

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

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

DIAMコア資産設計ファンド（堅実型）

DIAMコア資産設計ファンド（積極型）

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

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

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

契約型の追加型証券投資信託の受益権（以下「受益権」といいます。）

信用格付業者から提供されもしくは閲覧に供された信用格付、または信用格付業者から提供されもしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。

ファンドの受益権は、「社債、株式等の振替に関する法律」（以下「社振法」といいます。）の規定の適用を受けており、受益権の帰属は、後述の「（11）振替機関に関する事項」に記載の振替機関等（後述の「（11）振替機関に関する事項」に記載の振替機関および当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含めます。）をいいます。以下同じ。）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託会社であるアセットマネジメントOne株式会社（以下、「委託会社」といいます。）は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

（３）【発行（売出）価額の総額】

各ファンドにつき、5,000億円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

お申込日の翌営業日の基準価額 とします。

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

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

< 基準価額の照会方法等 >

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

各ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・ 販売会社へのお問い合わせ
- ・ 委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

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

（５）【申込手数料】

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

*消費税率が10%になった場合は、3.3%となります。

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7月12日から2020年1月10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、各取得申込日の発行価額の総額は、販売会社によって、追加信託が行われる日に、委託会社の指定する口座を経由して受託会社の指定するファンド口座(受託会社が信託事務の一部について委託を行っている場合は当該委託先の口座)に払込まれます。

(1 0) 【払込取扱場所】

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

・委託会社への照会

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】

お申込みには、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、

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、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、資産価値下落時で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。

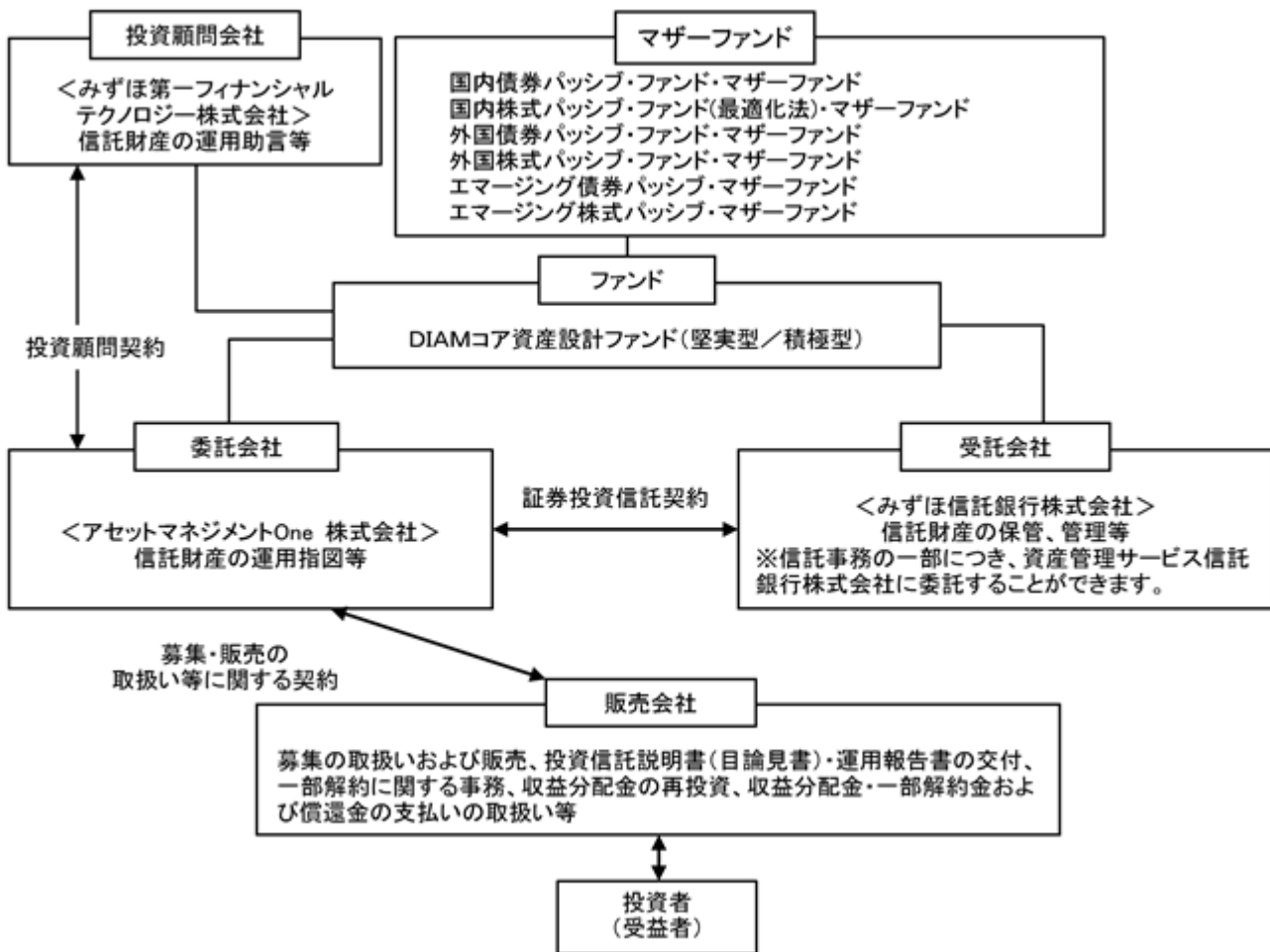
上記の分類は、一般社団法人投資信託協会の商品分類に関する指針に基づき記載しております。

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（<https://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。

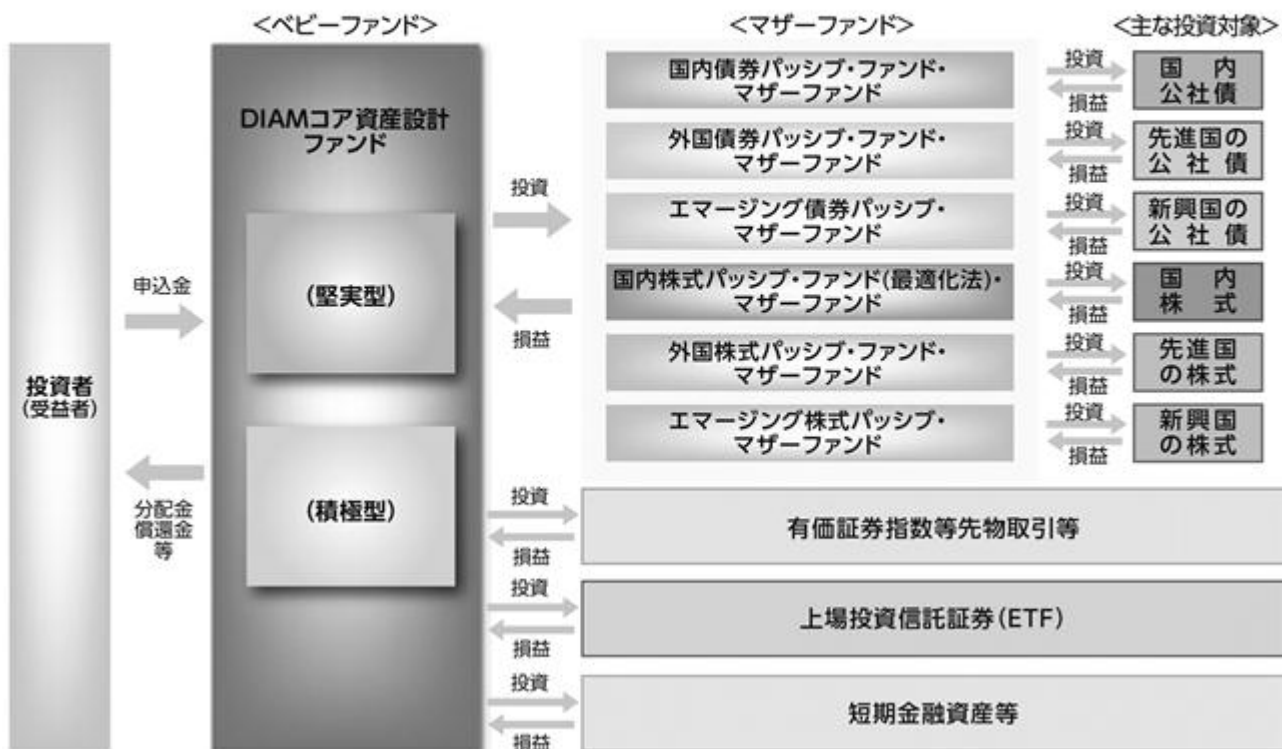
- ・「投資顧問契約」の概要

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（2019年4月26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

（2019年4月26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

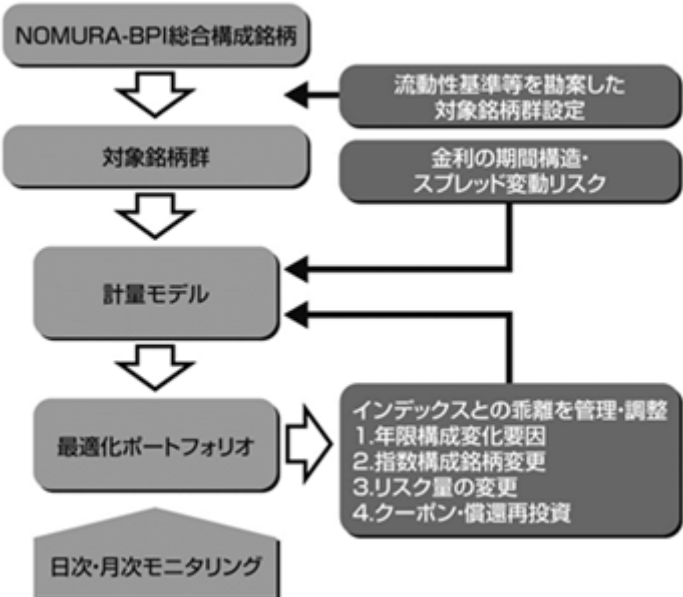
なお、1.の証券または証書、13.および18.の証券または証書のうち1.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、2.から7.までの証券ならびに13.および18.の証券または証書のうち2.から7.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、14.の証券および15.の証券を以下「投資信託証券」といいます。

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>

<p>主な投資制限</p>	<ol style="list-style-type: none"> 1. 株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限りします。 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。
---------------	---

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

投資態度	<ol style="list-style-type: none">1. 主として東京証券取引所第1部に上場されている株式に投資し、「東証株価指数(TOPIX)(配当込み)」に連動する投資成果をめざして運用を行います。2. 最適化法によるポートフォリオ構築を行い、運用コストの最小化と徹底したリスク管理を行います。3. 株式(株価指数先物取引を含みます。)の組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。4. 株式の組入比率の調整には、株価指数先物取引等を活用します。5. 非株式割合は原則として信託財産総額の50%以下とします。また、外貨建資産割合は原則として信託財産総額の10%以下とします。 <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

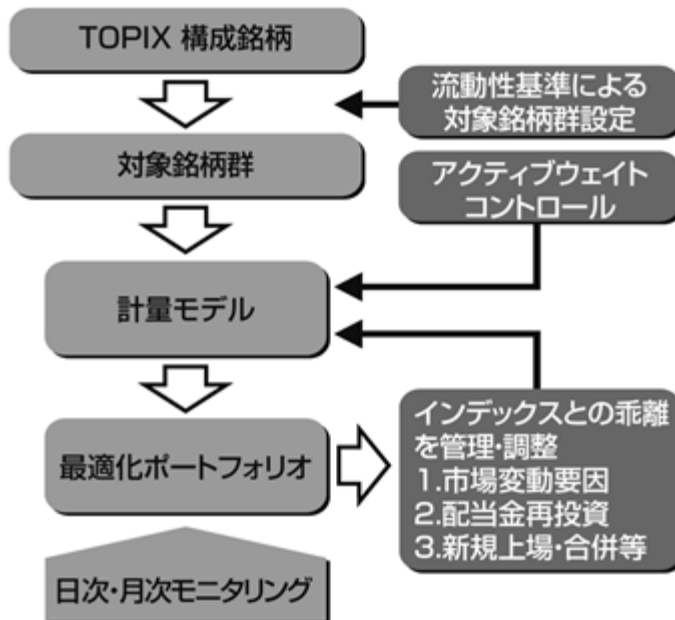
インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差(アクティブウェイト)を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。

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。

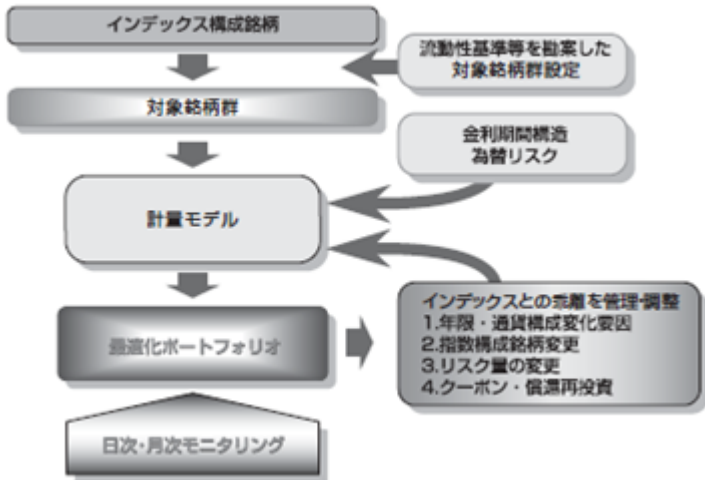
インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。

- ・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

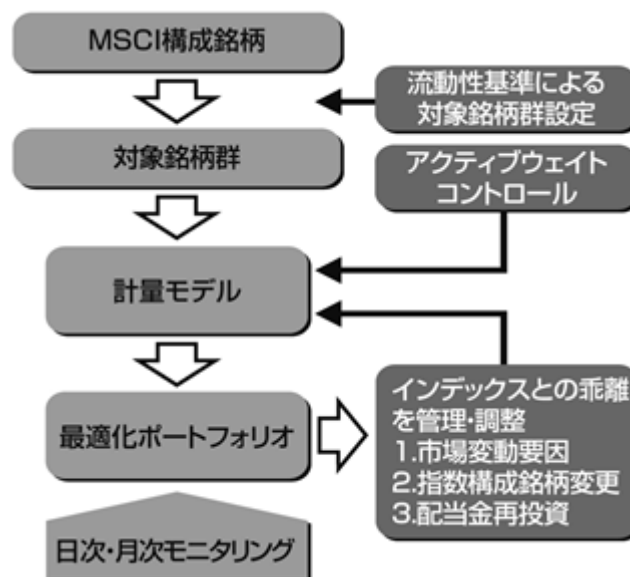
インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差(アクティブウェイト)を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。

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、当該ファンドが保有する債券の格付が上記基準未満となった場合は、当該債券を速やかに売却するものとします。 4. 外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。 <div style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin-top: 10px;"> <p>JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラスに関する著作権等の知的財産その他一切の権利はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。</p> </div>

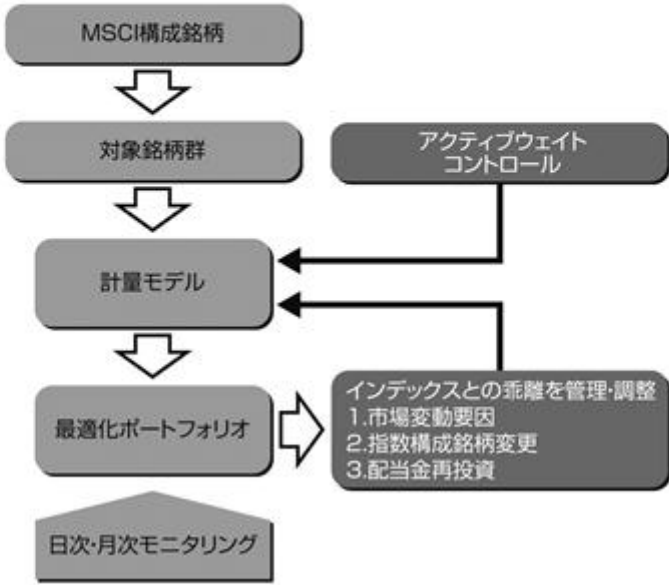
運用プロセス	<p>信用格付基準等を勘案した投資対象銘柄群を設定し、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。</p>
主な投資制限	<ol style="list-style-type: none"> 1. 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 2. 外貨建資産への投資には、制限を設けません。 3. 投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 4. デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金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

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

投資態度	<ol style="list-style-type: none">1.主として海外の証券取引所に上場している株式に投資し、MSCIエマージング・マーケット・インデックス(円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。2.原則として、株式の組入比率は高位を維持します。3.外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。
------	---

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

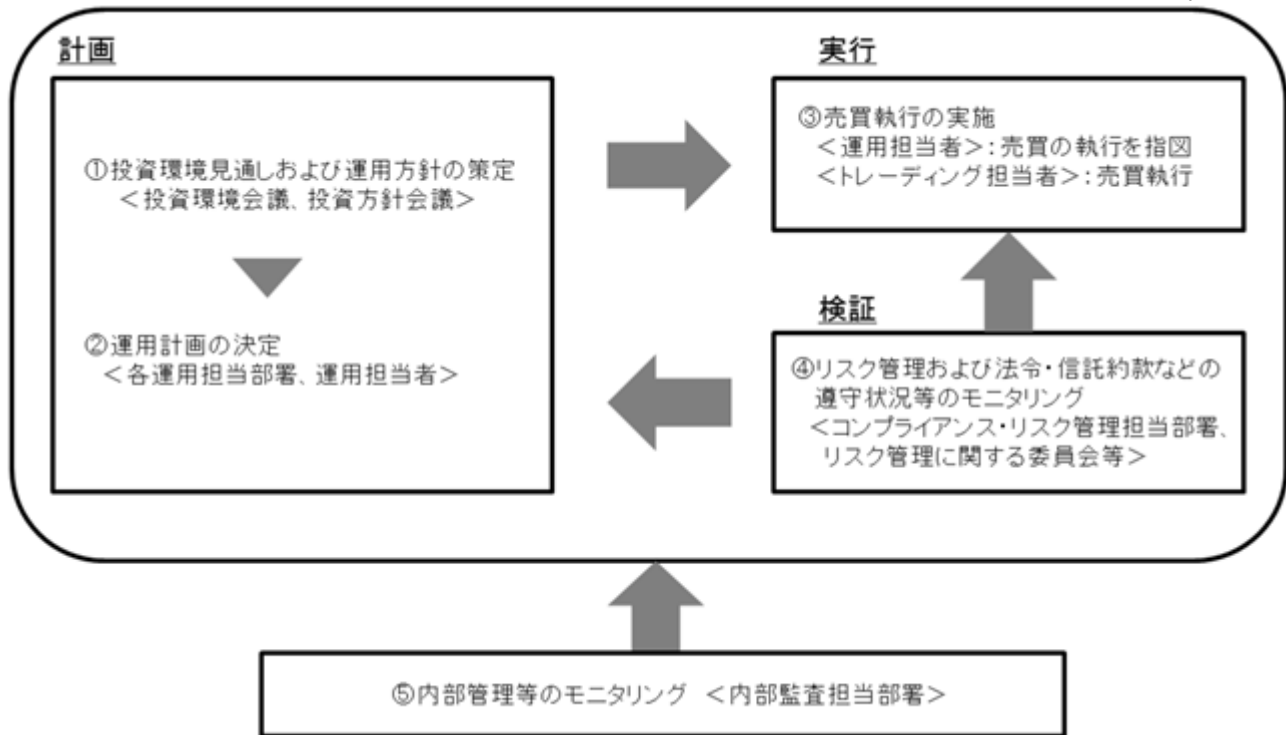
MSCIは、自らが信頼できると考える情報源からMSCI指数の計算に算入または使用するための情報を入手しますが、いかなるMSCI関係者も、MSCI指数またはそれに含まれるデータの独創性、正確性および/または完全性について保証するものではありません。いかなるMSCI関係者も、明示的か黙示的かを問わず、本ファンドの発行会社もしくは所有者、またはその他の者もしくは団体が、MSCI指数またはそれに含まれるデータを使用することにより得られる結果について保証を行いません。いかなるMSCI関係者も、MSCI指数またはそれに含まれるデータの、またはそれらに関連する過誤、脱漏または中断について責任を負いません。また、MSCI指数およびそれに含まれるデータの各々に関し、いかなるMSCI関係者も明示的または黙示的な保証を行うものではなく、かつMSCI関係者は、それらに関する特定目的に対する市場性および適合性に係る一切の保証を明示的に否認します。前記事項を制限することなく、直接的損害、間接的損害、特別損害、懲罰的損害、結果的損害その他あらゆる損害(逸失利益を含む。)については、その可能性について告知されていたとしても、MSCI関係者は、かかる損害について責任を負いません。本証券、本商品もしくは本ファンドの購入者、販売者もしくは所有者、またはその他いかなる者もしくは団体も、MSCIの承認が必要か否かの確認を事前にMSCIに求めることなく、本証券を保証、推奨、販売、または宣伝するためにMSCIのトレードネーム、トレードマークまたはサービスマークを使用したり、それらに言及することはできません。いかなる状況においても、いかなる者または団体も、事前にMSCIの書面による承認を得ることなくMSCIとの関係を主張することはできません。

運用プロセス	<p>現地口座の開設可否、預託証券の利用可否を基準に投資対象銘柄群を設定し、インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差(アクティブウェイト)を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用いて、インデックスとの乖離を抑えます。 日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理して、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。</p>  <pre> graph TD A[MSCI構成銘柄] --> B[対象銘柄群] B --> C[計量モデル] C --> D[最適化ポートフォリオ] E[アクティブウェイトコントロール] --> C E --> D D --> F[インデックスとの乖離を管理・調整 1.市場変動要因 2.指数構成銘柄変更 3.配当金再投資] F --> G[日次・月次モニタリング] </pre>
主な投資制限	<ol style="list-style-type: none"> 1. 株式への投資割合には、制限を設けません。 2. 外貨建資産への投資には、制限を設けません。 3. 投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 4. デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 5. 外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。 6. 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

資金動向、市況動向等によっては、上記の運用ができない場合があります。

（3）【運用体制】

a. ファンドの運用体制



投資環境見直しおよび運用方針の策定

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

運用計画の決定

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

売買執行の実施

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

モニタリング

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

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

内部管理等のモニタリング

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

b. ファンドの関係法人に関する管理

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

c. 運用体制に関する社内規則

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

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

運用体制は2019年4月26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、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、

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、
 - 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、)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、(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

資産配分比率が高い資産の価値が下落した場合や、複数または全ての資産の価値が同時に下落した場合等は、基準価額の下落要因となります。

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。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従できない場合があります。

・株価変動リスク

投資する企業の株価の下落は、基準価額の下落要因となります。

ファンドは、実質的に株式に投資をします。株式市場の変動により基準価額が上下します。

・金利リスク

金利の上昇(債券の価格の下落)は、基準価額の下落要因となります。

一般的に金利が上昇すると債券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。金利変動により基準価額が上下します。

・為替リスク

為替相場の円高は、基準価額の下落要因となります。

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

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

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

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

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

・カントリーリスク

投資する国・地域の政治・経済の不安定化等は、基準価額の下落要因となります。

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、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。

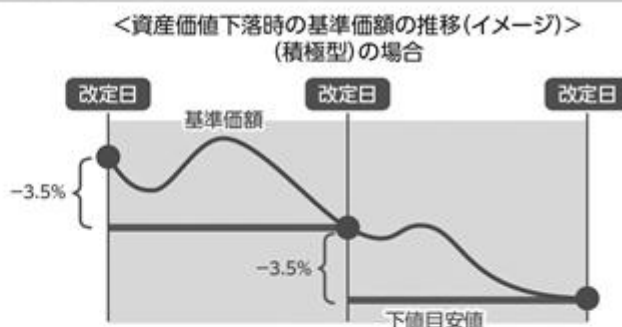
各ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行います。そのため、各ファンドが投資対象とするマザーファンドを投資対象とする他のベビーファンドに追加設定・解約等があった場合、資金変動等が起こり、その結果、当該マザーファンドにおいて売買等が生じた場合等には、各ファンドの基準価額に影響をおよぼす場合があります。

（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。

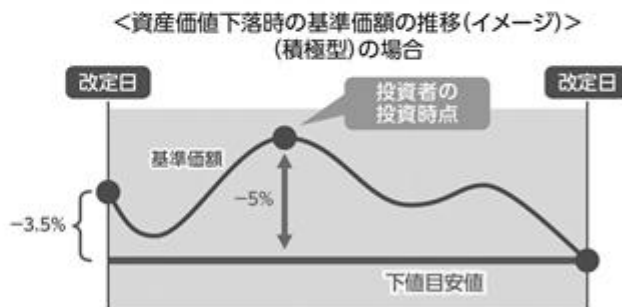
ケース① 下値目安値の切下げについて

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きますようお願いいたします。



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

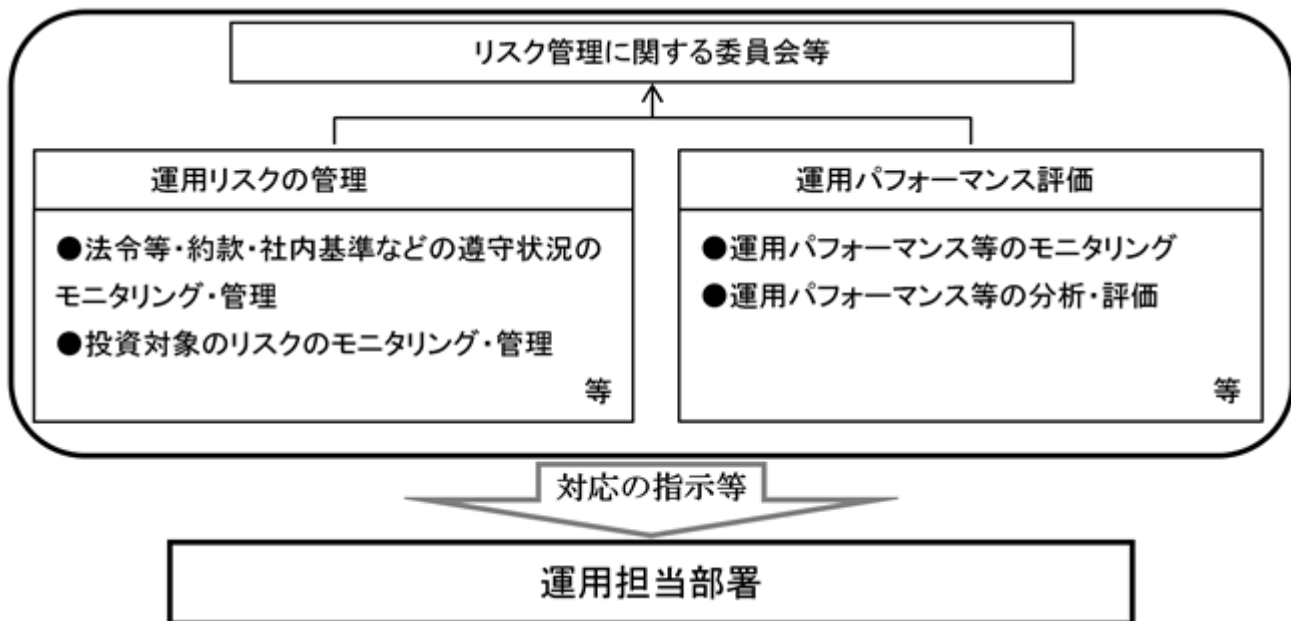
ハ. 投資信託は、購入金額について元本保証および利回り保証のいずれもありません。

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2019年4月26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>

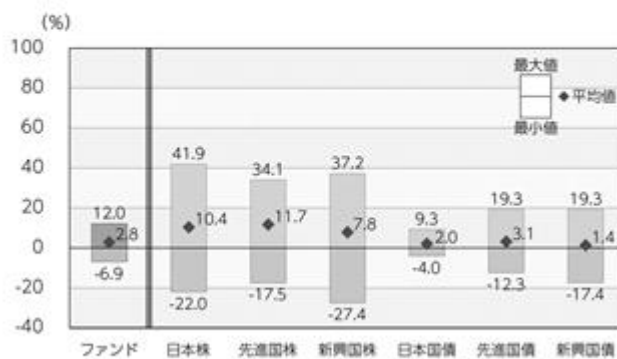
ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移

(堅 実 型)



2014年5月 2015年5月 2016年5月 2017年5月 2018年5月 2019年4月

ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較

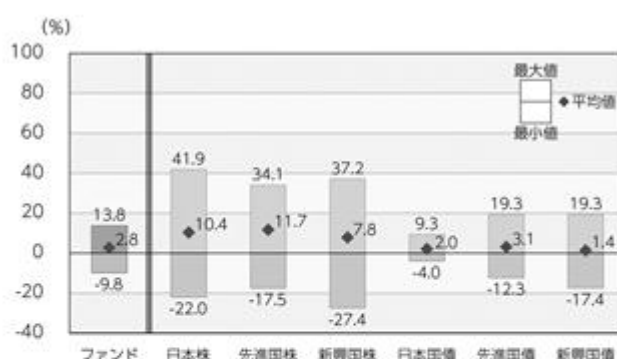


ファンド:2016年8月~2019年4月
 代表的な資産クラス:2014年5月~2019年4月

(積 極 型)



2014年5月 2015年5月 2016年5月 2017年5月 2018年5月 2019年4月



ファンド:2016年8月~2019年4月
 代表的な資産クラス:2014年5月~2019年4月

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

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

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

*全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

各資産クラスの指数

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

(注)海外の指数は為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

お申込時に、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。

*消費税率が10%になった場合は、3.3%となります。

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%）

*消費税率が10%になった場合は、年率1.155%となります。

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（ファンドの基準価額に反映）され、毎計算期末または信託終了のときに信託報酬にかかる消費税等相当額とともに信託財産から支払われます。

委託会社の信託報酬には、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(ファンドの基準価額に反映)され、毎計算期末または信託終了のとき、当該監査に要する費用にかかる消費税等相当額とともに信託財産から支払われます。

有価証券の売買時の売買委託手数料および有価証券取引にかかる手数料・税金、先物・オプション取引に要する費用、当該手数料にかかる消費税等相当額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、2019年4月末現在のものです。税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。

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

個別元本方式について

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

<個別元本について>

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

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

ただし、同一ファンドの受益権を複数の販売会社で取得する場合については販売会社毎に個別元本の算出が行われます。また、同一販売会社であっても複数支店等で同一ファンドの受益権を取得する場合は当該支店等毎に、「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31年4月26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	87,976,029	56.03
内 日本	87,976,029	56.03
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	69,048,591	43.97
純資産総額	157,024,620	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31年4月26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	273,927,056	88.13
内 日本	273,927,056	88.13
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	36,896,563	11.87
純資産総額	310,823,619	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31年4月26日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	264,759,812,660	97.37
内 日本	264,759,812,660	97.37
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	7,149,802,638	2.63
純資産総額	271,909,615,298	100.00

その他資産の投資状況

平成31年4月26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）	6,363,100,000	2.34
内 日本	6,363,100,000	2.34

（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31年4月26日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	232,617,975,600	80.23
内 日本	232,617,975,600	80.23
地方債証券	22,132,278,047	7.63
内 日本	22,132,278,047	7.63
特殊債券	18,020,970,577	6.22
内 日本	18,020,970,577	6.22
社債券	13,765,461,740	4.75
内 日本	13,360,859,740	4.61
内 フランス	404,602,000	0.14
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	3,398,295,561	1.17
純資産総額	289,934,981,525	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31年4月26日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	356,649,308,720	96.02
内 アメリカ	231,782,586,408	62.40
内 イギリス	22,270,267,373	6.00
内 カナダ	13,916,030,910	3.75
内 フランス	13,802,460,966	3.72
内 スイス	12,913,683,205	3.48
内 ドイツ	11,857,980,955	3.19
内 オーストラリア	8,589,389,986	2.31
内 オランダ	6,616,479,179	1.78
内 アイルランド	6,206,653,492	1.67
内 スペイン	4,055,972,576	1.09
内 香港	3,827,667,014	1.03
内 スウェーデン	3,400,356,570	0.92
内 イタリア	2,557,029,426	0.69
内 デンマーク	2,313,171,768	0.62
内 シンガポール	1,704,751,434	0.46
内 フィンランド	1,603,959,232	0.43
内 バミューダ	1,477,429,270	0.40
内 ベルギー	1,349,381,611	0.36
内 ジャージー	1,236,066,513	0.33
内 ケイマン諸島	1,030,959,562	0.28
内 ノルウェー	963,485,845	0.26
内 イスラエル	743,798,530	0.20
内 オランダ領キュラソー	586,606,563	0.16
内 ルクセンブルグ	420,715,460	0.11
内 オーストリア	324,872,174	0.09
内 ニューージーランド	291,491,991	0.08
内 パナマ	213,428,349	0.06

	内 ポルトガル	210,062,209	0.06
	内 リベリア	190,732,431	0.05
	内 パプアニューギニア	67,647,804	0.02
	内 イギリス領バージン諸島	60,441,923	0.02
	内 マン島	47,280,873	0.01
	内 モーリシャス	16,467,118	0.00
投資信託受益証券		823,448,221	0.22
	内 オーストラリア	673,677,645	0.18
	内 シンガポール	149,770,576	0.04
投資証券		8,567,397,719	2.31
	内 アメリカ	7,532,322,169	2.03
	内 イギリス	287,029,544	0.08
	内 香港	241,641,760	0.07
	内 オランダ	233,047,864	0.06
	内 フランス	206,472,462	0.06
	内 カナダ	66,883,920	0.02
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		5,388,822,088	1.45
純資産総額		371,428,976,748	100.00

その他資産の投資状況

平成31年4月26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)	1,229,422,990	0.33
-	1,229,422,990	0.33
株価指数先物取引(買建)	4,041,617,236	1.09
内 アメリカ	2,814,789,137	0.76
内 ドイツ	685,862,415	0.18
内 イギリス	255,457,286	0.07
内 カナダ	148,175,244	0.04
内 オーストラリア	137,333,154	0.04

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

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

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

(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31年4月26日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	188,223,302,831	97.36
内 アメリカ	89,030,749,987	46.05
内 フランス	18,561,169,095	9.60
内 イタリア	16,230,958,670	8.40
内 ドイツ	12,654,542,407	6.55
内 イギリス	12,128,589,433	6.27
内 スペイン	11,002,080,470	5.69
内 ベルギー	4,762,727,390	2.46
内 オーストラリア	3,962,099,487	2.05
内 オランダ	3,763,589,073	1.95
内 カナダ	3,548,998,204	1.84
内 オーストリア	2,904,461,637	1.50
内 メキシコ	1,467,873,505	0.76
内 アイルランド	1,359,899,731	0.70
内 フィンランド	1,205,283,822	0.62
内 ポーランド	1,108,371,326	0.57
内 南アフリカ	1,062,743,967	0.55
内 デンマーク	949,069,371	0.49
内 マレーシア	815,309,210	0.42
内 シンガポール	666,000,750	0.34
内 スウェーデン	647,800,202	0.34
内 ノルウェー	390,985,094	0.20
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	5,096,097,358	2.64
純資産総額	193,319,400,189	100.00

その他資産の投資状況

平成31年4月26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）	1,346,214,766	0.70
-	1,346,214,766	0.70

（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31年4月26日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	53,528,145,667	89.90
内 ケイマン諸島	9,402,025,247	15.79
内 韓国	6,897,225,548	11.58
内 台湾	6,185,259,265	10.39
内 中国	5,931,599,411	9.96
内 インド	4,853,514,933	8.15
内 ブラジル	3,785,558,904	6.36
内 南アフリカ	3,216,738,418	5.40
内 ロシア	2,005,211,148	3.37

内 香港	1,928,031,229	3.24
内 タイ	1,241,039,491	2.08
内 メキシコ	1,188,259,767	2.00
内 インドネシア	1,149,780,790	1.93
内 マレーシア	1,142,499,950	1.92
内 ポーランド	608,218,769	1.02
内 フィリピン	584,638,872	0.98
内 バミューダ	561,386,337	0.94
内 カタール	549,450,382	0.92
内 チリ	532,418,421	0.89
内 アラブ首長国連邦	426,421,590	0.72
内 トルコ	275,359,912	0.46
内 コロンビア	237,388,585	0.40
内 アメリカ	190,110,142	0.32
内 ハンガリー	168,751,738	0.28
内 ギリシャ	124,461,577	0.21
内 チェコ	83,942,467	0.14
内 エジプト	67,180,868	0.11
内 オランダ	41,552,096	0.07
内 マン島	30,906,080	0.05
内 ベルギー	29,358,388	0.05
内 ジャージー	26,145,624	0.04
内 ルクセンブルグ	25,416,820	0.04
内 パキスタン	19,826,911	0.03
内 シンガポール	18,465,987	0.03
新株予約権証券	222,507	0.00
内 タイ	222,507	0.00
投資信託受益証券	250,420,518	0.42
内 メキシコ	250,420,518	0.42
投資証券	77,214,705	0.13
内 メキシコ	47,302,661	0.08
内 南アフリカ	29,912,044	0.05
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	5,684,891,190	9.55
純資産総額	59,540,894,587	100.00

その他資産の投資状況

平成31年4月26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）	500,930,420	0.84
-	500,930,420	0.84
株価指数先物取引（買建）	5,136,582,622	8.63
内 アメリカ	5,136,582,622	8.63

（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31年4月26日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	97,889,019,082	96.69
内 メキシコ	14,976,062,687	14.79
内 インドネシア	12,960,464,503	12.80
内 ロシア	11,142,871,469	11.01
内 ブラジル	10,735,514,218	10.60
内 コロンビア	9,199,242,165	9.09
内 フィリピン	8,993,066,373	8.88
内 ハンガリー	5,652,834,126	5.58
内 パナマ	5,449,530,082	5.38
内 南アフリカ	5,288,106,708	5.22
内 ペルー	4,797,858,654	4.74
内 ルーマニア	4,777,823,298	4.72
内 クロアチア	3,915,644,799	3.87
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	3,352,479,889	3.31
純資産総額	101,241,498,971	100.00

その他資産の投資状況

平成31年4月26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）	290,524,000	0.29
-	290,524,000	0.29
為替予約取引（売建）	458,093,000	0.45
-	458,093,000	0.45

（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31年4月26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	10,502,085	2.5083 26,343,430	2.5266 26,534,567	- -	16.90%
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	18,102,848	1.2155 22,004,012	1.2012 21,745,141	- -	13.85%
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	7,115,256	1.8467 13,139,744	1.8395 13,088,513	- -	8.34%
4	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	2,403,581	3.6607 8,798,789	3.7169 8,933,870	- -	5.69%
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	4,605,473	1.9079 8,787,242	1.9229 8,855,864	- -	5.64%
6	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	6,730,841	1.3127 8,836,248	1.3101 8,818,074	- -	5.62%

(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31年4月26日現在

種類	投資比率
親投資信託受益証券	56.03%
合計	56.03%

(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31年4月26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	32,742,535	2.5121 82,254,228	2.5266 82,727,288	- -	26.62%
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	56,295,543	1.2153 68,418,006	1.2012 67,622,206	- -	21.76%
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	22,243,134	1.8476 41,096,478	1.8395 40,916,244	- -	13.16%
4	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	7,471,234	3.6667 27,395,188	3.7169 27,769,829	- -	8.93%
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	14,319,990	1.9093 27,341,214	1.9229 27,535,908	- -	8.86%
6	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	20,880,529	1.3123 27,402,883	1.3101 27,355,581	- -	8.80%

(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31年4月26日現在

種類	投資比率
親投資信託受益証券	88.13%
合計	88.13%

(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31年4月26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	1,270,500	6,575.00 8,353,537,500	6,905.00 8,772,802,500	- -	3.23%
2	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	467,600	9,962.00 4,658,231,200	11,555.00 5,403,118,000	- -	1.99%
3	三菱UFJフィナンシャル・ グループ 日本	株式 銀行業	7,740,300	578.10 4,474,667,430	549.90 4,256,390,970	- -	1.57%
4	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	995,400	4,473.43 4,452,857,793	4,112.00 4,093,084,800	- -	1.51%
5	ソニー 日本	株式 電気機器	764,900	4,713.00 3,604,973,700	5,212.00 3,986,658,800	- -	1.47%
6	キーエンス 日本	株式 電気機器	56,000	62,260.00 3,486,560,000	69,120.00 3,870,720,000	- -	1.42%
7	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	765,100	4,636.00 3,547,003,600	4,616.00 3,531,701,600	- -	1.30%
8	三井住友フィナンシャルグ ループ 日本	株式 銀行業	792,500	3,928.00 3,112,940,000	4,021.00 3,186,642,500	- -	1.17%
9	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	961,700	3,002.00 2,887,023,400	3,101.00 2,982,231,700	- -	1.10%
10	みずほフィナンシャルグルー プ 日本	株式 銀行業	15,279,300	173.40 2,649,430,620	173.50 2,650,958,550	- -	0.97%
11	リクルートホールディングス 日本	株式 サービス業	780,500	2,916.00 2,275,938,000	3,329.00 2,598,284,500	- -	0.96%
12	KDDI 日本	株式 情報・通信業	985,900	2,658.50 2,621,015,150	2,540.50 2,504,678,950	- -	0.92%
13	任天堂 日本	株式 その他製品	65,200	29,315.00 1,911,338,000	38,000.00 2,477,600,000	- -	0.91%
14	東海旅客鉄道 日本	株式 陸運業	102,100	23,625.00 2,412,112,500	23,895.00 2,439,679,500	- -	0.90%
15	三菱商事 日本	株式 卸売業	787,900	3,156.00 2,486,612,400	3,056.00 2,407,822,400	- -	0.89%
16	花王 日本	株式 化学	276,800	8,049.00 2,227,963,200	8,557.00 2,368,577,600	- -	0.87%
17	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	402,000	5,341.00 2,147,082,000	5,602.00 2,252,004,000	- -	0.83%
18	ファナック 日本	株式 電気機器	108,300	18,795.00 2,035,498,500	20,775.00 2,249,932,500	- -	0.83%
19	ダイキン工業 日本	株式 機械	155,600	11,755.00 1,829,078,000	14,100.00 2,193,960,000	- -	0.81%
20	日本電産 日本	株式 電気機器	137,200	13,145.00 1,803,494,000	15,785.00 2,165,702,000	- -	0.80%

21	村田製作所 日本	株式 電気機器	358,800	5,796.66 2,079,844,074	5,960.00 2,138,448,000	- -	0.79%
22	東日本旅客鉄道 日本	株式 陸運業	202,700	10,160.00 2,059,432,000	10,465.00 2,121,255,500	- -	0.78%
23	信越化学工業 日本	株式 化学	196,800	9,244.00 1,819,219,200	10,430.00 2,052,624,000	- -	0.75%
24	資生堂 日本	株式 化学	226,600	7,200.00 1,631,520,000	8,718.00 1,975,498,800	- -	0.73%
25	キヤノン 日本	株式 電気機器	613,700	3,185.00 1,954,634,500	3,089.00 1,895,719,300	- -	0.70%
26	日立製作所 日本	株式 電気機器	513,300	3,503.00 1,798,089,900	3,689.00 1,893,563,700	- -	0.70%
27	セブン&アイ・ホールディングス 日本	株式 小売業	470,600	4,768.00 2,243,820,800	3,859.00 1,816,045,400	- -	0.67%
28	三菱電機 日本	株式 電気機器	1,140,000	1,390.50 1,585,170,000	1,582.00 1,803,480,000	- -	0.66%
29	HOYA 日本	株式 精密機器	229,600	6,590.00 1,513,064,000	7,815.00 1,794,324,000	- -	0.66%
30	第一三共 日本	株式 医薬品	326,200	3,604.00 1,175,624,800	5,481.00 1,787,902,200	- -	0.66%

(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31年4月26日現在

種類	投資比率
株式	97.37%
合計	97.37%

(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31年4月26日現在

業種	国内/外国	投資比率
電気機器	国内	13.28%
情報・通信業		8.32%
輸送用機器		7.83%
化学		7.30%
銀行業		5.88%
医薬品		5.39%
機械		5.10%
サービス業		4.91%
卸売業		4.81%
陸運業		4.54%
小売業		4.45%
食料品		4.06%
建設業		2.79%
不動産業		2.25%
保険業		2.15%
その他製品		2.07%
精密機器		2.02%
電気・ガス業		1.69%
その他金融業		1.07%
鉄鋼		0.94%
ガラス・土石製品		0.87%
ゴム製品		0.76%
証券、商品先物取引業		0.76%
非鉄金属		0.76%
繊維製品		0.63%
石油・石炭製品		0.60%
空運業		0.55%
金属製品		0.55%
パルプ・紙		0.28%
鉱業		0.28%
倉庫・運輸関連業		0.19%
海運業	0.17%	
水産・農林業	0.11%	
合計	97.37%	

(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31年4月26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	125回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	3,000,000,000	100.43 3,013,170,000	100.35 3,010,710,000	0.100000 2020/9/20	1.04%
2	350回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,850,000,000	101.50 2,892,978,000	101.78 2,900,986,500	0.100000 2028/3/20	1.00%
3	339回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,640,000,000	103.63 2,735,978,400	103.52 2,733,060,000	0.400000 2025/6/20	0.94%
4	345回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,610,000,000	101.90 2,659,668,300	101.88 2,659,276,800	0.100000 2026/12/20	0.92%
5	342回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,600,000,000	101.90 2,649,426,000	101.84 2,647,866,000	0.100000 2026/3/20	0.91%
6	341回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,510,000,000	103.21 2,590,771,800	103.11 2,588,136,300	0.300000 2025/12/20	0.89%
7	332回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,460,000,000	103.76 2,552,496,000	103.58 2,548,240,200	0.600000 2023/12/20	0.88%
8	343回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,500,000,000	101.93 2,548,275,000	101.87 2,546,800,000	0.100000 2026/6/20	0.88%
9	340回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,450,000,000	103.76 2,542,267,000	103.63 2,539,131,000	0.400000 2025/9/20	0.88%
10	126回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	2,500,000,000	100.50 2,512,700,000	100.42 2,510,550,000	0.100000 2020/12/20	0.87%
11	328回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,390,000,000	103.15 2,465,285,000	102.99 2,461,652,200	0.600000 2023/3/20	0.85%
12	346回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,370,000,000	101.88 2,414,556,000	101.90 2,415,243,300	0.100000 2027/3/20	0.83%
13	349回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,360,000,000	101.64 2,398,744,800	101.82 2,403,117,200	0.100000 2027/12/20	0.83%
14	351回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,360,000,000	101.40 2,393,205,200	101.74 2,401,229,200	0.100000 2028/6/20	0.83%
15	329回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,270,000,000	104.22 2,365,794,000	104.02 2,361,367,500	0.800000 2023/6/20	0.81%

16	347回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	2,300,000,000	101.85 2,342,697,000	101.88 2,343,401,000	0.100000 2027/6/20	0.81%
17	335回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	2,250,000,000	103.76 2,334,651,000	103.63 2,331,720,000	0.500000 2024/9/20	0.80%
18	352回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	2,270,000,000	101.25 2,298,375,000	101.65 2,307,477,700	0.100000 2028/9/20	0.80%
19	344回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	2,230,000,000	101.92 2,272,816,000	101.86 2,271,544,900	0.100000 2026/9/20	0.78%
20	348回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	2,230,000,000	101.73 2,268,645,900	101.86 2,271,478,000	0.100000 2027/9/20	0.78%
21	312回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	2,200,000,000	102.53 2,255,726,000	102.21 2,248,642,000	1.200000 2020/12/20	0.78%
22	128回 利付国庫債券（5年） 日本	国債証券	2,200,000,000	100.63 2,213,948,000	100.55 2,212,166,000	0.100000 2021/6/20	0.76%
23	334回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	2,120,000,000	104.15 2,208,001,200	103.97 2,204,312,400	0.600000 2024/6/20	0.76%
24	333回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	2,100,000,000	103.96 2,183,196,000	103.78 2,179,380,000	0.600000 2024/3/20	0.75%
25	325回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	2,100,000,000	103.48 2,173,218,000	103.29 2,169,090,000	0.800000 2022/9/20	0.75%
26	129回 利付国庫債券（5年） 日本	国債証券	2,120,000,000	100.70 2,134,850,500	100.63 2,133,377,200	0.100000 2021/9/20	0.74%
27	338回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	2,060,000,000	103.45 2,131,209,600	103.37 2,129,586,800	0.400000 2025/3/20	0.73%
28	135回 利付国庫債券（5年） 日本	国債証券	2,100,000,000	101.11 2,123,352,000	101.07 2,122,491,000	0.100000 2023/3/20	0.73%
29	131回 利付国庫債券（5年） 日本	国債証券	2,020,000,000	100.83 2,036,927,600	100.76 2,035,412,600	0.100000 2022/3/20	0.70%
30	132回 利付国庫債券（5年） 日本	国債証券	2,000,000,000	100.90 2,018,140,000	100.84 2,016,940,000	0.100000 2022/6/20	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31年4月26日現在

種類	投資比率
国債証券	80.23%
地方債証券	7.63%
特殊債券	6.22%
社債券	4.75%
合計	98.83%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成31年4月26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	412,475	19,103.97 7,879,914,150	22,960.56 9,470,660,285	- -	2.55%
2	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフトウェア	633,637	11,962.10 7,579,635,206	14,445.42 9,153,157,344	- -	2.46%
3	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 インターネット 販売・通信 販売	36,117	181,515.18 6,555,783,965	212,766.66 7,684,493,549	- -	2.07%
4	FACEBOOK INC アメリカ	株式 インタラク ティブ・メ ディアおよび サービス	208,740	18,336.50 3,827,562,731	21,616.13 4,512,151,184	- -	1.21%
5	ALPHABET INC-CL C アメリカ	株式 インタラク ティブ・メ ディアおよび サービス	27,525	125,457.77 3,453,225,190	141,316.88 3,889,747,190	- -	1.05%
6	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	288,360	11,455.67 3,303,359,019	12,707.27 3,664,270,828	- -	0.99%
7	ALPHABET INC-CL A アメリカ	株式 インタラク ティブ・メ ディアおよび サービス	25,795	126,298.20 3,257,862,263	141,751.97 3,656,492,298	- -	0.98%
8	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	232,816	15,024.98 3,498,057,909	15,619.85 3,636,551,579	- -	0.98%
9	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	367,491	8,533.09 3,135,836,124	9,196.30 3,379,560,055	- -	0.91%
10	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	265,023	9,651.36 2,557,832,503	10,657.75 2,824,549,090	- -	0.76%

11	VISA INC アメリカ	株式 情報技術サービス	152,457	16,012.44 2,441,209,479	18,010.08 2,745,763,833	- -	0.74%
12	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 銀行	808,577	3,175.42 2,567,572,790	3,364.44 2,720,415,270	- -	0.73%
13	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 各種金融サービス	113,163	22,680.94 2,566,643,552	23,706.60 2,682,710,824	- -	0.72%
14	INTEL CORP アメリカ	株式 半導体・半導体製造装置	396,284	5,683.09 2,252,121,005	6,443.67 2,553,526,690	- -	0.69%
15	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品	216,494	11,012.86 2,384,218,181	11,551.86 2,500,910,110	- -	0.67%
16	CISCO SYSTEMS INC アメリカ	株式 通信機器	389,909	5,413.53 2,110,787,967	6,300.51 2,456,625,748	- -	0.66%
17	THE WALT DISNEY CO アメリカ	株式 娯楽	155,657	12,426.22 1,934,229,165	15,350.29 2,389,380,713	- -	0.64%
18	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 専門小売り	97,969	20,995.36 2,056,894,766	23,097.02 2,262,792,442	- -	0.61%
19	VERIZON COMM INC アメリカ	株式 各種電気通信サービス	358,767	6,046.04 2,169,122,003	6,246.82 2,241,153,767	- -	0.60%
20	PFIZER INC アメリカ	株式 医薬品	500,973	4,694.34 2,351,739,847	4,430.37 2,219,500,008	- -	0.60%
21	MASTERCARD INC アメリカ	株式 情報技術サービス	79,593	24,585.74 1,956,853,480	27,471.47 2,186,537,388	- -	0.59%
22	CHEVRON CORP アメリカ	株式 石油・ガス・消耗燃料	165,788	13,219.14 2,191,575,674	13,187.11 2,186,265,421	- -	0.59%
23	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	83,204	29,658.98 2,467,745,816	25,813.86 2,147,816,532	- -	0.58%
24	AT&T INC アメリカ	株式 各種電気通信サービス	631,496	3,333.64 2,105,180,670	3,393.52 2,142,999,989	- -	0.58%
25	WELLS FARGO & CO アメリカ	株式 銀行	388,191	5,426.96 2,106,697,805	5,313.99 2,062,844,450	- -	0.56%
26	BOEING CO アメリカ	株式 航空宇宙・防衛	46,850	45,838.36 2,147,527,493	42,816.18 2,005,938,033	- -	0.54%
27	MERCK & CO. INC. アメリカ	株式 医薬品	225,419	8,829.43 1,990,323,309	8,538.62 1,924,769,210	- -	0.52%
28	COMCAST CORP-CL A アメリカ	株式 メディア	392,285	4,169.31 1,635,558,047	4,801.72 1,883,642,926	- -	0.51%
29	COCA-COLA CO/THE アメリカ	株式 飲料	349,868	5,098.91 1,783,947,918	5,350.90 1,872,110,080	- -	0.50%

30	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN	株式	61,398	29,663.30	28,983.90	-	0.48%
	スイス	医薬品		1,821,267,661	1,779,554,106	-	

(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31年4月26日現在

種類	投資比率
株式	96.02%
投資信託受益証券	0.22%
投資証券	2.31%
合計	98.55%

(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31年4月26日現在

業種	国内/外国	投資比率
銀行	外国	8.04%
石油・ガス・消耗燃料		5.95%
医薬品		5.24%
ソフトウェア		5.21%
情報技術サービス		3.90%
保険		3.83%
インタラクティブ・メディアおよびサービス		3.42%
半導体・半導体製造装置		3.17%
コンピュータ・周辺機器		2.86%
資本市場		2.78%
インターネット販売・通信販売		2.56%
ヘルスケア機器・用品		2.52%
化学		2.30%
航空宇宙・防衛		2.27%
各種電気通信サービス		1.98%
飲料		1.97%
電力		1.91%
食品		1.89%
ホテル・レストラン・レジャー		1.88%
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス		1.79%
バイオテクノロジー		1.75%
専門小売り		1.72%
機械		1.56%
繊維・アパレル・贅沢品		1.45%
食品・生活必需品小売り		1.44%
娯楽		1.43%
金属・鉱業		1.40%
コングロマリット		1.36%
家庭用品		1.29%
メディア		1.28%
陸運・鉄道		1.11%
総合公益事業		1.06%
通信機器		0.99%

各種金融サービス	0.98%
タバコ	0.93%
自動車	0.85%
電気設備	0.74%
専門サービス	0.73%
パーソナル用品	0.72%
ライフサイエンス・ツール/サービス	0.72%
不動産管理・開発	0.57%
航空貨物・物流サービス	0.51%
電子装置・機器・部品	0.50%
複合小売り	0.48%
消費者金融	0.48%
商業サービス・用品	0.45%
建設関連製品	0.39%
家庭用耐久財	0.38%
エネルギー設備・サービス	0.37%
自動車部品	0.34%
建設・土木	0.33%
商社・流通業	0.30%
建設資材	0.28%
無線通信サービス	0.28%
容器・包装	0.27%
運送インフラ	0.21%
ガス	0.17%
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.11%
旅客航空輸送業	0.10%
ヘルスケア・テクノロジー	0.10%
紙製品・林産品	0.09%
水道	0.08%
販売	0.07%
レジャー用品	0.06%
海運業	0.06%
各種消費者サービス	0.01%
合計	96.02%

(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31年4月26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	1,845,525,000	100.12 1,847,758,085	100.26 1,850,489,462	2.625000 2020/8/15	0.96%
2	US T N/B 3.5 05/15/20 アメリカ	国債証券	1,565,900,000	101.14 1,583,751,260	101.12 1,583,453,739	3.500000 2020/5/15	0.82%
3	US T N/B 2.0 05/31/21 アメリカ	国債証券	1,342,200,000	98.92 1,327,771,350	99.35 1,333,542,810	2.000000 2021/5/31	0.69%
4	US T N/B 1.375 04/30/20 アメリカ	国債証券	1,342,200,000	98.67 1,324,362,162	98.96 1,328,241,120	1.375000 2020/4/30	0.69%
5	US T N/B 1.375 04/30/21 アメリカ	国債証券	1,253,838,500	97.62 1,224,097,450	98.11 1,230,228,721	1.375000 2021/4/30	0.64%
6	US T N/B 2.0 02/15/22 アメリカ	国債証券	1,235,942,500	98.65 1,219,331,432	99.21 1,226,227,991	2.000000 2022/2/15	0.63%
7	US T N/B 2.125 08/15/21 アメリカ	国債証券	1,230,350,000	99.14 1,219,867,418	99.58 1,225,293,261	2.125000 2021/8/15	0.63%
8	US T N/B 1.875 06/30/20 アメリカ	国債証券	1,230,350,000	99.11 1,219,486,009	99.39 1,222,844,865	1.875000 2020/6/30	0.63%
9	US T N/B 2.0 11/15/21 アメリカ	国債証券	1,163,240,000	98.77 1,149,013,574	99.27 1,154,783,245	2.000000 2021/11/15	0.60%
10	US T N/B 2.125 12/31/21 アメリカ	国債証券	1,155,410,500	99.04 1,144,387,883	99.55 1,150,257,369	2.125000 2021/12/31	0.60%
11	US T N/B 2.125 09/30/21 アメリカ	国債証券	1,118,500,000	99.11 1,108,623,645	99.57 1,113,690,450	2.125000 2021/9/30	0.58%
12	US T N/B 2.5 01/31/21 アメリカ	国債証券	1,097,248,500	99.96 1,096,824,161	100.23 1,099,859,951	2.500000 2021/1/31	0.57%
13	US T N/B 2.25 03/31/21 アメリカ	国債証券	1,091,656,000	99.49 1,086,110,387	99.83 1,089,822,017	2.250000 2021/3/31	0.56%
14	US T N/B 2.75 11/15/23 アメリカ	国債証券	1,048,034,500	101.18 1,060,474,669	101.82 1,067,192,570	2.750000 2023/11/15	0.55%
15	US T N/B 2.125 06/30/22 アメリカ	国債証券	1,062,575,000	98.88 1,050,695,411	99.44 1,056,677,708	2.125000 2022/6/30	0.55%
16	US T N/B 2.0 02/15/23 アメリカ	国債証券	1,062,575,000	98.20 1,043,480,527	98.88 1,050,695,411	2.000000 2023/2/15	0.54%
17	US T N/B 2.0 02/15/25 アメリカ	国債証券	1,062,575,000	97.05 1,031,271,540	97.93 1,040,654,077	2.000000 2025/2/15	0.54%
18	US T N/B 1.625 08/15/22 アメリカ	国債証券	1,062,575,000	97.17 1,032,514,753	97.85 1,039,740,263	1.625000 2022/8/15	0.54%
19	US T N/B 2.625 08/31/20 アメリカ	国債証券	1,034,612,500	100.13 1,036,019,573	100.33 1,038,047,413	2.625000 2020/8/31	0.54%
20	US T N/B 1.625 11/15/22 アメリカ	国債証券	1,053,627,000	96.97 1,021,723,174	97.70 1,029,425,187	1.625000 2022/11/15	0.53%
21	US T N/B 2.5 05/15/24 アメリカ	国債証券	1,006,650,000	100.03 1,006,962,061	100.79 1,014,662,934	2.500000 2024/5/15	0.52%
22	US T N/B 2.375 08/15/24 アメリカ	国債証券	995,465,000	99.31 988,616,200	100.12 996,709,331	2.375000 2024/8/15	0.52%
23	US T N/B 1.75 12/31/20 アメリカ	国債証券	1,006,650,000	98.63 992,879,028	99.00 996,583,500	1.750000 2020/12/31	0.52%

24	US T N/B 1.75 05/15/22 アメリカ	国債証券	1,006,650,000	97.76 984,151,372	98.37 990,291,937	1.750000 2022/5/15	0.51%
25	US T N/B 2.125 05/15/25 アメリカ	国債証券	998,820,500	97.58 974,698,984	98.45 983,438,664	2.125000 2025/5/15	0.51%
26	US T N/B 1.75 03/31/22 アメリカ	国債証券	989,872,500	97.87 968,837,709	98.46 974,707,653	1.750000 2022/3/31	0.50%
27	US T N/B 1.75 09/30/22 アメリカ	国債証券	977,569,000	97.50 953,198,204	98.17 959,767,468	1.750000 2022/9/30	0.50%
28	US T N/B 2.25 11/15/24 アメリカ	国債証券	960,791,500	98.56 946,975,318	99.35 954,555,963	2.250000 2024/11/15	0.49%
29	US T N/B 1.625 11/30/20 アメリカ	国債証券	951,843,500	98.44 937,042,333	98.85 940,906,818	1.625000 2020/11/30	0.49%
30	US T N/B 1.75 01/31/23 アメリカ	国債証券	958,554,500	97.25 932,261,350	97.99 939,306,725	1.750000 2023/1/31	0.49%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成31年4月26日現在

種類	投資比率
国債証券	97.36%
合計	97.36%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

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31年4月26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	508,600	5,641.25 2,869,142,801	5,458.72 2,776,309,060	- -	4.66%
2	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	115,334	20,977.46 2,419,415,236	21,014.37 2,423,672,272	- -	4.07%
3	TAIWAN SEMICONDUCTOR 台湾	株式 半導体・半導 体製造装置	2,193,083	944.01 2,070,303,248	965.67 2,117,805,426	- -	3.56%
4	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD 韓国	株式 コンピュー タ・周辺機器	425,222	4,545.02 1,932,646,746	4,313.18 1,834,063,278	- -	3.08%
5	NASPERS LTD 南アフリカ	株式 インターネッ ト販売・通信 販売	39,023	27,983.06 1,091,983,098	28,325.73 1,105,355,145	- -	1.86%
6	CHINA CONSTRUCTION BANK 中国	株式 銀行	8,568,530	102.10 874,860,622	98.53 844,313,813	- -	1.42%
7	PING AN INSURANCE GROUP CO-H 中国	株式 保険	464,000	1,346.85 624,941,648	1,314.05 609,723,376	- -	1.02%
8	CHINA MOBILE LIMITED 香港	株式 無線通信サー ビス	547,000	1,083.76 592,816,720	1,057.37 578,386,313	- -	0.97%
9	RELIANCE INDUSTRIES LTD インド	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	253,290	2,163.43 547,977,084	2,209.56 559,660,465	- -	0.94%
10	IND & COMM BK OF CHINA - H 中国	株式 銀行	6,184,235	86.41 534,414,378	83.56 516,776,939	- -	0.87%
11	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	24,629	19,051.41 469,217,189	18,782.97 462,605,780	- -	0.78%
12	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP インド	株式 貯蓄・抵当・ 不動産金融	144,973	3,262.98 473,045,014	3,147.79 456,344,777	- -	0.77%
13	LUKOIL SPON ADR ロシア	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	43,770	9,715.29 425,238,287	9,786.87 428,371,518	- -	0.72%

14	ITAU UNIBANCO HOLDING SA ブラジル	株式 銀行	432,347	915.01 395,605,071	952.58 411,849,428	- -	0.69%
15	SK HYNIX INC 韓国	株式 半導体・半導 体製造装置	51,790	7,747.31 401,233,702	7,747.31 401,233,702	- -	0.67%
16	VALE SA ブラジル	株式 金属・鉱業	280,921	1,476.06 414,656,953	1,421.82 399,419,798	- -	0.67%
17	SBERBANK ADR ロシア	株式 銀行	242,421	1,666.56 404,010,353	1,616.23 391,808,698	- -	0.66%
18	BANK OF CHINA LTD 中国	株式 銀行	7,073,200	54.47 385,299,838	53.04 375,213,455	- -	0.63%
19	HON HAI PRECISION INDUSTRY 台湾	株式 電子装置・機 器・部品	1,171,225	331.39 388,141,622	313.34 367,001,011	- -	0.62%
20	BANCO BRADESCO SA PREF ブラジル	株式 銀行	359,050	969.51 348,105,120	1,018.97 365,863,871	- -	0.61%
21	INFOSYS LTD インド	株式 情報技術サー ビス	310,730	1,165.80 362,249,344	1,172.96 364,475,569	- -	0.61%
22	CNOOC LTD 香港	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	1,585,000	211.61 335,415,164	209.05 331,346,786	- -	0.56%
23	TATA CONSULTANCY SERVICES LTD インド	株式 情報技術サー ビス	80,017	3,432.19 274,634,187	3,533.94 282,776,077	- -	0.47%
24	PETROLEO BRASILEIRO SA ブラジル	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	348,312	755.68 263,215,024	785.34 273,546,829	- -	0.46%
25	GAZPROM PAO ADR ロシア	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	485,843	566.40 275,185,556	544.37 264,480,272	- -	0.44%
26	AMERICA MOVIL SAB DE CV メキシコ	株式 無線通信サー ビス	2,994,678	87.52 262,099,309	86.93 260,341,433	- -	0.44%
27	QATAR NATIONAL BANK カタール	株式 銀行	42,998	5,543.41 238,355,861	6,054.63 260,337,071	- -	0.44%
28	SAMSUNG ELECTRONICS-PFD 韓国	株式 コンピュー タ・周辺機器	73,243	3,665.96 268,506,640	3,477.59 254,709,856	- -	0.43%
29	PETROLEO BRASILEIRO SA ブラジル	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	263,110	852.58 224,323,639	866.14 227,891,410	- -	0.38%
30	AMBEV SA ブラジル	株式 飲料	417,895	481.66 201,284,350	517.25 216,159,322	- -	0.36%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成31年4月26日現在

種類	投資比率
株式	89.90%

新株予約権証券	0.00%
投資信託受益証券	0.42%
投資証券	0.13%
合計	90.45%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

平成31年4月26日現在

業種	国内/外国	投資比率
銀行	外国	15.19%
石油・ガス・消耗燃料		7.12%
インターネット販売・通信販売		6.84%
インタラクティブ・メディアおよびサービス		6.28%
半導体・半導体製造装置		5.14%
コンピュータ・周辺機器		4.38%
保険		3.58%
金属・鉱業		2.97%
無線通信サービス		2.56%
不動産管理・開発		2.49%
電子装置・機器・部品		2.08%
化学		2.06%
自動車		1.72%
情報技術サービス		1.67%
食品		1.53%
食品・生活必需品小売り		1.52%
各種電気通信サービス		1.37%
コングロマリット		1.25%
資本市場		1.23%
医薬品		1.18%
建設資材		0.91%
貯蓄・抵当・不動産金融		0.85%
電力		0.85%
運送インフラ		0.85%
各種金融サービス		0.84%
飲料		0.82%
娯楽		0.73%
繊維・アパレル・贅沢品		0.71%
ホテル・レストラン・レジャー		0.68%
パーソナル用品		0.67%
建設・土木		0.67%
機械		0.63%
ガス		0.56%
独立系発電事業者・エネルギー販売業者		0.53%
タバコ		0.53%
自動車部品		0.52%
複合小売り		0.51%
各種消費者サービス		0.49%
バイオテクノロジー		0.45%
専門小売り		0.42%
家庭用品		0.40%

ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	0.38%
紙製品・林産品	0.34%
家庭用耐久財	0.32%
メディア	0.31%
旅客航空輸送業	0.26%
陸運・鉄道	0.26%
消費者金融	0.24%
水道	0.24%
ライフサイエンス・ツール/サービス	0.23%
エクイティ不動産投資信託（REITs）	0.17%
航空貨物・物流サービス	0.16%
電気設備	0.16%
航空宇宙・防衛	0.15%
商業サービス・用品	0.13%
ソフトウェア	0.10%
海運業	0.09%
ヘルスケア機器・用品	0.09%
エネルギー設備・サービス	0.08%
レジャー用品	0.08%
ヘルスケア・テクノロジー	0.07%
通信機器	0.06%
総合公益事業	0.06%
容器・包装	0.05%
商社・流通業	0.04%
専門サービス	0.04%
建設関連製品	0.03%
合計	89.90%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

平成31年4月26日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	RUSSIAN FEDERATION 5.25 06/23/47 ロシア	国債証券	2,796,250,000	101.94 2,850,497,250	102.14 2,856,089,750	5.250000 2047/6/23	2.82%
2	COLOMBIA 5.0 06/15/45 コロンビア	国債証券	1,789,600,000	103.75 1,856,710,000	104.00 1,861,184,000	5.000000 2045/6/15	1.84%
3	PERU 5.625 11/18/50 ペルー	国債証券	1,342,200,000	128.01 1,718,244,174	127.84 1,715,908,746	5.625000 2050/11/18	1.69%
4	HUNGARY 6.375 03/29/21 ハンガリー	国債証券	1,454,050,000	106.44 1,547,792,603	106.46 1,547,981,630	6.375000 2021/3/29	1.53%
5	UNITED MEXICAN STATES 4.75 03/08/44 メキシコ	国債証券	1,498,790,000	97.25 1,457,573,275	98.00 1,468,814,200	4.750000 2044/3/8	1.45%
6	RUSSIAN FEDERATION 03/31/30 ロシア	国債証券	1,291,867,500	111.49 1,440,432,262	111.49 1,440,432,262	7.500000 2030/3/31	1.42%

7	PERU 7.35 07/21/25 ペルー	国債証券	1,152,055,000	124.18 1,430,621,899	124.04 1,429,124,227	7.350000 2025/7/21	1.41%
8	ROMANIA 6.75 02/07/22 ルーマニア	国債証券	1,286,275,000	109.18 1,404,380,770	109.28 1,405,667,045	6.750000 2022/2/7	1.39%
9	RUSSIAN FEDERATION 5.625 04/04/42 ロシア	国債証券	1,207,980,000	109.60 1,324,018,558	109.92 1,327,835,775	5.625000 2042/4/4	1.31%
10	BRAZIL 4.875 01/22/21 ブラジル	国債証券	1,275,090,000	103.30 1,317,167,970	103.05 1,313,980,245	4.875000 2021/1/22	1.30%
11	UNITED MEXICAN STATES 5.55 01/21/45 メキシコ	国債証券	1,163,240,000	108.77 1,265,325,942	109.27 1,271,130,510	5.550000 2045/1/21	1.26%
12	UNITED MEXICAN STATES 6.05 01/11/40 メキシコ	国債証券	1,107,315,000	113.50 1,256,813,598	114.37 1,266,491,531	6.050000 2040/1/11	1.25%
13	BRAZIL 4.25 01/07/25 ブラジル	国債証券	1,241,535,000	100.87 1,252,398,431	101.22 1,256,756,219	4.250000 2025/1/7	1.24%
14	RUSSIAN FEDERATION 4.875 09/16/23 ロシア	国債証券	1,163,240,000	105.24 1,224,205,408	105.36 1,225,636,193	4.875000 2023/9/16	1.21%
15	CROATIA 6.625 07/14/20 クロアチア	国債証券	1,174,425,000	104.18 1,223,586,430	104.15 1,223,210,614	6.625000 2020/7/14	1.21%
16	UNITED MEXICAN STATES 4.0 10/02/23 メキシコ	国債証券	1,174,425,000	102.87 1,208,154,486	102.92 1,208,800,419	4.000000 2023/10/2	1.19%
17	UNITED MEXICAN STATES 4.15 03/28/27 メキシコ	国債証券	1,163,240,000	101.00 1,174,872,400	101.25 1,177,780,500	4.150000 2027/3/28	1.16%
18	INDONESIA 4.875 05/05/21 インドネシア	国債証券	1,129,685,000	103.51 1,169,438,615	103.64 1,170,839,424	4.875000 2021/5/5	1.16%
19	ROMANIA 4.375 08/22/23 ルーマニア	国債証券	1,118,500,000	103.60 1,158,766,000	103.70 1,159,884,500	4.375000 2023/8/22	1.15%
20	HUNGARY 5.375 02/21/23 ハンガリー	国債証券	1,073,760,000	107.68 1,156,267,718	107.80 1,157,588,443	5.375000 2023/2/21	1.14%
21	PANAMA 6.7 01/26/36 パナマ	国債証券	883,615,000	129.10 1,140,835,326	129.26 1,142,249,110	6.700000 2036/1/26	1.13%
22	RUSSIAN FEDERATION 4.5 04/04/22 ロシア	国債証券	1,096,130,000	103.18 1,130,986,934	103.26 1,131,929,605	4.500000 2022/4/4	1.12%
23	INDONESIA 4.125 01/15/25 インドネシア	国債証券	1,096,130,000	102.49 1,123,467,482	103.00 1,129,013,900	4.125000 2025/1/15	1.12%
24	COLOMBIA 5.625 02/26/44 コロンビア	国債証券	1,006,650,000	111.43 1,121,780,560	111.56 1,123,089,205	5.625000 2044/2/26	1.11%
25	BRAZIL 4.625 01/13/28 ブラジル	国債証券	1,096,130,000	100.02 1,096,414,993	100.37 1,100,240,487	4.625000 2028/1/13	1.09%
26	PHILIPPINES 9.5 02/02/30 フィリピン	国債証券	715,840,000	153.03 1,095,485,744	153.43 1,098,356,262	9.500000 2030/2/2	1.08%
27	BRAZIL 5.0 01/27/45 ブラジル	国債証券	1,207,980,000	90.31 1,090,950,897	90.81 1,096,990,797	5.000000 2045/1/27	1.08%
28	COLOMBIA 3.875 04/25/27 コロンビア	国債証券	1,073,760,000	100.54 1,079,644,204	101.30 1,087,751,092	3.875000 2027/4/25	1.07%

29	UNITED MEXICAN STATES 4.6 01/23/46 メキシコ	国債証券	1,118,500,000	95.30 1,065,930,500	95.85 1,072,082,250	4.600000 2046/1/23	1.06%
30	HUNGARY 5.375 03/25/24 ハンガリー	国債証券	961,910,000	109.39 1,052,233,349	109.67 1,054,936,316	5.375000 2024/3/25	1.04%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成31年4月26日現在

種類	投資比率
国債証券	96.69%
合計	96.69%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【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31年4月26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 3106月	買建	394	6,347,645,656	6,363,100,000	2.34%

(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31年4月26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2019年05月	売建	7,615,000	850,894,008	850,900,100	0.23%
		ユーロ売/円買201 9年05月	売建	1,721,000	214,018,052	214,057,980	0.06%
		イギリス・ポンド売/ 円買2019年05月	売建	535,000	76,945,840	77,093,500	0.02%
		カナダ・ドル売/円買 2019年05月	売建	677,000	56,106,984	56,109,760	0.02%
		オーストラリア・ドル 売/円買2019年0 5月	売建	399,000	31,255,465	31,261,650	0.01%
株価指数先物 取引	シカゴ商品 取引所	S&P500 EMI NI FUT Jun 19	買建	172	2,766,292,375	2,814,789,137	0.76%
	EUREX 取引所	DJ EURO ST OXX 50 Jun 19	買建	161	667,447,956	685,862,415	0.18%
	ICE-E EU	FTSE 100 I NDEX FUTUR E Jun19	買建	24	253,621,408	255,457,286	0.07%
	モン トリ オール 取引 所	S&P/TSE 6 0 IX FUT J un19	買建	9	144,838,995	148,175,244	0.04%
	シド ニー 先 物 取引 所	SPI 200 FU TURES Jun1 9	買建	11	135,751,233	137,333,154	0.04%

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

(注2) 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31年4月26日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
為替予約取引	-	ユーロ売/円買2019年05月	売建	5,432,022	675,510,000	675,634,936	0.35%
		アメリカ・ドル売/円買2019年05月	売建	4,583,012	512,060,000	512,060,000	0.26%
		イギリス・ポンド売/円買2019年05月	売建	615,278	88,650,000	88,661,690	0.05%
		カナダ・ドル売/円買2019年05月	売建	491,486	40,730,000	40,734,423	0.02%
		オーストラリア・ドル売/円買2019年05月	売建	371,760	29,120,000	29,123,717	0.02%

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

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

為替予約取引の数量は、現地通貨建契約金額です。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

平成31年4月26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2019年05月	売建	4,483,000	500,925,937	500,930,420	0.84%
株価指数先物取引	ICE-US	MINI MSCI EMG MKT Jun19	買建	854	5,211,139,595	5,136,582,622	8.63%

(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31年4月26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2019年05月	買建	2,600,000	291,662,800	290,524,000	0.29%
		アメリカ・ドル売/円買2019年05月	売建	4,100,000	458,093,000	458,093,000	0.45%

(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31年4月末)、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

D I A Mコア資産設計ファンド(堅実型)

	純資産総額 (分配落) (百万円)	純資産総額 (分配付) (百万円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (平成27年10月13日)	301	301	0.9926	0.9926
第2計算期間末 (平成28年4月11日)	240	240	0.9460	0.9460
第3計算期間末 (平成28年10月11日)	233	233	0.9477	0.9477
第4計算期間末 (平成29年4月11日)	165	165	1.0000	1.0000
第5計算期間末 (平成29年10月11日)	141	141	1.0538	1.0538
第6計算期間末 (平成30年4月11日)	133	133	1.0645	1.0645
第7計算期間末 (平成30年10月11日)	154	154	1.0294	1.0294
第8計算期間末 (平成31年4月11日)	157	157	1.0513	1.0513
平成30年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	-
11月末日	157	-	1.0173	-
12月末日	155	-	1.0050	-
平成31年1月末日	162	-	1.0174	-
2月末日	160	-	1.0354	-
3月末日	156	-	1.0364	-
4月末日	157	-	1.0512	-

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
第8計算期間末 (平成31年4月11日)	310	310	1.0353	1.0353
平成30年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	-
11月末日	292	-	0.9930	-
12月末日	292	-	0.9754	-
平成31年1月末日	297	-	0.9919	-
2月末日	306	-	1.0169	-
3月末日	307	-	1.0182	-
4月末日	310	-	1.0348	-

【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
第8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
第8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
第8計算期間	2.1

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

なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

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
第8計算期間	2.6

(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】

DIAM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
第8計算期間	16,604,344	16,654,728

(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。

DIAM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
第8計算期間	26,771,880	14,887,931

(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:2019年4月26日

(堅 実 型)

基準価額・純資産の推移 (2015年8月28日～2019年4月26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)

第4期(2017.04.11)	0円
第5期(2017.10.11)	0円
第6期(2018.04.11)	0円
第7期(2018.10.11)	0円
第8期(2019.04.11)	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たりです。

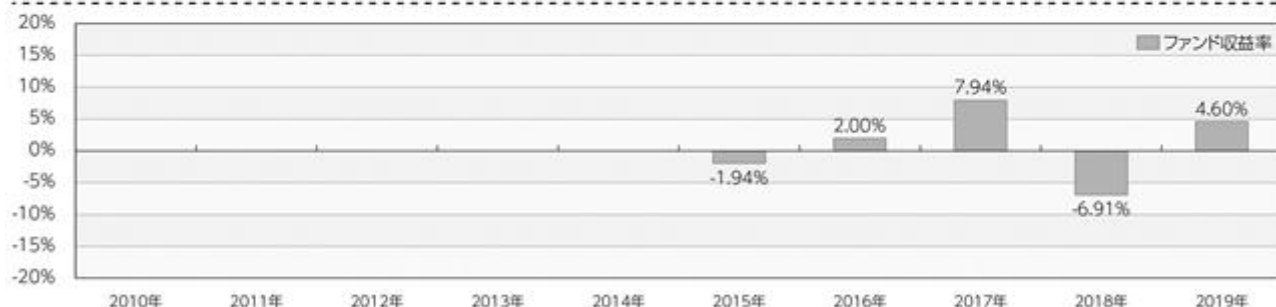
主要な資産の状況

■組入銘柄一覧 ※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

順位	銘柄名	比率(%)
1	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	16.90
2	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	13.85
3	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	8.34
4	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	5.69
5	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	5.64
6	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	5.62

※マザーファンドについては、「各マザーファンドの主要な資産の状況」をご参照ください。

年間収益率の推移(暦年ベース)



※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。

※2015年は設定日から年末までの収益率、および2019年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

※当ファンドにはベンチマークはありません。

○掲載データ等は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。

(積 極 型)

基準価額・純資産の推移 (2015年8月28日～2019年4月26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)

第4期(2017.04.11)	0円
第5期(2017.10.11)	0円
第6期(2018.04.11)	0円
第7期(2018.10.11)	0円
第8期(2019.04.11)	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たりです。

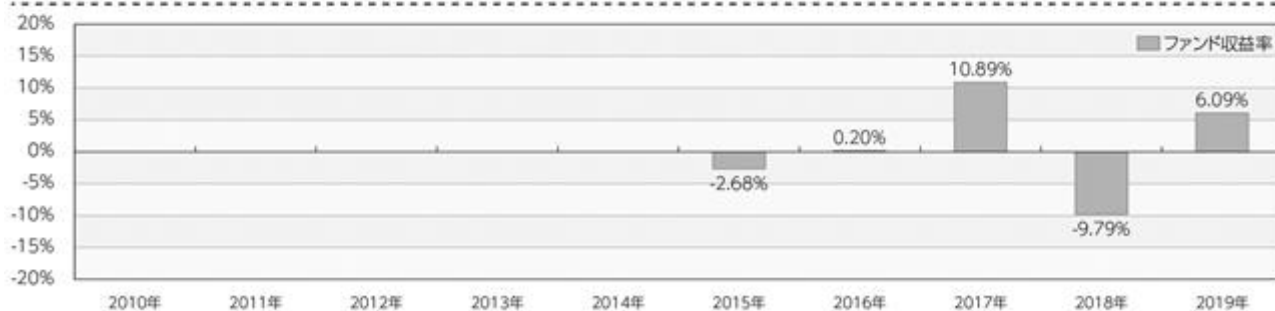
主要な資産の状況

■組入銘柄一覧 ※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

順位	銘柄名	比率(%)
1	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	26.62
2	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	21.76
3	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	13.16
4	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	8.93
5	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	8.86
6	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	8.80

※マザーファンドについては、「各マザーファンドの主要な資産の状況」をご参照ください。

年間収益率の推移(暦年ベース)



※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。

※2015年は設定日から年末までの収益率、および2019年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

※当ファンドにはベンチマークはありません。

○掲載データ等は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。

各マザーファンドの主要な資産の状況

■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	125回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.100000	2020/9/20	1.04
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	339回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.400000	2025/6/20	0.94
4	345回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.100000	2026/12/20	0.92
5	342回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.100000	2026/3/20	0.91

■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	3.23
2	ソフトバンクグループ	株式	日本	情報・通信業	1.99
3	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	日本	銀行業	1.57
4	武田薬品工業	株式	日本	医薬品	1.51
5	ソニー	株式	日本	電気機器	1.47

■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	0.96
2	US T N/B 3.5 05/15/20	国債証券	アメリカ	3.500000	2020/5/15	0.82
3	US T N/B 2.0 05/31/21	国債証券	アメリカ	2.000000	2021/5/31	0.69
4	US T N/B 1.375 04/30/20	国債証券	アメリカ	1.375000	2020/4/30	0.69
5	US T N/B 1.375 04/30/21	国債証券	アメリカ	1.375000	2021/4/30	0.64

■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	2.55
2	MICROSOFT CORP	株式	アメリカ	ソフトウェア	2.46
3	AMAZON.COM INC	株式	アメリカ	インターネット販売・通信販売	2.07
4	FACEBOOK INC	株式	アメリカ	インタラクティブ・メディアおよびサービス	1.21
5	ALPHABET INC-CL C	株式	アメリカ	インタラクティブ・メディアおよびサービス	1.05

○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。

■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	2.82
2	COLOMBIA 5.0 06/15/45	国債証券	コロンビア	5.000000	2045/6/15	1.84
3	PERU 5.625 11/18/50	国債証券	ペルー	5.625000	2050/11/18	1.69
4	HUNGARY 6.375 03/29/21	国債証券	ハンガリー	6.375000	2021/3/29	1.53
5	UNITED MEXICAN STATES 4.75 03/08/44	国債証券	メキシコ	4.750000	2044/3/8	1.45

■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	4.66
2	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	4.07
3	TAIWAN SEMICONDUCTOR	株式	台湾	半導体・半導体製造装置	3.56
4	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	株式	韓国	コンピュータ・周辺機器	3.08
5	NASPERS LTD	株式	南アフリカ	インターネット販売・通信販売	1.86

○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。

* 消費税率が10%になった場合は、3.3%となります。

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8期計算期間(平成30年10月12日から平成31年4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7期 平成30年10月11日現在	第8期 平成31年4月11日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	94,577,306	33,429,278
親投資信託受益証券	61,015,594	126,109,471
流動資産合計	155,592,900	159,538,749
資産合計	155,592,900	159,538,749
負債の部		
流動負債		
未払解約金	48,279	654,837
未払受託者報酬	37,801	42,628
未払委託者報酬	756,827	853,412
その他未払費用	2,906	3,160
流動負債合計	845,813	1,554,037
負債合計	845,813	1,554,037
純資産の部		
元本等		
元本	1 150,326,288	1 150,275,904
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	4,420,799	7,708,808
(分配準備積立金)	7,281,497	7,293,517
元本等合計	154,747,087	157,984,712
純資産合計	154,747,087	157,984,712
負債純資産合計	155,592,900	159,538,749

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第7期		第8期	
	自	平成30年4月12日 至 平成30年10月11日	自	平成30年10月12日 至 平成31年4月11日
営業収益				
有価証券売買等損益		4,111,796		4,393,877
営業収益合計		4,111,796		4,393,877
営業費用				
支払利息		28,691		35,694
受託者報酬		37,801		42,628
委託者報酬		756,827		853,412
その他費用		13,765		3,160
営業費用合計		837,084		934,894
営業利益又は営業損失()		4,948,880		3,458,983
経常利益又は経常損失()		4,948,880		3,458,983
当期純利益又は当期純損失()		4,948,880		3,458,983
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()		86,859		78,904
期首剰余金又は期首欠損金()		8,092,979		4,420,799
剰余金増加額又は欠損金減少額		1,723,538		218,042
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		1,723,538		218,042
剰余金減少額又は欠損金増加額		533,697		467,920
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		533,697		467,920
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金()		4,420,799		7,708,808

(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7期 平成30年10月11日現在	第8期 平成31年4月11日現在
1. 1 期首元本額	125,512,135円	150,326,288円
期中追加設定元本額	33,165,458円	16,604,344円
期中一部解約元本額	8,351,305円	16,654,728円
2. 受益権の総数	150,326,288口	150,275,904口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第7期 自 平成30年4月12日 至 平成30年10月11日	第8期 自 平成30年10月12日 至 平成31年4月11日
1. 1 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(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。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(754,600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(3,718,910円)及び分配準備積立金(6,538,917円)より分配対象収益は11,012,427円(1万口当たり732.81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7期 自 平成30年4月12日 至 平成30年10月11日	第8期 自 平成30年10月12日 至 平成31年4月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これら(親投資信託受益証券が保有する金融商品を含む)は、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第7期 平成30年10月11日現在	第8期 平成31年4月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第7期 平成30年10月11日現在	第8期 平成31年4月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
親投資信託受益証券	1,931,157	6,810,787
合計	1,931,157	6,810,787

(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7期 平成30年10月11日現在	第8期 平成31年4月11日現在
	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0294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31年4月11日現在

種 類	銘 柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	14,887,351	37,343,431	
	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	9,016,033	11,836,248	
	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	3,632,855	13,298,792	
	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	9,876,940	18,239,745	
	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	27,152,622	33,004,012	
	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	6,492,266	12,387,243	
親投資信託受益証券 合計		71,058,067	126,109,471	
合計		71,058,067	126,109,471	

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。

DIAM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8期計算期間(平成30年10月12日から平成31年4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7期 平成30年10月11日現在	第8期 平成31年4月11日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	101,286,292	23,943,736
親投資信託受益証券	135,475,460	288,508,000
未収入金	55,800,000	-
流動資産合計	292,561,752	312,451,736
資産合計	292,561,752	312,451,736
負債の部		
流動負債		
未払解約金	9,999	32,181
未払受託者報酬	80,855	79,887
未払委託者報酬	1,617,989	1,598,477
その他未払費用	6,357	5,981
流動負債合計	1,715,200	1,716,526
負債合計	1,715,200	1,716,526
純資産の部		
元本等		
元本	1,288,266,653	1,300,150,602
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	2,579,899	10,584,608
(分配準備積立金)	14,671,072	15,907,967
元本等合計	290,846,552	310,735,210
純資産合計	290,846,552	310,735,210
負債純資産合計	292,561,752	312,451,736

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第7期		第8期	
	自	平成30年4月12日 至 平成30年10月11日	自	平成30年10月12日 至 平成31年4月11日
営業収益				
有価証券売買等損益		12,217,023		9,932,540
営業収益合計		12,217,023		9,932,540
営業費用				
支払利息		33,468		49,336
受託者報酬		80,855		79,887
委託者報酬		1,617,989		1,598,477
その他費用		17,236		5,981
営業費用合計		1,749,548		1,733,681
営業利益又は営業損失()		13,966,571		8,198,859
経常利益又は経常損失()		13,966,571		8,198,859
当期純利益又は当期純損失()		13,966,571		8,198,859
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()		449,881		121,739
期首剰余金又は期首欠損金()		16,071,575		2,579,899
剰余金増加額又は欠損金減少額		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		2,095,575		-
剰余金減少額又は欠損金増加額		2,070,561		315,889
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		2,070,561		117,878
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		198,011
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金()		2,579,899		10,584,608

(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7期 平成30年10月11日現在	第8期 平成31年4月11日現在
1. 1 期首元本額	281,225,161円	288,266,653円
期中追加設定元本額	43,415,961円	26,771,880円
期中一部解約元本額	36,374,469円	14,887,931円
2. 受益権の総数	288,266,653口	300,150,602口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第7期 自 平成30年4月12日 至 平成30年10月11日	第8期 自 平成30年10月12日 至 平成31年4月11日
1. 1 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(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。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(1,951,688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(6,172,475円)及び分配準備積立金(13,956,279円)より分配対象収益は22,080,442円(1万口当たり735.65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7期 自 平成30年4月12日 至 平成30年10月11日	第8期 自 平成30年10月12日 至 平成31年4月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これら(親投資信託受益証券が保有する金融商品を含む)は、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第7期 平成30年10月11日現在	第8期 平成31年4月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第7期 平成30年10月11日現在	第8期 平成31年4月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
親投資信託受益証券	4,881,219	17,321,533
合計	4,881,219	17,321,533

(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7期 平成30年10月11日現在	第8期 平成31年4月11日現在
	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0089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31年4月11日現在

種 類	銘 柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	33,987,494	85,254,229	
	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	20,568,924	27,002,883	
	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	8,330,426	30,495,190	
	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	22,578,913	41,696,478	
	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	62,211,441	75,618,006	
	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	14,906,297	28,441,214	
親投資信託受益証券 合計		162,583,495	288,508,000	
合計		162,583,495	288,508,000	

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10月11日現在	平成31年4月11日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		5,141,874,534	4,803,841,058
株式	2	275,619,206,300	267,473,099,534
派生商品評価勘定		10,343,152	14,698,576
未収入金		330,060	24,626,638
未収配当金		2,478,473,147	3,049,917,110
前払金		52,604,000	-
流動資産合計		283,302,831,193	275,366,182,916
資産合計		283,302,831,193	275,366,182,916
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		353,629,896	10,475,492
前受金		-	39,252,200
未払解約金		237,110,000	245,441,000
流動負債合計		590,739,896	295,168,692
負債合計		590,739,896	295,168,692
純資産の部			
元本等			
元本	1	107,816,602,893	109,661,282,654
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		174,895,488,404	165,409,731,570
元本等合計		282,712,091,297	275,071,014,224
純資産合計		282,712,091,297	275,071,014,224
負債純資産合計		283,302,831,193	275,366,182,916

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10月11日現在	平成31年4月11日現在
1 . 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	111,281,995,587円	107,816,602,893円
同期中追加設定元本額	15,217,860,556円	20,474,353,672円
同期中一部解約元本額	18,683,253,250円	18,629,673,911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	10,889,998,888円	12,668,931,843円
DIAM国内株式パッシブ・ファンド	2,192,108,705円	2,168,923,735円
MITO ラップ型ファンド（安定型）	3,392,166円	2,776,822円
MITO ラップ型ファンド（中立型）	7,399,968円	6,407,379円
MITO ラップ型ファンド（積極型）	12,999,220円	10,485,597円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	23,906,761円	23,981,540円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	19,553,564円	17,383,331円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	17,030,556円	13,797,232円
たわらノーロード TOPIX	277,927,485円	422,756,035円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	56,618,250円	137,248,442円
たわらノーロード バランス（堅実型）	1,460,887円	3,496,236円
たわらノーロード バランス（標準型）	10,511,100円	24,898,023円

たわらノーロード バランス (積極型)	25,438,489円	46,406,186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)	183,257円	327,596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)	5,725,335円	14,766,980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)	18,667,647円	43,854,797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)	15,203,520円	33,807,168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)	37,332,875円	87,512,030円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(保守型)	40,828円	113,556円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定型)	70,562円	370,362円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定成長型)	623,211円	1,047,516円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(成長型)	535,585円	752,704円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(積極型)	1,592,610円	2,283,949円
D I A M国内株式インデックス ファンド< D C年金>	37,206,521,425円	38,045,737,318円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 1 安定型	816,531,612円	930,183,626円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 2 安定・成長型	2,847,785,821円	3,146,301,944円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 3 成長型	2,998,403,698円	3,265,847,751円
D I A M D C バランス3 0 インデックスファンド	335,014,767円	362,592,699円
D I A M D C バランス5 0 インデックスファンド	1,134,503,177円	1,201,139,471円
D I A M D C バランス7 0 インデックスファンド	1,076,982,515円	1,128,860,255円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型>	41,354,593円	41,151,160円
マネックス資産設計ファンド< 育成型>	1,081,393,977円	1,121,126,791円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	25,211,643円	26,814,455円
D I A M D C 8資産バラ ンスファンド(新興国1 0)	270,587,522円	298,987,432円
D I A M D C 8資産バラ ンスファンド(新興国2 0)	169,556,877円	204,079,632円
D I A M D C 8資産バラ ンスファンド(新興国3 0)	302,458,993円	357,516,716円
投資のソムリエ	2,603,577,387円	1,187,816,155円
クルーズコントロール	811,309,601円	1,465,176,884円
投資のソムリエ< D C年金>	226,394,802円	116,986,239円

D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	185,086,296円	229,870,413円
D I A M DC バランス・F(成長型)	240,119,447円	283,212,905円
クルーズコントロール<DC年金>	469,071円	1,052,435円
D I A Mコア資産設計ファンド(堅実型)	6,372,781円	14,887,351円
D I A Mコア資産設計ファンド(積極型)	13,273,632円	33,987,494円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	73,476,645円	73,451,697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	1,319,223円	525,651円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	1,388,764,282円	1,115,435,590円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	1,099,505円	1,230,593円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	793,044円	1,088,011円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	436,709円	510,392円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	1,452,537円	2,348,788円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	13,416,010円	17,543,246円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	235,255,917円	127,614,872円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	18,666円	4,274,818円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	-円	281,173円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	-円	281,173円
D I A Mワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	-円	281,173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)	62,827,883円	69,109,314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)	55,539,660円	170,735,594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)	110,246,818円	115,326,011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)	270,358,342円	279,228,920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)	14,259,379円	15,104,246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)	60,980,777円	63,194,214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)	15,221,233円	16,724,300円
D I A M国内重視バランスファン ド50VA(適格機関投資家 限定)	14,774,325円	13,710,162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)	29,165,799円	26,468,214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)	51,769,778円	53,161,852円
D I A Mバランスファンド25 VA(適格機関投資家限定)	971,587,261円	1,001,118,266円
D I A Mバランスファンド3 7.5VA(適格機関投資家限 定)	923,970,304円	962,180,043円
D I A Mバランスファンド50 VA(適格機関投資家限定)	2,593,869,939円	2,675,023,448円
D I A Mグローバル・アセッ ト・バランスVA(適格機関投 資家限定)	183,476,305円	191,105,727円
D I A Mグローバル・アセッ ト・バランスVA2(適格機関 投資家限定)	49,363,658円	51,608,997円
D I A M アクサ グローバ ル バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	527,096,832円	546,618,622円
D I A M世界アセットバランス ファンドVA(適格機関投資家 向け)	421,703,927円	309,279,190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	10,473,598円
D I A M世界バランスファンド 55VA(適格機関投資家限 定)	7,124,683円	3,257,762円
D I A M世界バランスファンド 35VA(適格機関投資家限 定)	57,585,354円	44,788,612円
D I A M世界アセットバランス ファンド2VA(適格機関投資 家限定)	10,230,280,281円	7,259,974,356円
D I A M世界アセットバランス ファンド40VA(適格機関投 資家限定)	378,222,399円	77,079,110円
D I A M世界アセットバランス ファンド25VA(適格機関投 資家限定)	1,642,740,603円	1,802,209,783円
D I A M世界アセットバランス ファンド3VA(適格機関投資 家限定)	9,443,795,131円	10,323,903,671円
D I A Mバランス30VA(適 格機関投資家限定)	3,071,696円	4,930,852円

	D I A Mバランス50VA(適格機関投資家限定)	2,949,084円	297,689円
	D I A Mバランス70VA(適格機関投資家限定)	3,687,674円	3,734,305円
	D I A M世界アセットバランスファンド4VA(適格機関投資家限定)	8,432,589,388円	9,210,567,059円
	D I A M世界バランス25VA(適格機関投資家限定)	65,631,920円	63,993,329円
	D I A M国内バランス30VA(適格機関投資家限定)	26,139,818円	25,852,788円
	D I A Mバランス20VA(適格機関投資家限定)	24,002,219円	26,313,803円
	D I A Mバランス40VA(適格機関投資家限定)	96,992円	107,163円
	D I A Mバランス60VA(適格機関投資家限定)	110,708円	120,862円
	D I A M世界アセットバランスファンド7VA(1212)(適格機関投資家限定)	405,365,089円	426,124,037円
	D I A M世界アセットバランスファンド7VA(1303)(適格機関投資家限定)	1,261,532,817円	1,366,625,210円
	D I A M世界アセットバランスファンド7VA(1306)(適格機関投資家限定)	1,669,062,351円	1,837,729,242円
	D I A M世界アセットバランスファンド7VA(1309)(適格機関投資家限定)	68,825,151円	72,976,941円
	計	107,816,602,893円	109,661,282,654円
2 .	受益権の総数	107,816,602,893口	109,661,282,654口
3 .	2 差入代用有価証券	株式 3,298,500,000円	株式 3,370,500,000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30年4月12日 至 平成30年10月11日	自 平成30年10月12日 至 平成31年4月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価の変動によるリスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成30年10月11日現在	平成31年4月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成30年10月11日現在	平成31年4月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
株式	7,451,385,633	6,215,927,955
合計	7,451,385,633	6,215,927,955

(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10月11日まで及び平成31年2月8日から平成31年4月11日まで）に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

株式関連

種類	平成30年10月11日 現在				平成31年4月11日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
先物取引								
買 建	8,086,019,000	-	7,742,880,000	343,139,000	6,549,869,400	-	6,554,225,000	4,355,600
合計	8,086,019,000	-	7,742,880,000	343,139,000	6,549,869,400	-	6,554,225,000	4,355,600

(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10月11日現在	平成31年4月11日現在
1口当たり純資産額	2.6222円	2.5084円
(1万口当たり純資産額)	(26,222円)	(25,084円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

平成31年4月11日現在

銘柄	株式数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
極洋	5,100	2,790.00	14,229,000	
日本水産	157,800	765.00	120,717,000	
マルハニチロ	22,800	3,685.00	84,018,000	
ハウスイ	900	867.00	780,300	
カネコ種苗	4,500	1,450.00	6,525,000	
サカタのタネ	19,200	3,650.00	70,080,000	
ホクト	13,200	1,913.00	25,251,600	
ホクリヨウ	2,200	600.00	1,320,000	
ヒノキヤグループ	3,400	2,297.00	7,809,800	
ショーボンドホールディングス	11,300	7,720.00	87,236,000	
ミライト・ホールディングス	44,500	1,646.00	73,247,000	
タマホーム	7,700	1,032.00	7,946,400	
サンヨーホームズ	2,400	784.00	1,881,600	
日本アクア	4,000	518.00	2,072,000	
ファーストコーポレーション	4,500	897.00	4,036,500	
ベステラ	3,100	1,354.00	4,197,400	
TATERU	19,400	257.00	4,985,800	
スペースバリューホールディングス	19,400	519.00	10,068,600	
住石ホールディングス	34,400	119.00	4,093,600	
日鉄鉱業	3,700	4,675.00	17,297,500	
三井松島ホールディングス	6,600	1,289.00	8,507,400	
国際石油開発帝石	632,900	1,050.50	664,861,450	
石油資源開発	22,600	2,440.00	55,144,000	
K&Oエナジーグループ	7,600	1,601.00	12,167,600	
ダイセキ環境ソリューション	3,100	636.00	1,971,600	
第一カッター興業	1,900	1,733.00	3,292,700	
安藤・間	101,000	713.00	72,013,000	
東急建設	46,200	795.00	36,729,000	
コムシスホールディングス	55,900	2,993.00	167,308,700	
ミサワホーム	12,400	757.00	9,386,800	
ピーアールホールディングス	13,200	324.00	4,276,800	
高松コンストラクショングループ	9,800	2,361.00	23,137,800	
東建コーポレーション	4,800	7,420.00	35,616,000	
ソネック	1,800	721.00	1,297,800	
ヤマウラ	6,200	917.00	5,685,400	
大成建設	129,500	4,770.00	617,715,000	
大林組	390,300	1,069.00	417,230,700	
清水建設	398,100	932.00	371,029,200	
飛島建設	11,200	1,397.00	15,646,400	
長谷工コーポレーション	162,700	1,358.00	220,946,600	
松井建設	14,300	706.00	10,095,800	
銭高組	1,600	5,290.00	8,464,000	
鹿島建設	305,000	1,565.00	477,325,000	

不動テトラ	9,000	1,463.00	13,167,000
大末建設	4,600	906.00	4,167,600
鉄建建設	7,900	2,864.00	22,625,600
西松建設	28,100	2,328.00	65,416,800
三井住友建設	93,900	710.00	66,669,000
大豊建設	8,800	3,010.00	26,488,000
前田建設工業	92,800	1,075.00	99,760,000
佐田建設	8,300	398.00	3,303,400
ナカノフドー建設	10,100	480.00	4,848,000
奥村組	21,400	3,475.00	74,365,000
東鉄工業	15,600	3,030.00	47,268,000
イチケン	2,400	1,867.00	4,480,800
富士ピー・エス	4,200	432.00	1,814,400
浅沼組	4,600	2,294.00	10,552,400
戸田建設	151,300	676.00	102,278,800
熊谷組	18,600	3,105.00	57,753,000
青木あすなろ建設	6,400	916.00	5,862,400
北野建設	2,800	3,090.00	8,652,000
植木組	1,600	2,322.00	3,715,200
矢作建設工業	17,600	756.00	13,305,600
ピーエス三菱	13,800	645.00	8,901,000
日本ハウスホールディングス	25,000	479.00	11,975,000
大東建託	46,300	15,335.00	710,010,500
新日本建設	15,500	938.00	14,539,000
N I P P O	34,400	2,030.00	69,832,000
東亜道路工業	2,500	2,954.00	7,385,000
前田道路	40,700	2,074.00	84,411,800
日本道路	3,600	6,220.00	22,392,000
東亜建設工業	11,400	1,568.00	17,875,200
若築建設	6,600	1,443.00	9,523,800
東洋建設	47,500	411.00	19,522,500
五洋建設	154,800	491.00	76,006,800
世紀東急工業	19,100	573.00	10,944,300
福田組	4,200	4,290.00	18,018,000
日本ドライケミカル	3,300	1,114.00	3,676,200
住友林業	92,100	1,559.00	143,583,900
日本基礎技術	13,600	363.00	4,936,800
巴コーポレーション	16,300	359.00	5,851,700
大和ハウス工業	360,400	3,458.00	1,246,263,200
ライト工業	25,100	1,446.00	36,294,600
積水ハウス	398,400	1,810.00	721,104,000
日特建設	11,200	585.00	6,552,000
北陸電気工事	6,300	856.00	5,392,800
ユアテック	20,800	803.00	16,702,400
四電工	2,000	2,677.00	5,354,000
中電工	16,700	2,244.00	37,474,800
関電工	59,200	929.00	54,996,800
きんでん	86,500	1,773.00	153,364,500
東京エネシス	13,400	967.00	12,957,800
トーエネック	3,700	3,190.00	11,803,000

住友電設	9,000	1,872.00	16,848,000
日本電設工業	22,100	2,321.00	51,294,100
協和エクシオ	51,000	3,085.00	157,335,000
新日本空調	11,000	1,760.00	19,360,000
日本工営	7,500	2,453.00	18,397,500
九電工	25,700	2,989.00	76,817,300
三機工業	29,300	1,220.00	35,746,000
日揮	112,100	1,734.00	194,381,400
中外炉工業	3,700	1,790.00	6,623,000
ヤマト	11,700	508.00	5,943,600
太平電業	8,800	2,401.00	21,128,800
高砂熱学工業	32,800	1,769.00	58,023,200
三晃金属工業	1,500	2,700.00	4,050,000
NEC ネットエスアイ	12,500	2,714.00	33,925,000
朝日工業社	2,700	2,921.00	7,886,700
明星工業	23,500	730.00	17,155,000
大気社	17,700	3,380.00	59,826,000
ダイダン	8,700	2,437.00	21,201,900
日比谷総合設備	12,400	1,839.00	22,803,600
東芝プラントシステム	28,200	1,997.00	56,315,400
日本製粉	38,600	1,871.00	72,220,600
日清製粉グループ本社	131,700	2,517.00	331,488,900
日東富士製粉	800	6,380.00	5,104,000
昭和産業	10,700	3,050.00	32,635,000
鳥越製粉	10,500	771.00	8,095,500
中部飼料	14,200	1,180.00	16,756,000
フィード・ワン	78,600	170.00	13,362,000
東洋精糖	1,900	1,004.00	1,907,600
日本甜菜製糖	6,600	1,885.00	12,441,000
三井製糖	9,200	2,770.00	25,484,000
塩水港精糖	13,000	231.00	3,003,000
日新製糖	5,500	2,012.00	11,066,000
LIFULL	40,200	575.00	23,115,000
ジェイエイシーリクルートメント	9,000	2,404.00	21,636,000
日本M&Aセンター	82,800	3,055.00	252,954,000
メンバーズ	3,800	1,752.00	6,657,600
中広	1,100	559.00	614,900
タケエイ	11,700	791.00	9,254,700
E・Jホールディングス	1,400	1,123.00	1,572,200
トラスト・テック	5,500	3,665.00	20,157,500
コシダカホールディングス	29,700	1,597.00	47,430,900
アルトナー	2,100	882.00	1,852,200
パソナグループ	13,500	1,623.00	21,910,500
CDS	2,800	1,232.00	3,449,600
リンクアンドモチベーション	20,600	826.00	17,015,600
GCA	11,300	822.00	9,288,600
エス・エム・エス	40,800	1,836.00	74,908,800
パーソルホールディングス	111,100	1,924.00	213,756,400
リニカル	6,300	1,301.00	8,196,300
クックパッド	35,200	261.00	9,187,200

エスクリ	3,200	626.00	2,003,200	
アイ・ケイ・ケイ	5,500	778.00	4,279,000	
森永製菓	29,300	4,680.00	137,124,000	
中村屋	3,000	4,390.00	13,170,000	
江崎グリコ	35,100	5,750.00	201,825,000	
名糖産業	5,600	1,431.00	8,013,600	
井村屋グループ	4,900	2,409.00	11,804,100	
不二家	6,500	2,150.00	13,975,000	
山崎製パン	95,300	1,726.00	164,487,800	
第一屋製パン	2,100	1,024.00	2,150,400	
モロゾフ	2,000	5,180.00	10,360,000	
亀田製菓	7,200	5,240.00	37,728,000	
寿スピリッツ	12,400	4,255.00	52,762,000	
カルビー	53,200	2,989.00	159,014,800	
森永乳業	23,300	3,460.00	80,618,000	
六甲バター	8,500	2,043.00	17,365,500	
ヤクルト本社	86,400	7,380.00	637,632,000	
明治ホールディングス	82,600	8,790.00	726,054,000	
雪印メグミルク	28,100	2,430.00	68,283,000	
プリマハム	16,400	2,058.00	33,751,200	
日本ハム	50,400	4,150.00	209,160,000	
林兼産業	3,900	590.00	2,301,000	
丸大食品	12,400	1,901.00	23,572,400	
S Foods	10,500	4,005.00	42,052,500	
伊藤ハム米久ホールディングス	75,000	676.00	50,700,000	
学情	4,500	1,220.00	5,490,000	
スタジオアリス	5,600	2,151.00	12,045,600	
シミックホールディングス	6,100	1,544.00	9,418,400	
システナ	40,700	1,272.00	51,770,400	
N J S	2,500	1,500.00	3,750,000	
デジタルアーツ	6,100	9,810.00	59,841,000	
日鉄ソリューションズ	17,100	2,962.00	50,650,200	
総合警備保障	44,200	4,875.00	215,475,000	
キューブシステム	6,200	804.00	4,984,800	
いちご	145,800	377.00	54,966,600	
エイジア	2,300	1,261.00	2,900,300	
日本駐車場開発	139,100	169.00	23,507,900	
コア	4,800	1,188.00	5,702,400	
カカクコム	83,200	2,202.00	183,206,400	
アイロムグループ	4,200	1,572.00	6,602,400	
セントケア・ホールディング	6,300	526.00	3,313,800	
サイネックス	1,800	687.00	1,236,600	
ルネサンス	6,200	1,974.00	12,238,800	
ディップ	18,000	1,919.00	34,542,000	
S B Sホールディングス	11,600	1,947.00	22,585,200	
オプトホールディング	6,800	1,827.00	12,423,600	
新日本科学	15,100	879.00	13,272,900	
ツクイ	26,200	672.00	17,606,400	
キャリアデザインセンター	2,900	1,233.00	3,575,700	
ベネフィット・ワン	30,800	2,111.00	65,018,800	

エムスリー	233,800	1,803.00	421,541,400
ツカダ・グローバルホールディング	7,100	603.00	4,281,300
プラス	800	606.00	484,800
アウトソーシング	58,600	1,364.00	79,930,400
ウェルネット	10,600	1,063.00	11,267,800
ワールドホールディングス	3,100	1,897.00	5,880,700
ディー・エヌ・エー	59,900	1,644.00	98,475,600
博報堂DYホールディングス	154,300	1,787.00	275,734,100
ぐるなび	15,800	642.00	10,143,600
タカミヤ	11,600	653.00	7,574,800
ジャパンベストレスキューシステム	8,800	1,592.00	14,009,600
ファンコミュニケーションズ	30,600	530.00	16,218,000
ライク	4,400	926.00	4,074,400
ビジネス・ブレークスルー	4,800	372.00	1,785,600
WDBホールディングス	5,000	3,125.00	15,625,000
ティア	5,300	673.00	3,566,900
CDG	1,000	1,316.00	1,316,000
パリュウコマース	7,500	2,239.00	16,792,500
インフォマート	60,900	1,517.00	92,385,300
サッポロホールディングス	42,600	2,320.00	98,832,000
アサヒグループホールディングス	244,100	4,799.00	1,171,435,900
麒麟ホールディングス	527,400	2,560.00	1,350,144,000
宝ホールディングス	87,300	1,258.00	109,823,400
オエノンホールディングス	33,300	405.00	13,486,500
養命酒製造	3,600	2,100.00	7,560,000
コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールディングス	89,300	2,699.00	241,020,700
サントリー食品インターナショナル	78,000	5,010.00	390,780,000
ダイドーグループホールディングス	6,600	5,010.00	33,066,000
伊藤園	35,400	5,470.00	193,638,000
キーコーヒー	11,500	2,079.00	23,908,500
ユニカフェ	3,300	1,002.00	3,306,600
ジャパンフーズ	1,700	1,220.00	2,074,000
日清オイリオグループ	15,000	3,250.00	48,750,000
不二製油グループ本社	28,500	3,655.00	104,167,500
かどや製油	1,300	5,170.00	6,721,000
J・オイルミルズ	6,000	4,030.00	24,180,000
ローソン	29,000	5,980.00	173,420,000
サンエー	8,600	4,115.00	35,389,000
カワチ薬品	8,900	1,775.00	15,797,500
エービーシー・マート	17,900	6,410.00	114,739,000
ハードオフコーポレーション	4,500	768.00	3,456,000
高千穂交易	4,400	953.00	4,193,200
アスクル	12,000	2,800.00	33,600,000
ゲオホールディングス	17,400	1,491.00	25,943,400
アダストリア	15,800	2,853.00	45,077,400
ジーフット	6,700	645.00	4,321,500
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	1,500	717.00	1,075,500
伊藤忠食品	2,800	4,810.00	13,468,000
くらコーポレーション	6,700	4,990.00	33,433,000

キャンドウ	5,400	1,681.00	9,077,400
エレマテック	5,300	1,801.00	9,545,300
パルグループホールディングス	5,800	3,285.00	19,053,000
JALUX	3,300	2,455.00	8,101,500
エディオン	48,500	955.00	46,317,500
あらた	6,300	3,835.00	24,160,500
サーラコーポレーション	23,200	603.00	13,989,600
ワッツ	3,900	743.00	2,897,700
トーメンデバイス	1,700	2,446.00	4,158,200
ハローズ	4,200	2,280.00	9,576,000
J Pホールディングス	32,100	305.00	9,790,500
フジオフードシステム	4,800	3,135.00	15,048,000
あみやき亭	2,500	3,380.00	8,450,000
東京エレクトロン デバイス	4,100	1,838.00	7,535,800
ひらまつ	22,900	342.00	7,831,800
フィールズ	10,100	787.00	7,948,700
双日	632,000	379.00	239,528,000
アルフレッサ ホールディングス	127,200	3,075.00	391,140,000
大黒天物産	2,800	3,815.00	10,682,000
ハニーズホールディングス	10,100	1,021.00	10,312,100
ファーマライズホールディングス	2,700	535.00	1,444,500
キッコーマン	77,000	5,420.00	417,340,000
味の素	257,400	1,718.50	442,341,900
キュービー	64,900	2,584.00	167,701,600
ハウス食品グループ本社	44,500	4,435.00	197,357,500
カゴメ	46,700	3,015.00	140,800,500
焼津水産化学工業	5,700	1,123.00	6,401,100
アリアケジャパン	10,700	6,520.00	69,764,000
ピエトロ	1,600	1,627.00	2,603,200
エバラ食品工業	2,600	2,191.00	5,696,600
ニチレイ	60,600	2,612.00	158,287,200
横浜冷凍	29,900	865.00	25,863,500
東洋水産	60,000	4,215.00	252,900,000
イートアンド	4,100	1,617.00	6,629,700
大冷	1,400	1,728.00	2,419,200
ヨシムラ・フード・ホールディングス	3,300	606.00	1,999,800
日清食品ホールディングス	49,500	7,600.00	376,200,000
永谷園ホールディングス	6,200	2,304.00	14,284,800
一正蒲鉾	4,500	1,116.00	5,022,000
フジッコ	12,600	2,191.00	27,606,600
ロック・フィールド	12,500	1,582.00	19,775,000
日本たばこ産業	673,200	2,625.50	1,767,486,600
ケンコーマヨネーズ	6,500	2,196.00	14,274,000
わらべや日洋ホールディングス	7,600	1,871.00	14,219,600
なとり	6,500	1,641.00	10,666,500
イフジ産業	2,100	680.00	1,428,000
ピックルスコーポレーション	2,900	2,168.00	6,287,200
北の達人コーポレーション	45,800	480.00	21,984,000
ユーグレナ	48,300	733.00	35,403,900
片倉工業	13,900	1,255.00	17,444,500

グンゼ	7,700	4,635.00	35,689,500
ヒューリック	239,200	997.00	238,482,400
神栄	1,600	768.00	1,228,800
ラサ商事	6,100	833.00	5,081,300
アルペン	8,700	1,676.00	14,581,200
ハブ	3,800	1,101.00	4,183,800
ラクーンホールディングス	5,500	702.00	3,861,000
クオールホールディングス	16,900	1,606.00	27,141,400
アルコニックス	12,200	1,290.00	15,738,000
神戸物産	17,300	4,485.00	77,590,500
ソリトンシステムズ	6,400	997.00	6,380,800
ジーンズ	7,800	6,250.00	48,750,000
ビックカメラ	61,100	1,186.00	72,464,600
DCMホールディングス	61,700	1,039.00	64,106,300
ペッパーフードサービス	9,000	2,237.00	20,133,000
Monotaro	72,300	2,366.00	171,061,800
東京一番フーズ	2,500	622.00	1,555,000
DDホールディングス	2,600	1,840.00	4,784,000
あいホールディングス	16,300	1,879.00	30,627,700
ディー・ブイエックス	4,100	939.00	3,849,900
きちりホールディングス	3,100	765.00	2,371,500
アークランドサービスホールディングス	8,400	1,999.00	16,791,600
J・フロントリテイリング	146,200	1,317.00	192,545,400
ドトール・日レスホールディングス	20,100	2,043.00	41,064,300
マツモトキヨシホールディングス	47,300	3,570.00	168,861,000
ブロンコビリー	6,000	2,575.00	15,450,000
ZOZO	123,700	1,878.00	232,308,600
トレジャー・ファクトリー	3,500	770.00	2,695,000
物語コーポレーション	2,900	9,030.00	26,187,000
ココカラファイン	12,800	4,325.00	55,360,000
三越伊勢丹ホールディングス	213,900	1,052.00	225,022,800
東洋紡	48,100	1,500.00	72,150,000
ユニチカ	33,400	451.00	15,063,400
富士紡ホールディングス	5,900	2,800.00	16,520,000
日清紡ホールディングス	64,400	1,013.00	65,237,200
倉敷紡績	10,900	2,079.00	22,661,100
ダイワボウホールディングス	10,500	5,990.00	62,895,000
シキボウ	5,900	1,021.00	6,023,900
日東紡績	17,300	2,144.00	37,091,200
トヨタ紡織	40,600	1,766.00	71,699,600
マクニカ・富士エレホールディングス	31,700	1,592.00	50,466,400
Hamee	3,100	789.00	2,445,900
ラクト・ジャパン	2,500	8,070.00	20,175,000
ウエルシアホールディングス	30,200	4,090.00	123,518,000
クリエイトSDホールディングス	16,900	2,513.00	42,469,700
バイタルケーエスケー・ホールディングス	21,500	1,051.00	22,596,500
八洲電機	9,000	825.00	7,425,000
メディアスホールディングス	6,600	726.00	4,791,600

レスターホールディングス	12,600	1,896.00	23,889,600
ジュテックホールディングス	2,700	988.00	2,667,600
丸善CHIホールディングス	13,300	364.00	4,841,200
大光	3,000	688.00	2,064,000
OCHIホールディングス	3,400	1,204.00	4,093,600
TOKAIホールディングス	60,400	916.00	55,326,400
黒谷	2,000	450.00	900,000
ミサワ	2,400	407.00	976,800
ティーライフ	1,600	888.00	1,420,800
Cominix	1,900	847.00	1,609,300
エー・ピーカンパニー	2,300	497.00	1,143,100
三洋貿易	5,700	1,979.00	11,280,300
チムニー	3,500	2,591.00	9,068,500
シュッピン	7,800	838.00	6,536,400
ビューティガレージ	1,800	1,401.00	2,521,800
ウイン・パートナーズ	7,400	1,233.00	9,124,200
ネクステージ	17,700	1,108.00	19,611,600
ジョイフル本田	33,500	1,330.00	44,555,000
鳥貴族	3,900	1,840.00	7,176,000
麒麟堂ホールディングス	4,500	1,888.00	8,496,000
ホットランド	6,000	1,613.00	9,678,000
すかいらくホールディングス	106,600	1,840.00	196,144,000
綿半ホールディングス	4,200	2,276.00	9,559,200
日本毛織	37,300	919.00	34,278,700
ダイトウボウ	18,800	83.00	1,560,400
トーア紡コーポレーション	4,900	456.00	2,234,400
ダイドーリミテッド	14,000	333.00	4,662,000
ヨシックス	1,900	3,200.00	6,080,000
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	33,200	994.00	33,000,800
三栄建築設計	4,600	1,608.00	7,396,800
スター・マイカ	5,300	1,487.00	7,881,100
野村不動産ホールディングス	76,300	2,060.00	157,178,000
三重交通グループホールディングス	23,300	579.00	13,490,700
サムティ	15,900	1,324.00	21,051,600
ディア・ライフ	14,900	421.00	6,272,900
コーセーアールイー	3,500	736.00	2,576,000
エー・ディー・ワークス	169,500	34.00	5,763,000
日本商業開発	7,200	1,469.00	10,576,800
プレサンスコーポレーション	18,300	1,388.00	25,400,400
ユニゾホールディングス	17,300	2,029.00	35,101,700
THEグローバル社	5,400	532.00	2,872,800
日本管理センター	7,700	909.00	6,999,300
サンセイランディック	3,200	744.00	2,380,800
エストラスト	1,600	731.00	1,169,600
フージャースホールディングス	25,000	641.00	16,025,000
オープンハウス	18,700	3,950.00	73,865,000
東急不動産ホールディングス	308,300	624.00	192,379,200
飯田グループホールディングス	95,500	1,938.00	185,079,000
イーランド	1,700	671.00	1,140,700

ムゲンエステート	8,000	581.00	4,648,000
帝国繊維	12,700	2,606.00	33,096,200
日本コークス工業	97,700	101.00	9,867,700
ゴルフダイジェスト・オンライン	4,700	681.00	3,200,700
ミタチ産業	2,900	752.00	2,180,800
B E E N O S	2,800	1,259.00	3,525,200
あさひ	9,500	1,344.00	12,768,000
日本調剤	4,100	3,705.00	15,190,500
コスモス薬品	5,000	18,150.00	90,750,000
シップヘルスケアホールディングス	23,800	4,460.00	106,148,000
トーエル	5,600	859.00	4,810,400
ソフトクリエイトホールディングス	4,900	1,558.00	7,634,200
オンリー	2,000	873.00	1,746,000
セブン&アイ・ホールディングス	479,500	3,943.00	1,890,668,500
薬王堂	5,000	2,569.00	12,845,000
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	30,800	1,300.00	40,040,000
明治電機工業	3,700	1,788.00	6,615,600
ツルハホールディングス	24,900	8,920.00	222,108,000
デリカフーズホールディングス	2,100	1,362.00	2,860,200
スターティアホールディングス	2,400	601.00	1,442,400
サンマルクホールディングス	9,000	2,454.00	22,086,000
フェリシモ	2,700	1,051.00	2,837,700
トリドールホールディングス	14,100	2,367.00	33,374,700
帝人	92,700	1,910.00	177,057,000
東レ	882,400	767.50	677,242,000
クラレ	192,000	1,474.00	283,008,000
旭化成	809,300	1,164.00	942,025,200
サカイオーベックス	2,800	1,764.00	4,939,200
T O K Y O B A S E	10,300	857.00	8,827,100
稲葉製作所	6,400	1,417.00	9,068,800
宮地エンジニアリンググループ	3,600	1,869.00	6,728,400
トーカロ	29,600	913.00	27,024,800
アルファ	4,100	1,307.00	5,358,700
S U M C O	127,000	1,395.00	177,165,000
川田テクノロジーズ	2,600	7,100.00	18,460,000
R S T e c h n o l o g i e s	2,400	3,275.00	7,860,000
ビーロット	1,800	1,670.00	3,006,000
ファーストブラザーズ	3,200	1,086.00	3,475,200
ハウズドゥ	4,400	1,457.00	6,410,800
シーアールイー	3,900	904.00	3,525,600
プロパティエージェント	1,100	1,068.00	1,174,800
ケイアイスター不動産	3,200	1,662.00	5,318,400
アグレ都市デザイン	1,500	509.00	763,500
グッドコムアセット	2,000	1,594.00	3,188,000
ジェイ・エス・ビー	400	3,600.00	1,440,000
住江織物	3,200	2,897.00	9,270,400
日本フェルト	6,400	463.00	2,963,200
イチカワ	1,600	1,346.00	2,153,600
エコナックホールディングス	21,300	128.00	2,726,400

日東製網	1,400	1,638.00	2,293,200
芦森工業	2,500	1,592.00	3,980,000
アツギ	9,400	973.00	9,146,200
ウイルプラスホールディングス	1,100	905.00	995,500
ジャパンミート	4,300	1,800.00	7,740,000
コメダホールディングス	26,500	2,092.00	55,438,000
サツドラホールディングス	1,800	1,988.00	3,578,400
デファクトスタンダード	700	417.00	291,900
アレンザホールディングス	6,200	858.00	5,319,600
バロックジャパンリミテッド	9,300	889.00	8,267,700
クスリのアオキホールディングス	11,400	7,480.00	85,272,000
ダイニック	4,500	732.00	3,294,000
共和レザー	7,100	777.00	5,516,700
力の源ホールディングス	3,300	772.00	2,547,600
スシローグローバルホールディングス	12,500	7,310.00	91,375,000
LIXILピバ	9,700	1,346.00	13,056,200
セーレン	28,000	1,675.00	46,900,000
ソトー	4,400	967.00	4,254,800
東海染工	1,600	1,090.00	1,744,000
小松マテレー	18,700	864.00	16,156,800
ワコールホールディングス	33,100	2,752.00	91,091,200
ホギメディカル	14,100	3,860.00	54,426,000
レナウン	33,600	100.00	3,360,000
クラウドディアホールディングス	2,900	485.00	1,406,500
T S Iホールディングス	42,000	737.00	30,954,000
マツオカコーポレーション	3,700	3,505.00	12,968,500
ワールド	11,200	2,083.00	23,329,600
T I S	38,000	5,220.00	198,360,000
ネオス	4,100	1,039.00	4,259,900
電算システム	4,300	3,360.00	14,448,000
グリー	78,700	453.00	35,651,100
コーエーテクモホールディングス	23,300	2,048.00	47,718,400
三菱総合研究所	4,400	3,220.00	14,168,000
ボルテージ	2,300	540.00	1,242,000
電算	1,300	1,948.00	2,532,400
A G S	6,400	711.00	4,550,400
ファインデックス	9,700	830.00	8,051,000
ブレインパッド	2,200	6,110.00	13,442,000
K L a b	20,500	806.00	16,523,000
ポールトゥウィン・ピットクルーホールディングス	15,100	1,024.00	15,462,400
イーブクイニシアティブジャパン	1,900	1,609.00	3,057,100
ネクソン	290,400	1,674.00	486,129,600
アイスタイル	29,200	789.00	23,038,800
エムアップ	4,000	2,641.00	10,564,000
エイチーム	7,200	1,756.00	12,643,200
テクノスジャパン	9,700	688.00	6,673,600
e n i s h	4,100	659.00	2,701,900
コロブラ	32,600	670.00	21,842,000
オルトプラス	7,200	296.00	2,131,200

ブロードリーフ	56,500	560.00	31,640,000
クロス・マーケティンググループ	3,300	394.00	1,300,200
デジタルハーツホールディングス	5,200	1,268.00	6,593,600
メディアドゥホールディングス	3,500	2,578.00	9,023,000
じげん	12,300	556.00	6,838,800
バイキューブ	6,200	504.00	3,124,800
サイバーリンクス	1,800	1,073.00	1,931,400
ディー・エル・イー	7,400	132.00	976,800
フィックスターズ	11,000	1,327.00	14,597,000
CARTA HOLDINGS	6,100	1,204.00	7,344,400
オブティム	4,900	2,269.00	11,118,100
セレス	3,800	2,108.00	8,010,400
特種東海製紙	7,200	4,130.00	29,736,000
ティーガイア	11,500	1,829.00	21,033,500
セック	1,900	3,630.00	6,897,000
日本アジアグループ	12,200	317.00	3,867,400
豆蔵ホールディングス	7,800	1,077.00	8,400,600
テクマトリックス	8,100	1,871.00	15,155,100
プロシップ	3,300	1,210.00	3,993,000
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	274,800	362.00	99,477,600
GMOペイメントゲートウェイ	18,800	8,240.00	154,912,000
ザッパラス	5,800	447.00	2,592,600
システムリサーチ	1,600	2,763.00	4,420,800
インターネットイニシアティブ	18,600	2,266.00	42,147,600
さくらインターネット	13,800	517.00	7,134,600
ヴィンクス	3,900	1,166.00	4,547,400
GMOクラウド	2,600	4,315.00	11,219,000
SRAホールディングス	6,000	2,419.00	14,514,000
MINORIソリューションズ	2,300	1,656.00	3,808,800
システムインテグレータ	3,400	793.00	2,696,200
朝日ネット	9,600	575.00	5,520,000
eBASE	6,900	1,092.00	7,534,800
アバント	3,200	1,553.00	4,969,600
アドソル日進	4,100	1,703.00	6,982,300
フリービット	6,800	1,069.00	7,269,200
コムチュア	6,400	3,590.00	22,976,000
サイバーコム	2,100	2,135.00	4,483,500
アステリア	5,700	855.00	4,873,500
王子ホールディングス	512,300	700.00	358,610,000
日本製紙	54,400	2,274.00	123,705,600
三菱製紙	18,500	584.00	10,804,000
北越コーポレーション	75,500	635.00	47,942,500
中越パルプ工業	4,800	1,383.00	6,638,400
巴川製紙所	3,900	1,025.00	3,997,500
大王製紙	55,500	1,358.00	75,369,000
阿波製紙	3,000	500.00	1,500,000
マークライنز	4,000	1,481.00	5,924,000
メディカル・データ・ビジョン	10,200	1,024.00	10,444,800
gumi	13,700	651.00	8,918,700

ショーケース	2,600	720.00	1,872,000
モバイルファクトリー	3,200	1,335.00	4,272,000
テラスカイ	700	3,655.00	2,558,500
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	5,000	1,530.00	7,650,000
PCIホールディングス	2,000	2,437.00	4,874,000
パイプドHD	1,900	1,377.00	2,616,300
アイビーシー	1,900	1,293.00	2,456,700
ネオジャパン	2,200	913.00	2,008,600
PR TIMES	700	2,251.00	1,575,700
ランドコンピュータ	1,300	1,180.00	1,534,000
ダブルスタンダード	700	5,020.00	3,514,000
オーブンドア	5,600	3,120.00	17,472,000
マイネット	3,800	974.00	3,701,200
アカツキ	4,100	5,760.00	23,616,000
ベネフィットジャパン	600	864.00	518,400
Ubicomホールディングス	2,100	1,333.00	2,799,300
LINE	34,800	3,755.00	130,674,000
カナミックネットワーク	1,800	1,902.00	3,423,600
ノムラシステムコーポレーション	900	736.00	662,400
レンゴー	117,400	996.00	116,930,400
トーモク	7,000	1,784.00	12,488,000
ザ・バック	8,600	3,480.00	29,928,000
チェンジ	1,500	4,115.00	6,172,500
シンクロ・フード	4,900	603.00	2,954,700
オークネット	6,000	1,199.00	7,194,000
AOI TYO HOLDINGS	12,400	757.00	9,386,800
マクロミル	20,300	1,345.00	27,303,500
ビーグリー	2,300	924.00	2,125,200
オロ	1,100	6,790.00	7,469,000
昭和電工	75,600	4,135.00	312,606,000
住友化学	895,200	532.00	476,246,400
住友精化	5,500	4,280.00	23,540,000
日産化学	69,900	5,140.00	359,286,000
ラサ工業	4,100	1,595.00	6,539,500
クレハ	10,500	6,750.00	70,875,000
多木化学	3,400	5,900.00	20,060,000
テイカ	9,300	2,473.00	22,998,900
石原産業	21,800	1,224.00	26,683,200
片倉コープアグリ	3,000	1,143.00	3,429,000
日東エフシー	7,100	855.00	6,070,500
日本曹達	18,000	2,961.00	53,298,000
東ソー	175,800	1,812.00	318,549,600
トクヤマ	32,800	2,833.00	92,922,400
セントラル硝子	24,800	2,664.00	66,067,200
東亜合成	71,400	1,226.00	87,536,400
大阪ソーダ	12,300	2,714.00	33,382,200
関東電化工業	27,100	797.00	21,598,700
デンカ	44,700	3,200.00	143,040,000
イビデン	71,100	1,747.00	124,211,700

信越化学工業	200,500	10,540.00	2,113,270,000
日本カーバイド工業	3,900	1,513.00	5,900,700
堺化学工業	7,600	2,601.00	19,767,600
第一稀元素化学工業	9,300	860.00	7,998,000
エア・ウォーター	93,100	1,698.00	158,083,800
大陽日酸	93,800	1,791.00	167,995,800
日本化学工業	3,900	2,113.00	8,240,700
東邦アセチレン	1,800	1,434.00	2,581,200
日本パーカライジング	62,100	1,466.00	91,038,600
高圧ガス工業	18,000	869.00	15,642,000
チタン工業	1,500	2,348.00	3,522,000
四国化成工業	19,200	1,155.00	22,176,000
戸田工業	2,500	2,283.00	5,707,500
ステラ ケミファ	6,700	3,205.00	21,473,500
保土谷化学工業	4,000	3,400.00	13,600,000
日本触媒	19,200	7,610.00	146,112,000
大日精化工業	9,400	3,365.00	31,631,000
カネカ	30,200	4,365.00	131,823,000
協和発酵キリン	136,400	2,205.00	300,762,000
三菱瓦斯化学	117,000	1,649.00	192,933,000
三井化学	103,300	2,814.00	290,686,200
J S R	114,100	1,811.00	206,635,100
東京応化工業	19,600	3,415.00	66,934,000
大阪有機化学工業	10,600	1,177.00	12,476,200
三菱ケミカルホールディングス	760,400	798.50	607,179,400
K Hネオケム	17,400	3,145.00	54,723,000
ダイセル	176,600	1,246.00	220,043,600
住友ベークライト	19,700	4,160.00	81,952,000
積水化学工業	248,600	1,828.00	454,440,800
日本ゼオン	102,600	1,160.00	119,016,000
アイカ工業	34,100	3,845.00	131,114,500
宇部興産	57,400	2,446.00	140,400,400
積水樹脂	18,800	1,995.00	37,506,000
タキロンシーアイ	24,600	630.00	15,498,000
旭有機材	7,900	1,803.00	14,243,700
日立化成	52,700	2,600.00	137,020,000
ニチバン	6,000	2,215.00	13,290,000
リケンテクノス	31,000	490.00	15,190,000
大倉工業	5,800	1,899.00	11,014,200
積水化成品工業	17,000	899.00	15,283,000
群栄化学工業	2,900	2,666.00	7,731,400
タイガースポリマー	6,000	585.00	3,510,000
ミライアル	3,400	1,272.00	4,324,800
ダイキアクシス	4,100	834.00	3,419,400
ダイキョーニシカワ	24,000	1,147.00	27,528,000
竹本容器	4,100	1,454.00	5,961,400
森六ホールディングス	6,100	2,613.00	15,939,300
日本化薬	72,300	1,321.00	95,508,300
カーリットホールディングス	12,200	814.00	9,930,800
E P Sホールディングス	16,700	1,923.00	32,114,100

ソルクシーズ	4,800	826.00	3,964,800
レッグス	2,900	1,141.00	3,308,900
プレステージ・インターナショナル	20,800	1,502.00	31,241,600
フェイス	4,100	845.00	3,464,500
ハイマックス	1,400	1,866.00	2,612,400
アミューズ	6,700	2,433.00	16,301,100
野村総合研究所	72,500	5,060.00	366,850,000
ドリームインキュベータ	3,400	1,571.00	5,341,400
サイバネットシステム	9,500	551.00	5,234,500
クイック	6,900	1,697.00	11,709,300
T A C	6,500	238.00	1,547,000
C Eホールディングス	3,100	771.00	2,390,100
ケネディクス	97,600	540.00	52,704,000
日本システム技術	1,900	1,394.00	2,648,600
電通	135,300	4,660.00	630,498,000
インテージホールディングス	14,600	900.00	13,140,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	4,200	1,338.00	5,619,600
東邦システムサイエンス	3,500	911.00	3,188,500
びあ	3,200	4,445.00	14,224,000
イオンファンタジー	3,600	3,220.00	11,592,000
ソースネクスト	44,400	454.00	20,157,600
シーティーエス	12,600	642.00	8,089,200
ネクシィーズグループ	3,300	2,437.00	8,042,100
インフォコム	9,400	1,710.00	16,074,000
メディカルシステムネットワーク	12,400	481.00	5,964,400
日本精化	9,200	1,252.00	11,518,400
扶桑化学工業	11,600	1,980.00	22,968,000
トリケミカル研究所	2,600	5,210.00	13,546,000
F I G	10,500	319.00	3,349,500
A D E K A	56,000	1,631.00	91,336,000
日油	43,900	3,820.00	167,698,000
ミヨシ油脂	4,500	1,135.00	5,107,500
新日本理化	20,900	210.00	4,389,000
ハリマ化成グループ	9,500	1,078.00	10,241,000
アルテリア・ネットワークス	9,600	1,273.00	12,220,800
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	2,600	1,868.00	4,856,800
花王	282,000	8,487.00	2,393,334,000
第一工業製薬	4,200	3,690.00	15,498,000
石原ケミカル	2,900	1,723.00	4,996,700
日華化学	3,900	1,018.00	3,970,200
ニイタカ	1,800	1,524.00	2,743,200
三洋化成工業	7,600	5,290.00	40,204,000
武田薬品工業	1,014,100	4,390.00	4,451,899,000
アステラス製薬	1,071,100	1,618.00	1,733,039,800
大日本住友製薬	86,200	2,580.00	222,396,000
塩野義製薬	148,500	6,546.00	972,081,000
田辺三菱製薬	121,400	1,460.00	177,244,000
わかもと製薬	14,100	282.00	3,976,200
あすか製薬	14,300	1,142.00	16,330,600

日本新薬	30,400	7,620.00	231,648,000
ビオフェルミン製薬	2,000	2,317.00	4,634,000
中外製薬	121,100	7,110.00	861,021,000
科研製薬	20,900	4,960.00	103,664,000
エーザイ	139,000	6,510.00	904,890,000
理研ビタミン	5,500	3,555.00	19,552,500
ロート製薬	59,600	2,999.00	178,740,400
小野薬品工業	274,300	2,067.50	567,115,250
久光製薬	34,300	5,110.00	175,273,000
有機合成薬品工業	8,200	217.00	1,779,400
持田製薬	17,600	5,530.00	97,328,000
参天製薬	220,200	1,652.00	363,770,400
扶桑薬品工業	4,100	2,539.00	10,409,900
日本ケミファ	1,600	2,874.00	4,598,400
ツムラ	36,000	3,345.00	120,420,000
日医工	29,700	1,443.00	42,857,100
テルモ	328,600	3,371.00	1,107,710,600
みらかホールディングス	31,000	2,710.00	84,010,000
キッセイ薬品工業	20,600	2,804.00	57,762,400
生化学工業	22,500	1,173.00	26,392,500
栄研化学	20,500	2,403.00	49,261,500
日水製薬	4,800	1,178.00	5,654,400
鳥居薬品	6,200	2,180.00	13,516,000
JCRファーマ	8,200	6,340.00	51,988,000
東和薬品	16,600	2,834.00	47,044,400
富士製薬工業	7,900	1,737.00	13,722,300
沢井製薬	23,800	6,320.00	150,416,000
ゼリア新薬工業	23,000	1,976.00	45,448,000
第一三共	332,400	5,259.00	1,748,091,600
キョーリン製薬ホールディングス	25,600	2,079.00	53,222,400
大幸薬品	5,200	1,828.00	9,505,600
ダイト	6,800	2,972.00	20,209,600
大塚ホールディングス	221,300	4,196.00	928,574,800
大正製薬ホールディングス	26,000	10,370.00	269,620,000
ペプチドリーム	57,900	5,660.00	327,714,000
大日本塗料	12,800	1,120.00	14,336,000
日本ペイントホールディングス	93,900	4,465.00	419,263,500
関西ペイント	127,900	2,190.00	280,101,000
神東塗料	9,300	171.00	1,590,300
中国塗料	37,400	1,068.00	39,943,200
日本特殊塗料	8,600	1,182.00	10,165,200
藤倉化成	15,300	622.00	9,516,600
太陽ホールディングス	9,400	3,810.00	35,814,000
DIC	51,500	3,425.00	176,387,500
サカタインクス	24,900	1,046.00	26,045,400
東洋インキSCホールディングス	24,000	2,625.00	63,000,000
T&K TOKA	8,800	974.00	8,571,200
アルプス技研	9,800	1,844.00	18,071,200
サニックス	19,700	234.00	4,609,800
ダイオーズ	2,600	1,367.00	3,554,200

日本空調サービス	12,600	681.00	8,580,600
オリエンタルランド	131,200	12,480.00	1,637,376,000
フォーカスシステムズ	7,700	945.00	7,276,500
ダスキン	29,800	2,620.00	78,076,000
パーク24	67,000	2,347.00	157,249,000
明光ネットワークジャパン	14,100	980.00	13,818,000
ファルコホールディングス	6,100	1,279.00	7,801,900
クレスコ	3,500	3,365.00	11,777,500
フジ・メディア・ホールディングス	118,300	1,487.00	175,912,100
秀英予備校	2,500	485.00	1,212,500
田谷	2,100	627.00	1,316,700
ラウンドワン	34,500	1,411.00	48,679,500
リゾートトラスト	46,900	1,563.00	73,304,700
オービック	39,500	11,750.00	464,125,000
ジャストシステム	16,200	2,719.00	44,047,800
TDCソフト	10,100	887.00	8,958,700
ヤフー	743,600	276.00	205,233,600
ビー・エム・エル	14,300	3,105.00	44,401,500
ワタベウェディング	1,900	587.00	1,115,300
トレンドマイクロ	60,800	5,520.00	335,616,000
りらいあコミュニケーションズ	20,100	975.00	19,597,500
IDホールディングス	3,400	1,342.00	4,562,800
リソー教育	56,500	438.00	24,747,000
日本オラクル	23,100	7,340.00	169,554,000
早稲田アカデミー	3,200	674.00	2,156,800
アルファシステムズ	3,600	2,715.00	9,774,000
フューチャー	15,500	1,876.00	29,078,000
CAC Holdings	8,200	1,615.00	13,243,000
ソフトバンク・テクノロジー	4,800	2,243.00	10,766,400
トーセ	3,100	845.00	2,619,500
ユー・エス・エス	135,600	2,090.00	283,404,000
オービックビジネスコンサルタント	11,700	4,585.00	53,644,500
伊藤忠テクノソリューションズ	52,000	2,588.00	134,576,000
アイティフォー	13,800	923.00	12,737,400
東京個別指導学院	4,000	1,192.00	4,768,000
東計電算	1,700	3,090.00	5,253,000
サイバーエージェント	68,400	4,270.00	292,068,000
楽天	517,400	1,077.00	557,239,800
エクスネット	2,200	918.00	2,019,600
クリーク・アンド・リバー社	6,600	1,329.00	8,771,400
テー・オー・ダブリュー	9,900	728.00	7,207,200
大塚商会	61,700	4,280.00	264,076,000
サイボウズ	13,300	997.00	13,260,100
ソフトブレイン	9,300	491.00	4,566,300
山田コンサルティンググループ	5,300	2,407.00	12,757,100
セントラルスポーツ	4,100	3,060.00	12,546,000
パラカ	3,000	1,950.00	5,850,000
電通国際情報サービス	7,000	3,685.00	25,795,000
デジタルガレージ	22,200	3,210.00	71,262,000
イーエムシステムズ	9,300	1,327.00	12,341,100

ウェザーニューズ	3,900	3,275.00	12,772,500
C I J	9,000	839.00	7,551,000
東洋ビジネスエンジニアリング	1,100	2,205.00	2,425,500
日本エンタープライズ	12,500	175.00	2,187,500
WOWOW	5,400	2,881.00	15,557,400
スカラ	8,100	920.00	7,452,000
フルキャストホールディングス	11,200	2,400.00	26,880,000
エン・ジャパン	12,200	3,350.00	40,870,000
富士フイルムホールディングス	241,300	5,240.00	1,264,412,000
コニカミノルタ	253,700	1,125.00	285,412,500
資生堂	230,800	8,076.00	1,863,940,800
ライオン	161,800	2,297.00	371,654,600
高砂香料工業	8,000	3,465.00	27,720,000
マンダム	26,100	2,802.00	73,132,200
ミルボン	14,300	5,310.00	75,933,000
ファンケル	51,800	2,755.00	142,709,000
コーセー	19,700	21,130.00	416,261,000
コタ	6,000	1,252.00	7,512,000
シーボン	1,400	2,530.00	3,542,000
ポーラ・オルビスホールディングス	49,600	3,405.00	168,888,000
ノエビアホールディングス	7,400	5,630.00	41,662,000
アジュバンコスメジャパン	2,700	924.00	2,494,800
エステー	8,300	1,863.00	15,462,900
アグロ カネショウ	4,700	2,171.00	10,203,700
コニシ	20,600	1,721.00	35,452,600
長谷川香料	13,900	1,784.00	24,797,600
星光PMC	7,800	800.00	6,240,000
小林製薬	32,600	9,670.00	315,242,000
荒川化学工業	10,500	1,440.00	15,120,000
メック	8,000	1,154.00	9,232,000
日本高純度化学	3,200	2,371.00	7,587,200
タカラバイオ	30,400	2,490.00	75,696,000
J C U	15,100	1,833.00	27,678,300
新田ゼラチン	7,400	676.00	5,002,400
O A T アグリオ	1,700	1,685.00	2,864,500
デクセリアルズ	29,900	715.00	21,378,500
アース製薬	8,800	5,010.00	44,088,000
北興化学工業	12,200	537.00	6,551,400
大成ラミック	3,700	2,817.00	10,422,900
クミアイ化学工業	48,000	830.00	39,840,000
日本農薬	27,900	449.00	12,527,100
富士興産	4,400	682.00	3,000,800
ニチレキ	14,900	1,075.00	16,017,500
ユシロ化学工業	6,000	1,322.00	7,932,000
ビービー・カストロール	4,100	1,432.00	5,871,200
富士石油	28,400	272.00	7,724,800
MORESCO	4,200	1,490.00	6,258,000
出光興産	134,149	3,680.00	493,668,320
J X T Gホールディングス	1,953,700	545.70	1,066,134,090
コスモエネルギーホールディングス	33,700	2,356.00	79,397,200

横浜ゴム	67,300	2,155.00	145,031,500
TOYO TIRE	59,700	1,329.00	79,341,300
ブリヂストン	357,000	4,397.00	1,569,729,000
住友ゴム工業	104,300	1,380.00	143,934,000
藤倉コンポジット	10,200	434.00	4,426,800
オカモト	8,100	5,580.00	45,198,000
アキレス	8,400	1,893.00	15,901,200
フコク	5,100	837.00	4,268,700
ニッタ	13,100	3,735.00	48,928,500
クリエートメディック	3,900	962.00	3,751,800
住友理工	22,500	1,013.00	22,792,500
三ツ星ベルト	15,300	2,091.00	31,992,300
バンドー化学	22,100	1,139.00	25,171,900
A G C	114,800	3,855.00	442,554,000
日本板硝子	55,600	922.00	51,263,200
石塚硝子	1,600	1,720.00	2,752,000
有沢製作所	18,300	857.00	15,683,100
日本山村硝子	4,800	1,441.00	6,916,800
日本電気硝子	50,200	3,120.00	156,624,000
オハラ	4,600	1,330.00	6,118,000
住友大阪セメント	23,400	4,525.00	105,885,000
太平洋セメント	73,300	3,870.00	283,671,000
リソルホールディングス	1,200	4,060.00	4,872,000
日本ヒューム	11,800	762.00	8,991,600
日本コンクリート工業	25,200	280.00	7,056,000
三谷セキサン	5,400	3,015.00	16,281,000
アジアパイルホールディングス	16,600	609.00	10,109,400
東海カーボン	105,500	1,450.00	152,975,000
日本カーボン	5,500	5,220.00	28,710,000
東洋炭素	6,800	2,125.00	14,450,000
ノリタケカンパニーリミテド	6,900	5,370.00	37,053,000
T O T O	89,300	4,655.00	415,691,500
日本碍子	141,600	1,694.00	239,870,400
日本特殊陶業	97,900	2,251.00	220,372,900
ダントーホールディングス	9,300	111.00	1,032,300
M A R U W A	4,100	5,670.00	23,247,000
品川リフラクトリーズ	3,100	3,220.00	9,982,000
黒崎播磨	2,300	5,650.00	12,995,000
ヨータイ	10,400	518.00	5,387,200
イソライト工業	6,100	517.00	3,153,700
東京窯業	15,000	373.00	5,595,000
ニッカトー	5,300	908.00	4,812,400
フジインコーポレーテッド	10,400	2,443.00	25,407,200
クニミネ工業	4,000	836.00	3,344,000
エーアンドエーマテリアル	2,300	1,022.00	2,350,600
ニチアス	31,800	2,242.00	71,295,600
日本製鉄	533,700	2,021.50	1,078,874,550
神戸製鋼所	210,200	863.00	181,402,600
中山製鋼所	15,700	504.00	7,912,800
合同製鐵	5,500	1,705.00	9,377,500

ジェイ エフ イー ホールディングス	310,200	1,941.00	602,098,200	
東京製鐵	61,600	881.00	54,269,600	
共英製鋼	12,900	1,649.00	21,272,100	
大和工業	24,400	2,917.00	71,174,800	
東京鐵鋼	4,700	1,213.00	5,701,100	
大阪製鐵	7,600	1,835.00	13,946,000	
淀川製鋼所	15,400	2,105.00	32,417,000	
丸一鋼管	40,700	3,210.00	130,647,000	
モリ工業	3,500	2,498.00	8,743,000	
大同特殊鋼	18,800	4,690.00	88,172,000	
日本高周波鋼業	4,200	519.00	2,179,800	
日本冶金工業	95,200	252.00	23,990,400	
山陽特殊製鋼	14,500	2,374.00	34,423,000	
愛知製鋼	6,400	3,425.00	21,920,000	
日立金属	123,700	1,299.00	160,686,300	
日本金属	2,700	1,238.00	3,342,600	
大平洋金属	7,800	2,594.00	20,233,200	
新日本電工	68,900	230.00	15,847,000	
栗本鐵工所	5,700	1,473.00	8,396,100	
虹 技	1,800	1,383.00	2,489,400	
日本鑄鉄管	1,200	856.00	1,027,200	
日本製鋼所	34,900	2,050.00	71,545,000	
三菱製鋼	8,500	1,599.00	13,591,500	
日垂鋼業	17,000	326.00	5,542,000	
日本精線	1,700	3,270.00	5,559,000	
エンビプロ・ホールディングス	2,500	653.00	1,632,500	
大紀アルミニウム工業所	19,000	675.00	12,825,000	
日本軽金属ホールディングス	312,900	248.00	77,599,200	
三井金属鉱業	31,000	2,952.00	91,512,000	
東邦亜鉛	6,400	3,315.00	21,216,000	
三菱マテリアル	75,900	3,040.00	230,736,000	
住友金属鉱山	157,300	3,479.00	547,246,700	
D O W Aホールディングス	26,800	3,780.00	101,304,000	
古河機械金属	19,000	1,436.00	27,284,000	
エス・サイエンス	52,200	69.00	3,601,800	
大阪チタニウムテクノロジーズ	13,300	1,661.00	22,091,300	
東邦チタニウム	20,600	945.00	19,467,000	
U A C J	17,400	2,149.00	37,392,600	
C Kサンエツ	2,200	3,005.00	6,611,000	
古河電気工業	33,100	3,015.00	99,796,500	
住友電気工業	429,300	1,508.50	647,599,050	
フジクラ	138,700	454.00	62,969,800	
昭和電線ホールディングス	13,300	748.00	9,948,400	
東京特殊電線	1,500	1,916.00	2,874,000	
タツタ電線	22,800	494.00	11,263,200	
カナレ電気	1,900	1,953.00	3,710,700	
平河ヒューテック	4,800	1,424.00	6,835,200	
リョービ	14,100	2,563.00	36,138,300	
アーレスティ	14,200	660.00	9,372,000	

アサヒホールディングス	21,500	2,041.00	43,881,500
東洋製罐グループホールディングス	73,200	2,258.00	165,285,600
ホッカンホールディングス	5,800	1,885.00	10,933,000
コロナ	6,300	1,060.00	6,678,000
横河ブリッジホールディングス	21,300	1,892.00	40,299,600
OSJBホールディングス	57,700	267.00	15,405,900
駒井ハルテック	2,200	1,788.00	3,933,600
高田機工	1,000	2,481.00	2,481,000
三和ホールディングス	118,700	1,335.00	158,464,500
文化シャッター	33,900	815.00	27,628,500
三協立山	15,900	1,279.00	20,336,100
アルインコ	9,000	979.00	8,811,000
東洋シャッター	2,900	722.00	2,093,800
LIXILグループ	169,500	1,639.00	277,810,500
日本ファイルコン	8,900	517.00	4,601,300
ノーリツ	25,600	1,764.00	45,158,400
長府製作所	11,700	2,339.00	27,366,300
リンナイ	20,500	7,740.00	158,670,000
ユニプレス	22,400	1,837.00	41,148,800
ダイニチ工業	6,300	689.00	4,340,700
日東精工	16,100	593.00	9,547,300
三洋工業	1,500	1,850.00	2,775,000
岡部	23,200	984.00	22,828,800
ジーテクト	12,700	1,637.00	20,789,900
中国工業	1,900	534.00	1,014,600
東プレ	21,400	2,099.00	44,918,600
高周波熱錬	22,000	902.00	19,844,000
東京製綱	7,100	1,037.00	7,362,700
サンコール	6,500	634.00	4,121,000
モリテックスチール	9,100	404.00	3,676,400
パイオラックス	18,400	2,277.00	41,896,800
エイチワン	11,400	943.00	10,750,200
日本発条	114,400	1,037.00	118,632,800
中央発條	1,400	2,977.00	4,167,800
アドパネクス	1,500	1,753.00	2,629,500
三浦工業	49,700	2,630.00	130,711,000
タクマ	41,900	1,365.00	57,193,500
テクノプロ・ホールディングス	22,200	6,560.00	145,632,000
アトラ	2,300	374.00	860,200
インターワークス	2,300	694.00	1,596,200
アイ・アールジャパンホールディングス	3,500	1,787.00	6,254,500
KeepPer 技研	3,900	1,337.00	5,214,300
ファーストロジック	2,300	581.00	1,336,300
三機サービス	1,900	1,583.00	3,007,700
Gunosy	7,100	2,285.00	16,223,500
デザインワン・ジャパン	2,300	382.00	878,600
イー・ガーディアン	5,300	2,201.00	11,665,300
リブセンス	6,200	280.00	1,736,000
ジャパンマテリアル	30,400	1,551.00	47,150,400

ベクトル	13,500	1,391.00	18,778,500
ウチヤマホールディングス	5,800	483.00	2,801,400
ライクキッズネクスト	2,500	857.00	2,142,500
キャリアリンク	4,200	445.00	1,869,000
I B J	7,500	870.00	6,525,000
アサンテ	4,500	2,116.00	9,522,000
N・フィールド	7,200	754.00	5,428,800
バリューHR	2,500	2,592.00	6,480,000
M&Aキャピタルパートナーズ	2,900	4,465.00	12,948,500
ライドオンエクスプレスホールディングス	4,600	1,142.00	5,253,200
E R Iホールディングス	3,300	1,038.00	3,425,400
アビスト	1,800	3,130.00	5,634,000
シグマクシス	5,300	1,020.00	5,406,000
ウィルグループ	7,300	1,145.00	8,358,500
エスクロー・エージェント・ジャパン	15,500	284.00	4,402,000
日本ビューホテル	3,700	1,249.00	4,621,300
リクルートホールディングス	795,200	3,053.00	2,427,745,600
エラン	7,700	1,669.00	12,851,300
ツガミ	25,900	944.00	24,449,600
オークマ	14,600	6,270.00	91,542,000
東芝機械	12,900	2,363.00	30,482,700
アマダホールディングス	177,200	1,193.00	211,399,600
アイダエンジニアリング	31,700	853.00	27,040,100
滝澤鉄工所	3,600	1,533.00	5,518,800
F U J I	34,400	1,558.00	53,595,200
牧野フライス製作所	13,400	4,725.00	63,315,000
オーエスジー	56,500	2,238.00	126,447,000
ダイジェット工業	1,300	1,699.00	2,208,700
旭ダイヤモンド工業	30,100	783.00	23,568,300
D M G 森精機	72,700	1,544.00	112,248,800
ソディック	25,000	945.00	23,625,000
ディスコ	15,500	18,000.00	279,000,000
日東工器	6,300	2,303.00	14,508,900
日進工具	3,400	2,496.00	8,486,400
パンチ工業	8,100	622.00	5,038,200
富士ダイス	5,000	648.00	3,240,000
土木管理総合試験所	4,900	457.00	2,239,300
日本郵政	909,700	1,248.00	1,135,305,600
ベルシステム24ホールディングス	18,600	1,581.00	29,406,600
鎌倉新書	8,100	1,362.00	11,032,200
一蔵	1,300	545.00	708,500
L I T A L I C O	2,600	1,788.00	4,648,800
グローバルキッズCOMPANY	1,400	1,026.00	1,436,400
エボラブルアジア	3,300	2,275.00	7,507,500
アトラエ	2,200	3,210.00	7,062,000
ストライク	2,900	1,981.00	5,744,900
ソラスト	27,100	1,144.00	31,002,400
セラク	2,600	592.00	1,539,200
インソース	3,700	2,183.00	8,077,100

豊田自動織機	94,000	6,060.00	569,640,000
豊和工業	6,300	979.00	6,167,700
OKK	4,700	827.00	3,886,900
石川製作所	2,800	1,634.00	4,575,200
東洋機械金属	8,300	585.00	4,855,500
津田駒工業	2,500	2,047.00	5,117,500
エンシュウ	3,100	1,181.00	3,661,100
島精機製作所	15,800	3,595.00	56,801,000
オプトラン	11,300	2,344.00	26,487,200
NCホールディングス	3,800	526.00	1,998,800
フリー	9,300	997.00	9,272,100
ヤマシンフィルタ	20,100	722.00	14,512,200
日阪製作所	14,100	940.00	13,254,000
やまびこ	22,200	1,087.00	24,131,400
平田機工	5,400	7,570.00	40,878,000
ペガサスミシン製造	10,800	643.00	6,944,400
マルマエ	3,300	994.00	3,280,200
タツモ	3,700	830.00	3,071,000
ナブテスコ	63,100	3,375.00	212,962,500
三井海洋開発	12,200	3,530.00	43,066,000
レオン自動機	11,300	1,649.00	18,633,700
SMC	34,000	44,040.00	1,497,360,000
新川	8,900	458.00	4,076,200
ホソカワミクロン	4,100	5,180.00	21,238,000
ユニオンツール	4,900	3,040.00	14,896,000
オイレス工業	16,100	1,855.00	29,865,500
日精エー・エス・ビー機械	3,400	4,050.00	13,770,000
サトーホールディングス	13,800	2,618.00	36,128,400
技研製作所	8,000	3,570.00	28,560,000
日本エアーテック	3,700	599.00	2,216,300
カワタ	2,400	1,418.00	3,403,200
日精樹脂工業	9,700	919.00	8,914,300
オカダアイヨン	4,000	1,307.00	5,228,000
ワイエイシーホールディングス	4,600	799.00	3,675,400
小松製作所	525,900	2,763.50	1,453,324,650
住友重機械工業	66,500	3,865.00	257,022,500
日立建機	46,500	2,922.00	135,873,000
日工	3,200	2,435.00	7,792,000
巴工業	4,900	2,449.00	12,000,100
井関農機	11,600	1,662.00	19,279,200
TOWA	10,100	817.00	8,251,700
丸山製作所	2,500	1,393.00	3,482,500
北川鉄工所	5,200	2,295.00	11,934,000
シンニッタン	18,000	365.00	6,570,000
ローツェ	5,100	2,239.00	11,418,900
タカキタ	4,100	609.00	2,496,900
クボタ	622,300	1,598.50	994,746,550
荏原実業	3,500	2,017.00	7,059,500
東洋エンジニアリング	15,400	594.00	9,147,600
三菱化工機	4,100	1,560.00	6,396,000

月島機械	23,000	1,398.00	32,154,000
帝国電機製作所	8,100	1,179.00	9,549,900
東京機械製作所	4,600	430.00	1,978,000
新東工業	27,500	1,007.00	27,692,500
澁谷工業	10,200	3,415.00	34,833,000
アイチコーポレーション	20,200	711.00	14,362,200
小森コーポレーション	31,300	1,274.00	39,876,200
鶴見製作所	9,000	1,971.00	17,739,000
住友精密工業	1,900	3,040.00	5,776,000
酒井重工業	2,200	2,891.00	6,360,200
荏原製作所	51,500	3,285.00	169,177,500
石井鐵工所	1,800	1,968.00	3,542,400
西島製作所	11,900	982.00	11,685,800
北越工業	12,100	1,183.00	14,314,300
千代田化工建設	94,100	298.00	28,041,800
ダイキン工業	158,600	13,265.00	2,103,829,000
オルガノ	4,100	3,170.00	12,997,000
トヨーカネツ	4,300	2,071.00	8,905,300
栗田工業	62,800	2,930.00	184,004,000
椿本チエイン	15,200	3,930.00	59,736,000
大同工業	5,500	863.00	4,746,500
日機装	37,500	1,377.00	51,637,500
木村化工機	9,700	368.00	3,569,600
新興プランテック	23,400	1,146.00	26,816,400
アネスト岩田	18,100	960.00	17,376,000
ダイフク	63,900	6,260.00	400,014,000
サムコ	3,300	892.00	2,943,600
加藤製作所	5,900	2,737.00	16,148,300
油研工業	2,000	1,730.00	3,460,000
タダノ	56,000	1,157.00	64,792,000
フジテック	42,200	1,354.00	57,138,800
C K D	32,300	1,223.00	39,502,900
キトー	8,800	1,759.00	15,479,200
平和	32,400	2,243.00	72,673,200
理想科学工業	10,300	1,827.00	18,818,100
SANKYO	29,000	4,330.00	125,570,000
日本金銭機械	12,800	1,266.00	16,204,800
マースグループホールディングス	7,300	2,145.00	15,658,500
福島工業	7,200	3,720.00	26,784,000
オーイズミ	4,900	402.00	1,969,800
ダイコク電機	5,300	1,493.00	7,912,900
竹内製作所	19,500	2,025.00	39,487,500
アマノ	33,200	2,574.00	85,456,800
JUKI	16,200	1,214.00	19,666,800
サンデンホールディングス	14,300	826.00	11,811,800
蛇の目ミシン工業	10,500	471.00	4,945,500
ブラザー工業	151,300	2,162.00	327,110,600
マックス	17,800	1,684.00	29,975,200
モリタホールディングス	20,300	1,876.00	38,082,800
グローリー	32,100	2,814.00	90,329,400

新晃工業	10,800	1,607.00	17,355,600
大和冷機工業	16,800	1,183.00	19,874,400
セガサミーホールディングス	115,200	1,321.00	152,179,200
日本ピストンリング	4,200	1,588.00	6,669,600
リケン	5,300	5,330.00	28,249,000
T P R	15,600	2,255.00	35,178,000
ツバキ・ナカシマ	17,600	1,974.00	34,742,400
ホシザキ	34,000	7,270.00	247,180,000
大豊工業	9,500	970.00	9,215,000
日本精工	238,500	1,119.00	266,881,500
N T N	249,500	359.00	89,570,500
ジェイテクト	111,400	1,442.00	160,638,800
不二越	10,800	4,770.00	51,516,000
ミネベアミツミ	215,700	1,865.00	402,280,500
日本トムソン	34,600	541.00	18,718,600
T H K	72,400	2,922.00	211,552,800
ユーシン精機	9,000	1,154.00	10,386,000
前澤給装工業	4,500	1,917.00	8,626,500
イーグル工業	14,300	1,292.00	18,475,600
前澤工業	7,900	355.00	2,804,500
日本ピラー工業	11,800	1,326.00	15,646,800
キッツ	47,100	845.00	39,799,500
日立製作所	523,000	3,640.00	1,903,720,000
三菱電機	1,161,500	1,526.00	1,772,449,000
富士電機	75,400	3,380.00	254,852,000
東洋電機製造	4,600	1,292.00	5,943,200
安川電機	134,700	3,910.00	526,677,000
シンフォニア テクノロジー	16,100	1,535.00	24,713,500
明電舎	22,900	1,622.00	37,143,800
オリジン	3,200	2,103.00	6,729,600
山洋電気	5,600	4,655.00	26,068,000
デンヨー	10,800	1,423.00	15,368,400
ベイカレント・コンサルティング	5,900	3,295.00	19,440,500
アイモバイル	2,700	908.00	2,451,600
キャリアインデックス	3,900	865.00	3,373,500
M S - J a p a n	4,500	1,630.00	7,335,000
船場	1,900	982.00	1,865,800
グレイステクノロジー	3,100	1,984.00	6,150,400
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	6,600	2,091.00	13,800,600
フルテック	1,200	1,105.00	1,326,000
グリーンズ	2,600	1,463.00	3,803,800
ツナググループ・ホールディングス	1,000	639.00	639,000
日総工産	2,800	2,379.00	6,661,200
キュービーネットホールディングス	5,000	2,348.00	11,740,000
三櫻工業	14,900	556.00	8,284,400
マキタ	141,400	3,960.00	559,944,000
東芝テック	14,500	3,285.00	47,632,500
芝浦メカトロニクス	2,100	3,955.00	8,305,500
マブチモーター	32,100	3,955.00	126,955,500

日本電産	139,800	15,400.00	2,152,920,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	6,300	1,617.00	10,187,100
トレックス・セミコンダクター	4,000	1,229.00	4,916,000
東光高岳	5,900	1,360.00	8,024,000
ダブル・スコープ	17,000	1,637.00	27,829,000
宮越ホールディングス	4,300	995.00	4,278,500
ダイヘン	12,700	3,045.00	38,671,500
田淵電機	16,300	118.00	1,923,400
ヤーマン	16,900	1,149.00	19,418,100
JVCケンウッド	88,800	272.00	24,153,600
ミマキエンジニアリング	10,500	647.00	6,793,500
第一精工	4,800	1,125.00	5,400,000
日新電機	27,300	1,034.00	28,228,200
大崎電気工業	23,200	716.00	16,611,200
オムロン	123,500	5,720.00	706,420,000
日東工業	18,700	2,236.00	41,813,200
I D E C	15,600	2,089.00	32,588,400
不二電機工業	1,300	1,285.00	1,670,500
ジーエス・ユアサ コーポレーション	41,800	2,314.00	96,725,200
サクサホールディングス	3,000	1,697.00	5,091,000
メルコホールディングス	4,800	3,740.00	17,952,000
テクノメディカ	2,600	2,098.00	5,454,800
日本電気	150,300	3,915.00	588,424,500
富士通	111,900	7,962.00	890,947,800
沖電気工業	50,300	1,349.00	67,854,700
岩崎通信機	5,500	822.00	4,521,000
電気興業	6,100	3,365.00	20,526,500
サンケン電気	13,500	2,357.00	31,819,500
ナカヨ	2,200	1,403.00	3,086,600
アイホン	6,600	1,785.00	11,781,000
ルネサスエレクトロニクス	120,400	578.00	69,591,200
セイコーエプソン	144,100	1,753.00	252,607,300
ワコム	84,100	469.00	39,442,900
アルバック	23,100	3,545.00	81,889,500
アクセル	4,900	524.00	2,567,600
E I Z O	10,700	4,495.00	48,096,500
ジャパンディスプレイ	275,200	78.00	21,465,600
日本信号	29,500	1,030.00	30,385,000
京三製作所	25,000	410.00	10,250,000
能美防災	15,400	1,874.00	28,859,600
ホーチキ	7,400	1,213.00	8,976,200
星和電機	4,100	492.00	2,017,200
エレコム	10,800	3,565.00	38,502,000
パナソニック	1,326,900	987.80	1,310,711,820
シャープ	115,200	1,262.00	145,382,400
アンリツ	74,800	2,204.00	164,859,200
富士通ゼネラル	35,500	1,556.00	55,238,000
ソニー	779,200	5,126.00	3,994,179,200
T D K	60,800	9,290.00	564,832,000
帝国通信工業	5,000	1,223.00	6,115,000

タムラ製作所	44,900	683.00	30,666,700
アルプスアルパイン	120,900	2,387.00	288,588,300
池上通信機	3,700	1,143.00	4,229,100
日本電波工業	10,600	539.00	5,713,400
鈴木	6,000	690.00	4,140,000
日本トリム	2,200	5,740.00	12,628,000
ローランド ディー・ジー・	5,900	2,461.00	14,519,900
フォスター電機	13,600	1,669.00	22,698,400
S M K	3,300	2,729.00	9,005,700
ヨコオ	8,300	1,718.00	14,259,400
ティアック	8,500	199.00	1,691,500
ホシデン	34,200	971.00	33,208,200
ヒロセ電機	16,700	12,350.00	206,245,000
日本航空電子工業	26,600	1,591.00	42,320,600
T O A	12,400	1,118.00	13,863,200
マクセルホールディングス	25,000	1,615.00	40,375,000
古野電気	15,000	1,094.00	16,410,000
ユニデンホールディングス	3,500	2,425.00	8,487,500
スミダコーポレーション	10,000	1,642.00	16,420,000
アイコム	6,400	2,177.00	13,932,800
リオン	5,300	2,060.00	10,918,000
本多通信工業	10,100	544.00	5,494,400
船井電機	11,800	772.00	9,109,600
横河電機	116,200	2,362.00	274,464,400
新電元工業	4,100	4,510.00	18,491,000
アズビル	75,000	2,704.00	202,800,000
東亜ディーケーケー	5,800	839.00	4,866,200
日本光電工業	51,200	3,220.00	164,864,000
チノー	4,100	1,341.00	5,498,100
共和電業	12,100	412.00	4,985,200
日本電子材料	4,600	709.00	3,261,400
堀場製作所	23,000	6,300.00	144,900,000
アドバンテスト	79,200	3,065.00	242,748,000
小野測器	5,400	622.00	3,358,800
エスベック	10,300	2,169.00	22,340,700
キーエンス	57,000	70,570.00	4,022,490,000
日置電機	6,100	4,875.00	29,737,500
シスメックス	90,500	6,463.00	584,901,500
日本マイクロニクス	18,800	818.00	15,378,400
メガチップス	9,200	1,808.00	16,633,600
O B A R A G R O U P	6,700	3,970.00	26,599,000
I M A G I C A G R O U P	9,700	591.00	5,732,700
澤藤電機	1,400	1,603.00	2,244,200
デンソー	255,700	4,743.00	1,212,785,100
原田工業	3,600	814.00	2,930,400
コーセル	14,800	1,198.00	17,730,400
イリソ電子工業	10,700	5,470.00	58,529,000
オブテックスグループ	20,500	1,857.00	38,068,500
千代田インテグレ	4,800	2,025.00	9,720,000
アイ・オー・データ機器	4,300	1,191.00	5,121,300

レーザーテック	23,800	5,050.00	120,190,000
スタンレー電気	82,100	3,170.00	260,257,000
岩崎電気	4,500	1,389.00	6,250,500
ウシオ電機	70,300	1,349.00	94,834,700
岡谷電機産業	8,500	362.00	3,077,000
ヘリオス テクノ ホールディング	10,800	676.00	7,300,800
エノモト	2,500	893.00	2,232,500
日本セラミック	11,800	3,050.00	35,990,000
遠藤照明	5,900	764.00	4,507,600
古河電池	8,300	717.00	5,951,100
双信電機	5,700	565.00	3,220,500
山一電機	8,500	1,201.00	10,208,500
図研	7,600	1,510.00	11,476,000
日本電子	22,900	2,156.00	49,372,400
カシオ計算機	102,800	1,392.00	143,097,600
ファナック	110,400	21,230.00	2,343,792,000
日本シイエムケイ	29,600	729.00	21,578,400
エンプラス	5,200	2,966.00	15,423,200
大真空	4,200	1,209.00	5,077,800
ローム	56,100	7,540.00	422,994,000
浜松ホトニクス	83,300	4,445.00	370,268,500
三井ハイテック	12,800	1,205.00	15,424,000
新光電気工業	39,000	883.00	34,437,000
京セラ	177,100	6,636.00	1,175,235,600
協栄産業	1,400	1,557.00	2,179,800
太陽誘電	51,700	2,453.00	126,820,100
村田製作所	365,500	5,759.00	2,104,914,500
双葉電子工業	18,900	1,778.00	33,604,200
日東電工	87,700	6,056.00	531,111,200
北陸電気工業	4,300	1,105.00	4,751,500
東海理化電機製作所	30,500	2,014.00	61,427,000
ニチコン	36,600	1,024.00	37,478,400
日本ケミコン	8,300	2,240.00	18,592,000
K O A	17,600	1,638.00	28,828,800
三井E & Sホールディングス	42,000	1,199.00	50,358,000
日立造船	91,900	345.00	31,705,500
三菱重工業	194,600	4,640.00	902,944,000
川崎重工業	90,300	2,711.00	244,803,300
I H I	89,200	2,654.00	236,736,800
名村造船所	35,000	377.00	13,195,000
サノヤスホールディングス	15,600	256.00	3,993,600
スプリックス	3,100	2,280.00	7,068,000
日本車輛製造	4,200	2,490.00	10,458,000
三菱ロジスネクスト	13,800	1,307.00	18,036,600
近畿車輛	1,800	2,004.00	3,607,200
F P G	36,100	943.00	34,042,300
島根銀行	2,700	782.00	2,111,400
じもとホールディングス	78,200	116.00	9,071,200
全国保証	32,300	3,770.00	121,771,000
めぶきフィナンシャルグループ	594,800	283.00	168,328,400

東京きらぼしフィナンシャルグループ	15,500	1,578.00	24,459,000	
九州フィナンシャルグループ	187,900	455.00	85,494,500	
かんぽ生命保険	43,200	2,700.00	116,640,000	
ゆうちょ銀行	324,500	1,223.00	396,863,500	
富山第一銀行	27,300	378.00	10,319,400	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	729,800	437.00	318,922,600	
ジェイリース	2,600	351.00	912,600	
西日本フィナンシャルホールディングス	73,300	964.00	70,661,200	
マーキュリアインベストメント	4,500	702.00	3,159,000	
イントラスト	3,400	497.00	1,689,800	
日本モーゲージサービス	1,600	1,195.00	1,912,000	
CASA	4,000	1,074.00	4,296,000	
アルヒ	10,500	2,045.00	21,472,500	
プレミアグループ	4,900	1,808.00	8,859,200	
日産自動車	1,369,800	930.70	1,274,872,860	
いすゞ自動車	367,200	1,539.00	565,120,800	
トヨタ自動車	1,294,500	6,741.00	8,726,224,500	*
日野自動車	144,900	983.00	142,436,700	
三菱自動車工業	429,800	615.00	264,327,000	
エフテック	8,200	938.00	7,691,600	
レシップホールディングス	4,300	810.00	3,483,000	
GMB	2,300	866.00	1,991,800	
ファルテック	2,000	854.00	1,708,000	
武蔵精密工業	28,300	1,652.00	46,751,600	
日産車体	22,600	1,007.00	22,758,200	
新明和工業	52,200	1,356.00	70,783,200	
極東開発工業	23,100	1,512.00	34,927,200	
日信工業	21,200	1,484.00	31,460,800	
トピー工業	9,600	2,378.00	22,828,800	
ティラド	4,200	2,439.00	10,243,800	
曙ブレーキ工業	64,400	134.00	8,629,600	
タチエス	19,800	1,682.00	33,303,600	
NOK	62,300	1,796.00	111,890,800	
フタバ産業	32,400	670.00	21,708,000	
KYB	12,100	2,967.00	35,900,700	
市光工業	17,500	651.00	11,392,500	
大同メタル工業	18,900	723.00	13,664,700	
プレス工業	57,600	598.00	34,444,800	
ミクニ	14,900	440.00	6,556,000	
太平洋工業	24,400	1,660.00	40,504,000	
ケーヒン	26,700	1,891.00	50,489,700	
河西工業	14,200	923.00	13,106,600	
アイシン精機	95,600	4,270.00	408,212,000	
マツダ	364,500	1,320.50	481,322,250	
今仙電機製作所	10,800	1,061.00	11,458,800	
本田技研工業	979,900	3,074.00	3,012,212,600	
スズキ	212,500	4,982.00	1,058,675,000	
SUBARU	360,600	2,777.50	1,001,566,500	

安永	5,600	1,904.00	10,662,400
ヤマハ発動機	164,000	2,295.00	376,380,000
ショーワ	27,500	1,529.00	42,047,500
小糸製作所	69,600	6,750.00	469,800,000
T B K	13,700	418.00	5,726,600
エクセディ	15,700	2,573.00	40,396,100
ミツバ	21,400	725.00	15,515,000
豊田合成	37,400	2,520.00	94,248,000
愛三工業	18,100	739.00	13,375,900
盟和産業	1,900	1,086.00	2,063,400
日本プラスト	9,100	802.00	7,298,200
ヨロズ	10,800	1,684.00	18,187,200
エフ・シー・シー	20,800	2,429.00	50,523,200
新家工業	2,700	1,586.00	4,282,200
シマノ	46,800	17,780.00	832,104,000
テイ・エス テック	27,000	3,350.00	90,450,000
関西みらいフィナンシャルグループ	53,800	753.00	40,511,400
三十三フィナンシャルグループ	9,900	1,524.00	15,087,600
第四北越フィナンシャルグループ	19,900	3,285.00	65,371,500
ジャムコ	5,800	2,325.00	13,485,000
小野建	10,300	1,566.00	16,129,800
はるやまホールディングス	5,400	830.00	4,482,000
南陽	2,400	2,007.00	4,816,800
ノジマ	20,400	1,971.00	40,208,400
佐島電機	8,400	994.00	8,349,600
カッパ・クリエイト	16,100	1,442.00	23,216,200
エコートレーディング	2,600	552.00	1,435,200
伯東	7,800	1,209.00	9,430,200
コンドーテック	8,900	977.00	8,695,300
中山福	6,500	532.00	3,458,000
ライトオン	9,700	760.00	7,372,000
ナガイレーベン	16,500	2,476.00	40,854,000
ジーンズメイト	3,700	411.00	1,520,700
三菱食品	12,500	2,836.00	35,450,000
良品計画	16,200	23,600.00	382,320,000
三城ホールディングス	14,100	395.00	5,569,500
松田産業	8,300	1,395.00	11,578,500
第一興商	17,000	5,600.00	95,200,000
メディカルホールディングス	123,500	2,571.00	317,518,500
アドヴァン	17,500	1,028.00	17,990,000
S P K	2,500	2,397.00	5,992,500
萩原電気ホールディングス	4,200	3,085.00	12,957,000
アルビス	4,300	2,245.00	9,653,500
アズワン	8,200	8,810.00	72,242,000
スズデン	4,000	1,488.00	5,952,000
尾家産業	3,400	1,347.00	4,579,800
シモジマ	7,000	1,148.00	8,036,000
ドウシシャ	10,800	1,840.00	19,872,000
小津産業	2,600	1,968.00	5,116,800
コナカ	14,600	444.00	6,482,400

高速	6,800	1,170.00	7,956,000
ハウス オブ ローゼ	1,500	1,694.00	2,541,000
G - 7ホールディングス	3,400	2,351.00	7,993,400
たけびし	4,100	1,417.00	5,809,700
イオン北海道	11,300	743.00	8,395,900
コジマ	17,000	604.00	10,268,000
ヒマラヤ	3,700	915.00	3,385,500
コーナン商事	15,000	2,620.00	39,300,000
ネットワンシステムズ	40,300	2,879.00	116,023,700
エコス	4,200	1,518.00	6,375,600
ワタミ	15,000	1,597.00	23,955,000
マルシェ	3,200	777.00	2,486,400
リックス	2,600	1,510.00	3,926,000
システムソフト	27,800	103.00	2,863,400
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	68,500	7,350.00	503,475,000
丸文	10,100	661.00	6,676,100
西松屋チェーン	25,100	872.00	21,887,200
ゼンショーホールディングス	54,000	2,425.00	130,950,000
ハビネット	9,600	1,354.00	12,998,400
幸楽苑ホールディングス	7,300	3,185.00	23,250,500
ハークスレイ	2,400	1,074.00	2,577,600
橋本総業ホールディングス	2,300	1,426.00	3,279,800
日本ライフライン	35,900	1,792.00	64,332,800
サイゼリヤ	18,900	2,344.00	44,301,600
タカショー	5,700	446.00	2,542,200
エクセル	4,200	2,142.00	8,996,400
V Tホールディングス	38,800	444.00	17,227,200
マルカ	3,800	2,116.00	8,040,800
アルゴグラフィックス	9,700	2,286.00	22,174,200
魚力	3,200	1,464.00	4,684,800
I D O M	38,600	319.00	12,313,400
日本エム・ディ・エム	6,700	1,161.00	7,778,700
ポブラ	3,100	535.00	1,658,500
フジ・コーポレーション	2,300	2,335.00	5,370,500
ユナイテッドアローズ	13,000	3,585.00	46,605,000
進和	6,700	2,251.00	15,081,700
エスケイジャパン	2,900	777.00	2,253,300
ダイトロン	5,200	1,751.00	9,105,200
ハイデイ日高	16,500	2,040.00	33,660,000
シークス	14,500	1,728.00	25,056,000
京都きもの友禅	7,500	400.00	3,000,000
コロワイド	38,000	2,217.00	84,246,000
ピーシーデポコーポレーション	15,300	425.00	6,502,500
田中商事	3,700	598.00	2,212,600
オーハシテクニカ	6,500	1,438.00	9,347,000
壱番屋	8,100	4,570.00	37,017,000
白銅	3,800	1,536.00	5,836,800
トップカルチャー	4,500	314.00	1,413,000
P L A N T	2,600	1,006.00	2,615,600

スギホールディングス	25,100	4,950.00	124,245,000
島津製作所	149,500	3,245.00	485,127,500
JMS	10,800	693.00	7,484,400
クボテック	2,600	412.00	1,071,200
長野計器	9,100	831.00	7,562,100
ブイ・テクノロジー	2,800	15,620.00	43,736,000
スター精密	19,800	1,737.00	34,392,600
東京計器	7,400	1,115.00	8,251,000
愛知時計電機	1,500	4,005.00	6,007,500
インターアクション	5,500	1,759.00	9,674,500
オーバル	11,500	258.00	2,967,000
東京精密	21,000	3,030.00	63,630,000
マニー	14,100	5,770.00	81,357,000
ニコン	202,400	1,574.00	318,577,600
トプコン	62,300	1,329.00	82,796,700
オリンパス	692,000	1,240.00	858,080,000
理研計器	10,300	2,189.00	22,546,700
SCREENホールディングス	20,200	4,890.00	98,778,000
キヤノン電子	10,600	1,804.00	19,122,400
タムロン	10,300	2,139.00	22,031,700
HOYA	233,900	7,600.00	1,777,640,000
シード	4,900	1,068.00	5,233,200
ノーリツ鋼機	9,200	2,106.00	19,375,200
エー・アンド・デイ	10,700	855.00	9,148,500
朝日インテック	49,300	5,130.00	252,909,000
キヤノン	625,200	3,217.00	2,011,268,400
リコー	349,200	1,165.00	406,818,000
シチズン時計	127,000	619.00	78,613,000
リズム時計工業	4,000	1,332.00	5,328,000
大研医器	9,200	549.00	5,050,800
メニコン	15,900	3,110.00	49,449,000
シンシア	1,800	615.00	1,107,000
中本パックス	3,400	1,520.00	5,168,000
スノーピーク	4,400	1,500.00	6,600,000
パラマウントベッドホールディングス	13,300	5,050.00	67,165,000
トランザクション	6,400	752.00	4,812,800
SHOBI	3,500	352.00	1,232,000
ニホンフラッシュ	5,000	2,255.00	11,275,000
前田工織	12,800	2,411.00	30,860,800
永大産業	15,300	442.00	6,762,600
アートネイチャー	12,400	627.00	7,774,800
バンダイナムコホールディングス	120,100	5,020.00	602,902,000
アイフィスジャパン	2,700	589.00	1,590,300
共立印刷	19,900	210.00	4,179,000
SHOEI	5,600	4,670.00	26,152,000
フランスベッドホールディングス	16,300	916.00	14,930,800
マーベラス	17,500	845.00	14,787,500
パイロットコーポレーション	20,300	4,375.00	88,812,500
萩原工業	6,500	1,470.00	9,555,000
エイベックス	19,600	1,408.00	27,596,800

トッパン・フォームズ	24,800	965.00	23,932,000
フジシールインターナショナル	26,100	3,785.00	98,788,500
タカラトミー	48,600	1,166.00	56,667,600
廣済堂	11,100	768.00	8,524,800
エステールホールディングス	3,200	651.00	2,083,200
アーク	44,800	107.00	4,793,600
レック	12,400	1,522.00	18,872,800
タカノ	4,600	842.00	3,873,200
三光合成	9,400	338.00	3,177,200
プロネクサス	10,000	1,310.00	13,100,000
ホクシン	7,600	140.00	1,064,000
ウッドワン	4,000	1,065.00	4,260,000
大建工業	8,800	2,083.00	18,330,400
きもと	20,000	168.00	3,360,000
凸版印刷	163,900	1,747.00	286,333,300
大日本印刷	163,600	2,638.00	431,576,800
図書印刷	11,000	938.00	10,318,000
共同印刷	3,600	2,465.00	8,874,000
N I S S H A	23,900	1,196.00	28,584,400
光村印刷	1,000	2,250.00	2,250,000
藤森工業	10,400	3,070.00	31,928,000
ヴィア・ホールディングス	14,100	655.00	9,235,500
宝印刷	5,600	1,699.00	9,514,400
前澤化成工業	7,900	1,032.00	8,152,800
未来工業	6,200	2,336.00	14,483,200
アシックス	115,300	1,429.00	164,763,700
ツツミ	3,600	1,812.00	6,523,200
ウェーブロックホールディングス	2,500	867.00	2,167,500
J S P	6,800	2,465.00	16,762,000
ニチハ	16,200	3,120.00	50,544,000
エフピコ	9,600	6,680.00	64,128,000
小松ウオール工業	3,600	1,818.00	6,544,800
ヤマハ	69,100	5,740.00	396,634,000
河合楽器製作所	3,600	2,955.00	10,638,000
クリナップ	10,900	639.00	6,965,100
ビジョン	70,300	4,435.00	311,780,500
天馬	8,000	2,123.00	16,984,000
兼松サステック	800	1,581.00	1,264,800
キングジム	9,600	866.00	8,313,600
象印マホービン	21,600	1,117.00	24,127,200
リンテック	27,600	2,428.00	67,012,800
信越ポリマー	20,800	878.00	18,262,400
東リ	29,000	264.00	7,656,000
イトーキ	21,300	552.00	11,757,600
任天堂	71,500	32,950.00	2,355,925,000
三菱鉛筆	19,100	2,107.00	40,243,700
松風	5,600	1,268.00	7,100,800
タカラスタANDARD	24,000	1,696.00	40,704,000
コクヨ	55,700	1,593.00	88,730,100
ナカバヤシ	11,700	516.00	6,037,200

ニフコ	46,400	3,065.00	142,216,000
立川ブラインド工業	5,000	1,205.00	6,025,000
グローブライド	5,600	3,135.00	17,556,000
オカムラ	40,500	1,169.00	47,344,500
バルカー	9,500	2,351.00	22,334,500
MUTOHホールディングス	1,600	1,882.00	3,011,200
伊藤忠商事	800,200	2,001.50	1,601,600,300
丸紅	1,128,300	781.80	882,104,940
スクロール	17,700	367.00	6,495,900
高島	1,800	1,715.00	3,087,000
ヨンドシーホールディングス	12,600	2,376.00	29,937,600
三陽商会	6,800	1,819.00	12,369,200
長瀬産業	64,200	1,686.00	108,241,200
ナイガイ	4,400	516.00	2,270,400
蝶理	7,200	1,626.00	11,707,200
豊田通商	127,700	3,700.00	472,490,000
オンワードホールディングス	68,300	634.00	43,302,200
三共生興	19,200	481.00	9,235,200
兼松	45,600	1,229.00	56,042,400
美津濃	11,500	2,596.00	29,854,000
ツカモトコーポレーション	2,100	1,240.00	2,604,000
ユニー・ファミリーマートホールディングス	128,000	2,767.00	354,176,000
ルックホールディングス	4,100	1,594.00	6,535,400
三井物産	942,500	1,743.50	1,643,248,750
日本紙パルプ商事	6,500	4,140.00	26,910,000
東京エレクトロン	77,500	17,460.00	1,353,150,000
日立ハイテクノロジーズ	34,800	4,710.00	163,908,000
カメイ	14,900	1,178.00	17,552,200
東都水産	1,700	2,349.00	3,993,300
OUGホールディングス	1,800	2,626.00	4,726,800
スターゼン	4,200	3,780.00	15,876,000
セイコーホールディングス	17,900	2,568.00	45,967,200
山善	44,700	1,181.00	52,790,700
椿本興業	2,600	3,900.00	10,140,000
住友商事	676,400	1,573.50	1,064,315,400
日本ユニシス	35,600	2,849.00	101,424,400
内田洋行	5,200	3,305.00	17,186,000
三菱商事	802,800	3,050.00	2,448,540,000
第一実業	5,200	3,300.00	17,160,000
キヤノンマーケティングジャパン	32,700	2,218.00	72,528,600
西華産業	6,400	1,370.00	8,768,000
佐藤商事	10,300	939.00	9,671,700
菱洋エレクトロ	11,600	1,687.00	19,569,200
東京産業	11,700	518.00	6,060,600
ユアサ商事	11,700	3,190.00	37,323,000
神鋼商事	2,600	2,638.00	6,858,800
小林産業	6,900	353.00	2,435,700
阪和興業	19,900	3,205.00	63,779,500
正栄食品工業	6,000	3,280.00	19,680,000

カナデン	11,000	1,211.00	13,321,000
菱電商事	9,000	1,496.00	13,464,000
ニプロ	80,400	1,374.00	110,469,600
フルサト工業	6,300	1,588.00	10,004,400
岩谷産業	25,400	3,520.00	89,408,000
すてきナイスグループ	4,800	923.00	4,430,400
昭光通商	4,100	626.00	2,566,600
ニチモウ	1,900	1,704.00	3,237,600
極東貿易	3,600	1,548.00	5,572,800
イワキ	13,800	414.00	5,713,200
兼松エレクトロニクス	6,200	3,225.00	19,995,000
三愛石油	30,700	939.00	28,827,300
稲畑産業	27,500	1,564.00	43,010,000
G S Iクレオス	3,100	1,168.00	3,620,800
明和産業	10,900	464.00	5,057,600
キムラタン	56,400	35.00	1,974,000
ゴールドウイン	10,300	17,400.00	179,220,000
ユニ・チャーム	246,300	3,557.00	876,089,100
デサント	27,800	2,703.00	75,143,400
キング	6,100	619.00	3,775,900
ワキタ	24,400	1,133.00	27,645,200
ヤマトインターナショナル	7,700	420.00	3,234,000
東邦ホールディングス	33,800	2,658.00	89,840,400
サンゲツ	34,500	2,076.00	71,622,000
ミツウロコグループホールディングス	16,600	861.00	14,292,600
シナネンホールディングス	4,700	2,103.00	9,884,100
伊藤忠エネクス	25,200	900.00	22,680,000
サンリオ	35,400	2,591.00	91,721,400
サンワテクノス	7,000	924.00	6,468,000
リョーサン	12,500	3,010.00	37,625,000
新光商事	10,800	1,894.00	20,455,200
トーヨー	5,100	2,162.00	11,026,200
三信電気	9,500	1,928.00	18,316,000
東陽テクニカ	13,000	895.00	11,635,000
モスフードサービス	15,000	2,580.00	38,700,000
加賀電子	11,400	2,123.00	24,202,200
三益半導体工業	9,400	1,706.00	16,036,400
ソーダニッカ	11,900	586.00	6,973,400
立花エレテック	8,400	1,725.00	14,490,000
木曽路	14,000	2,550.00	35,700,000
S R Sホールディングス	13,500	1,009.00	13,621,500
千趣会	20,800	241.00	5,012,800
タカキュー	9,100	188.00	1,710,800
ケーヨー	21,200	499.00	10,578,800
上新電機	13,500	2,440.00	32,940,000
日本瓦斯	18,600	2,934.00	54,572,400
ロイヤルホールディングス	20,000	2,694.00	53,880,000
東天紅	800	1,247.00	997,600
いなげや	12,700	1,307.00	16,598,900
島忠	25,900	2,797.00	72,442,300

チヨダ	12,000	1,779.00	21,348,000
ライフコーポレーション	8,700	2,296.00	19,975,200
リンガーハット	14,100	2,364.00	33,332,400
MrMaxHD	15,800	451.00	7,125,800
テンアライド	10,900	408.00	4,447,200
AOKIホールディングス	22,800	1,128.00	25,718,400
オークワ	16,300	1,062.00	17,310,600
コメリ	17,700	2,647.00	46,851,900
青山商事	20,000	2,435.00	48,700,000
しまむら	13,300	8,890.00	118,237,000
はせがわ	6,000	402.00	2,412,000
高島屋	89,700	1,333.00	119,570,100
松屋	23,100	1,007.00	23,261,700
エイチ・ツー・オー リテイリング	58,600	1,465.00	85,849,000
近鉄百貨店	4,300	3,345.00	14,383,500
パルコ	10,900	1,092.00	11,902,800
丸井グループ	96,800	2,209.00	213,831,200
クレディセゾン	80,300	1,415.00	113,624,500
アクシアル リテイリング	9,500	3,360.00	31,920,000
井筒屋	5,800	270.00	1,566,000
イオン	440,300	2,067.00	910,100,100
イズミ	23,200	5,070.00	117,624,000
フォーバル	5,000	817.00	4,085,000
平和堂	23,200	2,072.00	48,070,400
フジ	13,800	1,867.00	25,764,600
ヤオコー	12,900	5,200.00	67,080,000
ゼビオホールディングス	13,700	1,197.00	16,398,900
ケースホールディングス	119,000	979.00	116,501,000
PALTAC	20,700	6,080.00	125,856,000
三谷産業	13,700	285.00	3,904,500
Olympicグループ	6,800	700.00	4,760,000
日産東京販売ホールディングス	17,000	291.00	4,947,000
新生銀行	84,100	1,530.00	128,673,000
あおぞら銀行	64,000	2,666.00	170,624,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	7,886,500	552.80	4,359,657,200
りそなホールディングス	1,257,300	460.00	578,358,000
三井住友トラスト・ホールディングス	225,300	3,970.00	894,441,000
三井住友フィナンシャルグループ	807,400	3,893.00	3,143,208,200
千葉銀行	405,900	601.00	243,945,900
群馬銀行	228,900	446.00	102,089,400
武蔵野銀行	17,000	2,193.00	37,281,000
千葉興業銀行	31,400	300.00	9,420,000
筑波銀行	48,100	197.00	9,475,700
七十七銀行	35,900	1,602.00	57,511,800
青森銀行	8,900	2,914.00	25,934,600
秋田銀行	7,300	2,224.00	16,235,200
山形銀行	12,800	1,859.00	23,795,200
岩手銀行	8,000	3,265.00	26,120,000
東邦銀行	102,400	296.00	30,310,400
東北銀行	5,900	1,064.00	6,277,600

みちのく銀行	7,400	1,623.00	12,010,200
ふくおかフィナンシャルグループ	100,952	2,532.00	255,610,464
静岡銀行	288,200	835.00	240,647,000
十六銀行	15,300	2,318.00	35,465,400
スルガ銀行	117,400	559.00	65,626,600
八十二銀行	207,300	464.00	96,187,200
山梨中央銀行	14,100	1,350.00	19,035,000
大垣共立銀行	18,100	2,444.00	44,236,400
福井銀行	9,800	1,635.00	16,023,000
北國銀行	12,200	3,375.00	41,175,000
清水銀行	4,700	1,802.00	8,469,400
富山銀行	2,300	3,210.00	7,383,000
滋賀銀行	22,900	2,618.00	59,952,200
南都銀行	13,400	2,149.00	28,796,600
百五銀行	103,000	362.00	37,286,000
京都銀行	41,000	4,705.00	192,905,000
紀陽銀行	40,500	1,551.00	62,815,500
ほくほくフィナンシャルグループ	76,200	1,192.00	90,830,400
広島銀行	169,200	582.00	98,474,400
山陰合同銀行	68,000	786.00	53,448,000
中国銀行	73,900	1,070.00	79,073,000
鳥取銀行	4,000	1,415.00	5,660,000
伊予銀行	151,600	606.00	91,869,600
百十四銀行	12,200	2,270.00	27,694,000
四国銀行	16,400	1,017.00	16,678,800
阿波銀行	18,400	2,775.00	51,060,000
大分銀行	7,000	3,430.00	24,010,000
宮崎銀行	7,600	2,697.00	20,497,200
佐賀銀行	6,900	1,832.00	12,640,800
沖縄銀行	10,500	3,395.00	35,647,500
琉球銀行	26,500	1,164.00	30,846,000
セブン銀行	387,000	296.00	114,552,000
みずほフィナンシャルグループ	15,567,400	171.60	2,671,365,840
高知銀行	4,300	822.00	3,534,600
山口フィナンシャルグループ	143,000	891.00	127,413,000
芙蓉総合リース	13,100	5,610.00	73,491,000
興銀リース	21,500	2,665.00	57,297,500
東京センチュリー	23,100	5,060.00	116,886,000
SBIホールディングス	136,500	2,409.00	328,828,500
日本証券金融	50,600	565.00	28,589,000
アイフル	175,000	257.00	44,975,000
日本アジア投資	10,200	201.00	2,050,200
長野銀行	3,900	1,714.00	6,684,600
名古屋銀行	9,200	3,640.00	33,488,000
北洋銀行	172,700	277.00	47,837,900
愛知銀行	4,100	3,505.00	14,370,500
中京銀行	4,700	2,177.00	10,231,900
大光銀行	4,000	1,684.00	6,736,000
愛媛銀行	16,000	1,099.00	17,584,000
トマト銀行	4,600	1,060.00	4,876,000

京葉銀行	50,500	668.00	33,734,000
栃木銀行	59,200	232.00	13,734,400
北日本銀行	3,700	1,924.00	7,118,800
東和銀行	20,200	723.00	14,604,600
福島銀行	10,200	367.00	3,743,400
大東銀行	5,500	641.00	3,525,500
リコーリース	9,000	3,370.00	30,330,000
イオンフィナンシャルサービス	73,100	2,228.00	162,866,800
アコム	230,100	380.00	87,438,000
ジャックス	12,600	1,763.00	22,213,800
オリエントコーポレーション	308,900	113.00	34,905,700
日立キャピタル	27,000	2,569.00	69,363,000
アプラスフィナンシャル	55,300	87.00	4,811,100
オリックス	764,400	1,593.50	1,218,071,400
三菱UFJリース	258,300	569.00	146,972,700
ジャフコ	18,800	4,035.00	75,858,000
九州リースサービス	5,700	669.00	3,813,300
トモニホールディングス	88,500	415.00	36,727,500
大和証券グループ本社	919,200	528.30	485,613,360
野村ホールディングス	2,015,800	414.30	835,145,940
岡三証券グループ	97,400	415.00	40,421,000
丸三証券	33,900	658.00	22,306,200
東洋証券	40,900	141.00	5,766,900
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	136,500	399.00	54,463,500
光世証券	2,700	712.00	1,922,400
水戸証券	33,500	204.00	6,834,000
いちよし証券	24,000	780.00	18,720,000
松井証券	56,100	986.00	55,314,600
SOMPOホールディングス	202,000	4,090.00	826,180,000
だいこう証券ビジネス	4,700	422.00	1,983,400
日本取引所グループ	309,500	1,779.00	550,600,500
マネックスグループ	107,100	369.00	39,519,900
カブドットコム証券	85,900	558.00	47,932,200
極東証券	15,300	1,038.00	15,881,400
岩井コスモホールディングス	11,800	1,188.00	14,018,400
藍澤證券	21,400	666.00	14,252,400
フィデアホールディングス	111,700	131.00	14,632,700
池田泉州ホールディングス	121,800	283.00	34,469,400
アニコムホールディングス	9,300	3,030.00	28,179,000
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	299,600	3,365.00	1,008,154,000
ソニーフィナンシャルホールディングス	94,200	2,266.00	213,457,200
マネーパートナーズグループ	13,600	306.00	4,161,600
小林洋行	3,400	258.00	877,200
第一生命ホールディングス	648,200	1,582.50	1,025,776,500
東京海上ホールディングス	415,300	5,544.00	2,302,423,200
アドバンテッジリスクマネジメント	4,400	899.00	3,955,600
イー・ギャランティ	10,800	1,149.00	12,409,200

アサックス	4,800	527.00	2,529,600
NECキャピタルソリューション	4,600	1,724.00	7,930,400
T&Dホールディングス	354,300	1,172.00	415,239,600
アドバンスクリエイト	2,800	1,827.00	5,115,600
三井不動産	607,900	2,649.00	1,610,327,100
三菱地所	802,700	1,871.00	1,501,851,700
平和不動産	21,700	1,979.00	42,944,300
東京建物	125,300	1,292.00	161,887,600
ダイビル	33,700	997.00	33,598,900
京阪神ビルディング	20,600	977.00	20,126,200
住友不動産	257,600	4,195.00	1,080,632,000
太平洋興発	4,500	751.00	3,379,500
テーオーシー	26,200	726.00	19,021,200
東京楽天地	1,700	5,000.00	8,500,000
レオパレス21	141,500	208.00	29,432,000
スターツコーポレーション	15,600	2,419.00	37,736,400
フジ住宅	14,800	825.00	12,210,000
空港施設	13,300	544.00	7,235,200
明和地所	6,600	556.00	3,669,600
ゴールドクレスト	9,000	1,474.00	13,266,000
リログループ	60,700	3,050.00	185,135,000
日本エスリード	4,500	1,522.00	6,849,000
日神不動産	17,100	454.00	7,763,400
日本エスコン	20,800	762.00	15,849,600
タカラレーベン	53,800	339.00	18,238,200
サンヨーハウジング名古屋	6,500	946.00	6,149,000
イオンモール	57,400	1,750.00	100,450,000
ファースト住建	4,300	1,258.00	5,409,400
ランド	477,300	9.00	4,295,700
カチタス	12,700	3,500.00	44,450,000
東祥	6,900	2,928.00	20,203,200
トーセイ	15,900	941.00	14,961,900
穴吹興産	1,300	2,961.00	3,849,300
サンフロンティア不動産	15,900	1,119.00	17,792,100
エフ・ジェー・ネクスト	10,100	914.00	9,231,400
インテリックス	3,500	704.00	2,464,000
ランドビジネス	5,900	797.00	4,702,300
グランディハウス	10,200	435.00	4,437,000
東武鉄道	122,500	3,060.00	374,850,000
相鉄ホールディングス	39,800	3,225.00	128,355,000
東京急行電鉄	315,500	1,797.00	566,953,500
京浜急行電鉄	159,200	1,789.00	284,808,800
小田急電鉄	186,100	2,537.00	472,135,700
京王電鉄	64,900	6,610.00	428,989,000
京成電鉄	87,000	3,905.00	339,735,000
富士急行	15,800	4,135.00	65,333,000
新京成電鉄	3,000	2,055.00	6,165,000
東日本旅客鉄道	206,500	10,255.00	2,117,657,500
西日本旅客鉄道	104,100	8,201.00	853,724,100
東海旅客鉄道	104,000	24,365.00	2,533,960,000

西武ホールディングス	148,100	1,830.00	271,023,000
鴻池運輸	18,500	1,802.00	33,337,000
西日本鉄道	32,100	2,600.00	83,460,000
ハマキョウレックス	8,900	4,315.00	38,403,500
サカイ引越センター	6,100	6,780.00	41,358,000
近鉄グループホールディングス	110,100	4,865.00	535,636,500
阪急阪神ホールディングス	146,700	3,975.00	583,132,500
南海電気鉄道	49,100	2,907.00	142,733,700
京阪ホールディングス	49,000	4,420.00	216,580,000
神戸電鉄	2,900	4,015.00	11,643,500
名古屋鉄道	88,100	2,946.00	259,542,600
山陽電気鉄道	8,500	2,184.00	18,564,000
トランコム	3,100	6,490.00	20,119,000
日本通運	43,200	6,160.00	266,112,000
ヤマトホールディングス	192,900	2,771.50	534,622,350
山九	30,500	5,210.00	158,905,000
日新	9,500	1,933.00	18,363,500
丸運	6,100	285.00	1,738,500
丸全昭和運輸	8,900	2,900.00	25,810,000
センコーグループホールディングス	60,700	900.00	54,630,000
トナミホールディングス	2,700	6,220.00	16,794,000
ニッコンホールディングス	41,800	2,652.00	110,853,600
日本石油輸送	1,300	2,889.00	3,755,700
福山通運	14,100	4,335.00	61,123,500
セイノーホールディングス	82,400	1,500.00	123,600,000
エスライン	3,100	1,044.00	3,236,400
神奈川中央交通	2,800	3,860.00	10,808,000
日立物流	24,200	3,210.00	77,682,000
丸和運輸機関	5,800	3,860.00	22,388,000
C & F ロジホールディングス	11,200	1,243.00	13,921,600
日本郵船	92,000	1,743.00	160,356,000
商船三井	65,200	2,643.00	172,323,600
川崎汽船	33,900	1,383.00	46,883,700
N S ユナイテッド海運	6,000	2,493.00	14,958,000
明治海運	11,800	357.00	4,212,600
飯野海運	52,000	382.00	19,864,000
共栄タンカー	800	1,499.00	1,199,200
九州旅客鉄道	92,300	3,575.00	329,972,500
S Gホールディングス	103,900	3,175.00	329,882,500
日本航空	201,400	3,816.00	768,542,400
A N Aホールディングス	201,100	4,024.00	809,226,400
パスコ	2,200	883.00	1,942,600
西本W i s m e t t a cホールディングス	2,600	4,270.00	11,102,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	900	1,219.00	1,097,100
Genky Drug Stores	4,600	2,424.00	11,150,400
国際紙バルブ商事	20,200	298.00	6,019,600
総合メディカルホールディングス	10,000	1,775.00	17,750,000
ブックオフグループホールディングス	5,900	839.00	4,950,100
三菱倉庫	38,000	3,080.00	117,040,000

三井倉庫ホールディングス	13,500	1,746.00	23,571,000
住友倉庫	41,400	1,404.00	58,125,600
澁澤倉庫	6,000	1,775.00	10,650,000
ヤマタネ	5,700	1,543.00	8,795,100
東陽倉庫	20,300	322.00	6,536,600
乾汽船	10,000	863.00	8,630,000
日本トランスシティ	24,200	448.00	10,841,600
ケイヒン	2,200	1,372.00	3,018,400
中央倉庫	6,700	1,056.00	7,075,200
川西倉庫	2,300	1,336.00	3,072,800
安田倉庫	9,100	883.00	8,035,300
東洋埠頭	3,300	1,497.00	4,940,100
宇徳	9,500	545.00	5,177,500
上組	67,900	2,618.00	177,762,200
サンリツ	2,700	673.00	1,817,100
キムラユニティー	3,100	1,118.00	3,465,800
キューソー流通システム	2,800	2,056.00	5,756,800
近鉄エクスプレス	20,700	1,701.00	35,210,700
東海運	6,200	273.00	1,692,600
エーアイティー	7,200	1,136.00	8,179,200
内外トランスライン	3,600	1,325.00	4,770,000
日本コンセプト	3,200	1,085.00	3,472,000
東京放送ホールディングス	75,600	2,037.00	153,997,200
日本テレビホールディングス	104,600	1,651.00	172,694,600
朝日放送グループホールディングス	11,200	779.00	8,724,800
テレビ朝日ホールディングス	31,300	1,932.00	60,471,600
スカパーJ S A Tホールディングス	86,900	451.00	39,191,900
テレビ東京ホールディングス	9,400	2,269.00	21,328,600
日本BS放送	4,000	1,058.00	4,232,000
ビジョン	3,600	5,070.00	18,252,000
USEN-NEXT HOLDINGS	4,300	858.00	3,689,400
ワイヤレスゲート	5,200	419.00	2,178,800
コネクシオ	8,100	1,428.00	11,566,800
日本通信	98,900	113.00	11,175,700
クロップス	2,200	629.00	1,383,800
日本電信電話	779,600	4,605.00	3,590,058,000
KDDI	1,004,500	2,417.00	2,427,876,500
ソフトバンク	906,300	1,277.00	1,157,345,100
光通信	13,400	20,490.00	274,566,000
NTTドコモ	721,600	2,295.50	1,656,432,800
エムティーアイ	13,300	629.00	8,365,700
GMOインターネット	41,600	1,860.00	77,376,000
アйдママーケティングコミュニケーション	2,500	465.00	1,162,500
カドカワ	33,300	1,329.00	44,255,700
学研ホールディングス	3,900	5,320.00	20,748,000
ゼンリン	22,700	2,551.00	57,907,700
昭文社	5,300	410.00	2,173,000
インプレスホールディングス	9,600	145.00	1,392,000

東京電力ホールディングス	927,500	646.00	599,165,000
中部電力	355,500	1,634.00	580,887,000
関西電力	474,100	1,580.50	749,315,050
中国電力	160,700	1,358.00	218,230,600
北陸電力	113,800	820.00	93,316,000
東北電力	272,200	1,386.00	377,269,200
四国電力	104,600	1,304.00	136,398,400
九州電力	239,500	1,236.00	296,022,000
北海道電力	108,900	619.00	67,409,100
沖縄電力	21,500	1,851.00	39,796,500
電源開発	92,400	2,618.00	241,903,200
エフオン	5,500	793.00	4,361,500
イーレックス	20,300	1,019.00	20,685,700
レノバ	12,500	927.00	11,587,500
東京瓦斯	227,900	2,948.00	671,849,200
大阪瓦斯	225,400	2,138.00	481,905,200
東邦瓦斯	57,500	4,775.00	274,562,500
北海道瓦斯	6,200	1,453.00	9,008,600
広島ガス	23,900	354.00	8,460,600
西部瓦斯	13,000	2,388.00	31,044,000
静岡ガス	35,800	877.00	31,396,600
メタウォーター	5,600	3,130.00	17,528,000
アイネット	6,400	1,292.00	8,268,800
松竹	7,500	11,900.00	89,250,000
東宝	75,000	4,365.00	327,375,000
エイチ・アイ・エス	19,800	3,925.00	77,715,000
東映	4,800	14,460.00	69,408,000
ラックランド	2,300	2,163.00	4,974,900
エヌ・ティ・ティ・データ	303,400	1,234.00	374,395,600
共立メンテナンス	17,000	5,380.00	91,460,000
イチネンホールディングス	11,600	1,193.00	13,838,800
建設技術研究所	7,700	1,478.00	11,380,600
スペース	7,200	1,316.00	9,475,200
長 大	4,500	775.00	3,487,500
アインホールディングス	15,300	8,270.00	126,531,000
燦ホールディングス	2,500	2,441.00	6,102,500
ピー・シー・エー	1,500	2,840.00	4,260,000
スバル興業	700	5,910.00	4,137,000
東京テアトル	4,400	1,295.00	5,698,000
タナベ経営	2,200	1,208.00	2,657,600
ビジネスブレイン太田昭和	2,000	1,908.00	3,816,000
ナガワ	3,100	6,160.00	19,096,000
よみうりランド	2,400	4,180.00	10,032,000
東京都競馬	7,300	3,290.00	24,017,000
常磐興産	4,500	1,614.00	7,263,000
カナモト	16,600	2,725.00	45,235,000
東京ドーム	41,500	1,044.00	43,326,000
D T S	12,700	3,905.00	49,593,500
スクウェア・エニックス・ホールディングス	53,100	3,570.00	189,567,000

シーイーシー	12,300	2,118.00	26,051,400
カブコン	48,900	2,404.00	117,555,600
西尾レントオール	11,300	3,140.00	35,482,000
アイ・エス・ビー	2,300	1,902.00	4,374,600
アゴラ・ホスピタリティー・グループ	62,200	34.00	2,114,800
日本空港ビルデング	36,600	4,425.00	161,955,000
トランス・コスモス	12,400	2,256.00	27,974,400
乃村工藝社	26,000	3,040.00	79,040,000
ジャステック	6,600	965.00	6,369,000
S C S K	30,000	5,030.00	150,900,000
藤田観光	4,400	2,705.00	11,902,000
K N T - C Tホールディングス	5,900	1,474.00	8,696,600
日本管財	11,900	1,999.00	23,788,100
トーカイ	10,800	2,695.00	29,106,000
白洋舎	1,300	2,958.00	3,845,400
セコム	117,800	9,375.00	1,104,375,000
日本システムウエア	3,800	2,157.00	8,196,600
セントラル警備保障	5,300	4,875.00	25,837,500
アイネス	14,500	1,397.00	20,256,500
丹青社	21,000	1,241.00	26,061,000
メイテック	14,000	5,000.00	70,000,000
T K C	9,700	4,230.00	41,031,000
富士ソフト	17,000	4,440.00	75,480,000
応用地質	12,000	1,148.00	13,776,000
船井総研ホールディングス	22,900	2,752.00	63,020,800
N S D	18,700	2,655.00	49,648,500
進学会ホールディングス	5,100	561.00	2,861,100
丸紅建材リース	1,100	1,941.00	2,135,100
オオバ	8,900	677.00	6,025,300
コナミホールディングス	46,500	4,755.00	221,107,500
いであ	2,300	1,050.00	2,415,000
学究社	3,800	1,300.00	4,940,000
ベネッセホールディングス	40,600	3,015.00	122,409,000
イオンディライト	13,600	3,930.00	53,448,000
ナック	7,100	989.00	7,021,900
福井コンピュータホールディングス	3,800	2,085.00	7,923,000
ニチイ学館	15,900	1,330.00	21,147,000
ダイセキ	18,600	2,617.00	48,676,200
ステップ	4,100	1,474.00	6,043,400
日鉄物産	8,100	4,555.00	36,895,500
泉州電業	3,900	2,674.00	10,428,600
元気寿司	3,300	4,555.00	15,031,500
トラスコ中山	23,800	2,955.00	70,329,000
ヤマダ電機	348,400	538.00	187,439,200
オートバックスセブン	45,500	1,879.00	85,494,500
モリト	8,400	839.00	7,047,600
アークランドサカモト	19,400	1,451.00	28,149,400
ニトリホールディングス	49,500	13,690.00	677,655,000
グルメ杵屋	8,300	1,158.00	9,611,400

愛眼	9,400	268.00	2,519,200	
ケーユーホールディングス	5,900	856.00	5,050,400	
吉野家ホールディングス	40,000	1,793.00	71,720,000	
加藤産業	17,900	3,670.00	65,693,000	
北恵	2,300	935.00	2,150,500	
イノテック	6,800	999.00	6,793,200	
イエローハット	21,500	1,393.00	29,949,500	
松屋フーズホールディングス	5,500	3,660.00	20,130,000	
JBC Cホールディングス	9,000	1,463.00	13,167,000	
J Kホールディングス	10,400	580.00	6,032,000	
サガミホールディングス	15,300	1,313.00	20,088,900	
日伝	9,500	1,597.00	15,171,500	
関西スーパーマーケット	8,600	1,042.00	8,961,200	
ミロク情報サービス	11,400	2,860.00	32,604,000	
北沢産業	9,000	275.00	2,475,000	
杉本商事	6,200	1,853.00	11,488,600	
因幡電機産業	16,200	4,450.00	72,090,000	
王将フードサービス	8,400	7,210.00	60,564,000	
プレナス	12,700	1,766.00	22,428,200	
ミニストップ	8,500	1,798.00	15,283,000	
アークス	21,400	2,362.00	50,546,800	
パローホールディングス	24,700	2,747.00	67,850,900	
東テク	3,800	2,155.00	8,189,000	
ミスミグループ本社	143,300	2,859.00	409,694,700	
藤久	900	783.00	704,700	
アルテック	8,600	228.00	1,960,800	
ベルク	5,600	4,940.00	27,664,000	
大 庄	6,100	1,505.00	9,180,500	
タキヒヨー	3,500	1,824.00	6,384,000	
ファーストリテイリング	15,300	55,500.00	849,150,000	
ソフトバンクグループ	476,300	10,940.00	5,210,722,000	
蔵王産業	1,900	1,324.00	2,515,600	
スズケン	52,200	6,470.00	337,734,000	
サンドラッグ	43,000	2,980.00	128,140,000	
サックスパー ホールディングス	9,700	1,098.00	10,650,600	
ジェコス	7,900	1,020.00	8,058,000	
ヤマザワ	2,400	1,657.00	3,976,800	
やまや	2,000	2,131.00	4,262,000	
ルネサスイーストン	10,600	418.00	4,430,800	
ベルーナ	28,100	855.00	24,025,500	
合計	135,923,501		267,473,099,534	

*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10月11日現在	平成31年4月11日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		1,179,724,600	2,177,322,246
国債証券		284,006,195,500	235,656,584,600
地方債証券		21,983,801,692	22,337,193,535
特殊債券		17,162,735,349	18,037,052,825
社債券		15,129,617,810	14,177,366,920
未収入金		-	888,223,200
未収利息		523,441,973	426,848,961
前払費用		20,345,639	9,732,026
流動資産合計		340,005,862,563	293,710,324,313
資産合計		340,005,862,563	293,710,324,313
負債の部			
流動負債			
未払解約金		530,378,000	405,308,000
流動負債合計		530,378,000	405,308,000
負債合計		530,378,000	405,308,000
純資産の部			
元本等			
元本	1	265,366,082,224	223,413,510,899
剰余金			
剰余金又は欠損金()		74,109,402,339	69,891,505,414
元本等合計		339,475,484,563	293,305,016,313
純資産合計		339,475,484,563	293,305,016,313
負債純資産合計		340,005,862,563	293,710,324,313

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10月11日現在	平成31年4月11日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額 同期中追加設定元本額 同期中一部解約元本額	270,498,995,615円 57,554,431,325円 62,687,344,716円	265,366,082,224円 58,967,815,327円 100,920,386,652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	17,218,009,424円	18,542,941,690円
M I T O ラップ型ファンド（安定型）	116,744,280円	98,053,779円
M I T O ラップ型ファンド（中立型）	91,662,889円	82,246,467円
M I T O ラップ型ファンド（積極型）	28,460,338円	23,787,325円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	822,678,821円	853,555,568円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	242,214,024円	223,136,638円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	37,278,552円	31,300,209円
たわらノーロード 国内債券	4,811,044,247円	6,631,598,844円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	117,873,280円	253,918,623円
たわらノーロード バランス（堅実型）	28,055,982円	59,891,315円
たわらノーロード バランス（標準型）	53,706,124円	113,395,722円
たわらノーロード バランス（積極型）	10,644,651円	17,126,027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）	5,244,226円	7,784,144円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（安定型）	73,873,160円	137,279,074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）	94,425,671円	170,440,817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）	26,321,104円	46,713,048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)	13,608,174円	14,598,852円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(保守型)	1,243,634円	3,041,123円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定型)	656,526円	2,859,168円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定成長型)	2,983,535円	3,635,234円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(成長型)	675,927円	711,076円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(積極型)	17,517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>	12,875,217,346円	13,252,403,826円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 1 安定型	5,953,625,902円	6,110,390,220円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 2 安定・成長型	8,557,028,547円	8,548,716,549円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 3 成長型	3,470,237,031円	3,401,223,759円
D I A M D C バランス3 0 インデックスファンド	1,836,055,699円	1,792,490,668円
D I A M D C バランス5 0 インデックスファンド	2,032,813,435円	1,973,088,952円
D I A M D C バランス7 0 インデックスファンド	315,744,242円	308,704,546円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型>	88,374,891円	87,183,872円
マネックス資産設計ファンド< 育成型>	2,317,324,650円	2,376,748,298円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	4,391,950円	2,490,772円
D I A M D C 8資産バラ ンスファンド(新興国1 0)	3,186,425,011円	3,237,341,313円
D I A M D C 8資産バラ ンスファンド(新興国2 0)	756,623,110円	798,863,206円
D I A M D C 8資産バラ ンスファンド(新興国3 0)	161,357,166円	169,080,945円
投資のソムリエ	9,687,855,915円	4,557,086,188円
クルーズコントロール	1,637,656,208円	2,654,296,497円
投資のソムリエ< D C年金>	841,937,321円	449,706,296円
D I A M 8資産バランスファ ンドN< D C年金>	2,259,771,712円	2,511,207,678円
D I A M D C バランス・F (成長型)	286,078,562円	296,038,436円
クルーズコントロール< D C年 金>	946,644円	1,907,209円
D I A Mコア資産設計ファンド (堅実型)	5,135,239円	9,016,033円
D I A Mコア資産設計ファンド (積極型)	10,773,596円	20,568,924円
投資のソムリエ< D C年金>リ スク抑制型	644,288,090円	478,675,883円

ダイナミック・ナビゲーション	515,269円	751,240円
リスク抑制世界8資産バランス	12,200,329,309円	7,290,177,041円
ファンド		
投資のソムリエ(ターゲット・	2,416,181円	1,686,598円
イヤー2045)		
投資のソムリエ(ターゲット・	1,740,009円	1,488,746円
イヤー2055)		
リスク抑制世界8資産バランス	3,821,192円	3,354,116円
ファンド(DC)		
投資のソムリエ(ターゲット・	3,490,471円	2,825,226円
イヤー2035)		
4資産分散投資・スタンダード	74,600,200円	87,919,051円
<DC年金>		
リスクコントロール世界資産分	758,397,642円	1,013,020,634円
散ファンド		
9資産分散投資・スタンダード	290,676円	61,715,605円
<DC年金>		
投資のソムリエ(ターゲット・	-円	389,686円
イヤー2040)		
投資のソムリエ(ターゲット・	-円	389,686円
イヤー2050)		
投資のソムリエ(ターゲット・	-円	389,686円
イヤー2060)		
DIAMエマージング債券ファ	9,450,010円	9,450,010円
ンド		
DIAM国内債券パッシブファ	22,706,772,840円	7,855,596,929円
ンド(適格機関投資家向け)		
DIAMワールドバランス25	451,828,315円	429,578,182円
VA(適格機関投資家限定)		
One収益追求型マルチアセッ	-円	2,650,787,553円
ト戦略ファンド(適格機関投資		
家限定)		
One収益追求型マルチアセッ	-円	2,646,517,337円
ト戦略ファンドII(適格機関		
投資家限定)		
One収益追求型マルチアセッ	-円	2,631,578,948円
ト戦略ファンドIII(適格機		
関投資家限定)		
DIAMグローバル・バランス	289,466,887円	261,696,785円
ファンド25VA(適格機関投		
資家限定)		
DIAMグローバル・バランス	236,494,470円	210,992,596円
ファンド50VA(適格機関投		
資家限定)		
DIAM国際分散バランスファ	72,823,300円	66,672,886円
ンド30VA(適格機関投資家		
限定)		
DIAM国際分散バランスファ	200,165,850円	179,266,800円
ンド50VA(適格機関投資家		
限定)		
DIAM国内重視バランスファ	83,310,095円	79,085,471円
ンド30VA(適格機関投資家		
限定)		

D I A M国内重視バランスファン ド5 0 V A (適格機関投資家 限定)	43,155,088円	34,566,256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)	95,738,566円	75,081,969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)	169,898,524円	150,807,546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)	5,671,071,527円	5,049,439,304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)	3,032,854,964円	2,729,170,354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)	5,675,200,299円	5,057,516,277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)	602,332,656円	542,211,925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)	269,865,242円	244,146,269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)	3,466,351,848円	3,102,506,498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)	923,203,788円	584,683,808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	188,050,355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)	46,910,967円	18,491,174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)	97,843,684円	68,878,786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)	59,718,393,543円	36,607,246,535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)	827,727,378円	145,726,566円
D I A M世界アセットバランス ファンド2 5 V A (適格機関投 資家限定)	7,191,254,876円	6,817,509,991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)	27,550,090,073円	26,028,568,280円
D I A Mバランス3 0 V A (適 格機関投資家限定)	53,798,122円	74,798,009円
D I A Mバランス5 0 V A (適 格機関投資家限定)	16,094,725円	1,409,737円

D I A Mバランス70VA(適格機関投資家限定)	8,024,060円	7,060,380円
D I A M世界アセットバランスファンド4VA(適格機関投資家限定)	30,758,149,462円	29,031,914,677円
D I A M世界バランス25VA(適格機関投資家限定)	469,748,503円	398,905,432円
D I A M国内バランス30VA(適格機関投資家限定)	133,450,015円	114,101,434円
D I A Mバランス20VA(適格機関投資家限定)	526,036,110円	499,031,047円
D I A Mバランス40VA(適格機関投資家限定)	737,508円	713,239円
D I A Mバランス60VA(適格機関投資家限定)	400,694円	381,909円
計	265,366,082,224円	223,413,510,899円
2. 受益権の総数	265,366,082,224口	223,413,510,899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30年4月12日 至 平成30年10月11日	自 平成30年10月12日 至 平成31年4月11日
1． 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2． 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
3． 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成30年10月11日現在	平成31年4月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成30年10月11日現在	平成31年4月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
国債証券	3,224,291,700	1,520,267,900
地方債証券	128,478,573	22,534,119
特殊債証券	142,042,634	36,313,397
社債証券	103,253,440	24,303,380
合計	3,598,066,347	1,509,743,798

(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10月11日まで及び平成31年2月15日から平成31年4月11日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成30年10月11日現在	平成31年4月11日現在
1口当たり純資産額	1.2793円	1.3128円
(1万口当たり純資産額)	(12,793円)	(13,128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31年4月11日現在

種 類	銘 柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
国債証券	390回 利付国庫債券(2年)	1,200,000,000	1,204,020,000	
	392回 利付国庫債券(2年)	800,000,000	803,056,000	
	393回 利付国庫債券(2年)	1,000,000,000	1,004,050,000	
	394回 利付国庫債券(2年)	700,000,000	702,947,000	
	395回 利付国庫債券(2年)	900,000,000	903,987,000	
	396回 利付国庫債券(2年)	700,000,000	703,262,000	
	397回 利付国庫債券(2年)	800,000,000	803,912,000	
	125回 利付国庫債券(5年)	3,000,000,000	3,011,910,000	
	126回 利付国庫債券(5年)	2,500,000,000	2,511,425,000	
	127回 利付国庫債券(5年)	1,220,000,000	1,226,392,800	
	128回 利付国庫債券(5年)	2,200,000,000	2,213,046,000	
	129回 利付国庫債券(5年)	2,120,000,000	2,134,013,200	
	130回 利付国庫債券(5年)	1,100,000,000	1,108,019,000	
	131回 利付国庫債券(5年)	2,020,000,000	2,036,382,200	
	132回 利付国庫債券(5年)	2,000,000,000	2,017,620,000	
	133回 利付国庫債券(5年)	1,470,000,000	1,484,244,300	
	134回 利付国庫債券(5年)	1,580,000,000	1,596,432,000	
	135回 利付国庫債券(5年)	2,100,000,000	2,123,310,000	
	136回 利付国庫債券(5年)	1,700,000,000	1,720,077,000	
	137回 利付国庫債券(5年)	1,400,000,000	1,417,542,000	
	138回 利付国庫債券(5年)	1,100,000,000	1,114,300,000	
	2回 利付国庫債券(40年)	460,000,000	675,947,000	
	3回 利付国庫債券(40年)	490,000,000	726,812,100	
	4回 利付国庫債券(40年)	640,000,000	958,092,800	
	5回 利付国庫債券(40年)	580,000,000	840,286,600	
	6回 利付国庫債券(40年)	580,000,000	828,814,200	
	7回 利付国庫債券(40年)	630,000,000	866,439,000	
	8回 利付国庫債券(40年)	720,000,000	924,436,800	
	9回 利付国庫債券(40年)	1,000,000,000	953,940,000	
	10回 利付国庫債券(40年)	990,000,000	1,112,720,400	
	11回 利付国庫債券(40年)	580,000,000	631,562,000	
	310回 利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,525,455,000	
	311回 利付国庫債券(10年)	1,020,000,000	1,034,361,600	
	312回 利付国庫債券(10年)	2,200,000,000	2,251,084,000	
	313回 利付国庫債券(10年)	1,790,000,000	1,841,122,400	
	314回 利付国庫債券(10年)	800,000,000	819,744,000	
	315回 利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,545,150,000	
	316回 利付国庫債券(10年)	500,000,000	513,950,000	
	317回 利付国庫債券(10年)	600,000,000	618,678,000	
	318回 利付国庫債券(10年)	1,600,000,000	1,645,872,000	

319回	利付国庫債券(10年)	800,000,000	827,456,000
320回	利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,547,430,000
321回	利付国庫債券(10年)	1,600,000,000	1,655,488,000
322回	利付国庫債券(10年)	1,000,000,000	1,031,730,000
323回	利付国庫債券(10年)	750,000,000	775,852,500
324回	利付国庫債券(10年)	850,000,000	876,571,000
325回	利付国庫債券(10年)	2,100,000,000	2,170,875,000
326回	利付国庫債券(10年)	500,000,000	516,250,000
327回	利付国庫債券(10年)	1,450,000,000	1,502,504,500
328回	利付国庫債券(10年)	2,390,000,000	2,463,420,800
329回	利付国庫債券(10年)	2,270,000,000	2,363,887,200
330回	利付国庫債券(10年)	1,450,000,000	1,513,611,500
331回	利付国庫債券(10年)	650,000,000	672,691,500
332回	利付国庫債券(10年)	2,460,000,000	2,550,749,400
333回	利付国庫債券(10年)	2,100,000,000	2,181,039,000
334回	利付国庫債券(10年)	2,120,000,000	2,206,029,600
335回	利付国庫債券(10年)	2,250,000,000	2,334,060,000
336回	利付国庫債券(10年)	850,000,000	883,226,500
337回	利付国庫債券(10年)	1,610,000,000	1,654,419,900
338回	利付国庫債券(10年)	2,060,000,000	2,131,688,000
339回	利付国庫債券(10年)	2,640,000,000	2,735,832,000
340回	利付国庫債券(10年)	2,450,000,000	2,542,585,500
341回	利付国庫債券(10年)	2,510,000,000	2,591,575,000
342回	利付国庫債券(10年)	2,600,000,000	2,650,206,000
343回	利付国庫債券(10年)	2,500,000,000	2,550,050,000
344回	利付国庫債券(10年)	2,730,000,000	2,785,528,200
345回	利付国庫債券(10年)	2,610,000,000	2,663,870,400
346回	利付国庫債券(10年)	2,370,000,000	2,418,561,300
347回	利付国庫債券(10年)	2,300,000,000	2,347,656,000
348回	利付国庫債券(10年)	2,230,000,000	2,275,715,000
349回	利付国庫債券(10年)	2,360,000,000	2,407,695,600
350回	利付国庫債券(10年)	2,850,000,000	2,906,629,500
351回	利付国庫債券(10年)	2,360,000,000	2,404,887,200
352回	利付国庫債券(10年)	2,270,000,000	2,311,064,300
353回	利付国庫債券(10年)	1,300,000,000	1,322,841,000
1回	利付国庫債券(30年)	100,000,000	129,370,000
2回	利付国庫債券(30年)	100,000,000	126,339,000
3回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	251,358,000
4回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	267,016,000
5回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	252,340,000
6回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	258,886,000
7回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	386,868,000
8回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	245,994,000
11回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	244,256,000
12回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	256,212,000
13回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	380,868,000
14回	利付国庫債券(30年)	290,000,000	386,172,700
15回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	269,998,000
16回	利付国庫債券(30年)	400,000,000	541,452,000
17回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	268,366,000

18回	利付国庫債券(30年)	420,000,000	558,377,400	
19回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	266,488,000	
20回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	410,484,000	
21回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	401,751,000	
22回	利付国庫債券(30年)	320,000,000	440,211,200	
23回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	275,754,000	
24回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	414,540,000	
25回	利付国庫債券(30年)	400,000,000	540,288,000	
26回	利付国庫債券(30年)	700,000,000	960,008,000	
27回	利付国庫債券(30年)	580,000,000	809,332,000	
28回	利付国庫債券(30年)	680,000,000	953,190,000	
29回	利付国庫債券(30年)	900,000,000	1,249,479,000	
30回	利付国庫債券(30年)	960,000,000	1,319,942,400	
31回	利付国庫債券(30年)	700,000,000	953,400,000	
32回	利付国庫債券(30年)	960,000,000	1,331,673,600	
33回	利付国庫債券(30年)	1,070,000,000	1,424,951,100	
34回	利付国庫債券(30年)	1,040,000,000	1,433,432,000	
35回	利付国庫債券(30年)	1,120,000,000	1,502,939,200	
36回	利付国庫債券(30年)	1,050,000,000	1,414,843,500	
37回	利付国庫債券(30年)	1,160,000,000	1,542,823,200	
38回	利付国庫債券(30年)	720,000,000	944,323,200	
39回	利付国庫債券(30年)	630,000,000	842,133,600	
40回	利付国庫債券(30年)	550,000,000	723,849,500	
41回	利付国庫債券(30年)	610,000,000	789,968,300	
42回	利付国庫債券(30年)	560,000,000	726,717,600	
43回	利付国庫債券(30年)	550,000,000	714,433,500	
44回	利付国庫債券(30年)	610,000,000	794,024,800	
45回	利付国庫債券(30年)	700,000,000	878,353,000	
46回	利付国庫債券(30年)	780,000,000	980,467,800	
47回	利付国庫債券(30年)	760,000,000	975,034,400	
48回	利付国庫債券(30年)	740,000,000	913,670,600	
49回	利付国庫債券(30年)	790,000,000	975,808,000	
50回	利付国庫債券(30年)	760,000,000	823,900,800	
51回	利付国庫債券(30年)	850,000,000	812,226,000	
52回	利付国庫債券(30年)	910,000,000	915,514,600	
53回	利付国庫債券(30年)	800,000,000	824,464,000	
54回	利付国庫債券(30年)	850,000,000	920,397,000	
55回	利付国庫債券(30年)	740,000,000	800,783,600	
56回	利付国庫債券(30年)	700,000,000	757,001,000	
57回	利付国庫債券(30年)	760,000,000	822,365,600	
58回	利付国庫債券(30年)	1,010,000,000	1,092,113,000	
59回	利付国庫債券(30年)	800,000,000	843,976,000	
60回	利付国庫債券(30年)	640,000,000	709,337,600	
61回	利付国庫債券(30年)	400,000,000	421,224,000	
46回	利付国庫債券(20年)	500,000,000	514,210,000	
47回	利付国庫債券(20年)	250,000,000	258,592,500	
48回	利付国庫債券(20年)	500,000,000	522,755,000	
51回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	628,710,000	
52回	利付国庫債券(20年)	550,000,000	580,706,500	
55回	利付国庫債券(20年)	410,000,000	436,346,600	

61回	利付国庫債券(20年)	500,000,000	523,390,000	
64回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	655,722,000	
72回	利付国庫債券(20年)	350,000,000	393,739,500	
73回	利付国庫債券(20年)	340,000,000	382,503,400	
75回	利付国庫債券(20年)	440,000,000	499,901,600	
78回	利付国庫債券(20年)	640,000,000	722,860,800	
81回	利付国庫債券(20年)	240,000,000	273,914,400	
83回	利付国庫債券(20年)	480,000,000	553,732,800	
85回	利付国庫債券(20年)	440,000,000	509,933,600	
88回	利付国庫債券(20年)	750,000,000	884,497,500	
90回	利付国庫債券(20年)	700,000,000	824,404,000	
92回	利付国庫債券(20年)	1,000,000,000	1,175,510,000	
93回	利付国庫債券(20年)	700,000,000	820,890,000	
94回	利付国庫債券(20年)	800,000,000	944,584,000	
95回	利付国庫債券(20年)	350,000,000	420,742,000	
97回	利付国庫債券(20年)	500,000,000	599,425,000	
99回	利付国庫債券(20年)	900,000,000	1,075,464,000	
100回	利付国庫債券(20年)	850,000,000	1,027,216,500	
102回	利付国庫債券(20年)	660,000,000	813,021,000	
105回	利付国庫債券(20年)	700,000,000	845,565,000	
106回	利付国庫債券(20年)	350,000,000	426,114,500	
107回	利付国庫債券(20年)	400,000,000	484,920,000	
108回	利付国庫債券(20年)	750,000,000	894,585,000	
109回	利付国庫債券(20年)	520,000,000	621,883,600	
110回	利付国庫債券(20年)	750,000,000	911,940,000	
111回	利付国庫債券(20年)	570,000,000	701,339,400	
112回	利付国庫債券(20年)	750,000,000	915,135,000	
113回	利付国庫債券(20年)	1,170,000,000	1,431,764,100	
114回	利付国庫債券(20年)	800,000,000	982,216,000	
115回	利付国庫債券(20年)	400,000,000	495,396,000	
116回	利付国庫債券(20年)	350,000,000	434,927,500	
117回	利付国庫債券(20年)	950,000,000	1,170,105,500	
118回	利付国庫債券(20年)	290,000,000	355,093,400	
119回	利付国庫債券(20年)	300,000,000	360,621,000	
120回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	707,808,000	
121回	利付国庫債券(20年)	730,000,000	888,176,400	
122回	利付国庫債券(20年)	500,000,000	602,625,000	
123回	利付国庫債券(20年)	680,000,000	845,450,800	
124回	利付国庫債券(20年)	500,000,000	615,820,000	
125回	利付国庫債券(20年)	610,000,000	767,898,500	
126回	利付国庫債券(20年)	450,000,000	555,772,500	
127回	利付国庫債券(20年)	450,000,000	550,417,500	
128回	利付国庫債券(20年)	850,000,000	1,042,397,500	
129回	利付国庫債券(20年)	240,000,000	291,412,800	
130回	利付国庫債券(20年)	560,000,000	681,587,200	
131回	利付国庫債券(20年)	450,000,000	542,137,500	
132回	利付国庫債券(20年)	540,000,000	651,947,400	
133回	利付国庫債券(20年)	720,000,000	878,335,200	
134回	利付国庫債券(20年)	470,000,000	574,612,600	
135回	利付国庫債券(20年)	500,000,000	604,875,000	

136回	利付国庫債券(20年)	500,000,000	598,460,000		
137回	利付国庫債券(20年)	490,000,000	593,987,800		
138回	利付国庫債券(20年)	250,000,000	296,525,000		
139回	利付国庫債券(20年)	430,000,000	515,638,800		
140回	利付国庫債券(20年)	940,000,000	1,141,742,800		
141回	利付国庫債券(20年)	900,000,000	1,095,210,000		
142回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	738,252,000		
143回	利付国庫債券(20年)	760,000,000	916,066,000		
144回	利付国庫債券(20年)	510,000,000	607,721,100		
145回	利付国庫債券(20年)	1,200,000,000	1,465,536,000		
146回	利付国庫債券(20年)	1,100,000,000	1,345,751,000		
147回	利付国庫債券(20年)	1,280,000,000	1,550,105,600		
148回	利付国庫債券(20年)	1,080,000,000	1,293,948,000		
149回	利付国庫債券(20年)	1,250,000,000	1,499,487,500		
150回	利付国庫債券(20年)	1,260,000,000	1,494,297,000		
151回	利付国庫債券(20年)	1,160,000,000	1,341,563,200		
152回	利付国庫債券(20年)	1,140,000,000	1,319,116,800		
153回	利付国庫債券(20年)	1,110,000,000	1,302,485,100		
154回	利付国庫債券(20年)	1,150,000,000	1,331,987,500		
155回	利付国庫債券(20年)	1,180,000,000	1,329,246,400		
156回	利付国庫債券(20年)	1,020,000,000	1,047,407,400		
157回	利付国庫債券(20年)	1,100,000,000	1,090,925,000		
158回	利付国庫債券(20年)	980,000,000	1,020,091,800		
159回	利付国庫債券(20年)	1,120,000,000	1,183,392,000		
160回	利付国庫債券(20年)	1,050,000,000	1,127,238,000		
161回	利付国庫債券(20年)	950,000,000	1,002,611,000		
162回	利付国庫債券(20年)	950,000,000	1,001,547,000		
163回	利付国庫債券(20年)	960,000,000	1,010,966,400		
164回	利付国庫債券(20年)	1,210,000,000	1,251,115,800		
165回	利付国庫債券(20年)	1,120,000,000	1,156,444,800		
166回	利付国庫債券(20年)	880,000,000	940,341,600		
167回	利付国庫債券(20年)	750,000,000	772,140,000		
国債証券 合計		212,830,000,000	235,656,584,600		
地方債証券	685回	東京都公募公債	500,000,000	506,685,000	
	688回	東京都公募公債	200,000,000	202,690,000	
	697回	東京都公募公債	500,000,000	512,020,000	
	701回	東京都公募公債	700,000,000	716,709,000	
	708回	東京都公募公債	500,000,000	514,040,000	
	720回	東京都公募公債	300,000,000	310,812,000	
	726回	東京都公募公債	400,000,000	413,512,000	
	5回	東京都公募公債 20年	100,000,000	112,393,000	
	9回	東京都公募公債 20年	200,000,000	234,666,000	
	10回	東京都公募公債 20年	300,000,000	351,351,000	
	22年度12回	北海道公募公債	200,000,000	204,532,000	
	30年度14回	北海道公募公債	300,000,000	302,886,000	
	194回	神奈川県公募公債	300,000,000	308,649,000	
	208回	神奈川県公募公債	300,000,000	308,262,000	
	345回	大阪府公募公債	300,000,000	306,294,000	
	356回	大阪府公募公債	200,000,000	205,584,000	
	364回	大阪府公募公債	300,000,000	307,887,000	

374回 大阪府公募公債	300,000,000	311,685,000	
26年度11回 京都府公募公債	350,000,000	359,072,000	
26年度17回 兵庫県公募公債	200,000,000	205,046,000	
1回 兵庫県公募公債(12年)	300,000,000	316,692,000	
22年度8回 静岡県公募公債	200,000,000	202,894,000	
23年度9回 静岡県公募公債	200,000,000	205,434,000	
8回 静岡県公募公債 15年	200,000,000	214,876,000	
1回 静岡県公募公債 20年	100,000,000	113,888,000	
22年度6回 愛知県公募公債	200,000,000	203,056,000	
23年度20回 愛知県公募公債	500,000,000	515,885,000	
25年度4回 愛知県公募公債	300,000,000	310,488,000	
22年度1回 広島県公募公債	200,000,000	203,078,000	
23年度2回 埼玉県公募公債	200,000,000	205,002,000	
26年度5回 埼玉県公募公債	400,000,000	412,512,000	
14回 埼玉県公募公債 20年	300,000,000	354,150,000	
25年度11回 福岡県公募公債	200,000,000	206,672,000	
24年度2回 福岡県公募公債(20年)	300,000,000	354,375,000	
24年度7回 千葉県公募公債	300,000,000	308,097,000	
25年度5回 千葉県公募公債	200,000,000	207,254,000	
94回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,204,000	
99回 共同発行市場公募地方債	700,000,000	717,899,000	
106回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	308,040,000	
109回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	515,790,000	
111回 共同発行市場公募地方債	700,000,000	719,719,000	
119回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	515,295,000	
121回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	511,300,000	
126回 共同発行市場公募地方債	793,900,000	822,202,535	
127回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	515,200,000	
128回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	309,009,000	
137回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	514,360,000	
139回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	514,210,000	
142回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	509,100,000	
144回 共同発行市場公募地方債	400,000,000	410,456,000	
146回 共同発行市場公募地方債	400,000,000	412,768,000	
148回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	516,395,000	
166回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	505,240,000	
29年度4回 大阪市公募公債	200,000,000	202,192,000	
488回 名古屋市公募公債 10年	450,000,000	464,143,500	
4回 京都市公募公債 20年	100,000,000	118,453,000	
30年度7回 神戸市公募公債 30年	300,000,000	305,463,000	
22年度3回 横浜市公募公債	200,000,000	203,346,000	
22年度5回 横浜市公募公債	200,000,000	204,188,000	
23年度4回 横浜市公募公債	450,000,000	462,064,500	
25年度2回 横浜市公募公債	400,000,000	414,948,000	
25年度4回 札幌市公募公債	200,000,000	206,620,000	
2回 川崎市公募公債 15年	100,000,000	101,948,000	
23年度1回 千葉市公募公債	200,000,000	205,512,000	
地方債証券 合計	21,543,900,000	22,337,193,535	
特殊債券			
78回 日本政策投資銀行債券	200,000,000	202,568,000	
19回 高速道路機構債	150,000,000	228,720,000	

26回 高速道路機構債	200,000,000	278,892,000	
96回 高速道路機構債	700,000,000	718,445,000	
116回 高速道路機構債	100,000,000	103,070,000	
172回 高速道路機構債	200,000,000	195,584,000	
9回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	103,807,000	
18回政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	316,089,000	
121回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	595,405,000	
149回政保日本高速道路保有・債務返済機構	400,000,000	411,044,000	
180回政保日本高速道路保有・債務返済機構	1,000,000,000	1,028,980,000	
189回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	511,875,000	
193回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	519,590,000	
195回政保日本高速道路保有・債務返済機構	330,000,000	343,602,600	
239回政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	341,475,000	
241回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	514,810,000	
260回政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	240,914,000	
309回政保日本高速道路保有・債務返済機構	800,000,000	811,776,000	
319回政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	209,094,000	
28回 日本道路・機構承継債	400,000,000	543,520,000	
1回 地方公共団体金融機構債券 20年	200,000,000	237,474,000	
15回 政保地方公共団体金融機構債券	200,000,000	202,820,000	
20回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	306,645,000	
24回 地方公共団体金融機構債券	300,000,000	307,518,000	
19回 地方公共団体金融機構債券	200,000,000	239,766,000	
36回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	308,826,000	
24回 地方公共団体金融機構債券 20年	200,000,000	237,848,000	
44回 政保地方公共団体金融機構債券	400,000,000	413,304,000	
50回 政保地方公共団体金融機構債券	500,000,000	520,385,000	
56回 政保地方公共団体金融機構債券	542,000,000	562,541,800	
64回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	309,606,000	
44回 地方公共団体金融機構債券 20年	200,000,000	228,938,000	
83回 地方公共団体金融機構債券 10年	400,000,000	401,120,000	
15回 日本政策金融公庫債券	200,000,000	238,904,000	
39回 住宅金融支援機構債券	200,000,000	241,268,000	
75回 住宅金融支援機構債券	350,000,000	426,832,000	
222回 住宅金融支援機構債券	300,000,000	303,075,000	
230回 住宅金融支援機構債券	300,000,000	304,614,000	

6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	41,820,000	43,756,266	
8回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	29,398,000	30,830,270	
9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	44,061,000	46,278,590	
2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	46,878,000	49,636,770	
13回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	16,167,000	16,609,167	
14回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	81,300,000	83,187,786	
43回貸付債権担保住宅金融公庫債券	15,655,000	16,573,948	
44回貸付債権担保住宅金融公庫債券	59,388,000	62,700,068	
51回貸付債権担保住宅金融公庫債券	44,175,000	46,448,687	
1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	74,970,000	78,399,877	
29回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	156,600,000	169,240,752	
36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	270,552,000	288,860,253	
126回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	282,813,000	286,789,350	
128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	284,214,000	287,999,730	
131回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	288,207,000	291,613,606	
132回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	288,648,000	292,056,932	
137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	294,213,000	299,176,373	
い第783号 利付商工債	300,000,000	300,804,000	
325回 利附信金中金債	400,000,000	399,948,000	
220号 利附商工債(3年)	300,000,000	300,252,000	
15回 国際協力機構債	100,000,000	119,170,000	
55回 鉄道建設運輸施設債	500,000,000	515,975,000	
特殊債券 合計	16,891,059,000	18,037,052,825	
社債券			
1回 B P C E S A円貨社債(ソーシャルボンド)	200,000,000	199,328,000	
6回 クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	200,000,000	205,488,000	
337回 東京交通債	200,000,000	208,538,000	
27回 ラボバンク・ネダーランド円貨社債	200,000,000	200,604,000	
22回 中日本高速道路債券	300,000,000	304,227,000	
34回 政保西日本高速道路債券	200,000,000	203,662,000	
9回 日本たばこ産業社債	200,000,000	200,482,000	
19回 三菱ケミカルホールディングス社債	100,000,000	101,232,000	
6回 J Xホールディングス社債	100,000,000	103,909,000	
23回 ジェイ エフ イー ホールディングス社債	100,000,000	99,888,000	
13回 パナソニック社債	100,000,000	101,262,000	
14回 トヨタ自動車社債	200,000,000	206,894,000	
16回 トヨタ自動車社債	200,000,000	205,202,000	
94回 丸紅社債	100,000,000	103,443,000	
45回 住友商事社債	100,000,000	102,986,000	

47回	住友商事社債	100,000,000	103,114,000	
48回	クレディセゾン社債	100,000,000	103,499,000	
57回	東京三菱銀行社債	200,000,000	214,902,000	
25回	三菱東京UFJ銀行劣後社債	200,000,000	203,846,000	
28回	三菱東京UFJ銀行劣後社債	200,000,000	205,054,000	
32回	三菱東京UFJ銀行劣後社債	300,000,000	309,633,000	
7回	三菱UFJ信託銀行劣後債	200,000,000	203,448,000	
9回	三菱UFJ信託銀行劣後債	100,000,000	103,161,000	
12回	住友信託銀行劣後債	100,000,000	102,015,000	
10回	三井住友信託銀行社債	200,000,000	204,944,000	
10回	セブン銀行社債	100,000,000	102,714,000	
22回	三井住友銀行劣後社債	200,000,000	203,860,000	
23回	三井住友銀行劣後社債	400,000,000	410,120,000	
15回	トヨタファイナンス社債	200,000,000	204,804,000	
47回	日立キャピタル社債	200,000,000	205,380,000	
14回	大和証券グループ本社社債	100,000,000	101,227,000	
26回	野村ホールディングス社債	100,000,000	102,116,000	
42回	野村ホールディングス社債	200,000,000	202,716,000	
72回	三菱地所社債	100,000,000	111,586,000	
108回	住友不動産社債	200,000,000	200,938,000	
15回	東日本旅客鉄道社債	300,000,000	310,869,000	
19回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	106,728,000	
21回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	106,883,000	
39回	東日本旅客鉄道社債	300,000,000	335,790,000	
42回	東日本旅客鉄道社債	200,000,000	225,496,000	
9回	西日本旅客鉄道社債	200,000,000	213,342,000	
10回	西日本旅客鉄道社債	300,000,000	326,469,000	
6回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	106,749,000	
11回	東海旅客鉄道社債	300,000,000	312,336,000	
13回	東海旅客鉄道社債	200,000,000	218,246,000	
14回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	110,452,000	
4回	東京地下鉄社債	120,000,000	139,233,600	
60回	日本電信電話社債	300,000,000	306,372,000	
496回	中部電力社債	500,000,000	507,520,000	
518回	中部電力社債	200,000,000	200,188,000	
377回	中国電力社債	400,000,000	415,876,000	
379回	中国電力社債	300,000,000	302,946,000	
260回	北陸電力社債	100,000,000	102,559,000	
301回	北陸電力社債	100,000,000	103,795,000	
307回	北陸電力社債	100,000,000	105,251,000	
471回	東北電力社債	400,000,000	417,176,000	
473回	東北電力社債	300,000,000	303,117,000	
253回	四国電力社債	200,000,000	206,792,000	
424回	九州電力社債	200,000,000	209,030,000	
426回	九州電力社債	400,000,000	415,268,000	
320回	北海道電力社債	200,000,000	202,236,000	
321回	北海道電力社債	161,000,000	165,688,320	
340回	北海道電力社債	300,000,000	301,323,000	
13回	電源開発社債	200,000,000	221,276,000	
38回	電源開発社債	300,000,000	310,188,000	

	23回 東京瓦斯社債	300,000,000	312,024,000	
	18回 大阪ガス社債	100,000,000	105,292,000	
	27回 NTTデータ社債	100,000,000	103,382,000	
	7回 ファーストリテイリング社債	200,000,000	201,252,000	
社債券	合計	13,681,000,000	14,177,366,920	
合計		264,945,959,000	290,208,197,880	

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10月11日現在	平成31年4月11日現在
資産の部			
流動資産			
預金		10,061,478,612	7,061,920,256
コール・ローン		154,222,369	156,581,174
株式		296,696,112,569	351,329,769,011
投資信託受益証券		703,250,786	825,455,982
投資証券		6,482,474,457	8,679,754,968
派生商品評価勘定		234,013	134,447,417
未収入金		13,053,564	18,294,211
未収配当金		331,659,889	621,560,460
差入委託証拠金		2,833,462,520	1,909,310,966
流動資産合計		317,275,948,779	370,737,094,445
資産合計		317,275,948,779	370,737,094,445
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		546,002,448	1,057,818
未払解約金		161,743,000	193,072,000
流動負債合計		707,745,448	194,129,818
負債合計		707,745,448	194,129,818
純資産の部			
元本等			
元本	1	89,733,368,409	101,222,657,435
剰余金			
剰余金又は欠損金()		226,834,834,922	269,320,307,192
元本等合計		316,568,203,331	370,542,964,627
純資産合計		316,568,203,331	370,542,964,627
負債純資産合計		317,275,948,779	370,737,094,445

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</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10月11日現在	平成31年4月11日現在
<p>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</p> <p>同期中追加設定元本額</p> <p>同期中一部解約元本額</p> <p>元本の内訳</p> <p>ファンド名</p>	<p>89,487,416,345円</p> <p>11,043,162,608円</p> <p>10,797,210,544円</p>	<p>89,733,368,409円</p> <p>26,443,107,224円</p> <p>14,953,818,198円</p>

D I A M外国株式パッシブ・ ファンド	2,638,827,677円	2,464,432,769円
M I T O ラップ型ファンド (安定型)	2,913,395円	2,983,123円
M I T O ラップ型ファンド (中立型)	8,722,459円	7,633,761円
M I T O ラップ型ファンド (積極型)	17,210,299円	11,831,701円
グローバル8資産ラップファン ド(安定型)	20,527,857円	26,003,896円
グローバル8資産ラップファン ド(中立型)	23,048,530円	20,709,909円
グローバル8資産ラップファン ド(積極型)	22,541,548円	15,567,979円
たわらノーロード 先進国株式	7,704,483,687円	9,051,497,992円
たわらノーロード 先進国株式 <ラップ向け>	424,170円	423,862円
たわらノーロード 先進国株式 <為替ヘッジあり>	911,021,956円	1,138,660,341円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	41,745,330円	94,649,227円
たわらノーロード バランス (堅実型)	3,180,770円	7,358,152円
たわらノーロード バランス (標準型)	29,341,088円	66,266,603円
たわらノーロード バランス (積極型)	56,849,736円	99,238,837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)	200,628円	338,089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)	13,473,000円	23,615,343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)	39,600,653円	67,056,920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)	28,891,613円	52,203,830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)	71,164,065円	127,929,050円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(保守型)	14,928円	39,745円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定型)	61,466円	258,526円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定成長型)	641,442円	813,052円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(成長型)	555,237円	687,287円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(積極型)	1,823,220円	2,215,533円
D I A M外国株式インデックス ファンド<DC年金>	39,507,511,136円	40,508,147,492円
D I A Mバランス・ファンド< DC年金>1安定型	158,416,607円	171,738,457円

D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 2 安定・成長型	838,916,152円	883,769,307円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 3 成長型	1,056,140,169円	1,087,746,742円
D I A M D C バランス3 0 インデックスファンド	123,352,569円	127,447,207円
D I A M D C バランス5 0 インデックスファンド	357,204,541円	360,157,922円
D I A M D C バランス7 0 インデックスファンド	318,410,977円	319,459,047円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型>	30,441,363円	29,147,086円
マネックス資産設計ファンド< 育成型>	796,380,003円	793,874,061円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	209,146,305円	200,950,172円
D I A M D C 8 資産バラン スファンド(新興国1 0)	196,337,172円	210,522,133円
D I A M D C 8 資産バラン スファンド(新興国2 0)	124,912,903円	142,329,955円
D I A M D C 8 資産バラン スファンド(新興国3 0)	221,831,396円	249,403,292円
投資のソムリエ	2,561,519,510円	1,814,508,893円
クルーズコントロール	297,492,300円	538,564,304円
投資のソムリエ< D C年金>	222,689,229円	178,936,611円
D I A M 8 資産バラン スファンドN< D C年金>	135,266,314円	161,531,099円
D I A M D C バランス・F (成長型)	84,492,319円	93,327,739円
クルーズコントロール< D C年 金>	171,899円	386,935円
D I A Mコア資産設計ファンド (堅実型)	1,867,184円	3,632,855円
D I A Mコア資産設計ファンド (積極型)	3,890,801円	8,330,426円
投資のソムリエ< D C年金>リ スク抑制型	70,852,416円	71,221,054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	1,428,890円	1,499,638円
ワールドアセットバランス(基 本コース)	1,340,930,384円	1,084,088,064円
ワールドアセットバランス(リ スク抑制コース)	609,630,220円	538,208,747円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2 0 4 5)	2,331,660,543円	2,099,313,588円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2 0 5 5)	1,288,905円	1,460,617円
リスク抑制世界8 資産バラン スファンド(D C)	928,926円	1,291,637円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2 0 3 5)	419,590円	492,897円
	1,765,184円	1,207,534円

4資産分散投資・スタンダード <DC年金>	4,985,423円	6,029,076円
リスクコントロール世界資産分 散ファンド	225,974,073円	155,880,500円
9資産分散投資・スタンダード <DC年金>	13,989円	2,938,608円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2040)	-円	334,672円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2050)	-円	334,672円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2060)	-円	334,672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)	91,118,948円	88,543,691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)	2,865,678,103円	2,365,730,642円
DIAM先進国株式パッシブ ファンド(適格機関投資家限 定)	158,341,575円	12,396,554,671円
外国株式パッシブ・ファンド2 (適格機関投資家限定)	206,237,678円	206,133,975円
DIAMワールドバランス25 VA(適格機関投資家限定)	20,111,940円	20,682,097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)	82,409,794円	80,564,707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)	202,104,662円	195,036,692円
DIAM国際分散バランスファ ンド30VA(適格機関投資家 限定)	10,658,870円	10,550,883円
DIAM国際分散バランスファ ンド50VA(適格機関投資家 限定)	68,391,773円	66,247,792円
DIAM国内重視バランスファ ンド30VA(適格機関投資家 限定)	5,688,290円	5,840,568円
DIAM国内重視バランスファ ンド50VA(適格機関投資家 限定)	7,362,707円	6,385,786円
DIAM世界バランスファンド 40VA(適格機関投資家限 定)	21,802,018円	18,487,694円
DIAM世界バランスファンド 50VA(適格機関投資家限 定)	58,081,886円	55,730,669円
DIAMバランスファンド25 VA(適格機関投資家限定)	484,016,743円	466,013,880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)	604,294,941円	588,012,041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)	1,938,940,345円	1,868,434,980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)	684,969,447円	667,491,649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)	110,822,092円	108,139,533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)	789,140,244円	763,956,210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)	104,542,172円	71,913,462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 55 V A (適格機関投資家限 定)	24,066,858円	10,238,600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)	17,108,371円	12,605,625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)	5,096,391,761円	3,379,561,600円
D I A M世界アセットバランス ファンド40 V A (適格機関投 資家限定)	282,718,187円	53,835,275円
D I A M世界アセットバランス ファンド25 V A (適格機関投 資家限定)	1,227,955,973円	1,258,827,447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)	4,705,921,543円	4,806,575,151円
D I A Mバランス30 V A (適 格機関投資家限定)	11,502,672円	17,233,157円
D I A Mバランス50 V A (適 格機関投資家限定)	8,825,591円	833,729円
D I A Mバランス70 V A (適 格機関投資家限定)	10,114,789円	9,579,558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)	6,303,374,003円	6,433,560,646円
D I A Mバランス20 V A (適 格機関投資家限定)	53,919,416円	55,155,631円
D I A Mバランス40 V A (適 格機関投資家限定)	217,282円	226,151円
D I A Mバランス60 V A (適 格機関投資家限定)	248,614円	255,030円
計	89,733,368,409円	101,222,657,435円

2 . 受益権の総数	89,733,368,409口	101,222,657,435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30年4月12日 至 平成30年10月11日	自 平成30年10月12日 至 平成31年4月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。</p> <p>また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。</p>	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成30年10月11日現在	平成31年4月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成30年10月11日現在	平成31年4月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
株式	3,938,435,381	16,983,859,477
投資信託受益証券	50,242,662	20,413,057
投資証券	241,340,293	397,817,241
合計	4,230,018,336	17,402,089,775

(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10月11日まで及び平成31年2月16日から平成31年4月11日まで）に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	平成30年10月11日 現在				平成31年4月11日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	359,455,591	-	359,226,120	229,471	807,490,842	-	807,499,530	8,688
アメリカ・ドル	253,511,280	-	253,398,810	112,470	571,936,830	-	571,909,630	27,200
イギリス・ポンド	18,254,184	-	18,254,430	246	45,958,884	-	45,975,160	16,276
オーストラリア・ドル	4,074,633	-	4,050,390	24,243	17,030,334	-	17,032,260	1,926
カナダ・ドル	15,016,662	-	14,979,960	36,702	35,319,616	-	35,319,440	176
ユーロ	68,598,832	-	68,542,530	56,302	137,245,178	-	137,263,040	17,862
合計	359,455,591	-	359,226,120	229,471	807,490,842	-	807,499,530	8,688

(注) 時価の算定方法

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

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

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

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

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10月11日 現在				平成31年4月11日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								
先物取引								
買 建	12,819,785,070	-	12,273,787,164	545,997,906	8,703,739,547	-	8,837,137,834	133,398,287
合計	12,819,785,070	-	12,273,787,164	545,997,906	8,703,739,547	-	8,837,137,834	133,398,287

(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10月11日現在	平成31年4月11日現在
1口当たり純資産額	3.5279円	3.6607円
(1万口当たり純資産額)	(35,279円)	(36,607円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

平成31年4月11日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	AMAZON.COM INC	36,117	1,847.330	66,720,017.610	
	ABBOTT LABORATORIES	151,129	78.970	11,934,657.130	
	AES CORP	55,631	18.060	1,004,695.860	
	ABIOMED INC	3,560	280.540	998,722.400	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	78,672	143.020	11,251,669.440	
	ADVANCED MICRO DEVICES	83,961	27.830	2,336,634.630	
	ADOBE INC	42,194	271.580	11,459,046.520	
	CHUBB LTD	40,560	137.410	5,573,349.600	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	19,465	193.040	3,757,523.600	
	ALLEGHANY CORP	1,325	617.630	818,359.750	
	RALPH LAUREN CORP	4,893	126.460	618,768.780	
	ALLSTATE CORP	30,651	95.000	2,911,845.000	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	63,714	159.970	10,192,328.580	
	AMGEN INC	54,747	193.890	10,614,895.830	
	HESS CORP	23,734	63.360	1,503,786.240	
	AMERICAN EXPRESS CO	62,653	110.160	6,901,854.480	
	AMERICAN ELECTRIC POWER	42,628	83.350	3,553,043.800	
	AFLAC INC	66,664	49.210	3,280,535.440	
	AMERICAN INTL GROUP	77,910	44.880	3,496,600.800	
	AMERCO	551	370.480	204,134.480	
	ANALOG DEVICES	31,340	112.070	3,512,273.800	
	ANADARKO PETROLEUM CORP	42,877	46.800	2,006,643.600	
	ALEXION PHARMACEUTICALS INC	19,482	141.300	2,752,806.600	
	JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	81,035	35.820	2,902,673.700	
	JONES LANG LASALLE INC	4,087	154.450	631,237.150	
	VALERO ENERGY CORP	37,219	88.430	3,291,276.170	
	APACHE CORP	31,470	35.720	1,124,108.400	
	ANSYS INC	7,633	187.920	1,434,393.360	
	APPLE INC	412,475	200.620	82,750,734.500	
	APPLIED MATERIALS INC	87,137	42.170	3,674,567.290	
	ALBEMARLE CORP	9,826	85.550	840,614.300	
	ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	49,679	43.240	2,148,119.960	
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	9,600	94.120	903,552.000		
AMEREN CORP	22,070	71.500	1,578,005.000		
ARROW ELECTRONICS INC	8,346	83.060	693,218.760		

AUTOLIV INC	8,154	80.260	654,440.040	
AUTODESK INC	19,295	170.460	3,289,025.700	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	38,501	160.420	6,176,330.420	
AUTOZONE INC	2,231	1,060.170	2,365,239.270	
AVERY DENNISON CORP	8,042	113.760	914,857.920	
BALL CORP	27,803	58.250	1,619,524.750	
BERKSHIRE HATHAWAY INC- CL B	113,163	204.520	23,144,096.760	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	86,363	51.290	4,429,558.270	
BAXTER INTERNATIONAL INC	44,971	80.160	3,604,875.360	
BECTON DICKINSON & CO	22,845	252.230	5,762,194.350	
AMETEK INC	19,925	84.040	1,674,497.000	
VERIZON COMM INC	358,767	58.610	21,027,333.870	
WR BERKLEY CORP	12,201	56.870	693,870.870	
BEST BUY CO INC	20,918	74.490	1,558,181.820	
YUM! BRANDS INC	27,859	100.040	2,787,014.360	
FIRSTENERGY CORP	46,146	40.830	1,884,141.180	
H&R BLOCK INC	16,114	25.070	403,977.980	
BOEING CO	46,850	364.940	17,097,439.000	
ROBERT HALF INTL INC	10,827	65.600	710,251.200	
BORGWARNER INC	17,210	42.780	736,243.800	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	119,820	38.360	4,596,295.200	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	11,755	88.330	1,038,319.150	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	10,153	95.330	967,885.490	
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	2,142	737.970	1,580,731.740	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	142,627	45.890	6,545,153.030	
AFFILIATED MANAGERS GROUP INC	5,215	110.510	576,309.650	
INGREDION INC	5,305	94.260	500,049.300	
ONEOK INC	35,019	69.810	2,444,676.390	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	5,900	96.820	571,238.000	
UNITED RENTALS INC	7,693	121.190	932,314.670	
SEMPRA ENERGY	24,422	127.430	3,112,095.460	
FEDEX CORP	21,525	191.000	4,111,275.000	
VERISIGN INC	9,648	188.970	1,823,182.560	
AMPHENOL CORP	26,886	101.870	2,738,876.820	
BROWN-FORMAN CORP	23,558	53.010	1,248,809.580	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	153,241	5.990	917,913.590	
CSX CORP	71,027	75.070	5,331,996.890	
CABOT OIL & GAS CORP	38,255	27.150	1,038,623.250	
CAMPBELL SOUP CO	14,050	39.130	549,776.500	
SEAGATE TECHNOLOGY	24,337	49.710	1,209,792.270	
CONSTELLATION BRANDS INC	14,553	190.100	2,766,525.300	

CARDINAL HEALTH INC	26,919	46.940	1,263,577.860	
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	35,448	52.270	1,852,866.960	
CATERPILLAR INC	50,777	137.530	6,983,360.810	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	11,232	125.550	1,410,177.600	
CELGENE CORP	60,871	94.330	5,741,961.430	
CITRIX SYSTEMS INC	12,526	101.560	1,272,140.560	
CENTURYLINK INC	80,424	12.550	1,009,321.200	
CERNER CORP	26,414	63.710	1,682,835.940	
JPMORGAN CHASE & CO	288,360	105.340	30,375,842.400	
CHURCH & DWIGHT CO INC	22,243	73.220	1,628,632.460	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	14,286	86.050	1,229,310.300	
CINTAS CORP	7,944	204.970	1,628,281.680	
CISCO SYSTEMS INC	389,909	55.820	21,764,720.380	
CLOROX COMPANY	10,885	153.790	1,674,004.150	
COCA-COLA CO/THE	349,868	46.640	16,317,843.520	
COPART INC	18,944	64.270	1,217,530.880	
COGNEX CORP	15,291	53.730	821,585.430	
COLGATE-PALMOLIVE CO	71,000	68.110	4,835,810.000	
MARRIOTT INTERNATIONAL- CL A	24,199	132.750	3,212,417.250	
COMERICA INC	14,931	77.470	1,156,704.570	
NRG ENERGY, INC.	25,631	42.260	1,083,166.060	
COMCAST CORP-CL A	392,285	41.080	16,115,067.800	
CONAGRA BRANDS INC	40,573	29.390	1,192,440.470	
CONSOLIDATED EDISON INC	26,733	83.870	2,242,096.710	
CMS ENERGY CORP	23,616	54.390	1,284,474.240	
COOPER COS INC	4,484	291.680	1,307,893.120	
MOLSON COORS BREWING CO	16,200	59.400	962,280.000	
CORNING INC	68,691	34.400	2,362,970.400	
SEALED AIR CORP	13,870	46.440	644,122.800	
CUMMINS INC	13,193	162.540	2,144,390.220	
DR HORTON INC	32,152	43.930	1,412,437.360	
DANAHER CORP	55,286	131.500	7,270,109.000	
MOODY'S CORP	14,503	185.280	2,687,115.840	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	50,331	74.600	3,754,692.600	
TARGET CORP	43,650	80.750	3,524,737.500	
DEERE & CO	26,237	158.630	4,161,975.310	
MORGAN STANLEY	113,217	44.450	5,032,495.650	
REPUBLIC SERVICES INC	19,891	79.650	1,584,318.150	
COSTAR GROUP INC	2,994	478.670	1,433,137.980	
THE WALT DISNEY CO	155,657	117.160	18,236,774.120	
DOLLAR TREE INC	20,078	103.430	2,076,667.540	
DOVER CORP	12,635	95.180	1,202,599.300	
OMNICOM GROUP	19,325	75.190	1,453,046.750	
DTE ENERGY CO	16,034	123.010	1,972,342.340	

DUKE ENERGY CORP	60,456	89.940	5,437,412.640	
FLOWERVE CORP	13,139	47.810	628,175.590	
DARDEN RESTAURANTS INC	10,990	117.010	1,285,939.900	
EBAY INC	78,621	37.720	2,965,584.120	
BANK OF AMERICA CORP	808,577	29.070	23,505,333.390	
CITIGROUP INC	211,049	65.520	13,827,930.480	
EASTMAN CHEMICAL CO	13,009	81.630	1,061,924.670	
E*TRADE FINANCIAL CORP	21,624	48.040	1,038,816.960	
EATON CORP PLC	38,409	82.420	3,165,669.780	
EATON VANCE CORP	9,184	41.390	380,125.760	
CADENCE DESIGN SYS INC	24,922	64.470	1,606,721.340	
DISH NETWORK CORP	21,762	34.610	753,182.820	
ECOLAB INC	22,192	182.580	4,051,815.360	
ELECTRONIC ARTS INC	27,214	99.630	2,711,330.820	
SALESFORCE.COM INC	66,024	160.240	10,579,685.760	
EMERSON ELECTRIC CO	54,324	71.130	3,864,066.120	
ATMOS ENERGY CORP	10,220	100.430	1,026,394.600	
ENERGY CORP	16,259	94.590	1,537,938.810	
EOG RESOURCES INC	50,726	98.730	5,008,177.980	
EQUIFAX INC	10,231	123.120	1,259,640.720	
ESTEE LAUDER COS INC/THE	19,424	166.520	3,234,484.480	
EXPEDITORS INTERNATIONAL	14,792	77.800	1,150,817.600	
EXXON MOBIL CORP	367,491	81.560	29,972,565.960	
FMC CORP	12,634	80.420	1,016,026.280	
NEXTERA ENERGY INC	40,856	188.620	7,706,258.720	
ASSURANT INC	4,089	94.470	386,287.830	
FASTENAL CO	25,418	65.190	1,656,999.420	
FIFTH THIRD BANCORP	60,050	26.720	1,604,536.000	
M&T BANK CORP	11,572	163.050	1,886,814.600	
FISERV INC	33,890	86.750	2,939,957.500	
FLIR SYSTEMS INC	11,623	48.760	566,737.480	
MACY'S INC	24,741	24.760	612,587.160	
FORD MOTOR CO	324,391	9.330	3,026,568.030	
FRANKLIN RESOURCES INC	28,548	34.980	998,609.040	
FREEMPORT-MCMORAN INC	117,269	13.490	1,581,958.810	
FLEX LTD	50,680	11.080	561,534.400	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	16,478	78.600	1,295,170.800	
GAP INC/THE	18,295	25.900	473,840.500	
DENTSPLY SIRONA INC	21,295	50.610	1,077,739.950	
GENERAL DYNAMICS CORP	22,143	169.370	3,750,359.910	
GENERAL MILLS INC	52,709	51.550	2,717,148.950	
GENUINE PARTS CO	13,432	112.770	1,514,726.640	
GILEAD SCIENCES INC	113,377	67.400	7,641,609.800	
GARTNER INC	8,412	157.280	1,323,039.360	
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	18,097	19.520	353,253.440	
MCKESSON CORP	16,848	115.270	1,942,068.960	
NVIDIA CORP	50,490	192.100	9,699,129.000	
GENERAL ELECTRIC CO	761,066	9.160	6,971,364.560	

WW GRAINGER INC	4,331	303.170	1,313,029.270	
HALLIBURTON CO	74,684	31.040	2,318,191.360	
MONSTER BEVERAGE CORP	36,373	54.970	1,999,423.810	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	29,527	202.980	5,993,390.460	
HARLEY-DAVIDSON INC	12,901	39.330	507,396.330	
HARRIS CORP	10,033	162.690	1,632,268.770	
HASBRO INC	10,927	85.600	935,351.200	
HENRY SCHEIN INC	13,800	61.840	853,392.000	
HELMERICH & PAYNE INC	10,055	59.480	598,071.400	
HERSHEY FOODS CORP	12,135	116.310	1,411,421.850	
HP INC	137,654	19.970	2,748,950.380	
F5 NETWORKS INC	4,874	168.150	819,563.100	
CROWN HOLDINGS INC NPR	10,472	56.270	589,259.440	
UNITED THERAPEUTICS CORP	3,447	110.810	381,962.070	
JUNIPER NETWORKS INC	27,740	27.490	762,572.600	
HOLLYFRONTIER CORP	15,339	50.040	767,563.560	
HOLOGIC INC	26,761	47.560	1,272,753.160	
UNUM GROUP	20,720	35.380	733,073.600	
HOME DEPOT INC	97,969	199.430	19,537,957.670	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	15,079	92.300	1,391,791.700	
HORMEL FOODS CORP	24,161	41.750	1,008,721.750	
CENTERPOINT ENERGY INC	43,020	30.200	1,299,204.000	
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,913	269.790	785,898.270	
HUMANA INC	11,962	266.500	3,187,873.000	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	7,359	102.380	753,414.420	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	93,648	13.300	1,245,518.400	
RED HAT INC	15,843	183.000	2,899,269.000	
NEKTAR THERAPEUTICS	15,689	35.830	562,136.870	
BIOGEN INC	17,877	240.280	4,295,485.560	
IDEX CORP	7,174	155.380	1,114,696.120	
ILLINOIS TOOL WORKS	26,425	151.690	4,008,408.250	
INTUIT INC	21,595	259.090	5,595,048.550	
IDEXX LABORATORIES INC	7,402	224.520	1,661,897.040	
INGERSOLL-RAND PLC	21,989	110.990	2,440,559.110	
INTEL CORP	396,284	55.750	22,092,833.000	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	7,446	130.490	971,628.540	
INTERNATIONAL PAPER CO	32,983	46.930	1,547,892.190	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	35,849	21.610	774,696.890	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	11,766	75.510	888,450.660	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	7,247	142.060	1,029,508.820	
INCYTE CORP	15,601	83.410	1,301,279.410	
JOHNSON & JOHNSON	232,816	135.580	31,565,193.280	

HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	29,441	49.980	1,471,461.180	
KLA-TENCOR CORP	13,639	123.340	1,682,234.260	
DEVON ENERGY CORP	39,119	31.400	1,228,336.600	
KELLOGG CO	21,564	57.550	1,241,008.200	
EAST WEST BANCORP INC	11,560	50.560	584,473.600	
KEYCORP	88,511	16.390	1,450,695.290	
KIMBERLY-CLARK CORP	30,175	121.660	3,671,090.500	
BLACKROCK INC/NEW YORK	10,326	442.760	4,571,939.760	
KOHL'S CORP	14,910	71.510	1,066,214.100	
KROGER CO	66,610	24.980	1,663,917.800	
LAM RESEARCH CORP	13,725	190.840	2,619,279.000	
PACKAGING CORP OF AMERICA	8,982	101.490	911,583.180	
AKAMAI TECHNOLOGIES	13,254	75.090	995,242.860	
LEGGETT & PLATT INC	9,588	42.980	412,092.240	
LENNAR CORP	26,065	50.840	1,325,144.600	
JEFFERIES FINANCIAL GROUP INC	29,862	19.930	595,149.660	
ELI LILLY & CO	77,211	127.190	9,820,467.090	
L BRANDS INC	21,698	27.200	590,185.600	
LINCOLN NATIONAL CORP	18,890	62.950	1,189,125.500	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	60,555	113.080	6,847,559.400	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	28,167	81.680	2,300,680.560	
LOCKHEED MARTIN CORP	22,560	299.120	6,748,147.200	
LOEWS CORP	21,346	48.680	1,039,123.280	
LOWE'S COS INC	69,479	113.760	7,903,931.040	
DOMINION ENERGY INC	65,473	75.830	4,964,817.590	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	46,414	26.640	1,236,468.960	
MCCORMICK & CO INC	10,952	154.570	1,692,850.640	
MCDONALD'S CORPORATION	67,589	189.220	12,789,190.580	
S&P GLOBAL INC	21,599	212.680	4,593,675.320	
EVEREST RE GROUP LTD	3,751	216.810	813,254.310	
MANPOWERGROUP INC	6,265	83.970	526,072.050	
MARKEL CORPORATION	1,222	979.660	1,197,144.520	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	18,526	188.830	3,498,264.580	
MARSH & MCLENNAN COS	43,593	93.120	4,059,380.160	
MASCO CORP	28,638	40.410	1,157,261.580	
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	5,382	204.840	1,102,448.880	
MATTEL INC	24,003	13.500	324,040.500	
METLIFE INC	73,803	44.830	3,308,588.490	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	24,323	58.140	1,414,139.220	
MEDTRONIC PLC	115,721	88.630	10,256,352.230	
ACTIVISION BLIZZARD INC	62,953	47.860	3,012,930.580	

CVS HEALTH CORP	113,150	53.870	6,095,390.500	
MERCK & CO. INC.	225,419	80.820	18,218,363.580	
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	39,897	22.990	917,232.030	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	8,994	159.610	1,435,532.340	
MICROSOFT CORP	633,637	120.190	76,156,831.030	
MICRON TECH INC	97,353	42.170	4,105,376.010	
MIDDLEBY CORP	4,100	134.170	550,097.000	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	20,269	94.250	1,910,353.250	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	55,242	22.340	1,234,106.280	
3M CO	50,239	212.110	10,656,194.290	
MOHAWK INDUSTRIES INC	6,093	131.200	799,401.600	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	14,680	142.700	2,094,836.000	
KANSAS CITY SOUTHERN	8,856	117.120	1,037,214.720	
MYLAN NV	43,574	27.220	1,186,084.280	
ILLUMINA INC	12,690	324.860	4,122,473.400	
XCEL ENERGY INC	44,702	55.350	2,474,255.700	
NATIONAL OILWELL VARCO INC	33,468	28.680	959,862.240	
NETAPP INC	23,104	74.250	1,715,472.000	
NEWELL BRANDS INC	43,380	15.480	671,522.400	
NEWMONT MINING CORP	45,565	36.270	1,652,642.550	
NVR INC	307	2,910.420	893,498.940	
NIKE INC-CL B	110,181	84.880	9,352,163.280	
NOBLE ENERGY INC	39,436	25.230	994,970.280	
NORDSTROM INC	9,487	44.940	426,345.780	
NORFOLK SOUTHERN CORP	23,435	192.610	4,513,815.350	
EVERSOURCE ENERGY	27,088	70.310	1,904,557.280	
NISOURCE INC	31,548	27.870	879,242.760	
TAPESTRY INC	26,818	33.410	895,989.380	
NORTHERN TRUST CORP	17,867	93.400	1,668,777.800	
NORTHROP GRUMMAN CORP	14,011	270.530	3,790,395.830	
WELLS FARGO & CO	388,191	47.790	18,551,647.890	
NUCOR CORP	28,241	58.230	1,644,473.430	
CHENIERE ENERGY INC	19,175	67.050	1,285,683.750	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	41,783	85.630	3,577,878.290	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	65,907	67.180	4,427,632.260	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	4,917	150.310	739,074.270	
OGE ENERGY CORP	16,028	41.910	671,733.480	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	7,014	405.010	2,840,740.140	
ORACLE CORP	229,747	53.970	12,399,445.590	
PACCAR INC	29,661	68.780	2,040,083.580	
PTC INC	10,028	95.180	954,465.040	
EXELON CORP	85,437	49.560	4,234,257.720	

PARKER HANNIFIN CORP	11,023	183.050	2,017,760.150	
PAYCHEX INC	28,792	81.140	2,336,182.880	
ALIGN TECHNOLOGY INC	6,875	290.120	1,994,575.000	
PPL CORPORATION	63,229	31.740	2,006,888.460	
PEPSICO INC	121,781	122.040	14,862,153.240	
PENTAIR PLC	16,869	39.230	661,770.870	
PFIZER INC	500,973	42.730	21,406,576.290	
CONOCOPHILLIPS	99,913	66.970	6,691,173.610	
PVH CORP	6,862	127.330	873,738.460	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	15,508	150.490	2,333,798.920	
ALTRIA GROUP INC	164,568	55.420	9,120,358.560	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	39,730	127.290	5,057,231.700	
POLARIS INDUSTRIES INC	5,726	94.710	542,309.460	
GARMIN LTD	10,774	88.800	956,731.200	
FLUOR CORP (NEW)	9,821	39.740	390,286.540	
PPG INDUSTRIES INC	20,371	114.900	2,340,627.900	
IPG PHOTONICS CORP	3,652	166.570	608,313.640	
COSTCO WHOLESALE CORP	38,478	245.610	9,450,581.580	
T ROWE PRICE GROUP INC	20,133	104.050	2,094,838.650	
QUEST DIAGNOSTICS	10,883	90.370	983,496.710	
PROCTER & GAMBLE CO	216,494	104.650	22,656,097.100	
PROGRESSIVE CORP	50,598	72.070	3,646,597.860	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	43,956	59.470	2,614,063.320	
PULTE GROUP INC	21,209	28.920	613,364.280	
GLOBAL PAYMENTS INC	13,406	137.050	1,837,292.300	
QUALCOMM INC	106,616	56.330	6,005,679.280	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	12,337	85.610	1,056,170.570	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	3,948	145.520	574,512.960	
REGENERON PHARMACEUTICALS	7,045	408.230	2,875,980.350	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA INC	6,079	146.220	888,871.380	
RESMED INC	12,271	101.620	1,246,979.020	
US BANCORP	135,109	49.300	6,660,873.700	
SEATTLE GENETICS INC /WA	10,269	80.910	830,864.790	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	37,125	32.340	1,200,622.500	
ROSS STORES INC	32,858	98.340	3,231,255.720	
ROLLINS INC	12,378	41.840	517,895.520	
ROPER TECHNOLOGIES INC	9,248	342.920	3,171,324.160	
ROCKWELL AUTOMATION INC	10,439	182.860	1,908,875.540	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	14,121	116.510	1,645,237.710	
RAYTHEON COMPANY	24,616	178.600	4,396,417.600	

ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	3,848	176.470	679,056.560	
ACCENTURE PLC-CL A	55,807	177.000	9,877,839.000	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	125,693	49.700	6,246,942.100	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	11,016	179.040	1,972,304.640	
THE TRAVELERS COMPANIES INC	23,127	135.460	3,132,783.420	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	27,850	112.380	3,129,783.000	
BOOKING HOLDINGS INC	4,071	1,806.000	7,352,226.000	
SCHLUMBERGER LTD	121,122	45.550	5,517,107.100	
SCHWAB (CHARLES) CORP	105,264	44.270	4,660,037.280	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	18,138	128.840	2,336,899.920	
BUNGE LTD	13,404	52.990	710,277.960	
SEI INVESTMENTS CO	12,294	56.060	689,201.640	
ANTHEM INC	22,158	288.040	6,382,390.320	
AMERISOURCEBERGEN CORP	14,724	74.000	1,089,576.000	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	26,093	52.750	1,376,405.750	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	7,397	443.710	3,282,122.870	
CENTENE CORP	36,739	57.290	2,104,777.310	
SVB FINANCIAL GROUP	4,852	237.270	1,151,234.040	
IAC INTERACTIVE CORP	6,938	213.360	1,480,291.680	
SMITH (A.O.) CORP	11,351	54.190	615,110.690	
ACUITY BRANDS INC	3,087	139.860	431,747.820	
SNAP-ON INC	4,935	153.800	759,003.000	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	35,083	98.390	3,451,816.370	
ADVANCE AUTO PARTS	6,330	178.800	1,131,804.000	
EDISON INTERNATIONAL	29,504	62.660	1,848,720.640	
SOUTHERN CO	87,584	51.770	4,534,223.680	
BB&T CORP	67,781	48.110	3,260,943.910	
SOUTHWEST AIRLINES	11,352	52.620	597,342.240	
AT&T INC	631,496	31.880	20,132,092.480	
CHEVRON CORP	165,788	125.490	20,804,736.120	
STANLEY BLACK & DECKER INC	13,077	142.460	1,862,949.420	
STATE STREET CORP	33,680	69.000	2,323,920.000	
STARBUCKS CORP	109,075	75.480	8,232,981.000	
STEEL DYNAMICS INC	19,030	34.670	659,770.100	
STRYKER CORP	29,638	196.140	5,813,197.320	
NETFLIX INC	37,442	363.920	13,625,892.640	
SUNTRUST BANKS INC	38,341	61.560	2,360,271.960	
SYMANTEC CORP	55,368	23.740	1,314,436.320	
KNIGHT SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	9,793	33.090	324,050.370	
SYNOPSIS INC	13,239	117.280	1,552,669.920	

SYSCO CORP	43,043	67.420	2,901,959.060	
INTUITIVE SURGICAL INC	9,901	585.890	5,800,896.890	
TELEFLEX INC	3,905	304.850	1,190,439.250	
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	80,553	14.660	1,180,906.980	
TEXAS INSTRUMENTS INC	82,811	114.920	9,516,640.120	
TEXTRON INC	19,312	50.460	974,483.520	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	34,647	278.850	9,661,315.950	
TIFFANY & CO	8,733	105.880	924,650.040	
TORCHMARK CORP	7,992	85.020	679,479.840	
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	14,384	98.210	1,412,652.640	
DAVITA INC	10,878	55.900	608,080.200	
TRACTOR SUPPLY CO	11,088	101.170	1,121,772.960	
TRIMBLE INC	20,073	40.240	807,737.520	
TYSON FOODS INC	24,607	70.650	1,738,484.550	
UGI CORP	14,725	52.870	778,510.750	
MARATHON OIL CORP	71,846	17.450	1,253,712.700	
UNION PACIFIC CORP	63,831	166.350	10,618,286.850	
UNITED TECHNOLOGIES CORP	70,997	131.660	9,347,465.020	
UNITEDHEALTH GROUP INC	83,204	246.030	20,470,680.120	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	7,743	134.490	1,041,356.070	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	8,438	140.590	1,186,298.420	
VF CORP	30,057	89.350	2,685,592.950	
CBS CORP	30,711	51.630	1,585,608.930	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	22,369	190.370	4,258,386.530	
VULCAN MATERIALS CO	12,142	119.760	1,454,125.920	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	71,945	54.510	3,921,721.950	
WALMART INC	127,054	99.600	12,654,578.400	
WASTE MANAGEMENT INC	36,986	102.930	3,806,968.980	
WATERS CORP	6,953	250.680	1,742,978.040	
ALLERGAN PLC	29,620	146.100	4,327,482.000	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	10,459	119.070	1,245,353.130	
VAIL RESORTS INC	3,773	216.090	815,307.570	
WESTERN DIGITAL CORP	26,076	50.690	1,321,792.440	
WABTEC CORP	11,532	74.360	857,519.520	
WHIRLPOOL CORP	5,553	137.030	760,927.590	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	16,296	88.050	1,434,862.800	
WYNN RESORTS LTD	9,240	141.000	1,302,840.000	
NASDAQ INC	9,132	87.500	799,050.000	
CME GROUP INC	31,462	170.060	5,350,427.720	
WILLIAMS COS INC	106,174	28.660	3,042,946.840	
LKQ CORP	26,690	30.330	809,507.700	
ALLIANT ENERGY CORP	19,910	46.290	921,633.900	

WEC ENERGY GROUP INC	28,063	76.940	2,159,167.220	
TD AMERITRADE HOLDING CORP	25,664	52.490	1,347,103.360	
CARMAX INC	15,979	74.310	1,187,399.490	
XEROX CORP	17,455	33.840	590,677.200	
XILINX INC	22,388	131.590	2,946,036.920	
CIMAREX ENERGY CO	9,253	67.970	628,926.410	
TJX COMPANIES INC	107,399	54.440	5,846,801.560	
ZIONS BANCORP NA	16,584	47.140	781,769.760	
DAIRY FARM INTERNATIONAL HLDNGS	27,400	8.030	220,022.000	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	76,400	7.090	541,676.000	
JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	15,700	63.170	991,769.000	
JARDINE STRATEGIC HOLDINGS LTD	17,100	36.710	627,741.000	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	8,192	90.890	744,570.880	
SIGNATURE BANK	4,171	130.560	544,565.760	
CBRE GROUP INC	29,499	50.870	1,500,614.130	
LIBERTY GLOBAL PLC	19,835	27.380	543,082.300	
WELLCARE HEALTH PLANS INC	4,350	284.120	1,235,922.000	
REGIONS FINANCIAL CORP	92,992	15.120	1,406,039.040	
DOMINO'S PIZZA INC	3,256	248.940	810,548.640	
WESTLAKE CHEMICAL CORP	3,000	74.930	224,790.000	
T-MOBILE US INC	30,213	72.160	2,180,170.080	
LAS VEGAS SANDS CORP	33,332	65.850	2,194,912.200	
MOSAIC CO/THE	31,433	27.360	860,006.880	
CELANESE CORP	11,880	101.810	1,209,502.800	
DEXCOM INC	7,665	118.880	911,215.200	
DISCOVERY INC-A	10,423	30.590	318,839.570	
EXPEDIA GROUP INC	10,373	124.160	1,287,911.680	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	18,475	42.550	786,111.250	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	12,493	138.540	1,730,780.220	
LIBERTY GLOBAL PLC- SERIES C	41,818	26.530	1,109,431.540	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	49,425	76.850	3,798,311.250	
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	14,696	21.360	313,906.560	
VIACOM INC-CLASS B	30,282	30.240	915,727.680	
LIVE NATION	13,682	64.600	883,857.200	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,224	718.850	1,598,722.400	
UNITED CONTINENTAL HOLIDINGS INC	6,191	84.520	523,263.320	
TRANSDIGM GROUP INC	4,312	456.960	1,970,411.520	

MASTERCARD INC	79,593	237.060	18,868,316.580	
QURATE RETAIL INC	35,733	17.090	610,676.970	
HANESBRANDS INC	27,619	18.020	497,694.380	
WESTERN UNION CO	35,222	19.370	682,250.140	
OWENS CORNING	10,591	50.880	538,870.080	
LEIDOS HOLDINGS INC	13,182	64.620	851,820.840	
AERCAP HOLDINGS NV	11,586	47.400	549,176.400	
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLDINGS INC	9,175	84.790	777,948.250	
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT-ADR	24,800	25.440	630,912.000	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	10,519	109.500	1,151,830.500	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	29,653	16.810	498,466.930	
DELTA AIR LINES INC	13,898	57.860	804,138.280	
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	10,144	46.880	475,550.720	
DISCOVER FINANCIAL	29,057	74.530	2,165,618.210	
TE CONNECTIVITY LTD	29,610	86.080	2,548,828.800	
CONCHO RESOURCES INC/MIDLAND TX	17,807	107.740	1,918,526.180	
WABCO HOLDING INC	4,076	133.260	543,167.760	
LULULEMON ATHLETICA INC	9,080	167.460	1,520,536.800	
VMWARE INC	6,648	189.310	1,258,532.880	
MERCADOLIBRE INC	3,750	514.340	1,928,775.000	
ULTA BEAUTY INC	5,020	350.280	1,758,405.600	
INVESCO LTD	33,443	20.790	695,279.970	
MSCI INC	7,537	214.610	1,617,515.570	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	136,077	85.710	11,663,159.670	
VISA INC	152,457	158.560	24,173,581.920	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	15,933	104.030	1,657,509.990	
DISCOVERY INC-C	29,484	28.250	832,923.000	
MARATHON PETROLEUM CORP	59,929	63.600	3,811,484.400	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	11,624	49.670	577,364.080	
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	176,914	19.840	3,509,973.760	
XYLEM INC	15,111	79.370	1,199,360.070	
ALKERMES PLC	12,053	35.820	431,738.460	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	28,987	89.560	2,596,075.720	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,479	212.230	738,348.170	
SPLUNK INC	12,240	133.920	1,639,180.800	
HCA HEALTHCARE INC	24,178	133.930	3,238,159.540	
VERISK ANALYTICS INC	13,405	134.760	1,806,457.800	

JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	5,474	141.090	772,326.660	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	7,443	250.150	1,861,866.450	
FIRST REPUBLIC BANK/SAN FRANCISCO CA	13,676	103.360	1,413,551.360	
CIT GROUP INC	9,287	49.410	458,870.670	
NXP SEMICONDUCTOR NV	30,600	98.130	3,002,778.000	
TARGA RESOURCES CORP	17,811	39.300	699,972.300	
LEAR CORP	6,172	155.050	956,968.600	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	10,084	96.140	969,475.760	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	20,223	64.940	1,313,281.620	
DOLLAR GENERAL CORP	23,634	121.810	2,878,857.540	
FORTINET INC	13,230	89.620	1,185,672.600	
AON PLC	20,942	172.840	3,619,615.280	
TESLA INC	10,991	276.060	3,034,175.460	
GENERAL MOTORS CO	110,050	39.250	4,319,462.500	
WORLDPAY INC	26,592	112.770	2,998,779.840	
XPO LOGISTICS INC	12,825	61.200	784,890.000	
TRIPADVISOR INC	9,263	53.370	494,366.310	
ALLY FINANCIAL INC	33,215	29.160	968,549.400	
CAPRI HOLDINGS LTD	12,138	49.830	604,836.540	
VOYA FINANCIAL INC	13,525	52.770	713,714.250	
APTIV PLC	22,571	88.560	1,998,887.760	
PHILLIPS 66	38,115	98.610	3,758,520.150	
FACEBOOK INC	208,740	177.820	37,118,146.800	
IQVIA HOLDINGS INC	13,426	144.810	1,944,219.060	
DIAMONDBACK ENERGY INC	13,109	103.870	1,361,631.830	
SERVICENOW INC	15,812	243.660	3,852,751.920	
PALO ALTO NETWORKS INC	7,935	242.520	1,924,396.200	
TABLEAU SOFTWARE INC	6,429	126.510	813,332.790	
WORKDAY INC	13,192	195.100	2,573,759.200	
ABBVIE INC	130,017	82.950	10,784,910.150	
ZOETIS INC	42,209	101.330	4,277,037.970	
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDINGS LTD	19,821	56.500	1,119,886.500	
COTY INC	38,541	11.170	430,502.970	
NEWS CORP/NEW-CL A	30,263	12.650	382,826.950	
HD SUPPLY HOLDINGS INC	12,891	44.130	568,879.830	
CDW CORP	13,040	104.050	1,356,812.000	
SPRINT CORP	63,882	5.940	379,459.080	
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	10,199	34.020	346,969.980	
ARCONIC INC	36,761	20.080	738,160.880	
LIBERTY MEDIA CORP- LIBERTY-C	17,852	37.180	663,737.360	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	5,006	39.540	197,937.240	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-C	17,931	39.610	710,246.910	
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	15,410	19.320	297,721.200	

BAKER HUGHES A GE CO	43,404	26.870	1,166,265.480	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	12,611	72.400	913,036.400	
ALTICE USA INC-A	29,400	22.850	671,790.000	
TECHNIPFMC LTD	38,724	24.830	961,516.920	
BROADCOM INC	35,733	307.510	10,988,254.830	
BURLINGTON STORES INC	6,007	157.520	946,222.640	
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	9,985	38.730	386,719.050	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	24,000	32.550	781,200.000	
VEEVA SYSTEMS INC	10,852	135.960	1,475,437.920	
TWITTER INC	61,268	34.750	2,129,063.000	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING PLC	13,214	48.190	636,782.660	
EVERGY INC	24,427	57.160	1,396,247.320	
PLAINS GP HOLDINGS LP	14,935	24.520	366,206.200	
COMMSCOPE HOLDING CO INC	19,592	25.000	489,800.000	
ALLEGION PLC	7,325	93.330	683,642.250	
WIX.COM LTD	4,000	122.650	490,600.000	
KKR & CO INC	43,616	23.070	1,006,221.120	
PERRIGO CO PLC	10,553	51.250	540,841.250	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	23,927	87.990	2,105,336.730	
ARAMARK	21,772	30.430	662,521.960	
CIGNA CORP	32,831	168.200	5,522,174.200	
DELL TECHNOLOGIES INC	12,960	63.290	820,238.400	
DOW INC	66,176	55.710	3,686,664.960	
FOX CORP-A	30,595	36.480	1,116,105.600	
FOX CORP-B	13,009	35.930	467,413.370	
GRUBHUB INC	8,158	70.280	573,344.240	
SABRE CORP	25,826	21.880	565,072.880	
PARSLEY ENERGY INC	25,677	18.550	476,308.350	
ARISTA NETWORKS INC	4,441	322.250	1,431,112.250	
IHS MARKIT LTD	34,991	54.970	1,923,455.270	
FNF GROUP	25,311	38.290	969,158.190	
SYNCHRONY FINANCIAL	55,311	32.550	1,800,373.050	
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	40,320	34.110	1,375,315.200	
CDK GLOBAL INC	9,969	58.510	583,286.190	
WAYFAIR INC	5,091	146.940	748,071.540	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	15,515	90.620	1,405,969.300	
QORVO INC	10,887	76.230	829,916.010	
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	16,089	31.130	500,850.570	
LIBERTY BROADBAND CORP-C W/I	10,018	94.250	944,196.500	
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	17,018	26.900	457,784.200	
GODADDY INC	14,641	75.950	1,111,983.950	
NIELSEN HOLDINGS PLC	32,827	26.540	871,228.580	

TRANSUNION	17,208	68.380	1,176,683.040	
SQUARE INC	26,820	74.740	2,004,526.800	
DOWDUPONT INC	198,530	38.500	7,643,405.000	
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS PLC	20,475	51.150	1,047,296.250	
WESTROCK CO	22,394	38.990	873,142.060	
KRAFT HEINZ CO	54,603	32.980	1,800,806.940	
FORTIVE CORP	26,779	86.030	2,303,797.370	
WASTE CONNECTIONS INC	23,491	88.380	2,076,134.580	
ALPHABET INC-CL A	25,795	1,206.450	31,120,377.750	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	125,608	16.270	2,043,642.160	
PAYPAL HOLDINGS INC	96,963	107.510	10,424,492.130	
AXA EQUITABLE HOLDINGS INC	23,220	21.850	507,357.000	
FIRST DATA CORP	44,487	25.690	1,142,871.030	
DXC TECHNOLOGY CO	23,734	64.400	1,528,469.600	
ZILLOW GROUP INC-C	11,723	37.080	434,688.840	
ALPHABET INC-CL C	27,525	1,202.160	33,089,454.000	
BEIGENE LTD ADR	3,159	146.170	461,751.030	
L3 TECHNOLOGIES INC	6,752	210.370	1,420,418.240	
CHEMOURS CO	12,723	38.580	490,853.340	
LINDE PLC	48,171	181.020	8,719,914.420	
ATHENE HOLDING LTD	11,784	42.390	499,523.760	
CHARTER COMMUNICATIONS INC	13,690	354.350	4,851,051.500	
VISTRA ENERGY CORP	30,000	25.900	777,000.000	
アメリカ・ドル 小計	26,277,778		2,145,984,360.540 (238,440,322,299)	
イギリス・ポンド				
ANTOFAGASTA PLC	31,798	10.210	324,657.580	
ASHTED GROUP	42,154	19.725	831,487.650	
SEVERN TRENT PLC	18,217	19.670	358,328.390	
BHP GROUP PLC	182,343	19.434	3,543,653.860	
BARCLAYS PLC	1,506,906	1.611	2,427,625.560	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	82,283	6.042	497,153.880	
BT GROUP PLC	760,443	2.244	1,706,434.090	
BUNZL PLC	27,838	25.050	697,341.900	
EASYJET PLC	13,628	10.560	143,911.680	
AVIVA PLC	350,451	4.299	1,506,588.840	
CRODA INTERNATIONAL	10,645	50.800	540,766.000	
DIAGEO PLC	212,915	31.235	6,650,400.020	
SCHRODERS PLC	10,932	29.340	320,744.880	
DCC PLC	9,753	68.580	668,860.740	
NATIONAL GRID PLC	293,775	8.340	2,450,083.500	
KINGFISHER PLC	165,680	2.494	413,205.920	
BAE SYSTEMS PLC	268,920	5.034	1,353,743.280	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	200,984	30.990	6,228,494.160	
NEXT PLC	12,064	56.180	677,755.520	

IMPERIAL BRANDS PLC	84,312	25.475	2,147,848.200	
JOHNSON MATTHEY PLC	15,017	33.320	500,366.440	
ANGLO AMERICAN PLC	90,106	22.260	2,005,759.560	
COMPASS GROUP PLC	139,409	18.010	2,510,756.090	
HSBC HOLDINGS PLC	1,733,777	6.527	11,316,362.470	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	508,463	2.827	1,437,424.900	
CENTRICA PLC	471,340	1.109	522,716.060	
UNILEVER PLC	95,665	43.940	4,203,520.100	
MEGGITT PLC	62,181	5.120	318,366.720	
MORRISON <WM.> SUPERMARKETS	230,551	2.216	510,901.010	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	54,487	8.288	451,588.250	
RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	80,864	5.220	422,110.080	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	30,240	25.140	760,233.600	
PEARSON PLC	65,009	8.220	534,373.980	
PERSIMMON PLC	26,085	21.770	567,870.450	
PRUDENTIAL PLC	230,320	16.490	3,797,976.800	
RIO TINTO PLC	102,665	47.620	4,888,907.300	
VODAFONE GROUP PLC	2,332,041	1.398	3,260,193.310	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	58,278	59.920	3,492,017.760	
RELX PLC	173,666	16.560	2,875,908.960	
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	152,877	8.890	1,359,076.530	
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	449,443	2.532	1,137,989.670	
ST JAMES'S PLACE PLC	48,466	10.480	507,923.680	
SSE PLC	95,257	11.470	1,092,597.790	
BP PLC	1,755,946	5.762	10,117,760.850	
SAGE GROUP PLC(THE)	103,609	7.036	728,992.920	
SMITHS GROUP PLC	31,720	14.940	473,896.800	
STANDARD CHARTERED PLC	237,531	6.478	1,538,725.810	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	6,133,835	0.628	3,852,048.380	
TAYLOR WIMPLEY PLC	325,650	1.827	594,962.550	
TESCO PLC	877,157	2.423	2,125,351.410	
3I GROUP PLC	88,662	10.315	914,548.530	
SMITH & NEPHEW PLC	74,903	15.105	1,131,409.810	
GLAXOSMITHKLINE PLC	436,021	15.776	6,878,667.290	
WEIR GROUP	18,336	17.175	314,920.800	
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	26,266	47.700	1,252,888.200	
BABCOCK INT'L GROUP	21,302	5.024	107,021.240	
WPP PLC	107,494	8.724	937,777.650	
FERGUSON PLC	21,079	52.460	1,105,804.340	
ASTRAZENECA PLC	111,261	61.200	6,809,173.200	
WHITBREAD PLC	15,639	48.940	765,372.660	

CARNIVAL PLC	16,492	38.840	640,549.280	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	120,290	2.821	339,338.090	
JOHN WOOD GROUP PLC	48,988	5.228	256,109.260	
INTERTEK GROUP PLC	14,335	50.380	722,197.300	
BURBERRY GROUP PLC	38,727	19.375	750,335.620	
INVESTEC PLC	50,655	4.822	244,258.410	
INTERCONTINENTAL HOTELS	15,125	47.725	721,840.620	
ITV PLC	370,908	1.354	502,209.430	
SAINSBURY (J) PLC	137,215	2.340	321,083.100	
G4S PLC	122,250	2.210	270,172.500	
ADMIRAL GROUP PLC	15,893	22.240	353,460.320	
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	10,726	36.940	396,218.440	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	389,400	24.905	9,698,007.000	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	324,753	25.115	8,156,171.590	
TUI AG-DI	45,043	7.162	322,597.960	
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	214,715	2.759	592,398.680	
EXPERIAN PLC	80,395	21.240	1,707,589.800	
MONDI PLC	28,318	18.110	512,838.980	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	21,290	20.550	437,509.500	
FRESNILLO PLC NPR	15,639	8.606	134,589.230	
INFORMA PLC	102,475	7.736	792,746.600	
GLENCORE PLC	982,806	3.315	3,258,001.890	
GVC HOLDINGS PLC	49,618	5.920	293,738.560	
NMC HEALTH PLC	8,149	24.080	196,227.920	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP PLC	112,694	3.355	378,088.370	
COCA-COLA HBC AG	19,447	25.740	500,565.780	
CONVATEC GROUP PLC	118,400	1.394	165,049.600	
ROYAL MAIL PLC	55,060	2.533	139,466.980	
MERLIN ENTERTAINMENTS PLC	50,037	3.440	172,127.280	
MICRO FOCUS INTERNATIONAL PLC	38,867	19.420	754,797.140	
AUTO TRADER GROUP PLC	76,348	5.338	407,545.620	
MELROSE INDUSTRIES PLC	417,620	1.842	769,256.040	
イギリス・ボンド 小計	26,031,337		156,520,436.490 (22,775,288,714)	
イスラエル・シユケル				
BANK HAPOLIM BM	102,044	25.530	2,605,183.320	
BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	128,049	24.520	3,139,761.480	
BEZEQ ISRAELI TELECOMMUNICATION CORP LTD	188,230	2.605	490,339.150	
ELBIT SYSTEMS LTD	1,760	512.100	901,296.000	

	ISRAEL CHEMICALS LTD	49,411	19.160	946,714.760	
	NICE LTD	6,065	445.700	2,703,170.500	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	10,444	77.790	812,438.760	
	AZRIELI GROUP	4,428	222.000	983,016.000	
イスラエル・シュケル 小計		490,431		12,581,919.970 (390,542,796)	
オーストラリア・ ドル	RAMSAY HEALTH CARE LTD	11,115	64.010	711,471.150	
	AUST AND NZ BANKING GROUP LT	251,648	25.680	6,462,320.640	
	AMCOR LTD	93,873	15.350	1,440,950.550	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	303,645	25.900	7,864,405.500	
	BANK OF QUEENSLAND LTD	30,569	9.410	287,654.290	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	114,125	8.170	932,401.250	
	TELSTRA CORP LTD	360,654	3.290	1,186,551.660	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD	39,014	9.770	381,166.780	
	AMP LTD	302,414	2.210	668,334.940	
	ASX LTD	15,573	70.680	1,100,699.640	
	BHP GROUP LTD	259,625	39.890	10,356,441.250	
	CALTEX AUSTRALIA LTD	20,946	27.160	568,893.360	
	HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	22,182	3.910	86,731.620	
	COMPUTERSHARE LT	38,040	17.520	666,460.800	
	CSL LIMITED	39,608	201.470	7,979,823.760	
	REA GROUP LTD	4,119	75.260	309,995.940	
	TRANSURBAN GROUP	241,102	13.270	3,199,423.540	
	COCA-COLA AMATIL LTD	48,601	8.400	408,248.400	
	COCHLEAR LTD	5,374	171.030	919,115.220	
	ORIGIN ENERGY LTD	163,057	7.230	1,178,902.110	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	153,519	70.750	10,861,469.250	
	BORAL LIMITED	86,101	4.730	407,257.730	
	RIO TINTO LIMITED	32,562	101.830	3,315,788.460	
	APA GROUP	116,193	9.650	1,121,262.450	
	ARISTOCRAT LEISU	53,168	25.550	1,358,442.400	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	206,789	7.590	1,569,528.510	
	TPG TELECOM LTD	28,719	7.000	201,033.000	
	FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	3,275	43.820	143,510.500	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	46,091	18.650	859,597.150	
	ORICA LTD	37,821	18.230	689,476.830	
	CIMIC GROUP LTD	8,709	48.850	425,434.650	
	BLUESCOPE STEEL LTD	36,941	14.290	527,886.890	
SYDNEY AIRPORT	85,130	7.230	615,489.900		

	MACQUARIE GROUP LTD	28,250	130.590	3,689,167.500	
	WORLEYPARSONS LTD	35,828	14.640	524,521.920	
	SUNCORP GROUP LTD	107,913	13.300	1,435,242.900	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	243,217	24.630	5,990,434.710	
	NEWCREST MINING LTD	69,638	25.570	1,780,643.660	
	OIL SEARCH LTD	105,470	8.060	850,088.200	
	INCITEC PIVOT LTD	136,426	3.210	437,927.460	
	QBE INSURANCE GROUP LIMITED	107,820	12.350	1,331,577.000	
	CHALLENGER FINANCIAL SERVICES	45,707	7.650	349,658.550	
	SANTOS LTD	165,637	6.990	1,157,802.630	
	SONIC HEALTHCARE	43,041	24.760	1,065,695.160	
	WASHINGTON H SOUL PATTINSON & CO LTD	5,000	24.550	122,750.000	
	TABCORP HOLDINGS LTD	194,274	4.850	942,228.900	
	WESFARMERS LTD	96,821	34.260	3,317,087.460	
	ALUMINA LIMITED	184,613	2.490	459,686.370	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	79,115	35.150	2,780,892.250	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	117,557	30.380	3,571,381.660	
	SEEK LTD	25,899	17.610	456,081.390	
	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES LTD	4,581	43.720	200,281.320	
	AUSNET SERVICES	165,066	1.760	290,516.160	
	AGL ENERGY LTD	60,649	21.510	1,304,559.990	
	BRAMBLES LTD	144,062	11.800	1,699,931.600	
	CROWN RESORTS LTD	32,861	12.770	419,634.970	
	AURIZON HOLDINGS LTD	190,969	4.620	882,276.780	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	69,179	14.980	1,036,301.420	
	MEDIBANK PVT LTD	273,424	2.660	727,307.840	
	SOUTH32 LTD(AUD)	443,160	3.700	1,639,692.000	
	COLES GROUP LTD	96,821	12.210	1,182,184.410	
	オーストラリア・ドル 小計	6,533,300		108,451,724.330 (8,633,841,773)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	20,281	57.400	1,164,129.400	
	ALIMENTATION COUCHE TARD INC	39,722	80.910	3,213,907.020	
	BARRICK GOLD CORP	150,726	18.130	2,732,662.380	
	ATCO LTD	7,193	46.370	333,539.410	
	BANK OF MONTREAL	55,083	102.060	5,621,770.980	
	BANK OF NOVA SCOTIA	108,221	71.350	7,721,568.350	
	NATIONAL BANK OF CANADA	28,553	61.940	1,768,572.820	
	BCE INC	15,175	59.830	907,920.250	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT	74,072	63.090	4,673,202.480	
	BAUSCH HEALTH COS INC	25,819	34.800	898,501.200	
	BOMBARDIER INC 'B'	151,615	2.720	412,392.800	

SAPUTO INC	18,601	46.050	856,576.050	
BLACKBERRY LTD	39,652	12.410	492,081.320	
CGI INC	22,736	92.130	2,094,667.680	
CCL INDUSTRIES INC	11,340	55.340	627,555.600	
CAE INC	23,000	30.430	699,890.000	
CAMECO CORP	32,627	15.820	516,159.140	
ROGERS COMM-CL B	30,822	71.970	2,218,259.340	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	38,586	109.150	4,211,661.900	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	108,040	39.520	4,269,740.800	
CANADIAN TIRE CORP-CL A	4,862	145.910	709,414.420	
CANADIAN UTILITIES LTD	9,119	36.930	336,764.670	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	63,781	120.310	7,673,492.110	
FIRST CAPITAL REALTY INC	11,417	21.130	241,241.210	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	20,176	49.110	990,843.360	
OPEN TEXT CORP	21,610	51.250	1,107,512.500	
EMPIRE CO LTD	15,093	29.940	451,884.420	
KINROSS GOLD CORP	99,741	4.710	469,780.110	
FINNING INTERNATIONAL INC	18,509	23.940	443,105.460	
FORTIS INC	36,000	49.780	1,792,080.000	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	55,296	15.650	865,382.400	
TELUS CORP	15,945	49.790	793,901.550	
GREAT WEST LIFECO INC	27,766	33.040	917,388.640	
IMPERIAL OIL LTD	21,542	38.660	832,813.720	
ENBRIDGE INC	177,176	49.030	8,686,939.280	
IGM FINANCIAL INC	8,426	35.640	300,302.640	
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	87,995	2.200	193,589.000	
MANULIFE FINANCIAL CORP	173,640	23.700	4,115,268.000	
LOBLAW CO LTD	15,354	66.670	1,023,651.180	
MAGNA INTERNATIONAL INC	28,590	71.510	2,044,470.900	
SUN LIFE FINANCIAL INC	52,457	52.660	2,762,385.620	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,419	619.140	1,497,699.660	
METRO INC	19,226	50.260	966,298.760	
HUSKY ENERGY INC	28,749	14.210	408,523.290	
EMERA INC	6,509	50.370	327,858.330	
METHANEX CORP	5,281	77.920	411,495.520	
ONEX CORP	6,646	77.750	516,726.500	
GOLDCORP INC	81,902	15.450	1,265,385.900	
POWER CORP OF CANADA	30,338	31.320	950,186.160	
POWER FINANCIAL CORP	18,594	32.380	602,073.720	
ROYAL BANK OF CANADA	125,549	103.500	12,994,321.500	
SNC-LAVALIN GROUP INC	13,134	34.250	449,839.500	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	12,107	280.590	3,397,103.130	

SHAW COMM INC-B	43,461	27.100	1,177,793.100		
SUNCOR ENERGY INC	137,353	44.020	6,046,279.060		
LUNDIN MINING CORP	71,805	6.580	472,476.900		
ENCANA CORP	127,517	9.640	1,229,263.880		
TECK RESOURCES LTD-CL B	41,016	32.700	1,341,223.200		
THOMSON REUTERS CORP	16,394	78.640	1,289,224.160		
TORONTO DOMINION BANK (THE) C\$	157,510	73.760	11,617,937.600		
TRANSCANADA CORP	80,543	61.640	4,964,670.520		
WEST FRASER TIMBER CO LTD	5,696	65.500	373,088.000		
WESTON (GEORGE) LTD	8,239	101.880	839,389.320		
INTACT FINANCIAL CORP	12,716	110.590	1,406,262.440		
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	42,447	31.380	1,331,986.860		
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,729	1,175.560	2,032,543.240		
FRANCO-NEVADA CORP NPR	16,887	99.720	1,683,971.640		
CI FINANCIAL CORP	20,695	18.560	384,099.200		
TOURMALINE OIL CORP	27,410	21.230	581,914.300		
KEYERA CORP	16,668	32.610	543,543.480		
ALTAGAS LTD	23,944	18.370	439,851.280		
PEMBINA PIPELINE CORP	43,784	49.970	2,187,886.480		
DOLLARAMA INC	28,295	39.500	1,117,652.500		
STARS GROUP INC	18,529	24.910	461,557.390		
CENOVUS ENERGY INC W/I	98,471	13.360	1,315,572.560		
VERMILION ENERGY INC	12,923	33.990	439,252.770		
ARC RESOURCES LTD	22,997	9.370	215,481.890		
INTER PIPELINE LTD	38,609	22.080	852,486.720		
NUTRIEN LTD	54,224	70.650	3,830,925.600		
CRONOS GROUP INC	16,000	24.130	386,080.000		
WSP GLOBAL INC	8,400	71.880	603,792.000		
IA FINANCIAL CORP INC	8,104	51.470	417,112.880		
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	14,961	19.100	285,755.100		
SEVEN GENERATIONS ENERGY LTD	17,231	10.240	176,445.440		
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	20,664	87.490	1,807,893.360		
AURORA CANNABIS INC	66,562	12.150	808,728.300		
SHOPIFY INC	7,671	275.150	2,110,675.650		
CANOPY GROWTH CORP	18,634	56.180	1,046,858.120		
HYDRO ONE LTD	27,340	21.020	574,686.800		
カナダ・ドル 小計	3,692,242		162,368,843.820 (13,528,572,066)		
シンガポール・ドル	SINGAPORE TECH ENG	125,000	3.830	478,750.000	
	SEMBICORP INDUSTRIES	81,400	2.730	222,222.000	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	123,700	2.470	305,539.000	

	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	692,140	0.315	218,024.100	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	158,100	26.970	4,263,957.000	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	29,000	9.350	271,150.000	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	5,944	34.290	203,819.760	
	SINGAPORE AIRPORT TERMINAL SERVICES LTD	47,800	5.290	252,862.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	68,900	7.380	508,482.000	
	CAPITALAND LTD	204,515	3.700	756,705.500	
	GENTING SINGAPORE LTD	416,400	0.965	401,826.000	
	KEPPEL CORP LTD	134,600	6.650	895,090.000	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	177,900	2.610	464,319.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	289,553	11.720	3,393,561.160	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	734,322	3.110	2,283,741.420	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	47,500	9.830	466,925.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	120,500	26.560	3,200,480.000	
	UOL GROUP LIMITED	40,500	7.290	295,245.000	
	VENTURE CORP LTD	21,000	18.900	396,900.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	142,300	3.500	498,050.000	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	188,800	1.620	305,856.000	
シンガポール・ドル	小計	3,849,874		20,083,504.940 (1,650,261,600)	
スイス・フラン	CREDIT SUISSE GROUP AG	218,040	12.225	2,665,539.000	
	NESTLE SA-REGISTERED	265,023	97.120	25,739,033.760	
	CIE FINANC RICHEMONT	46,547	70.840	3,297,389.480	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	61,398	275.800	16,933,568.400	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,607	216.100	779,472.700	
	SIKA INHABER	11,291	145.100	1,638,324.100	
	SGS SA-REG	484	2,574.000	1,245,816.000	
	NOVARTIS AG-REG SHS	187,737	82.240	15,439,490.880	
	BALOISE HOLDING AG -R	4,127	169.100	697,875.700	
	BARRY CALLEBAUT AG	236	1,869.000	441,084.000	
	CLARIANT AG-REG	19,496	21.380	416,824.480	
	SWISSCOM AG-REG	2,280	467.700	1,066,356.000	
	ABB LTD	162,358	19.475	3,161,922.050	
	ADECCO GROUP AG-REG	12,341	55.280	682,210.480	
	GEBERIT AG	3,243	409.500	1,328,008.500	
	LONZA GROUP AG-REG	6,237	315.400	1,967,149.800	
	LINDT & SPRUENGLI PART	105	6,800.000	714,000.000	
	LINDT & SPRUENGLI NAMEN	9	77,900.000	701,100.000	
	GIVAUDAN-REG	771	2,542.000	1,959,882.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	13,046	314.900	4,108,185.400	

	LAFARGEHOLCIM LTD	40,615	51.420	2,088,423.300	
	TEMENOS GROUP	5,640	155.200	875,328.000	
	SONOVA HOLDING AG	5,319	201.100	1,069,650.900	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG	5,105	142.800	728,994.000	
	STRAUMANN HOLDING AG	976	833.200	813,203.200	
	THE SWATCH GROUP AG-B	2,691	288.800	777,160.800	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	4,592	55.450	254,626.400	
	SCHINDLER NAMEN	1,663	212.000	352,556.000	
	SWISS LIFE HOLDING AG	3,119	453.000	1,412,907.000	
	VIFOR PHARMA AG	4,583	133.200	610,455.600	
	EMS-CHEMIE HOLDING	633	591.500	374,419.500	
	SWISS PRIME SITE AG	5,990	82.500	494,175.000	
	PARGESA HOLDING PORTEUR	3,000	79.600	238,800.000	
	DUFREY GROUP	2,390	102.250	244,377.500	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,505	743.400	1,118,817.000	
	JULIUS BAER GROUP LTD	17,849	43.560	777,502.440	
	SWISS RE LTD	25,455	99.340	2,528,699.700	
	ALCON INC	37,547	57.640	2,164,209.080	
	UBS GROUP AG	336,464	12.460	4,192,341.440	
	スイス・フラン 小計	1,523,512		106,099,879.590 (11,759,049,655)	
スウェーデン・ク ローナ	ATLAS COPCO AB-A SHS	57,191	270.100	15,447,289.100	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	38,314	250.900	9,612,982.600	
	ERICSSON LM-B SHS	271,783	90.400	24,569,183.200	
	LUNDBERGS B	7,382	298.000	2,199,836.000	
	SKF AB-B SHS	37,198	168.200	6,256,703.600	
	SANDVIK AB	96,746	166.100	16,069,510.600	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	147,588	88.100	13,002,502.800	
	SKANSKA AB-B SHS	32,547	174.750	5,687,588.250	
	SWEDBANK AB	82,410	147.000	12,114,270.000	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	126,705	104.000	13,177,320.000	
	VOLVO AB-B SHS	141,608	144.550	20,469,436.400	
	SWEDISH MATCH AB	16,488	446.000	7,353,648.000	
	TELE2 AB-B SHS	44,876	125.600	5,636,425.600	
	INDUSTRIVARDEN C	11,403	206.300	2,352,438.900	
	ELECTROLUX AB-SER B	19,191	240.400	4,613,516.400	
	SECURITAS AB-B SHS	24,098	158.850	3,827,967.300	
	INVESTOR AB-B SHS	37,657	429.500	16,173,681.500	
	HENNES&MAURITZ AB-B SHS	77,779	163.120	12,687,310.480	
	ASSA ABLOY AB-B	88,327	206.400	18,230,692.800	
	TELIA CO AB	231,855	42.690	9,897,889.950	
	LUNDIN PETROLEUM AB	16,790	314.200	5,275,418.000	
	BOLIDEN AB	21,855	283.400	6,193,707.000	
	ALFA LAVAL AB	23,343	217.600	5,079,436.800	
	KINNEVIK AB-B	18,310	245.400	4,493,274.000	

	MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR SA	5,332	559.500	2,983,254.000	
	ICA GRUPPEN AB	5,920	364.000	2,154,880.000	
	HUSQVARNA AB-B SHS	33,692	79.960	2,694,012.320	
	HEXAGON AB	22,037	505.000	11,128,685.000	
	EPIROC AB-A	63,358	95.580	6,055,757.640	
	EPIROC AB-B	30,899	91.140	2,816,134.860	
	ESSITY AB-B	52,522	267.000	14,023,374.000	
	NORDEA BANK ABP	267,838	75.600	20,248,552.800	
スウェーデン・クローナ 小計		2,153,042		302,526,679.900 (3,627,294,892)	
デンマーク・ク ローネ	CARLSBERG AS-B	9,644	850.000	8,197,400.000	
	A P MOLLER A/S	604	8,304.000	5,015,616.000	
	AP MOLLER MAERSK A	273	7,780.000	2,123,940.000	
	DANSKE BANK A/S	61,114	121.650	7,434,518.100	
	GENMAB A/S	5,622	1,179.500	6,631,149.000	
	NOVOZYMES-B SHS	19,111	316.700	6,052,453.700	
	NOVO NORDISK A/S-B	156,526	339.400	53,124,924.400	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	17,720	595.000	10,543,400.000	
	COLOPLAST-B	9,729	710.000	6,907,590.000	
	DSV A/S	17,123	569.600	9,753,260.800	
	DEMANT A/S	6,537	197.150	1,288,769.550	
	H LUNDBECK A/S	4,840	290.900	1,407,956.000	
	TRYG A/S	11,107	194.100	2,155,868.700	
	PANDORA A/S	8,251	271.400	2,239,321.400	
	CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S	9,283	676.800	6,282,734.400	
ISS A/S	16,240	214.300	3,480,232.000		
ORSTED A/S	17,249	510.000	8,796,990.000		
デンマーク・クローネ 小計		370,973		141,436,124.050 (2,373,298,161)	
ニュージーラン ド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	85,245	7.970	679,402.650	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	29,894	11.500	343,781.000	
	A2 MILK CO LTD	55,091	14.620	805,430.420	
	FISHER & PAYKEL	42,678	15.050	642,303.900	
	FLETCHER BUILDING LTD	64,104	4.960	317,955.840	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	159,623	3.575	570,652.220	
	MERIDIAN ENERGY LTD	90,173	3.970	357,986.810	
ニュージーランド・ドル 小計		526,808		3,717,512.840 (279,371,090)	
ノルウェー・ク ローネ	MOWI ASA	41,773	189.000	7,895,097.000	
	DNB ASA	79,783	162.850	12,992,661.550	
	NORSK HYDRO ASA	137,190	37.340	5,122,674.600	
	TELENOR ASA	62,076	173.500	10,770,186.000	
	ORKLA ASA	64,938	66.060	4,289,804.280	
	EQUINOR ASA	105,468	196.800	20,756,102.400	

	YARA INTERNATIONAL ASA	16,000	360.000	5,760,000.000	
	AKER BP ASA	8,552	314.000	2,685,328.000	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	16,683	157.500	2,627,572.500	
	ADEVINTA ASA	7,445	89.090	663,275.050	
	SCHIBSTED ASA	7,445	226.600	1,687,037.000	
	ノルウェー・クローネ 小計	547,353		75,249,738.380 (984,266,578)	
ユーロ	CRH PLC	71,394	28.600	2,041,868.400	
	PADDY POWER BETFAIR PLC	6,246	69.940	436,845.240	
	KERRY GROUP PLC-A	13,865	98.850	1,370,555.250	
	KINGSPAN GROUP PLC	14,756	44.180	651,920.080	
	UMICORE	19,109	41.200	787,290.800	
	AIR LIQUIDE	37,092	116.550	4,323,072.600	
	AIRBUS SE	50,291	116.500	5,858,901.500	
	AXA	171,730	23.175	3,979,842.750	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	49,632	20.530	1,018,944.960	
	ADIDAS AG	15,601	226.300	3,530,506.300	
	ASSICURAZIONI GENERALI	104,014	16.670	1,733,913.380	
	DASSAULT AVIATION SA	274	1,300.000	356,200.000	
	DANONE	54,023	69.000	3,727,587.000	
	SAFRAN SA	29,268	120.900	3,538,501.200	
	INTESA SANPAOLO	1,266,706	2.221	2,813,354.020	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	30,304	73.190	2,217,949.760	
	ACCOR SA	16,000	36.870	589,920.000	
	BOUYGUES	17,572	33.710	592,352.120	
	BNP PARIBAS	96,988	44.200	4,286,869.600	
	THALES SA	9,883	104.550	1,033,267.650	
	CAPGEMINI SA	13,759	109.350	1,504,546.650	
	CASINO GUICHARD PERRACHON	4,264	36.220	154,442.080	
	INGENICO GROUP	4,334	65.680	284,657.120	
	UNICREDIT SPA	170,144	11.836	2,013,824.380	
	NATIXIS	70,166	4.936	346,339.370	
	KONINKLIJKE DSM NV	15,111	101.250	1,529,988.750	
	COMMERZBANK AG	83,118	7.227	600,693.780	
	EIFFAGE	5,949	88.040	523,749.960	
	FRESENIUS SE & CO KGAA	37,562	51.600	1,938,199.200	
	UNITED INTERNET	9,882	33.520	331,244.640	
	FUCHS PETROLUB SE PREF	5,546	37.300	206,865.800	
	PUBLICIS GROUPE	18,222	46.530	847,869.660	
	FAURECIA	6,117	42.290	258,687.930	
	IBERDROLA SA	532,301	7.948	4,230,728.340	
	ENI SPA	222,205	15.940	3,541,947.700	
	IMERYS SA	2,256	46.640	105,219.840	
	JERONIMO MARTINS	19,517	13.830	269,920.110	
	KBC GROUPE	20,803	64.580	1,343,457.740	
	HANNOVER RUECK SE	4,868	129.800	631,866.400	

WARTSILA OYJ	34,935	14.800	517,038.000	
L'OREAL	21,749	242.500	5,274,132.500	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	23,977	329.750	7,906,415.750	
GEA GROUP AG	11,838	24.570	290,859.660	
BOLLORE	71,347	4.102	292,665.390	
MEDIOBANCA SPA	62,022	9.304	577,052.680	
MICHELIN(CGDE)-B	15,018	112.100	1,683,517.800	
CONTINENTAL AG	9,528	146.600	1,396,804.800	
DEUTSCHE POST AG-REG	86,663	29.915	2,592,523.640	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	24,847	15.205	377,798.630	
NOKIAN RENKAAT OYJ	9,399	30.330	285,071.670	
AXEL SPRINGER SE	4,978	49.000	243,922.000	
OMV AG	12,817	48.230	618,163.910	
VERBUND AG	6,778	45.160	306,094.480	
PERNOD-RICARD	18,479	160.000	2,956,640.000	
PEUGEOT SA	50,087	22.910	1,147,493.170	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG- PFD	13,249	58.500	775,066.500	
RENAULT SA	17,786	60.830	1,081,922.380	
REPSOL SA	126,723	15.295	1,938,228.280	
REMY COINTREAU	1,860	118.300	220,038.000	
MERCK KGAA	11,193	99.700	1,115,942.100	
COMPAGNIE DE SAINT- GOBAIN	44,331	35.000	1,551,585.000	
RWE AG	45,905	24.120	1,107,228.600	
SEB SA	2,420	161.000	389,620.000	
SOCIETE GENERALE-A	69,792	26.260	1,832,737.920	
VINCI S.A.	43,889	89.440	3,925,432.160	
SODEXO	8,639	101.450	876,426.550	
SOLVAY SA	7,086	103.200	731,275.200	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	48,032	73.220	3,516,903.040	
VIVENDI SA	93,560	26.320	2,462,499.200	
SAP SE	85,055	99.700	8,479,983.500	
TELEFONICA S.A	415,379	7.394	3,071,312.320	
TOTAL SA	208,673	50.370	10,510,859.010	
VALEO	19,653	28.340	556,966.020	
E.ON SE	197,427	10.076	1,989,274.450	
VOEST-ALPINE AG	9,875	28.760	284,005.000	
HENKEL AG & CO KGAA	9,300	83.000	771,900.000	
SIEMENS AG-REG	67,182	101.580	6,824,347.560	
UPM-KYMMENE OYJ	49,371	26.550	1,310,800.050	
ING GROEP NV-CVA	341,295	11.248	3,838,886.160	
PUMA AG	600	529.000	317,400.000	
BAYER AG	81,767	61.470	5,026,217.490	
STORA ENSO OYJ-R SHS	54,186	11.945	647,251.770	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	15,350	89.200	1,369,220.000	

DAIMLER AG	80,758	55.060	4,446,535.480	
BASF SE	79,836	68.830	5,495,111.880	
BEIERSDORF AG	8,371	94.800	793,570.800	
HOCHTIEF AG	1,707	129.000	220,203.000	
HEIDELBERGCEMENT AG	14,126	69.720	984,864.720	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	18,494	73.740	1,363,747.560	
ORANGE	172,654	14.680	2,534,560.720	
SAMPO OYJ-A SHS	39,403	39.390	1,552,084.170	
RANDSTAD NV	12,061	46.300	558,424.300	
ALLIANZ SE	36,249	206.500	7,485,418.500	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	242,094	3.470	840,066.180	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	103,511	23.310	2,412,841.410	
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	17,602	14.040	247,132.080	
HERMES INTL	2,703	588.600	1,590,985.800	
ENDESA S.A.	29,314	22.830	669,238.620	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	24,926	20.880	520,454.880	
ERSTE GROUP BANK AG	25,117	34.180	858,499.060	
MUENCHENER RUECKVER AG- REG	12,966	214.500	2,781,207.000	
ARCELOR MITTAL (NL)	58,189	19.700	1,146,323.300	
SOCIETE BIC SA	2,478	78.850	195,390.300	
DASSAULT SYSTEMES SA	10,913	132.950	1,450,883.350	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	23,521	39.460	928,138.660	
HEINEKEN NV	23,051	94.700	2,182,929.700	
AKZO NOBEL	18,786	79.480	1,493,111.280	
ASML HOLDING NV	35,099	177.800	6,240,602.200	
AEGON NV	150,349	4.433	666,497.110	
BANKINTER S.A.	57,960	6.976	404,328.960	
VOLKSWAGEN AG	3,545	152.100	539,194.500	
VOLKSWAGEN AG PFD	15,382	147.600	2,270,383.200	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	595,667	5.294	3,153,461.090	
KERING	6,609	523.600	3,460,472.400	
CNP ASSURANCES	13,987	20.420	285,614.540	
FORTUM OYJ	37,452	19.205	719,265.660	
AGEAS	17,904	44.940	804,605.760	
UCB SA	11,267	75.880	854,939.960	
THYSSENKRUPP AG	37,894	12.825	485,990.550	
UNILEVER NV-CVA	134,883	51.600	6,959,962.800	
CARREFOUR SA	51,094	16.215	828,489.210	
NATURGY ENERGY GROUP SA	29,010	25.570	741,785.700	
ATOS SE	8,816	84.120	741,601.920	
NOKIA OYJ	495,975	5.168	2,563,198.800	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	79,121	35.285	2,791,784.480	
WOLTERS KLUWER-CVA	25,051	61.160	1,532,119.160	
SANOFI	97,369	77.960	7,590,887.240	

STMICROELECTRONICS NV	55,611	15.600	867,531.600	
ELISA OYJ	14,176	39.230	556,124.480	
BANCO SANTANDER SA	1,411,232	4.371	6,168,495.070	
METSO OYJ	8,585	32.970	283,047.450	
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	34,596	18.820	651,096.720	
QIAGEN N.V.	21,897	36.850	806,904.450	
1&1 DRILLISCH AG	3,149	32.460	102,216.540	
DEUTSCHE BANK AG-REG	171,985	7.242	1,245,515.370	
BMW VORZUG	4,116	63.450	261,160.200	
ENEL SPA	695,271	5.676	3,946,358.190	
COLRUYT NV	4,673	66.000	308,418.000	
VOPAK (KON.)	5,364	42.250	226,629.000	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	285,473	14.926	4,260,969.990	
SARTORIUS AG	2,712	161.600	438,259.200	
LEONARDO SPA	40,409	10.220	412,979.980	
UBISOFT ENTERTAINMENT	7,786	80.380	625,838.680	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	99,068	19.982	1,979,576.770	
KONINKLIJKE KPN NV	291,029	2.878	837,581.460	
EUROFINS SCIENTIFIC	794	360.200	285,998.800	
TELEPERFORMANCE	5,363	166.400	892,403.200	
DEUTSCHE BOERSE AG	16,913	115.250	1,949,223.250	
EURAZEO	4,725	65.950	311,613.750	
BANCO SABADELL	563,371	0.932	525,061.770	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	6,278	88.120	553,217.360	
FRAPORT AG	3,149	70.360	221,563.640	
HEINEKEN HOLDING NV-A	9,791	90.000	881,190.000	
INDITEX	96,734	26.540	2,567,320.360	
JC DECAUX SA	6,058	27.520	166,716.160	
ANDRITZ AG	6,265	41.280	258,619.200	
MAPFRE SA	84,474	2.552	215,577.640	
ESSILORLUXOTTICA	25,705	96.860	2,489,786.300	
SNAM SPA	199,702	4.611	920,825.920	
CREDIT AGRICOLE SA	99,973	11.380	1,137,692.740	
ENAGAS	18,095	25.840	467,574.800	
WENDEL	2,220	115.800	257,076.000	
WIRECARD AG	9,891	109.200	1,080,097.200	
TENARIS SA	36,959	12.515	462,541.880	
TELECOM ITALIA SPA	1,158,473	0.531	615,149.160	
TELECOM ITALIA-RNC	497,596	0.492	244,817.230	
ATLANTIA SPA	43,688	23.270	1,016,619.760	
ILIAD SA	2,102	93.300	196,116.600	
PROXIMUS	14,283	26.740	381,927.420	
SES FDR	34,268	15.050	515,733.400	
TERNA SPA	112,686	5.628	634,196.800	
BIOMERIEUX	3,248	77.000	250,096.000	
GRIFOLS SA	23,518	25.010	588,185.180	
FERROVIAL SA	37,911	20.650	782,862.150	

LANXESS AG	6,856	51.160	350,752.960	
NESTE OYJ	32,520	32.810	1,066,981.200	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	9,641	21.720	209,402.520	
RECORDATI SPA	6,859	36.060	247,335.540	
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	55,725	8.725	486,200.620	
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	4,859	205.300	997,552.700	
KONE OYJ	29,124	47.500	1,383,390.000	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	2,881	111.800	322,095.800	
ENGIE	159,735	13.605	2,173,194.670	
ALSTOM	12,046	39.760	478,948.960	
TELENET GROUP HOLDING NV	3,634	45.380	164,910.920	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	12,542	15.070	189,007.940	
ELECTRICITE DE FRANCE	53,800	12.360	664,968.000	
IPSEN SA	3,646	122.800	447,728.800	
DEUTSCHE WOHNEN	30,689	40.700	1,249,042.300	
ARKEMA SA	6,873	88.540	608,535.420	
LEGRAND SA	23,308	61.440	1,432,043.520	
ADP	2,313	176.400	408,013.200	
ORION OYJ	8,051	34.050	274,136.550	
RTL GROUP SA	3,446	50.200	172,989.200	
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	40,088	14.610	585,685.680	
SYMRISE AG	11,548	82.720	955,250.560	
SCOR SE	13,875	38.000	527,250.000	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	17,397	26.810	466,413.570	
REXEL SA	23,245	10.750	249,883.750	
PRYSMIAN SPA	21,452	16.295	349,560.340	
CAIXABANK	297,224	2.874	854,221.770	
BUREAU VERITAS SA	21,480	21.620	464,397.600	
GETLINK	37,646	13.960	525,538.160	
SUEZ SA	38,331	12.115	464,380.060	
AMADEUS IT GROUP SA	38,492	70.700	2,721,384.400	
BRENNTAG AG	12,353	47.050	581,208.650	
EVONIK INDUSTRIES AG	17,116	25.900	443,304.400	
EDENRED	22,652	41.960	950,477.920	
BANKIA SA	100,675	2.271	228,632.920	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	61,541	2.767	170,283.940	
HUGO BOSS AG -ORD	5,218	59.480	310,366.640	
OSRAM LICHT AG	7,017	31.920	223,982.640	
KION GROUP AG	7,345	53.600	393,692.000	
VONOVIA SE	44,635	45.490	2,030,446.150	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	82,256	5.495	451,996.720	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	15,254	37.280	568,669.120	
FERRARI NV	10,895	121.350	1,322,108.250	

	METRO AG	10,774	14.615	157,462.010	
	CNH INDUSTRIAL NV	94,317	9.468	892,993.350	
	AROWNTOWN SA	71,783	7.194	516,406.900	
	AIB GROUP PLC	86,464	4.048	350,006.270	
	INNOGY SE-TEMPORARY	9,769	39.100	381,967.900	
	MONCLER SPA	14,353	35.810	513,980.930	
	NN GROUP NV	28,528	36.940	1,053,824.320	
	ZALANDO SE	9,414	36.310	341,822.340	
	FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	89,977	13.896	1,250,320.390	
	AENA SME SA	6,175	162.350	1,002,511.250	
	ABN AMRO GROUP NV	34,251	20.830	713,448.330	
	EXOR NV	10,237	59.180	605,825.660	
	COVESTRO AG	15,802	52.340	827,076.680	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	65,369	77.510	5,066,751.190	
	POSTE ITALIANE SPA	40,015	8.942	357,814.130	
	AMUNDI SA	6,409	59.600	381,976.400	
	ADYEN NV	672	697.800	468,921.600	
	PIRELLI & C SPA	34,086	6.260	213,378.360	
	UNIPER SE	19,366	27.220	527,142.520	
	DELIVERY HERO SE	7,238	35.040	253,619.520	
ユーロ 小計		17,190,823		334,822,465.320 (41,933,165,557)	
香港・ドル	ASM PACIFIC TECH	32,700	94.300	3,083,610.000	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	164,000	19.400	3,181,600.000	
	BANK OF EAST ASIA	103,860	25.700	2,669,202.000	
	CLP HOLDINGS LTD	149,500	90.100	13,469,950.000	
	PCCW LTD	331,000	4.710	1,559,010.000	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	49,000	63.000	3,087,000.000	
	HONG KONG EXCHANGES &CLEAR	108,540	281.000	30,499,740.000	
	MTR CORP	150,000	48.650	7,297,500.000	
	HANG LUNG GROUP LTD	63,000	24.500	1,543,500.000	
	HANG SENG BANK LTD	65,400	198.000	12,949,200.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	132,228	50.850	6,723,793.800	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	123,000	54.200	6,666,600.000	
	(THE) WHARF HOLDINGS LTD	95,750	23.450	2,245,337.500	
	HONG KONG & CHINA GAS	837,050	18.880	15,803,504.000	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	50,000	43.150	2,157,500.000	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	203,000	60.400	12,261,200.000	
	KERRY PROPERTIES LTD	73,500	34.500	2,535,750.000	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	324,000	35.400	11,469,600.000	
NWS HOLDINGS LTD	135,000	16.960	2,289,600.000		

YUE YUEN INDUSTRIAL HOLDINGS	50,500	26.200	1,323,100.000	
NEW WORLD DEVELOPMENT	605,266	13.520	8,183,196.320	
SHANGRI-LA ASIA LTD	104,000	11.440	1,189,760.000	
SINO LAND CO	255,400	14.580	3,723,732.000	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	135,000	139.600	18,846,000.000	
SWIRE PACIFIC LTD A	47,500	98.600	4,683,500.000	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	113,500	57.850	6,565,975.000	
WHEELLOCK & CO LTD	86,000	56.950	4,897,700.000	
MINTH GROUP LTD	44,000	28.350	1,247,400.000	
SJM HOLDINGS LTD	156,000	9.670	1,508,520.000	
WYNN MACAU LTD	124,400	21.750	2,705,700.000	
MGM CHINA HOLDINGS LTD	64,800	17.000	1,101,600.000	
AIA GROUP LTD	1,044,427	80.250	83,815,266.750	
HKT TRUST / HKT LTD	386,000	12.320	4,755,520.000	
SANDS CHINA LTD	232,800	43.300	10,080,240.000	
SWIRE PROPERTIES LTD	104,200	32.700	3,407,340.000	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT CO LTD	95,750	58.850	5,634,887.500	
HK ELECTRIC INVESTMENTS & HK ELECTRIC INVESTMENTS LTD	230,000	7.660	1,761,800.000	
WH GROUP LTD	701,500	8.690	6,096,035.000	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	242,832	85.350	20,725,711.200	
CK ASSET HOLDINGS LTD	222,832	70.250	15,653,948.000	
香港・ドル 小計	8,237,235		349,400,129.070 (4,954,493,830)	
合計	97,424,708		351,329,769,011 (351,329,769,011)	

(2) 株式以外の有価証券

平成31年4月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	オーストラリア・ドル	DEXUS	80,596.000	1,006,644.040	
		GOODMAN GROUP	147,572.000	1,944,998.960	
		GPT GROUP	144,955.000	866,830.900	
		LENLEASE GROUP	42,974.000	538,034.480	
		MIRVAC GROUP	295,783.000	816,361.080	
		SCENTRE GROUP	476,956.000	1,860,128.400	
		STOCKLAND	194,018.000	746,969.300	
	VICINITY CENTRES	270,443.000	676,107.500		
	オーストラリア・ドル	小計	1,653,297.000	8,456,074.660 (673,188,104)	
シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	200,806.000	588,361.580		
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	206,300.000	410,537.000		
	CAPITALAND MALL TRUST	199,000.000	479,590.000		

		SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	192,100.000	374,595.000	
	シンガポール・ドル	小計	798,206.000	1,853,083.580 (152,267,878)	
投資信託受益証券	合計		2,451,503	825,455,982 (825,455,982)	
投資証券	アメリカ・ドル	AGNC INVESTMENT CORP	44,741.000	809,364.690	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	9,644.000	1,387,192.960	
		AMERICAN TOWER CORP	38,497.000	7,569,280.140	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	125,554.000	1,259,306.620	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	12,353.000	2,497,776.600	
		BOSTON PROPERTIES INC	13,309.000	1,841,832.510	
		BROOKFIELD PROPERTY REIT INC	11,193.000	235,836.510	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	8,062.000	826,355.000	
		CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	36,860.000	4,801,015.000	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	18,388.000	2,242,968.240	
		DUKE REALTY TRUST	32,954.000	1,015,971.820	
		EQUINIX INC	6,964.000	3,211,866.440	
		EQUITY RESIDENTIAL	32,976.000	2,517,717.600	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	5,653.000	1,632,021.100	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	10,070.000	1,027,039.300	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	6,000.000	831,240.000	
		HCP INC	39,277.000	1,216,408.690	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	64,001.000	1,226,259.160	
		INVITATION HOMES INC	30,427.000	737,854.750	
		IRON MOUNTAIN INC	23,977.000	868,207.170	
		KIMCO REALTY	32,980.000	608,810.800	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	11,649.000	574,062.720	
		MID AMERICA	10,258.000	1,130,021.280	
		NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	13,649.000	733,906.730	
		PROLOGIS INC	55,164.000	4,057,863.840	
		PUBLIC STORAGE	13,721.000	3,011,759.500	
		REALTY INCOME CORP	26,616.000	1,909,964.160	
		REGENCY CENTERS CORP	13,023.000	895,721.940	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	10,277.000	2,081,400.810	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	26,150.000	4,835,919.500	
		SL GREEN	7,097.000	650,723.930	
		THE MACERICH COMPANY	9,014.000	391,207.600	
		UDR INC	21,658.000	982,406.880	
		VENTAS INC	30,244.000	1,893,274.400	
		VEREIT INC	93,429.000	778,263.570	

	VORNADO REALTY TRUST	15,346.000	1,041,839.940	
	WELLTOWER INC	33,309.000	2,548,804.680	
	WEYERHAEUSER CO	63,699.000	1,701,400.290	
	WP CAREY INC	15,148.000	1,186,997.280	
アメリカ・ドル 小計		1,073,331.000	68,769,864.150 (7,641,019,606)	
イギリス・ポンド	BRITISH LAND CO PLC	92,822.000	556,189.420	
	HAMMERSON PLC	58,616.000	194,780.960	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	55,843.000	510,293.330	
	SEGRO PLC	104,952.000	710,734.940	
イギリス・ポンド 小計		312,233.000	1,971,998.650 (286,945,523)	
カナダ・ドル	H & R REAL ESTATE INVESTMENT	10,748.000	252,255.560	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	9,675.000	255,613.500	
	SMARTCENTRES REIT	9,288.000	323,315.280	
カナダ・ドル 小計		29,711.000	831,184.340 (69,254,280)	
ユーロ	COVIVIO	4,675.000	445,060.000	
	GECINA SA	3,670.000	482,972.000	
	ICADE	2,234.000	169,784.000	
	KLEPIERRE	17,042.000	546,196.100	
	UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	12,061.000	1,848,348.250	
ユーロ 小計		39,682.000	3,492,360.350 (437,383,210)	
香港・ドル	LINK REIT	185,500.000	17,288,600.000	
香港・ドル 小計		185,500.000	17,288,600.000 (245,152,349)	
投資証券 合計		1,640,457	8,679,754,968 (8,679,754,968)	
合計			9,505,210,950 (9,505,210,950)	

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 597銘柄	64.35%	-%	-%	68.20%
	投資証券 39銘柄	-%	-%	2.06%	
イギリス・ポンド	株式 92銘柄	6.15%	-%	-%	6.39%
	投資証券 4銘柄	-%	-%	0.08%	
イスラエル・シケル	株式 8銘柄	0.11%	-%	-%	0.11%
オーストラリア・ドル	株式 61銘柄	2.33%	-%	-%	2.58%
	投資信託 受益証券 8銘柄	-%	0.18%	-%	
カナダ・ドル	株式 89銘柄	3.65%	-%	-%	3.77%
	投資証券 3銘柄	-%	-%	0.02%	
シンガポール・ドル	株式 21銘柄	0.45%	-%	-%	0.50%
	投資信託 受益証券 4銘柄	-%	0.04%	-%	
スイス・フラン	株式 39銘柄	3.17%	-%	-%	3.26%
スウェーデン・クローナ	株式 32銘柄	0.98%	-%	-%	1.01%
デンマーク・クローネ	株式 17銘柄	0.64%	-%	-%	0.66%
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 11銘柄	0.27%	-%	-%	0.27%
ユーロ	株式 237銘柄	11.32%	-%	-%	11.74%
	投資証券 5銘柄	-%	-%	0.12%	
香港・ドル	株式 40銘柄	1.34%	-%	-%	1.44%
	投資証券 1銘柄	-%	-%	0.07%	

(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10月11日現在	平成31年4月11日現在
資産の部			
流動資産			
預金		2,747,434,662	2,576,357,011
コール・ローン		613,753,950	407,578,092
国債証券		195,991,508,237	190,797,876,089
派生商品評価勘定		52,210	17,979
未収入金		319,125,655	762,037,986
未収利息		1,762,319,633	1,643,186,697
前払費用		26,013,949	52,139,914
流動資産合計		201,460,208,296	196,239,193,768
資産合計		201,460,208,296	196,239,193,768
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		-	44,409
未払金		1,190,886,419	-
未払解約金		264,766,000	203,621,100
流動負債合計		1,455,652,419	203,665,509
負債合計		1,455,652,419	203,665,509
純資産の部			
元本等			
元本	1	111,753,378,219	106,154,635,396
剰余金			
剰余金又は欠損金()		88,251,177,658	89,880,892,863
元本等合計		200,004,555,877	196,035,528,259
純資産合計		200,004,555,877	196,035,528,259
負債純資産合計		201,460,208,296	196,239,193,768

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10月11日現在	平成31年4月11日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額 同期中追加設定元本額 同期中一部解約元本額	115,824,125,042円 16,933,511,969円 21,004,258,792円	111,753,378,219円 11,118,473,796円 16,717,216,619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	7,830,421,913円	7,849,278,423円
M I T O ラップ型ファンド（安定型）	12,133,962円	8,220,777円
M I T O ラップ型ファンド（中立型）	32,672,527円	27,516,031円
M I T O ラップ型ファンド（積極型）	40,635,275円	33,907,393円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	85,434,297円	71,426,569円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	86,584,078円	74,651,150円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	53,227,010円	44,617,036円
たわらノーロード 先進国債券	2,732,598,993円	3,841,645,385円
たわらノーロード 先進国債券<ラップ向け>	606,412円	606,247円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	85,757,190円	187,901,180円
たわらノーロード バランス（堅実型）	1,666,151円	3,585,939円

たわらノーロード バランス (標準型)	9,134,238円	19,526,698円
たわらノーロード バランス (積極型)	2,975,382円	4,872,923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)	278,668円	658,750円
たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(安定型)	15,745,793円	33,134,590円
たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(安定成長 型)	24,957,436円	59,040,033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)	7,742,312円	17,505,651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)	3,802,159円	20,790,228円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定型)	125,481円	747,834円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定成長型)	952,774円	1,568,090円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(成長型)	440,423円	623,210円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(積極型)	715,447円	1,025,018円
D I A M外国債券インデックス ファンド< D C年金>	5,130,383,036円	5,472,791,469円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 1 安定型	508,593,929円	537,272,707円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 2 安定・成長型	1,661,346,768円	1,705,477,031円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 3 成長型	1,750,297,361円	1,765,920,058円
D I A M D C バランス3 0 インデックスファンド	375,053,475円	369,540,190円
D I A M D C バランス5 0 インデックスファンド	812,877,584円	800,764,253円
D I A M D C バランス7 0 インデックスファンド	644,522,531円	620,721,465円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型>	22,797,155円	22,350,096円
マネックス資産設計ファンド< 育成型>	597,658,723円	609,542,332円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	16,493,279円	10,876,029円
D I A M D C 8 資産バラ ンスファンド(新興国1 0)	116,556,212円	120,567,843円
D I A M D C 8 資産バラ ンスファンド(新興国2 0)	67,061,918円	73,194,203円
D I A M D C 8 資産バラ ンスファンド(新興国3 0)	112,693,813円	120,507,291円
クルーズコントロール	1,748,041,047円	2,914,474,463円
D I A M 8 資産バランスファ ンドN< D C年金>	81,966,152円	92,429,886円

D I A M D C バランス・F (成長型)	145,018,693円	153,444,763円
クルーズコントロール<DC年金>	1,010,504円	2,093,489円
D I A Mコア資産設計ファンド (堅実型)	7,283,621円	9,876,940円
D I A Mコア資産設計ファンド (積極型)	15,275,389円	22,578,913円
ダイナミック・ナビゲーション	364,709円	357,565円
4資産分散投資・スタンダード <DC年金>	15,301,697円	18,014,393円
9資産分散投資・スタンダード <DC年金>	11,075円	2,338,252円
D I A Mパッシブ資産分散ファ ンド	1,315,797,580円	1,293,843,278円
D I A M為替フルヘッジ型外国 債券パッシブ私募ファンド(適 格機関投資家向け)	6,773,540,012円	6,956,217,810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)	4,135,915,089円	3,701,885,314円
外国債券パッシブファンド(適 格機関投資家限定)	3,316,290,366円	2,487,091,451円
先進国債券パッシブファンド (適格機関投資家限定)	6,087,766,169円	6,082,590,551円
D I A Mワールドバランス25 VA(適格機関投資家限定)	95,731,710円	93,139,643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)	806,989,317円	746,352,851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)	659,285,763円	602,002,775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)	50,717,767円	47,514,109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)	92,921,832円	85,161,928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)	23,232,912円	22,538,189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)	7,499,874円	6,154,833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)	66,675,797円	53,506,580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)	79,005,779円	71,641,773円
D I A Mバランスファンド25 VA(適格機関投資家限定)	3,455,775,354円	3,146,845,261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)	2,288,310,075円	2,105,933,704円
D I A Mバランスファンド50 V A (適格機関投資家限定)	3,952,485,636円	3,602,288,898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)	699,334,985円	644,233,551円
D I A Mグローバル・アセッ ト・バランスV A 2 (適格機関 投資家限定)	263,420,576円	243,619,032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)	3,224,437,640円	2,940,331,693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)	2,354,914,119円	1,526,963,092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	14,665,687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)	16,311,743円	6,584,678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)	156,842,701円	110,273,347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)	10,390,321,013円	6,515,570,494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)	19,189,841,080円	18,539,204,677円
D I A Mバランス30 V A (適 格機関投資家限定)	14,080,569円	19,981,901円
D I A Mバランス50 V A (適 格機関投資家限定)	11,257,433円	1,005,859円
D I A Mバランス70 V A (適 格機関投資家限定)	5,627,956円	5,037,615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)	17,135,274,007円	16,541,064,284円
D I A M世界バランス25 V A (適格機関投資家限定)	100,006,763円	86,235,059円
D I A Mバランス20 V A (適 格機関投資家限定)	110,036,727円	106,645,796円
D I A Mバランス40 V A (適 格機関投資家限定)	369,121円	363,412円
D I A Mバランス60 V A (適 格機関投資家限定)	168,633円	163,485円
計	111,753,378,219円	106,154,635,396円
2. 受益権の総数	111,753,378,219口	106,154,635,396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30年4月12日 至 平成30年10月11日	自 平成30年10月12日 至 平成31年4月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成30年10月11日現在	平成31年4月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成30年10月11日現在	平成31年4月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
国債証券	3,947,068,518	2,199,575,016
合計	3,947,068,518	2,199,575,016

(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10月11日まで及び平成31年2月22日から平成31年4月11日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	平成30年10月11日 現在				平成31年4月11日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	-	-	-	-	1,263,610,000	-	1,263,636,430	26,430
アメリカ・ドル	-	-	-	-	634,830,000	-	634,830,000	-
イギリス・債券	-	-	-	-	91,250,000	-	91,256,900	6,900
オーストラリア・ドル	-	-	-	-	29,710,000	-	29,713,360	3,360
カナダ・ドル	-	-	-	-	26,200,000	-	26,201,257	1,257
ユーロ	-	-	-	-	457,690,000	-	457,722,892	32,892
南アフリカ・ランド	-	-	-	-	23,930,000	-	23,912,021	17,979
買 建	1,350,330,000	-	1,350,382,210	52,210	-	-	-	-
アメリカ・ドル	504,760,000	-	504,760,000	-	-	-	-	-
ユーロ	845,570,000	-	845,622,210	52,210	-	-	-	-
合計	1,350,330,000	-	1,350,382,210	52,210	1,263,610,000	-	1,263,636,430	26,430

(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10月11日現在	平成31年4月11日現在
1口当たり純資産額	1,7897円	1,8467円
(1万口当たり純資産額)	(17,897円)	(18,467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31年4月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	US T N/B 1.125 02/28/21	3,680,000.000	3,597,752.000	
		US T N/B 1.375 01/31/21	2,750,000.000	2,702,727.500	
		US T N/B 1.375 04/30/20	12,000,000.000	11,870,520.000	
		US T N/B 1.375 04/30/21	11,210,000.000	10,998,018.900	
		US T N/B 1.375 05/31/20	3,500,000.000	3,459,505.000	
		US T N/B 1.375 06/30/23	7,000,000.000	6,746,740.000	
		US T N/B 1.375 09/30/23	5,900,000.000	5,672,260.000	
		US T N/B 1.5 08/15/26	7,000,000.000	6,573,420.000	
		US T N/B 1.625 02/15/26	5,500,000.000	5,237,430.000	
		US T N/B 1.625 05/15/26	7,330,000.000	6,965,185.900	
		US T N/B 1.625 05/31/23	5,300,000.000	5,164,161.000	
		US T N/B 1.625 08/15/22	9,500,000.000	9,302,495.000	
		US T N/B 1.625 11/15/22	9,420,000.000	9,210,970.200	
		US T N/B 1.625 11/30/20	8,510,000.000	8,408,901.200	
		US T N/B 1.75 01/31/23	8,570,000.000	8,401,942.300	
		US T N/B 1.75 03/31/22	9,450,000.000	9,308,911.500	
		US T N/B 1.75 05/15/22	9,910,000.000	9,753,521.100	
		US T N/B 1.75 05/15/23	7,000,000.000	6,857,200.000	
		US T N/B 1.75 09/30/22	10,230,000.000	10,052,509.500	
		US T N/B 1.75 10/31/20	6,000,000.000	5,943,240.000	
		US T N/B 1.75 12/31/20	9,000,000.000	8,907,840.000	
		US T N/B 1.875 02/28/22	1,680,000.000	1,661,100.000	
		US T N/B 1.875 06/30/20	11,000,000.000	10,931,580.000	
		US T N/B 1.875 08/31/22	8,450,000.000	8,340,403.500	
		US T N/B 1.875 08/31/24	5,760,000.000	5,633,510.400	
		US T N/B 2.0 02/15/22	11,050,000.000	10,970,550.500	
		US T N/B 2.0 02/15/23	9,500,000.000	9,404,240.000	
		US T N/B 2.0 02/15/25	9,500,000.000	9,324,060.000	
		US T N/B 2.0 05/31/21	12,000,000.000	11,920,680.000	
		US T N/B 2.0 05/31/24	6,180,000.000	6,092,553.000	
		US T N/B 2.0 08/15/25	6,920,000.000	6,773,988.000	
		US T N/B 2.0 09/30/20	6,000,000.000	5,966,700.000	
		US T N/B 2.0 11/15/21	10,400,000.000	10,328,032.000	
		US T N/B 2.0 11/15/26	7,000,000.000	6,798,750.000	
		US T N/B 2.0 11/30/20	7,920,000.000	7,874,143.200	
		US T N/B 2.0 11/30/22	6,590,000.000	6,527,131.400	
US T N/B 2.125 01/31/21	5,000,000.000	4,980,050.000			
US T N/B 2.125 02/29/24	1,300,000.000	1,290,146.000			
US T N/B 2.125 05/15/25	8,930,000.000	8,816,231.800			
US T N/B 2.125 06/30/22	9,500,000.000	9,456,205.000			

US T N/B 2.125 08/15/21	11,000,000.000	10,955,670.000	
US T N/B 2.125 08/31/20	3,000,000.000	2,989,680.000	
US T N/B 2.125 09/30/21	10,000,000.000	9,960,100.000	
US T N/B 2.125 09/30/24	5,710,000.000	5,651,986.400	
US T N/B 2.125 12/31/21	10,330,000.000	10,287,956.900	
US T N/B 2.125 12/31/22	8,000,000.000	7,958,080.000	
US T N/B 2.25 01/31/24	350,000.000	349,422.500	
US T N/B 2.25 02/15/27	7,040,000.000	6,960,800.000	
US T N/B 2.25 03/31/21	9,760,000.000	9,745,848.000	
US T N/B 2.25 08/15/27	6,750,000.000	6,656,107.500	
US T N/B 2.25 08/15/46	4,070,000.000	3,569,512.100	
US T N/B 2.25 11/15/24	8,590,000.000	8,557,787.500	
US T N/B 2.25 11/15/25	7,000,000.000	6,947,500.000	
US T N/B 2.25 11/15/27	6,620,000.000	6,520,700.000	
US T N/B 2.25 12/31/23	5,860,000.000	5,851,737.400	
US T N/B 2.375 05/15/27	6,330,000.000	6,309,680.700	
US T N/B 2.375 08/15/24	8,900,000.000	8,930,527.000	
US T N/B 2.375 12/31/20	8,300,000.000	8,301,245.000	
US T N/B 2.5 01/15/22	3,850,000.000	3,871,791.000	
US T N/B 2.5 01/31/21	9,810,000.000	9,835,604.100	
US T N/B 2.5 01/31/24	3,890,000.000	3,929,172.300	
US T N/B 2.5 02/15/22	1,070,000.000	1,076,387.900	
US T N/B 2.5 02/15/45	4,500,000.000	4,181,445.000	
US T N/B 2.5 02/15/46	2,970,000.000	2,751,408.000	
US T N/B 2.5 02/28/26	2,550,000.000	2,570,119.500	
US T N/B 2.5 03/31/23	1,020,000.000	1,028,680.200	
US T N/B 2.5 05/15/24	9,000,000.000	9,090,000.000	
US T N/B 2.5 05/15/46	4,400,000.000	4,072,728.000	
US T N/B 2.5 08/15/23	8,000,000.000	8,074,960.000	
US T N/B 2.625 01/31/26	2,180,000.000	2,214,727.400	
US T N/B 2.625 02/15/29	4,640,000.000	4,699,438.400	
US T N/B 2.625 03/31/25	4,080,000.000	4,144,056.000	
US T N/B 2.625 06/30/23	1,820,000.000	1,845,298.000	
US T N/B 2.625 08/15/20	16,500,000.000	16,548,180.000	
US T N/B 2.625 08/31/20	9,250,000.000	9,279,230.000	
US T N/B 2.625 11/15/20	6,000,000.000	6,022,260.000	
US T N/B 2.625 12/15/21	3,770,000.000	3,804,005.400	
US T N/B 2.625 12/31/23	3,060,000.000	3,106,848.600	
US T N/B 2.625 12/31/25	2,290,000.000	2,326,296.500	
US T N/B 2.75 02/15/24	8,040,000.000	8,212,056.000	
US T N/B 2.75 02/15/28	5,950,000.000	6,090,836.500	
US T N/B 2.75 02/28/25	3,510,000.000	3,588,413.400	
US T N/B 2.75 04/30/23	2,490,000.000	2,535,318.000	
US T N/B 2.75 05/31/23	3,270,000.000	3,330,789.300	
US T N/B 2.75 06/30/25	790,000.000	807,956.700	
US T N/B 2.75 07/31/23	6,500,000.000	6,625,905.000	
US T N/B 2.75 08/15/42	1,800,000.000	1,767,222.000	
US T N/B 2.75 08/15/47	4,420,000.000	4,294,295.200	
US T N/B 2.75 08/31/23	2,170,000.000	2,212,879.200	

US T N/B 2.75 08/31/25	1,640,000.000	1,677,654.400	
US T N/B 2.75 11/15/23	9,370,000.000	9,559,555.100	
US T N/B 2.75 11/15/42	3,190,000.000	3,127,667.400	
US T N/B 2.75 11/15/47	3,360,000.000	3,257,083.200	
US T N/B 2.75 11/30/20	7,840,000.000	7,889,235.200	
US T N/B 2.875 05/15/28	7,120,000.000	7,361,368.000	
US T N/B 2.875 05/15/43	3,880,000.000	3,882,716.000	
US T N/B 2.875 05/31/25	2,530,000.000	2,605,090.400	
US T N/B 2.875 07/31/25	3,390,000.000	3,492,208.500	
US T N/B 2.875 08/15/28	5,730,000.000	5,924,247.000	
US T N/B 2.875 08/15/45	4,400,000.000	4,389,660.000	
US T N/B 2.875 09/30/23	840,000.000	861,126.000	
US T N/B 2.875 10/31/23	6,010,000.000	6,163,976.200	
US T N/B 2.875 11/15/21	4,880,000.000	4,951,443.200	
US T N/B 2.875 11/15/46	4,400,000.000	4,386,580.000	
US T N/B 2.875 11/30/23	5,640,000.000	5,789,347.200	
US T N/B 2.875 11/30/25	3,480,000.000	3,588,193.200	
US T N/B 3.0 02/15/47	3,480,000.000	3,554,750.400	
US T N/B 3.0 02/15/48	4,020,000.000	4,093,164.000	
US T N/B 3.0 02/15/49	3,050,000.000	3,108,377.000	
US T N/B 3.0 05/15/42	980,000.000	1,005,793.600	
US T N/B 3.0 05/15/45	4,440,000.000	4,537,102.800	
US T N/B 3.0 05/15/47	3,380,000.000	3,453,379.800	
US T N/B 3.0 08/15/48	4,770,000.000	4,857,529.500	
US T N/B 3.0 09/30/25	1,410,000.000	1,463,636.400	
US T N/B 3.0 10/31/25	4,480,000.000	4,651,808.000	
US T N/B 3.0 11/15/44	3,760,000.000	3,842,532.000	
US T N/B 3.0 11/15/45	3,900,000.000	3,984,981.000	
US T N/B 3.125 02/15/42	1,800,000.000	1,886,616.000	
US T N/B 3.125 02/15/43	2,600,000.000	2,717,000.000	
US T N/B 3.125 05/15/21	8,000,000.000	8,129,040.000	
US T N/B 3.125 05/15/48	4,350,000.000	4,537,572.000	
US T N/B 3.125 08/15/44	3,470,000.000	3,622,888.200	
US T N/B 3.125 11/15/28	5,830,000.000	6,153,331.800	
US T N/B 3.125 11/15/41	1,800,000.000	1,889,424.000	
US T N/B 3.375 05/15/44	3,910,000.000	4,260,648.800	
US T N/B 3.375 11/15/48	5,270,000.000	5,770,650.000	
US T N/B 3.5 02/15/39	1,300,000.000	1,457,209.000	
US T N/B 3.5 05/15/20	14,000,000.000	14,161,280.000	
US T N/B 3.625 02/15/21	5,500,000.000	5,625,675.000	
US T N/B 3.625 02/15/44	4,510,000.000	5,114,249.800	
US T N/B 3.625 08/15/43	3,700,000.000	4,191,397.000	
US T N/B 3.75 08/15/41	1,500,000.000	1,731,900.000	
US T N/B 3.75 11/15/43	4,120,000.000	4,761,484.000	
US T N/B 3.875 08/15/40	1,430,000.000	1,682,366.400	
US T N/B 4.25 05/15/39	810,000.000	1,001,994.300	
US T N/B 4.25 11/15/40	2,000,000.000	2,475,780.000	
US T N/B 4.375 02/15/38	750,000.000	939,255.000	
US T N/B 4.375 05/15/40	2,000,000.000	2,515,460.000	

	US T N/B 4.375 05/15/41	1,700,000.000	2,141,456.000	
	US T N/B 4.375 11/15/39	1,470,000.000	1,847,937.000	
	US T N/B 4.5 02/15/36	1,230,000.000	1,542,776.700	
	US T N/B 4.5 05/15/38	800,000.000	1,018,120.000	
	US T N/B 4.5 08/15/39	1,400,000.000	1,788,276.000	
	US T N/B 4.625 02/15/40	2,300,000.000	2,985,860.000	
	US T N/B 4.75 02/15/41	1,800,000.000	2,378,376.000	
	US T N/B 5.0 05/15/37	800,000.000	1,070,872.000	
	US T N/B 5.25 02/15/29	1,000,000.000	1,240,820.000	
	US T N/B 5.25 11/15/28	1,500,000.000	1,854,540.000	
	US T N/B 5.375 02/15/31	1,500,000.000	1,937,865.000	
	US T N/B 5.5 08/15/28	1,100,000.000	1,376,716.000	
	US T N/B 6.0 02/15/26	840,000.000	1,030,831.200	
	US T N/B 6.125 11/15/27	1,400,000.000	1,796,592.000	
	US T N/B 6.25 05/15/30	1,400,000.000	1,906,016.000	
	US T N/B 6.25 08/15/23	1,000,000.000	1,162,890.000	
	US T N/B 8.0 11/15/21	6,000,000.000	6,854,280.000	
アメリカ・ドル 小計		795,900,000.000 (88,432,449,000)	804,687,605.200 (89,408,839,814)	
イギリス・ポンド	UK TREASURY 0.5 07/22/22	2,350,000.000	2,334,607.500	
	UK TREASURY 0.75 07/22/23	1,560,000.000	1,558,580.400	
	UK TREASURY 1.0 04/22/24	580,000.000	584,564.600	
	UK TREASURY 1.25 07/22/27	2,320,000.000	2,368,047.200	
	UK TREASURY 1.5 01/22/21	2,700,000.000	2,738,907.000	
	UK TREASURY 1.5 07/22/26	1,970,000.000	2,051,341.300	
	UK TREASURY 1.5 07/22/47	2,320,000.000	2,255,272.000	
	UK TREASURY 1.625 10/22/28	1,790,000.000	1,876,045.300	
	UK TREASURY 1.625 10/22/71	1,010,000.000	1,065,236.900	
	UK TREASURY 1.75 01/22/49	460,000.000	474,030.000	
	UK TREASURY 1.75 07/22/57	1,730,000.000	1,842,104.000	
	UK TREASURY 1.75 09/07/22	3,000,000.000	3,103,650.000	
	UK TREASURY 1.75 09/07/37	1,900,000.000	1,963,840.000	
	UK TREASURY 2.0 09/07/25	1,110,000.000	1,189,642.500	
	UK TREASURY 2.25 09/07/23	2,590,000.000	2,756,485.200	

UK TREASURY 2.5 07/22/65	1,720,000.000	2,291,040.000	
UK TREASURY 2.75 09/07/24	2,000,000.000	2,204,200.000	
UK TREASURY 3.25 01/22/44	2,280,000.000	3,032,628.000	
UK TREASURY 3.5 01/22/45	2,300,000.000	3,202,980.000	
UK TREASURY 3.5 07/22/68	1,720,000.000	2,917,636.000	
UK TREASURY 3.75 07/22/52	1,630,000.000	2,554,536.000	
UK TREASURY 3.75 09/07/21	1,850,000.000	1,985,494.000	
UK TREASURY 4.0 01/22/60	1,530,000.000	2,684,997.000	
UK TREASURY 4.0 03/07/22	1,040,000.000	1,139,361.600	
UK TREASURY 4.25 03/07/36	2,100,000.000	2,972,970.000	
UK TREASURY 4.25 06/07/32	1,440,000.000	1,954,224.000	
UK TREASURY 4.25 09/07/39	1,400,000.000	2,062,340.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/27	1,700,000.000	2,161,822.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/40	1,780,000.000	2,656,116.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/46	1,510,000.000	2,389,424.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/49	1,430,000.000	2,345,343.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/55	1,750,000.000	3,079,475.000	
UK TREASURY 4.5 09/07/34	1,820,000.000	2,599,870.000	
UK TREASURY 4.5 12/07/42	1,820,000.000	2,863,042.000	
UK TREASURY 4.75 12/07/30	1,500,000.000	2,080,950.000	
UK TREASURY 4.75 12/07/38	1,610,000.000	2,494,856.000	
UK TREASURY 5.0 03/07/25	2,030,000.000	2,515,779.000	
UK TREASURY 6.0 12/07/28	1,050,000.000	1,525,482.000	
UK TREASURY 8.0 06/07/21	1,700,000.000	1,967,325.000	
イギリス・ボンド 小計	68,100,000.000 (9,909,231,000)	85,844,244.500 (12,491,196,017)	

オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN 5.75 05/15/21	3,700,000.000	4,023,565.000	
	AUSTRALIAN 2.0 12/21/21	1,770,000.000	1,795,895.100	
	AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	2,570,000.000	2,656,866.000	
	AUSTRALIAN 2.25 11/21/22	890,000.000	915,293.800	
	AUSTRALIAN 2.5 05/21/30	830,000.000	879,169.200	
	AUSTRALIAN 2.75 04/21/24	3,100,000.000	3,285,876.000	
	AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	900,000.000	975,627.000	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	2,900,000.000	3,110,453.000	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/28	2,700,000.000	2,907,684.000	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/29	1,560,000.000	1,687,998.000	
	AUSTRALIAN 3.0 03/21/47	1,250,000.000	1,376,600.000	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	3,100,000.000	3,391,803.000	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	3,100,000.000	3,488,027.000	
	AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	900,000.000	1,037,556.000	
	AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	1,200,000.000	1,475,040.000	
	AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	3,600,000.000	4,206,600.000	
	AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	1,500,000.000	1,951,830.000	
	AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	2,950,000.000	3,606,050.500	
	AUSTRALIAN 5.5 04/21/23	3,000,000.000	3,474,030.000	
	AUSTRALIAN 5.75 07/15/22	3,500,000.000	3,979,395.000	
オーストラリア・ドル 小計		45,020,000.000 (3,584,042,200)	50,225,358.600 (3,998,440,798)	
カナダ・ドル	CANADA 8.0 06/01/27	430,000.000	635,540.000	
	CANADA 0.75 03/01/21	2,300,000.000	2,265,109.000	
	CANADA 0.75 09/01/20	2,400,000.000	2,371,320.000	
	CANADA 0.75 09/01/21	600,000.000	588,570.000	
	CANADA 1.0 06/01/27	800,000.000	759,384.000	
	CANADA 1.0 09/01/22	800,000.000	785,096.000	
	CANADA 1.5 06/01/23	2,300,000.000	2,293,399.000	
	CANADA 1.5 06/01/26	1,700,000.000	1,684,190.000	
	CANADA 1.75 03/01/23	1,160,000.000	1,167,864.800	
	CANADA 2.0 06/01/28	1,020,000.000	1,047,346.200	
	CANADA 2.0 09/01/23	740,000.000	753,645.600	
	CANADA 2.0 12/01/51	250,000.000	251,285.000	
	CANADA 2.25 03/01/24	530,000.000	547,092.500	

	CANADA 2.25 06/01/25	1,500,000.000	1,556,475.000	
	CANADA 2.25 06/01/29	610,000.000	640,908.700	
	CANADA 2.5 06/01/24	1,600,000.000	1,673,168.000	
	CANADA 2.75 06/01/22	3,230,000.000	3,346,118.500	
	CANADA 2.75 12/01/48	1,450,000.000	1,699,545.000	
	CANADA 2.75 12/01/64	680,000.000	846,001.600	
	CANADA 3.25 06/01/21	4,700,000.000	4,865,158.000	
	CANADA 3.5 06/01/20	2,800,000.000	2,857,316.000	
	CANADA 3.5 12/01/45	1,720,000.000	2,255,384.400	
	CANADA 4.0 06/01/41	1,400,000.000	1,904,490.000	
	CANADA 5.0 06/01/37	1,400,000.000	2,054,542.000	
	CANADA 5.75 06/01/29	1,600,000.000	2,196,000.000	
	CANADA 5.75 06/01/33	1,260,000.000	1,875,144.600	
カナダ・ドル 小計		38,980,000.000 (3,247,813,600)	42,920,093.900 (3,576,102,224)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE 1.25 10/01/21	1,000,000.000	985,200.000	
	SINGAPORE 2.125 06/01/26	210,000.000	211,982.400	
	SINGAPORE 2.25 08/01/36	200,000.000	197,150.000	
	SINGAPORE 2.375 06/01/25	500,000.000	512,385.000	
	SINGAPORE 2.75 03/01/46	660,000.000	689,508.600	
	SINGAPORE 2.75 04/01/42	550,000.000	577,230.500	
	SINGAPORE 2.875 07/01/29	400,000.000	428,604.000	
	SINGAPORE 2.875 09/01/30	460,000.000	492,807.200	
	SINGAPORE 3.0 09/01/24	810,000.000	854,452.800	
	SINGAPORE 3.125 09/01/22	1,600,000.000	1,665,712.000	
	SINGAPORE 3.375 09/01/33	480,000.000	545,419.200	
	SINGAPORE 3.5 03/01/27	900,000.000	997,479.000	
	シンガポール・ドル 小計		7,770,000.000 (638,460,900)	8,157,930.700 (670,337,166)
スウェーデン・クローナ	SWEDEN 0.75 05/12/28	4,970,000.000	5,209,255.800	
	SWEDEN 0.75 11/12/29	2,170,000.000	2,257,190.600	
	SWEDEN 1.0 11/12/26	7,000,000.000	7,481,950.000	
	SWEDEN 1.5 11/13/23	9,700,000.000	10,492,199.000	
	SWEDEN 2.5 05/12/25	7,300,000.000	8,453,911.000	
	SWEDEN 3.5 03/30/39	4,600,000.000	6,827,366.000	
	SWEDEN 3.5 06/01/22	12,870,000.000	14,448,505.500	
スウェーデン・クローナ 小計		48,610,000.000 (582,833,900)	55,170,377.900 (661,492,831)	
デンマーク・クローネ	DENMARK 0.5 11/15/27	7,130,000.000	7,528,923.500	
	DENMARK 1.5 11/15/23	5,500,000.000	6,010,125.000	
	DENMARK 1.75 11/15/25	9,470,000.000	10,783,962.500	
	DENMARK 3.0 11/15/21	8,870,000.000	9,709,545.500	
	DENMARK 4.5 11/15/39	13,930,000.000	25,295,765.600	

デンマーク・クローネ 小計		44,900,000.000 (753,422,000)	59,328,322.100 (995,529,245)	
ノルウェー・クローネ	NORWAY 1.5 02/19/26	6,000,000.000	5,979,480.000	
	NORWAY 1.75 02/17/27	3,970,000.000	4,010,970.400	
	NORWAY 1.75 03/13/25	3,800,000.000	3,852,136.000	
	NORWAY 2.0 04/26/28	2,070,000.000	2,125,517.400	
	NORWAY 2.0 05/24/23	7,600,000.000	7,776,624.000	
	NORWAY 3.0 03/14/24	6,200,000.000	6,653,406.000	
ノルウェー・クローネ 小計		29,640,000.000 (387,691,200)	30,398,133.800 (397,607,590)	
ポーランド・ズロチ	POLAND 1.75 07/25/21	2,200,000.000	2,206,226.000	
	POLAND 2.0 04/25/21	1,130,000.000	1,139,379.000	
	POLAND 2.25 04/25/22	4,000,000.000	4,057,520.000	
	POLAND 2.5 01/25/23	1,350,000.000	1,375,920.000	
	POLAND 2.5 04/25/24	1,050,000.000	1,065,393.000	
	POLAND 2.5 07/25/26	4,200,000.000	4,174,590.000	
	POLAND 2.5 07/25/27	3,000,000.000	2,952,000.000	
	POLAND 2.75 04/25/28	1,900,000.000	1,890,310.000	
	POLAND 3.25 07/25/25	3,300,000.000	3,458,895.000	
	POLAND 4.0 10/25/23	3,100,000.000	3,355,223.000	
	POLAND 5.25 10/25/20	2,970,000.000	3,138,399.000	
	POLAND 5.75 04/25/29	1,440,000.000	1,812,225.600	
	POLAND 5.75 09/23/22	3,200,000.000	3,610,368.000	
	POLAND 5.75 10/25/21	3,680,000.000	4,054,440.000	
ポーランド・ズロチ 小計		36,520,000.000 (1,068,940,400)	38,290,888.600 (1,120,774,309)	
マレーシア・リングgit	MALAYSIA 3.418 08/15/22	3,000,000.000	2,991,480.000	
	MALAYSIA 3.48 03/15/23	1,220,000.000	1,215,986.200	
	MALAYSIA 3.492 03/31/20	2,200,000.000	2,203,124.000	
	MALAYSIA 3.502 05/31/27	2,570,000.000	2,525,153.500	
	MALAYSIA 3.733 06/15/28	2,000,000.000	1,993,160.000	
	MALAYSIA 3.844 04/15/33	1,210,000.000	1,178,491.600	
	MALAYSIA 3.892 03/15/27	800,000.000	804,744.000	
	MALAYSIA 4.127 04/15/32	1,850,000.000	1,868,259.500	
	MALAYSIA 4.16 07/15/21	4,000,000.000	4,062,720.000	
	MALAYSIA 4.181 07/15/24	2,430,000.000	2,490,336.900	
	MALAYSIA 4.392 04/15/26	3,070,000.000	3,198,510.200	
	MALAYSIA 4.498 04/15/30	1,800,000.000	1,887,354.000	
	MALAYSIA 4.935 09/30/43	2,000,000.000	2,125,380.000	
	MALAYSIA 5.248 09/15/28	1,600,000.000	1,778,576.000	
マレーシア・リングgit 小計		29,750,000.000 (803,845,000)	30,323,275.900 (819,334,915)	
メキシコ・ペソ	MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	13,000,000.000	15,011,360.000	
	MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	35,000,000.000	38,455,900.000	
	MEXICAN BONDS 5.75 03/05/26	14,859,000.000	13,155,267.060	

	MEXICAN BONDS 6.5 06/09/22	26,000,000.000	25,036,700.000	
	MEXICAN BONDS 6.5 06/10/21	38,000,000.000	36,998,320.000	
	MEXICAN BONDS 7.25 12/09/21	10,880,000.000	10,717,344.000	
	MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	10,000,000.000	9,725,200.000	
	MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	10,000,000.000	9,707,100.000	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	22,000,000.000	20,522,700.000	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	7,000,000.000	6,678,630.000	
	MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47	5,000,000.000	4,771,450.000	
	MEXICAN BONDS 8.0 12/07/23	14,000,000.000	14,088,900.000	
	MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	31,000,000.000	32,053,380.000	
	MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	15,000,000.000	15,179,550.000	
	メキシコ・ペソ 小計	251,739,000.000 (1,485,260,100)	252,101,801.060 (1,487,400,626)	
ユーロ	AUSTRIA 0.5 02/20/29	340,000.000	348,068.200	
	AUSTRIA 0.5 04/20/27	520,000.000	538,824.000	
	AUSTRIA 0.75 02/20/28	450,000.000	473,818.500	
	AUSTRIA 0.75 10/20/26	1,300,000.000	1,375,049.000	
	AUSTRIA 07/15/23	350,000.000	355,547.500	
	AUSTRIA 09/20/22	470,000.000	477,397.800	
	AUSTRIA 1.2 10/20/25	1,000,000.000	1,089,320.000	
	AUSTRIA 1.5 02/20/47	300,000.000	332,790.000	
	AUSTRIA 1.5 11/02/86	290,000.000	303,641.600	
	AUSTRIA 1.65 10/21/24	1,250,000.000	1,382,575.000	
	AUSTRIA 1.75 10/20/23	1,400,000.000	1,536,920.000	
	AUSTRIA 2.1 09/20/17	220,000.000	289,768.600	
	AUSTRIA 2.4 05/23/34	780,000.000	978,736.200	
	AUSTRIA 3.15 06/20/44	720,000.000	1,075,291.200	
	AUSTRIA 3.4 11/22/22	740,000.000	843,903.400	
	AUSTRIA 3.5 09/15/21	1,900,000.000	2,087,340.000	
	AUSTRIA 3.65 04/20/22	1,200,000.000	1,350,360.000	
	AUSTRIA 3.8 01/26/62	730,000.000	1,367,574.700	
	AUSTRIA 3.9 07/15/20	1,700,000.000	1,794,350.000	
	AUSTRIA 4.15 03/15/37	1,410,000.000	2,223,006.000	
	AUSTRIA 4.85 03/15/26	1,100,000.000	1,480,523.000	
	AUSTRIA 6.25 07/15/27	1,150,000.000	1,739,432.500	
	BELGIUM 0.2 10/22/23	660,000.000	675,312.000	
	BELGIUM 0.5 10/22/24	1,070,000.000	1,110,232.000	
	BELGIUM 0.8 06/22/25	1,570,000.000	1,655,816.200	

BELGIUM 0.8 06/22/27	1,100,000.000	1,154,197.000	
BELGIUM 0.8 06/22/28	1,720,000.000	1,796,419.600	
BELGIUM 0.9 06/22/29	500,000.000	524,005.000	
BELGIUM 1.0 06/22/26	1,500,000.000	1,602,735.000	
BELGIUM 1.0 06/22/31	1,140,000.000	1,190,661.600	
BELGIUM 1.25 04/22/33	510,000.000	542,527.800	
BELGIUM 1.45 06/22/37	440,000.000	466,826.800	
BELGIUM 1.6 06/22/47	1,000,000.000	1,046,880.000	
BELGIUM 1.7 06/22/50	210,000.000	221,062.800	
BELGIUM 1.9 06/22/38	730,000.000	829,447.900	
BELGIUM 2.15 06/22/66	640,000.000	721,536.000	
BELGIUM 2.25 06/22/23	1,700,000.000	1,889,822.000	
BELGIUM 2.25 06/22/57	380,000.000	441,746.200	
BELGIUM 2.6 06/22/24	1,510,000.000	1,733,646.100	
BELGIUM 3.0 06/22/34	720,000.000	941,508.000	
BELGIUM 3.75 06/22/45	990,000.000	1,524,609.900	
BELGIUM 3.75 09/28/20	2,200,000.000	2,338,710.000	
BELGIUM 4.0 03/28/22	1,500,000.000	1,700,520.000	
BELGIUM 4.0 03/28/32	920,000.000	1,302,085.200	
BELGIUM 4.25 03/28/41	1,740,000.000	2,763,624.600	
BELGIUM 4.25 09/28/21	1,870,000.000	2,091,520.200	
BELGIUM 4.25 09/28/22	1,190,000.000	1,385,624.100	
BELGIUM 4.5 03/28/26	790,000.000	1,038,289.100	
BELGIUM 5.0 03/28/35	1,980,000.000	3,186,374.400	
BELGIUM 5.5 03/28/28	2,010,000.000	2,943,665.100	
BUNDESobl 0.25 10/16/20	1,500,000.000	1,519,305.000	
BUNDESobl 04/08/22	2,010,000.000	2,045,979.000	
BUNDESobl 04/09/21	2,200,000.000	2,227,368.000	
BUNDESobl 04/14/23	1,130,000.000	1,154,735.700	
BUNDESobl 10/07/22	2,090,000.000	2,132,050.800	
BUNDESobl 10/13/23	1,280,000.000	1,308,659.200	
BUNDESSCHAT 06/12/20	1,270,000.000	1,278,686.800	
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27	2,680,000.000	2,782,295.600	
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/29	750,000.000	772,725.000	
DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28	1,780,000.000	1,834,361.200	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25	2,200,000.000	2,317,150.000	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26	2,690,000.000	2,842,227.100	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28	2,210,000.000	2,334,069.400	
DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27	2,700,000.000	2,856,600.000	
DEUTSCHLAND 08/15/26	2,370,000.000	2,418,466.500	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/24	1,340,000.000	1,444,292.200	

DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25	2,500,000.000	2,718,675.000	
DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48	1,300,000.000	1,522,495.000	
DEUTSCHLAND 1.5 02/15/23	2,100,000.000	2,267,685.000	
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/23	2,500,000.000	2,710,750.000	
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/24	2,000,000.000	2,202,200.000	
DEUTSCHLAND 1.5 09/04/22	1,650,000.000	1,768,008.000	
DEUTSCHLAND 1.75 02/15/24	1,500,000.000	1,664,475.000	
DEUTSCHLAND 1.75 07/04/22	2,700,000.000	2,906,361.000	
DEUTSCHLAND 2.0 01/04/22	2,700,000.000	2,894,022.000	
DEUTSCHLAND 2.0 08/15/23	1,500,000.000	1,666,305.000	
DEUTSCHLAND 2.25 09/04/20	4,200,000.000	4,367,832.000	
DEUTSCHLAND 2.25 09/04/21	1,070,000.000	1,143,723.000	
DEUTSCHLAND 2.5 01/04/21	2,200,000.000	2,321,550.000	
DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	2,510,000.000	3,669,042.700	
DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	2,600,000.000	3,866,200.000	
DEUTSCHLAND 3.0 07/04/20	3,000,000.000	3,132,780.000	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/21	3,150,000.000	3,422,506.500	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	1,500,000.000	2,416,680.000	
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	2,310,000.000	3,777,889.500	
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	1,390,000.000	2,431,235.100	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	1,120,000.000	1,627,852.800	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	2,080,000.000	3,497,977.600	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	1,660,000.000	3,123,555.600	
DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	1,500,000.000	2,466,060.000	
DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	1,600,000.000	2,418,768.000	

DEUTSCHLAND 6.25 01/04/24	1,700,000.000	2,247,638.000	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	1,100,000.000	1,847,208.000	
DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	1,120,000.000	1,745,430.400	
FINLAND 0.375 09/15/20	500,000.000	506,655.000	
FINLAND 0.5 04/15/26	600,000.000	624,504.000	
FINLAND 0.5 09/15/27	300,000.000	310,749.000	
FINLAND 0.5 09/15/28	670,000.000	690,100.000	
FINLAND 0.5 09/15/29	270,000.000	276,604.200	
FINLAND 0.75 04/15/31	450,000.000	468,031.500	
FINLAND 0.875 09/15/25	300,000.000	320,010.000	
FINLAND 04/15/22	320,000.000	324,694.400	
FINLAND 09/15/23	230,000.000	233,647.800	
FINLAND 1.125 04/15/34	420,000.000	454,150.200	
FINLAND 1.375 04/15/47	40,000.000	44,934.400	
FINLAND 1.5 04/15/23	950,000.000	1,023,150.000	
FINLAND 1.625 09/15/22	400,000.000	428,900.000	
FINLAND 2.0 04/15/24	680,000.000	759,165.600	
FINLAND 2.625 07/04/42	500,000.000	699,910.000	
FINLAND 2.75 07/04/28	630,000.000	781,439.400	
FINLAND 3.5 04/15/21	700,000.000	757,134.000	
FINLAND 4.0 07/04/25	800,000.000	1,011,240.000	
FRANCE BTAN 8.5 04/25/23	1,700,000.000	2,316,777.000	
FRANCE OAT 0.25 11/25/20	1,100,000.000	1,114,234.000	
FRANCE OAT 0.25 11/25/26	3,000,000.000	3,054,240.000	
FRANCE OAT 0.5 05/25/25	3,700,000.000	3,852,625.000	
FRANCE OAT 0.5 05/25/26	2,920,000.000	3,034,347.200	
FRANCE OAT 0.5 05/25/29	1,030,000.000	1,048,653.300	
FRANCE OAT 0.75 05/25/28	3,590,000.000	3,768,925.600	
FRANCE OAT 0.75 11/25/28	2,940,000.000	3,077,474.400	
FRANCE OAT 02/25/21	1,370,000.000	1,383,426.000	
FRANCE OAT 03/25/23	1,900,000.000	1,929,222.000	
FRANCE OAT 03/25/24	1,390,000.000	1,408,890.100	
FRANCE OAT 05/25/21	2,510,000.000	2,537,610.000	
FRANCE OAT 05/25/22	3,000,000.000	3,042,690.000	
FRANCE OAT 1.0 05/25/27	3,350,000.000	3,600,379.000	
FRANCE OAT 1.0 11/25/25	3,000,000.000	3,221,760.000	
FRANCE OAT 1.25 05/25/34	1,290,000.000	1,385,911.500	
FRANCE OAT 1.25 05/25/36	2,840,000.000	3,018,920.000	
FRANCE OAT 1.5 05/25/31	4,890,000.000	5,465,504.100	

FRANCE OAT 1.5 05/25/50	730,000.000	755,484.300	
FRANCE OAT 1.75 05/25/23	4,400,000.000	4,791,600.000	
FRANCE OAT 1.75 05/25/66	1,150,000.000	1,220,943.500	
FRANCE OAT 1.75 06/25/39	1,440,000.000	1,640,692.800	
FRANCE OAT 1.75 11/25/24	3,630,000.000	4,037,830.500	
FRANCE OAT 2.0 05/25/48	2,580,000.000	3,015,400.800	
FRANCE OAT 2.25 05/25/24	4,000,000.000	4,524,200.000	
FRANCE OAT 2.25 10/25/22	3,400,000.000	3,724,802.000	
FRANCE OAT 2.5 05/25/30	3,490,000.000	4,283,556.200	
FRANCE OAT 2.5 10/25/20	6,330,000.000	6,628,016.400	
FRANCE OAT 2.75 10/25/27	3,580,000.000	4,390,368.800	
FRANCE OAT 3.0 04/25/22	4,790,000.000	5,298,171.100	
FRANCE OAT 3.25 05/25/45	2,470,000.000	3,614,968.500	
FRANCE OAT 3.25 10/25/21	4,190,000.000	4,594,754.000	
FRANCE OAT 3.5 04/25/26	3,810,000.000	4,781,550.000	
FRANCE OAT 3.75 04/25/21	4,640,000.000	5,047,160.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/55	1,440,000.000	2,489,472.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/60	1,330,000.000	2,363,981.900	
FRANCE OAT 4.0 10/25/38	2,630,000.000	4,091,122.800	
FRANCE OAT 4.25 10/25/23	5,000,000.000	6,057,450.000	
FRANCE OAT 4.5 04/25/41	3,620,000.000	6,116,460.600	
FRANCE OAT 4.75 04/25/35	2,690,000.000	4,334,800.500	
FRANCE OAT 5.5 04/25/29	3,650,000.000	5,550,445.500	
FRANCE OAT 5.75 10/25/32	3,390,000.000	5,690,047.200	
FRANCE OAT 6.0 10/25/25	2,900,000.000	4,067,917.000	
IRISH 0.8 03/15/22	950,000.000	982,347.500	
IRISH 0.9 05/15/28	580,000.000	606,163.800	
IRISH 1.0 05/15/26	1,200,000.000	1,272,420.000	
IRISH 1.1 05/15/29	340,000.000	358,938.000	
IRISH 1.3 05/15/33	450,000.000	473,229.000	
IRISH 1.35 03/18/31	210,000.000	224,649.600	
IRISH 1.7 05/15/37	570,000.000	623,511.600	
IRISH 10/18/22	220,000.000	222,290.200	
IRISH 2.0 02/18/45	870,000.000	998,342.400	
IRISH 2.4 05/15/30	1,100,000.000	1,309,209.000	
IRISH 3.4 03/18/24	930,000.000	1,092,880.200	
IRISH 3.9 03/20/23	700,000.000	816,011.000	

IRISH 5.0 10/18/20	850,000.000	921,153.500	
IRISH 5.4 03/13/25	1,260,000.000	1,661,083.200	
ITALY BTPS 0.35 11/01/21	1,700,000.000	1,684,870.000	
ITALY BTPS 0.45 06/01/21	910,000.000	908,817.000	
ITALY BTPS 0.65 10/15/23	2,100,000.000	2,034,144.000	
ITALY BTPS 0.65 11/01/20	3,600,000.000	3,621,312.000	
ITALY BTPS 0.9 08/01/22	980,000.000	973,835.800	
ITALY BTPS 0.95 03/01/23	2,420,000.000	2,391,710.200	
ITALY BTPS 0.95 03/15/23	2,500,000.000	2,471,750.000	
ITALY BTPS 1.2 04/01/22	770,000.000	775,621.000	
ITALY BTPS 1.25 12/01/26	2,000,000.000	1,895,660.000	
ITALY BTPS 1.35 04/15/22	2,500,000.000	2,526,200.000	
ITALY BTPS 1.45 05/15/25	2,190,000.000	2,144,119.500	
ITALY BTPS 1.45 09/15/22	1,500,000.000	1,518,210.000	
ITALY BTPS 1.45 11/15/24	2,020,000.000	1,990,447.400	
ITALY BTPS 1.5 06/01/25	2,500,000.000	2,450,825.000	
ITALY BTPS 1.6 06/01/26	1,500,000.000	1,461,900.000	
ITALY BTPS 1.65 03/01/32	2,260,000.000	2,015,129.000	
ITALY BTPS 1.85 05/15/24	2,100,000.000	2,125,200.000	
ITALY BTPS 2.0 02/01/28	2,090,000.000	2,054,428.200	
ITALY BTPS 2.0 12/01/25	2,010,000.000	2,020,230.900	
ITALY BTPS 2.05 08/01/27	1,870,000.000	1,849,448.700	
ITALY BTPS 2.15 12/15/21	2,200,000.000	2,276,780.000	
ITALY BTPS 2.2 06/01/27	2,040,000.000	2,045,508.000	
ITALY BTPS 2.25 09/01/36	1,500,000.000	1,365,300.000	
ITALY BTPS 2.45 09/01/33	1,100,000.000	1,054,537.000	
ITALY BTPS 2.5 11/15/25	550,000.000	568,051.000	
ITALY BTPS 2.5 12/01/24	970,000.000	1,009,285.000	
ITALY BTPS 2.7 03/01/47	1,650,000.000	1,490,775.000	
ITALY BTPS 2.8 03/01/67	660,000.000	566,808.000	
ITALY BTPS 2.8 12/01/28	1,400,000.000	1,449,266.000	
ITALY BTPS 2.95 09/01/38	1,270,000.000	1,234,795.600	

ITALY BTPS 3.25 09/01/46	1,780,000.000	1,772,221.400	
ITALY BTPS 3.35 03/01/35	1,100,000.000	1,149,874.000	
ITALY BTPS 3.45 03/01/48	1,430,000.000	1,458,213.900	
ITALY BTPS 3.5 03/01/30	2,570,000.000	2,790,069.100	
ITALY BTPS 3.75 03/01/21	3,300,000.000	3,507,108.000	
ITALY BTPS 3.75 05/01/21	2,300,000.000	2,451,800.000	
ITALY BTPS 3.75 08/01/21	3,200,000.000	3,425,280.000	
ITALY BTPS 3.75 09/01/24	1,900,000.000	2,096,669.000	
ITALY BTPS 3.85 09/01/49	890,000.000	952,246.600	
ITALY BTPS 4.0 02/01/37	2,830,000.000	3,200,730.000	
ITALY BTPS 4.0 09/01/20	3,700,000.000	3,894,435.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/24	2,390,000.000	2,714,442.500	
ITALY BTPS 4.5 03/01/26	2,110,000.000	2,447,178.000	
ITALY BTPS 4.5 05/01/23	1,400,000.000	1,574,258.000	
ITALY BTPS 4.75 08/01/23	1,900,000.000	2,167,900.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/21	2,470,000.000	2,704,897.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/28	2,400,000.000	2,893,584.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/44	1,790,000.000	2,209,558.100	
ITALY BTPS 5.0 03/01/22	2,590,000.000	2,889,404.000	
ITALY BTPS 5.0 03/01/25	2,400,000.000	2,824,032.000	
ITALY BTPS 5.0 08/01/34	2,510,000.000	3,140,512.000	
ITALY BTPS 5.0 08/01/39	1,820,000.000	2,296,294.000	
ITALY BTPS 5.0 09/01/40	2,250,000.000	2,828,700.000	
ITALY BTPS 5.25 11/01/29	2,900,000.000	3,621,520.000	
ITALY BTPS 5.5 09/01/22	2,480,000.000	2,840,071.200	
ITALY BTPS 5.5 11/01/22	2,500,000.000	2,874,100.000	
ITALY BTPS 5.75 02/01/33	2,240,000.000	2,974,496.000	
ITALY BTPS 6.0 05/01/31	3,100,000.000	4,145,320.000	
ITALY BTPS 6.5 11/01/27	3,020,000.000	4,010,560.000	
ITALY BTPS 7.25 11/01/26	1,080,000.000	1,466,748.000	
ITALY BTPS 9.0 11/01/23	1,510,000.000	2,011,169.000	
NETHERLANDS 0.25 07/15/25	1,020,000.000	1,051,813.800	
NETHERLANDS 0.25 07/15/29	400,000.000	404,080.000	

NETHERLANDS 0.5 07/15/26	1,410,000.000	1,476,834.000	
NETHERLANDS 0.75 07/15/27	1,450,000.000	1,543,670.000	
NETHERLANDS 0.75 07/15/28	1,260,000.000	1,341,030.600	
NETHERLANDS 01/15/22	1,750,000.000	1,776,477.500	
NETHERLANDS 01/15/24	1,680,000.000	1,709,232.000	
NETHERLANDS 1.75 07/15/23	2,000,000.000	2,187,740.000	
NETHERLANDS 2.0 07/15/24	1,560,000.000	1,753,642.800	
NETHERLANDS 2.25 07/15/22	1,550,000.000	1,691,964.500	
NETHERLANDS 2.5 01/15/33	1,300,000.000	1,677,143.000	
NETHERLANDS 2.75 01/15/47	1,430,000.000	2,184,882.700	
NETHERLANDS 3.25 07/15/21	1,860,000.000	2,023,196.400	
NETHERLANDS 3.5 07/15/20	1,670,000.000	1,755,988.300	
NETHERLANDS 3.75 01/15/23	590,000.000	685,521.000	
NETHERLANDS 3.75 01/15/42	1,620,000.000	2,717,080.200	
NETHERLANDS 4.0 01/15/37	1,560,000.000	2,497,248.000	
NETHERLANDS 5.5 01/15/28	1,350,000.000	2,001,510.000	
SPAIN 0.05 01/31/21	400,000.000	402,456.000	
SPAIN 0.35 07/30/23	1,460,000.000	1,481,491.200	
SPAIN 0.4 04/30/22	2,200,000.000	2,239,072.000	
SPAIN 0.45 10/31/22	1,340,000.000	1,368,126.600	
SPAIN 0.75 07/30/21	1,700,000.000	1,740,749.000	
SPAIN 1.15 07/30/20	2,100,000.000	2,141,265.000	
SPAIN 1.3 10/31/26	2,120,000.000	2,224,410.000	
SPAIN 1.4 04/30/28	2,230,000.000	2,334,230.200	
SPAIN 1.4 07/30/28	1,950,000.000	2,031,003.000	
SPAIN 1.45 04/30/29	1,130,000.000	1,174,194.300	
SPAIN 1.45 10/31/27	2,200,000.000	2,318,580.000	
SPAIN 1.5 04/30/27	2,000,000.000	2,117,400.000	
SPAIN 1.6 04/30/25	2,160,000.000	2,323,706.400	
SPAIN 1.95 04/30/26	1,790,000.000	1,962,448.600	
SPAIN 1.95 07/30/30	2,240,000.000	2,422,806.400	
SPAIN 2.15 10/31/25	2,100,000.000	2,330,811.000	
SPAIN 2.35 07/30/33	1,620,000.000	1,796,580.000	
SPAIN 2.7 10/31/48	950,000.000	1,056,229.000	
SPAIN 2.75 10/31/24	2,390,000.000	2,721,086.700	
SPAIN 2.9 10/31/46	1,800,000.000	2,095,668.000	

	SPAIN 3.45 07/30/66	1,000,000.000	1,263,440.000	
	SPAIN 3.8 04/30/24	1,720,000.000	2,034,880.400	
	SPAIN 4.0 04/30/20	2,400,000.000	2,510,616.000	
	SPAIN 4.2 01/31/37	1,960,000.000	2,726,164.000	
	SPAIN 4.4 10/31/23	2,300,000.000	2,754,779.000	
	SPAIN 4.65 07/30/25	2,360,000.000	2,985,730.400	
	SPAIN 4.7 07/30/41	2,100,000.000	3,163,251.000	
	SPAIN 4.8 01/31/24	2,200,000.000	2,694,560.000	
	SPAIN 4.85 10/31/20	2,900,000.000	3,135,306.000	
	SPAIN 4.9 07/30/40	1,840,000.000	2,821,640.000	
	SPAIN 5.15 10/31/28	1,900,000.000	2,622,190.000	
	SPAIN 5.15 10/31/44	1,330,000.000	2,154,294.100	
	SPAIN 5.4 01/31/23	2,800,000.000	3,386,208.000	
	SPAIN 5.5 04/30/21	3,600,000.000	4,028,220.000	
	SPAIN 5.75 07/30/32	2,190,000.000	3,371,658.300	
	SPAIN 5.85 01/31/22	2,300,000.000	2,693,507.000	
	SPAIN 5.9 07/30/26	2,040,000.000	2,812,568.400	
	SPAIN 6.0 01/31/29	2,750,000.000	4,051,740.000	
ユーロ 小計		507,610,000.000 (63,573,076,400)	591,308,028.500 (74,055,417,489)	
南アフリカ・ランド	SOUTH AFRICA 10.5 12/21/26	25,000,000.000	27,857,250.000	
	SOUTH AFRICA 6.25 03/31/36	14,700,000.000	10,845,072.000	
	SOUTH AFRICA 6.5 02/28/41	11,760,000.000	8,473,197.600	
	SOUTH AFRICA 7.0 02/28/31	11,600,000.000	9,827,520.000	
	SOUTH AFRICA 7.75 02/28/23	3,600,000.000	3,619,440.000	
	SOUTH AFRICA 8.0 01/31/30	13,110,000.000	12,235,694.100	
	SOUTH AFRICA 8.25 03/31/32	10,000,000.000	9,298,200.000	
	SOUTH AFRICA 8.5 01/31/37	10,910,000.000	10,009,270.400	
	SOUTH AFRICA 8.75 01/31/44	10,000,000.000	9,196,300.000	
	SOUTH AFRICA 8.75 02/28/48	20,280,000.000	18,690,250.800	
	SOUTH AFRICA 8.875 02/28/35	12,510,000.000	11,963,688.300	
	SOUTH AFRICA 9.0 01/31/40	8,000,000.000	7,584,000.000	
南アフリカ・ランド 小計		151,470,000.000 (1,210,245,300)	139,599,883.200 (1,115,403,067)	
国債証券 合計		175,677,311,000 (175,677,311,000)	190,797,876,089 (190,797,876,089)	
合計		175,677,311,000 (175,677,311,000)	190,797,876,089 (190,797,876,089)	

- (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 155銘柄	45.61%	46.86%
イギリス・ポンド	国債証券 39銘柄	6.37%	6.55%
オーストラリア・ドル	国債証券 20銘柄	2.04%	2.10%
カナダ・ドル	国債証券 26銘柄	1.82%	1.87%
シンガポール・ドル	国債証券 12銘柄	0.34%	0.35%
スウェーデン・クローナ	国債証券 7銘柄	0.34%	0.35%
デンマーク・クローネ	国債証券 5銘柄	0.51%	0.52%
ノルウェー・クローネ	国債証券 6銘柄	0.20%	0.21%
ポーランド・ズロチ	国債証券 14銘柄	0.57%	0.59%
マレーシア・リンギット	国債証券 14銘柄	0.42%	0.43%
メキシコ・ペソ	国債証券 14銘柄	0.76%	0.78%
ユーロ	国債証券 286銘柄	37.78%	38.81%
南アフリカ・ランド	国債証券 12銘柄	0.57%	0.58%

(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10月11日現在	平成31年4月11日現在
資産の部			
流動資産			
預金		4,131,787,212	2,826,019,646
コール・ローン		70,988,267	61,653,788
株式		49,707,246,286	57,624,376,273
新株予約権証券		-	214,880
投資信託受益証券		281,626,794	278,678,319
投資証券		91,665,478	84,806,284
派生商品評価勘定		127,051	157,311,569
未収入金		2,571,830	-
未収配当金		69,349,236	120,709,614
差入委託証拠金		778,607,087	1,097,912,127
流動資産合計		55,133,969,241	62,251,682,500
資産合計		55,133,969,241	62,251,682,500
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		296,515,767	-
未払金		30,576,656	4,637
未払解約金		42,577,000	60,001,000
流動負債合計		369,669,423	60,005,637
負債合計		369,669,423	60,005,637
純資産の部			
元本等			
元本	1	50,025,024,540	51,163,760,665
剰余金			
剰余金又は欠損金()		4,739,275,278	11,027,916,198
元本等合計		54,764,299,818	62,191,676,863
純資産合計		54,764,299,818	62,191,676,863
負債純資産合計		55,133,969,241	62,251,682,500

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>新株予約権証券 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10月11日現在	平成31年4月11日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	53,100,504,600円	50,025,024,540円
同期中追加設定元本額	17,404,759,399円	21,374,215,984円
同期中一部解約元本額	20,480,239,459円	20,235,479,859円
元本の内訳		
ファンド名		
D I A M新興国株式インデックスファンド< D C 年金 >	3,994,589,819円	4,477,076,371円
D I A M新興国株式インデックスファンド< 為替ヘッジなし > (ファンドラップ)	526,663,191円	501,249,666円
M I T O ラップ型ファンド (安定型)	3,985,301円	3,316,467円
M I T O ラップ型ファンド (中立型)	10,799,409円	11,116,546円
M I T O ラップ型ファンド (積極型)	13,414,427円	13,786,110円
グローバル8資産ラップファンド (安定型)	28,092,719円	29,063,383円
グローバル8資産ラップファンド (中立型)	28,537,703円	30,019,978円
グローバル8資産ラップファンド (積極型)	17,351,870円	17,894,922円
たわらノーロード 新興国株式	4,122,080,841円	4,696,179,196円
たわらノーロード 新興国株式 <ラップ向け>	1,767,045,461円	1,786,102,834円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	136,210,830円	290,919,969円
たわらノーロード バランス (堅実型)	885,658円	1,805,667円
たわらノーロード バランス (標準型)	3,641,182円	7,560,261円
たわらノーロード バランス (積極型)	9,490,560円	15,013,195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)	108,437円	174,756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)	5,437,197円	10,571,496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)	16,617,446円	31,395,648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)	12,031,101円	22,342,507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)	35,451,913円	55,276,983円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	27,969円	132,439円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	369,091円	500,055円

たわらノーロード 最適化バ ランス(成長型)	293,335円	372,422円
たわらノーロード 最適化バ ランス(積極型)	667,435円	1,089,616円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	447,212,307円	453,215,866円
D I A M D C 8資産バラン スファンド(新興国10)	314,439,194円	322,361,801円
D I A M D C 8資産バラン スファンド(新興国20)	267,422,836円	291,153,227円
D I A M D C 8資産バラン スファンド(新興国30)	531,664,281円	572,621,496円
投資のソムリエ	3,362,324,690円	8,054,382,424円
クルーズコントロール	895,110,618円	1,607,243,763円
投資のソムリエ<DC年金>	292,031,702円	794,559,986円
D I A M 8資産バランスマ ンドN<DC年金>	211,686,781円	247,104,657円
クルーズコントロール<DC年 金>	517,357円	1,154,335円
D I A Mコア資産設計ファンド (堅実型)	10,528,358円	27,152,622円
D I A Mコア資産設計ファンド (積極型)	29,281,738円	62,211,441円
投資のソムリエ<DC年金>リ スク抑制型	100,151,426円	186,431,702円
ダイナミック・ナビゲーション	564,769円	1,713,505円
リスク抑制世界8資産バラン スファンド	1,889,566,731円	2,843,208,568円
ワールドアセットバランス(基 本コース)	1,897,818,968円	1,641,892,969円
ワールドアセットバランス(リ スク抑制コース)	7,270,447,519円	6,277,274,398円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2045)	1,147,064円	2,599,644円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2055)	824,219円	2,301,914円
リスク抑制世界8資産バラン スファンド(DC)	595,341円	1,284,566円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2035)	1,488,465円	4,280,116円
リスクコントロール世界資産分 散ファンド	270,188,548円	274,183,673円
9資産分散投資・スタンダード <DC年金>	20,870円	4,456,034円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2040)	-円	596,693円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2050)	-円	596,693円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2060)	-円	596,693円
エマージング株式バッシブファ ンドVA(適格機関投資家専 用)	3,861,359,568円	2,882,007,336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)	2,126,263,232円	-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)	8,070,831,328円	5,210,365,490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)	7,437,743,735円	7,393,848,566円
	計	50,025,024,540円	51,163,760,665円
2 .	受益権の総数	50,025,024,540口	51,163,760,665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30年4月12日 至 平成30年10月11日	自 平成30年10月12日 至 平成31年4月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。</p> <p>また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。</p>	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成30年10月11日現在	平成31年4月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成30年10月11日現在	平成31年4月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
株式	5,579,552,724	413,311,381
新株予約権証券	-	145,787
投資信託受益証券	629,376	16,916,567
投資証券	18,501,260	12,289,685
合計	5,597,424,608	384,250,916

(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4月19日から平成30年10月11日まで及び平成30年4月19日から平成31年4月11日まで）に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	平成30年10月11日 現在				平成31年4月11日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	151,880,561	-	151,753,510	127,051	632,565,540	-	632,549,620	15,920
アメリカ・ドル	131,077,440	-	131,077,440	-	632,565,540	-	632,549,620	15,920
カタール・リアル	20,803,121	-	20,676,070	127,051	-	-	-	-
買 建	20,803,121	-	20,566,067	237,054	-	-	-	-
アメリカ・ドル	20,803,121	-	20,566,067	237,054	-	-	-	-
合計	172,683,682	-	172,319,577	110,003	632,565,540	-	632,549,620	15,920

(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10月11日 現在				平成31年4月11日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								
先物取引								
買 建	4,827,540,658	-	4,531,261,945	296,278,713	3,388,988,887	-	3,546,284,536	157,295,649
合計	4,827,540,658	-	4,531,261,945	296,278,713	3,388,988,887	-	3,546,284,536	157,295,649

(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10月11日現在	平成31年4月11日現在
1口当たり純資産額	1.0947円	1.2155円
(1万口当たり純資産額)	(10,947円)	(12,155円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

平成31年4月11日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	CTRI.P.COM INTERNATIONAL LTD ADR	39,058	44.970	1,756,438.260	
	CIA DE MINAS BUENAVENTURA SA ADR	17,000	17.230	292,910.000	
	SURGUTNEFTEGAZ SP ADR PREF	69,900	6.255	437,224.500	
	CREDICORP LTD	6,494	241.630	1,569,145.220	
	SINA CORP	5,870	64.460	378,380.200	
	MOBILE TELESYSTEMS PJSC ADR	52,753	8.030	423,606.590	
	NETEASE INC-ADR	7,421	272.970	2,025,710.370	
	SOUTHERN COPPER CORP	7,248	41.070	297,675.360	
	LUKOIL SPON ADR	46,700	88.340	4,125,478.000	
	GAZPROM PAO ADR	519,669	5.066	2,632,643.150	
	COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK SP GDR	157,079	4.070	639,311.530	
	INNER MONGOLIA YITAI COAL CO	105,800	1.174	124,209.200	
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRADE	102,880	1.515	155,863.200	
	SURGUTNEFTEGAZ ADR	77,537	3.876	300,533.410	
	51JOB INC ADR	2,300	88.650	203,895.000	
	X5 RETAIL GROUP NV GDR	12,636	25.530	322,597.080	
	NOVATEK PJSC GDR	8,833	179.600	1,586,406.800	
	BAIDU INC -SPON ADR	26,313	177.040	4,658,453.520	
	NOVOLIPETSK STEEL GDR	13,617	26.700	363,573.900	
	MMC NORILSK NICKEL ADR	63,543	22.540	1,432,259.220	
	ROSNEFT OIL CO GDR	115,100	6.622	762,192.200	
	NEW ORIENTAL EDUCATION & TECH	13,649	90.670	1,237,554.830	
	SEVERSTAL GDR	24,728	16.200	400,593.600	
	TATNEFT ADR	24,684	70.900	1,750,095.600	
	MAGNITOGORSK IRON & STEEL SPON GDR	23,748	8.940	212,307.120	
	VTB BANK OJSC GDR	172,000	1.206	207,432.000	
	DP WORLD PLC	15,219	17.600	267,854.400	
	MAGNIT PJSC GDR	35,689	14.000	499,646.000	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD ADR	42,434	8.050	341,593.700	
	TAL EDUCATION GROUP-ADR	33,986	36.840	1,252,044.240	
NOAH HOLDINGS LTD ADR	2,700	49.840	134,568.000		
SBERBANK ADR	258,817	15.350	3,972,840.950		
PHOSAGRO PJSC GDR	13,784	12.500	172,300.000		

	HUAZHU GROUP LTD ADR	12,676	43.840	555,715.840	
	YY INC-ADR	4,398	85.550	376,248.900	
	GDS HOLDINGS LTD ADR	5,600	39.680	222,208.000	
	TENCENT MUSIC ENTERTAINMENT GROUP ADR	8,115	17.970	145,826.550	
	58.COM INC ADR	9,117	70.110	639,192.870	
	AUTOHOME INC ADR	5,656	108.410	613,166.960	
	WEIBO CORP ADR	5,427	70.570	382,983.390	
	JD.COM INC ADR	69,718	30.170	2,103,392.060	
	ALIBABA GROUP HOLDING LTD-ADR	123,079	186.190	22,916,079.010	
	MOMO INC SPON ADR	14,047	38.030	534,207.410	
	BAOZUN INC-SPN ADR	3,400	42.870	145,758.000	
	PINDUODUO INC ADR	18,417	21.950	404,253.150	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	34,385	43.600	1,499,186.000	
	IQIYI INC ADR	11,109	24.130	268,060.170	
	POLYUS PJSC GDR	6,012	38.960	234,227.520	
	HUTCHISON CHINA MEDITECH LTD ADR	4,746	31.490	149,451.540	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC ADR	30,696	19.110	586,600.560	
アメリカ・ドル 小計		2,485,787		66,713,895.080 (7,412,580,882)	
アラブ首長国連 邦・ディルハム	DUBAI ISLAMIC BANK PJSC	136,145	5.040	686,170.800	
	EMIRATES TELECOMMUNICATIONS GROUP CO PJSC	164,845	16.760	2,762,802.200	
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK PJSC	201,006	9.140	1,837,194.840	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	258,974	14.940	3,869,071.560	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	343,166	5.130	1,760,441.580	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	356,142	1.710	609,002.820	
	EMAAR DEVELOPMENT PJSC	77,463	3.900	302,105.700	
	EMAAR MALLS PJSC	178,166	1.740	310,008.840	
DAMAC PROPERTIES DUBAI CO PJSC	190,235	1.330	253,012.550		
アラブ首長国連邦・ディルハム 小計		1,906,142		12,389,810.890 (374,172,290)	
イギリス・ポンド	POLYMETAL INTERNATIONAL PLC	22,756	8.356	190,149.130	
イギリス・ポンド 小計		22,756		190,149.130 (27,668,600)	
インド・ルピー	RELIANCE INDUSTRIES LTD	270,506	1,331.400	360,151,688.400	
	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	72,940	357.750	26,094,285.000	
	ASIAN PAINTS LTD	27,804	1,409.850	39,199,469.400	
	EICHER MOTORS LTD	1,223	20,973.750	25,650,896.250	
	GRASIM INDUSTRIES LTD	32,639	847.300	27,655,024.700	

MAHINDRA & MAHINDRA LTD	72,196	670.250	48,389,369.000	
SHREE CEMENT LTD	846	18,992.000	16,067,232.000	
ICICI BANK LTD	227,154	394.200	89,544,106.800	
HINDUSTAN PETROLEUM CORP LTD	58,463	255.950	14,963,604.850	
STATE BANK OF INDIA LTD	170,963	310.900	53,152,396.700	
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	18,935	519.400	9,834,839.000	
LIC HOUSING FINANCE LTD	26,242	528.150	13,859,712.300	
TATA STEEL LTD	30,106	544.400	16,389,706.400	
TATA MOTORS LTD	156,148	216.050	33,735,775.400	
JSW STEEL LTD	83,415	288.550	24,069,398.250	
TATA POWER CO LTD	100,483	70.900	7,124,244.700	
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	5,751	2,958.800	17,016,058.800	
NESTLE INDIA LTD	2,250	10,811.950	24,326,887.500	
GAIL INDIA LTD	70,027	337.700	23,648,117.900	
VEDANTA LTD	115,072	188.500	21,691,072.000	
AXIS BANK LTD	181,046	760.850	137,748,849.100	
TITAN COMPANY LTD	27,648	1,100.200	30,418,329.600	
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	122,655	158.000	19,379,490.000	
LUPIN LTD	22,453	804.750	18,069,051.750	
BAJAJ FINANCE LTD	16,595	2,998.350	49,757,618.250	
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP	155,550	2,029.250	315,649,837.500	
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISES LTD	43,870	412.550	18,098,568.500	
INFOSYS LTD	332,056	752.700	249,938,551.200	
WIPRO LTD	134,610	281.000	37,825,410.000	
INDIAN OIL CORP LTD	168,252	156.600	26,348,263.200	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	61,550	1,694.150	104,274,932.500	
HCL TECHNOLOGIES LTD	51,818	1,098.700	56,932,436.600	
DABUR INDIA LTD	51,560	403.300	20,794,148.000	
HERO MOTOCORP LTD	4,509	2,594.400	11,698,149.600	
DR REDDYS LABORATORIES LTD	10,389	2,765.000	28,725,585.000	
BHARTI AIRTEL LTD	135,106	340.000	45,936,040.000	
UNITED SPIRITS LTD	29,261	547.150	16,010,156.150	
SUN PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD	81,313	471.950	38,375,670.350	
DIVI'S LABORATORIES LTD	7,703	1,722.550	13,268,802.650	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	10,111	7,186.350	72,661,184.850	
GLENMARK PHARMACEUTICALS LTD	13,689	649.900	8,896,481.100	
AUROBINDO PHARMA LTD	26,223	790.050	20,717,481.150	
HAVELLS INDIA LTD	26,492	757.500	20,067,690.000	
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	95,048	148.150	14,081,361.200	

SHRIRAM TRANSPORT FINANCE CO LTD	13,834	1,196.900	16,557,914.600	
PETRONET LNG LTD	52,875	235.950	12,475,856.250	
CIPLA LTD/INDIA	31,870	546.450	17,415,361.500	
LARSEN & TOUBRO LTD	45,602	1,371.550	62,545,423.100	
ULTRATECH CEMENT LTD	9,355	4,131.050	38,645,972.750	
ASHOK LEYLAND LTD	110,886	91.550	10,151,613.300	
BOSCH LTD	687	17,788.650	12,220,802.550	
TATA CONSULTANCY SERVICES LTD	85,392	2,040.250	174,221,028.000	
NTPC LTD	210,066	134.600	28,274,883.600	
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	7,474	2,683.900	20,059,468.600	
YES BANK LTD	162,258	268.250	43,525,708.500	
AMBUJA CEMENTS LTD	54,635	223.900	12,232,776.500	
BHARAT FORGE LTD	18,421	497.900	9,171,815.900	
HINDALCO INDUSTRIES LTD	116,135	211.700	24,585,779.500	
ITC LTD	328,199	294.700	96,720,245.300	
PIDILITE INDUSTRIES LTD	11,666	1,282.150	14,957,561.900	
UNITED PHOSPHORUS LTD	34,838	925.950	32,258,246.100	
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	32,823	663.250	21,769,854.750	
TECH MAHINDRA LTD	45,527	790.250	35,977,711.750	
VODAFONE IDEA LTD	196,527	29.000	5,699,283.000	
MARICO LTD	45,660	359.400	16,410,204.000	
PAGE INDUSTRIES LTD	528	23,818.700	12,576,273.600	
POWER GRID CORP OF INDIA LTD	171,078	198.650	33,984,644.700	
ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	50,892	383.450	19,514,537.400	
REC LTD	55,173	150.550	8,306,295.150	
BAJAJ FINSERV LTD	3,723	7,423.300	27,636,945.900	
BAJAJ AUTO LTD	7,967	2,942.900	23,446,084.300	
COAL INDIA LTD	62,457	240.050	14,992,802.850	
MAHINDRA & MAHINDRA FINANCIAL SERVICES LTD	28,933	411.750	11,913,162.750	
BHARTI INFRA TEL LTD	32,296	315.300	10,182,928.800	
INDIABULLS HOUSING FINANCE LTD	25,466	824.400	20,994,170.400	
TATA STEEL LTD-PARTLY PAID	2,333	88.050	205,420.650	
CADILA HEALTHCARE LTD	16,962	343.400	5,824,750.800	
AVENUE SUPERMARTS LTD	11,216	1,522.300	17,074,116.800	
INTERGLOBE AVIATION LTD	8,300	1,394.000	11,570,200.000	
インド・ルピー 小計	5,444,724		3,192,337,819.150 (5,171,587,268)	
インドネシア・ル ピア				
UNITED TRACTORS TBK PT	167,001	26,050.000	4,350,376,050.000	
INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK PT	458,800	6,525.000	2,993,670,000.000	

	UNILEVER INDONESIA TBK PT	137,500	49,300.000	6,778,750,000.000	
	PT ASTRA INTERNATIONAL TBK	1,939,200	7,675.000	14,883,360,000.000	
	TELEKOMUNIKASI INDONESIA PERSERO TBK	4,736,300	3,950.000	18,708,385,000.000	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA TBK PT	675,600	6,475.000	4,374,510,000.000	
	GUDANG GARAM TBK PT	44,800	78,150.000	3,501,120,000.000	
	HANJAYA MANDALA SAMPOERNA TBK	795,500	3,600.000	2,863,800,000.000	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA TBK PT	180,300	22,500.000	4,056,750,000.000	
	INDAH KIAT PULP AND PAPER CORP TBK PT	262,000	8,375.000	2,194,250,000.000	
	BUKIT ASAM TBK PT	256,700	4,030.000	1,034,501,000.000	
	BANK DANAMON INDONESIA TBK PT	261,316	9,800.000	2,560,896,800.000	
	BANK MANDIRI	1,790,000	7,600.000	13,604,000,000.000	
	PABRIK KERTAS TJIWI KIMIA TBK PT	98,000	10,600.000	1,038,800,000.000	
	BANK RAKYAT INDONESIA	5,290,400	4,320.000	22,854,528,000.000	
	PERUSAHAAN GAS NEGARA PT	1,064,100	2,290.000	2,436,789,000.000	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSERO TBK PT	724,400	9,750.000	7,062,900,000.000	
	KALBE FARMA TBK PT	1,822,200	1,540.000	2,806,188,000.000	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK PT	276,500	14,300.000	3,953,950,000.000	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	933,800	27,675.000	25,842,915,000.000	
	JASA MARGA PERSERO TBK PT	200,125	6,050.000	1,210,756,250.000	
	BUMI SERPONG DAMAI PT	746,500	1,410.000	1,052,565,000.000	
	ADARO ENERGY PT	1,434,500	1,315.000	1,886,367,500.000	
	PAKUWON JATI TBK	1,659,900	740.000	1,228,326,000.000	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR TBK PT	238,500	9,375.000	2,235,937,500.000	
	TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE TBK PT	180,800	4,020.000	726,816,000.000	
	BANK TABUNGAN NEGARA TBK PT	480,300	2,410.000	1,157,523,000.000	
	PT SURYA CITRA MEDIA TBK	511,300	1,765.000	902,444,500.000	
	インドネシア・ルピア 小計	27,366,342		158,301,174,600.000 (1,250,579,279)	
オフショア・人民元	LUXSHARE PRECISION INDUSTRY CO LTD	9,600	25.240	242,304.000	
	FOCUS MEDIA INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD	26,300	7.270	191,201.000	
	IFLYTEK CO LTD	6,400	36.020	230,528.000	
	YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD	2,300	94.090	216,407.000	

JIANGSU YANGHE BREWERY JOINT-STOCK CO LTD	2,500	128.000	320,000.000	
WULIANGYE YIBIN CO LTD	7,200	107.000	770,400.000	
SUNING.COM CO LTD	29,500	14.110	416,245.000	
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LTD	79,900	3.920	313,208.000	
CHINA MERCHANTS SHEKOU INDUSTRIAL ZONE HOLDINGS CO LTD	12,300	23.390	287,697.000	
GREE ELECTRIC APPLIANCES INC OF ZHUHAI	5,700	57.120	325,584.000	
MIDEA GROUP CO LTD	8,000	54.720	437,760.000	
HANGZHOU HIKVISION DIGITAL TECHNOLOGY CO LTD	12,000	35.050	420,600.000	
PING AN BANK CO LTD	27,200	13.730	373,456.000	
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO LTD	79,000	5.660	447,140.000	
CHINA VANKE CO LTD	13,700	32.770	448,949.000	
WEICHAI POWER CO LTD	29,900	13.860	414,414.000	
GF SECURITIES CO LTD	22,700	16.300	370,010.000	
BYD CO LTD	7,500	55.520	416,400.000	
BANK OF SHANGHAI CO LTD	20,900	12.480	260,832.000	
PETROCHINA CO LTD	32,800	7.690	252,232.000	
INDUSTRIAL & COMMERCIAL BANK OF CHINA LTD	75,500	5.750	434,125.000	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA LTD	82,500	3.770	311,025.000	
BANK OF CHINA LTD	74,500	3.860	287,570.000	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL CORP	51,300	5.900	302,670.000	
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	31,500	35.070	1,104,705.000	
PING AN INSURANCE GROUP CO OF CHINA LTD	19,500	82.030	1,599,585.000	
INDUSTRIAL BANK CO LTD	27,400	19.180	525,532.000	
SHANGHAI PUDONG DEVELOPMENT BANK CO LTD	36,700	11.480	421,316.000	
CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	73,320	6.530	478,779.600	
SAIC MOTOR CORP LTD	10,900	29.230	318,607.000	
KWEICHOW MOUTAI CO LTD	1,800	947.990	1,706,382.000	
BANK OF COMMUNICATIONS CO LTD	79,200	6.300	498,960.000	
CITIC SECURITIES CO LTD	31,600	24.950	788,420.000	
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	10,900	35.110	382,699.000	
CHINA YANGTZE POWER CO LTD	26,500	16.580	439,370.000	
DAQIN RAILWAY CO LTD	30,100	8.500	255,850.000	

CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD	60,800	4.170	253,536.000	
CHINA STATE CONSTRUCTION ENGINEERING CORP LTD	61,600	6.530	402,248.000	
HAITONG SECURITIES CO LTD	36,000	14.830	533,880.000	
HUAXIA BANK CO LTD	23,200	8.500	197,200.000	
INNER MONGOLIA YILI INDUSTRIAL GROUP CO LTD	10,400	31.490	327,496.000	
BANK OF BEIJING CO LTD	42,800	6.380	273,064.000	
BAOSHAN IRON & STEEL CO LTD	29,200	7.810	228,052.000	
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	16,500	44.000	726,000.000	
CHINA MERCHANTS SECURITIES CO LTD	22,800	18.380	419,064.000	
POLY DEVELOPMENTS AND HOLDINGS GROUP CO LTD	20,400	14.650	298,860.000	
CRRG CORP LTD	84,700	9.330	790,251.000	
JIANGSU HENGRUI MEDICINE CO LTD	10,200	65.730	670,446.000	
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION CORP LTD	27,400	11.970	327,978.000	
HUATAI SECURITIES CO LTD	23,600	22.650	534,540.000	
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD	21,100	14.000	295,400.000	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	11,000	31.750	349,250.000	
FOUNDER SECURITIES CO LTD	31,000	8.020	248,620.000	
CHINA INTERNATIONAL TRAVEL SERVICE CORP LTD	3,900	72.400	282,360.000	
AVIC CAPITAL CO LTD	49,800	6.500	323,700.000	
METALLURGICAL CORP OF CHINA LTD	151,200	3.680	556,416.000	
POWER CONSTRUCTION CORP OF CHINA LTD	95,400	6.120	583,848.000	
SICHUAN CHUANTOU ENERGY CO LTD	23,700	9.470	224,439.000	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD	9,900	21.600	213,840.000	
AECC AVIATION POWER CO LTD	9,500	26.330	250,135.000	
JOINTOWN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	16,000	15.970	255,520.000	
INDUSTRIAL SECURITIES CO LTD	53,200	7.400	393,680.000	
BEIJING TONGRENTANG CO LTD	6,400	33.140	212,096.000	

	SHANDONG GOLD MINING CO LTD	8,000	31.440	251,520.000	
	YONGHUI SUPERSTORES CO LTD	24,000	9.450	226,800.000	
	AISINO CORP	6,400	29.240	187,136.000	
	CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD	66,500	9.040	601,160.000	
	ZHANGZHOU PIENZHEHUANG PHARMACEUTICAL CO LTD	1,800	122.500	220,500.000	
	HENGTONG OPTIC-ELECTRIC CO LTD	8,100	22.780	184,518.000	
	CHINA NATIONAL NUCLEAR POWER CO LTD	51,300	6.330	324,729.000	
	BANK OF JIANGSU CO LTD	32,400	7.300	236,520.000	
	ORIENT SECURITIES CO LTD/CHINA	24,800	12.130	300,824.000	
	EVERBRIGHT SECURITIES CO LTD	24,000	13.540	324,960.000	
オフショア・人民元 小計		2,297,620		30,041,548.600 (496,586,799)	
カタール・リアル	QATAR INSURANCE CO SAQ	14,417	39.000	562,263.000	
	QATAR NATIONAL BANK	42,998	180.990	7,782,208.020	
	COMMERCIAL BANK OF QATAR QSC	18,202	45.960	836,563.920	
	OOREDOO QSC	6,760	65.000	439,400.000	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	5,050	172.990	873,599.500	
	INDUSTRIES QATAR QSC	17,405	124.940	2,174,580.700	
	QATAR ISLAMIC BANK SAQ	11,406	160.000	1,824,960.000	
	MASRAF AL RAYAN	36,535	36.190	1,322,201.650	
	BARWA REAL ESTATE CO	16,763	35.190	589,889.970	
	EZDAN HOLDING GROUP QSC	69,416	11.290	783,706.640	
カタール・リアル 小計		238,952		17,189,373.400 (523,760,208)	
コロンビア・ペソ	INTERCONEXION ELECTRICA SA ESP	44,150	16,300.000	719,645,000.000	
	ECOPETROL SA	455,598	3,405.000	1,551,311,190.000	
	GRUPO DE INVERSIONES SURAMERICANA SA-PREF	10,138	34,880.000	353,613,440.000	
	GRUPO AVAL ACCIONES Y VALORES SA-PREF	341,831	1,300.000	444,380,300.000	
	CEMENTOS ARGOS SA	37,720	8,130.000	306,663,600.000	
	GRUPO ARGOS SA	28,217	18,380.000	518,628,460.000	
	BANCOLOMBIA SA	20,947	41,400.000	867,205,800.000	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	44,976	42,600.000	1,915,977,600.000	
コロンビア・ペソ 小計		1,007,644		7,561,646,970.000 (271,463,126)	
タイ・パーツ	BANGKOK BANK PCL	22,000	223.000	4,906,000.000	

BERLI JUCKER PCL NVDR	123,600	51.000	6,303,600.000	
KRUNG THAI BANK PCL NVDR	348,000	19.200	6,681,600.000	
ROBINSON PCL-NVDR	38,800	58.750	2,279,500.000	
SIAM COMMERCIAL BANK PCL NVDR	173,900	131.500	22,867,850.000	
TRUE CORP PCL NVDR	1,074,755	5.200	5,588,726.000	
KASIKORNBANK PCL NVDR	62,100	193.000	11,985,300.000	
TMB BANK PCL -NVDR	1,010,000	2.100	2,121,000.000	
IRPC PCL NVDR	1,060,900	5.900	6,259,310.000	
BANPU PCL PUBLIC CO LTD NVDR	172,000	16.000	2,752,000.000	
ELECTRICITY GENERATING PCL NVDR	13,100	288.000	3,772,800.000	
CHAROEN POKPHAND FOODS PCL	311,500	25.000	7,787,500.000	
ADVANCED INFO SERVICE PCL	101,900	191.000	19,462,900.000	
HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	380,520	15.200	5,783,904.000	
DELTA ELECTRONICS THAI PCL NVDR	44,200	79.000	3,491,800.000	
PTT PCL	996,000	48.250	48,057,000.000	
THAI UNION GROUP PCL-NVDR	162,600	18.800	3,056,880.000	
LAND AND HOUSES PCL NVDR	263,900	10.700	2,823,730.000	
SIAM CEMENT PCL NVDR	33,850	466.000	15,774,100.000	
AIRPORTS OF THAILAND PCL-NVDR	406,400	68.250	27,736,800.000	
KASIKORNBANK PCL - FOREIGN	107,600	195.000	20,982,000.000	
CENTRAL PATTANA PCL NVDR	119,200	74.500	8,880,400.000	
BANGKOK DUSIT MEDICAL SERVICES NVDR	381,300	24.900	9,494,370.000	
BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR	32,400	179.500	5,815,800.000	
MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	227,610	37.250	8,478,472.500	
THAI OIL PCL NVDR	98,300	71.500	7,028,450.000	
GLOW ENERGY PCL NVDR	54,000	91.250	4,927,500.000	
CP ALL PCL NVDR	481,200	77.000	37,052,400.000	
BTS GROUP HOLDINGS PCL	531,300	11.200	5,950,560.000	
PTT EXPLORATION & PRODUCTION PCL NVDR	132,945	132.500	17,615,212.500	
INDORAMA VENTURES PCL NVDR	170,922	49.500	8,460,639.000	
PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	217,208	70.750	15,367,466.000	
ENERGY ABSOLUTE PCL NVDR	118,000	50.500	5,959,000.000	
BANGKOK EXPRESSWAY & METRO PCL NVDR	767,800	10.100	7,754,780.000	

	GULF ENERGY DEVELOPMENT PCL NVDR	34,200	100.500	3,437,100.000	
	MUANGTHAI CAPITAL PCL NVDR	59,400	49.500	2,940,300.000	
タイ・パーツ 小計		10,333,410		379,636,750.000 (1,328,728,626)	
チェコ・コルナ	KOMERCNI BANKA AS	7,113	940.000	6,686,220.000	
	CEZ	15,014	545.500	8,190,137.000	
	MONETA MONEY BANK AS	55,183	80.550	4,444,990.650	
チェコ・コルナ 小計		77,310		19,321,347.650 (94,481,389)	
チリ・ペソ	BANCO SANTANDER CHILE	6,414,470	51.000	327,137,970.000	
	BANCO DE CREDITO E INVERSIONES	4,770	45,800.000	218,466,000.000	
	BANCO DE CHILE	2,213,493	99.650	220,574,577.450	
	EMPRESAS CMPC SA	111,577	2,298.000	256,403,946.000	
	EMPRESAS COPEC SA	37,673	8,700.000	327,755,100.000	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	13,024	9,486.700	123,554,780.800	
	ENTEL CHILE SA	13,572	7,200.000	97,718,400.000	
	ENEL AMERICAS SA	2,818,718	117.500	331,199,365.000	
	COLBUN SA	819,136	152.800	125,163,980.800	
	AGUAS ANDINAS SA	224,014	382.950	85,786,161.300	
	EMBOTELLADORA ANDINA SA	40,401	2,480.000	100,194,480.000	
	LATAM AIRLINES GROUP SA	30,655	7,345.000	225,160,975.000	
	SOCIEDAD QUIMICA Y MINERA DE CHILE SA	10,624	25,590.000	271,868,160.000	
	SACI FALABELLA	67,478	5,080.000	342,788,240.000	
	ITAU CORPBANCA	13,236,977	5.836	77,250,997.770	
	CENCOSUD SA	151,141	1,350.000	204,040,350.000	
ENEL CHILE SA	2,891,060	70.370	203,443,892.200		
チリ・ペソ 小計		29,098,783		3,538,507,376.320 (593,761,537)	
トルコ・リラ	AKBANK TAS	295,891	6.270	1,855,236.570	
	ANADOLU EFES BIRACILIK VE MALT SANAYII AS	19,724	19.280	380,278.720	
	ARCELIK	18,902	18.490	349,497.980	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	31,766	21.200	673,439.200	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIKALARI TAS	125,960	9.540	1,201,658.400	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	5,919	50.300	297,725.700	
	KOC HOLDING AS	67,325	16.750	1,127,693.750	
	PETKIM PETROKIMYA HOLDING	88,174	4.600	405,600.400	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI AS	54,397	6.070	330,189.790	
	TURK HAVA YOLLARI	49,081	13.970	685,661.570	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	93,118	12.610	1,174,217.980	

	TURKIYE GARANTI BANKASI AS	238,394	8.800	2,097,867.200	
	TURKIYE IS BANKASI	151,063	5.780	873,144.140	
	TUPRAS TURKIYE PETROL RAFINE	10,681	131.000	1,399,211.000	
	HACI OMER SABANCI HOLDING AS	109,114	8.100	883,823.400	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	19,011	78.250	1,487,610.750	
	TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	13,735	24.380	334,859.300	
	TURKIYE HALK BANKASI AS	61,970	6.380	395,368.600	
トルコ・リラ 小計		1,454,225		15,953,084.450 (312,201,863)	
ハンガリー・フォロント	RICHTER GEDEON NYRT	13,104	5,515.000	72,268,560.000	
	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NYRT	34,934	3,280.000	114,583,520.000	
	OTP BANK NYRT	21,483	12,820.000	275,412,060.000	
ハンガリー・フォロント 小計		69,521		462,264,140.000 (180,098,108)	
パキスタン・ルピー	MCB BANK LTD	39,000	186.990	7,292,610.000	
	OIL & GAS DEVELOPMENT CO LTD	74,500	142.170	10,591,665.000	
	HABIB BANK LTD	54,400	122.740	6,677,056.000	
パキスタン・ルピー 小計		167,900		24,561,331.000 (19,403,452)	
フィリピン・ペソ	AYALA LAND INC	718,600	45.350	32,588,510.000	
	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	179,890	60.950	10,964,295.500	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAND	85,570	82.250	7,038,132.500	
	AYALA CORP	24,433	924.000	22,576,092.000	
	ALLIANCE GLOBAL GROUP INC	307,700	16.320	5,021,664.000	
	DMCI HOLDINGS INC	351,850	12.100	4,257,385.000	
	GLOBE TELECOM INC	2,785	1,910.000	5,319,350.000	
	INTERNATIONAL CONTAINER TERM SERVICES INC	81,420	133.300	10,853,286.000	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	289,240	66.450	19,219,998.000	
	JOLLIBEE FOODS CORP	43,720	322.000	14,077,840.000	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	144,997	78.500	11,382,264.500	
	BDO UNIBANK INC	192,583	130.900	25,209,114.700	
	MEGAWORLD CORP	962,000	5.820	5,598,840.000	
	PLDT INC	8,600	1,165.000	10,019,000.000	
	ROBINSONS LAND CORP	218,722	24.500	5,358,689.000	
	SECURITY BANK CORP	23,420	180.500	4,227,310.000	
SM PRIME HOLDINGS INC	970,075	39.950	38,754,496.250		

	UNIVERSAL ROBINA CORP	79,130	159.600	12,629,148.000	
	SM INVESTMENTS CORP	21,938	967.000	21,214,046.000	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CORP	1,148,900	4.700	5,399,830.000	
	ABOITIZ POWER CORP	128,200	36.600	4,692,120.000	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	23,430	385.000	9,020,550.000	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	9,137	900.000	8,223,300.000	
フィリピン・ペソ	小計	6,016,340		293,645,261.450 (628,400,859)	
ブラジル・リアル	BRF SA	47,492	24.980	1,186,350.160	
	VALE SA	300,521	51.760	15,554,966.960	
	RAIA DROGASIL SA	20,600	66.550	1,370,930.000	
	TIM PARTICIPACOES SA	76,300	12.410	946,883.000	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	23,850	36.150	862,177.500	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	19,800	33.940	672,012.000	
	BANCO DO BRASIL SA	84,700	48.810	4,134,207.000	
	INVESTIMENTOS ITAU SA	432,360	11.820	5,110,495.200	
	LOJAS AMERICANAS SA	77,074	15.400	1,186,939.600	
	GERDAU SA	101,030	15.530	1,568,995.900	
	CIA BRASILEIRA DE DISTRIBUICAO GRUPO PAO DE ACUCAR	15,806	91.850	1,451,781.100	
	PETROLEO BRASILEIRO SA	278,210	32.270	8,977,836.700	
	PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	32,800	23.400	767,520.000	
	PETROLEO BRASILEIRO SA	377,412	28.780	10,861,917.360	
	KROTON EDUCACIONAL SA	137,368	10.370	1,424,506.160	
	CCR SA	121,420	12.450	1,511,679.000	
	WEG SA	90,072	18.330	1,651,019.760	
	BANCO BRADESCO SA PREF	350,550	35.790	12,546,184.500	
	BANCO BRADESCO SA	99,741	31.200	3,111,919.200	
	NATURA COSMETICOS SA	19,800	46.460	919,908.000	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	61,706	16.110	994,083.660	
	SUZANO SA	52,375	43.130	2,258,933.750	
	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	463,947	34.090	15,815,953.230	
	PORTO SEGURO SA	8,800	53.140	467,632.000	
	B2W CIA DIGITAL	16,200	36.650	593,730.000	
	BRASKEM SA	15,730	47.620	749,062.600	
	ENGIE BRASIL SA	21,187	42.760	905,956.120	
	LOCALIZA RENT A CAR	58,480	31.580	1,846,798.400	
	TELEFONICA BRASIL S.A.	43,428	48.280	2,096,703.840	
	LOJAS RENNER SA	71,370	42.690	3,046,785.300	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	35,852	45.520	1,631,983.040	
	COSAN SA	16,200	46.300	750,060.000	
	EQUATORIAL ENERGIA SA	17,700	80.000	1,416,000.000	

EMBRAER SA	65,660	18.790	1,233,751.400	
M DIAS BRANCO SA	10,400	42.180	438,672.000	
BR MALLS PARTICIPACOES SA	76,565	12.340	944,812.100	
JBS SA	90,000	17.110	1,539,900.000	
CIA ENERGETICA DE MINAS GERAIS	79,449	14.670	1,165,516.830	
CIA DE SANEAMENTO BASICO DO ESTADO DE SAO PAULO	33,898	40.000	1,355,920.000	
MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS IMOBILIARIOS SA	34,440	23.000	792,120.000	
SUL AMERICA SA	17,869	31.370	560,550.530	
HYPERA SA	36,500	25.290	923,085.000	
B3 SA-BRASIL BOLSA BAICAO	198,716	32.140	6,386,732.240	
MAGAZINE LUIZA SA	7,500	168.700	1,265,250.000	
BANCO SANTANDER BRASIL SA	40,800	45.160	1,842,528.000	
CIELO SA	111,307	9.720	1,081,904.040	
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	68,900	27.580	1,900,262.000	
ATACADAO DISTRIBUICAO COMERCIO E INDUSTRIA LTDA	37,300	20.030	747,119.000	
AMBEV SA	448,195	17.550	7,865,822.250	
KLABIN SA	64,800	16.450	1,065,960.000	
RUMO SA	108,000	18.160	1,961,280.000	
IRB BRASIL RESSEGUROS S/A	13,700	93.420	1,279,854.000	
ブラジル・リアル 小計	5,133,880		142,742,950.430 (4,145,255,281)	
ポーランド・ズロチ				
BANK MILLENNIUM SA	49,782	9.500	472,929.000	
MBANK	1,383	444.000	614,052.000	
BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA	2,596	65.400	169,778.400	
KGHM POLSKA MIEDZ SA	14,294	112.000	1,600,928.000	
BANK PEKAO SA	15,887	113.800	1,807,940.600	
ORANGE POLSKA SA	58,600	5.105	299,153.000	
POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	28,643	102.050	2,923,018.150	
LPP SA	131	9,125.000	1,195,375.000	
SANTANDER BANK POLSKA SA	3,515	396.800	1,394,752.000	
CD PROJEKT RED SA	6,015	207.900	1,250,518.500	
POWSZECHNA KASA OSZCZEDNOSCI BANK POLSKI SA	84,554	39.780	3,363,558.120	
CCC SA	2,763	235.400	650,410.200	
GRUPA LOTOS SA	9,385	84.720	795,097.200	

	POLSKIE GORNICtwo NAFTOWE I GAZOWNICTWO SA	165,076	6.365	1,050,708.740	
	CYFROWY POLSAT SA	23,495	25.880	608,050.600	
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	70,529	9.648	680,463.790	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZEN SA	53,842	41.480	2,233,366.160	
	JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA SA	5,380	60.600	326,028.000	
	ALIOR BANK SA	9,007	60.000	540,420.000	
	DINO POLSKA SA	4,709	133.500	628,651.500	
ポーランド・ズロチ 小計		609,586		22,605,198.960 (661,654,174)	
マレーシア・リン ギット	AMMB HOLDINGS BHD	134,500	4.440	597,180.000	
	GENTING PLANTATIONS BHD	37,500	10.560	396,000.000	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	465,100	5.080	2,362,708.000	
	DIGI.COM BHD	288,700	4.690	1,354,003.000	
	MALAYSIA AIRPORTS HOLDINGS BHD	101,420	6.750	684,585.000	
	RHB BANK BHD	77,780	5.690	442,568.200	
	HAP SENG CONSOLIDATED BHD	63,200	9.890	625,048.000	
	TOP GLOVE CORP BHD	133,800	4.570	611,466.000	
	GAMUDA BHD	194,600	3.300	642,180.000	
	GENTING BHD	211,700	6.790	1,437,443.000	
	YTL CORP BHD	283,710	1.200	340,452.000	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP BHD	20,256	19.480	394,586.880	
	HONG LEONG BANK BHD	62,408	20.080	1,253,152.640	
	IJM CORP BHD	230,360	2.340	539,042.400	
	IOI CORP BHD	187,213	4.520	846,202.760	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	44,500	24.900	1,108,050.000	
	FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	12,800	34.980	447,744.000	
	MALAYAN BANKING BHD	366,275	9.280	3,399,032.000	
	ALLIANCE BANK MALAYSIA BHD	88,400	4.090	361,556.000	
	MISC BHD	90,280	6.670	602,167.600	
	NESTLE MALAYSIA BHD	4,800	146.800	704,640.000	
	PPB GROUP BHD	47,560	18.800	894,128.000	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	19,600	25.000	490,000.000	
	PETRONAS GAS BHD	60,400	17.620	1,064,248.000	
GENTING MALAYSIA BHD	298,600	3.180	949,548.000		
BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD	14,700	36.760	540,372.000		
TELEKOM MALAYSIA BHD	103,400	3.040	314,336.000		
SP SETIA BHD	136,700	2.250	307,575.000		
TENAGA NASIONAL BHD	304,650	12.580	3,832,497.000		

	QL RESOURCES BHD	53,800	6.830	367,454.000	
	DIALOG GROUP BHD	320,544	3.240	1,038,562.560	
	PUBLIC BANK BHD(LLOCAL)	276,230	22.640	6,253,847.200	
	AIRASIA GROUP BHD	147,900	2.530	374,187.000	
	SIME DARBY BERHAD	229,600	2.190	502,824.000	
	HARTALEGA HOLDINGS BHD	117,100	4.690	549,199.000	
	AXIATA GROUP BERHAD	274,600	4.150	1,139,590.000	
	MAXIS BHD	238,400	5.600	1,335,040.000	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	233,100	9.000	2,097,900.000	
	IHH HEALTHCARE BHD	213,700	5.600	1,196,720.000	
	WESTPORTS HOLDINGS BHD	109,200	3.750	409,500.000	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDINGS BHD	124,000	4.590	569,160.000	
	SIME DARBY PROPERTY BHD	232,700	1.110	258,297.000	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	216,100	5.140	1,110,754.000	
	IOI PROPERTIES GROUP SDN BHD	174,548	1.340	233,894.320	
	マレーシア・リンギット 小計	7,046,434		44,979,440.560 (1,215,344,484)	
メキシコ・ペソ	ALFA SAB DE CV	264,100	20.020	5,287,282.000	
	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	51,500	126.990	6,539,985.000	
	EL PUERTO DE LIVERPOOL SAB DE CV	19,100	121.410	2,318,931.000	
	GRUPO TELEVISA SAB	238,900	41.960	10,024,244.000	
	GRUPO BIMBO SAB DE CV	162,600	41.410	6,733,266.000	
	GRUMA SAB DE CV	21,640	201.280	4,355,699.200	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INFRAESTRUCTURA	20,260	189.130	3,831,773.800	
	GRUPO CARSO SAB DE CV	37,600	74.090	2,785,784.000	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE SAB DE CV	248,400	117.040	29,072,736.000	
	MEXICHEM SAB DE CV	94,025	46.900	4,409,772.500	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	16,155	233.760	3,776,392.800	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO SAB DE CV	134,300	33.380	4,482,934.000	
	ALSEA SAB DE CV	43,700	44.950	1,964,315.000	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL SURESTE SAB DE CV	20,465	306.950	6,281,731.750	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV	338,952	55.560	18,832,173.120	
	AMERICA MOVIL SAB DE CV	3,212,578	14.950	48,028,041.100	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA SA	198,800	28.350	5,635,980.000	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	42,600	107.790	4,591,854.000	
	WAL-MART DE MEXICO SAB DE CV	496,200	54.530	27,057,786.000	

	GRUPO AEROPORTUARIO DEL PACIFICO SAB DE CV	31,200	190.460	5,942,352.000	
	MEGACABLE HOLDINGS SAB DE CV	27,400	91.900	2,518,060.000	
	INFRAESTRUCTURA ENERGETICA NOVA SAB DE CV	54,400	83.620	4,548,928.000	
	BANCO SANTANDER MEXICO SA	154,590	28.720	4,439,824.800	
メキシコ・ペソ 小計		5,929,465		213,459,846.070 (1,259,413,092)	
ユーロ	ALPHA BANK A.E.	125,732	1.457	183,191.520	
	TITAN CEMENT CO. S.A.	4,089	18.840	77,036.760	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	22,051	12.300	271,227.300	
	FF GROUP	3,130	2.400	7,512.000	
	MOTOR OIL HELLAS CORINTH REFIN	5,847	21.180	123,839.460	
	OPAP SA	19,846	9.360	185,758.560	
	JUMBO SA	11,502	14.840	170,689.680	
ユーロ 小計		192,197		1,019,255.280 (127,651,530)	
韓国・ウォン	CHEIL WORLDWIDE INC	7,551	25,050.000	189,152,550.000	
	HANMI SCIENCE CO LTD	1,187	76,600.000	90,924,200.000	
	HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	3,124	82,000.000	256,168,000.000	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANC	2,940	293,500.000	862,890,000.000	
	DB INSURANCE CO LTD	4,871	68,900.000	335,611,900.000	
	WOONGJIN COWAY CO LTD	5,070	93,000.000	471,510,000.000	
	KT&G CORP	11,307	102,500.000	1,158,967,500.000	
	S-1 CORPORATION	1,444	101,000.000	145,844,000.000	
	KOREA GAS CORP	2,469	46,450.000	114,685,050.000	
	CJ CORP	1,695	128,000.000	216,960,000.000	
	KAKAO CORP	4,862	102,500.000	498,355,000.000	
	CJ ENM CO LTD	987	232,200.000	229,181,400.000	
	DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE	2,634	29,300.000	77,176,200.000	
	SK TELECOM CO LTD	1,859	246,500.000	458,243,500.000	
	DAELIM INDUSTRIAL CO	2,649	96,900.000	256,688,100.000	
	MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD	40,322	7,820.000	315,318,040.000	
	NCSOFT CORPORATION	1,688	497,500.000	839,780,000.000	
	LG UPLUS CORP	9,656	14,650.000	141,460,400.000	
	DAEWOO ENGINEERING & CONSTRUCT	13,540	5,080.000	68,783,200.000	
	POSCO INTERNATIONAL CORP	3,600	18,500.000	66,600,000.000	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD	896	1,430,000.000	1,281,280,000.000		
LG CHEM LTD	4,391	389,000.000	1,708,099,000.000		

LG CHEM LTD	726	215,500.000	156,453,000.000	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD	201	829,000.000	166,629,000.000	
SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD	40,781	45,750.000	1,865,730,750.000	
S-OIL CORP	4,383	92,700.000	406,304,100.000	
HANWHA CHEMICAL CORPORATION	8,289	23,000.000	190,647,000.000	
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	5,997	36,750.000	220,389,750.000	
POSCO CHEMICAL CO LTD	2,126	60,700.000	129,048,200.000	
LOTTE CHEMICAL CORPORATION	1,677	295,500.000	495,553,500.000	
HOTEL SHILLA CO LTD	2,826	104,500.000	295,317,000.000	
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	3,844	119,500.000	459,358,000.000	
HYUNDAI MOBIS	6,484	226,000.000	1,465,384,000.000	
SK HYNIX INC	55,420	78,600.000	4,356,012,000.000	
HYUNDAI ENGINEERING & CONSTRUCTION CO LTD	7,408	53,900.000	399,291,200.000	
HYUNDAI MOTOR CO	1,954	74,000.000	144,596,000.000	
HYUNDAI MOTOR CO	13,532	127,500.000	1,725,330,000.000	
HYUNDAI STEEL CO	7,194	48,250.000	347,110,500.000	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	22,606	14,550.000	328,917,300.000	
KCC CORP	554	334,000.000	185,036,000.000	
KIA MOTORS CORP	25,170	40,100.000	1,009,317,000.000	
KOREA ZINC CO LTD	838	482,500.000	404,335,000.000	
KOREA ELECTRIC POWER CORP	24,764	29,650.000	734,252,600.000	
HANWHA CORP	3,785	31,350.000	118,659,750.000	
KOREAN AIR CO LTD	4,387	32,950.000	144,551,650.000	
OCI COMPANY LTD	1,829	97,300.000	177,961,700.000	
CJ LOGISTICS	860	169,500.000	145,770,000.000	
KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	1,509	101,000.000	152,409,000.000	
KT CORP	2,048	27,700.000	56,729,600.000	
HLB INC	2,994	86,000.000	257,484,000.000	
LG ELECTRONICS INC	10,293	77,200.000	794,619,600.000	
LOTTE CORP	2,810	50,600.000	142,186,000.000	
LG CORP	9,219	78,700.000	725,535,300.000	
NH INVESTMENT & SECURITIES CO LTD	13,362	14,450.000	193,080,900.000	
GS ENGINEERING & CONSTRUCTION	6,004	39,850.000	239,259,400.000	
NAVER CORP	13,374	122,000.000	1,631,628,000.000	
HYUNDAI DEPARTMENT STORE CO LTD	1,249	99,900.000	124,775,100.000	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO LTD	4,291	71,200.000	305,519,200.000	
OTTOGI CORP	112	741,000.000	82,992,000.000	

AMOREPACIFIC GROUP	2,761	71,500.000	197,411,500.000	
KANGWON LAND INC	10,655	31,600.000	336,698,000.000	
POSCO	7,446	273,000.000	2,032,758,000.000	
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	14,449	16,700.000	241,298,300.000	
SAMSUNG SDI CO LTD	5,265	220,500.000	1,160,932,500.000	
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO LTD	5,455	110,500.000	602,777,500.000	
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	453,255	46,700.000	21,167,008,500.000	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES CO LTD	39,172	8,800.000	344,713,600.000	
SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	78,205	37,400.000	2,924,867,000.000	
SHINSEGAE CO LTD	646	329,000.000	212,534,000.000	
YUHAN CORP	951	248,000.000	235,848,000.000	
HANON SYSTEMS	17,156	12,150.000	208,445,400.000	
HYUNDAI MARINE & FIRE INSURANCE CO LTD	5,667	38,600.000	218,746,200.000	
GS HOLDINGS CORP	4,751	53,800.000	255,603,800.000	
LG DISPLAY CO LTD	22,849	21,950.000	501,535,550.000	
CELLTRION INC	7,964	205,500.000	1,636,602,000.000	
VIROMED CO LTD	1,190	278,000.000	330,820,000.000	
HANA FINANCIAL GROUP	28,914	39,150.000	1,131,983,100.000	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	1,800	139,500.000	251,100,000.000	
CELLTRION PHARM INC	1,457	57,800.000	84,214,600.000	
LOTTE SHOPPING CO	1,003	179,500.000	180,038,500.000	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LTD	6,776	85,500.000	579,348,000.000	
AMOREPACIFIC CORP	3,123	201,500.000	629,284,500.000	
AMOREPACIFIC CORP-PREF	848	115,000.000	97,520,000.000	
SAMSUNG CARD CO	2,877	35,500.000	102,133,500.000	
SK INNOVATION CO LTD	6,175	184,000.000	1,136,200,000.000	
CJ CHEILJEDANG CORP	858	329,500.000	282,711,000.000	
STX PAN OCEAN CO LTD	18,395	4,345.000	79,926,275.000	
LG INNOTEK CO LTD	1,440	125,500.000	180,720,000.000	
SK HOLDINGS CO LTD	3,080	272,500.000	839,300,000.000	
KB FINANCIAL GROUP INC	38,076	45,200.000	1,721,035,200.000	
MEDY-TOX INC	421	609,100.000	256,431,100.000	
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES LTD	6,602	36,600.000	241,633,200.000	
BNK FINANCIAL GROUP INC	24,923	7,200.000	179,445,600.000	
HANMI PHARM CO LTD	653	442,500.000	288,952,500.000	
HANWHA LIFE INSURANCE CO LTD	28,468	3,970.000	113,017,960.000	
FILA KOREA LTD	4,310	77,100.000	332,301,000.000	
E-MART CO LTD	1,878	179,500.000	337,101,000.000	
DGB FINANCIAL GROUP INC	16,321	8,410.000	137,259,610.000	
GS RETAIL CO LTD	2,482	38,550.000	95,681,100.000	
HANKOOK TIRE CO LTD NEW	6,590	40,550.000	267,224,500.000	

	HDC HYUNDAI DEVELOPMENT CO-ENGINEERING & CONSTRUCTION	2,482	48,200.000	119,632,400.000	
	HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOLDINGS CO LTD	863	341,000.000	294,283,000.000	
	BGF RETAIL CO LTD	631	224,500.000	141,659,500.000	
	ORION CORP REPUBLIC OF KOREA	2,071	102,000.000	211,242,000.000	
	ORANGE LIFE INSURANCE LTD	2,763	34,800.000	96,152,400.000	
	NETMARBLE CORP	2,291	128,000.000	293,248,000.000	
	WOORI FINANCIAL GROUP INC	44,348	14,350.000	636,393,800.000	
	SAMSUNG SDS CO LTD	3,352	235,000.000	787,720,000.000	
	SAMSUNG C&T CORP	7,394	111,000.000	820,734,000.000	
	SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	1,563	363,500.000	568,150,500.000	
	PEARL ABYSS CORP	534	181,300.000	96,814,200.000	
	DOOSAN BOBCAT INC	3,636	31,200.000	113,443,200.000	
	SILLAJEN INC	5,319	65,600.000	348,926,400.000	
	CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	4,460	70,000.000	312,200,000.000	
韓国・ウォン 小計		1,410,656		77,555,612,635.000 (7,584,938,916)	
香港・ドル	JIANGXI COPPER CO LTD	124,000	11.000	1,364,000.000	
	JIANGSU EXPRESS	128,000	11.080	1,418,240.000	
	CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD	126,000	7.700	970,200.000	
	ANGANG STEEL CO LTD-H	104,000	6.180	642,720.000	
	CHINA MOBILE LIMITED	582,500	77.850	45,347,625.000	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	106,000	52.050	5,517,300.000	
	DATANG INTERNATIONAL POWER GEN	288,000	2.160	622,080.000	
	BEIJING ENTERPRISES	51,500	43.800	2,255,700.000	
	HUANENG POWER INTERNATIONAL IN	436,000	4.720	2,057,920.000	
	ALIBABA HEALTH INFORMATION TECHNOLOGY	340,000	10.000	3,400,000.000	
	YANZHOU COAL MINING CO LTD	172,000	9.040	1,554,880.000	
	HENGAN INTERNATIONAL GROUP	70,000	70.650	4,945,500.000	
	HUADIAN POWER INTL CORP- H	144,000	3.300	475,200.000	
	CHINA EASTERN AIRLINES CORP LT	124,000	6.130	760,120.000	
	CNOOC LTD	1,697,000	14.920	25,319,240.000	
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	270,000	8.820	2,381,400.000		

CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LTD	452,000	16.160	7,304,320.000	
CHINA OVERSEAS LAND & INVESTME	365,120	30.500	11,136,160.000	
CHINA RESOURCES LAND LTD	264,888	34.850	9,231,346.800	
CITIC LTD	562,000	12.100	6,800,200.000	
CHINA TRAVEL INTERNATIONAL INV	198,000	1.930	382,140.000	
BEIJING CAPITAL INTERNATIONAL	162,000	7.230	1,171,260.000	
LENOVO GROUP LTD	698,000	7.490	5,228,020.000	
PETRO CHINA CO LTD	1,982,000	5.230	10,365,860.000	
CHINA UNICOM HONG KONG LTD	592,742	10.120	5,998,549.040	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS CO LTD	159,990	25.350	4,055,746.500	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL COR	2,409,200	6.250	15,057,500.000	
TONG REN TANG TECHNOLOGIES CO	54,000	10.920	589,680.000	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	94,000	19.620	1,844,280.000	
KINGDEE INTERNATIONAL SOFTWARE GROUP CO LTD	232,000	9.350	2,169,200.000	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	75,500	76.250	5,756,875.000	
KUNLUN ENERGY COMPANY LTD	288,000	8.450	2,433,600.000	
TOWNGAS CHINA CO LTD	91,000	6.160	560,560.000	
COSCO SHIPPING PORTS LTD	152,000	9.260	1,407,520.000	
YUEXIU PROPERTY CO LTD	634,000	1.920	1,217,280.000	
CHINA MERCHANTS PORT HOLDINGS CO LTD	124,000	16.460	2,041,040.000	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	374,000	3.400	1,271,600.000	
CHINA DING YI FENG HOLDINGS LTD	80,000	23.100	1,848,000.000	
SHENZHEN INTERNATIONAL HOLDING	104,000	17.520	1,822,080.000	
CHINA EVERBRIGHT LTD	106,000	15.360	1,628,160.000	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	171,000	26.000	4,446,000.000	
KINGBOARD HOLDINGS LTD	63,500	28.600	1,816,100.000	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LTD	478,000	17.700	8,460,600.000	
SHENZHEN INVESTMENT LTD	306,000	3.270	1,000,620.000	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LTD	82,000	34.950	2,865,900.000	
BYD CO LTD	57,500	52.850	3,038,875.000	
CHINA TELECOM CORP LTD	1,340,000	4.290	5,748,600.000	
CHINA OILFIELD SERVICES LTD	172,000	8.520	1,465,440.000	

ALIBABA PICTURES GROUP LTD	1,430,000	1.450	2,073,500.000	
SINOTRANS LTD	190,000	3.630	689,700.000	
MAANSHAN IRON & STEEL	172,000	4.200	722,400.000	
CHINA EVERBRIGHT INTERNATIONAL	337,592	7.950	2,683,856.400	
MMG LTD	220,000	3.750	825,000.000	
LEE & MAN PAPER MANUFACTURING LTD	136,000	6.720	913,920.000	
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	661,788	8.980	5,942,856.240	
AVICHINA INDUSTRY & TECHNOLOGY	189,000	4.800	907,200.000	
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS	191,200	11.380	2,175,856.000	
GREAT WALL MOTOR COMPANY LTD	312,500	6.960	2,175,000.000	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	715,000	21.600	15,444,000.000	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD	561,000	3.450	1,935,450.000	
CHINA ORIENTAL GROUP CO LTD	70,000	5.290	370,300.000	
SHANDONG WEIGAO GROUP MEDICAL-H	176,000	6.960	1,224,960.000	
SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	274,700	7.970	2,189,359.000	
WEICHAJ POWER CO LTD	176,440	14.900	2,628,956.000	
CHINA SHIPPING DEVELOPMENT CO	100,000	5.200	520,000.000	
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEMICAL	373,000	3.960	1,477,080.000	
SHANGHAI INDUSTRIAL	46,000	19.180	882,280.000	
TINGYI HOLDING CORP	178,000	12.640	2,249,920.000	
TSINGTAO BREWERY CO LTD	34,000	42.900	1,458,600.000	
GUANGDONG INVESTMENTS LTD	282,000	14.560	4,105,920.000	
CHINA TRADITIONAL CHINESE MEDICINE HOLDINGS CO LTD	208,000	5.010	1,042,080.000	
CHINA RESOURCES BEER HOLDINGS	141,333	34.900	4,932,521.700	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO LTD	146,000	9.290	1,356,340.000	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	675,500	8.160	5,512,080.000	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	265,000	29.500	7,817,500.000	
TENCENT HOLDINGS LTD	542,600	388.800	210,962,880.000	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	492,000	93.450	45,977,400.000	

BEIJING ENTERPRISES WATER GROUP LTD	508,000	4.800	2,438,400.000	
GOME RETAIL HOLDINGS LTD	970,240	0.830	805,299.200	
CHINA POWER INTERNATIONAL	350,000	2.030	710,500.000	
AIR CHINA / HONG KONG	164,000	10.280	1,685,920.000	
ZTE CORP	71,288	25.400	1,810,715.200	
SHANGHAI ELECTRIC GROUP CO LTD	250,000	3.110	777,500.000	
CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD	334,000	18.080	6,038,720.000	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO LTD	248,500	3.770	936,845.000	
BANK OF COMMUNICATIONS	810,205	6.640	5,379,761.200	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT HOLDINGS LTD	186,250	7.350	1,368,937.500	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	72,000	53.800	3,873,600.000	
CHINA CONSTRUCTION BANK	9,138,530	6.920	63,238,627.600	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP HOLDINGS LTD	72,600	106.200	7,710,120.000	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	270,000	8.620	2,327,400.000	
AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	158,000	13.020	2,057,160.000	
SSY GROUP LTD	144,000	7.870	1,133,280.000	
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS LTD	171,000	7.810	1,335,510.000	
CHINA NATIONAL BLDG MATERIAL	392,000	7.540	2,955,680.000	
BANK OF CHINA LTD	7,528,200	3.750	28,230,750.000	
SHUI ON LAND LTD	335,500	1.980	664,290.000	
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	113,000	26.550	3,000,150.000	
GREENTOWN CHINA HOLDINGS LTD	82,000	8.060	660,920.000	
GUANGZHOU R&F PROPERTIES CO LTD	80,000	17.080	1,366,400.000	
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	370,970	40.450	15,005,736.500	
IND & COMM BK OF CHINA - H	6,590,235	5.860	38,618,777.100	
ZHAOJIN MINING INDUSTRY CO LTD	96,000	7.720	741,120.000	
KINGBOARD LAMINATES HOLDING	104,000	9.290	966,160.000	
CHINA COMMUNICATIONS SERVICES	227,600	7.080	1,611,408.000	
CHINA COMMUNICATIONS CONSTRUCTION CO LTD	442,000	8.270	3,655,340.000	

CHINA COAL ENERGY CO	178,000	3.360	598,080.000	
HAITIAN INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	54,000	19.420	1,048,680.000	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC CO LTD	51,000	44.550	2,272,050.000	
HAIER ELECTRONICS GROUP CO LTD	115,000	23.200	2,668,000.000	
CHINA AGRI-INDUSTRIES HOLDINGS LTD	191,000	2.630	502,330.000	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD	727,142	13.260	9,641,902.920	
CHINA MOLYBDENUM CO LTD	369,000	3.650	1,346,850.000	
CHINA CITIC BANK-H	879,800	5.060	4,451,788.000	
KWG GROUP HOLDINGS LTD	121,000	9.440	1,142,240.000	
SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	68,700	107.700	7,398,990.000	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	104,000	52.150	5,423,600.000	
FOSUN INTERNATIONAL	261,028	13.240	3,456,010.720	
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP LTD	514,000	5.750	2,955,500.000	
SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD	253,500	4.040	1,024,140.000	
SOHO CHINA LTD	172,500	3.030	522,675.000	
KINGSOFT CORP LTD	76,000	21.550	1,637,800.000	
SINOTRUK HONG KONG LTD	64,500	20.200	1,302,900.000	
CHINA RAILWAY GROUP LTD	338,000	6.760	2,284,880.000	
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS LTD	122,000	7.200	878,400.000	
BYD ELECTRONIC INTERNATIONAL CO LTD	52,500	11.980	628,950.000	
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION CORP	165,000	9.980	1,646,700.000	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	488,000	6.550	3,196,400.000	
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	251,800	32.600	8,208,680.000	
CHINA EVERGRANDE GROUP	250,000	26.250	6,562,500.000	
CRRC CORP LTD - H	337,450	7.420	2,503,879.000	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDINGS LTD	126,000	8.230	1,036,980.000	
SUN ART RETAIL GROUP LTD	211,500	7.200	1,522,800.000	
BBMG CORP	222,000	3.070	681,540.000	
CHINA ZHONGWANG HOLDINGS LTD	145,200	4.280	621,456.000	
SINOPHARM GROUP CO	107,600	32.700	3,518,520.000	
CHINA RESOURCES CEMENT	238,000	8.660	2,061,080.000	
METALLURGICAL CORP OF CHINA LTD	276,000	2.350	648,600.000	

GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD	274,527	9.910	2,720,562.570	
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	199,500	6.680	1,332,660.000	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL BANK	268,000	4.820	1,291,760.000	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP CORP	272,000	5.420	1,474,240.000	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD	73,700	17.460	1,286,802.000	
HUANENG RENEWABLES CORP LTD	472,000	2.270	1,071,440.000	
SIHUA PHARMACEUTICAL HOLDINGS GROUP LTD	325,000	2.060	669,500.000	
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	233,000	42.700	9,949,100.000	
YUZHOU PROPERTIES CO LTD	166,000	4.700	780,200.000	
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	144,000	29.200	4,204,800.000	
NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	84,600	44.150	3,735,090.000	
CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	592,656	6.000	3,555,936.000	
KAISA GROUP HOLDINGS LTD	203,000	3.670	745,010.000	
XINJIANG GOLDWIND SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	84,800	10.020	849,696.000	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD	269,000	3.840	1,032,960.000	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA	2,791,000	3.670	10,242,970.000	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS LTD	55,000	21.850	1,201,750.000	
FAR EAST HORIZON LTD	199,000	8.700	1,731,300.000	
CITIC SECURITIES CO LTD	202,500	18.500	3,746,250.000	
FUTURE LAND DEVELOPMENT HOLDINGS LTD	172,000	10.300	1,771,600.000	
HAITONG SECURITIES CO LTD	292,000	10.620	3,101,040.000	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROUP OF CHINA LTD	789,000	3.380	2,666,820.000	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	46,000	30.350	1,396,100.000	
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	334,000	5.980	1,997,320.000	
SINOPEC ENGINEERING GROUP CO LTD	121,500	7.550	917,325.000	
CHINA GALAXY SECURITIES CO LTD	328,500	5.400	1,773,900.000	
HANERGY THIN FILM POWER GROUP	986,000	0.000	0.000	

NEXTEER AUTOMOTIVE GROUP LTD	85,000	11.320	962,200.000	
CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS CO LTD	323,000	0.000	0.000	
GREENTOWN SERVICE GROUP CO LTD	96,000	7.320	702,720.000	
JIAYUAN INTERNATIONAL GROUP LTD	94,000	4.040	379,760.000	
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO LTD	59,800	16.460	984,308.000	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA CO LTD	717,000	4.570	3,276,690.000	
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING LTD	43,000	38.100	1,638,300.000	
GENSCRIPT BIOTECH CORP	74,000	22.300	1,650,200.000	
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLDINGS CO LTD	118,000	14.500	1,711,000.000	
CHINA FIRST CAPITAL GROUP LTD	308,000	3.870	1,191,960.000	
CHINA TOWER CORP LTD	3,806,000	2.120	8,068,720.000	
XIAOMI CORP	335,600	11.840	3,973,504.000	
MEITUAN DIANPING	29,400	53.750	1,580,250.000	
XINJIANG GOLDWIND SCIENCE & TECHNOLOGY-RTS	11,400	1.690	19,266.000	
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	276,000	4.150	1,145,400.000	
CHINA CINDA ASSET MANAGEMENT CO LTD	796,000	2.220	1,767,120.000	
LOGAN PROPERTY HOLDINGS CO LTD	134,000	13.820	1,851,880.000	
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS LTD	148,000	28.300	4,188,400.000	
CHINA VANKE CO LTD-H	120,861	34.550	4,175,747.550	
LUYE PHARMA GROUP LTD	108,000	7.640	825,120.000	
CAR INC	68,000	6.490	441,320.000	
HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	39,000	18.940	738,660.000	
CGN POWER CO LTD	981,000	2.200	2,158,200.000	
FULLSHARE HOLDINGS LTD	695,000	0.980	681,100.000	
BAIC MOTOR CORP LTD	163,500	6.420	1,049,670.000	
GF SECURITIES CO LTD	112,000	11.100	1,243,200.000	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD	51,200	29.250	1,497,600.000	
HUATAI SECURITIES CO LTD	145,800	15.580	2,271,564.000	
3SBIO INC	129,000	16.000	2,064,000.000	
LEGEND HOLDINGS CORP	31,500	21.700	683,550.000	
CHINA RESOURCES PHARMACEUTICAL GROUP LTD	160,500	11.120	1,784,760.000	
CHINA HUARONG ASSET MANAGEMENT CO LTD	904,000	1.700	1,536,800.000	

	CHINA LITERATURE LTD	24,000	39.200	940,800.000	
	DALI FOODS GROUP CO LTD	188,000	5.850	1,099,800.000	
	CHINA RAILWAY SIGNAL & COMMUNICATION CORP LTD	141,000	6.230	878,430.000	
	CHINA REINSURANCE GROUP CORP	525,000	1.640	861,000.000	
	MEITU INC	152,500	3.820	582,550.000	
	BOC AVIATION LTD	19,400	64.900	1,259,060.000	
	ZHONGAN ONLINE P&C INSURANCE CO LTD	23,000	30.500	701,500.000	
	CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CORP LTD	96,000	17.660	1,695,360.000	
	WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	44,500	83.200	3,702,400.000	
	HENGTEEN NETWORKS GROUP LTD	2,096,000	0.238	498,848.000	
香港・ドル 小計		89,246,675		978,600,930.740 (13,876,561,197)	
台湾・ドル	ACER INC	278,532	20.750	5,779,539.000	
	ASUSTEK COMPUTER INC	67,554	232.500	15,706,305.000	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	45,616	191.500	8,735,464.000	
	ASIA CEMENT CORP	194,928	41.300	8,050,526.400	
	WALSIN TECHNOLOGY CORP	31,000	204.000	6,324,000.000	
	TAIWAN BUSINESS BANK	371,457	12.100	4,494,629.700	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMICONDUCTOR CORP	85,000	67.200	5,712,000.000	
	MICRO-STAR INTERNATIONAL CO LTD	65,000	86.000	5,590,000.000	
	CHICONY ELECTRONICS CO LTD	54,975	73.200	4,024,170.000	
	QUANTA COMPUTER INC	260,858	59.000	15,390,622.000	
	HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	92,070	49.900	4,594,293.000	
	EVA AIRWAYS CORP	196,269	15.350	3,012,729.150	
	CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	62,760	256.000	16,066,560.000	
	CHANG HWA COMMERCIAL BANK	512,345	18.400	9,427,148.000	
	CHINA AIRLINES	232,156	9.870	2,291,379.720	
	CHENG SHIN RUBBER INDUSTRY CO	196,169	42.550	8,346,990.950	
	CHINA STEEL CORP	1,211,058	25.250	30,579,214.500	
	CHINA LIFE INSURANCE CO LTD/TAIWAN	264,994	25.500	6,757,347.000	
	ADVANTECH CO LTD	29,889	250.000	7,472,250.000	
	COMPAL ELECTRONICS INC	391,304	19.550	7,649,993.200	
DELTA ELECTRONICS INC	197,663	166.000	32,812,058.000		
NANYA TECHNOLOGY CORP	108,000	62.500	6,750,000.000		
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	357,327	109.500	39,127,306.500		

AU OPTRONICS CORP	873,194	11.400	9,954,411.600	
TAIWAN MOBILE CO LTD	146,800	111.000	16,294,800.000	
EVERGREEN MARINE CORP	198,276	12.050	2,389,225.800	
FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	321,824	32.600	10,491,462.400	
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	29,825	214.500	6,397,462.500	
ECLAT TEXTILE CO LTD	15,322	431.500	6,611,443.000	
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	51,285	197.500	10,128,787.500	
FORMOSA PLASTICS CORP	424,633	110.000	46,709,630.000	
FORMOSA TAFFETA CO LTD	95,000	36.200	3,439,000.000	
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE CO	335,594	108.500	36,411,949.000	
GIANT MANUFACTURING	30,151	210.000	6,331,710.000	
MEDIATEK INC	143,507	300.000	43,052,100.000	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD	631,936	45.500	28,753,088.000	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	634,232	19.300	12,240,677.600	
HOTAI MOTOR CO LTD	26,000	410.000	10,660,000.000	
FAR EASTONE TELECOMMUNICATIONS CO LTD	144,000	73.800	10,627,200.000	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	876,141	17.650	15,463,888.650	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	774,920	44.200	34,251,464.000	
CHINA DEPT FINANCIAL HOLDING	1,223,403	10.050	12,295,200.150	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO LTD	936,168	24.000	22,468,032.000	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	1,249,225	83.000	103,685,675.000	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,026,495	28.150	28,895,834.250	
LARGAN PRECISION CO LTD	9,220	4,770.000	43,979,400.000	
TAISHIN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	978,589	14.250	13,944,893.250	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING CO	943,061	8.810	8,308,367.410	
INVENTEC CO LTD	206,005	24.200	4,985,321.000	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	184,845	45.250	8,364,236.250	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	1,058,443	11.550	12,225,016.650	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,672,048	20.550	34,360,586.400	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO LTD	932,220	21.300	19,856,286.000	
POWERTECH TECHNOLOGY INC	85,560	75.000	6,417,000.000	

NAN YA PLASTICS CORP	489,828	77.700	38,059,635.600	
WISTRON CORP	266,916	25.150	6,712,937.400	
POU CHEN CORP	228,990	36.500	8,358,135.000	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CORP	462,297	73.500	33,978,829.500	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	54,392	293.000	15,936,856.000	
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	108,480	114.500	12,420,960.000	
PHISON ELECTRONICS CORP	12,658	313.000	3,961,954.000	
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	54,393	43.950	2,390,572.350	
RUENTEX INDUSTRIES LTD	33,829	79.700	2,696,171.300	
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	95,588	67.300	6,433,072.400	
STANDARD FOODS CORP	34,639	51.100	1,770,052.900	
SYNNEX TECHNOLOGY INTERNATIONAL CORP	151,899	37.700	5,726,592.300	
TAIWAN CEMENT CORP	444,561	42.000	18,671,562.000	
TATUNG CO LTD	164,000	29.800	4,887,200.000	
TAIWAN SEMICONDUCTOR	2,337,083	254.000	593,619,082.000	
UNITED MICROELECTRONICS CORP	1,156,525	12.250	14,167,431.250	
WINBOND ELECTRONICS CORP	318,000	16.600	5,278,800.000	
YAGEO CORP	23,160	329.000	7,619,640.000	
TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	203,000	35.600	7,226,800.000	
INNOLUX CORPORATION	820,345	10.100	8,285,484.500	
WPG HOLDINGS CO LTD	143,203	40.550	5,806,881.650	
HIWIN TECHNOLOGIES CORP	19,073	291.500	5,559,779.500	
TAIMED BIOLOGICS INC	18,000	172.500	3,105,000.000	
PEGATRON CORP	192,554	54.200	10,436,426.800	
AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	9,000	428.000	3,852,000.000	
WIN SEMICONDUCTORS CORP	31,000	212.000	6,572,000.000	
CHAILEASE HOLDING CO LTD	111,737	133.000	14,861,021.000	
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING LTD	45,385	102.500	4,651,962.500	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL HOLDING	839,412	19.500	16,368,534.000	
SHANGHAI COMMERCIAL & SAVINGS BANK LTD	299,000	48.900	14,621,100.000	
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	332,903	71.800	23,902,435.400	
GLOBALWAFERS CO LTD	19,000	345.000	6,555,000.000	
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	15,000	259.000	3,885,000.000	
台湾・ドル 小計	31,100,696		1,803,067,583.880 (6,491,043,302)	

南アフリカ・ランド	BIDVEST GROUP LTD	33,472	210.610	7,049,537.920	
	CLICKS GROUP LTD	22,423	178.500	4,002,505.500	
	TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	45,311	73.500	3,330,358.500	
	DISCOVERY LTD	35,824	143.360	5,135,728.640	
	REDEFINE PROPERTIES LTD	545,811	10.010	5,463,568.110	
	GOLD FIELDS LTD	69,936	55.050	3,849,976.800	
	REMGRO LTD	50,621	193.550	9,797,694.550	
	THE FOSCHINI GROUP LTD	19,873	176.010	3,497,846.730	
	MMI HOLDINGS LTD	80,877	17.390	1,406,451.030	
	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	289,826	24.370	7,063,059.620	
	EXXARO RESOURCES LTD	24,846	172.860	4,294,879.560	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	3,704	1,403.750	5,199,490.000	
	LIBERTY HOLDINGS LTD	11,438	100.610	1,150,777.180	
	MTN GROUP LTD	162,678	93.350	15,185,991.300	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	40,522	191.720	7,768,877.840	
	TELKOM SA SOC LTD	22,080	74.400	1,642,752.000	
	FIRSTRAND LTD	319,517	67.110	21,442,785.870	
	PSG GROUP LTD	14,938	270.000	4,033,260.000	
	NASPERS LTD	41,643	3,601.660	149,983,927.380	
	NEDBANK GROUP LTD	38,761	266.620	10,334,457.820	
	NETCARE LTD	105,465	24.250	2,557,526.250	
	PICK'N PAY STORES LTD	31,255	71.850	2,245,671.750	
	RMB HOLDINGS LTD	61,174	81.040	4,957,540.960	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	5,042	812.540	4,096,826.680	
	SAPPI LTD	53,882	68.260	3,677,985.320	
	SASOL LTD	53,728	467.320	25,108,168.960	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	43,380	169.840	7,367,659.200	
	MR PRICE GROUP LTD	23,411	210.860	4,936,443.460	
	STANDARD BANK GROUP LTD	123,596	194.700	24,064,141.200	
	SPAR GROUP LTD/THE	20,038	201.000	4,027,638.000	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	88,009	47.800	4,206,830.200	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LTD	34,576	99.000	3,423,024.000	
	ABSA GROUP LTD	69,864	161.170	11,259,980.880	
	TIGER BRANDS LTD	15,965	268.410	4,285,165.650	
	SANLAM LTD	171,329	77.530	13,283,137.370	
	INVESTEC LTD	29,537	88.710	2,620,227.270	
	KUMBA IRON ORE LTD	5,327	478.210	2,547,424.670	
	MONDI LTD	10,866	322.640	3,505,806.240	
	LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDINGS LTD	137,182	28.410	3,897,340.620	
	RMI HOLDINGS	55,570	34.750	1,931,057.500	
VODACOM GROUP PTY LTD	62,612	114.470	7,167,195.640		
NEPI ROCKCASTLE PLC	32,983	119.080	3,927,615.640		

	OLD MUTUAL LTD	475,887	23.070	10,978,713.090	
	REINET INVESTMENTS SCA	13,993	237.480	3,323,057.640	
	MULTICHOICE GROUP LTD	40,724	131.100	5,338,916.400	
	FORTRESS REIT LTD-A	102,950	18.760	1,931,342.000	
	BID CORP LTD	32,321	290.500	9,389,250.500	
南アフリカ・ランド 小計		3,774,767		447,689,613.440 (3,577,040,011)	
合計		232,431,812		57,624,376,273 (57,624,376,273)	

(2) 株式以外の有価証券

平成31年4月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
新株予約権証券	タイ・パーツ	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	59,033.000	61,394.320	
	タイ・パーツ 小計		59,033.000	61,394.320 (214,880)	
新株予約権証券 合計			59,033	214,880 (214,880)	
投資信託受益証券	メキシコ・ペソ	CEMEX SAB DE CV	1,485,375.000	13,932,817.500	
		FOMENTO ECONOMICO MEXICANO SAB DE CV	184,400.000	33,300,796.000	
	メキシコ・ペソ 小計		1,669,775.000	47,233,613.500 (278,678,319)	
投資信託受益証券 合計			1,669,775	278,678,319 (278,678,319)	
投資証券	メキシコ・ペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	326,100.000	9,049,275.000	
	メキシコ・ペソ 小計		326,100.000	9,049,275.000 (53,390,723)	
	南アフリカ・ランド	FORTRESS REIT LTD-B	57,784.000	640,824.560	
		HYPROP INVESTMENTS LTD	22,174.000	1,649,967.340	
		RESILIENT REIT LTD	28,600.000	1,641,068.000	
	南アフリカ・ランド 小計		108,558.000	3,931,859.900 (31,415,561)	
投資証券 合計			434,658	84,806,284 (84,806,284)	
合計				363,699,483 (363,699,483)	

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

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入新株 予約権証券 時価比率	組入 投資信託 受益証券 時価比率	組入 投資証券 時価比率	有価証券の 合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	株式 50銘柄	11.92%	-%	-%	-%	12.78%
アラブ首長国連邦・ディ ルハム	株式 9銘柄	0.60%	-%	-%	-%	0.65%
イギリス・ポンド	株式 1銘柄	0.04%	-%	-%	-%	0.05%
インド・ルピー	株式 79銘柄	8.32%	-%	-%	-%	8.92%
インドネシア・ルピア	株式 28銘柄	2.01%	-%	-%	-%	2.16%
オフショア・人民元	株式 73銘柄	0.80%	-%	-%	-%	0.86%
カタール・リアル	株式 10銘柄	0.84%	-%	-%	-%	0.90%
コロンビア・ペソ	株式 9銘柄	0.44%	-%	-%	-%	0.47%
タイ・バーツ	株式 36銘柄 新株予約 権証券 1銘柄	2.14% -%	-% 0.00%	-% -%	-% -%	2.29%
チェコ・コルナ	株式 3銘柄	0.15%	-%	-%	-%	0.16%
チリ・ペソ	株式 17銘柄	0.95%	-%	-%	-%	1.02%
トルコ・リラ	株式 18銘柄	0.50%	-%	-%	-%	0.54%
ハンガリー・フォリント	株式 3銘柄	0.29%	-%	-%	-%	0.31%
パキスタン・ルピー	株式 3銘柄	0.03%	-%	-%	-%	0.03%
フィリピン・ペソ	株式 23銘柄	1.01%	-%	-%	-%	1.08%
ブラジル・レアル	株式 52銘柄	6.67%	-%	-%	-%	7.15%
ポーランド・ズロチ	株式 20銘柄	1.06%	-%	-%	-%	1.14%
マレーシア・リンギット	株式 44銘柄	1.95%	-%	-%	-%	2.10%
メキシコ・ペソ	株式 23銘柄 投資信託 受益証券 2銘柄 投資証券 1銘柄	2.03% -% -%	-% -% -%	-% 0.45% -%	-% -% 0.09%	2.74%
ユーロ	株式 7銘柄	0.21%	-%	-%	-%	0.22%
韓国・ウォン	株式 114銘柄	12.20%	-%	-%	-%	13.08%
香港・ドル	株式 207銘柄	22.31%	-%	-%	-%	23.93%
台湾・ドル	株式 87銘柄	10.44%	-%	-%	-%	11.19%
南アフリカ・ランド	株式 47銘柄 投資証券 3銘柄	5.75% -%	-% -%	-% -%	-% 0.05%	6.22%

(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10月11日現在	平成31年4月11日現在
資産の部			
流動資産			
預金		1,821,744,363	1,267,575,044
コール・ローン		60,384,414	78,711,130
国債証券		98,156,495,828	104,792,128,623
派生商品評価勘定		207,000	-
未収入金		685,349,932	1,262,987,648
未収利息		976,970,470	932,961,344
前払費用		163,768,233	140,688,851
流動資産合計		101,864,920,240	108,475,052,640
資産合計		101,864,920,240	108,475,052,640
負債の部			
流動負債			
未払解約金		69,375,000	58,061,000
流動負債合計		69,375,000	58,061,000
負債合計		69,375,000	58,061,000
純資産の部			
元本等			
元本	1	56,260,738,714	56,823,091,842
剰余金			
剰余金又は欠損金()		45,534,806,526	51,593,899,798
元本等合計		101,795,545,240	108,416,991,640
純資産合計		101,795,545,240	108,416,991,640
負債純資産合計		101,864,920,240	108,475,052,640

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10月11日現在	平成31年4月11日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	61,796,728,209円	56,260,738,714円
同期中追加設定元本額	19,156,141,866円	51,810,226,812円
同期中一部解約元本額	24,692,131,361円	51,247,873,684円
元本の内訳		
ファンド名		
DIAM新興国債券インデックスファンド<為替ヘッジなし>（ファンドラップ）	273,439,997円	246,522,298円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	84,276,405円	182,097,559円
たわらノーロード バランス（堅実型）	4,383,541円	9,238,405円
たわらノーロード バランス（標準型）	13,515,484円	28,280,289円
たわらノーロード バランス（積極型）	8,805,859円	14,124,311円
たわらノーロード 最適化バランス（保守型）	91,216円	223,599円
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	141,118円	646,741円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	819,823円	1,068,168円
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	310,046円	379,183円
たわらノーロード 最適化バランス（積極型）	422,186円	498,417円

マネックス資産設計ファンド エボリューション	58,646,088円	65,812,114円
DIAM DC 8資産バラン スファンド(新興国10)	195,394,626円	196,851,738円
DIAM DC 8資産バラン スファンド(新興国20)	168,433,969円	178,790,603円
DIAM DC 8資産バラン スファンド(新興国30)	335,742,291円	351,300,641円
投資のソムリエ	8,561,194,872円	8,772,909,195円
クルーズコントロール	579,705,357円	962,603,896円
投資のソムリエ<DC年金>	741,598,209円	866,443,655円
DIAM 8資産バランスファ ンドN<DC年金>	136,462,429円	150,180,507円
クルーズコントロール<DC年 金>	335,299円	691,512円
DIAMコア資産設計ファンド (堅実型)	3,640,572円	6,492,266円
DIAMコア資産設計ファンド (積極型)	7,608,735円	14,906,297円
投資のソムリエ<DC年金>リ スク抑制型	193,344,732円	329,284,222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	177,753円	523,034円
ワールドアセットバランス(基 本コース)	3,643,414,698円	5,014,673,512円
ワールドアセットバランス(リ スク抑制コース)	818,794,191円	1,007,730,855円
ワールドアセットバランス(リ スク抑制コース)	3,141,358,276円	3,974,858,758円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2045)	2,174,682円	3,475,708円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2055)	1,585,888円	3,070,777円
リスク抑制世界8資産バラン スファンド(DC)	1,132,324円	2,294,446円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2035)	3,151,566円	5,824,329円
リスクコントロール世界資産分 散ファンド	457,307,222円	698,429,996円
9資産分散投資・スタンダード <DC年金>	13,655円	2,827,272円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2040)	-円	795,968円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2050)	-円	795,968円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2060)	-円	795,968円
エマージング債券リスク抑制型 (適格機関投資家限定)	14,137,760,067円	16,237,609,327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)	2,322,386,202円	1,697,402,859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)	5,142,517,974円	3,157,566,120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)	4,748,815,413円	4,492,294,363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)	3,811,858,365円	3,910,785,285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)	2,928,571,287円	- 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)	3,731,406,297円	4,231,991,681円
	計	56,260,738,714円	56,823,091,842円
2 .	受益権の総数	56,260,738,714口	56,823,091,842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30年4月12日 至 平成30年10月11日	自 平成30年10月12日 至 平成31年4月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成30年10月11日現在	平成31年4月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成30年10月11日現在	平成31年4月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
国債証券	3,294,289,542	3,440,317,596
合計	3,294,289,542	3,440,317,596

(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4月19日から平成30年10月11日まで及び平成30年4月19日から平成31年4月11日まで）に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	平成30年10月11日 現在				平成31年4月11日 現在			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	146,232,000	-	146,025,000	207,000	655,313,000	-	655,313,000	-
アメリカ・ドル	146,232,000	-	146,025,000	207,000	655,313,000	-	655,313,000	-
合計	146,232,000	-	146,025,000	207,000	655,313,000	-	655,313,000	-

(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10月11日現在	平成31年4月11日現在
1口当たり純資産額	1.8094円	1.9080円
(1万口当たり純資産額)	(18,094円)	(19,080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31年4月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	BRAZIL 2.625 01/05/23	7,800,000.000	7,566,000.000	
		BRAZIL 4.25 01/07/25	13,100,000.000	13,299,906.000	
		BRAZIL 4.625 01/13/28	10,800,000.000	10,845,900.000	
		BRAZIL 4.875 01/22/21	13,400,000.000	13,828,800.000	
		BRAZIL 5.0 01/27/45	11,800,000.000	10,760,184.000	
		BRAZIL 5.625 01/07/41	9,100,000.000	9,111,466.000	
		BRAZIL 5.625 02/21/47	9,600,000.000	9,461,952.000	
		BRAZIL 6.0 04/07/26	8,800,000.000	9,737,200.000	
		BRAZIL 7.125 01/20/37	8,300,000.000	9,762,875.000	
		BRAZIL 8.25 01/20/34	5,200,000.000	6,601,920.000	
		BRAZIL 8.75 02/04/25	4,800,000.000	5,946,000.000	
		COLOMBIA 2.625 03/15/23	4,700,000.000	4,597,775.000	
		COLOMBIA 3.875 04/25/27	9,600,000.000	9,688,512.000	
		COLOMBIA 4.0 02/26/24	9,100,000.000	9,361,625.000	
		COLOMBIA 4.375 07/12/21	10,200,000.000	10,503,450.000	
		COLOMBIA 4.5 01/28/26	5,000,000.000	5,256,850.000	
		COLOMBIA 5.0 06/15/45	17,000,000.000	17,748,000.000	
		COLOMBIA 5.625 02/26/44	9,000,000.000	10,116,000.000	
		COLOMBIA 6.125 01/18/41	9,000,000.000	10,575,090.000	
		COLOMBIA 7.375 09/18/37	7,400,000.000	9,655,150.000	
		COLOMBIA 8.125 05/21/24	2,900,000.000	3,511,030.000	
		CROATIA 5.5 04/04/23	9,400,000.000	10,166,570.000	
		CROATIA 6.0 01/26/24	7,400,000.000	8,276,678.000	
		CROATIA 6.375 03/24/21	9,400,000.000	9,921,700.000	
		CROATIA 6.625 07/14/20	12,500,000.000	13,035,000.000	
		HUNGARY 5.375 02/21/23	9,600,000.000	10,369,536.000	
		HUNGARY 5.375 03/25/24	8,600,000.000	9,442,284.000	
		HUNGARY 5.75 11/22/23	10,000,000.000	11,070,200.000	
		HUNGARY 6.375 03/29/21	15,000,000.000	15,982,350.000	
		HUNGARY 7.625 03/29/41	5,400,000.000	8,045,784.000	
		INDONESIA 2.95 01/11/23	3,800,000.000	3,762,912.000	
		INDONESIA 3.375 04/15/23	4,700,000.000	4,708,272.000	
		INDONESIA 3.5 01/11/28	3,200,000.000	3,114,688.000	
		INDONESIA 3.75 04/25/22	8,000,000.000	8,121,280.000	
INDONESIA 3.85 07/18/27	2,600,000.000	2,599,558.000			
INDONESIA 4.1 04/24/28	5,000,000.000	5,069,600.000			
INDONESIA 4.125 01/15/25	11,800,000.000	12,062,078.000			
INDONESIA 4.35 01/08/27	5,000,000.000	5,166,700.000			
INDONESIA 4.35 01/11/48	4,400,000.000	4,314,992.000			
INDONESIA 4.625 04/15/43	5,400,000.000	5,387,310.000			

INDONESIA 4.75 01/08/26	6,800,000.000	7,189,640.000	
INDONESIA 4.875 05/05/21	10,100,000.000	10,465,014.000	
INDONESIA 5.125 01/15/45	6,400,000.000	6,792,256.000	
INDONESIA 5.25 01/08/47	3,400,000.000	3,667,682.000	
INDONESIA 5.25 01/17/42	7,300,000.000	7,869,911.000	
INDONESIA 5.875 01/15/24	6,200,000.000	6,843,374.000	
INDONESIA 5.95 01/08/46	4,200,000.000	4,945,920.000	
INDONESIA 6.75 01/15/44	6,500,000.000	8,306,285.000	
INDONESIA 7.75 01/17/38	6,500,000.000	8,840,130.000	
PANAMA 3.75 03/16/25	8,200,000.000	8,433,782.000	
PANAMA 3.875 03/17/28	6,100,000.000	6,321,186.000	
PANAMA 4.5 04/16/50	8,300,000.000	8,640,549.000	
PANAMA 4.5 05/15/47	5,000,000.000	5,244,800.000	
PANAMA 6.7 01/26/36	9,900,000.000	12,872,970.000	
PANAMA 7.125 01/29/26	4,800,000.000	5,850,000.000	
PANAMA 9.375 04/01/29	4,900,000.000	7,125,090.000	
PERU 4.125 08/25/27	7,300,000.000	7,920,500.000	
PERU 5.625 11/18/50	14,000,000.000	18,048,940.000	
PERU 6.55 03/14/37	6,000,000.000	8,052,000.000	
PERU 7.35 07/21/25	12,300,000.000	15,337,485.000	
PHILIPPINES 3.0 02/01/28	6,000,000.000	5,900,880.000	
PHILIPPINES 3.7 02/02/42	6,400,000.000	6,404,928.000	
PHILIPPINES 3.7 03/01/41	6,600,000.000	6,628,512.000	
PHILIPPINES 3.95 01/20/40	6,800,000.000	7,113,752.000	
PHILIPPINES 4.0 01/15/21	7,400,000.000	7,532,608.000	
PHILIPPINES 4.2 01/21/24	5,800,000.000	6,118,420.000	
PHILIPPINES 5.0 01/13/37	4,800,000.000	5,631,264.000	
PHILIPPINES 5.5 03/30/26	3,600,000.000	4,136,436.000	
PHILIPPINES 6.375 01/15/32	3,600,000.000	4,629,132.000	
PHILIPPINES 6.375 10/23/34	6,000,000.000	7,940,040.000	
PHILIPPINES 7.75 01/14/31	6,100,000.000	8,547,198.000	
PHILIPPINES 9.5 02/02/30	6,400,000.000	9,828,032.000	
ROMANIA 4.375 08/22/23	10,000,000.000	10,372,100.000	
ROMANIA 4.875 01/22/24	6,600,000.000	7,026,096.000	
ROMANIA 5.125 06/15/48	6,600,000.000	6,533,868.000	
ROMANIA 6.125 01/22/44	5,400,000.000	6,161,400.000	
ROMANIA 6.75 02/07/22	13,500,000.000	14,754,825.000	
RUSSIAN FEDERATION 03/31/30	12,300,000.000	13,722,741.000	
RUSSIAN FEDERATION 4.25 06/23/27	9,400,000.000	9,381,670.000	
RUSSIAN FEDERATION 4.375 03/21/29	5,400,000.000	5,388,444.000	
RUSSIAN FEDERATION 4.5 04/04/22	9,800,000.000	10,109,876.000	

RUSSIAN FEDERATION 4.75 05/27/26	10,400,000.000	10,756,512.000	
RUSSIAN FEDERATION 4.875 09/16/23	12,400,000.000	13,051,124.000	
RUSSIAN FEDERATION 5.25 06/23/47	25,000,000.000	25,330,000.000	
RUSSIAN FEDERATION 5.625 04/04/42	10,800,000.000	11,827,080.000	
RUSSIAN FEDERATION 5.875 09/16/43	4,200,000.000	4,738,104.000	
SOUTH AFRICA 4.3 10/12/28	7,200,000.000	6,805,512.000	
SOUTH AFRICA 4.665 01/17/24	6,100,000.000	6,204,920.000	
SOUTH AFRICA 4.875 04/14/26	4,400,000.000	4,404,928.000	
SOUTH AFRICA 5.0 10/12/46	3,800,000.000	3,427,790.000	
SOUTH AFRICA 5.375 07/24/44	3,800,000.000	3,574,356.000	
SOUTH AFRICA 5.65 09/27/47	4,200,000.000	4,045,356.000	
SOUTH AFRICA 5.875 05/30/22	4,000,000.000	4,230,480.000	
SOUTH AFRICA 5.875 06/22/30	5,400,000.000	5,585,544.000	
SOUTH AFRICA 5.875 09/16/25	7,200,000.000	7,658,064.000	
SOUTH AFRICA 6.3 06/22/48	2,000,000.000	2,055,840.000	
UNITED MEXICAN STATES 3.5 01/21/21	6,400,000.000	6,481,728.000	
UNITED MEXICAN STATES 3.6 01/30/25	9,200,000.000	9,177,000.000	
UNITED MEXICAN STATES 3.625 03/15/22	8,900,000.000	9,063,760.000	
UNITED MEXICAN STATES 3.75 01/11/28	9,200,000.000	9,055,100.000	
UNITED MEXICAN STATES 4.0 10/02/23	12,500,000.000	12,890,875.000	
UNITED MEXICAN STATES 4.125 01/21/26	8,000,000.000	8,156,960.000	
UNITED MEXICAN STATES 4.15 03/28/27	12,400,000.000	12,561,200.000	
UNITED MEXICAN STATES 4.35 01/15/47	7,000,000.000	6,503,350.000	
UNITED MEXICAN STATES 4.6 01/23/46	10,000,000.000	9,622,000.000	
UNITED MEXICAN STATES 4.6 02/10/48	8,400,000.000	8,101,128.000	

	UNITED MEXICAN STATES 4.75 03/08/44	15,400,000.000	15,130,500.000	
	UNITED MEXICAN STATES 5.55 01/21/45	10,400,000.000	11,362,520.000	
	UNITED MEXICAN STATES 5.75 10/12/2110	8,800,000.000	8,969,400.000	
	UNITED MEXICAN STATES 6.05 01/11/40	11,900,000.000	13,610,625.000	
	UNITED MEXICAN STATES 6.75 09/27/34	6,200,000.000	7,573,920.000	
	アメリカ・ドル 小計	876,100,000.000 (97,343,471,000)	943,138,589.000 (104,792,128,624)	
国債証券 合計		97,343,471,000 (97,343,471,000)	104,792,128,623 (104,792,128,623)	
合計		97,343,471,000 (97,343,471,000)	104,792,128,623 (104,792,128,623)	

- (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	96.66%	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31年4月26日現在

資産総額	157,098,137円
負債総額	73,517円
純資産総額（ - ）	157,024,620円
発行済数量	149,374,727口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0512円

D I A Mコア資産設計ファンド（積極型）

平成31年4月26日現在

資産総額	310,968,970円
負債総額	145,351円
純資産総額（ - ）	310,823,619円
発行済数量	300,356,262口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0348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31年4月26日現在

資産総額	273,800,965,426円
負債総額	1,891,350,128円
純資産総額（ - ）	271,909,615,298円
発行済数量	107,619,823,886口
1口当たり純資産額（ / ）	2.5266円

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成31年4月26日現在

資産総額	291,213,194,525円
負債総額	1,278,213,000円
純資産総額（ - ）	289,934,981,525円
発行済数量	221,309,020,088口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3101円

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成31年4月26日現在

資産総額	372,641,756,230円
負債総額	1,212,779,482円
純資産総額（ - ）	371,428,976,748円
発行済数量	99,930,993,668口
1口当たり純資産額（ / ）	3.7169円

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成31年4月26日現在

資産総額	193,951,925,155円
負債総額	632,524,966円
純資産総額(-)	193,319,400,189円
発行済数量	105,094,460,953口
1口当たり純資産額(/)	1.8395円

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

平成31年4月26日現在

資産総額	59,604,100,404円
負債総額	63,205,817円
純資産総額(-)	59,540,894,587円
発行済数量	49,566,627,667口
1口当たり純資産額(/)	1.2012円

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

平成31年4月26日現在

資産総額	101,604,993,771円
負債総額	363,494,800円
純資産総額(-)	101,241,498,971円
発行済数量	52,649,584,512口
1口当たり純資産額(/)	1.9229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(2019年4月26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(2019年4月26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。

2019年4月26日現在、委託会社の運用する投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除く）

基本的性格	本数	純資産総額（単位：円）
追加型公社債投資信託	26	1,146,595,911,916
追加型株式投資信託	871	13,561,034,565,287
単位型公社債投資信託	46	176,328,445,456
単位型株式投資信託	161	1,240,583,444,476
合計	1,104	16,124,542,367,135

3【委託会社等の経理状況】

1. 委託会社であるアセットマネジメントOne株式会社(以下「委託会社」という。)の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年8月6日内閣府令第52号)により作成しております。
2. 財務諸表の金額は、千円未満の端数を切り捨てて記載しております。
3. 委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき第34期事業年度(自2018年4月1日至2019年3月31日)の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

	第33期 (2018年3月31日現在)	第34期 (2019年3月31日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金	49,071,217	41,087,475
金銭の信託	12,083,824	18,773,228
有価証券	-	153,518
未収委託者報酬	11,769,015	12,438,085
未収運用受託報酬	4,574,225	3,295,109
未収投資助言報酬	341,689	327,064
未収収益	59,526	56,925
前払費用	569,431	573,874
その他	427,238	491,914
流動資産計	78,896,169	77,197,195
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 1,156,953	1 1,096,916
器具備品	1 476,504	1 364,399
建設仮勘定	10,368	-
無形固定資産		
ソフトウェア	1,026,319	885,545
ソフトウェア仮勘定	904,389	1,522,040
電話加入権	3,931	3,931
電信電話専用施設利用権	60	23
投資その他の資産		
投資有価証券	1,721,433	1,611,931
関係会社株式	3,229,196	4,499,196
長期差入保証金	1,518,725	1,312,328
繰延税金資産	1,699,533	1,748,459
その他	101,425	97,892
固定資産計	11,848,840	13,142,665
資産合計	90,745,010	90,339,861

(単位:千円)

	第33期 (2018年3月31日現在)	第34期 (2019年3月31日現在)
(負債の部)		
流動負債		
預り金	1,003,550	2,183,889
未払金	5,081,728	5,697,942
未払収益分配金	1,031	1,053
未払償還金	57,275	48,968
未払手数料	4,629,133	4,883,723
その他未払金	394,288	764,196
未払費用	7,711,038	6,724,986
未払法人税等	5,153,972	3,341,238
未払消費税等	1,660,259	576,632
賞与引当金	1,393,911	1,344,466
役員賞与引当金	49,986	48,609
本社移転費用引当金	156,587	-
流動負債計	22,211,034	19,917,766
固定負債		
退職給付引当金	1,637,133	1,895,158
時効後支払損引当金	199,026	177,851
固定負債計	1,836,160	2,073,009
負債合計	24,047,195	21,990,776
(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	44,349,855	45,949,372
利益準備金	123,293	123,293
その他利益剰余金	44,226,562	45,826,079
別途積立金	24,580,000	31,680,000
研究開発積立金	300,000	-
運用責任準備積立金	200,000	-
繰越利益剰余金	19,146,562	14,146,079
株主資本計	65,902,812	67,502,329
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	795,002	846,755
評価・換算差額等計	795,002	846,755
純資産合計	66,697,815	68,349,085
負債・純資産合計	90,745,010	90,339,861

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	第33期 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)		第34期 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	
営業収益				
委託者報酬	84,705,447		84,812,585	
運用受託報酬	19,124,427		16,483,356	
投資助言報酬	1,217,672		1,235,553	
その他営業収益	117,586		113,622	
営業収益計		105,165,133		102,645,117
営業費用				
支払手数料	37,242,284		36,100,556	
広告宣伝費	379,873		387,028	
公告費	1,485		375	
調査費	23,944,438		24,389,003	
調査費	10,677,166		9,956,757	
委託調査費	13,267,272		14,432,246	
委託計算費	1,073,938		936,075	
営業雑経費	1,215,963		1,254,114	
通信費	48,704		47,007	
印刷費	947,411		978,185	
協会費	64,331		63,558	
諸会費	22,412		22,877	
支払販売手数料	133,104		142,485	
営業費用計		63,857,984		63,067,153
一般管理費				
給料	11,304,873		10,859,354	
役員報酬	189,022		189,198	
給料・手当	9,565,921		9,098,957	
賞与	1,549,929		1,571,197	
交際費	58,863		60,115	
寄付金	5,150		7,255	
旅費交通費	395,605		361,479	
租税公課	625,498		588,172	
不動産賃借料	1,534,255		1,511,876	
退職給付費用	595,876		521,184	
固定資産減価償却費	1,226,472		590,667	
福利厚生費	49,797		45,292	
修繕費	4,620		16,247	
賞与引当金繰入額	1,393,911		1,344,466	
役員賞与引当金繰入額	49,986		48,609	
機器リース料	148		130	
事務委託費	3,037,804		3,302,806	
事務用消耗品費	144,804		131,074	
器具備品費	5,253		8,112	
諸経費	149,850		188,367	
一般管理費計		20,582,772		19,585,212
営業利益		20,724,376		19,992,752

(単位:千円)

	第33期 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)		第34期 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	
営業外収益				
受取利息		1,430		1,749
受取配当金		74,278		73,517
時効成立分配金・償還金		256		8,582
為替差益		8,530		-
投資信託解約益		236,398		-
投資信託償還益		93,177		-
受取負担金		-		177,066
雑収入		10,306		24,919
時効後支払損引当金戻入額		17,429		19,797
営業外収益計		441,807		305,633
営業外費用				
為替差損		-		17,542
投資信託解約損		4,138		-
投資信託償還損		17,065		-
金銭の信託運用損		99,303		175,164
雑損失		-		5,659
営業外費用計		120,507		198,365
経常利益		21,045,676		20,100,019
特別利益				
固定資産売却益		1		-
投資有価証券売却益		479,323		353,644
関係会社株式売却益	1	1,492,680	1	-
本社移転費用引当金戻入額		138,294		-
その他特別利益		350		-
特別利益計		2,110,649		353,644
特別損失				
固定資産除却損	2	36,992	2	19,121
固定資産売却損		134		-
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		804,083		19,121
税引前当期純利益		22,352,243		20,434,543
法人税、住民税及び事業税		6,951,863		6,386,793
法人税等調整額		249,832		71,767
法人税等合計		6,702,031		6,315,026
当期純利益		15,650,211		14,119,516

(3) 【株主資本等変動計算書】

第33期(自 2017年4月1日 至 2018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

第34期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

(単位:千円)

	株主資本								
	資本金	資本剰余金			利益剰余金				
		資本準備金	その他 資本剰余金	資本剰余金 合計	利益 準備金	その他利益剰余金			
						別途 積立金	研究開発 積立金	運用責 任準備 積立金	繰越利益 剰余金
当期首残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	24,580,000	300,000	200,000	19,146,562
当期変動額									
剰余金の配当									12,520,000
当期純利益									14,119,516
別途積立金の積立						7,100,000			
研究開発積立金の取崩							300,000		
運用責任準備積立金の取崩								200,000	
繰越利益剰余金の取崩									6,600,000
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)									
当期変動額合計	-	-	-	-	-	7,100,000	300,000	200,000	5,000,483
当期末残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	31,680,000	-	-	14,146,079

	株主資本		評価・換算差額等		純資産 合計
	利益剰余金	株主資本 合計	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
	利益剰余金 合計				
当期首残高	44,349,855	65,902,812	795,002	795,002	66,697,815
当期変動額					
剰余金の配当	12,520,000	12,520,000			12,520,000
当期純利益	14,119,516	14,119,516			14,119,516
別途積立金の積立	7,100,000	7,100,000			7,100,000
研究開発積立金の取崩	300,000	300,000			300,000
運用責任準備積立金の取崩	200,000	200,000			200,000
繰越利益剰余金の取崩	6,600,000	6,600,000			6,600,000
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)		-	51,753	51,753	51,753
当期変動額合計	1,599,516	1,599,516	51,753	51,753	1,651,270
当期末残高	45,949,372	67,502,329	846,755	846,755	68,349,085

重要な会計方針

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 子会社株式及び関連会社株式 ：移動平均法による原価法</p> <p>(2) その他有価証券 時価のあるもの：決算日の市場価格等に基づく時価法 （評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定） 時価のないもの：移動平均法による原価法</p>
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
3. 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産 定率法を採用しております。 ただし、2016年4月1日以降に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。</p> <p>(2) 無形固定資産 定額法を採用しております。 なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法を採用しております。</p>
4. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、期末日の直物等為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
5. 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金は、従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当事業年度に見合う分を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金は、役員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当事業年度に見合う分を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金は、従業員の退職給付に備えるため、退職一時金制度について、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき計上しております。</p> <p>退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。</p> <p>数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 過去勤務費用については、その発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を費用処理しております。</p> <p>数理計算上の差異については、各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年または10年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生翌事業年度から費用処理しております。</p> <p>(4) 時効後支払損引当金は、時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。</p> <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。

表示方法の変更

第34期（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

「『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）を当事業年度から適用し、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。

この結果、前事業年度の貸借対照表において、「流動資産」の「繰延税金資産」842,996千円は、「投資その他の資産」の「繰延税金資産」1,699,533千円に含めて表示しております。

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33期 （2018年3月31日現在）	第34期 （2019年3月31日現在）
建物	140,580	229,897
器具備品	847,466	927,688

（損益計算書関係）

1. 関係会社に対する事項

（千円）

	第33期 （自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日）	第34期 （自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日）
関係会社株式売却益	1,492,680	-

2. 固定資産除却損の内訳

（千円）

	第33期 （自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日）	第34期 （自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日）
建物	298	1,550
器具備品	8,217	439
ソフトウェア	28,472	17,130
電話加入権	3	-

（株主資本等変動計算書関係）

第33期（自 2017年4月1日 至 2018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
2017年6月21日 定時株主総会	普通株式	3,200,000	80,000	2017年3月31日	2017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

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
2018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	2018年3月31日	2018年6月21日
	A種種類株式					

第34期（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額（千円）	1株当たり配当額（円）	基準日	効力発生日
2018年6月20日 定時株主総会	普通株式	12,520,000	313,000	2018年3月31日	2018年6月21日
	A種種類株式				

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

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

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

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

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

（2）金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

営業債務である未払手数料は、1年以内の支払期日であります。

（3）金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

（4）金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。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33期(2018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	-

第34期(2019年3月31日現在)

	貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1) 現金・預金	41,087,475	41,087,475	-
(2) 金銭の信託	18,773,228	18,773,228	-
(3) 未収委託者報酬	12,438,085	12,438,085	-
(4) 未収運用受託報酬	3,295,109	3,295,109	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	1,488,684	1,488,684	-
資産計	77,082,582	77,082,582	-
(1) 未払手数料	4,883,723	4,883,723	-
負債計	4,883,723	4,883,723	-

(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33期 (2018年3月31日現在)	第34期 (2019年3月31日現在)
非上場株式	272,464	276,764
関係会社株式	3,229,196	4,499,196

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

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

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第33期(2018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	-	-

第34期(2019年3月31日現在)

	1年以内 (千円)	1年超5年以内 (千円)	5年超10年以内 (千円)	10年超 (千円)
(1) 現金・預金	41,087,475	-	-	-
(2) 金銭の信託	18,773,228	-	-	-
(3) 未収委託者報酬	12,438,085	-	-	-
(4) 未収運用受託報酬	3,295,109	-	-	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券(投資信託)	153,518	1,995	996	-

(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33期の貸借対照表計上額3,229,196千円、第34期の貸借対照表計上額4,499,196千円)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33期（2018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。

第34期（2019年3月31日現在）

（千円）

区分	貸借対照表日における 貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの			
株式	1,326,372	111,223	1,215,148
投資信託	158,321	153,000	5,321
小計	1,484,694	264,223	1,220,470
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
株式	-	-	-
投資信託	3,990	4,000	9
小計	3,990	4,000	9
合計	1,488,684	268,223	1,220,460

（注）非上場株式（貸借対照表計上額276,674千円）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33期（自 2017年4月1日 至 2018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。

第34期(自2018年4月1日至2019年3月31日)

区分	売却額 (千円)	売却益の合計額 (千円)	売却損の合計額 (千円)
株式	394,222	353,644	-
投資信託	-	-	-

(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2017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33期 (自2017年4月1日 至2018年3月31日)	第34期 (自2018年4月1日 至2019年3月31日)
退職給付債務の期首残高	2,718,372	2,154,607
勤務費用	269,128	300,245
利息費用	7,523	1,918
数理計算上の差異の発生額	61,792	10,147
退職給付の支払額	111,758	158,018
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	-
その他	-	438
退職給付債務の期末残高	2,154,607	2,289,044

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

(千円)

	第33期 (自2017年4月1日 至2018年3月31日)	第34期 (自2018年4月1日 至2019年3月31日)
年金資産の期首残高	1,363,437	-
期待運用収益	17,042	-
事業主からの拠出額	36,672	-
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	-	-

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

(千円)

	第33期 (2018年3月31日現在)	第34期 (2019年3月31日現在)
非積立型制度の退職給付債務	2,154,607	2,289,044
未積立退職給付債務	2,154,607	2,289,044
未認識数理計算上の差異	204,636	150,568
未認識過去勤務費用	312,836	243,317
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	1,637,133	1,895,158
退職給付引当金	1,637,133	1,895,158
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	1,637,133	1,895,158

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(千円)

	第33期 (自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日)	第34期 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)
勤務費用	269,128	300,245
利息費用	7,523	1,918
期待運用収益	17,042	-
数理計算上の差異の費用処理額	88,417	43,920
過去勤務費用の費用処理額	39,611	69,519
退職一時金制度改定に伴う費用処理額	70,560	-
その他	1,620	3,640
確定給付制度に係る退職給付費用	456,577	411,963
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) 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33期 (2018年3月31日現在)	第34期 (2019年3月31日現在)
割引率	0.09%	0.09%
予想昇給率	1.00% ~ 4.42%	1.00% ~ 4.42%

3. 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33期 (自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日)	第34期 (自 2018年4月 1日 至 2019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	53,156	-
制度への拠出額	35,640	-
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	-	-

(2) 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 53,156千円 当事業年度 - 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86,141千円、当事業年度104,720千円であります。

(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33期	第34期
	(2018年3月31日現在)	(2019年3月31日現在)
	(千円)	(千円)
繰延税金資産		
未払事業税	290,493	173,805
未払事業所税	11,683	10,915
賞与引当金	426,815	411,675
未払法定福利費	81,186	80,253
未払給与	9,186	7,961
受取負担金	-	138,994
運用受託報酬	-	102,490
資産除去債務	90,524	10,152
減価償却超過額(一括償却資産)	11,331	4,569
減価償却超過額	176,791	125,839
繰延資産償却超過額(税法上)	34,977	135,542
退職給付引当金	501,290	580,297
時効後支払損引当金	60,941	54,458
ゴルフ会員権評価損	13,173	7,360
関係会社株式評価損	166,740	166,740
投資有価証券評価損	28,976	28,976
本社移転費用引当金	47,947	-
その他	29,193	29,494
繰延税金資産小計	1,981,254	2,069,527
評価性引当額	-	-
繰延税金資産合計	1,981,254	2,069,527
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	281,720	321,067
繰延税金負債合計	281,720	321,067
繰延税金資産の純額	1,699,533	1,748,459

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

(企業結合等関係)

当社(以下「AMOne」という)は、2016年7月13日付で締結した、DIAMアセットマネジメント株式会社(以下「DIAM」という)、みずほ投信投資顧問株式会社(以下「MHAM」という)、みずほ信託銀行株式会社(以下「TB」という)及び新光投信株式会社(以下「新光投信」という)(以下総称して「統合4社」という)間の「統合契約書」に基づき、2016年10月1日付で統合いたしました。

1. 結合当事企業

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

2. 企業結合日

2016年10月1日

3. 企業結合の方法

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

4. 結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

5. 企業結合の主な目的

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

6. 合併比率

「3. 企業結合の方法」の吸収合併における合併比率は以下の通りであります。

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

(*) 普通株式と種類株式を合算して算定しております。

7. 交付した株式数

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

8. 経済的持分比率（議決権比率）

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

MHFGが企業結合日に追加取得した当社に対する経済的持分比率 20.00%

MHFGの追加取得後の当社に対する経済的持分比率 70.00%

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

9. 取得企業を決定するに至った主な根拠

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

10. 会計処理

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

11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

(1) 被取得企業の取得原価及びその内訳

取得の対価 MHAMの普通株式 144,212,500千円

取得原価 144,212,500千円

(2) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

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

(3) 企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

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

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

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

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

12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

(1) 貸借対照表項目

	第33期 (2018年3月31日現在)	第34期 (2019年3月31日現在)
流動資産	- 千円	- 千円
固定資産	114,270,495千円	104,326,078千円
資産合計	114,270,495千円	104,326,078千円
流動負債	- 千円	- 千円
固定負債	13,059,836千円	10,571,428千円
負債合計	13,059,836千円	10,571,428千円
純資産	101,210,659千円	93,754,650千円

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

のれん	70,507,975千円	66,696,733千円
顧客関連資産	45,200,838千円	39,959,586千円

(2) 損益計算書項目

	第33期 (自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日)	第34期 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)
営業収益	- 千円	- 千円
営業利益	9,012,128千円	9,043,138千円
経常利益	9,012,128千円	9,043,138千円
税引前当期純利益	9,012,128千円	9,091,728千円
当期純利益	7,419,617千円	7,489,721千円
1株当たり当期純利益	185,490円43銭	187,243円04銭

(注) 営業利益には、のれん及び顧客関連資産の償却額が含まれております。

のれんの償却額	3,811,241千円	3,811,241千円
顧客関連資産の償却額	5,233,360千円	5,241,252千円

(資産除去債務関係)

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

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

(セグメント情報等)

1. セグメント情報

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

第33期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)及び第34期(自 2018年4月1日 至 2019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33期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

該当はありません。

第34期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

該当はありません。

(2) 子会社及び関連会社等

第33期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

該当はありません。

第34期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

該当はありません。

(3) 兄弟会社等

第33期(自 2017年4月1日 至 2018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

第34期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は 出資金	事業の 内容又 は職業	議決権 等の所 有(被 所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員の 兼任等	事業上 の関係				
親会社 の子会社	株式会社 みずほ銀行	東京都 千代田 区	14,040 億円	銀行業	-	-	当社設定 投資信託 の販売	投資信託の 販売代行手 数料	6,048,352	未払 手数料	915,980
								子会社株式 の取得	1,270,000	-	-
	みずほ証 券株式会 社	東京都 千代田 区	1,251 億円	証券業	-	-	当社設定 投資信託 の販売	投資信託の 販売代行手 数料	10,215,017	未払 手数料	1,670,194

取引条件及び取引条件の決定方針等

- (注1) 投資信託の販売代行手数料は、一般的取引条件を勘案した個別契約により決定しております。
- (注2) 子会社株式の取得は、独立した第三者機関により算定された価格を基礎として協議の上、合理的に決定しております。
- (注3) 上記の取引金額には消費税等が含まれておりません。期末残高には、消費税等が含まれております。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

株式会社みずほフィナンシャルグループ
(東京証券取引所及びニューヨーク証券取引所に上場)

(2) 重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません。

(1株当たり情報)

	第33期 (自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日)	第34期 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)
1株当たり純資産額	1,667,445円37銭	1,708,727円13銭
1株当たり当期純利益金額	391,255円29銭	352,987円92銭

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

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

	第33期 (自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日)	第34期 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)
当期純利益金額	15,650,211千円	14,119,516千円
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	15,650,211千円	14,119,516千円
普通株式及び普通株式と同等の株式の期中平均株式数	40,000株	40,000株
(うち普通株式)	(24,490株)	(24,490株)
(うちA種種類株式)	(15,510株)	(15,510株)

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

4【利害関係人との取引制限】

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

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

(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

2019年3月末日現在 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

2019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

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2018年4月1日から2019年3月31日までの第34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2019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

令和1年5月31日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 丘本 正彦 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10月12日から平成31年4月11日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DIAMコア資産設計ファンド（堅実型）の平成31年4月11日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

令和1年5月31日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 丘本 正彦 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10月12日から平成31年4月11日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DIAMコア資産設計ファンド（積極型）の平成31年4月11日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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。