

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2020年7月13日提出
【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】	酒井 隆
【電話番号】	03-6774-5100
【届出の対象とした募集（売出）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（売出）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、3.3%（税抜3.00%）を上限に各販売会社が定める手数料率を乗じて得た額とします。

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

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

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

(6) 【申込単位】

各販売会社が定める単位とします。

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

取扱コースおよびお申込単位は、販売会社にお問い合わせください。

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

当初元本は1口当たり1円です。

(7) 【申込期間】

継続申込期間：2020年7月14日から2021年1月12日まで

取得またはスイッチングの申込日が、ニューヨーク証券取引所、ロンドン証券取引所、フランクフルト証券取引所、ニューヨークの銀行、ロンドンの銀行のいずれかの休業日に該当する日（以下、「海外休業日」という場合があります。）には、取得またはスイッチングのお申込みの受付を行いません。

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

(8) 【申込取扱場所】

ファンドのお申込みにかかる取扱い等は販売会社が行います。

販売会社は、以下の方法でご確認ください。

- ・ 委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

(9) 【払込期日】

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

(1 0) 【払込取扱場所】

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

・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

(1 1) 【振替機関に関する事項】

ファンドの受益権にかかる振替機関は以下の通りです。

株式会社証券保管振替機構

(1 2) 【その他】

お申込みの際は、販売会社所定の方法でお申込みください。

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

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

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

ただし、海外休業日には取得またはスイッチングのお申込みの受付は行いません。

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

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

なお、販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引き換えに、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録を行うことができます。委託会社は、分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとします。振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場

合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行います。受託会社は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権にかかる信託を設定した旨の通知を行います。

<スイッチング>

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

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

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

振替受益権について

ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、上記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関の振替業にかかる業務規程等の規則にしたがって取り扱われるものとします。

ファンドの収益分配金、償還金、解約代金は、社振法および上記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関の業務規程その他の規則にしたがって支払われます。

(参考)

投資信託振替制度

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

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

各ファンドは、信託財産の成長を図ることを目的として、運用を行います。

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

<ファンドの特色>

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

- 主として、日本、先進国および新興国の債券・株式にマザーファンドを通じて実質的に投資します。マザーファンドのほか、有価証券指数等先物取引等、上場投資信託証券(ETF)、短期金融資産等へ投資する場合があります。
- 実質的な組入外貨建資産に対しては、原則として、対円での為替ヘッジを行いません。
- 6資産の配分比率(以下、基本配分比率とします。)は、統計的手法により、原則として年1回見直すこととします。経済環境、運用環境の大きな変化などにより委託会社が必要と判断した場合には、適宜、基本配分比率の見直しを行うことがあります。

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

- 資産価値上昇時には値上がり益の獲得をめざし、資産価値下落時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。

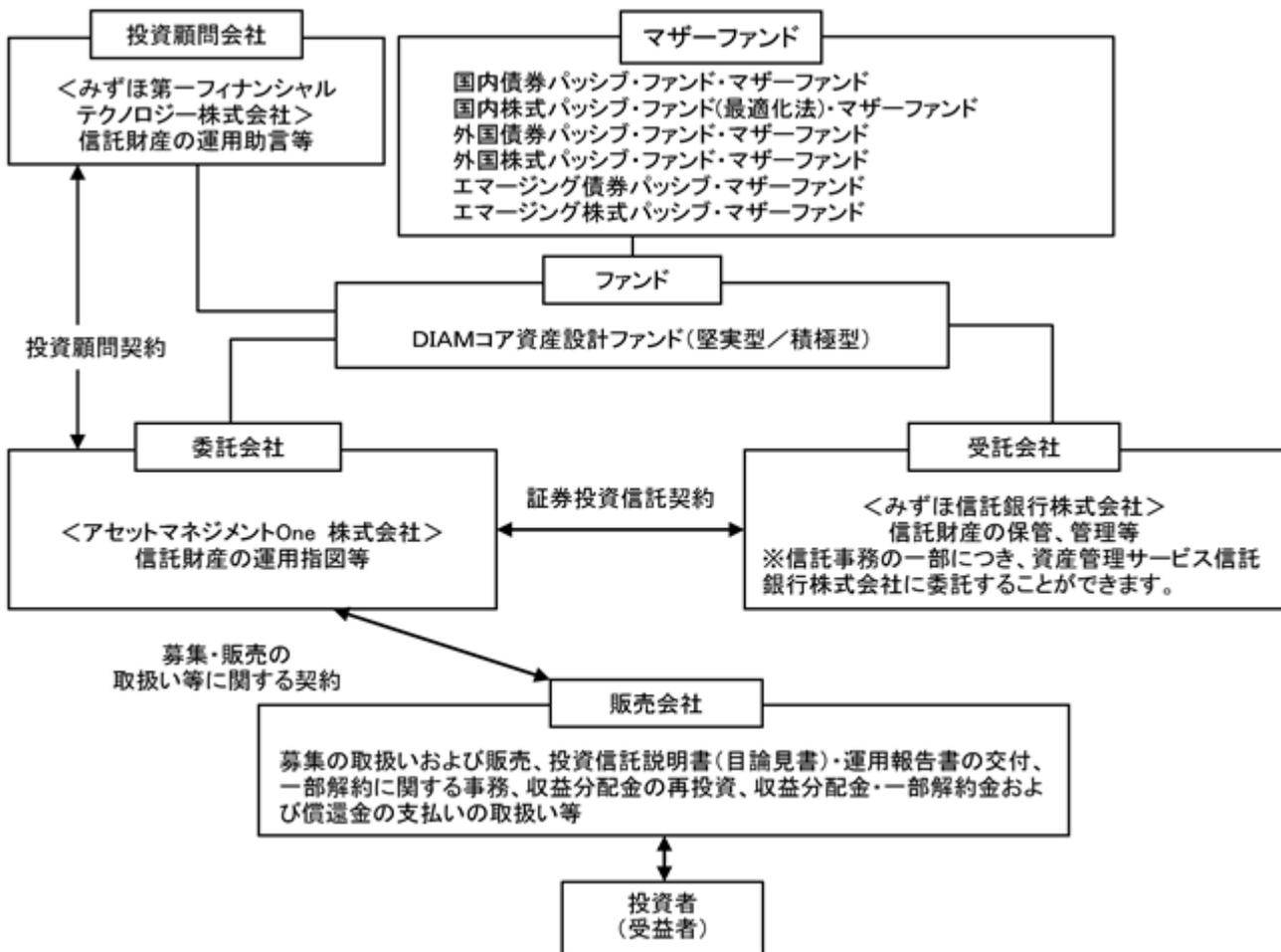
上記の分類は、一般社団法人投資信託協会の商品分類に関する指針に基づき記載しております。

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。

資産管理サービス信託銀行株式会社は、関係当局の許認可等を前提に、2020年7月27日付でJTCホールディングス株式会社および日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社と合併し、株式会社日本カストディ銀行に商号を変更する予定です。

- ・「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。

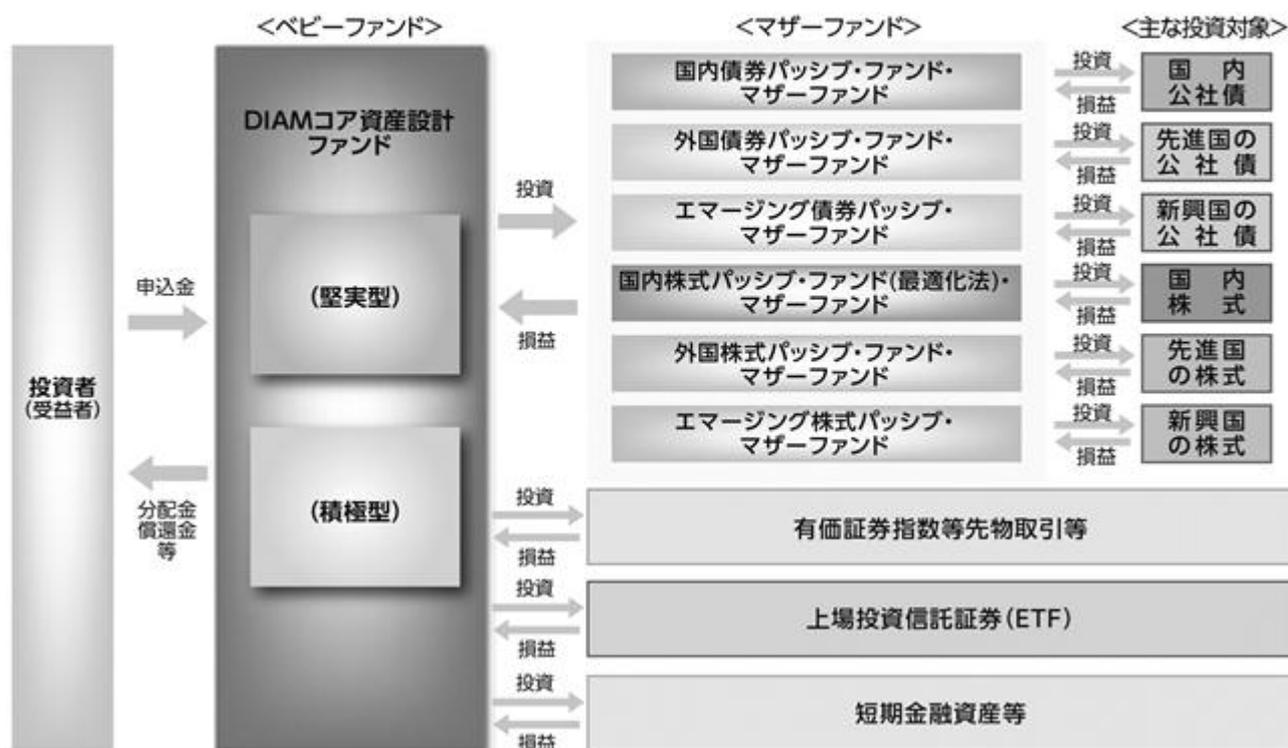
- ・「投資顧問契約」の概要

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（2020年4月30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

（2020年4月30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

ブ・ファンド・マザーファンド、外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド、エマージング債券パッシブ・マザーファンド、エマージング株式パッシブ・マザーファンドの各受益証券のほか次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することを指図します。

1. 株券または新株引受権証書
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券(新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。))の新株引受権証券を除きます。なお、社債券のうち、新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの、ならびに会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を総称して以下「転換社債型新株予約権付社債」といいます。)
6. 資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
7. 投資法人債券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいい、振替投資法人債を含みます。)
8. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券(金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。)
9. 協同組織金融機関の優先出資に関する法律に規定する優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。)
10. 資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券(金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。)
11. コマーシャル・ペーパー
12. 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。)、新株予約権証券および新投資口予約権証券
13. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、1.~12.の証券または証書の性質を有するもの
14. 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいい、振替受益権を含みます。)
15. 投資証券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
16. 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
17. オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限りません。)
18. 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
19. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
20. 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限りません。)

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

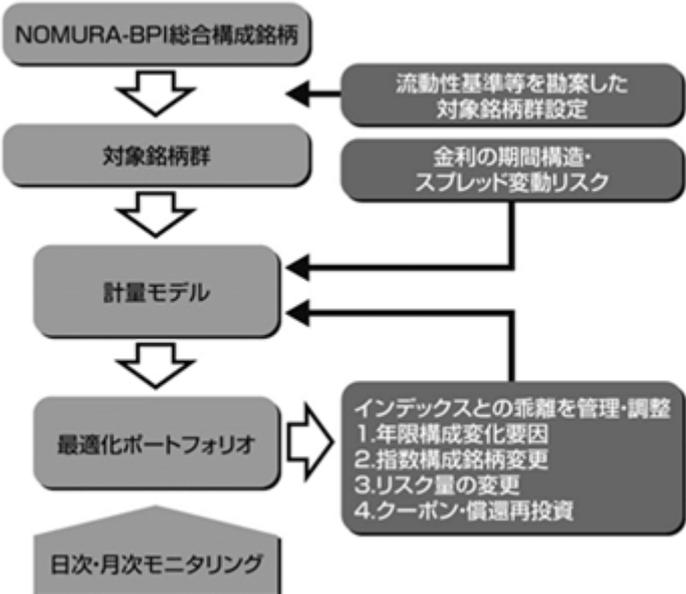
なお、1.の証券または証書、13.および18.の証券または証書のうち1.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、2.から7.までの証券ならびに13.および18.の証券または証書のうち2.から7.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、14.の証券および15.の証券を以下「投資信託証券」といいます。

運用の指図範囲等(約款第17条第2項)

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

1. 預金
2. 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
6. 外国の者に対する権利で5.の権利の性質を有するもの

（参考）各ファンドが投資対象とするマザーファンドの概要

ファンド名	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、NOMURA - B P I 総合に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主な投資対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	<p>1.主としてわが国の公社債に投資し、「NOMURA - B P I 総合」 に連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>2.公社債（債券先物取引等を含みます。）の組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</p> <p>3.公社債の組入比率の調整には、債券先物取引等を活用する場合があります。</p>
	<p>NOMURA - B P I 総合の知的財産権その他一切の権利は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。</p>
運用プロセス	<p>1.流動性基準等による対象銘柄群設定 NOMURA - B P I 総合構成銘柄のうち、流動性基準等を勘案して投資対象銘柄群を設定します。</p> <p>2.最適化法によるポートフォリオの構築 1) 債券種別・格付けから発生するベンチマーク乖離要因 2) 金利の期間構造、スプレッドの期間構造から発生するベンチマーク乖離要因 1)、2) が最小になると判断されるポートフォリオを構築します。</p> <p>3.インデックスとの乖離を管理 日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。 インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。 ・年限構成変化要因 ・指数構成銘柄変更 ・リスク量の変更 ・クーポン、償還再投資</p>  <p>日次・月次モニタリング</p>

主な投資制限	<ol style="list-style-type: none"> 1. 株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限りします。 2. 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 3. 同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 4. 同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 5. 外貨建資産への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 6. デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます。)は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 7. 外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。 8. 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
--------	---

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

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

運用プロセス

1.流動性基準による対象銘柄群設定

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

2.最適化法によるポートフォリオの構築

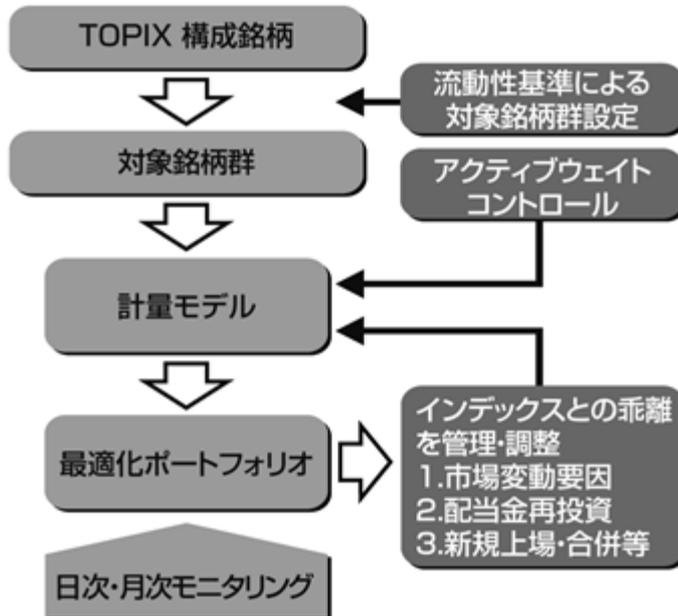
インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差(アクティブウェイト)を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。

3.インデックスとの乖離を管理

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

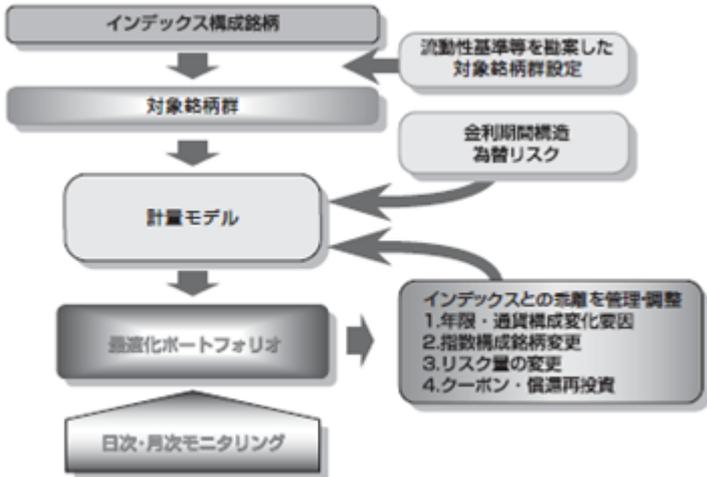
インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。

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



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

<p>ファンド名</p>	<p>外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド</p>
<p>基本方針</p>	<p>この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。</p>
<p>主な投資対象</p>	<p>海外の公社債を主要投資対象とします。</p>
<p>投資態度</p>	<ol style="list-style-type: none"> 1. 主に日本を除く世界主要国の公社債に投資し、「FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）」に連動する投資成果をめざして運用を行います。 2. 外国債券への投資は原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。 3. 外貨建資産については原則為替ヘッジは行いませんが、金利・為替状況によってはヘッジを実施する可能性があります。 <div style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin-top: 10px;"> <p>FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。</p> <p>このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。</p> </div>

運用プロセス	<p>1.流動性基準等による対象銘柄群設定 FTSE世界国債インデックス構成銘柄のうち、流動性基準等を勘案して投資対象銘柄群を設定します。</p> <p>2.最適化法によるポートフォリオの構築 金利の期間構造、通貨エクスポージャーから発生するベンチマーク乖離要因が最小となるポートフォリオを構築します。</p> <p>3.インデックスとの乖離を管理 日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理して、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。 インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・ 年限・通貨構成変化要因 ・ 指数構成銘柄変更 ・ リスク量の変更 ・ クーポン・償還再投資 
主な投資制限	<p>1. 株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限りします。 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>2. 同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>3. 同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>4. 外貨建資産への投資には、制限を設けません。</p> <p>5. デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</p> <p>6. 外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。</p> <p>7. 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>

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

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

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

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

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

事前にMSCIの書面による承認を得ることなくMSCIとの関係を主張することはできません。

運用プロセス

1.流動性基準による対象銘柄群設定

取引コスト、マーケットインパクトの低減を図る為、MSCIコクサイ・インデックス構成銘柄のうち、流動性が著しく低くかつ時価総額比率が小さい銘柄を除外して投資銘柄群を設定します。

2.最適化法によるポートフォリオの構築

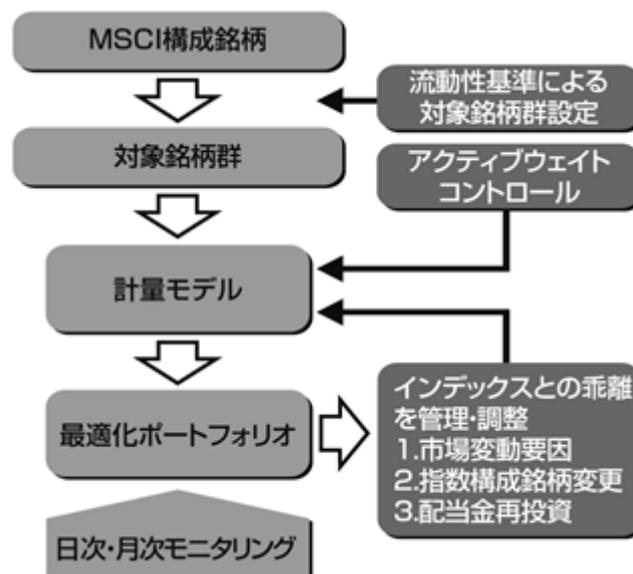
インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差(アクティブウェイト)を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。

3.インデックスとの乖離を管理

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

インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。

- ・市場変動に伴うもの：推定トラッキングエラーの増加に伴い実施
- ・ベンチマーク構成銘柄の変更に伴うもの：四半期に一度の銘柄入替、コーポレートアクションおよび指数構築手法の変更に伴い実施
- ・配当金再投資に伴うもの：キャッシュ比率の上昇に伴い実施



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

ファンド名	エマージング債券パッシブ・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、主として新興国の債券に投資し、JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス(円換算ベース・為替ヘッジなし)の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。
主な投資対象	新興国の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	<ol style="list-style-type: none"> 1. 主として新興国の債券に投資し、JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス(円換算ベース・為替ヘッジなし)の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。 2. 原則として、新興国の債券の組入比率は高位を維持します。 3. 組入債券は、当初組入時において、S&PもしくはMoody'sの外貨建て長期格付がBB-格もしくはBa3格以上を取得している債券とします。但し、両社が格付を付与している場合には、どちらか低い方の格付を基準とします。また、当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>

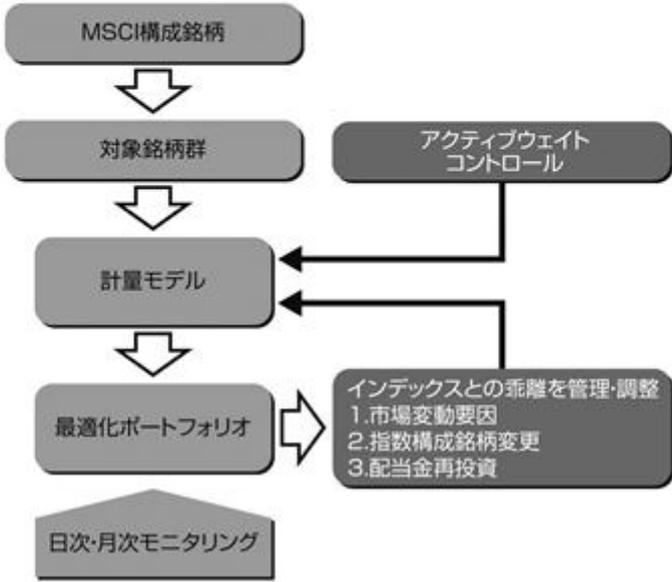
<p>運用プロセス</p>	<p>信用格付基準等を勘案した投資対象銘柄群を設定し、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。</p>
<p>主な投資制限</p>	<ol style="list-style-type: none"> 1. 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 2. 外貨建資産への投資には、制限を設けません。 3. 投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 4. デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものを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

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

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

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

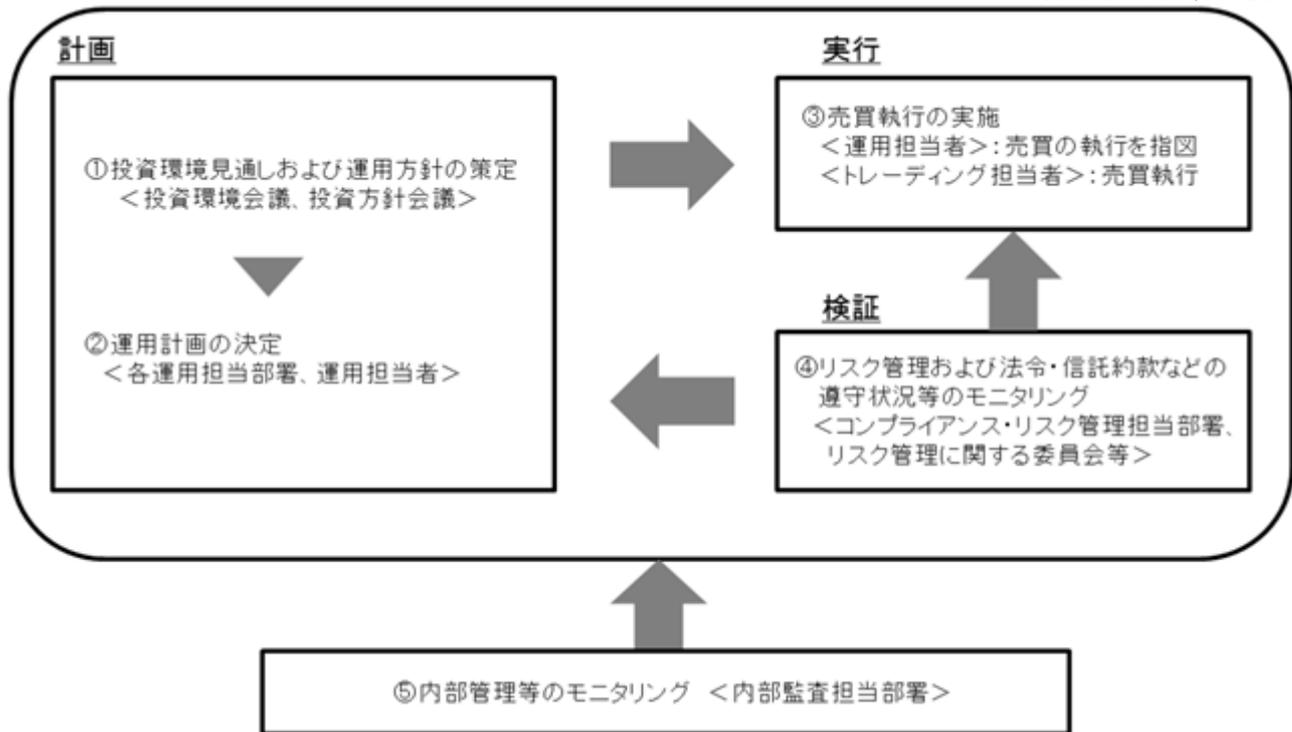
MSCIは、自らが信頼できると考える情報源からMSCI指数の計算に算入または使用するための情報を入手しますが、いかなるMSCI関係者も、MSCI指数またはそれに含まれるデータの独創性、正確性および/または完全性について保証するものではありません。いかなるMSCI関係者も、明示的か黙示的かを問わず、本ファンドの発行会社もしくは所有者、またはその他の者もしくは団体が、MSCI指数またはそれに含まれるデータを使用することにより得られる結果について保証を行いません。いかなるMSCI関係者も、MSCI指数またはそれに含まれるデータの、またはそれらに関連する過誤、脱漏または中断について責任を負いません。ま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

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

資金動向、市況動向等によっては、上記の運用ができない場合があります。

（3）【運用体制】

a. ファンドの運用体制



投資環境見通しおよび運用方針の策定

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

運用計画の決定

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

売買執行の実施

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

モニタリング

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

定期的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2020年4月30日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

上記体制は、マザーファンドを通じた実質的な運用体制を記載しております。

(4) 【分配方針】

収益分配方針

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

(1) 分配対象額の範囲

経費控除後の配当等収益および売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。

(2) 分配対象額についての分配方針

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

(3) 留保益の運用方針

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

収益の分配方式

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

- 1) 信託財産に属する配当等収益(配当金、利子、貸付有価証券にかかる品貸料およびこれ等に類する収益から支払利息を控除した額をいいます。以下同じ。)とマザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち信託財産に属するとみなした額(以下「みなし配当等収益」といいます。)との合計額から、諸経費、監査費用および当該監査費用にかかる消費税および地方消費税(以下「消費税等」といいます。)に相当する金額、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除した後、その残金を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。
 - 2) 売買損益に評価損益を加減した額からみなし配当等収益を控除して得た利益金額(以下「売買益」といいます。)は、諸経費、監査費用および当該監査費用にかかる消費税等に相当する金額、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のある時はその全額を売買益をもって補填した後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。
- (2) 上記(1)の1)および2)におけるみなし配当等収益とは、マザーファンドの信託財産にかかる配当等収益の額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- (3) 毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

収益分配金の支払い

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

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

(5) 【投資制限】

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

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

マザーファンド受益証券以外の投資信託証券(上場投資信託証券(金融商品取引所に上場等され、かつ当該取引所において常時売却可能(市場急変等により一時的に流動性が低下している場合を除きます。))な投資信託証券をいいます。)を除きます。)への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。(約款「運用の基本方針」2. 運用方法 (3) 投資制限)

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

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

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

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

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

投資する株式等の範囲(約款第20条)

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

信用取引の指図範囲(約款第21条)

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

先物取引等の運用指図(約款第22条)

- 1)委託会社は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。)ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします(以下同じ。)

- 1.先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする有価証券(以下「ヘッジ対象有価証券」といいます。)の時価総額とマザーファンドの信託財産に属するヘッジ対象有価証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額(信

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

2. 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象有価証券の組入可能額(信託財産の組入ヘッジ対象有価証券およびマザーファンドの組入ヘッジ対象有価証券のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める組入ヘッジ対象有価証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。)を差し引いた額)に信託財産が限月までに受取る組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券および組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金とマザーファンドが限月までに受取る組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券および組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券および組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金の割合を乗じて得た額をいいます。)を加えた額を限度とし、かつ信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに上記(2)投資対象 運用の指図範囲等の1.~4.に掲げる金融商品で運用している額(以下「金融商品運用額」といいます。)とマザーファンドが限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに金融商品運用額のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占めるマザーファンドが限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに金融商品運用額の割合を乗じて得た額をいいます。)の合計額の範囲内とします。
3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、 で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

2)委託会社は、信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。

1. 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の売予約と合せてヘッジ対象とする外貨建資産の時価総額とマザーファンドの信託財産に属するヘッジ対象とする外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占めるヘッジ対象とする外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。)との合計額の範囲内とします。
2. 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の買予約と合せて、外貨建有価証券とマザーファンドの信託財産に属する外貨建有価証券のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める外貨建有価証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。)を加えた額の買付代金等実需の範囲内とします。
3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点の保有外貨建資産の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

3)委託会社は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。

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

スワップ取引の運用指図(約款第23条)

- 1)委託会社は、信託財産に属する資産の価格変動リスクや為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利、または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行うことの指図をすることができます。
- 2)スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 3)スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。以下3)において同

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

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

金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図(約款第24条)

- 1)委託会社は、信託財産に属する資産の価格変動リスクや為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。
- 2)金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 3)金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(「金利先渡取引の想定元本の合計額」といいます。以下3)において同じ。)が、信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額とマザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(「ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額」といいます。以下3)において同じ。)を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額が減少して、金利先渡取引の想定元本の総額がヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかにその超える額に相当する金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
- 4)上記3)においてマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- 5)為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(「為替先渡取引の想定元本の合計額」といいます。以下5)において同じ。)が、信託財産にかかるヘッジ対象とする外貨建資産(「ヘッジ対象外貨建資産」といいます。以下5)において同じ。)の時価総額とマザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(「ヘッジ対象外貨建資産

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

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

7)金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。

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

デリバティブ取引等にかかる投資制限(約款第25条)

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

有価証券の貸付の指図および範囲(約款第26条)

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

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

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

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

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

特別な場合の外貨建有価証券への投資制限(約款第27条)

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

外国為替予約取引の指図(約款第28条)

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

2)上記1)の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約とマザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約のうち信託財産に属するとみなした額との合計額と、信託財産にかかる売予約とマザーファンドの信託財産にかかる為替の売予約のうち信託財産に属するとみなした額との合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産(マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に

属するとみなした額を含みます。)の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。

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

資金の借入れ(約款第34条)

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

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

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

3【投資リスク】

<基準価額の主な変動要因>

各ファンドは、値動きのある有価証券等(外貨建資産には為替変動リスクもあります。)に投資しますので、ファンドの基準価額は変動します。これらの運用による損益はすべて投資者のみなさまに帰属します。したがって、投資者のみなさまの投資元本は保証されているものではなく、基

準価額の下落により、損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

また、投資信託は預貯金と異なります。

・資産配分リスク

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。

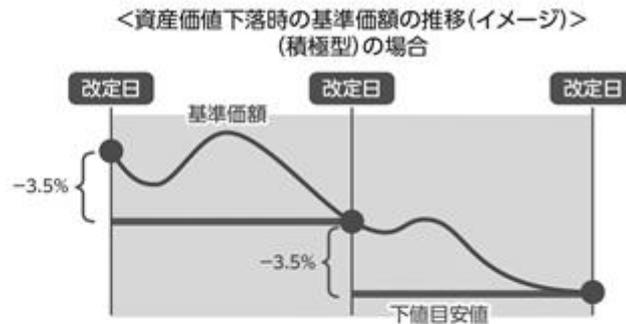
各ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行います。そのため、各ファンドが投資対象とするマザーファンドを投資対象とする他のベビーファンドに追加設定・解約等があった場合、資金変動等が起こり、その結果、当該マザーファンドにおいて売買等が生じた場合等には、各ファンドの基準価額に影響をおよぼす場合があります。

（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。

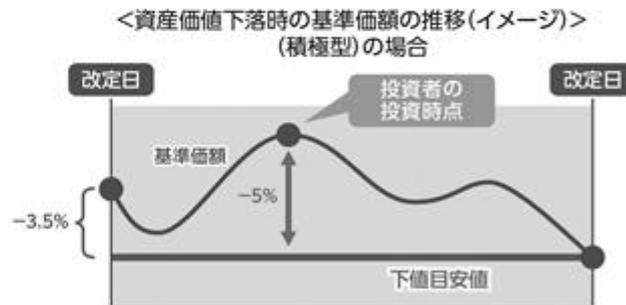
ケース① 下値目安値の切下げについて

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。

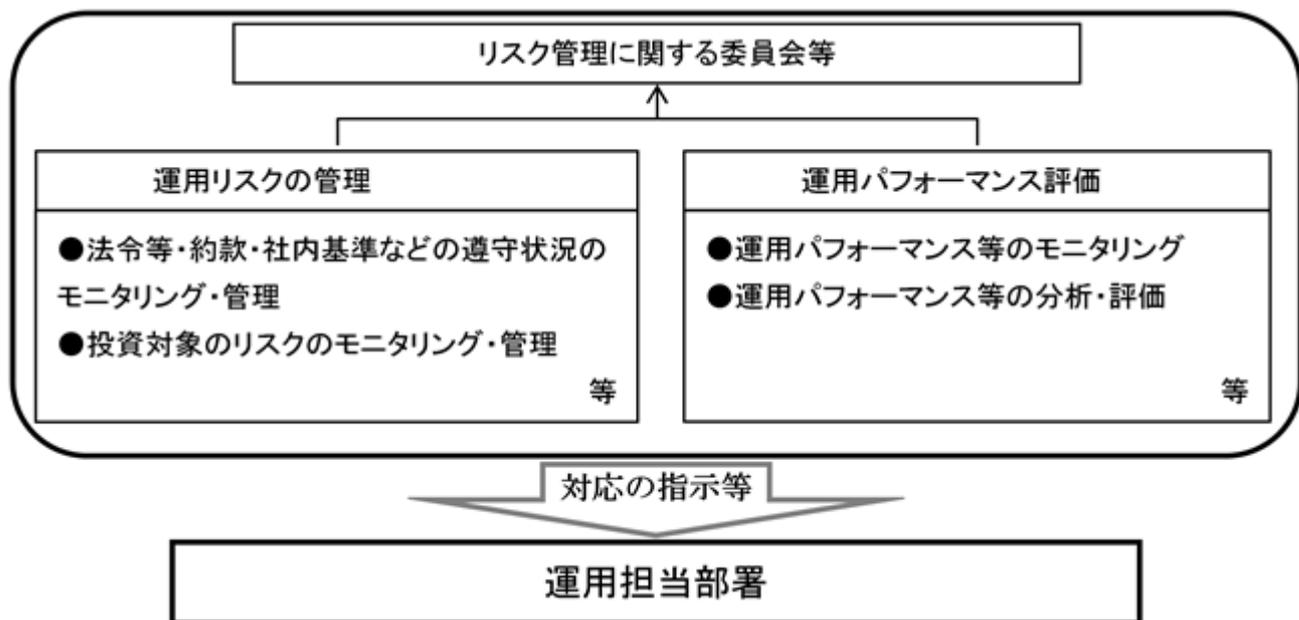
注意事項

- 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2020年4月30日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

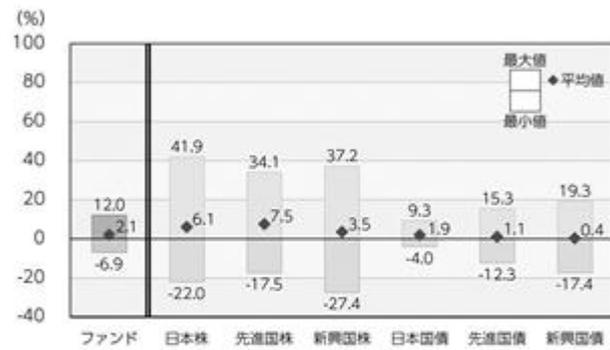
<参考情報>

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)

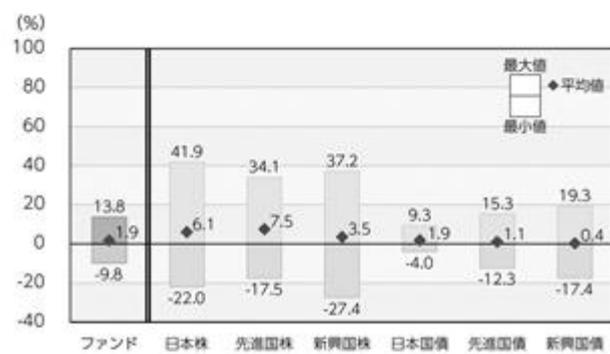


ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



ファンド:2016年8月～2020年4月
代表的な資産クラス:2015年5月～2020年4月

(積極型)



ファンド:2016年8月～2020年4月
代表的な資産クラス:2015年5月～2020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 (東東京証券取引所) の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、東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・ディバーシファイド (円ベース)	[JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイド]は、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが公表している新興国の現地通貨建ての国債で構成されている時価総額加重平均指数です。同指数に関する著作権等の知的財産その他一切の権利はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。また、同社は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

(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、3.3%（税抜3.00%）を上限に各販売会社が定める手数料率を乗じて得た額とします。

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

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

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

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

(2)【換金（解約）手数料】

ありません。

(3)【信託報酬等】

各ファンドの日々の純資産総額に対して年率1.155%（税抜1.05%）

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

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率

信託報酬は、毎日計上（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。

外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。

上記は、2020年4月末現在のものです。税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。

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

個別元本方式について

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

< 個別元本について >

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

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

ただし、同一ファンドの受益権を複数の販売会社で取得する場合には販売会社毎に個別元本の算出が行われます。また、同一販売会社であっても複数支店等で同一ファンドの受益権を取得する場合は当該支店等毎に、「分配金受取コース」と「分配金自動引き落とし投資コース」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）

令和2年4月30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	28,399,639	25.01
内 日本	28,399,639	25.01
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	85,138,329	74.99
純資産総額	113,537,968	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）

令和2年4月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	75,405,953	36.87
内 日本	75,405,953	36.87
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	129,131,413	63.13
純資産総額	204,537,366	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）

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和2年4月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	183,068,970,200	80.41
内 日本	183,068,970,200	80.41
地方債証券	17,591,205,000	7.73
内 日本	17,591,205,000	7.73
特殊債券	15,758,819,703	6.92
内 日本	15,758,819,703	6.92
社債券	9,886,347,520	4.34
内 日本	9,483,161,520	4.17
内 フランス	403,186,000	0.18
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	1,359,105,369	0.60
純資産総額	227,664,447,792	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。

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

令和2年4月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	217,268,585,080	97.07
内 日本	217,268,585,080	97.07
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	6,559,504,250	2.93
純資産総額	223,828,089,330	100.00

その他資産の投資状況

令和2年4月30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）	6,702,940,000	2.99
内 日本	6,702,940,000	2.99

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和2年4月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	114,211,813,491	96.14
内 アメリカ	58,433,490,236	49.19
内 フランス	10,757,722,394	9.06
内 イタリア	9,666,042,493	8.14
内 イギリス	7,419,590,199	6.25
内 ドイツ	6,709,629,982	5.65
内 スペイン	6,035,474,585	5.08
内 ベルギー	2,727,207,589	2.30
内 オーストラリア	2,107,283,739	1.77
内 オランダ	2,098,132,613	1.77
内 カナダ	1,845,114,534	1.55
内 オーストリア	1,646,167,208	1.39
内 アイルランド	788,642,626	0.66
内 メキシコ	706,508,466	0.59
内 フィンランド	618,951,788	0.52
内 ポーランド	605,794,158	0.51
内 マレーシア	562,364,788	0.47
内 デンマーク	533,237,096	0.45
内 シンガポール	477,376,463	0.40
内 スウェーデン	251,411,952	0.21
内 ノルウェー	221,670,582	0.19
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	4,589,953,991	3.86
純資産総額	118,801,767,482	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

令和2年4月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	316,444,647,223	94.27
内 アメリカ	216,390,826,936	64.47
内 イギリス	15,987,669,018	4.76
内 スイス	12,383,888,186	3.69
内 カナダ	11,470,306,660	3.42
内 フランス	10,819,697,749	3.22
内 ドイツ	9,285,050,828	2.77
内 オーストラリア	6,330,040,609	1.89
内 アイルランド	6,240,602,772	1.86

内 オランダ	5,722,495,050	1.70
内 香港	2,978,555,877	0.89
内 スウェーデン	2,849,268,940	0.85
内 スペイン	2,703,124,353	0.81
内 デンマーク	2,431,917,442	0.72
内 イタリア	1,895,275,351	0.56
内 フィンランド	1,281,339,240	0.38
内 シンガポール	1,177,045,516	0.35
内 パミュダ	1,073,713,585	0.32
内 ジャージー	980,229,757	0.29
内 ベルギー	977,802,568	0.29
内 ケイマン諸島	725,002,298	0.22
内 イスラエル	662,267,511	0.20
内 ノルウェー	610,067,688	0.18
内 ニュージーランド	342,573,238	0.10
内 ルクセンブルグ	268,720,623	0.08
内 オランダ領キュラソー	225,834,007	0.07
内 オーストリア	195,373,800	0.06
内 ポルトガル	173,157,998	0.05
内 パナマ	79,665,403	0.02
内 リベリア	72,291,623	0.02
内 マン島	51,215,240	0.02
内 パプアニューギニア	38,145,923	0.01
内 イギリス領バージン諸島	21,481,434	0.01
投資信託受益証券	553,293,830	0.16
内 オーストラリア	394,347,648	0.12
内 シンガポール	158,946,182	0.05
投資証券	7,877,133,086	2.35
内 アメリカ	7,226,211,437	2.15
内 イギリス	187,239,234	0.06
内 香港	165,562,740	0.05
内 フランス	138,641,500	0.04
内 オランダ	85,367,091	0.03
内 カナダ	74,111,084	0.02
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	10,791,411,231	3.21
純資産総額	335,666,485,370	100.00

その他資産の投資状況

令和2年4月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引（買建）	10,102,299,539	3.01
内 アメリカ	7,417,590,212	2.21
内 ドイツ	1,589,538,720	0.47
内 イギリス	527,913,977	0.16
内 カナダ	352,009,750	0.10
内 オーストラリア	215,246,880	0.06

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

（注3）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

令和2年4月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	107,399,845,186	98.82
内 メキシコ	16,340,976,156	15.04
内 ロシア	15,189,881,587	13.98
内 インドネシア	15,087,543,943	13.88
内 ブラジル	11,000,051,083	10.12
内 フィリピン	10,750,052,346	9.89
内 コロンビア	10,601,760,593	9.76
内 パナマ	5,953,388,920	5.48
内 南アフリカ	5,778,351,803	5.32
内 ペルー	5,069,710,815	4.66
内 ハンガリー	4,644,170,322	4.27
内 ルーマニア	4,189,176,780	3.85
内 クロアチア	2,794,780,838	2.57
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	1,277,993,901	1.18
純資産総額	108,677,839,087	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。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

令和2年4月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	34,231,447,658	81.37
内 ケイマン諸島	7,679,657,774	18.26
内 中国	4,668,543,000	11.10
内 台湾	4,272,242,482	10.16
内 韓国	4,100,737,644	9.75
内 インド	2,817,625,704	6.70
内 ブラジル	1,646,472,901	3.91
内 南アフリカ	1,279,735,173	3.04
内 ロシア	1,114,482,297	2.65
内 香港	1,057,455,141	2.51
内 サウジアラビア	878,497,429	2.09
内 タイ	789,322,528	1.88
内 マレーシア	608,799,474	1.45

内 インドネシア	497,207,203	1.18
内 メキシコ	470,632,629	1.12
内 バミューダ	326,483,049	0.78
内 カタール	315,848,873	0.75
内 フィリピン	282,167,916	0.67
内 ポーランド	246,778,726	0.59
内 チリ	235,442,425	0.56
内 アラブ首長国連邦	194,867,407	0.46
内 トルコ	147,405,581	0.35
内 アメリカ	135,231,223	0.32
内 コロンビア	79,516,345	0.19
内 ハンガリー	78,493,257	0.19
内 ギリシャ	66,382,461	0.16
内 チェコ	41,188,536	0.10
内 エジプト	40,374,652	0.10
内 ルクセンブルグ	38,209,185	0.09
内 ジャージー	31,453,785	0.07
内 オランダ	27,384,268	0.07
内 アルゼンチン	20,634,484	0.05
内 マン島	13,229,882	0.03
内 シンガポール	9,475,040	0.02
内 ペルー	8,403,198	0.02
内 ベルギー	4,127,976	0.01
内 パキスタン	4,047,727	0.01
内 スペイン	2,890,283	0.01
新株予約権証券	69,340	0.00
内 タイ	69,340	0.00
投資信託受益証券	222,416,131	0.53
内 メキシコ	150,401,540	0.36
内 ブラジル	72,014,591	0.17
投資証券	37,100,537	0.09
内 南アフリカ	20,989,091	0.05
内 メキシコ	16,111,446	0.04
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	7,576,893,481	18.01
純資産総額	42,067,927,147	100.00

その他資産の投資状況

令和2年4月30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）	7,579,674,063	18.02
内 アメリカ	7,579,674,063	18.02

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

(注3) 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。

(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)

令和2年4月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	3,680,922	2.2544	2.3470	-	7.61
				8,298,638	8,639,123	-	
2	エマージング株式パッシブ・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	7,287,401	0.9562	0.9849	-	6.32
				6,968,941	7,177,361	-	
3	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	2,181,504	1.9232	1.9066	-	3.66
				4,195,686	4,159,255	-	
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	827,983	3.3424	3.4754	-	2.53
				2,767,533	2,877,572	-	
5	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	2,156,128	1.3121	1.3169	-	2.50
				2,829,271	2,839,404	-	
6	エマージング債券パッシブ・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	1,431,478	1.9348	1.8910	-	2.38
				2,769,766	2,706,924	-	

(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

令和2年4月30日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	25.01
合計	25.01

(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）

令和2年4月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	国内株式パッシブ・ファン ド（最適化法）・マザー ファンド 日本	親投資 信託受 益証券	9,728,150	2.2544 21,932,114	2.3470 22,831,968	- -	11.16
2	エマージング株式パッシ ブ・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	19,375,965	0.9562 18,529,235	0.9849 19,083,387	- -	9.33
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	5,802,523	1.9232 11,159,992	1.9066 11,063,090	- -	5.41
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	2,226,157	3.3424 7,440,929	3.4754 7,736,786	- -	3.78
5	国内債券パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	5,651,203	1.3121 7,415,508	1.3169 7,442,069	- -	3.64
6	エマージング債券パッシ ブ・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	3,833,238	1.9348 7,416,932	1.8910 7,248,653	- -	3.54

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

令和2年4月30日現在

種類	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	36.87
合計	36.87

（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）

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和2年4月30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	3 2 5 回 利付国庫債券 (1 0 年) 日本	国債証 券	2,300,000,000	102.42 2,355,775,000	102.37 2,354,625,000	0.8 2022/9/20	1.03
2	3 5 0 回 利付国庫債券 (1 0 年) 日本	国債証 券	2,250,000,000	101.71 2,288,542,500	101.95 2,293,965,000	0.1 2028/3/20	1.01
3	3 4 7 回 利付国庫債券 (1 0 年) 日本	国債証 券	2,210,000,000	101.92 2,252,601,300	101.91 2,252,277,300	0.1 2027/6/20	0.99

4	129回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	2,120,000,000	100.39 2,128,437,600	100.41 2,128,692,000	0.1 2021/9/20	0.94
5	343回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	2,080,000,000	101.55 2,112,366,200	101.67 2,114,819,200	0.1 2026/6/20	0.93
6	348回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	2,030,000,000	101.70 2,064,640,900	101.94 2,069,463,200	0.1 2027/9/20	0.91
7	342回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	1,980,000,000	101.47 2,009,145,600	101.60 2,011,759,200	0.1 2026/3/20	0.88
8	335回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	1,940,000,000	102.90 1,996,282,900	102.98 1,997,909,000	0.5 2024/9/20	0.88
9	339回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	1,940,000,000	103.08 1,999,933,500	102.95 1,997,288,200	0.4 2025/6/20	0.88
10	334回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	1,930,000,000	103.26 1,992,962,600	103.25 1,992,744,300	0.6 2024/6/20	0.88
11	344回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	1,930,000,000	101.59 1,960,802,800	101.74 1,963,639,900	0.1 2026/9/20	0.86
12	341回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	1,910,000,000	102.62 1,960,042,000	102.67 1,961,092,500	0.3 2025/12/20	0.86
13	340回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	1,900,000,000	103.07 1,958,330,000	103.10 1,958,900,000	0.4 2025/9/20	0.86
14	333回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	1,890,000,000	103.08 1,948,244,400	103.07 1,948,041,900	0.6 2024/3/20	0.86
15	332回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	1,860,000,000	103.01 1,916,019,000	102.87 1,913,475,000	0.6 2023/12/20	0.84
16	338回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	1,830,000,000	102.76 1,880,520,000	102.80 1,881,368,100	0.4 2025/3/20	0.83
17	346回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	1,820,000,000	101.68 1,850,591,000	101.84 1,853,579,000	0.1 2027/3/20	0.81
18	329回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	1,770,000,000	103.18 1,826,392,200	103.09 1,824,710,700	0.8 2023/6/20	0.80
19	349回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	1,760,000,000	101.74 1,790,624,000	101.97 1,794,689,600	0.1 2027/12/20	0.79
20	345回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	1,760,000,000	101.83 1,792,358,000	101.81 1,791,891,200	0.1 2026/12/20	0.79

21	130回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	1,780,000,000	100.46 1,788,188,000	100.47 1,788,472,800	0.1 2021/12/20	0.79
22	352回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	1,720,000,000	101.60 1,747,520,000	101.86 1,752,060,800	0.1 2028/9/20	0.77
23	351回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	1,660,000,000	101.63 1,687,098,000	101.93 1,692,087,800	0.1 2028/6/20	0.74
24	328回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	1,590,000,000	102.28 1,626,261,600	102.26 1,625,949,900	0.6 2023/3/20	0.71
25	142回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	1,600,000,000	101.22 1,619,610,500	101.23 1,619,808,000	0.1 2024/12/20	0.71
26	356回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	1,580,000,000	101.30 1,600,550,500	101.51 1,603,858,000	0.1 2029/9/20	0.70
27	353回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	1,540,000,000	101.41 1,561,749,200	101.78 1,567,519,800	0.1 2028/12/20	0.69
28	354回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	1,470,000,000	101.50 1,492,152,900	101.70 1,495,004,700	0.1 2029/3/20	0.66
29	357回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	1,460,000,000	101.50 1,481,903,000	101.45 1,481,199,200	0.1 2029/12/20	0.65
30	355回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	1,450,000,000	101.45 1,471,083,000	101.61 1,473,345,000	0.1 2029/6/20	0.65

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

令和2年4月30日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	80.41
地方債証券	7.73
特殊債券	6.92
社債券	4.34
合計	99.40

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

令和2年4月30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	1,177,900	7,649.68 9,010,563,530	6,666.00 7,851,881,400	- -	3.51
2	ソニー 日本	株式 電気機器	661,200	7,605.09 5,028,486,186	6,932.00 4,583,438,400	- -	2.05
3	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	821,900	4,907.02 4,033,086,814	4,633.00 3,807,862,700	- -	1.70
4	キーエンス 日本	株式 電気機器	95,600	37,843.85 3,617,872,326	38,770.00 3,706,412,000	- -	1.66
5	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	878,400	4,318.95 3,793,768,880	3,883.00 3,410,827,200	- -	1.52
6	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	1,384,800	2,799.22 3,876,360,235	2,443.00 3,383,066,400	- -	1.51
7	三菱UFJフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	7,122,800	553.41 3,941,888,258	434.30 3,093,432,040	- -	1.38
8	任天堂 日本	株式 その他製品	64,700	40,865.11 2,643,972,680	44,650.00 2,888,855,000	- -	1.29
9	NTTドコモ 日本	株式 情報・通信業	765,300	3,155.15 2,414,642,460	3,148.00 2,409,164,400	- -	1.08
10	KDDI 日本	株式 情報・通信業	772,000	3,365.43 2,598,118,250	3,109.00 2,400,148,000	- -	1.07
11	リクルートホールディングス 日本	株式 サービス業	722,600	4,228.99 3,055,871,891	3,182.00 2,299,313,200	- -	1.03
12	第一三共 日本	株式 医薬品	302,200	8,033.06 2,427,590,860	7,382.00 2,230,840,400	- -	1.00
13	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	831,100	2,781.84 2,311,994,133	2,610.50 2,169,586,550	- -	0.97
14	信越化学工業 日本	株式 化学	177,400	13,196.29 2,341,022,017	12,015.00 2,131,461,000	- -	0.95
15	花王 日本	株式 化学	252,800	8,670.53 2,191,910,669	8,316.00 2,102,284,800	- -	0.94
16	HOYA 日本	株式 精密機器	210,800	10,028.12 2,113,928,324	9,866.00 2,079,752,800	- -	0.93

17	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	720,200	3,760.62 2,708,400,509	2,844.00 2,048,248,800	- -	0.92
18	ダイキン工業 日本	株式 機械	134,400	15,892.64 2,135,971,831	14,005.00 1,882,272,000	- -	0.84
19	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	368,100	6,014.09 2,213,788,060	5,086.00 1,872,156,600	- -	0.84
20	村田製作所 日本	株式 電気機器	310,100	6,443.75 1,998,209,335	6,019.00 1,866,491,900	- -	0.83
21	ファナック 日本	株式 電気機器	100,200	19,914.26 1,995,409,548	17,830.00 1,786,566,000	- -	0.80
22	みずほフィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	14,149,300	158.35 2,240,646,458	125.80 1,779,981,940	- -	0.80
23	三菱商事 日本	株式 卸売業	729,600	2,816.14 2,054,662,308	2,300.00 1,678,080,000	- -	0.75
24	日立製作所 日本	株式 電気機器	507,200	4,074.41 2,066,543,845	3,241.00 1,643,835,200	- -	0.73
25	アステラス製薬 日本	株式 医薬品	915,500	1,935.01 1,771,509,700	1,786.50 1,635,540,750	- -	0.73
26	S M C 日本	株式 機械	33,100	50,129.01 1,659,270,365	49,000.00 1,621,900,000	- -	0.72
27	日本電産 日本	株式 電気機器	254,200	7,137.36 1,814,318,920	6,286.00 1,597,901,200	- -	0.71
28	伊藤忠商事 日本	株式 卸売業	727,300	2,606.54 1,895,738,982	2,125.00 1,545,512,500	- -	0.69
29	東京エレクトロン 日本	株式 電気機器	66,900	23,881.16 1,597,649,752	22,940.00 1,534,686,000	- -	0.69
30	東海旅客鉄道 日本	株式 陸運業	87,700	21,410.89 1,877,735,826	17,005.00 1,491,338,500	- -	0.67

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

令和2年4月30日現在

種類	投資比率(%)
株式	97.07
合計	97.07

(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

令和2年4月30日現在

業種	国内 / 外国	投資比率 (%)
電気機器	国内	14.28
情報・通信業		9.51
化学		7.18
輸送用機器		7.18
医薬品		6.44
銀行業		5.03
サービス業		4.99
機械		4.90
小売業		4.62
卸売業		4.52
陸運業		4.17
食料品		3.90
建設業		2.57
精密機器		2.51
その他製品		2.39
保険業		2.13
不動産業		2.10
電気・ガス業		1.61
その他金融業		1.06
証券、商品先物取引業		0.76
ガラス・土石製品		0.74
非鉄金属		0.64
ゴム製品		0.62
鉄鋼		0.55
金属製品		0.52
繊維製品		0.50
石油・石炭製品		0.44
空運業		0.34
パルプ・紙		0.25
鉱業		0.21
倉庫・運輸関連業		0.18
海運業	0.14	
水産・農林業	0.10	
合計		97.07

(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

令和2年4月30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 2.125 08/15/21 アメリカ	国債証券	1,175,570,000	100.98 1,187,187,934	102.52 1,205,234,768	2.125 2021/8/15	1.01
2	US T N/B 2.0 11/15/21 アメリカ	国債証券	1,111,448,000	101.00 1,122,605,892	102.80 1,142,577,223	2 2021/11/15	0.96
3	US T N/B 2.0 05/31/21 アメリカ	国債証券	1,082,593,100	100.66 1,089,824,474	101.98 1,104,033,509	2 2021/5/31	0.93

4	US T N/B 2.125 12/31/21 アメリカ	国債証 券	978,929,200	101.30 991,701,161	103.18 1,010,132,568	2.125 2021/12/31	0.85
5	US T N/B 2.125 09/30/21 アメリカ	国債証 券	944,730,800	101.08 954,989,981	102.74 970,637,085	2.125 2021/9/30	0.82
6	US T N/B 2.0 02/15/22 アメリカ	国債証 券	905,188,900	101.19 915,973,373	103.23 934,430,736	2 2022/2/15	0.79
7	US T N/B 3.125 05/15/21 アメリカ	国債証 券	854,960,000	102.01 872,159,384	103.08 881,376,921	3.125 2021/5/15	0.74
8	US T N/B 1.75 03/31/22 アメリカ	国債証 券	747,021,300	100.75 752,682,316	102.96 769,140,129	1.75 2022/3/31	0.65
9	US T N/B 2.375 08/15/24 アメリカ	国債証 券	686,105,400	108.30 743,097,842	108.65 745,496,397	2.375 2024/8/15	0.63
10	US T N/B 2.0 11/30/22 アメリカ	国債証 券	704,273,300	101.70 716,267,953	104.51 736,075,640	2 2022/11/30	0.62
11	US T N/B 2.125 06/30/22 アメリカ	国債証 券	697,861,100	101.72 709,910,103	104.14 726,811,427	2.125 2022/6/30	0.61
12	US T N/B 2.5 05/15/24 アメリカ	国債証 券	666,868,800	104.63 697,763,576	108.72 725,063,518	2.5 2024/5/15	0.61
13	US T N/B 8.0 11/15/21 アメリカ	国債証 券	641,220,000	111.23 713,232,005	112.03 718,416,872	8 2021/11/15	0.60
14	US T N/B 2.75 11/15/23 アメリカ	国債証 券	643,357,400	105.04 675,826,843	108.57 698,495,136	2.75 2023/11/15	0.59
15	US T N/B 3.125 11/15/28 アメリカ	国債証 券	517,250,800	113.25 585,826,935	121.11 626,479,615	3.125 2028/11/15	0.53
16	US T N/B 1.625 11/15/22 アメリカ	国債証 券	600,609,400	100.67 604,668,203	103.51 621,748,033	1.625 2022/11/15	0.52
17	US T N/B 2.75 02/15/24 アメリカ	国債証 券	568,548,400	105.35 599,019,040	109.18 620,783,784	2.75 2024/2/15	0.52
18	US T N/B 2.125 12/31/22 アメリカ	国債証 券	589,922,400	102.11 602,412,160	105.01 619,510,695	2.125 2022/12/31	0.52
19	US T N/B 2.0 02/15/25 アメリカ	国債証 券	566,411,000	102.98 583,314,827	107.79 610,573,357	2 2025/2/15	0.51
20	US T N/B 2.25 11/15/25 アメリカ	国債証 券	554,655,300	104.62 580,308,107	109.96 609,904,164	2.25 2025/11/15	0.51
21	US T N/B 2.0 08/15/25 アメリカ	国債証 券	553,586,600	103.17 571,188,920	108.33 599,733,229	2 2025/8/15	0.50
22	US T N/B 2.125 05/15/25 アメリカ	国債証 券	550,380,500	103.71 570,804,773	108.72 598,409,795	2.125 2025/5/15	0.50
23	US T N/B 1.75 05/15/22 アメリカ	国債証 券	577,098,000	100.82 581,832,003	103.13 595,199,935	1.75 2022/5/15	0.50
24	US T N/B 2.875 08/15/28 アメリカ	国債証 券	500,151,600	110.99 555,129,195	118.56 592,992,240	2.875 2028/8/15	0.50
25	US T N/B 1.75 09/30/22 アメリカ	国債証 券	561,067,500	100.96 566,502,840	103.69 581,800,694	1.75 2022/9/30	0.49
26	US T N/B 2.875 05/15/28 アメリカ	国債証 券	473,434,100	110.75 524,365,249	118.13 559,281,014	2.875 2028/5/15	0.47
27	US T N/B 1.5 09/30/21 アメリカ	国債証 券	547,174,400	100.10 547,751,493	101.87 557,412,541	1.5 2021/9/30	0.47
28	US T N/B 1.75 01/31/23 アメリカ	国債証 券	532,212,600	101.10 538,075,250	104.14 554,249,527	1.75 2023/1/31	0.47

29	US T N/B 2.25 12/31/23 アメリカ	国債証券	516,182,100	103.34 533,441,938	107.14 553,040,727	2.25 2023/12/31	0.47
30	US T N/B 1.625 12/31/21 アメリカ	国債証券	534,350,000	102.42 547,291,208	102.37 547,051,232	1.625 2021/12/31	0.46

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

令和2年4月30日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	96.14
合計	96.14

(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

令和2年4月30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	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフト ウェア	612,293	19,552.11 11,971,624,777	18,961.94 11,610,265,638	- -	3.46
2	APPLE INC アメリカ	株式 コン ピュー タ・周辺 機器	375,457	34,031.43 12,777,339,105	30,749.70 11,545,192,027	- -	3.44
3	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 インター ネット販 売・通信 販売	35,610	227,226.83 8,091,547,576	253,571.51 9,029,681,745	- -	2.69
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	203,497	22,368.49 4,551,922,628	20,753.08 4,223,190,599	- -	1.26
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	26,102	158,776.30 4,144,379,128	143,363.96 3,742,086,282	- -	1.11

6	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	25,327	158,410.47 4,012,062,223	143,438.77 3,632,873,894	- -	1.08
7	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	222,446	15,873.46 3,530,989,304	16,056.14 3,571,626,075	- -	1.06
8	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	251,234	11,701.96 2,939,931,500	11,275.28 2,832,733,745	- -	0.84
9	VISA INC アメリカ	株式 情報技術サービス	144,684	21,969.90 3,178,693,471	19,427.89 2,810,905,892	- -	0.84
10	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	264,853	14,164.63 3,751,545,592	10,458.29 2,769,911,653	- -	0.83
11	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品	210,615	13,352.76 2,812,291,760	12,512.33 2,635,286,404	- -	0.79
12	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	80,158	31,340.64 2,512,203,798	30,741.15 2,464,149,542	- -	0.73
13	INTEL CORP アメリカ	株式 半導体・半導体製造装置	367,803	7,070.14 2,600,421,158	6,604.56 2,429,179,188	- -	0.72
14	MASTERCARD INC アメリカ	株式 情報技術サービス	75,867	35,475.82 2,691,444,732	30,317.95 2,300,131,935	- -	0.69
15	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 各種金融サービス	110,971	23,777.41 2,638,603,682	20,263.62 2,248,674,252	- -	0.67
16	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN スイス	株式 医薬品	59,494	36,957.11 2,198,726,458	37,429.15 2,226,810,236	- -	0.66
17	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 専門小売り	92,075	25,633.70 2,360,223,702	23,704.83 2,182,622,655	- -	0.65
18	VERIZON COMM INC アメリカ	株式 各種電気通信サービス	349,319	6,215.10 2,171,054,221	6,211.28 2,169,719,655	- -	0.65
19	AT&T INC アメリカ	株式 各種電気通信サービス	617,278	3,991.21 2,463,686,464	3,358.92 2,073,389,950	- -	0.62

20	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 銀行	721,958	3,576.50 2,582,083,648	2,648.23 1,911,917,043	- -	0.57
21	PFIZER INC アメリカ	株式 医薬品	468,051	3,869.58 1,811,162,334	4,073.88 1,906,785,667	- -	0.57
22	MERCK & CO. INC. アメリカ	株式 医薬品	215,331	8,780.83 1,890,786,260	8,631.88 1,858,713,484	- -	0.55
23	THE WALT DISNEY CO アメリカ	株式 娯楽	152,701	14,469.23 2,209,467,415	11,996.15 1,831,825,246	- -	0.55
24	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 石油・ガス・消耗 燃料	358,262	6,231.26 2,232,426,149	5,072.05 1,817,122,848	- -	0.54
25	COCA-COLA CO/THE アメリカ	株式 飲料	343,729	6,238.92 2,144,498,997	5,035.71 1,730,921,074	- -	0.52
26	NOVARTIS AG-REG SHS スイス	株式 医薬品	181,712	10,285.11 1,868,928,750	9,313.21 1,692,323,723	- -	0.50
27	PEPSICO INC アメリカ	株式 飲料	117,703	15,481.02 1,822,163,646	14,252.18 1,677,524,719	- -	0.50
28	CISCO SYSTEMS INC アメリカ	株式 通信機器	360,078	4,947.47 1,781,475,712	4,631.74 1,667,789,764	- -	0.50
29	NETFLIX INC アメリカ	株式 娯楽	37,089	40,678.62 1,508,729,413	44,018.68 1,632,608,982	- -	0.49
30	CHEVRON CORP アメリカ	株式 石油・ガス・消耗 燃料	160,110	11,376.32 1,821,464,008	10,112.03 1,619,038,628	- -	0.48

（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

令和2年4月30日現在

種類	投資比率（％）
株式	94.27
投資信託受益証券	0.16
投資証券	2.35
合計	96.79

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

令和2年4月30日現在

業種	国内 / 外国	投資比率（％）
ソフトウェア	外国	6.43
医薬品		6.13
銀行		5.72
情報技術サービス		4.46
インタラクティブ・メディアおよびサービス		3.67
コンピュータ・周辺機器		3.66
半導体・半導体製造装置		3.65
石油・ガス・消耗燃料		3.63
インターネット販売・通信販売		3.28
保険		3.18
ヘルスケア機器・用品		3.02

資本市場	2.89
バイオテクノロジー	2.13
電力	2.11
化学	2.10
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	2.09
食品	2.02
各種電気通信サービス	1.93
飲料	1.85
専門小売り	1.66
航空宇宙・防衛	1.61
食品・生活必需品小売り	1.58
ホテル・レストラン・レジャー	1.53
機械	1.52
家庭用品	1.45
娯楽	1.43
金属・鉱業	1.34
繊維・アパレル・贅沢品	1.32
メディア	1.14
コングロマリット	1.12
総合公益事業	1.07
陸運・鉄道	1.02
ライフサイエンス・ツール/サービス	0.90
各種金融サービス	0.89
タバコ	0.85
自動車	0.81
専門サービス	0.78
通信機器	0.76
電気設備	0.71
パーソナル用品	0.67
電子装置・機器・部品	0.52
複合小売り	0.49
航空貨物・物流サービス	0.48
不動産管理・開発	0.46
建設関連製品	0.44
商業サービス・用品	0.42
消費者金融	0.37
家庭用耐久財	0.33
無線通信サービス	0.28
建設・土木	0.28
容器・包装	0.27
商社・流通業	0.26
建設資材	0.24
自動車部品	0.23
ガス	0.18
エネルギー設備・サービス	0.16
運送インフラ	0.16
ヘルスケア・テクノロジー	0.13
水道	0.12
紙製品・林産品	0.09
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.07

販売	0.06
旅客航空輸送業	0.05
海運業	0.05
レジャー用品	0.04
合計	94.27

(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

令和2年4月30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	2,244,270,000	124.26 2,788,753,840	123.23 2,765,629,630	5.25 2047/6/23	2.54
2	RUSSIAN FEDERATION 5.1 03/28/35 ロシア	国債証券	1,603,050,000	117.89 1,889,957,476	116.68 1,870,570,190	5.1 2035/3/28	1.72
3	RUSSIAN FEDERATION 5.625 04/04/42 ロシア	国債証券	1,282,440,000	125.96 1,615,366,767	126.61 1,623,798,596	5.625 2042/4/4	1.49
4	UNITED MEXICAN STATES 6.05 01/11/40 メキシコ	国債証券	1,485,493,000	111.74 1,659,998,992	107.62 1,598,791,551	6.05 2040/1/11	1.47
5	RUSSIAN FEDERATION 4.75 05/27/26 ロシア	国債証券	1,432,058,000	110.52 1,582,740,254	110.34 1,580,190,079	4.75 2026/5/27	1.45
6	PERU 5.625 11/18/50 ペルー	国債証券	1,068,700,000	144.97 1,549,347,825	147.00 1,570,989,000	5.625 2050/11/18	1.45
7	BRAZIL 4.25 01/07/25 ブラジル	国債証券	1,506,867,000	104.29 1,571,590,143	103.06 1,553,052,473	4.25 2025/1/7	1.43
8	UNITED MEXICAN STATES 4.5 04/22/29 メキシコ	国債証券	1,496,180,000	101.26 1,515,051,104	100.62 1,505,531,125	4.5 2029/4/22	1.39
9	PERU 6.55 03/14/37 ペルー	国債証券	1,068,700,000	139.35 1,489,254,824	138.84 1,483,783,080	6.55 2037/3/14	1.37
10	CROATIA 6.0 01/26/24 クロアチア	国債証券	1,325,188,000	111.70 1,480,286,186	111.56 1,478,424,789	6 2024/1/26	1.36
11	PANAMA 6.7 01/26/36 パナマ	国債証券	1,164,883,000	123.13 1,434,357,842	125.60 1,463,093,048	6.7 2036/1/26	1.35
12	RUSSIAN FEDERATION 4.25 06/23/27 ロシア	国債証券	1,325,188,000	108.11 1,432,705,290	107.89 1,429,838,096	4.25 2027/6/23	1.32
13	HUNGARY 5.75 11/22/23 ハンガリー	国債証券	1,282,440,000	111.60 1,431,217,253	111.46 1,429,497,394	5.75 2023/11/22	1.32
14	INDONESIA 7.75 01/17/38 インドネシア	国債証券	1,015,265,000	140.16 1,423,040,389	139.98 1,421,223,380	7.75 2038/1/17	1.31
15	UNITED MEXICAN STATES 4.75 03/08/44 メキシコ	国債証券	1,538,928,000	95.94 1,476,535,584	91.00 1,400,424,480	4.75 2044/3/8	1.29
16	HUNGARY 7.625 03/29/41 ハンガリー	国債証券	854,960,000	162.97 1,393,386,556	160.51 1,372,320,234	7.625 2041/3/29	1.26
17	INDONESIA 6.75 01/15/44 インドネシア	国債証券	1,015,265,000	134.54 1,365,959,132	134.15 1,362,015,043	6.75 2044/1/15	1.25
18	COLOMBIA 7.375 09/18/37 コロンビア	国債証券	1,111,448,000	126.49 1,405,874,850	121.50 1,350,409,320	7.375 2037/9/18	1.24

19	RUSSIAN FEDERATION 4.875 09/16/23 ロシア	国債証券	1,218,318,000	109.35 1,332,274,229	109.20 1,330,510,467	4.875 2023/9/16	1.22
20	UNITED MEXICAN STATES 4.15 03/28/27 メキシコ	国債証券	1,325,188,000	100.65 1,333,844,470	99.87 1,323,531,515	4.15 2027/3/28	1.22
21	PHILIPPINES 9.5 02/02/30 フィリピン	国債証券	833,586,000	159.36 1,328,461,040	158.26 1,319,283,910	9.5 2030/2/2	1.21
22	INDONESIA 5.875 01/15/24 インドネシア	国債証券	1,196,944,000	110.00 1,316,689,842	110.01 1,316,767,657	5.875 2024/1/15	1.21
23	CROATIA 5.5 04/04/23 クロアチア	国債証券	1,218,318,000	108.15 1,317,638,190	108.04 1,316,356,049	5.5 2023/4/4	1.21
24	RUSSIAN FEDERATION 5.875 09/16/43 ロシア	国債証券	983,204,000	130.30 1,281,210,952	130.63 1,284,402,646	5.875 2043/9/16	1.18
25	UNITED MEXICAN STATES 4.0 10/02/23 メキシコ	国債証券	1,229,005,000	101.96 1,253,121,551	102.52 1,259,975,926	4 2023/10/2	1.16
26	BRAZIL 6.0 04/07/26 ブラジル	国債証券	1,154,196,000	112.05 1,293,351,427	109.15 1,259,804,934	6 2026/4/7	1.16
27	BRAZIL 7.125 01/20/37 ブラジル	国債証券	1,100,761,000	116.52 1,282,684,732	111.37 1,225,972,563	7.125 2037/1/20	1.13
28	RUSSIAN FEDERATION 4.375 03/21/29 ロシア	国債証券	1,111,448,000	110.51 1,228,301,795	110.16 1,224,466,701	4.375 2029/3/21	1.13
29	RUSSIAN FEDERATION 03/31/30 ロシア	国債証券	1,052,990,110	113.01 1,190,089,422	114.35 1,204,167,900	7.5 2030/3/31	1.11
30	ROMANIA 6.75 02/07/22 ルーマニア	国債証券	1,122,135,000	106.48 1,194,916,141	106.55 1,195,702,170	6.75 2022/2/7	1.10

（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

令和2年4月30日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	98.82
合計	98.82

（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

令和2年4月30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	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	108,025	22,449.27 2,425,082,997	22,090.02 2,386,275,382	- -	5.67
2	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	356,200	5,646.78 2,011,385,746	5,750.43 2,048,303,166	- -	4.87
3	TAIWAN SEMICONDUCTOR 台湾	株式 半導体・半導体製造装置	1,527,083	1,092.37 1,668,147,043	1,067.42 1,630,054,206	- -	3.87
4	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD 韓国	株式 コンピュータ・周辺機器	296,343	4,519.71 1,339,385,089	4,420.00 1,309,836,060	- -	3.11
5	CHINA CONSTRUCTION BANK 中国	株式 銀行	5,921,530	84.32 499,343,819	87.15 516,077,919	- -	1.23
6	NASPERS LTD 南アフリカ	株式 インターネット販売・通信販売	27,593	16,409.42 452,785,166	17,216.46 475,054,056	- -	1.13
7	PING AN INSURANCE GROUP CO-H 中国	株式 保険	342,500	1,085.03 371,624,339	1,099.06 376,429,077	- -	0.89
8	RELIANCE INDUSTRIES LTD インド	株式 石油・ガス・消耗燃料	176,944	1,756.98 310,888,434	2,040.53 361,061,044	- -	0.86
9	CHINA MOBILE LIMITED 香港	株式 無線通信サービス	381,500	833.81 318,099,890	861.18 328,542,268	- -	0.78
10	IND & COMM BK OF CHINA - H 中国	株式 銀行	4,006,235	70.83 283,792,358	72.67 291,146,318	- -	0.69
11	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP インド	株式 貯蓄・抵当・不動産金融	102,209	2,418.02 247,144,193	2,626.55 268,457,304	- -	0.64
12	SK HYNIX INC 韓国	株式 半導体・半導体製造装置	33,854	7,395.81 250,377,974	7,399.07 250,488,454	- -	0.60

13	JD.COM INC ADR ケイマン諸島	株式 インター ネット販 売・通信 販売	45,945	4,910.61 225,618,154	4,738.61 217,715,702	- -	0.52
14	HON HAI PRECISION INDUSTRY 台湾	株式 電子装 置・機 器・部品	772,225	270.92 209,216,294	269.89 208,417,349	- -	0.50
15	INFOSYS LTD インド	株式 情報技術 サービス	211,527	906.84 191,821,512	967.46 204,645,286	- -	0.49
16	BANK OF CHINA LTD 中国	株式 銀行	4,857,200	41.07 199,504,851	40.95 198,932,940	- -	0.47
17	SBERBANK ADR ロシア	株式 銀行	170,238	1,099.33 187,147,782	1,148.31 195,487,385	- -	0.46
18	SAMSUNG ELECTRONICS-PFD 韓国	株式 コン ピュー タ・周辺 機器	51,035	3,884.06 198,223,040	3,734.89 190,610,621	- -	0.45
19	LUKOIL SPON ADR ロシア	株式 石油・ガ ス・消耗 燃料	26,312	6,615.84 174,076,127	7,162.42 188,457,789	- -	0.45
20	GAZPROM PAO ADR ロシア	株式 石油・ガ ス・消耗 燃料	334,571	527.12 176,361,197	558.93 187,001,802	- -	0.44
21	VALE SA ブラジル	株式 金属・鉱 業	196,321	874.26 171,635,874	935.06 183,573,347	- -	0.44
22	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	17,162	11,214.25 192,459,029	10,651.73 182,805,040	- -	0.43
23	NETEASE INC-ADR ケイマン諸島	株式 娯楽	4,471	37,263.81 166,606,535	37,765.72 168,850,536	- -	0.40
24	HINDUSTAN UNILEVER LTD インド	株式 家庭用品	50,870	3,397.33 172,822,417	3,191.40 162,346,645	- -	0.39
25	ICICI BANK LTD インド	株式 銀行	297,881	533.20 158,831,876	529.74 157,800,523	- -	0.38

26	NAVER CORP 韓国	株式 インタラクティブ・メディアおよびサービス	8,720	15,843.20 138,152,765	17,459.00 152,242,480	- -	0.36
27	TATA CONSULTANCY SERVICES LTD インド	株式 情報技術サービス	55,556	2,587.46 143,749,475	2,725.07 151,394,516	- -	0.36
28	TAL EDUCATION GROUP-ADR ケイマン諸島	株式 各種消費者サービス	24,087	5,484.13 132,096,276	5,905.63 142,249,059	- -	0.34
29	ITAU UNIBANCO HOLDING SA ブラジル	株式 銀行	297,847	462.29 137,694,122	473.43 141,011,671	- -	0.34
30	QATAR NATIONAL BANK カタール	株式 銀行	277,075	513.46 142,267,408	503.09 139,396,432	- -	0.33

（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

令和2年4月30日現在

種類	投資比率（％）
株式	81.37
新株予約権証券	0.00
投資信託受益証券	0.53
投資証券	0.09
合計	81.99

（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

令和2年4月30日現在

業種	国内 / 外国	投資比率（％）
銀行	外国	11.69
インターネット販売・通信販売		8.08
インタラクティブ・メディアおよびサービス		6.16
半導体・半導体製造装置		5.59
石油・ガス・消耗燃料		4.97
コンピュータ・周辺機器		4.54
保険		3.00
金属・鉱業		2.65
無線通信サービス		2.32
不動産管理・開発		2.23
電子装置・機器・部品		1.95
化学		1.91
食品		1.64
食品・生活必需品小売り		1.29
情報技術サービス		1.26
医薬品		1.18
各種電気通信サービス		1.18

自動車	1.18
資本市場	1.03
コングロマリット	0.95
建設資材	0.90
飲料	0.82
娯楽	0.81
電力	0.72
各種消費者サービス	0.68
貯蓄・抵当・不動産金融	0.65
繊維・アパレル・贅沢品	0.65
運送インフラ	0.64
パーソナル用品	0.62
ホテル・レストラン・レジャー	0.60
機械	0.59
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.53
ガス	0.53
建設・土木	0.53
各種金融サービス	0.50
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	0.49
家庭用品	0.49
バイオテクノロジー	0.48
ライフサイエンス・ツール/サービス	0.45
複合小売り	0.43
専門小売り	0.43
自動車部品	0.31
電気設備	0.31
タバコ	0.30
家庭用耐久財	0.29
商業サービス・用品	0.23
ソフトウェア	0.23
ヘルスケア・テクノロジー	0.23
陸運・鉄道	0.22
航空貨物・物流サービス	0.22
水道	0.19
ヘルスケア機器・用品	0.18
通信機器	0.18
紙製品・林産品	0.16
メディア	0.15
消費者金融	0.15
旅客航空輸送業	0.15
航空宇宙・防衛	0.11
海運業	0.09
レジャー用品	0.08
エネルギー設備・サービス	0.07
総合公益事業	0.04
商社・流通業	0.04
建設関連製品	0.04
専門サービス	0.02
販売	0.02
合計	81.37

（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。

【投資不動産物件】

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。

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

該当事項はありません。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

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

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。

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

令和2年4月30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 0206月	買建	461	6,488,204,130	6,702,940,000	2.99

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

外国債券パッシブ・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

令和2年4月30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	シカゴ商品 取引所	S&P500 EMINI FUT Jun20	買建	472	6,667,982,658	7,417,590,212	2.21
	E U R E X 取引所	DJ EURO STOXX 50 Jun20	買建	462	1,466,900,040	1,589,538,720	0.47
	I C E - E U	FTSE 100 INDEX FUTURE Jun20	買建	65	482,102,367	527,913,977	0.16
	モントリ オール取引 所	S&P/TSE 60 IX FUT Jun20	買建	25	315,309,994	352,009,750	0.10
	シドニー先 物取引所	SPI 200 FUTURES Jun20	買建	23	212,706,450	215,246,880	0.06

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

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

令和2年4月30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	I C E - U S	MINI MSCI EMG MKT Jun20	買建	1,533	7,337,747,635	7,579,674,063	18.02

（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）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。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

D I A Mコア資産設計ファンド（堅実型）

直近日（令和2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。

	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
第9計算期間末 （令和1年10月11日）	145	145	1.0129	1.0129
第10計算期間末 （令和2年4月13日）	112	112	1.0386	1.0386
平成31年4月末日	157	-	1.0512	-
令和1年5月末日	153	-	1.0293	-
6月末日	153	-	1.0337	-
7月末日	153	-	1.0326	-
8月末日	150	-	1.0108	-
9月末日	146	-	1.0131	-
10月末日	146	-	1.0328	-
11月末日	138	-	1.0437	-
12月末日	139	-	1.0684	-
令和2年1月末日	131	-	1.0663	-
2月末日	116	-	1.0548	-
3月末日	113	-	1.0387	-
4月末日	113	-	1.0432	-

D I A Mコア資産設計ファンド(積極型)

直近日(令和2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。

	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
第9計算期間末 (令和1年10月11日)	281	281	0.9819	0.9819
第10計算期間末 (令和2年4月13日)	205	205	1.0067	1.0067
平成31年4月末日	310	-	1.0348	-
令和1年5月末日	298	-	1.0050	-
6月末日	299	-	1.0073	-
7月末日	293	-	1.0058	-
8月末日	286	-	0.9777	-
9月末日	282	-	0.9820	-
10月末日	284	-	1.0091	-
11月末日	281	-	1.0219	-
12月末日	280	-	1.0469	-
令和2年1月末日	251	-	1.0393	-
2月末日	218	-	1.0227	-
3月末日	210	-	1.0075	-
4月末日	204	-	1.0136	-

【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
第9計算期間	0.0000
第10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
第9計算期間	0.0000
第10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
第9計算期間	3.7
第10計算期間	2.5

（注）収益率は期間騰落率です。

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
第9計算期間	5.2
第10計算期間	2.5

（注）収益率は期間騰落率です。

（４）【設定及び解約の実績】

D I A Mコア資産設計ファンド（堅実型）

	設定口数	解約口数
第1計算期間	312,448,290	8,299,019
第2計算期間	41,355,881	91,105,022
第3計算期間	7,228,942	14,873,920
第4計算期間	6,056,134	87,803,625
第5計算期間	10,207,312	41,322,402
第6計算期間	12,455,819	20,836,255
第7計算期間	33,165,458	8,351,305
第8計算期間	16,604,344	16,654,728
第9計算期間	1,311,733	7,974,207
第10計算期間	1,606,500	36,538,844

（注1）本邦外における設定及び解約はありません。

（注2）第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

D I A Mコア資産設計ファンド（積極型）

	設定口数	解約口数
第1計算期間	538,147,596	13,046,804
第2計算期間	67,620,276	138,974,156
第3計算期間	13,958,010	31,768,621
第4計算期間	14,712,909	70,413,301
第5計算期間	38,653,832	119,655,755
第6計算期間	34,785,616	52,794,441
第7計算期間	43,415,961	36,374,469
第8計算期間	26,771,880	14,887,931
第9計算期間	6,903,112	20,146,926
第10計算期間	3,492,125	85,806,510

（注1）本邦外における設定及び解約はありません。

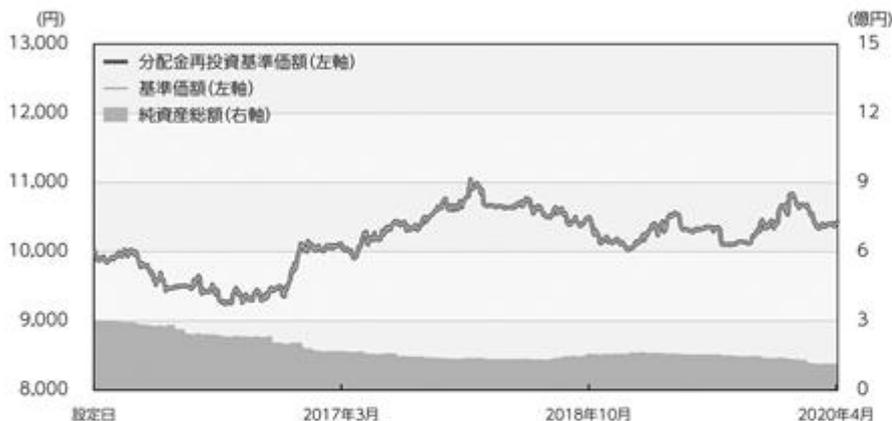
（注2）第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

<< 参考情報 >>

データの基準日:2020年4月30日

(堅 実 型)

基準価額・純資産の推移 (2015年8月28日～2020年4月30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)

分配の推移(税引前)

2018年 4月	0円
2018年10月	0円
2019年 4月	0円
2019年10月	0円
2020年 4月	0円
設定来累計	0円

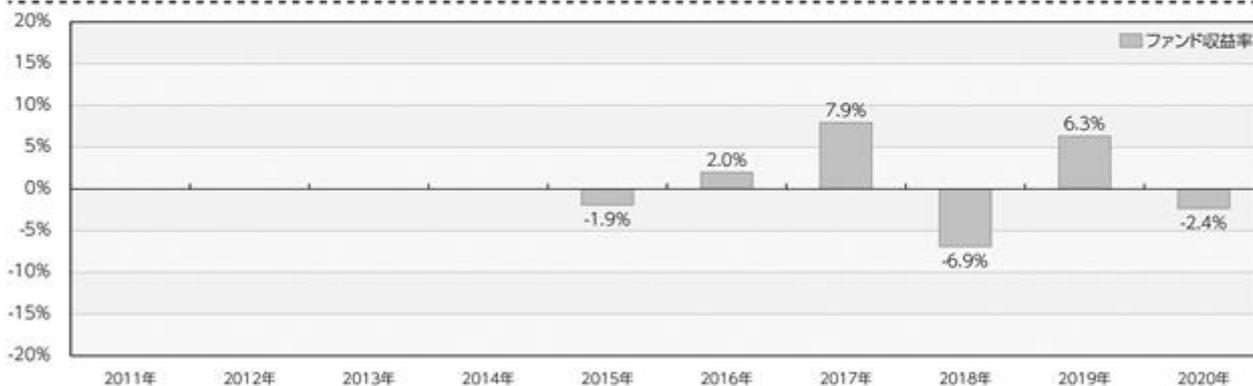
※分配金は1万口当たりです。

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	7.61
2	エマージング株式/パッシブ・マザーファンド	6.32
3	外国債券/パッシブ・ファンド・マザーファンド	3.66
4	外国株式/パッシブ・ファンド・マザーファンド	2.53
5	国内債券/パッシブ・ファンド・マザーファンド	2.50
6	エマージング債券/パッシブ・マザーファンド	2.38

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2020年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

※当ファンドにはベンチマークはありません。

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

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

データの基準日:2020年4月30日

(積 極 型)

基準価額・純資産の推移 (2015年8月28日～2020年4月30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)

分配の推移(税引前)

2018年 4月	0円
2018年10月	0円
2019年 4月	0円
2019年10月	0円
2020年 4月	0円
設定来累計	0円

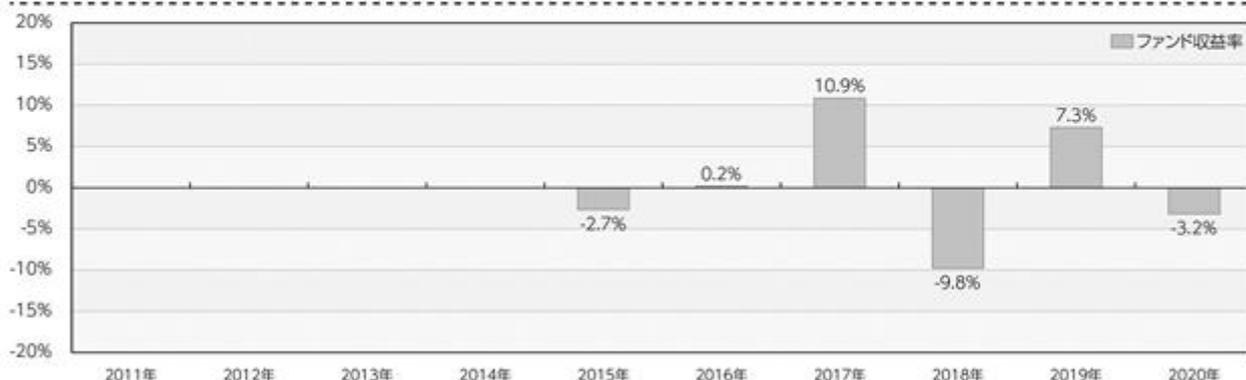
※分配金は1万口当たりです。

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	11.16
2	エマーシング株式パッシブ・マザーファンド	9.33
3	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	5.41
4	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	3.78
5	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	3.64
6	エマーシング債券パッシブ・マザーファンド	3.54

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2020年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

※当ファンドにはベンチマークはありません。

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

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

データの基準日:2020年4月30日

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(%)	償還日	比率(%)
1	325回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.8	2022/9/20	1.03
2	350回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.1	2028/3/20	1.01
3	347回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.1	2027/6/20	0.99
4	129回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.1	2021/9/20	0.94
5	343回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.1	2026/6/20	0.93

■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	3.51
2	ソニー	株式	日本	電気機器	2.05
3	ソフトバンクグループ	株式	日本	情報・通信業	1.70
4	キーエンス	株式	日本	電気機器	1.66
5	武田薬品工業	株式	日本	医薬品	1.52

■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(%)	償還日	比率(%)
1	US T N/B 2.125 08/15/21	国債証券	アメリカ	2.125	2021/8/15	1.01
2	US T N/B 2.0 11/15/21	国債証券	アメリカ	2	2021/11/15	0.96
3	US T N/B 2.0 05/31/21	国債証券	アメリカ	2	2021/5/31	0.93
4	US T N/B 2.125 12/31/21	国債証券	アメリカ	2.125	2021/12/31	0.85
5	US T N/B 2.125 09/30/21	国債証券	アメリカ	2.125	2021/9/30	0.82

■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	MICROSOFT CORP	株式	アメリカ	ソフトウェア	3.46
2	APPLE INC	株式	アメリカ	コンピュータ・周辺機器	3.44
3	AMAZON.COM INC	株式	アメリカ	インターネット販売・通信販売	2.69
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	1.26
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	1.11

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

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

データの基準日:2020年4月30日

■エマージング債券パッシブ・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還日	比率(%)
1	RUSSIAN FEDERATION 5.25 06/23/47	国債証券	ロシア	5.25	2047/6/23	2.54
2	RUSSIAN FEDERATION 5.1 03/28/35	国債証券	ロシア	5.1	2035/3/28	1.72
3	RUSSIAN FEDERATION 5.625 04/04/42	国債証券	ロシア	5.625	2042/4/4	1.49
4	UNITED MEXICAN STATES 6.05 01/11/40	国債証券	メキシコ	6.05	2040/1/11	1.47
5	RUSSIAN FEDERATION 4.75 05/27/26	国債証券	ロシア	4.75	2026/5/27	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	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	5.67
2	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	4.87
3	TAIWAN SEMICONDUCTOR	株式	台湾	半導体・半導体製造装置	3.87
4	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	株式	韓国	コンピュータ・周辺機器	3.11
5	CHINA CONSTRUCTION BANK	株式	中国	銀行	1.23

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

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

第2【管理及び運営】

1【申込(販売)手続等】

お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

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

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

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

ただし、ニューヨーク証券取引所、ロンドン証券取引所、フランクフルト証券取引所、ニューヨークの銀行、ロンドンの銀行のいずれかの休業日に該当する日(以下、「海外休業日」という場合があります。)には取得またはスイッチングのお申込みの受付を行いません。

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

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

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

・お申込価額

お申込日の翌営業日の基準価額とします。

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

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

< 基準価額の照会方法等 >

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

各ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・ 販売会社へのお問い合わせ
- ・ 委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

・ お申込手数料

お申込日の翌営業日の基準価額に、3.3%（税抜3.00%）を上限に各販売会社が定める手数料率を乗じて得た額とします。

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

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

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

・ お申込単位

各販売会社が定める単位とします。

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

取扱コースおよびお申込単位は、販売会社にお問い合わせください。

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

当初元本は1口当たり1円です。

・ 払込期日

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

2【換金（解約）手続等】

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

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

海外休業日には、解約の受付を行いません。

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

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

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

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、解約の受付を中止することおよびすでに受付けた解約の請求の受付を取り消すことができます。解約の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の解約の請求を撤回できます。ただし、受益者がその解約の請求を撤回しない場合には、当該受益権の解約価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に解約の請求を受付けたものとして、下記に準じて計算した価額とします。

・解約価額

解約価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

各ファンドの解約価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

・解約単位

各販売会社が定める単位とします。

解約単位は販売会社にお問い合わせください。

・解約代金の受渡日

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

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

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

<主な投資対象の時価評価方法の原則>

投資対象	評価方法
マザーファンド 受益証券	計算日の基準価額
株式	計算日における金融商品取引所等の最終相場

公社債等	計算日における以下のいずれかの価額 ・日本証券業協会が発表する売買参考統計値(平均値) ・金融商品取引業者、銀行などの提示する価額(売り気配相場を除きます。) ・価格情報会社の提供する価額
外貨建資産の円換算	計算日の国内における対顧客電信売買相場の仲値
外国為替予約の円換算	計算日の国内における対顧客先物売買相場の仲値

外国で取引されているものについては、計算時に知りうる直近の日

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

ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

(2)【保管】

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

信託期間は、2015年8月28日から原則として無期限です。

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

(4)【計算期間】

a. 計算期間は、原則として毎年4月12日から10月11日まで、および10月12日から翌年4月11日までとします。

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

(5)【その他】

イ.償還規定

a. 委託会社は、信託期間中において、信託契約を解約することが受益者のために有利であると認める場合、各ファンドにつき受益権口数が10億口を下回ることとなった場合、マザーファンドのベンチマークである対象インデックスが改廃された場合、またはやむを得ない事情が発生した場合は、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

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

ロ. 信託約款の変更等

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

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

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

八. 関係法人との契約の更改

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

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

二．公告

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

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

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

ホ．運用報告書

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

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

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

4【受益者の権利等】

収益分配金請求権

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

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

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

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

償還金請求権

受益者は、持ち分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

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

一部解約請求権

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

帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

D I A Mコア資産設計ファンド(堅実型)

D I A Mコア資産設計ファンド(積極型)

(1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドの計算期間は6ヵ月であるため、財務諸表は6ヵ月毎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10期計算期間(令和1年10月12日から令和2年4月13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9期 令和1年10月11日現在	第10期 令和2年4月13日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	131,035,915	85,814,451
親投資信託受益証券	15,294,045	27,829,835
流動資産合計	146,329,960	113,644,286
資産合計	146,329,960	113,644,286
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	41,097	36,595
未払委託者報酬	822,648	732,575
その他未払費用	3,044	2,621
流動負債合計	866,789	771,791
負債合計	866,789	771,791
純資産の部		
元本等		
元本	143,613,430	108,681,086
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	1,849,741	4,191,409
(分配準備積立金)	6,908,558	5,569,586
元本等合計	145,463,171	112,872,495
純資産合計	145,463,171	112,872,495
負債純資産合計	146,329,960	113,644,286

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第9期 自 平成31年4月12日 至 令和1年10月11日	第10期 自 令和1年10月12日 至 令和2年4月13日
営業収益		
有価証券売買等損益	4,815,426	5,075,790
営業収益合計	4,815,426	5,075,790
営業費用		
支払利息	39,446	11,337
受託者報酬	41,097	36,595
委託者報酬	822,648	732,575
その他費用	13,844	2,621
営業費用合計	917,035	783,128
営業利益又は営業損失()	5,732,461	4,292,662
経常利益又は経常損失()	5,732,461	4,292,662
当期純利益又は当期純損失()	5,732,461	4,292,662
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()	245,850	1,553,490
期首剰余金又は期首欠損金()	7,708,808	1,849,741
剰余金増加額又は欠損金減少額	35,781	79,768
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	35,781	79,768
剰余金減少額又は欠損金増加額	408,237	477,272
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	408,237	477,272
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金()	1,849,741	4,191,409

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第10期	
	自 令和1年10月12日 至 令和2年4月13日	
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。	
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日の取扱い 当ファンドは、原則として毎年4月11日及び10月11日を計算期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、当計算期間末日を令和2年4月13日としております。	

(貸借対照表に関する注記)

項目	第9期	第10期
	令和1年10月11日現在	令和2年4月13日現在
1. 期首元本額	150,275,904円	143,613,430円
期中追加設定元本額	1,311,733円	1,606,500円
期中一部解約元本額	7,974,207円	36,538,844円
2. 受益権の総数	143,613,430口	108,681,086口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第9期	第10期
	自 平成31年4月12日 至 令和1年10月11日	自 令和1年10月12日 至 令和2年4月13日
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(0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(3,615,715円)及び分配準備積立金(6,908,558円)より分配対象収益は10,524,273円(1万口当たり732.81円)ですが、分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(409,015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(2,804,355円)及び分配準備積立金(5,160,571円)より分配対象収益は8,373,941円(1万口当たり770.50円)ですが、分配を行っておりません。

（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9期 自 平成31年4月12日 至 令和1年10月11日	第10期 自 令和1年10月12日 至 令和2年4月13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、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性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	第9期 令和1年10月11日現在	第10期 令和2年4月13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9期 令和1年10月11日現在	第10期 令和2年4月13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	79,299	1,003,409
合計	79,299	1,003,409

(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9期 令和1年10月11日現在	第10期 令和2年4月13日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1,0129円 (10,129円)	1,0386円 (10,386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

令和2年4月13日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	国内株式パッシブ・ファンド (最適化法)・マザーファンド	3,680,922	8,298,638	
	国内債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	2,156,128	2,829,271	
	外国株式パッシブ・ファンド・ マザーファンド	827,983	2,767,533	
	外国債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	2,181,504	4,195,686	
	エマージング株式パッシブ・マ ザーファンド	7,287,401	6,968,941	
	エマージング債券パッシブ・マ ザーファンド	1,431,478	2,769,766	
親投資信託受益証券 合計		17,565,416	27,829,835	
合計			27,829,835	

(注) 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)【貸借対照表】

(単位:円)

	第9期 令和1年10月11日現在	第10期 令和2年4月13日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	233,373,987	133,569,220
親投資信託受益証券	50,054,337	73,894,710
流動資産合計	283,428,324	207,463,930
資産合計	283,428,324	207,463,930
負債の部		
流動負債		
未払解約金	30,205	-
未払受託者報酬	79,685	71,115
未払委託者報酬	1,594,836	1,423,320
その他未払費用	5,972	5,183
流動負債合計	1,710,698	1,499,618
負債合計	1,710,698	1,499,618
純資産の部		
元本等		
元本	286,906,788	204,592,403
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	5,189,162	1,371,909
(分配準備積立金)	14,854,053	11,271,271
元本等合計	281,717,626	205,964,312
純資産合計	281,717,626	205,964,312
負債純資産合計	283,428,324	207,463,930

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第9期 自 平成31年4月12日 至 令和1年10月11日	第10期 自 令和1年10月12日 至 令和2年4月13日
営業収益		
有価証券売買等損益	14,053,663	10,560,373
営業収益合計	14,053,663	10,560,373
営業費用		
支払利息	64,541	16,680
受託者報酬	79,685	71,115
委託者報酬	1,594,836	1,423,320
その他費用	16,772	5,183
営業費用合計	1,755,834	1,516,298
営業利益又は営業損失()	15,809,497	9,044,075
経常利益又は経常損失()	15,809,497	9,044,075
当期純利益又は当期純損失()	15,809,497	9,044,075
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()	727,479	4,096,546
期首剰余金又は期首欠損金()	10,584,608	5,189,162
剰余金増加額又は欠損金減少額	11,888	1,613,542
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	1,525,684
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	11,888	87,858
剰余金減少額又は欠損金増加額	703,640	-
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	703,640	-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金()	5,189,162	1,371,909

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第10期	
	自 令和1年10月12日 至 令和2年4月13日	
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。	
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日の取扱い 当ファンドは、原則として毎年4月11日及び10月11日を計算期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、当計算期間末日を令和2年4月13日としております。	

(貸借対照表に関する注記)

項目	第9期	第10期
	令和1年10月11日現在	令和2年4月13日現在
1. 期首元本額	300,150,602円	286,906,788円
期中追加設定元本額	6,903,112円	3,492,125円
期中一部解約元本額	20,146,926円	85,806,510円
2. 受益権の総数	286,906,788口	204,592,403口
3. 元本の欠損	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は5,189,162円であります。	-

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第9期	第10期
	自 平成31年4月12日 至 令和1年10月11日	自 令和1年10月12日 至 令和2年4月13日
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(0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(6,252,970円)及び分配準備積立金(14,854,053円)より分配対象収益は21,107,023円(1万口当たり735.67円)ですが、分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(829,035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(4,610,237円)及び分配準備積立金(10,442,236円)より分配対象収益は15,881,508円(1万口当たり776.25円)ですが、分配を行っておりません。

(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9期 自 平成31年4月12日 至 令和1年10月11日	第10期 自 令和1年10月12日 至 令和2年4月13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、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性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	第9期 令和1年10月11日現在	第10期 令和2年4月13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9期 令和1年10月11日現在	第10期 令和2年4月13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	147,177	2,388,131
合計	147,177	2,388,131

（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9期 令和1年10月11日現在	第10期 令和2年4月13日現在
1口当たり純資産額	0.9819円	1.0067円
(1万口当たり純資産額)	(9,819円)	(10,067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

令和2年4月13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	9,728,150	21,932,114	
	国内債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	5,651,203	7,415,508	
	外国株式パッシブ・ファンド・ マザーファンド	2,226,157	7,440,929	
	外国債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	5,802,523	11,159,992	
	エマージング株式パッシブ・マ ザーファンド	19,375,965	18,529,235	
	エマージング債券パッシブ・マ ザーファンド	3,833,238	7,416,932	
親投資信託受益証券 合計		46,617,236	73,894,710	
合計			73,894,710	

(注) 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」受益証券及び「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。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

令和2年4月13日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,512,791,880
国債証券	177,214,340,700
地方債証券	17,788,975,000
特殊債券	16,333,068,633
社債券	9,874,411,240
未収利息	301,223,605
前払費用	15,774,975
流動資産合計	225,040,586,033
資産合計	225,040,586,033
負債の部	
流動負債	
未払解約金	3,267,713,000
流動負債合計	3,267,713,000
負債合計	3,267,713,000
純資産の部	
元本等	
元本	169,011,359,928
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	52,761,513,105
元本等合計	221,772,873,033
純資産合計	221,772,873,033
負債純資産合計	225,040,586,033

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自 令和1年10月12日 至 令和2年4月13日
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	令和2年4月13日現在
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	186,660,155,663円
同期中追加設定元本額	62,884,613,844円
同期中一部解約元本額	80,533,409,579円
元本の内訳 ファンド名	
DIAM国内債券パッシブ・ファンド	19,075,861,961円
MITO ラップ型ファンド（安定型）	63,009,638円
MITO ラップ型ファンド（中立型）	58,706,805円
MITO ラップ型ファンド（積極型）	13,974,609円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	878,215,411円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	235,495,520円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	21,238,840円
たわらノーロード 国内債券	10,400,501,253円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	638,020,862円

たわらノーロード バランス(堅実型)	221,502,309円
たわらノーロード バランス(標準型)	336,551,760円
たわらノーロード バランス(積極型)	38,790,602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)	16,401,195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)	437,637,174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)	409,546,502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)	95,432,981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)	7,412,116円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	6,229,163円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	8,784,646円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	9,385,691円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	1,763,278円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	212,211円
DIAM国内債券インデックスファンド<DC年金>	14,034,961,092円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	6,607,734,353円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	8,640,074,651円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	3,319,983,500円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	1,799,375,618円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	1,889,584,511円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	317,181,619円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	75,324,315円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	2,202,944,320円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	5,536,922円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	3,317,374,997円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	904,780,443円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	203,004,179円
投資のソムリエ	5,535,840,135円
クルーズコントロール	772,283,506円
投資のソムリエ<DC年金>	522,018,321円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	2,877,309,695円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	318,204,336円
クルーズコントロール<DC年金>	880,213円
DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)	2,156,128円
DIAMコア資産設計ファンド(積極型)	5,651,203円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	1,000,536,144円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	9,795,399,108円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	4,979,306円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	3,378,904円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	9,107,413円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	10,018,666円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	253,759,559円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	459,589,464円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	3,277,176,407円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	1,019,363円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	478,193円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	636,141円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	451,841円
DIAMエマージング債券ファンド	9,450,010円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12(適格機関投資家限定)	1,245,370,912円
DIAM国内債券パッシブファンド(適格機関投資家向け)	10,103,127,638円
Oneコアポートフォリオ戦略ファンド(適格機関投資家限定)	414,273,420円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	325,121,487円

One収益追求型マルチアセット戦略ファンド(適格機関投資家限定)	6,293,250,059円
One収益追求型マルチアセット戦略ファンド(適格機関投資家限定)	6,271,883,975円
One収益追求型マルチアセット戦略ファンド(適格機関投資家限定)	6,324,036,938円
One収益追求型マルチアセット戦略ファンド(適格機関投資家限定)	6,297,786,997円
One収益追求型マルチアセット戦略ファンド(適格機関投資家限定)	6,308,458,386円
インカム重視マルチアセット運用ファンド(適格機関投資家限定)	1,515,507,864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)	200,353,714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)	146,147,625円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	52,970,461円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	123,066,038円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	58,796,733円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	25,419,928円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	75,102,287円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	152,254,785円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	4,315,815,047円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	2,387,727,857円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	4,407,757,196円
DIAMグローバル・アセット・バランスVA(適格機関投資家限定)	460,442,578円
DIAMグローバル・アセット・バランスVA2(適格機関投資家限定)	217,417,802円
DIAM アクサ グローバル バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	2,607,470,730円
DIAM世界アセットバランスファンドVA(適格機関投資家向け)	222,859,446円
DIAM世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	11,777,582円
DIAM世界バランスファンド35VA(適格機関投資家限定)	53,108,876円
DIAM世界アセットバランスファンド2VA(適格機関投資家限定)	2,351,672,150円
DIAM世界アセットバランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	68,292,577円
DIAM世界アセットバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	512,027,520円
DIAM世界アセットバランスファンド3VA(適格機関投資家限定)	889,503,099円
DIAM世界アセットバランスファンド4VA(適格機関投資家限定)	1,196,318,546円
DIAM世界バランス25VA(適格機関投資家限定)	326,678,101円
DIAM国内バランス30VA(適格機関投資家限定)	103,650,322円
DIAMバランス20VA(適格機関投資家限定)	108,848,061円
DIAMバランス40VA(適格機関投資家限定)	686,854円
DIAMバランス60VA(適格機関投資家限定)	365,393円
Oneコアポートフォリオ・プラス戦略ファンド(適格機関投資家限定)	1,683,151,841円
計	169,011,359,928円
2. 受益権の総数	169,011,359,928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 令和1年10月12日 至 令和2年4月13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。
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、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。
3 . 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	令和2年4月13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。
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。
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。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	令和2年4月13日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
国債証券	1,300,664,800
地方債証券	62,731,000
特殊債券	87,556,087
社債券	62,211,390
合計	1,513,163,277

(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(令和2年2月15日から令和2年4月13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)

	令和2年4月13日現在
1口当たり純資産額	1.3122円
(1万口当たり純資産額)	(13,122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

令和2年4月13日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
国債証券	406回 利付国庫債券(2年)	990,000,000	994,464,900	
	408回 利付国庫債券(2年)	800,000,000	803,992,000	
	409回 利付国庫債券(2年)	1,020,000,000	1,025,344,800	
	410回 利付国庫債券(2年)	500,000,000	502,730,000	
	129回 利付国庫債券(5年)	2,120,000,000	2,128,692,000	
	130回 利付国庫債券(5年)	1,780,000,000	1,788,561,800	
	131回 利付国庫債券(5年)	1,420,000,000	1,427,980,400	
	132回 利付国庫債券(5年)	1,200,000,000	1,207,356,000	
	133回 利付国庫債券(5年)	1,180,000,000	1,188,366,200	
	134回 利付国庫債券(5年)	1,180,000,000	1,189,074,200	
	135回 利付国庫債券(5年)	1,040,000,000	1,048,736,000	
	136回 利付国庫債券(5年)	1,250,000,000	1,261,200,000	
	137回 利付国庫債券(5年)	1,400,000,000	1,412,810,000	
	138回 利付国庫債券(5年)	1,450,000,000	1,463,702,500	
	139回 利付国庫債券(5年)	720,000,000	727,113,600	
	140回 利付国庫債券(5年)	1,390,000,000	1,404,025,100	
	141回 利付国庫債券(5年)	1,410,000,000	1,425,101,100	
	142回 利付国庫債券(5年)	1,600,000,000	1,617,344,000	
	2回 利付国庫債券(40年)	280,000,000	413,369,600	
	3回 利付国庫債券(40年)	290,000,000	432,424,800	
4回 利付国庫債券(40年)	430,000,000	647,502,600		
5回 利付国庫債券(40年)	480,000,000	700,430,400		
6回 利付国庫債券(40年)	450,000,000	648,297,000		
7回 利付国庫債券(40年)	480,000,000	666,427,200		

8回 利付国庫債券(40年)	520,000,000	677,294,800	
9回 利付国庫債券(40年)	880,000,000	862,382,400	
10回 利付国庫債券(40年)	780,000,000	895,408,800	
11回 利付国庫債券(40年)	580,000,000	646,816,000	
12回 利付国庫債券(40年)	480,000,000	485,534,400	
315回 利付国庫債券(10年)	700,000,000	711,494,000	
316回 利付国庫債券(10年)	500,000,000	507,620,000	
317回 利付国庫債券(10年)	1,100,000,000	1,120,339,000	
318回 利付国庫債券(10年)	1,400,000,000	1,423,870,000	
319回 利付国庫債券(10年)	800,000,000	817,368,000	
320回 利付国庫債券(10年)	900,000,000	918,018,000	
321回 利付国庫債券(10年)	800,000,000	818,376,000	
322回 利付国庫債券(10年)	500,000,000	510,515,000	
323回 利付国庫債券(10年)	750,000,000	767,670,000	
324回 利付国庫債券(10年)	1,050,000,000	1,072,438,500	
325回 利付国庫債券(10年)	1,300,000,000	1,331,161,000	
326回 利付国庫債券(10年)	500,000,000	511,800,000	
327回 利付国庫債券(10年)	1,200,000,000	1,231,560,000	
328回 利付国庫債券(10年)	1,590,000,000	1,626,061,200	
329回 利付国庫債券(10年)	1,770,000,000	1,824,940,800	
330回 利付国庫債券(10年)	450,000,000	465,003,000	
331回 利付国庫債券(10年)	650,000,000	667,179,500	
332回 利付国庫債券(10年)	1,860,000,000	1,912,042,800	
333回 利付国庫債券(10年)	1,990,000,000	2,049,023,400	
334回 利付国庫債券(10年)	1,930,000,000	1,990,100,200	
335回 利付国庫債券(10年)	1,940,000,000	1,995,406,400	

336回 利付国庫債券(10年)	700,000,000	720,951,000	
337回 利付国庫債券(10年)	1,340,000,000	1,367,470,000	
338回 利付国庫債券(10年)	2,030,000,000	2,083,916,800	
339回 利付国庫債券(10年)	1,940,000,000	1,994,688,600	
340回 利付国庫債券(10年)	1,900,000,000	1,956,183,000	
341回 利付国庫債券(10年)	1,910,000,000	1,958,151,100	
342回 利付国庫債券(10年)	1,980,000,000	2,007,819,000	
343回 利付国庫債券(10年)	1,780,000,000	1,806,077,000	
344回 利付国庫債券(10年)	1,930,000,000	1,958,795,600	
345回 利付国庫債券(10年)	1,760,000,000	1,786,681,600	
346回 利付国庫債券(10年)	1,820,000,000	1,847,973,400	
347回 利付国庫債券(10年)	1,710,000,000	1,736,624,700	
348回 利付国庫債券(10年)	2,030,000,000	2,061,952,200	
349回 利付国庫債券(10年)	1,760,000,000	1,787,948,800	
350回 利付国庫債券(10年)	2,250,000,000	2,285,055,000	
351回 利付国庫債券(10年)	1,660,000,000	1,685,298,400	
352回 利付国庫債券(10年)	1,720,000,000	1,744,802,400	
353回 利付国庫債券(10年)	1,540,000,000	1,560,820,800	
354回 利付国庫債券(10年)	1,470,000,000	1,488,433,800	
355回 利付国庫債券(10年)	1,450,000,000	1,466,675,000	
356回 利付国庫債券(10年)	1,580,000,000	1,597,158,800	
357回 利付国庫債券(10年)	1,460,000,000	1,474,848,200	
1回 利付国庫債券(30年)	100,000,000	126,479,000	
2回 利付国庫債券(30年)	100,000,000	123,651,000	
3回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	246,204,000	
4回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	260,390,000	
6回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	252,904,000	
8回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	240,982,000	

11回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	239,456,000	
12回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	250,538,000	
13回 利付国庫債券(30年)	100,000,000	124,224,000	
14回 利付国庫債券(30年)	290,000,000	377,237,800	
15回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	263,626,000	
16回 利付国庫債券(30年)	150,000,000	198,405,000	
17回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	262,582,000	
18回 利付国庫債券(30年)	320,000,000	416,521,600	
19回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	261,120,000	
20回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	267,874,000	
21回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	262,474,000	
22回 利付国庫債券(30年)	220,000,000	296,520,400	
23回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	270,414,000	
24回 利付国庫債券(30年)	190,000,000	257,691,300	
25回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	265,456,000	
26回 利付国庫債券(30年)	400,000,000	538,820,000	
27回 利付国庫債券(30年)	420,000,000	576,437,400	
28回 利付国庫債券(30年)	480,000,000	663,072,000	
29回 利付国庫債券(30年)	560,000,000	768,124,000	
30回 利付国庫債券(30年)	570,000,000	776,305,800	
31回 利付国庫債券(30年)	600,000,000	811,590,000	
32回 利付国庫債券(30年)	610,000,000	841,025,300	
33回 利付国庫債券(30年)	880,000,000	1,168,050,400	
34回 利付国庫債券(30年)	710,000,000	974,716,400	
35回 利付国庫債券(30年)	820,000,000	1,097,438,800	

36回 利付国庫債券(30年)	800,000,000	1,075,424,000	
37回 利付国庫債券(30年)	880,000,000	1,169,819,200	
38回 利付国庫債券(30年)	570,000,000	747,828,600	
39回 利付国庫債券(30年)	510,000,000	681,701,700	
40回 利付国庫債券(30年)	450,000,000	592,605,000	
41回 利付国庫債券(30年)	460,000,000	596,472,800	
42回 利付国庫債券(30年)	510,000,000	662,031,000	
43回 利付国庫債券(30年)	520,000,000	676,520,000	
44回 利付国庫債券(30年)	490,000,000	638,185,800	
45回 利付国庫債券(30年)	500,000,000	629,220,000	
46回 利付国庫債券(30年)	630,000,000	793,396,800	
47回 利付国庫債券(30年)	590,000,000	758,049,700	
48回 利付国庫債券(30年)	590,000,000	730,425,900	
49回 利付国庫債券(30年)	620,000,000	767,981,600	
50回 利付国庫債券(30年)	630,000,000	688,394,700	
51回 利付国庫債券(30年)	570,000,000	552,558,000	
52回 利付国庫債券(30年)	610,000,000	620,870,200	
53回 利付国庫債券(30年)	490,000,000	510,550,600	
54回 利付国庫債券(30年)	600,000,000	655,164,000	
55回 利付国庫債券(30年)	520,000,000	568,209,200	
56回 利付国庫債券(30年)	550,000,000	600,671,500	
57回 利付国庫債券(30年)	590,000,000	644,799,200	
58回 利付国庫債券(30年)	710,000,000	775,504,600	
59回 利付国庫債券(30年)	580,000,000	619,364,600	
60回 利付国庫債券(30年)	500,000,000	560,250,000	

61回 利付国庫債券(30年)	500,000,000	533,790,000	
62回 利付国庫債券(30年)	500,000,000	507,695,000	
63回 利付国庫債券(30年)	570,000,000	563,370,900	
64回 利付国庫債券(30年)	500,000,000	493,500,000	
65回 利付国庫債券(30年)	530,000,000	523,746,000	
72回 利付国庫債券(20年)	350,000,000	384,905,500	
73回 利付国庫債券(20年)	340,000,000	374,136,000	
75回 利付国庫債券(20年)	140,000,000	155,495,200	
78回 利付国庫債券(20年)	190,000,000	210,181,800	
81回 利付国庫債券(20年)	240,000,000	268,056,000	
85回 利付国庫債券(20年)	440,000,000	498,652,000	
88回 利付国庫債券(20年)	350,000,000	403,014,500	
90回 利付国庫債券(20年)	300,000,000	345,252,000	
92回 利付国庫債券(20年)	870,000,000	1,000,152,000	
93回 利付国庫債券(20年)	250,000,000	287,045,000	
94回 利付国庫債券(20年)	450,000,000	519,826,500	
95回 利付国庫債券(20年)	350,000,000	411,075,000	
97回 利付国庫債券(20年)	500,000,000	586,365,000	
99回 利付国庫債券(20年)	450,000,000	526,666,500	
100回 利付国庫債券(20年)	600,000,000	709,758,000	
102回 利付国庫債券(20年)	360,000,000	433,540,800	
105回 利付国庫債券(20年)	400,000,000	473,452,000	
106回 利付国庫債券(20年)	350,000,000	417,242,000	
107回 利付国庫債券(20年)	400,000,000	475,016,000	
108回 利付国庫債券(20年)	400,000,000	468,036,000	

109回 利付国庫債券(20年)	220,000,000	258,139,200	
110回 利付国庫債券(20年)	330,000,000	393,122,400	
111回 利付国庫債券(20年)	290,000,000	349,392,000	
112回 利付国庫債券(20年)	550,000,000	657,574,500	
113回 利付国庫債券(20年)	770,000,000	923,876,800	
114回 利付国庫債券(20年)	550,000,000	662,178,000	
115回 利付国庫債券(20年)	200,000,000	242,730,000	
116回 利付国庫債券(20年)	320,000,000	389,916,800	
117回 利付国庫債券(20年)	650,000,000	785,564,000	
118回 利付国庫債券(20年)	310,000,000	372,567,300	
119回 利付国庫債券(20年)	300,000,000	354,447,000	
120回 利付国庫債券(20年)	400,000,000	464,464,000	
121回 利付国庫債券(20年)	540,000,000	645,046,200	
122回 利付国庫債券(20年)	350,000,000	414,445,500	
123回 利付国庫債券(20年)	520,000,000	633,630,400	
124回 利付国庫債券(20年)	390,000,000	471,077,100	
125回 利付国庫債券(20年)	360,000,000	443,664,000	
126回 利付国庫債券(20年)	340,000,000	411,631,200	
127回 利付国庫債券(20年)	300,000,000	359,946,000	
128回 利付国庫債券(20年)	550,000,000	661,683,000	
129回 利付国庫債券(20年)	290,000,000	345,671,300	
130回 利付国庫債券(20年)	580,000,000	692,653,400	
131回 利付国庫債券(20年)	300,000,000	354,870,000	
132回 利付国庫債券(20年)	270,000,000	319,893,300	
133回 利付国庫債券(20年)	570,000,000	681,913,800	

134回 利付国庫債券(20年)	430,000,000	515,277,600	
135回 利付国庫債券(20年)	350,000,000	415,292,500	
136回 利付国庫債券(20年)	300,000,000	352,434,000	
137回 利付国庫債券(20年)	350,000,000	416,153,500	
138回 利付国庫債券(20年)	280,000,000	326,202,800	
139回 利付国庫債券(20年)	350,000,000	411,953,500	
140回 利付国庫債券(20年)	960,000,000	1,143,744,000	
141回 利付国庫債券(20年)	650,000,000	775,411,000	
142回 利付国庫債券(20年)	400,000,000	482,156,000	
143回 利付国庫債券(20年)	560,000,000	662,160,800	
144回 利付国庫債券(20年)	350,000,000	409,416,000	
145回 利付国庫債券(20年)	890,000,000	1,065,579,200	
146回 利付国庫債券(20年)	850,000,000	1,019,481,500	
147回 利付国庫債券(20年)	980,000,000	1,164,298,800	
148回 利付国庫債券(20年)	790,000,000	929,822,100	
149回 利付国庫債券(20年)	900,000,000	1,060,632,000	
150回 利付国庫債券(20年)	950,000,000	1,108,384,000	
151回 利付国庫債券(20年)	1,030,000,000	1,173,582,000	
152回 利付国庫債券(20年)	890,000,000	1,015,356,500	
153回 利付国庫債券(20年)	890,000,000	1,029,712,200	
154回 利付国庫債券(20年)	850,000,000	971,448,000	
155回 利付国庫債券(20年)	830,000,000	923,947,700	
156回 利付国庫債券(20年)	840,000,000	857,329,200	
157回 利付国庫債券(20年)	850,000,000	840,114,500	
158回 利付国庫債券(20年)	860,000,000	890,426,800	

	159回 利付国庫債券(20年)	850,000,000	893,350,000	
	160回 利付国庫債券(20年)	650,000,000	693,569,500	
	161回 利付国庫債券(20年)	800,000,000	840,592,000	
	162回 利付国庫債券(20年)	760,000,000	798,433,200	
	163回 利付国庫債券(20年)	770,000,000	808,792,600	
	164回 利付国庫債券(20年)	910,000,000	940,166,500	
	165回 利付国庫債券(20年)	740,000,000	764,198,000	
	166回 利付国庫債券(20年)	750,000,000	801,007,500	
	167回 利付国庫債券(20年)	800,000,000	825,384,000	
	168回 利付国庫債券(20年)	700,000,000	709,359,000	
	169回 利付国庫債券(20年)	750,000,000	746,610,000	
	170回 利付国庫債券(20年)	780,000,000	776,427,600	
	171回 利付国庫債券(20年)	660,000,000	656,944,200	
	国債証券 合計	161,970,000,000	177,214,340,700	
地方債証券	697回 東京都公募公債	500,000,000	506,375,000	
	701回 東京都公募公債	700,000,000	709,604,000	
	708回 東京都公募公債	500,000,000	509,395,000	
	720回 東京都公募公債	300,000,000	308,010,000	
	726回 東京都公募公債	400,000,000	410,312,000	
	5回 東京都公募公債 20年	100,000,000	110,216,000	
	9回 東京都公募公債 20年	200,000,000	228,976,000	
	10回 東京都公募公債 20年	300,000,000	343,095,000	
	30年度14回 北海道公募公債	300,000,000	300,900,000	
	194回 神奈川県公募公債	300,000,000	306,129,000	
	208回 神奈川県公募公債	300,000,000	306,471,000	
	356回 大阪府公募公債	200,000,000	203,476,000	
	364回 大阪府公募公債	300,000,000	305,523,000	
	374回 大阪府公募公債	300,000,000	308,844,000	
	26年度11回 京都府公募公債	350,000,000	357,217,000	
	26年度17回 兵庫県公募公債	200,000,000	204,036,000	
	1回 兵庫県公募公債(12年)	300,000,000	313,278,000	
	23年度9回 静岡県公募公債	200,000,000	203,282,000	
	8回 静岡県公募公債 15年	200,000,000	213,012,000	

1回 静岡県公募公債 20年	100,000,000	111,396,000	
23年度20回 愛知県公募公債	500,000,000	510,295,000	
25年度4回 愛知県公募公債	300,000,000	307,737,000	
30年度19回 愛知県公募公債	200,000,000	199,556,000	
23年度2回 埼玉県公募公債	200,000,000	202,586,000	
26年度5回 埼玉県公募公債	400,000,000	409,876,000	
14回 埼玉県公募公債 20年	300,000,000	348,777,000	
25年度11回 福岡県公募公債	200,000,000	205,138,000	
24年度2回 福岡県公募公債(20年)	300,000,000	348,264,000	
24年度7回 千葉県公募公債	300,000,000	305,730,000	
25年度5回 千葉県公募公債	200,000,000	205,446,000	
14回 千葉県公募公債 20年	100,000,000	110,266,000	
99回 共同発行市場公募地方債	700,000,000	709,569,000	
106回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	305,031,000	
109回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	510,360,000	
111回 共同発行市場公募地方債	700,000,000	713,216,000	
119回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	511,035,000	
121回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	508,175,000	
128回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	306,825,000	
142回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	507,400,000	
144回 共同発行市場公募地方債	400,000,000	408,592,000	
146回 共同発行市場公募地方債	400,000,000	409,732,000	
148回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	512,575,000	
166回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	503,135,000	
29年度4回 大阪市公募公債	200,000,000	200,590,000	
488回 名古屋市公募公債10年	450,000,000	461,227,500	
4回 京都市公募公債 20年	100,000,000	115,517,000	
30年度7回 神戸市公募公債 30年	300,000,000	302,850,000	
23年度4回 横浜市公募公債	450,000,000	457,222,500	
25年度2回 横浜市公募公債	400,000,000	411,140,000	
25年度4回 札幌市公募公債	200,000,000	204,894,000	

	第91回 川崎市公募公債	200,000,000	200,748,000	
	17回 北九州市公募公債 20年	100,000,000	115,923,000	
地方債証券 合計		17,250,000,000	17,788,975,000	
特殊債券	78回 日本政策投資銀行債券	200,000,000	201,316,000	
	19回 高速道路機構債	150,000,000	230,148,000	
	26回 高速道路機構債	200,000,000	275,808,000	
	96回 高速道路機構債	700,000,000	713,237,000	
	116回 高速道路機構債	100,000,000	102,394,000	
	172回 高速道路機構債	200,000,000	196,284,000	
	18回政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	309,240,000	
	121回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	586,900,000	
	149回政保日本高速道路保有・債務返済機構	400,000,000	406,724,000	
	189回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	508,140,000	
	193回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	514,075,000	
	195回政保日本高速道路保有・債務返済機構	330,000,000	339,853,800	
	239回政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	336,000,000	
	241回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	510,915,000	
	260回政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	241,128,000	
	309回政保日本高速道路保有・債務返済機構	800,000,000	805,056,000	
	319回政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	208,112,000	
	28回 日本道路・機構承継債	400,000,000	531,344,000	
	1回 地方公共団体金融機構債券 20年	200,000,000	232,942,000	
	24回 地方公共団体金融機構債券	300,000,000	304,002,000	
	19回 地方公共団体金融機構債券	200,000,000	236,426,000	
	36回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	305,652,000	
	24回 地方公共団体金融機構債券 20年	200,000,000	234,224,000	
	44回 政保地方公共団体金融機構債券	400,000,000	409,192,000	
	50回 政保地方公共団体金融機構債券	500,000,000	514,720,000	
	56回 政保地方公共団体金融機構債券	542,000,000	557,159,740	
	64回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	307,077,000	

44回 地方公共団体金融機構債券 20年	200,000,000	227,008,000	
83回 地方公共団体金融機構債券 10年	400,000,000	399,756,000	
15回 日本政策金融公庫債券	200,000,000	235,824,000	
109回 都市再生機構債券	200,000,000	215,284,000	
39回 住宅金融支援機構債券	200,000,000	237,344,000	
75回 住宅金融支援機構債券	350,000,000	420,871,500	
222回 住宅金融支援機構債券	300,000,000	301,806,000	
230回 住宅金融支援機構債券	300,000,000	302,793,000	
6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	37,212,000	38,417,296	
8回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	26,148,000	27,102,663	
9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	39,159,000	40,647,042	
2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	41,628,000	43,572,443	
13回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	12,325,000	12,512,093	
14回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	61,950,000	62,749,155	
43回貸付債権担保住宅金融公庫債券	13,896,000	14,610,810	
44回貸付債権担保住宅金融公庫債券	52,940,000	55,212,184	
51回貸付債権担保住宅金融公庫債券	39,621,000	41,265,271	
1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	65,295,000	67,417,087	
29回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	139,735,000	150,547,694	
36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	234,776,000	249,167,768	
114回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	255,699,000	257,102,787	
126回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	269,475,000	272,485,035	
128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	270,273,000	273,097,352	
131回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	274,569,000	276,965,987	
132回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	274,383,000	276,781,107	
137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	282,240,000	286,072,819	
い第828号 利付商工債	100,000,000	99,821,000	
325回 利附信金中金債	400,000,000	399,448,000	
220号 利附商工債(3年)	300,000,000	299,931,000	

	15回 国際協力機構債	100,000,000	117,336,000	
	55回 鉄道建設運輸施設債	500,000,000	512,050,000	
特殊債券 合計		15,363,324,000	16,333,068,633	
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	199,194,000	
	6回 クレディ・アグリコル・ エス・エー円貨社債	200,000,000	203,690,000	
	34回 西日本高速道路債券	200,000,000	202,394,000	
	19回 三菱ケミカルホール ディングス社債	100,000,000	100,789,000	
	6回 J Xホールディングス社 債	100,000,000	102,877,000	
	14回 プリチストン社債	200,000,000	199,238,000	
	23回 ジェイ エフ イー ホールディングス社債	100,000,000	99,665,000	
	13回 パナソニック社債	100,000,000	100,689,000	
	14回 トヨタ自動車社債	200,000,000	204,630,000	
	16回 トヨタ自動車社債	200,000,000	203,312,000	
	94回 丸紅社債	100,000,000	102,220,000	
	45回 住友商事社債	100,000,000	101,723,000	
	47回 住友商事社債	100,000,000	101,783,000	
	48回 クレディセゾン社債	100,000,000	102,262,000	
	57回 東京三菱銀行社債	200,000,000	210,580,000	
	32回 三菱東京UFJ銀行劣 後社債	300,000,000	304,332,000	
	10回 三井住友信託銀行社債	200,000,000	203,448,000	
	10回 セブン銀行社債	100,000,000	101,994,000	
	47回 日立キャピタル社債	200,000,000	202,920,000	
	56回 三菱UFJリース社債	200,000,000	199,624,000	
	72回 三菱地所社債	100,000,000	108,854,000	
	108回 住友不動産社債	200,000,000	199,508,000	
	80回 東京急行電鉄社債	100,000,000	106,945,000	
	43回 京浜急行電鉄社債	100,000,000	99,711,000	
	19回 東日本旅客鉄道社債	100,000,000	104,152,000	
	21回 東日本旅客鉄道社債	100,000,000	104,555,000	
	39回 東日本旅客鉄道社債	300,000,000	327,732,000	
	42回 東日本旅客鉄道社債	200,000,000	219,950,000	
	9回 西日本旅客鉄道社債	200,000,000	208,334,000	
	10回 西日本旅客鉄道社債	300,000,000	319,068,000	
	6回 東海旅客鉄道社債	100,000,000	104,146,000	
	11回 東海旅客鉄道社債	300,000,000	307,947,000	
	13回 東海旅客鉄道社債	200,000,000	213,366,000	
	14回 東海旅客鉄道社債	100,000,000	107,822,000	
	4回 東京地下鉄社債	120,000,000	135,360,000	
	518回 中部電力社債	200,000,000	199,916,000	
	377回 中国電力社債	400,000,000	412,040,000	
	301回 北陸電力社債	100,000,000	102,759,000	
	307回 北陸電力社債	100,000,000	104,183,000	
	471回 東北電力社債	400,000,000	413,236,000	
	253回 四国電力社債	200,000,000	204,844,000	

4 2 4 回	九州電力社債	200,000,000	206,896,000	
4 2 6 回	九州電力社債	400,000,000	411,832,000	
3 2 0 回	北海道電力社債	200,000,000	201,300,000	
3 2 1 回	北海道電力社債	161,000,000	164,838,240	
3 4 0 回	北海道電力社債	300,000,000	300,096,000	
1 3 回	電源開発社債	200,000,000	217,142,000	
3 8 回	電源開発社債	300,000,000	307,791,000	
2 3 回	東京瓦斯社債	300,000,000	307,950,000	
1 8 回	大阪ガス社債	100,000,000	103,505,000	
2 7 回	NTTデータ社債	100,000,000	102,051,000	
7 回	ファーストリテイリング社債	200,000,000	199,218,000	
社債券 合計		9,581,000,000	9,874,411,240	
合計			221,210,795,573	

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。

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

令和2年4月13日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	5,977,742,243
株式	194,998,432,110
派生商品評価勘定	118,730,550
未収入金	6,300,000
未収配当金	2,418,246,263
流動資産合計	203,519,451,166
資産合計	
203,519,451,166	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	67,003,000
前受金	85,683,000
未払金	3,224,713,182
未払解約金	34,209,000
流動負債合計	3,411,608,182
負債合計	
3,411,608,182	
純資産の部	
元本等	
元本	88,759,178,632
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	111,348,664,352
元本等合計	200,107,842,984
純資産合計	200,107,842,984
負債純資産合計	203,519,451,166

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自 令和1年10月12日 至 令和2年4月13日
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	令和2年4月13日現在
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	93,946,912,393円
同期中追加設定元本額	32,404,639,881円
同期中一部解約元本額	37,592,373,642円
元本の内訳	

ファンド名	
One DC 国内株式インデックスファンド	14,364,578,391円
DIAM国内株式パッシブ・ファンド	2,726,163,743円
MITO ラップ型ファンド(安定型)	2,909,863円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	6,193,941円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	10,689,013円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	40,736,848円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	24,830,116円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	16,333,593円
たわらノーロード TOPIX	663,939,103円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	390,537,535円
たわらノーロード バランス(堅実型)	15,154,115円
たわらノーロード バランス(標準型)	85,704,893円
たわらノーロード バランス(積極型)	122,911,964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)	610,762円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定型)	38,571,048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)	115,942,262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)	72,110,987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)	138,440,965円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	257,220円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	1,005,616円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	2,073,309円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	1,454,916円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	4,275,755円
DIAM国内株式インデックスファンド<DC年金>	36,179,245,348円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	1,150,180,457円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	3,642,968,557円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	3,593,427,943円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	366,923,270円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	1,269,637,940円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	1,128,414,333円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	38,326,565円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	1,121,011,998円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	22,648,768円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	355,727,895円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	265,356,133円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	432,240,536円
投資のソムリエ	4,741,564,387円
クルーズコントロール	443,891,157円
投資のソムリエ<DC年金>	443,546,033円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	305,718,385円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	339,585,825円
クルーズコントロール<DC年金>	505,379円
DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)	3,680,922円
DIAMコア資産設計ファンド(積極型)	9,728,150円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	119,730,923円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	1,181,063,661円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	8,502,492円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	5,765,997円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	1,096,948円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	17,106,373円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	58,113,321円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	581,641,746円

9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	261,939,112円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	1,712,295円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	823,191円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	1,063,338円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	221,527円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12(適格機関投資家限定)	3,359,098円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	57,722,064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)	218,722,425円
インカム重視マルチアセット運用ファンド(適格機関投資家限定)	4,168,593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)	97,429,762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)	213,457,746円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	13,268,752円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	47,886,605円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	13,721,355円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	11,144,221円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	29,209,964円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	59,228,211円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	943,992,831円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	928,793,674円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	2,572,840,549円
DIAMグローバル・アセット・バランスVA(適格機関投資家限定)	178,856,303円
DIAMグローバル・アセット・バランスVA2(適格機関投資家限定)	50,456,291円
DIAM アクサ グローバル バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	506,157,077円
DIAM世界アセットバランスファンドVA(適格機関投資家向け)	130,135,146円
DIAM世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	2,288,047円
DIAM世界バランスファンド35VA(適格機関投資家限定)	38,824,926円
DIAM世界アセットバランスファンド2VA(適格機関投資家限定)	514,629,621円
DIAM世界アセットバランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	39,860,610円
DIAM世界アセットバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	149,372,607円
DIAM世界アセットバランスファンド3VA(適格機関投資家限定)	389,374,821円
DIAM世界アセットバランスファンド4VA(適格機関投資家限定)	418,806,872円
DIAM世界バランス25VA(適格機関投資家限定)	58,008,406円
DIAM国内バランス30VA(適格機関投資家限定)	25,906,914円
DIAMバランス20VA(適格機関投資家限定)	6,344,928円
DIAMバランス40VA(適格機関投資家限定)	114,082円
DIAMバランス60VA(適格機関投資家限定)	127,459円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA(1212)(適格機関投資家限定)	475,341,313円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA(1303)(適格機関投資家限定)	1,523,201,601円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA(1306)(適格機関投資家限定)	2,016,755,536円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA(1309)(適格機関投資家限定)	81,133,359円
計	88,759,178,632円

2. 受益権の総数	88,759,178,632口
3. 差入代用有価証券 株式	1,631,250,000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 令和1年10月12日 至 令和2年4月13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。
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、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 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。
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。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	令和2年4月13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。
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。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	令和2年4月13日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
株式	40,213,419,192
合計	40,213,419,192

(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(令和2年2月8日から令和2年4月13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	令和2年4月13日現在			
	契約額等（円）	うち 1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引 先物取引 買建	5,087,352,000	-	5,139,200,000	51,848,000
合計	5,087,352,000	-	5,139,200,000	51,848,000

(注) 時価の算定方法

株価指数先物取引

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

令和2年4月13日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.2545円 (22,545円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

令和2年4月13日現在

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
極洋	4,700	2,541.00	11,942,700	
日本水産	134,000	472.00	63,248,000	
マルハニチロ	19,300	2,269.00	43,791,700	
ハウスイ	700	698.00	488,600	
カネコ種苗	4,100	1,453.00	5,957,300	
サカタのタネ	16,100	3,330.00	53,613,000	
ホクト	10,300	1,901.00	19,580,300	
ホクリヨウ	2,200	589.00	1,295,800	
ヒノキヤグループ	3,300	1,420.00	4,686,000	
ショーボンドホールディングス	20,800	4,275.00	88,920,000	
ミライト・ホールディングス	39,800	1,333.00	53,053,400	
タマホーム	7,200	1,184.00	8,524,800	
サンヨーホームズ	1,000	600.00	600,000	
日本アクア	5,200	623.00	3,239,600	
ファーストコーポレーション	4,200	419.00	1,759,800	
ベステラ	2,400	954.00	2,289,600	
TATERU	27,800	112.00	3,113,600	
スペースバリューホールディングス	16,400	323.00	5,297,200	
住石ホールディングス	27,800	117.00	3,252,600	

日鉄鉱業	3,000	4,185.00	12,555,000
三井松島ホールディングス	5,200	866.00	4,503,200
国際石油開発帝石	537,300	662.50	355,961,250
石油資源開発	17,500	1,947.00	34,072,500
K&Oエナジーグループ	6,500	1,539.00	10,003,500
ダイセキ環境ソリューション	2,600	959.00	2,493,400
第一カッター興業	1,700	1,593.00	2,708,100
安藤・間	79,800	669.00	53,386,200
東急建設	39,200	542.00	21,246,400
コムシスホールディングス	47,600	2,804.00	133,470,400
ビーアールホールディングス	14,800	467.00	6,911,600
高松コンストラクショングループ	8,300	2,300.00	19,090,000
東建コーポレーション	4,100	7,610.00	31,201,000
ソネック	1,500	703.00	1,054,500
ヤマウラ	5,800	711.00	4,123,800
大成建設	103,200	3,265.00	336,948,000
大林組	309,200	933.00	288,483,600
清水建設	313,900	823.00	258,339,700
飛島建設	8,900	1,001.00	8,908,900
長谷工コーポレーション	119,800	1,142.00	136,811,600
松井建設	12,000	618.00	7,416,000
銭高組	1,400	3,610.00	5,054,000
鹿島建設	242,800	1,110.00	269,508,000
不動テトラ	8,100	1,266.00	10,254,600
大末建設	3,600	725.00	2,610,000
鉄建建設	6,700	2,249.00	15,068,300
西松建設	24,000	1,964.00	47,136,000
三井住友建設	74,900	436.00	32,656,400
大豊建設	6,900	2,205.00	15,214,500
前田建設工業	77,500	854.00	66,185,000
佐田建設	6,800	345.00	2,346,000
ナカノフドー建設	8,300	332.00	2,755,600
奥村組	16,900	2,293.00	38,751,700
東鉄工業	13,300	2,744.00	36,495,200
イチケン	2,200	1,134.00	2,494,800
富士ピー・エス	4,600	528.00	2,428,800
浅沼組	3,500	3,375.00	11,812,500
戸田建設	128,400	635.00	81,534,000
熊谷組	14,400	2,359.00	33,969,600
北野建設	1,900	2,501.00	4,751,900
植木組	1,400	2,493.00	3,490,200
矢作建設工業	13,600	747.00	10,159,200
ピーエス三菱	10,400	537.00	5,584,800
日本ハウスホールディングス	21,600	283.00	6,112,800
大東建託	37,000	10,145.00	375,365,000
新日本建設	13,000	784.00	10,192,000
N I P P O	25,600	2,344.00	60,006,400
東亜道路工業	2,000	2,908.00	5,816,000
前田道路	27,200	2,015.00	54,808,000
日本道路	2,900	6,320.00	18,328,000

東亜建設工業	9,700	1,375.00	13,337,500
日本国土開発	21,800	558.00	12,164,400
若築建設	5,600	1,183.00	6,624,800
東洋建設	34,700	440.00	15,268,000
五洋建設	122,700	537.00	65,889,900
世紀東急工業	14,900	795.00	11,845,500
福田組	3,600	4,065.00	14,634,000
日本ドライケミカル	2,400	1,362.00	3,268,800
住友林業	78,300	1,315.00	102,964,500
日本基礎技術	10,400	388.00	4,035,200
巴コーポレーション	13,700	333.00	4,562,100
大和ハウス工業	305,900	2,664.00	814,917,600
ライト工業	17,700	1,293.00	22,886,100
積水ハウス	338,300	1,804.50	610,462,350
日特建設	8,200	726.00	5,953,200
北陸電気工事	5,200	902.00	4,690,400
ユアテック	17,400	597.00	10,387,800
四電工	1,700	2,394.00	4,069,800
中電工	12,400	2,131.00	26,424,400
関電工	43,900	849.00	37,271,100
きんでん	73,500	1,683.00	123,700,500
東京エネシス	10,200	775.00	7,905,000
トーエネック	3,000	3,170.00	9,510,000
住友電設	8,800	2,172.00	19,113,600
日本電設工業	17,000	2,191.00	37,247,000
協和エクシオ	46,900	2,539.00	119,079,100
新日本空調	8,200	2,138.00	17,531,600
日本工営	6,400	2,773.00	17,747,200
九電工	21,700	2,825.00	61,302,500
三機工業	22,400	1,215.00	27,216,000
日揮ホールディングス	95,200	986.00	93,867,200
中外炉工業	3,300	1,442.00	4,758,600
ヤマト	9,900	634.00	6,276,600
太平電業	7,400	2,180.00	16,132,000
高砂熱学工業	26,800	1,734.00	46,471,200
三晃金属工業	1,400	2,060.00	2,884,000
N E C ネットズエスアイ	9,100	4,490.00	40,859,000
朝日工業社	2,100	2,959.00	6,213,900
明星工業	19,900	715.00	14,228,500
大気社	15,000	3,045.00	45,675,000
ダイダン	7,300	2,718.00	19,841,400
日比谷総合設備	9,900	1,851.00	18,324,900
日本製粉	28,900	1,662.00	48,031,800
日清製粉グループ本社	111,800	1,620.00	181,116,000
日東富士製粉	700	5,840.00	4,088,000
昭和産業	9,100	3,255.00	29,620,500
鳥越製粉	8,800	849.00	7,471,200
中部飼料	12,000	1,559.00	18,708,000
フィード・ワン	66,600	158.00	10,522,800
東洋精糖	1,800	1,185.00	2,133,000

日本甜菜製糖	5,100	1,679.00	8,562,900
三井製糖	8,700	2,091.00	18,191,700
塩水港精糖	11,100	196.00	2,175,600
日新製糖	4,600	1,896.00	8,721,600
L I F U L L	33,000	321.00	10,593,000
ジェイエイシーリクルートメント	6,400	1,031.00	6,598,400
日本M&Aセンター	71,200	3,185.00	226,772,000
メンバーズ	2,800	1,304.00	3,651,200
中広	1,300	464.00	603,200
UTグループ	11,200	1,046.00	11,715,200
アイティメディア	2,800	860.00	2,408,000
タケエイ	9,000	773.00	6,957,000
E・Jホールディングス	1,400	1,326.00	1,856,400
ビーネックスグループ	11,800	503.00	5,935,400
コシダカホールディングス	22,700	377.00	8,557,900
アルトナー	2,300	603.00	1,386,900
パソナグループ	10,400	899.00	9,349,600
C D S	2,400	1,227.00	2,944,800
リンクアンドモチベーション	20,800	294.00	6,115,200
G C A	11,500	575.00	6,612,500
エス・エム・エス	29,300	2,085.00	61,090,500
サニーサイドアップグループ	2,500	552.00	1,380,000
パーソルホールディングス	94,300	975.00	91,942,500
リニカル	4,500	859.00	3,865,500
クックパッド	32,700	299.00	9,777,300
エスクリ	2,900	347.00	1,006,300
アイ・ケイ・ケイ	4,600	612.00	2,815,200
森永製菓	23,400	4,335.00	101,439,000
中村屋	2,500	3,810.00	9,525,000
江崎グリコ	29,300	4,590.00	134,487,000
名糖産業	4,700	1,311.00	6,161,700
井村屋グループ	4,300	1,911.00	8,217,300
不二家	5,400	2,014.00	10,875,600
山崎製パン	74,200	2,201.00	163,314,200
第一屋製パン	1,800	889.00	1,600,200
モロゾフ	1,700	5,130.00	8,721,000
亀田製菓	5,600	5,090.00	28,504,000
寿スピリッツ	9,600	4,270.00	40,992,000
カルビー	45,100	3,030.00	136,653,000
森永乳業	18,300	4,210.00	77,043,000
六甲バター	6,600	1,393.00	9,193,800
ヤクルト本社	68,000	6,760.00	459,680,000
明治ホールディングス	65,500	7,500.00	491,250,000
雪印メグミルク	23,900	2,334.00	55,782,600
プリマハム	15,500	2,357.00	36,533,500
日本ハム	37,900	3,440.00	130,376,000
林兼産業	3,500	541.00	1,893,500
丸大食品	10,500	1,900.00	19,950,000
S F o o d s	7,900	2,236.00	17,664,400
柿安本店	3,500	2,171.00	7,598,500

伊藤ハム米久ホールディングス	63,600	619.00	39,368,400	
学情	3,500	1,103.00	3,860,500	
スタジオアリス	4,800	1,496.00	7,180,800	
クロスキャット	2,600	1,041.00	2,706,600	
シミックホールディングス	5,100	1,436.00	7,323,600	
エブコ	1,600	798.00	1,276,800	
システナ	34,600	1,456.00	50,377,600	
N J S	2,100	1,513.00	3,177,300	
デジタルアーツ	4,700	5,340.00	25,098,000	
日鉄ソリューションズ	14,500	2,671.00	38,729,500	
総合警備保障	37,500	5,220.00	195,750,000	
キューブシステム	5,100	616.00	3,141,600	
いちご	123,700	254.00	31,419,800	
エイジア	1,800	1,238.00	2,228,400	
日本駐車場開発	108,600	133.00	14,443,800	
コア	4,200	1,164.00	4,888,800	
カカクコム	69,500	2,007.00	139,486,500	
アイロムグループ	3,500	1,235.00	4,322,500	
セントケア・ホールディング	6,200	393.00	2,436,600	
サイネックス	1,600	583.00	932,800	
ルネサンス	5,300	902.00	4,780,600	
ディップ	13,300	1,697.00	22,570,100	
S B Sホールディングス	8,600	1,787.00	15,368,200	
オプトホールディング	5,000	1,538.00	7,690,000	
新日本科学	10,300	568.00	5,850,400	
ツクイ	22,600	389.00	8,791,400	
キャリアデザインセンター	2,400	839.00	2,013,600	
ベネフィット・ワン	25,800	1,623.00	41,873,400	
エムスリー	207,700	3,700.00	768,490,000	
ツカダ・グローバルホールディング	6,100	333.00	2,031,300	
プラス	800	395.00	316,000	
アウトソーシング	53,900	432.00	23,284,800	
ウェルネット	9,800	463.00	4,537,400	
ワールドホールディングス	3,000	1,245.00	3,735,000	
ディー・エヌ・エー	46,200	1,133.00	52,344,600	
博報堂D Yホールディングス	131,000	1,051.00	137,681,000	
ぐるなび	16,800	528.00	8,870,400	
タカミヤ	10,100	405.00	4,090,500	
ジャパンベストレスキューシステム	6,500	642.00	4,173,000	
ファンコミュニケーションズ	25,900	421.00	10,903,900	
ライク	3,000	1,192.00	3,576,000	
ビジネス・ブレークスルー	4,100	362.00	1,484,200	
エスプール	18,200	725.00	13,195,000	
W D Bホールディングス	4,300	2,242.00	9,640,600	
ティア	5,600	490.00	2,744,000	
C D G	900	1,393.00	1,253,700	
バリューコマース	5,200	1,755.00	9,126,000	
インフォマート	103,400	698.00	72,173,200	
サッポロホールディングス	33,800	1,982.00	66,991,600	
アサヒグループホールディングス	207,300	3,537.00	733,220,100	

キリンホールディングス	419,600	2,095.00	879,062,000	
宝ホールディングス	73,400	725.00	53,215,000	
オエノンホールディングス	26,100	404.00	10,544,400	
養命酒製造	2,900	1,900.00	5,510,000	
コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールディングス	69,400	1,939.00	134,566,600	
サントリー食品インターナショナル	66,300	4,045.00	268,183,500	
ダイドーグループホールディングス	5,100	4,010.00	20,451,000	
伊藤園	30,200	5,880.00	177,576,000	
キーコーヒー	9,800	2,234.00	21,893,200	
ユニカフェ	2,600	866.00	2,251,600	
ジャパンフーズ	1,500	1,095.00	1,642,500	
日清オイリオグループ	12,700	3,485.00	44,259,500	
不二製油グループ本社	24,200	2,570.00	62,194,000	
かどや製油	1,000	3,425.00	3,425,000	
J・オイルミルズ	5,100	4,215.00	21,496,500	
ローソン	24,500	5,360.00	131,320,000	
サンエー	8,100	4,490.00	36,369,000	
カワチ薬品	7,500	2,288.00	17,160,000	
エービーシー・マート	15,100	5,080.00	76,708,000	
ハードオフコーポレーション	3,900	679.00	2,648,100	
高千穂交易	3,800	920.00	3,496,000	
アスクル	10,300	3,190.00	32,857,000	
ゲオホールディングス	17,500	1,312.00	22,960,000	
アダストリア	13,500	1,318.00	17,793,000	
ジーフット	5,900	426.00	2,513,400	
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	1,700	401.00	681,700	
伊藤忠食品	2,400	4,350.00	10,440,000	
くら寿司	5,000	3,860.00	19,300,000	
キャンドウ	4,700	1,701.00	7,994,700	
エレマテック	9,000	786.00	7,074,000	
パルグループホールディングス	9,900	1,271.00	12,582,900	
JALUX	2,700	1,582.00	4,271,400	
エディオン	44,600	912.00	40,675,200	
あらた	7,600	4,330.00	32,908,000	
サーラコーポレーション	19,600	558.00	10,936,800	
ワッツ	4,400	584.00	2,569,600	
トーメンデバイス	1,500	3,450.00	5,175,000	
ハローズ	3,600	2,765.00	9,954,000	
J Pホールディングス	30,200	258.00	7,791,600	
フジオフードシステム	8,200	1,225.00	10,045,000	
あみやき亭	2,100	2,771.00	5,819,100	
東京エレクトロン デバイス	3,500	2,280.00	7,980,000	
ひらまつ	18,400	151.00	2,778,400	
フィールズ	7,500	320.00	2,400,000	
双日	536,600	249.00	133,613,400	
アルフレッサ ホールディングス	108,000	2,182.00	235,656,000	
大黒天物産	2,300	3,410.00	7,843,000	
ハニーズホールディングス	8,600	1,107.00	9,520,200	
ファーマライズホールディングス	2,400	699.00	1,677,600	

キッコーマン	71,300	4,600.00	327,980,000
味の素	218,600	1,840.00	402,224,000
キューピー	55,100	2,050.00	112,955,000
ハウス食品グループ本社	37,000	3,155.00	116,735,000
カゴメ	37,600	2,697.00	101,407,200
焼津水産化学工業	4,800	897.00	4,305,600
アリアケジャパン	9,000	6,070.00	54,630,000
ピエトロ	1,300	1,570.00	2,041,000
エバラ食品工業	2,300	2,171.00	4,993,300
やまみ	500	1,906.00	953,000
ニチレイ	47,100	2,758.00	129,901,800
横浜冷凍	27,100	886.00	24,010,600
東洋水産	50,900	5,080.00	258,572,000
イトアアンド	3,500	1,647.00	5,764,500
大冷	1,400	1,809.00	2,532,600
ヨシムラ・フード・ホールディングス	5,400	828.00	4,471,200
日清食品ホールディングス	42,100	8,850.00	372,585,000
永谷園ホールディングス	4,800	2,174.00	10,435,200
一正蒲鉾	3,900	933.00	3,638,700
フジッコ	10,700	1,959.00	20,961,300
ロック・フィールド	10,700	1,405.00	15,033,500
日本たばこ産業	571,400	1,961.00	1,120,515,400
ケンコーマヨネーズ	5,600	1,983.00	11,104,800
わらべや日洋ホールディングス	6,500	1,565.00	10,172,500
なとり	5,400	1,722.00	9,298,800
イフジ産業	1,700	742.00	1,261,400
ピククルスコーポレーション	2,200	2,251.00	4,952,200
北の達人コーポレーション	34,600	502.00	17,369,200
ユージェナ	42,300	657.00	27,791,100
スター・マイカ・ホールディングス	5,000	1,340.00	6,700,000
A Dワークスグループ	17,660	153.00	2,701,980
片倉工業	13,900	1,039.00	14,442,100
グンゼ	7,100	3,630.00	25,773,000
ヒューリック	207,600	966.00	200,541,600
神栄	1,600	561.00	897,600
ラサ商事	5,200	833.00	4,331,600
アルペン	7,400	1,537.00	11,373,800
ハブ	2,800	565.00	1,582,000
ラクーンホールディングス	4,300	593.00	2,549,900
クオールホールディングス	14,500	1,204.00	17,458,000
アルコニックス	10,400	1,051.00	10,930,400
神戸物産	33,400	4,920.00	164,328,000
ソリトンシステムズ	4,300	1,328.00	5,710,400
ジンズホールディングス	5,100	5,100.00	26,010,000
ビックカメラ	57,600	820.00	47,232,000
D C Mホールディングス	52,600	1,019.00	53,599,400
ペッパーフードサービス	8,200	416.00	3,411,200
Monotaro	69,000	2,940.00	202,860,000
東京一番フーズ	2,600	400.00	1,040,000
D Dホールディングス	3,900	707.00	2,757,300

あい ホールディングス	13,800	1,345.00	18,561,000
ディービーエックス	3,500	887.00	3,104,500
きちりホールディングス	2,600	496.00	1,289,600
アークランドサービスホールディングス	7,100	1,516.00	10,763,600
J.フロント リテイリング	115,900	779.00	90,286,100
ドトール・日レスホールディングス	15,500	1,644.00	25,482,000
マツモトキヨシホールディングス	40,200	3,645.00	146,529,000
ブロンコピリー	5,000	2,116.00	10,580,000
Z O Z O	66,800	1,617.00	108,015,600
トレジャー・ファクトリー	2,900	613.00	1,777,700
物語コーポレーション	2,600	5,720.00	14,872,000
ココカラファイン	10,200	5,110.00	52,122,000
三越伊勢丹ホールディングス	169,900	621.00	105,507,900
東洋紡	38,200	1,169.00	44,655,800
ユニチカ	28,700	294.00	8,437,800
富士紡ホールディングス	4,700	2,540.00	11,938,000
日清紡ホールディングス	65,700	703.00	46,187,100
倉敷紡績	9,600	2,593.00	24,892,800
ダイワボウホールディングス	8,200	6,160.00	50,512,000
シキボウ	5,100	1,300.00	6,630,000
日東紡績	14,700	4,675.00	68,722,500
トヨタ紡織	28,800	1,238.00	35,654,400
マクニカ・富士エレホールディングス	23,300	1,418.00	33,039,400
H a m e e	3,500	1,278.00	4,473,000
ラクト・ジャパン	3,600	3,145.00	11,322,000
ウエルシアホールディングス	28,900	7,440.00	215,016,000
クリエイトSDホールディングス	16,400	2,835.00	46,494,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	18,200	1,101.00	20,038,200
八洲電機	7,400	785.00	5,809,000
メディアスホールディングス	5,400	869.00	4,692,600
レスターホールディングス	10,200	1,643.00	16,758,600
ジュテックホールディングス	2,200	989.00	2,175,800
丸善C H I ホールディングス	10,500	373.00	3,916,500
大光	4,200	614.00	2,578,800
O C H I ホールディングス	2,700	1,407.00	3,798,900
T O K A I ホールディングス	51,200	929.00	47,564,800
黒谷	2,100	420.00	882,000
ミサワ	2,000	405.00	810,000
ティーライフ	1,400	893.00	1,250,200
C o m i n i x	1,800	707.00	1,272,600
エー・ピーカンパニー	1,900	374.00	710,600
三洋貿易	9,900	802.00	7,939,800
チムニー	2,900	1,443.00	4,184,700
シュッピン	6,700	629.00	4,214,300
ビューティガレージ	1,700	1,398.00	2,376,600
ウイン・パートナーズ	6,900	946.00	6,527,400
ネクステージ	13,900	627.00	8,715,300
ジョイフル本田	28,500	1,256.00	35,796,000

鳥貴族	3,200	1,351.00	4,323,200
キリン堂ホールディングス	3,900	1,969.00	7,679,100
ホットランド	6,600	969.00	6,395,400
すかいらーくホールディングス	108,900	1,511.00	164,547,900
SFPホールディングス	4,200	1,317.00	5,531,400
綿半ホールディングス	3,600	1,602.00	5,767,200
日本毛織	31,600	919.00	29,040,400
ダイトウボウ	16,000	149.00	2,384,000
トーア紡コーポレーション	3,900	451.00	1,758,900
ダイドーリミテッド	13,000	187.00	2,431,000
ヨシックス	1,700	1,681.00	2,857,700
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	28,300	976.00	27,620,800
三栄建築設計	3,900	1,145.00	4,465,500
野村不動産ホールディングス	59,100	1,677.00	99,110,700
三重交通グループホールディングス	19,900	488.00	9,711,200
サムティ	13,800	1,268.00	17,498,400
ディア・ライフ	12,700	368.00	4,673,600
コーセーアールイー	2,900	437.00	1,267,300
日本商業開発	6,200	1,283.00	7,954,600
プレサンスコーポレーション	16,100	1,082.00	17,420,200
フィル・カンパニー	1,400	2,120.00	2,968,000
THEグローバル社	4,600	316.00	1,453,600
ハウスコム	1,300	1,275.00	1,657,500
日本管理センター	6,500	1,063.00	6,909,500
サンセイランディック	2,900	651.00	1,887,900
エストラスト	1,400	580.00	812,000
フージャースホールディングス	19,300	612.00	11,811,600
オープンハウス	28,300	2,128.00	60,222,400
東急不動産ホールディングス	264,500	493.00	130,398,500
飯田グループホールディングス	81,000	1,386.00	112,266,000
イーグランド	1,700	619.00	1,052,300
ムゲンエステート	6,900	429.00	2,960,100
帝国繊維	10,900	2,151.00	23,445,900
日本コークス工業	83,400	60.00	5,004,000
ゴルフダイジェスト・オンライン	4,400	462.00	2,032,800
ミタチ産業	2,800	560.00	1,568,000
B E E N O S	3,800	827.00	3,142,600
あさひ	7,300	1,267.00	9,249,100
日本調剤	6,000	1,719.00	10,314,000
コスモス薬品	4,300	24,590.00	105,737,000
シップヘルスケアホールディングス	15,700	4,660.00	73,162,000
トーエル	4,700	765.00	3,595,500
ソフトクリエイイトホールディングス	4,300	1,668.00	7,172,400
オンリー	1,700	611.00	1,038,700
セブン&アイ・ホールディングス	380,000	3,472.00	1,319,360,000
クリエイイト・レストランツ・ホールディングス	52,400	562.00	29,448,800
明治電機工業	3,000	1,255.00	3,765,000
ツルハホールディングス	21,100	13,370.00	282,107,000

デリカフーズホールディングス	3,500	633.00	2,215,500	
スターティアホールディングス	2,300	530.00	1,219,000	
サンマルクホールディングス	7,600	1,742.00	13,239,200	
フェリシモ	2,100	946.00	1,986,600	
トリドールホールディングス	23,900	1,145.00	27,365,500	
帝人	78,800	1,727.00	136,087,600	
東レ	699,100	460.30	321,795,730	
クラレ	152,100	1,056.00	160,617,600	
旭化成	640,100	707.60	452,934,760	
サカイオーベックス	2,500	1,925.00	4,812,500	
TOKYO BASE	8,900	241.00	2,144,900	
稲葉製作所	5,400	1,239.00	6,690,600	
宮地エンジニアリンググループ	2,900	1,535.00	4,451,500	
トーカロ	27,000	953.00	25,731,000	
アルファ	3,500	917.00	3,209,500	
SUMCO	116,700	1,416.00	165,247,200	
川田テクノロジーズ	2,000	5,570.00	11,140,000	
RS Technologies	2,700	2,372.00	6,404,400	
信和	4,300	704.00	3,027,200	
ピーロット	4,700	590.00	2,773,000	
ファーストブラザーズ	2,200	660.00	1,452,000	
ハウズドゥ	4,800	733.00	3,518,400	
シーアールイー	2,400	1,074.00	2,577,600	
プロパティエージェント	1,600	834.00	1,334,400	
ケイアイスター不動産	3,000	1,028.00	3,084,000	
アグレ都市デザイン	1,700	411.00	698,700	
グッドコムアセット	2,300	1,461.00	3,360,300	
ジェイ・エス・ビー	900	4,070.00	3,663,000	
テンポイノベーション	2,300	542.00	1,246,600	
グローバル・リンク・マネジメント	1,700	540.00	918,000	
住江織物	2,100	1,714.00	3,599,400	
日本フェルト	5,600	423.00	2,368,800	
イチカワ	1,400	1,234.00	1,727,600	
エコナックホールディングス	17,500	85.00	1,487,500	
日東製網	1,000	1,624.00	1,624,000	
芦森工業	2,100	809.00	1,698,900	
アツギ	8,000	619.00	4,952,000	
ウイルプラスホールディングス	1,300	514.00	668,200	
JMホールディングス	4,900	2,180.00	10,682,000	
コメダホールディングス	21,200	1,589.00	33,686,800	
サツドラホールディングス	1,500	1,910.00	2,865,000	
アレンザホールディングス	4,800	795.00	3,816,000	
串カツ田中ホールディングス	1,600	1,100.00	1,760,000	
パロックジャパンリミテッド	6,800	579.00	3,937,200	
クスリのアオキホールディングス	8,700	8,310.00	72,297,000	
ダイニック	3,500	690.00	2,415,000	
共和レザー	5,100	681.00	3,473,100	
力の源ホールディングス	4,400	588.00	2,587,200	
スシローグローバルホールディングス	42,200	1,519.00	64,101,800	
LIXILピバ	9,600	1,894.00	18,182,400	

アセンテック	700	3,025.00	2,117,500	
セーレン	23,800	1,252.00	29,797,600	
ソトー	3,800	913.00	3,469,400	
東海染工	1,400	1,114.00	1,559,600	
小松マテーレ	15,800	738.00	11,660,400	
ワコールホールディングス	25,000	2,233.00	55,825,000	
ホギメディカル	11,100	3,775.00	41,902,500	
レナウン	25,500	73.00	1,861,500	
クラウドディアホールディングス	2,400	348.00	835,200	
T S Iホールディングス	32,200	388.00	12,493,600	
マツオカコーポレーション	2,700	1,794.00	4,843,800	
ワールド	13,700	1,301.00	17,823,700	
T I S	96,600	1,976.00	190,881,600	
ネオス	4,000	561.00	2,244,000	
電算システム	3,800	2,279.00	8,660,200	
グリー	59,300	403.00	23,897,900	
コーエーテクモホールディングス	19,700	2,685.00	52,894,500	
三菱総合研究所	4,200	3,230.00	13,566,000	
ボルテージ	2,100	349.00	732,900	
電算	1,000	1,968.00	1,968,000	
A G S	5,400	722.00	3,898,800	
ファインデックス	8,200	760.00	6,232,000	
ブレインパッド	2,300	4,810.00	11,063,000	
K L a b	18,700	662.00	12,379,400	
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	11,700	778.00	9,102,600	
イーブクイニシアティブジャパン	1,500	1,437.00	2,155,500	
ネクソン	269,800	1,747.00	471,340,600	
アイスタイル	27,100	241.00	6,531,100	
エムアップホールディングス	2,800	2,404.00	6,731,200	
エイチーム	6,700	662.00	4,435,400	
エニグモ	6,900	768.00	5,299,200	
テクノスジャパン	7,800	339.00	2,644,200	
e n i s h	4,500	383.00	1,723,500	
コロプラ	31,600	820.00	25,912,000	
オルトプラス	7,100	403.00	2,861,300	
ブロードリーフ	48,300	493.00	23,811,900	
クロス・マーケティンググループ	4,200	261.00	1,096,200	
デジタルハーツホールディングス	5,100	766.00	3,906,600	
システム情報	5,000	725.00	3,625,000	
メディアドゥホールディングス	3,000	3,250.00	9,750,000	
じげん	24,200	284.00	6,872,800	
バイキューブ	5,900	1,189.00	7,015,100	
エンカレッジ・テクノロジー	1,700	651.00	1,106,700	
サイバーリンクス	1,600	1,018.00	1,628,800	
ディー・エル・イー	8,100	112.00	907,200	
フィックスターズ	10,400	1,114.00	11,585,600	
C A R T A H O L D I N G S	4,600	842.00	3,873,200	
オブティム	5,100	2,222.00	11,332,200	
セレス	3,200	753.00	2,409,600	

S H I F T	2,500	8,980.00	22,450,000	
特種東海製紙	6,100	4,120.00	25,132,000	
ティーガイア	8,600	2,065.00	17,759,000	
セック	1,500	2,769.00	4,153,500	
日本アジアグループ	10,300	237.00	2,441,100	
テクマトリックス	6,800	2,368.00	16,102,400	
プロシップ	2,700	1,173.00	3,167,100	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	23,500	1,553.00	36,495,500	
GMOペイメントゲートウェイ	16,000	8,370.00	133,920,000	
ザッパラス	4,300	298.00	1,281,400	
システムリサーチ	2,500	1,428.00	3,570,000	
インターネットイニシアティブ	14,200	3,605.00	51,191,000	
さくらインターネット	10,500	526.00	5,523,000	
ヴィンクス	2,700	805.00	2,173,500	
GMOクラウド	1,800	2,120.00	3,816,000	
SRAホールディングス	5,100	2,127.00	10,847,700	
システムインテグレータ	3,200	704.00	2,252,800	
朝日ネット	6,800	838.00	5,698,400	
eBASE	11,500	823.00	9,464,500	
アバント	6,900	877.00	6,051,300	
アドソル日進	3,500	2,271.00	7,948,500	
フリービット	5,000	704.00	3,520,000	
コムチュア	10,900	2,228.00	24,285,200	
サイバーコム	1,800	1,655.00	2,979,000	
アステリア	6,100	346.00	2,110,600	
アイル	3,500	1,311.00	4,588,500	
王子ホールディングス	403,700	571.00	230,512,700	
日本製紙	42,700	1,564.00	66,782,800	
三菱製紙	10,900	348.00	3,793,200	
北越コーポレーション	64,200	407.00	26,129,400	
中越パルプ工業	4,100	1,364.00	5,592,400	
巴川製紙所	2,800	837.00	2,343,600	
大王製紙	42,300	1,492.00	63,111,600	
阿波製紙	2,500	457.00	1,142,500	
マークライNZ	4,800	1,613.00	7,742,400	
メディカル・データ・ビジョン	7,400	714.00	5,283,600	
gumi	12,400	588.00	7,291,200	
ショーケース	2,300	426.00	979,800	
モバイルファクトリー	2,200	1,035.00	2,277,000	
テラスカイ	3,500	2,909.00	10,181,500	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	3,900	1,255.00	4,894,500	
PCIホールディングス	4,100	829.00	3,398,900	
パイブドHD	1,400	1,145.00	1,603,000	
アイビーシー	1,900	808.00	1,535,200	
ネオジャパン	1,900	1,018.00	1,934,200	
P R T I M E S	800	1,740.00	1,392,000	
ランドコンピュータ	1,500	1,043.00	1,564,500	
ダブルスタンダード	1,300	3,765.00	4,894,500	

オープンドア	4,800	821.00	3,940,800
マイネット	3,200	602.00	1,926,400
アカツキ	3,500	3,700.00	12,950,000
ベネフィットジャパン	700	1,309.00	916,300
Ubicomホールディングス	2,200	1,275.00	2,805,000
LINE	22,200	5,240.00	116,328,000
カナミックネットワーク	5,900	562.00	3,315,800
ノムラシステムコーポレーション	2,200	322.00	708,400
レンゴー	91,200	838.00	76,425,600
トーモク	5,900	1,509.00	8,903,100
ザ・パック	7,300	3,530.00	25,769,000
チェンジ	2,000	3,265.00	6,530,000
シンクロ・フード	4,200	208.00	873,600
オークネット	5,900	1,120.00	6,608,000
セグエグループ	1,700	881.00	1,497,700
エイトレッド	1,300	1,340.00	1,742,000
AOI TYO HOLDINGS	9,800	444.00	4,351,200
マクロミル	19,700	574.00	11,307,800
ビーグリー	1,900	1,317.00	2,502,300
オロ	2,500	3,100.00	7,750,000
テモナ	1,400	550.00	770,000
ニーズウェル	1,400	553.00	774,200
サインポスト	1,600	1,317.00	2,107,200
昭和電工	68,800	2,307.00	158,721,600
住友化学	709,600	308.00	218,556,800
住友精化	4,300	2,860.00	12,298,000
日産化学	53,600	3,740.00	200,464,000
ラサ工業	3,500	1,270.00	4,445,000
クレハ	8,200	4,270.00	35,014,000
多木化学	2,800	4,330.00	12,124,000
テイカ	7,100	1,469.00	10,429,900
石原産業	17,400	564.00	9,813,600
片倉コープアグリ	2,400	1,153.00	2,767,200
日本曹達	14,200	2,724.00	38,680,800
東ソー	149,300	1,284.00	191,701,200
トクヤマ	27,900	2,068.00	57,697,200
セントラル硝子	19,700	1,841.00	36,267,700
東亜合成	60,500	919.00	55,599,500
大阪ソーダ	9,900	2,511.00	24,858,900
関東電化工業	23,000	767.00	17,641,000
デンカ	35,300	2,586.00	91,285,800
イビデン	60,300	2,162.00	130,368,600
信越化学工業	165,700	11,125.00	1,843,412,500
日本カーバイド工業	3,300	1,000.00	3,300,000
堺化学工業	6,300	1,710.00	10,773,000
第一稀元素化学工業	10,500	717.00	7,528,500
エア・ウォーター	89,900	1,354.00	121,724,600
大陽日酸	92,800	1,638.00	152,006,400
日本化学工業	2,900	2,196.00	6,368,400
東邦アセチレン	1,500	1,269.00	1,903,500

日本パーカライジング	48,600	1,119.00	54,383,400
高圧ガス工業	15,200	671.00	10,199,200
チタン工業	1,300	1,644.00	2,137,200
四国化成工業	14,800	986.00	14,592,800
戸田工業	2,300	1,219.00	2,803,700
ステラ ケミファ	5,200	2,348.00	12,209,600
保土谷化学工業	3,600	3,080.00	11,088,000
日本触媒	15,000	4,830.00	72,450,000
大日精化工業	8,600	2,201.00	18,928,600
カネカ	24,900	2,635.00	65,611,500
協和キリン	99,100	2,431.00	240,912,100
三菱瓦斯化学	89,900	1,258.00	113,094,200
三井化学	87,600	1,897.00	166,177,200
J S R	90,100	1,898.00	171,009,800
東京応化工業	16,700	3,940.00	65,798,000
大阪有機化学工業	8,900	1,500.00	13,350,000
三菱ケミカルホールディングス	645,500	602.50	388,913,750
K Hネオケム	17,100	1,581.00	27,035,100
ダイセル	132,200	786.00	103,909,200
住友ベークライト	15,200	2,356.00	35,811,200
積水化学工業	207,700	1,380.00	286,626,000
日本ゼオン	87,000	819.00	71,253,000
アイカ工業	29,000	3,100.00	89,900,000
宇部興産	48,700	1,639.00	79,819,300
積水樹脂	17,400	2,046.00	35,600,400
タキロンシーアイ	21,000	578.00	12,138,000
旭有機材	5,400	1,322.00	7,138,800
日立化成	44,700	4,620.00	206,514,000
ニチバン	5,000	1,478.00	7,390,000
リケンテクノス	24,300	384.00	9,331,200
大倉工業	4,500	1,565.00	7,042,500
積水化成品工業	12,800	564.00	7,219,200
群栄化学工業	2,200	2,520.00	5,544,000
タイガースポリマー	5,100	448.00	2,284,800
ミライアル	3,500	992.00	3,472,000
ダイキアクシス	3,500	731.00	2,558,500
ダイキョーニシカワ	20,400	456.00	9,302,400
竹本容器	3,500	606.00	2,121,000
森六ホールディングス	5,100	1,380.00	7,038,000
日本化薬	59,800	957.00	57,228,600
カーリットホールディングス	10,500	457.00	4,798,500
E P Sホールディングス	14,400	1,152.00	16,588,800
ソルクシーズ	4,200	548.00	2,301,600
レグス	2,400	822.00	1,972,800
プレステージ・インターナショナル	35,400	811.00	28,709,400
フェイス	3,500	584.00	2,044,000
プロトコーポレーション	8,800	848.00	7,462,400
ハイマックス	1,000	1,885.00	1,885,000
アミューズ	5,200	2,123.00	11,039,600
野村総合研究所	137,100	2,476.00	339,459,600

ドリームインキュベータ	2,800	1,073.00	3,004,400
サイバネットシステム	7,000	579.00	4,053,000
クイック	5,800	952.00	5,521,600
T A C	5,900	168.00	991,200
C Eホールディングス	5,700	476.00	2,713,200
ケネディクス	87,800	413.00	36,261,400
日本システム技術	1,600	1,138.00	1,820,800
電通グループ	97,200	1,885.00	183,222,000
インテージホールディングス	12,000	750.00	9,000,000
テイクアンドグヴ・ニーズ	3,600	513.00	1,846,800
東邦システムサイエンス	2,500	827.00	2,067,500
ぴあ	2,700	2,060.00	5,562,000
イオンファンタジー	3,800	1,333.00	5,065,400
ソースネクスト	46,100	299.00	13,783,900
シーティーエス	10,600	531.00	5,628,600
ネクシィーズグループ	3,300	959.00	3,164,700
インフォコム	10,600	2,689.00	28,503,400
メディカルシステムネットワーク	9,600	449.00	4,310,400
日本精化	7,800	1,438.00	11,216,400
扶桑化学工業	9,800	2,954.00	28,949,200
トリケミカル研究所	2,200	8,690.00	19,118,000
HEROZ	500	3,180.00	1,590,000
ラクスル	5,100	2,219.00	11,316,900
F I G	10,700	236.00	2,525,200
システムサポート	700	2,531.00	1,771,700
A D E K A	44,500	1,302.00	57,939,000
日油	36,300	3,455.00	125,416,500
ミヨシ油脂	3,900	1,069.00	4,169,100
新日本理化	16,300	162.00	2,640,600
ハリマ化成グループ	7,900	1,030.00	8,137,000
イーソル	3,500	1,025.00	3,587,500
アルテリア・ネットワークス	10,700	2,088.00	22,341,600
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	2,300	1,010.00	2,323,000
花王	236,100	8,725.00	2,059,972,500
第一工業製薬	3,600	3,955.00	14,238,000
石原ケミカル	2,600	1,787.00	4,646,200
日華化学	3,200	902.00	2,886,400
ニイタカ	1,600	2,544.00	4,070,400
三洋化成工業	5,800	3,880.00	22,504,000
武田薬品工業	820,400	3,608.00	2,960,003,200
アステラス製薬	855,000	1,723.00	1,473,165,000
大日本住友製薬	73,200	1,414.00	103,504,800
塩野義製薬	126,200	5,454.00	688,294,800
わかもと製薬	11,700	233.00	2,726,100
あすか製薬	11,200	1,116.00	12,499,200
日本新薬	25,800	7,920.00	204,336,000
ピオフェルミン製薬	1,700	2,335.00	3,969,500
中外製薬	102,700	13,565.00	1,393,125,500
科研製薬	17,000	5,810.00	98,770,000

エーザイ	117,900	7,599.00	895,922,100
理研ビタミン	9,100	2,044.00	18,600,400
ロート製薬	50,600	3,015.00	152,559,000
小野薬品工業	226,600	2,533.00	573,977,800
久光製薬	26,000	4,930.00	128,180,000
有機合成薬品工業	7,500	275.00	2,062,500
持田製薬	13,600	4,330.00	58,888,000
参天製薬	183,700	1,833.00	336,722,100
扶桑薬品工業	3,500	2,077.00	7,269,500
日本ケミファ	1,400	2,419.00	3,386,600
ツムラ	30,600	2,840.00	86,904,000
日医工	28,000	1,387.00	38,836,000
テルモ	278,900	3,690.00	1,029,141,000
みらかホールディングス	26,300	2,334.00	61,384,200
キッセイ薬品工業	17,500	2,566.00	44,905,000
生化学工業	19,000	1,079.00	20,501,000
栄研化学	17,400	2,150.00	37,410,000
日水製薬	4,200	1,217.00	5,111,400
鳥居薬品	6,200	2,855.00	17,701,000
JCRファーマ	6,900	10,470.00	72,243,000
東和薬品	12,600	2,267.00	28,564,200
富士製薬工業	6,700	1,213.00	8,127,100
沢井製薬	20,200	6,080.00	122,816,000
ゼリア新薬工業	17,800	2,034.00	36,205,200
第一三共	282,200	7,432.00	2,097,310,400
キョーリン製薬ホールディングス	21,900	2,236.00	48,968,400
大幸薬品	11,800	1,834.00	21,641,200
ダイト	5,900	2,955.00	17,434,500
大塚ホールディングス	187,900	4,215.00	791,998,500
大正製薬ホールディングス	20,800	6,540.00	136,032,000
ペプチドリーム	49,900	3,465.00	172,903,500
大日本塗料	10,900	846.00	9,221,400
日本ペイントホールディングス	79,700	5,770.00	459,869,000
関西ペイント	108,500	2,044.00	221,774,000
神東塗料	8,000	147.00	1,176,000
中国塗料	27,300	812.00	22,167,600
日本特殊塗料	7,200	782.00	5,630,400
藤倉化成	12,900	469.00	6,050,100
太陽ホールディングス	7,100	4,030.00	28,613,000
DIC	40,700	2,350.00	95,645,000
サカティンクス	21,100	862.00	18,188,200
東洋インキSCホールディングス	20,200	2,061.00	41,632,200
T&K TOKA	7,400	720.00	5,328,000
アルプス技研	8,300	1,452.00	12,051,600
サニックス	16,700	286.00	4,776,200
ダイオーズ	1,800	1,005.00	1,809,000
日本空調サービス	9,900	679.00	6,722,100
オリエンタルランド	100,100	13,800.00	1,381,380,000
フォーカスシステムズ	6,200	703.00	4,358,600
ダスキン	24,200	2,794.00	67,614,800

パーク24	52,600	1,439.00	75,691,400
明光ネットワークジャパン	11,300	733.00	8,282,900
ファルコホールディングス	5,200	1,735.00	9,022,000
クレスコ	5,900	1,318.00	7,776,200
フジ・メディア・ホールディングス	93,300	1,059.00	98,804,700
秀英予備校	2,000	400.00	800,000
田谷	1,800	551.00	991,800
ラウンドワン	26,700	678.00	18,102,600
リゾートトラスト	43,400	1,048.00	45,483,200
オービック	33,500	14,880.00	498,480,000
ジャストシステム	15,800	5,850.00	92,430,000
TDCソフト	8,500	772.00	6,562,000
Zホールディングス	1,328,500	360.00	478,260,000
ビー・エム・エル	12,000	2,727.00	32,724,000
ワタベウェディング	1,800	323.00	581,400
トレンドマイクロ	43,000	4,725.00	203,175,000
りらいあコミュニケーションズ	17,100	1,049.00	17,937,900
IDホールディングス	3,800	1,341.00	5,095,800
リソー教育	43,800	256.00	11,212,800
日本オラクル	19,600	9,660.00	189,336,000
早稲田アカデミー	3,200	960.00	3,072,000
アルファシステムズ	2,900	2,757.00	7,995,300
フューチャー	11,700	1,385.00	16,204,500
CAC Holdings	6,400	981.00	6,278,400
SBテクノロジー	3,500	2,406.00	8,421,000
トーセ	2,600	761.00	1,978,600
ユー・エス・エス	105,500	1,619.00	170,804,500
オービックビジネスコンサルタント	9,900	4,630.00	45,837,000
伊藤忠テクノソリューションズ	44,100	3,150.00	138,915,000
アイティフォー	11,700	591.00	6,914,700
東京個別指導学院	3,500	487.00	1,704,500
東計電算	1,500	4,130.00	6,195,000
サイバーエージェント	54,300	4,065.00	220,729,500
楽天	439,200	881.00	386,935,200
エクスネット	1,600	903.00	1,444,800
クリーク・アンド・リバー社	4,800	839.00	4,027,200
テー・オー・ダブリュー	15,100	262.00	3,956,200
大塚商会	52,500	4,615.00	242,287,500
サイボウズ	11,300	1,930.00	21,809,000
ソフトブレーン	5,800	386.00	2,238,800
山田コンサルティンググループ	4,600	1,011.00	4,650,600
セントラルスポーツ	3,600	2,040.00	7,344,000
パラカ	2,500	1,578.00	3,945,000
電通国際情報サービス	6,100	4,050.00	24,705,000
ACCESS	9,000	854.00	7,686,000
デジタルガレージ	17,500	3,545.00	62,037,500
イーエムシステムズ	13,600	879.00	11,954,400
ウェザーニューズ	3,300	3,295.00	10,873,500
CIJ	6,700	755.00	5,058,500
ビジネスエンジニアリング	1,000	2,245.00	2,245,000

日本エンタープライズ	10,200	218.00	2,223,600
WOWOW	4,600	2,428.00	11,168,800
スカラ	6,600	472.00	3,115,200
インテリジェント ウェイブ	4,300	504.00	2,167,200
フルキャストホールディングス	9,500	1,118.00	10,621,000
エン・ジャパン	16,900	2,001.00	33,816,900
富士フイルムホールディングス	189,100	5,471.00	1,034,566,100
コニカミノルタ	215,500	380.00	81,890,000
資生堂	196,000	6,496.00	1,273,216,000
ライオン	128,300	2,206.00	283,029,800
高砂香料工業	6,200	2,042.00	12,660,400
マンダム	22,200	2,094.00	46,486,800
ミルボン	13,200	5,040.00	66,528,000
ファンケル	40,000	2,476.00	99,040,000
コーセー	18,500	13,470.00	249,195,000
コタ	5,600	1,196.00	6,697,600
シーボン	1,400	2,105.00	2,947,000
ポーラ・オルビスホールディングス	42,200	2,039.00	86,045,800
ノエビアホールディングス	9,500	5,280.00	50,160,000
アジュバンコスメジャパン	2,200	898.00	1,975,600
エステー	6,400	1,494.00	9,561,600
アグロ カネショウ	3,000	1,658.00	4,974,000
コニシ	16,200	1,388.00	22,485,600
長谷川香料	13,000	2,008.00	26,104,000
星光PMC	5,700	637.00	3,630,900
小林製薬	27,800	10,440.00	290,232,000
荒川化学工業	8,800	1,164.00	10,243,200
メック	6,800	1,493.00	10,152,400
日本高純度化学	2,700	2,415.00	6,520,500
タカラバイオ	25,800	2,160.00	55,728,000
JCU	11,900	2,264.00	26,941,600
新田ゼラチン	6,300	626.00	3,943,800
OATアグリオ	1,800	891.00	1,603,800
デクセリアルズ	25,500	698.00	17,799,000
アース製薬	7,400	5,540.00	40,996,000
北興化学工業	10,100	547.00	5,524,700
大成ラミック	3,200	2,539.00	8,124,800
クミアイ化学工業	40,800	844.00	34,435,200
日本農薬	17,500	416.00	7,280,000
富士興産	2,900	417.00	1,209,300
ニチレキ	11,600	1,341.00	15,555,600
ユシロ化学工業	5,400	1,133.00	6,118,200
ビービー・カストロール	3,500	1,095.00	3,832,500
富士石油	26,700	184.00	4,912,800
MORESCO	3,600	905.00	3,258,000
出光興産	110,800	2,491.00	276,002,800
JXTGホールディングス	1,483,300	374.30	555,199,190
コスモエネルギーホールディングス	28,600	1,602.00	45,817,200
横浜ゴム	57,100	1,303.00	74,401,300
TOYO TIRE	56,700	1,157.00	65,601,900

ブリヂストン	284,000	3,255.00	924,420,000
住友ゴム工業	88,400	989.00	87,427,600
藤倉コンポジット	8,300	342.00	2,838,600
オカモト	5,900	4,280.00	25,252,000
アキレス	6,800	1,566.00	10,648,800
フコク	4,300	554.00	2,382,200
ニッタ	11,200	1,886.00	21,123,200
クリエートメディック	3,200	1,068.00	3,417,600
住友理工	18,900	544.00	10,281,600
三ツ星ベルト	12,900	1,302.00	16,795,800
バンドー化学	17,100	592.00	10,123,200
A G C	97,500	2,554.00	249,015,000
日本板硝子	47,300	309.00	14,615,700
石塚硝子	1,900	2,014.00	3,826,600
有沢製作所	15,800	806.00	12,734,800
日本山村硝子	4,100	834.00	3,419,400
日本電気硝子	39,600	1,433.00	56,746,800
オハラ	4,000	908.00	3,632,000
住友大阪セメント	18,600	3,310.00	61,566,000
太平洋セメント	62,300	2,053.00	127,901,900
リソルホールディングス	900	3,255.00	2,929,500
日本ヒューム	10,100	561.00	5,666,100
日本コンクリート工業	21,200	242.00	5,130,400
三谷セキサン	4,600	4,340.00	19,964,000
アジアパイルホールディングス	14,200	409.00	5,807,800
東海カーボン	103,400	907.00	93,783,800
日本カーボン	5,000	3,270.00	16,350,000
東洋炭素	5,800	1,408.00	8,166,400
ノリタケカンパニーリミテド	5,400	3,355.00	18,117,000
T O T O	70,400	3,530.00	248,512,000
日本碍子	120,300	1,273.00	153,141,900
日本特殊陶業	76,800	1,465.00	112,512,000
ダントーホールディングス	7,800	74.00	577,200
M A R U W A	3,900	6,420.00	25,038,000
品川リフラクトリーズ	2,600	2,134.00	5,548,400
黒崎播磨	2,000	3,660.00	7,320,000
ヨータイ	7,900	643.00	5,079,700
イソライト工業	5,100	413.00	2,106,300
東京窯業	12,000	289.00	3,468,000
ニッカトー	4,500	528.00	2,376,000
フジインコーポレーテッド	8,800	2,614.00	23,003,200
クニミネ工業	4,100	953.00	3,907,300
エーアンドエーマテリアル	1,700	1,113.00	1,892,100
ニチアス	26,900	2,003.00	53,880,700
日本製鉄	436,700	844.00	368,574,800
神戸製鋼所	178,800	339.00	60,613,200
中山製鋼所	13,400	382.00	5,118,800
合同製鐵	5,200	1,883.00	9,791,600
ジェイ エフ イー ホールディング ス	263,400	666.00	175,424,400

東京製鐵	47,700	667.00	31,815,900
共英製鋼	11,000	1,291.00	14,201,000
大和工業	20,600	1,959.00	40,355,400
東京鐵鋼	4,000	1,103.00	4,412,000
大阪製鐵	5,100	1,214.00	6,191,400
淀川製鋼所	13,000	1,729.00	22,477,000
丸一鋼管	31,600	2,418.00	76,408,800
モリ工業	2,900	2,236.00	6,484,400
大同特殊鋼	16,000	3,340.00	53,440,000
日本高周波鋼業	3,800	361.00	1,371,800
日本冶金工業	8,100	1,597.00	12,935,700
山陽特殊製鋼	6,700	860.00	5,762,000
愛知製鋼	5,300	2,916.00	15,454,800
日立金属	105,100	1,069.00	112,351,900
日本金属	2,200	610.00	1,342,000
大平洋金属	6,600	1,668.00	11,008,800
新日本電工	62,600	151.00	9,452,600
栗本鐵工所	4,800	1,822.00	8,745,600
虹 技	1,400	1,031.00	1,443,400
日本鑄鉄管	900	1,338.00	1,204,200
日本製鋼所	29,600	1,263.00	37,384,800
三菱製鋼	7,200	809.00	5,824,800
日垂鋼業	14,100	249.00	3,510,900
日本精線	1,700	2,816.00	4,787,200
エンビプロ・ホールディングス	4,200	533.00	2,238,600
大紀アルミニウム工業所	16,000	556.00	8,896,000
日本軽金属ホールディングス	246,600	164.00	40,442,400
三井金属鉱業	26,300	1,841.00	48,418,300
東邦亜鉛	5,000	1,170.00	5,850,000
三菱マテリアル	64,500	2,088.00	134,676,000
住友金属鉱山	124,500	2,392.00	297,804,000
DOWAホールディングス	24,600	2,829.00	69,593,400
古河機械金属	17,400	1,050.00	18,270,000
エス・サイエンス	44,400	35.00	1,554,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	10,300	884.00	9,105,200
東邦チタニウム	17,500	585.00	10,237,500
UACJ	14,800	1,595.00	23,606,000
CKサンエツ	2,100	2,698.00	5,665,800
古河電気工業	30,400	1,910.00	58,064,000
住友電気工業	364,400	1,044.50	380,615,800
フジクラ	117,900	292.00	34,426,800
昭和電線ホールディングス	11,300	1,019.00	11,514,700
東京特殊電線	1,500	2,331.00	3,496,500
タツタ電線	19,300	480.00	9,264,000
カナレ電気	1,700	1,588.00	2,699,600
平河ヒューテック	3,800	929.00	3,530,200
リョービ	11,900	1,197.00	14,244,300
アールスティ	12,600	339.00	4,271,400
アサヒホールディングス	17,200	2,278.00	39,181,600
東洋製罐グループホールディングス	62,000	1,135.00	70,370,000

ホッカホールディングス	5,300	1,493.00	7,912,900
コロナ	5,200	938.00	4,877,600
横河ブリッジホールディングス	18,100	1,877.00	33,973,700
OSJBホールディングス	49,800	238.00	11,852,400
駒井ハルテック	1,900	1,511.00	2,870,900
高田機工	800	2,239.00	1,791,200
三和ホールディングス	92,000	788.00	72,496,000
文化シャッター	28,800	786.00	22,636,800
三協立山	12,500	911.00	11,387,500
アルインコ	7,000	935.00	6,545,000
東洋シャッター	2,400	659.00	1,581,600
LIXILグループ	143,800	1,255.00	180,469,000
日本ファイルコン	7,300	472.00	3,445,600
ノーリツ	20,100	1,154.00	23,195,400
長府製作所	9,900	2,157.00	21,354,300
リンナイ	19,000	7,850.00	149,150,000
ユニプレス	19,100	906.00	17,304,600
ダイニチ工業	5,200	623.00	3,239,600
日東精工	13,500	502.00	6,777,000
三洋工業	1,400	1,751.00	2,451,400
岡部	19,700	718.00	14,144,600
ジーテクト	12,000	1,075.00	12,900,000
東プレ	18,200	1,111.00	20,220,200
高周波熱錬	18,700	594.00	11,107,800
東京製綱	7,000	542.00	3,794,000
サンコール	5,300	408.00	2,162,400
モリテックスチール	7,800	280.00	2,184,000
パイオラックス	14,500	1,553.00	22,518,500
エイチワン	9,600	484.00	4,646,400
日本発条	104,600	680.00	71,128,000
中央発條	1,300	2,601.00	3,381,300
アドバネクス	1,500	1,202.00	1,803,000
三浦工業	42,200	4,090.00	172,598,000
タクマ	33,000	1,238.00	40,854,000
テクノプロ・ホールディングス	18,700	4,565.00	85,365,500
アトラ	2,500	236.00	590,000
インターワークス	1,900	354.00	672,600
アイ・アールジャパンホールディングス	3,900	5,900.00	23,010,000
Keeper 技研	3,500	1,405.00	4,917,500
ファーストロジック	2,200	549.00	1,207,800
三機サービス	1,900	1,056.00	2,006,400
Gunosy	5,900	886.00	5,227,400
デザインワン・ジャパン	2,200	167.00	367,400
イー・ガーディアン	4,800	1,606.00	7,708,800
リブセンス	6,300	248.00	1,562,400
ジャパンマテリアル	29,000	1,453.00	42,137,000
ベクトル	11,800	700.00	8,260,000
ウチヤマホールディングス	4,700	328.00	1,541,600
チャーム・ケア・コーポレーション	8,200	770.00	6,314,000

ライクキッズ	1,700	531.00	902,700
キャリアリンク	3,000	423.00	1,269,000
I B J	6,600	564.00	3,722,400
アサンテ	3,900	1,465.00	5,713,500
N・フィールド	6,600	403.00	2,659,800
バリューHR	3,900	1,382.00	5,389,800
M&Aキャピタルパートナーズ	6,700	2,505.00	16,783,500
ライドオンエクスプレスホールディングス	3,600	1,639.00	5,900,400
E R Iホールディングス	2,700	608.00	1,641,600
アビスト	1,600	1,790.00	2,864,000
シグマクシス	6,500	1,427.00	9,275,500
ウィルグループ	6,300	556.00	3,502,800
エスクロー・エージェント・ジャパン	13,300	154.00	2,048,200
リクルートホールディングス	674,900	2,514.50	1,697,036,050
エラン	5,700	1,596.00	9,097,200
ツガミ	20,100	813.00	16,341,300
オークマ	11,400	3,320.00	37,848,000
芝浦機械	11,100	2,016.00	22,377,600
アマダ	123,900	855.00	105,934,500
アイダエンジニアリング	25,500	693.00	17,671,500
滝澤鉄工所	3,000	1,070.00	3,210,000
F U J I	41,800	1,600.00	66,880,000
牧野フライス製作所	11,400	2,821.00	32,159,400
オーエスジー	45,100	1,286.00	57,998,600
ダイジェット工業	1,000	1,156.00	1,156,000
旭ダイヤモンド工業	25,600	467.00	11,955,200
D M G 森精機	61,800	894.00	55,249,200
ソディック	23,000	687.00	15,801,000
ディスコ	13,200	22,700.00	299,640,000
日東工器	5,200	1,631.00	8,481,200
日進工具	2,800	2,585.00	7,238,000
パンチ工業	9,000	308.00	2,772,000
富士ダイス	4,300	574.00	2,468,200
土木管理総合試験所	4,300	317.00	1,363,100
ネットマーケティング	2,700	594.00	1,603,800
日本郵政	772,000	832.50	642,690,000
ベルシステム24ホールディングス	15,900	1,087.00	17,283,300
鎌倉新書	7,100	1,056.00	7,497,600
S M N	1,600	718.00	1,148,800
一蔵	1,300	345.00	448,500
L I T A L I C O	3,300	2,148.00	7,088,400
グローバルキッズCOMPANY	1,500	503.00	754,500
エアトリ	4,300	835.00	3,590,500
アトラエ	2,400	2,462.00	5,908,800
ストライク	3,500	3,855.00	13,492,500
ソラスト	26,200	966.00	25,309,200
セラク	2,900	708.00	2,053,200
インソース	4,600	1,927.00	8,864,200
豊田自動織機	79,800	5,180.00	413,364,000

豊和工業	5,400	635.00	3,429,000
OKK	4,100	446.00	1,828,600
石川製作所	2,400	1,259.00	3,021,600
東洋機械金属	7,000	412.00	2,884,000
津田駒工業	1,900	805.00	1,529,500
エンシュウ	2,400	922.00	2,212,800
島精機製作所	15,800	1,542.00	24,363,600
オプトラ	10,900	2,727.00	29,724,300
NCホールディングス	3,000	538.00	1,614,000
イワキ	4,600	895.00	4,117,000
フリー	9,700	839.00	8,138,300
ヤマシンフィルタ	21,200	841.00	17,829,200
日阪製作所	11,800	736.00	8,684,800
やまびこ	18,900	781.00	14,760,900
平田機工	4,600	4,820.00	22,172,000
ペガサスミシン製造	9,900	379.00	3,752,100
マルマエ	4,100	755.00	3,095,500
タツモ	4,500	1,077.00	4,846,500
ナブテスコ	57,400	2,722.00	156,242,800
三井海洋開発	10,500	1,453.00	15,256,500
レオン自動機	9,600	1,170.00	11,232,000
SMC	30,900	48,320.00	1,493,088,000
ホソカワミクロン	3,500	4,770.00	16,695,000
ユニオンツール	3,600	2,591.00	9,327,600
オイレス工業	12,600	1,367.00	17,224,200
日精エー・エス・ビー機械	3,300	2,959.00	9,764,700
サトーホールディングス	13,900	2,037.00	28,314,300
技研製作所	8,600	3,760.00	32,336,000
日本エアテック	3,000	1,165.00	3,495,000
カワタ	2,800	637.00	1,783,600
日精樹脂工業	8,100	952.00	7,711,200
オカダアイヨン	3,200	844.00	2,700,800
ワイエイシーホールディングス	4,300	384.00	1,651,200
小松製作所	446,600	1,846.00	824,423,600
住友重機械工業	56,500	2,122.00	119,893,000
日立建機	39,300	2,417.00	94,988,100
日工	13,600	582.00	7,915,200
巴工業	4,200	1,989.00	8,353,800
井関農機	9,800	1,153.00	11,299,400
TOWA	10,100	786.00	7,938,600
丸山製作所	2,200	1,084.00	2,384,800
北川鉄工所	4,400	1,539.00	6,771,600
シンニッタン	15,500	245.00	3,797,500
ローツェ	4,300	4,125.00	17,737,500
タカキタ	3,500	514.00	1,799,000
クボタ	523,100	1,243.50	650,474,850
荏原実業	2,500	2,157.00	5,392,500
東洋エンジニアリング	12,900	335.00	4,321,500
三菱化工機	3,500	1,659.00	5,806,500
月島機械	18,100	1,245.00	22,534,500

帝国電機製作所	8,100	1,321.00	10,700,100
東京機械製作所	4,200	237.00	995,400
新東工業	23,300	756.00	17,614,800
澁谷工業	8,600	2,567.00	22,076,200
アイチコーポレーション	17,200	658.00	11,317,600
小森コーポレーション	24,800	769.00	19,071,200
鶴見製作所	7,500	2,010.00	15,075,000
住友精密工業	1,500	2,275.00	3,412,500
日本ギア工業	3,500	231.00	808,500
酒井重工業	1,900	2,125.00	4,037,500
荏原製作所	40,800	2,150.00	87,720,000
石井鐵工所	1,400	2,265.00	3,171,000
西島製作所	9,800	771.00	7,555,800
北越工業	10,200	1,017.00	10,373,400
ダイキン工業	125,500	13,690.00	1,718,095,000
オルガノ	3,500	5,210.00	18,235,000
トーヨーカネツ	4,300	1,892.00	8,135,600
栗田工業	53,300	2,638.00	140,605,400
椿本チエイン	14,000	2,365.00	33,110,000
大同工業	4,600	669.00	3,077,400
日機装	29,600	809.00	23,946,400
木村化工機	8,300	425.00	3,527,500
レイズネクスト	16,700	1,210.00	20,207,000
アネスト岩田	15,200	857.00	13,026,400
ダイフク	50,400	7,040.00	354,816,000
サムコ	2,700	1,642.00	4,433,400
加藤製作所	5,400	1,195.00	6,453,000
油研工業	1,700	1,367.00	2,323,900
タダノ	47,700	748.00	35,679,600
フジテック	35,900	1,552.00	55,716,800
C K D	27,300	1,594.00	43,516,200
キトー	7,400	984.00	7,281,600
平和	27,300	1,866.00	50,941,800
理想科学工業	8,700	1,479.00	12,867,300
SANKYO	22,000	3,025.00	66,550,000
日本金銭機械	10,900	531.00	5,787,900
マースグループホールディングス	6,300	1,655.00	10,426,500
フクシマガリレイ	6,100	3,165.00	19,306,500
オーイズミ	4,300	350.00	1,505,000
ダイコク電機	4,600	1,141.00	5,248,600
竹内製作所	16,700	1,388.00	23,179,600
アマノ	25,800	2,313.00	59,675,400
JUKI	13,700	574.00	7,863,800
サンデンホールディングス	12,900	332.00	4,282,800
蛇の目ミシン工業	8,900	360.00	3,204,000
ブラザー工業	120,300	1,695.00	203,908,500
マックス	15,000	1,594.00	23,910,000
モリタホールディングス	17,300	1,605.00	27,766,500
グローリー	25,200	2,391.00	60,253,200
新晃工業	9,300	1,444.00	13,429,200

大和冷機工業	14,200	939.00	13,333,800
セガサミーホールディングス	97,700	1,300.00	127,010,000
日本ピストンリング	3,500	1,136.00	3,976,000
リケン	4,500	2,868.00	12,906,000
T P R	13,300	1,146.00	15,241,800
ツバキ・ナカシマ	20,200	615.00	12,423,000
ホシザキ	28,900	7,700.00	222,530,000
大豊工業	8,000	532.00	4,256,000
日本精工	185,700	660.00	122,562,000
N T N	228,100	182.00	41,514,200
ジェイテクト	94,600	711.00	67,260,600
不二越	9,100	2,735.00	24,888,500
ミネベアミツミ	183,100	1,598.00	292,593,800
日本トムソン	29,300	354.00	10,372,200
T H K	57,400	2,309.00	132,536,600
ユーシン精機	7,500	664.00	4,980,000
前澤給装工業	3,600	1,969.00	7,088,400
イーグル工業	12,000	678.00	8,136,000
前澤工業	6,700	319.00	2,137,300
日本ピラー工業	10,100	1,216.00	12,281,600
キッツ	40,100	632.00	25,343,200
日立製作所	473,700	3,079.00	1,458,522,300
三菱電機	985,800	1,305.50	1,286,961,900
富士電機	59,500	2,429.00	144,525,500
東洋電機製造	3,600	1,200.00	4,320,000
安川電機	106,100	3,055.00	324,135,500
シンフォニア テクノロジー	12,700	910.00	11,557,000
明電舎	18,100	1,574.00	28,489,400
オリジン	2,600	1,429.00	3,715,400
山洋電気	4,700	4,175.00	19,622,500
デンヨー	8,300	1,920.00	15,936,000
ベイカレント・コンサルティング	5,700	5,120.00	29,184,000
Orchestra Holdings	2,000	747.00	1,494,000
アイモバイル	2,900	640.00	1,856,000
キャリアインデックス	4,000	257.00	1,028,000
MS - Japan	3,000	697.00	2,091,000
船場	1,600	866.00	1,385,600
グレイステクノロジー	4,300	2,719.00	11,691,700
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	10,100	2,587.00	26,128,700
フルテック	1,400	1,208.00	1,691,200
グリーンズ	2,400	385.00	924,000
ツナググループ・ホールディングス	1,400	360.00	504,000
GAMEWITH	2,200	477.00	1,049,400
ソウルドアウト	1,500	1,915.00	2,872,500
MS & Consulting	1,600	445.00	712,000
日総工産	6,400	390.00	2,496,000
キュービーネットホールディングス	4,000	1,612.00	6,448,000
R P Aホールディングス	5,300	617.00	3,270,100

三櫻工業	12,500	683.00	8,537,500
マキタ	128,600	3,310.00	425,666,000
東芝テック	12,400	3,380.00	41,912,000
芝浦メカトロニクス	1,800	2,362.00	4,251,600
マブチモーター	27,200	3,145.00	85,544,000
日本電産	237,400	5,561.00	1,320,181,400
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	6,100	214.00	1,305,400
トレックス・セミコンダクター	5,700	1,009.00	5,751,300
東光高岳	5,300	900.00	4,770,000
ダブル・スコープ	15,700	317.00	4,976,900
宮越ホールディングス	3,600	521.00	1,875,600
ダイヘン	10,700	2,905.00	31,083,500
ヤーマン	16,200	706.00	11,437,200
JVCケンウッド	80,300	178.00	14,293,400
ミマキエンジニアリング	8,700	396.00	3,445,200
第一精工	4,100	2,100.00	8,610,000
日新電機	23,300	885.00	20,620,500
大崎電気工業	19,500	495.00	9,652,500
オムロン	88,300	5,790.00	511,257,000
日東工業	14,500	1,804.00	26,158,000
I D E C	14,200	1,389.00	19,723,800
正興電機製作所	2,300	929.00	2,136,700
不二電機工業	1,400	1,233.00	1,726,200
ジーエス・ユアサ コーポレーション	32,900	1,412.00	46,454,800
サクサホールディングス	2,300	1,577.00	3,627,100
メルコホールディングス	3,500	2,715.00	9,502,500
テクノメディカ	2,200	1,760.00	3,872,000
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	1,700	486.00	826,200
日本電気	119,700	4,015.00	480,595,500
富士通	95,000	10,040.00	953,800,000
沖電気工業	40,100	994.00	39,859,400
岩崎通信機	4,300	810.00	3,483,000
電気興業	4,700	2,388.00	11,223,600
サンケン電気	10,700	1,987.00	21,260,900
ナカヨ	2,000	1,393.00	2,786,000
アイホン	5,400	1,478.00	7,981,200
ルネサスエレクトロニクス	471,200	448.00	211,097,600
セイコーエプソン	122,400	1,014.00	124,113,600
ワコム	66,400	331.00	21,978,400
アルバック	18,100	2,634.00	47,675,400
アクセル	4,200	702.00	2,948,400
E I Z O	7,600	3,100.00	23,560,000
ジャパンディスプレイ	285,100	48.00	13,684,800
日本信号	25,000	982.00	24,550,000
京三製作所	23,100	452.00	10,441,200
能美防災	13,000	2,018.00	26,234,000
ホーチキ	7,100	1,297.00	9,208,700
星和電機	4,900	561.00	2,748,900
エレコム	10,900	4,370.00	47,633,000

パナソニック	1,126,600	794.10	894,633,060	
シャープ	114,200	1,140.00	130,188,000	
アンリツ	63,600	2,087.00	132,733,200	
富士通ゼネラル	26,700	1,812.00	48,380,400	
ソニー	623,900	6,507.00	4,059,717,300	
T D K	47,700	8,600.00	410,220,000	
帝国通信工業	4,400	1,168.00	5,139,200	
タムラ製作所	33,200	377.00	12,516,400	
アルプスアルパイン	87,500	994.00	86,975,000	
池上通信機	3,200	812.00	2,598,400	
日本電波工業	8,900	385.00	3,426,500	
鈴木	4,800	717.00	3,441,600	
日本トリム	1,400	2,838.00	3,973,200	
ローランド ディー・ジー	5,400	1,240.00	6,696,000	
フォスター電機	10,400	1,077.00	11,200,800	
S M K	2,500	2,352.00	5,880,000	
ヨコオ	6,400	2,222.00	14,220,800	
ティアック	7,300	150.00	1,095,000	
ホシデン	26,900	834.00	22,434,600	
ヒロセ電機	15,200	10,960.00	166,592,000	
日本航空電子工業	22,600	1,298.00	29,334,800	
T O A	10,600	704.00	7,462,400	
マクセルホールディングス	21,300	988.00	21,044,400	
古野電気	12,700	863.00	10,960,100	
ユニデンホールディングス	2,700	1,783.00	4,814,100	
スミダコーポレーション	7,500	632.00	4,740,000	
アイコム	5,400	2,495.00	13,473,000	
リオン	4,200	2,287.00	9,605,400	
本多通信工業	8,700	376.00	3,271,200	
船井電機	9,900	456.00	4,514,400	
横河電機	90,500	1,342.00	121,451,000	
新電元工業	3,500	2,331.00	8,158,500	
アズビル	62,200	2,762.00	171,796,400	
東亜ディーケーケー	4,800	897.00	4,305,600	
日本光電工業	40,700	3,785.00	154,049,500	
チノー	3,500	1,232.00	4,312,000	
共和電業	10,300	372.00	3,831,600	
日本電子材料	4,000	854.00	3,416,000	
堀場製作所	19,500	5,360.00	104,520,000	
アドバンテスト	73,400	4,430.00	325,162,000	
小野測器	4,200	479.00	2,011,800	
エスベック	8,800	1,574.00	13,851,200	
キーエンス	89,300	36,430.00	3,253,199,000	
日置電機	5,100	3,045.00	15,529,500	
シスメックス	70,400	7,950.00	559,680,000	
日本マイクロニクス	17,300	770.00	13,321,000	
メガチップス	9,300	1,536.00	14,284,800	
O B A R A G R O U P	5,000	2,422.00	12,110,000	
I M A G I C A G R O U P	8,300	346.00	2,871,800	
澤藤電機	1,300	1,617.00	2,102,100	

デンソー	217,000	3,676.00	797,692,000
原田工業	4,700	802.00	3,769,400
コーセル	13,000	911.00	11,843,000
イリソ電子工業	8,200	3,010.00	24,682,000
オブテックスグループ	16,200	1,008.00	16,329,600
千代田インテグレ	4,500	1,688.00	7,596,000
アイ・オー・データ機器	3,300	892.00	2,943,600
レーザーテック	43,300	5,190.00	224,727,000
スタンレー電気	69,300	2,266.00	157,033,800
岩崎電気	3,900	1,275.00	4,972,500
ウシオ電機	54,500	1,016.00	55,372,000
岡谷電機産業	7,900	315.00	2,488,500
ヘリオス テクノ ホールディング	9,400	339.00	3,186,600
エノモト	2,900	885.00	2,566,500
日本セラミック	10,100	1,881.00	18,998,100
遠藤照明	4,800	564.00	2,707,200
古河電池	7,000	549.00	3,843,000
双信電機	4,900	333.00	1,631,700
山一電機	7,100	1,311.00	9,308,100
図研	6,500	2,181.00	14,176,500
日本電子	19,400	2,720.00	52,768,000
カシオ計算機	87,400	1,620.00	141,588,000
ファナック	93,600	14,595.00	1,366,092,000
日本シイエムケイ	23,300	417.00	9,716,100
エンプラス	5,000	2,203.00	11,015,000
大真空	3,600	1,670.00	6,012,000
ローム	43,800	6,260.00	274,188,000
浜松ホトニクス	70,800	4,440.00	314,352,000
三井ハイテック	10,900	1,078.00	11,750,200
新光電気工業	33,000	1,043.00	34,419,000
京セラ	138,700	6,075.00	842,602,500
協栄産業	1,000	1,081.00	1,081,000
太陽誘電	43,900	2,787.00	122,349,300
村田製作所	289,600	5,594.00	1,620,022,400
双葉電子工業	15,800	1,017.00	16,068,600
日東電工	68,000	4,850.00	329,800,000
北陸電気工業	4,000	851.00	3,404,000
東海理化電機製作所	26,000	1,314.00	34,164,000
ニチコン	33,400	650.00	21,710,000
日本ケミコン	7,400	1,091.00	8,073,400
K O A	14,900	867.00	12,918,300
三井E & Sホールディングス	35,700	554.00	19,777,800
日立造船	78,200	340.00	26,588,000
三菱重工業	165,200	2,634.00	435,136,800
川崎重工業	76,600	1,452.00	111,223,200
I H I	71,100	1,200.00	85,320,000
名村造船所	31,500	191.00	6,016,500
サノヤスホールディングス	12,100	140.00	1,694,000
スプリックス	3,300	727.00	2,399,100
マネジメントソリューションズ	2,800	1,003.00	2,808,400

カーブスホールディングス	23,400	466.00	10,904,400	
日本車輛製造	3,600	2,562.00	9,223,200	
三菱ロジスネクスト	13,000	892.00	11,596,000	
近畿車輛	1,600	1,064.00	1,702,400	
F P G	30,200	531.00	16,036,200	
島根銀行	2,000	431.00	862,000	
じもとホールディングス	66,000	90.00	5,940,000	
全国保証	27,300	2,950.00	80,535,000	
めぶきフィナンシャルグループ	505,600	212.00	107,187,200	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	13,000	1,098.00	14,274,000	
九州フィナンシャルグループ	159,600	443.00	70,702,800	
かんぽ生命保険	34,500	1,320.00	45,540,000	
ゆうちょ銀行	275,200	987.00	271,622,400	
富山第一銀行	22,800	282.00	6,429,600	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	572,100	306.00	175,062,600	
ジェイリース	2,800	219.00	613,200	
西日本フィナンシャルホールディングス	66,400	611.00	40,570,400	
マーキュリアインベストメント	4,400	539.00	2,371,600	
イントラスト	3,500	577.00	2,019,500	
日本モーゲージサービス	2,000	1,560.00	3,120,000	
C A S A	3,500	1,068.00	3,738,000	
アルヒ	15,500	1,186.00	18,383,000	
プレミアグループ	5,200	1,466.00	7,623,200	
日産自動車	1,163,000	369.00	429,147,000	
いすゞ自動車	285,700	738.70	211,046,590	
トヨタ自動車	1,100,100	6,525.00	7,178,152,500	代用有価証券 250,000株
日野自動車	123,100	579.00	71,274,900	
三菱自動車工業	365,200	305.00	111,386,000	
エフテック	7,000	419.00	2,933,000	
レシップホールディングス	4,100	423.00	1,734,300	
G M B	1,800	577.00	1,038,600	
ファルテック	1,800	600.00	1,080,000	
武蔵精密工業	22,000	770.00	16,940,000	
日産車体	19,200	824.00	15,820,800	
新明和工業	26,500	1,101.00	29,176,500	
極東開発工業	18,300	1,203.00	22,014,900	
日信工業	20,000	2,206.00	44,120,000	
トピー工業	8,100	1,205.00	9,760,500	
ティラド	3,600	1,277.00	4,597,200	
曙ブレーキ工業	54,300	167.00	9,068,100	
タチエス	16,200	935.00	15,147,000	
N O K	52,900	1,103.00	58,348,700	
フタバ産業	27,300	449.00	12,257,700	
K Y B	11,100	2,026.00	22,488,600	
市光工業	14,800	441.00	6,526,800	
大同メタル工業	19,000	520.00	9,880,000	
プレス工業	48,900	244.00	11,931,600	

ミクニ	12,600	234.00	2,948,400
太平洋工業	20,600	799.00	16,459,400
ケーヒン	22,600	2,540.00	57,404,000
河西工業	13,400	494.00	6,619,600
アイシン精機	81,100	2,736.00	221,889,600
マツダ	290,100	571.00	165,647,100
今仙電機製作所	9,300	685.00	6,370,500
本田技研工業	776,200	2,336.50	1,813,591,300
スズキ	195,400	3,034.00	592,843,600
S U B A R U	306,000	2,005.50	613,683,000
安永	4,700	972.00	4,568,400
ヤマハ発動機	128,700	1,263.00	162,548,100
ショーワ	23,400	2,250.00	52,650,000
小糸製作所	59,200	3,890.00	230,288,000
T B K	11,700	460.00	5,382,000
エクセディ	13,400	1,544.00	20,689,600
ミツバ	18,100	433.00	7,837,300
豊田合成	31,700	1,826.00	57,884,200
愛三工業	15,500	525.00	8,137,500
盟和産業	1,600	905.00	1,448,000
日本プラスト	7,600	425.00	3,230,000
ヨロズ	9,300	1,057.00	9,830,100
エフ・シー・シー	16,200	1,522.00	24,656,400
新家工業	2,200	1,012.00	2,226,400
シマノ	36,900	15,340.00	566,046,000
テイ・エス テック	23,000	2,762.00	63,526,000
関西みらいフィナンシャルグループ	57,000	345.00	19,665,000
三十三フィナンシャルグループ	9,000	1,429.00	12,861,000
第四北越フィナンシャルグループ	16,900	2,246.00	37,957,400
ジャムコ	4,900	665.00	3,258,500
小野建	8,700	1,155.00	10,048,500
はるやまホールディングス	4,400	690.00	3,036,000
南陽	2,100	1,229.00	2,580,900
ノジマ	17,300	1,771.00	30,638,300
佐鳥電機	6,600	794.00	5,240,400
カッパ・クリエイト	13,600	1,293.00	17,584,800
エコトレーディング	2,300	493.00	1,133,900
伯東	5,900	947.00	5,587,300
コンドーテック	7,400	916.00	6,778,400
中山福	5,400	425.00	2,295,000
ライトオン	7,200	483.00	3,477,600
ナガイレーベン	14,000	2,481.00	34,734,000
ジーンズメイト	3,000	222.00	666,000
三菱食品	10,600	2,644.00	28,026,400
良品計画	129,000	1,036.00	133,644,000
三城ホールディングス	10,300	253.00	2,605,900
松田産業	7,100	1,276.00	9,059,600
第一興商	14,700	2,783.00	40,910,100
メディバルホールディングス	104,800	2,156.00	225,948,800
アドヴァン	14,800	1,050.00	15,540,000

S P K	4,300	1,266.00	5,443,800
萩原電気ホールディングス	3,600	2,072.00	7,459,200
アルビス	3,600	2,044.00	7,358,400
アズワン	6,400	9,400.00	60,160,000
スズデン	3,500	1,091.00	3,818,500
尾家産業	2,800	1,430.00	4,004,000
シモジマ	5,900	1,231.00	7,262,900
ドウシシャ	9,300	1,239.00	11,522,700
小津産業	2,200	1,831.00	4,028,200
コナカ	11,200	293.00	3,281,600
高速	5,700	1,228.00	6,999,600
ハウス オブ ローゼ	1,300	1,509.00	1,961,700
G - 7ホールディングス	5,700	2,223.00	12,671,100
たけびし	3,500	1,281.00	4,483,500
イオン北海道	11,700	747.00	8,739,900
コジマ	16,900	352.00	5,948,800
ヒマラヤ	3,500	701.00	2,453,500
コーナン商事	13,700	2,272.00	31,126,400
ネットワンシステムズ	36,900	2,456.00	90,626,400
エコス	3,500	1,807.00	6,324,500
ワタミ	11,700	938.00	10,974,600
マルシェ	2,600	510.00	1,326,000
リックス	2,200	1,464.00	3,220,800
システムソフト	24,400	69.00	1,683,600
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	213,500	1,887.00	402,874,500
丸文	8,700	504.00	4,384,800
西松屋チェーン	21,400	852.00	18,232,800
ゼンショーホールディングス	46,500	2,041.00	94,906,500
ハビネット	8,200	1,075.00	8,815,000
幸楽苑ホールディングス	6,200	1,367.00	8,475,400
ハークスレイ	2,000	1,005.00	2,010,000
橋本総業ホールディングス	2,000	1,773.00	3,546,000
日本ライフライン	28,800	1,255.00	36,144,000
サイゼリヤ	16,100	1,991.00	32,055,100
タカショー	4,800	462.00	2,217,600
V Tホールディングス	40,300	280.00	11,284,000
マルカ	3,500	1,704.00	5,964,000
アルゴグラフィックス	8,200	3,240.00	26,568,000
魚力	2,600	1,463.00	3,803,800
I D O M	26,200	384.00	10,060,800
日本エム・ディ・エム	5,700	1,463.00	8,339,100
ポブラ	2,600	434.00	1,128,400
フジ・コーポレーション	2,500	1,775.00	4,437,500
ユナイテッドアローズ	10,300	1,578.00	16,253,400
進和	5,700	1,710.00	9,747,000
エスケイジャパン	2,100	271.00	569,100
ダイトロン	4,100	1,442.00	5,912,200
ハイデイ日高	14,000	1,480.00	20,720,000
シークス	12,300	815.00	10,024,500

京都きもの友禅	6,400	245.00	1,568,000
コロワイド	32,200	1,452.00	46,754,400
ピーシーデポコーポレーション	12,900	473.00	6,101,700
田中商事	3,000	651.00	1,953,000
オーハシテクニカ	5,400	1,351.00	7,295,400
壱番屋	6,800	4,145.00	28,186,000
白銅	3,500	1,212.00	4,242,000
トップカルチャー	3,600	314.00	1,130,400
P L A N T	2,600	445.00	1,157,000
スギホールディングス	19,400	5,660.00	109,804,000
薬王堂ホールディングス	4,200	2,327.00	9,773,400
島津製作所	117,700	2,884.00	339,446,800
J M S	8,300	844.00	7,005,200
クボテック	2,600	349.00	907,400
長野計器	7,100	778.00	5,523,800
ブイ・テクノロジー	4,600	3,200.00	14,720,000
スター精密	15,200	1,060.00	16,112,000
東京計器	6,400	716.00	4,582,400
愛知時計電機	1,400	4,475.00	6,265,000
インターアクション	5,200	1,962.00	10,202,400
オーバル	8,600	212.00	1,823,200
東京精密	17,800	3,175.00	56,515,000
マニー	39,200	2,398.00	94,001,600
ニコン	159,600	953.00	152,098,800
トプコン	49,600	799.00	39,630,400
オリンパス	545,600	1,569.00	856,046,400
理研計器	8,700	2,038.00	17,730,600
S C R E E Nホールディングス	17,200	3,925.00	67,510,000
キヤノン電子	10,500	1,596.00	16,758,000
タムロン	7,900	1,740.00	13,746,000
H O Y A	196,900	9,615.00	1,893,193,500
シード	4,200	797.00	3,347,400
ノーリツ鋼機	6,700	1,001.00	6,706,700
エー・アンド・デイ	9,000	636.00	5,724,000
朝日インテック	83,800	2,890.00	242,182,000
キヤノン	530,800	2,270.00	1,204,916,000
リコー	250,900	686.00	172,117,400
シチズン時計	115,800	367.00	42,498,600
リズム時計工業	3,000	610.00	1,830,000
大研医器	6,900	642.00	4,429,800
メニコン	13,900	4,825.00	67,067,500
シンシア	1,300	359.00	466,700
中本パックス	2,500	1,347.00	3,367,500
スノーピーク	5,000	714.00	3,570,000
パラマウントベッドホールディングス	10,500	4,425.00	46,462,500
トランザクション	6,400	853.00	5,459,200
粧美堂	2,900	331.00	959,900
ニホンフラッシュ	9,100	1,149.00	10,455,900
前田工織	10,900	1,965.00	21,418,500
永大産業	12,800	265.00	3,392,000

アートネイチャー	10,700	671.00	7,179,700
バンダイナムコホールディングス	102,000	5,523.00	563,346,000
アイフィスジャパン	2,600	631.00	1,640,600
共立印刷	16,200	145.00	2,349,000
SHOEI	9,400	2,079.00	19,542,600
フランスベッドホールディングス	13,800	863.00	11,909,400
マーベラス	15,000	513.00	7,695,000
パイロットコーポレーション	16,200	3,350.00	54,270,000
萩原工業	5,400	1,271.00	6,863,400
エイベックス	17,000	827.00	14,059,000
トッパン・フォームズ	21,100	963.00	20,319,300
フジシールインターナショナル	22,100	1,863.00	41,172,300
タカラトミー	44,400	813.00	36,097,200
廣済堂	7,000	802.00	5,614,000
エステールホールディングス	2,500	633.00	1,582,500
アーク	35,900	83.00	2,979,700
レック	10,500	1,104.00	11,592,000
タカノ	3,900	688.00	2,683,200
三光合成	11,300	240.00	2,712,000
プロネクス	8,300	1,009.00	8,374,700
ホクシン	6,400	113.00	723,200
ウッドワン	3,200	1,030.00	3,296,000
大建工業	6,600	1,693.00	11,173,800
きもと	17,300	128.00	2,214,400
凸版印刷	139,200	1,543.00	214,785,600
大日本印刷	129,000	2,294.00	295,926,000
共同印刷	2,900	2,703.00	7,838,700
NISSHA	20,200	716.00	14,463,200
光村印刷	800	1,430.00	1,144,000
藤森工業	8,900	3,075.00	27,367,500
ヴィア・ホールディングス	11,700	410.00	4,797,000
TAKARA & COMPANY	4,700	1,765.00	8,295,500
前澤化成工業	6,200	993.00	6,156,600
未来工業	5,200	1,906.00	9,911,200
アシックス	81,400	916.00	74,562,400
ツツミ	3,000	1,617.00	4,851,000
ウェーブロックホールディングス	3,500	623.00	2,180,500
JSP	5,700	1,334.00	7,603,800
ニチハ	13,700	1,958.00	26,824,600
エフピコ	10,900	7,710.00	84,039,000
小松ウオール工業	3,000	1,825.00	5,475,000
ヤマハ	58,800	4,145.00	243,726,000
河合楽器製作所	3,000	2,463.00	7,389,000
クリナップ	9,100	515.00	4,686,500
ピジョン	59,600	4,035.00	240,486,000
天馬	6,600	1,581.00	10,434,600
オリバー	2,100	2,895.00	6,079,500
兼松サステック	600	1,473.00	883,800
キングジム	8,300	814.00	6,756,200
象印マホービン	29,000	1,481.00	42,949,000

リンテック	23,500	2,297.00	53,979,500
信越ポリマー	17,600	823.00	14,484,800
東リ	24,300	250.00	6,075,000
イトーキ	20,700	305.00	6,313,500
任天堂	60,400	44,310.00	2,676,324,000
三菱鉛筆	16,300	1,373.00	22,379,900
松風	4,400	1,554.00	6,837,600
タカラスタANDARD	20,200	1,619.00	32,703,800
コクヨ	47,200	1,427.00	67,354,400
ナカバヤシ	9,800	528.00	5,174,400
ニフコ	36,200	1,876.00	67,911,200
立川ブラインド工業	4,300	1,055.00	4,536,500
グローブライト	4,400	1,731.00	7,616,400
オカムラ	34,400	775.00	26,660,000
バルカー	8,000	1,806.00	14,448,000
MUTOHホールディングス	1,400	1,431.00	2,003,400
伊藤忠商事	679,200	2,089.00	1,418,848,800
丸紅	1,010,800	497.50	502,873,000
スクロール	14,800	282.00	4,173,600
高島	1,600	1,499.00	2,398,400
ヨンドシーホールディングス	9,900	1,766.00	17,483,400
三陽商会	4,900	890.00	4,361,000
長瀬産業	54,500	1,283.00	69,923,500
ナイガイ	3,600	427.00	1,537,200
蝶理	6,200	1,458.00	9,039,600
豊田通商	108,400	2,291.00	248,344,400
オンワードホールディングス	57,800	389.00	22,484,200
三共生興	14,500	464.00	6,728,000
兼松	36,300	1,105.00	40,111,500
美津濃	9,000	1,714.00	15,426,000
ツカモトコーポレーション	1,800	1,072.00	1,929,600
ファミリーマート	77,600	1,696.00	131,609,600
ルックホールディングス	3,300	751.00	2,478,300
三井物産	853,400	1,481.00	1,263,885,400
日本紙パルプ商事	5,400	3,615.00	19,521,000
東京エレクトロン	62,500	21,790.00	1,361,875,000
日立ハイテク	31,600	7,950.00	251,220,000
カメイ	12,500	1,065.00	13,312,500
東都水産	1,300	2,656.00	3,452,800
OUGホールディングス	1,600	2,454.00	3,926,400
スターゼン	3,500	4,290.00	15,015,000
セイコーホールディングス	13,900	1,658.00	23,046,200
山善	37,900	895.00	33,920,500
椿本興業	1,800	3,275.00	5,895,000
住友商事	612,800	1,189.50	728,925,600
日本ユニシス	30,300	2,922.00	88,536,600
内田洋行	4,200	4,265.00	17,913,000
三菱商事	681,400	2,185.50	1,489,199,700
第一実業	4,700	3,515.00	16,520,500
キヤノンマーケティングジャパン	27,900	2,122.00	59,203,800

西華産業	5,400	1,091.00	5,891,400
佐藤商事	7,900	790.00	6,241,000
菱洋エレクトロ	9,900	2,249.00	22,265,100
東京産業	8,900	478.00	4,254,200
ユアサ商事	9,300	2,952.00	27,453,600
神鋼商事	2,400	1,650.00	3,960,000
トルク	5,900	254.00	1,498,600
阪和興業	18,200	1,600.00	29,120,000
正栄食品工業	6,300	3,800.00	23,940,000
カナデン	7,900	1,177.00	9,298,300
菱電商事	7,000	1,347.00	9,429,000
ニプロ	68,100	1,181.00	80,426,100
フルサト工業	5,300	1,337.00	7,086,100
岩谷産業	21,600	3,675.00	79,380,000
ナイス	4,200	877.00	3,683,400
昭光通商	3,200	576.00	1,843,200
ニチモウ	1,600	1,611.00	2,577,600
極東貿易	2,800	1,304.00	3,651,200
イワキ	12,900	456.00	5,882,400
兼松エレクトロニクス	5,200	3,435.00	17,862,000
三愛石油	23,900	1,126.00	26,911,400
稲畑産業	21,300	1,141.00	24,303,300
G S Iクレオス	2,400	941.00	2,258,400
明和産業	9,100	467.00	4,249,700
クワザワ	3,500	467.00	1,634,500
キムラタン	52,700	24.00	1,264,800
ゴールドウイン	17,500	5,500.00	96,250,000
ユニ・チャーム	190,000	3,989.00	757,910,000
デサント	18,900	1,261.00	23,832,900
キング	4,600	467.00	2,148,200
ワキタ	20,500	1,005.00	20,602,500
ヤマトインターナショナル	5,900	325.00	1,917,500
東邦ホールディングス	31,100	2,339.00	72,742,900
サンゲツ	26,400	1,564.00	41,289,600
ミツウロコグループホールディングス	14,400	1,075.00	15,480,000
シナネンホールディングス	4,000	2,701.00	10,804,000
伊藤忠エネクス	21,400	831.00	17,783,400
サンリオ	27,300	1,469.00	40,103,700
サンワテクノス	6,900	813.00	5,609,700
リョーサン	10,600	2,343.00	24,835,800
新光商事	15,200	830.00	12,616,000
トーヨー	4,400	1,677.00	7,378,800
三信電気	5,200	1,413.00	7,347,600
東陽テクニカ	11,300	981.00	11,085,300
モスフードサービス	12,700	2,589.00	32,880,300
加賀電子	9,700	1,724.00	16,722,800
三益半導体工業	7,600	1,922.00	14,607,200
ソーダニッカ	9,900	577.00	5,712,300
立花エレテック	7,100	1,462.00	10,380,200
木曽路	12,700	2,325.00	29,527,500

S R S ホールディングス	11,500	810.00	9,315,000
千趣会	17,600	350.00	6,160,000
タカキュー	7,900	129.00	1,019,100
ケーヨー	19,600	514.00	10,074,400
上新電機	11,400	1,918.00	21,865,200
日本瓦斯	15,400	3,400.00	52,360,000
ロイヤルホールディングス	17,300	1,635.00	28,285,500
東天紅	700	821.00	574,700
いなげや	11,900	1,529.00	18,195,100
島忠	18,300	2,691.00	49,245,300
チヨダ	10,200	1,044.00	10,648,800
ライフコーポレーション	7,300	3,250.00	23,725,000
リンガーハット	12,000	2,027.00	24,324,000
MrMaxHD	13,000	401.00	5,213,000
テナライド	8,900	339.00	3,017,100
AOKIホールディングス	19,700	666.00	13,120,200
オークワ	15,100	1,519.00	22,936,900
コメリ	14,900	1,935.00	28,831,500
青山商事	20,000	849.00	16,980,000
しまむら	11,300	6,360.00	71,868,000
はせがわ	5,200	408.00	2,121,600
高島屋	70,900	959.00	67,993,100
松屋	19,500	654.00	12,753,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	45,900	808.00	37,087,200
近鉄百貨店	3,800	2,330.00	8,854,000
丸井グループ	89,000	1,646.00	146,494,000
クレディセゾン	68,100	1,105.00	75,250,500
アクシアル リテイリング	8,000	3,895.00	31,160,000
井筒屋	5,600	149.00	834,400
イオン	373,700	2,176.00	813,171,200
イズミ	19,700	2,826.00	55,672,200
フォーバル	4,200	1,060.00	4,452,000
平和堂	19,600	1,774.00	34,770,400
フジ	11,700	1,756.00	20,545,200
ヤオコー	11,000	6,330.00	69,630,000
ゼビオホールディングス	11,700	867.00	10,143,900
ケーズホールディングス	93,700	1,139.00	106,724,300
PALTAC	15,700	5,420.00	85,094,000
三谷産業	12,700	313.00	3,975,100
Olympicグループ	5,000	606.00	3,030,000
日産東京販売ホールディングス	14,500	204.00	2,958,000
新生銀行	71,500	1,444.00	103,246,000
あおぞら銀行	57,900	2,050.00	118,695,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	6,652,200	420.80	2,799,245,760
りそなホールディングス	1,067,500	332.90	355,370,750
三井住友トラスト・ホールディングス	183,800	3,080.00	566,104,000
三井住友フィナンシャルグループ	672,600	2,781.50	1,870,836,900
千葉銀行	324,600	474.00	153,860,400
群馬銀行	191,300	329.00	62,937,700
武蔵野銀行	14,500	1,322.00	19,169,000

千葉興業銀行	26,700	240.00	6,408,000
筑波銀行	40,700	157.00	6,389,900
七十七銀行	32,800	1,302.00	42,705,600
青森銀行	7,400	2,140.00	15,836,000
秋田銀行	6,300	1,355.00	8,536,500
山形銀行	10,900	1,345.00	14,660,500
岩手銀行	6,400	2,587.00	16,556,800
東邦銀行	86,400	242.00	20,908,800
東北銀行	4,700	847.00	3,980,900
みちのく銀行	6,400	1,072.00	6,860,800
ふくおかフィナンシャルグループ	81,900	1,390.00	113,841,000
静岡銀行	241,000	625.00	150,625,000
十六銀行	12,100	1,849.00	22,372,900
スルガ銀行	99,600	348.00	34,660,800
八十二銀行	234,700	373.00	87,543,100
山梨中央銀行	11,400	726.00	8,276,400
大垣共立銀行	19,200	2,073.00	39,801,600
福井銀行	8,300	1,484.00	12,317,200
北國銀行	10,100	3,370.00	34,037,000
清水銀行	4,100	1,758.00	7,207,800
富山銀行	1,900	1,800.00	3,420,000
滋賀銀行	19,500	2,588.00	50,466,000
南都銀行	16,200	2,136.00	34,603,200
百五銀行	87,600	299.00	26,192,400
京都銀行	34,900	3,480.00	121,452,000
紀陽銀行	34,400	1,523.00	52,391,200
ほくほくフィナンシャルグループ	64,800	855.00	55,404,000
広島銀行	143,300	436.00	62,478,800
山陰合同銀行	57,500	560.00	32,200,000
中国銀行	83,700	1,002.00	83,867,400
鳥取銀行	3,500	1,242.00	4,347,000
伊予銀行	138,600	559.00	77,477,400
百十四銀行	10,400	1,911.00	19,874,400
四国銀行	14,700	788.00	11,583,600
阿波銀行	16,000	2,379.00	38,064,000
大分銀行	5,600	2,005.00	11,228,000
宮崎銀行	6,500	2,277.00	14,800,500
佐賀銀行	5,800	1,060.00	6,148,000
沖縄銀行	8,900	3,095.00	27,545,500
琉球銀行	22,400	980.00	21,952,000
セブン銀行	325,500	285.00	92,767,500
みずほフィナンシャルグループ	13,214,400	124.60	1,646,514,240
高知銀行	3,500	649.00	2,271,500
山口フィナンシャルグループ	121,400	565.00	68,591,000
芙蓉総合リース	10,300	5,360.00	55,208,000
みずほリース	15,000	2,087.00	31,305,000
東京センチュリー	19,500	3,665.00	71,467,500
SBIホールディングス	108,600	1,736.00	188,529,600
日本証券金融	42,700	492.00	21,008,400
アイフル	148,600	222.00	32,989,200

日本アジア投資	8,500	190.00	1,615,000	
長野銀行	3,200	1,120.00	3,584,000	
名古屋銀行	7,900	2,286.00	18,059,400	
北洋銀行	146,100	191.00	27,905,100	
愛知銀行	3,500	3,005.00	10,517,500	
中京銀行	4,100	2,051.00	8,409,100	
大光銀行	3,500	1,482.00	5,187,000	
愛媛銀行	13,500	1,143.00	15,430,500	
トマト銀行	3,800	973.00	3,697,400	
京葉銀行	41,300	506.00	20,897,800	
栃木銀行	47,300	148.00	7,000,400	
北日本銀行	3,000	1,830.00	5,490,000	
東和銀行	17,200	600.00	10,320,000	
福島銀行	9,600	157.00	1,507,200	
大東銀行	5,100	545.00	2,779,500	
リコーリース	7,600	2,802.00	21,295,200	
イオンフィナンシャルサービス	59,600	1,095.00	65,262,000	
アコム	195,200	447.00	87,254,400	
ジャックス	10,700	1,647.00	17,622,900	
オリエントコーポレーション	262,900	117.00	30,759,300	
日立キャピタル	23,000	1,966.00	45,218,000	
アプラスフィナンシャル	46,300	59.00	2,731,700	
オリックス	608,100	1,258.00	764,989,800	
三菱UFJリース	246,600	495.00	122,067,000	
ジャフコ	14,900	3,050.00	45,445,000	
九州リースサービス	4,500	425.00	1,912,500	
トモニホールディングス	74,800	366.00	27,376,800	
大和証券グループ本社	780,000	418.90	326,742,000	
野村ホールディングス	1,711,000	427.80	731,965,800	
岡三証券グループ	82,700	341.00	28,200,700	
丸三証券	29,000	433.00	12,557,000	
東洋証券	34,500	133.00	4,588,500	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	111,900	245.00	27,415,500	
光世証券	2,200	548.00	1,205,600	
水戸証券	28,100	195.00	5,479,500	
いちよし証券	18,200	440.00	8,008,000	
松井証券	55,500	799.00	44,344,500	
SOMPOホールディングス	182,900	3,554.00	650,026,600	
だいこう証券ビジネス	4,800	475.00	2,280,000	
日本取引所グループ	279,000	2,068.00	576,972,000	
マネックスグループ	73,500	193.00	14,185,500	
極東証券	13,000	529.00	6,877,000	
岩井コスモホールディングス	9,300	918.00	8,537,400	
藍澤證券	17,400	725.00	12,615,000	
フィデアホールディングス	94,600	96.00	9,081,600	
池田泉州ホールディングス	112,100	155.00	17,375,500	
アニコムホールディングス	8,000	3,470.00	27,760,000	
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	254,200	3,000.00	762,600,000	

ソニーフィナンシャルホールディングス	79,900	1,821.00	145,497,900	
マネーパートナーズグループ	10,600	195.00	2,067,000	
スパークス・グループ	33,600	172.00	5,779,200	
小林洋行	2,800	229.00	641,200	
第一生命ホールディングス	550,300	1,331.50	732,724,450	
東京海上ホールディングス	347,700	5,124.00	1,781,614,800	
アドバンテッジリスクマネジメント	4,800	645.00	3,096,000	
イー・ギャランティ	10,500	1,830.00	19,215,000	
アサックス	5,000	602.00	3,010,000	
NECキャピタルソリューション	4,000	1,838.00	7,352,000	
T&Dホールディングス	290,900	875.00	254,537,500	
アドバンスクリエイト	2,300	1,762.00	4,052,600	
三井不動産	479,700	1,891.00	907,112,700	
三菱地所	681,400	1,701.00	1,159,061,400	
平和不動産	17,800	2,675.00	47,615,000	
東京建物	102,400	1,098.00	112,435,200	
ダイビル	24,900	849.00	21,140,100	
京阪神ビルディング	15,900	1,323.00	21,035,700	
住友不動産	218,700	2,722.50	595,410,750	
太平洋興発	3,900	601.00	2,343,900	
テオーシー	19,100	601.00	11,479,100	
東京楽天地	1,600	4,085.00	6,536,000	
レオパレス21	127,500	246.00	31,365,000	
スターツコーポレーション	13,200	2,068.00	27,297,600	
フジ住宅	11,100	492.00	5,461,200	
空港施設	9,400	403.00	3,788,200	
明和地所	4,900	420.00	2,058,000	
ゴールドクレスト	7,600	1,652.00	12,555,200	
リログループ	51,500	2,225.00	114,587,500	
エスリード	3,800	1,257.00	4,776,600	
日神グループホールディングス	14,400	380.00	5,472,000	
日本エスコン	17,600	612.00	10,771,200	
タカラレーベン	44,300	341.00	15,106,300	
A V A N T I A	5,400	546.00	2,948,400	
イオンモール	48,700	1,295.00	63,066,500	
毎日コムネット	2,400	772.00	1,852,800	
ファースト住建	4,100	1,024.00	4,198,400	
ランド	532,000	9.00	4,788,000	
カチタス	24,100	1,794.00	43,235,400	
東祥	5,900	883.00	5,209,700	
トーセイ	13,400	994.00	13,319,600	
穴吹興産	2,200	1,378.00	3,031,600	
サンフロンティア不動産	13,400	790.00	10,586,000	
エフ・ジェー・ネクスト	8,600	783.00	6,733,800	
インテリックス	2,700	535.00	1,444,500	
ランドビジネス	4,100	282.00	1,156,200	
日本社宅サービス	2,300	873.00	2,007,900	
グランディハウス	7,800	320.00	2,496,000	
東武鉄道	104,000	3,505.00	364,520,000	

相鉄ホールディングス	31,500	2,748.00	86,562,000	
東急	248,900	1,647.00	409,938,300	
京浜急行電鉄	126,700	1,781.00	225,652,700	
小田急電鉄	146,600	2,313.00	339,085,800	
京王電鉄	51,100	6,070.00	310,177,000	
京成電鉄	68,600	3,010.00	206,486,000	
富士急行	13,600	2,768.00	37,644,800	
新京成電鉄	2,500	2,041.00	5,102,500	
東日本旅客鉄道	173,600	8,224.00	1,427,686,400	
西日本旅客鉄道	87,900	6,954.00	611,256,600	
東海旅客鉄道	81,900	17,475.00	1,431,202,500	
西武ホールディングス	132,700	1,238.00	164,282,600	
鴻池運輸	15,800	1,171.00	18,501,800	
西日本鉄道	27,200	2,546.00	69,251,200	
ハマキョウレックス	7,500	2,689.00	20,167,500	
サカイ引越センター	5,100	5,580.00	28,458,000	
近鉄グループホールディングス	93,600	5,100.00	477,360,000	
阪急阪神ホールディングス	124,600	3,590.00	447,314,000	
南海電気鉄道	44,400	2,333.00	103,585,200	
京阪ホールディングス	41,600	4,725.00	196,560,000	
神戸電鉄	2,200	3,680.00	8,096,000	
名古屋鉄道	76,900	3,055.00	234,929,500	
山陽電気鉄道	6,600	2,002.00	13,213,200	
トランコム	2,600	7,060.00	18,356,000	
日本通運	33,000	5,040.00	166,320,000	
ヤマトホールディングス	163,700	1,911.00	312,830,700	
山九	26,000	3,990.00	103,740,000	
日新	8,100	1,678.00	13,591,800	
丸運	5,400	226.00	1,220,400	
丸全昭和運輸	7,500	2,261.00	16,957,500	
センコーグループホールディングス	51,500	850.00	43,775,000	
トナミホールディングス	2,200	4,960.00	10,912,000	
ニッコンホールディングス	33,300	2,040.00	67,932,000	
日本石油輸送	900	2,761.00	2,484,900	
福山通運	11,800	3,655.00	43,129,000	
セイノーホールディングス	70,000	1,216.00	85,120,000	
エスライン	2,800	833.00	2,332,400	
神奈川中央交通	2,300	3,950.00	9,085,000	
日立物流	17,200	2,396.00	41,211,200	
丸和運輸機関	9,900	2,707.00	26,799,300	
C & F ロジホールディングス	9,400	1,203.00	11,308,200	
日本郵船	78,100	1,335.00	104,263,500	
商船三井	59,200	1,754.00	103,836,800	
川崎汽船	28,800	914.00	26,323,200	
N S ユナイテッド海運	5,100	1,386.00	7,068,600	
明治海運	10,100	328.00	3,312,800	
飯野海運	43,700	306.00	13,372,200	
共栄タンカー	1,700	810.00	1,377,000	
九州旅客鉄道	81,800	2,918.00	238,692,400	
S G ホールディングス	98,000	2,709.00	265,482,000	

日本航空	168,100	1,969.00	330,988,900
A N Aホールディングス	170,700	2,420.00	413,094,000
パスコ	1,900	1,523.00	2,893,700
西本W i s m e t t a cホールディングス	1,800	1,830.00	3,294,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	800	1,659.00	1,327,200
G e n k y D r u g S t o r e s	4,300	2,057.00	8,845,100
国際紙パルプ商事	23,000	282.00	6,486,000
ナルミヤ・インターナショナル	1,700	520.00	884,000
ブックオフグループホールディングス	5,700	803.00	4,577,100
三菱倉庫	29,600	2,165.00	64,084,000
三井倉庫ホールディングス	10,600	1,412.00	14,967,200
住友倉庫	34,400	1,209.00	41,589,600
澁澤倉庫	5,000	1,950.00	9,750,000
ヤマタネ	4,800	1,167.00	5,601,600
東陽倉庫	16,700	320.00	5,344,000
乾汽船	5,300	1,195.00	6,333,500
日本トランスシティ	20,400	443.00	9,037,200
ケイヒン	1,800	1,140.00	2,052,000
中央倉庫	5,600	1,095.00	6,132,000
川西倉庫	1,800	962.00	1,731,600
安田倉庫	7,600	834.00	6,338,400
ファイズホールディングス	2,000	1,022.00	2,044,000
東洋埠頭	2,800	1,288.00	3,606,400
宇徳	8,100	457.00	3,701,700
上組	52,200	1,820.00	95,004,000
サンリツ	2,200	546.00	1,201,200
キムラユニティー	2,400	977.00	2,344,800
キューソー流通システム	2,300	1,499.00	3,447,700
近鉄エクスプレス	19,700	1,500.00	29,550,000
東海運	5,300	244.00	1,293,200
エーアイティー	6,700	759.00	5,085,300
内外トランスライン	3,500	1,169.00	4,091,500
ショーエイコーポレーション	1,300	655.00	851,500
日本コンセプト	3,000	1,382.00	4,146,000
東京放送ホールディングス	59,000	1,610.00	94,990,000
日本テレビホールディングス	80,800	1,194.00	96,475,200
朝日放送グループホールディングス	9,500	682.00	6,479,000
テレビ朝日ホールディングス	26,500	1,589.00	42,108,500
スカパーJ S A Tホールディングス	63,600	397.00	25,249,200
テレビ東京ホールディングス	7,900	2,262.00	17,869,800
日本B S放送	3,300	1,001.00	3,303,300
ビジョン	9,100	723.00	6,579,300
スマートバリュー	2,500	866.00	2,165,000
U S E N - N E X T H O L D I N G S	3,800	1,278.00	4,856,400
ワイヤレスゲート	4,700	522.00	2,453,400
コネクシオ	5,400	1,381.00	7,457,400
日本通信	75,700	167.00	12,641,900
クロップス	2,000	470.00	940,000

日本電信電話	1,293,300	2,562.50	3,314,081,250	
KDDI	721,000	3,100.00	2,235,100,000	
ソフトバンク	879,400	1,381.50	1,214,891,100	
光通信	10,100	19,540.00	197,354,000	
NTTドコモ	714,700	3,287.00	2,349,218,900	
エムティーアイ	9,400	562.00	5,282,800	
GMOインターネット	38,100	2,288.00	87,172,800	
ファイバーゲート	2,200	1,209.00	2,659,800	
アイドママーケティングコミュニケーション	2,900	398.00	1,154,200	
KADOKAWA	26,100	1,615.00	42,151,500	
学研ホールディングス	13,200	1,701.00	22,453,200	
ゼンリン	19,300	1,046.00	20,187,800	
昭文社ホールディングス	4,400	371.00	1,632,400	
インプレスホールディングス	8,100	133.00	1,077,300	
東京電力ホールディングス	787,300	372.00	292,875,600	
中部電力	301,500	1,485.50	447,878,250	
関西電力	373,600	1,154.50	431,321,200	
中国電力	142,400	1,490.00	212,176,000	
北陸電力	90,300	729.00	65,828,700	
東北電力	246,200	1,024.00	252,108,800	
四国電力	88,800	829.00	73,615,200	
九州電力	203,300	878.00	178,497,400	
北海道電力	92,400	443.00	40,933,200	
沖縄電力	18,300	1,896.00	34,696,800	
電源開発	78,400	2,120.00	166,208,000	
エフオン	5,600	450.00	2,520,000	
イーレックス	14,000	1,300.00	18,200,000	
レノバ	16,500	1,011.00	16,681,500	
東京瓦斯	189,600	2,590.50	491,158,800	
大阪瓦斯	191,400	2,033.00	389,116,200	
東邦瓦斯	48,500	5,160.00	250,260,000	
北海道瓦斯	5,200	1,523.00	7,919,600	
広島ガス	20,000	348.00	6,960,000	
西部瓦斯	11,000	2,566.00	28,226,000	
静岡ガス	28,000	943.00	26,404,000	
メタウォーター	4,700	4,040.00	18,988,000	
アイネット	4,900	1,420.00	6,958,000	
松竹	6,500	11,520.00	74,880,000	
東宝	57,300	3,320.00	190,236,000	
エイチ・アイ・エス	14,900	1,270.00	18,923,000	
東映	3,600	13,520.00	48,672,000	
ラックランド	2,200	1,584.00	3,484,800	
エヌ・ティ・ティ・データ	257,600	1,034.00	266,358,400	
共立メンテナンス	15,800	2,334.00	36,877,200	
イチネンホールディングス	10,600	1,063.00	11,267,800	
建設技術研究所	6,600	1,745.00	11,517,000	
スペース	6,200	1,020.00	6,324,000	
長 大	3,500	802.00	2,807,000	
アインホールディングス	11,900	5,890.00	70,091,000	

燦ホールディングス	4,200	1,210.00	5,082,000
ピー・シー・エー	1,400	3,095.00	4,333,000
スバル興業	500	7,730.00	3,865,000
東京テアトル	3,800	1,144.00	4,347,200
タナベ経営	1,800	1,196.00	2,152,800
ビジネスブレイン太田昭和	1,700	2,742.00	4,661,400
ナガワ	2,900	7,070.00	20,503,000
よみうりランド	2,100	3,135.00	6,583,500
東京都競馬	6,300	3,195.00	20,128,500
常磐興産	3,900	1,262.00	4,921,800
カナモト	15,500	2,107.00	32,658,500
東京ドーム	38,700	712.00	27,554,400
D T S	21,700	1,912.00	41,490,400
スクウェア・エニックス・ホールディングス	41,300	4,950.00	204,435,000
シーイーシー	10,500	1,436.00	15,078,000
カブコン	45,600	3,330.00	151,848,000
西尾レントオール	9,600	2,193.00	21,052,800
アイ・エス・ビー	1,900	1,484.00	2,819,600
アゴーラ・ホスピタリティ・グループ	63,100	22.00	1,388,200
日本空港ビルデング	31,100	4,130.00	128,443,000
トランス・コスモス	9,000	1,862.00	16,758,000
乃村工藝社	40,400	807.00	32,602,800
ジャステック	6,200	1,016.00	6,299,200
S C S K	22,300	5,240.00	116,852,000
藤田観光	4,200	1,636.00	6,871,200
K N T - C Tホールディングス	5,900	758.00	4,472,200
日本管財	10,200	1,803.00	18,390,600
トーカイ	9,100	2,904.00	26,426,400
白洋舎	1,000	2,720.00	2,720,000
セコム	100,000	9,043.00	904,300,000
日本システムウエア	3,200	1,826.00	5,843,200
セントラル警備保障	4,500	4,075.00	18,337,500
アイネス	9,600	1,302.00	12,499,200
丹青社	17,800	691.00	12,299,800
メイテック	11,700	4,105.00	48,028,500
T K C	8,200	4,835.00	39,647,000
富士ソフト	12,400	3,640.00	45,136,000
応用地質	10,200	1,251.00	12,760,200
船井総研ホールディングス	19,500	2,070.00	40,365,000
N S D	31,200	1,437.00	44,834,400
進学会ホールディングス	3,800	528.00	2,006,400
丸紅建材リース	900	1,363.00	1,226,700
オオバ	6,900	532.00	3,670,800
コナミホールディングス	35,300	3,115.00	109,959,500
いであ	1,800	1,479.00	2,662,200
学究社	2,800	1,121.00	3,138,800
ベネッセホールディングス	31,500	2,812.00	88,578,000
イオンディライト	11,600	3,050.00	35,380,000

ナック	5,100	807.00	4,115,700
福井コンピュータホールディングス	3,900	2,351.00	9,168,900
ニチイ学館	13,600	1,057.00	14,375,200
ダイセキ	15,900	2,265.00	36,013,500
ステップ	3,500	1,337.00	4,679,500
日鉄物産	6,900	3,370.00	23,253,000
泉州電業	2,900	2,479.00	7,189,100
元気寿司	2,400	2,150.00	5,160,000
トラスコ中山	20,100	2,254.00	45,305,400
ヤマダ電機	295,800	512.00	151,449,600
オートバックスセブン	36,000	1,261.00	45,396,000
モリト	6,900	635.00	4,381,500
アークランドサカモト	15,000	994.00	14,910,000
ニトリホールディングス	42,100	15,405.00	648,550,500
グルメ杵屋	6,900	858.00	5,920,200
愛眼	7,800	204.00	1,591,200
ケーユーホールディングス	4,800	800.00	3,840,000
吉野家ホールディングス	31,800	2,098.00	66,716,400
加藤産業	15,100	3,475.00	52,472,500
北恵	1,900	839.00	1,594,100
イノテック	5,700	870.00	4,959,000
イエローハット	18,300	1,431.00	26,187,300
松屋フーズホールディングス	4,700	3,690.00	17,343,000
JBCホールディングス	6,600	1,746.00	11,523,600
JKホールディングス	8,700	711.00	6,185,700
サガミホールディングス	13,200	1,202.00	15,866,400
日伝	8,800	1,989.00	17,503,200
関西スーパーマーケット	8,000	1,021.00	8,168,000
ミロク情報サービス	8,600	2,512.00	21,603,200
北沢産業	7,300	280.00	2,044,000
杉本商事	5,200	1,667.00	8,668,400
因幡電機産業	27,800	2,267.00	63,022,600
王将フードサービス	7,100	5,690.00	40,399,000
プレナス	10,900	1,731.00	18,867,900
ミニストップ	7,200	1,423.00	10,245,600
アークス	19,800	1,930.00	38,214,000
パローホールディングス	21,600	1,906.00	41,169,600
東テク	3,200	1,779.00	5,692,800
ミスミグループ本社	121,700	2,414.00	293,783,800
藤久	800	708.00	566,400
アルテック	7,800	188.00	1,466,400
ベルク	4,800	5,750.00	27,600,000
大庄	5,200	1,032.00	5,366,400
タキヒヨー	2,900	1,570.00	4,553,000
ファーストリテイリング	13,000	46,350.00	602,550,000
ソフトバンクグループ	767,600	4,200.00	3,223,920,000
蔵王産業	1,900	1,396.00	2,652,400
スズケン	41,200	4,145.00	170,774,000
サンドラッグ	36,600	3,365.00	123,159,000
サクスパーホールディングス	8,300	563.00	4,672,900

ジェコス	6,700	787.00	5,272,900	
ヤマザワ	2,200	1,622.00	3,568,400	
やまや	2,000	2,028.00	4,056,000	
グローセル	9,700	384.00	3,724,800	
ペルーナ	20,700	475.00	9,832,500	
合計	116,815,460		194,998,432,110	

(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。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

令和2年4月13日現在

資産の部	
流動資産	
預金	2,238,736,618
コール・ローン	2,237,279,890
国債証券	112,062,482,518
未収利息	881,907,983
前払費用	6,297,152
流動資産合計	117,426,704,161
資産合計	
117,426,704,161	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,946,947
未払解約金	766,656,300
流動負債合計	769,603,247
負債合計	
769,603,247	
純資産の部	
元本等	
元本	60,656,036,029
剰余金	
剰余金又は欠損金()	56,001,064,885
元本等合計	116,657,100,914
純資産合計	116,657,100,914
負債純資産合計	117,426,704,161

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 令和1年10月12日 至 令和2年4月13日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	令和2年4月13日現在
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	79,110,937,109円
同期中追加設定元本額	8,301,993,388円
同期中一部解約元本額	26,756,894,468円
元本の内訳	
ファンド名	
DIAM外国債券パッシブ・ファンド	6,827,395,876円
MITO ラップ型ファンド（安定型）	5,131,135円
MITO ラップ型ファンド（中立型）	16,743,311円
MITO ラップ型ファンド（積極型）	16,534,415円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	72,401,583円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	67,177,261円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	25,138,993円
たわらノーロード 先進国債券	6,866,858,958円
たわらノーロード 先進国債券<ラップ向け>	132,469,320円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	454,301,701円
たわらノーロード バランス（堅実型）	12,666,748円
たわらノーロード バランス（標準型）	54,985,920円
たわらノーロード バランス（積極型）	10,135,489円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（保守型）	2,131,629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）	133,642,357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）	167,383,731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）	52,999,449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）	29,979,425円
たわらノーロード 最適化バランス（保守型）	74,041円
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	2,555,588円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	3,763,370円
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	1,259,313円
たわらノーロード 最適化バランス（積極型）	2,033,269円
DIAM外国債券インデックスファンド<DC年金>	5,844,188,554円
One DC 先進国債券インデックスファンド	4,383,523円

DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	575,568,476円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	1,729,391,688円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	1,689,554,730円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	367,533,477円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	770,865,035円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	597,762,131円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	17,884,013円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	521,348,662円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	17,411,191円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	125,271,635円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	89,589,782円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	139,048,634円
クルーズコントロール	789,354,745円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	109,167,362円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	159,740,852円
クルーズコントロール<DC年金>	898,881円
DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)	2,181,504円
DIAMコア資産設計ファンド(積極型)	5,802,523円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	49,883,796円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	122,462,651円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	126,026円
DIAMパッシブ資産分散ファンド	1,140,095,937円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12(適格機関投資家限定)	2,873,320円
DIAM為替フルヘッジ型外国債券パッシブ私募ファンド(適格機関投資家向け)	6,062,590,914円
DIAM外国債券パッシブファンド(適格機関投資家向け)	2,966,458,530円
外国債券パッシブファンド(適格機関投資家限定)	2,197,719,689円
先進国債券パッシブファンド(適格機関投資家限定)	5,689,634,902円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	66,492,740円
インカム重視マルチアセット運用ファンド(適格機関投資家限定)	3,855,189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)	538,519,168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)	393,277,610円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	35,617,611円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	55,151,514円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	15,807,383円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	4,269,629円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	50,506,883円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	68,234,501円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	2,538,122,909円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	1,738,595,511円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	2,960,463,464円
DIAMグローバル・アセット・バランスVA(適格機関投資家限定)	517,492,784円
DIAMグローバル・アセット・バランスVA2(適格機関投資家限定)	204,934,958円
DIAM アクサ グローバル バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	2,351,144,726円
DIAM世界アセットバランスファンドVA(適格機関投資家向け)	557,357,591円
DIAM世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	3,965,181円
DIAM世界バランスファンド35VA(適格機関投資家限定)	80,481,385円
DIAM世界アセットバランスファンド2VA(適格機関投資家限定)	394,725,199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）	597,722,845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）	643,438,730円
D I A M世界バランス25 V A（適格機関投資家限定）	66,813,203円
D I A Mバランス20 V A（適格機関投資家限定）	22,011,643円
D I A Mバランス40 V A（適格機関投資家限定）	329,950円
D I A Mバランス60 V A（適格機関投資家限定）	147,677円
計	60,656,036,029円
2. 受益権の総数	60,656,036,029口

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 令和1年10月12日 至 令和2年4月13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。
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、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。</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、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。</p>
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。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	令和2年4月13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。
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。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	令和2年4月13日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
国債証券	1,874,777,742
合計	1,874,777,742

(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(令和2年2月22日から令和2年4月13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	令和2年4月13日現在			
	契約額等（円）	うち		時価（円）
		1年超		
市場取引以外の取引 為替予約取引 買建	913,310,000	-	910,363,053	2,946,947
アメリカ・ドル	325,970,000	-	325,124,291	845,709
ユーロ	587,340,000	-	585,238,762	2,101,238
合計	913,310,000	-	910,363,053	2,946,947

（注）時価の算定方法

為替予約取引

1. 計算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）

令和2年4月13日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.9233円 (19,233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

令和2年4月13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 1.25 08/31/24	2,440,000.000	2,532,643.750	
		US T N/B 1.375 01/31/25	3,280,000.000	3,431,443.730	
		US T N/B 1.375 06/30/23	3,460,000.000	3,579,478.120	
		US T N/B 1.375 08/31/26	1,100,000.000	1,156,289.050	
		US T N/B 1.375 09/30/23	3,100,000.000	3,212,375.000	
		US T N/B 1.5 01/31/27	490,000.000	519,859.370	
		US T N/B 1.5 08/15/22	1,210,000.000	1,245,307.410	

US T N/B 1.5 08/15/26	4,290,000.000	4,540,696.870	
US T N/B 1.5 09/15/22	750,000.000	772,646.480	
US T N/B 1.5 09/30/21	5,120,000.000	5,214,599.980	
US T N/B 1.625 02/15/26	4,180,000.000	4,447,781.250	
US T N/B 1.625 05/15/26	4,290,000.000	4,571,196.070	
US T N/B 1.625 05/31/23	2,900,000.000	3,020,078.120	
US T N/B 1.625 08/15/22	3,980,000.000	4,108,261.700	
US T N/B 1.625 08/15/29	4,380,000.000	4,743,060.890	
US T N/B 1.625 10/31/26	2,350,000.000	2,508,992.180	
US T N/B 1.625 11/15/22	5,620,000.000	5,816,480.420	
US T N/B 1.75 01/31/23	4,980,000.000	5,184,257.780	
US T N/B 1.75 03/31/22	6,990,000.000	7,198,061.680	
US T N/B 1.75 05/15/22	5,400,000.000	5,572,546.840	
US T N/B 1.75 05/15/23	2,620,000.000	2,736,467.170	
US T N/B 1.75 06/15/22	830,000.000	857,526.160	
US T N/B 1.75 06/30/24	1,340,000.000	1,417,573.430	
US T N/B 1.75 07/31/24	3,690,000.000	3,907,652.320	
US T N/B 1.75 09/30/22	5,250,000.000	5,444,003.880	
US T N/B 1.75 11/15/29	3,440,000.000	3,770,562.500	
US T N/B 1.75 12/31/26	740,000.000	796,714.050	
US T N/B 1.875 02/28/22	1,680,000.000	1,731,843.740	
US T N/B 1.875 06/30/26	720,000.000	778,725.000	
US T N/B 1.875 07/31/26	2,370,000.000	2,562,932.810	
US T N/B 1.875 08/31/22	3,680,000.000	3,820,300.000	
US T N/B 1.875 08/31/24	3,120,000.000	3,320,850.000	
US T N/B 2.0 02/15/22	8,470,000.000	8,746,267.510	
US T N/B 2.0 02/15/23	4,370,000.000	4,583,037.500	
US T N/B 2.0 02/15/25	5,300,000.000	5,699,156.250	
US T N/B 2.0 02/15/50	650,000.000	754,101.560	
US T N/B 2.0 05/31/21	10,130,000.000	10,334,578.490	
US T N/B 2.0 05/31/24	4,770,000.000	5,093,092.940	
US T N/B 2.0 08/15/25	5,180,000.000	5,600,470.280	
US T N/B 2.0 11/15/21	10,400,000.000	10,696,968.670	
US T N/B 2.0 11/15/26	4,140,000.000	4,522,626.540	
US T N/B 2.0 11/30/22	6,590,000.000	6,889,124.180	
US T N/B 2.125 02/29/24	1,300,000.000	1,389,070.300	
US T N/B 2.125 03/31/24	4,080,000.000	4,364,325.000	
US T N/B 2.125 05/15/25	5,150,000.000	5,589,359.370	
US T N/B 2.125 05/31/26	2,050,000.000	2,247,312.500	
US T N/B 2.125 06/30/22	6,530,000.000	6,803,953.870	
US T N/B 2.125 08/15/21	11,000,000.000	11,278,867.160	
US T N/B 2.125 09/30/21	8,840,000.000	9,092,768.750	
US T N/B 2.125 09/30/24	2,930,000.000	3,155,701.560	
US T N/B 2.125 12/31/21	9,160,000.000	9,458,415.570	
US T N/B 2.125 12/31/22	5,520,000.000	5,797,293.720	
US T N/B 2.25 01/31/24	350,000.000	375,156.250	
US T N/B 2.25 02/15/27	3,550,000.000	3,946,878.880	
US T N/B 2.25 03/31/26	3,090,000.000	3,405,759.370	
US T N/B 2.25 04/30/24	3,300,000.000	3,550,851.540	

US T N/B 2.25 08/15/27	2,690,000.000	3,006,915.620	
US T N/B 2.25 08/15/46	1,510,000.000	1,820,257.800	
US T N/B 2.25 08/15/49	2,400,000.000	2,922,187.480	
US T N/B 2.25 11/15/24	4,690,000.000	5,085,352.310	
US T N/B 2.25 11/15/25	5,190,000.000	5,695,619.500	
US T N/B 2.25 11/15/27	4,040,000.000	4,526,693.750	
US T N/B 2.25 12/31/23	4,830,000.000	5,173,382.810	
US T N/B 2.375 04/30/26	1,760,000.000	1,954,150.000	
US T N/B 2.375 05/15/27	3,100,000.000	3,485,320.290	
US T N/B 2.375 05/15/29	2,810,000.000	3,223,596.870	
US T N/B 2.375 08/15/24	790,000.000	857,767.180	
US T N/B 2.375 11/15/49	2,770,000.000	3,461,417.940	
US T N/B 2.5 01/15/22	3,850,000.000	4,003,548.810	
US T N/B 2.5 01/31/24	3,890,000.000	4,204,542.940	
US T N/B 2.5 02/15/22	1,070,000.000	1,114,680.850	
US T N/B 2.5 02/15/45	1,820,000.000	2,280,829.670	
US T N/B 2.5 02/15/46	1,970,000.000	2,480,353.120	
US T N/B 2.5 02/28/26	2,550,000.000	2,841,855.450	
US T N/B 2.5 03/31/23	1,020,000.000	1,086,698.430	
US T N/B 2.5 05/15/24	6,240,000.000	6,781,612.460	
US T N/B 2.5 05/15/46	2,510,000.000	3,166,619.760	
US T N/B 2.5 08/15/23	4,330,000.000	4,645,954.680	
US T N/B 2.625 01/31/26	2,180,000.000	2,444,835.920	
US T N/B 2.625 02/15/29	4,110,000.000	4,792,966.360	
US T N/B 2.625 03/31/25	2,150,000.000	2,383,812.500	
US T N/B 2.625 06/30/23	1,820,000.000	1,955,931.250	
US T N/B 2.625 12/15/21	3,770,000.000	3,921,241.760	
US T N/B 2.625 12/31/23	3,060,000.000	3,319,143.750	
US T N/B 2.625 12/31/25	2,290,000.000	2,563,368.750	
US T N/B 2.75 02/15/24	5,320,000.000	5,805,450.000	
US T N/B 2.75 02/15/28	4,370,000.000	5,076,028.120	
US T N/B 2.75 02/28/25	1,660,000.000	1,845,971.870	
US T N/B 2.75 04/30/23	2,490,000.000	2,675,388.260	
US T N/B 2.75 05/31/23	3,270,000.000	3,520,870.310	
US T N/B 2.75 06/30/25	790,000.000	884,059.370	
US T N/B 2.75 07/31/23	3,270,000.000	3,531,855.450	
US T N/B 2.75 08/15/42	1,430,000.000	1,844,476.560	
US T N/B 2.75 08/15/47	1,880,000.000	2,489,237.490	
US T N/B 2.75 08/31/23	2,170,000.000	2,348,007.810	
US T N/B 2.75 08/31/25	1,640,000.000	1,840,003.110	
US T N/B 2.75 11/15/23	6,020,000.000	6,539,225.000	
US T N/B 2.75 11/15/42	570,000.000	735,745.300	
US T N/B 2.75 11/15/47	2,640,000.000	3,498,000.000	
US T N/B 2.875 05/15/28	4,430,000.000	5,205,250.000	
US T N/B 2.875 05/15/43	2,720,000.000	3,588,487.470	
US T N/B 2.875 05/15/49	3,090,000.000	4,228,230.440	
US T N/B 2.875 05/31/25	2,530,000.000	2,843,285.140	
US T N/B 2.875 07/31/25	1,860,000.000	2,096,568.750	
US T N/B 2.875 08/15/28	4,680,000.000	5,519,475.000	

US T N/B 2.875 08/15/45	2,090,000.000	2,798,477.330	
US T N/B 2.875 09/30/23	840,000.000	914,615.620	
US T N/B 2.875 10/31/23	3,690,000.000	4,020,082.010	
US T N/B 2.875 11/15/21	4,880,000.000	5,086,065.610	
US T N/B 2.875 11/15/46	2,220,000.000	2,999,601.540	
US T N/B 3.0 02/15/47	2,540,000.000	3,512,939.030	
US T N/B 3.0 02/15/48	2,540,000.000	3,523,456.240	
US T N/B 3.0 02/15/49	3,070,000.000	4,285,528.120	
US T N/B 3.0 05/15/42	980,000.000	1,312,817.180	
US T N/B 3.0 05/15/45	2,500,000.000	3,409,179.670	
US T N/B 3.0 05/15/47	2,350,000.000	3,249,792.950	
US T N/B 3.0 08/15/48	3,210,000.000	4,464,658.560	
US T N/B 3.0 09/30/25	1,410,000.000	1,601,451.560	
US T N/B 3.0 10/31/25	1,920,000.000	2,185,200.000	
US T N/B 3.0 11/15/44	2,290,000.000	3,108,675.000	
US T N/B 3.0 11/15/45	1,630,000.000	2,231,317.180	
US T N/B 3.125 02/15/42	1,380,000.000	1,882,837.500	
US T N/B 3.125 02/15/43	1,440,000.000	1,969,987.490	
US T N/B 3.125 05/15/21	8,000,000.000	8,251,562.480	
US T N/B 3.125 05/15/48	2,660,000.000	3,771,796.860	
US T N/B 3.125 08/15/44	1,750,000.000	2,418,144.520	
US T N/B 3.125 11/15/28	4,840,000.000	5,827,284.330	
US T N/B 3.125 11/15/41	760,000.000	1,034,431.250	
US T N/B 3.375 05/15/44	2,420,000.000	3,465,326.540	
US T N/B 3.375 11/15/48	2,260,000.000	3,357,689.040	
US T N/B 3.5 02/15/39	900,000.000	1,275,328.120	
US T N/B 3.625 02/15/44	1,630,000.000	2,415,328.890	
US T N/B 3.625 08/15/43	1,670,000.000	2,463,119.520	
US T N/B 3.75 08/15/41	410,000.000	607,120.310	
US T N/B 3.75 11/15/43	2,620,000.000	3,942,690.620	
US T N/B 3.875 08/15/40	1,110,000.000	1,654,160.130	
US T N/B 4.25 05/15/39	810,000.000	1,250,437.500	
US T N/B 4.25 11/15/40	1,110,000.000	1,734,461.710	
US T N/B 4.375 02/15/38	550,000.000	853,660.150	
US T N/B 4.375 05/15/40	1,150,000.000	1,812,867.180	
US T N/B 4.375 05/15/41	1,040,000.000	1,660,425.000	
US T N/B 4.375 11/15/39	410,000.000	643,283.590	
US T N/B 4.5 02/15/36	730,000.000	1,117,128.120	
US T N/B 4.5 05/15/38	540,000.000	851,385.930	
US T N/B 4.5 08/15/39	790,000.000	1,255,791.400	
US T N/B 4.625 02/15/40	750,000.000	1,213,769.520	
US T N/B 4.75 02/15/41	1,200,000.000	1,994,250.000	
US T N/B 5.0 05/15/37	500,000.000	818,242.180	
US T N/B 5.25 02/15/29	490,000.000	682,286.710	
US T N/B 5.25 11/15/28	850,000.000	1,176,718.750	
US T N/B 5.375 02/15/31	1,000,000.000	1,481,875.000	
US T N/B 5.5 08/15/28	650,000.000	906,191.400	
US T N/B 6.0 02/15/26	840,000.000	1,106,175.000	
US T N/B 6.125 11/15/27	900,000.000	1,268,718.750	

	US T N/B 6.25 05/15/30	710,000.000	1,092,789.840	
	US T N/B 6.25 08/15/23	1,000,000.000	1,197,656.250	
	US T N/B 8.0 11/15/21	6,000,000.000	6,745,078.070	
アメリカ・ドル	小計	462,710,000.000 (50,079,103,300)	523,116,476.220 (56,616,896,221)	
イギリス・ポンド	UK TREASURY 0.5 07/22/22	1,920,000.000	1,940,294.400	
	UK TREASURY 0.75 07/22/23	1,560,000.000	1,594,476.000	
	UK TREASURY 0.875 10/22/29	430,000.000	454,194.550	
	UK TREASURY 1.0 04/22/24	820,000.000	850,340.000	
	UK TREASURY 1.25 07/22/27	960,000.000	1,036,838.400	
	UK TREASURY 1.5 07/22/26	900,000.000	978,003.000	
	UK TREASURY 1.5 07/22/47	540,000.000	652,482.000	
	UK TREASURY 1.625 10/22/28	1,830,000.000	2,053,000.860	
	UK TREASURY 1.625 10/22/54	510,000.000	673,031.700	
	UK TREASURY 1.625 10/22/71	580,000.000	890,932.200	
	UK TREASURY 1.75 01/22/49	580,000.000	744,488.000	
	UK TREASURY 1.75 07/22/57	590,000.000	827,593.000	
	UK TREASURY 1.75 09/07/22	1,530,000.000	1,592,316.900	
	UK TREASURY 1.75 09/07/37	1,240,000.000	1,471,508.000	
	UK TREASURY 2.0 09/07/25	790,000.000	872,544.560	
	UK TREASURY 2.25 09/07/23	1,180,000.000	1,267,796.240	
	UK TREASURY 2.5 07/22/65	820,000.000	1,478,284.180	
	UK TREASURY 2.75 09/07/24	1,380,000.000	1,542,126.540	
	UK TREASURY 3.25 01/22/44	1,410,000.000	2,203,548.000	
	UK TREASURY 3.5 01/22/45	1,280,000.000	2,102,400.000	
	UK TREASURY 3.5 07/22/68	890,000.000	2,027,598.000	
	UK TREASURY 3.75 07/22/52	940,000.000	1,804,800.000	
	UK TREASURY 4.0 01/22/60	870,000.000	1,950,366.000	
UK TREASURY 4.25 03/07/36	1,130,000.000	1,766,642.000		
UK TREASURY 4.25 06/07/32	1,110,000.000	1,610,277.000		
UK TREASURY 4.25 09/07/39	920,000.000	1,530,604.000		

	UK TREASURY 4.25 12/07/27	780,000.000	1,020,879.600	
	UK TREASURY 4.25 12/07/40	960,000.000	1,628,544.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/46	1,060,000.000	1,984,426.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/49	990,000.000	1,947,429.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/55	1,000,000.000	2,186,100.000	
	UK TREASURY 4.5 09/07/34	900,000.000	1,401,210.000	
	UK TREASURY 4.5 12/07/42	1,080,000.000	1,952,208.000	
	UK TREASURY 4.75 12/07/30	940,000.000	1,376,066.000	
	UK TREASURY 4.75 12/07/38	360,000.000	624,168.000	
	UK TREASURY 5.0 03/07/25	1,610,000.000	1,992,004.700	
	UK TREASURY 6.0 12/07/28	760,000.000	1,137,856.800	
イギリス・ボンド 小計		37,150,000.000 (5,007,820,000)	53,167,377.630 (7,166,962,505)	
オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	1,740,000.000	1,926,702.000	
	AUSTRALIAN 2.25 11/21/22	890,000.000	935,949.180	
	AUSTRALIAN 2.5 05/21/30	1,200,000.000	1,384,209.230	
	AUSTRALIAN 2.75 04/21/24	1,980,000.000	2,169,281.860	
	AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	530,000.000	636,379.900	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	1,330,000.000	1,526,108.500	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/28	1,780,000.000	2,067,058.820	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/29	1,560,000.000	1,820,988.000	
	AUSTRALIAN 3.0 03/21/47	870,000.000	1,094,680.450	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	1,520,000.000	1,730,855.920	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	2,820,000.000	3,409,680.330	
	AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	720,000.000	912,891.810	
	AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	760,000.000	1,016,774.130	
	AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	2,010,000.000	2,450,578.330	
	AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	1,130,000.000	1,600,004.400	
	AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	1,670,000.000	2,140,823.430	
AUSTRALIAN 5.5 04/21/23	1,710,000.000	1,978,555.670		
AUSTRALIAN 5.75 07/15/22	1,180,000.000	1,325,589.340		
オーストラリア・ドル 小計		25,400,000.000 (1,741,678,000)	30,127,111.300 (2,065,816,022)	
カナダ・ドル	CANADA 8.0 06/01/27	230,000.000	347,237.900	
	CANADA 0.75 09/01/21	600,000.000	602,874.000	
	CANADA 1.0 06/01/27	800,000.000	820,448.000	
	CANADA 1.0 09/01/22	800,000.000	811,408.000	
	CANADA 1.5 06/01/23	1,210,000.000	1,249,034.600	
	CANADA 1.5 06/01/26	800,000.000	842,768.000	
	CANADA 1.75 03/01/23	1,160,000.000	1,202,664.800	
	CANADA 2.0 06/01/28	1,020,000.000	1,128,793.200	

	CANADA 2.0 09/01/23	740,000.000	777,051.800	
	CANADA 2.0 12/01/51	420,000.000	492,588.600	
	CANADA 2.25 03/01/24	530,000.000	564,513.600	
	CANADA 2.25 06/01/25	1,500,000.000	1,626,900.000	
	CANADA 2.25 06/01/29	610,000.000	694,045.800	
	CANADA 2.5 06/01/24	1,600,000.000	1,726,400.000	
	CANADA 2.75 06/01/22	2,240,000.000	2,352,022.400	
	CANADA 2.75 12/01/48	850,000.000	1,135,719.000	
	CANADA 2.75 12/01/64	350,000.000	519,239.000	
	CANADA 3.5 12/01/45	1,020,000.000	1,500,124.200	
	CANADA 4.0 06/01/41	880,000.000	1,323,000.800	
	CANADA 5.0 06/01/37	740,000.000	1,180,033.600	
	CANADA 5.75 06/01/29	1,100,000.000	1,591,700.000	
	CANADA 5.75 06/01/33	720,000.000	1,148,011.200	
カナダ・ドル 小計		19,920,000.000 (1,544,796,000)	23,636,578.500 (1,833,016,663)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE 2.125 06/01/26	210,000.000	226,071.040	
	SINGAPORE 2.25 08/01/36	200,000.000	223,679.620	
	SINGAPORE 2.375 06/01/25	340,000.000	366,764.930	
	SINGAPORE 2.75 03/01/46	420,000.000	530,686.920	
	SINGAPORE 2.75 04/01/42	380,000.000	470,661.350	
	SINGAPORE 2.875 07/01/29	200,000.000	231,318.000	
	SINGAPORE 2.875 09/01/30	370,000.000	431,236.700	
	SINGAPORE 3.0 09/01/24	550,000.000	603,259.250	
	SINGAPORE 3.125 09/01/22	1,600,000.000	1,693,541.120	
	SINGAPORE 3.375 09/01/33	480,000.000	599,976.000	
	SINGAPORE 3.5 03/01/27	730,000.000	855,193.100	
シンガポール・ドル 小計		5,480,000.000 (418,726,800)	6,232,388.030 (476,216,769)	
スウェーデン・クローナ	SWEDEN 0.75 05/12/28	3,740,000.000	3,986,129.400	
	SWEDEN 0.75 11/12/29	2,170,000.000	2,326,782.500	
	SWEDEN 1.0 11/12/26	4,250,000.000	4,566,531.500	
	SWEDEN 2.5 05/12/25	6,180,000.000	7,038,402.000	
	SWEDEN 3.5 03/30/39	3,270,000.000	5,111,108.100	
スウェーデン・クローナ 小計		19,610,000.000 (213,356,800)	23,028,953.500 (250,555,014)	
デンマーク・クローネ	DENMARK 0.5 11/15/27	7,130,000.000	7,528,909.240	
	DENMARK 1.5 11/15/23	5,500,000.000	5,874,605.000	
	DENMARK 1.75 11/15/25	5,320,000.000	5,937,148.720	
	DENMARK 4.5 11/15/39	7,880,000.000	14,443,019.540	
デンマーク・クローネ 小計		25,830,000.000 (409,147,200)	33,783,682.500 (535,133,531)	
ノルウェー・クローネ	NORWAY 1.5 02/19/26	3,770,000.000	3,995,823.000	
	NORWAY 1.75 02/17/27	3,970,000.000	4,302,414.450	
	NORWAY 1.75 03/13/25	3,800,000.000	4,045,758.540	

	NORWAY 2.0 04/26/28	2,070,000.000	2,287,143.000	
	NORWAY 3.0 03/14/24	6,200,000.000	6,832,214.000	
ノルウェー・クローネ 小計		19,810,000.000 (209,193,600)	21,463,352.990 (226,653,008)	
ポーランド・ズロチ	POLAND 2.25 04/25/22	4,000,000.000	4,130,550.800	
	POLAND 2.5 01/25/23	1,350,000.000	1,414,981.980	
	POLAND 2.5 04/25/24	2,290,000.000	2,434,594.030	
	POLAND 2.5 07/25/26	2,440,000.000	2,624,380.790	
	POLAND 2.5 07/25/27	2,280,000.000	2,470,497.190	
	POLAND 2.75 04/25/28	1,900,000.000	2,084,300.000	
	POLAND 3.25 07/25/25	2,380,000.000	2,640,700.440	
	POLAND 4.0 10/25/23	1,820,000.000	2,020,170.880	
	POLAND 5.75 04/25/29	1,440,000.000	1,954,906.410	
	POLAND 5.75 09/23/22	1,720,000.000	1,926,314.000	
ポーランド・ズロチ 小計		21,620,000.000 (561,903,800)	23,701,396.520 (615,999,296)	
マレーシア・リングgit	MALAYSIA 3.418 08/15/22	3,000,000.000	3,057,652.500	
	MALAYSIA 3.48 03/15/23	1,220,000.000	1,249,479.100	
	MALAYSIA 3.733 06/15/28	2,000,000.000	2,039,924.600	
	MALAYSIA 3.844 04/15/33	1,210,000.000	1,214,186.470	
	MALAYSIA 3.892 03/15/27	800,000.000	829,836.960	
	MALAYSIA 4.127 04/15/32	1,850,000.000	1,918,157.330	
	MALAYSIA 4.181 07/15/24	2,430,000.000	2,559,585.580	
	MALAYSIA 4.392 04/15/26	3,070,000.000	3,256,360.350	
	MALAYSIA 4.498 04/15/30	1,800,000.000	1,925,396.100	
	MALAYSIA 4.935 09/30/43	2,000,000.000	2,264,331.600	
MALAYSIA 5.248 09/15/28	1,600,000.000	1,804,989.750		
マレーシア・リングgit 小計		20,980,000.000 (525,758,800)	22,119,900.340 (554,324,703)	
メキシコ・ペソ	MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	8,085,000.000	9,770,156.550	
	MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	27,596,000.000	31,719,394.320	
	MEXICAN BONDS 5.75 03/05/26	14,859,000.000	14,299,261.470	
	MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	18,071,000.000	18,764,205.360	
	MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	10,000,000.000	10,283,500.000	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	14,643,000.000	14,152,313.070	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	7,000,000.000	7,124,180.000	
	MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47	5,000,000.000	4,930,300.000	
	MEXICAN BONDS 8.0 12/07/23	14,000,000.000	14,862,547.000	

	MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	15,109,000.000	16,448,563.940	
	MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	11,125,000.000	11,640,532.500	
メキシコ・ペソ	小計	145,488,000.000 (672,154,560)	153,994,954.210 (711,456,688)	
ユーロ	AUSTRIA 0.5 02/20/29	340,000.000	353,800.260	
	AUSTRIA 0.5 04/20/27	520,000.000	540,967.960	
	AUSTRIA 0.75 02/20/28	820,000.000	867,720.720	
	AUSTRIA 0.75 10/20/26	580,000.000	613,299.540	
	AUSTRIA 07/15/23	350,000.000	354,235.000	
	AUSTRIA 09/20/22	470,000.000	475,510.750	
	AUSTRIA 1.2 10/20/25	640,000.000	690,382.720	
	AUSTRIA 1.5 02/20/47	370,000.000	464,651.180	
	AUSTRIA 1.5 11/02/86	150,000.000	198,870.000	
	AUSTRIA 1.65 10/21/24	540,000.000	588,059.460	
	AUSTRIA 1.75 10/20/23	750,000.000	806,652.000	
	AUSTRIA 2.1 09/20/17	330,000.000	569,195.550	
	AUSTRIA 2.4 05/23/34	480,000.000	621,940.800	
	AUSTRIA 3.15 06/20/44	370,000.000	605,166.400	
	AUSTRIA 3.4 11/22/22	740,000.000	814,984.200	
	AUSTRIA 3.5 09/15/21	1,420,000.000	1,500,798.000	
	AUSTRIA 3.65 04/20/22	280,000.000	303,520.000	
	AUSTRIA 3.8 01/26/62	110,000.000	238,638.070	
	AUSTRIA 4.15 03/15/37	890,000.000	1,451,768.000	
	AUSTRIA 4.85 03/15/26	590,000.000	767,296.770	
	AUSTRIA 6.25 07/15/27	670,000.000	975,017.500	
	BELGIUM 0.1 06/22/30	240,000.000	238,080.000	
	BELGIUM 0.2 10/22/23	660,000.000	670,989.000	
	BELGIUM 0.4 06/22/40	160,000.000	152,447.360	
	BELGIUM 0.5 10/22/24	530,000.000	547,448.600	
	BELGIUM 0.8 06/22/25	900,000.000	945,517.500	
	BELGIUM 0.8 06/22/27	650,000.000	687,063.000	
	BELGIUM 0.8 06/22/28	880,000.000	927,696.000	
	BELGIUM 0.9 06/22/29	610,000.000	656,817.500	
	BELGIUM 1.0 06/22/26	720,000.000	767,783.520	
	BELGIUM 1.0 06/22/31	810,000.000	878,598.900	
	BELGIUM 1.25 04/22/33	510,000.000	571,541.700	
	BELGIUM 1.45 06/22/37	150,000.000	172,576.050	
	BELGIUM 1.6 06/22/47	640,000.000	771,185.280	
	BELGIUM 1.7 06/22/50	140,000.000	172,482.560	
	BELGIUM 1.9 06/22/38	550,000.000	675,937.790	
	BELGIUM 2.15 06/22/66	320,000.000	446,320.000	
	BELGIUM 2.25 06/22/23	160,000.000	173,479.680	
	BELGIUM 2.25 06/22/57	320,000.000	455,792.640	
	BELGIUM 2.6 06/22/24	1,050,000.000	1,176,936.600	
	BELGIUM 3.0 06/22/34	470,000.000	641,147.490	
	BELGIUM 3.75 06/22/45	550,000.000	934,557.800	
	BELGIUM 4.0 03/28/22	420,000.000	456,848.070	

BELGIUM 4.0 03/28/32	530,000.000	763,323.490	
BELGIUM 4.25 03/28/41	1,040,000.000	1,769,127.360	
BELGIUM 4.25 09/28/21	1,240,000.000	1,325,176.220	
BELGIUM 4.25 09/28/22	1,190,000.000	1,328,105.450	
BELGIUM 5.0 03/28/35	1,070,000.000	1,779,613.300	
BELGIUM 5.5 03/28/28	1,240,000.000	1,781,174.440	
BUNDESOBL 04/05/24	630,000.000	645,417.860	
BUNDESOBL 04/08/22	1,340,000.000	1,356,321.200	
BUNDESOBL 04/14/23	1,130,000.000	1,151,746.620	
BUNDESOBL 10/07/22	1,400,000.000	1,421,912.520	
BUNDESOBL 10/13/23	1,280,000.000	1,307,136.000	
BUNDESOBL 10/18/24	1,130,000.000	1,160,447.850	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	330,000.000	324,002.910	
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27	1,460,000.000	1,536,328.800	
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/29	780,000.000	826,564.440	
DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28	1,440,000.000	1,522,814.400	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25	1,360,000.000	1,431,400.000	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26	1,260,000.000	1,338,107.400	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28	1,430,000.000	1,538,780.100	
DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27	1,600,000.000	1,717,736.000	
DEUTSCHLAND 08/15/26	630,000.000	651,603.330	
DEUTSCHLAND 08/15/29	680,000.000	704,456.060	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/24	1,340,000.000	1,434,708.520	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25	670,000.000	726,213.000	
DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48	1,040,000.000	1,394,061.530	
DEUTSCHLAND 1.5 02/15/23	970,000.000	1,029,482.340	
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/23	850,000.000	906,276.800	
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/24	1,010,000.000	1,098,426.100	
DEUTSCHLAND 1.5 09/04/22	1,650,000.000	1,734,767.430	
DEUTSCHLAND 1.75 02/15/24	1,500,000.000	1,638,276.300	
DEUTSCHLAND 1.75 07/04/22	1,540,000.000	1,622,071.220	
DEUTSCHLAND 2.0 01/04/22	1,650,000.000	1,725,702.000	
DEUTSCHLAND 2.0 08/15/23	950,000.000	1,034,137.510	
DEUTSCHLAND 2.25 09/04/21	1,070,000.000	1,112,543.200	
DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	1,290,000.000	2,078,448.000	
DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	1,470,000.000	2,432,073.840	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	900,000.000	1,564,317.000	
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	1,390,000.000	2,370,772.590	
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	840,000.000	1,549,976.400	

DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	600,000.000	859,752.000	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	1,220,000.000	2,096,411.400	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	920,000.000	1,829,981.200	
DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	1,240,000.000	2,027,883.600	
DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	860,000.000	1,270,254.400	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/24	840,000.000	1,056,216.000	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	710,000.000	1,174,183.800	
DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	710,000.000	1,073,782.700	
FINLAND 0.5 04/15/26	300,000.000	311,823.300	
FINLAND 0.5 09/15/27	300,000.000	312,390.450	
FINLAND 0.5 09/15/28	240,000.000	250,204.440	
FINLAND 0.5 09/15/29	270,000.000	281,232.540	
FINLAND 0.75 04/15/31	380,000.000	406,688.160	
FINLAND 0.875 09/15/25	300,000.000	317,810.310	
FINLAND 04/15/22	320,000.000	323,366.880	
FINLAND 09/15/23	230,000.000	233,107.570	
FINLAND 1.125 04/15/34	230,000.000	257,743.750	
FINLAND 1.375 04/15/47	130,000.000	161,560.030	
FINLAND 1.5 04/15/23	170,000.000	179,732.500	
FINLAND 1.625 09/15/22	400,000.000	420,410.800	
FINLAND 2.0 04/15/24	280,000.000	306,647.600	
FINLAND 2.625 07/04/42	350,000.000	520,128.000	
FINLAND 2.75 07/04/28	380,000.000	466,729.680	
FINLAND 4.0 07/04/25	430,000.000	526,305.810	
FRANCE BTAN 8.5 04/25/23	1,030,000.000	1,310,884.090	
FRANCE OAT 0.0 11/25/29	610,000.000	603,955.510	
FRANCE OAT 0.25 11/25/26	1,380,000.000	1,412,522.460	
FRANCE OAT 0.5 05/25/25	2,620,000.000	2,723,752.000	
FRANCE OAT 0.5 05/25/26	2,070,000.000	2,153,298.870	
FRANCE OAT 0.5 05/25/29	2,190,000.000	2,277,424.800	
FRANCE OAT 0.75 05/25/28	2,250,000.000	2,389,387.500	
FRANCE OAT 0.75 05/25/52	280,000.000	274,034.880	
FRANCE OAT 0.75 11/25/28	2,140,000.000	2,273,403.320	
FRANCE OAT 03/25/23	1,900,000.000	1,925,653.800	
FRANCE OAT 03/25/24	2,720,000.000	2,759,724.230	
FRANCE OAT 03/25/25	1,270,000.000	1,286,666.210	
FRANCE OAT 05/25/22	2,190,000.000	2,213,123.550	
FRANCE OAT 1.0 05/25/27	1,650,000.000	1,774,806.000	
FRANCE OAT 1.0 11/25/25	1,720,000.000	1,835,359.190	
FRANCE OAT 1.25 05/25/34	1,740,000.000	1,951,790.700	
FRANCE OAT 1.25 05/25/36	1,990,000.000	2,234,969.000	
FRANCE OAT 1.5 05/25/31	2,290,000.000	2,624,483.800	
FRANCE OAT 1.5 05/25/50	1,560,000.000	1,856,100.480	

FRANCE OAT 1.75 05/25/23	1,930,000.000	2,062,699.080	
FRANCE OAT 1.75 05/25/66	740,000.000	980,556.240	
FRANCE OAT 1.75 06/25/39	1,280,000.000	1,560,268.800	
FRANCE OAT 1.75 11/25/24	2,680,000.000	2,937,239.800	
FRANCE OAT 2.0 05/25/48	1,490,000.000	1,955,496.980	
FRANCE OAT 2.25 05/25/24	1,980,000.000	2,193,832.080	
FRANCE OAT 2.25 10/25/22	3,030,000.000	3,241,251.600	
FRANCE OAT 2.5 05/25/30	1,610,000.000	1,996,461.180	
FRANCE OAT 2.75 10/25/27	1,400,000.000	1,696,940.000	
FRANCE OAT 3.0 04/25/22	2,850,000.000	3,053,661.000	
FRANCE OAT 3.25 05/25/45	1,500,000.000	2,380,512.150	
FRANCE OAT 3.25 10/25/21	2,980,000.000	3,153,605.860	
FRANCE OAT 3.5 04/25/26	2,320,000.000	2,831,212.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/55	960,000.000	1,877,568.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/60	790,000.000	1,626,800.390	
FRANCE OAT 4.0 10/25/38	1,520,000.000	2,456,613.360	
FRANCE OAT 4.25 10/25/23	2,730,000.000	3,184,888.980	
FRANCE OAT 4.5 04/25/41	1,450,000.000	2,568,206.200	
FRANCE OAT 4.75 04/25/35	1,650,000.000	2,707,838.100	
FRANCE OAT 5.5 04/25/29	2,540,000.000	3,789,738.420	
FRANCE OAT 5.75 10/25/32	1,480,000.000	2,488,124.200	
FRANCE OAT 6.0 10/25/25	1,800,000.000	2,421,759.600	
IRISH 0.4 05/15/35	220,000.000	214,139.640	
IRISH 0.8 03/15/22	370,000.000	378,458.570	
IRISH 0.9 05/15/28	430,000.000	456,081.650	
IRISH 1.0 05/15/26	680,000.000	719,780.000	
IRISH 1.1 05/15/29	340,000.000	367,477.400	
IRISH 1.3 05/15/33	260,000.000	288,565.420	
IRISH 1.35 03/18/31	210,000.000	232,770.090	
IRISH 1.5 05/15/50	200,000.000	230,563.200	
IRISH 1.7 05/15/37	320,000.000	375,579.840	
IRISH 10/18/22	220,000.000	221,884.960	
IRISH 2.0 02/18/45	500,000.000	640,784.500	
IRISH 2.4 05/15/30	630,000.000	762,909.840	
IRISH 3.4 03/18/24	510,000.000	581,784.430	
IRISH 3.9 03/20/23	240,000.000	269,470.940	
IRISH 5.4 03/13/25	800,000.000	1,014,373.600	
ITALY BTPS 0.35 11/01/21	1,700,000.000	1,693,992.200	
ITALY BTPS 0.65 10/15/23	980,000.000	974,821.680	
ITALY BTPS 0.9 08/01/22	980,000.000	984,410.000	
ITALY BTPS 0.95 03/01/23	920,000.000	924,523.640	
ITALY BTPS 0.95 03/15/23	1,070,000.000	1,075,243.000	
ITALY BTPS 1.2 04/01/22	770,000.000	777,869.400	
ITALY BTPS 1.25 12/01/26	1,350,000.000	1,351,225.800	
ITALY BTPS 1.35 04/01/30	1,040,000.000	1,017,562.000	
ITALY BTPS 1.35 04/15/22	980,000.000	992,944.820	
ITALY BTPS 1.45 05/15/25	1,540,000.000	1,565,987.500	
ITALY BTPS 1.45 09/15/22	1,500,000.000	1,526,212.500	
ITALY BTPS 1.45 11/15/24	1,040,000.000	1,059,976.320	

ITALY BTPS 1.5 06/01/25	1,690,000.000	1,722,917.820	
ITALY BTPS 1.6 06/01/26	1,500,000.000	1,535,400.000	
ITALY BTPS 1.65 03/01/32	640,000.000	635,465.600	
ITALY BTPS 1.85 05/15/24	810,000.000	839,970.000	
ITALY BTPS 2.0 02/01/28	1,390,000.000	1,451,892.530	
ITALY BTPS 2.0 12/01/25	970,000.000	1,014,572.470	
ITALY BTPS 2.05 08/01/27	940,000.000	985,039.160	
ITALY BTPS 2.1 07/15/26	130,000.000	136,635.200	
ITALY BTPS 2.15 12/15/21	1,680,000.000	1,722,537.600	
ITALY BTPS 2.2 06/01/27	520,000.000	550,524.000	
ITALY BTPS 2.25 09/01/36	1,020,000.000	1,054,068.000	
ITALY BTPS 2.45 09/01/33	1,100,000.000	1,175,212.500	
ITALY BTPS 2.45 09/01/50	370,000.000	371,554.000	
ITALY BTPS 2.5 11/15/25	550,000.000	589,853.880	
ITALY BTPS 2.5 12/01/24	970,000.000	1,033,272.220	
ITALY BTPS 2.7 03/01/47	1,020,000.000	1,079,160.000	
ITALY BTPS 2.8 03/01/67	320,000.000	335,936.000	
ITALY BTPS 2.8 12/01/28	1,400,000.000	1,547,032.480	
ITALY BTPS 2.95 09/01/38	940,000.000	1,026,480.000	
ITALY BTPS 3.0 08/01/29	780,000.000	877,276.140	
ITALY BTPS 3.1 03/01/40	520,000.000	588,601.100	
ITALY BTPS 3.25 09/01/46	990,000.000	1,148,296.050	
ITALY BTPS 3.35 03/01/35	790,000.000	925,946.990	
ITALY BTPS 3.45 03/01/48	1,020,000.000	1,224,044.880	
ITALY BTPS 3.5 03/01/30	1,640,000.000	1,920,554.800	
ITALY BTPS 3.75 08/01/21	3,200,000.000	3,329,408.000	
ITALY BTPS 3.75 09/01/24	1,010,000.000	1,127,033.750	
ITALY BTPS 3.85 09/01/49	740,000.000	952,912.800	
ITALY BTPS 4.0 02/01/37	1,130,000.000	1,430,580.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/24	1,090,000.000	1,237,408.330	
ITALY BTPS 4.5 03/01/26	1,630,000.000	1,934,973.000	
ITALY BTPS 4.5 05/01/23	1,400,000.000	1,555,734.600	
ITALY BTPS 4.75 08/01/23	1,900,000.000	2,143,200.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/21	2,470,000.000	2,612,099.100	
ITALY BTPS 4.75 09/01/28	990,000.000	1,244,834.910	
ITALY BTPS 4.75 09/01/44	970,000.000	1,382,619.570	
ITALY BTPS 5.0 03/01/22	1,700,000.000	1,837,700.000	
ITALY BTPS 5.0 03/01/25	1,790,000.000	2,122,314.020	
ITALY BTPS 5.0 08/01/34	1,610,000.000	2,214,877.000	
ITALY BTPS 5.0 08/01/39	1,330,000.000	1,903,230.000	
ITALY BTPS 5.0 09/01/40	1,150,000.000	1,655,885.000	
ITALY BTPS 5.25 11/01/29	1,750,000.000	2,316,300.000	
ITALY BTPS 5.5 09/01/22	1,150,000.000	1,279,020.800	
ITALY BTPS 5.5 11/01/22	1,960,000.000	2,193,305.460	
ITALY BTPS 5.75 02/01/33	1,280,000.000	1,842,048.000	
ITALY BTPS 6.0 05/01/31	970,000.000	1,384,869.000	
ITALY BTPS 6.5 11/01/27	1,790,000.000	2,439,949.000	
ITALY BTPS 7.25 11/01/26	1,080,000.000	1,484,460.000	
ITALY BTPS 9.0 11/01/23	1,190,000.000	1,527,722.000	

NETHERLANDS 0.25 07/15/25	1,020,000.000	1,055,412.360	
NETHERLANDS 0.25 07/15/29	790,000.000	819,170.590	
NETHERLANDS 0.5 01/15/40	340,000.000	364,792.120	
NETHERLANDS 0.5 07/15/26	940,000.000	988,833.000	
NETHERLANDS 0.75 07/15/27	700,000.000	752,238.900	
NETHERLANDS 0.75 07/15/28	750,000.000	809,065.720	
NETHERLANDS 01/15/22	460,000.000	464,411.860	
NETHERLANDS 01/15/24	480,000.000	488,940.480	
NETHERLANDS 1.75 07/15/23	1,110,000.000	1,192,709.430	
NETHERLANDS 2.0 07/15/24	820,000.000	906,979.040	
NETHERLANDS 2.25 07/15/22	880,000.000	936,009.790	
NETHERLANDS 2.5 01/15/33	780,000.000	1,033,015.620	
NETHERLANDS 2.75 01/15/47	900,000.000	1,503,781.550	
NETHERLANDS 3.25 07/15/21	1,860,000.000	1,949,077.960	
NETHERLANDS 3.75 01/15/23	300,000.000	335,940.000	
NETHERLANDS 3.75 01/15/42	750,000.000	1,334,430.000	
NETHERLANDS 4.0 01/15/37	950,000.000	1,571,680.000	
NETHERLANDS 5.5 01/15/28	850,000.000	1,228,760.000	
SPAIN 0.25 07/30/24	340,000.000	339,865.370	
SPAIN 0.35 07/30/23	1,120,000.000	1,126,698.260	
SPAIN 0.4 04/30/22	1,570,000.000	1,583,596.200	
SPAIN 0.45 10/31/22	1,340,000.000	1,354,399.640	
SPAIN 0.5 04/30/30	850,000.000	826,881.020	
SPAIN 0.6 10/31/29	1,080,000.000	1,066,285.280	
SPAIN 0.75 07/30/21	1,700,000.000	1,719,774.400	
SPAIN 1.3 10/31/26	1,070,000.000	1,123,776.060	
SPAIN 1.4 04/30/28	1,240,000.000	1,312,090.740	
SPAIN 1.4 07/30/28	1,210,000.000	1,281,390.000	
SPAIN 1.45 04/30/29	1,370,000.000	1,457,961.250	
SPAIN 1.45 10/31/27	1,480,000.000	1,568,950.960	
SPAIN 1.5 04/30/27	1,210,000.000	1,286,109.000	
SPAIN 1.6 04/30/25	520,000.000	553,075.950	
SPAIN 1.85 07/30/35	490,000.000	539,546.530	
SPAIN 1.95 04/30/26	570,000.000	621,338.410	
SPAIN 1.95 07/30/30	1,460,000.000	1,624,861.740	
SPAIN 2.15 10/31/25	1,580,000.000	1,733,316.560	
SPAIN 2.35 07/30/33	1,140,000.000	1,328,898.000	
SPAIN 2.7 10/31/48	860,000.000	1,088,725.600	
SPAIN 2.75 10/31/24	1,540,000.000	1,711,096.770	

	SPAIN 2.9 10/31/46	870,000.000	1,131,513.640	
	SPAIN 3.45 07/30/66	660,000.000	1,006,514.520	
	SPAIN 3.8 04/30/24	1,270,000.000	1,452,283.100	
	SPAIN 4.2 01/31/37	670,000.000	980,352.970	
	SPAIN 4.4 10/31/23	1,430,000.000	1,643,456.100	
	SPAIN 4.65 07/30/25	1,370,000.000	1,678,298.220	
	SPAIN 4.7 07/30/41	1,070,000.000	1,732,638.480	
	SPAIN 4.8 01/31/24	1,130,000.000	1,326,366.080	
	SPAIN 4.9 07/30/40	1,170,000.000	1,911,663.000	
	SPAIN 5.15 10/31/28	880,000.000	1,205,512.000	
	SPAIN 5.15 10/31/44	830,000.000	1,461,259.820	
	SPAIN 5.4 01/31/23	1,460,000.000	1,675,536.880	
	SPAIN 5.75 07/30/32	1,220,000.000	1,908,178.930	
	SPAIN 5.85 01/31/22	1,810,000.000	2,003,167.180	
	SPAIN 5.9 07/30/26	1,170,000.000	1,562,395.770	
	SPAIN 6.0 01/31/29	1,580,000.000	2,294,141.040	
	ユーロ 小計	289,080,000.000 (34,189,491,600)	342,769,517.370 (40,539,350,819)	
南アフリカ・ランド	SOUTH AFRICA 10.5 12/21/26	14,130,000.000	14,615,167.680	
	SOUTH AFRICA 6.25 03/31/36	7,460,000.000	4,633,320.210	
	SOUTH AFRICA 6.5 02/28/41	3,570,000.000	2,158,826.480	
	SOUTH AFRICA 7.0 02/28/31	7,030,000.000	5,236,647.000	
	SOUTH AFRICA 8.0 01/31/30	10,900,000.000	9,023,249.440	
	SOUTH AFRICA 8.25 03/31/32	6,590,000.000	5,293,263.160	
	SOUTH AFRICA 8.5 01/31/37	8,820,000.000	6,755,500.130	
	SOUTH AFRICA 8.75 01/31/44	10,000,000.000	7,654,881.300	
	SOUTH AFRICA 8.75 02/28/48	16,040,000.000	12,257,763.170	
	SOUTH AFRICA 8.875 02/28/35	8,410,000.000	6,846,115.840	
	SOUTH AFRICA 9.0 01/31/40	4,860,000.000	3,875,478.690	
	南アフリカ・ランド 小計	97,810,000.000 (586,860,000)	78,350,213.100 (470,101,279)	
国債証券 合計	96,159,990,460 (96,159,990,460)	112,062,482,518 (112,062,482,518)		
合計		112,062,482,518 (112,062,482,518)		

(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 157銘柄	48.53	50.52
イギリス・ポンド	国債証券 37銘柄	6.14	6.40
オーストラリア・ドル	国債証券 18銘柄	1.77	1.84
カナダ・ドル	国債証券 22銘柄	1.57	1.64
シンガポール・ドル	国債証券 11銘柄	0.41	0.42
スウェーデン・クローナ	国債証券 5銘柄	0.21	0.22
デンマーク・クローネ	国債証券 4銘柄	0.46	0.48
ノルウェー・クローネ	国債証券 5銘柄	0.19	0.20
ポーランド・ズロチ	国債証券 10銘柄	0.53	0.55
マレーシア・リングgit	国債証券 11銘柄	0.48	0.49
メキシコ・ペソ	国債証券 11銘柄	0.61	0.63
ユーロ	国債証券 278銘柄	34.75	36.18
南アフリカ・ランド	国債証券 11銘柄	0.40	0.42

(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。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
貸借対照表

（単位：円）

令和2年4月13日現在

資産の部	
流動資産	
預金	768,400,746
コール・ローン	855,217,334
株式	295,171,444,216
投資信託受益証券	555,147,191
投資証券	8,014,756,930
派生商品評価勘定	580,577,689
未収入金	9,021,893
未収配当金	362,817,708
差入委託証拠金	3,904,761,863
流動資産合計	310,222,145,570
資産合計	310,222,145,570
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	3,184,933
未払金	44,790,429
未払解約金	27,352,600
流動負債合計	75,327,962
負債合計	75,327,962
純資産の部	
元本等	
元本	92,790,071,936
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	217,356,745,672
元本等合計	310,146,817,608
純資産合計	310,146,817,608
負債純資産合計	310,222,145,570

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 令和1年10月12日 至 令和2年4月13日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>為替予約取引</p> <p>原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建資産及び負債は、計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	令和2年4月13日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	90,217,747,738円
同期中追加設定元本額	19,088,126,068円
同期中一部解約元本額	16,515,801,870円
元本の内訳	
ファンド名	
D I A M外国株式パッシブ・ファンド	4,950,787,143円
M I T O ラップ型ファンド（安定型）	3,685,366円
M I T O ラップ型ファンド（中立型）	11,383,730円
M I T O ラップ型ファンド（積極型）	12,730,791円

グローバル8資産ラップファンド(安定型)	51,588,764円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	45,630,569円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	19,455,672円
たわらノーロード 先進国株式	13,430,944,119円
たわらノーロード 先進国株式<ラップ向け>	173,571,596円
たわらノーロード 先進国株式<為替ヘッジあり>	1,826,690,479円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	277,443,433円
たわらノーロード バランス(堅実型)	31,265,726円
たわらノーロード バランス(標準型)	230,989,741円
たわらノーロード バランス(積極型)	266,472,193円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(保守型)	1,033,955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)	116,158,547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)	276,853,433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)	172,079,818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)	294,249,805円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	91,337円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	1,284,313円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	2,732,300円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	1,808,507円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	5,175,078円
たわらノーロード 全世界株式	54,027,894円
DIAM外国株式インデックスファンド<DC年金>	43,283,833,725円
One DC 先進国株式インデックスファンド	229,433,079円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	198,233,231円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	981,732,765円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	1,167,184,879円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	120,978,725円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	360,293,436円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	300,464,716円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	28,179,401円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	822,239,250円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	179,025,158円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	250,637,582円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	182,686,407円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	288,487,295円
投資のソムリエ	2,175,491,434円
クルーズコントロール	151,798,298円
投資のソムリエ<DC年金>	203,574,430円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	217,711,866円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	113,524,246円
クルーズコントロール<DC年金>	172,908円
DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)	827,983円
DIAMコア資産設計ファンド(積極型)	2,226,157円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	64,734,885円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	638,915,695円
ワールドアセットバランス(基本コース)	439,823,625円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	298,326,639円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2045)	3,398,895円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2055)	2,303,894円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	592,186円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2035)	5,110,679円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	20,884,784円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	237,028,583円

9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	182,359,506円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	698,592円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	329,504円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	434,084円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	76,622円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12(適格機関投資家限定)	1,230,222円
MSCIコクサイ・インデックスファンド<為替ヘッジあり>(適格機関投資家限定)	263,103,435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)	85,994,660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)	1,938,942,267円
DIAM先進国株式パッシブファンド(適格機関投資家限定)	9,247,087,372円
外国株式パッシブ・ファンド2(適格機関投資家限定)	205,930,677円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	17,496,143円
インカム重視マルチアセット運用ファンド(適格機関投資家限定)	858,417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)	69,014,734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)	151,246,650円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	9,446,065円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	50,917,257円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	4,854,894円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	5,274,835円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	20,721,446円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	62,951,938円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	445,496,854円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	576,337,148円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	1,822,429,507円
DIAMグローバル・アセット・バランスVA(適格機関投資家限定)	648,428,192円
DIAMグローバル・アセット・バランスVA2(適格機関投資家限定)	110,009,630円
DIAM アクサ グローバル バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	719,960,919円
DIAM世界アセットバランスファンドVA(適格機関投資家向け)	30,716,987円
DIAM世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	7,358,888円
DIAM世界バランスファンド35VA(適格機関投資家限定)	10,832,509円
DIAM世界アセットバランスファンド2VA(適格機関投資家限定)	242,892,399円
DIAM世界アセットバランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	28,232,026円
DIAM世界アセットバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	105,746,484円
DIAM世界アセットバランスファンド3VA(適格機関投資家限定)	183,738,328円
DIAM世界アセットバランスファンド4VA(適格機関投資家限定)	296,688,704円
DIAMバランス20VA(適格機関投資家限定)	13,727,111円
DIAMバランス40VA(適格機関投資家限定)	243,133円
DIAMバランス60VA(適格機関投資家限定)	272,652円
計	92,790,071,936円
2. 受益権の総数	92,790,071,936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 令和1年10月12日 至 令和2年4月13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。
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、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。</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いません。</p>
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。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	令和2年4月13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。
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。
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。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	令和2年4月13日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
株式	61,556,163,618
投資信託受益証券	227,876,942
投資証券	1,518,098,226
合計	63,302,138,786

(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(令和2年2月18日から令和2年4月13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	令和2年4月13日現在			
	契約額等（円）	うち 1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	3,883,233	-	3,907,920	24,687
オーストラリア・ドル	3,883,233	-	3,907,920	24,687
買建	756,489,954	-	753,365,000	3,124,954
アメリカ・ドル	565,766,972	-	563,176,880	2,590,092
イギリス・ポンド	41,426,246	-	41,245,740	180,506
オーストラリア・ドル	13,434,820	-	13,437,760	2,940
カナダ・ドル	20,114,926	-	20,082,860	32,066
ユーロ	115,746,990	-	115,421,760	325,230
合計	760,373,187	-	757,272,920	3,149,641

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

1. 計算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、計算日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

株式関連

種類	令和2年4月13日現在			
	契約額等（円）	うち 1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引 先物取引 買建	5,764,447,309	-	6,344,989,706	580,542,397
合計	5,764,447,309	-	6,344,989,706	580,542,397

（注）時価の算定方法

株価指数先物取引

1. 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）

令和2年4月13日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	3.3425円 (33,425円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

令和2年4月13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	34,582	2,042.760	70,642,726.320	
	ABBOTT LABORATORIES	145,133	86.040	12,487,243.320	
	AES CORP	56,917	14.720	837,818.240	
	ABIOMED INC	3,574	160.080	572,125.920	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	72,659	121.500	8,828,068.500	
	ADVANCED MICRO DEVICES	87,783	48.380	4,246,941.540	
	ADOBE INC	39,707	318.700	12,654,620.900	
	CHUBB LTD	37,578	122.270	4,594,662.060	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	17,787	219.320	3,901,044.840	
	ALLEGHANY CORP	1,346	584.820	787,167.720	
	SAREPTA THERAPEUTICS INC	6,052	108.750	658,155.000	
	RALPH LAUREN CORP	3,422	80.410	275,163.020	
	ALLSTATE CORP	27,068	100.340	2,716,003.120	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	58,608	143.430	8,406,145.440	
	AMGEN INC	48,754	218.210	10,638,610.340	
	HESS CORP	21,367	40.380	862,799.460	

AMERICAN EXPRESS CO	57,127	94.820	5,416,782.140	
AMERICAN ELECTRIC POWER	40,670	86.310	3,510,227.700	
AFLAC INC	60,919	38.080	2,319,795.520	
AMERICAN INTL GROUP	74,200	26.540	1,969,268.000	
AMERCO	585	277.840	162,536.400	
ANALOG DEVICES	30,476	98.790	3,010,724.040	
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	18,098	96.230	1,741,570.540	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	65,819	30.600	2,014,061.400	
JONES LANG LASALLE INC	4,087	115.370	471,517.190	
VALERO ENERGY CORP	34,559	50.100	1,731,405.900	
APACHE CORP	25,616	8.200	210,051.200	
ANSYS INC	6,688	237.920	1,591,208.960	
APPLE INC	364,679	267.990	97,730,325.210	
APPLIED MATERIALS INC	76,886	49.590	3,812,776.740	
ALBEMARLE CORP	10,027	67.020	672,009.540	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	45,888	37.580	1,724,471.040	
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	9,278	82.230	762,929.940	
AMEREN CORP	21,321	79.000	1,684,359.000	
ARROW ELECTRONICS INC	5,795	59.200	343,064.000	
AUTOLIV INC	5,913	57.660	340,943.580	
AUTODESK INC	18,410	164.900	3,035,809.000	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	35,679	142.520	5,084,971.080	
AUTOZONE INC	1,917	940.830	1,803,571.110	
AVERY DENNISON CORP	6,549	115.030	753,331.470	
BALL CORP	25,163	69.940	1,759,900.220	
BERKSHIRE HATHAWAY INC- CL B	107,654	193.840	20,867,651.360	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	70,002	37.140	2,599,874.280	
BAXTER INTERNATIONAL INC	40,217	86.890	3,494,455.130	
BECTON DICKINSON & CO	22,213	247.450	5,496,606.850	
AMETEK INC	19,590	78.230	1,532,525.700	
VERIZON COMM INC	338,433	57.440	19,439,591.520	
WR BERKLEY CORP	12,511	58.320	729,641.520	
BEST BUY CO INC	18,720	65.990	1,235,332.800	
BIO-RAD LABORATORIES-CL A	1,859	393.140	730,847.260	
YUM! BRANDS INC	24,939	80.370	2,004,347.430	
FIRSTENERGY CORP	43,588	44.750	1,950,563.000	
BOEING CO	44,043	151.840	6,687,489.120	
ROBERT HALF INTL INC	11,645	43.280	503,995.600	
BORGWARNER INC	17,210	25.740	442,985.400	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	115,462	36.830	4,252,465.460	

C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	11,838	73.220	866,778.360	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	9,830	119.400	1,173,702.000	
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	1,929	727.420	1,403,193.180	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	192,386	58.910	11,333,459.260	
INGREDION INC	5,305	82.100	435,540.500	
ONEOK INC	36,226	28.400	1,028,818.400	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	5,900	80.490	474,891.000	
UNITED RENTALS INC	6,181	107.710	665,755.510	
SEMPRA ENERGY	22,634	130.530	2,954,416.020	
FEDEX CORP	20,489	122.290	2,505,599.810	
VERISIGN INC	8,769	196.070	1,719,337.830	
AMPHENOL CORP	24,606	81.910	2,015,477.460	
BROWN-FORMAN CORP	24,381	62.890	1,533,321.090	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	125,254	5.250	657,583.500	
CSX CORP	61,172	64.000	3,915,008.000	
CABOT OIL & GAS CORP	31,416	18.880	593,134.080	
CAMPBELL SOUP CO	14,050	47.750	670,887.500	
SEAGATE TECHNOLOGY	19,641	51.250	1,006,601.250	
CONSTELLATION BRANDS INC	13,685	166.240	2,274,994.400	
CARDINAL HEALTH INC	22,950	50.430	1,157,368.500	
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	31,962	12.420	396,968.040	
CATERPILLAR INC	45,328	125.030	5,667,359.840	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	9,865	105.360	1,039,376.400	
CITRIX SYSTEMS INC	10,387	139.400	1,447,947.800	
CENTURYLINK INC	80,424	10.650	856,515.600	
CERNER CORP	25,170	68.380	1,721,124.600	
JPMORGAN CHASE & CO	257,255	102.760	26,435,523.800	
CHURCH & DWIGHT CO INC	19,574	68.390	1,338,665.860	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	12,872	83.580	1,075,841.760	
CINTAS CORP	7,294	198.740	1,449,609.560	
CISCO SYSTEMS INC	347,671	41.200	14,324,045.200	
CLOROX COMPANY	10,586	184.210	1,950,047.060	
COCA-COLA CO/THE	333,746	49.000	16,353,554.000	
COPART INC	16,749	74.990	1,256,007.510	
COGNEX CORP	15,179	46.190	701,118.010	
COLGATE-PALMOLIVE CO	66,755	69.910	4,666,842.050	
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	22,506	81.310	1,829,962.860	
COMERICA INC	11,985	34.750	416,478.750	
NRG ENERGY, INC.	21,039	30.760	647,159.640	
COMCAST CORP-CL A	372,113	38.000	14,140,294.000	
CONAGRA BRANDS INC	40,291	32.460	1,307,845.860	

CONSOLIDATED EDISON INC	26,829	87.940	2,359,342.260	
CMS ENERGY CORP	22,782	62.330	1,420,002.060	
COOPER COS INC	3,936	296.570	1,167,299.520	
MOLSON COORS BEVERAGE CO	16,513	47.400	782,716.200	
CORNING INC	65,417	21.180	1,385,532.060	
SEALED AIR CORP	13,870	30.800	427,196.000	
HEICO CORP-CL A	5,292	72.760	385,045.920	
CUMMINS INC	11,623	150.700	1,751,586.100	
DR HORTON INC	29,104	41.040	1,194,428.160	
DANAHER CORP	51,225	145.730	7,465,019.250	
MOODY'S CORP	14,130	241.680	3,414,938.400	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	45,276	54.280	2,457,581.280	
TARGET CORP	41,906	104.200	4,366,605.200	
DEERE & CO	24,765	145.750	3,609,498.750	
MORGAN STANLEY	99,775	41.080	4,098,757.000	
REPUBLIC SERVICES INC	18,180	81.820	1,487,487.600	
COSTAR GROUP INC	3,001	631.280	1,894,471.280	
THE WALT DISNEY CO	147,958	104.500	15,461,611.000	
DOLLAR TREE INC	18,697	77.560	1,450,139.320	
DOVER CORP	11,113	89.410	993,613.330	
OMNICOM GROUP	17,365	56.800	986,332.000	
DTE ENERGY CO	16,264	111.250	1,809,370.000	
DUKE ENERGY CORP	60,117	90.310	5,429,166.270	
FLOWSERVE CORP	9,882	27.190	268,691.580	
DARDEN RESTAURANTS INC	9,700	64.340	624,098.000	
EBAY INC	61,876	33.830	2,093,265.080	
BANK OF AMERICA CORP	701,223	24.860	17,432,403.780	
CITIGROUP INC	179,036	47.410	8,488,096.760	
EASTMAN CHEMICAL CO	12,121	59.710	723,744.910	
E*TRADE FINANCIAL CORP	17,104	41.760	714,263.040	
EATON CORP PLC	33,500	81.440	2,728,240.000	
EATON VANCE CORP	9,184	34.910	320,613.440	
CADENCE DESIGN SYS INC	22,460	71.650	1,609,259.000	
DISH NETWORK CORP	23,723	23.070	547,289.610	
ECOLAB INC	21,004	179.860	3,777,779.440	
PERKINELMER INC	10,109	78.340	791,939.060	
ELECTRONIC ARTS INC	23,805	105.800	2,518,569.000	
SALESFORCE.COM INC	68,322	154.550	10,559,165.100	
ERIE INDEMNITY CO	2,243	166.090	372,539.870	
EMERSON ELECTRIC CO	49,455	51.780	2,560,779.900	
ATMOS ENERGY CORP	9,937	105.200	1,045,372.400	
ENTERGY CORP	16,319	102.910	1,679,388.290	
EOG RESOURCES INC	48,085	44.820	2,155,169.700	
EQUIFAX INC	10,344	124.220	1,284,931.680	
ESTEE LAUDER COS INC/THE	18,601	164.830	3,066,002.830	
EXPEDITORS INTERNATIONAL	14,440	71.480	1,032,171.200	
EXXON MOBIL CORP	347,328	43.130	14,980,256.640	
FMC CORP	10,209	90.000	918,810.000	

NEXTERA ENERGY INC	40,019	245.280	9,815,860.320	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	3,373	279.160	941,606.680	
ASSURANT INC	4,594	112.390	516,319.660	
FASTENAL CO	49,297	33.620	1,657,365.140	
FIFTH THIRD BANCORP	58,016	17.820	1,033,845.120	
M&T BANK CORP	9,999	114.750	1,147,385.250	
FISERV INC	47,592	99.220	4,722,078.240	
FLIR SYSTEMS INC	12,717	34.500	438,736.500	
FORD MOTOR CO	313,382	5.370	1,682,861.340	
FRANKLIN RESOURCES INC	23,713	16.810	398,615.530	
FREEPORT-MCMORAN INC	114,993	8.190	941,792.670	
FLEX LTD	35,127	8.810	309,468.870	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	15,924	86.840	1,382,840.160	
GAP INC/THE	18,295	9.090	166,301.550	
DENTSPLY SIRONA INC	18,386	41.870	769,821.820	
GENERAL DYNAMICS CORP	20,788	141.010	2,931,315.880	
GENERAL MILLS INC	48,560	57.400	2,787,344.000	
GENUINE PARTS CO	11,605	71.670	831,730.350	
GILEAD SCIENCES INC	103,846	73.510	7,633,719.460	
GARTNER INC	7,522	106.890	804,026.580	
MCKESSON CORP	13,720	133.320	1,829,150.400	
NVIDIA CORP	47,686	262.950	12,539,033.700	
GENERAL ELECTRIC CO	717,586	7.140	5,123,564.040	
WW GRAINGER INC	3,745	279.870	1,048,113.150	
HALLIBURTON CO	66,843	8.210	548,781.030	
MONSTER BEVERAGE CORP	32,591	60.510	1,972,081.410	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	25,754	184.260	4,745,432.040	
HARLEY-DAVIDSON INC	12,901	21.130	272,598.130	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	18,329	190.790	3,496,989.910	
HASBRO INC	11,383	75.670	861,351.610	
HENRY SCHEIN INC	11,516	52.250	601,711.000	
HEICO CORP	3,623	82.000	297,086.000	
HERSHEY FOODS CORP	12,250	143.910	1,762,897.500	
HP INC	118,522	15.970	1,892,796.340	
F5 NETWORKS INC	4,874	125.390	611,150.860	
CROWN HOLDINGS INC NPR	10,472	62.200	651,358.400	
JUNIPER NETWORKS INC	27,939	21.670	605,438.130	
HOLLYFRONTIER CORP	11,855	26.420	313,209.100	
HOLOGIC INC	23,457	41.110	964,317.270	
UNUM GROUP	15,185	15.580	236,582.300	
HOME DEPOT INC	89,413	201.530	18,019,401.890	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	14,356	79.550	1,142,019.800	
HORMEL FOODS CORP	23,263	47.540	1,105,923.020	
CENTERPOINT ENERGY INC	37,678	17.810	671,045.180	
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,913	204.290	595,096.770	
HUMANA INC	10,862	341.900	3,713,717.800	

JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	7,392	99.190	733,212.480	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	79,517	9.025	717,640.920	
BIOGEN INC	14,848	321.050	4,766,950.400	
IDEX CORP	6,154	151.520	932,454.080	
ILLINOIS TOOL WORKS	26,528	159.280	4,225,379.840	
INTUIT INC	21,351	252.100	5,382,587.100	
IDEXX LABORATORIES INC	6,791	258.580	1,756,016.780	
IONIS PHARMACEUTICALS INC	10,960	53.000	580,880.000	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	19,760	91.600	1,810,016.000	
INTEL CORP	356,894	57.140	20,392,923.160	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	7,965	127.370	1,014,502.050	
INTERNATIONAL PAPER CO	29,411	34.170	1,004,973.870	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	28,862	16.280	469,873.360	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	11,705	81.310	951,733.550	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	6,019	170.160	1,024,193.040	
INCYTE CORP	15,616	86.810	1,355,624.960	
JOHNSON & JOHNSON	215,989	141.230	30,504,126.470	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	29,620	41.880	1,240,485.600	
KLA CORPORATION	12,632	150.120	1,896,315.840	
DEVON ENERGY CORP	43,446	9.670	420,122.820	
KELLOGG CO	21,289	62.740	1,335,671.860	
EAST WEST BANCORP INC	11,560	31.110	359,631.600	
KEYCORP	84,596	12.010	1,015,997.960	
KIMBERLY-CLARK CORP	28,280	131.490	3,718,537.200	
BLACKROCK INC/NEW YORK	9,520	471.420	4,487,918.400	
KOHL'S CORP	11,910	19.910	237,128.100	
KROGER CO	66,283	31.060	2,058,749.980	
LAM RESEARCH CORP	11,659	258.280	3,011,286.520	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	3,160	327.920	1,036,227.200	
PACKAGING CORP OF AMERICA	7,143	90.460	646,155.780	
AKAMAI TECHNOLOGIES	12,833	95.390	1,224,139.870	
LEGGETT & PLATT INC	10,928	29.880	326,528.640	
LENNAR CORP	23,510	44.800	1,053,248.000	
JEFFERIES FINANCIAL GROUP INC	20,795	14.170	294,665.150	
ELI LILLY & CO	70,973	145.730	10,342,895.290	
LINCOLN NATIONAL CORP	15,344	34.290	526,145.760	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	57,558	98.690	5,680,399.020	

AGILENT TECHNOLOGIES INC	25,430	78.330	1,991,931.900	
LOCKHEED MARTIN CORP	20,853	371.000	7,736,463.000	
LOEWS CORP	21,759	39.420	857,739.780	
LOWE'S COS INC	62,974	95.310	6,002,051.940	
DOMINION ENERGY INC	67,412	81.590	5,500,145.080	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	38,573	14.550	561,237.150	
MCCORMICK & CO INC	9,876	154.300	1,523,866.800	
MCDONALD'S CORPORATION	62,121	183.700	11,411,627.700	
S&P GLOBAL INC	20,090	283.550	5,696,519.500	
EVEREST RE GROUP LTD	3,114	212.300	661,102.200	
MANPOWERGROUP INC	4,555	61.800	281,499.000	
MARKEL CORPORATION	1,210	1,005.400	1,216,534.000	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	17,341	215.440	3,735,945.040	
MARSH & MCLENNAN COS	41,917	96.610	4,049,601.370	
MASCO CORP	25,107	40.370	1,013,569.590	
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	4,786	208.190	996,397.340	
METLIFE INC	62,638	35.460	2,221,143.480	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	21,386	51.790	1,107,580.940	
MEDTRONIC PLC	109,853	101.030	11,098,448.590	
ACTIVISION BLIZZARD INC	62,444	60.460	3,775,364.240	
CVS HEALTH CORP	106,760	60.470	6,455,777.200	
MERCK & CO. INC.	208,995	82.490	17,239,997.550	
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	32,686	13.730	448,778.780	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	8,070	146.800	1,184,676.000	
MICROSOFT CORP	594,648	165.140	98,200,170.720	
MICRON TECH INC	91,561	46.130	4,223,708.930	
MIDDLEBY CORP	4,188	58.080	243,239.040	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	20,442	78.450	1,603,674.900	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	54,337	24.280	1,319,302.360	
3M CO	47,234	147.780	6,980,240.520	
MOHAWK INDUSTRIES INC	4,976	88.010	437,937.760	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	14,413	152.890	2,203,603.570	
KANSAS CITY SOUTHERN	7,614	136.600	1,040,072.400	
MYLAN NV	44,496	16.080	715,495.680	
ILLUMINA INC	11,919	287.620	3,428,142.780	
XCEL ENERGY INC	43,154	66.270	2,859,815.580	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	6,545	96.680	632,770.600	
NATIONAL OILWELL VARCO INC	39,996	11.600	463,953.600	
NETAPP INC	17,963	42.730	767,558.990	
NEWELL BRANDS INC	33,317	14.150	471,435.550	

NEWMONT CORP	66,573	57.310	3,815,298.630	
NVR INC	316	2,928.010	925,251.160	
NIKE INC-CL B	102,166	86.790	8,866,987.140	
NOBLE ENERGY INC	39,436	7.510	296,164.360	
NORDSTROM INC	9,487	21.320	202,262.840	
NORFOLK SOUTHERN CORP	21,134	159.300	3,366,646.200	
EVERSOURCE ENERGY	26,316	90.100	2,371,071.600	
NISOURCE INC	31,427	26.580	835,329.660	
TAPESTRY INC	21,790	15.700	342,103.000	
NORTHERN TRUST CORP	15,959	84.890	1,354,759.510	
NORTHROP GRUMMAN CORP	13,177	336.650	4,436,037.050	
WELLS FARGO & CO	329,895	33.200	10,952,514.000	
NUCOR CORP	24,042	39.430	947,976.060	
CHENIERE ENERGY INC	19,190	38.580	740,350.200	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	37,625	60.110	2,261,638.750	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	79,250	15.360	1,217,280.000	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	7,813	135.150	1,055,926.950	
OGE ENERGY CORP	16,028	32.520	521,230.560	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	6,222	342.440	2,130,661.680	
ORACLE CORP	188,658	53.180	10,032,832.440	
PACCAR INC	27,438	67.270	1,845,754.260	
PTC INC	10,059	63.940	643,172.460	
EXELON CORP	81,102	39.150	3,175,143.300	
PARKER HANNIFIN CORP	11,181	145.170	1,623,145.770	
PAYCHEX INC	25,879	66.540	1,721,988.660	
ALIGN TECHNOLOGY INC	6,181	193.190	1,194,107.390	
PPL CORPORATION	58,655	26.700	1,566,088.500	
PEPSICO INC	114,354	133.630	15,281,125.020	
PENTAIR PLC	12,511	32.840	410,861.240	
PFIZER INC	454,465	35.390	16,083,516.350	
ESSENTIAL UTILITIES INC	15,516	44.610	692,168.760	
CONOCOPHILLIPS	90,875	34.730	3,156,088.750	
PVH CORP	5,205	49.510	257,699.550	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	14,597	75.480	1,101,781.560	
ALTRIA GROUP INC	153,459	40.910	6,278,007.690	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	36,288	105.420	3,825,480.960	
BROWN & BROWN INC	21,068	39.030	822,284.040	
POLARIS INC	4,095	56.000	229,320.000	
GARMIN LTD	10,774	78.650	847,375.100	
PPG INDUSTRIES INC	18,738	97.170	1,820,771.460	
IPG PHOTONICS CORP	2,608	119.050	310,482.400	
COSTCO WHOLESALE CORP	36,208	300.010	10,862,762.080	
T ROWE PRICE GROUP INC	18,611	105.160	1,957,132.760	
QUEST DIAGNOSTICS	10,883	89.770	976,966.910	

PROCTER & GAMBLE CO	204,434	114.660	23,440,402.440	
PROGRESSIVE CORP	47,272	80.390	3,800,196.080	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	41,882	52.950	2,217,651.900	
PULTE GROUP INC	21,209	26.340	558,645.060	
GLOBAL PAYMENTS INC	25,029	151.030	3,780,129.870	
QUALCOMM INC	93,710	71.580	6,707,761.800	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	10,744	69.440	746,063.360	
EXACT SCIENCES CORP	11,306	67.060	758,180.360	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	4,052	164.740	667,526.480	
REGENERON PHARMACEUTICALS	6,648	512.960	3,410,158.080	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA INC	5,042	112.000	564,704.000	
RESMED INC	11,940	159.820	1,908,250.800	
US BANCORP	122,910	38.050	4,676,725.500	
SEATTLE GENETICS INC /WA	10,232	120.320	1,231,114.240	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	31,500	31.000	976,500.000	
ROSS STORES INC	30,427	88.740	2,700,091.980	
ROLLINS INC	12,378	36.020	445,855.560	
ROPER TECHNOLOGIES INC	8,359	315.450	2,636,846.550	
ROCKWELL AUTOMATION INC	9,327	167.640	1,563,578.280	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	14,075	40.220	566,096.500	
RPM INTERNATIONAL INC	11,004	65.810	724,173.240	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	3,848	38.580	148,455.840	
ACCENTURE PLC-CL A	52,029	177.920	9,256,999.680	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	117,863	52.340	6,168,949.420	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	10,239	196.020	2,007,048.780	
THE TRAVELERS COMPANIES INC	20,817	109.740	2,284,457.580	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	50,338	125.120	6,298,290.560	
BOOKING HOLDINGS INC	3,451	1,420.640	4,902,628.640	
SCHLUMBERGER LTD	116,108	16.470	1,912,298.760	
SCHWAB (CHARLES) CORP	95,786	36.540	3,500,020.440	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	16,910	110.360	1,866,187.600	
BUNGE LTD	10,622	40.830	433,696.260	
SEI INVESTMENTS CO	10,653	50.930	542,557.290	
ANTHEM INC	20,884	242.460	5,063,534.640	
AMERISOURCEBERGEN CORP	12,641	87.810	1,110,006.210	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	22,175	32.600	722,905.000	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	6,940	492.150	3,415,521.000	

CENTENE CORP	48,199	66.420	3,201,377.580	
SVB FINANCIAL GROUP	4,044	185.690	750,930.360	
IAC INTERACTIVE CORP	6,252	195.010	1,219,202.520	
SMITH (A.O.) CORP	11,351	40.210	456,423.710	
ACUITY BRANDS INC	3,087	92.140	284,436.180	
SNAP-ON INC	5,301	122.120	647,358.120	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	32,487	58.700	1,906,986.900	
ADVANCE AUTO PARTS	5,297	106.860	566,037.420	
EDISON INTERNATIONAL	28,916	60.270	1,742,767.320	
SOUTHERN CO	86,060	60.330	5,191,999.800	
TRUIST FINANCIAL CORP	110,666	36.110	3,996,149.260	
SOUTHWEST AIRLINES	11,791	36.470	430,017.770	
AT&T INC	598,780	30.730	18,400,509.400	
CHEVRON CORP	155,219	84.310	13,086,513.890	
STANLEY BLACK & DECKER INC	13,100	119.370	1,563,747.000	
STATE STREET CORP	29,847	60.950	1,819,174.650	
STARBUCKS CORP	97,388	73.880	7,195,025.440	
STEEL DYNAMICS INC	17,547	23.960	420,426.120	
STRYKER CORP	27,930	182.720	5,103,369.600	
NETFLIX INC	35,949	370.720	13,327,013.280	
NORTONLIFELOCK INC	48,955	19.370	948,258.350	
KNIGHT SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	9,793	35.030	343,048.790	
SYNOPSYS INC	12,867	136.580	1,757,374.860	
SYSCO CORP	38,745	49.590	1,921,364.550	
INTUITIVE SURGICAL INC	9,525	503.790	4,798,599.750	
TELEFLEX INC	3,899	325.560	1,269,358.440	
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	88,322	10.160	897,351.520	
TERADYNE INC	14,447	61.150	883,434.050	
TEXAS INSTRUMENTS INC	76,641	107.690	8,253,469.290	
TEXTRON INC	16,304	29.440	479,989.760	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	32,899	317.380	10,441,484.620	
TIFFANY & CO	8,733	127.950	1,117,387.350	
GLOBE LIFE INC	9,042	80.400	726,976.800	
DAVITA INC	7,993	74.820	598,036.260	
TRACTOR SUPPLY CO	9,573	88.230	844,625.790	
TRIMBLE INC	20,073	34.460	691,715.580	
TYLER TECHNOLOGIES INC	3,294	311.990	1,027,695.060	
TYSON FOODS INC	25,079	60.940	1,528,314.260	
UGI CORP	19,841	30.040	596,023.640	
MARATHON OIL CORP	58,418	4.120	240,682.160	
UNION PACIFIC CORP	56,912	148.730	8,464,521.760	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	123,465	64.710	7,989,420.150	
UNITEDHEALTH GROUP INC	77,700	264.130	20,522,901.000	

UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	6,153	104.510	643,050.030	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	7,226	113.150	817,621.900	
VF CORP	26,903	59.210	1,592,926.630	
VIACOMCBS INC	45,361	16.560	751,178.160	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	21,142	246.610	5,213,828.620	
VULCAN MATERIALS CO	11,057	113.100	1,250,546.700	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	62,594	43.980	2,752,884.120	
WALMART INC	116,589	121.800	14,200,540.200	
WASTE MANAGEMENT INC	35,117	99.850	3,506,432.450	
WATERS CORP	5,211	195.930	1,020,991.230	
ALLERGAN PLC	26,983	182.200	4,916,302.600	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	6,024	162.930	981,490.320	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	9,176	112.750	1,034,594.000	
VAIL RESORTS INC	3,109	164.690	512,021.210	
WESTERN DIGITAL CORP	25,867	45.050	1,165,308.350	
WABTEC CORP	15,540	55.260	858,740.400	
WHIRLPOOL CORP	4,614	104.750	483,316.500	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	13,935	89.950	1,253,453.250	
WYNN RESORTS LTD	8,639	70.650	610,345.350	
NASDAQ INC	9,020	107.920	973,438.400	
CME GROUP INC	29,406	190.160	5,591,844.960	
WILLIAMS COS INC	99,729	16.590	1,654,504.110	
LKQ CORP	29,464	22.530	663,823.920	
ALLIANT ENERGY CORP	19,849	53.140	1,054,775.860	
WEC ENERGY GROUP INC	26,725	98.220	2,624,929.500	
TD AMERITRADE HOLDING CORP	21,820	37.960	828,287.200	
CARMAX INC	14,208	66.500	944,832.000	
XILINX INC	20,663	83.110	1,717,301.930	
TJX COMPANIES INC	99,863	48.810	4,874,313.030	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP	4,128	201.220	830,636.160	
ZIONS BANCORP NA	13,142	30.995	407,336.290	
DAIRY FARM INTERNATIONAL HLDNGS	27,400	4.930	135,082.000	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	108,700	4.250	461,975.000	
JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	17,800	49.510	881,278.000	
JARDINE STRATEGIC HOLDINGS LTD	17,100	23.490	401,679.000	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	9,381	116.380	1,091,760.780	
SIGNATURE BANK	4,171	90.230	376,349.330	
CBRE GROUP INC	26,811	45.610	1,222,849.710	

LIBERTY GLOBAL PLC	12,732	18.590	236,687.880	
REGIONS FINANCIAL CORP	76,480	11.010	842,044.800	
DOMINO'S PIZZA INC	3,212	343.640	1,103,771.680	
WESTLAKE CHEMICAL CORP	3,000	45.610	136,830.000	
T-MOBILE US INC	35,299	85.900	3,032,184.100	
LAS VEGAS SANDS CORP	27,755	47.860	1,328,354.300	
MOSAIC CO/THE	28,249	12.970	366,389.530	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	3,218	403.350	1,297,980.300	
CELANESE CORP	10,139	83.910	850,763.490	
DEXCOM INC	7,700	275.270	2,119,579.000	
DISCOVERY INC-A	10,423	22.320	232,641.360	
EXPEDIA GROUP INC	12,120	62.420	756,530.400	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	18,475	31.010	572,909.750	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	10,651	120.470	1,283,125.970	
LIBERTY GLOBAL PLC- SERIES C	34,023	17.390	591,659.970	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	45,880	87.380	4,008,994.400	
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	14,696	10.430	153,279.280	
LIVE NATION	11,339	38.270	433,943.530	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,246	771.000	1,731,666.000	
UNITED AIRLINES HOLIDINGS INC	4,508	31.500	142,002.000	
TRANSDIGM GROUP INC	4,026	344.540	1,387,118.040	
MASTERCARD INC	73,599	269.400	19,827,570.600	
HANESBRANDS INC	27,619	9.570	264,313.830	
WESTERN UNION CO	35,367	20.190	714,059.730	
OWENS CORNING	7,756	44.100	342,039.600	
LEIDOS HOLDINGS INC	11,057	95.460	1,055,501.220	
AERCAP HOLDINGS NV	8,807	25.760	226,868.320	
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLDINGS INC	7,067	22.580	159,572.860	
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT-ADR	17,350	13.600	235,960.000	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	9,176	105.910	971,830.160	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	40,369	12.300	496,538.700	
DELTA AIR LINES INC	11,158	24.390	272,143.620	
INSULET CORP	4,781	182.940	874,636.140	
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	6,038	12.190	73,603.220	
DISCOVER FINANCIAL	28,398	39.210	1,113,485.580	
TE CONNECTIVITY LTD	27,638	71.170	1,966,996.460	
CONCHO RESOURCES INC/MIDLAND TX	15,970	52.740	842,257.800	
WABCO HOLDING INC	4,076	134.710	549,077.960	

LULULEMON ATHLETICA INC	8,919	203.510	1,815,105.690	
VMWARE INC	6,532	131.430	858,500.760	
MERCADOLIBRE INC	3,777	533.280	2,014,198.560	
ULTA BEAUTY INC	4,759	202.480	963,602.320	
INVESCO LTD	33,443	9.860	329,747.980	
MSCI INC	7,151	310.690	2,221,744.190	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	127,645	75.340	9,616,774.300	
VISA INC	140,380	173.690	24,382,602.200	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	15,441	131.750	2,034,351.750	
DISCOVERY INC-C	30,421	20.140	612,678.940	
MARATHON PETROLEUM CORP	53,851	25.630	1,380,201.130	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	12,110	50.830	615,551.300	
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	170,954	15.360	2,625,853.440	
XYLEM INC	15,151	69.340	1,050,570.340	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	20,876	58.930	1,230,222.680	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,484	192.390	670,286.760	
SPLUNK INC	12,174	123.130	1,498,984.620	
EPAM SYSTEMS INC	4,738	192.290	911,070.020	
HCA HEALTHCARE INC	22,084	108.060	2,386,397.040	
VERISK ANALYTICS INC	12,461	148.260	1,847,467.860	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,273	109.690	468,705.370	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	7,006	224.990	1,576,279.940	
FIRST REPUBLIC BANK/SAN FRANCISCO CA	13,975	99.500	1,390,512.500	
NXP SEMICONDUCTOR NV	22,860	89.970	2,056,714.200	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDING CORP	11,667	74.250	866,274.750	
TARGA RESOURCES CORP	19,038	8.610	163,917.180	
LEAR CORP	4,681	91.150	426,673.150	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	8,622	93.420	805,467.240	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	20,302	49.510	1,005,152.020	
DOLLAR GENERAL CORP	20,893	169.240	3,535,931.320	
FORTINET INC	12,393	101.930	1,263,218.490	
TESLA INC	11,100	573.000	6,360,300.000	
GENERAL MOTORS CO	109,268	24.060	2,628,988.080	
XPO LOGISTICS INC	7,614	61.900	471,306.600	
TRIPADVISOR INC	9,263	18.340	169,883.420	
ALLY FINANCIAL INC	34,101	16.830	573,919.830	
CAPRI HOLDINGS LTD	12,138	13.380	162,406.440	
VOYA FINANCIAL INC	10,273	45.650	468,962.450	
APTIV PLC	21,364	62.230	1,329,481.720	

PHILLIPS 66	36,678	61.520	2,256,430.560	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	7,589	83.410	632,998.490	
FACEBOOK INC	197,592	175.190	34,616,142.480	
IQVIA HOLDINGS INC	13,446	128.530	1,728,214.380	
DIAMONDBACK ENERGY INC	11,424	34.860	398,240.640	
SERVICENOW INC	15,562	278.060	4,327,169.720	
PALO ALTO NETWORKS INC	8,043	177.880	1,430,688.840	
WORKDAY INC	13,144	145.410	1,911,269.040	
ABBVIE INC	121,304	79.750	9,673,994.000	
ZOETIS INC	39,098	128.750	5,033,867.500	
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDINGS LTD	16,899	13.110	221,545.890	
COTY INC	23,813	6.020	143,354.260	
NEWS CORP/NEW-CL A	30,263	9.490	287,195.870	
HD SUPPLY HOLDINGS INC	14,075	32.070	451,385.250	
CDW CORP	11,406	106.260	1,212,001.560	
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	10,199	12.510	127,589.490	
HOWMET AEROSPACE INC	30,749	13.250	407,424.250	
TWILIO INC	9,190	95.340	876,174.600	
SNAP INC	57,130	13.610	777,539.300	
LIBERTY MEDIA CORP- LIBERTY-C	18,890	24.920	470,738.800	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	5,006	32.050	160,442.300	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-C	14,205	32.340	459,389.700	
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	15,410	9.350	144,083.500	
OKTA INC	8,556	130.960	1,120,493.760	
BLACK KNIGHT INC	12,793	63.480	812,099.640	
BAKER HUGHES CO	51,005	12.860	655,924.300	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	13,181	58.400	769,770.400	
ALTICE USA INC-A	14,073	24.600	346,195.800	
TECHNIPFMC LTD	31,257	8.400	262,558.800	
BROADCOM INC	32,537	254.300	8,274,159.100	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	6,250	205.140	1,282,125.000	
MONGODB INC	3,423	140.340	480,383.820	
BURLINGTON STORES INC	5,095	176.890	901,254.550	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	35,824	24.500	877,688.000	
VEEVA SYSTEMS INC	10,594	162.110	1,717,393.340	
TWITTER INC	63,023	27.770	1,750,148.710	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING PLC	13,214	34.280	452,975.920	
EVERGY INC	18,388	63.100	1,160,282.800	
ALLEGION PLC	7,469	95.360	712,243.840	
STERIS PLC	6,658	152.690	1,016,610.020	
DOCUSIGN INC	8,601	90.630	779,508.630	
WIX.COM LTD	4,000	114.460	457,840.000	
DROPBOX INC	17,573	18.060	317,368.380	
KKR & CO INC	42,982	25.300	1,087,444.600	
PERRIGO CO PLC	10,553	50.450	532,398.850	

HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	22,987	68.450	1,573,460.150	
ARAMARK	18,144	23.290	422,573.760	
CIGNA CORP	30,792	181.830	5,598,909.360	
DELL TECHNOLOGIES INC	12,960	41.560	538,617.600	
DOW INC	60,823	36.560	2,223,688.880	
AMCOR PLC	130,000	9.160	1,190,800.000	
PINTEREST INC	21,582	16.750	361,498.500	
XEROX HOLDINGS CORP	13,360	19.360	258,649.600	
FOX CORP-A	31,825	25.990	827,131.750	
FOX CORP-B	13,009	25.640	333,550.760	
CARRIER GLOBAL CORP	65,428	14.780	967,025.840	
OTIS WORLDWIDE CORP	32,714	49.140	1,607,565.960	
UBER TECHNOLOGIES INC	32,409	27.110	878,607.990	
CORTEVA INC	59,322	27.930	1,656,863.460	
BLACKSTONE GROUP INC	53,609	49.170	2,635,954.530	
GRUBHUB INC	8,158	45.090	367,844.220	
INGERSOLL RAND INC	28,361	26.500	751,566.500	
PAYCOM SOFTWARE INC	3,923	221.990	870,866.770	
SABRE CORP	19,809	7.000	138,663.000	
AON PLC	18,189	192.050	3,493,197.450	
ARISTA NETWORKS INC	4,385	209.910	920,455.350	
IHS MARKIT LTD	31,844	65.470	2,084,826.680	
FNF GROUP	21,372	28.860	616,795.920	
SYNCHRONY FINANCIAL	53,503	17.620	942,722.860	
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	36,972	22.110	817,450.920	
CYBERARK SOFTWARE LTD	3,457	89.090	307,984.130	
CDK GLOBAL INC	9,969	35.980	358,684.620	
WAYFAIR INC	5,091	76.850	391,243.350	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	15,555	92.100	1,432,615.500	
QORVO INC	8,871	83.110	737,268.810	
LIBERTY BROADBAND CORP-C W/I	8,307	115.480	959,292.360	
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	17,018	18.630	317,045.340	
GODADDY INC	14,540	62.540	909,331.600	
NIELSEN HOLDINGS PLC	26,204	14.140	370,524.560	
TRANSUNION	15,000	71.490	1,072,350.000	
SQUARE INC	28,837	59.210	1,707,438.770	
DUPONT DE NEMOURS INC	61,980	40.780	2,527,544.400	
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS PLC	20,048	43.640	874,894.720	
WESTROCK CO	22,778	32.160	732,540.480	
KRAFT HEINZ CO	56,143	28.110	1,578,179.730	
FORTIVE CORP	25,025	61.040	1,527,526.000	
MATCH GROUP INC	4,599	68.110	313,237.890	
WASTE CONNECTIONS INC	22,092	87.460	1,932,166.320	

	ALPHABET INC-CL A	24,827	1,206.570	29,955,513.390	
	HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	105,599	10.530	1,111,957.470	
	PAYPAL HOLDINGS INC	91,518	105.840	9,686,265.120	
	EQUITABLE HOLDINGS INC	37,687	16.610	625,981.070	
	DXC TECHNOLOGY CO	20,848	16.090	335,444.320	
	ZILLOW GROUP INC-C	10,805	40.630	439,007.150	
	ALPHABET INC-CL C	25,152	1,211.450	30,470,390.400	
	BEIGENE LTD ADR	3,159	150.400	475,113.600	
	LINDE PLC	43,847	189.480	8,308,129.560	
	ATHENE HOLDING LTD	11,847	30.350	359,556.450	
	ROKU INC	8,222	92.450	760,123.900	
	CHARTER COMMUNICATIONS INC	12,325	466.640	5,751,338.000	
	VISTRA ENERGY CORP	30,000	17.790	533,700.000	
アメリカ・ドル	小計	24,620,293		1,936,527,525.420 (209,590,374,078)	
イギリス・ポンド	ANTOFAGASTA PLC	31,798	7.622	242,364.350	
	ASHTED GROUP	38,255	19.560	748,267.800	
	SEVERN TRENT PLC	18,217	22.960	418,262.320	
	BHP GROUP PLC	170,632	13.140	2,242,104.480	
	BARCLAYS PLC	1,399,996	0.975	1,364,996.100	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	82,283	5.124	421,618.090	
	BT GROUP PLC	723,199	1.258	909,784.340	
	BUNZL PLC	28,834	16.940	488,447.960	
	EASYJET PLC	13,628	6.812	92,833.930	
	AVIVA PLC	318,596	2.646	843,005.010	
	CRODA INTERNATIONAL	10,391	44.120	458,450.920	
	DIAGEO PLC	191,865	26.330	5,051,805.450	
	SCHRODERS PLC	11,354	26.600	302,016.400	
	DCC PLC	7,898	53.580	423,174.840	
	NATIONAL GRID PLC	287,812	9.082	2,613,908.580	
	KINGFISHER PLC	165,680	1.524	252,496.320	
	BAE SYSTEMS PLC	269,245	5.384	1,449,615.080	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	187,993	30.205	5,678,328.560	
	HALMA PLC	31,901	19.700	628,449.700	
	NEXT PLC	10,018	46.240	463,232.320	
	IMPERIAL BRANDS PLC	78,235	16.650	1,302,612.750	
	JOHNSON MATTHEY PLC	15,017	19.805	297,411.680	
	ANGLO AMERICAN PLC	87,429	14.626	1,278,736.550	
	COMPASS GROUP PLC	128,001	13.595	1,740,173.590	
	HSBC HOLDINGS PLC	1,665,987	4.288	7,143,752.250	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	517,170	2.130	1,101,572.100	
	CENTRICA PLC	471,340	0.355	167,325.700	
	UNILEVER PLC	91,257	41.240	3,763,438.680	
	MEGGITT PLC	62,181	2.815	175,039.510	

MORRISON SUPERMARKETS	224,069	1.809	405,340.820	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	54,487	8.736	475,998.430	
RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	80,864	3.811	308,172.700	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	31,166	19.450	606,178.700	
PEARSON PLC	65,009	5.220	339,346.980	
PERSIMMON PLC	28,006	21.110	591,206.660	
PRUDENTIAL PLC	216,909	10.470	2,271,037.230	
RIO TINTO PLC	93,710	38.530	3,610,646.300	
VODAFONE GROUP PLC	2,229,795	1.130	2,519,668.350	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	58,381	61.680	3,600,940.080	
RELX PLC	160,493	17.915	2,875,232.090	
RENTOKIL INITIAL PLC	140,617	3.923	551,640.490	
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	139,268	3.502	487,716.530	
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	423,054	1.225	518,241.150	
ST JAMES'S PLACE PLC	37,685	8.252	310,976.620	
SSE PLC	82,005	12.485	1,023,832.420	
BP PLC	1,663,116	3.357	5,583,080.410	
SAGE GROUP PLC(THE)	87,111	6.148	535,558.420	
SMITHS GROUP PLC	31,720	12.370	392,376.400	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	5,518	84.000	463,512.000	
STANDARD CHARTERED PLC	220,443	4.509	993,977.480	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	5,688,933	0.333	1,894,414.680	
TAYLOR WIMPLEY PLC	252,287	1.419	357,995.250	
TESCO PLC	800,936	2.320	1,858,171.520	
3I GROUP PLC	76,643	7.732	592,603.670	
SMITH & NEPHEW PLC	68,027	15.640	1,063,942.280	
GLAXOSMITHKLINE PLC	408,922	15.442	6,314,573.520	
WEIR GROUP	19,161	9.320	178,580.520	
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	25,112	72.320	1,816,099.840	
WPP PLC	107,148	5.730	613,958.040	
ASTRAZENECA PLC	107,627	71.210	7,664,118.670	
WHITBREAD PLC	9,814	29.640	290,886.960	
CARNIVAL PLC	13,350	9.656	128,907.600	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	176,730	1.105	195,286.650	
INTERTEK GROUP PLC	14,390	48.420	696,763.800	
BURBERRY GROUP PLC	31,686	14.635	463,724.610	
INTERCONTINENTAL HOTELS	15,397	37.100	571,228.700	
ITV PLC	254,308	0.763	194,037.000	
SAINSBURY (J) PLC	137,215	2.002	274,704.430	
G4S PLC	122,250	1.068	130,563.000	
ADMIRAL GROUP PLC	15,893	22.160	352,188.880	

	THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	11,271	39.750	448,022.250	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	338,604	15.096	5,111,565.980	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	307,886	14.720	4,532,081.920	
	TUI AG-DI	29,824	3.988	118,938.110	
	AVEVA GROUP PLC	5,704	35.890	204,716.560	
	STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	206,313	2.302	474,932.520	
	EXPERIAN PLC	74,267	22.520	1,672,492.840	
	MONDI PLC	39,767	13.500	536,854.500	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	28,011	14.895	417,223.840	
	OCADO GROUP PLC	39,210	13.680	536,392.800	
	INFORMA PLC	108,748	4.631	503,611.980	
	GLENCORE PLC	880,918	1.447	1,274,688.340	
	GVC HOLDINGS PLC	49,618	6.728	333,829.900	
	EVRAZ PLC	48,765	2.643	128,885.890	
	NMC HEALTH PLC	8,149	0.001	8.140	
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP PLC	112,694	2.802	315,768.580	
	COCA-COLA HBC AG	15,208	20.290	308,570.320	
	FERGUSON PLC	19,440	53.000	1,030,320.000	
	M&G PLC	204,940	1.420	291,014.800	
	JD SPORTS FASHION PLC	32,086	5.646	181,157.550	
	MICRO FOCUS INTERNATIONAL PLC	26,100	4.640	121,104.000	
	AUTO TRADER GROUP PLC	76,348	4.140	316,080.720	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	364,735	1.009	368,017.610	
	イギリス・ポンド 小計	24,564,073		115,406,934.390 (15,556,854,756)	
イスラエル・シュケル	BANK HAPOLIM BM	102,359	20.850	2,134,185.150	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	130,703	18.920	2,472,900.760	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,760	440.000	774,400.000	
	ISRAEL DISCOUNT BANK LTD	102,134	10.740	1,096,919.160	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	49,411	11.650	575,638.150	
	NICE LTD	4,902	557.000	2,730,414.000	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	10,444	65.000	678,860.000	
	AZRIELI GROUP	2,291	182.400	417,878.400	
	イスラエル・シュケル 小計	404,004		10,881,195.620 (329,373,791)	
オーストラリア・ドル	RAMSAY HEALTH CARE LTD	12,432	61.200	760,838.400	
	AUST AND NZ BANKING GROUP LT	231,404	16.540	3,827,422.160	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	294,468	15.960	4,699,709.280	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	115,662	11.340	1,311,607.080	

TELSTRA CORP LTD	364,409	3.140	1,144,244.260	
BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD	39,014	6.170	240,716.380	
AMP LTD	302,414	1.305	394,650.270	
ASX LTD	15,573	79.540	1,238,676.420	
BHP GROUP LTD	242,967	31.500	7,653,460.500	
CALTEX AUSTRALIA LTD	20,946	24.220	507,312.120	
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	89,512	2.810	251,528.720	
COMPUTERSHARE LT	38,040	10.810	411,212.400	
CSL LIMITED	37,122	329.000	12,213,138.000	
REA GROUP LTD	4,119	84.470	347,931.930	
TRANSURBAN GROUP	223,753	12.280	2,747,686.840	
COCA-COLA AMATIL LTD	52,458	9.410	493,629.780	
COCHLEAR LTD	5,533	189.500	1,048,503.500	
ORIGIN ENERGY LTD	132,860	5.100	677,586.000	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	145,225	61.760	8,969,096.000	
BORAL LIMITED	86,101	2.580	222,140.580	
RIO TINTO LIMITED	30,466	89.390	2,723,355.740	
APA GROUP	94,106	10.970	1,032,342.820	
ARISTOCRAT LEISU	45,323	22.900	1,037,896.700	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	180,573	6.130	1,106,912.490	
TPG TELECOM LTD	28,719	7.300	209,648.700	
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	3,275	11.560	37,859.000	
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	33,926	20.270	687,680.020	
ORICA LTD	40,893	17.180	702,541.740	
CIMIC GROUP LTD	8,709	23.250	202,484.250	
LEND LEASE CORP LTD	42,974	11.650	500,647.100	
BLUESCOPE STEEL LTD	36,941	10.190	376,428.790	
SYDNEY AIRPORT	85,130	5.720	486,943.600	
MACQUARIE GROUP LTD	27,149	99.500	2,701,325.500	
WORLEY LTD	27,772	7.190	199,680.680	
SUNCORP GROUP LTD	110,775	9.090	1,006,944.750	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	243,511	16.080	3,915,656.880	
NEWCREST MINING LTD	62,080	25.640	1,591,731.200	
OIL SEARCH LTD	105,470	2.700	284,769.000	
INCITEC PIVOT LTD	136,426	2.210	301,501.460	
QANTAS AIRWAYS LIMITED	62,282	3.560	221,723.920	
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	117,359	9.110	1,069,140.490	
CHALLENGER FINANCIAL SERVICES	45,707	4.930	225,335.510	
SANTOS LTD	132,862	4.610	612,493.820	
SONIC HEALTHCARE	34,684	22.840	792,182.560	

	WASHINGTON H SOUL PATTINSON & CO LTD	15,775	17.950	283,161.250	
	TABCORP HOLDINGS LTD	148,535	2.860	424,810.100	
	WESFARMERS LTD	92,394	37.500	3,464,775.000	
	ALUMINA LIMITED	184,613	1.475	272,304.170	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	80,277	21.840	1,753,249.680	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	101,526	35.100	3,563,562.600	
	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	9,995	49.870	498,450.650	
	SEEK LTD	25,899	16.320	422,671.680	
	AUSNET SERVICES	165,066	1.795	296,293.470	
	AGL ENERGY LTD	49,644	17.470	867,280.680	
	BRAMBLES LTD	127,166	10.930	1,389,924.380	
	CROWN RESORTS LTD	32,861	8.320	273,403.520	
	AURIZON HOLDINGS LTD	150,150	4.350	653,152.500	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	57,667	10.630	613,000.210	
	MEDIBANK PVT LTD	206,910	2.690	556,587.900	
	SOUTH32 LTD(AUD)	472,144	2.030	958,452.320	
	COLES GROUP LTD	109,456	15.950	1,745,823.200	
	WISETECH GLOBAL LTD	8,000	15.960	127,680.000	
	オーストラリア・ドル 小計	6,229,202		89,352,900.650 (6,126,928,398)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	19,234	68.510	1,317,721.340	
	ALIMENTATION COUCHE TARD INC	73,988	35.420	2,620,654.960	
	BARRICK GOLD CORP	144,080	31.480	4,535,638.400	
	ATCO LTD	7,193	39.770	286,065.610	
	BANK OF MONTREAL	53,051	75.100	3,984,130.100	
	BANK OF NOVA SCOTIA	100,987	57.400	5,796,653.800	
	NATIONAL BANK OF CANADA	29,047	56.940	1,653,936.180	
	BCE INC	11,673	57.410	670,146.930	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT	109,222	49.120	5,364,984.640	
	BAUSCH HEALTH COS INC	20,415	25.250	515,478.750	
	BOMBARDIER INC 'B'	151,615	0.475	72,017.120	
	SAPUTO INC	18,601	33.940	631,317.940	
	BLACKBERRY LTD	39,652	5.250	208,173.000	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES CO	46,369	19.600	908,832.400	
	CGI INC	18,686	84.130	1,572,053.180	
	CCL INDUSTRIES INC	11,340	42.710	484,331.400	
	CAE INC	29,026	19.000	551,494.000	
	CAMECO CORP	32,627	13.000	424,151.000	
	ROGERS COMM-CL B	30,750	60.130	1,848,997.500	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	36,383	86.170	3,135,123.110	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	100,962	18.780	1,896,066.360	

CANADIAN TIRE CORP-CL A	4,862	92.960	451,971.520	
CANADIAN UTILITIES LTD	9,119	35.520	323,906.880	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	59,043	111.190	6,564,991.170	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	15,911	22.760	362,134.360	
OPEN TEXT CORP	21,795	51.510	1,122,660.450	
EMPIRE CO LTD	15,093	29.470	444,790.710	
KINROSS GOLD CORP	99,741	7.860	783,964.260	
FORTIS INC	35,862	55.410	1,987,113.420	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	55,296	7.320	404,766.720	
TELUS CORP	31,890	22.270	710,190.300	
GREAT WEST LIFECO INC	20,722	23.600	489,039.200	
IMPERIAL OIL LTD	21,542	18.070	389,263.940	
ENBRIDGE INC	167,112	40.130	6,706,204.560	
IGM FINANCIAL INC	10,692	25.750	275,319.000	
MANULIFE FINANCIAL CORP	158,249	17.880	2,829,492.120	
LOBLAW CO LTD	15,136	71.970	1,089,337.920	
MAGNA INTERNATIONAL INC	24,355	51.310	1,249,655.050	
SUN LIFE FINANCIAL INC	48,404	48.650	2,354,854.600	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,072	401.660	832,239.520	
METRO INC	19,949	59.160	1,180,182.840	
HUSKY ENERGY INC	28,749	4.780	137,420.220	
EMERA INC	19,138	56.200	1,075,555.600	
METHANEX CORP	5,281	20.890	110,320.090	
ONEX CORP	6,646	56.570	375,964.220	
POWER CORP OF CANADA	46,551	22.340	1,039,949.340	
QUEBECOR INC-B	17,237	29.870	514,869.190	
ROYAL BANK OF CANADA	117,083	88.250	10,332,574.750	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	11,307	315.760	3,570,298.320	
SHAW COMM INC-B	35,431	22.820	808,535.420	
SUNCOR ENERGY INC	124,884	22.750	2,841,111.000	
LUNDIN MINING CORP	43,480	6.180	268,706.400	
TECK RESOURCES LTD-CL B	41,016	11.070	454,047.120	
THOMSON REUTERS CORP	16,252	99.320	1,614,148.640	
TORONTO DOMINION BANK (THE) C\$	148,165	60.230	8,923,977.950	
TC ENERGY CORP	78,207	66.280	5,183,559.960	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	5,696	32.060	182,613.760	
WESTON (GEORGE) LTD	6,184	103.720	641,404.480	
INTACT FINANCIAL CORP	10,989	140.550	1,544,503.950	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	34,963	44.710	1,563,195.730	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,707	1,290.780	2,203,361.460	
FRANCO-NEVADA CORP NPR	16,080	159.150	2,559,132.000	
CI FINANCIAL CORP	12,479	13.690	170,837.510	

KEYERA CORP	16,668	15.700	261,687.600	
PARKLAND FUEL CORP	10,583	29.770	315,055.910	
ALTAGAS LTD	23,944	14.900	356,765.600	
PEMBINA PIPELINE CORP	42,684	28.560	1,219,055.040	
DOLLARAMA INC	23,536	41.000	964,976.000	
STARS GROUP INC	18,529	30.320	561,799.280	
CENOVUS ENERGY INC W/I	80,721	3.860	311,583.060	
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	23,762	50.110	1,190,713.820	
INTER PIPELINE LTD	27,946	10.010	279,739.460	
NUTRIEN LTD	48,340	51.460	2,487,576.400	
CRONOS GROUP INC	16,000	8.090	129,440.000	
WSP GLOBAL INC	8,400	84.250	707,700.000	
IA FINANCIAL CORP INC	8,104	45.910	372,054.640	
OVINTIV INC	19,278	6.170	118,945.260	
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	14,961	8.990	134,499.390	
AIR CANADA	10,722	20.080	215,297.760	
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	22,111	61.510	1,360,047.610	
AURORA CANNABIS INC	66,562	1.220	81,205.640	
SHOPIFY INC	8,669	584.720	5,068,937.680	
CANOPY GROWTH CORP	18,634	20.430	380,692.620	
HYDRO ONE LTD	27,340	26.530	725,330.200	
カナダ・ドル 小計	3,286,765		132,389,236.340 (10,266,785,278)	
シンガポール・ ドル				
SINGAPORE TECH ENG	125,000	3.260	407,500.000	
SEBACORP INDUSTRIES	81,400	1.580	128,612.000	
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	123,700	1.540	190,498.000	
DBS GROUP HOLDINGS LTD	142,400	19.140	2,725,536.000	
CITY DEVELOPMENTS LTD	36,400	7.720	281,008.000	
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	5,944	20.420	121,376.480	
SINGAPORE AIRPORT TERMINAL SERVICES LTD	47,800	3.200	152,960.000	
SINGAPORE EXCHANGE LTD	68,900	9.700	668,330.000	
CAPITALAND LTD	204,515	2.950	603,319.250	
GENTING SINGAPORE LTD	416,400	0.725	301,890.000	
KEPPEL CORP LTD	134,900	5.720	771,628.000	
COMFORTDELGRO CORP LTD	177,900	1.500	266,850.000	
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	271,653	8.950	2,431,294.350	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	676,822	2.710	1,834,187.620	
SINGAPORE AIRLINES LTD	47,500	6.130	291,175.000	
UNITED OVERSEAS BANK LTD	104,000	20.170	2,097,680.000	
UOL GROUP LIMITED	40,500	6.760	273,780.000	
VENTURE CORP LTD	21,000	15.220	319,620.000	
WILMAR INTERNATIONAL LTD	142,300	3.430	488,089.000	

	YANGZIJIANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	188,800	0.920	173,696.000	
シンガポール・ドル 小計		3,057,834		14,529,029.700 (1,110,163,159)	
スイス・フラン	CREDIT SUISSE GROUP AG	206,366	8.618	1,778,462.180	
	NESTLE SA-REGISTERED	243,865	102.220	24,927,880.300	
	CIE FINANC RICHEMONT	43,393	54.440	2,362,314.920	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	57,622	308.700	17,787,911.400	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,467	212.700	737,430.900	
	SIKA INHABER	10,101	167.600	1,692,927.600	
	SGS SA-REG	483	2,240.000	1,081,920.000	
	NOVARTIS AG-REG SHS	176,230	82.120	14,472,007.600	
	BALOISE HOLDING AG -R	4,199	142.900	600,037.100	
	BARRY CALLEBAUT AG	265	1,897.000	502,705.000	
	CLARIANT AG-REG	19,979	18.040	360,421.160	
	SWISSCOM AG-REG	2,192	517.000	1,133,264.000	
	ABB LTD	151,638	17.600	2,668,828.800	
	ADECCO GROUP AG-REG	12,944	39.710	514,006.240	
	GEBERIT AG	2,901	406.900	1,180,416.900	
	LONZA GROUP AG-REG	6,107	399.300	2,438,525.100	
	LINDT & SPRUENGLI PART	95	7,840.000	744,800.000	
	LINDT & SPRUENGLI NAMEN	9	83,100.000	747,900.000	
	GIVAUDAN-REG	768	3,071.000	2,358,528.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	12,060	319.400	3,851,964.000	
	LAFARGEHOLCIM LTD	40,497	37.650	1,524,712.050	
	TEMENOS GROUP	5,723	117.900	674,741.700	
	SONOVA HOLDING AG	4,667	177.200	826,992.400	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG	4,518	139.200	628,905.600	
	STRAUMANN HOLDING AG	794	753.200	598,040.800	
	THE SWATCH GROUP AG-B	2,134	200.900	428,720.600	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	4,592	38.780	178,077.760	
	SCHINDLER NAMEN	1,663	204.800	340,582.400	
	SWISS LIFE HOLDING AG	2,830	342.500	969,275.000	
	VIFOR PHARMA AG	3,465	143.000	495,495.000	
	EMS-CHEMIE HOLDING	633	607.000	384,231.000	
	SWISS PRIME SITE AG	5,990	90.350	541,196.500	
PARGESA HOLDING PORTEUR	3,000	67.350	202,050.000		
DUFREY GROUP	3,138	29.390	92,225.820		
PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,515	751.200	1,138,068.000		
JULIUS BAER GROUP LTD	17,849	35.610	635,602.890		
SWISS RE LTD	24,292	78.120	1,897,691.040		
ALCON INC	34,580	50.800	1,756,664.000		
UBS GROUP AG	318,832	9.676	3,085,018.430		
スイス・フラン 小計		1,435,396		98,340,542.190 (11,016,107,536)	

スウェーデン・ クローナ	ATLAS COPCO AB-A SHS	52,284	330.300	17,269,405.200	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	33,341	291.300	9,712,233.300	
	ERICSSON LM-B SHS	253,072	80.000	20,245,760.000	
	LUNDBERGS B	7,382	420.800	3,106,345.600	
	SKF AB-B SHS	28,812	140.450	4,046,645.400	
	SANDVIK AB	98,784	140.200	13,849,516.800	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	130,827	69.380	9,076,777.260	
	SKANSKA AB-B SHS	24,400	172.800	4,216,320.000	
	SWEDBANK AB	71,958	107.340	7,723,971.720	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	126,411	82.080	10,375,814.880	
	VOLVO AB-B SHS	119,911	127.000	15,228,697.000	
	SWEDISH MATCH AB	12,941	577.800	7,477,309.800	
	TELE2 AB-B SHS	44,518	135.600	6,036,640.800	
	INDUSTRIVARDEN C	11,403	202.000	2,303,406.000	
	ELECTROLUX AB-SER B	19,191	128.300	2,462,205.300	
	SECURITAS AB-B SHS	24,098	112.400	2,708,615.200	
	INVESTOR AB-B SHS	38,580	462.700	17,850,966.000	
	HENNES&MAURITZ AB-B SHS	73,283	136.500	10,003,129.500	
	ASSA ABLOY AB-B	80,055	179.650	14,381,880.750	
	TELIA CO AB	230,897	35.030	8,088,321.910	
	LUNDIN ENERGY AB	12,146	215.100	2,612,604.600	
	BOLIDEN AB	21,855	194.600	4,252,983.000	
	ALFA LAVAL AB	23,343	188.250	4,394,319.750	
	KINNEVIK AB-B	18,310	192.550	3,525,590.500	
	MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR SA	7,844	297.500	2,333,590.000	
	ICA GRUPPEN AB	9,009	432.700	3,898,194.300	
HUSQVARNA AB-B SHS	33,692	53.000	1,785,676.000		
HEXAGON AB	21,145	450.700	9,530,051.500		
EPIROC AB-A	48,955	99.620	4,876,897.100		
EPIROC AB-B	30,899	98.060	3,029,955.940		
ESSITY AB-B	52,640	284.900	14,997,136.000		
NORDEA BANK ABP	262,037	57.180	14,983,275.660		
スウェーデン・クローナ 小計	2,024,023		256,384,236.770 (2,789,460,496)		
デンマーク・ク ローネ	CARLSBERG AS-B	8,441	792.800	6,692,024.800	
	A P MOLLER A/S	491	6,500.000	3,191,500.000	
	AP MOLLER MAERSK A	435	6,025.000	2,620,875.000	
	DANSKE BANK A/S	51,034	74.060	3,779,578.040	
	GENMAB A/S	5,646	1,465.000	8,271,390.000	
	NOVOZYMES-B SHS	18,310	310.000	5,676,100.000	
	NOVO NORDISK A/S-B	145,197	406.450	59,015,320.650	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	15,504	580.400	8,998,521.600	
	COLOPLAST-B	9,449	993.400	9,386,636.600	
	DSV PANALPINA A S	17,572	629.200	11,056,302.400	

	DEMANT A/S	7,244	151.400	1,096,741.600	
	H LUNDBECK A/S	4,840	219.200	1,060,928.000	
	TRYG A/S	11,107	185.000	2,054,795.000	
	PANDORA A/S	8,251	224.200	1,849,874.200	
	CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S	9,258	511.600	4,736,392.800	
	ISS A/S	11,107	101.500	1,127,360.500	
	ORSTED A/S	15,090	654.600	9,877,914.000	
デンマーク・クローネ 小計		338,976		140,492,255.190 (2,225,397,322)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	85,245	5.750	490,158.750	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	29,894	11.120	332,421.280	
	A2 MILK CO LTD	55,091	17.480	962,990.680	
	FISHER & PAYKEL	50,218	27.000	1,355,886.000	
	FLETCHER BUILDING LTD	64,104	3.560	228,210.240	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	159,623	4.350	694,360.050	
	MIGHTY RIVER POWER LTD	61,734	4.250	262,369.500	
	MERIDIAN ENERGY LTD	124,162	4.360	541,346.320	
ニュージーランド・ドル 小計		630,071		4,867,742.820 (320,054,090)	
ノルウェー・クローネ	MOWI ASA	35,183	172.000	6,051,476.000	
	DNB ASA	83,164	112.000	9,314,368.000	
	NORSK HYDRO ASA	93,139	21.700	2,021,116.300	
	TELENOR ASA	54,766	153.000	8,379,198.000	
	ORKLA ASA	65,283	89.580	5,848,051.140	
	EQUINOR ASA	83,149	135.800	11,291,634.200	
	YARA INTERNATIONAL ASA	16,390	349.700	5,731,583.000	
	AKER BP ASA	8,552	162.000	1,385,424.000	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	16,683	181.000	3,019,623.000	
	SCHIBSTED ASA	7,445	190.000	1,414,550.000	
ノルウェー・クローネ 小計		463,754		54,457,023.640 (575,066,170)	
ユーロ	CRH PLC	68,058	27.370	1,862,747.460	
	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	6,246	88.300	551,521.800	
	KERRY GROUP PLC-A	13,521	98.000	1,325,058.000	
	KINGSPAN GROUP PLC	11,768	46.200	543,681.600	
	UMICORE	17,654	35.930	634,308.220	
	AIR LIQUIDE	38,592	118.450	4,571,222.400	
	AIRBUS SE	47,288	61.000	2,884,568.000	
	AXA	155,478	15.530	2,414,573.340	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	44,117	19.230	848,369.910	
	ADIDAS AG	15,061	224.300	3,378,182.300	
	ASSICURAZIONI GENERALI	87,030	12.870	1,120,076.100	
	DASSAULT AVIATION SA	163	825.500	134,556.500	
	DANONE	50,801	58.600	2,976,938.600	

SAFRAN SA	28,002	79.600	2,228,959.200	
INTESA SANPAOLO	1,245,487	1.445	1,799,728.710	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	27,741	50.820	1,409,797.620	
ACCOR SA	17,535	28.640	502,202.400	
BOUYGUES	17,572	30.260	531,728.720	
BNP PARIBAS	90,228	28.405	2,562,926.340	
THALES SA	8,549	74.460	636,558.540	
CAPGEMINI SA	12,515	81.000	1,013,715.000	
CASINO GUICHARD PERRACHON	4,264	35.900	153,077.600	
INGENICO GROUP	5,654	114.000	644,556.000	
UNICREDIT SPA	173,574	7.437	1,290,869.830	
NATIXIS	70,166	2.236	156,891.170	
KONINKLIJKE DSM NV	14,867	107.550	1,598,945.850	
COMMERZBANK AG	83,118	3.397	282,351.840	
EIFFAGE	6,461	73.660	475,917.260	
FRESENIUS SE & CO KGAA	34,713	38.010	1,319,441.130	
UNITED INTERNET	9,882	28.550	282,131.100	
FUCHS PETROLUB SE PREF	5,546	36.980	205,091.080	
PUBLICIS GROUPE	20,157	30.080	606,322.560	
FAURECIA	6,117	30.850	188,709.450	
IBERDROLA SA	509,958	9.108	4,644,697.460	
ENI SPA	211,633	9.308	1,969,879.960	
JERONIMO MARTINS	19,517	15.140	295,487.380	
KBC GROUPE	21,124	48.540	1,025,358.960	
HANNOVER RUECK SE	4,868	138.100	672,270.800	
WARTSILA OYJ	34,935	7.002	244,614.870	
L'OREAL	20,541	244.800	5,028,436.800	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	22,763	347.400	7,907,866.200	
GEA GROUP AG	11,838	21.500	254,517.000	
BOLLORE	71,347	2.516	179,509.050	
MEDIOBANCA SPA	41,639	5.542	230,763.330	
MICHELIN(CGDE)-B	13,862	87.040	1,206,548.480	
CONTINENTAL AG	8,312	73.040	607,108.480	
DEUTSCHE POST AG-REG	81,049	25.670	2,080,527.830	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	15,885	13.640	216,671.400	
NOKIAN RENKAAT OYJ	9,399	19.785	185,959.210	
OMV AG	12,817	30.700	393,481.900	
VERBUND AG	4,908	39.040	191,608.320	
PERNOD-RICARD	17,836	139.500	2,488,122.000	
PEUGEOT SA	43,905	13.415	588,985.570	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG- PFD	12,649	44.250	559,718.250	
RENAULT SA	14,917	18.538	276,531.340	
REPSOL SA	117,630	8.286	974,682.180	
REMY COINTREAU	1,860	103.200	191,952.000	

MERCK KGAA	11,125	95.800	1,065,775.000	
COMPAGNIE DE SAINT- GOBAIN	40,642	25.980	1,055,879.160	
RWE AG	46,489	25.660	1,192,907.740	
SEB SA	1,551	115.000	178,365.000	
SOCIETE GENERALE-A	68,153	15.022	1,023,794.360	
VINCI S.A.	42,889	76.500	3,281,008.500	
SODEXO	7,075	71.600	506,570.000	
SOLVAY SA	5,563	72.640	404,096.320	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	45,615	80.260	3,661,059.900	
VIVENDI SA	68,572	21.100	1,446,869.200	
SAP SE	80,600	110.000	8,866,000.000	
TELEFONICA S.A	394,836	4.324	1,707,270.860	
TOTAL SA	197,080	33.625	6,626,815.000	
VALEO	19,653	16.960	333,314.880	
E.ON SE	190,255	8.918	1,696,694.090	
VOEST-ALPINE AG	9,875	19.695	194,488.120	
HENKEL AG & CO KGAA	9,338	67.900	634,050.200	
SIEMENS AG-REG	63,050	81.340	5,128,487.000	
UPM-KYMMENE OYJ	44,829	24.610	1,103,241.690	
ING GROEP NV-CVA	310,268	5.411	1,678,860.140	
PUMA AG	7,534	57.500	433,205.000	
BAYER AG	80,700	57.470	4,637,829.000	
STORA ENSO OYJ-R SHS	54,622	10.245	559,602.390	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	13,759	78.020	1,073,477.180	
DAIMLER AG	73,648	29.840	2,197,656.320	
BASF SE	76,178	46.895	3,572,367.310	
BEIERSDORF AG	8,371	91.400	765,109.400	
HOCHTIEF AG	1,707	70.400	120,172.800	
HEIDELBERGCEMENT AG	12,031	43.900	528,160.900	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	18,156	63.240	1,148,185.440	
ORANGE	161,612	11.365	1,836,720.380	
SAMPO OYJ-A SHS	36,389	28.040	1,020,347.560	
RANDSTAD NV	9,074	34.260	310,875.240	
ALLIANZ SE	34,382	164.880	5,668,904.160	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	201,606	3.763	758,643.370	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	92,232	22.420	2,067,841.440	
HERMES INTL	2,676	641.800	1,717,456.800	
ENDESA S.A.	29,748	19.920	592,580.160	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	16,096	8.880	142,932.480	
ERSTE GROUP BANK AG	27,125	18.050	489,606.250	
MUENCHENER RUECKVER AG- REG	11,712	192.350	2,252,803.200	
ARCELOR MITTAL (NL)	61,594	9.578	589,947.330	
DASSAULT SYSTEMES SA	10,824	130.800	1,415,779.200	

ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	20,137	20.000	402,740.000	
HEINEKEN NV	21,153	75.100	1,588,590.300	
AKZO NOBEL	16,843	65.120	1,096,816.160	
ASML HOLDING NV	34,865	255.650	8,913,237.250	
AEGON NV	150,349	2.491	374,519.350	
BANKINTER S.A.	57,960	3.504	203,091.840	
VOLKSWAGEN AG	2,758	133.000	366,814.000	
VOLKSWAGEN AG PFD	15,582	122.540	1,909,418.280	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	535,630	3.004	1,609,032.520	
KERING	6,324	473.700	2,995,678.800	
CNP ASSURANCES	13,987	9.400	131,477.800	
FORTUM OYJ	39,409	15.510	611,233.590	
AGEAS	14,365	34.140	490,421.100	
UCB SA	10,571	80.240	848,217.040	
THYSSENKRUPP AG	27,110	5.800	157,238.000	
CARREFOUR SA	49,926	14.220	709,947.720	
NATURGY ENERGY GROUP SA	23,612	16.110	380,389.320	
ATOS SE	7,304	61.880	451,971.520	
NOKIA OYJ	473,158	2.978	1,409,064.520	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	74,500	37.765	2,813,492.500	
WOLTERS KLUWER-CVA	22,583	65.640	1,482,348.120	
SANOFI	92,501	82.130	7,597,107.130	
STMICROELECTRONICS NV	56,474	22.200	1,253,722.800	
ELISA OYJ	10,787	53.680	579,046.160	
BANCO SANTANDER SA	1,388,012	2.165	3,005,045.980	
METSO OYJ	8,585	23.180	199,000.300	
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	34,596	15.495	536,065.020	
QIAGEN N.V.	17,974	36.370	653,714.380	
DEUTSCHE BANK AG-REG	149,384	6.119	914,080.690	
BMW VORZUG	4,116	42.100	173,283.600	
ENEL SPA	672,872	6.453	4,342,043.010	
COLRUYT NV	4,673	53.500	250,005.500	
VOPAK (KON.)	5,364	46.250	248,085.000	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	277,656	12.365	3,433,216.440	
SARTORIUS AG	2,712	224.400	608,572.800	
LEONARDO SPA	28,316	7.150	202,459.400	
UBISOFT ENTERTAINMENT	7,686	68.840	529,104.240	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	101,157	16.232	1,641,980.420	
CARL ZEISS MEDITEC AG	3,771	95.400	359,753.400	
KONINKLIJKE KPN NV	291,029	2.190	637,353.510	
EUROFINS SCIENTIFIC	899	470.000	422,530.000	
TELEPERFORMANCE	5,018	203.700	1,022,166.600	
DEUTSCHE BOERSE AG	15,488	132.650	2,054,483.200	
EURAZEO	2,748	43.640	119,922.720	
BANCO SABADELL	413,631	0.443	183,238.530	

GRUPE BRUXELLES LAMBERT SA	6,689	72.960	488,029.440	
FRAPORT AG	3,149	40.300	126,904.700	
HEINEKEN HOLDING NV-A	10,004	70.350	703,781.400	
INDITEX	88,813	25.260	2,243,416.380	
JC DECAUX SA	6,058	19.000	115,102.000	
ANDRITZ AG	6,265	31.540	197,598.100	
MAPFRE SA	84,474	1.752	147,998.440	
ESSILORLUXOTTICA	22,866	106.700	2,439,802.200	
SNAM SPA	171,294	3.937	674,384.470	
CREDIT AGRICOLE SA	105,610	6.974	736,524.140	
ENAGAS	18,095	20.090	363,528.550	
WENDEL	2,220	80.800	179,376.000	
WIRECARD AG	10,105	112.880	1,140,652.400	
TENARIS SA	36,959	6.006	221,975.750	
TELECOM ITALIA SPA	762,675	0.370	282,189.750	
TELECOM ITALIA-RNC	497,596	0.365	181,622.540	
ATLANTIA SPA	37,365	12.945	483,689.920	
ILIAD SA	1,046	128.800	134,724.800	
PROXIMUS	13,739	20.510	281,786.890	
SES FDR	28,847	5.352	154,389.140	
TERNA SPA	113,654	5.536	629,188.540	
BIOMERIEUX	3,248	102.000	331,296.000	
GRIFOLS SA	23,518	29.680	698,014.240	
FERROVIAL SA	38,666	23.100	893,184.600	
LANXESS AG	6,856	41.850	286,923.600	
NESTE OYJ	32,931	29.120	958,950.720	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	9,641	15.230	146,832.430	
RECORDATI SPA	9,977	37.780	376,931.060	
GALAPAGOS NV	3,426	186.950	640,490.700	
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	58,858	6.630	390,228.540	
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	4,168	132.400	551,843.200	
KONE OYJ	28,802	51.980	1,497,127.960	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	2,554	188.500	481,429.000	
ENGIE	150,782	9.886	1,490,630.850	
ALSTOM	15,712	38.980	612,453.760	
TELENET GROUP HOLDING NV	3,634	33.980	123,483.320	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	12,542	9.600	120,403.200	
ELECTRICITE DE FRANCE	43,173	8.006	345,643.030	
IPSEN SA	3,646	54.600	199,071.600	
DEUTSCHE WOHNEN	30,347	35.050	1,063,662.350	
ARKEMA SA	5,033	76.300	384,017.900	
LEGRAND SA	22,725	59.160	1,344,411.000	
UNILEVER NV	119,914	45.690	5,478,870.660	
ADP	2,313	92.500	213,952.500	
ORION OYJ	8,051	40.350	324,857.850	

GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	40,088	10.270	411,703.760	
SYMRISE AG	11,342	88.140	999,683.880	
SCOR SE	15,667	22.880	358,460.960	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	17,397	26.600	462,760.200	
PRYSMIAN SPA	22,328	15.650	349,433.200	
CAIXABANK	307,331	1.744	535,985.260	
BUREAU VERITAS SA	23,179	18.670	432,751.930	
GETLINK	37,646	11.160	420,129.360	
SUEZ SA	26,620	9.848	262,153.760	
AMADEUS IT GROUP SA	34,631	49.700	1,721,160.700	
BRENTAG AG	12,353	37.640	464,966.920	
EVONIK INDUSTRIES AG	17,116	22.270	381,173.320	
EDENRED	19,188	40.500	777,114.000	
BANKIA SA	100,675	1.037	104,399.970	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	61,541	2.478	152,498.590	
KION GROUP AG	4,567	44.370	202,637.790	
VONOVIA SE	41,268	45.490	1,877,281.320	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	82,256	1.730	142,302.880	
KNORR-BREMSE AG	4,265	80.790	344,569.350	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	11,468	36.480	418,352.640	
FERRARI NV	9,758	140.600	1,371,974.800	
METRO AG	10,774	7.760	83,606.240	
CNH INDUSTRIAL NV	77,951	6.094	475,033.390	
AROUNDTOWN SA	88,534	5.256	465,334.700	
AIB GROUP PLC	41,352	1.089	45,032.320	
MONCLER SPA	14,353	32.850	471,496.050	
PROSUS NV	40,745	63.840	2,601,160.800	
WORLDLINE SA	9,849	62.000	610,638.000	
NN GROUP NV	26,416	25.320	668,853.120	
FINECOBANK SPA	45,048	9.442	425,343.210	
ZALANDO SE	9,964	39.910	397,663.240	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	97,919	7.479	732,336.200	
AENA SME SA	5,338	121.500	648,567.000	
CELLNEX TELECOM SAU	19,780	45.280	895,638.400	
JUST EAT TAKEAWAY.COM NV	9,000	86.000	774,000.000	
ABN AMRO BANK NV	34,251	7.950	272,295.450	
EXOR NV	7,971	50.380	401,578.980	
ALTICE EUROPE NV	56,763	3.531	200,430.150	
COVESTRO AG	17,056	29.920	510,315.520	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	61,657	43.620	2,689,478.340	
POSTE ITALIANE SPA	40,015	8.306	332,364.590	
AMUNDI SA	4,119	57.500	236,842.500	
ADYEN NV	818	775.400	634,277.200	
PIRELLI & C SPA	34,086	3.378	115,142.500	

	UNIPER SE	14,252	23.620	336,632.240	
	DELIVERY HERO SE	9,719	62.880	611,130.720	
ユーロ 小計		16,022,380		267,856,556.500 (31,679,394,937)	
香港・ドル	ASM PACIFIC TECH	32,900	81.550	2,682,995.000	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	164,000	16.520	2,709,280.000	
	BANK OF EAST ASIA	103,860	16.840	1,749,002.400	
	CLP HOLDINGS LTD	134,500	79.700	10,719,650.000	
	PCCW LTD	331,000	4.530	1,499,430.000	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	49,500	47.350	2,343,825.000	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	95,940	247.400	23,735,556.000	
	MTR CORP	126,000	42.300	5,329,800.000	
	HANG SENG BANK LTD	64,900	137.900	8,949,710.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	115,450	32.250	3,723,262.500	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	101,500	50.500	5,125,750.000	
	HONG KONG & CHINA GAS	850,755	14.080	11,978,630.400	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	176,000	48.000	8,448,000.000	
	KERRY PROPERTIES LTD	68,500	22.200	1,520,700.000	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	317,500	24.150	7,667,625.000	
	NWS HOLDINGS LTD	135,000	8.220	1,109,700.000	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HOLDINGS	50,500	13.240	668,620.000	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	484,266	8.950	4,334,180.700	
	SINO LAND CO	255,400	10.040	2,564,216.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	133,500	108.200	14,444,700.000	
	SWIRE PACIFIC LTD A	49,500	51.700	2,559,150.000	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	116,000	56.850	6,594,600.000	
	VITASOY INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	70,000	27.250	1,907,500.000	
	WHEELOK & CO LTD	64,000	54.350	3,478,400.000	
	SJM HOLDINGS LTD	156,000	7.480	1,166,880.000	
	WYNN MACAU LTD	124,400	12.860	1,599,784.000	
	AIA GROUP LTD	984,627	71.600	70,499,293.200	
	HKT TRUST / HKT LTD	289,000	11.880	3,433,320.000	
	SANDS CHINA LTD	198,800	30.450	6,053,460.000	
	SWIRE PROPERTIES LTD	104,200	21.500	2,240,300.000	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT CO LTD	95,750	29.900	2,862,925.000	
	HK ELECTRIC INVESTMENTS & HK ELECTRIC INVESTMENTS LTD	230,000	7.950	1,828,500.000	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LTD	101,900	20.800	2,119,520.000	

	WH GROUP LTD	742,500	7.820	5,806,350.000	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	227,332	57.800	13,139,789.600	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	220,332	46.500	10,245,438.000	
香港・ドル	小計	7,565,312		256,839,842.800 (3,585,484,205)	
合計		90,642,083		295,171,444,216 (295,171,444,216)	

(2) 株式以外の有価証券

令和2年4月13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	84,575.000	801,771.000	
		GOODMAN GROUP	134,222.000	1,860,316.920	
		GPT GROUP	158,232.000	642,421.920	
		MIRVAC GROUP	329,418.000	757,661.400	
		SCENTRE GROUP	420,268.000	874,157.440	
		STOCKLAND	194,018.000	585,934.360	
		VICINITY CENTRES	270,443.000	381,324.630	
	オーストラリア・ドル	小計	1,591,176.000	5,903,587.670 (404,809,008)	
	シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	272,806.000	761,128.740	
		CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	206,300.000	301,198.000	
		CAPITALAND MALL TRUST	199,000.000	334,320.000	
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	192,300.000	323,064.000	
		SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	192,100.000	247,809.000	
	シンガポール・ドル	小計	1,062,506.000	1,967,519.740 (150,338,183)	
投資信託受益証券	合計		2,653,682	555,147,191 (555,147,191)	
投資証券	アメリカ・ドル	AGNC INVESTMENT CORP	46,028.000	562,001.880	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	9,520.000	1,502,256.000	
		AMERICAN TOWER CORP	36,297.000	9,422,701.200	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	108,247.000	657,059.290	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	11,273.000	1,886,649.280	
		BOSTON PROPERTIES INC	12,027.000	1,274,862.000	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	8,458.000	753,523.220	
		CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	34,067.000	5,591,757.380	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	21,885.000	3,245,326.650	
		DUKE REALTY TRUST	31,185.000	1,108,938.600	
		EQUINIX INC	7,002.000	4,809,953.880	

	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	13,626.000	860,754.420	
	EQUITY RESIDENTIAL	29,869.000	2,073,505.980	
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	5,736.000	1,416,562.560	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	10,566.000	1,087,347.060	
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	6,000.000	516,000.000	
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	41,581.000	1,178,821.350	
	HOST HOTELS & RESORTS INC	55,116.000	656,431.560	
	INVITATION HOMES INC	42,384.000	1,030,355.040	
	IRON MOUNTAIN INC	24,591.000	666,662.010	
	KIMCO REALTY	32,980.000	356,843.600	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST	39,953.000	730,740.370	
	MID AMERICA	8,834.000	1,030,486.100	
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	13,649.000	482,901.620	
	OMEGA HEALTHCARE INVS INC	17,771.000	614,698.890	
	PROLOGIS INC	60,488.000	5,548,564.240	
	PUBLIC STORAGE	12,849.000	2,680,172.910	
	REALTY INCOME CORP	28,267.000	1,602,173.560	
	REGENCY CENTERS CORP	14,499.000	639,695.880	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	9,254.000	2,829,965.740	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	25,461.000	1,735,676.370	
	SL GREEN	7,748.000	419,709.160	
	SUN COMMUNITIES INC	7,418.000	988,300.140	
	UDR INC	22,345.000	918,826.400	
	VENTAS INC	31,091.000	1,050,875.800	
	VEREIT INC	82,604.000	436,149.120	
	VICI PROPERTIES INC	34,200.000	586,872.000	
	VORNADO REALTY TRUST	16,426.000	714,202.480	
	WELLTOWER INC	32,205.000	1,822,803.000	
	WEYERHAEUSER CO	65,842.000	1,383,340.420	
	WP CAREY INC	15,548.000	1,088,360.000	
アメリカ・ドル	小計	1,134,890.000	67,962,827.160 (7,355,616,784)	
イギリス・ポンド	BRITISH LAND CO PLC	69,819.000	286,397.530	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	55,843.000	378,057.110	
	SEGRO PLC	87,247.000	721,009.200	
イギリス・ポンド	小計	212,909.000	1,385,463.840 (186,760,526)	
カナダ・ドル	CANADIAN APT PPTYS REIT	7,954.000	363,815.960	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	12,935.000	188,462.950	
	H & R REAL ESTATE INVESTMENT	10,748.000	109,629.600	

	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	13,467.000	239,308.590	
	SMARTCENTRES REIT	3,067.000	71,123.730	
カナダ・ドル 小計		48,171.000	972,340.830 (75,405,031)	
ユーロ	COVIVIO	4,663.000	300,996.650	
	GECINA SA	3,670.000	466,824.000	
	ICADE	2,234.000	172,576.500	
	KLEPIERRE	17,099.000	329,668.720	
	UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	10,898.000	712,075.320	
ユーロ 小計		38,564.000	1,982,141.190 (234,427,839)	
香港・ドル	LINK REIT	172,500.000	11,643,750.000	
香港・ドル 小計		172,500.000	11,643,750.000 (162,546,750)	
投資証券 合計		1,607,034	8,014,756,930 (8,014,756,930)	
合計			8,569,904,121 (8,569,904,121)	

(注) 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 608銘柄	67.58	-	-	71.42
	投資証券 41銘柄	-	-	2.37	
イギリス・ポンド	株式 93銘柄	5.02	-	-	5.18
	投資証券 3銘柄	-	-	0.06	
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 62銘柄	1.98	-	-	2.15
	投資信託受益証券 7銘柄	-	0.13	-	
カナダ・ドル	株式 84銘柄	3.31	-	-	3.40
	投資証券 5銘柄	-	-	0.02	
シンガポール・ドル	株式 20銘柄	0.36	-	-	0.41
	投資信託受益証券 5銘柄	-	0.05	-	
スイス・フラン	株式 39銘柄	3.55	-	-	3.63
スウェーデン・クローナ	株式 32銘柄	0.90	-	-	0.92
デンマーク・クローネ	株式 17銘柄	0.72	-	-	0.73
ニュージーランド・ドル	株式 8銘柄	0.10	-	-	0.11
ノルウェー・クローネ	株式 10銘柄	0.19	-	-	0.19
ユーロ	株式 236銘柄	10.21	-	-	10.51
	投資証券 5銘柄	-	-	0.08	
香港・ドル	株式 36銘柄	1.16	-	-	1.23
	投資証券 1銘柄	-	-	0.05	

（注）「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

エマージング債券パッシブ・マザーファンド
貸借対照表

(単位：円)

令和2年4月13日現在

資産の部	
流動資産	
預金	641,723,499
コール・ローン	17,094,817,100
国債証券	67,084,933,625
未収利息	392,250,551
前払費用	126,573,349
流動資産合計	85,340,298,124
資産合計	85,340,298,124
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	59,589,319
未払金	16,242,936,529
未払解約金	1,325,000
流動負債合計	16,303,850,848
負債合計	16,303,850,848
純資産の部	
元本等	
元本	35,679,597,967
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	33,356,849,309
元本等合計	69,036,447,276
純資産合計	69,036,447,276
負債純資産合計	85,340,298,124

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 令和1年10月12日 至 令和2年4月13日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	令和2年4月13日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	42,731,976,708円
同期中追加設定元本額	57,569,228,830円
同期中一部解約元本額	64,621,607,571円
元本の内訳 ファンド名	

D I A M新興国債券インデックスファンド<為替ヘッジなし>(ファン ドラップ)	173,461,180円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	453,104,348円
たわらノーロード バランス(堅実型)	34,045,374円
たわらノーロード バランス(標準型)	83,114,944円
たわらノーロード バランス(積極型)	31,861,335円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	450,859円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	1,643,916円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	2,075,528円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	705,450円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	878,449円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	44,240,071円
D I A M D C 8資産バランスファンド(新興国10)	196,333,833円
D I A M D C 8資産バランスファンド(新興国20)	203,727,538円
D I A M D C 8資産バランスファンド(新興国30)	376,267,256円
投資のソムリエ	3,005,554,882円
クルーズコントロール	262,178,890円
投資のソムリエ<DC年金>	281,488,117円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	171,006,640円
クルーズコントロール<DC年金>	298,079円
D I A Mコア資産設計ファンド(堅実型)	1,431,478円
D I A Mコア資産設計ファンド(積極型)	3,833,238円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	104,334,553円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	1,029,749,095円
ワールドアセットバランス(基本コース)	843,793,149円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	490,833,333円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	7,142,699円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	4,846,010円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	956,167円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	14,375,215円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	693,551,118円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	149,816,429円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	1,467,675円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	692,951円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	909,815円
エマージング債券リスク抑制型(適格機関投資家限定)	16,090,592,717円
高度リスク分散・安定型戦略ファンド(適格機関投資家限定)	2,671,308,252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)	81,643,341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)	200,602,665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)	151,714,582円
D I A Mグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンド(適格 機関投資家限定)	4,026,245,071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)	3,787,321,725円
計	35,679,597,967円
2. 受益権の総数	35,679,597,967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 令和1年10月12日 至 令和2年4月13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。
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、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 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。
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。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	令和2年4月13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。
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。
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。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	令和2年4月13日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
国債証券	2,780,728,607
合計	2,780,728,607

(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31年4月19日から令和2年4月13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	令和2年4月13日現在			
	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 買建 アメリカ・ドル	17,030,000,000	-	16,970,410,681	59,589,319
	17,030,000,000	-	16,970,410,681	59,589,319
合計	17,030,000,000	-	16,970,410,681	59,589,319

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

1. 計算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)

令和2年4月13日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.9349円 (19,349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

令和2年4月13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	4,800,000.000	4,852,800.000	
		BRAZIL 4.25 01/07/25	8,100,000.000	8,515,125.000	
		BRAZIL 4.5 05/30/29	5,000,000.000	5,048,000.000	
		BRAZIL 4.625 01/13/28	6,800,000.000	7,201,200.000	
		BRAZIL 5.0 01/27/45	6,800,000.000	6,470,200.000	
		BRAZIL 5.625 01/07/41	5,100,000.000	5,189,250.000	
		BRAZIL 5.625 02/21/47	5,600,000.000	5,740,000.000	
		BRAZIL 6.0 04/07/26	4,800,000.000	5,389,200.000	

BRAZIL 7.125 01/20/37	4,300,000.000	5,029,409.000	
BRAZIL 8.25 01/20/34	5,200,000.000	6,439,160.000	
BRAZIL 8.75 02/04/25	3,800,000.000	4,633,720.000	
COLOMBIA 2.625 03/15/23	3,700,000.000	3,653,787.000	
COLOMBIA 3.875 04/25/27	4,600,000.000	4,652,946.000	
COLOMBIA 4.0 02/26/24	6,100,000.000	6,254,391.000	
COLOMBIA 4.375 07/12/21	1,200,000.000	1,225,812.000	
COLOMBIA 4.5 01/28/26	5,000,000.000	5,196,925.000	
COLOMBIA 4.5 03/15/29	5,000,000.000	5,224,450.000	
COLOMBIA 5.0 06/15/45	7,000,000.000	7,367,500.000	
COLOMBIA 5.2 05/15/49	3,000,000.000	3,123,900.000	
COLOMBIA 5.625 02/26/44	4,000,000.000	4,452,040.000	
COLOMBIA 6.125 01/18/41	5,000,000.000	5,795,050.000	
COLOMBIA 7.375 09/18/37	5,400,000.000	6,871,500.000	
COLOMBIA 8.125 05/21/24	3,900,000.000	4,468,425.000	
CROATIA 5.5 04/04/23	6,400,000.000	6,828,480.000	
CROATIA 6.0 01/26/24	5,400,000.000	5,943,418.200	
HUNGARY 5.375 02/21/23	6,358,000.000	6,850,713.210	
HUNGARY 5.375 03/25/24	6,380,000.000	7,046,123.040	
HUNGARY 5.75 11/22/23	6,000,000.000	6,633,768.000	
HUNGARY 7.625 03/29/41	4,000,000.000	6,392,260.000	
INDONESIA 3.375 04/15/23	3,700,000.000	3,721,867.000	
INDONESIA 3.4 09/18/29	3,000,000.000	2,930,660.910	
INDONESIA 3.5 01/11/28	2,200,000.000	2,156,309.950	
INDONESIA 3.85 07/18/27	2,600,000.000	2,581,800.000	
INDONESIA 4.1 04/24/28	5,000,000.000	5,119,378.550	
INDONESIA 4.125 01/15/25	4,800,000.000	4,932,951.600	
INDONESIA 4.35 01/08/27	5,000,000.000	5,179,403.500	
INDONESIA 4.35 01/11/48	4,000,000.000	4,017,188.320	
INDONESIA 4.625 04/15/43	2,400,000.000	2,492,953.410	
INDONESIA 4.75 01/08/26	6,800,000.000	7,190,923.220	
INDONESIA 4.75 02/11/29	4,000,000.000	4,289,701.400	
INDONESIA 4.875 05/05/21	1,100,000.000	1,118,272.920	
INDONESIA 5.125 01/15/45	3,400,000.000	3,682,577.460	
INDONESIA 5.25 01/08/47	2,400,000.000	2,632,552.800	
INDONESIA 5.25 01/17/42	5,300,000.000	5,894,000.520	
INDONESIA 5.35 02/11/49	3,000,000.000	3,395,219.400	
INDONESIA 5.875 01/15/24	5,200,000.000	5,663,551.810	
INDONESIA 5.95 01/08/46	4,200,000.000	4,919,910.360	
INDONESIA 6.75 01/15/44	5,500,000.000	7,065,537.820	
INDONESIA 7.75 01/17/38	5,500,000.000	7,488,027.250	
PANAMA 3.16 01/23/30	2,000,000.000	1,949,600.000	
PANAMA 3.75 03/16/25	3,200,000.000	3,344,016.000	
PANAMA 3.875 03/17/28	2,100,000.000	2,244,396.000	
PANAMA 4.5 04/16/50	4,300,000.000	4,665,543.000	
PANAMA 4.5 05/15/47	3,000,000.000	3,255,945.000	
PANAMA 6.7 01/26/36	4,900,000.000	5,880,000.000	
PANAMA 7.125 01/29/26	4,800,000.000	5,753,004.000	
PANAMA 9.375 04/01/29	3,900,000.000	5,429,979.750	

PERU 2.844 06/20/30	3,000,000.000	3,078,930.000	
PERU 4.125 08/25/27	3,300,000.000	3,695,348.250	
PERU 5.625 11/18/50	6,000,000.000	8,595,000.000	
PERU 6.55 03/14/37	7,000,000.000	9,541,000.000	
PERU 7.35 07/21/25	4,300,000.000	5,297,600.000	
PHILIPPINES 3.0 02/01/28	3,000,000.000	3,181,808.580	
PHILIPPINES 3.7 02/02/42	6,000,000.000	6,874,569.180	
PHILIPPINES 3.7 03/01/41	3,000,000.000	3,420,954.840	
PHILIPPINES 3.75 01/14/29	3,000,000.000	3,388,100.340	
PHILIPPINES 3.95 01/20/40	2,800,000.000	3,191,575.540	
PHILIPPINES 4.2 01/21/24	4,800,000.000	5,119,270.220	
PHILIPPINES 5.0 01/13/37	2,800,000.000	3,486,117.680	
PHILIPPINES 5.5 03/30/26	4,600,000.000	5,316,178.370	
PHILIPPINES 6.375 01/15/32	2,600,000.000	3,470,996.100	
PHILIPPINES 6.375 10/23/34	3,000,000.000	4,197,961.050	
PHILIPPINES 7.75 01/14/31	4,100,000.000	5,923,479.180	
PHILIPPINES 9.5 02/02/30	5,800,000.000	8,953,750.000	
ROMANIA 4.375 08/22/23	4,000,000.000	4,145,520.000	
ROMANIA 4.875 01/22/24	3,600,000.000	3,793,320.000	
ROMANIA 5.125 06/15/48	3,600,000.000	3,730,201.200	
ROMANIA 6.125 01/22/44	4,400,000.000	5,041,291.200	
ROMANIA 6.75 02/07/22	6,500,000.000	6,853,795.000	
RUSSIAN FEDERATION 03/31/30	9,853,000.000	11,008,264.250	
RUSSIAN FEDERATION 4.25 06/23/27	6,400,000.000	6,918,604.800	
RUSSIAN FEDERATION 4.375 03/21/29	6,400,000.000	7,053,344.000	
RUSSIAN FEDERATION 4.5 04/04/22	4,800,000.000	5,036,400.000	
RUSSIAN FEDERATION 4.75 05/27/26	8,400,000.000	9,245,460.000	
RUSSIAN FEDERATION 4.875 09/16/23	7,400,000.000	8,089,088.000	
RUSSIAN FEDERATION 5.1 03/28/35	8,000,000.000	9,574,960.000	
RUSSIAN FEDERATION 5.25 06/23/47	13,000,000.000	16,292,250.000	
RUSSIAN FEDERATION 5.625 04/04/42	9,000,000.000	11,358,738.000	
RUSSIAN FEDERATION 5.875 09/16/43	5,200,000.000	6,786,000.000	
SOUTH AFRICA 4.3 10/12/28	5,200,000.000	4,453,800.000	

SOUTH AFRICA 4.665 01/17/24	5,100,000.000	4,964,289.000	
SOUTH AFRICA 4.875 04/14/26	5,400,000.000	5,035,554.000	
SOUTH AFRICA 5.0 10/12/46	2,800,000.000	2,127,020.000	
SOUTH AFRICA 5.375 07/24/44	2,800,000.000	2,154,740.000	
SOUTH AFRICA 5.65 09/27/47	3,200,000.000	2,480,000.000	
SOUTH AFRICA 5.875 05/30/22	3,000,000.000	3,083,475.000	
SOUTH AFRICA 5.875 06/22/30	4,400,000.000	4,032,600.000	
SOUTH AFRICA 5.875 09/16/25	5,200,000.000	5,133,190.400	
SOUTH AFRICA 6.3 06/22/48	3,000,000.000	2,498,397.000	
UNITED MEXICAN STATES 3.6 01/30/25	5,200,000.000	5,322,668.000	
UNITED MEXICAN STATES 3.625 03/15/22	5,900,000.000	5,976,759.000	
UNITED MEXICAN STATES 3.75 01/11/28	3,200,000.000	3,248,800.000	
UNITED MEXICAN STATES 4.0 10/02/23	8,500,000.000	8,774,847.500	
UNITED MEXICAN STATES 4.125 01/21/26	5,000,000.000	5,125,050.000	
UNITED MEXICAN STATES 4.15 03/28/27	8,400,000.000	8,790,600.000	
UNITED MEXICAN STATES 4.35 01/15/47	6,000,000.000	5,654,100.000	
UNITED MEXICAN STATES 4.5 01/31/50	3,000,000.000	2,746,800.000	
UNITED MEXICAN STATES 4.5 04/22/29	8,000,000.000	8,356,000.000	
UNITED MEXICAN STATES 4.6 01/23/46	6,000,000.000	5,790,000.000	
UNITED MEXICAN STATES 4.6 02/10/48	6,400,000.000	6,208,000.000	
UNITED MEXICAN STATES 4.75 03/08/44	6,400,000.000	6,360,000.000	
UNITED MEXICAN STATES 5.55 01/21/45	6,400,000.000	7,056,000.000	
UNITED MEXICAN STATES 5.75 10/12/2110	5,800,000.000	5,879,750.000	
UNITED MEXICAN STATES 6.05 01/11/40	7,900,000.000	9,082,630.000	
UNITED MEXICAN STATES 6.75 09/27/34	5,200,000.000	6,357,000.000	

	アメリカ・ドル 小計	563,091,000.000 (60,943,338,930)	619,836,770.080 (67,084,933,625)	
国債証券	合計	60,943,338,930 (60,943,338,930)	67,084,933,625 (67,084,933,625)	
合計			67,084,933,625 (67,084,933,625)	

(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 115銘柄	97.17	100.00

(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

貸借対照表

(単位:円)

令和2年4月13日現在

資産の部	
流動資産	
預金	6,657,404,530
コール・ローン	489,898,471
株式	20,848,698,461
新株予約権証券	41,854
投資信託受益証券	128,384,536
投資証券	23,613,009
派生商品評価勘定	961,229,923
未収入金	1,444,493
未収配当金	80,236,539
差入委託証拠金	2,923,158,668
流動資産合計	32,114,110,484
資産合計	32,114,110,484
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	8,494,748
未払金	68,167,856
未払解約金	187,200
流動負債合計	76,849,804
負債合計	76,849,804
純資産の部	
元本等	
元本	33,500,936,897
剰余金	
剰余金又は欠損金()	1,463,676,217
元本等合計	32,037,260,680
純資産合計	32,037,260,680
負債純資産合計	32,114,110,484

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 令和1年10月12日 至 令和2年4月13日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<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>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<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日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計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	令和2年4月13日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	39,188,097,626円
同期中追加設定元本額	26,658,649,084円
同期中一部解約元本額	32,345,809,813円

元本の内訳	
ファンド名	
DIAM新興国株式インデックスファンド<DC年金>	5,966,487,609円
DIAM新興国株式インデックスファンド<為替ヘッジなし>(ファンドラップ)	393,407,561円
MITO ラップ型ファンド(安定型)	2,737,273円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	8,945,691円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	9,485,481円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	38,313,785円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	35,858,209円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	14,497,885円
たわらノーロード 新興国株式	5,911,939,947円
たわらノーロード 新興国株式<ラップ向け>	2,569,657,306円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	941,819,135円
たわらノーロード バランス(堅実型)	9,026,402円
たわらノーロード バランス(標準型)	28,903,810円
たわらノーロード バランス(積極型)	45,067,198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)	495,665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)	72,242,070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)	144,523,743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)	114,354,089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)	172,607,793円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	500,592円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	2,214,325円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	1,205,545円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	3,133,670円
たわらノーロード 全世界株式	27,192,564円
One DC 新興国株式インデックスファンド	23,486,891円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	441,719,912円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	398,227,441円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	400,152,689円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	712,425,282円
投資のソムリエ	6,356,535,873円
クルーズコントロール	530,462,496円
投資のソムリエ<DC年金>	594,492,133円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	363,111,843円
クルーズコントロール<DC年金>	603,694円
DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)	7,287,401円
DIAMコア資産設計ファンド(積極型)	19,375,965円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	221,210,030円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	2,176,795,052円
ワールドアセットバランス(基本コース)	1,464,721,356円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	915,052,973円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	7,173,871円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	4,866,363円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	2,013,199円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	8,646,549円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	1,090,170,249円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	316,965,786円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	1,470,458円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	692,778円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	908,690円
エマージング株式パッシブファンドVA(適格機関投資家専用)	179,615,850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)	425,957,927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)	322,176,798円
計	33,500,936,897円
2. 受益権の総数	33,500,936,897口
3. 元本の欠損	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は1,463,676,217円であります。

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 令和1年10月12日 至 令和2年4月13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。
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、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有していません。
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。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	令和2年4月13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。
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。
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。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	令和2年4月13日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
株式	2,037,707,742
新株予約権証券	64,748
投資信託受益証券	28,540,284
投資証券	16,396,667
合計	2,082,709,441

(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31年4月19日から令和2年4月13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	令和2年4月13日現在			
	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	1,602,464,046	-	1,602,315,514	148,532
アメリカ・ドル	1,601,467,291	-	1,601,319,323	147,968
アラブ首長国連邦・ディルハム	650,640	-	650,640	-
チリ・ペソ	124,535	-	125,117	582
ブラジル・レアル	221,580	-	220,434	1,146
買建	2,022,720,264	-	2,028,377,744	5,657,480
アメリカ・ドル	421,252,973	-	419,697,744	1,555,229
インド・ルピー	482,093,540	-	489,600,000	7,506,460
オフショア・人民元	291,404,352	-	291,080,000	324,352
台湾・ドル	827,969,399	-	828,000,000	30,601
合計	3,625,184,310	-	3,630,693,258	5,806,012

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

1. 計算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	令和2年4月13日現在			
	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	10,064,621,567	-	11,011,550,730	946,929,163
合計	10,064,621,567	-	11,011,550,730	946,929,163

（注）時価の算定方法

株価指数先物取引

- 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。
 - 先物取引の残高表示は、契約額によっております。
 - 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）

令和2年4月13日現在	
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	0.9563円 (9,563円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

（1）株式

令和2年4月13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	TRIP.COM GROUP LTD ADR	18,842	24.820	467,658.440	
	CIA DE MINAS BUENAVENTURA SA ADR	10,055	7.450	74,909.750	
	SURGUTNEFTEGAZ SP ADR PREF	24,210	5.107	123,640.470	
	CREDICORP LTD	2,725	135.620	369,564.500	
	SINA CORP	2,124	33.160	70,431.840	
	MOBILE TELESYSTEMS PJSC ADR	23,788	8.110	192,920.680	
	NETEASE INC-ADR	2,823	327.350	924,109.050	
	GRUPO FINANCIERO GALICIA SA ADR	3,343	7.090	23,701.870	
	SOUTHERN COPPER CORP	2,829	31.120	88,038.480	
	TELECOM ARGENTINA SA SP ADR	3,789	8.310	31,486.590	
	YPF SA ADR	1,594	4.200	6,694.800	
	LUKOIL SPON ADR	16,828	70.400	1,184,691.200	
	GAZPROM PAO ADR	211,741	5.190	1,098,935.790	

COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK SP GDR	62,486	4.060	253,693.160	
INNER MONGOLIA YITAI COAL CO	21,600	0.671	14,493.600	
SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRADE	54,736	0.807	44,171.950	
SURGUTNEFTEGAZ ADR	32,784	5.060	165,887.040	
51JOB INC ADR	673	65.980	44,404.540	
X5 RETAIL GROUP NV GDR	5,356	30.560	163,679.360	
NOVATEK PJSC GDR	3,663	146.500	536,629.500	
BAIDU INC -SPON ADR	10,890	99.000	1,078,110.000	
NOVOLIPETSK STEEL GDR	5,100	18.100	92,310.000	
BANCO MACRO SA ADR	3,236	16.570	53,620.520	
MMC NORILSK NICKEL ADR	25,846	28.590	738,937.140	
ROSNEFT OIL CO GDR	47,501	4.783	227,197.280	
NEW ORIENTAL EDUCATION & TECH	5,708	115.740	660,643.920	
SEVERSTAL GDR	12,260	12.220	149,817.200	
TATNEFT ADR	10,449	48.860	510,538.140	
MAGNITOGORSK IRON & STEEL SPON GDR	7,536	7.000	52,752.000	
VTB BANK OJSC GDR	82,000	1.000	82,000.000	
DP WORLD PLC	6,042	15.450	93,348.900	
MAGNIT PJSC GDR	15,701	10.100	158,580.100	
VIPSHOP HOLDINGS LTD ADR	17,735	15.490	274,715.150	
TAL EDUCATION GROUP-ADR	15,308	50.820	777,952.560	
NOAH HOLDINGS LTD ADR	1,630	24.650	40,179.500	
SBERBANK ADR	107,738	10.985	1,183,501.930	
PHOSAGRO PJSC GDR	3,578	11.600	41,504.800	
HUAZHU GROUP LTD ADR	5,508	28.520	157,088.160	
JOYY INC-ADR	2,093	57.040	119,384.720	
GDS HOLDINGS LTD ADR	2,200	50.880	111,936.000	
ZAI LAB LTD ADR	1,693	59.920	101,444.560	
BEST INC ADR	8,574	5.430	46,556.820	
HUYA INC ADR	1,560	15.620	24,367.200	
NIO INC ADR	23,428	2.670	62,552.760	
TENCENT MUSIC ENTERTAINMENT GROUP ADR	4,689	10.970	51,438.330	
58.COM INC ADR	4,107	51.760	212,578.320	
AUTOHOME INC ADR	2,476	72.230	178,841.480	
LUCKIN COFFEE INC ADR	3,029	4.390	13,297.310	
WEIBO CORP ADR	1,947	35.620	69,352.140	
JD.COM INC ADR	29,102	42.160	1,226,940.320	
GLOBANT SA	1,142	92.900	106,091.800	
ALIBABA GROUP HOLDING LTD-ADR	68,395	196.370	13,430,726.150	
MOMO INC SPON ADR	6,337	21.830	138,336.710	

	BAOZUN INC-SPN ADR	2,070	29.960	62,017.200	
	PINDUODUO INC ADR	7,754	41.040	318,224.160	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	14,345	45.480	652,410.600	
	IQIYI INC ADR	4,321	17.370	75,055.770	
	POLYUS PJSC GDR	2,509	76.000	190,684.000	
	HUTCHISON CHINA MEDITECH LTD ADR	1,311	18.290	23,978.190	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC ADR	13,035	27.130	353,639.550	
アメリカ・ドル	小計	1,095,872		29,822,394.000 (3,227,677,703)	
アラブ首長国 連邦・ディル ハム	DUBAI ISLAMIC BANK PJSC	63,016	3.350	211,103.600	
	EMIRATES TELECOMMUNICATIONS GROUP CO PJSC	59,104	15.000	886,560.000	
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK PJSC	111,127	4.490	498,960.230	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	98,180	12.500	1,227,250.000	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	134,877	2.500	337,192.500	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	141,995	1.550	220,092.250	
	EMAAR MALLS PJSC	95,355	1.150	109,658.250	
アラブ首長国連邦・ディルハム	小計	703,654		3,490,816.830 (102,979,096)	
イギリス・ポ ンド	POLYMETAL INTERNATIONAL PLC	9,778	15.100	147,647.800	
イギリス・ポ ンド	小計	9,778		147,647.800 (19,902,923)	
インド・ル ピー	RELIANCE INDUSTRIES LTD	111,810	1,219.950	136,402,609.500	
	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	28,246	344.900	9,742,045.400	
	ASIAN PAINTS LTD	11,559	1,651.350	19,087,954.650	
	EICHER MOTORS LTD	558	13,742.300	7,668,203.400	
	GRASIM INDUSTRIES LTD	13,474	530.550	7,148,630.700	
	MAHINDRA & MAHINDRA LTD	30,953	381.400	11,805,474.200	
	SHREE CEMENT LTD	278	16,935.300	4,708,013.400	
	ICICI BANK LTD	187,609	342.700	64,293,604.300	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP LTD	20,228	207.850	4,204,389.800	
	STATE BANK OF INDIA LTD	71,405	187.750	13,406,288.750	
	CONTAINER CORP OF INDIA LTD	6,692	374.250	2,504,481.000	
	LIC HOUSING FINANCE LTD	14,436	255.350	3,686,232.600	
	TATA STEEL LTD	13,826	284.850	3,938,336.100	
	TATA MOTORS LTD	58,168	74.600	4,339,332.800	
	JSW STEEL LTD	38,177	166.300	6,348,835.100	
	TATA POWER CO LTD	37,195	36.500	1,357,617.500	

BRITANNIA INDUSTRIES LTD	2,188	2,801.700	6,130,119.600	
NESTLE INDIA LTD	962	16,839.700	16,199,791.400	
GAIL INDIA LTD	58,710	87.750	5,151,802.500	
VEDANTA LTD	87,477	76.800	6,718,233.600	
AXIS BANK LTD	83,072	420.150	34,902,700.800	
TITAN COMPANY LTD	12,637	1,013.850	12,812,022.450	
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	107,810	77.300	8,333,713.000	
COLGATE-PALMOLIVE INDIA LTD	2,097	1,362.550	2,857,267.350	
LUPIN LTD	7,845	790.150	6,198,726.750	
BAJAJ FINANCE LTD	7,201	2,551.850	18,375,871.850	
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP	64,287	1,703.100	109,487,189.700	
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISES LTD	31,162	149.850	4,669,625.700	
INFOSYS LTD	134,605	636.250	85,642,431.250	
WIPRO LTD	49,110	196.700	9,659,937.000	
INDIAN OIL CORP LTD	72,810	83.400	6,072,354.000	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	25,378	2,372.250	60,202,960.500	
HCL TECHNOLOGIES LTD	44,102	469.050	20,686,043.100	
DABUR INDIA LTD	22,989	485.350	11,157,711.150	
HERO MOTOCORP LTD	4,143	1,990.900	8,248,298.700	
DR REDDYS LABORATORIES LTD	4,695	3,621.550	17,003,177.250	
BHARTI AIRTEL LTD	96,925	488.700	47,367,247.500	
UNITED SPIRITS LTD	10,033	550.900	5,527,179.700	
SUN PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD	36,294	454.450	16,493,808.300	
DIVI'S LABORATORIES LTD	2,540	2,310.900	5,869,686.000	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	4,103	5,326.650	21,855,244.950	
AUROBINDO PHARMA LTD	11,418	460.200	5,254,563.600	
HAVELLS INDIA LTD	6,489	550.600	3,572,843.400	
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	42,676	66.050	2,818,749.800	
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE CO LTD	3,777	675.950	2,553,063.150	
PETRONET LNG LTD	23,031	224.200	5,163,550.200	
CIPLA LTD/INDIA	11,637	579.600	6,744,805.200	
LARSEN & TOUBRO LTD	19,570	812.800	15,906,496.000	
ULTRATECH CEMENT LTD	4,156	3,366.050	13,989,303.800	
ASHOK LEYLAND LTD	50,057	45.650	2,285,102.050	
BOSCH LTD	222	10,205.600	2,265,643.200	
TATA CONSULTANCY SERVICES LTD	35,308	1,766.150	62,359,224.200	
NTPC LTD	114,212	87.100	9,947,865.200	
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	5,589	958.400	5,356,497.600	
AMBUJA CEMENTS LTD	19,998	158.800	3,175,682.400	

	BHARAT FORGE LTD	7,644	245.550	1,876,984.200	
	HINDALCO INDUSTRIES LTD	56,131	107.550	6,036,889.050	
	ITC LTD	135,710	185.250	25,140,277.500	
	PIDILITE INDUSTRIES LTD	4,365	1,348.700	5,887,075.500	
	UNITED PHOSPHORUS LTD	18,242	319.000	5,819,198.000	
	SIEMENS INDIA LTD	2,678	1,154.500	3,091,751.000	
	INFO EDGE INDIA LTD	2,151	2,241.950	4,822,434.450	
	GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	15,695	595.100	9,340,094.500	
	TECH MAHINDRA LTD	20,462	545.250	11,156,905.500	
	MARICO LTD	15,555	296.600	4,613,613.000	
	PAGE INDUSTRIES LTD	191	17,231.750	3,291,264.250	
	DLF LTD	24,013	149.100	3,580,338.300	
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	60,638	164.450	9,971,919.100	
	ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	17,220	251.900	4,337,718.000	
	REC LTD	26,309	89.000	2,341,501.000	
	BAJAJ FINSERV LTD	1,269	4,820.250	6,116,897.250	
	BAJAJ AUTO LTD	3,392	2,435.950	8,262,742.400	
	COAL INDIA LTD	54,464	140.800	7,668,531.200	
	MAHINDRA & MAHINDRA FINANCIAL SERVICES LTD	8,621	166.400	1,434,534.400	
	BHARTI INFRATEL LTD	14,070	173.900	2,446,773.000	
	TATA STEEL LTD-PARTLY PAID	2,333	31.050	72,439.650	
	HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	21,672	472.250	10,234,602.000	
	HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	1,043	2,447.250	2,552,481.750	
	BANDHAN BANK LTD	9,923	192.250	1,907,696.750	
	BERGER PAINTS INDIA LTD	7,954	474.300	3,772,582.200	
	AVENUE SUPERMARTS LTD	2,870	2,392.650	6,866,905.500	
	ICICI LOMBARD GENERAL INSURANCE CO LTD	7,931	1,169.000	9,271,339.000	
	ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURANCE CO LTD	11,566	342.550	3,961,933.300	
	INTERGLOBE AVIATION LTD	3,635	1,041.950	3,787,488.250	
	SBI LIFE INSURANCE CO LTD	14,970	739.450	11,069,566.500	
インド・ルピー	小計	2,538,646		1,170,393,059.600 (1,685,366,006)	
インドネシア・ルピア	BARITO PACIFIC TBK PT	566,700	945.000	535,531,500.000	
	UNITED TRACTORS TBK PT	55,301	17,125.000	947,029,625.000	
	INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK PT	150,900	6,375.000	961,987,500.000	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	360,800	7,250.000	2,615,800,000.000	

PT ASTRA INTERNATIONAL TBK	852,900	4,090.000	3,488,361,000.000	
TELEKOMUNIKASI INDONESIA PERSERO TBK	2,024,400	3,120.000	6,316,128,000.000	
CHAROEN POKPHAND INDONESIA TBK PT	244,000	4,370.000	1,066,280,000.000	
GUDANG GARAM TBK PT	15,800	47,825.000	755,635,000.000	
HANJAYA MANDALA SAMPOERNA TBK	456,300	1,660.000	757,458,000.000	
INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA TBK PT	36,900	11,600.000	428,040,000.000	
INDAH KIAT PULP AND PAPER CORP TBK PT	142,800	4,910.000	701,148,000.000	
BUKIT ASAM TBK PT	230,000	1,980.000	455,400,000.000	
BANK MANDIRI	791,100	4,670.000	3,694,437,000.000	
PABRIK KERTAS TJIWI KIMIA TBK PT	86,800	4,930.000	427,924,000.000	
BANK RAKYAT INDONESIA	2,264,300	2,790.000	6,317,397,000.000	
PERUSAHAAN GAS NEGARA TBK PT	477,200	835.000	398,462,000.000	
BANK NEGARA INDONESIA PERSERO TBK PT	253,600	3,990.000	1,011,864,000.000	
KALBE FARMA TBK PT	575,300	1,140.000	655,842,000.000	
SEMEN INDONESIA PERSERO TBK PT	100,900	8,100.000	817,290,000.000	
BANK CENTRAL ASIA TBK PT	390,800	27,975.000	10,932,630,000.000	
XL AXIATA TBK PT	35,500	2,150.000	76,325,000.000	
JASA MARGA PERSERO TBK PT	41,625	2,840.000	118,215,000.000	
BUMI SERPONG DAMAI PT	663,100	845.000	560,319,500.000	
ADARO ENERGY PT	684,500	1,040.000	711,880,000.000	
PAKUWON JATI TBK	218,500	404.000	88,274,000.000	
INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR TBK PT	77,400	10,100.000	781,740,000.000	
BANK TABUNGAN NEGARA TBK PT	157,900	920.000	145,268,000.000	
ACE HARDWARE INDONESIA TBK PT	110,400	1,190.000	131,376,000.000	
インドネシア・ルピア 小計	12,065,726		45,898,042,125.000 (316,696,491)	
オフショア・ 人民元				
EVE ENERGY CO LTD	2,700	59.010	159,327.000	
LUXI CHEMICAL GROUP CO LTD	17,300	8.000	138,400.000	
WUS PRINTED CIRCUIT KUNSHAN CO LTD	5,400	24.910	134,514.000	
BEIJING SHUNXIN AGRICULTURE CO LTD	3,000	63.010	189,030.000	

JIANGXI GANFENG LITHIUM CO LTD	3,500	39.650	138,775.000	
XINJIANG ZHONGTAI CHEMICAL CO LTD	32,300	4.890	157,947.000	
UNISPLENDOUR CORP LTD	5,600	35.110	196,616.000	
HANGZHOU TIGERMED CONSULTING CO LTD	1,200	75.000	90,000.000	
CHANGCHUN HIGH & NEW TECHNOLOGY INDUSTRY GROUP INC	300	551.360	165,408.000	
ZHEJIANG SANHUA INTELLIGENT CONTROLS CO LTD	8,100	17.180	139,158.000	
MANGO EXCELLENT MEDIA CO LTD	5,200	39.980	207,896.000	
HUBEI BIOCAUSE PHARMACEUTICAL CO LTD	23,800	5.690	135,422.000	
SUOFEIYA HOME COLLECTION CO LTD	6,600	18.280	120,648.000	
GEM CO LTD	29,100	4.730	137,643.000	
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO LTD	6,900	32.180	222,042.000	
WUHAN GUIDE INFRARED CO LTD	3,600	37.510	135,036.000	
HANGZHOU ROBAM APPLIANCES CO LTD	5,904	28.370	167,496.480	
ZHEJIANG NHU CO LTD	4,200	27.580	115,836.000	
SHIJIAZHANG YILING PHARMACEUTICAL CO LTD	1,900	25.880	49,172.000	
AVIC JONHON OPTRONIC TECHNOLOGY CO LTD	1,800	34.590	62,262.000	
GUANGDONG HAID GROUP CO LTD	3,700	42.870	158,619.000	
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD	3,600	123.900	446,040.000	
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICAL PRODUCTS CO LTD	3,700	74.000	273,800.000	
GLODON CO LTD	2,300	44.030	101,269.000	
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	11,200	12.260	137,312.000	
JINKE PROPERTIES GROUP CO LTD	14,300	7.880	112,684.000	
SICHUAN KELUN PHARMACEUTICAL CO LTD	12,000	22.740	272,880.000	
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEERING INC	6,000	48.580	291,480.000	
RONGSHENG PETRO CHEMICAL CO LTD	9,600	11.000	105,600.000	

INSPUR ELECTRONIC INFORMATION INDUSTRY CO LTD	3,570	38.110	136,052.700	
GRG BANKING EQUIPMENT CO LTD	12,700	9.360	118,872.000	
O-FILM TECH CO LTD	8,600	13.970	120,142.000	
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO LTD	8,600	42.890	368,854.000	
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY BEIJING CO LTD	6,900	38.010	262,269.000	
XCMG CONSTRUCTION MACHINERY CO LTD	38,200	5.650	215,830.000	
CHENGDU KANGHONG PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	6,700	40.700	272,690.000	
GUANGZHOU HAIGE COMMUNICATIONS GROUP INC CO	15,300	11.960	182,988.000	
YANTAI JEREH OILFIELD SERVICES GROUP CO LTD	5,000	25.530	127,650.000	
WUHU SHUNRONG SANQI INTERACTIVE ENTERTAINMENT NETWORK TECHNOLOGY	6,600	33.520	221,232.000	
LUZHOU LAOJIAO CO LTD	2,300	76.850	176,755.000	
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLOGY CO LTD	7,400	28.320	209,568.000	
BEIJING DABEINONG TECHNOLOGY GROUP CO LTD	14,950	7.830	117,058.500	
NORTHEAST SECURITIES CO LTD	17,700	8.370	148,149.000	
SONGCHENG PERFORMANCE DEVELOPMENT CO LTD	3,300	26.560	87,648.000	
BEIJING SHIJI INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD	3,800	29.740	113,012.000	
RISESUN REAL ESTATE DEVELOPMENT CO LTD	16,000	7.960	127,360.000	
HITHINK ROYALFLUSH INFORMATION NETWORK CO LTD	2,100	116.240	244,104.000	
LUXSHARE PRECISION INDUSTRY CO LTD	10,650	39.650	422,272.500	
FOCUS MEDIA INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD	26,900	4.040	108,676.000	
NEW HOPE LIUHE CO LTD	11,100	32.750	363,525.000	
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY CO LTD	6,500	16.500	107,250.000	
IFLYTEK CO LTD	7,500	35.760	268,200.000	
GOERTEK INC	10,500	17.810	187,005.000	

BANK OF NINGBO CO LTD	12,600	23.270	293,202.000	
LENS TECHNOLOGY CO LTD	4,300	17.640	75,852.000	
TCL TECHNOLOGY GROUP CORPORATION	47,400	4.410	209,034.000	
SHENZHEN OVERSEAS CHINESE TOWN CO LTD	37,600	6.420	241,392.000	
CHONGQING CHANGAN AUTOMOBILE CO LTD	12,200	9.800	119,560.000	
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT & DEVELOPMENT CO LTD	7,900	40.090	316,711.000	
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD	3,000	83.140	249,420.000	
AVIC AIRCRAFT CO LTD	10,700	16.590	177,513.000	
EAST MONEY INFORMATION CO LTD	20,200	17.130	346,026.000	
JIANGSU YANGHE BREWERY JOINT-STOCK CO LTD	3,000	91.120	273,360.000	
WULIANGYE YIBIN CO LTD	9,400	126.520	1,189,288.000	
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUCTS CO LTD	20,800	7.940	165,152.000	
SUNING.COM CO LTD	29,100	8.970	261,027.000	
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LTD	79,100	3.800	300,580.000	
CHINA MERCHANTS SHEKOU INDUSTRIAL ZONE HOLDINGS CO LTD	19,200	16.590	318,528.000	
GREE ELECTRIC APPLIANCES INC OF ZHUHAI	5,100	53.740	274,074.000	
HANGZHOU HIKVISION DIGITAL TECHNOLOGY CO LTD	19,100	29.400	561,540.000	
GUOSEN SECURITIES CO LTD	17,000	10.970	186,490.000	
PING AN BANK CO LTD	40,500	12.790	517,995.000	
WENS FOODSTUFFS GROUP CO LTD	12,100	32.650	395,065.000	
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO LTD	65,700	4.400	289,080.000	
CHINA VANKE CO LTD	23,700	26.880	637,056.000	
ZTE CORP	9,700	39.290	381,113.000	
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY SCIENCE AND TECHNOLOGY CO LTD	40,500	6.230	252,315.000	
WEICHAI POWER CO LTD	22,000	13.180	289,960.000	
GF SECURITIES CO LTD	18,300	13.810	252,723.000	
XINJIANG GOLDWIND SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	6,200	9.860	61,132.000	

BYD CO LTD	3,100	54.570	169,167.000	
LOMON BILLIONS GROUP CO LTD	11,000	15.070	165,770.000	
NANJI E-COMMERCE CO LTD	12,900	11.300	145,770.000	
NAURA TECHNOLOGY GROUP CO LTD	1,200	117.000	140,400.000	
PERFECT WORLD CO LTD/CHINA	3,700	48.050	177,785.000	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO LTD	1,200	116.560	139,872.000	
HENGYI PETROCHEMICAL CO LTD	12,000	11.700	140,400.000	
YUNDA HOLDING CO LTD	5,400	28.610	154,494.000	
GCL SYSTEM INTEGRATION TECHNOLOGY CO LTD	33,800	2.870	97,006.000	
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCARE HOLDINGS CO LTD	15,100	12.660	191,166.000	
SF HOLDING CO LTD	5,000	48.130	240,650.000	
SHANDONG SINOCERA FUNCTIONAL MATERIAL CO LTD	6,500	21.480	139,620.000	
BANK OF SHANGHAI CO LTD	18,090	8.290	149,966.100	
CSC FINANCIAL CO LTD	6,300	30.900	194,670.000	
HENGLI PETROCHEMICAL CO LTD	17,100	12.710	217,341.000	
JIANGSU CHANGSHU RURAL COMMERCIAL BANK CO LTD	23,600	7.010	165,436.000	
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO LTD	4,320	32.480	140,313.600	
HEILONGJIANG AGRICULTURE CO LTD	9,500	16.090	152,855.000	
SHENNAN CIRCUITS CO LTD	500	225.900	112,950.000	
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICAL PRODUCTS CO LTD	1,600	123.120	196,992.000	
CAITONG SECURITIES CO LTD	12,700	9.910	125,857.000	
BANK OF CHENGDU CO LTD	27,000	7.590	204,930.000	
NANJING SECURITIES CO LTD	9,800	14.820	145,236.000	
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNET CO LTD	14,400	13.620	196,128.000	
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDICAL ELECTRONICS CO LTD	1,900	261.410	496,679.000	
HUAXI SECURITIES CO LTD	15,500	10.400	161,200.000	
SANGFOR TECHNOLOGIES INC	1,100	166.000	182,600.000	

CONTEMPORARY AMPEREX TECHNOLOGY CO LTD	4,100	118.460	485,686.000	
GIGADEVICE SEMICONDUCTOR BEIJING INC	600	246.930	148,158.000	
WUXI APPTec CO LTD	3,200	100.150	320,480.000	
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD	2,500	102.800	257,000.000	
WILL SEMICONDUCTOR LTD	1,400	155.500	217,700.000	
PETROCHINA CO LTD	12,800	4.600	58,880.000	
INDUSTRIAL & COMMERCIAL BANK OF CHINA LTD	163,300	5.110	834,463.000	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA LTD	230,600	3.410	786,346.000	
BANK OF CHINA LTD	84,000	3.500	294,000.000	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL CORP	35,100	4.490	157,599.000	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	10,000	26.480	264,800.000	
CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD	6,100	15.890	96,929.000	
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	54,600	32.100	1,752,660.000	
PING AN INSURANCE GROUP CO OF CHINA LTD	27,000	70.990	1,916,730.000	
INDUSTRIAL BANK CO LTD	38,300	16.150	618,545.000	
SHANGHAI PUDONG DEVELOPMENT BANK CO LTD	63,000	10.210	643,230.000	
CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	59,000	5.770	340,430.000	
SAIC MOTOR CORP LTD	17,500	18.920	331,100.000	
KWEICHOW MOUTAI CO LTD	3,000	1,165.000	3,495,000.000	
BANK OF COMMUNICATIONS CO LTD	61,300	5.180	317,534.000	
CITIC SECURITIES CO LTD	19,900	22.490	447,551.000	
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	16,500	27.960	461,340.000	
SHANGHAI INTERNATIONAL PORT GROUP CO LTD	38,300	4.430	169,669.000	
CHINA YANGTZE POWER CO LTD	62,800	17.050	1,070,740.000	
DAQIN RAILWAY CO LTD	17,100	6.890	117,819.000	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD	74,800	3.580	267,784.000	
CHINA STATE CONSTRUCTION ENGINEERING CORP LTD	73,100	5.250	383,775.000	
CHINA SHIPBUILDING INDUSTRY CO LTD	73,600	4.240	312,064.000	

HAITONG SECURITIES CO LTD	24,200	12.880	311,696.000	
HUAXIA BANK CO LTD	22,900	6.470	148,163.000	
INNER MONGOLIA YILI INDUSTRIAL GROUP CO LTD	12,900	30.200	389,580.000	
BANK OF BEIJING CO LTD	88,000	4.820	424,160.000	
CHINA UNITED NETWORK COMMUNICATIONS LTD	79,500	5.380	427,710.000	
BAOSHAN IRON & STEEL CO LTD	40,700	4.850	197,395.000	
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	10,700	57.880	619,316.000	
CHINA MERCHANTS SECURITIES CO LTD	15,700	17.600	276,320.000	
POLY DEVELOPMENTS AND HOLDINGS GROUP CO LTD	24,600	14.690	361,374.000	
CRRC CORP LTD	51,600	6.280	324,048.000	
JIANGSU HENGRUI MEDICINE CO LTD	8,300	96.210	798,543.000	
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION CORP LTD	29,800	9.550	284,590.000	
HUATAI SECURITIES CO LTD	19,700	18.030	355,191.000	
CHINA RAILWAY GROUP LTD	49,700	5.650	280,805.000	
NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	7,100	41.170	292,307.000	
HAIER SMART HOME CO LTD	4,200	15.290	64,218.000	
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD	14,700	19.070	280,329.000	
GD POWER DEVELOPMENT CO LTD	61,800	2.030	125,454.000	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	3,600	32.880	118,368.000	
GEMDALE CORP	10,600	13.320	141,192.000	
SANAN OPTOELECTRONICS CO LTD	7,500	20.840	156,300.000	
WANHUA CHEMICAL GROUP CO LTD	7,100	42.900	304,590.000	
CHINA FORTUNE LAND DEVELOPMENT CO LTD	9,900	21.370	211,563.000	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD	70,000	3.970	277,900.000	
FOUNDER SECURITIES CO LTD	15,900	7.090	112,731.000	
SDIC POWER HOLDINGS CO LTD	12,000	7.720	92,640.000	
NARI TECHNOLOGY CO LTD	14,500	20.410	295,945.000	
OFFSHORE OIL ENGINEERING CO LTD	29,800	5.260	156,748.000	

CHINA INTERNATIONAL TRAVEL SERVICE CORP LTD	3,500	77.320	270,620.000	
INNER MONGOLIA BAOTOU STEEL UNION CO LTD	173,900	1.140	198,246.000	
NINGBO ZHOUSHAN PORT CO LTD	66,900	3.470	232,143.000	
AVIC CAPITAL CO LTD	32,200	3.940	126,868.000	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	65,800	2.900	190,820.000	
AIR CHINA LTD	28,400	6.740	191,416.000	
CHINA NATIONAL CHEMICAL ENGINEERING CO LTD	42,500	5.940	252,450.000	
METALLURGICAL CORP OF CHINA LTD	33,600	2.600	87,360.000	
POWER CONSTRUCTION CORP OF CHINA LTD	26,400	3.750	99,000.000	
SHANGHAI INTERNATIONAL AIRPORT CO LTD	3,300	65.580	216,414.000	
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHARMACEUTICAL HOLDINGS CO LTD	6,900	31.470	217,143.000	
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS CO LTD	8,400	20.950	175,980.000	
SINOLINK SECURITIES CO LTD	14,800	9.560	141,488.000	
ZHEJIANG LONGSHENG GROUP CO LTD	4,800	11.960	57,408.000	
SICHUAN CHUANYOU ENERGY CO LTD	23,700	9.220	218,514.000	
AECC AVIATION POWER CO LTD	9,300	22.680	210,924.000	
BANK OF NANJING CO LTD	15,600	7.520	117,312.000	
JOINTOWN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	7,600	17.850	135,660.000	
CHINA MOLYBDENUM CO LTD	61,800	3.530	218,154.000	
INDUSTRIAL SECURITIES CO LTD	28,200	6.230	175,686.000	
BEIJING TONGRENTANG CO LTD	10,600	24.960	264,576.000	
SHANDONG GOLD MINING CO LTD	6,800	36.050	245,140.000	
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS CO LTD	7,600	23.710	180,196.000	
BBMG CORP	54,200	3.280	177,776.000	
YONGHUI SUPERSTORES CO LTD	29,400	10.310	303,114.000	
YANZHOU COAL MINING CO LTD	18,600	8.590	159,774.000	
SHENERGY CO LTD	46,400	5.370	249,168.000	

CHINA EASTERN AIRLINES CORP LTD	6,500	4.260	27,690.000	
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD	15,019	8.540	128,262.260	
AISINO CORP	10,300	19.560	201,468.000	
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC	1,800	91.070	163,926.000	
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY CO LTD	6,500	42.270	274,755.000	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD	32,700	5.260	172,002.000	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD	1,700	18.850	32,045.000	
XIAMEN C & D INC	30,400	7.560	229,824.000	
AVIC HELICOPTER CO LTD	4,600	43.490	200,054.000	
SOOCHOW SECURITIES CO LTD	16,800	7.930	133,224.000	
INNER MONGOLIA JUNZHENG ENERGY & CHEMICAL INDUSTRY GROUP CO LTD	85,000	2.580	219,300.000	
FANGDA CARBON NEW MATERIAL CO LTD	14,000	9.070	126,980.000	
ZHANGZHOU PIENZHEHUANG PHARMACEUTICAL CO LTD	1,700	129.700	220,490.000	
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE FACTORY CO LTD	1,700	93.480	158,916.000	
SHANGHAI AJ GROUP CO LTD	15,700	7.890	123,873.000	
SHANGHAI ELECTRIC POWER CO LTD	12,900	7.480	96,492.000	
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLOGY CO LTD	12,600	10.290	129,654.000	
GUANGZHOU BAIYUN INTERNATIONAL AIRPORT CO LTD	11,900	13.410	159,579.000	
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD	4,500	28.560	128,520.000	
TONGWEI CO LTD	11,600	11.780	136,648.000	
SHANGHAI JINJIANG INTERNATIONAL HOTELS CO LTD	5,300	25.720	136,316.000	
CHINA RAILWAY HI-TECH INDUSTRY CO LTD	22,800	9.390	214,092.000	
CHINA JUSHI CO LTD	23,400	8.350	195,390.000	
HENGTONG OPTIC-ELECTRIC CO LTD	6,700	16.500	110,550.000	
LONGI GREEN ENERGY TECHNOLOGY CO LTD	6,500	24.750	160,875.000	
SHAANXI COAL INDUSTRY CO LTD	32,351	7.400	239,397.400	

	FOSHAN HAITIAN FLAVOURING & FOOD CO LTD	3,800	126.800	481,840.000	
	NINGBO JOYSON ELECTRONIC CORP	12,400	19.660	243,784.000	
	HONGFA TECHNOLOGY CO LTD	5,800	29.900	173,420.000	
	DONGXING SECURITIES CO LTD	13,200	10.930	144,276.000	
	JUNEYAO AIRLINES CO LTD	12,800	9.920	126,976.000	
	GUOTAI JUNAN SECURITIES CO LTD	21,500	16.480	354,320.000	
	CHINA NATIONAL NUCLEAR POWER CO LTD	21,400	4.440	95,016.000	
	HUAAN SECURITIES CO LTD	16,500	7.560	124,740.000	
	BANK OF JIANGSU CO LTD	21,800	6.010	131,018.000	
	BANK OF HANGZHOU CO LTD	23,600	7.800	184,080.000	
	SHENZHEN GOODIX TECHNOLOGY CO LTD	1,200	260.000	312,000.000	
	SDIC CAPITAL CO LTD	6,500	12.210	79,365.000	
	CHINA GRAND AUTOMOTIVE SERVICES CO LTD	35,100	3.810	133,731.000	
	ZHEJIANG DINGLI MACHINERY CO LTD	2,100	63.130	132,573.000	
	ORIENT SECURITIES CO LTD/CHINA	8,300	9.440	78,352.000	
	SPRING AIRLINES CO LTD	7,500	33.020	247,650.000	
	EVERBRIGHT SECURITIES CO LTD	16,000	11.270	180,320.000	
	GREENLAND HOLDINGS CORP LTD	29,200	5.470	159,724.000	
	オフショア・人民元 小計	4,843,754		59,863,962.540 (917,714,546)	
カタール・リアル	QATAR INSURANCE CO SAQ	82,282	2.300	189,248.600	
	QATAR NATIONAL BANK	161,180	18.730	3,018,901.400	
	COMMERCIAL BANK OF QATAR QSC	75,809	4.075	308,921.670	
	OOREDOO QSC	17,437	6.300	109,853.100	
	QATAR FUEL QSC	16,867	17.310	291,967.770	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	20,149	14.480	291,757.520	
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC BANK QSC	28,675	8.290	237,715.750	
	INDUSTRIES QATAR QSC	67,409	7.175	483,659.570	
	QATAR ISLAMIC BANK SAQ	37,487	15.360	575,800.320	
	MASRAF AL RAYAN	160,422	3.790	607,999.380	
	BARWA REAL ESTATE CO	100,055	3.180	318,174.900	
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDING CO	176,957	1.946	344,358.320	

カタール・リアル 小計		944,729		6,778,358.300 (200,842,756)	
コロンビア・ペソ	INTERCONEXION ELECTRICA SA ESP	21,675	17,200.000	372,810,000.000	
	ECOPETROL SA	176,459	2,360.000	416,443,240.000	
	GRUPO AVAL ACCIONES Y VALORES SA-PREF	196,073	936.000	183,524,328.000	
	GRUPO ARGOS SA	14,897	11,580.000	172,507,260.000	
	BANCOLOMBIA SA	6,747	26,100.000	176,096,700.000	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	17,116	26,540.000	454,258,640.000	
	GRUPO DE INVERSIONES SURAMERICANA SA	9,236	23,000.000	212,428,000.000	
コロンビア・ペソ 小計		442,203		1,988,068,168.000 (56,063,522)	
サウジアラビア・リアル	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL CO	5,839	44.550	260,127.450	
	JARIR MARKETING CO	2,189	137.600	301,206.400	
	CO FOR COOPERATIVE INSURANCE	2,030	65.500	132,965.000	
	ETIHAD ETISALAT CO	13,226	25.300	334,617.800	
	SAUDI BRITISH BANK	19,265	22.520	433,847.800	
	AL RAJHI BANK	36,748	54.400	1,999,091.200	
	ARAB NATIONAL BANK	16,818	19.000	319,542.000	
	BANK ALBILAD	12,862	21.680	278,848.160	
	BANK AL-JAZIRA	15,131	12.100	183,085.100	
	BANQUE SAUDI FRANSI	15,048	28.100	422,848.800	
	RIYAD BANK	33,338	16.160	538,742.080	
	SAMBA FINANCIAL GROUP	26,706	22.580	603,021.480	
	SAUDI TELECOM CO	11,543	92.700	1,070,036.100	
	SAUDI ARABIAN FERTILIZER CO	4,707	69.300	326,195.100	
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	20,943	76.900	1,610,516.700	
	SAUDI CEMENT CO	2,773	52.200	144,750.600	
	SAUDI ELECTRICITY CO	23,410	16.980	397,501.800	
	SAUDI INDUSTRIAL INVESTMENT GROUP	7,650	17.460	133,569.000	
	SAVOLA GROUP	9,220	41.450	382,169.000	
	NATIONAL INDUSTRIALIZATION CO	7,317	9.870	72,218.790	
	ALMARAI CO JSC	8,064	48.000	387,072.000	
	EMAAR ECONOMIC CITY	15,395	7.090	109,150.550	
	SAHARA INTERNATIONAL PETROCHEMICAL CO	12,536	13.460	168,734.560	
ADVANCED PETROCHEMICAL CO	3,751	44.200	165,794.200		
SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	12,891	8.240	106,221.840		

	DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEVELOPMENT CO	20,830	8.370	174,347.100	
	RABIGH REFINING & PETROCHEMICAL CO	6,066	14.080	85,409.280	
	BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE INSURANCE CO	718	99.900	71,728.200	
	ALINMA BANK	28,197	16.340	460,738.980	
	SAUDI ARABIAN MINING CO	10,301	34.850	358,989.850	
	SAUDI AIRLINES CATERING CO	338	74.800	25,282.400	
	SAUDI ARABIAN OIL CO	38,293	31.650	1,211,973.450	
	NATIONAL COMMERCIAL BANK	34,383	36.250	1,246,383.750	
	サウジアラビア・リアル 小計	478,526		14,516,726.520 (418,662,393)	
タイ・パーツ	BANGKOK BANK PCL	23,500	107.500	2,526,250.000	
	BERLI JUCKER PCL NVDR	42,900	42.500	1,823,250.000	
	KRUNG THAI BANK PCL NVDR	146,200	10.800	1,578,960.000	
	RATCHABURI ELECTRICITY GENERATING HOLDING PCL NVDR	23,600	61.250	1,445,500.000	
	SIAM COMMERCIAL BANK PCL NVDR	29,700	70.250	2,086,425.000	
	TRUE CORP PCL NVDR	585,955	3.340	1,957,089.700	
	KASIKORNBANK PCL NVDR	16,500	95.000	1,567,500.000	
	TMB BANK PCL -NVDR	1,336,200	0.880	1,175,856.000	
	IRPC PCL NVDR	379,600	2.440	926,224.000	
	BANPU PCL PUBLIC CO LTD NVDR	211,900	6.100	1,292,590.000	
	ELECTRICITY GENERATING PCL NVDR	7,400	257.000	1,901,800.000	
	SHIN CORP PCL	100,200	47.750	4,784,550.000	
	CHAROEN POKPHAND FOODS PCL	133,500	24.900	3,324,150.000	
	ADVANCED INFO SERVICE PCL	47,200	192.500	9,086,000.000	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	318,620	12.600	4,014,612.000	
	PTT PCL	453,000	36.000	16,308,000.000	
	THAI UNION GROUP PCL-NVDR	146,400	13.100	1,917,840.000	
	LAND AND HOUSES PCL NVDR	367,800	7.200	2,648,160.000	
	SIAM CEMENT PCL NVDR	32,250	324.000	10,449,000.000	
	AIRPORTS OF THAILAND PCL-NVDR	175,300	57.250	10,035,925.000	
	KASIKORNBANK PCL - FOREIGN	56,600	96.000	5,433,600.000	

	CENTRAL PATTANA PCL NVDR	73,700	48.500	3,574,450.000	
	BANGKOK DUSIT MEDICAL SERVICES NVDR	422,100	20.300	8,568,630.000	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR	23,900	117.000	2,796,300.000	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	126,510	19.000	2,403,690.000	
	THAI OIL PCL NVDR	31,900	34.750	1,108,525.000	
	CP ALL PCL NVDR	228,100	64.250	14,655,425.000	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL	236,000	10.300	2,430,800.000	
	PTT EXPLORATION & PRODUCTION PCL NVDR	49,745	79.750	3,967,163.750	
	TOTAL ACCESS COMMUNICATION PCL	13,200	40.250	531,300.000	
	INDORAMA VENTURES PCL NVDR	53,622	24.800	1,329,825.600	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	78,808	34.750	2,738,578.000	
	ENERGY ABSOLUTE PCL NVDR	44,500	36.500	1,624,250.000	
	BANGKOK EXPRESSWAY & METRO PCL NVDR	239,700	8.450	2,025,465.000	
	B GRIMM POWER PCL NVDR	15,800	44.750	707,050.000	
	GULF ENERGY DEVELOPMENT PCL NVDR	24,400	178.500	4,355,400.000	
	OSOTSPA PCL NVDR	26,700	38.000	1,014,600.000	
	CENTRAL RETAIL CORP PCL NVDR	61,433	34.000	2,088,722.000	
	SRISAWAD POWER 1979 PCL NVDR	17,300	51.750	895,275.000	
	MUANGTHAI CAPITAL PCL NVDR	30,700	44.500	1,366,150.000	
	GLOBAL POWER SYNERGY CO LTD NVDR	25,500	68.250	1,740,375.000	
	タイ・パーツ 小計	6,457,943		146,205,256.050 (482,477,345)	
チェコ・コルナ	KOMERCNI BANKA AS	2,492	566.000	1,410,472.000	
	CEZ	8,001	442.500	3,540,442.500	
	MONETA MONEY BANK AS	20,973	57.300	1,201,752.900	
	チェコ・コルナ 小計	31,466		6,152,667.400 (27,010,210)	
チリ・ペソ	BANCO SANTANDER CHILE	2,799,658	35.300	98,827,927.400	
	BANCO DE CREDITO E INVERSIONES	1,491	29,205.000	43,544,655.000	
	BANCO DE CHILE	1,930,773	74.100	143,070,279.300	
	EMPRESAS CMPC SA	39,074	1,621.100	63,342,861.400	
	EMPRESAS COPEC SA	18,031	5,190.500	93,589,905.500	

	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	5,363	6,410.000	34,376,830.000	
	ENTEL CHILE SA	6,610	4,448.900	29,407,229.000	
	ENEL AMERICAS SA	1,665,525	135.800	226,178,295.000	
	COLBUN SA	256,874	116.000	29,797,384.000	
	AGUAS ANDINAS SA	86,853	249.000	21,626,397.000	
	EMBOTELLADORA ANDINA SA	20,026	1,861.000	37,268,386.000	
	LATAM AIRLINES GROUP SA	3,899	2,841.000	11,077,059.000	
	SOCIEDAD QUIMICA Y MINERA DE CHILE SA	4,010	19,299.000	77,388,990.000	
	SACI FALABELLA	26,852	2,100.000	56,389,200.000	
	ITAU CORPBANCA	1,236,977	2.390	2,956,375.030	
	CENCOSUD SA	73,205	940.000	68,812,700.000	
	ENEL CHILE SA	949,772	65.500	62,210,066.000	
チリ・ペソ 小計		9,124,993		1,099,864,539.630 (141,992,512)	
トルコ・リラ	AKBANK TAS	91,171	6.120	557,966.520	
	ANADOLU EFES BIRACILIK VE MALT SANAYII AS	3,573	18.600	66,457.800	
	ARCELIK	801	15.200	12,175.200	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	9,192	25.100	230,719.200	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIKALARI TAS	35,230	7.610	268,100.300	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	4,668	56.900	265,609.200	
	KOC HOLDING AS	30,217	15.200	459,298.400	
	TURK HAVA YOLLARI	43,005	9.800	421,449.000	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	54,966	13.060	717,855.960	
	TURKIYE GARANTI BANKASI AS	77,350	8.630	667,530.500	
	TURKIYE IS BANKASI	69,478	5.090	353,643.020	
	TUPRAS TURKIYE PETROL RAFINE	7,264	92.900	674,825.600	
	HACI OMER SABANCI HOLDING AS	21,360	7.670	163,831.200	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	19,176	51.650	990,440.400	
TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	3,040	18.360	55,814.400		
トルコ・リラ 小計		470,491		5,905,716.700 (95,141,096)	
ハンガリー・フォロント	RICHTER GEDEON NYRT	4,407	6,595.000	29,064,165.000	
	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NYRT	17,955	2,044.000	36,700,020.000	
	OTP BANK NYRT	8,915	8,890.000	79,254,350.000	
ハンガリー・フォロント 小計		31,277		145,018,535.000 (48,537,704)	

パキスタン・ルビー	MCB BANK LTD	12,400	154.500	1,915,800.000	
	OIL & GAS DEVELOPMENT CO LTD	21,868	94.690	2,070,680.920	
	HABIB BANK LTD	19,300	109.050	2,104,665.000	
パキスタン・ルビー 小計		53,568		6,091,145.920 (3,959,245)	
フィリピン・ペソ	AYALA LAND INC	306,200	32.000	9,798,400.000	
	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	109,630	41.950	4,598,978.500	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAND	24,820	57.050	1,415,981.000	
	AYALA CORP	8,273	498.000	4,119,954.000	
	GLOBE TELECOM INC	1,555	2,160.000	3,358,800.000	
	INTERNATIONAL CONTAINER TERM SERVICES INC	29,100	73.750	2,146,125.000	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	92,160	54.500	5,022,720.000	
	JOLLIBEE FOODS CORP	9,570	120.000	1,148,400.000	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	56,575	36.300	2,053,672.500	
	BDO UNIBANK INC	91,273	98.500	8,990,390.500	
	MEGAWORLD CORP	198,000	2.720	538,560.000	
	PLDT INC	2,265	1,100.000	2,491,500.000	
	ROBINSONS LAND CORP	94,000	13.740	1,291,560.000	
	SECURITY BANK CORP	11,310	105.000	1,187,550.000	
	SM PRIME HOLDINGS INC	391,875	29.200	11,442,750.000	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	41,490	122.000	5,061,780.000	
	SM INVESTMENTS CORP	10,638	870.000	9,255,060.000	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CORP	352,900	2.490	878,721.000	
	ABOITIZ POWER CORP	51,000	27.250	1,389,750.000	
MANILA ELECTRIC COMPANY	14,800	266.200	3,939,760.000		
GT CAPITAL HOLDINGS INC	2,411	399.000	961,989.000		
フィリピン・ペソ 小計		1,899,845		81,092,401.500 (173,537,739)	
ブラジル・リアル	BRF SA	19,892	18.040	358,851.680	
	VALE SA	123,921	43.280	5,363,300.880	
	RAIA DROGASIL SA	9,200	101.960	938,032.000	
	TIM PARTICIPACOES SA	29,000	13.310	385,990.000	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	9,450	28.340	267,813.000	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	5,200	25.260	131,352.000	
	BANCO DO BRASIL SA	35,600	29.650	1,055,540.000	
	INVESTIMENTOS ITAU SA	180,760	9.240	1,670,222.400	
	LOJAS AMERICANAS SA	31,874	21.300	678,916.200	
	GERDAU SA	49,530	10.700	529,971.000	

CIA BRASILEIRA DE DISTRIBUICAO	6,506	63.300	411,829.800	
PETROLEO BRASILEIRO SA	146,810	16.860	2,475,216.600	
PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	24,600	19.420	477,732.000	
PETROLEO BRASILEIRO SA	166,112	16.820	2,794,003.840	
COGNA EDUCACAO	64,247	4.580	294,251.260	
CCR SA	53,920	12.810	690,715.200	
WEG SA	34,072	38.300	1,304,957.600	
BANCO BRADESCO SA PRAF	159,350	22.390	3,567,846.500	
BANCO BRADESCO SA	46,841	20.680	968,671.880	
CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	19,506	7.170	139,858.020	
SUZANO SA	19,075	35.400	675,255.000	
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	188,747	23.500	4,435,554.500	
PORTO SEGURO SA	4,600	48.250	221,950.000	
B2W CIA DIGITAL	9,100	57.730	525,343.000	
BRASKEM SA	10,330	16.290	168,275.700	
ENGIE BRASIL SA	11,087	39.270	435,386.490	
LOCALIZA RENT A CAR	27,289	30.150	822,763.350	
TELEFONICA BRASIL S.A.	18,028	50.800	915,822.400	
LOJAS RENNER SA	34,837	36.580	1,274,337.460	
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	25,004	14.240	356,056.960	
COSAN SA	5,100	51.570	263,007.000	
EQUATORIAL ENERGIA SA	41,700	18.330	764,361.000	
EMBRAER SA	21,160	9.630	203,770.800	
BR MALLS PARTICIPACOES SA	29,465	9.450	278,444.250	
JBS SA	45,300	19.000	860,700.000	
CIA ENERGETICA DE MINAS GERAIS	27,549	9.170	252,624.330	
CIA DE SANEAMENTO BASICO DO ESTADO DE SAO PAULO	9,398	41.780	392,648.440	
MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS IMOBILIARIOS SA	5,040	19.560	98,582.400	
HYPERA SA	12,900	31.460	405,834.000	
B3 SA-BRASIL BOLSA BAICAO	82,616	39.010	3,222,850.160	
MAGAZINE LUIZA SA	30,100	41.650	1,253,665.000	
CIELO SA	46,507	4.830	224,628.810	
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	29,600	25.780	763,088.000	
NOTRE DAME INTERMEDICA PARTICIPACOES SA	20,600	52.150	1,074,290.000	
HAPVIDA PARTICIPACOES E INVESTIMENTOS SA	7,700	48.860	376,222.000	

	ATACADAO DISTRIBUICAO COMERCIO E INDUSTRIA LTDA	16,300	20.000	326,000.000	
	AMBEV SA	185,495	12.100	2,244,489.500	
	NATURA &CO HOLDING SA	27,000	28.980	782,460.000	
	RUMO SA	45,200	19.470	880,044.000	
	IRB BRASIL RESSEGUROS S/A	25,000	10.100	252,500.000	
	ブラジル・リアル 小計	2,278,218		49,256,026.410 (1,043,242,639)	
ポーランド・ ズロチ	BANK MILLENNIUM SA	5,536	3.310	18,324.160	
	MBANK	668	229.000	152,972.000	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	4,407	69.340	305,581.380	
	BANK PEKAO SA	6,811	55.760	379,781.360	
	ORANGE POLSKA SA	29,777	6.855	204,121.330	
	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	10,316	64.860	669,095.760	
	LPP SA	57	5,635.000	321,195.000	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	1,003	167.800	168,303.400	
	CD PROJEKT RED SA	2,749	329.000	904,421.000	
	POWSZECHNA KASA OSZCZEDNOSCI BANK POLSKI SA	33,598	22.680	762,002.640	
	CCC SA	2,025	35.400	71,685.000	
	GRUPA LOTOS SA	3,978	63.200	251,409.600	
	POLSKIE GORNICtwo NAFTOWE I GAZOWNICTWO SA	82,178	3.620	297,484.360	
	CYFROWY POLSAT SA	12,485	25.800	322,113.000	
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	41,693	4.457	185,825.700	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZEN SA	23,409	28.950	677,690.550	
	DINO POLSKA SA	1,797	168.600	302,974.200	
	AMREST HOLDINGS SE	4,400	24.850	109,340.000	
	ポーランド・ズロチ 小計	266,887		6,104,320.440 (158,651,288)	
マレーシア・ リングギット	AMMB HOLDINGS BHD	84,400	2.960	249,824.000	
	GENTING PLANTATIONS BHD	14,100	9.450	133,245.000	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	196,100	3.520	690,272.000	
	DIGI.COM BHD	120,800	4.470	539,976.000	
	MALAYSIA AIRPORTS HOLDINGS BHD	58,820	4.400	258,808.000	
	RHB BANK BHD	57,780	4.690	270,988.200	
	HAP SENG CONSOLIDATED BHD	34,400	7.330	252,152.000	
	TOP GLOVE CORP BHD	56,300	6.500	365,950.000	

GAMUDA BHD	69,600	3.160	219,936.000		
GENTING BHD	68,600	3.700	253,820.000		
YTL CORP BHD	107,010	0.785	84,002.850		
HONG LEONG FINANCIAL GROUP BHD	8,756	12.660	110,850.960		
HONG LEONG BANK BHD	23,708	13.340	316,264.720		
IJM CORP BHD	108,060	1.780	192,346.800		
IOI CORP BHD	55,613	3.860	214,666.180		
KUALA LUMPUR KEPONG BHD	12,800	20.700	264,960.000		
FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	8,800	31.500	277,200.000		
MALAYAN BANKING BHD	139,175	7.500	1,043,812.500		
MISC BHD	56,180	7.590	426,406.200		
NESTLE MALAYSIA BHD	2,900	136.900	397,010.000		
PPB GROUP BHD	26,260	16.520	433,815.200		
PETRONAS DAGANGAN BHD	7,600	21.020	159,752.000		
PETRONAS GAS BHD	27,100	15.400	417,340.000		
GENTING MALAYSIA BHD	139,600	2.070	288,972.000		
TELEKOM MALAYSIA BHD	56,700	3.770	213,759.000		
TENAGA NASIONAL BHD	129,450	12.040	1,558,578.000		
QL RESOURCES BHD	37,200	7.950	295,740.000		
DIALOG GROUP BHD	150,444	3.120	469,385.280		
PUBLIC BANK BHD(LLOCAL)	122,030	15.880	1,937,836.400		
AIRASIA GROUP BHD	55,500	0.725	40,237.500		
CARLSBERG BREWERY-MALAY BHD	7,000	24.700	172,900.000		
SIME DARBY BERHAD	153,100	1.830	280,173.000		
HARTALEGA HOLDINGS BHD	76,500	7.470	571,455.000		
AXIATA GROUP BERHAD	89,500	3.560	318,620.000		
MAXIS BHD	91,000	5.160	469,560.000		
PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	81,600	4.820	393,312.000		
IHH HEALTHCARE BHD	66,700	5.090	339,503.000		
WESTPORTS HOLDINGS BHD	14,500	3.660	53,070.000		
PRESS METAL ALUMINIUM HOLDINGS BHD	27,700	3.670	101,659.000		
SIME DARBY PLANTATION BHD	87,600	4.970	435,372.000		
マレーシア・リンギット 小計	2,730,986		15,513,530.790 (388,769,082)		
メキシコ・ペ ソ	ALFA SAB DE CV	86,100	8.710	749,931.000	
	EL PUERTO DE LIVERPOOL SAB DE CV	10,600	62.960	667,376.000	
	GRUPO BIMBO SAB DE CV	72,000	33.460	2,409,120.000	
	GRUMA SAB DE CV	10,385	192.130	1,995,270.050	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INFRAESTRUCTURA	7,760	146.420	1,136,219.200	
	GRUPO CARSO SAB DE CV	9,200	52.620	484,104.000	

	GRUPO FINANCIERO BANORTE SAB DE CV	107,000	67.160	7,186,120.000	
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	32,725	26.190	857,067.750	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	7,555	154.000	1,163,470.000	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO SAB DE CV	52,100	34.780	1,812,038.000	
	ALSEA SAB DE CV	29,400	14.590	428,946.000	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL SURESTE SAB DE CV	10,075	219.230	2,208,742.250	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV	141,352	42.400	5,993,324.800	
	AMERICA MOVIL SAB DE CV	1,311,478	13.950	18,295,118.100	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA SA	73,900	16.810	1,242,259.000	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	15,000	97.950	1,469,250.000	
	WAL-MART DE MEXICO SAB DE CV	204,900	56.430	11,562,507.000	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL PACIFICO SAB DE CV	11,940	128.710	1,536,797.400	
	INFRAESTRUCTURA ENERGETICA NOVA SAB DE CV	18,700	70.210	1,312,927.000	
メキシコ・ペソ	小計	2,212,170		62,510,587.550 (288,798,914)	
ユーロ	ALPHA BANK A.E.	38,328	0.720	27,596.160	
	NATIONAL BANK OF GREECE	26,348	1.272	33,514.650	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	8,146	11.880	96,774.480	
	FF GROUP	3,130	0.000	0.000	
	EUROBANK ERGASIAS SERVICES	74,845	0.400	29,938.000	
	MOTOR OIL HELLAS CORINTH REFIN	2,265	14.250	32,276.250	
	OPAP SA	9,184	7.200	66,124.800	
	JUMBO SA	5,430	14.380	78,083.400	
	TITAN CEMENT INTERNATIONAL SA	2,700	11.000	29,700.000	
ユーロ	小計	170,376		394,007.740 (46,599,295)	
韓国・ウォン	CHEIL WORLDWIDE INC	3,354	16,900.000	56,682,600.000	
	HYUNDAI MOTOR CO LTD- 2ND PFD	879	64,700.000	56,871,300.000	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANC	1,375	183,000.000	251,625,000.000	
	DB INSURANCE CO LTD	1,628	37,250.000	60,643,000.000	
	COWAY CO LTD	1,755	63,900.000	112,144,500.000	
	KT&G CORP	4,951	78,200.000	387,168,200.000	
	S-1 CORPORATION	487	82,600.000	40,226,200.000	

KOREA GAS CORP	2,607	25,350.000	66,087,450.000	
CJ CORP	309	73,100.000	22,587,900.000	
KAKAO CORP	2,102	161,000.000	338,422,000.000	
CJ ENM CO LTD	563	111,900.000	62,999,700.000	
DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE	3,183	17,100.000	54,429,300.000	
KMW CO LTD	863	61,100.000	52,729,300.000	
SK TELECOM CO LTD	617	194,000.000	119,698,000.000	
DAELIM INDUSTRIAL CO	722	75,100.000	54,222,200.000	
MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD	22,372	5,150.000	115,215,800.000	
NCSOFT CORPORATION	670	650,000.000	435,500,000.000	
LG UPLUS CORP	6,176	11,950.000	73,803,200.000	
DAEWOO ENGINEERING & CONSTRUCT	5,023	3,145.000	15,797,335.000	
POSCO INTERNATIONAL CORP	1,634	13,750.000	22,467,500.000	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD	380	1,215,000.000	461,700,000.000	
LG CHEM LTD	1,821	324,000.000	590,004,000.000	
LG CHEM LTD	354	155,000.000	54,870,000.000	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD	78	664,000.000	51,792,000.000	
SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD	18,438	29,050.000	535,623,900.000	
S-OIL CORP	1,392	68,700.000	95,630,400.000	
HANWHA SOLUTIONS CORPORATION	3,234	14,100.000	45,599,400.000	
MERITZ SECURITIES CO LTD	13,412	2,905.000	38,961,860.000	
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	2,560	28,750.000	73,600,000.000	
POSCO CHEMICAL CO LTD	683	47,400.000	32,374,200.000	
LOTTE CHEMICAL CORPORATION	837	183,500.000	153,589,500.000	
HOTEL SHILLA CO LTD	1,053	74,900.000	78,869,700.000	
KOREA SHIPBUILDING & OFFSHORE ENGINEERING CO LTD	1,835	85,400.000	156,709,000.000	
HYUNDAI MOBIS	2,866	181,000.000	518,746,000.000	
SK HYNIX INC	21,544	84,100.000	1,811,850,400.000	
HYUNDAI ENGINEERING & CONSTRUCTION CO LTD	2,224	30,650.000	68,165,600.000	
HYUNDAI MOTOR CO	744	60,700.000	45,160,800.000	
HYUNDAI MOTOR CO	6,235	99,700.000	621,629,500.000	
HYUNDAI STEEL CO	4,476	20,150.000	90,191,400.000	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	6,478	7,820.000	50,657,960.000	
KCC CORP	51	152,500.000	7,777,500.000	
KIA MOTORS CORP	10,519	31,000.000	326,089,000.000	

KOREA ZINC CO LTD	292	385,500.000	112,566,000.000	
KOREA ELECTRIC POWER CORP	8,681	20,050.000	174,054,050.000	
HANWHA CORP	137	18,300.000	2,507,100.000	
KOREAN AIR CO LTD	879	20,350.000	17,887,650.000	
OCI COMPANY LTD	528	38,500.000	20,328,000.000	
CJ LOGISTICS	433	135,000.000	58,455,000.000	
KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	390	64,500.000	25,155,000.000	
HLB INC	1,188	97,600.000	115,948,800.000	
LG ELECTRONICS INC	4,601	53,800.000	247,533,800.000	
LOTTE CORP	2,183	26,600.000	58,067,800.000	
LG CORP	3,154	60,300.000	190,186,200.000	
NH INVESTMENT & SECURITIES CO LTD	5,145	8,840.000	45,481,800.000	
GS ENGINEERING & CONSTRUCTION	2,523	22,850.000	57,650,550.000	
NAVER CORP	5,555	166,500.000	924,907,500.000	
HYUNDAI DEPARTMENT STORE CO LTD	234	64,400.000	15,069,600.000	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO LTD	2,133	47,200.000	100,677,600.000	
OTTOGI CORP	6	525,000.000	3,150,000.000	
AMOREPACIFIC GROUP	840	60,500.000	50,820,000.000	
KANGWON LAND INC	3,735	24,100.000	90,013,500.000	
POSCO	3,163	178,000.000	563,014,000.000	
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	4,734	11,650.000	55,151,100.000	
SAMSUNG SDI CO LTD	2,209	250,500.000	553,354,500.000	
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO LTD	2,333	103,000.000	240,299,000.000	
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	187,606	49,250.000	9,239,595,500.000	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES CO LTD	24,294	4,500.000	109,323,000.000	
SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	32,394	42,200.000	1,367,026,800.000	
SHINSEGAE CO LTD	187	241,000.000	45,067,000.000	
YUHAN CORP	1,425	48,550.000	69,183,750.000	
HANON SYSTEMS	4,056	9,100.000	36,909,600.000	
HYUNDAI MARINE & FIRE INSURANCE CO LTD	3,018	24,000.000	72,432,000.000	
GS HOLDINGS CORP	2,116	39,150.000	82,841,400.000	
LG DISPLAY CO LTD	10,838	11,450.000	124,095,100.000	
CELLTRION INC	3,781	209,500.000	792,119,500.000	
HELIXMITH CO LTD	958	76,900.000	73,670,200.000	
HANA FINANCIAL GROUP	12,945	25,300.000	327,508,500.000	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	741	105,000.000	77,805,000.000	
LOTTE SHOPPING CO	550	86,700.000	47,685,000.000	

SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LTD	1,903	50,600.000	96,291,800.000		
AMOREPACIFIC CORP	1,322	172,000.000	227,384,000.000		
AMOREPACIFIC CORP-PREF	368	61,900.000	22,779,200.000		
SAMSUNG CARD CO	875	29,250.000	25,593,750.000		
SK INNOVATION CO LTD	2,496	100,500.000	250,848,000.000		
CJ CHEILJEDANG CORP	484	231,500.000	112,046,000.000		
STX PAN OCEAN CO LTD	1,843	3,115.000	5,740,945.000		
LG INNOTEK CO LTD	698	124,000.000	86,552,000.000		
SK HOLDINGS CO LTD	1,527	179,000.000	273,333,000.000		
KB FINANCIAL GROUP INC	15,915	33,650.000	535,539,750.000		
MEDY-TOX INC	229	194,200.000	44,471,800.000		
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES LTD	4,570	23,000.000	105,110,000.000		
BNK FINANCIAL GROUP INC	5,090	4,810.000	24,482,900.000		
HANMI PHARM CO LTD	151	260,000.000	39,260,000.000		
HANWHA LIFE INSURANCE CO LTD	11,369	1,720.000	19,554,680.000		
FILA HOLDINGS CORP	2,424	34,050.000	82,537,200.000		
E-MART CO LTD	647	111,500.000	72,140,500.000		
GS RETAIL CO LTD	821	31,800.000	26,107,800.000		
HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO LTD	1,508	22,500.000	33,930,000.000		
HDC HYUNDAI DEVELOPMENT CO-ENGINEERING & CONSTRUCTION	1,233	18,250.000	22,502,250.000		
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOLDINGS CO LTD	240	230,500.000	55,320,000.000		
BGF RETAIL CO LTD	253	148,000.000	37,444,000.000		
ORION CORP REPUBLIC OF KOREA	618	113,000.000	69,834,000.000		
NETMARBLE CORP	862	95,000.000	81,890,000.000		
WOORI FINANCIAL GROUP INC	24,632	7,970.000	196,317,040.000		
SAMSUNG SDS CO LTD	1,537	157,500.000	242,077,500.000		
SAMSUNG C&T CORP	3,598	94,200.000	338,931,600.000		
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	725	559,000.000	405,275,000.000		
PEARL ABYSS CORP	314	196,000.000	61,544,000.000		
DOOSAN BOBCAT INC	989	22,600.000	22,351,400.000		
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	1,831	79,700.000	145,930,700.000		
韓国・ウォン 小計	593,541		28,259,574,320.000 (2,509,450,200)		
香港・ドル	JIANGXI COPPER CO LTD	38,000	7.650	290,700.000	
	JIANGSU EXPRESS	36,000	8.500	306,000.000	
	CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD	58,000	3.450	200,100.000	

CHINA MOBILE LIMITED	241,500	61.600	14,876,400.000	
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	49,500	57.500	2,846,250.000	
DATANG INTERNATIONAL POWER GEN	100,000	1.120	112,000.000	
BEIJING ENTERPRISES	19,000	27.750	527,250.000	
HUANENG POWER INTERNATIONAL IN	114,000	2.810	320,340.000	
ALIBABA HEALTH INFORMATION TECHNOLOGY	156,000	15.080	2,352,480.000	
YANZHOU COAL MINING CO LTD	70,000	6.140	429,800.000	
HENGAN INTERNATIONAL GROUP	30,500	65.250	1,990,125.000	
HUADIAN POWER INTL CORP-H	38,000	2.380	90,440.000	
CHINA EASTERN AIRLINES CORP LT	80,000	2.880	230,400.000	
CNOOC LTD	705,000	8.920	6,288,600.000	
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	112,000	6.710	751,520.000	
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LTD	198,000	16.940	3,354,120.000	
CHINA OVERSEAS LAND & INVESTME	149,120	26.800	3,996,416.000	
CHINA RESOURCES LAND LTD	124,888	32.700	4,083,837.600	
CITIC LTD	243,000	8.000	1,944,000.000	
BEIJING CAPITAL INTERNATIONAL	94,000	5.360	503,840.000	
LENOVO GROUP LTD	248,000	4.280	1,061,440.000	
PETRO CHINA CO LTD	872,000	2.980	2,598,560.000	
CHINA UNICOM HONG KONG LTD	256,742	5.260	1,350,462.920	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS CO LTD	58,990	12.720	750,352.800	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL COR	1,053,200	4.010	4,223,332.000	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	37,000	14.400	532,800.000	
KINGDEE INTERNATIONAL SOFTWARE GROUP CO LTD	101,000	10.220	1,032,220.000	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	32,200	82.400	2,653,280.000	
KUNLUN ENERGY COMPANY LTD	170,000	4.740	805,800.000	
TOWNGAS CHINA CO LTD	10,000	3.830	38,300.000	
COSCO SHIPPING PORTS LTD	80,000	4.070	325,600.000	
YUEXIU PROPERTY CO LTD	420,000	1.480	621,600.000	

CHINA MERCHANTS PORT HOLDINGS CO LTD	32,000	9.290	297,280.000	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	146,000	1.670	243,820.000	
(THE) WHARF HOLDINGS LTD	36,000	15.080	542,880.000	
SHENZHEN INTERNATIONAL HOLDING	23,500	14.540	341,690.000	
CHINA EVERBRIGHT LTD	22,000	11.360	249,920.000	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	75,000	25.300	1,897,500.000	
KINGBOARD HOLDINGS LTD	20,000	19.300	386,000.000	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LTD	203,000	11.500	2,334,500.000	
SHENZHEN INVESTMENT LTD	148,000	2.430	359,640.000	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LTD	36,000	41.300	1,486,800.000	
BYD CO LTD	27,000	40.500	1,093,500.000	
CHINA TELECOM CORP LTD	576,000	2.660	1,532,160.000	
CHINA OILFIELD SERVICES LTD	58,000	6.380	370,040.000	
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	520,000	1.010	525,200.000	
SINOTRANS LTD	15,000	1.870	28,050.000	
MAANSHAN IRON & STEEL	16,000	2.390	38,240.000	
CHINA EVERBRIGHT INTERNATIONAL	192,592	4.510	868,589.920	
LEE & MAN PAPER MANUFACTURING LTD	70,000	4.890	342,300.000	
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	287,788	7.300	2,100,852.400	
AVICHINA INDUSTRY & TECHNOLOGY	158,000	2.960	467,680.000	
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS	101,200	8.880	898,656.000	
GREAT WALL MOTOR COMPANY LTD	119,000	5.050	600,950.000	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	284,000	15.680	4,453,120.000	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD	161,000	3.120	502,320.000	
SHANDONG WEIGAO GROUP MEDICAL-H	72,000	10.400	748,800.000	
SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	126,200	13.960	1,761,752.000	
WEICHA I POWER CO LTD	81,440	13.700	1,115,728.000	
CHINA SHIPPING DEVELOPMENT CO	34,000	4.540	154,360.000	
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEMICAL	57,000	1.990	113,430.000	
SHANGHAI INDUSTRIAL	17,000	12.740	216,580.000	

SHENZHEN EXPRESSWAY CO LTD	54,000	8.230	444,420.000	
TINGYI HOLDING CORP	86,000	13.760	1,183,360.000	
TSINGTAO BREWERY CO LTD	16,000	44.450	711,200.000	
GUANGDONG INVESTMENTS LTD	130,000	15.500	2,015,000.000	
CHINA TRADITIONAL CHINESE MEDICINE HOLDINGS CO LTD	148,000	3.450	510,600.000	
CHINA RESOURCES BEER HOLDINGS	61,333	37.600	2,306,120.800	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO LTD	74,000	5.490	406,260.000	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	291,500	11.280	3,288,120.000	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	114,000	28.250	3,220,500.000	
TENCENT HOLDINGS LTD	225,600	391.400	88,299,840.000	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	217,000	76.250	16,546,250.000	
LI NING CO LTD	83,000	24.200	2,008,600.000	
BEIJING ENTERPRISES WATER GROUP LTD	128,000	3.050	390,400.000	
GOME RETAIL HOLDINGS LTD	435,240	0.720	313,372.800	
CHINA POWER INTERNATIONAL	210,000	1.540	323,400.000	
AIR CHINA / HONG KONG	54,000	5.190	280,260.000	
ZTE CORP	20,688	24.700	510,993.600	
SHANGHAI ELECTRIC GROUP CO LTD	126,000	2.140	269,640.000	
CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD	148,500	14.160	2,102,760.000	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO LTD	69,000	2.220	153,180.000	
BANK OF COMMUNICATIONS	379,205	4.780	1,812,599.900	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT HOLDINGS LTD	52,250	6.130	320,292.500	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	30,500	40.450	1,233,725.000	
CHINA CONSTRUCTION BANK	3,800,530	6.270	23,829,323.100	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP HOLDINGS LTD	31,200	87.600	2,733,120.000	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	98,000	5.020	491,960.000	
AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	64,000	8.520	545,280.000	
SSY GROUP LTD	98,000	6.300	617,400.000	
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS LTD	60,000	7.490	449,400.000	

CHINA NATIONAL BLDG MATERIAL	166,000	9.170	1,522,220.000	
BANK OF CHINA LTD	3,081,200	2.990	9,212,788.000	
SHUI ON LAND LTD	50,000	1.350	67,500.000	
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	48,500	29.150	1,413,775.000	
GUANGZHOU R&F PROPERTIES CO LTD	46,000	10.560	485,760.000	
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	147,970	34.800	5,149,356.000	
IND & COMM BK OF CHINA - H	2,523,235	5.210	13,146,054.350	
ZHAOJIN MINING INDUSTRY CO LTD	35,500	8.180	290,390.000	
KINGBOARD LAMINATES HOLDING	56,500	7.400	418,100.000	
CHINA COMMUNICATIONS SERVICES	119,600	5.990	716,404.000	
CHINA COMMUNICATIONS CONSTRUCTION CO LTD	199,000	5.410	1,076,590.000	
CHINA COAL ENERGY CO	43,000	2.230	95,890.000	
HAITIAN INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	12,000	14.500	174,000.000	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC CO LTD	17,000	23.400	397,800.000	
HAIER ELECTRONICS GROUP CO LTD	56,000	19.940	1,116,640.000	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD	296,142	9.600	2,842,963.200	
CHINA MOLYBDENUM CO LTD	132,000	2.320	306,240.000	
CHINA CITIC BANK-H	384,800	3.770	1,450,696.000	
KWG GROUP HOLDINGS LTD	44,500	11.540	513,530.000	
SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	28,600	112.500	3,217,500.000	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	44,000	59.050	2,598,200.000	
FOSUN INTERNATIONAL	126,528	9.330	1,180,506.240	
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP LTD	220,000	5.320	1,170,400.000	
CHINA AOYUAN GROUP LTD	41,000	9.250	379,250.000	
SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD	134,000	2.060	276,040.000	
BOSIDENG INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	150,000	1.980	297,000.000	
SOHO CHINA LTD	111,500	3.590	400,285.000	
KINGSOFT CORP LTD	24,000	24.500	588,000.000	
SINOTRUK HONG KONG LTD	16,000	15.040	240,640.000	
CHINA RAILWAY GROUP LTD	94,000	4.540	426,760.000	
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS LTD	54,000	7.830	422,820.000	

BYD ELECTRONIC INTERNATIONAL CO LTD	25,000	13.860	346,500.000	
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION CORP	87,000	8.790	764,730.000	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	164,000	5.750	943,000.000	
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	106,800	23.900	2,552,520.000	
CHINA EVERGRANDE GROUP	63,000	13.800	869,400.000	
CRRC CORP LTD - H	193,450	4.110	795,079.500	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDINGS LTD	37,000	9.570	354,090.000	
SUN ART RETAIL GROUP LTD	79,000	11.720	925,880.000	
BBMG CORP	46,000	2.030	93,380.000	
CHINA ZHONGWANG HOLDINGS LTD	23,600	1.990	46,964.000	
SINOPHARM GROUP CO	61,600	19.320	1,190,112.000	
CHINA RESOURCES CEMENT	88,000	9.470	833,360.000	
METALLURGICAL CORP OF CHINA LTD	8,000	1.430	11,440.000	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD	126,527	6.760	855,322.520	
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	84,500	3.540	299,130.000	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL BANK	60,000	3.170	190,200.000	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP CORP	91,000	3.900	354,900.000	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD	30,500	13.840	422,120.000	
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	96,000	36.250	3,480,000.000	
YUZHOU PROPERTIES CO LTD	86,000	3.230	277,780.000	
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY SCIENCE AND TECHNOLOGY CO LTD	56,600	6.090	344,694.000	
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	70,500	39.800	2,805,900.000	
NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	35,300	24.600	868,380.000	
CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	302,156	5.710	1,725,310.760	
KAISA GROUP HOLDINGS LTD	126,000	3.000	378,000.000	
XINJIANG GOLDWIND SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	6,800	7.310	49,708.000	

CHINA LESSO GROUP HOLDINGS LTD	31,000	9.750	302,250.000	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD	124,000	3.040	376,960.000	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA	1,080,000	3.120	3,369,600.000	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS LTD	20,000	29.750	595,000.000	
FAR EAST HORIZON LTD	51,000	6.160	314,160.000	
CITIC SECURITIES CO LTD	91,500	14.520	1,328,580.000	
SEAZEN GROUP LIMITED	78,000	7.290	568,620.000	
HAITONG SECURITIES CO LTD	122,000	7.160	873,520.000	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROUP OF CHINA LTD	254,000	2.540	645,160.000	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	12,000	26.300	315,600.000	
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	94,000	5.910	555,540.000	
SINOPEC ENGINEERING GROUP CO LTD	123,500	3.380	417,430.000	
CHINA GALAXY SECURITIES CO LTD	84,500	3.870	327,015.000	
HANERGY THIN FILM POWER GROUP	986,000	0.000	0.000	
NEXTEER AUTOMOTIVE GROUP LTD	20,000	4.420	88,400.000	
CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS CO LTD	323,000	0.000	0.000	
GREENTOWN SERVICE GROUP CO LTD	30,000	8.870	266,100.000	
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO LTD	26,000	11.720	304,720.000	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA CO LTD	318,000	4.700	1,494,600.000	
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING LTD	20,000	58.250	1,165,000.000	
GENSCRIPT BIOTECH CORP	32,000	13.240	423,680.000	
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLDINGS CO LTD	52,000	32.600	1,695,200.000	
ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD	63,000	4.930	310,590.000	
PING AN HEALTHCARE AND TECHNOLOGY CO LTD	11,300	85.850	970,105.000	
CHINA EDUCATION GROUP HOLDINGS LTD	19,000	10.680	202,920.000	
A-LIVING SERVICES CO LTD	16,000	39.100	625,600.000	
CHINA TOWER CORP LTD	1,674,000	1.710	2,862,540.000	

XIAOMI CORP	413,400	10.140	4,191,876.000	
WUXI APPTec CO LTD	4,800	105.400	505,920.000	
MEITUAN DIANPING	40,100	97.250	3,899,725.000	
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDING LTD	10,000	31.800	318,000.000	
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	144,000	4.520	650,880.000	
INNOVENT BIOLOGICS INC	40,000	34.150	1,366,000.000	
CHINA CINDA ASSET MANAGEMENT CO LTD	456,000	1.480	674,880.000	
LOGAN PROPERTY HOLDINGS CO LTD	64,000	12.760	816,640.000	
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS LTD	69,500	34.950	2,429,025.000	
CHINA EAST EDUCATION HOLDINGS LTD	28,000	12.100	338,800.000	
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	29,000	9.050	262,450.000	
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	16,000	28.400	454,400.000	
CHINA VANKE CO LTD-H	56,361	26.100	1,471,022.100	
LUYE PHARMA GROUP LTD	53,000	4.000	212,000.000	
HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	24,000	15.180	364,320.000	
CGN POWER CO LTD	357,000	1.840	656,880.000	
BAIC MOTOR CORP LTD	82,000	3.230	264,860.000	
GF SECURITIES CO LTD	28,600	8.650	247,390.000	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD	21,600	16.840	363,744.000	
HUATAI SECURITIES CO LTD	72,600	12.440	903,144.000	
3SBIO INC	39,500	8.640	341,280.000	
LEGEND HOLDINGS CORP	13,500	9.490	128,115.000	
CHINA RESOURCES PHARMACEUTICAL GROUP LTD	28,000	4.890	136,920.000	
CHINA HUARONG ASSET MANAGEMENT CO LTD	521,000	0.950	494,950.000	
CHINA LITERATURE LTD	6,000	31.200	187,200.000	
DALI FOODS GROUP CO LTD	78,000	4.920	383,760.000	
CHINA RAILWAY SIGNAL & COMMUNICATION CORP LTD	27,000	3.900	105,300.000	
CHINA REINSURANCE GROUP CORP	26,000	0.940	24,440.000	
BOC AVIATION LTD	4,000	48.600	194,400.000	
ZHONGAN ONLINE P&C INSURANCE CO LTD	8,700	26.600	231,420.000	
CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CORP LTD	38,000	11.720	445,360.000	

	WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	32,500	114.700	3,727,750.000	
香港・ドル 小計		36,260,775		365,441,822.010 (5,101,567,829)	
台湾・ドル	ACCTON TECHNOLOGY CORP	21,000	178.500	3,748,500.000	
	ACER INC	140,532	15.900	2,234,458.800	
	ASUSTEK COMPUTER INC	27,554	197.500	5,441,915.000	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	16,616	217.500	3,613,980.000	
	ASIA CEMENT CORP	93,928	42.150	3,959,065.200	
	WALSIN TECHNOLOGY CORP	9,000	180.000	1,620,000.000	
	TAIWAN BUSINESS BANK	208,779	10.450	2,181,740.550	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMICONDUCTOR CORP	41,000	62.900	2,578,900.000	
	MICRO-STAR INTERNATIONAL CO LTD	25,000	87.800	2,195,000.000	
	CHICONY ELECTRONICS CO LTD	20,975	76.100	1,596,197.500	
	QUANTA COMPUTER INC	105,858	61.800	6,542,024.400	
	HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	32,070	40.650	1,303,645.500	
	EVA AIRWAYS CORP	84,125	10.250	862,281.250	
	CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	25,760	197.500	5,087,600.000	
	CHANG HWA COMMERCIAL BANK	234,771	19.700	4,624,988.700	
	CHINA AIRLINES	68,156	7.220	492,086.320	
	CHENG SHIN RUBBER INDUSTRY CO	69,169	32.550	2,251,450.950	
	CHINA STEEL CORP	467,058	19.700	9,201,042.600	
	CHINA LIFE INSURANCE CO LTD/TAIWAN	95,994	19.200	1,843,084.800	
	ADVANTECH CO LTD	13,889	259.500	3,604,195.500	
	COMPAL ELECTRONICS INC	162,304	18.300	2,970,163.200	
	DELTA ELECTRONICS INC	75,663	128.000	9,684,864.000	
	NANYA TECHNOLOGY CORP	33,000	62.000	2,046,000.000	
	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	142,327	108.000	15,371,316.000	
	AU OPTRONICS CORP	391,194	7.440	2,910,483.360	
	TAIWAN MOBILE CO LTD	62,800	104.500	6,562,600.000	
	EVERGREEN MARINE CORP	98,820	10.200	1,007,964.000	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	109,824	24.700	2,712,652.800	
	FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	11,307	138.500	1,566,019.500	
	ECLAT TEXTILE CO LTD	7,322	270.000	1,976,940.000	
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	24,285	185.000	4,492,725.000		
FORMOSA PLASTICS CORP	174,633	81.900	14,302,442.700		
FORMOSA TAFFETA CO LTD	19,000	32.100	609,900.000		

FORMOSA CHEMICALS & FIBRE CO	142,594	71.000	10,124,174.000	
GIANT MANUFACTURING	11,151	138.500	1,544,413.500	
MEDIATEK INC	59,507	350.000	20,827,450.000	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD	251,936	39.200	9,875,891.200	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	331,459	18.700	6,198,283.300	
HOTAI MOTOR CO LTD	12,000	501.000	6,012,000.000	
FAR EASTONE TELECOMMUNICATIONS CO LTD	69,000	64.100	4,422,900.000	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	404,141	16.300	6,587,498.300	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	297,941	37.800	11,262,169.800	
CHINA DEPT FINANCIAL HOLDING	445,403	8.130	3,621,126.390	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO LTD	419,545	25.850	10,845,238.250	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	483,225	73.900	35,710,327.500	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LTD	423,495	29.150	12,344,879.250	
LARGAN PRECISION CO LTD	3,220	3,685.000	11,865,700.000	
TAISHIN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	428,593	12.250	5,250,264.250	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING CO	483,061	8.610	4,159,155.210	
INVENTEC CO LTD	88,005	23.150	2,037,315.750	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	93,845	42.500	3,988,412.500	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	471,443	11.600	5,468,738.800	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD	721,048	18.650	13,447,545.200	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO LTD	404,852	20.600	8,339,951.200	
POWERTECH TECHNOLOGY INC	35,560	91.400	3,250,184.000	
NAN YA PLASTICS CORP	204,828	58.400	11,961,955.200	
WISTRON CORP	135,916	25.250	3,431,879.000	
POU CHEN CORP	65,990	28.100	1,854,319.000	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CORP	191,297	69.000	13,199,493.000	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	21,392	288.000	6,160,896.000	
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	48,480	82.300	3,989,904.000	
PHISON ELECTRONICS CORP	5,658	277.500	1,570,095.000	

	RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	28,393	41.450	1,176,889.850	
	RUENTEX INDUSTRIES LTD	11,829	68.000	804,372.000	
	FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	45,588	54.300	2,475,428.400	
	STANDARD FOODS CORP	25,639	62.900	1,612,693.100	
	SYNNEX TECHNOLOGY INTERNATIONAL CORP	47,899	37.350	1,789,027.650	
	TAIWAN CEMENT CORP	200,684	41.000	8,228,044.000	
	TATUNG CO LTD	61,000	22.600	1,378,600.000	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR	966,083	279.500	270,020,198.500	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	455,525	14.300	6,514,007.500	
	WINBOND ELECTRONICS CORP	105,000	12.650	1,328,250.000	
	YAGEO CORP	9,160	343.000	3,141,880.000	
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	55,000	31.650	1,740,750.000	
	INNOLUX CORPORATION	281,345	6.090	1,713,391.050	
	WPG HOLDINGS CO LTD	72,203	36.800	2,657,070.400	
	HIWIN TECHNOLOGIES CORP	8,645	231.000	1,996,995.000	
	PEGATRON CORP	78,554	62.000	4,870,348.000	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	4,000	472.000	1,888,000.000	
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	14,000	268.500	3,759,000.000	
	CHAILEASE HOLDING CO LTD	49,029	98.200	4,814,647.800	
	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING LTD	22,385	96.800	2,166,868.000	
	TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL HOLDING	372,674	19.150	7,136,707.100	
	SHANGHAI COMMERCIAL & SAVINGS BANK LTD	138,993	41.100	5,712,612.300	
	WIWYNN CORP	3,000	673.000	2,019,000.000	
	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	137,903	61.500	8,481,034.500	
	GLOBALWAFERS CO LTD	9,000	369.000	3,321,000.000	
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	6,000	211.000	1,266,000.000	
	台湾・ドル 小計	13,077,829		722,561,202.380 (2,601,220,329)	
南アフリカ・ランド	BIDVEST GROUP LTD	10,095	155.000	1,564,725.000	
	CLICKS GROUP LTD	10,858	265.720	2,885,187.760	
	DISCOVERY LTD	13,197	90.850	1,198,947.450	
	GOLD FIELDS LTD	33,591	112.880	3,791,752.080	
	REMGRO LTD	22,862	138.170	3,158,842.540	
	THE FOSCHINI GROUP LTD	7,572	81.800	619,389.600	
	NORTHAM PLATINUM LTD	12,632	81.910	1,034,687.120	

MOMENTUM METROPOLITAN HOLDINGS LTD	39,505	16.010	632,475.050	
EXXARO RESOURCES LTD	7,998	109.500	875,781.000	
CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	1,623	1,071.000	1,738,233.000	
LIBERTY HOLDINGS LTD	5,422	70.150	380,353.300	
MTN GROUP LTD	68,391	51.370	3,513,245.670	
ANGLOGOLD ASHANTI LTD	16,607	380.390	6,317,136.730	
TELKOM SA SOC LTD	7,470	21.510	160,679.700	
FIRSTRAND LTD	134,239	40.610	5,451,445.790	
PSG GROUP LTD	4,909	151.530	743,860.770	
NASPERS LTD	17,442	2,588.600	45,150,361.200	
NEDBANK GROUP LTD	13,424	111.000	1,490,064.000	
PICK'N PAY STORES LTD	14,915	60.180	897,584.700	
RMB HOLDINGS LTD	41,200	52.770	2,174,124.000	
ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	1,871	878.240	1,643,187.040	
SASOL LTD	22,848	74.490	1,701,947.520	
SHOPRITE HOLDINGS LTD	19,218	124.420	2,391,103.560	
MR PRICE GROUP LTD	9,214	136.620	1,258,816.680	
STANDARD BANK GROUP LTD	51,540	113.390	5,844,120.600	
SPAR GROUP LTD/THE	8,076	180.780	1,459,979.280	
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	33,018	30.260	999,124.680	
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LTD	13,148	109.100	1,434,446.800	
ABSA GROUP LTD	30,737	93.730	2,880,979.010	
TIGER BRANDS LTD	7,248	171.150	1,240,495.200	
SANLAM LTD	76,113	55.060	4,190,781.780	
INVESTEC LTD	3,043	38.050	115,786.150	
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	33,470	103.700	3,470,839.000	
KUMBA IRON ORE LTD	3,074	344.000	1,057,456.000	
LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDINGS LTD	80,661	20.350	1,641,451.350	
RMI HOLDINGS	48,213	23.590	1,137,344.670	
VODACOM GROUP PTY LTD	24,927	123.400	3,075,991.800	
NEPI ROCKCASTLE PLC	15,182	85.680	1,300,793.760	
OLD MUTUAL LTD	221,819	11.770	2,610,809.630	
REINET INVESTMENTS SCA	3,931	276.860	1,088,336.660	
PEPKOR HOLDINGS LTD	16,633	12.250	203,754.250	
MULTICHOICE GROUP LTD	15,103	90.000	1,359,270.000	
SIBANYE STILLWATER LTD	91,218	29.100	2,654,443.800	
BID CORP LTD	13,833	248.160	3,432,797.280	
南アフリカ・ランド 小計	1,328,090		131,972,932.960 (791,837,598)	
合計	100,111,343		20,848,698,461 (20,848,698,461)	

(2) 株式以外の有価証券

令和2年4月13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	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	9,465.000	12,683.100	
	タイ・パーツ 小計		9,465.000	12,683.100 (41,854)	
新株予約権証券 合計			9,465	41,854 (41,854)	
投資信託受益証券	ブラジル・リアル	BANCO BTG PACTUAL SA	7,200.000	300,600.000	
		BANCO SANTANDER BRASIL SA	13,600.000	375,088.000	
		ENERGISA SA	6,100.000	254,431.000	
		KLABIN SA	25,200.000	403,200.000	
		SUL AMERICA SA	10,269.000	403,571.700	
	ブラジル・リアル 小計		62,369.000	1,736,890.700 (36,787,345)	
	メキシコ・ペソ	CEMEX SAB DE CV	688,475.000	3,449,259.750	
		COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	23,300.000	2,350,271.000	
		FOMENTO ECONOMICO MEXICANO SAB DE CV	76,300.000	10,917,004.000	
		GRUPO TELEVISIA SAB	103,800.000	2,640,672.000	
MEGACABLE HOLDINGS SAB DE CV		7,300.000	469,025.000		
メキシコ・ペソ 小計		899,175.000	19,826,231.750 (91,597,191)		
投資信託受益証券 合計			961,544	128,384,536 (128,384,536)	
投資証券	メキシコ・ペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	91,800.000	1,950,750.000	
	メキシコ・ペソ 小計		91,800.000	1,950,750.000 (9,012,465)	
	南アフリカ・ランド	FORTRESS REIT LTD	54,518.000	651,490.100	
		GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	99,911.000	1,373,776.250	
		REDEFINE PROPERTIES LTD	152,868.000	408,157.560	
	南アフリカ・ランド 小計		307,297.000	2,433,423.910 (14,600,544)	
投資証券 合計			399,097	23,613,009 (23,613,009)	
合計				152,039,399 (152,039,399)	

(注) 投資信託受益証券、投資証券及び新株予約権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 60銘柄	10.07	-	-	-	15.37
アラブ首長国連邦・ディル ハム	株式 7銘柄	0.32	-	-	-	0.49
イギリス・ポンド	株式 1銘柄	0.06	-	-	-	0.09
インド・ルピー	株式 85銘柄	5.26	-	-	-	8.03
インドネシア・ルピア	株式 28銘柄	0.99	-	-	-	1.51
オフショア・人民元	株式 234銘柄	2.86	-	-	-	4.37
カタール・リアル	株式 12銘柄	0.63	-	-	-	0.96
コロンビア・ペソ	株式 7銘柄	0.17	-	-	-	0.27
サウジアラビア・リアル	株式 33銘柄	1.31	-	-	-	1.99
タイ・バーツ	株式 41銘柄 新株予約権証 券 1銘柄	1.51 -	- 0.00	-	-	2.30
チェコ・コルナ	株式 3銘柄	0.08	-	-	-	0.13
チリ・ペソ	株式 17銘柄	0.44	-	-	-	0.68
トルコ・リラ	株式 15銘柄	0.30	-	-	-	0.45
ハンガリー・フォリント	株式 3銘柄	0.15	-	-	-	0.23
パキスタン・ルピー	株式 3銘柄	0.01	-	-	-	0.02
フィリピン・ペソ	株式 21銘柄	0.54	-	-	-	0.83
ブラジル・レアル	株式 50銘柄 投資信託受益 証券 5銘柄	3.26 -	-	- 0.11	-	5.14
ポーランド・ズロチ	株式 18銘柄	0.50	-	-	-	0.76
マレーシア・リングgit	株式 40銘柄	1.21	-	-	-	1.85
メキシコ・ペソ	株式 19銘柄 投資信託受益 証券 5銘柄 投資証券 1銘柄	0.90 - -	- - -	- 0.29 -	- - 0.03	1.85
ユーロ	株式 9銘柄	0.15	-	-	-	0.22
韓国・ウォン	株式 110銘柄	7.83	-	-	-	11.95
香港・ドル	株式 207銘柄	15.92	-	-	-	24.29
台湾・ドル	株式 88銘柄	8.12	-	-	-	12.39
南アフリカ・ランド	株式 44銘柄 投資証券 3銘柄	2.47 -	- -	- -	- 0.05	3.84

(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)

令和2年4月30日現在

資産総額	113,598,968円
負債総額	61,000円
純資産総額(-)	113,537,968円
発行済数量	108,833,774口
1口当たり純資産額(/)	1.0432円

D I A Mコア資産設計ファンド(積極型)

令和2年4月30日現在

資産総額	205,177,201円
負債総額	639,835円
純資産総額(-)	204,537,366円
発行済数量	201,790,510口
1口当たり純資産額(/)	1.0136円

(参考)

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和2年4月30日現在

資産総額	228,748,357,292円
負債総額	1,083,909,500円
純資産総額(-)	227,664,447,792円
発行済数量	172,882,872,620口
1口当たり純資産額(/)	1.3169円

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

令和2年4月30日現在

資産総額	224,199,549,505円
負債総額	371,460,175円
純資産総額(-)	223,828,089,330円
発行済数量	95,367,867,553口
1口当たり純資産額(/)	2.3470円

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和2年4月30日現在

資産総額	119,691,336,921円
負債総額	889,569,439円
純資産総額(-)	118,801,767,482円
発行済数量	62,310,999,326口
1口当たり純資産額(/)	1.9066円

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和2年4月30日現在

資産総額	335,747,641,940円
負債総額	81,156,570円
純資産総額（ - ）	335,666,485,370円
発行済数量	96,583,257,214口
1口当たり純資産額（ / ）	3.4754円

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

令和2年4月30日現在

資産総額	115,842,845,839円
負債総額	7,165,006,752円
純資産総額（ - ）	108,677,839,087円
発行済数量	57,471,390,264口
1口当たり純資産額（ / ）	1.8910円

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

令和2年4月30日現在

資産総額	42,074,604,742円
負債総額	6,677,595円
純資産総額（ - ）	42,067,927,147円
発行済数量	42,712,890,041口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9849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(2020年4月30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(2020年4月30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。

2020年4月30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	1,147,569,054,025
追加型株式投資信託	858	12,752,574,416,317
単位型公社債投資信託	37	96,812,263,974
単位型株式投資信託	183	1,275,450,528,810
合計	1,104	15,272,406,263,126

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35期事業年度(自2019年4月1日至2020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34期 (2019年3月31日現在)	第35期 (2020年3月31日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金	41,087,475	32,932,013
金銭の信託	18,773,228	28,548,165
有価証券	153,518	996
未収委託者報酬	12,438,085	11,487,393
未収運用受託報酬	3,295,109	4,674,225
未収投資助言報酬	327,064	331,543
未収収益	56,925	11,674
前払費用	573,874	480,129
その他	491,914	2,815,351
流動資産計	77,197,195	81,281,494
固定資産		
有形固定資産		
建物	1,461,316	1,278,455
1 建物	1,096,916	1,006,793
器具備品	1 364,399	1 270,768
建設仮勘定	-	894
無形固定資産		
ソフトウェア	2,411,540	3,524,781
ソフトウェア仮勘定	885,545	3,299,065
1,522,040	221,784	
電話加入権	3,931	3,931
電信電話専用施設利用権	23	-
投資その他の資産		
投資有価証券	9,269,808	9,482,127
関係会社株式	1,611,931	261,361
4,499,196	5,299,196	
長期差入保証金	1,312,328	1,302,402
繰延税金資産	1,748,459	2,508,004
その他	97,892	111,162
固定資産計	13,142,665	14,285,364
資産合計	90,339,861	95,566,859

(単位:千円)

	第34期 (2019年3月31日現在)	第35期 (2020年3月31日現在)
(負債の部)		
流動負債		
預り金	2,183,889	3,702,906
未払金	5,697,942	4,803,140
未払収益分配金	1,053	966
未払償還金	48,968	9,999
未払手数料	4,883,723	4,582,140
その他未払金	764,196	210,034
未払費用	6,724,986	6,673,320
未払法人税等	3,341,238	4,090,268
未払消費税等	576,632	1,338,183
賞与引当金	1,344,466	1,373,328
役員賞与引当金	48,609	65,290
流動負債計	19,917,766	22,046,438
固定負債		
退職給付引当金	1,895,158	2,118,947
時効後支払損引当金	177,851	174,139
固定負債計	2,073,009	2,293,087
負債合計	21,990,776	24,339,526
(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	45,949,372	49,674,383
利益準備金	123,293	123,293
その他利益剰余金	45,826,079	49,551,090
別途積立金	31,680,000	31,680,000
繰越利益剰余金	14,146,079	17,871,090
株主資本計	67,502,329	71,227,341
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	846,755	7
評価・換算差額等計	846,755	7
純資産合計	68,349,085	71,227,333
負債・純資産合計	90,339,861	95,566,859

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	第34期 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)		第35期 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	
	営業収益			
委託者報酬	84,812,585		84,426,075	
運用受託報酬	16,483,356		16,912,305	
投資助言報酬	1,235,553		1,208,954	
その他営業収益	113,622		68,156	
営業収益計		102,645,117		102,615,492
営業費用				
支払手数料	36,100,556		34,980,736	
広告宣伝費	387,028		340,791	
公告費	375		375	
調査費	24,389,003		25,132,268	
調査費	9,956,757		10,586,542	
委託調査費	14,432,246		14,545,725	
委託計算費	936,075		698,723	
営業雑経費	1,254,114		990,002	
通信費	47,007		44,209	
印刷費	978,185		738,330	
協会費	63,558		71,386	
諸会費	22,877		22,790	
支払販売手数料	142,485		113,286	
営業費用計		63,067,153		62,142,897
一般管理費				
給料	10,859,354		10,817,861	
役員報酬	189,198		174,795	
給料・手当	9,098,957		9,087,800	
賞与	1,571,197		1,555,264	
交際費	60,115		40,436	
寄付金	7,255		8,906	
旅費交通費	361,479		320,037	
租税公課	588,172		651,265	
不動産賃借料	1,511,876		1,479,503	
退職給付費用	521,184		505,189	
固定資産減価償却費	590,667		882,526	
福利厚生費	45,292		44,352	
修繕費	16,247		1,843	
賞与引当金繰入額	1,344,466		1,373,328	
役員賞与引当金繰入額	48,609		65,290	
機器リース料	130		233	
事務委託費	3,302,806		3,625,424	
事務用消耗品費	131,074		104,627	
器具備品費	8,112		1,620	
諸経費	188,367		197,094	
一般管理費計		19,585,212		20,119,543
営業利益		19,992,752		20,353,050

(単位:千円)

	第34期 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)		第35期 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	
営業外収益				
受取利息		1,749		4,440
受取配当金		73,517		11,185
時効成立分配金・償還金		8,582		49,164
投資信託償還益		-		5,528
受取負担金		177,066		297,886
雑収入		24,919		7,394
時効後支払損引当金戻入額		19,797		3,473
営業外収益計		305,633		379,073
営業外費用				
為替差損		17,542		19,750
投資信託償還損		-		1
金銭の信託運用損		175,164		169,505
システム解約料		-		31,680
雑損失		5,659		104
営業外費用計		198,365		221,042
経常利益		20,100,019		20,511,082
特別利益				
投資有価証券売却益		353,644		1,169,758
特別利益計		353,644		1,169,758
特別損失				
固定資産除却損	1	19,121	1	16,085
特別損失計		19,121		16,085
税引前当期純利益		20,434,543		21,664,754
法人税、住民税及び事業税		6,386,793		7,045,579
法人税等調整額		71,767		385,835
法人税等合計		6,315,026		6,659,743
当期純利益		14,119,516		15,005,011

(3) 【株主資本等変動計算書】

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
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

第35期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

(単位:千円)

	株主資本								
	資本金	資本剰余金			利益準備金	利益剰余金			株主資本合計
		資本準備金	その他 資本剰余金	資本剰余金 合計		別途 積立金	繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計	
当期首残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	31,680,000	14,146,079	45,949,372	67,502,329
当期変動額									
剰余金の配当							11,280,000	11,280,000	11,280,000
当期純利益							15,005,011	15,005,011	15,005,011
株主資本以外の 項目の当期 変動額(純額)									-
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	3,725,011	3,725,011	3,725,011
当期末残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	31,680,000	17,871,090	49,674,383	71,227,341

	評価・換算差額等		純資産 合計
	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	846,755	846,755	68,349,085
当期変動額			
剰余金の配当			11,280,000
当期純利益			15,005,011
株主資本以外の 項目の当期 変動額(純額)	846,763	846,763	846,763
当期変動額合計	846,763	846,763	2,878,247
当期末残高	7	7	71,227,333

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>
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。

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34期 (2019年3月31日現在)	第35期 (2020年3月31日現在)
建物	229,897	320,020
器具備品	927,688	949,984

(損益計算書関係)

1. 固定資産除却損の内訳

(千円)

	第34期 (自2018年4月1日 至2019年3月31日)	第35期 (自2019年4月1日 至2020年3月31日)
建物	1,550	-
器具備品	439	9,609
ソフトウエア	17,130	6,475

(株主資本等変動計算書関係)

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

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					

第35期(自 2019年4月1日 至 2020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
2019年6月20日 定時株主総会	普通株式	11,280,000	282,000	2019年3月31日	2019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
2020年6月17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
2020年6月17日 定時株主総会	普通 株式	利益 剰余金	12,000,000	300,000	2020年3月31日	2020年6月18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あります。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	-

第35期(2020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	32,932,013	32,932,013	-
(2) 金銭の信託	28,548,165	28,548,165	-
(3) 未収委託者報酬	11,487,393	11,487,393	-
(4) 未収運用受託報酬	4,674,225	4,674,225	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	2,988	2,988	-
資産計	77,644,787	77,644,787	-
(1) 未払手数料	4,582,140	4,582,140	-
負債計	4,582,140	4,582,140	-

(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34期 (2019年3月31日現在)	第35期 (2020年3月31日現在)
非上場株式	276,764	259,369
関係会社株式	4,499,196	5,299,196

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	-

第35期(2020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	32,932,013	-	-	-
(2) 金銭の信託	28,548,165	-	-	-
(3) 未収委託者報酬	11,487,393	-	-	-
(4) 未収運用受託報酬	4,674,225	-	-	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券(投資信託)	996	994	997	-

(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34期の貸借対照表計上額4,499,196千円、第35期の貸借対照表計上額5,299,196千円)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、記載していません。

2. その他有価証券

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276,764千円)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35期(2020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	-	-	-
投資信託	-	-	-
小計			
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	2,988	3,000	11
小計	2,988	3,000	11
合計	2,988	3,000	11

(注)非上場株式(貸借対照表計上額259,369千円)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	-	-	-

第35期(自 2019年4月1日 至 2020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	1,298,377	1,169,758	-
投資信託	159,526	5,528	1

(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、償還によるものであります。

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

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34期 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)	第35期 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)
退職給付債務の期首残高	2,154,607	2,289,044
勤務費用	300,245	302,546
利息費用	1,918	2,087
数理計算上の差異の発生額	10,147	18,448
退職給付の支払額	158,018	187,749
その他	438	1,476
退職給付債務の期末残高	2,289,044	2,422,901

(2) 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34期 (2019年3月31日現在)	第35期 (2020年3月31日現在)
非積立型制度の退職給付債務	2,289,044	2,422,901
未積立退職給付債務	2,289,044	2,422,901
未認識数理計算上の差異	150,568	130,155
未認識過去勤務費用	243,317	173,798
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	1,895,158	2,118,947
退職給付引当金	1,895,158	2,118,947
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	1,895,158	2,118,947

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(千円)

	第34期 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)	第35期 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)
勤務費用	300,245	302,546
利息費用	1,918	2,087
数理計算上の差異の費用処理額	43,920	38,861
過去勤務費用の費用処理額	69,519	69,519
その他	3,640	11,303
確定給付制度に係る退職給付費用	411,963	401,711

(4) 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34期 (2019年3月31日現在)	第35期 (2020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. 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104,720千円、当事業年度103,477千円であります。

(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34期	第35期
	(2019年3月31日現在)	(2020年3月31日現在)
	(千円)	(千円)
繰延税金資産		
未払事業税	173,805	221,053
未払事業所税	10,915	10,778
賞与引当金	411,675	420,513
未払法定福利費	80,253	78,439
未払給与	7,961	10,410
受取負担金	138,994	47,781
運用受託報酬	102,490	331,395
資産除去債務	10,152	14,116
減価償却超過額(一括償却資産)	4,569	50,942
減価償却超過額	125,839	82,684
繰延資産償却超過額(税法上)	135,542	323,132
退職給付引当金	580,297	648,821
時効後支払損引当金	54,458	53,321
ゴルフ会員権評価損	7,360	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
その他	29,494	11,532
その他有価証券評価差額金	-	3
繰延税金資産小計	2,069,527	2,508,004
評価性引当額	-	-
繰延税金資産合計	2,069,527	2,508,004
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	321,067	-
繰延税金負債合計	321,067	-
繰延税金資産の純額	1,748,459	2,508,004

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

(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34期 (2019年3月31日現在)	第35期 (2020年3月31日現在)
流動資産	- 千円	- 千円
固定資産	104,326,078千円	94,605,736千円
資産合計	104,326,078千円	94,605,736千円
流動負債	- 千円	- 千円
固定負債	10,571,428千円	8,278,713千円
負債合計	10,571,428千円	8,278,713千円
純資産	93,754,650千円	86,327,023千円

(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	66,696,733千円	62,885,491千円
顧客関連資産	39,959,586千円	34,810,031千円

(2) 損益計算書項目

	第34期 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)	第35期 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)
営業収益	- 千円	- 千円
営業利益	9,043,138千円	8,954,439千円
経常利益	9,043,138千円	8,954,439千円
税引前当期純利益	9,091,728千円	9,111,312千円
当期純利益	7,489,721千円	7,536,465千円
1株当たり当期純利益	187,243円04銭	188,411円64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	5,241,252千円	5,149,555千円

(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34期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)及び第35期(自 2019年4月1日 至 2020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34期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

該当はありません。

第35期(自 2019年4月1日 至 2020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34期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

該当はありません。

第35期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

該当はありません。

(3) 兄弟会社等

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	-	-
子 会 社	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

第35期(自 2019年4月1日 至 2020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	5,793,912	未払 手数料	1,112,061
								子会社株式 の取得	10,294,840	未払 手数料	1,231,431
子 会 社	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	10,294,840	未払 手数料	1,231,431

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34期 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)	第35期 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)
1株当たり純資産額	1,708,727円13銭	1,780,683円32銭
1株当たり当期純利益金額	352,987円92銭	375,125円27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34期 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)	第35期 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)
当期純利益金額	14,119,516千円	15,005,011千円
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	14,119,516千円	15,005,011千円
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) 通常取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下（4）（5）において同じ。）または子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引または店頭デリバティブ取引を行うこと。
- (4) 委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。
- (5) 上記（3）（4）に掲げるもののほか、委託会社の親法人等または子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

5【その他】

- (1) 定款の変更、事業譲渡又は事業譲受、出資の状況その他の重要事項
該当事項はありません。
- (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

2019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2019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

2020年5月27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
東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 山野 浩 印

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 長谷川 敬 印

監査意見

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2019年4月1日から2020年3月31日までの第35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。

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2020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、全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。

監査意見の根拠

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。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、会社から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。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。

財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、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基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

監査等委員会の責任は、財務報告プロセスの整備及び運用における取締役の職務の執行を監視することにある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による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て、監査報告書にお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。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、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従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。

- ・ 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、監査人は、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、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、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いるかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、監査等委員会に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

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2年5月29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

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 丘本正彦 印
業務執行社員

監査意見

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）の令和1年10月12日から令和2年4月13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。

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）の令和2年4月13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、全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。

監査意見の根拠

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。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、アセットマネジメントOne株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。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。

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。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、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基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による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て、監査報告書にお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。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、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従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・ 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、監査人は、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、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業的前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業的前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、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いるかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

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2年5月29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

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 丘本正彦 印
業務執行社員

監査意見

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）の令和1年10月12日から令和2年4月13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。

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）の令和2年4月13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、全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。

監査意見の根拠

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。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、アセットマネジメントOne株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。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。

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。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、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基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による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て、監査報告書にお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。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、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従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・ 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、監査人は、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、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業的前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業的前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、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いるかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

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。