	0.62%
14	US T N/B 1.375 04/30/21 アメリカ	国債証券	1,269,644,600	96.34 1,223,259,759	96.41 1,224,115,144	1.375000 2021/4/30	0.62%
15	US T N/B 2.125 08/15/21 アメリカ	国債証券	1,245,860,000	98.74 1,230,187,081	97.95 1,220,407,080	2.125000 2021/8/15	0.62%
16	US T N/B 1.25 01/31/20 アメリカ	国債証券	1,223,208,000	98.10 1,199,979,280	98.16 1,200,749,901	1.250000 2020/1/31	0.61%
17	US T N/B 1.625 11/15/22 アメリカ	国債証券	1,251,523,000	95.67 1,197,447,869	95.05 1,189,622,672	1.625000 2022/11/15	0.60%
18	US T N/B 2.0 11/30/20 アメリカ	国債証券	1,189,230,000	98.96 1,176,862,008	98.28 1,168,787,136	2.000000 2020/11/30	0.59%
19	US T N/B 2.0 11/15/21 アメリカ	国債証券	1,177,904,000	98.12 1,155,853,637	97.42 1,147,572,972	2.000000 2021/11/15	0.58%
20	US T N/B 2.75 11/15/23 アメリカ	国債証券	1,132,600,000	100.15 1,134,366,856	99.10 1,122,508,534	2.750000 2023/11/15	0.57%
21	US T N/B 1.75 09/30/22 アメリカ	国債証券	1,158,649,800	96.20 1,114,736,972	95.67 1,108,584,542	1.750000 2022/9/30	0.56%
22	US T N/B 2.125 09/30/21 アメリカ	国債証券	1,132,600,000	98.62 1,117,026,750	97.85 1,108,260,426	2.125000 2021/9/30	0.56%
23	US T N/B 1.75 01/31/23 アメリカ	国債証券	1,132,600,000	95.85 1,085,677,888	95.28 1,079,152,606	1.750000 2023/1/31	0.54%

24	FRANCE OAT 2.5 10/25/20 フランス	国債証券	1,001,754,000	107.59 1,077,827,198	106.02 1,062,149,748	2.500000 2020/10/25	0.54%
25	US T N/B 2.125 06/30/22 アメリカ	国債証券	1,075,970,000	98.05 1,055,031,623	97.27 1,046,628,298	2.125000 2022/6/30	0.53%
26	US T N/B 2.625 08/31/20 アメリカ	国債証券	1,047,655,000	99.65 1,044,061,543	99.62 1,043,757,723	2.625000 2020/8/31	0.53%
27	US T N/B 2.0 02/15/23 アメリカ	国債証券	1,075,970,000	96.94 1,043,142,155	96.25 1,035,696,442	2.000000 2023/2/15	0.52%
28	US T N/B 1.625 08/15/22 アメリカ	国債証券	1,075,970,000	95.83 1,031,198,888	95.36 1,026,120,309	1.625000 2022/8/15	0.52%
29	US T N/B 2.0 02/15/25 アメリカ	国債証券	1,075,970,000	94.75 1,019,481,575	94.22 1,013,843,492	2.000000 2025/2/15	0.51%
30	US T N/B 1.75 12/31/20 アメリカ	国債証券	1,019,340,000	98.21 1,001,175,361	97.70 995,925,760	1.750000 2020/12/31	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10月31日現在

種類	投資比率
国債証券	97.92%
合計	97.92%

(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

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10月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	TENCENT HOLDINGS LTD ケイマン諸島	株式 インタラク ティブ・メ ディアおよび サービス	483,600	5,749.11 2,780,272,521	3,641.76 1,761,159,004	- -	3.75%
2	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD 韓国	株式 コンピュ ータ・周辺機器	408,907	4,965.75 2,030,531,603	4,213.82 1,723,062,539	- -	3.67%
3	TAIWAN SEMICONDUCTOR 台湾	株式 半導体・半導 体製造装置	2,099,083	865.69 1,817,158,033	816.17 1,713,229,562	- -	3.65%
4	ALIBABA GROUP HOLDING LTD- ADR ケイマン諸島	株式 インターネッ ト販売・通信 販売	98,080	20,457.56 2,006,478,002	15,440.73 1,514,427,367	- -	3.23%
5	CHINA CONSTRUCTION BANK 中国	株式 銀行	8,136,530	113.57 924,118,848	89.52 728,447,257	- -	1.55%
6	NASPERS LTD 南アフリカ	株式 メディア	37,314	23,584.25 880,022,857	18,320.09 683,596,211	- -	1.46%
7	CHINA MOBILE LIMITED 香港	株式 無線通信サー ビス	520,000	1,045.67 543,750,265	1,031.01 536,128,320	- -	1.14%
8	BAIDU INC -SPON ADR ケイマン諸島	株式 インタラク ティブ・メ ディアおよび サービス	23,400	27,037.67 632,681,570	20,768.48 485,982,577	- -	1.04%
9	PING AN INSURANCE GROUP CO-H 中国	株式 保険	439,500	1,160.96 510,245,860	1,047.62 460,429,869	- -	0.98%
10	IND & COMM BK OF CHINA - H 中国	株式 銀行	5,875,235	94.57 555,669,852	76.24 447,946,717	- -	0.95%
11	VALE SA ブラジル	株式 金属・鉱業	267,621	1,430.15 382,739,955	1,649.49 441,440,678	- -	0.94%
12	ITAU UNIBANCO HOLDING SA ブラジル	株式 銀行	273,898	1,524.45 417,545,868	1,515.38 415,060,592	- -	0.88%
13	RELIANCE INDUSTRIES LTD インド	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	241,368	1,476.52 356,385,568	1,638.34 395,445,262	- -	0.84%
14	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP インド	株式 貯蓄・抵当・ 不動産金融	135,245	2,933.49 396,741,005	2,591.44 350,479,979	- -	0.75%

15	LUKOIL SPON ADR ロシア	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	42,079	7,409.36 311,778,656	8,265.71 347,813,013	- -	0.74%
16	SK HYNIX INC 韓国	株式 半導体・半導 体製造装置	49,265	8,322.08 409,987,379	6,785.89 334,307,363	- -	0.71%
17	BANK OF CHINA LTD 中国	株式 銀行	6,712,200	59.25 397,754,184	47.65 319,849,754	- -	0.68%
18	HON HAI PRECISION INDUSTRY 台湾	株式 電子装置・機 器・部品	1,117,225	386.65 431,983,504	279.62 312,402,923	- -	0.67%
19	BANCO BRADESCO SA PREF ブラジル	株式 銀行	288,125	1,017.46 293,156,702	1,064.04 306,577,965	- -	0.65%
20	INFOSYS LTD インド	株式 情報技術サー ビス	295,401	886.37 261,836,605	1,022.37 302,012,074	- -	0.64%
21	SBERBANK ADR ロシア	株式 銀行	231,040	1,608.86 371,712,696	1,300.22 300,403,937	- -	0.64%
22	CNOOC LTD 香港	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	1,506,000	181.00 272,592,788	195.80 294,884,438	- -	0.63%
23	PETROLEO BRASILEIRO SA ブラジル	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	333,212	629.36 209,712,889	857.35 285,682,640	- -	0.61%
24	SAMSUNG ELECTRONICS-PFD 韓国	株式 コンピュー タ・周辺機器	72,684	4,024.20 292,495,348	3,492.44 253,845,235	- -	0.54%
25	GAZPROM PAO ADR ロシア	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	468,810	515.21 241,537,903	526.20 246,690,616	- -	0.53%
26	PETROLEO BRASILEIRO SA ブラジル	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	250,610	710.93 178,167,179	934.52 234,200,658	- -	0.50%
27	AMERICA MOVIL SAB DE CV メキシコ	株式 無線通信サー ビス	2,854,078	99.47 283,896,698	80.08 228,577,398	- -	0.49%
28	TATA CONSULTANCY SERVICES LTD インド	株式 情報技術サー ビス	77,574	2,507.56 194,521,972	2,936.93 227,830,183	- -	0.49%
29	QATAR NATIONAL BANK カタール	株式 銀行	37,758	4,834.25 182,531,669	5,764.59 217,659,766	- -	0.46%
30	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL COR 中国	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	2,139,200	106.37 227,566,671	94.43 202,020,913	- -	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10月31日現在

種類	投資比率
株式	94.83%
投資信託受益証券	0.49%
投資証券	0.17%
合計	95.49%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

平成30年10月31日現在

業種	国内/外国	投資比率
銀行	外国	16.51%
石油・ガス・消耗燃料		8.28%
インタラクティブ・メディアおよびサービス		5.65%
半導体・半導体製造装置		5.22%
コンピュータ・周辺機器		5.09%
インターネット販売・通信販売		3.92%
保険		3.69%
金属・鉱業		3.38%
無線通信サービス		2.98%
化学		2.40%
不動産管理・開発		2.35%
電子装置・機器・部品		2.19%
自動車		1.87%
情報技術サービス		1.79%
食品・生活必需品小売り		1.78%
メディア		1.77%
食品		1.73%
各種電気通信サービス		1.53%
コングロマリット		1.47%
医薬品		1.38%
資本市場		1.21%
各種金融サービス		1.12%
電力		1.01%
運送インフラ		0.88%
建設資材		0.86%
飲料		0.85%
貯蓄・抵当・不動産金融		0.85%
建設・土木		0.76%
機械		0.68%
ホテル・レストラン・レジャー		0.68%
パーソナル用品		0.67%
複合小売り		0.66%
娯楽		0.64%
繊維・アパレル・贅沢品		0.62%
ガス		0.61%
タバコ		0.58%
独立系発電事業者・エネルギー販売業者		0.56%
自動車部品		0.56%

バイオテクノロジー	0.55%
紙製品・林産品	0.51%
専門小売り	0.46%
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	0.45%
各種消費者サービス	0.45%
家庭用品	0.42%
家庭用耐久財	0.31%
陸運・鉄道	0.30%
旅客航空輸送業	0.25%
電気設備	0.24%
水道	0.22%
消費者金融	0.22%
ライフサイエンス・ツール/サービス	0.22%
エクイティ不動産投資信託(REITs)	0.20%
航空宇宙・防衛	0.19%
商業サービス・用品	0.13%
ヘルスケア機器・用品	0.12%
海運業	0.11%
エネルギー設備・サービス	0.10%
レジャー用品	0.09%
容器・包装	0.08%
総合公益事業	0.08%
ソフトウェア	0.07%
ヘルスケア・テクノロジー	0.06%
航空貨物・物流サービス	0.06%
通信機器	0.05%
商社・流通業	0.05%
専門サービス	0.03%
建設関連製品	0.03%
販売	0.03%
合計	94.83%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

平成30年10月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	RUSSIAN FEDERATION 5.25 06/23/47 ロシア	国債証券	1,902,768,000	95.28 1,813,119,312	92.78 1,765,483,288	5.250000 2047/6/23	2.51%
2	RUSSIA FOREIGN BOND 5.0 04/29/20 ロシア	国債証券	1,291,164,000	102.13 1,318,744,395	101.81 1,314,650,273	5.000000 2020/4/29	1.87%
3	PERU 5.625 11/18/50 ペルー	国債証券	1,132,600,000	119.86 1,357,644,222	112.17 1,270,448,746	5.625000 2050/11/18	1.81%
4	BRAZIL 4.25 01/07/25 ブラジル	国債証券	1,279,838,000	98.82 1,264,839,544	97.06 1,242,249,157	4.250000 2025/1/7	1.77%
5	PERU 7.35 07/21/25 ペルー	国債証券	951,384,000	123.92 1,178,975,439	120.11 1,142,754,891	7.350000 2025/7/21	1.63%
6	COLOMBIA 5.0 06/15/45 コロンビア	国債証券	1,155,252,000	100.87 1,165,388,770	95.00 1,097,489,400	5.000000 2045/6/15	1.56%
7	UNITED MEXICAN STATES 4.75 03/08/44 メキシコ	国債証券	1,200,556,000	97.16 1,166,464,740	88.90 1,067,306,289	4.750000 2044/3/8	1.52%
8	ROMANIA 6.75 02/07/22 ルーマニア	国債証券	985,362,000	110.65 1,090,338,050	107.95 1,063,727,839	6.750000 2022/2/7	1.52%
9	PANAMA 6.7 01/26/36 パナマ	国債証券	883,428,000	125.39 1,107,762,082	119.95 1,059,760,228	6.700000 2036/1/26	1.51%
10	HUNGARY 6.375 03/29/21 ハンガリー	国債証券	974,036,000	108.03 1,052,292,317	106.05 1,033,004,139	6.375000 2021/3/29	1.47%
11	RUSSIAN FEDERATION 03/31/30 ロシア	国債証券	916,556,550	110.27 1,010,738,375	109.13 1,000,302,321	7.500000 2030/3/31	1.42%
12	BRAZIL 4.875 01/22/21 ブラジル	国債証券	974,036,000	103.12 1,004,457,636	101.70 990,594,612	4.875000 2021/1/22	1.41%
13	RUSSIAN FEDERATION 4.75 05/27/26 ロシア	国債証券	928,732,000	100.70 935,234,483	98.98 919,323,944	4.750000 2026/5/27	1.31%
14	UNITED MEXICAN STATES 4.15 03/28/27 メキシコ	国債証券	928,732,000	99.81 927,021,774	95.40 886,010,328	4.150000 2027/3/28	1.26%
15	UNITED MEXICAN STATES 6.05 01/11/40 メキシコ	国債証券	826,798,000	113.47 938,209,030	104.40 863,185,379	6.050000 2040/1/11	1.23%
16	COLOMBIA 6.125 01/18/41 コロンビア	国債証券	792,820,000	114.56 908,265,918	108.60 861,010,448	6.125000 2041/1/18	1.23%
17	INDONESIA 4.875 05/05/21 インドネシア	国債証券	826,798,000	103.80 858,227,196	102.30 845,863,961	4.875000 2021/5/5	1.20%
18	COLOMBIA 4.0 02/26/24 コロンビア	国債証券	849,450,000	100.82 856,469,288	98.77 839,044,237	4.000000 2024/2/26	1.20%
19	RUSSIAN FEDERATION 4.875 09/16/23 ロシア	国債証券	815,472,000	102.82 838,545,327	102.52 836,103,441	4.875000 2023/9/16	1.19%

20	HUNGARY 6.25 01/29/20 ハンガリー	国債証券	804,146,000	105.27 846,551,563	103.49 832,218,736	6.250000 2020/1/29	1.19%
21	INDONESIA 4.125 01/15/25 インドネシア	国債証券	860,776,000	100.76 867,322,428	96.15 827,644,731	4.125000 2025/1/15	1.18%
22	CROATIA 5.5 04/04/23 クロアチア	国債証券	770,168,000	107.08 824,699,518	105.15 809,893,265	5.500000 2023/4/4	1.15%
23	RUSSIAN FEDERATION 5.625 04/04/42 ロシア	国債証券	792,820,000	104.62 829,499,930	102.13 809,746,707	5.625000 2042/4/4	1.15%
24	UNITED MEXICAN STATES 4.0 10/02/23 メキシコ	国債証券	804,146,000	101.54 816,559,635	99.07 796,723,732	4.000000 2023/10/2	1.13%
25	ROMANIA 4.375 08/22/23 ルーマニア	国債証券	792,820,000	102.58 813,352,225	100.07 793,406,686	4.375000 2023/8/22	1.13%
26	BRAZIL 4.625 01/13/28 ブラジル	国債証券	838,124,000	93.53 783,974,394	94.07 788,473,534	4.625000 2028/1/13	1.12%
27	PHILIPPINES 9.5 02/02/30 フィリピン	国債証券	543,648,000	149.66 813,657,574	144.35 784,755,888	9.500000 2030/2/2	1.12%
28	BRAZIL 5.0 01/27/45 ブラジル	国債証券	928,732,000	85.67 795,667,356	83.31 773,745,203	5.000000 2045/1/27	1.10%
29	HUNGARY 5.375 03/25/24 ハンガリー	国債証券	724,864,000	108.38 785,663,100	106.28 770,392,707	5.375000 2024/3/25	1.10%
30	COLOMBIA 4.375 07/12/21 コロンビア	国債証券	747,516,000	103.14 771,006,124	101.47 758,541,861	4.375000 2021/7/12	1.08%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成30年10月31日現在

種類	投資比率
国債証券	96.42%
合計	96.42%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

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10月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 （円）	評価金額 （円）	投資 比率
株価指数先物 取引	大阪取引所	TOPIX 先物 3012月	買建	633	10,758,754,692	10,387,530,000	3.73%

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年10月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
為替予約取引	-	アメリカ・ドル買/円 売2018年11月	買建	19,756,000	2,223,249,300	2,237,357,550	0.70%
		ユーロ買/円売201 8年11月	買建	4,241,000	542,864,100	544,671,630	0.17%
		イギリス・ポンド買/ 円売2018年11月	買建	1,477,000	212,737,131	212,525,530	0.07%
		カナダ・ドル買/円売 2018年11月	買建	1,351,000	115,956,201	116,753,420	0.04%
		オーストラリア・ドル 買/円売2018年1 1月	買建	1,027,000	81,713,246	82,396,210	0.03%
株価指数先物 取引	シカゴ商品 取引所	S&P500 EMI NI FUT Dec 18	買建	660	10,345,581,799	10,036,336,695	3.13%
	EUREX 取引所	DJ EURO ST OXX 50 Dec 18	買建	608	2,529,049,981	2,454,225,379	0.76%
	ICE-E U	FTSE 100 I NDEX FUTUR E Dec18	買建	94	963,383,878	949,702,586	0.30%
	モン トリ オール 取引 所	S&P/TSE 6 0 IX FUT D ec18	買建	35	551,900,493	536,401,866	0.17%
	シド ニー 先 物 取引 所	SPI 200 FU TURES Dec1 8	買建	31	365,110,054	358,937,592	0.11%

(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10月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
為替予約取引	-	アメリカ・ドル売/円 買2018年11月	売建	1,642,352	185,980,000	185,980,000	0.09%

(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10月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
為替予約取引	-	アメリカ・ドル買/円 売2018年11月	買建	1,009,000	113,731,540	114,266,290	0.24%
株価指数先物 取引	ICE-US	MINI MSCI EMG MKT Dec 18	買建	395	2,234,892,190	2,115,422,144	4.51%

(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10月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
為替予約取引	-	アメリカ・ドル買/円 売2018年11月	買建	250,000	28,125,000	28,312,500	0.04%
		アメリカ・ドル売/円 買2018年11月	売建	7,400,000	837,976,000	837,976,000	1.19%

(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10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
第7計算期間末 (平成30年10月11日)	154	154	1.0294	1.0294
平成29年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	-
5月末日	131	-	1.0565	-
6月末日	131	-	1.0503	-
7月末日	139	-	1.0585	-
8月末日	147	-	1.0457	-
9月末日	157	-	1.0496	-
10月末日	154	-	1.0150	-

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
第7計算期間末 (平成30年10月11日)	290	290	1.0089	1.0089
平成29年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	-
5月末日	293	-	1.0469	-
6月末日	292	-	1.0372	-
7月末日	306	-	1.0487	-
8月末日	301	-	1.0321	-
9月末日	298	-	1.0411	-
10月末日	285	-	0.9895	-

【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
第7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
第7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
第7計算期間	3.3

(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
第7計算期間	4.6

(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
第7計算期間	33,165,458	8,351,305

(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
第7計算期間	43,415,961	36,374,469

(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10月31日

基準価額・純資産の推移 (2015年8月28日～2018年10月31日)



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。

※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額とは異なります。(設定日: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
第7期(2018.10.11)	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	6.01%
2	エマーシング株式パッシブ・マザーファンド	5.00%
3	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	3.14%
4	エマーシング債券パッシブ・マザーファンド	2.11%
5	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	2.07%
6	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	2.06%

(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	8.71%
2	エマーシング株式パッシブ・マザーファンド	7.22%
3	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	4.54%
4	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	3.02%
5	エマーシング債券パッシブ・マザーファンド	3.00%
6	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	2.94%

○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10月31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	122回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.100000	2019/12/20	1.18%
2	350回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.100000	2028/3/20	1.00%
3	340回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.400000	2025/9/20	0.94%
4	339回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.400000	2025/6/20	0.94%
5	338回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.400000	2025/3/20	0.94%

■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	3.05%
2	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	日本	銀行業	1.94%
3	ソニー	株式	日本	電気機器	1.70%
4	ソフトバンクグループ	株式	日本	情報・通信業	1.53%
5	日本電信電話	株式	日本	情報・通信業	1.32%

■外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還期限	比率
1	US T N/B 2.625 08/15/20	国債証券	アメリカ	2.625000	2020/8/15	0.94%
2	US T N/B 3.625 02/15/20	国債証券	アメリカ	3.625000	2020/2/15	0.88%
3	US T N/B 1.25 10/31/19	国債証券	アメリカ	1.250000	2019/10/31	0.84%
4	US T N/B 3.5 05/15/20	国債証券	アメリカ	3.500000	2020/5/15	0.81%
5	US T N/B 2.125 12/31/21	国債証券	アメリカ	2.125000	2021/12/31	0.72%

■外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	業種	比率
1	APPLE INC	株式	アメリカ	コンピュータ・周辺機器	2.87%
2	MICROSOFT CORP	株式	アメリカ	ソフトウェア	2.07%
3	AMAZON.COM INC	株式	アメリカ	インターネット販売・通信販売	1.73%
4	JOHNSON & JOHNSON	株式	アメリカ	医薬品	1.04%
5	JPMORGAN CHASE & CO	株式	アメリカ	銀行	1.00%

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

○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10月31日

■エマージング債券パッシブ・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還期限	比率
1	RUSSIAN FEDERATION 5.25 06/23/47	国債証券	ロシア	5.250000	2047/6/23	2.51%
2	RUSSIA FOREIGN BOND 5.0 04/29/20	国債証券	ロシア	5.000000	2020/4/29	1.87%
3	PERU 5.625 11/18/50	国債証券	ペルー	5.625000	2050/11/18	1.81%
4	BRAZIL 4.25 01/07/25	国債証券	ブラジル	4.250000	2025/1/7	1.77%
5	PERU 7.35 07/21/25	国債証券	ペルー	7.350000	2025/7/21	1.63%

■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	インタラクティブ・メディアおよびサービス	3.75%
2	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	株式	韓国	コンピュータ・周辺機器	3.67%
3	TAIWAN SEMICONDUCTOR	株式	台湾	半導体・半導体製造装置	3.65%
4	ALIBABA GROUP HOLDING LTD-ADR	株式	ケイマン諸島	インターネット販売・通信販売	3.23%
5	CHINA CONSTRUCTION BANK	株式	中国	銀行	1.55%


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。

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

○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】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

信託期間は、2015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す。なお、知っている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- d. 上記b.の書面決議は議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- e. 上記b.からd.までの規定は、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、信託契約にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって上記b.からd.までの手続きを行うことが困難な場合にも適用しません。
- 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發します。
- c. 上記b.の書面決議において、受益者(委託会社およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下同じ。)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】

D I A M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7期計算期間(平成30年4月12日から平成30年10月11日まで)の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

1【財務諸表】

【DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)】

(1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第6期 平成30年4月11日現在	第7期 平成30年10月11日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	121,049,435	94,577,306
親投資信託受益証券	13,327,390	61,015,594
流動資産合計	134,376,825	155,592,900
資産合計	134,376,825	155,592,900
負債の部		
流動負債		
未払解約金	-	48,279
未払受託者報酬	36,566	37,801
未払委託者報酬	732,294	756,827
その他未払費用	2,851	2,906
流動負債合計	771,711	845,813
負債合計	771,711	845,813
純資産の部		
元本等		
元本	1 125,512,135	1 150,326,288
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	8,092,979	4,420,799
(分配準備積立金)	7,750,312	7,281,497
元本等合計	133,605,114	154,747,087
純資産合計	133,605,114	154,747,087
負債純資産合計	134,376,825	155,592,900

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第6期		第7期	
	自	平成29年10月12日 至 平成30年4月11日	自	平成30年4月12日 至 平成30年10月11日
営業収益				
有価証券売買等損益		2,224,043		4,111,796
営業収益合計		2,224,043		4,111,796
営業費用				
支払利息		21,329		28,691
受託者報酬		36,566		37,801
委託者報酬		732,294		756,827
その他費用		2,851		13,765
営業費用合計		793,040		837,084
営業利益又は営業損失()		1,431,003		4,948,880
経常利益又は経常損失()		1,431,003		4,948,880
当期純利益又は当期純損失()		1,431,003		4,948,880
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()		260,564		86,859
期首剰余金又は期首欠損金()		7,198,480		8,092,979
剰余金増加額又は欠損金減少額		852,632		1,723,538
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		852,632		1,723,538
剰余金減少額又は欠損金増加額		1,128,572		533,697
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		1,128,572		533,697
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金()		8,092,979		4,420,799

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	第6期 平成30年4月11日現在	第7期 平成30年10月11日現在
1. 1 期首元本額	133,892,571円	125,512,135円
期中追加設定元本額	12,455,819円	33,165,458円
期中一部解約元本額	20,836,255円	8,351,305円
2. 受益権の総数	125,512,135口	150,326,288口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第6期 自 平成29年10月12日 至 平成30年4月11日	第7期 自 平成30年4月12日 至 平成30年10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(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(8,441円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(2,978,331円)及び分配準備積立金(7,273,056円)より分配対象収益は10,259,828円(1万口当たり682.50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6期 自 平成29年10月12日 至 平成30年4月11日	第7期 自 平成30年4月12日 至 平成30年10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6期 平成30年4月11日現在	第7期 平成30年10月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第6期 平成30年4月11日現在	第7期 平成30年10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	420,149	1,931,157
合計	420,149	1,931,157

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	第6期 平成30年4月11日現在	第7期 平成30年10月11日現在
1口当たり純資産額	1.0645円	1.0294円
(1万口当たり純資産額)	(10,645円)	(10,294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10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	6,372,781	16,710,706	
	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファ ンド	5,135,239	6,569,511	
	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファ ンド	1,867,184	6,587,238	
	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファ ンド	7,283,621	13,035,496	
	エマージング株式パッシブ・マザーファン ド	10,528,358	11,525,393	
	エマージング債券パッシブ・マザーファン ド	3,640,572	6,587,250	
親投資信託受益証券 合計		34,827,755	61,015,594	
合計		34,827,755	61,015,594	

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7期計算期間(平成30年4月12日から平成30年10月11日まで)の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

【DIAMコア資産設計ファンド(積極型)】

(1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第6期 平成30年4月11日現在	第7期 平成30年10月11日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	258,085,930	101,286,292
親投資信託受益証券	40,892,483	135,475,460
未収入金	-	55,800,000
流動資産合計	298,978,413	292,561,752
資産合計	298,978,413	292,561,752
負債の部		
流動負債		
未払解約金	-	9,999
未払受託者報酬	79,730	80,855
未払委託者報酬	1,595,654	1,617,989
その他未払費用	6,293	6,357
流動負債合計	1,681,677	1,715,200
負債合計	1,681,677	1,715,200
純資産の部		
元本等		
元本	1,281,225,161	1,288,266,653
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	16,071,575	2,579,899
(分配準備積立金)	15,726,208	14,671,072
元本等合計	297,296,736	290,846,552
純資産合計	297,296,736	290,846,552
負債純資産合計	298,978,413	292,561,752

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第6期		第7期	
	自	平成29年10月12日 至 平成30年4月11日	自	平成30年4月12日 至 平成30年10月11日
営業収益				
有価証券売買等損益		5,315,954		12,217,023
営業収益合計		5,315,954		12,217,023
営業費用				
支払利息		35,162		33,468
受託者報酬		79,730		80,855
委託者報酬		1,595,654		1,617,989
その他費用		6,293		17,236
営業費用合計		1,716,839		1,749,548
営業利益又は営業損失()		3,599,115		13,966,571
経常利益又は経常損失()		3,599,115		13,966,571
当期純利益又は当期純損失()		3,599,115		13,966,571
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()		1,075,830		449,881
期首剰余金又は期首欠損金()		13,494,248		16,071,575
剰余金増加額又は欠損金減少額		2,480,937		2,095,575
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		2,480,937		2,095,575
剰余金減少額又は欠損金増加額		2,426,895		2,070,561
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		2,070,561
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金()		16,071,575		2,579,899

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	第6期 平成30年4月11日現在	第7期 平成30年10月11日現在
1. 1 期首元本額	299,233,986円	281,225,161円
期中追加設定元本額	34,785,616円	43,415,961円
期中一部解約元本額	52,794,441円	36,374,469円
2. 受益権の総数	281,225,161口	288,266,653口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第6期 自 平成29年10月12日 至 平成30年4月11日	第7期 自 平成30年4月12日 至 平成30年10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(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。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(830,464円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(4,649,278円)及び分配準備積立金(13,840,608円)より分配対象収益は19,320,350円(1万口当たり670.22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6期 自 平成29年10月12日 至 平成30年4月11日	第7期 自 平成30年4月12日 至 平成30年10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6期 平成30年4月11日現在	第7期 平成30年10月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第6期 平成30年4月11日現在	第7期 平成30年10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	775,093	4,881,219
合計	775,093	4,881,219

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	第6期 平成30年4月11日現在	第7期 平成30年10月11日現在
1口当たり純資産額	1.0571円	1.0089円
(1万口当たり純資産額)	(10,571円)	(10,089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10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	13,273,632	34,806,117	
	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	10,773,596	13,782,661	
	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	3,890,801	13,726,356	
	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	15,275,389	27,338,363	
	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	29,281,738	32,054,718	
	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	7,608,735	13,767,245	
親投資信託受益証券 合計		80,103,891	135,475,460	
合計		80,103,891	135,475,460	

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30年4月11日現在	平成30年10月11日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		10,828,232,932	5,141,874,534
株式	2	289,561,896,277	275,619,206,300
派生商品評価勘定		94,074,052	10,343,152
未収入金		166,835,521	330,060
未収配当金		2,641,772,683	2,478,473,147
前払金		-	52,604,000
流動資産合計		303,292,811,465	283,302,831,193
資産合計		303,292,811,465	283,302,831,193
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		203,240	353,629,896
前受金		341,690,000	-
未払金		9,984,484,244	-
未払解約金		175,074,000	237,110,000
流動負債合計		10,501,451,484	590,739,896
負債合計		10,501,451,484	590,739,896
純資産の部			
元本等			
元本	1	111,281,995,587	107,816,602,893
剰余金			
剰余金又は欠損金()		181,509,364,394	174,895,488,404
元本等合計		292,791,359,981	282,712,091,297
純資産合計		292,791,359,981	282,712,091,297
負債純資産合計		303,292,811,465	283,302,831,193

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	平成30年4月11日現在	平成30年10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	119,262,204,158円	111,281,995,587円
同期中追加設定元本額	12,307,585,270円	15,217,860,556円
同期中一部解約元本額	20,287,793,841円	18,683,253,250円
元本の内訳		
ファンド名		
DIAM DC 国内株式インデックスファンド	9,553,973,683円	10,889,998,888円
DIAM国内株式パッシブ・ファンド	1,934,519,101円	2,192,108,705円
MITO ラップ型ファンド（安定型）	4,115,683円	3,392,166円
MITO ラップ型ファンド（中立型）	9,042,847円	7,399,968円
MITO ラップ型ファンド（積極型）	16,007,723円	12,999,220円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	22,367,745円	23,906,761円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	18,721,655円	19,553,564円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	15,039,866円	17,030,556円
たわらノーロード TOPIX	170,149,558円	277,927,485円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	20,100,721円	56,618,250円
たわらノーロード バランス（堅実型）	412,759円	1,460,887円
たわらノーロード バランス（標準型）	2,586,944円	10,511,100円

たわらノーロード バランス (積極型)	7,648,425円	25,438,489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)	41,970円	183,257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)	1,824,825円	5,725,335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)	2,727,260円	18,667,647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)	2,355,579円	15,203,520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)	5,700,586円	37,332,875円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(保守型)	42,775円	40,828円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定型)	57,341円	70,562円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定成長型)	403,344円	623,211円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(成長型)	422,453円	535,585円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(積極型)	1,308,809円	1,592,610円
D I A M国内株式インデックス ファンド< D C年金>	37,286,881,966円	37,206,521,425円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 1 安定型	799,183,741円	816,531,612円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 2 安定・成長型	2,743,834,554円	2,847,785,821円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 3 成長型	2,857,763,553円	2,998,403,698円
D I A M D C バランス3 0 インデックスファンド	338,608,842円	335,014,767円
D I A M D C バランス5 0 インデックスファンド	1,131,085,619円	1,134,503,177円
D I A M D C バランス7 0 インデックスファンド	1,063,174,443円	1,076,982,515円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型>	43,373,703円	41,354,593円
マネックス資産設計ファンド< 育成型>	1,084,829,283円	1,081,393,977円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	25,558,900円	25,211,643円
D I A M D C 8 資産バラ ンスファンド(新興国1 0)	41,290,133円	270,587,522円
D I A M D C 8 資産バラ ンスファンド(新興国2 0)	107,162,699円	169,556,877円
D I A M D C 8 資産バラ ンスファンド(新興国3 0)	209,192,825円	302,458,993円
投資のソムリエ	1,456,346,648円	2,603,577,387円
クルーズコントロール	201,841,066円	811,309,601円
投資のソムリエ< D C年金>	104,068,746円	226,394,802円

DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	166,392,070円	185,086,296円
DIAM DC バランス・F(成長型)	216,687,941円	240,119,447円
クルーズコントロール<DC年金>	74,862円	469,071円
DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)	1,239,139円	6,372,781円
DIAMコア資産設計ファンド(積極型)	3,802,586円	13,273,632円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	34,252,346円	73,476,645円
ダイナミック・ナビゲーション	1,702,235円	1,319,223円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	565,736,630円	1,388,764,282円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	564,394円	1,099,505円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	412,164円	793,044円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	172,550円	436,709円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	585,580円	1,452,537円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	1,186,612円	13,416,010円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	- 円	235,255,917円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	- 円	18,666円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	71,978,721円	62,827,883円
日米資産配分戦略ファンド(インカム重視型)(為替ヘッジあり)(適格機関投資家限定)	- 円	55,539,660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)	131,297,159円	110,246,818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)	293,628,160円	270,358,342円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	16,310,580円	14,259,379円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	71,472,546円	60,980,777円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	17,536,694円	15,221,233円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	20,478,291円	14,774,325円

D I A M世界バランスファンド 4 0 V A (適格機関投資家限 定)	30,744,677円	29,165,799円
D I A M世界バランスファンド 5 0 V A (適格機関投資家限 定)	55,943,767円	51,769,778円
D I A Mバランスファンド2 5 V A (適格機関投資家限定)	1,081,391,430円	971,587,261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)	1,017,110,915円	923,970,304円
D I A Mバランスファンド5 0 V A (適格機関投資家限定)	2,787,488,555円	2,593,869,939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)	201,920,528円	183,476,305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)	83,966,353円	49,363,658円
D I A M アクサ グローバ ル バランスファンド3 0 V A (適格機関投資家限定)	597,430,175円	527,096,832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)	1,313,335,435円	421,703,927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)	10,313,671円	10,313,671円
D I A M世界バランスファンド 5 5 V A (適格機関投資家限 定)	21,943,421円	7,124,683円
D I A M世界バランスファンド 3 5 V A (適格機関投資家限 定)	687,744,704円	57,585,354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)	15,402,729,373円	10,230,280,281円
D I A M世界アセットバランス ファンド4 0 V A (適格機関投 資家限定)	550,455,348円	378,222,399円
D I A M世界アセットバランス ファンド2 5 V A (適格機関投 資家限定)	1,760,010,553円	1,642,740,603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)	10,095,461,362円	9,443,795,131円
D I A Mバランス3 0 V A (適 格機関投資家限定)	5,031,055円	3,071,696円
D I A Mバランス5 0 V A (適 格機関投資家限定)	273,573円	2,949,084円
D I A Mバランス7 0 V A (適 格機関投資家限定)	3,720,103円	3,687,674円

	D I A M世界アセットバランス ファンド4 V A (適格機関投資 家限定)	8,987,350,006円	8,432,589,388円
	D I A M世界バランス25 V A (適格機関投資家限定)	72,431,048円	65,631,920円
	D I A M国内バランス30 V A (適格機関投資家限定)	28,338,107円	26,139,818円
	D I A Mバランス20 V A (適 格機関投資家限定)	26,228,092円	24,002,219円
	D I A Mバランス40 V A (適 格機関投資家限定)	98,961円	96,992円
	D I A Mバランス60 V A (適 格機関投資家限定)	111,124円	110,708円
	D I A M世界アセットバランス ファンド7 V A (1 2 1 2) (適格機関投資家限定)	426,902,115円	405,365,089円
	D I A M世界アセットバランス ファンド7 V A (1 3 0 3) (適格機関投資家限定)	1,323,021,834円	1,261,532,817円
	D I A M世界アセットバランス ファンド7 V A (1 3 0 6) (適格機関投資家限定)	1,737,262,933円	1,669,062,351円
	D I A M世界アセットバランス ファンド7 V A (1 3 0 9) (適格機関投資家限定)	73,956,736円	68,825,151円
	計	111,281,995,587円	107,816,602,893円
2 .	受益権の総数	111,281,995,587口	107,816,602,893口
3 .	2 差入代用有価証券	株式 3,422,500,000円	株式 3,298,500,000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10月12日 至 平成30年4月11日	自 平成30年4月12日 至 平成30年10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30年4月11日現在	平成30年10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30年4月11日現在	平成30年10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	3,985,062,194	7,451,385,633
合計	3,985,062,194	7,451,385,633

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成30年2月8日から平成30年4月11日まで及び平成30年2月8日から平成30年10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30年4月11日 現在				平成30年10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	5,717,585,000	-	5,811,565,000	93,980,000	8,086,019,000	-	7,742,880,000	343,139,000
合計	5,717,585,000	-	5,811,565,000	93,980,000	8,086,019,000	-	7,742,880,000	343,139,000

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成30年4月11日現在	平成30年10月11日現在
1口当たり純資産額	2.6311円	2.6222円
(1万口当たり純資産額)	(26,311円)	(26,222円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

平成30年10月11日現在

銘柄	株式数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
極洋	5,000	3,195.00	15,975,000	
日本水産	143,200	715.00	102,388,000	
マル八ニチロ	24,100	4,100.00	98,810,000	
ハウスイ	900	1,033.00	929,700	
カネコ種苗	4,300	1,525.00	6,557,500	
サカタのタネ	18,800	3,850.00	72,380,000	
ホクト	12,900	1,928.00	24,871,200	
ホクリヨウ	2,100	766.00	1,608,600	
ヒノキヤグループ	3,200	2,755.00	8,816,000	
ショーボンドホールディングス	12,000	8,270.00	99,240,000	
ミライト・ホールディングス	43,600	1,828.00	79,700,800	
タマホーム	9,500	1,095.00	10,402,500	
サンヨーホームズ	2,200	925.00	2,035,000	
日本アクア	3,500	368.00	1,288,000	
ファーストコーポレーション	4,300	1,110.00	4,773,000	
ベステラ	2,300	1,402.00	3,224,600	
TATERU	18,100	520.00	9,412,000	
スペースバリューホールディングス	18,800	1,112.00	20,905,600	
住石ホールディングス	32,900	131.00	4,309,900	
日鉄鉱業	3,500	4,870.00	17,045,000	
三井松島ホールディングス	6,400	1,852.00	11,852,800	
国際石油開発帝石	618,400	1,352.00	836,076,800	
石油資源開発	20,200	2,499.00	50,479,800	
K&Oエナジーグループ	7,500	1,620.00	12,150,000	
ダイセキ環境ソリューション	2,900	904.00	2,621,600	
第一カッター興業	1,700	2,137.00	3,632,900	
安藤・間	103,800	816.00	84,700,800	
東急建設	49,000	1,047.00	51,303,000	
コムシスホールディングス	48,947	3,160.00	154,672,520	
ミサワホーム	10,600	899.00	9,529,400	
ビーアールホールディングス	12,600	434.00	5,468,400	
高松コンストラクショングループ	8,200	2,980.00	24,436,000	
東建コーポレーション	4,800	7,280.00	34,944,000	
ソネック	1,600	757.00	1,211,200	
ヤマウラ	5,900	872.00	5,144,800	
大成建設	126,600	4,960.00	627,936,000	
大林組	381,300	1,036.00	395,026,800	
清水建設	389,000	986.00	383,554,000	
飛島建設	11,500	1,772.00	20,378,000	
長谷工コーポレーション	148,400	1,426.00	211,618,400	
松井建設	14,000	841.00	11,774,000	
銭高組	1,800	5,030.00	9,054,000	
鹿島建設	279,400	1,549.00	432,790,600	

不動テトラ	9,500	1,919.00	18,230,500
大末建設	4,100	1,194.00	4,895,400
鉄建建設	7,700	2,807.00	21,613,900
西松建設	29,400	2,773.00	81,526,200
三井住友建設	91,700	730.00	66,941,000
大豊建設	9,200	3,025.00	27,830,000
前田建設工業	90,700	1,436.00	130,245,200
佐田建設	8,200	419.00	3,435,800
ナカノフドー建設	9,700	640.00	6,208,000
奥村組	20,900	3,450.00	72,105,000
東鉄工業	15,300	2,803.00	42,885,900
イチケン	2,300	2,124.00	4,885,200
富士ビー・エス	3,400	550.00	1,870,000
浅沼組	4,500	3,290.00	14,805,000
戸田建設	147,800	789.00	116,614,200
熊谷組	20,000	3,020.00	60,400,000
青木あすなろ建設	8,400	906.00	7,610,400
北野建設	2,600	3,785.00	9,841,000
植木組	1,600	2,623.00	4,196,800
矢作建設工業	17,200	807.00	13,880,400
ピーエス三菱	15,100	562.00	8,486,200
日本ハウスホールディングス	24,300	612.00	14,871,600
大東建託	45,300	14,540.00	658,662,000
新日本建設	15,100	1,093.00	16,504,300
N I P P O	29,500	1,915.00	56,492,500
東亜道路工業	2,500	3,585.00	8,962,500
前田道路	39,800	2,170.00	86,366,000
日本道路	3,400	6,440.00	21,896,000
東亜建設工業	10,300	2,309.00	23,782,700
若築建設	6,800	1,528.00	10,390,400
東洋建設	39,900	458.00	18,274,200
五洋建設	151,200	712.00	107,654,400
世紀東急工業	17,100	670.00	11,457,000
福田組	4,100	5,130.00	21,033,000
日本ドライケミカル	2,900	1,252.00	3,630,800
住友林業	81,300	1,862.00	151,380,600
日本基礎技術	14,100	376.00	5,301,600
巴コーポレーション	15,800	460.00	7,268,000
大和ハウス工業	375,700	3,363.00	1,263,479,100
ライト工業	24,400	1,488.00	36,307,200
積水ハウス	413,800	1,660.00	686,908,000
日特建設	10,800	723.00	7,808,400
北陸電気工事	7,000	997.00	6,979,000
ユアテック	17,800	890.00	15,842,000
四電工	1,800	2,666.00	4,798,800
中電工	16,400	2,525.00	41,410,000
関電工	50,600	1,109.00	56,115,400
きんでん	84,600	1,742.00	147,373,200
東京エネシス	14,400	1,036.00	14,918,400
トーエネック	3,500	3,060.00	10,710,000

住友電設	10,000	1,752.00	17,520,000
日本電設工業	19,500	2,243.00	43,738,500
協和エクシオ	48,438	3,195.00	154,759,410
新日本空調	9,800	1,668.00	16,346,400
日本工営	7,300	2,808.00	20,498,400
九電工	25,100	4,195.00	105,294,500
三機工業	27,000	1,143.00	30,861,000
日揮	109,500	2,392.00	261,924,000
中外炉工業	3,900	2,677.00	10,440,300
ヤマト	10,400	661.00	6,874,400
太平電業	8,600	2,831.00	24,346,600
高砂熱学工業	35,000	1,945.00	68,075,000
三晃金属工業	1,400	3,295.00	4,613,000
NEC ネットズエスアイ	12,300	2,460.00	30,258,000
朝日工業社	2,500	3,315.00	8,287,500
明星工業	23,000	841.00	19,343,000
大気社	16,100	3,525.00	56,752,500
ダイダン	8,500	2,635.00	22,397,500
日比谷総合設備	14,200	1,852.00	26,298,400
東芝プラントシステム	27,600	2,288.00	63,148,800
日本製粉	37,800	1,908.00	72,122,400
日清製粉グループ本社	139,400	2,443.00	340,554,200
日東富士製粉	800	5,170.00	4,136,000
昭和産業	10,400	2,842.00	29,556,800
鳥越製粉	10,000	1,009.00	10,090,000
中部飼料	13,900	1,431.00	19,890,900
フィード・ワン	76,500	195.00	14,917,500
東洋精糖	1,900	1,200.00	2,280,000
日本甜菜製糖	6,500	1,941.00	12,616,500
三井製糖	9,000	3,065.00	27,585,000
塩水港精糖	13,500	253.00	3,415,500
日新製糖	5,500	2,231.00	12,270,500
L I F U L L	37,700	536.00	20,207,200
ジェイエイシーリクルートメント	8,800	2,320.00	20,416,000
日本M&Aセンター	75,100	3,150.00	236,565,000
メンバーズ	3,600	1,154.00	4,154,400
中広	1,200	707.00	848,400
タケエイ	11,300	777.00	8,780,100
E・Jホールディングス	1,400	1,322.00	1,850,800
トラスト・テック	5,300	3,775.00	20,007,500
コシダカホールディングス	29,000	1,190.00	34,510,000
アルトナー	1,700	949.00	1,613,300
パソナグループ	10,300	1,467.00	15,110,100
C D S	2,700	1,387.00	3,744,900
リンクアンドモチベーション	20,000	1,265.00	25,300,000
G C A	11,000	925.00	10,175,000
エス・エム・エス	42,800	1,991.00	85,214,800
パーソルホールディングス	100,100	2,364.00	236,636,400
リニカル	7,000	1,642.00	11,494,000
クックパッド	34,100	414.00	14,117,400

エスクリ	3,800	730.00	2,774,000
アイ・ケイ・ケイ	5,300	764.00	4,049,200
森永製菓	26,800	4,310.00	115,508,000
中村屋	2,800	4,625.00	12,950,000
江崎グリコ	31,800	5,660.00	179,988,000
名糖産業	5,500	1,526.00	8,393,000
井村屋グループ	4,500	3,100.00	13,950,000
不二家	6,300	2,480.00	15,624,000
山崎製パン	93,200	2,131.00	198,609,200
第一屋製パン	1,900	1,104.00	2,097,600
モロゾフ	1,800	5,650.00	10,170,000
亀田製菓	7,100	5,000.00	35,500,000
寿スピリッツ	11,000	4,595.00	50,545,000
カルビー	51,900	3,705.00	192,289,500
森永乳業	22,800	2,968.00	67,670,400
六甲バター	8,300	2,469.00	20,492,700
ヤクルト本社	66,300	8,840.00	586,092,000
明治ホールディングス	75,400	7,550.00	569,270,000
雪印メグミルク	27,500	2,767.00	76,092,500
プリマハム	16,000	2,337.00	37,392,000
日本ハム	49,300	4,120.00	203,116,000
林兼産業	4,000	686.00	2,744,000
丸大食品	12,100	2,029.00	24,550,900
S Foods	8,000	4,590.00	36,720,000
伊藤ハム米久ホールディングス	73,300	749.00	54,901,700
学情	4,400	1,665.00	7,326,000
スタジオアリス	5,500	2,403.00	13,216,500
シミックホールディングス	6,000	2,281.00	13,686,000
システナ	35,700	1,414.00	50,479,800
N J S	2,300	1,726.00	3,969,800
デジタルアーツ	5,500	5,040.00	27,720,000
新日鉄住金ソリューションズ	16,600	3,380.00	56,108,000
総合警備保障	43,100	4,730.00	203,863,000
キューブシステム	6,400	899.00	5,753,600
いちご	160,100	390.00	62,439,000
エイジア	2,200	1,340.00	2,948,000
日本駐車場開発	135,200	170.00	22,984,000
コア	4,700	1,272.00	5,978,400
カカクコム	81,700	2,064.00	168,628,800
アイロムグループ	3,700	1,715.00	6,345,500
セントケア・ホールディング	4,600	660.00	3,036,000
サイネックス	1,600	751.00	1,201,600
ルネサンス	5,300	2,495.00	13,223,500
ディップ	15,300	2,455.00	37,561,500
S B Sホールディングス	11,200	1,481.00	16,587,200
オプトホールディング	6,700	2,803.00	18,780,100
新日本科学	13,200	545.00	7,194,000
ツクイ	25,500	1,060.00	27,030,000
キャリアデザインセンター	2,700	1,476.00	3,985,200
エムスリー	228,200	2,270.00	518,014,000

ツカダ・グローバルホールディング	6,900	615.00	4,243,500
プラス	800	654.00	523,200
アウトソーシング	56,700	1,483.00	84,086,100
ウェルネット	10,900	1,024.00	11,161,600
ワールドホールディングス	3,000	3,015.00	9,045,000
ディー・エヌ・エー	58,500	1,900.00	111,150,000
博報堂DYホールディングス	150,700	1,938.00	292,056,600
ぐるなび	17,100	926.00	15,834,600
エスアールジータカミヤ	12,900	623.00	8,036,700
ジャパンベストレスキューシステム	8,600	1,066.00	9,167,600
ファンコミュニケーションズ	29,800	656.00	19,548,800
ライク	4,300	1,555.00	6,686,500
ビジネス・ブレイクスルー	5,100	400.00	2,040,000
WDBホールディングス	5,000	3,500.00	17,500,000
ティア	5,000	851.00	4,255,000
CDG	1,000	1,598.00	1,598,000
バリューコマース	7,300	2,104.00	15,359,200
インフォマート	59,400	1,253.00	74,428,200
サッポロホールディングス	41,700	2,289.00	95,451,300
アサヒグループホールディングス	238,600	4,673.00	1,114,977,800
キリンホールディングス	515,400	2,687.50	1,385,137,500
宝ホールディングス	85,300	1,692.00	144,327,600
オエノンホールディングス	32,300	401.00	12,952,300
養命酒製造	3,400	2,383.00	8,102,200
コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールディングス	87,200	2,834.00	247,124,800
サントリー食品インターナショナル	76,200	4,465.00	340,233,000
ダイドグループホールディングス	5,800	5,660.00	32,828,000
伊藤園	37,700	5,140.00	193,778,000
キーコーヒー	11,200	2,111.00	23,643,200
ユニカフェ	3,400	1,249.00	4,246,600
ジャパンフーズ	1,600	1,398.00	2,236,800
日清オイリオグループ	13,400	3,245.00	43,483,000
不二製油グループ本社	30,900	3,420.00	105,678,000
かどや製油	1,200	6,190.00	7,428,000
J-オイルミルズ	5,900	3,785.00	22,331,500
ローソン	28,200	7,220.00	203,604,000
サンエー	8,500	4,910.00	41,735,000
カワチ薬品	8,700	2,124.00	18,478,800
エービーシー・マート	20,300	6,790.00	137,837,000
ハードオフコーポレーション	4,900	949.00	4,650,100
高千穂交易	4,300	1,008.00	4,334,400
アスクル	9,700	3,375.00	32,737,500
ゲオホールディングス	18,600	1,636.00	30,429,600
アダストリア	17,200	1,725.00	29,670,000
ジーフット	6,800	748.00	5,086,400
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	1,500	759.00	1,138,500
伊藤忠食品	2,700	5,810.00	15,687,000
くらコーポレーション	6,500	6,640.00	43,160,000
キャンドウ	5,400	1,702.00	9,190,800

エレマテック	5,300	2,579.00	13,668,700
バルグループホールディングス	5,700	2,953.00	16,832,100
JALUX	3,100	2,867.00	8,887,700
エディオン	43,400	1,231.00	53,425,400
あらた	5,600	5,030.00	28,168,000
サーラコーポレーション	22,700	655.00	14,868,500
ワッツ	3,700	870.00	3,219,000
トーメンデバイス	1,700	2,619.00	4,452,300
ハローズ	4,100	2,637.00	10,811,700
J Pホールディングス	34,100	290.00	9,889,000
あみやき亭	2,400	4,205.00	10,092,000
東京エレクトロン デバイス	4,100	1,804.00	7,396,400
ひらまつ	15,400	430.00	6,622,000
フィールズ	8,600	898.00	7,722,800
双日	661,600	397.00	262,655,200
アルフレッサ ホールディングス	124,200	2,924.00	363,160,800
大黒天物産	2,700	4,400.00	11,880,000
ハニーズホールディングス	10,800	932.00	10,065,600
ファーマライズホールディングス	2,500	603.00	1,507,500
キッコーマン	82,000	6,480.00	531,360,000
味の素	262,000	1,866.50	489,023,000
キューピー	63,500	2,610.00	165,735,000
ハウス食品グループ本社	43,400	3,305.00	143,437,000
カゴメ	45,700	3,060.00	139,842,000
焼津水産化学工業	5,500	1,071.00	5,890,500
アリアケジャパン	10,400	10,440.00	108,576,000
ピエトロ	1,500	1,639.00	2,458,500
エバラ食品工業	2,400	2,170.00	5,208,000
ニチレイ	54,200	2,862.00	155,120,400
横浜冷凍	29,200	886.00	25,871,200
東洋水産	62,500	4,280.00	267,500,000
イトアアンド	3,600	1,629.00	5,864,400
大冷	1,300	1,939.00	2,520,700
ヨシムラ・フード・ホールディングス	2,300	871.00	2,003,300
日清食品ホールディングス	44,700	7,500.00	335,250,000
永谷園ホールディングス	5,800	2,955.00	17,139,000
一正蒲鉾	4,500	993.00	4,468,500
フジッコ	12,400	2,283.00	28,309,200
ロック・フィールド	12,300	1,772.00	21,795,600
日本たばこ産業	657,800	2,890.00	1,901,042,000
ケンコーマヨネーズ	7,600	2,585.00	19,646,000
わらべや日洋ホールディングス	7,500	1,869.00	14,017,500
なとり	6,300	1,796.00	11,314,800
イフジ産業	1,900	769.00	1,461,100
ピクルスコーポレーション	2,200	2,297.00	5,053,400
北の達人コーポレーション	34,800	635.00	22,098,000
ユーグレナ	45,400	737.00	33,459,800
片倉工業	13,600	1,304.00	17,734,400
グンゼ	8,900	5,230.00	46,547,000
ヒューリック	233,700	1,008.00	235,569,600

神栄	1,600	1,173.00	1,876,800
ラサ商事	4,900	949.00	4,650,100
アルペン	8,600	1,959.00	16,847,400
ハブ	2,800	900.00	2,520,000
ラクーン	6,600	569.00	3,755,400
クオールホールディングス	12,400	2,385.00	29,574,000
アルコニックス	11,900	1,416.00	16,850,400
神戸物産	8,500	6,240.00	53,040,000
ソリトンシステムズ	6,200	925.00	5,735,000
ジーンズ	7,600	6,130.00	46,588,000
ビックカメラ	59,700	1,486.00	88,714,200
D C Mホールディングス	60,300	1,070.00	64,521,000
ペッパーフードサービス	8,800	3,710.00	32,648,000
M o n o t a R O	70,700	2,926.00	206,868,200
東京一番フーズ	2,300	642.00	1,476,600
D Dホールディングス	2,400	2,510.00	6,024,000
あい ホールディングス	17,900	2,356.00	42,172,400
ディーブイエックス	4,000	1,414.00	5,656,000
きちり	3,000	794.00	2,382,000
アークランドサービスホールディングス	8,200	2,180.00	17,876,000
J . フロント リテイリング	133,500	1,588.00	211,998,000
ドトール・日レスホールディングス	19,700	1,999.00	39,380,300
マツモトキヨシホールディングス	46,200	4,235.00	195,657,000
ブロンコビリー	5,800	3,350.00	19,430,000
Z O Z O	109,800	2,980.00	327,204,000
トレジャー・ファクトリー	3,300	725.00	2,392,500
物語コーポレーション	3,200	10,000.00	32,000,000
ココカラファイン	11,700	6,780.00	79,326,000
三越伊勢丹ホールディングス	209,100	1,288.00	269,320,800
東洋紡	43,900	1,773.00	77,834,700
ユニチカ	34,600	630.00	21,798,000
富士紡ホールディングス	6,600	3,400.00	22,440,000
日清紡ホールディングス	73,800	1,300.00	95,940,000
倉敷紡績	12,000	2,696.00	32,352,000
ダイワボウホールディングス	9,500	6,860.00	65,170,000
シキボウ	5,800	1,252.00	7,261,600
日東紡績	16,800	2,504.00	42,067,200
トヨタ紡織	33,100	1,979.00	65,504,900
マクニカ・富士エレホールディングス	21,400	1,798.00	38,477,200
H a m e e	2,800	1,640.00	4,592,000
ラクト・ジャパン	2,400	6,930.00	16,632,000
ウエルシアホールディングス	29,600	5,940.00	175,824,000
クリエイトSDホールディングス	16,500	2,859.00	47,173,500
バイタルケーエスケー・ホールディングス	21,000	1,229.00	25,809,000
八洲電機	8,700	876.00	7,621,200
メディアスホールディングス	6,100	866.00	5,282,600
U K Cホールディングス	7,200	2,414.00	17,380,800
ジュテックホールディングス	2,500	1,066.00	2,665,000

丸善CHIホールディングス	13,000	353.00	4,589,000
大光	2,800	708.00	1,982,400
OCHIホールディングス	3,200	1,332.00	4,262,400
TOKAIホールディングス	59,100	1,037.00	61,286,700
黒谷	1,800	499.00	898,200
ミサワ	1,800	464.00	835,200
ティーライフ	1,500	1,059.00	1,588,500
Cominix	1,700	870.00	1,479,000
エー・ピーカンパニー	2,100	587.00	1,232,700
三洋貿易	5,600	1,929.00	10,802,400
チムニー	3,400	2,845.00	9,673,000
シュッピン	6,700	1,279.00	8,569,300
ビューティガレージ	1,600	2,103.00	3,364,800
ウイン・パートナーズ	8,100	1,183.00	9,582,300
ネクステージ	17,100	861.00	14,723,100
ジョイフル本田	32,700	1,666.00	54,478,200
鳥貴族	3,700	2,114.00	7,821,800
キリン堂ホールディングス	4,000	1,560.00	6,240,000
ホットランド	5,800	1,312.00	7,609,600
すかいらくホールディングス	104,200	1,701.00	177,244,200
綿半ホールディングス	4,200	2,642.00	11,096,400
日本毛織	36,600	894.00	32,720,400
ダイトウボウ	18,300	95.00	1,738,500
トーア紡コーポレーション	4,700	548.00	2,575,600
ダイドーリミテッド	13,100	372.00	4,873,200
ヨシックス	1,800	2,774.00	4,993,200
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	37,100	1,334.00	49,491,400
三栄建築設計	4,500	1,657.00	7,456,500
スター・マイカ	5,200	1,592.00	8,278,400
野村不動産ホールディングス	74,500	2,162.00	161,069,000
三重交通グループホールディングス	22,700	527.00	11,962,900
サムティ	15,500	1,618.00	25,079,000
ディア・ライフ	13,400	501.00	6,713,400
コーセーアールイー	2,500	852.00	2,130,000
エー・ディー・ワークス	149,400	37.00	5,527,800
日本商業開発	6,300	1,732.00	10,911,600
プレサンスコーポレーション	15,500	1,299.00	20,134,500
ユニゾホールディングス	15,400	2,049.00	31,554,600
THEグローバル社	5,300	789.00	4,181,700
日本管理センター	7,400	1,227.00	9,079,800
サンセイランディック	2,900	1,167.00	3,384,300
エストラスト	1,600	812.00	1,299,200
フージャースホールディングス	27,200	662.00	18,006,400
オープンハウス	18,200	4,955.00	90,181,000
東急不動産ホールディングス	271,000	660.00	178,860,000
飯田グループホールディングス	93,400	1,961.00	183,157,400
イーランド	1,800	771.00	1,387,800
ムゲンエステート	7,700	658.00	5,066,600
帝国繊維	12,500	2,615.00	32,687,500

日本コークス工業	95,800	110.00	10,538,000
ゴルフダイジェスト・オンライン	4,500	956.00	4,302,000
ミタチ産業	2,800	820.00	2,296,000
BEENOS	2,600	1,785.00	4,641,000
あさひ	8,300	1,416.00	11,752,800
日本調剤	4,000	3,550.00	14,200,000
コスモス薬品	5,600	24,150.00	135,240,000
シップヘルスケアホールディングス	23,300	4,165.00	97,044,500
トーエル	5,400	955.00	5,157,000
一六堂	2,400	373.00	895,200
ソフトクリエイイトホールディングス	5,400	1,690.00	9,126,000
オンリー	1,800	861.00	1,549,800
セブン&アイ・ホールディングス	468,600	4,940.00	2,314,884,000
薬王堂	4,900	3,755.00	18,399,500
クリエイイト・レストランツ・ホールディングス	30,100	1,255.00	37,775,500
明治電機工業	3,800	1,903.00	7,231,400
ツルハホールディングス	24,200	12,880.00	311,696,000
デリカフーズホールディングス	2,100	1,539.00	3,231,900
スターティアホールディングス	2,500	615.00	1,537,500
サンマルクホールディングス	8,000	2,598.00	20,784,000
フェリシモ	2,800	1,323.00	3,704,400
トリドールホールディングス	13,800	2,008.00	27,710,400
帝人	97,600	2,065.00	201,544,000
東レ	862,500	814.60	702,592,500
クラレ	187,600	1,541.00	289,091,600
旭化成	741,500	1,545.50	1,145,988,250
サカイオーベックス	2,900	2,212.00	6,414,800
TOKYO BASE	9,900	556.00	5,504,400
稲葉製作所	6,300	1,381.00	8,700,300
宮地エンジニアリンググループ	3,200	2,716.00	8,691,200
トーカロ	31,200	971.00	30,295,200
アルファ	4,000	1,404.00	5,616,000
SUMCO	124,000	1,482.00	183,768,000
川田テクノロジーズ	2,200	6,580.00	14,476,000
RS Technologies	2,200	4,620.00	10,164,000
ビーロッド	1,800	1,232.00	2,217,600
ファーストブラザーズ	3,000	1,239.00	3,717,000
ハウスドゥ	4,100	1,996.00	8,183,600
シーアールイー	3,700	901.00	3,333,700
プロパティエージェント	900	1,028.00	925,200
ケイアイスター不動産	4,000	2,161.00	8,644,000
アグレ都市デザイン	1,200	802.00	962,400
グッドコムアセット	1,900	1,849.00	3,513,100
ジェイ・エス・ビー	400	4,920.00	1,968,000
住江織物	3,000	3,115.00	9,345,000
日本フェルト	6,200	499.00	3,093,800
イチカワ	1,600	1,605.00	2,568,000
エコナックホールディングス	21,200	118.00	2,501,600
日東製網	1,300	1,615.00	2,099,500

芦森工業	2,300	2,072.00	4,765,600
アツギ	7,900	1,136.00	8,974,400
ウイルプラスホールディングス	1,000	920.00	920,000
ジャパンミート	4,200	2,065.00	8,673,000
コメダホールディングス	20,800	2,302.00	47,881,600
サツドラホールディングス	1,800	2,042.00	3,675,600
ダイユー・リックホールディングス	5,300	1,091.00	5,782,300
パロックジャパンリミテッド	9,000	946.00	8,514,000
クスリのアオキホールディングス	8,900	8,430.00	75,027,000
ダイニック	4,500	912.00	4,104,000
共和レザー	6,900	926.00	6,389,400
力の源ホールディングス	2,400	1,018.00	2,443,200
スシローグローバルホールディングス	12,300	5,830.00	71,709,000
L I X I L ビバ	14,200	1,696.00	24,083,200
セーレン	27,400	1,768.00	48,443,200
ソトー	4,300	997.00	4,287,100
東海染工	1,700	1,311.00	2,228,700
小松マテーレ	18,200	971.00	17,672,200
ワコールホールディングス	32,400	3,120.00	101,088,000
ホギメディカル	15,000	3,785.00	56,775,000
レナウン	32,400	119.00	3,855,600
クラウディアホールディングス	2,700	512.00	1,382,400
T S Iホールディングス	41,000	754.00	30,914,000
マツオカコーポレーション	2,800	3,195.00	8,946,000
T I S	37,100	5,080.00	188,468,000
ネオス	3,300	934.00	3,082,200
電算システム	4,300	2,133.00	9,171,900
グリー	59,800	491.00	29,361,800
コーエーテクモホールディングス	22,800	1,856.00	42,316,800
三菱総合研究所	4,400	4,095.00	18,018,000
ボルテージ	2,200	736.00	1,619,200
電算	1,200	2,201.00	2,641,200
A G S	6,200	753.00	4,668,600
ファインデックス	9,300	743.00	6,909,900
ヒト・コミュニケーションズ	2,500	1,720.00	4,300,000
ブレインパッド	2,300	6,250.00	14,375,000
K L a b	19,900	998.00	19,860,200
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	8,100	2,582.00	20,914,200
イーブックイニシアティブジャパン	1,800	2,207.00	3,972,600
ネクソン	282,900	1,352.00	382,480,800
アイスタイル	28,300	1,066.00	30,167,800
エムアップ	3,700	2,542.00	9,405,400
エイチーム	6,900	1,748.00	12,061,200
テクノスジャパン	10,000	953.00	9,530,000
e n i s h	3,800	634.00	2,409,200
コロブラ	31,800	693.00	22,037,400
オルトプラス	6,600	492.00	3,247,200
ブロードリーフ	55,200	703.00	38,805,600
クロス・マーケティンググループ	3,100	493.00	1,528,300

デジタルハーツホールディングス	5,900	1,574.00	9,286,600
メディアドゥホールディングス	3,600	2,171.00	7,815,600
じげん	11,800	744.00	8,779,200
ブイキューブ	5,900	556.00	3,280,400
サイバーリンクス	1,700	1,073.00	1,824,100
ディー・エル・イー	7,300	316.00	2,306,800
フィックスターズ	10,600	1,388.00	14,712,800
VOYAGE GROUP	5,800	1,365.00	7,917,000
オプティム	1,900	4,120.00	7,828,000
セレス	3,600	1,895.00	6,822,000
特種東海製紙	6,500	4,590.00	29,835,000
ベリサーブ	1,500	4,615.00	6,922,500
ティーガイア	11,100	2,773.00	30,780,300
セック	1,500	4,870.00	7,305,000
日本アジアグループ	11,800	404.00	4,767,200
豆蔵ホールディングス	8,300	874.00	7,254,200
テクマトリックス	5,500	2,130.00	11,715,000
プロシップ	1,600	2,660.00	4,256,000
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	268,400	213.00	57,169,200
GMOペイメントゲートウェイ	18,300	6,250.00	114,375,000
ザッパラス	5,400	387.00	2,089,800
システムリサーチ	1,500	5,080.00	7,620,000
インターネットイニシアティブ	18,100	2,175.00	39,367,500
さくらインターネット	13,200	671.00	8,857,200
ヴィンクス	3,100	1,440.00	4,464,000
GMOクラウド	2,400	3,560.00	8,544,000
SRAホールディングス	5,900	3,265.00	19,263,500
MINORIソリューションズ	2,100	1,377.00	2,891,700
システムインテグレータ	1,600	2,551.00	4,081,600
朝日ネット	10,100	502.00	5,070,200
eBASE	2,900	1,711.00	4,961,900
アバント	3,000	1,475.00	4,425,000
アドソル日進	4,300	2,048.00	8,806,400
フリービット	7,400	933.00	6,904,200
コムチュア	5,600	3,970.00	22,232,000
サイバーコム	1,900	1,830.00	3,477,000
アステリア	5,500	1,013.00	5,571,500
王子ホールディングス	500,400	794.00	397,317,600
日本製紙	53,300	2,034.00	108,412,200
三菱製紙	16,900	623.00	10,528,700
北越コーポレーション	66,400	579.00	38,445,600
中越バルブ工業	4,800	1,552.00	7,449,600
巴川製紙所	3,500	1,351.00	4,728,500
大王製紙	47,400	1,532.00	72,616,800
阿波製紙	2,800	599.00	1,677,200
マークライنز	3,800	1,693.00	6,433,400
メディカル・データ・ビジョン	9,800	1,799.00	17,630,200
gumi	12,900	632.00	8,152,800
ショーケース・ティービー	2,300	941.00	2,164,300

モバイルファクトリー	3,100	1,671.00	5,180,100
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	4,900	1,500.00	7,350,000
P C Iホールディングス	1,900	2,812.00	5,342,800
パイブドHD	1,800	1,076.00	1,936,800
アイビーシー	1,800	1,426.00	2,566,800
ネオジャパン	2,600	951.00	2,472,600
P R T I M E S	700	2,475.00	1,732,500
ランドコンピュータ	1,100	1,102.00	1,212,200
オープンドア	4,400	2,779.00	12,227,600
マイネット	3,500	1,108.00	3,878,000
アカツキ	2,900	4,520.00	13,108,000
ベネフィットジャパン	600	839.00	503,400
U b i c o mホールディングス	1,600	1,063.00	1,700,800
L I N E	33,900	3,920.00	132,888,000
カナミックネットワーク	1,700	1,917.00	3,258,900
ノムラシステムコーポレーション	900	1,046.00	941,400
レンゴー	114,600	958.00	109,786,800
トーモク	6,800	2,016.00	13,708,800
ザ・バック	8,400	3,515.00	29,526,000
シンクロ・フード	3,800	779.00	2,960,200
オークネット	5,800	1,226.00	7,110,800
A O I T Y O H O L D I N G S	12,100	1,361.00	16,468,100
マクロミル	14,000	2,341.00	32,774,000
ビーグリー	2,100	1,375.00	2,887,500
オロ	1,100	5,770.00	6,347,000
昭和電工	73,900	5,430.00	401,277,000
住友化学	875,200	598.00	523,369,600
住友精化	5,000	5,990.00	29,950,000
日産化学	68,200	5,880.00	401,016,000
ラサ工業	4,200	2,002.00	8,408,400
クレハ	10,200	8,180.00	83,436,000
多木化学	1,600	9,230.00	14,768,000
テイカ	9,100	2,514.00	22,877,400
石原産業	21,300	1,517.00	32,312,100
片倉コープアグリ	2,800	1,166.00	3,264,800
日東エフシー	6,900	755.00	5,209,500
日本曹達	16,600	3,225.00	53,535,000
東ソー	171,800	1,572.00	270,069,600
トクヤマ	34,500	2,815.00	97,117,500
セントラル硝子	24,200	2,766.00	66,937,200
東亜合成	69,800	1,146.00	79,990,800
大阪ソーダ	11,800	2,798.00	33,016,400
関東電化工業	28,400	1,114.00	31,637,600
デンカ	43,700	3,805.00	166,278,500
イビデン	69,500	1,463.00	101,678,500
信越化学工業	195,900	8,971.00	1,757,418,900
日本カーバイド工業	3,800	1,684.00	6,399,200
堺化学工業	8,200	2,715.00	22,263,000
第一稀元素化学工業	9,100	1,209.00	11,001,900

エア・ウォーター	98,000	1,905.00	186,690,000
大陽日酸	91,600	1,680.00	153,888,000
日本化学工業	4,400	3,340.00	14,696,000
東邦アセチレン	1,700	1,472.00	2,502,400
日本パーカライジング	60,700	1,432.00	86,922,400
高压ガス工業	17,600	862.00	15,171,200
チタン工業	1,300	2,403.00	3,123,900
四国化成工業	17,100	1,456.00	24,897,600
戸田工業	2,300	2,716.00	6,246,800
ステラ ケミファ	6,000	3,740.00	22,440,000
保土谷化学工業	3,900	2,968.00	11,575,200
日本触媒	18,700	8,090.00	151,283,000
大日精化工業	9,200	3,380.00	31,096,000
カネカ	32,100	4,940.00	158,574,000
協和発酵キリン	142,200	2,006.00	285,253,200
三菱瓦斯化学	98,000	2,105.00	206,290,000
三井化学	108,100	2,633.00	284,627,300
J S R	119,600	1,891.00	226,163,600
東京応化工業	19,100	3,090.00	59,019,000
大阪有機化学工業	10,300	1,537.00	15,831,100
三菱ケミカルホールディングス	796,300	980.40	780,692,520
K Hネオケム	16,800	3,890.00	65,352,000
ダイセル	160,300	1,272.00	203,901,600
住友ベークライト	19,300	4,295.00	82,893,500
積水化学工業	243,000	1,896.00	460,728,000
日本ゼオン	100,300	1,176.00	117,952,800
アイカ工業	33,400	4,270.00	142,618,000
宇部興産	59,900	2,712.00	162,448,800
積水樹脂	18,300	2,097.00	38,375,100
タキロンシーアイ	24,000	574.00	13,776,000
旭有機材	7,000	2,454.00	17,178,000
日立化成	58,700	1,942.00	113,995,400
ニチバン	5,800	2,402.00	13,931,600
リケンテクノス	25,600	541.00	13,849,600
大倉工業	5,600	2,029.00	11,362,400
積水化成品工業	14,900	946.00	14,095,400
群栄化学工業	2,700	3,100.00	8,370,000
タイガースポリマー	5,800	717.00	4,158,600
ミライアル	3,900	1,000.00	3,900,000
ダイキアクシス	3,900	1,270.00	4,953,000
ダイキョーニシカワ	23,500	1,133.00	26,625,500
竹本容器	1,900	2,877.00	5,466,300
森六ホールディングス	5,900	2,883.00	17,009,700
日本化薬	77,200	1,296.00	100,051,200
カーリットホールディングス	11,000	848.00	9,328,000
E P Sホールディングス	16,400	2,271.00	37,244,400
ソルクシーズ	4,800	902.00	4,329,600
レグス	2,700	1,194.00	3,223,800
プレステージ・インターナショナル	22,500	1,335.00	30,037,500
フェイス	3,900	1,230.00	4,797,000

ハイマックス	1,500	1,869.00	2,803,500
アミューズ	7,200	3,020.00	21,744,000
野村総合研究所	70,800	5,340.00	378,072,000
ドリームインキュベータ	3,600	1,923.00	6,922,800
サイバネットシステム	9,200	660.00	6,072,000
クイック	6,700	1,863.00	12,482,100
T A C	6,500	259.00	1,683,500
C E ホールディングス	2,800	765.00	2,142,000
ケネディクス	101,400	591.00	59,927,400
日本システム技術	1,800	2,197.00	3,954,600
電通	132,100	5,480.00	723,908,000
インテージホールディングス	13,100	956.00	12,523,600
テイクアンドギヴ・ニーズ	5,100	1,988.00	10,138,800
東邦システムサイエンス	3,700	867.00	3,207,900
びあ	3,600	5,400.00	19,440,000
イオンファンタジー	3,500	4,075.00	14,262,500
ソースネクスト	16,600	1,190.00	19,754,000
シーティーエス	10,700	751.00	8,035,700
ネクシィーズグループ	3,300	1,958.00	6,461,400
メディカルシステムネットワーク	12,900	468.00	6,037,200
日本精化	9,800	1,207.00	11,828,600
扶桑化学工業	11,300	2,323.00	26,249,900
トリケミカル研究所	2,700	4,420.00	11,934,000
F I G	9,900	320.00	3,168,000
A D E K A	51,100	1,846.00	94,330,600
日油	46,000	3,470.00	159,620,000
ミヨシ油脂	4,400	1,273.00	5,601,200
新日本理化	18,800	214.00	4,023,200
ハリマ化成グループ	9,200	930.00	8,556,000
花王	279,100	8,508.00	2,374,582,800
第一工業製薬	4,500	3,275.00	14,737,500
石原ケミカル	2,800	2,150.00	6,020,000
日華化学	3,700	1,203.00	4,451,100
ニイタカ	1,700	1,785.00	3,034,500
三洋化成工業	7,500	5,320.00	39,900,000
武田薬品工業	418,100	4,429.00	1,851,764,900
アステラス製薬	1,116,300	1,869.00	2,086,364,700
大日本住友製薬	84,100	2,547.00	214,202,700
塩野義製薬	160,000	7,267.00	1,162,720,000
田辺三菱製薬	138,500	1,789.00	247,776,500
わかもと製薬	13,600	280.00	3,808,000
あすか製薬	12,900	1,499.00	19,337,100
日本新薬	29,700	7,150.00	212,355,000
ピオフェルミン製薬	1,800	2,751.00	4,951,800
中外製薬	118,400	6,800.00	805,120,000
科研製薬	20,400	5,810.00	118,524,000
エーザイ	135,900	10,285.00	1,397,731,500
理研ビタミン	4,300	3,840.00	16,512,000
ロート製薬	62,300	3,760.00	234,248,000
小野薬品工業	268,000	3,044.00	815,792,000

久光製薬	33,500	7,270.00	243,545,000
有機合成薬品工業	7,800	261.00	2,035,800
持田製薬	7,900	8,750.00	69,125,000
参天製薬	215,200	1,716.00	369,283,200
扶桑薬品工業	3,900	2,753.00	10,736,700
日本ケミファ	1,500	4,615.00	6,922,500
ツムラ	40,600	3,705.00	150,423,000
日医工	29,900	1,582.00	47,301,800
テルモ	174,000	6,710.00	1,167,540,000
みらかホールディングス	32,300	2,850.00	92,055,000
キッセイ薬品工業	20,100	3,405.00	68,440,500
生化学工業	22,000	1,631.00	35,882,000
栄研化学	18,400	2,438.00	44,859,200
日水製薬	4,800	1,307.00	6,273,600
鳥居薬品	6,100	2,565.00	15,646,500
JCRファーマ	8,000	5,710.00	45,680,000
東和薬品	5,500	8,610.00	47,355,000
富士製薬工業	7,700	1,865.00	14,360,500
沢井製薬	22,800	6,070.00	138,396,000
ゼリア新薬工業	24,300	2,275.00	55,282,500
第一三共	324,800	4,510.00	1,464,848,000
キョーリン製薬ホールディングス	31,700	2,582.00	81,849,400
大幸薬品	6,000	1,858.00	11,148,000
ダイト	6,600	3,295.00	21,747,000
大塚ホールディングス	216,200	5,470.00	1,182,614,000
大正製薬ホールディングス	25,400	12,900.00	327,660,000
ペプチドリーム	51,900	4,205.00	218,239,500
大日本塗料	13,600	1,212.00	16,483,200
日本ペイントホールディングス	91,700	3,670.00	336,539,000
関西ペイント	124,900	1,790.00	223,571,000
神東塗料	8,800	205.00	1,804,000
中国塗料	34,100	1,025.00	34,952,500
日本特殊塗料	7,500	2,418.00	18,135,000
藤倉化成	15,000	646.00	9,690,000
太陽ホールディングス	9,200	4,315.00	39,698,000
DIC	50,300	3,565.00	179,319,500
サカタインクス	24,200	1,280.00	30,976,000
東洋インキSCホールディングス	23,500	2,695.00	63,332,500
T&K TOKA	8,000	1,084.00	8,672,000
アルプス技研	9,500	2,420.00	22,990,000
サニックス	17,200	262.00	4,506,400
ダイオーズ	2,100	1,324.00	2,780,400
日本空調サービス	11,300	787.00	8,893,100
オリエンタルランド	128,100	10,970.00	1,405,257,000
フォーカスシステムズ	6,300	937.00	5,903,100
ダスキン	29,200	2,679.00	78,226,800
パーク24	65,300	3,420.00	223,326,000
明光ネットワークジャパン	13,700	1,027.00	14,069,900
ファルコホールディングス	5,500	1,717.00	9,443,500
クレスコ	2,500	3,250.00	8,125,000

フジ・メディア・ホールディングス	115,600	2,028.00	234,436,800
秀英予備校	2,300	490.00	1,127,000
田谷	1,900	659.00	1,252,100
ラウンドワン	33,700	1,385.00	46,674,500
リゾートトラスト	45,900	1,718.00	78,856,200
オービック	35,100	10,450.00	366,795,000
ジャストシステム	18,100	2,407.00	43,566,700
TDCソフト	9,700	1,183.00	11,475,100
ヤフー	803,200	375.00	301,200,000
ビー・エム・エル	13,900	3,360.00	46,704,000
ワタベウェディング	1,800	528.00	950,400
トレンドマイクロ	59,300	6,560.00	389,008,000
りらいあコミュニケーションズ	17,100	1,357.00	23,204,700
インフォメーション・ディベロプメント	3,500	1,559.00	5,456,500
リソー教育	18,300	1,050.00	19,215,000
日本オラクル	18,000	8,220.00	147,960,000
早稲田アカデミー	1,600	1,895.00	3,032,000
アルファシステムズ	3,700	2,757.00	10,200,900
フューチャー	15,100	1,647.00	24,869,700
CAC Holdings	8,400	1,036.00	8,702,400
ソフトバンク・テクノロジー	4,700	2,932.00	13,780,400
トーセ	3,000	965.00	2,895,000
ユー・エス・エス	132,500	2,015.00	266,987,500
オービックビジネスコンサルタント	5,600	9,310.00	52,136,000
伊藤忠テクノソリューションズ	50,700	2,220.00	112,554,000
アイティフォー	13,500	932.00	12,582,000
東京個別指導学院	3,800	1,466.00	5,570,800
東計電算	1,700	3,200.00	5,440,000
サイバーエージェント	66,800	5,110.00	341,348,000
楽天	505,600	806.10	407,564,160
エクスネット	1,800	1,109.00	1,996,200
クリーク・アンド・リバー社	5,500	1,093.00	6,011,500
テー・オー・ダブリュー	10,300	848.00	8,734,400
大塚商会	60,300	3,815.00	230,044,500
サイボウズ	13,000	621.00	8,073,000
ソフトブレイン	8,800	477.00	4,197,600
セントラルスポーツ	4,100	4,270.00	17,507,000
バラカ	2,800	2,070.00	5,796,000
電通国際情報サービス	6,900	3,845.00	26,530,500
デジタルガレージ	20,100	3,245.00	65,224,500
イーエムシステムズ	7,700	1,170.00	9,009,000
ウェザーニューズ	3,800	3,345.00	12,711,000
C I J	8,700	736.00	6,403,200
東洋ビジネスエンジニアリング	1,100	2,192.00	2,411,200
日本エンタープライズ	11,500	225.00	2,587,500
WOWOW	5,400	3,470.00	18,738,000
スカラ	9,000	1,017.00	9,153,000
フルキャストホールディングス	10,800	2,288.00	24,710,400
エン・ジャパン	9,200	5,130.00	47,196,000

富士フイルムホールディングス	235,800	4,821.00	1,136,791,800
コニカミノルタ	265,700	1,152.00	306,086,400
資生堂	225,600	7,317.00	1,650,715,200
ライオン	158,100	2,188.00	345,922,800
高砂香料工業	7,100	3,875.00	27,512,500
マンダム	22,100	3,395.00	75,029,500
ミルボン	14,000	4,800.00	67,200,000
ファンケル	27,600	4,730.00	130,548,000
コーセー	19,200	18,810.00	361,152,000
コタ	5,500	1,514.00	8,327,000
シーズ・ホールディングス	13,700	3,655.00	50,073,500
シーボン	1,400	2,709.00	3,792,600
ポーラ・オルビスホールディングス	48,500	3,540.00	171,690,000
ノエビアホールディングス	7,200	5,400.00	38,880,000
アジュバンコスメジャパン	2,500	964.00	2,410,000
エステー	8,100	1,994.00	16,151,400
アグロ カネショウ	4,600	2,408.00	11,076,800
コニシ	18,700	1,655.00	30,948,500
長谷川香料	13,500	2,164.00	29,214,000
星光PMC	7,600	1,000.00	7,600,000
小林製薬	31,800	7,510.00	238,818,000
荒川化学工業	10,200	1,734.00	17,686,800
メック	7,800	1,705.00	13,299,000
日本高純度化学	3,000	2,333.00	6,999,000
タカラバイオ	29,700	2,977.00	88,416,900
JCU	13,700	2,522.00	34,551,400
新田ゼラチン	7,800	805.00	6,279,000
OATアグリオ	1,600	3,150.00	5,040,000
デクセリアルズ	29,200	1,051.00	30,689,200
アース製薬	8,600	5,230.00	44,978,000
北興化学工業	11,600	595.00	6,902,000
大成ラミック	3,400	3,100.00	10,540,000
クミアイ化学工業	46,900	749.00	35,128,100
日本農薬	27,200	679.00	18,468,800
昭和シェル石油	106,200	2,464.00	261,676,800
富士興産	4,300	619.00	2,661,700
ニチレキ	14,500	1,128.00	16,356,000
ユシロ化学工業	6,300	1,434.00	9,034,200
ビービー・カストロール	4,100	1,536.00	6,297,600
富士石油	27,600	462.00	12,751,200
MORESCO	4,100	1,601.00	6,564,100
出光興産	95,300	5,970.00	568,941,000
JXTGホールディングス	1,811,500	802.00	1,452,823,000
コスモエネルギーホールディングス	32,900	4,585.00	150,846,500
横浜ゴム	65,700	2,270.00	149,139,000
東洋ゴム工業	58,200	1,876.00	109,183,200
ブリヂストン	348,900	4,216.00	1,470,962,400
住友ゴム工業	101,900	1,605.00	163,549,500
藤倉ゴム工業	9,900	541.00	5,355,900
オカモト	8,000	5,240.00	41,920,000

アキレス	8,600	2,253.00	19,375,800
フコク	5,000	929.00	4,645,000
ニッタ	11,700	4,040.00	47,268,000
クリエートメディック	3,800	1,188.00	4,514,400
住友理工	22,000	1,044.00	22,968,000
三ツ星ベルト	13,600	2,916.00	39,657,600
バンドー化学	21,600	1,251.00	27,021,600
A G C	114,500	4,385.00	502,082,500
日本板硝子	57,400	1,163.00	66,756,200
石塚硝子	1,600	2,393.00	3,828,800
有沢製作所	19,100	908.00	17,342,800
日本山村硝子	4,700	1,795.00	8,436,500
日本電気硝子	49,100	3,390.00	166,449,000
オハラ	4,500	2,720.00	12,240,000
住友大阪セメント	21,500	4,555.00	97,932,500
太平洋セメント	71,700	3,335.00	239,119,500
リソルホールディングス	1,200	4,290.00	5,148,000
日本ヒューム	11,400	954.00	10,875,600
日本コンクリート工業	24,400	320.00	7,808,000
三谷セキサン	5,900	2,684.00	15,835,600
アジアパイルホールディングス	14,600	675.00	9,855,000
東海カーボン	103,100	2,018.00	208,055,800
日本カーボン	5,500	7,480.00	41,140,000
東洋炭素	6,600	3,085.00	20,361,000
ノリタケカンパニーリミテド	6,200	6,150.00	38,130,000
T O T O	87,300	4,550.00	397,215,000
日本碍子	138,500	1,689.00	233,926,500
日本特殊陶業	95,700	2,980.00	285,186,000
ダントーホールディングス	8,800	131.00	1,152,800
M A R U W A	3,900	6,200.00	24,180,000
品川リフラクトリーズ	3,000	4,820.00	14,460,000
黒崎播磨	2,200	7,940.00	17,468,000
ヨータイ	9,100	828.00	7,534,800
イソライト工業	5,800	518.00	3,004,400
東京窯業	14,400	453.00	6,523,200
ニッカトー	5,200	1,077.00	5,600,400
フジミインコーポレーテッド	10,100	2,657.00	26,835,700
クニミネ工業	3,000	1,002.00	3,006,000
エーアンドエーマテリアル	2,400	1,119.00	2,685,600
ニチアス	31,200	2,713.00	84,645,600
新日鐵住金	502,400	2,252.50	1,131,656,000
神戸製鋼所	205,400	985.00	202,319,000
中山製鋼所	15,600	667.00	10,405,200
合同製鐵	6,000	2,104.00	12,624,000
ジェイ エフ イー ホールディングス	303,200	2,483.00	752,845,600
日新製鋼	31,000	1,593.00	49,383,000
東京製鐵	60,100	813.00	48,861,300
共英製鋼	12,700	2,088.00	26,517,600
大和工業	23,900	3,245.00	77,555,500

東京鐵鋼	4,600	1,702.00	7,829,200
大阪製鐵	7,500	2,072.00	15,540,000
淀川製鋼所	16,500	2,558.00	42,207,000
丸一鋼管	39,700	3,450.00	136,965,000
モリ工業	3,600	2,578.00	9,280,800
大同特殊鋼	19,900	5,090.00	101,291,000
日本高周波鋼業	4,200	743.00	3,120,600
日本冶金工業	92,900	296.00	27,498,400
山陽特殊製鋼	12,900	2,733.00	35,255,700
愛知製鋼	6,300	4,035.00	25,420,500
日立金属	120,900	1,288.00	155,719,200
日本金属	2,800	1,514.00	4,239,200
大平洋金属	6,900	3,900.00	26,910,000
新日本電工	67,200	271.00	18,211,200
栗本鐵工所	5,600	1,740.00	9,744,000
虹 技	1,700	1,759.00	2,990,300
日本鑄鉄管	1,200	1,492.00	1,790,400
日本製鋼所	36,600	2,504.00	91,646,400
三菱製鋼	8,300	2,009.00	16,674,700
日亜鋼業	16,400	327.00	5,362,800
日本精線	1,800	3,895.00	7,011,000
エンビプロ・ホールディングス	2,300	699.00	1,607,700
大紀アルミニウム工業所	18,500	692.00	12,802,000
日本軽金属ホールディングス	327,700	233.00	76,354,100
三井金属鉱業	30,300	3,025.00	91,657,500
東邦亜鉛	6,200	4,020.00	24,924,000
三菱マテリアル	74,200	3,265.00	242,263,000
住友金属鉱山	143,500	3,651.00	523,918,500
DOWAホールディングス	28,400	3,345.00	94,998,000
古河機械金属	18,500	1,520.00	28,120,000
エス・サイエンス	53,200	70.00	3,724,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	11,700	1,863.00	21,797,100
東邦チタニウム	20,100	1,317.00	26,471,700
UACJ	17,000	2,588.00	43,996,000
CKサンエツ	2,100	3,135.00	6,583,500
古河電気工業	37,400	3,310.00	123,794,000
住友電気工業	419,700	1,629.00	683,691,300
フジクラ	135,500	490.00	66,395,000
昭和電線ホールディングス	14,100	753.00	10,617,300
東京特殊電線	1,500	2,042.00	3,063,000
タツタ電線	22,300	574.00	12,800,200
カナレ電気	1,800	2,049.00	3,688,200
平河ヒューテック	5,500	1,715.00	9,432,500
リョービ	13,800	3,710.00	51,198,000
アーレスティ	13,700	798.00	10,932,600
アサヒホールディングス	19,200	1,985.00	38,112,000
東洋製罐グループホールディングス	71,500	2,332.00	166,738,000
ホッカンホールディングス	5,600	2,110.00	11,816,000
コロナ	6,200	1,195.00	7,409,000
横河ブリッジホールディングス	20,800	2,081.00	43,284,800

OSJBホールディングス	56,100	294.00	16,493,400
駒井ハルテック	2,400	2,256.00	5,414,400
高田機工	1,100	2,760.00	3,036,000
三和ホールディングス	107,700	1,283.00	138,179,100
文化シャッター	33,100	835.00	27,638,500
三協立山	15,600	1,410.00	21,996,000
アルインコ	8,100	1,017.00	8,237,700
東洋シャッター	2,800	657.00	1,839,600
LIXILグループ	165,500	2,051.00	339,440,500
日本フィルコン	8,600	595.00	5,117,000
ノーリツ	25,100	1,651.00	41,440,100
長府製作所	11,400	2,443.00	27,850,200
リンナイ	20,100	8,210.00	165,021,000
ユニプレス	21,900	2,148.00	47,041,200
ダイニチ工業	6,000	769.00	4,614,000
日東精工	15,500	650.00	10,075,000
三洋工業	1,400	2,100.00	2,940,000
岡部	22,800	1,036.00	23,620,800
ジーテクト	12,400	1,643.00	20,373,200
中国工業	1,700	606.00	1,030,200
東プレ	20,900	2,532.00	52,918,800
高周波熱錬	21,600	1,107.00	23,911,200
東京製綱	8,000	1,327.00	10,616,000
サンコール	6,300	792.00	4,989,600
モリテックスチール	8,800	506.00	4,452,800
パイオラックス	16,600	2,525.00	41,915,000
エイチワン	11,000	1,290.00	14,190,000
日本発条	111,900	1,107.00	123,873,300
中央発條	1,300	3,675.00	4,777,500
アドバネクス	1,800	1,845.00	3,321,000
三浦工業	48,600	3,270.00	158,922,000
タクマ	38,100	1,496.00	56,997,600
テクノプロ・ホールディングス	20,400	6,440.00	131,376,000
アトラ	2,100	687.00	1,442,700
インターワークス	2,400	855.00	2,052,000
KeepPer 技研	3,500	1,098.00	3,843,000
ファーストロジック	2,000	947.00	1,894,000
三機サービス	1,700	2,283.00	3,881,100
Gunosy	6,600	1,970.00	13,002,000
デザインワン・ジャパン	2,100	767.00	1,610,700
イー・ガーディアン	5,200	2,551.00	13,265,200
リブセンス	5,900	338.00	1,994,200
ジャパンマテリアル	29,600	1,381.00	40,877,600
ベクトル	13,000	2,157.00	28,041,000
ウチヤマホールディングス	5,400	492.00	2,656,800
ライクキッズネクスト	2,200	1,200.00	2,640,000
キャリアリンク	3,600	460.00	1,656,000
IBJ	7,300	712.00	5,197,600
アサンテ	3,900	2,268.00	8,845,200
N・フィールド	7,000	1,727.00	12,089,000

バリューHR	2,200	2,246.00	4,941,200
M&Aキャピタルパートナーズ	2,700	5,960.00	16,092,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	4,500	1,417.00	6,376,500
ERIホールディングス	3,000	1,001.00	3,003,000
アビスト	1,700	3,925.00	6,672,500
シグマクシス	5,700	1,115.00	6,355,500
ウィルグループ	4,700	964.00	4,530,800
エスクロー・エージェント・ジャパン	14,900	469.00	6,988,100
日本ビューホテル	3,400	1,401.00	4,763,400
リクルートホールディングス	836,800	3,440.00	2,878,592,000
エラン	3,700	3,180.00	11,766,000
ツガミ	30,200	972.00	29,354,400
オークマ	13,000	5,870.00	76,310,000
東芝機械	12,700	2,210.00	28,067,000
アマダホールディングス	173,300	1,090.00	188,897,000
アイダエンジニアリング	28,500	947.00	26,989,500
滝澤鉄工所	3,500	1,629.00	5,701,500
FUJ I	33,600	1,637.00	55,003,200
牧野フライス製作所	11,500	4,340.00	49,910,000
オーエスジー	55,200	2,335.00	128,892,000
ダイジェット工業	1,400	1,881.00	2,633,400
旭ダイヤモンド工業	33,400	739.00	24,682,600
DMG森精機	71,000	1,698.00	120,558,000
ソディック	24,500	868.00	21,266,000
ディスコ	15,200	16,810.00	255,512,000
日東工器	6,900	2,582.00	17,815,800
日進工具	3,000	2,895.00	8,685,000
パンチ工業	9,300	699.00	6,500,700
富士ダイス	5,600	835.00	4,676,000
土木管理総合試験所	4,700	592.00	2,782,400
日本郵政	615,500	1,363.00	838,926,500
ベルシステム24ホールディングス	18,200	1,616.00	29,411,200
鎌倉新書	7,900	1,300.00	10,270,000
一蔵	1,400	802.00	1,122,800
LITALICO	2,400	2,079.00	4,989,600
グローバルグループ	1,300	1,690.00	2,197,000
エボラブルアジア	3,100	2,341.00	7,257,100
アトラエ	2,000	2,217.00	4,434,000
ストライク	2,700	3,105.00	8,383,500
ソラスト	19,800	1,343.00	26,591,400
セラク	2,400	665.00	1,596,000
インソース	3,600	2,235.00	8,046,000
豊田自動織機	91,900	5,900.00	542,210,000
豊和工業	6,200	857.00	5,313,400
OKK	4,300	1,084.00	4,661,200
石川製作所	2,900	1,458.00	4,228,200
東洋機械金属	8,800	689.00	6,063,200
津田駒工業	2,400	2,018.00	4,843,200
エンシュウ	2,900	1,425.00	4,132,500

島精機製作所	14,200	4,500.00	63,900,000
オプトラン	10,900	2,510.00	27,359,000
NCホールディングス	3,500	662.00	2,317,000
フリュー	8,000	921.00	7,368,000
ヤマシンフィルタ	17,000	749.00	12,733,000
日阪製作所	16,200	1,084.00	17,560,800
やまびこ	21,800	1,294.00	28,209,200
平田機工	4,200	7,640.00	32,088,000
ベガサスミシン製造	10,500	927.00	9,733,500
ナプテスコ	61,700	2,626.00	162,024,200
三井海洋開発	12,000	3,430.00	41,160,000
レオン自動機	10,000	1,972.00	19,720,000
S M C	35,600	31,890.00	1,135,284,000
新川	9,200	527.00	4,848,400
ホソカワミクロン	4,000	5,620.00	22,480,000
ユニオンツール	4,900	3,955.00	19,379,500
オイレス工業	14,500	2,274.00	32,973,000
日精エー・エス・ビー機械	3,200	3,960.00	12,672,000
サトーホールディングス	14,800	3,525.00	52,170,000
技研製作所	7,700	3,375.00	25,987,500
日本エアーテック	3,500	741.00	2,593,500
カワタ	2,200	2,079.00	4,573,800
日精樹脂工業	9,400	1,082.00	10,170,800
オカダアイヨン	3,800	1,631.00	6,197,800
ワイエイシイホールディングス	3,800	767.00	2,914,600
小松製作所	548,000	3,209.00	1,758,532,000
住友重機械工業	64,900	3,760.00	244,024,000
日立建機	53,100	3,520.00	186,912,000
日工	3,100	2,545.00	7,889,500
巴工業	4,900	2,254.00	11,044,600
井関農機	11,300	1,981.00	22,385,300
T O W A	8,900	942.00	8,383,800
丸山製作所	2,400	1,711.00	4,106,400
北川鉄工所	5,500	2,791.00	15,350,500
シンニッタン	17,400	424.00	7,377,600
ローツェ	5,500	1,942.00	10,681,000
タカキタ	4,000	694.00	2,776,000
クボタ	608,900	1,846.00	1,124,029,400
荏原実業	3,300	2,035.00	6,715,500
東洋エンジニアリング	15,000	875.00	13,125,000
三菱化工機	3,900	1,808.00	7,051,200
月島機械	22,500	1,392.00	31,320,000
帝国電機製作所	7,900	1,574.00	12,434,600
東京機械製作所	4,400	404.00	1,777,600
新東工業	27,000	1,041.00	28,107,000
澁谷工業	9,900	3,780.00	37,422,000
アイチコーポレーション	19,600	613.00	12,014,800
小森コーポレーション	28,500	1,300.00	37,050,000
鶴見製作所	9,500	1,754.00	16,663,000
住友精密工業	1,800	3,720.00	6,696,000

酒井重工業	2,100	3,445.00	7,234,500
荏原製作所	50,300	3,470.00	174,541,000
石井鐵工所	1,800	1,830.00	3,294,000
西島製作所	11,600	988.00	11,460,800
北越工業	12,800	1,220.00	15,616,000
千代田化工建設	82,600	817.00	67,484,200
ダイキン工業	155,000	13,920.00	2,157,600,000
オルガノ	4,100	2,994.00	12,275,400
トーヨーカネツ	4,600	2,704.00	12,438,400
栗田工業	61,400	2,904.00	178,305,600
椿本チエイン	13,400	4,670.00	62,578,000
大同工業	4,900	1,097.00	5,375,300
日機装	36,600	1,435.00	52,521,000
木村化工機	9,400	405.00	3,807,000
新興ブランテック	24,500	1,049.00	25,700,500
アネスト岩田	19,100	1,016.00	19,405,600
ダイフク	57,700	5,000.00	288,500,000
サムコ	3,100	1,250.00	3,875,000
加藤製作所	5,400	3,500.00	18,900,000
油研工業	2,200	2,139.00	4,705,800
タダノ	54,700	1,269.00	69,414,300
フジテック	35,000	1,395.00	48,825,000
C K D	31,500	1,277.00	40,225,500
キトー	8,600	1,851.00	15,918,600
平和	35,100	2,475.00	86,872,500
理想科学工業	11,300	2,523.00	28,509,900
S A N K Y O	28,400	4,280.00	121,552,000
日本金銭機械	10,400	1,170.00	12,168,000
マースグループホールディングス	7,200	2,282.00	16,430,400
福島工業	7,000	5,350.00	37,450,000
オーイズミ	4,700	478.00	2,246,600
ダイコク電機	5,200	1,715.00	8,918,000
竹内製作所	19,000	2,550.00	48,450,000
アマノ	35,100	2,215.00	77,746,500
J U K I	15,800	1,275.00	20,145,000
サンデンホールディングス	13,800	1,411.00	19,471,800
蛇の目ミシン工業	10,300	642.00	6,612,600
ブラザー工業	138,600	2,120.00	293,832,000
マックス	17,400	1,557.00	27,091,800
モリタホールディングス	18,200	2,326.00	42,333,200
グローリー	33,900	2,692.00	91,258,800
新晃工業	11,500	1,696.00	19,504,000
大和冷機工業	16,400	1,159.00	19,007,600
セガサミーホールディングス	112,500	1,518.00	170,775,000
日本ピストンリング	4,100	2,189.00	8,974,900
リケン	5,300	5,710.00	30,263,000
T P R	12,800	2,797.00	35,801,600
ツバキ・ナカシマ	17,100	2,180.00	37,278,000
ホシザキ	33,200	11,180.00	371,176,000
大豊工業	9,200	1,165.00	10,718,000

日本精工	233,200	1,210.00	282,172,000
NTN	262,700	440.00	115,588,000
ジェイテクト	121,000	1,581.00	191,301,000
不二越	10,500	4,910.00	51,555,000
ミネベアミツミ	210,700	1,765.00	371,885,500
日本トムソン	36,200	652.00	23,602,400
THK	70,800	2,517.00	178,203,600
ユーシン精機	10,000	1,112.00	11,120,000
前澤給装工業	4,500	1,885.00	8,482,500
イーグル工業	14,000	1,360.00	19,040,000
前澤工業	8,300	441.00	3,660,300
日本ピラー工業	11,500	1,449.00	16,663,500
キッツ	46,000	884.00	40,664,000
日立製作所	545,000	3,505.00	1,910,225,000
三菱電機	1,135,100	1,420.00	1,611,842,000
富士電機	68,300	4,015.00	274,224,500
東洋電機製造	4,500	1,644.00	7,398,000
安川電機	131,600	3,020.00	397,432,000
シンフォニアテクノロジー	14,600	1,442.00	21,053,200
明電舎	19,300	1,698.00	32,771,400
オリジン電気	3,300	1,632.00	5,385,600
山洋電気	5,500	4,540.00	24,970,000
デンヨー	10,500	1,735.00	18,217,500
アイモバイル	2,200	725.00	1,595,000
キャリアインデックス	2,900	1,510.00	4,379,000
MS-Japan	4,300	1,888.00	8,118,400
船場	1,800	1,045.00	1,881,000
グレイステクノロジー	2,500	3,045.00	7,612,500
フルテック	1,200	1,105.00	1,326,000
グリーンズ	2,300	1,395.00	3,208,500
ツナグ・ソリューションズ	1,000	886.00	886,000
日総工産	3,500	2,653.00	9,285,500
キュービーネットホールディングス	5,500	2,018.00	11,099,000
三櫻工業	14,400	697.00	10,036,800
マキタ	148,000	5,060.00	748,880,000
東芝テック	16,200	3,310.00	53,622,000
芝浦メカトロニクス	1,700	3,385.00	5,754,500
マブチモーター	31,400	3,940.00	123,716,000
日本電産	136,600	14,510.00	1,982,066,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	4,800	2,048.00	9,830,400
トレックス・セミコンダクター	3,200	1,589.00	5,084,800
東光高岳	5,700	1,656.00	9,439,200
ダブル・スコープ	16,600	908.00	15,072,800
宮越ホールディングス	4,200	902.00	3,788,400
ダイヘン	12,500	2,448.00	30,600,000
田淵電機	15,700	180.00	2,826,000
ヤーマン	16,500	2,024.00	33,396,000
JVCケンウッド	93,400	292.00	27,272,800
ミマキエンジニアリング	10,100	1,123.00	11,342,300
第一精工	4,700	1,443.00	6,782,100

日新電機	26,600	879.00	23,381,400
大崎電気工業	24,300	834.00	20,266,200
オムロン	120,600	4,440.00	535,464,000
日東工業	18,200	1,894.00	34,470,800
I D E C	14,000	2,133.00	29,862,000
不二電機工業	1,300	1,354.00	1,760,200
ジーエス・ユアサ コーポレーション	40,900	2,488.00	101,759,200
サクサホールディングス	2,800	2,062.00	5,773,600
メルコホールディングス	5,500	3,960.00	21,780,000
テクノメディカ	2,600	2,051.00	5,332,600
日本電気	146,900	3,080.00	452,452,000
富士通	116,700	7,300.00	851,910,000
沖電気工業	46,100	1,399.00	64,493,900
岩崎通信機	5,000	803.00	4,015,000
電気興業	6,400	3,005.00	19,232,000
サンケン電気	13,200	2,449.00	32,326,800
ナカヨ	2,100	1,588.00	3,334,800
アイホン	6,400	1,580.00	10,112,000
ルネサスエレクトロニクス	117,500	664.00	78,020,000
セイコーエプソン	169,000	1,845.00	311,805,000
ワコム	88,000	420.00	36,960,000
アルバック	26,100	3,755.00	98,005,500
アクセル	4,800	616.00	2,956,800
E I Z O	10,400	4,655.00	48,412,000
ジャパンディスプレイ	233,100	106.00	24,708,600
日本信号	31,300	1,067.00	33,397,100
京三製作所	26,600	538.00	14,310,800
能美防災	15,000	2,402.00	36,030,000
ホーチキ	8,200	1,521.00	12,472,200
星和電機	3,900	437.00	1,704,300
エレコム	10,000	2,662.00	26,620,000
パナソニック	1,296,700	1,247.50	1,617,633,250
シャープ	112,500	2,013.00	226,462,500
アンリツ	82,800	1,730.00	143,244,000
富士通ゼネラル	34,700	1,800.00	62,460,000
ソニー	760,600	6,288.00	4,782,652,800
T D K	59,400	10,540.00	626,076,000
帝国通信工業	5,000	1,233.00	6,165,000
タムラ製作所	43,800	617.00	27,024,600
アルプス電気	97,700	2,799.00	273,462,300
池上通信機	3,600	1,244.00	4,478,400
パイオニア	189,300	110.00	20,823,000
日本電波工業	10,200	478.00	4,875,600
鈴木	5,500	732.00	4,026,000
日本トリム	2,400	5,490.00	13,176,000
ローランド ディー・ジー	5,700	2,570.00	14,649,000
フォスター電機	13,200	1,357.00	17,912,400
クラリオン	11,900	1,901.00	22,621,900
S M K	2,900	2,723.00	7,896,700
ヨコオ	7,300	1,324.00	9,665,200

ティアック	8,300	265.00	2,199,500
ホシデン	28,600	976.00	27,913,600
ヒロセ電機	18,500	10,870.00	201,095,000
日本航空電子工業	29,200	1,783.00	52,063,600
TOA	12,200	1,191.00	14,530,200
マクセルホールディングス	22,600	1,585.00	35,821,000
古野電気	13,500	1,265.00	17,077,500
ユニデンホールディングス	3,100	2,556.00	7,923,600
アルパイン	27,100	2,008.00	54,416,800
スミダコーポレーション	9,600	1,265.00	12,144,000
アイコム	6,200	2,369.00	14,687,800
リオン	4,800	2,445.00	11,736,000
本多通信工業	8,900	729.00	6,488,100
船井電機	11,500	645.00	7,417,500
横河電機	113,600	2,344.00	266,278,400
新電元工業	4,000	4,890.00	19,560,000
アズビル	68,000	2,266.00	154,088,000
東亜ディーケーケー	5,600	1,202.00	6,731,200
日本光電工業	46,900	3,585.00	168,136,500
チノー	3,900	1,494.00	5,826,600
共和電業	11,900	422.00	5,021,800
日本電子材料	4,500	768.00	3,456,000
堀場製作所	22,500	5,210.00	117,225,000
アドバンテスト	63,300	2,082.00	131,790,600
小野測器	5,300	819.00	4,340,700
エスベック	10,000	1,813.00	18,130,000
キーエンス	55,700	57,910.00	3,225,587,000
日置電機	5,900	3,195.00	18,850,500
シスメックス	88,400	8,740.00	772,616,000
日本マイクロニクス	18,300	685.00	12,535,500
メガチップス	9,000	2,049.00	18,441,000
OBARA GROUP	6,600	5,050.00	33,330,000
IMAGICA GROUP	9,400	581.00	5,461,400
澤藤電機	1,200	2,104.00	2,524,800
デンソー	251,900	5,266.00	1,326,505,400
コーセル	15,800	1,136.00	17,948,800
イリソ電子工業	9,500	5,750.00	54,625,000
オブテックスグループ	20,000	2,130.00	42,600,000
千代田インテグレ	4,800	2,244.00	10,771,200
アイ・オー・データ機器	4,700	1,314.00	6,175,800
レーザーテック	23,300	3,170.00	73,861,000
スタンレー電気	86,600	3,785.00	327,781,000
岩崎電気	4,400	1,530.00	6,732,000
ウシオ電機	68,900	1,360.00	93,704,000
岡谷電機産業	8,100	479.00	3,879,900
ヘリオス テクノ ホールディング	9,600	820.00	7,872,000
日本セラミック	11,500	2,913.00	33,499,500
遠藤照明	5,700	802.00	4,571,400
古河電池	8,100	852.00	6,901,200
双信電機	5,000	463.00	2,315,000

山一電機	8,200	1,355.00	11,111,000
図研	7,400	1,784.00	13,201,600
日本電子	20,400	2,135.00	43,554,000
カシオ計算機	91,300	1,738.00	158,679,400
ファナック	107,900	19,005.00	2,050,639,500
日本シイエムケイ	20,000	731.00	14,620,000
エンプラス	5,200	3,175.00	16,510,000
大真空	4,200	1,187.00	4,985,400
ローム	50,900	7,210.00	366,989,000
浜松ホトニクス	81,400	4,120.00	335,368,000
三井ハイテック	15,000	1,234.00	18,510,000
新光電気工業	42,800	852.00	36,465,600
京セラ	186,300	6,257.00	1,165,679,100
協栄産業	1,400	1,861.00	2,605,400
太陽誘電	55,100	2,334.00	128,603,400
村田製作所	119,100	16,020.00	1,907,982,000
ユーシン	17,000	746.00	12,682,000
双葉電子工業	18,600	1,841.00	34,242,600
日東電工	85,800	7,953.00	682,367,400
北陸電気工業	4,600	1,183.00	5,441,800
東海理化電機製作所	29,900	2,234.00	66,796,600
ニチコン	35,700	981.00	35,021,700
日本ケミコン	9,200	2,605.00	23,966,000
K O A	15,700	1,556.00	24,429,200
三井E & Sホールディングス	41,000	2,063.00	84,583,000
日立造船	90,000	440.00	39,600,000
三菱重工業	190,200	4,356.00	828,511,200
川崎重工業	88,300	3,130.00	276,379,000
I H I	87,200	4,350.00	379,320,000
名村造船所	34,100	543.00	18,516,300
サノヤスホールディングス	13,900	221.00	3,071,900
スプリックス	3,000	2,803.00	8,409,000
日本車輛製造	4,100	2,845.00	11,664,500
三菱ロジスネクスト	13,500	1,315.00	17,752,500
近畿車輛	1,700	2,337.00	3,972,900
F P G	35,800	1,040.00	37,232,000
島根銀行	2,300	1,208.00	2,778,400
じもとホールディングス	75,600	176.00	13,305,600
全国保証	31,500	4,270.00	134,505,000
めぶきフィナンシャルグループ	581,700	381.00	221,627,700
東京きらぼしフィナンシャルグループ	15,100	2,037.00	30,758,700
九州フィナンシャルグループ	183,800	531.00	97,597,800
かんぼ生命保険	42,300	2,686.00	113,617,800
ゆうちょ銀行	317,200	1,339.00	424,730,800
富山第一銀行	28,400	448.00	12,723,200
コンコルディア・フィナンシャルグループ	668,500	537.00	358,984,500
ジェイリース	2,000	636.00	1,272,000
西日本フィナンシャルホールディングス	71,800	1,255.00	90,109,000

マーキュリアインベストメント	4,300	885.00	3,805,500	
イントラスト	2,300	526.00	1,209,800	
アルヒ	12,800	1,998.00	25,574,400	
日産自動車	1,338,600	1,007.00	1,347,970,200	
いすゞ自動車	328,900	1,600.00	526,240,000	
トヨタ自動車	1,379,900	6,597.00	9,103,200,300	*
日野自動車	162,000	1,143.00	185,166,000	
三菱自動車工業	420,100	721.00	302,892,100	
エフテック	7,200	1,193.00	8,589,600	
レシップホールディングス	4,100	803.00	3,292,300	
GMB	1,800	1,265.00	2,277,000	
ファルテック	1,900	1,012.00	1,922,800	
武蔵精密工業	24,100	1,657.00	39,933,700	
日産車体	44,300	923.00	40,888,900	
新明和工業	49,400	1,449.00	71,580,600	
極東開発工業	21,100	1,705.00	35,975,500	
日信工業	23,100	1,741.00	40,217,100	
トピー工業	9,300	3,150.00	29,295,000	
ティラド	4,100	2,952.00	12,103,200	
曙ブレーキ工業	52,800	233.00	12,302,400	
タチエス	19,300	1,656.00	31,960,800	
NOK	61,000	1,722.00	105,042,000	
フタバ産業	34,800	704.00	24,499,200	
KYB	11,800	4,530.00	53,454,000	
市光工業	16,900	808.00	13,655,200	
大同メタル工業	14,600	897.00	13,096,200	
プレス工業	60,300	541.00	32,622,300	
ミクニ	14,400	680.00	9,792,000	
太平洋工業	23,800	1,777.00	42,292,600	
ケーヒン	26,100	2,231.00	58,229,100	
河西工業	13,900	1,091.00	15,164,900	
アイシン精機	93,500	4,855.00	453,942,500	
マツダ	356,200	1,286.00	458,073,200	
今仙電機製作所	10,500	1,078.00	11,319,000	
本田技研工業	1,021,400	3,085.00	3,151,019,000	
スズキ	225,000	5,881.00	1,323,225,000	
SUBARU	352,400	3,240.00	1,141,776,000	
安永	5,500	1,848.00	10,164,000	
ヤマハ発動機	160,300	2,862.00	458,778,600	
ショーワ	29,500	1,524.00	44,958,000	
小糸製作所	68,000	6,500.00	442,000,000	
TBK	13,400	476.00	6,378,400	
エクセディ	13,700	3,405.00	46,648,500	
ミツバ	20,800	937.00	19,489,600	
豊田合成	41,300	2,531.00	104,530,300	
愛三工業	20,000	863.00	17,260,000	
盟和産業	1,700	1,222.00	2,077,400	
日本プラスト	6,100	924.00	5,636,400	
ヨロズ	11,500	1,637.00	18,825,500	
エフ・シー・シー	18,600	2,927.00	54,442,200	

新家工業	2,500	1,885.00	4,712,500
シマノ	45,800	16,240.00	743,792,000
テイ・エス テック	26,400	3,415.00	90,156,000
関西みらいフィナンシャルグループ	49,000	993.00	48,657,000
三十三フィナンシャルグループ	9,400	2,226.00	20,924,400
第四北越フィナンシャルグループ	19,350	4,395.00	85,043,250
ジャムコ	5,600	2,993.00	16,760,800
小野建	9,900	1,682.00	16,651,800
はるやまホールディングス	5,300	928.00	4,918,400
ノジマ	19,800	2,266.00	44,866,800
佐島電機	8,200	1,072.00	8,790,400
カップ・クリエイト	13,900	1,348.00	18,737,200
エコトレーディング	2,400	644.00	1,545,600
伯東	6,800	1,512.00	10,281,600
コンドーテック	8,700	1,051.00	9,143,700
中山福	6,200	686.00	4,253,200
ライトオン	9,400	960.00	9,024,000
ナガイレーベン	16,200	2,584.00	41,860,800
ジーンズメイト	3,400	597.00	2,029,800
三菱食品	12,300	2,913.00	35,829,900
良品計画	14,800	33,000.00	488,400,000
三城ホールディングス	13,800	482.00	6,651,600
松田産業	8,200	1,476.00	12,103,200
第一興商	16,600	5,200.00	86,320,000
メディカルホールディングス	112,100	2,352.00	263,659,200
アドヴァン	11,400	1,072.00	12,220,800
S P K	2,300	2,358.00	5,423,400
萩原電気ホールディングス	4,100	3,020.00	12,382,000
アルビス	3,600	3,010.00	10,836,000
アズワン	8,800	8,170.00	71,896,000
スズデン	3,900	1,328.00	5,179,200
尾家産業	3,200	1,429.00	4,572,800
シモジマ	6,800	1,001.00	6,806,800
ドウシシャ	11,900	2,241.00	26,667,900
小津産業	2,400	1,978.00	4,747,200
コナカ	14,200	501.00	7,114,200
高速	6,600	1,177.00	7,768,200
ハウス オブ ローゼ	1,400	1,814.00	2,539,600
G - 7ホールディングス	3,300	2,715.00	8,959,500
たけびし	3,900	1,572.00	6,130,800
イオン北海道	11,200	815.00	9,128,000
コジマ	16,500	541.00	8,926,500
ヒマラヤ	3,500	947.00	3,314,500
コーナン商事	15,900	2,719.00	43,232,100
ネットワンシステムズ	45,500	2,349.00	106,879,500
エコス	4,500	1,900.00	8,550,000
ワタミ	13,200	1,318.00	17,397,600
マルシェ	2,900	803.00	2,328,700
リックス	2,500	1,607.00	4,017,500
システムソフト	26,600	113.00	3,005,800

ドンキホーテホールディングス	72,400	6,680.00	483,632,000
丸文	9,800	784.00	7,683,200
西松屋チェーン	24,500	1,057.00	25,896,500
ゼンショーホールディングス	58,000	2,068.00	119,944,000
ハピネット	7,600	1,711.00	13,003,600
幸楽苑ホールディングス	7,100	1,629.00	11,565,900
ハークスレイ	2,600	1,032.00	2,683,200
橋本総業ホールディングス	2,200	1,480.00	3,256,000
日本ライフライン	31,800	2,133.00	67,829,400
サイゼリヤ	18,400	1,973.00	36,303,200
タカショー	5,000	471.00	2,355,000
エクセル	4,500	1,772.00	7,974,000
V Tホールディングス	37,900	481.00	18,229,900
マルカキカイ	3,600	2,203.00	7,930,800
アルゴグラフィックス	5,200	4,570.00	23,764,000
魚力	3,100	1,449.00	4,491,900
I D O M	33,900	313.00	10,610,700
日本エム・ディ・エム	7,500	1,427.00	10,702,500
ポブラ	2,900	633.00	1,835,700
フジ・コーポレーション	2,200	2,297.00	5,053,400
ユナイテッドアローズ	13,800	4,565.00	62,997,000
進和	6,600	2,065.00	13,629,000
エスケイジャパン	2,700	583.00	1,574,100
ダイトロン	5,100	1,978.00	10,087,800
ハイデイ日高	14,700	2,242.00	32,957,400
シークス	14,200	1,679.00	23,841,800
京都きもの友禅	7,000	506.00	3,542,000
コロワイド	37,200	2,793.00	103,899,600
ピーシーデポコーポレーション	16,600	535.00	8,881,000
田中商事	3,400	656.00	2,230,400
オーハシテクニカ	6,300	1,507.00	9,494,100
壺番屋	7,900	4,615.00	36,458,500
白銅	4,000	1,861.00	7,444,000
トップカルチャー	4,000	421.00	1,684,000
P L A N T	2,500	1,226.00	3,065,000
スギホールディングス	24,500	5,470.00	134,015,000
島津製作所	135,600	3,180.00	431,208,000
J M S	10,400	612.00	6,364,800
クボテック	2,400	380.00	912,000
長野計器	9,000	1,009.00	9,081,000
ブイ・テクノロジー	2,600	14,080.00	36,608,000
スター精密	18,100	1,916.00	34,679,600
東京計器	7,200	1,064.00	7,660,800
愛知時計電機	1,500	4,370.00	6,555,000
インターアクション	6,000	1,601.00	9,606,000
オーバル	11,200	283.00	3,169,600
東京精密	20,500	2,744.00	56,252,000
マニー	13,800	4,880.00	67,344,000
ニコン	197,800	1,980.00	391,644,000
トプコン	60,900	1,930.00	117,537,000

オリンパス	169,100	4,230.00	715,293,000
理研計器	10,800	2,177.00	23,511,600
S C R E E Nホールディングス	21,500	6,110.00	131,365,000
キヤノン電子	10,400	2,183.00	22,703,200
タムロン	10,000	2,209.00	22,090,000
H O Y A	228,500	6,235.00	1,424,697,500
シード	4,800	1,782.00	8,553,600
ノーリツ鋼機	11,500	2,731.00	31,406,500
エー・アンド・デイ	10,300	879.00	9,053,700
キヤノン	611,000	3,453.00	2,109,783,000
リコー	341,200	1,204.00	410,804,800
シチズン時計	135,500	681.00	92,275,500
リズム時計工業	3,800	2,028.00	7,706,400
大研医器	10,100	822.00	8,302,200
メニコン	15,600	2,556.00	39,873,600
シンシア	1,700	625.00	1,062,500
中本ボックス	2,900	1,745.00	5,060,500
スノーピーク	4,000	1,713.00	6,852,000
パラマウントベッドホールディングス	12,000	5,100.00	61,200,000
トランザクション	6,100	700.00	4,270,000
S H O B I	3,300	389.00	1,283,700
ニホンフラッシュ	5,300	2,021.00	10,711,300
前田工織	12,500	2,262.00	28,275,000
永大産業	14,800	490.00	7,252,000
アートネイチャー	12,100	709.00	8,578,900
バンダイナムコホールディングス	117,300	4,065.00	476,824,500
アイフィスジャパン	2,500	753.00	1,882,500
共立印刷	18,800	328.00	6,166,400
S H O E I	5,500	4,395.00	24,172,500
フランスベッドホールディングス	13,100	950.00	12,445,000
マーベラス	18,900	855.00	16,159,500
パイロットコーポレーション	19,800	6,440.00	127,512,000
萩原工業	6,300	1,784.00	11,239,200
エイベックス	20,600	1,556.00	32,053,600
トッパン・フォームズ	24,300	1,030.00	25,029,000
フジシールインターナショナル	25,400	3,520.00	89,408,000
タカラトミー	47,500	1,137.00	54,007,500
廣済堂	10,500	476.00	4,998,000
エステールホールディングス	3,300	743.00	2,451,900
アーク	57,700	105.00	6,058,500
レック	13,400	2,397.00	32,119,800
タカノ	5,000	934.00	4,670,000
三光合成	8,700	405.00	3,523,500
プロネクサス	9,700	1,137.00	11,028,900
ホクシン	8,000	167.00	1,336,000
ウッドワン	3,700	1,252.00	4,632,400
大建工業	8,900	2,120.00	18,868,000
きもと	19,300	279.00	5,384,700
凸版印刷	160,100	1,743.00	279,054,300
大日本印刷	148,600	2,562.00	380,713,200

図書印刷	7,600	792.00	6,019,200
共同印刷	3,500	2,794.00	9,779,000
N I S S H A	23,300	1,999.00	46,576,700
光村印刷	1,000	2,311.00	2,311,000
藤森工業	9,500	3,510.00	33,345,000
ヴィア・ホールディングス	13,600	711.00	9,669,600
宝印刷	5,900	1,815.00	10,708,500
前澤化成工業	7,800	1,139.00	8,884,200
アシックス	112,700	1,586.00	178,742,200
ツツミ	3,500	2,128.00	7,448,000
ウェーブロックホールディングス	2,900	892.00	2,586,800
J S P	6,600	2,688.00	17,740,800
ニチハ	17,100	2,639.00	45,126,900
エフピコ	9,300	6,240.00	58,032,000
小松ウオール工業	3,800	2,054.00	7,805,200
ヤマハ	74,300	5,250.00	390,075,000
河合楽器製作所	3,800	4,575.00	17,385,000
クリナップ	10,500	734.00	7,707,000
ビジョン	68,600	5,880.00	403,368,000
天馬	8,900	1,850.00	16,465,000
兼松サステック	900	1,840.00	1,656,000
キングジム	9,400	943.00	8,864,200
象印マホービン	21,100	1,364.00	28,780,400
リンテック	27,000	2,757.00	74,439,000
信越ポリマー	23,300	834.00	19,432,200
東リ	28,200	336.00	9,475,200
イトーキ	20,900	613.00	12,811,700
任天堂	69,900	38,650.00	2,701,635,000
三菱鉛筆	18,700	1,884.00	35,230,800
松風	5,500	1,296.00	7,128,000
タカラスタANDARD	23,500	1,838.00	43,193,000
コクヨ	54,400	1,899.00	103,305,600
ナカバヤシ	11,200	614.00	6,876,800
ニフコ	41,700	2,803.00	116,885,100
立川ブラインド工業	5,000	1,149.00	5,745,000
グローブライド	5,100	2,802.00	14,290,200
オカムラ	39,600	1,473.00	58,330,800
バルカー	9,200	2,795.00	25,714,000
M U T O Hホールディングス	1,600	2,271.00	3,633,600
伊藤忠商事	820,400	2,187.50	1,794,625,000
丸紅	918,700	986.00	905,838,200
スクロール	17,200	610.00	10,492,000
高島	1,800	2,024.00	3,643,200
ヨンドシーホールディングス	11,400	2,345.00	26,733,000
三陽商会	6,700	2,175.00	14,572,500
長瀬産業	67,400	1,830.00	123,342,000
ナイガイ	4,300	503.00	2,162,900
蝶理	7,100	1,985.00	14,093,500
豊田通商	124,800	4,125.00	514,800,000
オンワードホールディングス	68,900	673.00	46,369,700

三共生興	19,000	472.00	8,968,000
兼松	47,600	1,631.00	77,635,600
美津濃	11,200	2,670.00	29,904,000
ツカモトコーポレーション	2,000	1,210.00	2,420,000
ユニー・ファミリーマートホールディングス	35,700	13,180.00	470,526,000
ルックホールディングス	4,100	1,198.00	4,911,800
三井物産	921,100	2,002.00	1,844,042,200
日本紙パルプ商事	5,800	4,375.00	25,375,000
東京エレクトロン	75,600	14,120.00	1,067,472,000
日立ハイテクノロジーズ	38,800	3,455.00	134,054,000
カメイ	14,600	1,436.00	20,965,600
東都水産	1,700	2,382.00	4,049,400
OUGホールディングス	1,800	2,735.00	4,923,000
スターゼン	4,500	4,450.00	20,025,000
セイコーホールディングス	17,500	2,942.00	51,485,000
山善	43,600	1,297.00	56,549,200
椿本興業	2,500	3,110.00	7,775,000
住友商事	705,100	1,831.50	1,291,390,650
日本ユニシス	31,000	2,695.00	83,545,000
内田洋行	5,200	2,768.00	14,393,600
三菱商事	784,500	3,475.00	2,726,137,500
第一実業	5,100	3,820.00	19,482,000
キヤノンマーケティングジャパン	31,900	2,214.00	70,626,600
西華産業	6,800	1,832.00	12,457,600
佐藤商事	9,900	1,127.00	11,157,300
菱洋エレクトロ	10,400	1,715.00	17,836,000
東京産業	11,100	731.00	8,114,100
ユアサ商事	10,600	3,885.00	41,181,000
神鋼商事	2,500	3,085.00	7,712,500
小林産業	6,700	326.00	2,184,200
阪和興業	20,900	3,570.00	74,613,000
正栄食品工業	5,800	4,190.00	24,302,000
カナデン	10,700	1,143.00	12,230,100
菱電商事	8,100	1,580.00	12,798,000
ニプロ	78,600	1,486.00	116,799,600
フルサト工業	6,100	1,712.00	10,443,200
岩谷産業	24,800	3,885.00	96,348,000
すてきナイスグループ	4,700	1,264.00	5,940,800
昭光通商	4,000	872.00	3,488,000
ニチモウ	1,700	1,608.00	2,733,600
極東貿易	3,100	2,061.00	6,389,100
イワキ	13,300	606.00	8,059,800
兼松エレクトロニクス	7,100	3,590.00	25,489,000
三愛石油	30,000	1,323.00	39,690,000
稲畑産業	26,900	1,675.00	45,057,500
G S Iクレオス	2,900	1,438.00	4,170,200
明和産業	10,300	470.00	4,841,000
キムラタン	54,600	31.00	1,692,600
ゴールドウイン	6,700	8,610.00	57,687,000

ユニ・チャーム	240,700	3,306.00	795,754,200
デサント	27,100	2,410.00	65,311,000
キング	5,800	454.00	2,633,200
ワキタ	23,900	1,335.00	31,906,500
ヤマトインターナショナル	7,300	484.00	3,533,200
東邦ホールディングス	33,100	2,887.00	95,559,700
サンゲツ	36,600	2,102.00	76,933,200
ミツウロコグループホールディングス	16,200	774.00	12,538,800
シナネンホールディングス	4,600	2,646.00	12,171,600
伊藤忠エネクス	24,700	1,116.00	27,565,200
サンリオ	31,300	2,294.00	71,802,200
サンワテクノス	7,200	1,290.00	9,288,000
リョーサン	12,400	3,675.00	45,570,000
新光商事	12,300	1,533.00	18,855,900
トーヨー	5,100	2,223.00	11,337,300
三信電気	10,300	1,929.00	19,868,700
東陽テクニカ	12,900	897.00	11,571,300
モスフードサービス	14,700	3,010.00	44,247,000
加賀電子	10,100	2,468.00	24,926,800
三益半導体工業	8,800	1,544.00	13,587,200
ソーダニッカ	11,500	644.00	7,406,000
立花エレテック	7,600	1,742.00	13,239,200
木曽路	13,700	2,718.00	37,236,600
SRSホールディングス	13,100	1,002.00	13,126,200
千趣会	20,200	406.00	8,201,200
タカキュー	8,800	202.00	1,777,600
ケーヨー	20,600	545.00	11,227,000
上新電機	13,100	2,983.00	39,077,300
日本瓦斯	20,500	4,935.00	101,167,500
ロイヤルホールディングス	19,900	2,826.00	56,237,400
東天紅	800	1,620.00	1,296,000
いなげや	12,500	1,662.00	20,775,000
島忠	25,300	3,435.00	86,905,500
チヨダ	13,200	2,188.00	28,881,600
ライフコーポレーション	8,500	2,919.00	24,811,500
リンガーハット	13,700	2,375.00	32,537,500
MrMaxHD	14,000	562.00	7,868,000
テンアライド	10,200	447.00	4,559,400
AOKIホールディングス	22,400	1,477.00	33,084,800
オークワ	15,600	1,176.00	18,345,600
コメリ	17,200	2,610.00	44,892,000
青山商事	21,500	3,440.00	73,960,000
しまむら	13,000	9,740.00	126,620,000
はせがわ	5,700	481.00	2,741,700
高島屋	87,700	1,802.00	158,035,400
松屋	22,500	1,264.00	28,440,000
エイチ・ツー・オーリテイリング	53,000	1,777.00	94,181,000
近鉄百貨店	4,300	3,690.00	15,867,000
パルコ	10,700	1,166.00	12,476,200
丸井グループ	102,400	2,520.00	258,048,000

クレディセゾン	85,000	1,771.00	150,535,000
アクシアル リテイリング	9,200	3,850.00	35,420,000
井筒屋	6,100	251.00	1,531,100
イオン	430,200	2,672.50	1,149,709,500
イズミ	20,200	6,510.00	131,502,000
フォーバル	4,900	1,002.00	4,909,800
平和堂	22,700	3,050.00	69,235,000
フジ	13,300	2,189.00	29,113,700
ヤオコー	12,700	6,540.00	83,058,000
ゼビオホールディングス	15,200	1,610.00	24,472,000
ケーズホールディングス	98,600	1,375.00	135,575,000
PALTAC	15,700	5,120.00	80,384,000
三谷産業	12,900	335.00	4,321,500
Olympicグループ	6,600	879.00	5,801,400
日産東京販売ホールディングス	16,500	347.00	5,725,500
新生銀行	91,300	1,771.00	161,692,300
あおぞら銀行	66,700	3,920.00	261,464,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	7,796,700	694.10	5,411,689,470
りそなホールディングス	1,228,500	618.20	759,458,700
三井住友トラスト・ホールディングス	220,100	4,546.00	1,000,574,600
三井住友フィナンシャルグループ	838,100	4,495.00	3,767,259,500
千葉銀行	396,500	749.00	296,978,500
群馬銀行	223,900	563.00	126,055,700
武蔵野銀行	17,900	3,085.00	55,221,500
千葉興業銀行	30,700	480.00	14,736,000
筑波銀行	46,500	268.00	12,462,000
七十七銀行	35,100	2,555.00	89,680,500
青森銀行	8,700	3,265.00	28,405,500
秋田銀行	7,200	2,862.00	20,606,400
山形銀行	12,600	2,393.00	30,151,800
岩手銀行	7,800	4,690.00	36,582,000
東邦銀行	100,100	402.00	40,240,200
東北銀行	5,700	1,352.00	7,706,400
みちのく銀行	7,200	1,784.00	12,844,800
ふくおかフィナンシャルグループ	90,900	3,070.00	279,063,000
静岡銀行	281,800	1,010.00	284,618,000
十六銀行	15,000	2,834.00	42,510,000
スルガ銀行	114,500	580.00	66,410,000
八十二銀行	202,600	516.00	104,541,600
山梨中央銀行	13,800	1,843.00	25,433,400
大垣共立銀行	17,700	2,809.00	49,719,300
福井銀行	9,500	2,214.00	21,033,000
北國銀行	12,700	4,185.00	53,149,500
清水銀行	4,500	2,087.00	9,391,500
富山銀行	2,100	4,115.00	8,641,500
滋賀銀行	21,000	2,800.00	58,800,000
南都銀行	13,000	2,761.00	35,893,000
百五銀行	107,500	437.00	46,977,500
京都銀行	42,700	5,560.00	237,412,000
紀陽銀行	42,200	1,671.00	70,516,200

ほくほくフィナンシャルグループ	74,500	1,506.00	112,197,000
広島銀行	165,200	754.00	124,560,800
山陰合同銀行	66,400	936.00	62,150,400
中国銀行	77,400	1,090.00	84,366,000
鳥取銀行	3,500	1,644.00	5,754,000
伊予銀行	159,800	671.00	107,225,800
百十四銀行	11,900	3,145.00	37,425,500
四国銀行	17,100	1,284.00	21,956,400
阿波銀行	17,900	3,170.00	56,743,000
大分銀行	6,400	3,945.00	25,248,000
宮崎銀行	7,500	3,210.00	24,075,000
佐賀銀行	6,800	2,215.00	15,062,000
十八銀行	6,900	3,550.00	24,495,000
沖縄銀行	10,900	3,950.00	43,055,000
琉球銀行	23,900	1,289.00	30,807,100
セブン銀行	420,300	335.00	140,800,500
みずほフィナンシャルグループ	15,213,000	194.20	2,954,364,600
高知銀行	4,100	1,078.00	4,419,800
山口フィナンシャルグループ	139,800	1,198.00	167,480,400
アクリーティブ	6,200	414.00	2,566,800
芙蓉総合リース	12,900	6,440.00	83,076,000
興銀リース	21,000	2,856.00	59,976,000
東京センチュリー	22,600	6,540.00	147,804,000
SBIホールディングス	126,700	3,150.00	399,105,000
日本証券金融	45,900	654.00	30,018,600
アイフル	187,900	325.00	61,067,500
日本アジア投資	10,100	284.00	2,868,400
長野銀行	3,700	1,686.00	6,238,200
名古屋銀行	9,100	3,730.00	33,943,000
北洋銀行	168,700	363.00	61,238,100
愛知銀行	3,800	4,795.00	18,221,000
中京銀行	4,600	2,305.00	10,603,000
大光銀行	3,700	2,237.00	8,276,900
愛媛銀行	15,700	1,201.00	18,855,700
トマト銀行	4,200	1,448.00	6,081,600
京葉銀行	49,700	887.00	44,083,900
栃木銀行	57,900	371.00	21,480,900
北日本銀行	3,500	2,583.00	9,040,500
東和銀行	19,700	1,010.00	19,897,000
福島銀行	10,500	656.00	6,888,000
大東銀行	5,400	1,075.00	5,805,000
リコーリース	8,800	3,535.00	31,108,000
イオンフィナンシャルサービス	79,400	2,242.00	178,014,800
アコム	225,000	428.00	96,300,000
ジャックス	13,600	2,264.00	30,790,400
オリエントコーポレーション	242,300	167.00	40,464,100
日立キャピタル	30,800	3,010.00	92,708,000
アプラスフィナンシャル	53,800	103.00	5,541,400
オリックス	746,900	1,823.50	1,361,972,150
三菱UFJリース	284,100	631.00	179,267,100

ジャフコ	16,100	4,210.00	67,781,000
九州リースサービス	4,800	707.00	3,393,600
トモニホールディングス	92,400	462.00	42,688,800
大和証券グループ本社	958,200	666.30	638,448,660
野村ホールディングス	1,926,100	538.60	1,037,397,460
岡三証券グループ	95,400	556.00	53,042,400
丸三証券	35,600	944.00	33,606,400
東洋証券	39,900	243.00	9,695,700
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	123,900	623.00	77,189,700
光世証券	2,600	1,154.00	3,000,400
水戸証券	32,300	373.00	12,047,900
いちよし証券	23,500	1,082.00	25,427,000
松井証券	54,800	1,166.00	63,896,800
SOMPOホールディングス	219,500	4,793.00	1,052,063,500
だいこう証券ビジネス	5,500	518.00	2,849,000
日本取引所グループ	321,300	1,905.00	612,076,500
マネックスグループ	114,100	521.00	59,446,100
カブドットコム証券	71,600	377.00	26,993,200
極東証券	15,000	1,389.00	20,835,000
岩井コスモホールディングス	11,500	1,500.00	17,250,000
藍澤證券	20,900	723.00	15,110,700
フィデアホールディングス	108,600	162.00	17,593,200
池田泉州ホールディングス	118,900	372.00	44,230,800
アニコムホールディングス	7,700	3,420.00	26,334,000
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	292,700	3,699.00	1,082,697,300
ソニーフィナンシャルホールディングス	92,000	2,491.00	229,172,000
マネーパートナーズグループ	14,300	370.00	5,291,000
小林洋行	3,200	285.00	912,000
第一生命ホールディングス	633,300	2,352.50	1,489,838,250
東京海上ホールディングス	421,700	5,486.00	2,313,446,200
アドバンテッジリスクマネジメント	3,600	1,069.00	3,848,400
イー・ギャランティ	11,900	1,159.00	13,792,100
アサックス	4,600	597.00	2,746,200
NECキャピタルソリューション	4,600	1,838.00	8,454,800
T&Dホールディングス	346,200	1,918.50	664,184,700
アドバンスクリエイト	2,600	2,324.00	6,042,400
三井不動産	559,000	2,534.00	1,416,506,000
三菱地所	833,300	1,828.50	1,523,689,050
平和不動産	19,800	2,011.00	39,817,800
東京建物	122,400	1,226.00	150,062,400
ダイビル	28,800	1,178.00	33,926,400
京阪神ビルディング	18,600	833.00	15,493,800
住友不動産	268,700	3,913.00	1,051,423,100
太平洋興発	4,700	925.00	4,347,500
大京	17,800	2,161.00	38,465,800
テーオーシー	38,600	768.00	29,644,800
東京楽天地	1,800	4,890.00	8,802,000

レオパレス21	133,600	572.00	76,419,200
スターツコーポレーション	15,200	2,346.00	35,659,200
フジ住宅	14,300	836.00	11,954,800
空港施設	11,200	618.00	6,921,600
明和地所	6,100	637.00	3,885,700
ゴールドクレスト	8,900	1,798.00	16,002,200
リログループ	59,300	2,922.00	173,274,600
日本エスリード	4,400	1,494.00	6,573,600
日神不動産	14,900	550.00	8,195,000
日本エスコン	20,200	715.00	14,443,000
タカラレーベン	52,400	331.00	17,344,400
サンヨーハウジング名古屋	6,300	1,059.00	6,671,700
イオンモール	72,100	2,032.00	146,507,200
ファースト住建	4,200	1,448.00	6,081,600
ランド	302,700	13.00	3,935,100
カチタス	15,300	2,939.00	44,966,700
東祥	6,700	4,675.00	31,322,500
トーセイ	15,400	1,003.00	15,446,200
穴吹興産	1,200	3,105.00	3,726,000
エヌ・ティ・ティ都市開発	69,600	1,303.00	90,688,800
サンフロンティア不動産	13,500	1,130.00	15,255,000
エフ・ジェー・ネクスト	8,600	857.00	7,370,200
インテリックス	3,100	766.00	2,374,600
ランドビジネス	5,600	515.00	2,884,000
グランディハウス	9,700	470.00	4,559,000
東武鉄道	119,700	3,185.00	381,244,500
相鉄ホールディングス	36,300	3,575.00	129,772,500
東京急行電鉄	308,300	1,919.00	591,627,700
京浜急行電鉄	155,500	1,849.00	287,519,500
小田急電鉄	168,800	2,567.00	433,309,600
京王電鉄	63,400	6,110.00	387,374,000
京成電鉄	79,000	3,795.00	299,805,000
富士急行	15,500	3,335.00	51,692,500
新京成電鉄	2,900	2,218.00	6,432,200
東日本旅客鉄道	201,800	9,967.00	2,011,340,600
西日本旅客鉄道	101,700	7,744.00	787,564,800
東海旅客鉄道	101,600	22,790.00	2,315,464,000
西武ホールディングス	144,700	2,092.00	302,712,400
鴻池運輸	16,100	1,777.00	28,609,700
西日本鉄道	31,400	2,943.00	92,410,200
ハマキョウレックス	8,100	3,925.00	31,792,500
サカイ引越センター	5,900	5,990.00	35,341,000
近鉄グループホールディングス	107,500	4,420.00	475,150,000
阪急阪神ホールディングス	143,400	3,880.00	556,392,000
南海電気鉄道	50,900	2,819.00	143,487,100
京阪ホールディングス	47,900	4,305.00	206,209,500
神戸電鉄	2,500	4,030.00	10,075,000
名古屋鉄道	86,100	2,765.00	238,066,500
山陽電気鉄道	8,300	2,531.00	21,007,300
ランコム	3,000	7,660.00	22,980,000

日本通運	42,200	6,900.00	291,180,000
ヤマトホールディングス	188,500	3,327.00	627,139,500
山九	27,600	6,150.00	169,740,000
日新	9,200	2,412.00	22,190,400
丸運	5,800	336.00	1,948,800
丸全昭和運輸	7,600	2,972.00	22,587,200
センコーグループホールディングス	64,600	874.00	56,460,400
トナミホールディングス	2,500	6,150.00	15,375,000
ニッコンホールディングス	40,900	2,803.00	114,642,700
日本石油輸送	1,300	2,823.00	3,669,900
福山通運	15,800	4,505.00	71,179,000
セイノーホールディングス	80,500	1,581.00	127,270,500
エスライン	2,900	1,279.00	3,709,100
神奈川中央交通	2,600	3,690.00	9,594,000
日立物流	23,700	2,983.00	70,697,100
丸和運輸機関	5,600	3,780.00	21,168,000
C & F ロジホールディングス	11,800	1,329.00	15,682,200
日本郵船	89,900	2,023.00	181,867,700
商船三井	68,100	3,125.00	212,812,500
川崎汽船	49,700	2,089.00	103,823,300
NSユナイテッド海運	5,100	2,580.00	13,158,000
明治海運	11,400	387.00	4,411,800
飯野海運	54,800	527.00	28,879,600
共栄タンカー	800	1,797.00	1,437,600
九州旅客鉄道	90,200	3,285.00	296,307,000
SGホールディングス	101,500	2,892.00	293,538,000
日本航空	196,800	3,782.00	744,297,600
ANAホールディングス	208,800	3,678.00	767,966,400
パスコ	2,100	1,283.00	2,694,300
西本Wismettacホールディングス	2,500	5,070.00	12,675,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	900	1,379.00	1,241,100
Genky DrugStores	4,400	4,020.00	17,688,000
国際紙パルプ商事	19,600	344.00	6,742,400
総合メディカルホールディングス	9,700	2,404.00	23,318,800
ブックオフグループホールディングス	6,300	716.00	4,510,800
三菱倉庫	37,200	2,842.00	105,722,400
三井倉庫ホールディングス	12,300	1,932.00	23,763,600
住友倉庫	37,500	1,436.00	53,850,000
澁澤倉庫	5,800	1,664.00	9,651,200
ヤマタネ	5,500	2,003.00	11,016,500
東陽倉庫	19,400	335.00	6,499,000
乾汽船	8,300	938.00	7,785,400
日本トランスシティ	26,000	471.00	12,246,000
ケイヒン	2,000	1,546.00	3,092,000
中央倉庫	6,500	1,166.00	7,579,000
川西倉庫	2,100	1,584.00	3,326,400
安田倉庫	9,600	886.00	8,505,600
東洋埠頭	3,100	1,636.00	5,071,600
宇徳	9,200	521.00	4,793,200

上組	66,300	2,405.00	159,451,500
サンリツ	2,700	712.00	1,922,400
キムラユニティー	2,800	1,169.00	3,273,200
キューソー流通システム	2,700	2,756.00	7,441,200
近鉄エクスプレス	20,200	1,967.00	39,733,400
東海運	5,900	327.00	1,929,300
エーアイティー	7,700	1,156.00	8,901,200
内外トランスライン	3,400	1,723.00	5,858,200
日本コンセプト	2,900	1,165.00	3,378,500
東京放送ホールディングス	61,500	2,206.00	135,669,000
日本テレビホールディングス	102,200	1,896.00	193,771,200
朝日放送グループホールディングス	11,100	799.00	8,868,900
テレビ朝日ホールディングス	30,600	2,120.00	64,872,000
スカパーJ S A Tホールディングス	85,000	513.00	43,605,000
テレビ東京ホールディングス	9,200	2,641.00	24,297,200
日本BS放送	3,800	1,252.00	4,757,600
ビジョン	3,400	4,520.00	15,368,000
USEN-NEXT HOLDINGS	4,200	1,422.00	5,972,400
ワイヤレスゲート	4,900	579.00	2,837,100
コネクシオ	7,900	1,902.00	15,025,800
日本通信	100,500	150.00	15,075,000
クロップス	2,300	767.00	1,764,100
日本電信電話	799,300	4,911.00	3,925,362,300
KDDI	981,500	2,935.00	2,880,702,500
光通信	13,100	20,680.00	270,908,000
NTTドコモ	799,800	2,944.50	2,355,011,100
エムティーアイ	12,900	581.00	7,494,900
GMOインターネット	40,600	1,609.00	65,325,400
アйдママーケティングコミュニケーション	2,300	649.00	1,492,700
カドカワ	32,500	1,164.00	37,830,000
学研ホールディングス	3,700	5,610.00	20,757,000
ゼンリン	20,200	3,305.00	66,761,000
昭文社	5,100	623.00	3,177,300
インプレスホールディングス	9,200	175.00	1,610,000
東京電力ホールディングス	906,200	574.00	520,158,800
中部電力	347,300	1,686.00	585,547,800
関西電力	463,100	1,697.50	786,112,250
中国電力	156,900	1,451.00	227,661,900
北陸電力	111,200	1,136.00	126,323,200
東北電力	265,800	1,511.00	401,623,800
四国電力	102,200	1,448.00	147,985,600
九州電力	250,700	1,351.00	338,695,700
北海道電力	113,800	720.00	81,936,000
沖縄電力	23,000	2,301.00	52,923,000
電源開発	90,300	3,115.00	281,284,500
エフオン	6,800	1,166.00	7,928,800
イーレックス	17,900	915.00	16,378,500
レノバ	11,800	1,113.00	13,133,400

東京瓦斯	238,600	2,763.00	659,251,800
大阪瓦斯	220,200	2,140.50	471,338,100
東邦瓦斯	56,200	4,175.00	234,635,000
北海道瓦斯	6,000	1,505.00	9,030,000
広島ガス	23,400	377.00	8,821,800
西部瓦斯	13,700	2,526.00	34,606,200
静岡ガス	35,000	941.00	32,935,000
メタウォーター	6,400	2,997.00	19,180,800
アイネット	6,300	1,690.00	10,647,000
松竹	7,400	13,250.00	98,050,000
東宝	73,300	3,595.00	263,513,500
エイチ・アイ・エス	19,300	3,540.00	68,322,000
東映	4,200	12,950.00	54,390,000
ラックランド	2,000	3,015.00	6,030,000
エヌ・ティ・ティ・データ	346,000	1,477.00	511,042,000
共立メンテナンス	19,400	4,890.00	94,866,000
イチネンホールディングス	12,200	1,422.00	17,348,400
建設技術研究所	7,500	1,605.00	12,037,500
スペース	7,000	1,310.00	9,170,000
長 大	4,300	864.00	3,715,200
アインホールディングス	15,000	8,690.00	130,350,000
燦ホールディングス	2,500	2,659.00	6,647,500
ピー・シー・エー	1,700	1,917.00	3,258,900
スバル興業	800	5,520.00	4,416,000
東京テアトル	4,600	1,353.00	6,223,800
タナベ経営	2,000	1,755.00	3,510,000
ビジネスブレイン太田昭和	1,900	2,160.00	4,104,000
ナガワ	2,100	5,410.00	11,361,000
よみうりランド	2,300	4,335.00	9,970,500
東京都競馬	7,100	4,070.00	28,897,000
常磐興産	4,400	1,768.00	7,779,200
カナモト	15,300	4,035.00	61,735,500
東京ドーム	43,900	993.00	43,592,700
D T S	11,600	4,215.00	48,894,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	51,800	4,275.00	221,445,000
シーイーシー	13,200	2,395.00	31,614,000
カプコン	47,700	2,616.00	124,783,200
西尾レントオール	11,000	3,800.00	41,800,000
アイ・エス・ピー	2,100	2,377.00	4,991,700
アゴーラ・ホスピタリティ・グループ	60,400	31.00	1,872,400
日本空港ビルデング	32,700	4,515.00	147,640,500
トランス・コスモス	12,100	2,761.00	33,408,100
乃村工芸社	25,300	2,162.00	54,698,600
ジャステック	6,400	1,155.00	7,392,000
S C S K	25,700	4,975.00	127,857,500
藤田観光	4,300	3,325.00	14,297,500
K N T - C Tホールディングス	6,700	1,201.00	8,046,700
日本管財	11,600	2,083.00	24,162,800

トーカイ	10,500	2,466.00	25,893,000
白洋舎	1,200	3,060.00	3,672,000
セコム	115,100	9,295.00	1,069,854,500
日本システムウエア	3,700	1,822.00	6,741,400
セントラル警備保障	5,300	4,810.00	25,493,000
アイネス	14,100	1,257.00	17,723,700
丹青社	22,200	1,074.00	23,842,800
メイテック	12,700	5,020.00	63,754,000
T K C	9,400	4,530.00	42,582,000
富士ソフト	16,600	5,260.00	87,316,000
応用地質	11,700	1,393.00	16,298,100
船井総研ホールディングス	22,500	2,301.00	51,772,500
N S D	18,300	2,415.00	44,194,500
進学会ホールディングス	5,000	618.00	3,090,000
丸紅建材リース	1,100	2,402.00	2,642,200
オオバ	8,600	649.00	5,581,400
コナミホールディングス	45,600	4,310.00	196,536,000
いであ	2,100	1,117.00	2,345,700
学究社	3,900	1,753.00	6,836,700
ベネッセホールディングス	39,700	3,090.00	122,673,000
イオンディライト	13,300	3,705.00	49,276,500
ナック	7,200	987.00	7,106,400
福井コンピュータホールディングス	3,200	1,841.00	5,891,200
ニチイ学館	20,500	925.00	18,962,500
ダイセキ	18,200	2,860.00	52,052,000
ステップ	4,000	1,580.00	6,320,000
日鉄住金物産	8,800	5,130.00	45,144,000
泉州電業	3,700	2,919.00	10,800,300
元気寿司	2,800	6,310.00	17,668,000
トラスコ中山	23,300	2,924.00	68,129,200
ヤマダ電機	382,200	563.00	215,178,600
オートバックスセブン	44,400	1,914.00	84,981,600
モリト	8,200	854.00	7,002,800
アークランドサカモト	19,000	1,449.00	27,531,000
ニトリホールディングス	44,400	15,085.00	669,774,000
グルメ杵屋	7,800	1,177.00	9,180,600
愛眼	9,100	334.00	3,039,400
ケーユーホールディングス	5,800	939.00	5,446,200
吉野家ホールディングス	36,700	1,768.00	64,885,600
加藤産業	17,500	3,715.00	65,012,500
イノテック	9,600	1,230.00	11,808,000
イエローハット	10,500	2,834.00	29,757,000
松屋フーズホールディングス	5,400	3,510.00	18,954,000
J B C Cホールディングス	8,800	1,334.00	11,739,200
J Kホールディングス	11,200	751.00	8,411,200
サガミホールディングス	15,000	1,373.00	20,595,000
日伝	9,200	1,903.00	17,507,600
関西スーパーマーケット	8,500	1,101.00	9,358,500
ミロク情報サービス	9,800	2,204.00	21,599,200
北沢産業	9,200	224.00	2,060,800

杉本商事	6,000	1,873.00	11,238,000
因幡電機産業	14,800	4,630.00	68,524,000
王将フードサービス	8,200	7,380.00	60,516,000
ブレナス	12,600	1,792.00	22,579,200
ミニストップ	8,300	2,190.00	18,177,000
アークス	20,900	2,907.00	60,756,300
パローホールディングス	26,000	2,495.00	64,870,000
バイテックホールディングス	5,100	2,398.00	12,229,800
東テク	3,700	2,994.00	11,077,800
ミスミグループ本社	129,900	2,530.00	328,647,000
藤久	900	1,055.00	949,500
アルテック	8,200	282.00	2,312,400
ベルク	5,000	6,070.00	30,350,000
大 庄	5,900	1,679.00	9,906,100
タキヒヨー	3,700	2,002.00	7,407,400
ファーストリテイリング	15,000	57,260.00	858,900,000
ソフトバンクグループ	504,200	9,535.00	4,807,547,000
蔵王産業	1,800	1,491.00	2,683,800
スズケン	51,000	5,280.00	269,280,000
サンドラッグ	42,100	4,015.00	169,031,500
サックスパー ホールディングス	10,500	953.00	10,006,500
ジェコス	7,700	1,155.00	8,893,500
ヤマザワ	2,200	1,693.00	3,724,600
やまや	2,300	2,840.00	6,532,000
ルネサスイーストン	10,200	515.00	5,253,000
ベルーナ	27,500	1,247.00	34,292,500
合計	130,846,435		275,619,206,300

*担保として以下の有価証券が差し入れられております。

銘柄	株式数
トヨタ自動車	500,000

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成30年4月11日現在	平成30年10月11日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		3,394,154,584	1,179,724,600
国債証券		293,957,311,600	284,006,195,500
地方債証券		22,888,894,339	21,983,801,692
特殊債券		14,890,973,814	17,162,735,349
社債券		16,253,711,810	15,129,617,810
未収利息		559,477,340	523,441,973
前払費用		16,854,005	20,345,639
流動資産合計		351,961,377,492	340,005,862,563
資産合計		351,961,377,492	340,005,862,563
負債の部			
流動負債			
未払金		2,202,588,500	-
未払解約金		296,057,000	530,378,000
流動負債合計		2,498,645,500	530,378,000
負債合計		2,498,645,500	530,378,000
純資産の部			
元本等			
元本	1	270,498,995,615	265,366,082,224
剰余金			
剰余金又は欠損金()		78,963,736,377	74,109,402,339
元本等合計		349,462,731,992	339,475,484,563
純資産合計		349,462,731,992	339,475,484,563
負債純資産合計		351,961,377,492	340,005,862,563

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	平成30年4月11日現在	平成30年10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	280,484,560,925円 28,260,515,152円 38,246,080,462円	270,498,995,615円 57,554,431,325円 62,687,344,716円
元本の内訳 ファンド名		
D I A M国内債券パッシブ・ファンド	15,270,651,926円	17,218,009,424円
M I T O ラップ型ファンド（安定型）	133,392,035円	116,744,280円
M I T O ラップ型ファンド（中立型）	103,531,902円	91,662,889円
M I T O ラップ型ファンド（積極型）	32,375,641円	28,460,338円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	711,138,730円	822,678,821円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	214,285,439円	242,214,024円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	30,402,668円	37,278,552円
たわらノーロード 国内債券	3,342,170,664円	4,811,044,247円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	39,377,237円	117,873,280円
たわらノーロード バランス（堅実型）	7,477,877円	28,055,982円
たわらノーロード バランス（標準型）	12,443,765円	53,706,124円
たわらノーロード バランス（積極型）	3,001,388円	10,644,651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）	1,145,317円	5,244,226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）	22,600,854円	73,873,160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）	14,185,243円	94,425,671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）	4,997,652円	26,321,104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)	1,928,074円	13,608,174円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(保守型)	998,019円	1,243,634円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定型)	535,415円	656,526円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定成長型)	1,682,510円	2,983,535円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(成長型)	520,352円	675,927円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(積極型)	77,886円	17,517円
D I A M国内債券インデックス ファンド< D C年金>	12,607,657,323円	12,875,217,346円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 1 安定型	5,535,324,397円	5,953,625,902円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 2 安定・成長型	8,050,703,820円	8,557,028,547円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 3 成長型	3,240,617,007円	3,470,237,031円
D I A M D C バランス3 0 インデックスファンド	1,802,466,064円	1,836,055,699円
D I A M D C バランス5 0 インデックスファンド	1,980,109,879円	2,032,813,435円
D I A M D C バランス7 0 インデックスファンド	307,549,092円	315,744,242円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型>	92,933,808円	88,374,891円
マネックス資産設計ファンド< 育成型>	2,325,174,416円	2,317,324,650円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	4,808,536円	4,391,950円
D I A M D C 8資産バラ ンスファンド(新興国1 0)	474,981,130円	3,186,425,011円
D I A M D C 8資産バラ ンスファンド(新興国2 0)	442,458,328円	756,623,110円
D I A M D C 8資産バラ ンスファンド(新興国3 0)	104,118,291円	161,357,166円
投資のソムリエ	3,656,031,803円	9,687,855,915円
クルーズコントロール	444,343,713円	1,637,656,208円
投資のソムリエ< D C年金>	261,049,297円	841,937,321円
D I A M 8資産バランスファ ンドN< D C年金>	1,910,445,810円	2,259,771,712円
D I A M D C バランス・F (成長型)	240,000,998円	286,078,562円
クルーズコントロール< D C年 金>	165,091円	946,644円
D I A Mコア資産設計ファンド (堅実型)	1,123,528円	5,135,239円
D I A Mコア資産設計ファンド (積極型)	3,353,398円	10,773,596円
投資のソムリエ< D C年金>リ スク抑制型	480,733,487円	644,288,090円

ダイナミック・ナビゲーション	415,602円	515,269円
リスク抑制世界8資産バランス ファンド	8,080,627,460円	12,200,329,309円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2045)	627,520円	2,416,181円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2055)	456,411円	1,740,009円
リスク抑制世界8資産バランス ファンド(DC)	2,438,657円	3,821,192円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2035)	1,175,568円	3,490,471円
4資産分散投資・スタンダード <DC年金>	6,297,633円	74,600,200円
リスクコントロール世界資産分 散ファンド	-円	758,397,642円
9資産分散投資・スタンダード <DC年金>	-円	290,676円
DIAM高金利通貨ファンド	9,608,918円	-円
DIAMエマージング債券ファ ンド	9,450,010円	9,450,010円
DIAM国内債券パッシブファ ンド(適格機関投資家向け)	22,725,657,792円	22,706,772,840円
DIAMワールドバランス25 VA(適格機関投資家限定)	480,025,025円	451,828,315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)	319,735,201円	289,466,887円
DIAMグローバル・バランス ファンド50VA(適格機関投 資家限定)	238,173,147円	236,494,470円
DIAM国際分散バランスファ ンド30VA(適格機関投資家 限定)	77,264,771円	72,823,300円
DIAM国際分散バランスファ ンド50VA(適格機関投資家 限定)	217,543,884円	200,165,850円
DIAM国内重視バランスファ ンド30VA(適格機関投資家 限定)	88,973,434円	83,310,095円
DIAM国内重視バランスファ ンド50VA(適格機関投資家 限定)	55,403,177円	43,155,088円
DIAM世界バランスファンド 40VA(適格機関投資家限 定)	93,566,153円	95,738,566円
DIAM世界バランスファンド 50VA(適格機関投資家限 定)	170,277,657円	169,898,524円
DIAMバランスファンド25 VA(適格機関投資家限定)	5,854,117,326円	5,671,071,527円
DIAMバランスファンド3 7.5VA(適格機関投資家限 定)	3,096,423,321円	3,032,854,964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)	5,656,419,674円	5,675,200,299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)	614,350,089円	602,332,656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)	426,305,760円	269,865,242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)	3,640,139,105円	3,466,351,848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)	2,665,344,766円	923,203,788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)	133,416,665円	46,910,967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)	1,122,556,207円	97,843,684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)	83,372,825,575円	59,718,393,543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)	1,116,861,192円	827,727,378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)	7,146,512,954円	7,191,254,876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)	27,319,006,488円	27,550,090,073円
D I A Mバランス30V A (適 格機関投資家限定)	81,853,560円	53,798,122円
D I A Mバランス50V A (適 格機関投資家限定)	1,395,995円	16,094,725円
D I A Mバランス70V A (適 格機関投資家限定)	7,548,153円	8,024,060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)	30,406,243,697円	30,758,149,462円
D I A M世界バランス25V A (適格機関投資家限定)	481,766,349円	469,748,503円
D I A M国内バランス30V A (適格機関投資家限定)	134,196,130円	133,450,015円
D I A Mバランス20V A (適 格機関投資家限定)	533,089,734円	526,036,110円
D I A Mバランス40V A (適 格機関投資家限定)	705,557円	737,508円
D I A Mバランス60V A (適 格機関投資家限定)	376,555円	400,694円

計	270,498,995,615円	265,366,082,224円
2. 受益権の総数	270,498,995,615口	265,366,082,224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10月12日 至 平成30年4月11日	自 平成30年4月12日 至 平成30年10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30年4月11日現在	平成30年10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 該当事項はありませぬ。 (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。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成30年4月11日現在	平成30年10月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
国債証券	1,226,238,700	3,224,291,700
地方債証券	1,296,716	128,478,573
特殊債証券	459,275	142,042,634
社債証券	9,458,440	103,253,440
合計	1,215,942,819	3,598,066,347

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(平成30年2月15日から平成30年4月11日まで及び平成30年2月15日から平成30年10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30年4月11日現在	平成30年10月11日現在
1口当たり純資産額	1.2919円	1.2793円
(1万口当たり純資産額)	(12,919円)	(12,793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10月11日現在

種 類	銘 柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
国債証券	384回 利付国庫債券(2年)	1,000,000,000	1,002,960,000	
	386回 利付国庫債券(2年)	1,000,000,000	1,003,270,000	
	387回 利付国庫債券(2年)	1,000,000,000	1,003,470,000	
	388回 利付国庫債券(2年)	800,000,000	802,928,000	
	390回 利付国庫債券(2年)	1,200,000,000	1,204,644,000	
	391回 利付国庫債券(2年)	1,400,000,000	1,405,684,000	
	122回 利付国庫債券(5年)	4,000,000,000	4,011,160,000	
	123回 利付国庫債券(5年)	3,000,000,000	3,009,900,000	
	124回 利付国庫債券(5年)	2,200,000,000	2,208,360,000	
	125回 利付国庫債券(5年)	3,000,000,000	3,012,810,000	
	126回 利付国庫債券(5年)	2,500,000,000	2,511,775,000	
	127回 利付国庫債券(5年)	3,000,000,000	3,015,360,000	
	128回 利付国庫債券(5年)	3,000,000,000	3,016,980,000	
	129回 利付国庫債券(5年)	2,420,000,000	2,434,616,800	
	130回 利付国庫債券(5年)	3,000,000,000	3,019,170,000	
	131回 利付国庫債券(5年)	2,020,000,000	2,033,574,400	
	132回 利付国庫債券(5年)	2,000,000,000	2,014,040,000	
	133回 利付国庫債券(5年)	2,460,000,000	2,477,982,600	
	134回 利付国庫債券(5年)	1,790,000,000	1,803,532,400	
	135回 利付国庫債券(5年)	2,100,000,000	2,116,338,000	
	136回 利付国庫債券(5年)	750,000,000	755,992,500	
	2回 利付国庫債券(40年)	460,000,000	617,623,600	
	3回 利付国庫債券(40年)	460,000,000	619,426,800	
	4回 利付国庫債券(40年)	770,000,000	1,039,584,700	
	5回 利付国庫債券(40年)	700,000,000	908,404,000	
	6回 利付国庫債券(40年)	700,000,000	888,685,000	
	7回 利付国庫債券(40年)	750,000,000	908,760,000	
	8回 利付国庫債券(40年)	840,000,000	941,035,200	
	9回 利付国庫債券(40年)	1,210,000,000	977,619,500	
	10回 利付国庫債券(40年)	1,120,000,000	1,073,990,400	
	11回 利付国庫債券(40年)	390,000,000	359,798,400	
	305回 利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,525,635,000	
	306回 利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,533,000,000	
	307回 利付国庫債券(10年)	1,400,000,000	1,428,784,000	
	308回 利付国庫債券(10年)	800,000,000	819,280,000	
	309回 利付国庫債券(10年)	1,000,000,000	1,020,710,000	
	310回 利付国庫債券(10年)	2,300,000,000	2,350,071,000	
	311回 利付国庫債券(10年)	1,020,000,000	1,038,237,600	
	312回 利付国庫債券(10年)	2,200,000,000	2,263,470,000	
	313回 利付国庫債券(10年)	1,790,000,000	1,851,629,700	

314回	利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,544,325,000	
315回	利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,552,965,000	
316回	利付国庫債券(10年)	500,000,000	516,305,000	
317回	利付国庫債券(10年)	1,000,000,000	1,035,530,000	
318回	利付国庫債券(10年)	1,600,000,000	1,652,128,000	
319回	利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,557,585,000	
320回	利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,552,785,000	
321回	利付国庫債券(10年)	1,100,000,000	1,141,514,000	
322回	利付国庫債券(10年)	1,000,000,000	1,034,290,000	
324回	利付国庫債券(10年)	2,000,000,000	2,065,840,000	
325回	利付国庫債券(10年)	2,900,000,000	3,001,442,000	
326回	利付国庫債券(10年)	500,000,000	516,390,000	
327回	利付国庫債券(10年)	1,450,000,000	1,503,621,000	
328回	利付国庫債券(10年)	2,890,000,000	2,976,815,600	
329回	利付国庫債券(10年)	2,270,000,000	2,362,865,700	
330回	利付国庫債券(10年)	1,200,000,000	1,251,120,000	
331回	利付国庫債券(10年)	650,000,000	671,248,500	
332回	利付国庫債券(10年)	2,960,000,000	3,060,077,600	
333回	利付国庫債券(10年)	2,500,000,000	2,587,150,000	
334回	利付国庫債券(10年)	2,600,000,000	2,693,314,000	
335回	利付国庫債券(10年)	2,750,000,000	2,835,855,000	
336回	利付国庫債券(10年)	1,150,000,000	1,186,685,000	
337回	利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,529,265,000	
338回	利付国庫債券(10年)	2,650,000,000	2,719,960,000	
339回	利付国庫債券(10年)	3,100,000,000	3,182,925,000	
340回	利付国庫債券(10年)	3,100,000,000	3,184,940,000	
341回	利付国庫債券(10年)	3,060,000,000	3,122,607,600	
342回	利付国庫債券(10年)	3,000,000,000	3,016,680,000	
343回	利付国庫債券(10年)	3,000,000,000	3,014,940,000	
344回	利付国庫債券(10年)	2,800,000,000	2,811,060,000	
345回	利付国庫債券(10年)	2,700,000,000	2,707,695,000	
346回	利付国庫債券(10年)	3,000,000,000	3,006,270,000	
347回	利付国庫債券(10年)	2,900,000,000	2,903,741,000	
348回	利付国庫債券(10年)	2,900,000,000	2,901,276,000	
349回	利付国庫債券(10年)	2,610,000,000	2,608,799,400	
350回	利付国庫債券(10年)	3,400,000,000	3,395,206,000	
351回	利付国庫債券(10年)	2,340,000,000	2,333,260,800	
1回	利付国庫債券(30年)	100,000,000	127,971,000	
2回	利付国庫債券(30年)	100,000,000	124,503,000	
3回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	247,344,000	
4回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	263,054,000	
5回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	247,498,000	
6回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	253,604,000	
7回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	378,168,000	
8回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	239,482,000	
11回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	237,220,000	
12回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	373,473,000	
13回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	369,525,000	
14回	利付国庫債券(30年)	500,000,000	646,315,000	
15回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	261,996,000	

16回	利付国庫債券(30年)	400,000,000	525,080,000	
17回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	259,830,000	
18回	利付国庫債券(30年)	420,000,000	539,733,600	
19回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	257,230,000	
20回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	396,174,000	
21回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	387,006,000	
22回	利付国庫債券(30年)	470,000,000	622,247,100	
23回	利付国庫債券(30年)	600,000,000	795,648,000	
24回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	398,448,000	
25回	利付国庫債券(30年)	400,000,000	518,312,000	
26回	利付国庫債券(30年)	700,000,000	919,835,000	
27回	利付国庫債券(30年)	700,000,000	934,136,000	
28回	利付国庫債券(30年)	900,000,000	1,203,921,000	
29回	利付国庫債券(30年)	900,000,000	1,190,619,000	
30回	利付国庫債券(30年)	960,000,000	1,254,796,800	
31回	利付国庫債券(30年)	900,000,000	1,162,467,000	
32回	利付国庫債券(30年)	1,060,000,000	1,392,988,400	
33回	利付国庫債券(30年)	1,300,000,000	1,633,840,000	
34回	利付国庫債券(30年)	1,140,000,000	1,483,071,600	
35回	利付国庫債券(30年)	1,250,000,000	1,577,425,000	
36回	利付国庫債券(30年)	1,300,000,000	1,643,551,000	
37回	利付国庫債券(30年)	1,200,000,000	1,493,712,000	
38回	利付国庫債券(30年)	900,000,000	1,101,978,000	
39回	利付国庫債券(30年)	800,000,000	997,872,000	
40回	利付国庫債券(30年)	650,000,000	796,737,500	
41回	利付国庫債券(30年)	680,000,000	818,597,600	
42回	利付国庫債券(30年)	800,000,000	963,368,000	
43回	利付国庫債券(30年)	800,000,000	963,688,000	
44回	利付国庫債券(30年)	650,000,000	783,237,000	
45回	利付国庫債券(30年)	870,000,000	1,007,312,100	
46回	利付国庫債券(30年)	980,000,000	1,134,634,200	
47回	利付国庫債券(30年)	860,000,000	1,015,771,800	
48回	利付国庫債券(30年)	940,000,000	1,064,991,800	
49回	利付国庫債券(30年)	990,000,000	1,121,392,800	
50回	利付国庫債券(30年)	1,000,000,000	986,680,000	
51回	利付国庫債券(30年)	930,000,000	801,873,900	
52回	利付国庫債券(30年)	1,060,000,000	964,260,800	
53回	利付国庫債券(30年)	900,000,000	839,286,000	
54回	利付国庫債券(30年)	900,000,000	883,620,000	
55回	利付国庫債券(30年)	980,000,000	960,939,000	
56回	利付国庫債券(30年)	900,000,000	881,352,000	
57回	利付国庫債券(30年)	930,000,000	909,549,300	
58回	利付国庫債券(30年)	1,130,000,000	1,103,693,600	
59回	利付国庫債券(30年)	800,000,000	758,952,000	
45回	利付国庫債券(20年)	900,000,000	932,742,000	
46回	利付国庫債券(20年)	500,000,000	519,720,000	
47回	利付国庫債券(20年)	250,000,000	261,292,500	
48回	利付国庫債券(20年)	500,000,000	528,725,000	
50回	利付国庫債券(20年)	780,000,000	818,368,200	
51回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	634,158,000	

5 2 回	利付国庫債券(20年)	550,000,000	585,794,000	
5 4 回	利付国庫債券(20年)	700,000,000	751,506,000	
5 5 回	利付国庫債券(20年)	410,000,000	439,626,600	
5 8 回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	647,076,000	
6 0 回	利付国庫債券(20年)	590,000,000	626,698,000	
6 1 回	利付国庫債券(20年)	500,000,000	523,920,000	
6 4 回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	658,260,000	
6 5 回	利付国庫債券(20年)	550,000,000	605,792,000	
6 7 回	利付国庫債券(20年)	520,000,000	574,953,600	
7 0 回	利付国庫債券(20年)	750,000,000	853,830,000	
7 2 回	利付国庫債券(20年)	350,000,000	394,124,500	
7 3 回	利付国庫債券(20年)	790,000,000	888,331,300	
7 5 回	利付国庫債券(20年)	440,000,000	499,624,400	
7 8 回	利付国庫債券(20年)	640,000,000	721,075,200	
8 1 回	利付国庫債券(20年)	240,000,000	273,120,000	
8 3 回	利付国庫債券(20年)	780,000,000	896,461,800	
8 5 回	利付国庫債券(20年)	440,000,000	507,570,800	
8 8 回	利付国庫債券(20年)	1,200,000,000	1,407,840,000	
9 0 回	利付国庫債券(20年)	1,200,000,000	1,404,024,000	
9 2 回	利付国庫債券(20年)	1,300,000,000	1,516,099,000	
9 3 回	利付国庫債券(20年)	700,000,000	813,295,000	
9 4 回	利付国庫債券(20年)	800,000,000	936,184,000	
9 5 回	利付国庫債券(20年)	1,200,000,000	1,429,836,000	
9 7 回	利付国庫債券(20年)	1,100,000,000	1,305,832,000	
9 9 回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,655,696,000	
1 0 0 回	利付国庫債券(20年)	850,000,000	1,016,370,500	
1 0 2 回	利付国庫債券(20年)	660,000,000	804,104,400	
1 0 5 回	利付国庫債券(20年)	950,000,000	1,133,644,500	
1 0 6 回	利付国庫債券(20年)	350,000,000	421,092,000	
1 0 7 回	利付国庫債券(20年)	650,000,000	777,588,500	
1 0 8 回	利付国庫債券(20年)	750,000,000	882,157,500	
1 0 9 回	利付国庫債券(20年)	770,000,000	907,984,000	
1 1 0 回	利付国庫債券(20年)	400,000,000	479,896,000	
1 1 1 回	利付国庫債券(20年)	770,000,000	934,564,400	
1 1 2 回	利付国庫債券(20年)	750,000,000	902,415,000	
1 1 3 回	利付国庫債券(20年)	1,500,000,000	1,808,970,000	
1 1 4 回	利付国庫債券(20年)	1,100,000,000	1,330,186,000	
1 1 5 回	利付国庫債券(20年)	300,000,000	366,063,000	
1 1 6 回	利付国庫債券(20年)	740,000,000	905,456,600	
1 1 7 回	利付国庫債券(20年)	950,000,000	1,151,789,500	
1 1 8 回	利付国庫債券(20年)	700,000,000	842,457,000	
1 1 9 回	利付国庫債券(20年)	700,000,000	826,490,000	
1 2 0 回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	694,344,000	
1 2 1 回	利付国庫債券(20年)	1,130,000,000	1,349,287,800	
1 2 2 回	利付国庫債券(20年)	500,000,000	591,220,000	
1 2 3 回	利付国庫債券(20年)	1,130,000,000	1,378,905,100	
1 2 4 回	利付国庫債券(20年)	500,000,000	604,210,000	
1 2 5 回	利付国庫債券(20年)	720,000,000	889,329,600	
1 2 6 回	利付国庫債券(20年)	450,000,000	544,648,500	
1 2 7 回	利付国庫債券(20年)	350,000,000	419,394,500	

1 2 8回	利付国庫債券(20年)	700,000,000	840,483,000	
1 2 9回	利付国庫債券(20年)	700,000,000	831,894,000	
1 3 0回	利付国庫債券(20年)	900,000,000	1,070,820,000	
1 3 1回	利付国庫債券(20年)	450,000,000	529,789,500	
1 3 2回	利付国庫債券(20年)	660,000,000	778,212,600	
1 3 3回	利付国庫債券(20年)	910,000,000	1,084,547,100	
1 3 4回	利付国庫債券(20年)	900,000,000	1,074,348,000	
1 3 5回	利付国庫債券(20年)	500,000,000	590,020,000	
1 3 6回	利付国庫債券(20年)	350,000,000	408,499,000	
1 3 7回	利付国庫債券(20年)	690,000,000	815,393,700	
1 3 8回	利付国庫債券(20年)	640,000,000	739,027,200	
1 3 9回	利付国庫債券(20年)	580,000,000	677,793,800	
1 4 0回	利付国庫債券(20年)	1,350,000,000	1,596,469,500	
1 4 1回	利付国庫債券(20年)	1,100,000,000	1,302,488,000	
1 4 2回	利付国庫債券(20年)	750,000,000	898,215,000	
1 4 3回	利付国庫債券(20年)	970,000,000	1,135,831,200	
1 4 4回	利付国庫債券(20年)	460,000,000	532,325,800	
1 4 5回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,660,540,000	
1 4 6回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,661,254,000	
1 4 7回	利付国庫債券(20年)	1,500,000,000	1,758,990,000	
1 4 8回	利付国庫債券(20年)	1,300,000,000	1,505,699,000	
1 4 9回	利付国庫債券(20年)	1,520,000,000	1,761,604,000	
1 5 0回	利付国庫債券(20年)	1,500,000,000	1,715,760,000	
1 5 1回	利付国庫債券(20年)	1,410,000,000	1,568,385,300	
1 5 2回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,555,918,000	
1 5 3回	利付国庫債券(20年)	1,360,000,000	1,532,298,400	
1 5 4回	利付国庫債券(20年)	1,150,000,000	1,276,707,000	
1 5 5回	利付国庫債券(20年)	1,600,000,000	1,722,528,000	
1 5 6回	利付国庫債券(20年)	1,370,000,000	1,336,229,500	
1 5 7回	利付国庫債券(20年)	1,300,000,000	1,220,752,000	
1 5 8回	利付国庫債券(20年)	1,330,000,000	1,312,710,000	
1 5 9回	利付国庫債券(20年)	1,420,000,000	1,423,493,200	
1 6 0回	利付国庫債券(20年)	1,300,000,000	1,322,672,000	
1 6 1回	利付国庫債券(20年)	1,200,000,000	1,197,984,000	
1 6 2回	利付国庫債券(20年)	1,200,000,000	1,194,912,000	
1 6 3回	利付国庫債券(20年)	1,210,000,000	1,202,752,100	
1 6 4回	利付国庫債券(20年)	1,460,000,000	1,420,974,200	
1 6 5回	利付国庫債券(20年)	1,220,000,000	1,184,949,400	
国債証券 合計		263,290,000,000	284,006,195,500	
地方債証券	6 8 0回 東京都公募公債	200,000,000	203,932,000	
	6 8 5回 東京都公募公債	500,000,000	509,365,000	
	6 8 8回 東京都公募公債	200,000,000	203,562,000	
	6 9 7回 東京都公募公債	500,000,000	514,690,000	
	7 0 1回 東京都公募公債	700,000,000	720,013,000	
	7 0 8回 東京都公募公債	500,000,000	515,850,000	
	7 2 0回 東京都公募公債	300,000,000	311,508,000	
	7 2 6回 東京都公募公債	400,000,000	413,652,000	
	5回 東京都公募公債 20年	100,000,000	112,813,000	
	9回 東京都公募公債 20年	200,000,000	234,886,000	
	10回 東京都公募公債 20年	300,000,000	351,003,000	

22年度12回 北海道公募公債	200,000,000	205,738,000	
194回 神奈川県公募公債	300,000,000	309,240,000	
208回 神奈川県公募公債	300,000,000	307,566,000	
336回 大阪府公募公債	200,000,000	204,204,000	
345回 大阪府公募公債	300,000,000	308,058,000	
356回 大阪府公募公債	200,000,000	206,474,000	
364回 大阪府公募公債	300,000,000	308,592,000	
374回 大阪府公募公債	300,000,000	312,216,000	
26年度11回 京都府公募公債	350,000,000	357,661,500	
26年度17回 兵庫県公募公債	200,000,000	204,046,000	
1回 兵庫県公募公債(12年)	300,000,000	316,665,000	
22年度8回 静岡県公募公債	200,000,000	203,886,000	
23年度9回 静岡県公募公債	200,000,000	206,302,000	
1回 静岡県公募公債 20年	100,000,000	114,055,000	
22年度6回 愛知県公募公債	200,000,000	204,168,000	
23年度20回 愛知県公募公債	500,000,000	518,015,000	
25年度4回 愛知県公募公債	300,000,000	310,959,000	
22年度1回 広島県公募公債	200,000,000	204,386,000	
23年度2回 埼玉県公募公債	200,000,000	206,090,000	
26年度5回 埼玉県公募公債	400,000,000	411,592,000	
25年度11回 福岡県公募公債	200,000,000	206,408,000	
24年度2回 福岡県公募公債(20年)	300,000,000	345,003,000	
24年度7回 千葉県公募公債	300,000,000	308,610,000	
25年度5回 千葉県公募公債	200,000,000	207,424,000	
80回 共同発行市場公募地方債	200,000,000	203,416,000	
94回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,768,000	
99回 共同発行市場公募地方債	700,000,000	721,658,000	
106回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	309,165,000	
109回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	517,835,000	
111回 共同発行市場公募地方債	700,000,000	721,854,000	
119回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	516,135,000	
121回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	511,420,000	
126回 共同発行市場公募地方債	793,900,000	822,702,692	
127回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	515,050,000	
128回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	308,793,000	
137回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	513,240,000	
139回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	512,865,000	
142回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	506,870,000	
144回 共同発行市場公募地方債	400,000,000	408,828,000	
146回 共同発行市場公募地方債	400,000,000	410,956,000	
148回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	513,875,000	
166回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	498,980,000	
29年度4回 大阪市公募公債	200,000,000	198,512,000	
488回 名古屋市公募公債 10年	450,000,000	462,960,000	
4回 京都市公募公債 20年	100,000,000	118,273,000	
22年度3回 横浜市公募公債	200,000,000	204,426,000	
22年度5回 横浜市公募公債	200,000,000	205,368,000	
23年度4回 横浜市公募公債	450,000,000	464,017,500	
25年度2回 横浜市公募公債	400,000,000	415,604,000	
25年度4回 札幌市公募公債	200,000,000	206,872,000	

	2回 川崎市公募公債 15年	100,000,000	102,730,000	
	21年度2回 北九州市公募公債	200,000,000	203,224,000	
	23年度1回 千葉市公募公債	200,000,000	206,772,000	
地方債証券 合計		21,243,900,000	21,983,801,692	
特殊債券	78回 日本政策投資銀行債券	200,000,000	199,750,000	
	19回 高速道路機構債	150,000,000	211,974,000	
	26回 高速道路機構債	200,000,000	267,358,000	
	96回 高速道路機構債	700,000,000	720,685,000	
	116回 高速道路機構債	100,000,000	103,287,000	
	9回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	104,728,000	
	18回政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	319,266,000	
	121回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	583,870,000	
	149回政保日本高速道路保有・債務返済機構	400,000,000	412,804,000	
	180回政保日本高速道路保有・債務返済機構	1,000,000,000	1,030,730,000	
	189回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	511,945,000	
	193回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	520,435,000	
	195回政保日本高速道路保有・債務返済機構	330,000,000	344,104,200	
	241回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	511,900,000	
	260回政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	220,856,000	
	309回政保日本高速道路保有・債務返済機構	800,000,000	798,312,000	
	319回政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	197,604,000	
	28回 日本道路・機構承継債	400,000,000	529,696,000	
	1回 地方公共団体金融機構債券 20年	200,000,000	234,542,000	
	8回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	305,115,000	
	10回 政保地方公共団体金融機構債券	500,000,000	509,475,000	
	15回 政保地方公共団体金融機構債券	200,000,000	203,812,000	
	20回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	308,400,000	
	24回 地方公共団体金融機構債券	300,000,000	309,390,000	
	19回 政保地方公共団体金融機構債券	200,000,000	234,520,000	
	36回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	309,855,000	
	44回 政保地方公共団体金融機構債券	400,000,000	414,096,000	
	50回 政保地方公共団体金融機構債券	500,000,000	521,165,000	
	56回 政保地方公共団体金融機構債券	542,000,000	562,162,400	
	64回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	308,559,000	
	44回 地方公共団体金融機構債券 20年	200,000,000	219,870,000	
	39回 住宅金融支援機構債券	200,000,000	237,822,000	
	75回 住宅金融支援機構債券	350,000,000	418,551,000	
	222回 住宅金融支援機構債券	300,000,000	298,251,000	

	6 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	44,469,000	46,792,060	
	8 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	31,276,000	32,969,908	
	9 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	46,818,000	49,389,712	
	2 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	49,590,000	52,664,580	
	1 3 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	18,125,000	18,666,393	
	1 4 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	91,320,000	93,596,607	
	4 3 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	16,636,000	17,607,875	
	4 4 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	62,808,000	66,314,570	
	5 1 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	47,139,000	49,697,233	
	1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	79,800,000	83,629,602	
	2 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	165,570,000	177,260,897	
	3 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	288,768,000	306,483,916	
	1 2 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	288,900,000	288,322,200	
	1 2 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	290,259,000	289,521,742	
	1 3 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	294,219,000	292,818,517	
	1 3 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	294,663,000	293,230,937	
	い第 7 7 9 号 利付商工債	200,000,000	200,430,000	
	い第 7 8 3 号 利付商工債	300,000,000	300,897,000	
	3 0 2 回 利附信金中金債	300,000,000	300,621,000	
	3 2 5 回 利附信金中金債	400,000,000	399,484,000	
	2 2 0 号 利附商工債(3年)	300,000,000	300,027,000	
	5 5 回 鉄道建設運輸施設債	500,000,000	517,420,000	
特殊債券 合計		16,282,360,000	17,162,735,349	
社債券	1 回 B P C E S A 円貨社債(ソーシャルボンド)	200,000,000	198,924,000	
	3 3 7 回 東京交通債	200,000,000	210,502,000	
	2 7 回 ラボバンク・ネダーランド円貨社債	200,000,000	200,744,000	
	2 2 回 中日本高速道路債券	300,000,000	305,901,000	
	3 4 回 政保西日本高速道路債券	200,000,000	201,226,000	
	7 回 キリンホールディングス社債	100,000,000	101,627,000	
	9 回 日本たばこ産業社債	200,000,000	200,464,000	
	1 9 回 三菱ケミカルホールディングス社債	100,000,000	101,222,000	
	6 回 J X ホールディングス社債	100,000,000	104,203,000	
	2 3 回 ジェイ エフ イー ホールディングス社債	100,000,000	99,676,000	
	3 0 回 豊田自動織機社債	200,000,000	199,786,000	
	1 2 回 パナソニック社債	200,000,000	200,812,000	
	1 3 回 パナソニック社債	100,000,000	101,338,000	
	5 6 回 日産自動車社債	100,000,000	100,617,000	
	1 4 回 トヨタ自動車社債	200,000,000	207,304,000	
	1 6 回 トヨタ自動車社債	200,000,000	204,950,000	
	9 4 回 丸紅社債	100,000,000	103,753,000	

45回	住友商事社債	100,000,000	103,188,000	
47回	住友商事社債	100,000,000	102,930,000	
48回	クレディセゾン社債	100,000,000	103,407,000	
57回	東京三菱銀行社債	200,000,000	216,946,000	
7回	東京三菱銀行劣後社債	200,000,000	204,786,000	
25回	三菱東京UFJ銀行劣後社債	200,000,000	204,824,000	
28回	三菱東京UFJ銀行劣後社債	200,000,000	206,394,000	
32回	三菱東京UFJ銀行劣後社債	300,000,000	311,721,000	
6回	りそな銀行劣後社債	100,000,000	102,765,000	
7回	三菱UFJ信託銀行劣後債	200,000,000	204,938,000	
9回	三菱UFJ信託銀行劣後債	100,000,000	103,887,000	
12回	住友信託銀行劣後債	100,000,000	102,548,000	
10回	三井住友信託銀行社債	200,000,000	203,724,000	
10回	セブン銀行社債	100,000,000	103,044,000	
22回	三井住友銀行劣後社債	200,000,000	205,024,000	
23回	三井住友銀行劣後社債	400,000,000	412,736,000	
15回	トヨタファイナンス社債	200,000,000	206,332,000	
47回	日立キャピタル社債	200,000,000	205,266,000	
14回	大和証券グループ本社社債	100,000,000	101,707,000	
26回	野村ホールディングス社債	100,000,000	102,797,000	
42回	野村ホールディングス社債	200,000,000	203,726,000	
46回	野村ホールディングス社債	200,000,000	200,620,000	
38回	三井不動産社債	200,000,000	203,966,000	
72回	三菱地所社債	100,000,000	111,904,000	
87回	住友不動産社債	100,000,000	100,964,000	
15回	東日本旅客鉄道社債	300,000,000	314,610,000	
19回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	107,638,000	
21回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	107,518,000	
39回	東日本旅客鉄道社債	300,000,000	336,630,000	
42回	東日本旅客鉄道社債	200,000,000	225,908,000	
9回	西日本旅客鉄道社債	200,000,000	215,034,000	
10回	西日本旅客鉄道社債	300,000,000	327,894,000	
5回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	103,343,000	
6回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	107,676,000	
11回	東海旅客鉄道社債	300,000,000	312,891,000	
13回	東海旅客鉄道社債	200,000,000	219,156,000	
14回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	110,932,000	
4回	東京地下鉄社債	120,000,000	139,483,200	
60回	日本電信電話社債	300,000,000	307,845,000	
496回	中部電力社債	500,000,000	510,485,000	
518回	中部電力社債	200,000,000	199,960,000	
377回	中国電力社債	400,000,000	416,864,000	
379回	中国電力社債	300,000,000	303,588,000	
260回	北陸電力社債	100,000,000	103,639,000	
301回	北陸電力社債	100,000,000	104,132,000	
307回	北陸電力社債	100,000,000	105,051,000	
471回	東北電力社債	400,000,000	417,900,000	
473回	東北電力社債	300,000,000	303,510,000	
253回	四国電力社債	200,000,000	207,156,000	
424回	九州電力社債	200,000,000	209,568,000	

426回	九州電力社債	400,000,000	415,708,000	
320回	北海道電力社債	200,000,000	202,578,000	
321回	北海道電力社債	161,000,000	165,992,610	
340回	北海道電力社債	300,000,000	299,757,000	
13回	電源開発社債	200,000,000	222,146,000	
38回	電源開発社債	300,000,000	310,671,000	
23回	東京瓦斯社債	300,000,000	312,225,000	
18回	大阪ガス社債	100,000,000	105,588,000	
27回	NTTデータ社債	100,000,000	103,348,000	
社債券 合計		14,581,000,000	15,129,617,810	
合計		315,397,260,000	338,282,350,351	

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30年4月11日現在	平成30年10月11日現在
資産の部			
流動資産			
預金		3,703,959,240	10,061,478,612
コール・ローン		118,630,552	154,222,369
株式		283,677,819,387	296,696,112,569
投資信託受益証券		836,893,845	703,250,786
投資証券		6,016,510,805	6,482,474,457
派生商品評価勘定		92,258,435	234,013
未収入金		2,633,604	13,053,564
未収配当金		463,874,593	331,659,889
差入委託証拠金		2,218,767,080	2,833,462,520
流動資産合計		297,131,347,541	317,275,948,779
資産合計		297,131,347,541	317,275,948,779
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		6,535,368	546,002,448
未払金		64,646,890	-
未払解約金		123,322,000	161,743,000
流動負債合計		194,504,258	707,745,448
負債合計		194,504,258	707,745,448
純資産の部			
元本等			
元本	1	89,487,416,345	89,733,368,409
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		207,449,426,938	226,834,834,922
元本等合計		296,936,843,283	316,568,203,331
純資産合計		296,936,843,283	316,568,203,331
負債純資産合計		297,131,347,541	317,275,948,779

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	平成30年4月11日現在	平成30年10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	88,520,951,451円	89,487,416,345円
同期中追加設定元本額	14,261,302,685円	11,043,162,608円
同期中一部解約元本額	13,294,837,791円	10,797,210,544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	1,910,656,569円	2,638,827,677円
M I T O ラップ型ファンド(安定型)	2,858,059円	2,913,395円
M I T O ラップ型ファンド(中立型)	8,377,043円	8,722,459円
M I T O ラップ型ファンド(積極型)	16,819,159円	17,210,299円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	15,228,505円	20,527,857円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	17,580,421円	23,048,530円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	15,817,157円	22,541,548円
たわらノーロード 先進国株式	6,210,258,461円	7,704,483,687円
たわらノーロード 先進国株式<ラップ向け>	424,744円	424,170円
たわらノーロード 先進国株式<為替ヘッジあり>	639,375,494円	911,021,956円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	16,286,862円	41,745,330円
たわらノーロード バランス(堅実型)	995,457円	3,180,770円
たわらノーロード バランス(標準型)	7,868,500円	29,341,088円
たわらノーロード バランス(積極型)	18,783,300円	56,849,736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)	39,311円	200,628円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定型)	4,702,845円	13,473,000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)	6,274,398円	39,600,653円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(成長型)	5,346,350円	28,891,613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)	12,203,677円	71,164,065円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	6,504円	14,928円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	53,876円	61,466円

たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	397,006円	641,442円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	413,060円	555,237円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	1,488,670円	1,823,220円
DIAM外国株式インデックスファンド<DC年金>	37,970,672,107円	39,507,511,136円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	168,107,521円	158,416,607円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	862,558,503円	838,916,152円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	1,070,957,443円	1,056,140,169円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	131,593,343円	123,352,569円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	385,116,497円	357,204,541円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	334,545,542円	318,410,977円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	31,943,791円	30,441,363円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	799,032,499円	796,380,003円
マネックス資産設計ファンドエボリューション	206,676,091円	209,146,305円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	33,634,872円	196,337,172円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	86,430,217円	124,912,903円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	168,111,819円	221,831,396円
投資のソムリエ	1,184,065,467円	2,561,519,510円
クルーズコントロール	81,781,664円	297,492,300円
投資のソムリエ<DC年金>	84,376,693円	222,689,229円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	135,297,788円	135,266,314円
DIAM DC バランス・F(成長型)	82,768,903円	84,492,319円
クルーズコントロール<DC年金>	30,467円	171,899円
DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)	402,135円	1,867,184円
DIAMコア資産設計ファンド(積極型)	1,245,127円	3,890,801円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	27,919,504円	70,852,416円
ダイナミック・ナビゲーション	765,335円	1,428,890円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	458,443,471円	1,340,930,384円
ワールドアセットバランス(基本コース)	679,300,871円	609,630,220円

ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	2,591,259,411円	2,331,660,543円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	355,096円	1,288,905円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	259,278円	928,926円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	138,358円	419,590円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	477,198円	1,765,184円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	480,719円	4,985,423円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	-円	225,974,073円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	-円	13,989円
DIAM外国株式インデックスファンドVA(適格機関投資家専用)	92,651,450円	91,118,948円
DIAM外国株式パッシブ私募ファンド(適格機関投資家向け)	2,893,521,103円	2,865,678,103円
DIAM先進国株式パッシブファンド(適格機関投資家限定)	161,127,439円	158,341,575円
外国株式パッシブ・ファンド2(適格機関投資家限定)	208,736,068円	206,237,678円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	24,820,525円	20,111,940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)	105,705,416円	82,409,794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)	236,509,944円	202,104,662円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	13,138,864円	10,658,870円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	86,357,971円	68,391,773円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	7,056,458円	5,688,290円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	10,993,104円	7,362,707円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	24,764,555円	21,802,018円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	67,594,843円	58,081,886円

D I A Mバランスファンド2 5 V A (適格機関投資家限定)	580,688,566円	484,016,743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)	717,031,720円	604,294,941円
D I A Mバランスファンド5 0 V A (適格機関投資家限定)	2,245,961,784円	1,938,940,345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)	809,803,654円	684,969,447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)	202,250,282円	110,822,092円
D I A M アクサ グローバ ル バランスファンド3 0 V A (適格機関投資家限定)	963,313,254円	789,140,244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)	353,184,647円	104,542,172円
D I A Mグローバル 私募ファ ンド(適格機関投資家向け)	2,754,975円	2,754,975円
D I A M世界バランスファンド 5 5 V A (適格機関投資家限 定)	79,200,060円	24,066,858円
D I A M世界バランスファンド 3 5 V A (適格機関投資家限 定)	222,757,374円	17,108,371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)	8,270,191,957円	5,096,391,761円
D I A M世界アセットバランス ファンド4 0 V A (適格機関投 資家限定)	443,354,165円	282,718,187円
D I A M世界アセットバランス ファンド2 5 V A (適格機関投 資家限定)	1,417,828,929円	1,227,955,973円
D I A M世界アセットバランス ファンド3 V A (適格機関投資 家限定)	5,420,120,223円	4,705,921,543円
D I A Mバランス3 0 V A (適 格機関投資家限定)	20,095,866円	11,502,672円
D I A Mバランス5 0 V A (適 格機関投資家限定)	896,839円	8,825,591円
D I A Mバランス7 0 V A (適 格機関投資家限定)	10,943,816円	10,114,789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)	7,239,924,939円	6,303,374,003円
D I A Mバランス2 0 V A (適 格機関投資家限定)	62,627,089円	53,919,416円
D I A Mバランス4 0 V A (適 格機関投資家限定)	238,391円	217,282円

	D I A Mバランス60VA(適 格機関投資家限定)	266,917円	248,614円
計		89,487,416,345円	89,733,368,409円
2.	受益権の総数	89,487,416,345口	89,733,368,409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10月12日 至 平成30年4月11日	自 平成30年4月12日 至 平成30年10月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成30年4月11日現在	平成30年10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30年4月11日現在	平成30年10月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
株式	2,449,182,350	3,938,435,381
投資信託受益証券	29,137,034	50,242,662
投資証券	81,195,533	241,340,293
合計	2,338,849,783	4,230,018,336

(注) 「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成30年2月16日から平成30年4月11日まで及び平成30年2月16日から平成30年10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30年4月11日 現在				平成30年10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	36,461,681	-	36,687,280	225,599	359,455,591	-	359,226,120	229,471
アメリカ・ドル	-	-	-	-	253,511,280	-	253,398,810	112,470
イギリス・債券	-	-	-	-	18,254,184	-	18,254,430	246
オーストラリア・ドル	-	-	-	-	4,074,633	-	4,050,390	24,243
カナダ・ドル	672,248	-	679,920	7,672	15,016,662	-	14,979,960	36,702
ユーロ	35,789,433	-	36,007,360	217,927	68,598,832	-	68,542,530	56,302
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・債券	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	1,339,993,422	-	1,340,148,310	296,310	359,455,591	-	359,226,120	229,471

(注) 時価の算定方法

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

株式関連

種類	平成30年4月11日 現在				平成30年10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	7,389,029,845	-	7,475,049,222	86,019,377	12,819,785,070	-	12,273,787,164	545,997,906
合計	7,389,029,845	-	7,475,049,222	86,019,377	12,819,785,070	-	12,273,787,164	545,997,906

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成30年4月11日現在	平成30年10月11日現在
1口当たり純資産額	3.3182円	3.5279円
(1万口当たり純資産額)	(33,182円)	(35,279円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

平成30年10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	30,663	1,755.250	53,821,230.750	
	ABBOTT LABORATORIES	129,962	68.920	8,956,981.040	
	AES CORP	45,579	14.780	673,657.620	
	ABIOMED INC	3,100	376.890	1,168,359.000	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	68,075	142.690	9,713,621.750	
	ADVANCED MICRO DEVICES	68,629	25.000	1,715,725.000	
	ADOBE INC	36,476	237.910	8,678,005.160	
	CHUBB LTD	34,634	132.440	4,586,926.960	
	AGCO CORP	5,610	56.900	319,209.000	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	16,380	160.600	2,630,628.000	
	ALLEGHANY CORP	1,054	622.370	655,977.980	
	RALPH LAUREN CORP	3,497	116.960	409,009.120	
	ALLSTATE CORP	25,754	96.870	2,494,789.980	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	55,523	156.620	8,696,012.260	
	AMGEN INC	49,209	201.200	9,900,850.800	
	HESS CORP	20,421	67.190	1,372,086.990	
	AMERICAN EXPRESS CO	53,581	103.570	5,549,384.170	
	AMERICAN ELECTRIC POWER	36,659	72.700	2,665,109.300	
	AFLAC INC	56,436	46.330	2,614,679.880	
	AMERICAN INTL GROUP	66,725	52.390	3,495,722.750	
	AMERCO	551	337.070	185,725.570	
	ANALOG DEVICES	27,711	83.900	2,324,952.900	
	ANADARKO PETROLEUM CORP	39,893	68.000	2,712,724.000	
	ALEXION PHARMACEUTICALS INC	16,015	123.990	1,985,699.850	
	JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	69,855	34.210	2,389,739.550	
	JONES LANG LASALLE INC	2,818	133.450	376,062.100	
	VALERO ENERGY CORP	32,105	110.840	3,558,518.200	
	APACHE CORP	30,595	46.400	1,419,608.000	
	ANSYS INC	6,519	155.710	1,015,073.490	
	APPLE INC	365,473	216.360	79,073,738.280	
	APPLIED MATERIALS INC	77,970	34.430	2,684,507.100	
	ALBEMARLE CORP	7,904	95.670	756,175.680	
	ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	42,401	50.140	2,125,986.140	
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	7,831	82.690	647,545.390		
AMEREN CORP	17,312	65.940	1,141,553.280		
ARROW ELECTRONICS INC	5,756	68.540	394,516.240		

AUTOLIV INC	6,197	79.920	495,264.240
AUTODESK INC	16,259	133.500	2,170,576.500
AUTOMATIC DATA PROCESSING	33,092	141.780	4,691,783.760
AUTOZONE INC	2,015	778.170	1,568,012.550
AVERY DENNISON CORP	6,262	100.480	629,205.760
AVNET INC	10,288	39.900	410,491.200
BALL CORP	24,324	43.860	1,066,850.640
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	94,579	213.100	20,154,784.900
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	73,749	50.720	3,740,549.280
BAXTER INTERNATIONAL INC	37,776	71.190	2,689,273.440
BECTON DICKINSON & CO	19,749	242.770	4,794,464.730
AMETEK INC	16,775	74.180	1,244,369.500
VERIZON COMM INC	306,879	54.330	16,672,736.070
WR BERKLEY CORP	8,134	77.050	626,724.700
BEST BUY CO INC	19,210	70.780	1,359,683.800
YUM! BRANDS INC	23,738	89.200	2,117,429.600
FIRSTENERGY CORP	35,496	38.050	1,350,622.800
H&R BLOCK INC	16,114	26.610	428,793.540
BOEING CO	41,469	367.470	15,238,613.430
ROBERT HALF INTL INC	8,158	65.930	537,856.940
BORGWARNER INC	14,648	38.580	565,119.840
BOSTON SCIENTIFIC CORP	101,641	36.110	3,670,256.510
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	9,894	92.550	915,689.700
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	8,731	122.250	1,067,364.750
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	1,838	567.400	1,042,881.200
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	121,395	60.770	7,377,174.150
AFFILIATED MANAGERS GROUP INC	3,788	127.250	482,023.000
INGREDION INC	5,305	101.230	537,025.150
ONEOK INC	30,787	67.310	2,072,272.970
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	5,900	109.130	643,867.000
UNITED RENTALS INC	6,332	144.840	917,126.880
SEMPRA ENERGY	18,112	115.460	2,091,211.520
FEDEX CORP	18,964	221.460	4,199,767.440
VERISIGN INC	7,896	140.900	1,112,546.400
AMPHENOL CORP	23,100	86.400	1,995,840.000
BROWN-FORMAN CORP	19,683	47.260	930,218.580
SIRIUS XM HOLDINGS INC	127,092	5.950	756,197.400
CSX CORP	62,392	69.560	4,339,987.520
CABOT OIL & GAS CORP	32,261	24.000	774,264.000
CAMPBELL SOUP CO	14,050	37.720	529,966.000
SEAGATE TECHNOLOGY	20,613	43.660	899,963.580
CONSTELLATION BRANDS INC	12,969	221.610	2,874,060.090

CARDINAL HEALTH INC	22,125	54.220	1,199,617.500
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	31,716	59.060	1,873,146.960
CATERPILLAR INC	44,558	143.720	6,403,875.760
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	9,832	110.180	1,083,289.760
CELGENE CORP	56,186	84.230	4,732,546.780
CITRIX SYSTEMS INC	10,896	104.300	1,136,452.800
CENTURYLINK INC	73,540	20.920	1,538,456.800
CERNER CORP	22,947	62.960	1,444,743.120
JPMORGAN CHASE & CO	254,725	111.470	28,394,195.750
CHURCH & DWIGHT CO INC	18,822	55.960	1,053,279.120
CIGNA CORP	18,009	209.970	3,781,349.730
CINCINNATI FINANCIAL CORP	10,982	76.330	838,256.060
CINTAS CORP	6,282	187.130	1,175,550.660
CISCO SYSTEMS INC	349,354	45.630	15,941,023.020
CLOROX COMPANY	9,331	147.550	1,376,789.050
COCA-COLA CO/THE	298,559	45.680	13,638,175.120
COPART INC	15,900	49.960	794,364.000
COGNEX CORP	11,508	45.610	524,879.880
COLGATE-PALMOLIVE CO	62,296	63.830	3,976,353.680
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	22,744	116.480	2,649,221.120
COMERICA INC	12,068	89.170	1,076,103.560
COMCAST CORP-CL A	345,846	34.280	11,855,600.880
CA INC	22,732	42.830	973,611.560
CONAGRA BRANDS INC	28,323	35.270	998,952.210
CONSOLIDATED EDISON INC	23,350	77.770	1,815,929.500
CMS ENERGY CORP	19,291	50.280	969,951.480
COOPER COS INC	3,794	252.570	958,250.580
MOLSON COORS BREWING CO	13,855	61.310	849,450.050
CORNING INC	61,112	32.320	1,975,139.840
SEALED AIR CORP	13,870	36.130	501,123.100
CUMMINS INC	11,239	147.860	1,661,798.540
DR HORTON INC	24,498	38.270	937,538.460
DANAHER CORP	47,175	103.840	4,898,652.000
MOODY'S CORP	12,963	156.040	2,022,746.520
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	43,966	71.440	3,140,931.040
TARGET CORP	37,486	85.200	3,193,807.200
DEERE & CO	22,801	147.460	3,362,235.460
MORGAN STANLEY	99,843	44.620	4,454,994.660
REPUBLIC SERVICES INC	17,375	71.480	1,241,965.000
COSTAR GROUP INC	2,786	373.240	1,039,846.640
THE WALT DISNEY CO	112,062	112.860	12,647,317.320
DOLLAR TREE INC	17,493	84.230	1,473,435.390
DOVER CORP	10,736	82.760	888,511.360
OMNICOM GROUP	16,993	69.570	1,182,203.010
DTE ENERGY CO	13,122	112.740	1,479,374.280

DUKE ENERGY CORP	52,625	81.880	4,308,935.000
FLOWERVE CORP	8,406	51.080	429,378.480
DARDEN RESTAURANTS INC	9,436	106.960	1,009,274.560
EBAY INC	71,564	31.670	2,266,431.880
BANK OF AMERICA CORP	722,337	29.240	21,121,133.880
CITIGROUP INC	190,608	69.950	13,333,029.600
EASTMAN CHEMICAL CO	10,193	84.240	858,658.320
E*TRADE FINANCIAL CORP	18,740	50.830	952,554.200
EATON CORP PLC	32,234	81.750	2,635,129.500
EATON VANCE CORP	9,184	48.140	442,117.760
CADENCE DESIGN SYS INC	20,877	39.480	824,223.960
DISH NETWORK CORP	16,150	33.050	533,757.500
ECOLAB INC	19,009	150.810	2,866,747.290
ELECTRONIC ARTS INC	23,050	105.150	2,423,707.500
SALESFORCE.COM INC	52,600	137.810	7,248,806.000
EMERSON ELECTRIC CO	47,931	73.350	3,515,738.850
ATMOS ENERGY CORP	8,221	96.020	789,380.420
ENTERGY CORP	13,599	82.950	1,128,037.050
EOG RESOURCES INC	43,300	126.470	5,476,151.000
EQUIFAX INC	8,495	122.290	1,038,853.550
EQT CORP	20,049	45.650	915,236.850
ESTEE LAUDER COS INC/THE	16,134	129.900	2,095,806.600
EXPEDITORS INTERNATIONAL	12,550	68.340	857,667.000
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	41,833	94.870	3,968,696.710
EXXON MOBIL CORP	315,280	84.520	26,647,465.600
FMC CORP	10,614	84.320	894,972.480
NEXTERA ENERGY INC	35,113	172.750	6,065,770.750
ASSURANT INC	4,089	105.500	431,389.500
FASTENAL CO	21,654	51.670	1,118,862.180
FIFTH THIRD BANCORP	52,173	27.960	1,458,757.080
M&T BANK CORP	10,399	165.820	1,724,362.180
FISERV INC	30,704	77.010	2,364,515.040
FLIR SYSTEMS INC	11,623	56.290	654,258.670
MACY'S INC	24,741	32.760	810,515.160
FORD MOTOR CO	278,818	8.820	2,459,174.760
FRANKLIN RESOURCES INC	22,314	29.590	660,271.260
FREEPORT-MCMORAN INC	96,812	12.770	1,236,289.240
FLEX LTD	35,913	11.810	424,132.530
ARTHUR J GALLAGHER & CO	12,176	73.280	892,257.280
GAP INC/THE	18,295	27.030	494,513.850
DENTSPLY SIRONA INC	17,477	35.900	627,424.300
GENERAL DYNAMICS CORP	19,047	197.820	3,767,877.540
GENERAL MILLS INC	44,775	43.940	1,967,413.500
GENUINE PARTS CO	11,759	96.640	1,136,389.760
GILEAD SCIENCES INC	97,302	74.780	7,276,243.560
GARTNER INC	7,153	146.670	1,049,130.510
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	18,097	20.800	376,417.600
MCKESSON CORP	15,054	135.500	2,039,817.000

NVIDIA CORP	42,765	245.690	10,506,932.850
GENERAL ELECTRIC CO	641,549	13.280	8,519,770.720
WW GRAINGER INC	3,832	316.290	1,212,023.280
HALLIBURTON CO	66,065	40.640	2,684,881.600
MONSTER BEVERAGE CORP	32,522	53.900	1,752,935.800
GOLDMAN SACHS GROUP INC	26,624	214.890	5,721,231.360
HARLEY-DAVIDSON INC	12,901	41.160	531,005.160
HARRIS CORP	8,954	160.650	1,438,460.100
HASBRO INC	9,136	98.370	898,708.320
HENRY SCHEIN INC	11,426	86.360	986,749.360
HELMERICH & PAYNE INC	7,213	69.250	499,500.250
HERSHEY FOODS CORP	10,132	103.740	1,051,093.680
HP INC	122,725	24.260	2,977,308.500
F5 NETWORKS INC	4,874	169.190	824,632.060
CROWN HOLDINGS INC NPR	10,472	47.300	495,325.600
UNITED THERAPEUTICS CORP	3,447	123.960	427,290.120
JUNIPER NETWORKS INC	27,740	27.610	765,901.400
HOLLYFRONTIER CORP	12,551	65.880	826,859.880
HOLOGIC INC	19,133	40.560	776,034.480
UNUM GROUP	16,000	39.000	624,000.000
HOME DEPOT INC	85,485	193.700	16,558,444.500
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	12,887	98.440	1,268,596.280
HORMEL FOODS CORP	19,345	40.050	774,767.250
CENTERPOINT ENERGY INC	31,952	27.880	890,821.760
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,337	204.800	478,617.600
HUMANA INC	10,468	328.800	3,441,878.400
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	5,927	113.930	675,263.110
HUNTINGTON BANCSHARES INC	82,761	15.150	1,253,829.150
RED HAT INC	13,147	117.680	1,547,138.960
NEKTAR THERAPEUTICS	12,000	48.630	583,560.000
BIOGEN INC	15,971	337.530	5,390,691.630
IDEX CORP	5,924	140.120	830,070.880
ILLINOIS TOOL WORKS	22,895	133.000	3,045,035.000
INTUIT INC	18,126	204.440	3,705,679.440
IDEXX LABORATORIES INC	6,255	217.210	1,358,648.550
INGERSOLL-RAND PLC	18,874	97.760	1,845,122.240
INTEL CORP	348,219	44.800	15,600,211.200
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	5,578	134.000	747,452.000
INTERNATIONAL PAPER CO	28,375	43.530	1,235,163.750
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	29,157	21.940	639,704.580
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	9,631	74.270	715,294.370
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	5,919	150.040	888,086.760
INCYTE CORP	12,360	63.850	789,186.000
JOHNSON & JOHNSON	198,834	137.730	27,385,406.820

HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	25,530	48.680	1,242,800.400	
KLA-TENCOR CORP	11,724	93.850	1,100,297.400	
DEVON ENERGY CORP	39,484	37.300	1,472,753.200	
KELLOGG CO	18,922	68.730	1,300,509.060	
EAST WEST BANCORP INC	11,000	59.870	658,570.000	
KEYCORP	79,276	19.920	1,579,177.920	
KIMBERLY-CLARK CORP	26,156	112.940	2,954,058.640	
BLACKROCK INC/NEW YORK	8,949	426.760	3,819,075.240	
KOHL'S CORP	11,357	71.730	814,637.610	
KROGER CO	60,317	27.730	1,672,590.410	
LAM RESEARCH CORP	12,122	139.780	1,694,413.160	
PACKAGING CORP OF AMERICA	7,057	88.950	627,720.150	
AKAMA I TECHNOLOGIES	12,622	62.500	788,875.000	
LEGGETT & PLATT INC	9,588	39.940	382,944.720	
LENNAR CORP	21,933	43.720	958,910.760	
JEFFERIES FINANCIAL GROUP INC	21,462	22.230	477,100.260	
ELI LILLY & CO	73,039	113.340	8,278,240.260	
L BRANDS INC	16,262	28.520	463,792.240	
LINCOLN NATIONAL CORP	16,362	68.030	1,113,106.860	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	51,308	116.650	5,985,078.200	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	25,175	66.670	1,678,417.250	
LOCKHEED MARTIN CORP	19,173	336.750	6,456,507.750	
LOEWS CORP	21,346	49.210	1,050,436.660	
LOWE'S COS INC	60,996	106.290	6,483,264.840	
DOMINION ENERGY INC	48,002	73.210	3,514,226.420	
SCANA CORP	10,902	39.950	435,534.900	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	40,298	26.230	1,057,016.540	
MCCORMICK & CO INC	9,307	134.300	1,249,930.100	
MCDONALD'S CORPORATION	58,315	168.370	9,818,496.550	
S&P GLOBAL INC	18,409	182.170	3,353,567.530	
EVEREST RE GROUP LTD	2,855	217.730	621,619.150	
MANPOWERGROUP INC	4,257	77.360	329,321.520	
MARKEL CORPORATION	989	1,159.050	1,146,300.450	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	16,081	140.250	2,255,360.250	
MARSH & MCLENNAN COS	37,853	81.060	3,068,364.180	
MASCO CORP	23,043	33.380	769,175.340	
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	4,387	176.000	772,112.000	
MATTEL INC	24,003	13.910	333,881.730	
METLIFE INC	64,937	46.160	2,997,491.920	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	20,342	50.780	1,032,966.760	
MEDTRONIC PLC	100,647	95.070	9,568,510.290	
ACTIVISION BLIZZARD INC	54,568	73.580	4,015,113.440	
CVS HEALTH CORP	75,876	78.920	5,988,133.920	
MERCK & CO. INC.	201,289	70.450	14,180,810.050	

ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	31,900	16.120	514,228.000
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	7,176	170.460	1,223,220.960
MICROSOFT CORP	542,300	106.160	57,570,568.000
MICRON TECH INC	86,870	41.610	3,614,660.700
MIDDLEBY CORP	4,100	117.600	482,160.000
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	17,529	66.440	1,164,626.760
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	45,086	17.380	783,594.680
3M CO	44,134	202.150	8,921,688.100
MOHAWK INDUSTRIES INC	4,873	159.630	777,876.990
MOTOROLA SOLUTIONS INC	12,062	120.680	1,455,642.160
KANSAS CITY SOUTHERN	7,247	104.470	757,094.090
MYLAN NV	38,244	34.580	1,322,477.520
ILLUMINA INC	11,065	304.760	3,372,169.400
XCEL ENERGY INC	37,554	48.840	1,834,137.360
NATIONAL OILWELL VARCO INC	26,938	42.870	1,154,832.060
NETAPP INC	20,587	75.640	1,557,200.680
NEWFIELD EXPLORATION CO	13,740	26.620	365,758.800
NEWELL BRANDS INC	36,206	18.070	654,242.420
NEWMONT MINING CORP	38,093	30.560	1,164,122.080
NVR INC	236	2,349.290	554,432.440
NIKE INC-CL B	95,097	74.940	7,126,569.180
NOBLE ENERGY INC	36,582	31.260	1,143,553.320
NORDSTROM INC	9,487	60.980	578,517.260
NORFOLK SOUTHERN CORP	21,159	171.600	3,630,884.400
EVERSOURCE ENERGY	23,085	63.040	1,455,278.400
NISOURCE INC	31,548	25.080	791,223.840
TAPESTRY INC	22,269	43.770	974,714.130
NORTHERN TRUST CORP	16,090	101.920	1,639,892.800
NORTHROP GRUMMAN CORP	12,188	309.050	3,766,701.400
WELLS FARGO & CO	344,095	52.430	18,040,900.850
NUCOR CORP	23,780	61.040	1,451,531.200
CHENIERE ENERGY INC	15,927	63.850	1,016,938.950
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	36,024	93.570	3,370,765.680
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	56,876	77.920	4,431,777.920
OLD DOMINION FREIGHT LINE	4,917	139.000	683,463.000
OGE ENERGY CORP	16,028	37.270	597,363.560
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	6,375	336.450	2,144,868.750
ORACLE CORP	227,904	47.400	10,802,649.600
PACCAR INC	26,537	63.850	1,694,387.450
EXELON CORP	69,910	43.560	3,045,279.600
PARKER HANNIFIN CORP	9,885	172.130	1,701,505.050
PAYCHEX INC	23,141	69.510	1,608,530.910
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	6,526	55.920	364,933.920
ALIGN TECHNOLOGY INC	5,854	316.030	1,850,039.620

PPL CORPORATION	52,183	30.450	1,588,972.350
PEPSICO INC	104,692	107.340	11,237,639.280
PENTAIR PLC	11,775	40.480	476,652.000
PFIZER INC	433,636	44.510	19,301,138.360
CONOCOPHILLIPS	87,473	75.090	6,568,347.570
PVH CORP	5,387	124.750	672,028.250
PG&E CORP	38,695	47.650	1,843,816.750
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	12,758	179.300	2,287,509.400
ALTRIA GROUP INC	141,336	62.910	8,891,447.760
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	35,408	136.200	4,822,569.600
POLARIS INDUSTRIES INC	3,845	93.320	358,815.400
GARMIN LTD	7,795	64.600	503,557.000
AETNA INC	23,744	203.410	4,829,767.040
FLUOR CORP (NEW)	9,821	56.220	552,136.620
PPG INDUSTRIES INC	19,079	99.600	1,900,268.400
IPG PHOTONICS CORP	2,441	131.750	321,601.750
PRAXAIR INC	21,319	158.010	3,368,615.190
COSTCO WHOLESALE CORP	32,871	221.050	7,266,134.550
T ROWE PRICE GROUP INC	18,363	101.550	1,864,762.650
QUEST DIAGNOSTICS	10,378	103.390	1,072,981.420
PROCTER & GAMBLE CO	186,535	81.440	15,191,410.400
PROGRESSIVE CORP	43,996	68.520	3,014,605.920
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	37,115	54.530	2,023,880.950
PULTE GROUP INC	21,209	23.570	499,896.130
NEW YORK COMMUNITY BANCORP INC	30,388	10.510	319,377.880
GLOBAL PAYMENTS INC	11,769	113.110	1,331,191.590
QUALCOMM INC	104,477	66.730	6,971,750.210
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	10,187	90.030	917,135.610
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	2,550	135.720	346,086.000
REGENERON PHARMACEUTICALS	5,659	381.940	2,161,398.460
REINSURANCE GROUP OF AMERICA INC	4,642	141.700	657,771.400
RESMED INC	10,594	103.160	1,092,877.040
US BANCORP	116,678	53.330	6,222,437.740
SEATTLE GENETICS INC /WA	7,317	71.560	523,604.520
ARCH CAPITAL GROUP LTD	31,422	28.090	882,643.980
ROSS STORES INC	28,189	95.020	2,678,518.780
ROLLINS INC	8,252	56.630	467,310.760
ROPER TECHNOLOGIES INC	7,723	280.540	2,166,610.420
ROCKWELL AUTOMATION INC	9,567	176.030	1,684,079.010
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	12,293	118.740	1,459,670.820
RAYTHEON COMPANY	21,317	197.600	4,212,239.200

ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	3,848	220.700	849,253.600	
ACCENTURE PLC-CL A	47,780	161.740	7,727,937.200	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	111,556	42.270	4,715,472.120	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	9,849	139.440	1,373,344.560	
ROCKWELL COLLINS INC	12,086	133.540	1,613,964.440	
THE TRAVELERS COMPANIES INC	19,755	128.170	2,531,998.350	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	24,562	102.830	2,525,710.460	
BOOKING HOLDINGS INC	3,571	1,788.740	6,387,590.540	
SCHLUMBERGER LTD	103,099	60.820	6,270,481.180	
SCHWAB (CHARLES) CORP	90,105	49.590	4,468,306.950	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	15,475	123.600	1,912,710.000	
BUNGE LTD	10,334	67.450	697,028.300	
SEI INVESTMENTS CO	9,315	56.050	522,105.750	
ANTHEM INC	19,325	272.650	5,268,961.250	
AMERISOURCEBERGEN CORP	12,257	90.840	1,113,425.880	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	21,442	58.660	1,257,787.720	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	6,319	414.790	2,621,058.010	
CENTENE CORP	15,113	141.950	2,145,290.350	
SVB FINANCIAL GROUP	4,107	301.140	1,236,781.980	
IAC INTERACTIVE CORP	5,766	191.660	1,105,111.560	
SMITH (A.O.) CORP	9,565	48.490	463,806.850	
ACUITY BRANDS INC	3,087	121.260	374,329.620	
SNAP-ON INC	3,932	170.440	670,170.080	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	31,808	102.790	3,269,544.320	
ADVANCE AUTO PARTS	5,273	163.170	860,395.410	
EDISON INTERNATIONAL	24,600	70.080	1,723,968.000	
SOUTHERN CO	75,642	43.940	3,323,709.480	
BB&T CORP	59,388	48.730	2,893,977.240	
SOUTHWEST AIRLINES	11,352	57.330	650,810.160	
AT&T INC	540,606	32.850	17,758,907.100	
CHEVRON CORP	141,261	122.600	17,318,598.600	
STANLEY BLACK & DECKER INC	11,629	130.230	1,514,444.670	
STATE STREET CORP	27,099	82.870	2,245,694.130	
STARBUCKS CORP	104,312	56.010	5,842,515.120	
STEEL DYNAMICS INC	19,030	43.360	825,140.800	
STRYKER CORP	25,320	171.150	4,333,518.000	
NETFLIX INC	32,015	325.890	10,433,368.350	
STERICYCLE INC	6,853	54.010	370,130.530	
SUNTRUST BANKS INC	34,756	65.440	2,274,432.640	
SYMANTEC CORP	47,004	19.900	935,379.600	
KNIGHT SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	9,793	31.690	310,340.170	

SYNOPSYS INC	10,656	86.810	925,047.360
SYSCO CORP	35,926	70.410	2,529,549.660
INTUITIVE SURGICAL INC	8,408	512.210	4,306,661.680
TELEFLEX INC	3,203	248.000	794,344.000
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	71,553	21.080	1,508,337.240
TEXAS INSTRUMENTS INC	73,391	99.240	7,283,322.840
TEXTRON INC	19,076	67.380	1,285,340.880
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	30,141	230.660	6,952,323.060
TIFFANY & CO	8,733	110.380	963,948.540
TOLL BROTHERS INC	9,526	31.420	299,306.920
TORCHMARK CORP	7,699	87.360	672,584.640
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	11,279	91.360	1,030,449.440
DAVITA INC	10,878	73.010	794,202.780
TRACTOR SUPPLY CO	9,276	84.820	786,790.320
TRIMBLE INC	20,073	39.040	783,649.920
TYSON FOODS INC	21,621	61.270	1,324,718.670
UGI CORP	12,068	55.250	666,757.000
MARATHON OIL CORP	64,347	21.160	1,361,582.520
UNION PACIFIC CORP	57,263	154.460	8,844,842.980
UNITED TECHNOLOGIES CORP	56,111	131.120	7,357,274.320
UNITEDHEALTH GROUP INC	71,700	263.080	18,862,836.000
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	6,351	125.860	799,336.860
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	6,848	104.630	716,506.240
VF CORP	24,309	86.240	2,096,408.160
CBS CORP	27,376	55.530	1,520,189.280
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	19,280	176.430	3,401,570.400
VULCAN MATERIALS CO	10,136	105.250	1,066,814.000
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	63,286	72.310	4,576,210.660
WALMART INC	109,762	95.760	10,510,809.120
WASTE MANAGEMENT INC	32,216	90.300	2,909,104.800
WATERS CORP	5,963	177.480	1,058,313.240
ALLERGAN PLC	25,196	187.140	4,715,179.440
JM SMUCKER CO/THE-NEW	8,855	103.540	916,846.700
VAIL RESORTS INC	3,098	238.850	739,957.300
WESTERN DIGITAL CORP	22,254	54.150	1,205,054.100
WABTEC CORP	5,497	99.540	547,171.380
WHIRLPOOL CORP	5,553	104.970	582,898.410
SKYWORKS SOLUTIONS INC	13,529	84.800	1,147,259.200
WYNN RESORTS LTD	7,179	115.110	826,374.690
NASDAQ INC	9,132	81.970	748,550.040
CME GROUP INC	25,415	180.250	4,581,053.750
WILLIAMS COS INC	89,081	27.200	2,423,003.200
LKQ CORP	22,948	28.590	656,083.320

ALLIANT ENERGY CORP	16,383	43.910	719,377.530	
WEC ENERGY GROUP INC	23,117	68.880	1,592,298.960	
TD AMERITRADE HOLDING CORP	21,581	50.800	1,096,314.800	
CARMAX INC	13,513	68.610	927,126.930	
XEROX CORP	17,455	25.520	445,451.600	
XILINX INC	19,197	74.480	1,429,792.560	
CIMAREX ENERGY CO	7,003	97.080	679,851.240	
TJX COMPANIES INC	47,171	108.640	5,124,657.440	
ZIONS BANCORP NA	16,584	50.820	842,798.880	
DAIRY FARM INTERNATIONAL HLDNGS	27,400	8.860	242,764.000	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	76,400	6.300	481,320.000	
JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	15,700	60.200	945,140.000	
JARDINE STRATEGIC HOLDINGS LTD	17,100	35.330	604,143.000	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	6,051	80.990	490,070.490	
SIGNATURE BANK	4,171	115.530	481,875.630	
CBRE GROUP INC	24,276	40.010	971,282.760	
LIBERTY GLOBAL PLC	12,435	25.170	312,988.950	
REGIONS FINANCIAL CORP	84,486	18.270	1,543,559.220	
DOMINO'S PIZZA INC	3,256	274.920	895,139.520	
WESTLAKE CHEMICAL CORP	3,000	80.270	240,810.000	
T-MOBILE US INC	25,388	66.630	1,691,602.440	
LAS VEGAS SANDS CORP	30,271	56.330	1,705,165.430	
MOSAIC CO/THE	26,525	32.310	857,022.750	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX NEWS	32,515	44.400	1,443,666.000	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC	78,440	44.620	3,499,992.800	
CELANESE CORP	9,491	100.490	953,750.590	
DISCOVERY INC-A	10,423	32.060	334,161.380	
EXPEDIA GROUP INC	8,709	116.760	1,016,862.840	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	18,475	50.340	930,031.500	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	10,578	143.540	1,518,366.120	
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	41,818	24.600	1,028,722.800	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	43,585	74.130	3,230,956.050	
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	14,696	18.260	268,348.960	
VIACOM INC-CLASS B	24,612	31.950	786,353.400	
LIVE NATION	8,864	49.580	439,477.120	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,807	434.210	784,617.470	

UNITED CONTINENTAL HOLIDINGS INC	6,191	78.930	488,655.630	
TRANSDIGM GROUP INC	3,812	340.060	1,296,308.720	
MASTERCARD INC	69,052	196.690	13,581,837.880	
QURATE RETAIL INC	35,733	20.780	742,531.740	
HANESBRANDS INC	27,619	16.640	459,580.160	
WESTERN UNION CO	35,222	17.760	625,542.720	
OWENS CORNING	7,333	52.730	386,669.090	
LEIDOS HOLDINGS INC	9,322	66.030	615,531.660	
AERCAP HOLDINGS NV	11,586	54.150	627,381.900	
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLDINGS INC	9,175	84.790	777,948.250	
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT-ADR	18,099	18.180	329,039.820	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	8,330	118.850	990,020.500	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	22,746	16.970	385,999.620	
DELTA AIR LINES INC	13,898	49.710	690,869.580	
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	6,354	61.400	390,135.600	
DISCOVER FINANCIAL	25,202	75.520	1,903,255.040	
TE CONNECTIVITY LTD	26,204	80.880	2,119,379.520	
CONCHO RESOURCES INC/MIDLAND TX	14,552	153.160	2,228,784.320	
WABCO HOLDING INC	4,076	112.030	456,634.280	
LULULEMON ATHLETICA INC	7,883	140.680	1,108,980.440	
VMWARE INC	5,491	143.320	786,970.120	
MERCADOLIBRE INC	3,215	319.070	1,025,810.050	
ULTA BEAUTY INC	4,332	268.130	1,161,539.160	
INVESCO LTD	29,824	21.140	630,479.360	
MSCI INC	6,462	156.840	1,013,500.080	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	114,627	84.620	9,699,736.740	
VISA INC	134,179	135.520	18,183,938.080	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	13,492	90.490	1,220,891.080	
DISCOVERY INC-C	23,054	29.340	676,404.360	
MARATHON PETROLEUM CORP	53,981	80.650	4,353,567.650	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	11,624	49.140	571,203.360	
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	147,783	18.000	2,660,094.000	
XYLEM INC	12,873	72.140	928,658.220	
ALKERMES PLC	12,053	42.530	512,614.090	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	24,984	97.620	2,438,938.080	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,479	247.910	862,478.890	

SPLUNK INC	10,674	98.450	1,050,855.300
HCA HEALTHCARE INC	21,696	135.090	2,930,912.640
VERISK ANALYTICS INC	11,859	115.110	1,365,089.490
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	3,987	162.000	645,894.000
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	6,544	205.280	1,343,352.320
FIRST REPUBLIC BANK/SAN FRANCISCO CA	11,868	92.880	1,102,299.840
CIT GROUP INC	9,287	50.210	466,300.270
NXP SEMICONDUCTOR NV	25,955	78.160	2,028,642.800
TARGA RESOURCES CORP	16,445	56.830	934,569.350
LEAR CORP	5,132	135.060	693,127.920
CBOE GLOBAL MARKETS INC	8,640	101.960	880,934.400
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	17,000	51.300	872,100.000
DOLLAR GENERAL CORP	19,686	105.580	2,078,447.880
FORTINET INC	11,399	79.570	907,018.430
AON PLC	18,487	151.140	2,794,125.180
TESLA INC	9,463	256.880	2,430,855.440
GENERAL MOTORS CO	95,770	32.600	3,122,102.000
WORLDPAY INC	21,000	91.740	1,926,540.000
XPO LOGISTICS INC	9,000	102.240	920,160.000
TRIPADVISOR INC	9,263	44.200	409,424.600
ALLY FINANCIAL INC	31,409	26.280	825,428.520
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	12,138	62.270	755,833.260
VOYA FINANCIAL INC	13,525	49.450	668,811.250
APTIV PLC	19,069	75.630	1,442,188.470
PHILLIPS 66	32,776	113.050	3,705,326.800
FACEBOOK INC	178,452	151.380	27,014,063.760
IQVIA HOLDINGS INC	11,751	122.810	1,443,140.310
DIAMONDBACK ENERGY INC	7,054	129.280	911,941.120
SERVICENOW INC	12,906	172.140	2,221,638.840
PALO ALTO NETWORKS INC	7,006	202.380	1,417,874.280
WORKDAY INC	10,417	124.300	1,294,833.100
ABBVIE INC	112,000	93.080	10,424,960.000
ZOETIS INC	36,976	89.630	3,314,158.880
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDINGS LTD	16,470	52.110	858,251.700
COTY INC	38,541	11.470	442,065.270
NEWS CORP/NEW-CL A	30,263	12.770	386,458.510
HD SUPPLY HOLDINGS INC	12,891	39.480	508,936.680
CDW CORP	10,824	81.350	880,532.400
SPRINT CORP	63,882	6.230	397,984.860
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	10,199	31.610	322,390.390
ARCONIC INC	27,513	21.750	598,407.750
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	13,175	33.380	439,781.500
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	5,006	40.830	204,394.980
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-C	13,368	40.850	546,082.800

DELL TECHNOLOGIES INC	15,074	92.470	1,393,892.780
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	15,410	16.810	259,042.100
BAKER HUGHES A GE CO	31,904	31.920	1,018,375.680
TECHNIPFMC LTD	32,556	30.370	988,725.720
BROADCOM INC	30,394	231.830	7,046,241.020
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	6,291	44.950	282,780.450
ANTERO RESOURCES CORP	13,163	19.170	252,334.710
VEEVA SYSTEMS INC	9,087	89.390	812,286.930
TWITTER INC	51,498	26.790	1,379,631.420
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING PLC	11,392	45.270	515,715.840
EVERGY INC	21,000	56.110	1,178,310.000
PLAINS GP HOLDINGS LP	7,837	24.050	188,479.850
COMMScope HOLDING CO INC	12,920	25.860	334,111.200
ALLEGION PLC	7,325	84.560	619,402.000
PERRIGO CO PLC	10,553	72.880	769,102.640
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	20,000	73.400	1,468,000.000
ARAMARK	17,307	40.330	697,991.310
SABRE CORP	17,624	23.060	406,409.440
PARSLEY ENERGY INC	17,454	29.630	517,162.020
ARISTA NETWORKS INC	3,748	225.790	846,260.920
IHS MARKIT LTD	30,253	51.140	1,547,138.420
FNF GROUP	20,660	37.990	784,873.400
SYNCHRONY FINANCIAL	53,885	30.520	1,644,570.200
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	34,845	38.160	1,329,685.200
CDK GLOBAL INC	8,309	57.140	474,776.260
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	14,300	61.390	877,877.000
QORVO INC	8,784	70.290	617,427.360
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	16,089	31.540	507,447.060
LIBERTY BROADBAND CORP-C W/I	7,818	79.740	623,407.320
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	14,710	26.760	393,639.600
GODADDY INC	11,400	70.790	807,006.000
NIELSEN HOLDINGS PLC	26,840	26.310	706,160.400
TRANSUNION	13,841	68.330	945,755.530
SQUARE INC	20,423	77.450	1,581,761.350
DOWDUPONT INC	173,668	59.320	10,301,985.760
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS PLC	17,100	43.060	736,326.000
WESTROCK CO	17,744	43.630	774,170.720
KRAFT HEINZ CO	46,854	55.740	2,611,641.960
FORTIVE CORP	23,630	80.220	1,895,598.600
WASTE CONNECTIONS INC	18,879	75.510	1,425,553.290
ALPHABET INC-CL A	22,200	1,092.160	24,245,952.000
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	113,242	15.110	1,711,086.620

	PAYPAL HOLDINGS INC	83,973	75.450	6,335,762.850	
	FIRST DATA CORP	35,404	22.530	797,652.120	
	DXC TECHNOLOGY CO	21,351	86.900	1,855,401.900	
	ZILLOW GROUP INC-C	8,134	38.340	311,857.560	
	ALPHABET INC-CL C	23,300	1,081.220	25,192,426.000	
	L3 TECHNOLOGIES INC	5,892	201.630	1,188,003.960	
	CHEMOURS CO	12,723	35.680	453,956.640	
	ATHENE HOLDING LTD	11,784	50.490	594,974.160	
	CHARTER COMMUNICATIONS INC	12,506	310.130	3,878,485.780	
	VISTRA ENERGY CORP	30,000	24.900	747,000.000	
アメリカ・ドル 小計		22,730,381		1,792,012,194.790 (201,350,490,207)	
イギリス・ポンド	ANTOFAGASTA PLC	25,905	7.796	201,955.380	
	ASHTREAD GROUP	35,233	20.540	723,685.820	
	SEVERN TRENT PLC	14,897	18.780	279,765.660	
	BHP BILLITON PLC	153,323	15.734	2,412,384.080	
	BARCLAYS PLC	1,292,957	1.716	2,218,714.210	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	64,682	5.552	359,114.460	
	BT GROUP PLC	638,910	2.370	1,514,216.700	
	SKY PLC	72,210	17.260	1,246,344.600	
	BUNZL PLC	26,515	21.940	581,739.100	
	EASYJET PLC	13,628	11.975	163,195.300	
	AVIVA PLC	303,368	4.499	1,364,852.630	
	CRODA INTERNATIONAL	10,645	46.120	490,947.400	
	DIAGEO PLC	183,390	26.000	4,768,140.000	
	SCHRODERS PLC	10,932	30.050	328,506.600	
	DCC PLC	5,936	63.650	377,826.400	
	NATIONAL GRID PLC	253,078	8.078	2,044,364.080	
	KINGFISHER PLC	165,680	2.611	432,590.480	
	BAE SYSTEMS PLC	225,176	5.904	1,329,439.100	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	169,676	34.500	5,853,822.000	
	NEXT PLC	9,731	55.020	535,399.620	
	IMPERIAL BRANDS PLC	72,328	26.815	1,939,475.320	
	JOHNSON MATTHEY PLC	15,017	31.810	477,690.770	
	ANGLO AMERICAN PLC	79,906	16.346	1,306,143.470	
	COMPASS GROUP PLC	115,111	15.430	1,776,162.730	
	HSBC HOLDINGS PLC	1,488,734	6.535	9,728,876.690	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	423,649	2.545	1,078,186.700	
	CENTRICA PLC	392,766	1.526	599,360.910	
	UNILEVER PLC	91,931	40.360	3,710,335.160	
	MEGGITT PLC	62,181	5.106	317,496.180	
	MORRISON <WM.> SUPERMARKETS	155,682	2.466	383,911.810	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	54,487	7.214	393,069.210		
RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	80,864	5.622	454,617.400		

ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	25,308	23.200	587,145.600	
PEARSON PLC	65,009	7.874	511,880.860	
PERSIMMON PLC	23,150	22.610	523,421.500	
PRUDENTIAL PLC	193,029	16.460	3,177,257.340	
RIO TINTO PLC	90,035	36.460	3,282,676.100	
VODAFONE GROUP PLC	1,993,578	1.530	3,050,174.340	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	50,208	65.910	3,309,209.280	
RELX PLC	147,464	14.915	2,199,425.560	
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	116,966	8.862	1,036,552.690	
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	330,000	2.489	821,370.000	
ST JAMES'S PLACE PLC	40,884	10.840	443,182.560	
TRAVIS PERKINS PLC	20,357	9.950	202,552.150	
SSE PLC	73,043	11.370	830,498.910	
BP PLC	1,481,204	5.692	8,431,013.160	
SHIRE PLC	67,647	43.540	2,945,350.380	
SAGE GROUP PLC(THE)	85,271	5.562	474,277.300	
SMITHS GROUP PLC	31,720	14.035	445,190.200	
STANDARD CHARTERED PLC	210,236	5.822	1,223,993.990	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	5,397,548	0.591	3,189,950.860	
TAYLOR WIMPLEY PLC	253,022	1.650	417,486.300	
TESCO PLC	740,567	2.162	1,601,105.850	
3I GROUP PLC	66,784	8.926	596,113.980	
SMITH & NEPHEW PLC	66,155	13.065	864,315.070	
GLAXOSMITHKLINE PLC	369,384	14.836	5,480,181.020	
WEIR GROUP	18,336	15.940	292,275.840	
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	21,888	41.600	910,540.800	
BABCOCK INT'L GROUP	21,302	6.684	142,382.560	
WPP PLC	90,628	10.760	975,157.280	
FERGUSON PLC	17,278	54.690	944,933.820	
ASTRAZENECA PLC	94,694	57.020	5,399,451.880	
WHITBREAD PLC	12,159	46.320	563,204.880	
CARNIVAL PLC	13,153	44.230	581,757.190	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	120,290	2.958	355,817.820	
JOHN WOOD GROUP PLC	48,988	7.586	371,622.960	
INTERTEK GROUP PLC	11,273	44.100	497,139.300	
BURBERRY GROUP PLC	29,893	17.280	516,551.040	
INVESTEC PLC	50,655	4.867	246,537.880	
INTERCONTINENTAL HOTELS	12,362	43.130	533,173.060	
ITV PLC	247,210	1.599	395,288.790	
SAINSBURY (J) PLC	137,215	3.115	427,424.720	
RANDGOLD RESOURCES LTD NPR	6,998	52.660	368,514.680	
G4S PLC	122,250	2.226	272,128.500	
ADMIRAL GROUP PLC	15,893	20.030	318,336.790	
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	10,726	34.400	368,974.400	

	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	341,563	25.620	8,750,844.060	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	279,650	25.990	7,268,103.500	
	TUI AG-DI	30,153	13.650	411,588.450	
	STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	184,183	2.888	531,920.500	
	EXPERIAN PLC	71,068	17.650	1,254,350.200	
	MONDI PLC	28,318	17.755	502,786.090	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	21,290	19.480	414,729.200	
	FRESNILLO PLC NPR	15,639	7.722	120,764.350	
	INFORMA PLC	102,475	7.210	738,844.750	
	GLENCORE PLC	861,237	3.118	2,685,336.960	
	GVC HOLDINGS PLC	36,000	8.955	322,380.000	
	NMC HEALTH PLC	8,149	31.380	255,715.620	
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP PLC	112,694	3.295	371,326.730	
	MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	30,616	4.459	136,516.740	
	COCA-COLA HBC AG	13,406	22.940	307,533.640	
	CONVATEC GROUP PLC	118,400	2.260	267,584.000	
	ROYAL MAIL PLC	55,060	3.453	190,122.180	
	MERLIN ENTERTAINMENTS PLC	50,037	3.787	189,490.110	
	MICRO FOCUS INTERNATIONAL PLC	32,342	13.500	436,617.000	
	AUTO TRADER GROUP PLC	76,348	4.000	305,392.000	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	335,000	1.741	583,235.000	
イギリス・ポンド	小計	22,553,916		135,563,050.240 (20,121,623,546)	
イスラエル・シュケル	BANK HAPOALIM BM	78,428	25.840	2,026,579.520	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	103,061	23.540	2,426,055.940	
	BEZEQ ISRAELI TELECOMMUNICATION CORP LTD	188,230	4.099	771,554.770	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,760	444.500	782,320.000	
	FRUTAROM INDUSTRIES LTD	2,600	381.000	990,600.000	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	49,411	22.430	1,108,288.730	
	NICE LTD	4,035	383.900	1,549,036.500	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	10,444	63.210	660,165.240	
	AZRIELI GROUP	4,428	180.900	801,025.200	
イスラエル・シュケル	小計	442,397		11,115,625.900 (343,917,465)	
オーストラリア・ドル	RAMSAY HEALTH CARE LTD	11,115	54.330	603,877.950	
	AUST AND NZ BANKING GROUP LT	218,921	26.880	5,884,596.480	
	AMCOR LTD	80,741	13.120	1,059,321.920	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	253,113	26.980	6,828,988.740	

BANK OF QUEENSLAND LTD	30,569	10.560	322,808.640
FORTESCUE METALS GROUP LTD	114,125	3.670	418,838.750
TELSTRA CORP LTD	272,919	3.210	876,069.990
BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD	39,014	10.230	399,113.220
AMP LTD	200,498	3.050	611,518.900
ASX LTD	15,573	60.000	934,380.000
BHP BILLITON LTD	239,570	34.720	8,317,870.400
CALTEX AUSTRALIA LTD	20,946	29.950	627,332.700
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	22,182	3.620	80,298.840
COMPUTERSHARE LT	38,040	20.330	773,353.200
CSL LIMITED	34,057	191.800	6,532,132.600
REA GROUP LTD	4,119	80.430	331,291.170
TRANSURBAN GROUP	167,883	10.950	1,838,318.850
COCA-COLA AMATIL LTD	48,601	10.060	488,926.060
COCHLEAR LTD	3,992	198.120	790,895.040
ORIGIN ENERGY LTD	121,721	8.480	1,032,194.080
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	129,233	68.970	8,913,200.010
BORAL LIMITED	86,101	6.600	568,266.600
RIO TINTO LIMITED	30,902	79.170	2,446,511.340
APA GROUP	77,562	9.860	764,761.320
ARISTOCRAT LEISU	43,933	27.930	1,227,048.690
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	171,471	7.110	1,219,158.810
TPG TELECOM LTD	28,719	7.920	227,454.480
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	3,275	53.400	174,885.000
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	28,489	19.710	561,518.190
ORICA LTD	25,308	16.760	424,162.080
CIMIC GROUP LTD	8,709	48.570	422,996.130
BLUESCOPE STEEL LTD	36,941	15.410	569,260.810
SYDNEY AIRPORT	85,130	6.650	566,114.500
MACQUARIE GROUP LTD	24,250	122.910	2,980,567.500
SUNCORP GROUP LTD	93,181	14.010	1,305,465.810
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	202,508	26.680	5,402,913.440
NEWCREST MINING LTD	59,818	19.310	1,155,085.580
OIL SEARCH LTD	93,715	8.890	833,126.350
INCITEC PIVOT LTD	136,426	4.060	553,889.560
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	95,390	11.560	1,102,708.400
CHALLENGER FINANCIAL SERVICES	45,707	10.910	498,663.370
SANTOS LTD	133,862	7.380	987,901.560
SONIC HEALTHCARE	26,192	24.550	643,013.600

	TABCORP HOLDINGS LTD	126,348	4.760	601,416.480	
	WESFARMERS LTD	84,335	48.950	4,128,198.250	
	ALUMINA LIMITED	184,613	2.750	507,685.750	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	68,074	38.030	2,588,854.220	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	99,142	28.120	2,787,873.040	
	SEEK LTD	25,899	20.510	531,188.490	
	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES LTD	4,581	52.340	239,769.540	
	AUSNET SERVICES	165,066	1.645	271,533.570	
	AGL ENERGY LTD	46,315	19.330	895,268.950	
	BRAMBLES LTD	115,255	10.600	1,221,703.000	
	CROWN RESORTS LTD	32,861	13.250	435,408.250	
	AURIZON HOLDINGS LTD	139,184	4.090	569,262.560	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	50,789	17.130	870,015.570	
	HEALTHSCOPE LTD	149,047	2.090	311,508.230	
	MEDIBANK PVT LTD	177,176	2.840	503,179.840	
	SOUTH32 LTD(AUD)	367,057	3.930	1,442,534.010	
オーストラリア・ドル 小計		5,440,263		90,206,200.410 (7,165,980,561)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	16,141	45.290	731,025.890	
	ALIMENTATION COUCHE TARD INC	30,728	61.040	1,875,637.120	
	BARRICK GOLD CORP	83,648	15.010	1,255,556.480	
	ATCO LTD	7,193	35.610	256,142.730	
	BANK OF MONTREAL	47,406	104.740	4,965,304.440	
	BANK OF NOVA SCOTIA	87,876	73.830	6,487,885.080	
	NATIONAL BANK OF CANADA	23,756	62.530	1,485,462.680	
	BCE INC	11,568	51.400	594,595.200	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT	63,537	54.960	3,491,993.520	
	BAUSCH HEALTH COS INC	25,819	31.780	820,527.820	
	BOMBARDIER INC 'B'	151,615	3.950	598,879.250	
	SAPUTO INC	18,601	38.470	715,580.470	
	BLACKBERRY LTD	39,652	12.080	478,996.160	
	CGI GROUP INC	19,367	77.390	1,498,812.130	
	CCL INDUSTRIES INC	11,340	54.930	622,906.200	
	CAE INC	23,000	24.730	568,790.000	
	CAMECO CORP	32,627	15.270	498,214.290	
	ROGERS COMM-CL B	25,967	65.260	1,694,606.420	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	32,680	118.540	3,873,887.200	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	91,420	39.120	3,576,350.400	
	CANADIAN TIRE CORP-CL A	4,862	148.650	722,736.300	
	CANADIAN UTILITIES LTD	9,119	29.590	269,831.210	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	54,813	111.850	6,130,834.050	
	FIRST CAPITAL REALTY INC	11,417	19.010	217,037.170	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	13,930	37.000	515,410.000		
OPEN TEXT CORP	19,756	44.600	881,117.600		

EMPIRE CO LTD	15,093	23.050	347,893.650
KINROSS GOLD CORP	99,741	3.710	370,039.110
FINNING INTERNATIONAL INC	9,892	31.600	312,587.200
FORTIS INC	33,302	41.440	1,380,034.880
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	55,296	14.370	794,603.520
TELUS CORP	15,945	44.710	712,900.950
GREAT WEST LIFECO INC	19,248	30.830	593,415.840
IMPERIAL OIL LTD	21,542	42.830	922,643.860
ENBRIDGE INC	125,330	42.610	5,340,311.300
IGM FINANCIAL INC	8,426	33.020	278,226.520
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	87,995	2.550	224,387.250
MANULIFE FINANCIAL CORP	145,162	20.970	3,044,047.140
LINAMAR CORP	3,827	55.100	210,867.700
LOBLAW CO LTD	15,354	63.250	971,140.500
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANCE AND FINANCIAL SERVICES INC	6,524	49.060	320,067.440
MAGNA INTERNATIONAL INC	25,339	61.950	1,569,751.050
SUN LIFE FINANCIAL INC	45,976	49.820	2,290,524.320
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,985	672.670	1,335,249.950
METRO INC	19,226	40.100	770,962.600
HUSKY ENERGY INC	28,749	20.450	587,917.050
CRESCENT POINT ENERGY CORP	39,992	7.640	305,538.880
EMERA INC	6,509	38.460	250,336.140
METHANEX CORP	5,281	97.280	513,735.680
ONEX CORP	6,646	85.780	570,093.880
GOLDCORP INC	66,602	13.200	879,146.400
POWER CORP OF CANADA	25,052	27.570	690,683.640
POWER FINANCIAL CORP	17,484	29.200	510,532.800
ROYAL BANK OF CANADA	106,200	100.700	10,694,340.000
SNC-LAVALIN GROUP INC	13,134	44.860	589,191.240
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	10,607	269.660	2,860,283.620
SHAW COMM INC-B	35,748	24.230	866,174.040
SUNCOR ENERGY INC	122,908	48.800	5,997,910.400
LUNDIN MINING CORP	35,268	6.070	214,076.760
ENCANA CORP	69,257	15.300	1,059,632.100
TECK RESOURCES LTD-CL B	41,016	29.400	1,205,870.400
THOMSON REUTERS CORP	20,469	58.670	1,200,916.230
TORONTO DOMINION BANK (THE) C\$	136,076	75.650	10,294,149.400
TRANSCANADA CORP	68,885	52.600	3,623,351.000
WEST FRASER TIMBER CO LTD	5,696	66.180	376,961.280
WESTON (GEORGE) LTD	3,105	91.570	284,324.850
INTACT FINANCIAL CORP	10,785	105.080	1,133,287.800

	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	33,943	22.520	764,396.360	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,494	879.900	1,314,570.600	
	FRANCO-NEVADA CORP NPR	14,687	80.660	1,184,653.420	
	CI FINANCIAL CORP	20,695	19.150	396,309.250	
	TOURMALINE OIL CORP	15,779	22.300	351,871.700	
	KEYERA CORP	13,728	34.510	473,753.280	
	ALTAGAS LTD	23,944	21.520	515,274.880	
	PEMBINA PIPELINE CORP	38,497	44.110	1,698,102.670	
	DOLLARAMA INC	22,512	37.580	846,000.960	
	CENOVUS ENERGY INC W/I	80,545	12.110	975,399.950	
	VERMILION ENERGY INC	12,923	40.840	527,775.320	
	ARC RESOURCES LTD	22,997	14.300	328,857.100	
	INTER PIPELINE LTD	24,083	21.990	529,585.170	
	NUTRIEN LTD	45,351	71.640	3,248,945.640	
	WSP GLOBAL INC	8,400	65.750	552,300.000	
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	14,961	22.190	331,984.590	
	SEVEN GENERATIONS ENERGY LTD	17,231	15.850	273,111.350	
	RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	17,753	73.800	1,310,171.400	
	AURORA CANNABIS INC	50,000	13.130	656,500.000	
	SHOPIFY INC	6,500	169.990	1,104,935.000	
	HYDRO ONE LTD	27,340	19.290	527,388.600	
	カナダ・ドル 小計	3,101,873		129,238,115.420 (11,128,694,118)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE TECH ENG	125,000	3.490	436,250.000	
	SEBACORP INDUSTRIES	81,400	2.950	240,130.000	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	123,700	2.710	335,227.000	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	692,140	0.255	176,495.700	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	134,800	24.950	3,363,260.000	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	29,000	8.450	245,050.000	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	5,944	29.030	172,554.320	
	SINGAPORE AIRPORT TERMINAL SERVICES LTD	42,300	4.920	208,116.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	68,900	7.010	482,989.000	
	CAPITALAND LTD	192,415	3.190	613,803.850	
	GENTING SINGAPORE LTD	416,400	1.000	416,400.000	
	KEPPEL CORP LTD	98,400	6.980	686,832.000	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	177,900	2.250	400,275.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	225,453	10.950	2,468,710.350	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	591,922	3.140	1,858,635.080	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	47,500	9.500	451,250.000	

	UNITED OVERSEAS BANK LTD	94,500	25.880	2,445,660.000	
	UOL GROUP LIMITED	40,500	6.440	260,820.000	
	VENTURE CORP LTD	21,000	16.740	351,540.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	142,300	3.140	446,822.000	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	188,800	1.250	236,000.000	
シンガポール・ドル	小計	3,540,274		16,296,820.300 (1,323,953,681)	
スイス・フラン	CREDIT SUISSE GROUP AG	187,381	13.840	2,593,353.040	
	NESTLE SA-REGISTERED	231,295	80.740	18,674,758.300	
	CIE FINANC RICHEMONT	39,186	73.340	2,873,901.240	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	52,431	243.900	12,787,920.900	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2,835	228.600	648,081.000	
	SIKA INHABER	9,060	127.600	1,156,056.000	
	SGS SA-REG	405	2,320.000	939,600.000	
	NOVARTIS AG-REG SHS	160,986	84.520	13,606,536.720	
	BALOISE HOLDING AG -R	4,127	148.900	614,510.300	
	BARRY CALLEBAUT AG	144	1,842.000	265,248.000	
	CLARIANT AG-REG	19,496	22.980	448,018.080	
	SWISSCOM AG-REG	1,795	437.600	785,492.000	
	ABB LTD	139,628	21.600	3,015,964.800	
	ADECCO GROUP AG-REG	12,341	49.850	615,198.850	
	GEBERIT AG	2,801	432.500	1,211,432.500	
	LONZA GROUP AG-REG	5,389	309.000	1,665,201.000	
	LINDT & SPRUENGLI PART	75	6,530.000	489,750.000	
	LINDT & SPRUENGLI NAMEN	9	76,200.000	685,800.000	
	GIVAUDAN-REG	692	2,316.000	1,602,672.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	11,199	313.000	3,505,287.000	
	LAFARGEHOLCIM LTD	35,730	45.400	1,622,142.000	
	TEMENOS GROUP	4,521	131.500	594,511.500	
	SONOVA HOLDING AG	4,142	162.550	673,282.100	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG	3,687	141.750	522,632.250	
	STRAUMANN HOLDING AG	782	658.500	514,947.000	
	THE SWATCH GROUP AG-B	2,311	344.200	795,446.200	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	4,592	66.700	306,286.400	
	SCHINDLER NAMEN	1,663	222.000	369,186.000	
	SWISS LIFE HOLDING AG	2,614	371.800	971,885.200	
	VIFOR PHARMA AG	3,050	143.150	436,607.500	
	EMS-CHEMIE HOLDING	553	535.500	296,131.500	
	SWISS PRIME SITE AG	5,990	79.550	476,504.500	
	PARGESA HOLDING PORTEUR	3,000	74.050	222,150.000	
	DUFREY GROUP	2,390	106.000	253,340.000	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,272	737.000	937,464.000	
	JULIUS BAER GROUP LTD	17,849	46.940	837,832.060	
	SWISS RE LTD	24,162	90.880	2,195,842.560	
	UBS GROUP AG	285,455	14.650	4,181,915.750	
スイス・フラン	小計	1,285,038		84,392,888.250	

(9,583,656,390)

スウェーデン・クローナ	ATLAS COPCO AB-A SHS	48,377	234.000	11,320,218.000	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	30,899	214.800	6,637,105.200	
	ERICSSON LM-B SHS	221,748	77.440	17,172,165.120	
	LUNDBERGS B	7,382	290.200	2,142,256.400	
	SKF AB-B SHS	24,866	160.950	4,002,182.700	
	SANDVIK AB	85,032	145.700	12,389,162.400	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	128,935	94.700	12,210,144.500	
	SKANSKA AB-B SHS	21,179	173.450	3,673,497.550	
	SWEDBANK AB	66,507	199.300	13,254,845.100	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	108,388	108.350	11,743,839.800	
	VOLVO AB-B SHS	113,672	150.200	17,073,534.400	
	SWEDISH MATCH AB	11,481	456.600	5,242,224.600	
	TELE2 AB-B SHS	26,976	110.400	2,978,150.400	
	INDUSTRIVARDEN C	11,403	190.650	2,173,981.950	
	ELECTROLUX AB-SER B	19,191	190.100	3,648,209.100	
	SECURITAS AB-B SHS	24,098	152.500	3,674,945.000	
	INVESTOR AB-B SHS	33,412	394.100	13,167,669.200	
	HENNES&MAURITZ AB-B SHS	66,448	170.960	11,359,950.080	
	ASSA ABLOY AB-B	77,223	175.750	13,571,942.250	
	TELIA CO AB	216,239	42.030	9,088,525.170	
	LUNDIN PETROLEUM AB	16,790	299.400	5,026,926.000	
	BOLIDEN AB	21,855	246.700	5,391,628.500	
	ALFA LAVAL AB	23,343	232.100	5,417,910.300	
	KINNEVIK AB-B	18,310	258.500	4,733,135.000	
	MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR SA	5,332	508.000	2,708,656.000	
	ICA GRUPPEN AB	5,920	283.400	1,677,728.000	
HUSQVARNA AB-B SHS	33,692	72.860	2,454,799.120		
HEXAGON AB	18,360	480.600	8,823,816.000		
EPIROC AB-A	48,377	95.100	4,600,652.700		
EPIROC AB-B	30,899	87.010	2,688,521.990		
ESSITY AB-B	46,071	225.500	10,389,010.500		
NORDEA BANK ABP	218,620	89.610	19,590,538.200		
スウェーデン・クローナ 小計	1,831,025		250,027,871.230 (3,075,342,816)		
デンマーク・クローネ	CARLSBERG AS-B	7,330	731.800	5,364,094.000	
	A P MOLLER A/S	481	8,210.000	3,949,010.000	
	AP MOLLER MAERSK A	273	7,760.000	2,118,480.000	
	DANSKE BANK A/S	54,380	144.500	7,857,910.000	
	GENMAB A/S	4,613	906.400	4,181,223.200	
	NOVOZYMES-B SHS	15,904	324.300	5,157,667.200	
	NOVO NORDISK A/S-B	135,241	274.300	37,096,606.300	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	15,808	394.700	6,239,417.600	
COLOPLAST-B	8,286	600.000	4,971,600.000		

	DSV A/S	14,452	541.000	7,818,532.000	
	WILLIAM DEMANT	6,537	202.200	1,321,781.400	
	H LUNDBECK A/S	4,840	377.800	1,828,552.000	
	TRYG A/S	11,107	150.700	1,673,824.900	
	PANDORA A/S	8,251	365.600	3,016,565.600	
	CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S	7,708	593.600	4,575,468.800	
	ISS A/S	11,125	211.100	2,348,487.500	
	ORSTED A/S	15,020	417.900	6,276,858.000	
デンマーク・クローネ 小計		321,356		105,796,078.500 (1,837,677,883)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	71,110	7.160	509,147.600	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	29,894	13.100	391,611.400	
	A2 MILK CO LTD	55,091	10.210	562,479.110	
	FISHER & PAYKEL	42,678	14.630	624,379.140	
	FLETCHER BUILDING LTD	64,104	6.220	398,726.880	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	159,623	3.920	625,722.160	
	MERIDIAN ENERGY LTD	90,173	3.220	290,357.060	
ニュージーランド・ドル 小計		512,673		3,402,423.350 (247,152,033)	
ノルウェー・クローネ	MARINE HARVEST	33,000	186.300	6,147,900.000	
	DNB ASA	70,426	165.350	11,644,939.100	
	NORSK HYDRO ASA	91,879	43.560	4,002,249.240	
	TELENOR ASA	53,178	156.550	8,325,015.900	
	ORKLA ASA	61,421	68.040	4,179,084.840	
	EQUINOR ASA	87,000	229.000	19,923,000.000	
	YARA INTERNATIONAL ASA	16,000	393.000	6,288,000.000	
	AKER BP ASA	8,552	320.000	2,736,640.000	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	16,683	132.000	2,202,156.000	
	SCHIBSTED ASA	7,445	260.500	1,939,422.500	
ノルウェー・クローネ 小計		445,584		67,388,407.580 (921,199,532)	
ユーロ	CRH PLC	65,287	27.150	1,772,542.050	
	PADDY POWER BETFAIR PLC	6,246	69.250	432,535.500	
	KERRY GROUP PLC-A	11,576	89.000	1,030,264.000	
	UMICORE	15,320	40.820	625,362.400	
	AIR LIQUIDE	32,310	108.900	3,518,559.000	
	AIRBUS SE	43,659	98.990	4,321,804.410	
	AXA	146,116	23.445	3,425,689.620	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	39,913	17.270	689,297.510	
	ADIDAS AG	14,139	195.150	2,759,225.850	
	ASSICURAZIONI GENERALI	88,233	14.485	1,278,055.000	
	DASSAULT AVIATION SA	157	1,439.000	225,923.000	
	DANONE	46,365	65.330	3,029,025.450	
	SAFRAN SA	25,571	109.350	2,796,188.850	
	INTESA SANPAOLO	1,068,877	2.085	2,228,608.540	

BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	24,725	75.350	1,863,028.750	
ACCOR SA	16,000	41.680	666,880.000	
BOUYGUES	16,412	36.220	594,442.640	
BNP PARIBAS	82,934	51.470	4,268,612.980	
THALES SA	8,128	111.850	909,116.800	
CAPGEMINI SA	11,481	104.550	1,200,338.550	
CASINO GUICHARD PERRACHON	4,264	37.340	159,217.760	
INGENICO GROUP	4,334	62.900	272,608.600	
UNICREDIT SPA	150,691	12.154	1,831,498.410	
NATIXIS	70,166	5.630	395,034.580	
KONINKLIJKE DSM NV	13,216	80.260	1,060,716.160	
COMMERZBANK AG	83,118	8.680	721,464.240	
EIFFAGE	5,949	91.160	542,310.840	
FRESENIUS SE & CO KGAA	30,924	67.740	2,094,791.760	
UNITED INTERNET	9,882	36.380	359,507.160	
FUCHS PETROLUB SE PEF	5,546	45.040	249,791.840	
PUBLICIS GROUPE	15,068	51.040	769,070.720	
MAN SE	3,396	91.950	312,262.200	
FAURECIA	6,117	46.070	281,810.190	
IBERDROLA SA	445,063	6.360	2,830,600.680	
ENI SPA	190,886	16.154	3,083,572.440	
IMERYS SA	2,256	57.850	130,509.600	
JERONIMO MARTINS	19,517	11.200	218,590.400	
KBC GROUPE	18,378	65.720	1,207,802.160	
HANNOVER RUECK SE	4,868	120.900	588,541.200	
WARTSILA OYJ	34,935	15.030	525,073.050	
L'OREAL	18,584	191.300	3,555,119.200	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	20,764	265.300	5,508,689.200	
GEA GROUP AG	11,838	27.100	320,809.800	
BOLLORE	71,347	3.596	256,563.810	
MEDIOBANCA SPA	42,404	7.844	332,616.970	
MICHELIN(CGDE) -B	12,118	99.260	1,202,832.680	
CONTINENTAL AG	8,317	139.200	1,157,726.400	
DEUTSCHE POST AG-REG	73,325	28.650	2,100,761.250	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	14,426	9.552	137,797.150	
NOKIAN RENKAAT OYJ	9,399	32.620	306,595.380	
AXEL SPRINGER SE	3,067	56.300	172,672.100	
OMV AG	9,766	49.520	483,612.320	
PERNOD-RICARD	15,401	132.200	2,036,012.200	
PEUGEOT SA	42,232	20.620	870,823.840	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG- PFD	10,591	54.520	577,421.320	
RENAULT SA	14,378	71.120	1,022,563.360	
REPSOL SA	103,827	17.075	1,772,846.020	
REMY COINTREAU	1,860	102.800	191,208.000	
MERCK KGAA	9,551	89.740	857,106.740	

COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	35,706	34.015	1,214,539.590
RWE AG	39,183	17.105	670,225.210
SEB SA	1,405	143.100	201,055.500
LUXOTTICA GROUP SPA	11,602	54.200	628,828.400
SOCIETE GENERALE-A	58,110	36.650	2,129,731.500
VINCI S.A.	37,228	78.900	2,937,289.200
SODEXO	6,286	86.860	546,001.960
SOLVAY SA	5,036	108.450	546,154.200
SCHNEIDER ELECTRIC SE	39,729	62.700	2,491,008.300
VIVENDI SA	79,680	21.500	1,713,120.000
SAP SE	73,011	98.710	7,206,915.810
TELEFONICA S.A	358,674	7.085	2,541,205.290
TOTAL SA	178,965	55.100	9,860,971.500
VALEO	17,731	31.500	558,526.500
E.ON SE	164,012	8.393	1,376,552.710
VOEST-ALPINE AG	9,875	37.160	366,955.000
HENKEL AG & CO KGAA	7,858	85.650	673,037.700
SIEMENS AG-REG	56,716	102.500	5,813,390.000
UPM-KYMMENE OYJ	41,197	30.800	1,268,867.600
ING GROEP NV-CVA	290,820	10.964	3,188,550.480
PUMA AG	600	411.500	246,900.000
BAYER AG	69,537	75.010	5,215,970.370
STORA ENSO OYJ-R SHS	42,303	14.510	613,816.530
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	13,222	96.480	1,275,658.560
DAIMLER AG	67,488	53.600	3,617,356.800
BASF SE	68,209	71.690	4,889,903.210
BEIERSDORF AG	6,780	91.460	620,098.800
HOCHTIEF AG	1,707	137.200	234,200.400
HEIDELBERGCEMENT AG	11,009	62.940	692,906.460
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	16,408	87.360	1,433,402.880
ORANGE	141,819	13.845	1,963,484.050
SAMPO OYJ-A SHS	32,949	42.500	1,400,332.500
RANDSTAD NV	7,794	44.250	344,884.500
ALLIANZ SE	32,994	188.660	6,224,648.040
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	189,631	3.140	595,441.340
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	93,187	19.576	1,824,228.710
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	17,602	22.070	388,476.140
HERMES INTL	2,285	505.400	1,154,839.000
ENDESA S.A.	21,037	18.815	395,811.150
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	15,963	19.325	308,484.970
ERSTE GROUP BANK AG	20,754	35.810	743,200.740
MUENCHENER RUECKVER AG- REG	11,602	189.150	2,194,518.300
ARCELOR MITTAL (NL)	47,245	24.760	1,169,786.200
SOCIETE BIC SA	2,478	72.950	180,770.100
DASSAULT SYSTEMES SA	8,961	114.000	1,021,554.000

ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	19,033	35.280	671,484.240	
HEINEKEN NV	20,425	77.060	1,573,950.500	
AKZO NOBEL	18,209	75.100	1,367,495.900	
ASML HOLDING NV	30,496	150.360	4,585,378.560	
AEGON NV	120,404	5.616	676,188.860	
BANKINTER S.A.	57,960	8.072	467,853.120	
VOLKSWAGEN AG	2,329	140.700	327,690.300	
VOLKSWAGEN AG PFD	13,901	143.540	1,995,349.540	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	504,414	5.293	2,669,863.300	
KERING	5,479	381.300	2,089,142.700	
CNP ASSURANCES	13,987	20.460	286,174.020	
FORTUM OYJ	29,739	20.060	596,564.340	
AGEAS	12,993	46.020	597,937.860	
UCB SA	8,747	75.600	661,273.200	
THYSSENKRUPP AG	29,903	20.560	614,805.680	
UNILEVER NV-CVA	114,914	46.785	5,376,251.490	
CARREFOUR SA	39,144	15.630	611,820.720	
NATURGY ENERGY GROUP SA	29,010	22.920	664,909.200	
ATOS SE	7,050	96.540	680,607.000	
NOKIA OYJ	417,248	4.500	1,877,616.000	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	73,000	35.780	2,611,940.000	
WOLTERS KLUWER-CVA	20,558	49.850	1,024,816.300	
SANOFI	84,037	76.640	6,440,595.680	
STMICROELECTRONICS NV	50,879	14.130	718,920.270	
ELISA OYJ	9,517	36.090	343,468.530	
BANCO SANTANDER SA	1,201,199	4.363	5,240,831.230	
METSO OYJ	8,585	28.960	248,621.600	
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	34,596	18.650	645,215.400	
QIAGEN N.V.	17,387	30.290	526,652.230	
1&1 DRILLISCH AG	3,149	37.560	118,276.440	
DEUTSCHE BANK AG-REG	149,244	9.583	1,430,205.250	
BMW VORZUG	4,116	65.800	270,832.800	
K & S	14,982	18.275	273,796.050	
ENEL SPA	607,499	4.376	2,658,415.620	
COLRUYT NV	4,673	48.040	224,490.920	
VOPAK (KON.)	5,364	41.500	222,606.000	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	246,287	14.285	3,518,209.790	
SARTORIUS AG	2,712	121.500	329,508.000	
LEONARDO SPA	26,269	10.065	264,397.480	
UBISOFT ENTERTAINMENT	5,911	83.660	494,514.260	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	81,774	18.320	1,498,099.680	
KONINKLIJKE KPN NV	228,967	2.319	530,974.470	
EUROFINS SCIENTIFIC	794	409.600	325,222.400	
TELEPERFORMANCE	4,436	146.900	651,648.400	
DEUTSCHE BOERSE AG	13,844	111.900	1,549,143.600	
EURAZEO	4,725	65.450	309,251.250	

BANCO SABADELL	367,753	1.296	476,607.880
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	5,814	83.140	483,375.960
FRAPORT AG	3,149	68.180	214,698.820
HEINEKEN HOLDING NV-A	8,014	75.000	601,050.000
INDITEX	82,035	24.890	2,041,851.150
JC DECAUX SA	6,058	29.500	178,711.000
ANDRITZ AG	6,265	47.040	294,705.600
MAPFRE SA	84,474	2.696	227,741.900
ESSILORLUXOTTICA	15,607	117.950	1,840,845.650
SNAM SPA	158,419	3.643	577,120.410
CREDIT AGRICOLE SA	85,585	12.508	1,070,497.180
ENAGAS	18,095	23.490	425,051.550
WENDEL	2,220	116.300	258,186.000
WIRECARD AG	8,803	156.250	1,375,468.750
TENARIS SA	36,959	14.690	542,927.710
TELECOM ITALIA SPA	792,163	0.503	398,457.980
TELECOM ITALIA-RNC	497,596	0.433	215,459.060
ATLANTIA SPA	34,969	17.700	618,951.300
ILIAD SA	2,102	103.050	216,611.100
PROXIMUS	14,283	22.070	315,225.810
SES FDR	24,585	19.560	480,882.600
TERNA SPA	112,686	4.576	515,651.130
BIOMERIEUX	3,248	62.600	203,324.800
GRIFOLS SA	23,518	21.860	514,103.480
FERROVIAL SA	37,657	17.795	670,106.310
LANXESS AG	6,856	60.440	414,376.640
NESTE OYJ	8,839	72.440	640,297.160
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	9,641	24.610	237,265.010
RECORDATI SPA	6,859	29.100	199,596.900
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	35,583	6.645	236,449.030
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	3,960	177.400	702,504.000
KONE OYJ	23,717	42.780	1,014,613.260
ENGIE	139,590	12.175	1,699,508.250
ALSTOM	12,046	38.060	458,470.760
TELENET GROUP HOLDING NV	3,634	43.980	159,823.320
EUTELSAT COMMUNICATIONS	12,542	22.320	279,937.440
ELECTRICITE DE FRANCE	43,198	14.630	631,986.740
IPSEN SA	2,487	128.850	320,449.950
DEUTSCHE WOHNEN	26,714	39.920	1,066,422.880
ARKEMA SA	5,230	99.540	520,594.200
LEGRAND SA	19,920	58.460	1,164,523.200
ADP	2,313	179.200	414,489.600
ORION OYJ	8,051	30.780	247,809.780
RTL GROUP SA	3,446	60.400	208,138.400
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	37,921	16.505	625,886.100

SYMRISE AG	9,628	72.760	700,533.280	
SCOR SE	13,875	41.640	577,755.000	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	17,397	29.600	514,951.200	
REXEL SA	23,245	11.990	278,707.550	
PRYSMIAN SPA	14,925	18.005	268,724.620	
CAIXABANK	262,372	3.905	1,024,562.660	
BUREAU VERITAS SA	21,480	19.745	424,122.600	
GETLINK	37,646	11.000	414,106.000	
SUEZ SA	25,406	13.015	330,659.090	
AMADEUS IT GROUP SA	32,520	71.860	2,336,887.200	
BRENNTAG AG	12,353	48.370	597,514.610	
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GROUP SA	44,747	6.752	302,131.740	
EVONIK INDUSTRIES AG	11,575	28.430	329,077.250	
EDENRED	18,306	31.610	578,652.660	
BANKIA SA	100,675	3.354	337,663.950	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	61,541	3.553	218,655.170	
HUGO BOSS AG -ORD	5,218	61.340	320,072.120	
OSRAM LICHT AG	7,017	31.740	222,719.580	
KION GROUP AG	4,686	46.830	219,445.380	
VONOVIA SE	35,308	39.170	1,383,014.360	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	73,287	6.520	477,831.240	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	10,000	33.250	332,500.000	
FERRARI NV	9,503	103.200	980,709.600	
METRO AG	10,774	13.640	146,957.360	
CNH INDUSTRIAL NV	78,645	9.852	774,810.540	
AIB GROUP PLC	52,322	4.500	235,449.000	
LINDE AG-TENDER	13,854	201.700	2,794,351.800	
INNOGY SE-TEMPORARY	9,769	36.750	359,010.750	
MONCLER SPA	14,353	31.730	455,420.690	
NN GROUP NV	21,965	39.330	863,883.450	
ZALANDO SE	6,674	31.510	210,297.740	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	76,719	14.136	1,084,499.780	
AENA SME SA	5,256	139.750	734,526.000	
ABN AMRO GROUP NV	34,251	23.590	807,981.090	
EXOR NV	7,726	53.660	414,577.160	
COVESTRO AG	14,459	63.000	910,917.000	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	57,180	74.610	4,266,199.800	
POSTE ITALIANE SPA	40,015	6.454	258,256.810	
AMUNDI SA	3,894	61.740	240,415.560	
SCHAEFFLER AG	12,644	9.940	125,681.360	
PIRELLI & C SPA	34,086	6.290	214,400.940	
UNIPER SE	13,897	25.300	351,594.100	
DELIVERY HERO SE	7,238	35.120	254,198.560	
ユ一ロ 小計	14,444,530		278,355,845.110	

(36,066,566,851)

香港・ドル	ASM PACIFIC TECH	16,600	79.150	1,313,890.000
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	164,000	14.820	2,430,480.000
	BANK OF EAST ASIA	76,260	27.700	2,112,402.000
	CLP HOLDINGS LTD	119,500	88.900	10,623,550.000
	PCCW LTD	331,000	4.370	1,446,470.000
	LI & FUNG LTD	532,400	1.740	926,376.000
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	49,000	62.250	3,050,250.000
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	89,040	208.800	18,591,552.000
	MTR CORP	118,500	39.950	4,734,075.000
	HANG LUNG GROUP LTD	63,000	20.450	1,288,350.000
	HANG SENG BANK LTD	56,000	210.400	11,782,400.000
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	92,228	38.200	3,523,109.600
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	96,500	54.150	5,225,475.000
	(THE) WHARF HOLDINGS LTD	95,750	20.300	1,943,725.000
	HONG KONG & CHINA GAS	671,050	15.020	10,079,171.000
	HYSAN DEVELOPMENT CO	50,000	39.250	1,962,500.000
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	186,000	44.950	8,360,700.000
	KERRY PROPERTIES LTD	33,000	25.400	838,200.000
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	262,000	35.150	9,209,300.000
	NWS HOLDINGS LTD	135,000	15.300	2,065,500.000
	YUE YUEN INDUSTRIAL HOLDINGS	50,500	20.850	1,052,925.000
	NEW WORLD DEVELOPMENT	441,266	10.240	4,518,563.840
	SHANGRI-LA ASIA LTD	104,000	11.000	1,144,000.000
	SINO LAND CO	255,400	12.700	3,243,580.000
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	114,000	108.400	12,357,600.000
	SWIRE PACIFIC LTD A	30,000	84.750	2,542,500.000
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	113,500	46.300	5,255,050.000
	WHEELLOCK & CO LTD	56,000	44.100	2,469,600.000
	MINTH GROUP LTD	44,000	27.150	1,194,600.000
	SJM HOLDINGS LTD	156,000	6.850	1,068,600.000
	WYNN MACAU LTD	124,400	16.940	2,107,336.000
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	64,800	12.220	791,856.000
	AIA GROUP LTD	904,027	63.200	57,134,506.400
	HKT TRUST / HKT LTD	282,000	11.000	3,102,000.000
SANDS CHINA LTD	169,200	34.550	5,845,860.000	
SWIRE PROPERTIES LTD	104,200	28.150	2,933,230.000	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT CO LTD	95,750	51.900	4,969,425.000	
HK ELECTRIC INVESTMENTS & HK ELECTRIC INVESTMENTS LTD	230,000	7.590	1,745,700.000	
WH GROUP LTD	701,500	5.910	4,145,865.000	

	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	199,332	83.650	16,674,121.800	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	184,332	56.150	10,350,241.800	
香港・ドル	小計	7,661,035		246,154,636.440 (3,529,857,486)	
合計		84,310,345		296,696,112,569 (296,696,112,569)	

(2) 株式以外の有価証券

平成30年10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	80,596.000	833,362.640	
		GOODMAN GROUP	121,619.000	1,245,378.560	
		GPT GROUP	144,955.000	733,472.300	
		LENLEASE GROUP	37,363.000	673,654.890	
		MIRVAC GROUP	295,783.000	683,258.730	
		SCENTRE GROUP	383,688.000	1,507,893.840	
		STOCKLAND	194,018.000	791,593.440	
		VICINITY CENTRES	270,443.000	708,560.660	
	オーストラリア・ドル	小計	1,528,465.000	7,177,175.060 (570,154,787)	
	シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	200,806.000	510,047.240	
		CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	206,300.000	354,836.000	
		CAPITALAND MALL TRUST	199,000.000	421,880.000	
		SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	192,100.000	351,543.000	
	シンガポール・ドル	小計	798,206.000	1,638,306.240 (133,095,999)	
	投資信託受益証券	合計		2,326,671	703,250,786 (703,250,786)
投資証券	アメリカ・ドル	AGNC INVESTMENT CORP	32,741.000	591,302.460	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	7,304.000	910,881.840	
		AMERICAN TOWER CORP	32,749.000	4,764,979.500	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	77,528.000	783,808.080	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	10,542.000	1,880,271.120	
		BOSTON PROPERTIES INC	11,168.000	1,329,662.080	
		BROOKFIELD PROPERTY REIT INC	19,124.000	382,097.520	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	6,285.000	582,996.600	
		CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	30,388.000	3,303,479.480	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	15,118.000	1,661,317.020	
		DUKE REALTY TRUST	24,470.000	684,670.600	
		EQUINIX INC	5,887.000	2,414,140.960	
		EQUITY RESIDENTIAL	27,070.000	1,751,158.300	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	5,024.000	1,240,375.360	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	9,741.000	840,843.120	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	6,000.000	731,340.000	
		HCP INC	34,130.000	880,554.000	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	51,147.000	1,012,199.130	
		INVITATION HOMES INC	22,567.000	495,796.990	
		IRON MOUNTAIN INC	19,265.000	625,149.250	
		KIMCO REALTY	32,980.000	510,530.400	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	11,649.000	490,888.860	
		MID AMERICA	8,123.000	799,871.810	

	NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	10,544.000	467,626.400	
	PROLOGIS INC	49,313.000	3,232,960.280	
	PUBLIC STORAGE	11,851.000	2,354,556.680	
	REALTY INCOME CORP	22,285.000	1,277,153.350	
	REGENCY CENTERS CORP	11,294.000	713,780.800	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	8,169.000	1,249,857.000	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	23,209.000	4,006,337.580	
	SL GREEN	7,097.000	660,872.640	
	THE MACERICH COMPANY	9,014.000	463,499.880	
	UDR INC	21,658.000	860,255.760	
	VENTAS INC	25,041.000	1,374,750.900	
	VEREIT INC	72,429.000	507,727.290	
	VORNADO REALTY TRUST	12,211.000	860,509.170	
	WELLTOWER INC	26,516.000	1,695,963.360	
	WEYERHAEUSER CO	56,867.000	1,654,829.700	
アメリカ・ドル 小計		868,498.000	50,048,995.270 (5,623,505,108)	
イギリス・ポンド	BRITISH LAND CO PLC	71,871.000	419,295.410	
	HAMMERSON PLC	58,616.000	258,555.170	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	59,062.000	498,247.030	
	SEGRO PLC	82,914.000	504,614.600	
イギリス・ポンド 小計		272,463.000	1,680,712.210 (249,468,113)	
カナダ・ドル	H & R REAL ESTATE INVESTMENT	10,748.000	207,328.920	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	9,675.000	230,265.000	
	SMARTCENTRES REIT	2,582.000	77,175.980	
カナダ・ドル 小計		23,005.000	514,769.900 (44,326,836)	
ユーロ	COVIVIO	2,343.000	199,975.050	
	GECINA SA	3,670.000	492,147.000	
	ICADE	2,234.000	166,209.600	
	KLEPIERRE	17,042.000	504,272.780	
	UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	10,338.000	1,689,229.200	
ユーロ 小計		35,627.000	3,051,833.630 (395,426,083)	
香港・ドル	LINK REIT	163,500.000	11,837,400.000	
香港・ドル 小計		163,500.000	11,837,400.000 (169,748,317)	
投資証券 合計		1,363,093	6,482,474,457 (6,482,474,457)	
合計			7,185,725,243 (7,185,725,243)	

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 596銘柄	63.60%	-%	-%	68.11%
	投資証券 38銘柄	-%	-%	1.78%	
イギリス・ポンド	株式 97銘柄	6.36%	-%	-%	6.70%
	投資証券 4銘柄	-%	-%	0.08%	
イスラエル・シケル	株式 9銘柄	0.11%	-%	-%	0.11%
オーストラリア・ドル	株式 59銘柄	2.26%	-%	-%	2.55%
	投資信託 受益証券 8銘柄	-%	0.18%	-%	
カナダ・ドル	株式 88銘柄	3.52%	-%	-%	3.68%
	投資証券 3銘柄	-%	-%	0.01%	
シンガポール・ドル	株式 21銘柄	0.42%	-%	-%	0.48%
	投資信託 受益証券 4銘柄	-%	0.04%	-%	
スイス・フラン	株式 38銘柄	3.03%	-%	-%	3.15%
スウェーデン・クローナ	株式 32銘柄	0.97%	-%	-%	1.01%
デンマーク・クローネ	株式 17銘柄	0.58%	-%	-%	0.60%
ニュージーランド・ドル	株式 7銘柄	0.08%	-%	-%	0.08%
ノルウェー・クローネ	株式 10銘柄	0.29%	-%	-%	0.30%
ユーロ	株式 238銘柄	11.39%	-%	-%	12.00%
	投資証券 5銘柄	-%	-%	0.12%	
香港・ドル	株式 41銘柄	1.12%	-%	-%	1.22%
	投資証券 1銘柄	-%	-%	0.05%	

(注) 「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

「外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位:円)

科 目	注記 番号	平成30年4月11日現在	平成30年10月11日現在
資産の部			
流動資産			
預金		2,570,263,021	2,747,434,662
コール・ローン		224,055,852	613,753,950
国債証券		207,030,932,658	195,991,508,237
派生商品評価勘定		-	52,210
未収入金		-	319,125,655
未収利息		1,932,723,939	1,762,319,633
前払費用		29,899,314	26,013,949
流動資産合計		211,787,874,784	201,460,208,296
資産合計		211,787,874,784	201,460,208,296
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		1,135,127	-
未払金		2,178,181,339	1,190,886,419
未払解約金		258,963,000	264,766,000
流動負債合計		2,438,279,466	1,455,652,419
負債合計		2,438,279,466	1,455,652,419
純資産の部			
元本等			
元本	1	115,824,125,042	111,753,378,219
剰余金			
剰余金又は欠損金()		93,525,470,276	88,251,177,658
元本等合計		209,349,595,318	200,004,555,877
純資産合計		209,349,595,318	200,004,555,877
負債純資産合計		211,787,874,784	201,460,208,296

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	平成30年4月11日現在	平成30年10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	129,831,961,732円	115,824,125,042円
同期中追加設定元本額	11,892,631,520円	16,933,511,969円
同期中一部解約元本額	25,900,468,210円	21,004,258,792円
元本の内訳		
ファンド名		
D I A M外国債券パッシブ・ファンド	6,942,722,213円	7,830,421,913円
M I T O ラップ型ファンド（安定型）	14,295,981円	12,133,962円
M I T O ラップ型ファンド（中立型）	38,214,549円	32,672,527円
M I T O ラップ型ファンド（積極型）	47,727,917円	40,635,275円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	76,241,137円	85,434,297円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	79,108,387円	86,584,078円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	44,833,056円	53,227,010円
たわらノーロード 先進国債券	1,705,415,252円	2,732,598,993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）	29,415,133円	85,757,190円
たわらノーロード バランス（堅実型）	453,206円	1,666,151円

たわらノーロード バランス (標準型)	2,163,239円	9,134,238円
たわらノーロード バランス (積極型)	860,802円	2,975,382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)	76,538円	278,668円
たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(安定型)	4,264,143円	15,745,793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)	2,488,857円	24,957,436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)	625,201円	7,742,312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	3,802,159円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定型)	83,913円	125,481円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定成長型)	392,432円	952,774円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(成長型)	220,283円	440,423円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(積極型)	337,035円	715,447円
D I A M外国債券インデックス ファンド< D C年金>	5,079,413,296円	5,130,383,036円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 1 安定型	491,792,934円	508,593,929円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 2 安定・成長型	1,591,909,852円	1,661,346,768円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 3 成長型	1,690,571,535円	1,750,297,361円
D I A M D C バランス3 0 インデックスファンド	373,223,365円	375,053,475円
D I A M D C バランス5 0 インデックスファンド	794,591,614円	812,877,584円
D I A M D C バランス7 0 インデックスファンド	627,578,064円	644,522,531円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型>	23,962,825円	22,797,155円
マネックス資産設計ファンド< 育成型>	599,670,192円	597,658,723円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	17,303,931円	16,493,279円
D I A M D C 8 資産バラ ンスファンド(新興国1 0)	18,007,015円	116,556,212円
D I A M D C 8 資産バラ ンスファンド(新興国2 0)	40,891,423円	67,061,918円
D I A M D C 8 資産バラ ンスファンド(新興国3 0)	75,523,877円	112,693,813円
クルーズコントロール	471,522,151円	1,748,041,047円
D I A M 8 資産バランスファ ンドN< D C年金>	72,533,521円	81,966,152円

D I A M D C バランス・F (成長型)	125,520,919円	145,018,693円
クルーズコントロール<DC年金>	175,031円	1,010,504円
D I A Mコア資産設計ファンド (堅実型)	1,547,650円	7,283,621円
D I A Mコア資産設計ファンド (積極型)	4,761,061円	15,275,389円
ダイナミック・ナビゲーション	303,476円	364,709円
4資産分散投資・スタンダード <DC年金>	1,302,909円	15,301,697円
9資産分散投資・スタンダード <DC年金>	- 円	11,075円
D I A Mパッシブ資産分散ファ ンド	1,370,643,849円	1,315,797,580円
D I A M為替フルヘッジ型外国 債券パッシブ私募ファンド(適 格機関投資家向け)	7,213,878,854円	6,773,540,012円
D I A M外国債券パッシブファ ンド(適格機関投資家向け)	4,074,076,473円	4,135,915,089円
外国債券パッシブファンド(適 格機関投資家限定)	3,312,147,806円	3,316,290,366円
先進国債券パッシブファンド (適格機関投資家限定)	575,438,442円	6,087,766,169円
D I A Mワールドバランス25 VA(適格機関投資家限定)	105,085,382円	95,731,710円
D I A Mグローバル・バランス ファンド25VA(適格機関投 資家限定)	920,591,104円	806,989,317円
D I A Mグローバル・バランス ファンド50VA(適格機関投 資家限定)	685,875,564円	659,285,763円
D I A M国際分散バランスファ ンド30VA(適格機関投資家 限定)	55,601,422円	50,717,767円
D I A M国際分散バランスファ ンド50VA(適格機関投資家 限定)	104,345,750円	92,921,832円
D I A M国内重視バランスファ ンド30VA(適格機関投資家 限定)	25,601,826円	23,232,912円
D I A M国内重視バランスファ ンド50VA(適格機関投資家 限定)	9,958,112円	7,499,874円
D I A M世界バランスファンド 40VA(適格機関投資家限 定)	67,333,025円	66,675,797円
D I A M世界バランスファンド 50VA(適格機関投資家限 定)	81,674,125円	79,005,779円
D I A Mバランスファンド25 VA(適格機関投資家限定)	3,688,649,971円	3,455,775,354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)	2,415,722,822円	2,288,310,075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)	4,073,380,482円	3,952,485,636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)	736,405,912円	699,334,985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)	429,854,135円	263,420,576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)	3,491,651,220円	3,224,437,640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)	7,013,788,927円	2,354,914,119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 55 V A (適格機関投資家限 定)	48,037,463円	16,311,743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)	1,811,767,262円	156,842,701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)	14,993,606,270円	10,390,321,013円
D I A M世界アセットバランス ファンド3 V A (適格機関投資 家限定)	19,659,509,959円	19,189,841,080円
D I A Mバランス30 V A (適 格機関投資家限定)	22,077,367円	14,080,569円
D I A Mバランス50 V A (適 格機関投資家限定)	1,004,502円	11,257,433円
D I A Mバランス70 V A (適 格機関投資家限定)	5,430,556円	5,627,956円
D I A M世界アセットバランス ファンド4 V A (適格機関投資 家限定)	17,503,085,704円	17,135,274,007円
D I A M世界バランス25 V A (適格機関投資家限定)	105,728,406円	100,006,763円
D I A Mバランス20 V A (適 格機関投資家限定)	115,018,539円	110,036,727円
D I A Mバランス40 V A (適 格機関投資家限定)	362,917円	369,121円
D I A Mバランス60 V A (適 格機関投資家限定)	163,038円	168,633円
計	115,824,125,042円	111,753,378,219円
2. 受益権の総数	115,824,125,042口	111,753,378,219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10月12日 至 平成30年4月11日	自 平成30年4月12日 至 平成30年10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30年4月11日現在	平成30年10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30年4月11日現在	平成30年10月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
国債証券	2,200,997,145	3,947,068,518
合計	2,200,997,145	3,947,068,518

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(平成30年2月22日から平成30年4月11日まで及び平成30年2月22日から平成30年10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30年4月11日 現在				平成30年10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	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	95,131,472	-	95,710,740	579,268	-	-	-	-
買 建	3,774,409,887	-	3,774,167,660	242,227	1,350,330,000	-	1,350,382,210	52,210
アメリカ・ドル	1,622,948,950	-	1,622,797,400	151,550	504,760,000	-	504,760,000	-
イギリス・ポンド	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	1,661,034,595	-	1,660,971,860	62,735	845,570,000	-	845,622,210	52,210
合計	3,964,644,917	-	3,965,295,590	1,135,127	1,350,330,000	-	1,350,382,210	52,210

（注）時価の算定方法

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

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

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

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

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	平成30年4月11日現在	平成30年10月11日現在
1口当たり純資産額	1.8075円	1.7897円
（1万口当たり純資産額）	（18,075円）	（17,897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10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 1.0 11/30/19	6,500,000.000	6,373,770.000	
		US T N/B 1.25 01/31/20	10,800,000.000	10,590,696.000	
		US T N/B 1.25 10/31/19	15,000,000.000	14,772,600.000	
		US T N/B 1.375 01/31/20	8,600,000.000	8,446,748.000	
		US T N/B 1.375 03/31/20	6,300,000.000	6,170,031.000	
		US T N/B 1.375 04/30/20	12,000,000.000	11,736,480.000	
		US T N/B 1.375 04/30/21	11,210,000.000	10,779,984.400	
		US T N/B 1.375 05/31/20	3,500,000.000	3,418,240.000	
		US T N/B 1.375 06/30/23	7,000,000.000	6,485,920.000	
		US T N/B 1.375 09/30/23	5,900,000.000	5,443,163.000	
		US T N/B 1.5 08/15/26	7,000,000.000	6,182,960.000	
		US T N/B 1.5 10/31/19	5,180,000.000	5,115,042.800	
		US T N/B 1.625 02/15/26	5,500,000.000	4,942,465.000	
		US T N/B 1.625 05/15/26	8,500,000.000	7,609,115.000	
		US T N/B 1.625 05/31/23	5,300,000.000	4,975,375.000	
		US T N/B 1.625 08/15/22	9,500,000.000	9,020,155.000	
		US T N/B 1.625 11/15/22	11,050,000.000	10,453,852.500	
		US T N/B 1.625 11/30/20	8,510,000.000	8,283,548.900	
		US T N/B 1.75 01/31/23	10,000,000.000	9,479,600.000	
		US T N/B 1.75 03/31/22	11,700,000.000	11,220,066.000	
		US T N/B 1.75 05/15/22	11,600,000.000	11,104,216.000	
		US T N/B 1.75 05/15/23	7,000,000.000	6,611,150.000	
		US T N/B 1.75 09/30/22	10,230,000.000	9,744,791.100	
		US T N/B 1.75 10/31/20	6,000,000.000	5,863,320.000	
		US T N/B 1.75 12/31/20	9,000,000.000	8,775,630.000	
		US T N/B 1.875 02/28/22	1,680,000.000	1,619,486.400	
		US T N/B 1.875 06/30/20	11,000,000.000	10,818,610.000	
		US T N/B 1.875 08/31/22	12,000,000.000	11,496,480.000	
		US T N/B 1.875 08/31/24	5,760,000.000	5,379,724.800	
		US T N/B 2.0 02/15/22	15,390,000.000	14,905,368.900	
		US T N/B 2.0 02/15/23	9,500,000.000	9,098,435.000	
		US T N/B 2.0 02/15/25	9,500,000.000	8,878,035.000	
		US T N/B 2.0 05/31/21	12,000,000.000	11,712,600.000	
		US T N/B 2.0 05/31/24	6,180,000.000	5,830,644.600	
		US T N/B 2.0 08/15/25	9,000,000.000	8,360,100.000	
		US T N/B 2.0 09/30/20	6,000,000.000	5,898,240.000	
		US T N/B 2.0 11/15/21	10,400,000.000	10,100,584.000	
		US T N/B 2.0 11/15/26	7,000,000.000	6,402,760.000	
		US T N/B 2.0 11/30/20	10,500,000.000	10,302,705.000	
		US T N/B 2.0 11/30/22	6,590,000.000	6,326,400.000	

US T N/B 2.125 01/31/21	5,000,000.000	4,910,900.000	
US T N/B 2.125 05/15/25	9,980,000.000	9,374,114.200	
US T N/B 2.125 06/30/22	9,500,000.000	9,204,550.000	
US T N/B 2.125 08/15/21	11,000,000.000	10,749,420.000	
US T N/B 2.125 08/31/20	3,000,000.000	2,958,510.000	
US T N/B 2.125 09/30/21	10,000,000.000	9,757,800.000	
US T N/B 2.125 09/30/24	6,780,000.000	6,415,032.600	
US T N/B 2.125 12/31/21	12,880,000.000	12,538,808.800	
US T N/B 2.125 12/31/22	8,000,000.000	7,711,200.000	
US T N/B 2.25 02/15/27	8,000,000.000	7,473,680.000	
US T N/B 2.25 03/31/21	11,500,000.000	11,313,125.000	
US T N/B 2.25 08/15/27	8,000,000.000	7,406,800.000	
US T N/B 2.25 08/15/46	4,500,000.000	3,569,400.000	
US T N/B 2.25 11/15/24	10,600,000.000	10,085,688.000	
US T N/B 2.25 11/15/25	7,000,000.000	6,592,250.000	
US T N/B 2.25 11/15/27	8,100,000.000	7,482,942.000	
US T N/B 2.25 12/31/23	6,610,000.000	6,348,640.600	
US T N/B 2.375 05/15/27	6,330,000.000	5,938,299.600	
US T N/B 2.375 08/15/24	8,900,000.000	8,549,518.000	
US T N/B 2.375 12/31/20	8,300,000.000	8,203,056.000	
US T N/B 2.5 02/15/45	4,500,000.000	3,795,435.000	
US T N/B 2.5 02/15/46	5,000,000.000	4,198,400.000	
US T N/B 2.5 03/31/23	1,020,000.000	996,886.800	
US T N/B 2.5 05/15/24	9,000,000.000	8,724,330.000	
US T N/B 2.5 05/15/46	4,400,000.000	3,690,808.000	
US T N/B 2.5 08/15/23	8,000,000.000	7,800,000.000	
US T N/B 2.625 03/31/25	4,080,000.000	3,957,273.600	
US T N/B 2.625 06/30/23	1,820,000.000	1,785,729.400	
US T N/B 2.625 08/15/20	16,500,000.000	16,422,615.000	
US T N/B 2.625 08/31/20	9,250,000.000	9,207,635.000	
US T N/B 2.625 11/15/20	6,000,000.000	5,965,020.000	
US T N/B 2.75 02/15/24	9,400,000.000	9,247,908.000	
US T N/B 2.75 02/15/28	5,950,000.000	5,724,078.500	
US T N/B 2.75 02/28/25	5,810,000.000	5,680,611.300	
US T N/B 2.75 05/31/23	3,270,000.000	3,228,601.800	
US T N/B 2.75 06/30/25	790,000.000	770,803.000	
US T N/B 2.75 07/31/23	6,500,000.000	6,411,080.000	
US T N/B 2.75 08/15/42	2,800,000.000	2,507,736.000	
US T N/B 2.75 08/15/47	5,150,000.000	4,578,659.000	
US T N/B 2.75 08/31/23	2,170,000.000	2,140,162.500	
US T N/B 2.75 08/31/25	1,640,000.000	1,598,868.800	
US T N/B 2.75 11/15/23	10,000,000.000	9,852,300.000	
US T N/B 2.75 11/15/42	3,400,000.000	3,039,532.000	
US T N/B 2.75 11/15/47	3,230,000.000	2,841,883.200	
US T N/B 2.875 05/15/28	7,120,000.000	6,917,507.200	
US T N/B 2.875 05/15/43	3,880,000.000	3,544,418.800	
US T N/B 2.875 07/31/25	3,390,000.000	3,331,997.100	
US T N/B 2.875 08/15/28	1,570,000.000	1,523,999.000	
US T N/B 2.875 08/15/45	4,900,000.000	4,445,574.000	

US T N/B 2.875 11/15/46	4,400,000.000	3,982,308.000	
US T N/B 3.0 02/15/47	4,430,000.000	4,109,489.500	
US T N/B 3.0 02/15/48	4,020,000.000	3,720,670.800	
US T N/B 3.0 05/15/42	980,000.000	918,750.000	
US T N/B 3.0 05/15/45	5,000,000.000	4,650,750.000	
US T N/B 3.0 05/15/47	4,680,000.000	4,378,701.600	
US T N/B 3.0 08/15/48	2,920,000.000	2,703,715.600	
US T N/B 3.0 11/15/44	5,100,000.000	4,748,151.000	
US T N/B 3.0 11/15/45	3,900,000.000	3,625,167.000	
US T N/B 3.125 02/15/42	1,800,000.000	1,724,328.000	
US T N/B 3.125 02/15/43	2,600,000.000	2,482,792.000	
US T N/B 3.125 05/15/21	8,000,000.000	8,036,240.000	
US T N/B 3.125 05/15/48	4,350,000.000	4,128,063.000	
US T N/B 3.125 08/15/44	4,600,000.000	4,385,778.000	
US T N/B 3.125 11/15/41	1,800,000.000	1,725,462.000	
US T N/B 3.375 05/15/44	3,910,000.000	3,894,399.100	
US T N/B 3.375 11/15/19	4,000,000.000	4,027,640.000	
US T N/B 3.5 02/15/39	1,300,000.000	1,331,174.000	
US T N/B 3.5 05/15/20	14,000,000.000	14,142,660.000	
US T N/B 3.625 02/15/20	15,300,000.000	15,463,710.000	
US T N/B 3.625 02/15/21	5,500,000.000	5,585,910.000	
US T N/B 3.625 02/15/44	4,510,000.000	4,683,319.300	
US T N/B 3.625 08/15/43	2,790,000.000	2,895,713.100	
US T N/B 3.75 08/15/41	2,000,000.000	2,116,700.000	
US T N/B 3.75 11/15/43	4,120,000.000	4,364,934.000	
US T N/B 3.875 08/15/40	2,100,000.000	2,263,401.000	
US T N/B 4.25 05/15/39	720,000.000	816,746.400	
US T N/B 4.25 11/15/40	2,000,000.000	2,272,960.000	
US T N/B 4.375 02/15/38	750,000.000	862,380.000	
US T N/B 4.375 05/15/40	2,000,000.000	2,309,060.000	
US T N/B 4.375 05/15/41	2,000,000.000	2,314,200.000	
US T N/B 4.375 11/15/39	1,660,000.000	1,914,826.600	
US T N/B 4.5 02/15/36	2,000,000.000	2,317,800.000	
US T N/B 4.5 05/15/38	1,100,000.000	1,285,878.000	
US T N/B 4.5 08/15/39	1,400,000.000	1,641,500.000	
US T N/B 4.625 02/15/40	2,300,000.000	2,741,485.000	
US T N/B 4.75 02/15/41	1,800,000.000	2,187,270.000	
US T N/B 5.0 05/15/37	800,000.000	987,680.000	
US T N/B 5.25 02/15/29	1,000,000.000	1,177,260.000	
US T N/B 5.25 11/15/28	1,500,000.000	1,759,440.000	
US T N/B 5.375 02/15/31	1,500,000.000	1,823,130.000	
US T N/B 5.5 08/15/28	1,100,000.000	1,309,902.000	
US T N/B 6.0 02/15/26	2,360,000.000	2,798,440.800	
US T N/B 6.125 11/15/27	1,400,000.000	1,719,970.000	
US T N/B 6.25 05/15/30	1,400,000.000	1,805,608.000	
US T N/B 6.25 08/15/23	1,000,000.000	1,143,900.000	
US T N/B 8.0 11/15/21	6,000,000.000	6,888,720.000	
アメリカ・ドル 小計	813,800,000.000 (91,438,568,000)	789,410,765.000 (88,698,193,555)	

イギリス・ポンド	UK TREASURY 0.5 07/22/22	2,350,000.000	2,294,845.500	
	UK TREASURY 0.75 07/22/23	1,360,000.000	1,326,816.000	
	UK TREASURY 1.25 07/22/27	2,730,000.000	2,646,462.000	
	UK TREASURY 1.5 01/22/21	2,700,000.000	2,733,750.000	
	UK TREASURY 1.5 07/22/26	2,400,000.000	2,396,640.000	
	UK TREASURY 1.5 07/22/47	2,400,000.000	2,099,760.000	
	UK TREASURY 1.625 10/22/28	820,000.000	812,833.200	
	UK TREASURY 1.625 10/22/71	430,000.000	380,863.900	
	UK TREASURY 1.75 07/22/57	1,530,000.000	1,419,993.000	
	UK TREASURY 1.75 09/07/22	3,000,000.000	3,068,640.000	
	UK TREASURY 1.75 09/07/37	1,250,000.000	1,191,000.000	
	UK TREASURY 2.0 09/07/25	930,000.000	965,526.000	
	UK TREASURY 2.25 09/07/23	2,800,000.000	2,930,704.000	
	UK TREASURY 2.5 07/22/65	2,000,000.000	2,310,640.000	
	UK TREASURY 2.75 09/07/24	2,000,000.000	2,157,740.000	
	UK TREASURY 3.25 01/22/44	2,600,000.000	3,180,060.000	
	UK TREASURY 3.5 01/22/45	2,520,000.000	3,223,836.000	
	UK TREASURY 3.5 07/22/68	1,900,000.000	2,802,310.000	
	UK TREASURY 3.75 07/22/52	1,780,000.000	2,516,564.000	
	UK TREASURY 3.75 09/07/20	2,900,000.000	3,055,817.000	
	UK TREASURY 3.75 09/07/21	1,850,000.000	1,995,743.000	
	UK TREASURY 4.0 01/22/60	1,600,000.000	2,497,120.000	
	UK TREASURY 4.0 03/07/22	2,000,000.000	2,196,180.000	
	UK TREASURY 4.25 03/07/36	2,450,000.000	3,260,460.000	
	UK TREASURY 4.25 06/07/32	1,850,000.000	2,376,880.000	
	UK TREASURY 4.25 09/07/39	1,550,000.000	2,126,755.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/27	1,700,000.000	2,084,285.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/40	1,980,000.000	2,747,052.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/46	1,930,000.000	2,811,817.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/49	1,560,000.000	2,339,844.000	

	UK TREASURY 4.25 12/07/55	1,940,000.000	3,061,126.000	
	UK TREASURY 4.5 09/07/34	1,680,000.000	2,262,792.000	
	UK TREASURY 4.5 12/07/42	1,720,000.000	2,508,448.000	
	UK TREASURY 4.75 12/07/30	1,500,000.000	1,981,800.000	
	UK TREASURY 4.75 12/07/38	1,610,000.000	2,333,212.000	
	UK TREASURY 5.0 03/07/25	2,030,000.000	2,477,736.800	
	UK TREASURY 6.0 12/07/28	1,350,000.000	1,896,615.000	
	UK TREASURY 8.0 06/07/21	1,700,000.000	2,012,460.000	
イギリス・ポンド 小計		72,400,000.000 (10,746,332,000)	86,485,126.400 (12,836,987,312)	
オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN 5.75 05/15/21	3,700,000.000	4,042,065.000	
	AUSTRALIAN 1.75 11/21/20	2,400,000.000	2,385,576.000	
	AUSTRALIAN 2.0 12/21/21	1,770,000.000	1,763,097.000	
	AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	2,570,000.000	2,458,462.000	
	AUSTRALIAN 2.25 11/21/22	890,000.000	890,872.200	
	AUSTRALIAN 2.75 04/21/24	3,100,000.000	3,156,017.000	
	AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	900,000.000	867,888.000	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	2,900,000.000	2,902,291.000	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/28	2,700,000.000	2,698,866.000	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/29	1,560,000.000	1,555,522.800	
	AUSTRALIAN 3.0 03/21/47	1,250,000.000	1,196,162.500	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	3,100,000.000	3,237,113.000	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	3,100,000.000	3,237,733.000	
	AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	900,000.000	916,794.000	
	AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	1,200,000.000	1,315,404.000	
	AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	3,600,000.000	4,004,676.000	
	AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	1,500,000.000	1,780,545.000	
AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	3,600,000.000	4,169,088.000		
AUSTRALIAN 5.5 04/21/23	3,000,000.000	3,415,710.000		
AUSTRALIAN 5.75 07/15/22	3,500,000.000	3,950,170.000		
オーストラリア・ドル 小計		47,240,000.000 (3,752,745,600)	49,944,052.500 (3,967,555,531)	
カナダ・ドル	CANADA 8.0 06/01/27	1,000,000.000	1,417,730.000	
	CANADA 0.75 03/01/21	1,090,000.000	1,050,334.900	
	CANADA 0.75 09/01/20	2,400,000.000	2,331,720.000	
	CANADA 0.75 09/01/21	600,000.000	573,522.000	
	CANADA 1.0 06/01/27	800,000.000	703,216.000	
	CANADA 1.0 09/01/22	800,000.000	758,344.000	
	CANADA 1.5 03/01/20	2,300,000.000	2,276,954.000	
	CANADA 1.5 06/01/23	2,300,000.000	2,206,206.000	
	CANADA 1.5 06/01/26	1,700,000.000	1,576,427.000	
	CANADA 1.75 03/01/23	1,160,000.000	1,127,264.800	
	CANADA 1.75 05/01/20	2,770,000.000	2,748,061.600	
	CANADA 2.0 06/01/28	1,020,000.000	973,488.000	
	CANADA 2.0 12/01/51	150,000.000	131,043.000	

	CANADA 2.25 06/01/25	1,500,000.000	1,475,415.000	
	CANADA 2.5 06/01/24	1,600,000.000	1,601,568.000	
	CANADA 2.75 06/01/22	3,900,000.000	3,947,853.000	
	CANADA 2.75 12/01/48	1,450,000.000	1,504,230.000	
	CANADA 2.75 12/01/64	750,000.000	794,100.000	
	CANADA 3.25 06/01/21	4,700,000.000	4,808,100.000	
	CANADA 3.5 06/01/20	2,800,000.000	2,854,992.000	
	CANADA 3.5 12/01/45	1,900,000.000	2,237,763.000	
	CANADA 4.0 06/01/41	1,800,000.000	2,229,948.000	
	CANADA 5.0 06/01/37	1,400,000.000	1,893,430.000	
	CANADA 5.75 06/01/29	1,600,000.000	2,067,200.000	
	CANADA 5.75 06/01/33	1,550,000.000	2,142,100.000	
カナダ・ドル 小計		43,040,000.000 (3,706,174,400)	45,431,010.300 (3,912,064,297)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE 1.25 10/01/21	1,000,000.000	972,500.000	
	SINGAPORE 2.25 08/01/36	200,000.000	180,976.000	
	SINGAPORE 2.375 06/01/25	500,000.000	495,150.000	
	SINGAPORE 2.75 03/01/46	660,000.000	633,804.600	
	SINGAPORE 2.75 04/01/42	550,000.000	529,925.000	
	SINGAPORE 2.875 07/01/29	400,000.000	406,400.000	
	SINGAPORE 2.875 09/01/30	460,000.000	464,830.000	
	SINGAPORE 3.0 09/01/24	810,000.000	833,085.000	
	SINGAPORE 3.125 09/01/22	1,600,000.000	1,649,280.000	
	SINGAPORE 3.25 09/01/20	1,340,000.000	1,369,815.000	
	SINGAPORE 3.375 09/01/33	480,000.000	508,147.200	
	SINGAPORE 3.5 03/01/27	900,000.000	960,120.000	
	シンガポール・ドル 小計		8,900,000.000 (723,036,000)	9,004,032.800 (731,487,625)
スウェーデン・クローナ	SWEDEN 0.75 05/12/28	4,970,000.000	4,984,363.300	
	SWEDEN 1.0 11/12/26	7,000,000.000	7,247,310.000	
	SWEDEN 1.5 11/13/23	9,700,000.000	10,370,658.000	
	SWEDEN 2.5 05/12/25	7,300,000.000	8,319,737.000	
	SWEDEN 3.5 03/30/39	6,200,000.000	8,482,220.000	
	SWEDEN 3.5 06/01/22	12,870,000.000	14,558,415.300	
スウェーデン・クローナ 小計		48,040,000.000 (590,892,000)	53,962,703.600 (663,741,254)	
デンマーク・クローネ	DENMARK 0.5 11/15/27	7,130,000.000	7,133,351.100	
	DENMARK 1.5 11/15/23	5,500,000.000	5,923,500.000	
	DENMARK 1.75 11/15/25	9,470,000.000	10,470,694.900	
	DENMARK 3.0 11/15/21	13,000,000.000	14,337,050.000	
	DENMARK 4.5 11/15/39	15,240,000.000	25,642,366.800	
デンマーク・クローネ 小計		50,340,000.000 (874,405,800)	63,506,962.800 (1,103,115,944)	
ノルウェー・クローネ	NORWAY 1.5 02/19/26	6,000,000.000	5,819,160.000	
	NORWAY 1.75 02/17/27	3,970,000.000	3,887,304.900	
	NORWAY 1.75 03/13/25	3,800,000.000	3,771,500.000	
	NORWAY 2.0 05/24/23	7,600,000.000	7,713,012.000	
	NORWAY 3.0 03/14/24	6,200,000.000	6,591,778.000	
ノルウェー・クローネ 小計		27,570,000.000	27,782,754.900	

		(376,881,900)	(379,790,259)	
ポーランド・ズロチ	POLAND 1.5 04/25/20	3,000,000.000	3,001,680.000	
	POLAND 1.75 07/25/21	2,200,000.000	2,197,800.000	
	POLAND 2.0 04/25/21	1,130,000.000	1,136,780.000	
	POLAND 2.25 04/25/22	4,000,000.000	4,010,800.000	
	POLAND 2.5 01/25/23	1,350,000.000	1,351,755.000	
	POLAND 2.5 07/25/26	4,200,000.000	4,011,210.000	
	POLAND 2.5 07/25/27	3,000,000.000	2,831,070.000	
	POLAND 2.75 04/25/28	960,000.000	915,408.000	
	POLAND 3.25 07/25/25	3,300,000.000	3,350,325.000	
	POLAND 4.0 10/25/23	3,100,000.000	3,303,825.000	
	POLAND 5.25 10/25/20	4,900,000.000	5,259,660.000	
	POLAND 5.75 04/25/29	1,440,000.000	1,762,070.400	
	POLAND 5.75 09/23/22	3,200,000.000	3,608,640.000	
	POLAND 5.75 10/25/21	3,680,000.000	4,096,024.000	
ポーランド・ズロチ 小計		39,460,000.000 (1,183,405,400)	40,837,047.400 (1,224,703,052)	
マレーシア・リングgit	MALAYSIA 3.418 08/15/22	3,000,000.000	2,962,680.000	
	MALAYSIA 3.48 03/15/23	1,220,000.000	1,202,078.200	
	MALAYSIA 3.492 03/31/20	2,200,000.000	2,200,044.000	
	MALAYSIA 3.502 05/31/27	2,570,000.000	2,447,359.600	
	MALAYSIA 3.733 06/15/28	2,000,000.000	1,939,420.000	
	MALAYSIA 3.844 04/15/33	1,210,000.000	1,118,778.100	
	MALAYSIA 3.892 03/15/27	800,000.000	785,688.000	
	MALAYSIA 4.127 04/15/32	1,850,000.000	1,765,621.500	
	MALAYSIA 4.16 07/15/21	4,000,000.000	4,055,120.000	
	MALAYSIA 4.181 07/15/24	2,430,000.000	2,455,369.200	
	MALAYSIA 4.378 11/29/19	3,680,000.000	3,719,081.600	
	MALAYSIA 4.392 04/15/26	3,070,000.000	3,125,413.500	
	MALAYSIA 4.498 04/15/30	1,800,000.000	1,806,084.000	
	MALAYSIA 4.935 09/30/43	2,000,000.000	2,018,640.000	
	MALAYSIA 5.248 09/15/28	1,600,000.000	1,701,824.000	
マレーシア・リングgit 小計		33,430,000.000 (903,612,900)	33,303,201.700 (900,185,542)	
メキシコ・ペソ	MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	13,000,000.000	15,093,260.000	
	MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	35,000,000.000	38,396,750.000	
	MEXICAN BONDS 5.75 03/05/26	14,859,000.000	12,948,281.190	
	MEXICAN BONDS 6.5 06/09/22	26,000,000.000	24,790,480.000	
	MEXICAN BONDS 6.5 06/10/21	38,000,000.000	36,680,640.000	
	MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	10,000,000.000	9,597,300.000	
	MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	10,000,000.000	9,639,300.000	

	MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	22,000,000.000	20,815,300.000	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	7,000,000.000	6,699,420.000	
	MEXICAN BONDS 8.0 06/11/20	30,000,000.000	30,052,200.000	
	MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47	5,000,000.000	4,853,650.000	
	MEXICAN BONDS 8.0 12/07/23	14,000,000.000	13,990,200.000	
	MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	31,000,000.000	31,722,920.000	
	MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	15,000,000.000	15,352,200.000	
	メキシコ・ペソ 小計	270,859,000.000 (1,587,233,740)	270,631,901.190 (1,585,902,941)	
ユーロ	AUSTRIA 0.5 04/20/27	500,000.000	493,680.000	
	AUSTRIA 0.75 10/20/26	1,300,000.000	1,319,357.000	
	AUSTRIA 07/15/23	350,000.000	348,827.500	
	AUSTRIA 09/20/22	1,790,000.000	1,796,909.400	
	AUSTRIA 1.2 10/20/25	1,000,000.000	1,056,000.000	
	AUSTRIA 1.5 02/20/47	230,000.000	230,308.200	
	AUSTRIA 1.5 11/02/86	290,000.000	255,690.100	
	AUSTRIA 1.65 10/21/24	1,250,000.000	1,356,550.000	
	AUSTRIA 1.75 10/20/23	1,400,000.000	1,518,720.000	
	AUSTRIA 2.1 09/20/17	100,000.000	107,960.000	
	AUSTRIA 2.4 05/23/34	900,000.000	1,060,866.000	
	AUSTRIA 3.15 06/20/44	810,000.000	1,118,901.600	
	AUSTRIA 3.4 11/22/22	1,500,000.000	1,716,870.000	
	AUSTRIA 3.5 09/15/21	1,900,000.000	2,112,800.000	
	AUSTRIA 3.65 04/20/22	1,200,000.000	1,362,840.000	
	AUSTRIA 3.8 01/26/62	820,000.000	1,377,837.800	
	AUSTRIA 3.9 07/15/20	1,700,000.000	1,830,747.000	
	AUSTRIA 4.15 03/15/37	1,480,000.000	2,190,992.000	
	AUSTRIA 4.85 03/15/26	1,100,000.000	1,456,664.000	
	AUSTRIA 6.25 07/15/27	1,150,000.000	1,701,241.000	
	BELGIUM 0.2 10/22/23	150,000.000	149,970.000	
	BELGIUM 0.5 10/22/24	1,070,000.000	1,079,276.900	
	BELGIUM 0.8 06/22/25	2,000,000.000	2,045,180.000	
	BELGIUM 0.8 06/22/27	1,100,000.000	1,101,243.000	
	BELGIUM 0.8 06/22/28	690,000.000	682,672.200	
	BELGIUM 1.0 06/22/26	1,500,000.000	1,540,845.000	
	BELGIUM 1.0 06/22/31	1,300,000.000	1,277,016.000	
	BELGIUM 1.25 04/22/33	510,000.000	508,016.100	
	BELGIUM 1.45 06/22/37	440,000.000	435,318.400	
	BELGIUM 1.6 06/22/47	900,000.000	861,723.000	
	BELGIUM 1.9 06/22/38	800,000.000	850,088.000	
	BELGIUM 2.15 06/22/66	700,000.000	710,290.000	
	BELGIUM 2.25 06/22/23	1,700,000.000	1,874,131.000	

BELGIUM 2.25 06/22/57	280,000.000	298,485.600	
BELGIUM 2.6 06/22/24	1,510,000.000	1,707,311.700	
BELGIUM 3.0 06/22/34	850,000.000	1,049,163.500	
BELGIUM 3.75 06/22/45	1,130,000.000	1,622,013.300	
BELGIUM 3.75 09/28/20	2,200,000.000	2,383,260.000	
BELGIUM 4.0 03/28/22	1,500,000.000	1,718,850.000	
BELGIUM 4.0 03/28/32	950,000.000	1,286,680.000	
BELGIUM 4.25 03/28/41	1,740,000.000	2,608,729.800	
BELGIUM 4.25 09/28/21	1,870,000.000	2,123,964.700	
BELGIUM 4.25 09/28/22	1,950,000.000	2,286,453.000	
BELGIUM 4.5 03/28/26	1,200,000.000	1,546,164.000	
BELGIUM 5.0 03/28/35	2,200,000.000	3,384,084.000	
BELGIUM 5.5 03/28/28	2,500,000.000	3,569,425.000	
BUNDESUBL 0.25 10/16/20	1,500,000.000	1,524,075.000	
BUNDESUBL 04/08/22	3,000,000.000	3,031,770.000	
BUNDESUBL 04/09/21	2,200,000.000	2,225,894.000	
BUNDESUBL 10/07/22	2,730,000.000	2,754,433.500	
BUNDESSCHAT 12/13/19	800,000.000	805,824.000	
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27	2,680,000.000	2,651,190.000	
DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28	890,000.000	864,279.000	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25	2,200,000.000	2,250,050.000	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26	2,690,000.000	2,737,532.300	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28	2,210,000.000	2,211,105.000	
DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27	2,700,000.000	2,716,470.000	
DEUTSCHLAND 08/15/26	2,800,000.000	2,732,016.000	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/24	2,600,000.000	2,741,960.000	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25	2,500,000.000	2,637,100.000	
DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48	1,060,000.000	1,083,298.800	
DEUTSCHLAND 1.5 02/15/23	2,100,000.000	2,253,552.000	
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/23	2,500,000.000	2,688,300.000	
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/24	2,000,000.000	2,164,980.000	
DEUTSCHLAND 1.5 09/04/22	1,650,000.000	1,763,338.500	
DEUTSCHLAND 1.75 02/15/24	1,500,000.000	1,641,135.000	
DEUTSCHLAND 1.75 07/04/22	2,700,000.000	2,905,497.000	
DEUTSCHLAND 2.0 01/04/22	2,700,000.000	2,906,226.000	
DEUTSCHLAND 2.0 08/15/23	1,500,000.000	1,652,355.000	
DEUTSCHLAND 2.25 09/04/20	4,200,000.000	4,424,784.000	
DEUTSCHLAND 2.25 09/04/21	1,070,000.000	1,152,925.000	
DEUTSCHLAND 2.5 01/04/21	2,200,000.000	2,349,358.000	
DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	2,700,000.000	3,541,185.000	
DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	2,700,000.000	3,583,629.000	
DEUTSCHLAND 3.0 07/04/20	3,000,000.000	3,186,630.000	

DEUTSCHLAND 3.25 01/04/20	3,600,000.000	3,776,544.000	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/21	3,150,000.000	3,468,811.500	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	1,650,000.000	2,415,171.000	
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	2,600,000.000	3,950,648.000	
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	1,660,000.000	2,680,717.400	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	1,420,000.000	1,993,765.200	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	2,200,000.000	3,473,866.000	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	1,480,000.000	2,571,810.800	
DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	2,050,000.000	3,217,967.000	
DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	1,600,000.000	2,349,968.000	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/24	1,700,000.000	2,257,379.000	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	1,100,000.000	1,777,930.000	
DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	1,120,000.000	1,708,492.800	
FINLAND 0.375 09/15/20	500,000.000	508,425.000	
FINLAND 0.5 04/15/26	600,000.000	600,408.000	
FINLAND 0.5 09/15/27	300,000.000	295,311.000	
FINLAND 0.75 04/15/31	450,000.000	438,862.500	
FINLAND 0.875 09/15/25	300,000.000	309,903.000	
FINLAND 04/15/22	320,000.000	321,958.400	
FINLAND 09/15/23	230,000.000	229,050.100	
FINLAND 1.125 04/15/34	420,000.000	421,961.400	
FINLAND 1.5 04/15/23	950,000.000	1,014,077.500	
FINLAND 1.625 09/15/22	400,000.000	427,212.000	
FINLAND 2.0 04/15/24	680,000.000	748,442.000	
FINLAND 2.625 07/04/42	660,000.000	851,538.600	
FINLAND 2.75 07/04/28	630,000.000	748,477.800	
FINLAND 3.375 04/15/20	980,000.000	1,038,221.800	
FINLAND 3.5 04/15/21	700,000.000	768,852.000	
FINLAND 4.0 07/04/25	800,000.000	993,688.000	
FRANCE BTAN 8.5 04/25/23	1,700,000.000	2,354,194.000	
FRANCE OAT 0.25 11/25/26	3,000,000.000	2,911,680.000	
FRANCE OAT 0.5 05/25/25	3,700,000.000	3,725,863.000	
FRANCE OAT 0.5 05/25/26	3,560,000.000	3,546,187.200	
FRANCE OAT 0.5 11/25/19	500,000.000	505,855.000	
FRANCE OAT 0.75 05/25/28	3,590,000.000	3,562,177.500	
FRANCE OAT 0.75 11/25/28	1,370,000.000	1,350,710.400	
FRANCE OAT 03/25/23	1,900,000.000	1,895,953.000	
FRANCE OAT 05/25/21	2,510,000.000	2,532,213.500	
FRANCE OAT 05/25/22	3,000,000.000	3,015,240.000	

FRANCE OAT 1.0 05/25/27	4,000,000.000	4,099,360.000	
FRANCE OAT 1.0 11/25/25	3,700,000.000	3,838,010.000	
FRANCE OAT 1.25 05/25/34	400,000.000	399,148.000	
FRANCE OAT 1.25 05/25/36	2,840,000.000	2,782,632.000	
FRANCE OAT 1.5 05/25/31	4,980,000.000	5,217,346.800	
FRANCE OAT 1.75 05/25/23	4,400,000.000	4,743,816.000	
FRANCE OAT 1.75 05/25/66	1,250,000.000	1,181,887.500	
FRANCE OAT 1.75 06/25/39	1,200,000.000	1,256,832.000	
FRANCE OAT 1.75 11/25/24	4,500,000.000	4,892,400.000	
FRANCE OAT 2.0 05/25/48	1,710,000.000	1,812,668.400	
FRANCE OAT 2.25 05/25/24	4,000,000.000	4,452,000.000	
FRANCE OAT 2.25 10/25/22	3,400,000.000	3,718,648.000	
FRANCE OAT 2.5 05/25/30	3,900,000.000	4,539,444.000	
FRANCE OAT 2.5 10/25/20	7,800,000.000	8,272,212.000	
FRANCE OAT 2.75 10/25/27	4,000,000.000	4,708,800.000	
FRANCE OAT 3.0 04/25/22	5,300,000.000	5,895,561.000	
FRANCE OAT 3.25 05/25/45	2,700,000.000	3,640,977.000	
FRANCE OAT 3.25 10/25/21	5,200,000.000	5,759,260.000	
FRANCE OAT 3.5 04/25/20	6,500,000.000	6,903,715.000	
FRANCE OAT 3.5 04/25/26	3,430,000.000	4,192,489.000	
FRANCE OAT 3.75 04/25/21	4,640,000.000	5,126,643.200	
FRANCE OAT 4.0 04/25/55	1,900,000.000	2,996,680.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/60	1,600,000.000	2,586,912.000	
FRANCE OAT 4.0 10/25/38	3,100,000.000	4,512,112.000	
FRANCE OAT 4.25 10/25/23	5,000,000.000	6,040,450.000	
FRANCE OAT 4.5 04/25/41	3,620,000.000	5,699,183.200	
FRANCE OAT 4.75 04/25/35	3,100,000.000	4,731,747.000	
FRANCE OAT 5.5 04/25/29	3,650,000.000	5,347,724.500	
FRANCE OAT 5.75 10/25/32	3,390,000.000	5,433,525.900	
FRANCE OAT 6.0 10/25/25	2,900,000.000	4,020,415.000	
IRISH 0.8 03/15/22	950,000.000	977,122.500	
IRISH 0.9 05/15/28	340,000.000	334,447.800	
IRISH 1.0 05/15/26	1,200,000.000	1,219,296.000	
IRISH 1.3 05/15/33	450,000.000	436,099.500	
IRISH 1.7 05/15/37	750,000.000	750,907.500	
IRISH 2.0 02/18/45	960,000.000	989,606.400	
IRISH 2.4 05/15/30	1,100,000.000	1,232,077.000	
IRISH 3.4 03/18/24	930,000.000	1,082,231.700	
IRISH 3.9 03/20/23	700,000.000	816,753.000	
IRISH 4.5 04/18/20	1,130,000.000	1,214,693.500	
IRISH 5.0 10/18/20	850,000.000	942,871.000	
IRISH 5.4 03/13/25	1,260,000.000	1,641,288.600	
ITALY BTPS 0.35 11/01/21	1,700,000.000	1,609,628.000	
ITALY BTPS 0.65 10/15/23	2,100,000.000	1,895,817.000	
ITALY BTPS 0.65 11/01/20	3,600,000.000	3,530,160.000	
ITALY BTPS 0.9 08/01/22	980,000.000	921,690.000	
ITALY BTPS 0.95 03/15/23	2,500,000.000	2,325,250.000	
ITALY BTPS 1.05 12/01/19	2,000,000.000	2,000,480.000	
ITALY BTPS 1.25 12/01/26	2,000,000.000	1,735,420.000	

ITALY BTPS 1.35 04/15/22	2,500,000.000	2,407,300.000	
ITALY BTPS 1.45 09/15/22	1,500,000.000	1,438,545.000	
ITALY BTPS 1.45 11/15/24	2,020,000.000	1,844,361.000	
ITALY BTPS 1.5 06/01/25	2,500,000.000	2,263,950.000	
ITALY BTPS 1.6 06/01/26	1,500,000.000	1,345,800.000	
ITALY BTPS 1.65 03/01/32	2,260,000.000	1,828,859.800	
ITALY BTPS 1.85 05/15/24	2,100,000.000	1,983,870.000	
ITALY BTPS 2.0 02/01/28	1,130,000.000	1,014,095.900	
ITALY BTPS 2.0 12/01/25	2,700,000.000	2,506,113.000	
ITALY BTPS 2.05 08/01/27	2,780,000.000	2,516,011.200	
ITALY BTPS 2.15 12/15/21	2,200,000.000	2,191,200.000	
ITALY BTPS 2.2 06/01/27	2,040,000.000	1,879,248.000	
ITALY BTPS 2.25 09/01/36	1,500,000.000	1,232,250.000	
ITALY BTPS 2.45 09/01/33	1,100,000.000	955,746.000	
ITALY BTPS 2.5 12/01/24	970,000.000	943,024.300	
ITALY BTPS 2.7 03/01/47	1,650,000.000	1,357,125.000	
ITALY BTPS 2.8 03/01/67	830,000.000	665,162.000	
ITALY BTPS 2.8 12/01/28	650,000.000	612,969.500	
ITALY BTPS 2.95 09/01/38	800,000.000	704,456.000	
ITALY BTPS 3.25 09/01/46	2,000,000.000	1,814,560.000	
ITALY BTPS 3.45 03/01/48	1,430,000.000	1,315,428.400	
ITALY BTPS 3.5 03/01/30	2,950,000.000	2,932,182.000	
ITALY BTPS 3.75 03/01/21	3,300,000.000	3,434,805.000	
ITALY BTPS 3.75 05/01/21	2,300,000.000	2,390,850.000	
ITALY BTPS 3.75 08/01/21	3,200,000.000	3,328,640.000	
ITALY BTPS 3.75 09/01/24	1,900,000.000	1,970,528.000	
ITALY BTPS 4.0 02/01/37	3,020,000.000	3,127,210.000	
ITALY BTPS 4.0 09/01/20	3,700,000.000	3,855,437.000	
ITALY BTPS 4.25 03/01/20	4,600,000.000	4,778,572.000	
ITALY BTPS 4.5 02/01/20	4,500,000.000	4,682,115.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/24	3,700,000.000	3,973,763.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/26	2,900,000.000	3,146,500.000	
ITALY BTPS 4.5 05/01/23	1,400,000.000	1,504,076.000	
ITALY BTPS 4.75 08/01/23	1,900,000.000	2,064,540.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/21	2,470,000.000	2,640,430.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/28	2,400,000.000	2,665,608.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/44	1,790,000.000	2,003,368.000	
ITALY BTPS 5.0 03/01/22	3,600,000.000	3,891,960.000	
ITALY BTPS 5.0 03/01/25	2,400,000.000	2,659,776.000	
ITALY BTPS 5.0 08/01/34	2,800,000.000	3,228,960.000	
ITALY BTPS 5.0 08/01/39	2,430,000.000	2,793,771.000	
ITALY BTPS 5.0 09/01/40	2,490,000.000	2,850,801.000	
ITALY BTPS 5.25 11/01/29	2,900,000.000	3,348,630.000	
ITALY BTPS 5.5 09/01/22	3,900,000.000	4,310,475.000	
ITALY BTPS 5.5 11/01/22	2,500,000.000	2,766,175.000	
ITALY BTPS 5.75 02/01/33	2,400,000.000	2,938,800.000	
ITALY BTPS 6.0 05/01/31	3,100,000.000	3,832,220.000	
ITALY BTPS 6.5 11/01/27	3,300,000.000	4,088,700.000	
ITALY BTPS 7.25 11/01/26	1,800,000.000	2,293,920.000	

ITALY BTPS 9.0 11/01/23	1,900,000.000	2,447,010.000	
NETHERLANDS 0.25 01/15/20	2,150,000.000	2,174,381.000	
NETHERLANDS 0.25 07/15/25	1,700,000.000	1,696,396.000	
NETHERLANDS 0.5 07/15/26	1,700,000.000	1,710,030.000	
NETHERLANDS 0.75 07/15/27	1,450,000.000	1,473,983.000	
NETHERLANDS 0.75 07/15/28	950,000.000	958,132.000	
NETHERLANDS 01/15/22	1,900,000.000	1,916,891.000	
NETHERLANDS 01/15/24	1,680,000.000	1,671,868.800	
NETHERLANDS 1.75 07/15/23	2,000,000.000	2,168,920.000	
NETHERLANDS 2.0 07/15/24	1,560,000.000	1,726,436.400	
NETHERLANDS 2.25 07/15/22	1,550,000.000	1,694,243.000	
NETHERLANDS 2.5 01/15/33	1,480,000.000	1,798,155.600	
NETHERLANDS 2.75 01/15/47	1,350,000.000	1,858,099.500	
NETHERLANDS 3.25 07/15/21	1,860,000.000	2,048,622.600	
NETHERLANDS 3.5 07/15/20	1,670,000.000	1,789,705.600	
NETHERLANDS 3.75 01/15/23	590,000.000	688,235.000	
NETHERLANDS 3.75 01/15/42	1,540,000.000	2,386,353.200	
NETHERLANDS 4.0 01/15/37	1,700,000.000	2,552,890.000	
NETHERLANDS 5.5 01/15/28	1,600,000.000	2,313,600.000	
SPAIN 0.05 01/31/21	400,000.000	400,156.000	
SPAIN 0.35 07/30/23	900,000.000	888,516.000	
SPAIN 0.4 04/30/22	2,200,000.000	2,208,866.000	
SPAIN 0.45 10/31/22	800,000.000	801,584.000	
SPAIN 0.75 07/30/21	1,700,000.000	1,731,773.000	
SPAIN 1.15 07/30/20	2,100,000.000	2,149,350.000	
SPAIN 1.3 10/31/26	2,000,000.000	1,996,700.000	
SPAIN 1.4 01/31/20	5,460,000.000	5,579,301.000	
SPAIN 1.4 04/30/28	1,920,000.000	1,894,694.400	
SPAIN 1.4 07/30/28	1,550,000.000	1,520,224.500	
SPAIN 1.45 10/31/27	2,540,000.000	2,532,405.400	
SPAIN 1.5 04/30/27	2,000,000.000	2,009,200.000	
SPAIN 1.6 04/30/25	2,500,000.000	2,594,950.000	
SPAIN 1.95 04/30/26	1,790,000.000	1,880,699.300	
SPAIN 1.95 07/30/30	2,240,000.000	2,271,292.800	
SPAIN 2.15 10/31/25	2,100,000.000	2,244,438.000	
SPAIN 2.35 07/30/33	1,480,000.000	1,527,360.000	
SPAIN 2.7 10/31/48	600,000.000	597,972.000	
SPAIN 2.75 10/31/24	2,700,000.000	2,993,031.000	
SPAIN 2.9 10/31/46	1,800,000.000	1,890,126.000	

	SPAIN 3.45 07/30/66	1,000,000.000	1,115,220.000	
	SPAIN 3.8 04/30/24	1,720,000.000	1,996,249.200	
	SPAIN 4.0 04/30/20	2,400,000.000	2,557,128.000	
	SPAIN 4.2 01/31/37	1,960,000.000	2,544,295.600	
	SPAIN 4.3 10/31/19	4,200,000.000	4,405,296.000	
	SPAIN 4.4 10/31/23	2,300,000.000	2,721,475.000	
	SPAIN 4.65 07/30/25	2,600,000.000	3,210,168.000	
	SPAIN 4.7 07/30/41	2,100,000.000	2,925,636.000	
	SPAIN 4.8 01/31/24	2,200,000.000	2,660,878.000	
	SPAIN 4.85 10/31/20	2,900,000.000	3,193,190.000	
	SPAIN 4.9 07/30/40	2,000,000.000	2,846,000.000	
	SPAIN 5.15 10/31/28	2,380,000.000	3,159,212.000	
	SPAIN 5.15 10/31/44	1,500,000.000	2,233,275.000	
	SPAIN 5.4 01/31/23	2,800,000.000	3,387,048.000	
	SPAIN 5.5 04/30/21	3,600,000.000	4,098,852.000	
	SPAIN 5.75 07/30/32	2,400,000.000	3,511,752.000	
	SPAIN 5.85 01/31/22	2,300,000.000	2,724,626.000	
	SPAIN 5.9 07/30/26	2,500,000.000	3,354,250.000	
	SPAIN 6.0 01/31/29	2,750,000.000	3,886,437.500	
	ユーロ 小計	541,810,000.000 (70,202,321,700)	609,153,447.800 (78,928,012,231)	
南アフリカ・ランド	SOUTH AFRICA 10.5 12/21/26	25,000,000.000	26,801,500.000	
	SOUTH AFRICA 6.25 03/31/36	14,700,000.000	10,268,538.000	
	SOUTH AFRICA 6.5 02/28/41	11,760,000.000	8,025,729.600	
	SOUTH AFRICA 7.0 02/28/31	11,600,000.000	9,341,480.000	
	SOUTH AFRICA 7.75 02/28/23	10,000,000.000	9,698,100.000	
	SOUTH AFRICA 8.0 01/31/30	13,110,000.000	11,652,299.100	
	SOUTH AFRICA 8.25 03/31/32	10,000,000.000	8,856,200.000	
	SOUTH AFRICA 8.5 01/31/37	10,910,000.000	9,521,047.900	
	SOUTH AFRICA 8.75 01/31/44	10,000,000.000	8,730,500.000	
	SOUTH AFRICA 8.75 02/28/48	20,280,000.000	17,708,496.000	
	SOUTH AFRICA 8.875 02/28/35	12,510,000.000	11,423,881.800	
	SOUTH AFRICA 9.0 01/31/40	8,000,000.000	7,232,240.000	
	南アフリカ・ランド 小計	157,870,000.000 (1,201,390,700)	139,260,012.400 (1,059,768,694)	
	国債証券 合計	187,287,000,140 (187,287,000,140)	195,991,508,237 (195,991,508,237)	
	合計	187,287,000,140	195,991,508,237	

(187,287,000,140)	(195,991,508,237)
-------------------	-------------------

- (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 136銘柄	44.35%	45.26%
イギリス・ポンド	国債証券 38銘柄	6.42%	6.55%
オーストラリア・ドル	国債証券 20銘柄	1.98%	2.02%
カナダ・ドル	国債証券 25銘柄	1.96%	2.00%
シンガポール・ドル	国債証券 12銘柄	0.37%	0.37%
スウェーデン・クローナ	国債証券 6銘柄	0.33%	0.34%
デンマーク・クローネ	国債証券 5銘柄	0.55%	0.56%
ノルウェー・クローネ	国債証券 5銘柄	0.19%	0.19%
ポーランド・ズロチ	国債証券 14銘柄	0.61%	0.62%
マレーシア・リングgit	国債証券 15銘柄	0.45%	0.46%
メキシコ・ペソ	国債証券 14銘柄	0.79%	0.81%
ユーロ	国債証券 270銘柄	39.46%	40.27%
南アフリカ・ランド	国債証券 12銘柄	0.53%	0.54%

(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30年4月11日現在	平成30年10月11日現在
資産の部			
流動資産			
預金		6,042,625,735	4,131,787,212
コール・ローン		119,740,004	70,988,267
株式		61,744,203,468	49,707,246,286
投資信託受益証券		326,742,195	281,626,794
投資証券		117,102,504	91,665,478
派生商品評価勘定		32,355,163	127,051
未収入金		-	2,571,830
未収配当金		100,426,950	69,349,236
差入委託証拠金		1,562,062,581	778,607,087
流動資産合計		70,045,258,600	55,133,969,241
資産合計		70,045,258,600	55,133,969,241
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		2,924,185	296,515,767
未払金		4,504,623,909	30,576,656
未払解約金		3,675,000	42,577,000
流動負債合計		4,511,223,094	369,669,423
負債合計		4,511,223,094	369,669,423
純資産の部			
元本等			
元本	1	53,100,504,600	50,025,024,540
剰余金			
剰余金又は欠損金()		12,433,530,906	4,739,275,278
元本等合計		65,534,035,506	54,764,299,818
純資産合計		65,534,035,506	54,764,299,818
負債純資産合計		70,045,258,600	55,133,969,241

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	平成30年4月11日現在	平成30年10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	47,632,425,380円	53,100,504,600円
同期中追加設定元本額	19,494,444,619円	17,404,759,399円
同期中一部解約元本額	14,026,365,399円	20,480,239,459円
元本の内訳		
ファンド名		
DIAM新興国株式インデックスファンド<DC年金>	3,436,204,969円	3,994,589,819円
DIAM新興国株式インデックスファンド<為替ヘッジなし>(ファンドラップ)	504,706,628円	526,663,191円
MITO ラップ型ファンド(安定型)	6,013,938円	3,985,301円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	15,725,843円	10,799,409円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	18,210,990円	13,414,427円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	31,548,302円	28,092,719円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	33,302,831円	28,537,703円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	18,874,652円	17,351,870円
たわらノーロード 新興国株式	3,506,128,016円	4,122,080,841円
たわらノーロード 新興国株式<ラップ向け>	1,094,544,768円	1,767,045,461円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	43,471,037円	136,210,830円
たわらノーロード バランス(堅実型)	223,011円	885,658円
たわらノーロード バランス(標準型)	798,794円	3,641,182円
たわらノーロード バランス(積極型)	2,544,706円	9,490,560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)	22,478円	108,437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)	1,568,583円	5,437,197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)	2,199,309円	16,617,446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)	1,842,053円	12,031,101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)	4,086,391円	35,451,913円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	20,102円	27,969円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	96,038円	369,091円

たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	129,047円	293,335円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	496,573円	667,435円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	429,132,057円	447,212,307円
DIAM DC 8資産バランス ファンド(新興国10)	43,983,763円	314,439,194円
DIAM DC 8資産バランス ファンド(新興国20)	150,861,940円	267,422,836円
DIAM DC 8資産バランス ファンド(新興国30)	331,857,161円	531,664,281円
投資のソムリエ	6,969,149,974円	3,362,324,690円
クルーズコントロール	209,411,663円	895,110,618円
投資のソムリエ<DC年金>	497,851,493円	292,031,702円
DIAM 8資産バランス ファンドN<DC年金>	177,667,170円	211,686,781円
クルーズコントロール<DC 年金>	77,276円	517,357円
DIAMコア資産設計ファンド (堅実型)	2,541,969円	10,528,358円
DIAMコア資産設計ファンド (積極型)	7,900,364円	29,281,738円
投資のソムリエ<DC年金> リスク抑制型	109,132,260円	100,151,426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	1,336,412円	564,769円
ワールドアセットバランス(基 本コース)	1,835,055,796円	1,889,566,731円
ワールドアセットバランス(リ スク抑制コース)	1,787,762,556円	1,897,818,968円
ワールドアセットバランス(リ スク抑制コース)	6,173,904,750円	7,270,447,519円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2045)	1,198,784円	1,147,064円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2055)	876,734円	824,219円
リスク抑制世界8資産 バランス ファンド(DC)	557,334円	595,341円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2035)	2,248,337円	1,488,465円
リスクコントロール世界資産 分散ファンド	- 円	270,188,548円
9資産分散投資・スタンダード <DC年金>	- 円	20,870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)	4,783,607,576円	3,861,359,568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)	2,636,951,676円	2,126,263,232円
DIAM世界アセット バランス ファンド2VA(適格機関 投資家 限定)	11,009,303,085円	8,070,831,328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)	7,215,375,411円	7,437,743,735円
計		53,100,504,600円	50,025,024,540円
2 .	受益権の総数	53,100,504,600口	50,025,024,540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10月12日 至 平成30年4月11日	自 平成30年4月12日 至 平成30年10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30年4月11日現在	平成30年10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30年4月11日現在	平成30年10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	7,270,519,512	5,579,552,724
投資信託受益証券	19,590,662	629,376
投資証券	18,203,717	18,501,260
合計	7,232,725,133	5,597,424,608

（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30年4月11日まで及び平成30年4月19日から平成30年10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30年4月11日 現在				平成30年10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	912,398,463	-	915,094,946	2,696,483	151,880,561	-	151,753,510	127,051
アメリカ・ドル	912,398,463	-	915,094,946	2,696,483	131,077,440	-	131,077,440	-
カタール・リアル	-	-	-	-	20,803,121	-	20,676,070	127,051
買 建	2,382,894,443	-	2,386,839,610	3,945,167	20,803,121	-	20,566,067	237,054
アメリカ・ドル	1,470,495,980	-	1,470,644,620	148,640	20,803,121	-	20,566,067	237,054
インドネシア・ルピア	92,956,245	-	93,323,716	367,471	-	-	-	-
コロンビア・ペソ	20,388,954	-	20,405,071	16,117	-	-	-	-
フィリピン・ペソ	47,980,882	-	47,892,940	87,942	-	-	-	-
ブラジル・リアル	322,650,769	-	324,120,463	1,469,694	-	-	-	-
マレーシア・リンギット	116,092,698	-	116,298,000	205,302	-	-	-	-
ユーロ	14,561,669	-	14,561,800	131	-	-	-	-
南アフリカ・ランド	297,767,246	-	299,593,000	1,825,754	-	-	-	-
合計	3,295,292,906	-	3,301,934,556	1,248,684	172,683,682	-	172,319,577	110,003

(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。

株式関連

種類	平成30年4月11日 現在				平成30年10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	4,656,503,439	-	4,684,685,733	28,182,294	4,827,540,658	-	4,531,261,945	296,278,713
合計	4,656,503,439	-	4,684,685,733	28,182,294	4,827,540,658	-	4,531,261,945	296,278,713

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成30年4月11日現在	平成30年10月11日現在
1口当たり純資産額	1.2342円	1.0947円
(1万口当たり純資産額)	(12,342円)	(10,947円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

平成30年10月11日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	CTIP.COM INTERNATIONAL LTD ADR	37,000	33.950	1,256,150.000	
	CIA DE MINAS BUENAVENTURA SA ADR	18,800	13.070	245,716.000	
	SURGUTNEFTEGAZ SP ADR PREF	69,900	5.500	384,450.000	
	CREDICORP LTD	6,349	217.170	1,378,812.330	
	SINA CORP	6,000	59.180	355,080.000	
	MOBILE TELESYSTEMS PJSC ADR	48,925	7.800	381,615.000	
	NETEASE INC-ADR	7,300	210.510	1,536,723.000	
	SOUTHERN COPPER CORP	7,580	41.350	313,433.000	
	LUKOIL SPON ADR	39,430	73.480	2,897,316.400	
	GAZPROM PAO ADR	501,010	5.010	2,510,060.100	
	COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK SP GDR	110,249	4.335	477,929.410	
	INNER MONGOLIA YITAI COAL CO	105,800	1.195	126,431.000	
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRADE	96,280	1.330	128,052.400	
	SURGUTNEFTEGAZ ADR	74,317	4.002	297,416.630	
	51JOB INC ADR	2,300	60.550	139,265.000	
	X5 RETAIL GROUP NV GDR	12,426	19.870	246,904.620	
	NOVATEK PJSC GDR	8,459	172.700	1,460,869.300	
	BAIDU INC -SPON ADR	25,200	194.260	4,895,352.000	
	NOVOLIPETSK STEEL GDR	13,240	26.250	347,550.000	
	MMC NORILSK NICKEL ADR	61,384	17.005	1,043,834.920	
	ROSNEFT OIL CO GDR	114,000	7.004	798,456.000	
	NEW ORIENTAL EDUCATION & TECH	12,900	59.040	761,616.000	
	SEVERSTAL GDR	21,907	16.230	355,550.610	
	TATNEFT ADR	23,860	74.000	1,765,640.000	
	MAGNITOGORSK IRON & STEEL SPON GDR	19,500	9.290	181,155.000	
	VTB BANK OJSC GDR	192,000	1.256	241,152.000	
	DP WORLD LTD	15,686	18.640	292,387.040	
	MAGNIT PJSC GDR	33,117	12.365	409,491.700	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD ADR	43,400	5.010	217,434.000	
	FANG HOLDINGS LTD ADR	19,300	2.240	43,232.000	
RUSHYDRO PJSC ADR	141,960	0.850	120,666.000		
TAL EDUCATION GROUP-ADR	32,200	22.000	708,400.000		
NOAH HOLDINGS LTD ADR	2,700	34.900	94,230.000		
SBERBANK ADR	249,900	11.610	2,901,339.000		

	PHOSAGRO PJSC GDR	13,784	13.000	179,192.000	
	HUAZHU GROUP LTD ADR	11,800	26.130	308,334.000	
	YY INC-ADR	4,700	68.420	321,574.000	
	GDS HOLDINGS LTD ADR	5,600	23.790	133,224.000	
	58.COM INC ADR	8,400	61.460	516,264.000	
	AUTOHOME INC ADR	5,400	65.690	354,726.000	
	WEIBO CORP ADR	4,700	56.500	265,550.000	
	JD.COM INC ADR	65,500	22.710	1,487,505.000	
	ALIBABA GROUP HOLDING LTD-ADR	104,880	138.290	14,503,855.200	
	MOMO INC SPON ADR	13,100	35.060	459,286.000	
	BAOZUN INC-SPN ADR	3,400	36.310	123,454.000	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	33,200	32.180	1,068,376.000	
	POLYUS PJSC GDR	6,012	30.950	186,071.400	
アメリカ・ドル 小計		2,454,855		49,221,122.060 (5,530,485,274)	
アラブ首長国連邦・ディルハム	DUBAI ISLAMIC BANK PJSC	168,000	5.350	898,800.000	
	EMIRATES TELECOMMUNICATIONS GROUP CO PJSC	156,450	16.700	2,612,715.000	
	DUBAI INVESTMENTS PJSC	169,895	1.770	300,714.150	
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK PJSC	194,762	7.990	1,556,148.380	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	127,622	14.800	1,888,805.600	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	322,486	5.000	1,612,430.000	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	356,142	1.720	612,564.240	
	EMAAR DEVELOPMENT PJSC	77,463	5.240	405,906.120	
	EMAAR MALLS PJSC	178,166	1.840	327,825.440	
	DAMAC PROPERTIES DUBAI CO PJSC	190,235	2.030	386,177.050	
アラブ首長国連邦・ディルハム 小計		1,941,221		10,602,085.980 (324,847,914)	
インド・ルピー	RELIANCE INDUSTRIES LTD	258,730	1,102.100	285,146,333.000	
	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	66,548	265.400	17,661,839.200	
	ASIAN PAINTS LTD	26,486	1,225.950	32,470,511.700	
	EICHER MOTORS LTD	1,197	22,582.350	27,031,072.950	
	GRASIM INDUSTRIES LTD	28,851	909.650	26,244,312.150	
	MAHINDRA & MAHINDRA LTD	67,342	764.100	51,456,022.200	
	SHREE CEMENT LTD	830	15,541.600	12,899,528.000	
	ICICI BANK LTD	213,994	319.850	68,445,980.900	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP LTD	58,463	180.700	10,564,264.100	
	STATE BANK OF INDIA LTD	162,789	278.650	45,361,154.850	
	CONTAINER CORP OF INDIA LTD	15,148	614.350	9,306,173.800	
	LIC HOUSING FINANCE LTD	26,242	428.650	11,248,633.300	
	TATA STEEL LTD	31,902	583.650	18,619,602.300	
TATA MOTORS LTD	138,820	188.750	26,202,275.000		

JSW STEEL LTD	76,971	376.800	29,002,672.800	
TATA POWER CO LTD	114,770	65.000	7,460,050.000	
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	2,743	5,708.500	15,658,415.500	
NESTLE INDIA LTD	2,343	9,510.250	22,282,515.750	
BHARAT HEAVY ELECTRICALS LTD	92,082	74.150	6,827,880.300	
GAIL INDIA LTD	70,027	336.350	23,553,581.450	
VEDANTA LTD	110,581	218.150	24,123,245.150	
AXIS BANK LTD	162,278	589.200	95,614,197.600	
TITAN COMPANY LTD	27,648	788.550	21,801,830.400	
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	122,655	148.600	18,226,533.000	
LUPIN LTD	22,500	858.100	19,307,250.000	
BAJAJ FINANCE LTD	15,656	2,270.950	35,553,993.200	
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP	144,729	1,736.950	251,387,036.550	
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISES LTD	43,870	459.800	20,171,426.000	
INFOSYS LTD	318,055	700.450	222,781,624.750	
WIPRO LTD	100,958	315.950	31,897,680.100	
INDIAN OIL CORP LTD	139,469	124.000	17,294,156.000	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	59,221	1,527.650	90,468,960.650	
HCL TECHNOLOGIES LTD	50,316	1,051.800	52,922,368.800	
DABUR INDIA LTD	52,045	405.250	21,091,236.250	
HERO MOTOCORP LTD	4,509	2,920.100	13,166,730.900	
DR REDDYS LABORATORIES LTD	10,085	2,484.600	25,057,191.000	
BHARTI AIRTEL LTD	125,025	295.100	36,894,877.500	
UNITED SPIRITS LTD	28,139	471.600	13,270,352.400	
SUN PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD	75,490	602.950	45,516,695.500	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	9,620	6,985.850	67,203,877.000	
GLENMARK PHARMACEUTICALS LTD	13,988	598.350	8,369,719.800	
AUROBINDO PHARMA LTD	23,572	779.650	18,377,909.800	
HAVELLS INDIA LTD	24,800	611.200	15,157,760.000	
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	64,460	232.100	14,961,166.000	
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE CO LTD	15,042	1,079.950	16,244,607.900	
PETRONET LNG LTD	52,875	212.850	11,254,443.750	
CIPLA LTD/INDIA	31,870	639.600	20,384,052.000	
LARSEN & TOUBRO LTD	42,451	1,250.650	53,091,343.150	
ULTRATECH CEMENT LTD	9,111	3,778.000	34,421,358.000	
ASHOK LEYLAND LTD	110,886	114.550	12,701,991.300	
BOSCH LTD	774	18,582.400	14,382,777.600	
TATA CONSULTANCY SERVICES LTD	83,649	2,043.600	170,945,096.400	
NTPC LTD	175,055	164.350	28,770,289.250	

	PIRAMAL ENTERPRISES LTD	7,474	2,400.650	17,942,458.100	
	YES BANK LTD	153,758	233.900	35,963,996.200	
	AMBUJA CEMENTS LTD	54,635	209.900	11,467,886.500	
	BHARAT FORGE LTD	18,421	589.000	10,849,969.000	
	HINDALCO INDUSTRIES LTD	99,935	226.900	22,675,251.500	
	ITC LTD	310,220	270.100	83,790,422.000	
	PIDILITE INDUSTRIES LTD	11,666	952.850	11,115,948.100	
	UNITED PHOSPHORUS LTD	32,882	622.450	20,467,400.900	
	SIEMENS INDIA LTD	7,396	916.100	6,775,475.600	
	GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	32,823	718.600	23,586,607.800	
	TECH MAHINDRA LTD	42,065	699.300	29,416,054.500	
	VODAFONE IDEA LTD	196,527	36.050	7,084,798.350	
	MARICO LTD	45,380	301.750	13,693,415.000	
	PAGE INDUSTRIES LTD	528	30,222.350	15,957,400.800	
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	149,485	187.150	27,976,117.750	
	ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	49,342	327.100	16,139,768.200	
	RURAL ELECTRIFICATION CORP LTD	55,173	104.200	5,749,026.600	
	BAJAJ FINSERV LTD	3,603	5,961.500	21,479,284.500	
	BAJAJ AUTO LTD	8,027	2,581.800	20,724,108.600	
	COAL INDIA LTD	62,457	272.700	17,032,023.900	
	MAHINDRA & MAHINDRA FINANCIAL SERVICES LTD	32,995	405.850	13,391,020.750	
	BHARTI INFRATEL LTD	32,296	258.250	8,340,442.000	
	INDIABULLS HOUSING FINANCE LTD	25,466	978.250	24,912,114.500	
	TATA STEEL LTD-PARTLY PAID	2,333	126.100	294,191.300	
	CADILA HEALTHCARE LTD	16,962	385.300	6,535,458.600	
	AVENUE SUPERMARTS LTD	11,937	1,374.400	16,406,212.800	
	INTERGLOBE AVIATION LTD	8,300	744.450	6,178,935.000	
	インド・ルピー 小計	5,199,746		2,786,202,385.800 (4,235,027,626)	
インドネシア・ルピア	UNITED TRACTORS TBK PT	163,401	32,300.000	5,277,852,300.000	
	INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK PT	359,200	5,700.000	2,047,440,000.000	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	137,500	44,900.000	6,173,750,000.000	
	PT ASTRA INTERNATIONAL TBK	1,798,100	6,950.000	12,496,795,000.000	
	TELEKOMUNIKASI INDONESIA PERSERO TBK	4,532,900	3,600.000	16,318,440,000.000	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA TBK PT	675,600	4,990.000	3,371,244,000.000	
	GUDANG GARAM TBK PT	48,600	75,350.000	3,662,010,000.000	

	HANJAYA MANDALA SAMPOERNA TBK	924,800	3,900.000	3,606,720,000.000	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA TBK PT	185,600	16,900.000	3,136,640,000.000	
	INDAH KIAT PULP AND PAPER CORP TBK PT	262,000	14,925.000	3,910,350,000.000	
	BANK DANAMON INDONESIA TBK PT	261,316	7,125.000	1,861,876,500.000	
	BANK MANDIRI	1,666,500	6,475.000	10,790,587,500.000	
	MATAHARI DEPARTMENT STORE TBK	276,500	6,275.000	1,735,037,500.000	
	BANK RAKYAT INDONESIA	4,985,300	3,010.000	15,005,753,000.000	
	PERUSAHAAN GAS NEGARA PT	1,064,100	2,250.000	2,394,225,000.000	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSERO TBK PT	669,100	6,950.000	4,650,245,000.000	
	KALBE FARMA TBK PT	1,822,200	1,285.000	2,341,527,000.000	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK PT	276,500	9,125.000	2,523,062,500.000	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	900,100	23,375.000	21,039,837,500.000	
	JASA MARGA PERSERO TBK PT	200,125	4,420.000	884,552,500.000	
	BUMI SERPONG DAMAI PT	851,700	1,005.000	855,958,500.000	
	ADARO ENERGY PT	1,434,500	1,780.000	2,553,410,000.000	
	PAKUWON JATI TBK	1,912,800	468.000	895,190,400.000	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR TBK PT	239,000	8,625.000	2,061,375,000.000	
	TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE TBK PT	180,800	5,100.000	922,080,000.000	
	BANK TABUNGAN NEGARA TBK PT	480,300	2,420.000	1,162,326,000.000	
	WASKITA KARYA PERSERO TBK PT	392,000	1,645.000	644,840,000.000	
	PT SURYA CITRA MEDIA TBK	511,300	1,740.000	889,662,000.000	
	インドネシア・ルビア 小計	27,211,842		133,212,787,200.000 (985,774,626)	
オフショア・人民 元	LUXSHARE PRECISION INDUSTRY CO LTD	9,600	14.950	143,520.000	
	FOCUS MEDIA INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD	26,300	7.720	203,036.000	
	IFLYTEK CO LTD	6,400	26.900	172,160.000	
	YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD	2,300	70.230	161,529.000	
	JIANGSU YANGHE BREWERY JOINT-STOCK CO LTD	2,500	113.500	283,750.000	
	WULIANGYE YIBIN CO LTD	4,500	60.810	273,645.000	
	SUNING.COM CO LTD	29,500	12.850	379,075.000	
	BOE TECHNOLOGY GROUP CO LTD	79,900	3.010	240,499.000	
	CHINA MERCHANTS SHEKOU INDUSTRIAL ZONE HOLDINGS CO LTD	12,300	17.650	217,095.000	

GREE ELECTRIC APPLIANCES INC OF ZHUHAI	5,700	38.310	218,367.000	
MIDEA GROUP CO LTD	8,000	40.300	322,400.000	
HANGZHOU HIKVISION DIGITAL TECHNOLOGY CO LTD	12,000	24.990	299,880.000	
PING AN BANK CO LTD	27,200	10.450	284,240.000	
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO LTD	79,000	4.370	345,230.000	
CHINA VANKE CO LTD	13,700	21.750	297,975.000	
WEICHAI POWER CO LTD	29,900	8.490	253,851.000	
GF SECURITIES CO LTD	22,700	13.580	308,266.000	
BYD CO LTD	7,500	45.910	344,325.000	
BANK OF SHANGHAI CO LTD	20,900	11.640	243,276.000	
PETROCHINA CO LTD	32,800	9.330	306,024.000	
INDUSTRIAL & COMMERCIAL BANK OF CHINA LTD	75,500	5.550	419,025.000	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA LTD	82,500	3.760	310,200.000	
BANK OF CHINA LTD	74,500	3.600	268,200.000	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL CORP	51,300	6.670	342,171.000	
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	32,300	29.600	956,080.000	
PING AN INSURANCE GROUP CO OF CHINA LTD	14,000	64.650	905,100.000	
INDUSTRIAL BANK CO LTD	27,400	15.600	427,440.000	
SHANGHAI PUDONG DEVELOPMENT BANK CO LTD	36,700	10.170	373,239.000	
CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	73,320	6.180	453,117.600	
SAIC MOTOR CORP LTD	10,900	29.350	319,915.000	
KWEICHOW MOUTAI CO LTD	1,800	670.920	1,207,656.000	
BANK OF COMMUNICATIONS CO LTD	79,200	5.730	453,816.000	
CITIC SECURITIES CO LTD	33,200	16.150	536,180.000	
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	10,900	33.610	366,349.000	
CHINA YANGTZE POWER CO LTD	26,500	15.800	418,700.000	
DAQIN RAILWAY CO LTD	30,100	7.960	239,596.000	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD	60,800	3.840	233,472.000	
CHINA STATE CONSTRUCTION ENGINEERING CORP LTD	61,600	5.360	330,176.000	
HAITONG SECURITIES CO LTD	36,000	8.500	306,000.000	
HUAXIA BANK CO LTD	23,200	7.850	182,120.000	
INNER MONGOLIA YILI INDUSTRIAL GROUP CO LTD	10,400	24.950	259,480.000	
BANK OF BEIJING CO LTD	42,800	5.920	253,376.000	

BAOSHAN IRON & STEEL CO LTD	29,200	7.480	218,416.000	
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	4,200	35.200	147,840.000	
CHINA MERCHANTS SECURITIES CO LTD	22,800	12.990	296,172.000	
POLY REAL ESTATE GROUP CO LTD	20,400	11.350	231,540.000	
CRRC CORP LTD	38,600	8.640	333,504.000	
JIANGSU HENGRUI MEDICINE CO LTD	4,900	58.140	284,886.000	
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION CORP LTD	27,400	11.360	311,264.000	
HUATAI SECURITIES CO LTD	30,600	15.080	461,448.000	
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD	21,100	8.560	180,616.000	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	11,000	29.390	323,290.000	
FOUNDER SECURITIES CO LTD	31,000	5.270	163,370.000	
KANGMEI PHARMACEUTICAL CO LTD	14,300	21.720	310,596.000	
CHINA INTERNATIONAL TRAVEL SERVICE CORP LTD	3,900	63.000	245,700.000	
AVIC CAPITAL CO LTD	49,800	4.590	228,582.000	
METALLURGICAL CORP OF CHINA LTD	54,400	3.530	192,032.000	
POWER CONSTRUCTION CORP OF CHINA LTD	36,100	5.270	190,247.000	
SICHUAN CHUANTOU ENERGY CO LTD	23,700	8.250	195,525.000	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD	9,900	19.440	192,456.000	
AECC AVIATION POWER CO LTD	9,500	23.050	218,975.000	
JOINTOWN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	16,000	14.810	236,960.000	
INDUSTRIAL SECURITIES CO LTD	53,200	4.370	232,484.000	
BEIJING TONGRENTANG CO LTD	6,400	30.800	197,120.000	
SHANDONG GOLD MINING CO LTD	8,000	26.100	208,800.000	
YONGHUI SUPERSTORES CO LTD	24,000	7.810	187,440.000	
AISINO CORP	6,400	25.800	165,120.000	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD	28,600	6.300	180,180.000	
ZHANGZHOU PIENZHEHUANG PHARMACEUTICAL CO LTD	1,800	91.400	164,520.000	

	HENGTONG OPTIC-ELECTRIC CO LTD	8,100	22.480	182,088.000	
	FOSHAN HAITIAN FLAVOURING & FOOD CO LTD	6,200	75.590	468,658.000	
	GUOTAI JUNAN SECURITIES CO LTD	33,800	14.460	488,748.000	
	CHINA NATIONAL NUCLEAR POWER CO LTD	51,300	5.930	304,209.000	
	BANK OF JIANGSU CO LTD	32,400	6.320	204,768.000	
	ORIENT SECURITIES CO LTD/CHINA	24,800	8.550	212,040.000	
	EVERBRIGHT SECURITIES CO LTD	24,000	9.110	218,640.000	
オフショア・人民元 小計		2,095,420		23,237,785.600 (376,684,504)	
カタール・リアル	QATAR INSURANCE CO SAQ	14,417	37.530	541,070.010	
	QATAR NATIONAL BANK	42,093	180.000	7,576,740.000	
	COMMERCIAL BANK OF QATAR QSC	18,202	38.800	706,237.600	
	OOREDOO QSC	8,410	67.710	569,441.100	
	DOHA BANK QSC	18,035	21.400	385,949.000	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	4,887	192.500	940,747.500	
	INDUSTRIES QATAR QSC	16,138	132.000	2,130,216.000	
	QATAR ISLAMIC BANK SAQ	10,281	141.010	1,449,723.810	
	MASRAF AL RAYAN	32,079	37.660	1,208,095.140	
	BARWA REAL ESTATE CO	9,376	36.500	342,224.000	
EZDAN HOLDING GROUP QSC	84,431	10.310	870,483.610		
カタール・リアル 小計		258,349		16,720,927.770 (517,011,087)	
コロンビア・ペソ	INTERCONEXION ELECTRICA SA ESP	45,324	12,840.000	581,960,160.000	
	ECOPETROL SA	412,135	4,015.000	1,654,722,025.000	
	GRUPO DE INVERSIONES SURAMERICANA SA-PREF	10,138	32,580.000	330,296,040.000	
	GRUPO AVAL ACCIONES Y VALORES SA-PREF	341,831	1,140.000	389,687,340.000	
	CEMENTOS ARGOS SA	37,720	7,300.000	275,356,000.000	
	GRUPO ARGOS SA	28,217	15,400.000	434,541,800.000	
	BANCOLOMBIA SA	20,855	31,080.000	648,173,400.000	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	42,495	31,280.000	1,329,243,600.000	
GRUPO DE INVERSIONES SURAMERICANA SA	25,428	33,700.000	856,923,600.000		
コロンビア・ペソ 小計		964,143		6,500,903,965.000 (235,982,814)	
タイ・パーツ	BANGKOK BANK PCL	27,700	216.000	5,983,200.000	
	BERLI JUCKER PCL NVDR	116,700	57.750	6,739,425.000	
	KRUNG THAI BANK PCL NVDR	348,000	20.200	7,029,600.000	
	ROBINSON PCL-NVDR	38,800	67.000	2,599,600.000	

SIAM COMMERCIAL BANK PCL NVDR	162,900	143.500	23,376,150.000	
TRUE CORP PCL NVDR	1,030,755	6.000	6,184,530.000	
KASIKORNBANK PCL NVDR	60,200	213.000	12,822,600.000	
TMB BANK PCL -NVDR	1,010,000	2.340	2,363,400.000	
IRPC PCL NVDR	1,065,500	6.450	6,872,475.000	
BANPU PCL PUBLIC CO LTD NVDR	172,000	18.800	3,233,600.000	
ELECTRICITY GENERATING PCL NVDR	13,100	233.000	3,052,300.000	
CHAROEN POKPHAND FOODS PCL	311,500	24.400	7,600,600.000	
ADVANCED INFO SERVICE PCL	92,800	198.500	18,420,800.000	
HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	380,520	15.200	5,783,904.000	
DELTA ELECTRONICS THAI PCL NVDR	44,200	69.750	3,082,950.000	
PTT PCL	946,600	54.000	51,116,400.000	
THAI UNION GROUP PCL-NVDR	162,600	16.300	2,650,380.000	
LAND AND HOUSES PCL NVDR	263,900	10.900	2,876,510.000	
SIAM CEMENT PCL NVDR	33,850	426.000	14,420,100.000	
AIRPORTS OF THAILAND PCL-NVDR	387,600	63.000	24,418,800.000	
KASIKORNBANK PCL - FOREIGN	106,000	214.000	22,684,000.000	
CENTRAL PATTANA PCL NVDR	119,200	80.250	9,565,800.000	
BANGKOK DUSIT MEDICAL SERVICES NVDR	373,900	25.250	9,440,975.000	
BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR	38,900	189.000	7,352,100.000	
MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	236,810	39.250	9,294,792.500	
THAI OIL PCL NVDR	98,500	84.250	8,298,625.000	
GLOW ENERGY PCL NVDR	54,000	87.500	4,725,000.000	
CP ALL PCL NVDR	453,300	69.000	31,277,700.000	
BTS GROUP HOLDINGS PCL	531,300	9.450	5,020,785.000	
PTT EXPLORATION & PRODUCTION PCL NVDR	120,745	152.000	18,353,240.000	
INDORAMA VENTURES PCL NVDR	166,322	58.500	9,729,837.000	
PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	196,708	79.500	15,638,286.000	
ENERGY ABSOLUTE PCL NVDR	118,000	47.500	5,605,000.000	
BANGKOK EXPRESSWAY & METRO PCL NVDR	740,700	8.350	6,184,845.000	
タイ・パーツ 小計	10,023,610		373,798,309.500 (1,270,914,252)	
チェコ・コルナ				
KOMERCNI BANKA AS	7,067	907.500	6,413,302.500	
O2 CZECH REPUBLIC AS	5,677	255.000	1,447,635.000	
CEZ	15,014	568.500	8,535,459.000	

	MONETA MONEY BANK AS	57,258	81.000	4,637,898.000	
チェコ・コルナ 小計		85,016		21,034,294.500 (105,381,816)	
チリ・ペソ	BANCO SANTANDER CHILE	5,959,453	52.190	311,023,852.070	
	BANCO DE CREDITO E INVERSIONES	4,581	43,347.000	198,572,607.000	
	BANCO DE CHILE	2,321,052	99.750	231,524,937.000	
	EMPRESAS CMPC SA	116,383	2,557.400	297,637,884.200	
	EMPRESAS COPEC SA	34,981	10,001.000	349,844,981.000	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	15,170	9,168.900	139,092,213.000	
	ENTEL CHILE SA	16,500	5,407.200	89,218,800.000	
	ENEL AMERICAS SA	2,523,913	102.340	258,297,256.420	
	COLBUN SA	780,648	140.410	109,610,785.680	
	AGUAS ANDINAS SA	224,014	357.600	80,107,406.400	
	EMBOTELLADORA ANDINA SA	27,270	2,537.200	69,189,444.000	
	LATAM AIRLINES GROUP SA	26,485	6,561.000	173,768,085.000	
	SOCIEDAD QUIMICA Y MINERA DE CHILE SA	10,624	29,622.000	314,704,128.000	
	SACI FALABELLA	68,025	5,278.500	359,069,962.500	
	ITAU CORPBANCA	13,236,977	6.702	88,714,219.850	
CENCOSUD SA	125,078	1,550.800	193,970,962.400		
ENEL CHILE SA	2,764,879	63.280	174,961,543.120		
チリ・ペソ 小計		28,256,033		3,439,309,067.640 (563,358,825)	
トルコ・リラ	AKBANK TAS	185,577	6.310	1,170,990.870	
	ANADOLU EFES BIRACILIK VE MALT SANAYII AS	21,520	18.340	394,676.800	
	ARCELIK	30,429	12.250	372,755.250	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	31,766	26.120	829,727.920	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIKALARI TAS	125,960	10.760	1,355,329.600	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	5,919	65.450	387,398.550	
	KOC HOLDING AS	67,325	16.300	1,097,397.500	
	PETKIM PETROKIMYA HOLDING	88,174	5.090	448,805.660	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI AS	79,624	5.430	432,358.320	
	TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKASI AS	17,797	22.360	397,940.920	
	TURK HAVA YOLLARI	57,827	16.700	965,710.900	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	98,512	10.660	1,050,137.920	
	TURKIYE GARANTI BANKASI AS	201,717	7.030	1,418,070.510	
	TURKIYE IS BANKASI	162,502	4.130	671,133.260	
	TUPRAS TURKIYE PETROL RAFINE	11,716	138.000	1,616,808.000	
	ULKER BISKUVI SANAYI AS	13,121	16.120	211,510.520	
	YAPI VE KREDI BANKASI AS	143,015	1.660	237,404.900	

	HACI OMER SABANCI HOLDING AS	98,354	7.260	714,050.040	
	COCA-COLA ICECEK AS	6,451	30.000	193,530.000	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	19,011	77.850	1,480,006.350	
	TURKIYE VAKIFLAR BANKASI TAO	90,731	3.640	330,260.840	
	TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	13,735	28.600	392,821.000	
	TURKIYE HALK BANKASI AS	61,970	6.740	417,677.800	
トルコ・リラ 小計		1,632,753		16,586,503.430 (306,518,583)	
ハンガリー・フォロント	RICHTER GEDEON NYRT	14,830	5,100.000	75,633,000.000	
	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NYRT	30,013	3,020.000	90,639,260.000	
	OTP BANK NYRT	20,222	10,150.000	205,253,300.000	
ハンガリー・フォロント 小計		65,065		371,525,560.000 (147,792,868)	
パキスタン・ルピー	LUCKY CEMENT LTD	9,900	469.550	4,648,545.000	
	MCB BANK LTD	39,000	195.700	7,632,300.000	
	OIL & GAS DEVELOPMENT CO LTD	74,500	152.580	11,367,210.000	
	UNITED BANK LTD	51,400	141.730	7,284,922.000	
	HABIB BANK LTD	54,400	137.880	7,500,672.000	
パキスタン・ルピー 小計		229,200		38,433,649.000 (32,668,602)	
フィリピン・ペソ	AYALA LAND INC	641,100	39.500	25,323,450.000	
	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	188,940	45.700	8,634,558.000	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAND	88,540	81.900	7,251,426.000	
	AYALA CORP	21,583	900.000	19,424,700.000	
	ALLIANCE GLOBAL GROUP INC	307,700	11.700	3,600,090.000	
	DMCI HOLDINGS INC	351,850	12.060	4,243,311.000	
	GLOBE TELECOM INC	2,785	2,168.000	6,037,880.000	
	INTERNATIONAL CONTAINER TERM SERVICES INC	40,680	95.000	3,864,600.000	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	290,050	47.000	13,632,350.000	
	JOLLIBEE FOODS CORP	44,130	254.000	11,209,020.000	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	82,037	66.850	5,484,173.450	
	BDO UNIBANK INC	172,483	110.000	18,973,130.000	
	MEGAWORLD CORP	962,000	4.150	3,992,300.000	
	PLDT INC	9,520	1,386.000	13,194,720.000	
	ROBINSONS LAND CORP	218,722	20.700	4,527,545.400	
	SECURITY BANK CORP	23,420	135.700	3,178,094.000	
	SM PRIME HOLDINGS INC	900,475	34.000	30,616,150.000	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	90,210	129.000	11,637,090.000	
	SM INVESTMENTS CORP	23,458	879.000	20,619,582.000	

	METRO PACIFIC INVESTMENTS CORP	1,148,900	5.060	5,813,434.000	
	ABOITIZ POWER CORP	128,200	32.600	4,179,320.000	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	24,000	357.200	8,572,800.000	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	9,387	710.000	6,664,770.000	
フィリピン・ペソ	小計	5,770,170		240,674,493.850 (498,196,201)	
ブラジル・リアル	BRF SA	47,492	20.540	975,485.680	
	VALE SA	287,921	55.890	16,091,904.690	
	RAIA DROGASIL SA	20,600	71.770	1,478,462.000	
	TIM PARTICIPACOES SA	76,300	11.640	888,132.000	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	19,450	24.550	477,497.500	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	23,000	20.710	476,330.000	
	BANCO DO BRASIL SA	77,600	37.350	2,898,360.000	
	INVESTIMENTOS ITAU SA	424,160	10.810	4,585,169.600	
	LOJAS AMERICANAS SA	68,374	17.200	1,176,032.800	
	GERDAU SA	90,630	15.550	1,409,296.500	
	CIA BRASILEIRA DE DISTRIBUICAO GRUPO PAO DE ACUCAR	14,606	80.970	1,182,647.820	
	PETROLEO BRASILEIRO SA	267,910	28.630	7,670,263.300	
	PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	32,800	23.900	783,920.000	
	PETROLEO BRASILEIRO SA	354,512	26.050	9,235,037.600	
	KROTON EDUCACIONAL SA	122,968	11.340	1,394,457.120	
	CCR SA	121,420	9.930	1,205,700.600	
	WEG SA	74,072	18.400	1,362,924.800	
	BANCO BRADESCO SA PREF	306,225	32.120	9,835,947.000	
	BANCO BRADESCO SA	90,118	27.800	2,505,280.400	
	NATURA COSMETICOS SA	19,400	28.160	546,304.000	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	61,606	9.330	574,783.980	
	SUZANO PAPEL E CELULOSE SA	39,900	41.910	1,672,209.000	
	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	294,598	48.070	14,161,325.860	
	PORTO SEGURO SA	8,800	54.700	481,360.000	
	FIBRIA CELULOSE SA	22,490	72.400	1,628,276.000	
	BRASKEM SA	17,030	53.550	911,956.500	
	ENGIE BRASIL SA	17,370	36.120	627,404.400	
	LOCALIZA RENT A CAR	45,880	24.160	1,108,460.800	
	TELEFONICA BRASIL S.A.	39,428	38.500	1,517,978.000	
	LOJAS RENNEN SA	62,870	35.000	2,200,450.000	
	EDP - ENERGIAS DO BRASIL SA	31,864	13.670	435,580.880	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	32,152	41.470	1,333,343.440	
	COSAN SA	16,500	34.650	571,725.000	
	EQUATORIAL ENERGIA SA	16,700	59.370	991,479.000	

	EMBRAER SA	63,360	18.960	1,201,305.600	
	M DIAS BRANCO SA	10,400	44.220	459,888.000	
	ODONTOPREV SA	32,200	12.600	405,720.000	
	BR MALLS PARTICIPACOES SA	85,565	11.380	973,729.700	
	JBS SA	89,900	8.920	801,908.000	
	CIA ENERGETICA DE MINAS GERAIS	96,249	9.880	950,940.120	
	CIA DE SANEAMENTO BASICO DO ESTADO DE SAO PAULO	34,698	27.350	948,990.300	
	MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS IMOBILIARIOS SA	31,140	20.900	650,826.000	
	SUL AMERICA SA	17,869	22.960	410,272.240	
	HYPERA SA	33,300	30.600	1,018,980.000	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BAICAO	185,916	24.800	4,610,716.800	
	MAGAZINE LUIZA SA	7,300	143.650	1,048,645.000	
	BANCO SANTANDER BRASIL SA	37,100	39.740	1,474,354.000	
	CIELO SA	111,307	12.400	1,380,206.800	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	62,400	27.200	1,697,280.000	
	ATACADA0 DISTRIBUICAO COMERCIO E INDUSTRIA LTDA	37,300	14.880	555,024.000	
	AMBEV SA	427,595	17.200	7,354,634.000	
	KLABIN SA	64,800	17.940	1,162,512.000	
	RUMO SA	97,800	15.300	1,496,340.000	
	IRB BRASIL RESSEGUROS S/A	10,500	61.630	647,115.000	
	ブラジル・リアル 小計	4,783,445		123,644,873.830 (3,696,981,728)	
ポーランド・ズロ チ	BANK MILLENNIUM SA	49,782	8.820	439,077.240	
	MBANK	1,595	405.400	646,613.000	
	BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA	2,596	73.100	189,767.600	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	11,899	85.500	1,017,364.500	
	BANK PEKAO SA	16,219	103.300	1,675,422.700	
	ORANGE POLSKA SA	58,600	4.440	260,184.000	
	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	26,492	94.520	2,504,023.840	
	LPP SA	130	8,505.000	1,105,650.000	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	3,142	353.600	1,111,011.200	
	CD PROJEKT RED SA	6,015	155.500	935,332.500	
	POWSZECHNA KASA OSZCZEDNOSCI BANK POLSKI SA	77,884	40.420	3,148,071.280	
	CCC SA	2,763	218.600	603,991.800	
	GRUPA LOTOS SA	9,480	74.200	703,416.000	
	POLSKIE GORNICtwo NAFTOWE I GAZOWNICTWO SA	167,192	6.490	1,085,076.080	
	CYFROWY POLSAT SA	23,495	23.440	550,722.800	
	GRUPA AZOTY SA	3,853	28.800	110,966.400	

	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	70,529	9.770	689,068.330	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZEN SA	53,451	39.040	2,086,727.040	
	JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA SA	6,170	66.960	413,143.200	
	ALIOR BANK SA	9,405	62.300	585,931.500	
	DINO POLSKA SA	4,709	89.850	423,103.650	
	PLAY COMMUNICATIONS SA	15,228	17.820	271,362.960	
ポーランド・ズロチ	小計	620,629		20,556,027.620 (616,475,268)	
マレーシア・リンギット	AMMB HOLDINGS BHD	195,500	3.990	780,045.000	
	GENTING PLANTATIONS BHD	18,800	9.480	178,224.000	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	419,200	5.840	2,448,128.000	
	DIGI.COM BHD	288,700	4.570	1,319,359.000	
	MALAYSIA AIRPORTS HOLDINGS BHD	91,320	8.550	780,786.000	
	RHB BANK BHD	108,980	5.210	567,785.800	
	HAP SENG CONSOLIDATED BHD	70,000	9.750	682,500.000	
	TOP GLOVE CORP BHD	66,900	10.500	702,450.000	
	GAMUDA BHD	194,600	2.070	402,822.000	
	GENTING BHD	200,900	7.300	1,466,570.000	
	YTL CORP BHD	283,710	1.120	317,755.200	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP BHD	20,256	19.000	384,864.000	
	HONG LEONG BANK BHD	62,308	20.560	1,281,052.480	
	IJM CORP BHD	230,360	1.450	334,022.000	
	IOI CORP BHD	187,213	4.520	846,202.760	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	43,200	24.940	1,077,408.000	
	FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	12,800	35.760	457,728.000	
	MALAYAN BANKING BHD	343,775	9.510	3,269,300.250	
	ALLIANCE BANK MALAYSIA BHD	88,400	4.100	362,440.000	
	MISC BHD	90,280	5.790	522,721.200	
	NESTLE MALAYSIA BHD	5,800	146.000	846,800.000	
	PPB GROUP BHD	57,360	16.880	968,236.800	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	19,600	26.100	511,560.000	
	PETRONAS GAS BHD	60,400	17.780	1,073,912.000	
	GENTING MALAYSIA BHD	281,900	4.660	1,313,654.000	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD	14,700	35.000	514,500.000	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	132,500	2.550	337,875.000	
	SP SETIA BHD	178,500	2.200	392,700.000	
	TENAGA NASIONAL BHD	281,150	14.680	4,127,282.000	
	UMW HOLDINGS BHD	39,000	4.600	179,400.000	
	DIALOG GROUP BHD	320,544	3.310	1,061,000.640	
	PUBLIC BANK BHD(LOCAL)	262,930	24.980	6,567,991.400	

	AIRASIA GROUP BHD	147,900	2.840	420,036.000	
	MY EG SERVICES BHD	165,800	1.520	252,016.000	
	SIME DARBY BERHAD	232,700	2.630	612,001.000	
	HARTALEGA HOLDINGS BHD	145,400	6.090	885,486.000	
	AXIATA GROUP BERHAD	264,600	3.850	1,018,710.000	
	MAXIS BHD	203,300	5.570	1,132,381.000	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	228,600	9.360	2,139,696.000	
	ASTRO MALAYSIA HOLDINGS BHD	140,500	1.390	195,295.000	
	IHH HEALTHCARE BHD	220,400	5.250	1,157,100.000	
	FGV HOLDINGS BHD	126,400	1.430	180,752.000	
	WESTPORTS HOLDINGS BHD	130,000	3.540	460,200.000	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDINGS BHD	153,100	4.910	751,721.000	
	SIME DARBY PROPERTY BHD	232,700	1.110	258,297.000	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	216,100	5.240	1,132,364.000	
	IOI PROPERTIES GROUP SDN BHD	174,548	1.410	246,112.680	
	マレーシア・リンギット 小計	7,453,634		46,919,243.210 (1,268,227,144)	
メキシコ・ペソ	ALFA SAB DE CV	264,100	23.740	6,269,734.000	
	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	51,400	116.520	5,989,128.000	
	EL PUERTO DE LIVERPOOL SAB DE CV	19,100	140.990	2,692,909.000	
	GRUPO TELEVISIA SAB	219,600	62.680	13,764,528.000	
	GRUPO BIMBO SAB DE CV	149,100	38.270	5,706,057.000	
	GRUMA SAB DE CV	19,445	229.030	4,453,488.350	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INFRAESTRUCTURA	20,260	197.560	4,002,565.600	
	GRUPO CARSO SAB DE CV	37,600	61.120	2,298,112.000	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE SAB DE CV	234,700	133.180	31,257,346.000	
	MEXICHEM SAB DE CV	103,425	64.530	6,674,015.250	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	14,695	322.620	4,740,900.900	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO SAB DE CV	156,700	31.080	4,870,236.000	
	ALSEA SAB DE CV	43,700	59.650	2,606,705.000	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL SURESTE SAB DE CV	17,990	367.370	6,608,986.300	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV	318,352	50.950	16,220,034.400	
	AMERICA MOVIL SAB DE CV	3,050,278	14.970	45,662,661.660	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA SA	198,800	29.150	5,795,020.000	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	43,400	115.600	5,017,040.000	
	WAL-MART DE MEXICO SAB DE CV	474,900	54.820	26,034,018.000	

	GRUPO AEROPORTUARIO DEL PACIFICO SAB DE CV	31,200	198.430	6,191,016.000	
	INFRAESTRUCTURA ENERGETICA NOVA SAB DE CV	53,200	90.040	4,790,128.000	
	BANCO SANTANDER MEXICO SA-B	174,090	29.290	5,099,096.100	
メキシコ・ペソ 小計		5,696,035		216,743,725.560 (1,270,118,231)	
ユーロ	PIRAEUS BANK S.A	25,000	1.100	27,500.000	
	ALPHA BANK A.E.	125,732	1.155	145,220.460	
	NATIONAL BANK OF GREECE	46,501	1.478	68,728.470	
	TITAN CEMENT CO. S.A.	5,217	18.980	99,018.660	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	24,351	9.745	237,300.490	
	FF GROUP	3,130	4.800	15,024.000	
	EUROBANK ERGASIAS	194,100	0.496	96,273.600	
	MOTOR OIL HELLAS CORINTH REFIN	5,847	22.300	130,388.100	
	OPAP SA	19,846	8.465	167,996.390	
	JUMBO SA	10,420	11.700	121,914.000	
ユーロ 小計		460,144		1,109,364.170 (143,740,315)	
韓国・ウォン	CHEIL WORLDWIDE INC	7,097	22,100.000	156,843,700.000	
	HANMI SCIENCE CO LTD	1,164	79,100.000	92,072,400.000	
	HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	3,477	78,600.000	273,292,200.000	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANC	2,595	285,500.000	740,872,500.000	
	DB INSURANCE CO LTD	5,060	71,500.000	361,790,000.000	
	COWAY CO LTD	4,439	84,700.000	375,983,300.000	
	KT&G CORP	10,519	102,500.000	1,078,197,500.000	
	S-1 CORPORATION	1,444	94,200.000	136,024,800.000	
	KOREA GAS CORP	2,997	60,200.000	180,419,400.000	
	CJ CORP	1,547	126,000.000	194,922,000.000	
	KAKAO CORP	4,774	104,000.000	496,496,000.000	
	CJ ENM CO LTD	987	245,600.000	242,407,200.000	
	SK TELECOM CO LTD	1,859	285,000.000	529,815,000.000	
	DAELIM INDUSTRIAL CO	2,649	84,500.000	223,840,500.000	
	MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD	40,612	7,640.000	310,275,680.000	
	NCSOFT CORPORATION	1,574	420,000.000	661,080,000.000	
	LG UPLUS CORP	20,384	17,500.000	356,720,000.000	
	DOOSAN HEAVY INDUSTRIES AND CONSTRUCTION CO LTD	7,766	13,400.000	104,064,400.000	
	DAEWOO ENGINEERING & CONSTRUCT	13,540	5,530.000	74,876,200.000	
	POSCO DAEWOO CORP	3,600	20,500.000	73,800,000.000	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD	810	1,140,000.000	923,400,000.000		
LG CHEM LTD	4,012	316,000.000	1,267,792,000.000		

LG CHEM LTD	726	183,000.000	132,858,000.000	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD	201	713,000.000	143,313,000.000	
SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD	37,095	46,150.000	1,711,934,250.000	
S-OIL CORP	4,133	132,500.000	547,622,500.000	
HANWHA CHEMICAL CORPORATION	10,493	17,950.000	188,349,350.000	
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	5,997	30,300.000	181,709,100.000	
LOTTE CHEMICAL CORPORATION	1,576	271,500.000	427,884,000.000	
HOTEL SHILLA CO LTD	2,826	87,900.000	248,405,400.000	
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	3,604	135,500.000	488,342,000.000	
HYUNDAI MOBIS	6,133	205,500.000	1,260,331,500.000	
SK HYNIX INC	52,126	70,300.000	3,664,457,800.000	
HYUNDAI ENGINEERING & CONSTRUCTION CO LTD	7,403	57,700.000	427,153,100.000	
HYUNDAI MOTOR CO	2,642	72,000.000	190,224,000.000	
HYUNDAI MOTOR CO	13,513	120,000.000	1,621,560,000.000	
HYUNDAI STEEL CO	7,476	52,700.000	393,985,200.000	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	22,788	15,100.000	344,098,800.000	
KCC CORP	554	305,500.000	169,247,000.000	
KIA MOTORS CORP	22,988	33,850.000	778,143,800.000	
KOREA ZINC CO LTD	834	407,500.000	339,855,000.000	
KOREA ELECTRIC POWER CORP	22,108	25,300.000	559,332,400.000	
HANWHA CORP	3,785	31,350.000	118,659,750.000	
KOREAN AIR CO LTD	5,301	27,150.000	143,922,150.000	
OCI COMPANY LTD	1,829	107,500.000	196,617,500.000	
CJ LOGISTICS	860	148,000.000	127,280,000.000	
KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	1,930	86,800.000	167,524,000.000	
KT CORP	2,048	30,000.000	61,440,000.000	
HLB INC	2,994	93,800.000	280,837,200.000	
LG ELECTRONICS INC	8,926	65,200.000	581,975,200.000	
LOTTE CORP	3,366	58,900.000	198,257,400.000	
HANSSEM CO LTD	1,100	68,100.000	74,910,000.000	
LG CORP	8,649	67,200.000	581,212,800.000	
NH INVESTMENT & SECURITIES CO LTD	13,362	12,700.000	169,697,400.000	
GS ENGINEERING & CONSTRUCTION	4,872	51,600.000	251,395,200.000	
NAVER CORP	2,531	704,000.000	1,781,824,000.000	
HYUNDAI DEPARTMENT STORE CO LTD	1,249	93,400.000	116,656,600.000	
DONGSUH CO INC	3,149	21,000.000	66,129,000.000	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO LTD	4,223	65,600.000	277,028,800.000	
OTTOGI CORP	112	689,000.000	77,168,000.000	
AMOREPACIFIC GROUP	2,818	76,500.000	215,577,000.000	

KANGWON LAND INC	10,655	28,700.000	305,798,500.000	
POSCO	6,891	272,000.000	1,874,352,000.000	
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	15,569	19,550.000	304,373,950.000	
SAMSUNG SDI CO LTD	4,950	238,500.000	1,180,575,000.000	
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO LTD	4,863	131,500.000	639,484,500.000	
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	436,407	45,300.000	19,769,237,100.000	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES CO LTD	42,202	7,550.000	318,625,100.000	
SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	77,783	36,200.000	2,815,744,600.000	
SHINSEGAE CO LTD	646	295,500.000	190,893,000.000	
YUHAN CORP	836	215,500.000	180,158,000.000	
HANON SYSTEMS	19,093	11,900.000	227,206,700.000	
HYUNDAI MARINE & FIRE INSURANCE CO LTD	6,480	41,150.000	266,652,000.000	
GS HOLDINGS CORP	4,842	54,600.000	264,373,200.000	
LG DISPLAY CO LTD	22,210	17,900.000	397,559,000.000	
CELLTRION INC	7,192	286,500.000	2,060,508,000.000	
VIROMED CO LTD	1,302	219,500.000	285,789,000.000	
HANA FINANCIAL GROUP	25,829	45,850.000	1,184,259,650.000	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	1,800	116,000.000	208,800,000.000	
CELLTRION PHARM INC	1,457	72,200.000	105,195,400.000	
LOTTE SHOPPING CO	1,227	202,500.000	248,467,500.000	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LTD	6,421	94,800.000	608,710,800.000	
AMOREPACIFIC CORP	2,661	212,000.000	564,132,000.000	
AMOREPACIFIC CORP-PREF	848	118,000.000	100,064,000.000	
SAMSUNG CARD CO	2,877	35,300.000	101,558,100.000	
SK INNOVATION CO LTD	5,628	216,000.000	1,215,648,000.000	
CJ CHEILJEDANG CORP	870	325,000.000	282,750,000.000	
STX PAN OCEAN CO LTD	18,395	4,935.000	90,779,325.000	
KEPCO PLANT SERVICE & ENGINEERING CO LTD	2,170	31,050.000	67,378,500.000	
LG INNOTEK CO LTD	1,440	125,000.000	180,000,000.000	
SK HOLDINGS CO LTD	2,618	285,500.000	747,439,000.000	
KB FINANCIAL GROUP INC	35,095	55,400.000	1,944,263,000.000	
MEDY-TOX INC	409	539,300.000	220,573,700.000	
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES LTD	6,602	32,250.000	212,914,500.000	
BNK FINANCIAL GROUP INC	25,264	8,620.000	217,775,680.000	
HANMI PHARM CO LTD	610	451,500.000	275,415,000.000	
HANWHA LIFE INSURANCE CO LTD	27,836	5,010.000	139,458,360.000	
E-MART CO LTD	1,699	212,500.000	361,037,500.000	
DGB FINANCIAL GROUP INC	18,575	10,400.000	193,180,000.000	
GS RETAIL CO LTD	2,482	40,750.000	101,141,500.000	
HANKOOK TIRE CO LTD NEW	6,590	47,600.000	313,684,000.000	

	HDC HYUNDAI DEVELOPMENT CO-ENGINEERING & CONSTRUCTION	3,444	44,900.000	154,635,600.000	
	HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOLDINGS CO LTD	942	395,000.000	372,090,000.000	
	BGF RETAIL CO LTD	854	210,000.000	179,340,000.000	
	ORION CORP REPUBLIC OF KOREA	2,071	99,100.000	205,236,100.000	
	ORANGE LIFE INSURANCE LTD	3,735	32,200.000	120,267,000.000	
	NETMARBLE CORP	2,446	126,000.000	308,196,000.000	
	SAMSUNG SDS CO LTD	3,043	212,000.000	645,116,000.000	
	WOORI BANK	41,071	16,950.000	696,153,450.000	
	SAMSUNG C&T CORP	6,626	123,000.000	814,998,000.000	
	SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	1,432	488,000.000	698,816,000.000	
	PEARL ABYSS CORP	534	209,100.000	111,659,400.000	
	DOOSAN BOBCAT INC	2,723	38,600.000	105,107,800.000	
	SILLAJEN INC	5,635	83,900.000	472,776,500.000	
	CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	3,490	84,400.000	294,556,000.000	
韓国・ウォン	小計	1,380,596		74,106,805,995.000 (7,314,341,752)	
香港・ドル	JIANGXI COPPER CO LTD	138,000	8.670	1,196,460.000	
	JIANGSU EXPRESS	124,000	9.730	1,206,520.000	
	CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD	156,000	4.450	694,200.000	
	ANGANG STEEL CO LTD-H	104,000	6.450	670,800.000	
	CHINA MOBILE LIMITED	559,000	80.750	45,139,250.000	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	111,500	44.350	4,945,025.000	
	DATANG INTERNATIONAL POWER GEN	288,000	1.880	541,440.000	
	BEIJING ENTERPRISES	52,500	42.350	2,223,375.000	
	HUANENG POWER INTERNATIONAL IN	400,000	4.790	1,916,000.000	
	ALIBABA HEALTH INFORMATION TECHNOLOGY	322,000	6.670	2,147,740.000	
	YANZHOU COAL MINING CO LTD	188,000	9.000	1,692,000.000	
	HENGAN INTERNATIONAL GROUP	65,000	66.800	4,342,000.000	
	HUADIAN POWER INTL CORP-H	144,000	2.910	419,040.000	
	CHONGQING CHANGAN AUTOMOBILE	63,600	5.730	364,428.000	
	CHINA EASTERN AIRLINES CORP LT	124,000	4.460	553,040.000	
	CNOOC LTD	1,617,000	14.840	23,996,280.000	
	BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	270,000	10.760	2,905,200.000	
	CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LTD	426,000	15.640	6,662,640.000	

CHINA OVERSEAS LAND & INVESTME	343,120	23.700	8,131,944.000	
CHINA RESOURCES LAND LTD	252,888	25.450	6,435,999.600	
CITIC LTD	521,000	11.920	6,210,320.000	
CHINA TRAVEL INTERNATIONAL INV	198,000	2.310	457,380.000	
BEIJING CAPITAL INTERNATIONAL	162,000	8.380	1,357,560.000	
LENOVO GROUP LTD	642,000	4.800	3,081,600.000	
PETRO CHINA CO LTD	1,894,000	6.230	11,799,620.000	
SKYWORTH DIGITAL HOLDINGS LTD	162,000	2.090	338,580.000	
CHINA UNICOM HONG KONG LTD	552,742	9.110	5,035,479.620	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS CO LTD	145,390	25.300	3,678,367.000	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL COR	2,283,200	6.810	15,548,592.000	
TONG REN TANG TECHNOLOGIES CO	54,000	10.920	589,680.000	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	90,000	18.240	1,641,600.000	
KINGDEE INTERNATIONAL SOFTWARE GROUP CO LTD	220,000	7.450	1,639,000.000	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	68,800	65.900	4,533,920.000	
KUNLUN ENERGY COMPANY LTD	288,000	8.860	2,551,680.000	
TOWNGAS CHINA CO LTD	91,000	5.720	520,520.000	
COSCO SHIPPING PORTS LTD	162,000	8.720	1,412,640.000	
YUEXIU PROPERTY CO LTD	696,000	1.280	890,880.000	
CHINA MERCHANTS PORT HOLDINGS CO LTD	132,000	14.040	1,853,280.000	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	374,000	3.290	1,230,460.000	
SHENZHEN INTERNATIONAL HOLDING	84,500	15.540	1,313,130.000	
CHINA EVERBRIGHT LTD	82,000	13.200	1,082,400.000	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	157,400	21.550	3,391,970.000	
KINGBOARD HOLDINGS LTD	63,500	23.850	1,514,475.000	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LTD	448,000	13.760	6,164,480.000	
SHENZHEN INVESTMENT LTD	306,000	2.200	673,200.000	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LTD	86,000	31.450	2,704,700.000	
BYD CO LTD	55,500	49.950	2,772,225.000	
CHINA TELECOM CORP LTD	1,244,000	4.030	5,013,320.000	
CHINA OILFIELD SERVICES LTD	172,000	8.150	1,401,800.000	
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	1,220,000	1.010	1,232,200.000	
SINOTRANS LTD	190,000	3.120	592,800.000	

CHINA EVERBRIGHT INTERNATIONAL	324,592	6.710	2,178,012.320	
MMG LTD	220,000	3.380	743,600.000	
LEE & MAN PAPER MANUFACTURING LTD	170,000	7.030	1,195,100.000	
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	625,788	8.770	5,488,160.760	
AVICHINA INDUSTRY & TECHNOLOGY	225,000	4.740	1,066,500.000	
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS	197,200	13.560	2,674,032.000	
GREAT WALL MOTOR COMPANY LTD	300,500	4.970	1,493,485.000	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	680,000	17.140	11,655,200.000	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD	561,000	2.840	1,593,240.000	
SHANDONG WEIGAO GROUP MEDICAL-H	176,000	7.290	1,283,040.000	
SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	274,700	7.490	2,057,503.000	
WEICHAI POWER CO LTD	176,440	9.060	1,598,546.400	
CHINA SHIPPING DEVELOPMENT CO	100,000	4.340	434,000.000	
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEMICAL	353,000	4.000	1,412,000.000	
SHANGHAI INDUSTRIAL	46,000	16.560	761,760.000	
TINGYI HOLDING CORP	178,000	13.300	2,367,400.000	
TSINGTAO BREWERY CO LTD	40,000	34.300	1,372,000.000	
GUANGDONG INVESTMENTS LTD	266,000	14.260	3,793,160.000	
CHINA TRADITIONAL CHINESE MEDICINE HOLDINGS CO LTD	208,000	4.610	958,880.000	
CHINA RESOURCES BEER HOLDINGS	133,333	28.500	3,799,990.500	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO LTD	146,000	6.680	975,280.000	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	634,500	6.550	4,155,975.000	
CHINA SHIPPING CONTAINER LINES	247,000	0.990	244,530.000	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	248,000	22.750	5,642,000.000	
TENCENT HOLDINGS LTD	517,100	286.400	148,097,440.000	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	474,500	74.750	35,468,875.000	
BEIJING ENTERPRISES WATER GROUP LTD	560,000	3.940	2,206,400.000	
GOME RETAIL HOLDINGS LTD	970,240	0.750	727,680.000	
CHINA POWER INTERNATIONAL	350,000	1.660	581,000.000	
AIR CHINA / HONG KONG	198,000	6.780	1,342,440.000	
ZTE CORP	71,288	11.700	834,069.600	
SHANGHAI ELECTRIC GROUP CO LTD	250,000	2.660	665,000.000	

CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD	306,500	18.300	5,608,950.000	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO LTD	248,500	3.040	755,440.000	
BANK OF COMMUNICATIONS	752,205	5.700	4,287,568.500	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT HOLDINGS LTD	206,250	8.180	1,687,125.000	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	66,500	75.450	5,017,425.000	
CHINA CONSTRUCTION BANK	8,756,530	6.280	54,991,008.400	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP HOLDINGS LTD	69,000	85.350	5,889,150.000	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	262,000	8.080	2,116,960.000	
AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	160,000	10.000	1,600,000.000	
SSY GROUP LTD	144,000	6.540	941,760.000	
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS LTD	168,000	8.150	1,369,200.000	
CHINA NATIONAL BLDG MATERIAL	364,000	6.240	2,271,360.000	
BANK OF CHINA LTD	7,192,200	3.340	24,021,948.000	
SHUI ON LAND LTD	335,500	1.680	563,640.000	
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	122,500	15.840	1,940,400.000	
GREENTOWN CHINA HOLDINGS LTD	82,000	5.860	480,520.000	
GUANGZHOU R&F PROPERTIES CO LTD	100,400	13.500	1,355,400.000	
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	349,470	29.800	10,414,206.000	
IND & COMM BK OF CHINA - H	6,295,235	5.320	33,490,650.200	
ZHAOJIN MINING INDUSTRY CO LTD	96,000	5.960	572,160.000	
KINGBOARD LAMINATES HOLDING	104,000	6.650	691,600.000	
CHINA COMMUNICATIONS SERVICES	227,600	6.730	1,531,748.000	
CHINA COMMUNICATIONS CONSTRUCTION CO LTD	397,000	8.120	3,223,640.000	
CHINA COAL ENERGY CO	178,000	3.450	614,100.000	
HAITIAN INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	64,000	16.700	1,068,800.000	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC CO LTD	51,000	42.600	2,172,600.000	
HAIER ELECTRONICS GROUP CO LTD	129,000	18.420	2,376,180.000	
CHINA AGRI-INDUSTRIES HOLDINGS LTD	191,000	2.800	534,800.000	

COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD	684,142	8.590	5,876,779.780	
CHINA MOLYBDENUM CO LTD	369,000	2.890	1,066,410.000	
CHINA CITIC BANK-H	811,800	4.860	3,945,348.000	
KWG GROUP HOLDINGS LTD	121,000	6.150	744,150.000	
SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	64,700	76.000	4,917,200.000	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	97,000	31.150	3,021,550.000	
FOSUN INTERNATIONAL	230,028	12.780	2,939,757.840	
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP LTD	502,000	3.090	1,551,180.000	
SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD	308,500	3.040	937,840.000	
SOHO CHINA LTD	172,500	2.810	484,725.000	
KINGSOFT CORP LTD	76,000	13.000	988,000.000	
GCL POLY ENERGY HOLDINGS LTD	1,362,000	0.520	708,240.000	
SINOTRUK HONG KONG LTD	64,500	14.240	918,480.000	
CHINA RAILWAY GROUP LTD	338,000	7.960	2,690,480.000	
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS LTD	122,000	8.010	977,220.000	
BYD ELECTRONIC INTERNATIONAL CO LTD	79,000	9.250	730,750.000	
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION CORP	178,000	10.760	1,915,280.000	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	450,000	5.700	2,565,000.000	
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	232,000	28.100	6,519,200.000	
CHINA EVERGRANDE GROUP	237,000	20.550	4,870,350.000	
CRRC CORP LTD - H	386,450	7.120	2,751,524.000	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDINGS LTD	126,000	9.200	1,159,200.000	
CHONG SING HOLDINGS FINTECH GROUP LTD	1,656,000	0.415	687,240.000	
SUN ART RETAIL GROUP LTD	240,000	9.720	2,332,800.000	
BBMG CORP	222,000	2.470	548,340.000	
CHINA ZHONGWANG HOLDINGS LTD	145,200	3.460	502,392.000	
SINOPHARM GROUP CO	107,600	37.100	3,991,960.000	
CHINA RESOURCES CEMENT	248,000	8.330	2,065,840.000	
METALLURGICAL CORP OF CHINA LTD	276,000	2.150	593,400.000	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD	274,527	7.810	2,144,055.870	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL BANK	285,000	4.140	1,179,900.000	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP CORP	317,000	6.430	2,038,310.000	

SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD	79,100	18.160	1,436,456.000	
HUANENG RENEWABLES CORP LTD	472,000	2.330	1,099,760.000	
SIHUAN PHARMACEUTICAL HOLDINGS GROUP LTD	325,000	1.660	539,500.000	
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	218,000	21.450	4,676,100.000	
YUZHOU PROPERTIES CO LTD	166,000	2.910	483,060.000	
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	128,500	17.860	2,295,010.000	
NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	75,800	36.400	2,759,120.000	
CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	563,156	5.600	3,153,673.600	
KAISA GROUP HOLDINGS LTD	203,000	2.420	491,260.000	
XINJIANG GOLDWIND SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	60,000	6.920	415,200.000	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD	257,000	3.380	868,660.000	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA	2,697,000	3.660	9,871,020.000	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS LTD	55,000	16.980	933,900.000	
FAR EAST HORIZON LTD	199,000	7.280	1,448,720.000	
CITIC SECURITIES CO LTD	184,000	12.900	2,373,600.000	
FUTURE LAND DEVELOPMENT HOLDINGS LTD	172,000	4.440	763,680.000	
HAITONG SECURITIES CO LTD	294,000	6.990	2,055,060.000	
CHINA INTERNATIONAL MARINE CONTAINERS GROUP CO LTD	39,400	7.740	304,956.000	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROUP OF CHINA LTD	706,000	3.570	2,520,420.000	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	46,000	27.950	1,285,700.000	
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	334,000	3.300	1,102,200.000	
SINOPEC ENGINEERING GROUP CO LTD	121,500	8.570	1,041,255.000	
CHINA GALAXY SECURITIES CO LTD	328,500	3.590	1,179,315.000	
HANERGY THIN FILM POWER GROUP	986,000	0.000	0.000	
NEXTEER AUTOMOTIVE GROUP LTD	85,000	10.880	924,800.000	
CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS CO LTD	323,000	0.000	0.000	
GREENTOWN SERVICE GROUP CO LTD	96,000	5.490	527,040.000	

JIAYUAN INTERNATIONAL GROUP LTD	94,000	13.860	1,302,840.000	
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO LTD	42,400	15.700	665,680.000	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA CO LTD	267,000	4.830	1,289,610.000	
GENSCRIPT BIOTECH CORP	74,000	12.800	947,200.000	
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLDINGS CO LTD	95,000	11.600	1,102,000.000	
CHINA FIRST CAPITAL GROUP LTD	308,000	3.780	1,164,240.000	
CHINA TOWER CORP LTD	3,154,000	1.150	3,627,100.000	
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	276,000	2.350	648,600.000	
CHINA CINDA ASSET MANAGEMENT CO LTD	796,000	1.900	1,512,400.000	
LOGAN PROPERTY HOLDINGS CO LTD	134,000	7.840	1,050,560.000	
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS LTD	147,500	25.200	3,717,000.000	
CHINA VANKE CO LTD-H	113,761	22.950	2,610,814.950	
LUYE PHARMA GROUP LTD	108,000	6.070	655,560.000	
CAR INC	68,000	6.280	427,040.000	
HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	39,000	13.740	535,860.000	
CGN POWER CO LTD	981,000	1.850	1,814,850.000	
FULLSHARE HOLDINGS LTD	702,500	3.120	2,191,800.000	
BAIC MOTOR CORP LTD	163,500	5.860	958,110.000	
GF SECURITIES CO LTD	127,400	9.490	1,209,026.000	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD	51,200	27.000	1,382,400.000	
HUATAI SECURITIES CO LTD	112,600	11.180	1,258,868.000	
3SBIO INC	130,000	11.960	1,554,800.000	
LEGEND HOLDINGS CORP	31,500	22.250	700,875.000	
CHINA RESOURCES PHARMACEUTICAL GROUP LTD	146,000	12.020	1,754,920.000	
CHINA HUARONG ASSET MANAGEMENT CO LTD	904,000	1.410	1,274,640.000	
CHINA LITERATURE LTD	17,200	44.850	771,420.000	
DALI FOODS GROUP CO LTD	188,000	5.550	1,043,400.000	
CHINA RAILWAY SIGNAL & COMMUNICATION CORP LTD	141,000	5.520	778,320.000	
CHINA REINSURANCE GROUP CORP	525,000	1.430	750,750.000	
MEITU INC	152,500	5.130	782,325.000	
BOC AVIATION LTD	20,300	57.150	1,160,145.000	
ZHONGAN ONLINE P&C INSURANCE CO LTD	15,500	27.250	422,375.000	
CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CORP LTD	101,600	12.600	1,280,160.000	

	WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	44,500	67.950	3,023,775.000	
	HENG TEN NETWORKS GROUP LTD	2,096,000	0.295	618,320.000	
香港・ドル	小計	88,299,075		787,766,030.940 (11,296,564,884)	
台湾・ドル	ACER INC	278,532	22.900	6,378,382.800	
	ASUSTEK COMPUTER INC	64,554	252.000	16,267,608.000	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	46,616	109.500	5,104,452.000	
	ASIA CEMENT CORP	209,928	39.550	8,302,652.400	
	WALSIN TECHNOLOGY CORP	31,000	173.500	5,378,500.000	
	TAIWAN BUSINESS BANK	371,457	11.100	4,123,172.700	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMICONDUCTOR CORP	85,000	60.000	5,100,000.000	
	MICRO-STAR INTERNATIONAL CO LTD	65,000	77.400	5,031,000.000	
	CHICONY ELECTRONICS CO LTD	54,975	57.900	3,183,052.500	
	QUANTA COMPUTER INC	235,858	50.600	11,934,414.800	
	HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	90,070	46.650	4,201,765.500	
	EVA AIRWAYS CORP	149,269	14.450	2,156,937.050	
	CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	59,760	308.000	18,406,080.000	
	CHANG HWA COMMERCIAL BANK	509,345	18.450	9,397,415.250	
	CHINA AIRLINES	232,156	9.400	2,182,266.400	
	CHENG SHIN RUBBER INDUSTRY CO	188,169	45.600	8,580,506.400	
	CHINA STEEL CORP	1,122,058	25.350	28,444,170.300	
	CHINA LIFE INSURANCE CO LTD/TAIWAN	279,994	29.750	8,329,821.500	
	ADVANTECH CO LTD	29,889	205.500	6,142,189.500	
	COMPAL ELECTRONICS INC	360,304	18.450	6,647,608.800	
	DELTA ELECTRONICS INC	188,663	117.500	22,167,902.500	
	NANYA TECHNOLOGY CORP	110,000	52.300	5,753,000.000	
	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	348,327	109.500	38,141,806.500	
	AU OPTRONICS CORP	810,194	12.500	10,127,425.000	
	TAIWAN MOBILE CO LTD	146,800	109.000	16,001,200.000	
	EVERGREEN MARINE CORP	187,590	12.550	2,354,254.500	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	275,824	35.850	9,888,290.400	
	FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	29,825	177.000	5,279,025.000	
	ECLAT TEXTILE CO LTD	18,322	366.000	6,705,852.000	
	NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	51,285	137.000	7,026,045.000	
	FORMOSA PLASTICS CORP	402,633	113.500	45,698,845.500	
	FORMOSA TAFFETA CO LTD	61,000	36.300	2,214,300.000	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE CO	318,594	124.000	39,505,656.000	

GIANT MANUFACTURING	30,151	127.500	3,844,252.500	
MEDIATEK INC	135,507	228.500	30,963,349.500	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD	598,936	51.500	30,845,204.000	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	701,232	18.100	12,692,299.200	
HOTAI MOTOR CO LTD	25,000	252.500	6,312,500.000	
FAR EASTONE TELECOMMUNICATIONS CO LTD	144,000	72.500	10,440,000.000	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	876,141	15.900	13,930,641.900	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	737,920	52.400	38,667,008.000	
CHINA DEPT FINANCIAL HOLDING	1,183,403	10.850	12,839,922.550	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO LTD	947,168	22.350	21,169,204.800	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	1,492,532	75.300	112,387,659.600	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LTD	981,495	27.550	27,040,187.250	
LARGAN PRECISION CO LTD	10,220	3,590.000	36,689,800.000	
TAISHIN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	956,589	14.400	13,774,881.600	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING CO	831,061	11.600	9,640,307.600	
INVENTEC CO LTD	268,005	25.300	6,780,526.500	
HTC CORPORATION	79,832	33.750	2,694,330.000	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	218,845	36.100	7,900,304.500	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	990,443	10.950	10,845,350.850	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,580,048	22.750	35,946,092.000	
MACRONIX INTERNATIONAL	196,861	21.250	4,183,296.250	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO LTD	915,220	20.600	18,853,532.000	
POWERTECH TECHNOLOGY INC	61,560	76.400	4,703,184.000	
NAN YA PLASTICS CORP	465,828	81.700	38,058,147.600	
WISTRON CORP	266,916	18.200	4,857,871.200	
POU CHEN CORP	183,990	31.700	5,832,483.000	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CORP	435,297	75.300	32,777,864.100	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	51,392	346.000	17,781,632.000	
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	108,480	135.000	14,644,800.000	
PHISON ELECTRONICS CORP	16,658	214.500	3,573,141.000	
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	54,393	50.400	2,741,407.200	
RUENTEX INDUSTRIES LTD	68,715	59.100	4,061,056.500	

FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	94,588	70.800	6,696,830.400	
STANDARD FOODS CORP	34,639	46.800	1,621,105.200	
SYNNEX TECHNOLOGY INTERNATIONAL CORP	144,899	37.100	5,375,752.900	
TAIWAN CEMENT CORP	406,561	40.050	16,282,768.050	
TECO ELECTRIC AND MACHINERY CO LTD	161,000	21.100	3,397,100.000	
TAIWAN SEMICONDUCTOR	2,233,083	244.000	544,872,252.000	
UNITED MICROELECTRONICS CORP	1,073,525	14.800	15,888,170.000	
WINBOND ELECTRONICS CORP	324,000	13.350	4,325,400.000	
YAGEO CORP	23,160	423.500	9,808,260.000	
TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	192,000	28.500	5,472,000.000	
INNOLUX CORPORATION	820,345	10.100	8,285,484.500	
WPG HOLDINGS CO LTD	130,203	38.500	5,012,815.500	
HIWIN TECHNOLOGIES CORP	23,073	223.500	5,156,815.500	
TAIMED BIOLOGICS INC	18,000	203.500	3,663,000.000	
PEGATRON CORP	178,554	59.600	10,641,818.400	
AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	13,000	240.500	3,126,500.000	
WIN SEMICONDUCTORS CORP	38,000	107.000	4,066,000.000	
CHAILEASE HOLDING CO LTD	101,737	99.900	10,163,526.300	
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING LTD	48,385	68.000	3,290,180.000	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL HOLDING	828,412	18.100	14,994,257.200	
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	311,903	68.600	21,396,545.800	
GLOBALWAFERS CO LTD	21,000	267.000	5,607,000.000	
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	15,000	220.500	3,307,500.000	
GENERAL INTERFACE SOLUTION HOLDING LTD	18,000	116.500	2,097,000.000	
台湾・ドル 小計	30,279,896		1,688,175,917.250 (6,111,196,820)	
南アフリカ・ランド				
BIDVEST GROUP LTD	29,572	179.500	5,308,174.000	
CLICKS GROUP LTD	22,975	160.800	3,694,380.000	
TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	44,326	80.910	3,586,416.660	
DISCOVERY LTD	31,052	159.610	4,956,209.720	
REDEFINE PROPERTIES LTD	469,360	9.650	4,529,324.000	
GOLD FIELDS LTD	81,159	36.090	2,929,028.310	
REMGRO LTD	46,304	188.460	8,726,451.840	
THE FOSCHINI GROUP LTD	19,873	165.080	3,280,634.840	
MMI HOLDINGS LTD	111,471	16.700	1,861,565.700	
GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	260,960	23.150	6,041,224.000	
EXXARO RESOURCES LTD	25,340	149.720	3,793,904.800	

CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	3,704	987.160	3,656,440.640	
LIBERTY HOLDINGS LTD	15,137	108.250	1,638,580.250	
MTN GROUP LTD	151,630	86.250	13,078,087.500	
ANGLOGOLD ASHANTI LTD	38,047	125.370	4,769,952.390	
TELKOM SA SOC LTD	31,588	50.850	1,606,249.800	
FIRSTRAND LTD	303,471	60.750	18,435,863.250	
PSG GROUP LTD	15,546	216.750	3,369,595.500	
NASPERS LTD	39,866	2,656.980	105,923,164.680	
CORONATION FUND MANAGERS LTD	26,700	50.480	1,347,816.000	
NEDBANK GROUP LTD	36,512	248.590	9,076,518.080	
NETCARE LTD	105,465	24.510	2,584,947.150	
PICK'N PAY STORES LTD	31,255	65.070	2,033,762.850	
RMB HOLDINGS LTD	61,174	69.140	4,229,570.360	
ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	6,200	478.820	2,968,684.000	
SAPPI LTD	48,883	84.150	4,113,504.450	
SASOL LTD	50,151	540.660	27,114,639.660	
SHOPRITE HOLDINGS LTD	40,566	181.620	7,367,596.920	
MR PRICE GROUP LTD	23,411	222.500	5,208,947.500	
STANDARD BANK GROUP LTD	116,717	163.860	19,125,247.620	
SPAR GROUP LTD/THE	16,512	171.790	2,836,596.480	
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	88,009	48.400	4,259,635.600	
IMPERIAL HOLDINGS LTD	16,774	160.670	2,695,078.580	
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LTD	34,576	160.000	5,532,160.000	
ABSA GROUP LTD	64,032	148.060	9,480,577.920	
TIGER BRANDS LTD	16,282	250.480	4,078,315.360	
SANLAM LTD	154,608	73.790	11,408,524.320	
INVESTEC LTD	29,312	94.120	2,758,845.440	
KUMBA IRON ORE LTD	5,327	300.840	1,602,574.680	
PIONEER FOODS LTD	15,500	78.810	1,221,555.000	
MONDI LTD	10,866	353.030	3,836,023.980	
LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDINGS LTD	135,845	24.060	3,268,430.700	
RMI HOLDINGS	55,278	35.660	1,971,213.480	
VODACOM GROUP PTY LTD	55,182	123.100	6,792,904.200	
NEPI ROCKCASTLE PLC	32,983	129.080	4,257,445.640	
OLD MUTUAL LTD	443,070	21.550	9,548,158.500	
REINET INVESTMENTS SCA	14,237	257.550	3,666,739.350	
FORTRESS REIT LTD-A	102,950	17.080	1,758,386.000	
BID CORP LTD	29,931	279.120	8,354,340.720	
南アフリカ・ランド 小計	3,609,689		375,683,988.420 (2,858,955,152)	
合計	228,770,566		49,707,246,286 (49,707,246,286)	

(2) 株式以外の有価証券

平成30年10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	1,300,875.000	15,519,438.750	
		FOMENTO ECONOMICO MEXICANO SAB DE CV	175,900.000	32,539,741.000	
	メキシコ・ペソ	小計	1,476,775.000	48,059,179.750 (281,626,794)	
投資信託受益証券	合計		1,476,775	281,626,794 (281,626,794)	
投資証券	トルコ・リラ	EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATIRIM	231,071.000	397,442.120	
	トルコ・リラ	小計	231,071.000	397,442.120 (7,344,731)	
	メキシコ・ペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	316,200.000	7,674,174.000	
	メキシコ・ペソ	小計	316,200.000	7,674,174.000 (44,970,659)	
	南アフリカ・ランド	FORTRESS REIT LTD-B	95,302.000	1,470,509.860	
		HYPROP INVESTMENTS LTD	22,174.000	2,001,203.500	
		RESILIENT REIT LTD	28,600.000	1,699,126.000	
南アフリカ・ランド	小計	146,076.000	5,170,839.360 (39,350,088)		
投資証券	合計		693,347	91,665,478 (91,665,478)	
合計				373,292,272 (373,292,272)	

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 47銘柄	10.10%	-%	-%	11.04%
アラブ首長国連邦・ディ ルハム	株式 10銘柄	0.59%	-%	-%	0.65%
インド・ルピー	株式 80銘柄	7.73%	-%	-%	8.46%
インドネシア・ルピア	株式 28銘柄	1.80%	-%	-%	1.97%
オフショア・人民元	株式 76銘柄	0.69%	-%	-%	0.75%
カタール・リアル	株式 11銘柄	0.94%	-%	-%	1.03%
コロンビア・ペソ	株式 9銘柄	0.43%	-%	-%	0.47%
タイ・バーツ	株式 34銘柄	2.32%	-%	-%	2.54%
チェコ・コルナ	株式 4銘柄	0.19%	-%	-%	0.21%
チリ・ペソ	株式 17銘柄	1.03%	-%	-%	1.12%
トルコ・リラ	株式 23銘柄 投資証券 1銘柄	0.56% -%	-% -%	-% 0.01%	0.63%
ハンガリー・フォリント	株式 3銘柄	0.27%	-%	-%	0.30%
パキスタン・ルピー	株式 5銘柄	0.06%	-%	-%	0.07%
フィリピン・ペソ	株式 23銘柄	0.91%	-%	-%	0.99%
ブラジル・レアル	株式 54銘柄	6.75%	-%	-%	7.38%
ポーランド・ズロチ	株式 22銘柄	1.13%	-%	-%	1.23%
マレーシア・リンギット	株式 47銘柄	2.32%	-%	-%	2.53%
メキシコ・ペソ	株式 22銘柄 投資信託 受益証券 2銘柄 投資証券 1銘柄	2.32% -% -%	-% 0.51% -%	-% -% 0.08%	3.19%
ユーロ	株式 10銘柄	0.26%	-%	-%	0.29%
韓国・ウォン	株式 115銘柄	13.36%	-%	-%	14.61%
香港・ドル	株式 205銘柄	20.63%	-%	-%	22.56%
台湾・ドル	株式 89銘柄	11.16%	-%	-%	12.20%
南アフリカ・ランド	株式 49銘柄 投資証券 3銘柄	5.22% -%	-% -%	-% 0.07%	5.79%

(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30年4月11日現在	平成30年10月11日現在
資産の部			
流動資産			
預金		3,187,738,055	1,821,744,363
コール・ローン		267,666,351	60,384,414
国債証券		107,644,798,793	98,156,495,828
派生商品評価勘定		704,000	207,000
未収入金		-	685,349,932
未収利息		936,989,196	976,970,470
前払費用		266,140,281	163,768,233
流動資産合計		112,304,036,676	101,864,920,240
資産合計		112,304,036,676	101,864,920,240
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		25,630,000	69,375,000
流動負債合計		2,268,190,112	69,375,000
負債合計		2,268,190,112	69,375,000
純資産の部			
元本等			
元本	1	61,796,728,209	56,260,738,714
剰余金			
剰余金又は欠損金()		48,239,118,355	45,534,806,526
元本等合計		110,035,846,564	101,795,545,240
純資産合計		110,035,846,564	101,795,545,240
負債純資産合計		112,304,036,676	101,864,920,240

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	平成30年4月11日現在	平成30年10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	54,294,770,403円 27,291,507,415円 19,789,549,609円	61,796,728,209円 19,156,141,866円 24,692,131,361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）	273,372,366円	273,439,997円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	29,655,552円	84,276,405円
たわらノーロード バランス（堅実型）	1,218,192円	4,383,541円
たわらノーロード バランス（標準型）	3,271,288円	13,515,484円
たわらノーロード バランス（積極型）	2,604,196円	8,805,859円
たわらノーロード 最適化バランス（保守型）	74,492円	91,216円
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	113,229円	141,118円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	464,224円	819,823円
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	222,746円	310,046円
たわらノーロード 最適化バランス（積極型）	341,580円	422,186円

マネックス資産設計ファンド エボリューション	59,295,344円	58,646,088円
DIAM DC 8資産バラン スファンド(新興国10)	30,468,731円	195,394,626円
DIAM DC 8資産バラン スファンド(新興国20)	104,407,098円	168,433,969円
DIAM DC 8資産バラン スファンド(新興国30)	230,214,662円	335,742,291円
投資のソムリエ	8,030,523,614円	8,561,194,872円
クルーズコントロール	151,309,039円	579,705,357円
投資のソムリエ<DC年金>	573,807,004円	741,598,209円
DIAM 8資産バランスファ ンドN<DC年金>	122,747,118円	136,462,429円
クルーズコントロール<DC年 金>	55,947円	335,299円
DIAMコア資産設計ファンド (堅実型)	756,244円	3,640,572円
DIAMコア資産設計ファンド (積極型)	2,284,297円	7,608,735円
投資のソムリエ<DC年金>リ スク抑制型	376,827,557円	193,344,732円
ダイナミック・ナビゲーション	154,706円	177,753円
リスク抑制世界8資産バラン スファンド	6,260,192,014円	3,643,414,698円
ワールドアセットバランス(基 本コース)	859,189,179円	818,794,191円
ワールドアセットバランス(リ スク抑制コース)	3,176,151,984円	3,141,358,276円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤ-2045)	1,380,918円	2,174,682円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤ-2055)	1,009,901円	1,585,888円
リスク抑制世界8資産バラン スファンド(DC)	1,888,535円	1,132,324円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤ-2035)	2,591,303円	3,151,566円
リスクコントロール世界資産分 散ファンド	-円	457,307,222円
9資産分散投資・スタンダード <DC年金>	-円	13,655円
エマージング債券リスク抑制型 (適格機関投資家限定)	16,514,634,587円	14,137,760,067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)	3,283,385,257円	2,322,386,202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)	7,585,869,299円	5,142,517,974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)	4,972,001,878円	4,748,815,413円

	D I A Mグローバル・リスク ファクター・パリティ戦略ファ ンド(適格機関投資家限定)	2,951,435,236円	3,811,858,365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)	2,324,514,542円	2,928,571,287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)	3,868,294,350円	3,731,406,297円
	計	61,796,728,209円	56,260,738,714円
2 .	受益権の総数	61,796,728,209口	56,260,738,714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10月12日 至 平成30年4月11日	自 平成30年4月12日 至 平成30年10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30年4月11日現在	平成30年10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30年4月11日現在	平成30年10月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
国債証券	2,882,542,372	3,294,289,542
合計	2,882,542,372	3,294,289,542

(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30年4月11日まで及び平成30年4月19日から平成30年10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30年4月11日 現在				平成30年10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	-	-	-	-	146,232,000	-	146,025,000	207,000
アメリカ・ドル	-	-	-	-	146,232,000	-	146,025,000	207,000
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	1,519,974,000	-	1,520,556,000	582,000	146,232,000	-	146,025,000	207,000

(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30年4月11日現在	平成30年10月11日現在
1口当たり純資産額	1.7806円	1.8094円
(1万口当たり純資産額)	(17,806円)	(18,094円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

平成30年10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	8,200,000.000	7,572,700.000	
		BRAZIL 4.25 01/07/25	14,500,000.000	13,909,270.000	
		BRAZIL 4.625 01/13/28	11,800,000.000	10,965,150.000	
		BRAZIL 4.875 01/22/21	10,600,000.000	10,766,950.000	
		BRAZIL 5.0 01/27/45	11,200,000.000	9,302,944.000	
		BRAZIL 5.625 01/07/41	8,700,000.000	7,993,125.000	
		BRAZIL 5.625 02/21/47	8,400,000.000	7,481,208.000	
		BRAZIL 6.0 04/07/26	8,200,000.000	8,552,600.000	
		BRAZIL 7.125 01/20/37	7,500,000.000	8,184,375.000	
		BRAZIL 8.25 01/20/34	6,000,000.000	7,143,000.000	
		BRAZIL 8.75 02/04/25	4,000,000.000	4,786,000.000	
		COLOMBIA 2.625 03/15/23	2,700,000.000	2,545,749.000	
		COLOMBIA 3.875 04/25/27	8,600,000.000	8,197,692.000	
		COLOMBIA 4.0 02/26/24	10,300,000.000	10,215,025.000	
		COLOMBIA 4.375 07/12/21	10,400,000.000	10,574,200.000	
		COLOMBIA 4.5 01/28/26	5,600,000.000	5,618,872.000	
		COLOMBIA 5.0 06/15/45	14,400,000.000	13,917,600.000	
		COLOMBIA 5.625 02/26/44	8,800,000.000	9,174,000.000	
		COLOMBIA 6.125 01/18/41	10,000,000.000	11,000,000.000	
		COLOMBIA 7.375 09/18/37	6,600,000.000	8,159,250.000	
		COLOMBIA 8.125 05/21/24	3,300,000.000	3,916,275.000	
		CROATIA 5.5 04/04/23	7,800,000.000	8,239,218.000	
		CROATIA 6.0 01/26/24	7,400,000.000	8,032,034.000	
		CROATIA 6.375 03/24/21	4,700,000.000	4,969,310.000	
		CROATIA 6.625 07/14/20	10,800,000.000	11,332,332.000	
		CROATIA 6.75 11/05/19	10,800,000.000	11,173,032.000	
		HUNGARY 5.375 02/21/23	7,700,000.000	8,136,821.000	
		HUNGARY 5.375 03/25/24	7,000,000.000	7,469,280.000	
		HUNGARY 5.75 11/22/23	12,000,000.000	12,951,000.000	
		HUNGARY 6.25 01/29/20	10,900,000.000	11,306,025.000	
		HUNGARY 6.375 03/29/21	12,400,000.000	13,193,600.000	
		HUNGARY 7.625 03/29/41	4,800,000.000	6,554,256.000	
		INDONESIA 3.375 04/15/23	5,500,000.000	5,308,710.000	
		INDONESIA 3.5 01/11/28	3,800,000.000	3,464,156.000	
INDONESIA 3.75 04/25/22	7,000,000.000	6,924,610.000			
INDONESIA 3.85 07/18/27	3,000,000.000	2,817,570.000			
INDONESIA 4.1 04/24/28	3,000,000.000	2,854,860.000			
INDONESIA 4.125 01/15/25	11,800,000.000	11,496,032.000			
INDONESIA 4.35 01/08/27	5,200,000.000	5,066,880.000			
INDONESIA 4.35 01/11/48	3,800,000.000	3,324,962.000			

INDONESIA 4.625 04/15/43	5,000,000.000	4,526,800.000	
INDONESIA 4.75 01/08/26	7,400,000.000	7,431,154.000	
INDONESIA 4.875 05/05/21	12,300,000.000	12,637,635.000	
INDONESIA 5.125 01/15/45	6,600,000.000	6,336,726.000	
INDONESIA 5.25 01/08/47	4,600,000.000	4,517,246.000	
INDONESIA 5.25 01/17/42	7,300,000.000	7,188,310.000	
INDONESIA 5.875 01/15/24	6,200,000.000	6,586,570.000	
INDONESIA 5.95 01/08/46	4,000,000.000	4,274,720.000	
INDONESIA 6.75 01/15/44	5,900,000.000	6,941,409.000	
INDONESIA 7.75 01/17/38	6,700,000.000	8,517,911.000	
PANAMA 3.75 03/16/25	6,400,000.000	6,329,664.000	
PANAMA 3.875 03/17/28	6,200,000.000	6,048,162.000	
PANAMA 4.5 05/15/47	5,600,000.000	5,389,384.000	
PANAMA 5.2 01/30/20	8,200,000.000	8,405,000.000	
PANAMA 6.7 01/26/36	10,400,000.000	12,665,120.000	
PANAMA 7.125 01/29/26	4,600,000.000	5,417,696.000	
PANAMA 9.375 04/01/29	4,300,000.000	6,030,750.000	
PERU 4.125 08/25/27	7,400,000.000	7,499,974.000	
PERU 5.625 11/18/50	14,000,000.000	15,887,200.000	
PERU 6.55 03/14/37	5,800,000.000	7,165,320.000	
PERU 7.35 07/21/25	11,600,000.000	14,059,780.000	
PHILIPPINES 3.0 02/01/28	7,600,000.000	6,923,524.000	
PHILIPPINES 3.7 02/02/42	4,800,000.000	4,295,184.000	
PHILIPPINES 3.7 03/01/41	6,600,000.000	5,928,780.000	
PHILIPPINES 3.95 01/20/40	6,200,000.000	5,779,268.000	
PHILIPPINES 4.0 01/15/21	4,400,000.000	4,459,840.000	
PHILIPPINES 4.2 01/21/24	5,800,000.000	5,912,230.000	
PHILIPPINES 5.0 01/13/37	4,600,000.000	4,919,010.000	
PHILIPPINES 5.5 03/30/26	2,800,000.000	3,034,248.000	
PHILIPPINES 6.375 01/15/32	3,600,000.000	4,329,972.000	
PHILIPPINES 6.375 10/23/34	6,400,000.000	7,827,968.000	
PHILIPPINES 6.5 01/20/20	4,600,000.000	4,800,560.000	
PHILIPPINES 7.75 01/14/31	5,900,000.000	7,790,124.000	
PHILIPPINES 9.5 02/02/30	6,200,000.000	8,995,270.000	
ROMANIA 4.375 08/22/23	8,000,000.000	8,046,320.000	
ROMANIA 4.875 01/22/24	3,400,000.000	3,486,564.000	
ROMANIA 6.125 01/22/44	4,200,000.000	4,602,654.000	
ROMANIA 6.75 02/07/22	10,700,000.000	11,633,361.000	
RUSSIA FOREIGN BOND 5.0 04/29/20	16,200,000.000	16,485,120.000	
RUSSIAN FEDERATION 03/31/30	11,993,500.000	13,153,151.510	
RUSSIAN FEDERATION 4.25 06/23/27	7,800,000.000	7,336,524.000	
RUSSIAN FEDERATION 4.5 04/04/22	8,000,000.000	8,075,920.000	
RUSSIAN FEDERATION 4.75 05/27/26	11,200,000.000	11,035,248.000	

RUSSIAN FEDERATION 4.875 09/16/23	10,000,000.000	10,241,500.000	
RUSSIAN FEDERATION 5.25 06/23/47	23,400,000.000	21,811,140.000	
RUSSIAN FEDERATION 5.625 04/04/42	10,200,000.000	10,454,388.000	
RUSSIAN FEDERATION 5.875 09/16/43	5,400,000.000	5,699,646.000	
SOUTH AFRICA 4.3 10/12/28	7,600,000.000	6,589,276.000	
SOUTH AFRICA 4.665 01/17/24	5,300,000.000	5,100,084.000	
SOUTH AFRICA 4.875 04/14/26	5,000,000.000	4,669,600.000	
SOUTH AFRICA 5.0 10/12/46	4,000,000.000	3,259,880.000	
SOUTH AFRICA 5.375 07/24/44	3,000,000.000	2,550,660.000	
SOUTH AFRICA 5.5 03/09/20	7,600,000.000	7,714,532.000	
SOUTH AFRICA 5.65 09/27/47	5,000,000.000	4,324,550.000	
SOUTH AFRICA 5.875 05/30/22	3,800,000.000	3,912,404.000	
SOUTH AFRICA 5.875 09/16/25	7,200,000.000	7,174,800.000	
UNITED MEXICAN STATES 3.5 01/21/21	7,200,000.000	7,211,520.000	
UNITED MEXICAN STATES 3.6 01/30/25	9,200,000.000	8,832,000.000	
UNITED MEXICAN STATES 3.625 03/15/22	6,500,000.000	6,509,750.000	
UNITED MEXICAN STATES 3.75 01/11/28	8,000,000.000	7,490,000.000	
UNITED MEXICAN STATES 4.0 10/02/23	11,300,000.000	11,317,402.000	
UNITED MEXICAN STATES 4.125 01/21/26	8,400,000.000	8,232,000.000	
UNITED MEXICAN STATES 4.15 03/28/27	11,200,000.000	10,828,944.000	
UNITED MEXICAN STATES 4.35 01/15/47	7,000,000.000	6,132,000.000	
UNITED MEXICAN STATES 4.6 01/23/46	9,400,000.000	8,495,250.000	
UNITED MEXICAN STATES 4.6 02/10/48	7,800,000.000	7,059,000.000	
UNITED MEXICAN STATES 4.75 03/08/44	14,800,000.000	13,660,548.000	
UNITED MEXICAN STATES 5.55 01/21/45	9,400,000.000	9,705,500.000	
UNITED MEXICAN STATES 5.75 10/12/2110	8,600,000.000	8,374,250.000	
UNITED MEXICAN STATES 6.05 01/11/40	10,900,000.000	11,821,050.000	

	UNITED MEXICAN STATES 6.75 09/27/34	6,000,000.000	7,119,600.000	
	アメリカ・ドル 小計	853,893,500.000 (95,943,473,660)	873,589,318.510 (98,156,495,828)	
国債証券 合計		95,943,473,660 (95,943,473,660)	98,156,495,828 (98,156,495,828)	
合計		95,943,473,660 (95,943,473,660)	98,156,495,828 (98,156,495,828)	

- (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 111銘柄	96.43%	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10月31日現在

資産総額	154,455,178円
負債総額	284,758円
純資産総額(-)	154,170,420円
発行済数量	151,898,344口
1口当たり純資産額(/)	1.0150円

D I A Mコア資産設計ファンド(積極型)

平成30年10月31日現在

資産総額	286,391,435円
負債総額	415,232円
純資産総額(-)	285,976,203円
発行済数量	289,001,853口
1口当たり純資産額(/)	0.9895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10月31日現在

資産総額	288,053,244,457円
負債総額	9,550,278,862円
純資産総額(-)	278,502,965,595円
発行済数量	109,793,582,090口
1口当たり純資産額(/)	2.5366円

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年10月31日現在

資産総額	340,345,575,284円
負債総額	1,133,142,500円
純資産総額(-)	339,212,432,784円
発行済数量	264,560,877,228口
1口当たり純資産額(/)	1.2822円

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年10月31日現在

資産総額	321,638,132,924円
負債総額	652,509,432円
純資産総額(-)	320,985,623,492円
発行済数量	94,000,930,863口
1口当たり純資産額(/)	3.4147円

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年10月31日現在

資産総額	198,452,581,465円
負債総額	41,261,000円
純資産総額(-)	198,411,320,465円
発行済数量	110,130,597,297口
1口当たり純資産額(/)	1.8016円

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

平成30年10月31日現在

資産総額	47,059,155,060円
負債総額	128,638,550円
純資産総額(-)	46,930,516,510円
発行済数量	44,538,215,774口
1口当たり純資産額(/)	1.0537円

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

平成30年10月31日現在

資産総額	70,209,936,322円
負債総額	32,000円
純資産総額(-)	70,209,904,322円
発行済数量	38,763,987,160口
1口当たり純資産額(/)	1.8112円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 受益証券の名義書換

該当事項はありません。

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

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

(2) 受益者等名簿

該当事項はありません。

(3) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

(4) 受益権の譲渡制限

譲渡制限はありません。

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

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

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

(5) 受益権の譲渡の対抗要件

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

(6) 受益権の再分割

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

(7) 質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額(2018年10月31日現在)

資本金の額	20億円
発行する株式総数	100,000株 (普通株式 上限100,000株、A種種類株式 上限30,000株)
発行済株式総数	40,000株 (普通株式24,490株、A種種類株式15,510株)
種類株式の発行が可能	

直近5カ年の資本金の増減：該当事項はありません。

(2) 会社の機構(2018年10月31日現在)

会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。

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

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

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

また、取締役会の決議によって、取締役社長を定めることができます。

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

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

投資運用の意思決定機構

1. 投資環境見直しおよび運用方針の策定

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

2.運用計画、売買計画の決定

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

2【事業の内容及び営業の概況】

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

2018年10月31日現在、委託会社の運用する投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除く）

基本的性格	本数	純資産総額（単位：円）
追加型公社債投資信託	38	1,187,081,738,031
追加型株式投資信託	854	12,790,313,997,301
単位型公社債投資信託	48	185,032,179,480
単位型株式投資信託	151	1,090,851,077,839
合計	1,091	15,253,278,992,651

3【委託会社等の経理状況】

- 1．委託会社であるアセットマネジメントOne株式会社（以下「委託会社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。
また、中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）、ならびに同規則第38条及び第57条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。
- 2．財務諸表及び中間財務諸表の金額は、千円未満の端数を切り捨てて記載しております。
- 3．委託会社は、第33期事業年度（自平成29年4月1日至平成30年3月31日）の財務諸表について、新日本有限責任監査法人の監査を受け、第34期中間会計期間（自平成30年4月1日至平成30年9月30日）の中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の中間監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

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

（単位：千円）

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

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

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

（単位：千円）

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

（３）【株主資本等変動計算書】

第32期（自平成28年4月1日至平成29年3月31日）

（単位：千円）

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

	株主資本		評価・換算差額等		純資産 合計
	利益剰余金	株主資本 合計	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
	利益剰余金 合計				
当期首残高	28,000,340	32,428,818	153,956	153,956	32,582,775
当期変動額					
剰余金の配当	2,544,000	2,544,000			2,544,000
別途積立金の 積立	-	-			-
当期純利益	6,443,302	6,443,302			6,443,302
合併による 増加		17,124,479			17,124,479
株主資本以外 の項目の当期 変動額(純額)		-	363,907	363,907	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いません。

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

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

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

(1) 中間貸借対照表

(単位:千円)

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

(単位:千円)

	第34期中間会計期間末 (平成30年9月30日現在)
(負債の部)	
流動負債	
預り金	2,420,695
未払金	5,448,301
未払収益分配金	1,091
未払償還金	48,968
未払手数料	4,999,441
その他未払金	398,799
未払費用	6,877,637
未払法人税等	3,090,099
未払消費税等	599,967
前受収益	70,778
賞与引当金	1,310,878
役員賞与引当金	25,584
流動負債計	19,843,940
固定負債	
退職給付引当金	1,739,495
時効後支払損引当金	177,842
固定負債計	1,917,338
負債合計	21,761,279
(純資産の部)	
株主資本	
資本金	2,000,000
資本剰余金	19,552,957
資本準備金	2,428,478
その他資本剰余金	17,124,479
利益剰余金	39,054,769
利益準備金	123,293
その他利益剰余金	38,931,475
別途積立金	31,680,000
繰越利益剰余金	7,251,475
株主資本計	60,607,726
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	1,291,302
評価・換算差額等計	1,291,302
純資産合計	61,899,028
負債・純資産合計	83,660,307

(2) 中間損益計算書

(単位：千円)

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

(単位:千円)

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

(3) 中間株主資本等変動計算書

第34期中間会計期間（自平成30年4月1日至平成30年9月30日）

（単位：千円）

	株主資本								
	資本金	資本剰余金			利益剰余金				
		資本準備金	その他 資本剰余金	資本剰余金 合計	利益 準備金	その他利益剰余金			
						別途 積立金	研究開発 積立金	運用責 任準備 積立金	繰越利益 剰余金
当期首残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	24,580,000	300,000	200,000	19,146,562
当中間期変動額									
剰余金の配当									12,520,000
中間純利益									7,224,913
別途積立金の積立						7,100,000			
研究開発積立金の取崩							300,000		
運用責任準備積立金の取崩								200,000	
繰越利益剰余金の取崩									6,600,000
株主資本以外の項目の当中間期変動額(純額)									
当中間期変動額合計	-	-	-	-	-	7,100,000	300,000	200,000	11,895,086
当中間期末残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	31,680,000	-	-	7,251,475

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

重要な会計方針

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 子会社株式及び関連会社株式 ：移動平均法による原価法</p> <p>(2) その他有価証券 時価のあるもの：中間決算日の市場価格等に基づく時価法 （評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定） 時価のないもの：移動平均法による原価法</p>
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
3. 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産 定率法を採用しております。 ただし、平成28年4月1日以降に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。 なお、主な耐用年数は次のとおりであります。 建物 … 6～18年 器具備品 … 2～20年</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）に基づく定額法によっております。</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、中間決算日の直物等為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
5. 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金は、従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当中間会計期間に見合う分を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金は、役員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当中間会計期間に見合う分を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金は、従業員の退職給付に備えるため、退職一時金制度について、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。 退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 過去勤務費用については、その発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を費用処理しております。 数理計算上の差異については、各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年または10年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生の日次事業年度から費用処理しております。</p> <p>(4) 時効後支払損引当金は、時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。</p>
6. 消費税等の会計処理	消費税及び地方消費税の会計処理は税抜き方式によっております。

表示方法の変更

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

注記事項

（中間貸借対照表関係）

項目	第34期中間会計期間末 （平成30年9月30日現在）						
1.有形固定資産の減価償却累計額	<table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 10%;">建物</td> <td style="width: 10%;">...</td> <td style="width: 10%;">184,810千円</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td>...</td> <td>860,618千円</td> </tr> </table>	建物	...	184,810千円	器具備品	...	860,618千円
建物	...	184,810千円					
器具備品	...	860,618千円					

（中間損益計算書関係）

項目	第34期中間会計期間 （自平成30年4月1日 至平成30年9月30日）						
1.減価償却実施額	<table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 10%;">有形固定資産</td> <td style="width: 10%;">...</td> <td style="width: 10%;">112,547千円</td> </tr> <tr> <td>無形固定資産</td> <td>...</td> <td>181,894千円</td> </tr> </table>	有形固定資産	...	112,547千円	無形固定資産	...	181,894千円
有形固定資産	...	112,547千円					
無形固定資産	...	181,894千円					

（中間株主資本等変動計算書関係）

第34期中間会計期間（自平成30年4月1日 至平成30年9月30日）

1.発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

(2) 基準日が当中間会計期間に属する配当のうち、配当の効力発生日が当中間会計期間後となるもの
該当事項はありません。

(金融商品関係)

第34期中間会計期間末（平成30年9月30日現在）

金融商品の時価等に関する事項

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

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

	中間貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1) 現金・預金	34,067,025	34,067,025	-
(2) 金銭の信託	18,936,052	18,936,052	-
(3) 未収委託者報酬	12,755,452	12,755,452	-
(4) 未収運用受託報酬	3,856,616	3,856,616	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	2,164,304	2,164,304	-
資産計	71,779,451	71,779,451	-
(1) 未払手数料	4,999,441	4,999,441	-
負債計	4,999,441	4,999,441	-

(注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3) 未収委託者報酬及び(4) 未収運用受託報酬

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

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

負債

(1) 未払手数料

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

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

区分	中間貸借対照表計上額 (千円)
非上場株式	272,464
関係会社株式	3,229,196

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

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

（有価証券関係）

第34期中間会計期間末
（平成30年9月30日現在）

1. 子会社株式

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

2. その他有価証券

区 分	中間貸借対照表 計上額（千円）	取得原価 （千円）	差額 （千円）
中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの			
株式	1,976,064	146,101	1,829,962
投資信託	184,247	153,000	31,247
小計	2,160,311	299,101	1,861,209
中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
株式	-	-	-
投資信託	3,993	4,000	6
小計	3,993	4,000	6
合計	2,164,304	303,101	1,861,202

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

（企業結合等関係）

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

1. 結合当事企業

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

2. 企業結合日

平成28年10月1日

3. 企業結合の方法

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

4. 結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

5. 企業結合の主な目的

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

6. 合併比率

「3. 企業結合の方法」の吸収合併における合併比率は以下の通りであります。

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

(*) 普通株式と種類株式を合算して算定しております。

7. 交付した株式数

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

8. 経済的持分比率（議決権比率）

MHFGが企業結合直前に所有していた当社に対する経済的持分比率 50.00%

MHFGが企業結合日に追加取得した当社に対する経済的持分比率 20.00%

MHFGの追加取得後の当社に対する経済的持分比率 70.00%

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

9. 取得企業を決定するに至った主な根拠

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

10. 会計処理

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

11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

(1) 中間財務諸表に含まれる被取得企業の業績の期間

平成30年4月1日から平成30年9月30日まで

(2) 被取得企業の取得原価及びその内訳

取得の対価 MHAMの普通株式 144,212,500千円

取得原価 144,212,500千円

(3) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

a. 発生したのれん金額 76,224,837千円

b. 発生原因 被取得企業から受け入れた資産及び引き受けた負債の純額と取得原価との差額によります。

c. のれんの償却方法及び償却期間 20年間の均等償却

(4) 企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

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

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

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

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

12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

(1) 貸借対照表項目

流動資産	- 千円
固定資産	109,432,950千円
資産合計	109,432,950千円
流動負債	- 千円
固定負債	11,942,856千円
負債合計	11,942,856千円
純資産	97,490,094千円

(注) 固定資産及び資産合計には、のれんの金額68,602,354千円及び顧客関連資産の金額42,580,212千円が含まれております。

(2) 損益計算書項目

営業収益	- 千円
営業利益	4,521,569千円
経常利益	4,521,569千円
税引前中間純利益	4,521,569千円
中間純利益	3,720,565千円
1株当たり中間純利益	93,014円14銭

(注) 営業利益には、のれんの償却額1,905,620千円及び顧客関連資産の償却額2,620,626千円が含まれております。

(資産除去債務関係)

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

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

(セグメント情報等)

第34期中間会計期間(自平成30年4月1日 至平成30年9月30日)

1.セグメント情報

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2.関連情報

(1)サービスごとの情報

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

(2)地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3)主要な顧客ごとの情報

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

(1株当たり情報)

第34期中間会計期間 (自平成30年4月1日 至平成30年9月30日)	
1株当たり純資産額	1,547,475円72銭
1株当たり中間純利益金額	180,622円83銭

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

1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第34期中間会計期間 (自平成30年4月1日 至平成30年9月30日)
中間純利益金額	7,224,913千円
普通株主及び普通株主と同等の株主に帰属しない金額	-
普通株式及び普通株式と同等の株式に係る中間純利益金額	7,224,913千円
普通株式及び普通株式と同等の株式の期中平均株式数	40,000株
(うち普通株式)	(24,490株)
(うちA種種類株式)	(15,510株)

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

(重要な後発事象)

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

4【利害関係人との取引制限】

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

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

5【その他】

- (1) 定款の変更、事業譲渡又は事業譲受、出資の状況その他の重要事項

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

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

- (2) 訴訟事件その他の重要事項

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

a. 名称

みずほ信託銀行株式会社

b. 資本金の額

2018年3月末現在 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2018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

2018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、図案を使用し、ファンドの基本的性格を記載する場合があります。また、以下の内容を記載することがあります。

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

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

(3)投資信託説明書（請求目論見書）に約款の全文を掲載します。

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

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

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

独立監査人の監査報告書

平成30年5月30日

アセットマネジメントOne株式会社
取締役会 御中

新日本有限責任監査法人

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

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

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

利害関係

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

以上

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

(注2) XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

平成30年11月22日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 湯原 尚 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDIAMコア資産設計ファンド（堅実型）の平成30年4月12日から平成30年10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10月11日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

（注2）XBRLデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

平成30年11月22日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 湯原 尚 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDIAMコア資産設計ファンド（積極型）の平成30年4月12日から平成30年10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10月11日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

（注2）XBRLデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の中間監査報告書

平成30年11月30日

アセットマネジメントOne株式会社
取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているアセットマネジメントOne株式会社の平成30年4月1日から平成31年3月31日までの第34期事業年度の中間会計期間(平成30年4月1日から平成30年9月30日まで)に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

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

利害関係

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

以上

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

(注2) XBR Lデータは中間監査の対象には含まれておりません。