

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	平成30年7月12日
【発行者名】	アセットマネジメントOne株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 菅野 暁
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目8番2号
【事務連絡者氏名】	三木谷 正直
【電話番号】	03-6774-5100
【届出の対象とした募集内国投資信託 受益証券に係るファンドの名称】	MITO ラップ型ファンド(安定型) MITO ラップ型ファンド(中立型) MITO ラップ型ファンド(積極型) MITO ラップ型ファンド(安定型) 5,000億円を上限とします。
【届出の対象とした募集内国投資信託 受益証券の金額】	MITO ラップ型ファンド(中立型) 5,000億円を上限とします。 MITO ラップ型ファンド(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】

MITO ラップ型ファンド（安定型）

MITO ラップ型ファンド（中立型）

MITO ラップ型ファンド（積極型）

（以下、総称して「MITO ラップ型ファンド」、「MITO ラップ型ファンド（安定型／中立型／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、「MITO ラップ型ファンド（安定型）」は「安定型」、「MITO ラップ型ファンド（中立型）」は「中立型」、「MITO ラップ型ファンド（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「グッドラップ」または「グッドラップ（安定型／中立型／積極型）」という名称を用いる場合があります。また、「MITO ラップ型ファンド（安定型）」の愛称として「グッドラップ（安定型）」、「MITO ラップ型ファンド（中立型）」の愛称として「グッドラップ（中立型）」、「MITO ラップ型ファンド（積極型）」の愛称として「グッドラップ（積極型）」を用いる場合があります。）

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

契約型の追加型証券投資信託の受益権（以下「受益権」といいます。）

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

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

（３）【発行（売出）価額の総額】

各ファンドにつき、5,000億円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

お申込日の翌営業日の基準価額 とします。

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

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

< 基準価額の照会方法等 >

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

各ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

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

(5) 【申込手数料】

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

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

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

当初元本は1口当たり1円です。

(7) 【申込期間】

継続申込期間：平成30年7月13日から平成31年1月11日まで

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

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

(8) 【申込取扱場所】

ファンドのお申込みにかかる取扱い等は販売会社が行っております。

販売会社は、以下の方法でご確認ください。

- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

(9) 【払込期日】

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

(1 0) 【払込取扱場所】

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

払込取扱場所についてご不明な点は、以下の方法でご確認ください。

・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

(1 1) 【振替機関に関する事項】

振替機関は以下の通りです。

・株式会社証券保管振替機構

(1 2) 【その他】

お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

ファンドでは、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、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。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。

<スイッチングについて>

「安定型」「中立型」「積極型」の3つのファンド間でスイッチングを行うことができます。

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。詳しくは販売会社までお問い合わせください。

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。

各ファンドは、別に定める投資信託証券を投資対象とする「ファンド・オブ・ファンズ方式」で運用します。

別に定める投資信託証券とは、以下の投資信託証券をいいます。

国内株式	親投資信託	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド
国内債券	親投資信託	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
先進国株式	親投資信託	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
先進国債券	親投資信託	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
新興国株式	親投資信託	エマージング株式パッシブ・マザーファンド
新興国債券	外国投資信託証券	iシェアーズ J.P.モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券 ETF
世界リート	親投資信託	J-REITインデックスファンド・マザーファンド
	親投資信託	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド
コモディティ	親投資信託	コモディティインデックス・マザーファンド

上記の投資信託証券のうち親投資信託のことを以下「マザーファンド」という場合があります。

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

世界の様々な資産に分散投資することにより、信託財産の中長期的な成長を図ることを目的として運用を行います。

- ・主として、投資信託証券への投資を通じて、国内株式、国内債券、先進国株式、先進国債券、新興国株式、新興国債券、世界リート、コモディティ^(*)等の資産に実質的に投資します。なお、短期金融資産等に直接投資する場合があります。
- ・投資対象となる投資信託証券は、継続的にモニタリングを行い、必要な場合は追加、除外、入替えを行う場合があります。
- ・実質的な組入外貨建資産に対しては、原則として、対円で為替ヘッジを行いません。

(*) コモディティ(商品)への投資に際しては、投資信託証券への投資を通じて、商品指数の動きに概ね連動する投資成果をめざす債券等に実質的に投資を行います。

2

「安定型」、「中立型」、「積極型」の3つのファンドから選択できます。

- ・お客さまのリスク許容度に応じて、目標リスク水準の異なる以下の3つのファンドがあります。

<各ファンドの目標リスク水準>

「安定型」:年率標準偏差 2.5~5.0%程度

「中立型」:年率標準偏差 5.0~8.0%程度

「積極型」:年率標準偏差 8.0~12.0%程度

- ・各ファンド間でスイッチングが可能です。

※目標リスク水準は、各ファンドの基準価額の変動リスクの目安を示したものであり、ポートフォリオを構築する際の目標値として使用します。なお、市場環境等によっては、実際の基準価額の変動が目標リスク水準を上回る場合や下回る場合があります。

※スイッチング時には、税金、購入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。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

3

各資産への投資割合の決定にあたっては、水戸証券株式会社の投資助言を受けます。

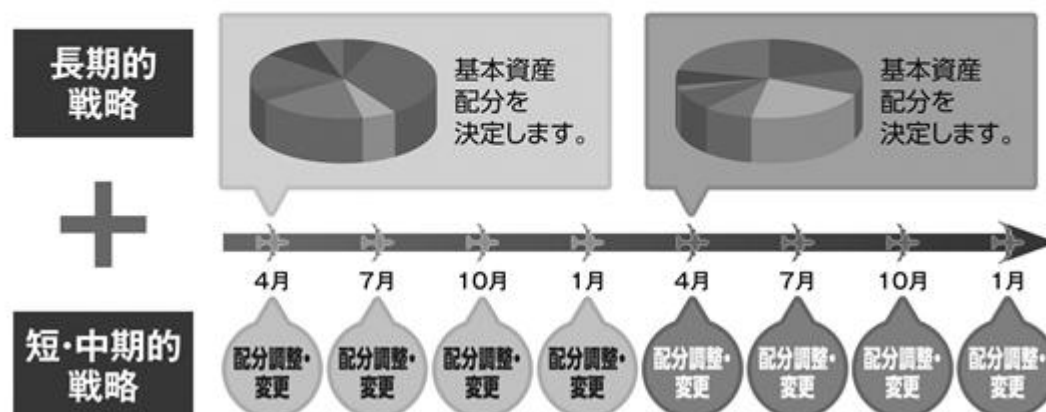
- ・各ファンドの目標リスク水準に応じて、長期的見通しと短・中期的見通しを組み合わせ、市場環境の変化に対応した適切な資産配分をめざします。
- ・長期的視点に基づく資産配分戦略により、基本資産配分を決定します(長期的戦略)。当該戦略は、原則として年1回見直しを行います。
- ・上記に加え、短・中期的視点に基づく資産配分戦略により、市場環境の変化に対応した資産配分を行います(短・中期的戦略)。当該戦略は、原則として四半期毎に見直しを行います。
- ・なお、市場環境に急激な変動があった場合、あるいはそれが予想される場合等には、適宜、資産配分の見直しを行う場合があります。

※市場環境等によっては、一部の資産への投資割合がゼロとなる場合があります。

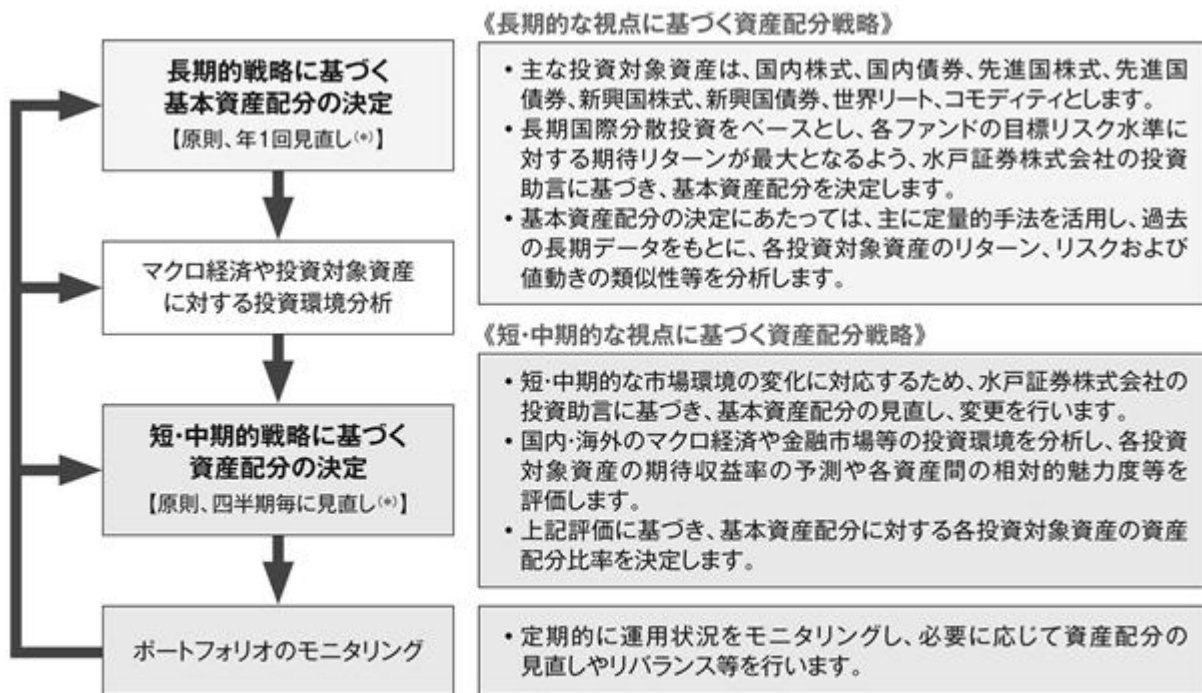
※コモディティへの投資割合は、原則として、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

✦ 資産配分のイメージ

年に1回、長期的戦略に基づき基本資産配分を決定し、それに対して、四半期毎に、短・中期的戦略に基づき機動的な資産配分の調整・変更を行います。



<運用プロセス>



※各資産への投資割合の決定にあたっては、水戸証券株式会社の投資助言を受けます。

(*) 市場環境に急激な変動があった場合、あるいはそれが予想される場合等には、適宜、資産配分の見直しを行う場合があります。

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
	海外	不動産投信
追加型投信	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、国内およ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	グローバル (日本含む)		
	年2回	日本		
	年4回	北米		
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)	欧州	ファミリー ファンド	あり ()
	年12回 (毎月)	アジア		
	日々	オセアニア		
不動産投信	その他 ()	中南米	ファンド・オブ・ ファンズ	なし
その他資産 (投資信託証券 (資産複合(株 式、債券、不動 産投信)資産配 分変更型))		アフリカ		
		中近東 (中東)		
資産複合 () 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

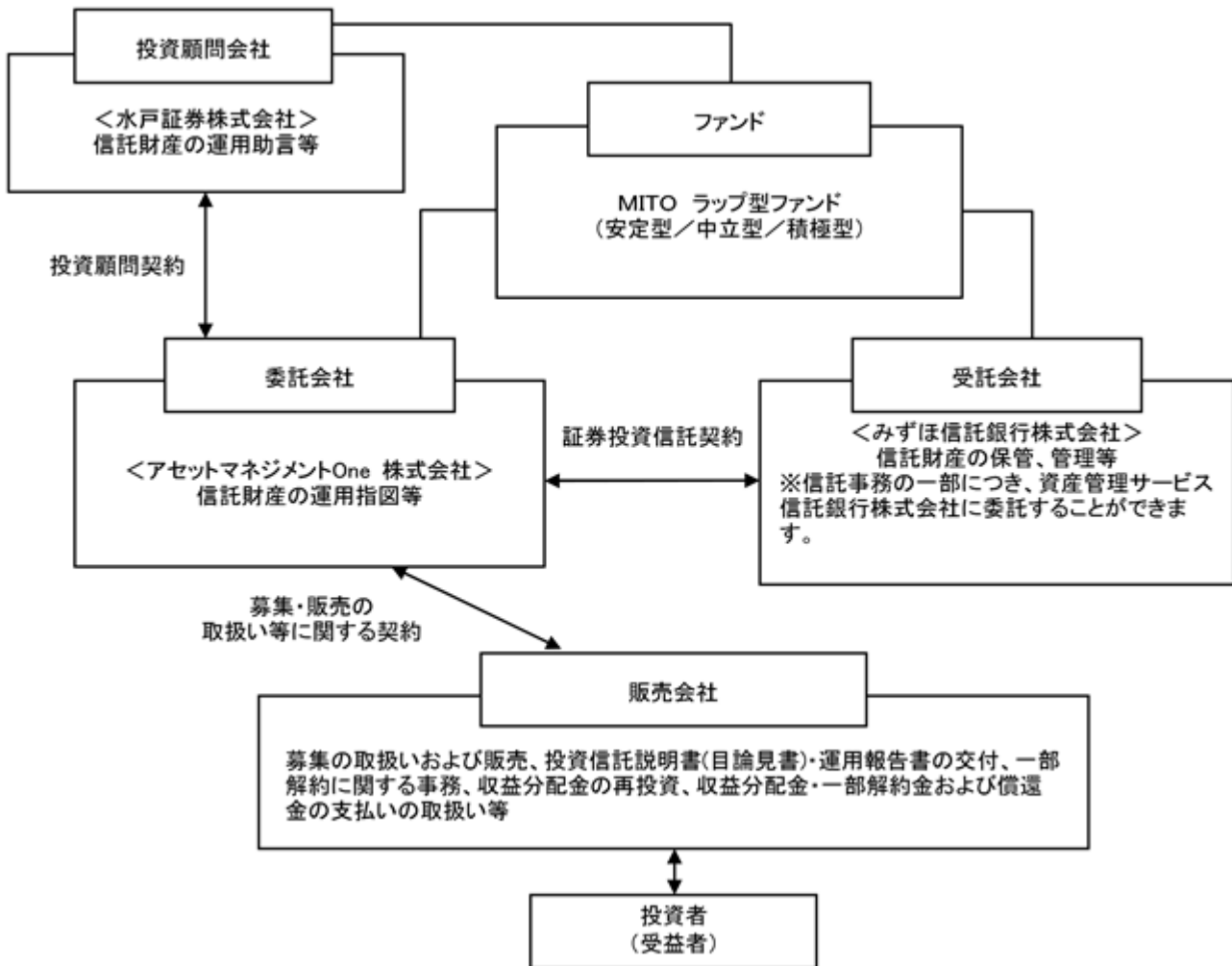
<p>その他資産 （投資信託証券（資産複合 （株式、債券、不動産投信） 資産配分変更型））</p>	<p>目論見書または投資信託約款において、投資信託証券への投資を通じて、主として複数の資産（株式、債券、不動産投信）を実質的な投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行う旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないものをいいます。</p> <p>（注）商品分類表の投資対象資産は資産複合に分類され、属性区分表の投資対象資産はその他資産（投資信託証券（資産複合（株式、債券、不動産投信）資産配分変更型））に分類されます。</p>
<p>年 1 回</p>	<p>目論見書または投資信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。</p>
<p>グローバル（日本含む）</p>	<p>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。</p>
<p>ファンド・オブ・ファンズ</p>	<p>「投資信託等の運用に関する規則」第2条に規定するファンド・オブ・ファンズをいいます。</p>
<p>為替ヘッジなし</p>	<p>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。</p>

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

(2) 【ファンドの沿革】

平成27年12月1日 信託契約締結、ファンドの設定、ファンドの運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】



- ・「証券投資信託契約」の概要

委託会社と受託会社との間においては、各ファンドにかかる証券投資信託契約を締結しております。当該契約の内容は、各ファンドの運用の基本方針、投資対象、投資制限、受益者の権利等を規定したものです。

- ・「募集・販売の取扱い等に関する契約」の概要

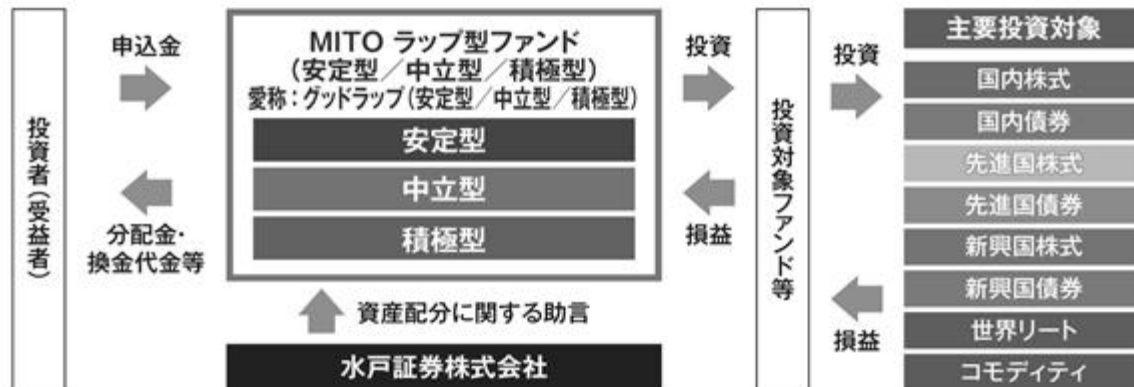
委託会社と販売会社との間においては、募集・販売の取扱い等に関する契約を締結しております。当該契約の内容は、証券投資信託の募集・販売の取扱い、一部解約に関する事務、収益分配金の再投資、収益分配金・一部解約金および償還金の受益者への支払い等に関する包括的な規則を定めたものです。

- ・「投資顧問契約」の概要

委託会社と投資顧問会社（水戸証券株式会社）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。

ファンド・オブ・ファンズ方式とは

各ファンドは、「ファンド・オブ・ファンズ方式」により運用を行います。「ファンド・オブ・ファンズ方式」とは、複数のファンドを投資対象とし、それらを組み合わせて運用する仕組みです。



委託会社の概況

名称：アセットマネジメントOne株式会社

本店の所在の場所：東京都千代田区丸の内一丁目8番2号

資本金の額

20億円（平成30年4月27日現在）

委託会社の沿革

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

大株主の状況

（平成30年4月27日現在）

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

1：A種種類株式（15,510株）を含みます。

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

<基本方針>

信託財産の成長を図ることを目的として、運用を行います。

<投資対象>

別に定める投資信託証券を主要投資対象とします。なお、短期金融資産等に直接投資する場合があります。

<投資態度>

主として、別に定める投資信託証券への投資を通じて、実質的に、国内株式、国内債券、先進国株式、先進国債券、新興国株式、新興国債券、世界リート、コモディティ^(*)等の各資産へ投資を行い、世界の様々な資産に分散投資を行います。なお、上記のほか、短期金融資産等に直接投資する場合があります。

(*)コモディティ（商品）への投資に際しては、投資信託証券への投資を通じて、商品指数の動きに概ね連動する投資成果をめざす債券等を実質的に投資を行います。

各資産への投資割合は、目標リスク水準に応じて、長期的見通しに基づく基本資産配分と短・中期的見通しに基づく資産配分を組み合わせで決定します。上記投資割合は定期的に見直しを行うほか、市場環境等によっては不定期に見直しを行う場合があります。なお、市場環境等によっては、一部の資産への投資割合がゼロとなる場合があります。

コモディティへの投資割合は、原則として、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

各資産への投資割合について、水戸証券株式会社の投資助言を受けます。

別に定める投資信託証券は、継続的にモニタリングを行い、必要な場合は追加、除外、入替えを行う場合があります。

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

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。

（２）【投資対象】

投資の対象とする資産の種類（約款第15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。

1. 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項に定めるものをいいます。以下同じ。）
 - イ．有価証券
 - ロ．金銭債権
 - ハ．約束手形（金融商品取引法第2条第1項第15号に掲げるものを除きます。）
2. 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16条第1項）

委託会社は、信託金を、主として、別に定める投資信託証券または次の有価証券（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. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
2. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、上記1.の証券の性質を有するもの
3. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）

運用の指図範囲等（約款第16条第2項）

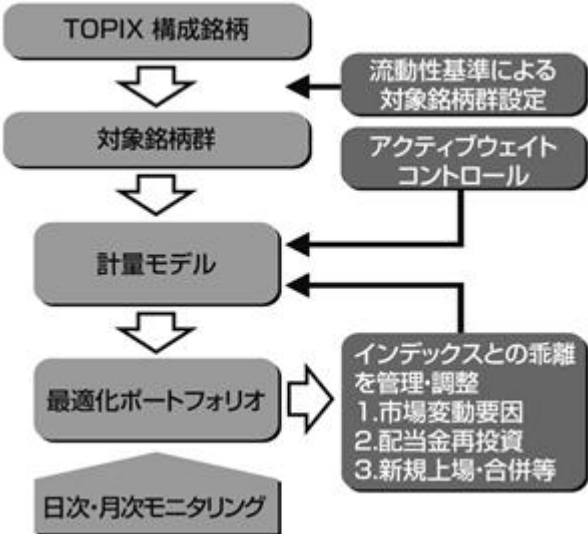
委託会社は、信託金を、上記 に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

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

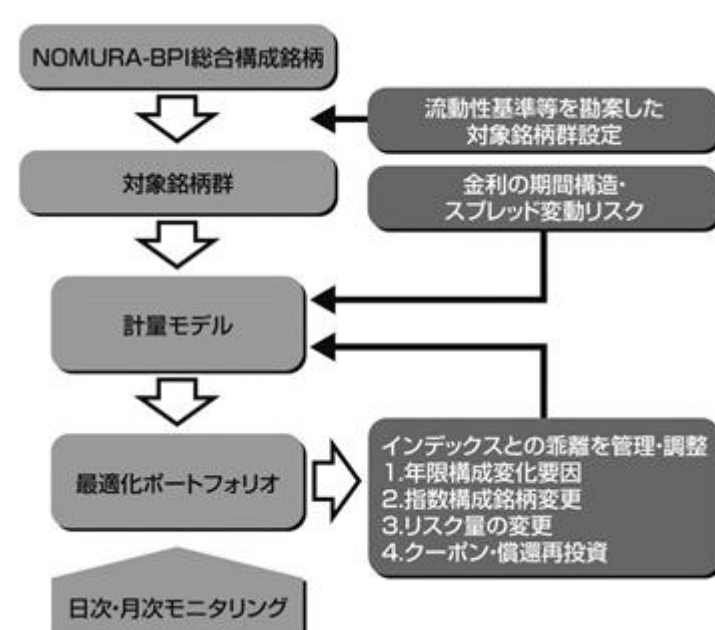
（参考）各ファンドが投資対象とする投資信託証券の概要

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	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <div style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin-top: 10px;"> <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	<p>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。</p> <p>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。</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。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・市場変動に伴うもの：推定トラッキングエラーの増加に伴い実施 ・新規上場、合併等に伴うもの：指数に与える影響を勘案し、決定 ・配当金再投資に伴うもの：キャッシュ比率の上昇に伴い実施 
主な投資制限	<p>1.株式への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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>
運用会社 （委託会社）	アセットマネジメントOne株式会社
申込手数料	ありません。

信託報酬	ありません。
------	--------

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> <div style="border: 1px solid black; padding: 5px;"> <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> </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 NOMURA - B P I 総合構成銘柄のうち、流動性基準等を勘案して投資対象銘柄群を設定します。</p> <p>2.最適化法によるポートフォリオの構築 1) 債券種別・格付けから発生するベンチマーク乖離要因 2) 金利の期間構造、スプレッドの期間構造から発生するベンチマーク乖離要因 1)、2) が最小になると判断されるポートフォリオを構築します。</p> <p>3.インデックスとの乖離を管理 日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。 インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。 ・年限構成変化要因 ・指数構成銘柄変更 ・リスク量の変更 ・クーポン、償還再投資</p> 

主な投資制限	<ol style="list-style-type: none"> 1. 株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限りします。 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、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 5. 外貨建資産への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 6. デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 7. 外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。 8. 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
運用会社 （委託会社）	アセットマネジメントOne株式会社
申込手数料	ありません。
信託報酬	ありません。

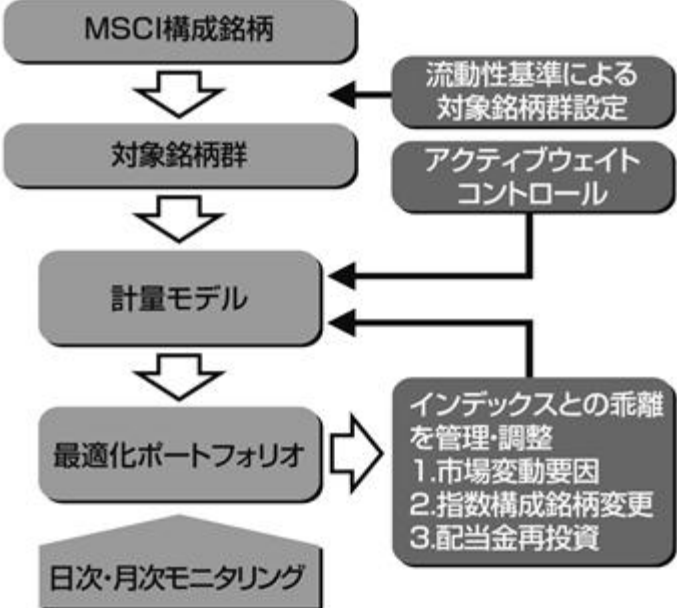
ファンド名	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。
主な投資対象	海外の株式を主要投資対象とします。

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

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

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

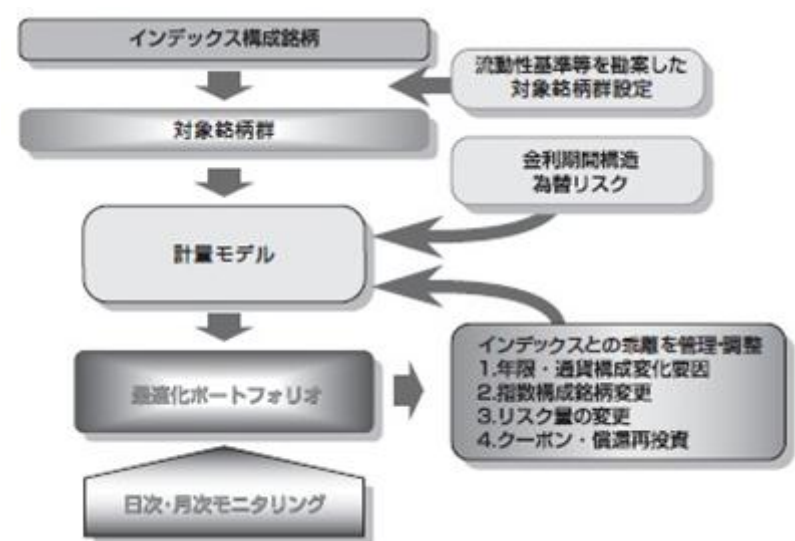
本証券、本商品もしくは本ファンドの購入者、販売者もしくは所有者、またはその他いかなる者もしくは団体も、MSCIの承認が必要か否かの確認を事前にMSCIに求めることなく、本証券を保証、推奨、販売、または宣伝するためにMSCIのトレードネーム、トレードマークまたはサービスマークを使用したり、それらに言及することはできません。いかなる状況においても、いかなる者ま

	<p>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。</p>
運用プロセス	<p>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。</p> <p>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。</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"> ・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  <pre> graph TD A[MSCI構成銘柄] --> B[対象銘柄群] C[流動性基準による対象銘柄群設定] --> B B --> D[計量モデル] E[アクティブウェイトコントロール] --> D D --> F[最適化ポートフォリオ] G[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 F --> H[日次・月次モニタリング] </pre>

主な投資制限	<p>1. 株式への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>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。</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、原則として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>
運用会社 (委託会社)	アセットマネジメントOne株式会社
申込手数料	ありません。
信託報酬	ありません。

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

投資態度	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <div data-bbox="371 450 1396 840" style="border: 1px solid black; padding: 5px;"><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ません。</p> <p>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>
運用会社 （委託会社）	アセットマネジメントOne株式会社
申込手数料	ありません。
信託報酬	ありません。

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、MSCIEマーキング・マーケット・インデックス(円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。2.原則として、株式の組入比率は高位を維持します。3.外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。
------	---

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

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

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

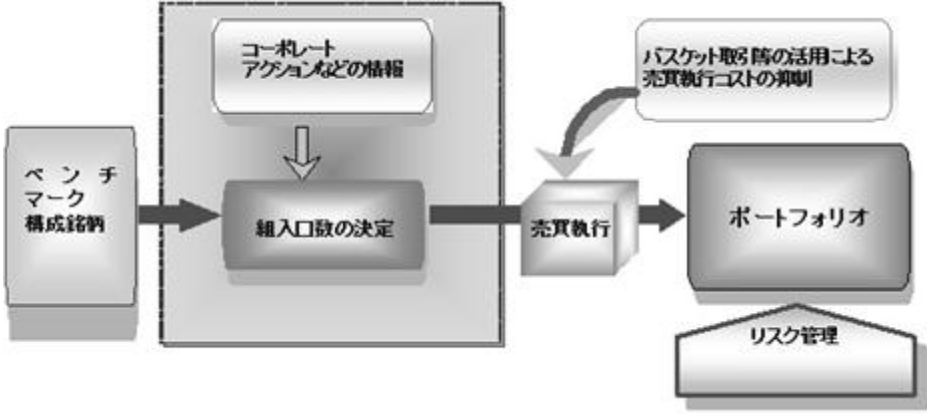
	<p>たは団体も、事前にMSCIの書面による承認を得ることなくMSCIとの関係を主張することはできません。</p>
運用プロセス	<p>現地口座の開設可否、預託証券の利用可否を基準に投資対象銘柄群を設定し、インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差(アクティブウェイト)を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用いて、インデックスとの乖離を抑えます。 日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理して、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。</p> <pre> graph TD A[MSCI構成銘柄] --> B[対象銘柄群] B --> C[計量モデル] C --> D[最適化ポートフォリオ] D --> E[日次・月次モニタリング] F[アクティブウェイトコントロール] --> C F --> D G["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"] --> D </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。
運用会社 （委託会社）	アセットマネジメントOne株式会社
申込手数料	ありません。
信託報酬	ありません。

ファンド名	iシェアーズ J.P.モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券 ETF
ファンドの形態等	オープンエンド型の外国投資信託（契約型）
表示通貨	米ドル

ファンドの目的および基本的性格	<p>J.P. モルガン EMBI グローバル・コア・インデックス（以下「対象指数」といいます。）の価格および利回りの実績に概ね対応する投資成果（手数料および経費控除前）をあげることがを目標としています。</p> <div style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin: 10px 0;"> <p>J.P. モルガン EMBI グローバル・コア・インデックスに関する著作権等の知的財産その他一切の権利はジェー・ピー・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>										
主要関係法人	<p>運用会社 ブラックロック・ファンド・アドバイザーズ(BFA) 受託者 ステート・ストリート・バンク・アンド・トラスト・カンパニー</p>										
投資の基本方針	<p>対象指数は、幅広く多様な米ドル建て新興国債券市場を表す指数であり、新興国で活発に取引されている対外債券商品のトータル・リターンを測定します。債務残高が高い国の構成比率を制限し、制限からの超過分を債務残高が低い国に割り当てることで構成国の比率を調整しています。当ファンドは、サンプリング手法を利用して対象指数への連動を試みます。</p>										
主な投資制限	<p>当ファンドは、原則として以下を行いません。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・投資の集中（総資産の25%以上を特定の産業または産業グループの証券に投資すること）。但し、当ファンドは、対象指数とほぼ同程度に特定の産業または産業グループの証券に投資を集中する。 ・借入れ（例外的に借入れを行う場合でも、総資産の3分の1を超えてはならない） ・優先証券の発行 ・貸付け ・不動産、商品、商品契約の売買（但し、当ファンドは不動産業を営む企業の証券や、不動産や不動産抵当権により担保されている証券やその他金融商品に投資することができる。） ・証券の引受業務 ・経営権または支配権を行使するために会社の有価証券に投資すること ・流動性のない有価証券を純資産総額の15%超保有すること <p>など</p>										
運用報酬等	<p>運用会社は、運用報酬として、当該ETFの属するファンドグループの純資産総額の日々平均残高の合計額に対して以下の料率にしたがって計算される運用報酬の合計額のうち、当該ETFにかかる割当額を受領します。</p> <table border="1" data-bbox="375 1579 1396 1892" style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <thead> <tr> <th style="text-align: center;">ファンドグループの純資産総額の合計額</th> <th style="text-align: center;">左記の残高レンジに適用される運用報酬率（年率）</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td style="text-align: center;">190億ドル以下</td> <td style="text-align: center;">0.4000%</td> </tr> <tr> <td style="text-align: center;">190億ドル超330億ドル以下</td> <td style="text-align: center;">0.3800%</td> </tr> <tr> <td style="text-align: center;">330億ドル超470億ドル以下</td> <td style="text-align: center;">0.3610%</td> </tr> <tr> <td style="text-align: center;">470億ドル超</td> <td style="text-align: center;">0.3430%</td> </tr> </tbody> </table>	ファンドグループの純資産総額の合計額	左記の残高レンジに適用される運用報酬率（年率）	190億ドル以下	0.4000%	190億ドル超330億ドル以下	0.3800%	330億ドル超470億ドル以下	0.3610%	470億ドル超	0.3430%
ファンドグループの純資産総額の合計額	左記の残高レンジに適用される運用報酬率（年率）										
190億ドル以下	0.4000%										
190億ドル超330億ドル以下	0.3800%										
330億ドル超470億ドル以下	0.3610%										
470億ドル超	0.3430%										

ファンド名	J - R E I Tインデックスファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、東証R E I T指数（配当込み）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。

主な投資対象	東京証券取引所に上場し、東証REIT指数に採用されている(または採用予定の)不動産投資信託証券(一般社団法人投資信託協会規則に定める不動産投信等をいいます。以下同じ。)を主要投資対象とします。
投資態度	<p>1. 東京証券取引所に上場し、東証REIT指数に採用されている(または採用予定の)不動産投資信託証券を主要投資対象とし、東証REIT指数(配当込み)の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。</p> <p>2. 不動産投資信託証券への投資は、原則として高位を維持することをめざします。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. 但し、ファンドの資金動向、市況動向等に急激な変化が生じたとき、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときならびに東証REIT指数(配当込み)が改廃されたとき等、やむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。</p> <div style="border: 1px solid black; padding: 10px; margin-top: 10px;"> <p>東証REIT指数の指数値および東証REIT指数の商標は、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REIT指数に関するすべての権利・ノウハウおよび東証REIT指数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REIT指数の指数値の算出もしくは公表の方法の変更、東証REIT指数の指数値の算出もしくは公表の停止または東証REIT指数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REIT指数の指数値および東証REIT指数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REIT指数の指数値について、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REIT指数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REIT指数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REIT指数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>

<p>運用プロセス</p>	<p>1.原則としてベンチマーク構成全銘柄をその構成比率で保有します。ベンチマーク構成銘柄および採用予定銘柄を投資対象銘柄とします。</p> <p>2.新規上場、公募増資、第三者割当等ベンチマーク構成の変更情報を事前に取得し、最適な執行方法によりリバランスを実施します。</p> <p>3.配当金入金等によりキャッシュ比率が上昇した場合にもリバランスを実施します。</p> 
<p>主な投資制限</p>	<p>1.投資信託証券への投資割合には制限を設けません。</p> <p>2.同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として信託財産の純資産総額の30%を超えないものとします。ただし、東証REIT指数採用の不動産投資信託証券の上場時価総額の合計額に占める同一銘柄の不動産投資信託証券の時価総額の割合が30%を超えている場合、当該同一銘柄の不動産投資信託証券への投資割合は、原則として当該同一銘柄の不動産投資信託証券の時価総額が東証REIT指数採用の不動産投資信託証券の上場時価総額の合計額に占める割合の範囲で投資することができるものとします。</p> <p>3.株式への投資は行いません。</p> <p>4.外貨建資産への投資は行いません。</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、価格変動および金利変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</p> <p>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。</p>
<p>運用会社 (委託会社)</p>	<p>アセットマネジメントOne株式会社</p>
<p>申込手数料</p>	<p>ありません。</p>
<p>信託報酬</p>	<p>ありません。</p>

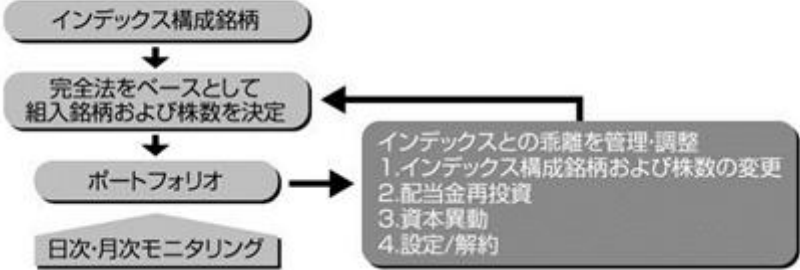
<p>ファンド名</p>	<p>外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド</p>
<p>基本方針</p>	<p>この投資信託は、S & P 先進国 REIT インデックス(除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)に連動する投資成果をめざして運用を行います。</p>

主な投資対象	日本を除く世界各国の不動産投資信託証券を主要投資対象とします。 海外の証券取引所に上場(これに準ずるものを含みます。)されている不動産投資信託証券とします。
--------	---

投資態度	<ol style="list-style-type: none">1.主に日本を除く世界各国の不動産投資信託証券を主要投資対象とし、S & P 先進国REITインデックス(除く日本、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.不動産投資信託証券への投資割合は、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、原則として為替ヘッジは行いません。ただし、金利・為替状況によってはヘッジを行う場合があります。
------	--

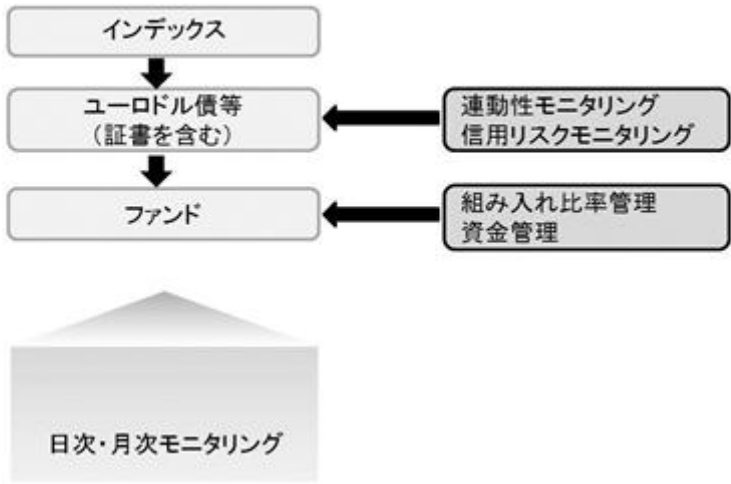
S & P 先進国 R E I Tインデックスは、S&P Globalの一部門であるS&Pダウ・ジョーンズ・インデックスLLCまたはその関連会社(「SPDJI」)の商品であり、これを利用するライセンスが委託会社に付与されています。Standard & Poor's®およびS&P®は、S&P Globalの一部門であるスタンダード&プアーズ・ファイナンシャル・サービシーズLLC(「S&P」)の登録商標で、Dow Jones®は、ダウ・ジョーンズ・トレードマーク・ホールディングズLLC(「Dow Jones」)の登録商標です。指数に直接投資することはできません。本商品は、SPDJI、Dow Jones、S&P、それらの各関連会社(総称して「S&P Dow Jones Indices」)によってスポンサー、保証、販売、または販売促進されているものではありません。S&P Dow Jones Indicesは、本商品の所有者またはいかなる一般人に対して、有価証券全般または具体的な商品への投資の妥当性、あるいは全般的な市場のパフォーマンスを追跡するS & P 先進国 R E I Tインデックスの能力に関して、明示または黙示を問わず、いかなる表明または保証もしません。指数の過去のパフォーマンスは、将来の成績を示唆または保証するものでもありません。S & P 先進国 R E I Tインデックスに関して、S&P Dow Jones Indicesと委託会社との間にある唯一の関係は、当指数とS&P Dow Jones Indicesおよび/または特定の商標、サービスマーク、および/または商標名のライセンス供与です。S & P 先進国 R E I Tインデックスは委託会社または本商品に関係なく、S&P Dow Jones Indicesによって決定、構成、計算されます。S&P Dow Jones Indicesは、S & P 先進国 R E I Tインデックスの決定、構成または計算において委託会社または本商品の所有者のニーズを考慮する義務を負いません。S&P Dow Jones Indicesは、本商品の価格および数量、または本商品の発行または販売のタイミングの決定、もしくは場合によっては本商品が将来換金、譲渡、または償還される計算式の決定または計算に関して、責任を負わず、またこれに関与したこともありません。S&P Dow Jones Indicesは、本商品の管理、マーケティング、または取引に関して、いかなる義務または責任も負いません。S & P 先進国 R E I Tインデックスに基づく投資商品が、指数のパフォーマンスを正確に追跡する、またはプラスの投資収益率を提供する保証はありません。S&P Dow Jones Indices LLCは投資または税務の顧問会社ではありません。免税証券のポートフォリオへの影響や特定の投資決断の税効果の評価は、税務顧問会社に相談してください。指数に証券が含まれることは、S&P Dow Jones Indicesがかかる証券の売り、買い、またはホールドの推奨を意味するものではなく、投資アドバイスとして見なしてはなりません。

S&P Dow Jones Indicesは、S & P 先進国 R E I Tインデックスまたはその関連データ、あるいは口頭または書面の通信(電子通信も含む)を含むがこれに限定されないあらゆる通信について、その妥当性、正確性、適時性、または完全性を保証しません。S&P Dow Jones Indicesは、これに含まれる過誤、遺漏または中断に対して、いかなる義務または責任も負わないものとします。S&P Dow Jones Indicesは、明示的または黙示的を問わず、いかなる保証もせず、商品性、特定の目的または使用への適合性、もしくはS & P 先進国 R E I Tインデックスを使用することによって、またはそれに関連するデータに関

	<p>して、委託会社、本商品の所有者、またはその他の人物や組織が得られる結果について、一切の保証を明示的に否認します。上記を制限することなく、いかなる場合においても、S&P Dow Jones Indicesは、利益の逸失、営業損失、時間または信用の喪失を含むがこれらに限定されない、間接的、特別、懲罰的、または派生的損害に対して、たとえその可能性について知らされていたとしても、契約の記述、不法行為、または厳格責任の有無を問わず、一切の責任を負わないものとします。S&P Dow Jones Indicesのライセンサーを除き、S&P Dow Jones Indicesと委託会社との間の契約または取り決めの第三者受益者は存在しません。</p>
運用プロセス	<p>ポートフォリオの構築にあたっては、原則としてインデックスである「S&P先進国REITインデックス(除く日本)」を構成する全ての銘柄を、その時価構成比で組み入れることをめざします。インデックスに対する連動性を随時確認し、必要に応じてポートフォリオのリバランスを実施します。</p>  <pre> graph TD A[インデックス構成銘柄] --> B[完全法をベースとして 組入銘柄および株数を決定] B --> C[ポートフォリオ] C --> D[日々・月次モニタリング] C --> E[インデックスとの乖離を管理・調整 1.インデックス構成銘柄および株数の変更 2.配当金再投資 3.資本異動 4.設定/解約] E --> B </pre>
主な投資制限	<ol style="list-style-type: none"> 1. 投資信託証券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割合には制限を設けません。 3. 株式への直接投資は行いません。 4. 同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として信託財産の純資産総額の30%以内とします。ただし、S & P 先進国 REITインデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）における時価の構成割合が30%を超える不動産投資信託証券がある場合には、指数との連動性を維持するために当該不動産投資信託証券をS & P 先進国 REITインデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）の構成割合の範囲で組入れることができるものとします。 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。
運用会社 (委託会社)	アセットマネジメントOne株式会社
申込手数料	ありません。

信託報酬	ありません。
------	--------

ファンド名	コモディティインデックス・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、主としてS&P GSCI商品指数に連動する投資成果をめざして運用を行います。
主な投資対象	S&P GSCI商品指数に連動するユーロドル債（証券を含みます。）を主要投資対象とします。
投資態度	<p>1.主として、S&P GSCI商品指数 に連動するユーロドル債（証券を含みます。）等に投資することにより、S&P GSCI商品指数の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>2.ユーロドル債（証券を含みます。）の組入比率は、原則として高位を維持します。ただし、市況動向、資金動向、信託財産の規模等により弾力的に変更を行う場合があります。</p> <p>3.組入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が、金利、為替状況によっては為替ヘッジを行う場合があります。</p> <p>4.ただし、ファンドの資金動向、市況動向等に急激な変化が生じたとき、残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき、ならびにS&P GSCI商品指数が改廃されたとき等、やむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。</p> <div style="border: 1px solid black; padding: 5px;"> <p>S&P GSCI商品指数（「当インデックス」）は、S&P Globalの一部門であるS&P Dow Jones Indices LLCまたはその関連会社（「SPDJI」）の商品であり、これを利用するライセンスが委託会社に付与されています。Standard & Poor's® およびS&P®は、S&P Globalの一部門であるStandard & Poor's Financial Services LLC（「S&P」）の登録商標で、Dow Jones®は、Dow Jones Trademark Holdings LLC（「Dow Jones」）の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスがSPDJIに付与されています。S&P®、S&P GSCI®およびS&P GSCI商品指数はS&Pの商標であり、これらを利用するライセンスがSPDJIとその関連会社に、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが委託会社にそれぞれ付与されています。S&P GSCI商品指数は、Goldman Sachs & Co.またはその関連会社によって所有、保証、または承認されたものではなく、これら会社とは一切関係がありません。当ファンドは、SPDJI、Dow Jones、S&Pまたはそれぞれの関連会社によってスポンサー、保証、販売、または販売促進されているものではなく、SPDJI、Dow Jones、S&P、それぞれの関連会社、または第三者のライセンスのいずれも、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行いません。</p> </div>

運用プロセス	<p>主にコモディティインデックスに連動するユーロドル債（証券を含む）等に投資し、ベンチマークに連動する投資成果を目標に運用を行います。</p>  <pre> graph TD A[インデックス] --> B[ユーロドル債等 (証券を含む)] B --> C[ファンド] D[連動性モニタリング 信用リスクモニタリング] --> B E[組み入れ比率管理 資金管理] --> C F[日次・月次モニタリング] </pre>
主な投資制限	<p>1. 株式への投資は行いません。 2. 外貨建資産の投資割合には、制限を設けません。</p>
運用会社 (委託会社)	アセットマネジメントOne株式会社
申込手数料	ありません。
信託報酬	ありません。

(注1) 上記内容は原則として、平成30年4月末時点の情報をもとに作成したものであり、今後、投資信託証券は追加・除外・入替等が行われることがあります。

(注2) 「iシェアーズ J.P.モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券 ETF」はブラックロック・ジャパン株式会社提供の資料を基に作成し、同社の確認のもと掲載したものです。

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。

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

内部管理等のモニタリング

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

b．ファンドの関係法人に関する管理

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

c．運用体制に関する社内規則

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

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

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

上記体制は、マザーファンドを通じた実質的な運用体制を記載しております。

（４）【分配方針】

収益分配方針

毎決算時（原則として毎年10月12日。休業日の場合は翌営業日。）に、原則として以下の方針に基づき収益分配を行います。

(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) 信託財産から生ず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、信託報酬および当該信託報酬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、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、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、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.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、)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】

投資信託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)

同一銘柄の投資信託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)

株式への直接投資は行いません。(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)

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)

デリバティブ取引の直接利用は行いません。(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)

特別な場合の外貨建有価証券への投資制限(約款第19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20条)

- (1) 委託会社は、信託財産に属する外貨建資産の時価総額と別に定める投資信託証券のうち親投資信託(以下「マザーファンド」といいます。)に属する外貨建資産のうち信託財産に属すると

みなした額との合計額について、当該外貨建資産の為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約を指図することができます。

- (2)上記(1)において信託財産に属するとみなした額とは、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。

資金の借入れ（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、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、投資信託証券への投資を通じて値動きのある有価証券等（外貨建資産には為替変動リスクもあります。）に投資しますので、ファンドの基準価額は変動します。これらの運用による損益はすべて投資者のみなさまに帰属します。したがって、投資者のみなさまの投資元本は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

また、投資信託は預貯金と異なります。

資産配分リスク

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

株価変動リスク

ファンドは、実質的に株式に投資をしますので、株式市場の変動により基準価額が上下します。新興国株式に投資する場合、先進国株式に比べ株価変動リスクが大きくなる傾向があります。

金利リスク

一般的に金利が上昇すると債券、リートの価格は下落します。ファンドは、実質的に債券、リートに投資をしますので、金利変動により基準価額が上下します。新興国債券に投資する場合、先進国債券に比べ金利リスクが大きくなる傾向があります。

リートの価格変動リスク

リートの価格は、リートが投資対象とする不動産等の価値、当該不動産等による賃貸収入の増減、不動産市況の変動、景気や株式市況等の動向などによって変動します。ファンドは、実質的にリートに投資をしますので、これらの影響を受け、基準価額が上下します。

為替リスク

ファンドは、実質組入外貨建資産について原則として対円で為替ヘッジを行わないため為替変動の影響を受けます。このため為替相場が当該実質組入資産の通貨に対して円高になった場合には基準価額が下がる要因となります。新興国通貨に投資する場合、先進国通貨に比べ為替リスクが大きくなる傾向があります。

信用リスク

ファンドが実質的に投資する株式・債券の発行者が経営不安・倒産に陥った場合、ファンドが実質的に投資するリートが収益性の悪化や資金繰り悪化等により清算される場合、またこうした状況に陥ると予想される場合等には、投資した資産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。新興国の株式・債券に投資する場合、先進国の株式・債券に比べ信用リスクが大きくなる傾向があります。

流動性リスク

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

カントリーリスク

ファンドの実質的な投資対象国・地域における政治・経済情勢の変化等によっては、運用上の制約を受ける可能性があり、基準価額が下がる要因となります。

コモディティ市況の変動リスク

一般にコモディティ価格は商品の需給関係の変化、為替、金利の変化など様々な要因で変動します。需給関係は、天候、作況、生産国の政治、経済の変化、貿易動向等の影響を大きく受けます。ファンドは、実質的にコモディティに投資をしますので、これらの影響を受け、基準価額が上下します。

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>

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

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

収益分配金に関する留意点として、以下の事項にご留意ください。

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

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

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

ファンドは、一部マザーファンドに投資を行います。そのため、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、ファンドの基準価額に影響をおよぼす場合があります。

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

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、お申込み（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、または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。

「安定型」「中立型」「積極型」の3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。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

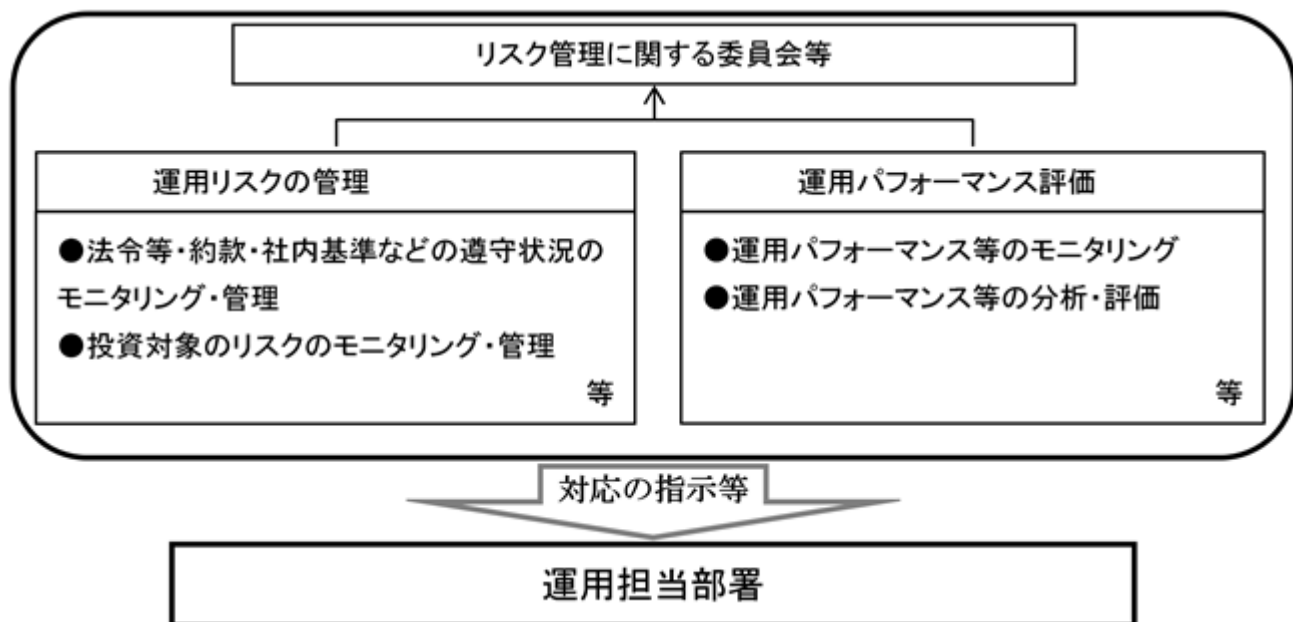
注意事項

- ・各ファンドは、投資信託証券等の値動きのある有価証券等（外貨建資産へ投資する場合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。
- ・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。
- ・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。
- ・投資信託は、投資した資産の価値が減少して購入金額を下回る場合があります、これによる損失は購入者が負担することとなります。

<リスク管理体制>

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

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



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

<参考情報>

ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移

【安定型】



【中立型】

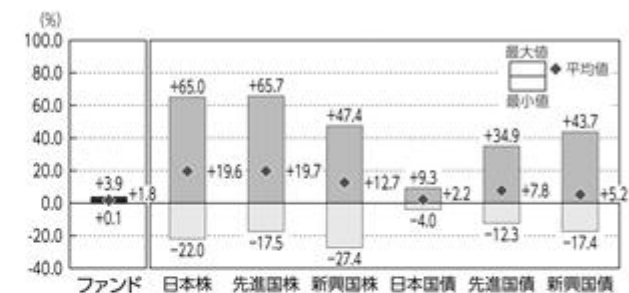


【積極型】

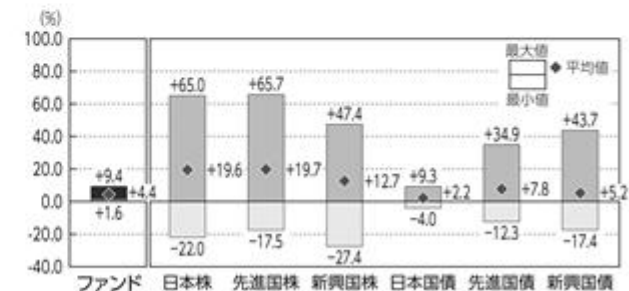


- *ファンドの分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した基準価額が記載されていますので、実際の基準価額とは異なる場合があります。
- *ファンドの年間騰落率は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した年間騰落率が記載されていますので、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

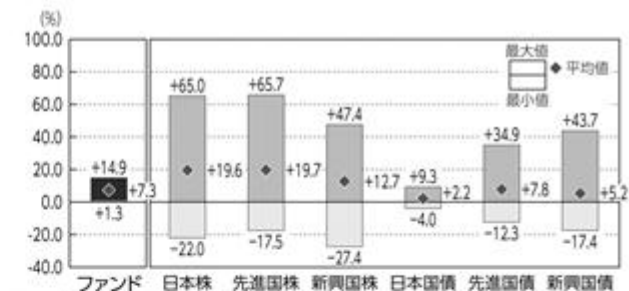
ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



ファンド:2016年12月~2018年4月
代表的な資産クラス:2013年5月~2018年4月



ファンド:2016年12月~2018年4月
代表的な資産クラス:2013年5月~2018年4月



ファンド:2016年12月~2018年4月
代表的な資産クラス:2013年5月~2018年4月

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

*各資産クラスの指数

- 日本株… 東証株価指数 (TOPIX) (配当込み)
- 先進国株… MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、円ベース)
- 新興国株… MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込み、円ベース)
- (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。

- 日本国債… NOMURA-BPI国債
- 先進国債… FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)
- 新興国債… JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイド (円ベース)

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

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

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

「分配金自動けいぞく投資コース」により、収益分配金を再投資する場合は、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	<p>ファンドの日々の純資産総額に対して年率1.3284%（税抜1.23%） 信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率 信託報酬は、毎日計上され、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日（休業日の場合は翌営業日）および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。</p>		
	支払先	内訳（税抜）	主な役務
	委託会社	年率0.69%	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0.04%	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
委託会社の信託報酬には、各ファンドの投資顧問会社（水戸証券株式会社）に対する投資顧問報酬が含まれます。			
投資対象とする外国投資信託	<p>iシェアーズ J.P.モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券 ETFの純資産総額に対して年率0.40%程度 （注）ただし、当該外国投資信託の信託報酬には、年間最低報酬額が定められている場合があり、純資産総額等によっては年率換算で上記の信託報酬率を上回る場合があります。 上記料率は、平成30年4月末時点のものです。</p>		

実質的な負担	<p>各ファンドの日々の純資産総額に対して年率1.346400%～1.420352%程度 (税抜1.248000%～1.321952%程度)(概算)</p> <p>上記の概算は、各ファンドの信託報酬率と投資対象とする投資信託証券の信託報酬率を合わせた実質的な信託報酬率であり、各ファンドの長期的戦略および短・中期的戦略に基づいて決定される資産配分に基づき算出したものです(平成30年4月末時点の資産配分に基づき算出)。この値は目安であり、投資対象とする投資信託証券の実際の組入比率が変動する可能性や投資信託証券の変更の可能性があることなどから、実質的な信託報酬率は変動することがあり、あらかじめ上限額等を記載することができません。そのため、実質的な信託報酬率は概算で表示しています。</p>
--------	---

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】

- ・信託財産留保額
ありません。

- ・その他の費用

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

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

監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用は、受益者の負担とし、毎日計上され、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日(休業日の場合は翌営業日)および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、当該手数料にかかる消費税等相当額および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。

投資対象とする投資信託証券でかかる費用等は、間接的にファンドで負担します。当該費用は以下の通りです。

各ファンドが投資対象とする 投資信託証券	主な費用
iシェアーズ J.P.モルガン・米ドル 建てエマージング・マーケット債券 ETF	信託財産に関する租税、組入資産の売買時の売買手数料、信託事務の処理に要する費用、信託財産の監査に要する費用、法律関係の費用、資産の保管などに要する費用、借入金の利息および立替金の利息、ファンドの設立にかかる費用等
マザーファンド	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および外貨建資産の保管等に要する費用等

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。

上場不動産投資信託(リート)は市場の需給により価格形成されるため、上場不動産投資信託(リート)の費用は表示しておりません。

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

(5)【課税上の取扱い】

各ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

個人の受益者に対する課税

収益分配時

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

詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

解約時および償還時

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

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

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

損益通算について

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

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

NISAおよびジュニアNISAは、上場株式や公募株式投資信託などにかかる非課税制度です。毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が一定期間非課税となります。ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。なお、同非課税口座内で少額上場株式等にかかる譲渡損失が生じた場合には、課税上譲渡

損失はないものとみなされ、他の口座の上場株式等の譲渡益および上場株式等の配当所得等の金額との損益通算を行うことはできませんので、ご注意ください。

法人の受益者に対する課税

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

なお、益金不算入制度の適用はありません。

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

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

個別元本方式について

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

< 個別元本について >

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

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

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

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

< 収益分配金の課税について >

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

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

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

税法が改正された場合等は、上記内容が変更になることがあります。

5【運用状況】

(1)【投資状況】

MITO ラップ型ファンド(安定型)

平成30年4月27日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	19,919,196	7.78
内 アメリカ	19,919,196	7.78
親投資信託受益証券	223,842,013	87.46
内 日本	223,842,013	87.46
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	12,177,405	4.76
純資産総額	255,938,614	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。

MITO ラップ型ファンド(中立型)

平成30年4月27日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	56,799,889	14.40
内 アメリカ	56,799,889	14.40
親投資信託受益証券	318,932,485	80.84
内 日本	318,932,485	80.84
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	18,797,240	4.76
純資産総額	394,529,614	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。

MITO ラップ型ファンド(積極型)

平成30年4月27日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	68,691,045	16.55
内 アメリカ	68,691,045	16.55
親投資信託受益証券	322,640,833	77.72
内 日本	322,640,833	77.72
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	23,806,302	5.73
純資産総額	415,138,180	100.00

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

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

（参考）

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

平成30年4月27日現在

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

その他資産の投資状況

平成30年4月27日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引（買建）	4,626,700,000	1.53
内 日本	4,626,700,000	1.53

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年4月27日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	289,165,936,100	83.81
内 日本	289,165,936,100	83.81
地方債証券	22,861,857,806	6.63
内 日本	22,861,857,806	6.63
特殊債券	14,869,558,465	4.31
内 日本	14,869,558,465	4.31
社債券	16,234,515,570	4.71
内 日本	16,033,595,570	4.65
内 オランダ	200,920,000	0.06
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	1,891,910,387	0.55
純資産総額	345,023,778,328	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

J-REITインデックスファンド・マザーファンド

平成30年4月27日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	31,847,015,860	97.85
内 日本	31,847,015,860	97.85
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	700,997,017	2.15
純資産総額	32,548,012,877	100.00

その他資産の投資状況

平成30年4月27日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
不動産投信指数先物取引（買建）	604,597,500	1.86
内 日本	604,597,500	1.86

（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。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年4月27日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	289,825,801,783	95.22
内 アメリカ	180,587,452,216	59.33
内 イギリス	20,370,583,105	6.69
内 フランス	12,181,289,613	4.00
内 ドイツ	11,745,181,536	3.86
内 カナダ	11,138,098,468	3.66
内 スイス	10,074,696,705	3.31
内 オーストラリア	7,199,134,112	2.37
内 オランダ	5,980,435,245	1.96
内 アイルランド	4,121,072,826	1.35
内 スペイン	3,943,134,799	1.30
内 スウェーデン	3,107,981,339	1.02
内 香港	2,896,049,479	0.95
内 イタリア	2,633,672,051	0.87
内 デンマーク	2,071,652,575	0.68
内 ジャージー	1,656,441,669	0.54
内 シンガポール	1,524,801,641	0.50
内 パミュダ	1,346,105,197	0.44
内 ベルギー	1,317,750,992	0.43
内 フィンランド	1,251,231,230	0.41
内 ケイマン諸島	861,283,862	0.28
内 ノルウェー	829,882,282	0.27
内 オランダ領キュラソー	794,590,958	0.26
内 イスラエル	542,550,400	0.18
内 ルクセンブルグ	389,816,251	0.13
内 オーストリア	308,686,985	0.10
内 ニュージーランド	181,765,299	0.06
内 ボルトガル	180,974,659	0.06
内 パナマ	175,216,749	0.06
内 リベリア	151,804,972	0.05
内 イギリス領バージン諸島	90,892,839	0.03
内 マン島	90,274,421	0.03
内 パプアニューギニア	61,082,771	0.02
内 モーリシャス	20,214,537	0.01
投資信託受益証券	831,332,570	0.27
内 オーストラリア	666,313,005	0.22

	内 シンガポール	165,019,565	0.05
投資証券		6,138,783,662	2.02
	内 アメリカ	5,231,945,408	1.72
	内 フランス	382,788,059	0.13
	内 イギリス	328,286,466	0.11
	内 香港	151,794,054	0.05
	内 カナダ	43,969,675	0.01
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		7,577,354,415	2.49
純資産総額		304,373,272,430	100.00

その他資産の投資状況

平成30年4月27日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（%）
為替予約取引（買建）	325,522,410	0.11
-	325,522,410	0.11
株価指数先物取引（買建）	7,729,929,356	2.54
内 アメリカ	5,220,349,863	1.72
内 ドイツ	1,471,867,007	0.48
内 イギリス	560,898,620	0.18
内 カナダ	282,052,530	0.09
内 オーストラリア	194,761,336	0.06

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

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

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年4月27日現在

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

その他資産の投資状況

平成30年4月27日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引(買建)	9,568,445,762	4.49
-	9,568,445,762	4.49

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

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

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

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年4月27日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	5,611,810,305	11.26
内 オーストラリア	3,885,745,847	7.80
内 シンガポール	1,705,678,150	3.42
内 カナダ	20,386,308	0.04
投資証券	42,750,028,059	85.77
内 アメリカ	33,539,137,898	67.29
内 イギリス	2,990,062,522	6.00
内 フランス	2,344,643,065	4.70
内 香港	992,869,126	1.99
内 カナダ	939,108,249	1.88
内 スペイン	547,754,358	1.10
内 ベルギー	391,734,753	0.79
内 オランダ	232,904,621	0.47
内 ニュージーランド	218,314,863	0.44
内 アイルランド	137,894,569	0.28
内 ドイツ	136,716,878	0.27
内 シンガポール	114,047,719	0.23
内 イタリア	62,672,461	0.13
内 ガーンジー	41,398,919	0.08
内 イスラエル	30,829,565	0.06
内 マン島	29,938,493	0.06
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	1,483,700,230	2.98
純資産総額	49,845,538,594	100.00

その他資産の投資状況

平成30年4月27日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引（売建）	1,234,801,000	2.48
-	1,234,801,000	2.48

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

コモディティインデックス・マザーファンド

平成30年4月27日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
社債券	3,455,473,329	99.17
内 イギリス	3,455,473,329	99.17
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	28,795,545	0.83
純資産総額	3,484,268,874	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

平成30年4月27日現在

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

その他資産の投資状況

平成30年4月27日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引(買建)	100,455,890	0.16
-	100,455,890	0.16
為替予約取引(売建)	787,956,000	1.22
-	787,956,000	1.22
株価指数先物取引(買建)	4,586,207,890	7.10
内 アメリカ	4,586,207,890	7.10

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

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

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

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

(2) 【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

MITO ラップ型ファンド(安定型)

平成30年4月27日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	国内債券パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	124,116,436	1.2812 159,028,576	1.2889 159,973,674	- -	62.50%
2	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	13,305,363	1.8440 24,535,172	1.8127 24,118,631	- -	9.42%
3	ISHARES JP MORGAN USD EMERGING MARKETS BOND ETF アメリカ	投資信託受益 証券	1,650	12,492.20 20,612,143	12,072.24 19,919,196	- -	7.78%
4	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	3,825,859	2.5721 9,840,750	2.7108 10,371,138	- -	4.05%
5	外国株式パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	2,658,946	3.3835 8,996,679	3.3937 9,023,665	- -	3.53%
6	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	5,594,422	1.2293 6,877,461	1.2288 6,874,425	- -	2.69%
7	コモディティインデックス・ マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	15,315,018	0.3933 6,023,398	0.4474 6,851,939	- -	2.68%
8	外国リート・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	5,363,831	1.2071 6,474,785	1.1228 6,022,509	- -	2.35%
9	J-REITインデックス ファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	336,199	1.6673 560,567	1.8026 606,032	- -	0.24%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成30年4月27日現在

種類	投資比率
投資信託受益証券	7.78%
親投資信託受益証券	87.46%
合計	95.24%

(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。

MITO ラップ型ファンド(中立型)

平成30年4月27日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	国内債券パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	103,531,902	1.2810 132,627,363	1.2889 133,442,268	- -	33.82%
2	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	38,214,549	1.8454 70,522,236	1.8127 69,271,512	- -	17.56%
3	ISHARES JP MORGAN USD EMERGING MARKETS BOND ETF アメリカ	投資信託受益 証券	4,705	12,670.38 59,614,159	12,072.23 56,799,889	- -	14.40%
4	外国株式パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	8,377,043	3.3710 28,239,103	3.3937 28,429,170	- -	7.21%
5	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	9,042,847	2.5661 23,205,383	2.7108 24,513,349	- -	6.21%
6	外国リート・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	21,338,908	1.1783 25,144,030	1.1228 23,959,325	- -	6.07%
7	エマージング株式パッシブ・ マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	15,725,843	1.2277 19,307,698	1.2288 19,323,915	- -	4.90%
8	コモディティインデックス・ マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	41,068,358	0.3933 16,152,186	0.4474 18,373,983	- -	4.66%
9	J-REITインデックス ファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	898,127	1.6642 1,494,736	1.8026 1,618,963	- -	0.41%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成30年4月27日現在

種類	投資比率
投資信託受益証券	14.40%
親投資信託受益証券	80.84%
合計	95.24%

(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。

MITO ラップ型ファンド(積極型)

平成30年4月27日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	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	47,125,720	1.8447 86,936,883	1.8127 85,424,792	- -	20.58%
2	ISHARES JP MORGAN USD EMERGING MARKETS BOND ETF アメリカ	投資信託受益 証券	5,690	12,670.38 72,094,487	12,072.23 68,691,045	- -	16.55%
3	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	16,604,873	3.3894 56,281,027	3.3937 56,351,957	- -	13.57%
4	外国リート・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	41,999,911	1.2010 50,445,238	1.1228 47,157,500	- -	11.36%
5	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	15,806,676	2.5775 40,741,713	2.7108 42,848,737	- -	10.32%
6	国内債券パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	31,965,086	1.2810 40,949,597	1.2889 41,199,799	- -	9.92%
7	コモディティインデックス・ マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	51,384,803	0.3933 20,209,695	0.4474 22,989,560	- -	5.54%
8	エマージング株式パッシブ・ マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	18,210,990	1.2331 22,457,733	1.2288 22,377,664	- -	5.39%
9	J-REITインデックス ファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	2,380,353	1.6709 3,977,401	1.8026 4,290,824	- -	1.03%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成30年4月27日現在

種類	投資比率
投資信託受益証券	16.55%
親投資信託受益証券	77.72%
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。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

(参考)

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

平成30年4月27日現在

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

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

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成30年4月27日現在

種類	投資比率
株式	98.42%
合計	98.42%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

平成30年4月27日現在

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

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年4月27日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	124回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	4,000,000,000	100.50 4,020,160,000	100.48 4,019,240,000	0.100000 2020/6/20	1.16%
2	122回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	4,000,000,000	100.42 4,016,960,000	100.37 4,015,040,000	0.100000 2019/12/20	1.16%
3	118回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	3,700,000,000	100.45 3,716,872,000	100.38 3,714,282,000	0.200000 2019/6/20	1.08%
4	344回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,500,000,000	100.68 3,524,010,000	100.79 3,527,860,000	0.100000 2026/9/20	1.02%
5	345回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,500,000,000	100.61 3,521,595,000	100.73 3,525,655,000	0.100000 2026/12/20	1.02%
6	347回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,500,000,000	100.51 3,517,885,000	100.68 3,523,905,000	0.100000 2027/6/20	1.02%
7	348回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,360,000,000	100.47 3,375,967,000	100.65 3,382,008,000	0.100000 2027/9/20	0.98%
8	341回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,060,000,000	102.43 3,134,418,000	102.48 3,136,071,600	0.300000 2025/12/20	0.91%
9	342回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,000,000,000	100.80 3,024,240,000	100.90 3,027,210,000	0.100000 2026/3/20	0.88%
10	343回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,000,000,000	100.74 3,022,470,000	100.85 3,025,620,000	0.100000 2026/6/20	0.88%
11	130回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	3,000,000,000	100.77 3,023,130,000	100.80 3,024,090,000	0.100000 2021/12/20	0.88%
12	346回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,000,000,000	100.54 3,016,290,000	100.70 3,021,270,000	0.100000 2027/3/20	0.88%
13	128回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	3,000,000,000	100.70 3,021,090,000	100.70 3,021,210,000	0.100000 2021/6/20	0.88%
14	127回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	3,000,000,000	100.65 3,019,500,000	100.63 3,019,080,000	0.100000 2021/3/20	0.88%
15	125回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	3,000,000,000	100.54 3,016,350,000	100.52 3,015,780,000	0.100000 2020/9/20	0.87%

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

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成30年4月27日現在

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

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

J-REITインデックスファンド・マザーファンド

平成30年4月27日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	日本ビルファンド投資法人 日本	投資証券	3,823	585,733.58 2,239,259,488	615,000.00 2,351,145,000	- -	7.22%
2	ジャパンリアルエステイト投資法人 日本	投資証券	3,928	565,984.40 2,223,186,733	568,000.00 2,231,104,000	- -	6.85%
3	野村不動産マスターファンド投資法人 日本	投資証券	11,682	155,870.56 1,820,879,950	152,700.00 1,783,841,400	- -	5.48%
4	日本リテールファンド投資法人 日本	投資証券	7,454	211,769.70 1,578,531,409	205,000.00 1,528,070,000	- -	4.69%
5	ユナイテッド・アーバン投資法人 日本	投資証券	8,706	165,370.91 1,439,719,201	167,800.00 1,460,866,800	- -	4.49%
6	オリックス不動産投資法人 日本	投資証券	7,832	169,101.85 1,324,405,750	166,700.00 1,305,594,400	- -	4.01%
7	日本プロロジスリート投資法人 日本	投資証券	5,261	238,742.40 1,256,023,785	230,300.00 1,211,608,300	- -	3.72%
8	大和ハウスリート投資法人 日本	投資証券	4,593	270,548.64 1,242,629,949	261,000.00 1,198,773,000	- -	3.68%
9	アドバンス・レジデンス投資法人 日本	投資証券	3,655	283,203.45 1,035,108,640	281,900.00 1,030,344,500	- -	3.17%
10	日本プライムリアルティ投資法人 日本	投資証券	2,492	402,813.60 1,003,811,506	397,000.00 989,324,000	- -	3.04%
11	GLP投資法人 日本	投資証券	8,195	120,504.49 987,534,362	117,500.00 962,912,500	- -	2.96%
12	ジャパン・ホテル・リート投資法人 日本	投資証券	11,394	78,487.42 894,285,743	82,800.00 943,423,200	- -	2.90%

13	アクティビア・プロパティーズ投資法人 日本	投資証券	1,786	489,723.37 874,645,948	485,000.00 866,210,000	- -	2.66%
14	ケネディクス・オフィス投資法人 日本	投資証券	1,154	626,846.68 723,381,069	672,000.00 775,488,000	- -	2.38%
15	日本アコモデーションファンド投資法人 日本	投資証券	1,312	472,874.89 620,411,866	489,500.00 642,224,000	- -	1.97%
16	フロンティア不動産投資法人 日本	投資証券	1,343	473,228.07 635,545,311	451,000.00 605,693,000	- -	1.86%
17	森ヒルズリート投資法人 日本	投資証券	4,241	140,434.36 595,582,126	140,500.00 595,860,500	- -	1.83%
18	日本ロジスティクスファンド投資法人 日本	投資証券	2,630	225,981.51 594,331,395	221,700.00 583,071,000	- -	1.79%
19	産業ファンド投資法人 日本	投資証券	4,585	122,850.22 563,268,277	121,100.00 555,243,500	- -	1.71%
20	大和証券オフィス投資法人 日本	投資証券	851	570,917.36 485,850,679	647,000.00 550,597,000	- -	1.69%
21	インヴィンシブル投資法人 日本	投資証券	10,827	49,724.52 538,367,452	48,900.00 529,440,300	- -	1.63%
22	ジャパンエクセレント投資法人 日本	投資証券	3,535	133,803.19 472,994,277	142,200.00 502,677,000	- -	1.54%
23	森トラスト総合リート投資法人 日本	投資証券	2,821	173,219.66 488,652,682	163,300.00 460,669,300	- -	1.42%
24	ヒューリックリート投資法人 日本	投資証券	2,681	174,730.41 468,452,246	168,900.00 452,820,900	- -	1.39%
25	イオンリート投資法人 日本	投資証券	3,749	120,429.82 451,491,428	113,500.00 425,511,500	- -	1.31%
26	東急リアル・エステート投資法人 日本	投資証券	2,647	138,245.88 365,936,866	147,200.00 389,638,400	- -	1.20%
27	プレミアム投資法人 日本	投資証券	3,566	115,844.98 413,103,216	107,100.00 381,918,600	- -	1.17%
28	日本賃貸住宅投資法人 日本	投資証券	4,440	82,844.03 367,827,536	85,200.00 378,288,000	- -	1.16%
29	コンフォリア・レジデンシャル投資法人 日本	投資証券	1,496	242,058.74 362,119,880	250,900.00 375,346,400	- -	1.15%
30	MCUBS MidCity投資法人 日本	投資証券	4,404	71,803.07 316,220,721	82,500.00 363,330,000	- -	1.12%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成30年4月27日現在

種類	投資比率
投資証券	97.85%
合計	97.85%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年4月27日現在

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

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

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成30年4月27日現在

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

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

平成30年4月27日現在

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

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

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年4月27日現在

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

24	US T N/B 2.0 11/30/20 アメリカ	国債証券	1,148,175,000	98.96 1,136,233,980	98.51 1,131,124,601	2.000000 2020/11/30	0.53%
25	US T N/B 1.375 09/30/23 アメリカ	国債証券	1,202,850,000	93.03 1,119,023,383	92.57 1,113,574,473	1.375000 2023/9/30	0.52%
26	US T N/B 2.25 11/15/24 アメリカ	国債証券	1,159,110,000	96.53 1,118,993,202	95.94 1,112,108,089	2.250000 2024/11/15	0.52%
27	US T N/B 2.0 11/15/21 アメリカ	国債証券	1,137,240,000	98.12 1,115,950,867	97.62 1,110,264,667	2.000000 2021/11/15	0.52%
28	FRANCE OAT 2.5 10/25/20 フランス	国債証券	1,032,642,000	107.59 1,111,060,833	107.30 1,108,097,150	2.500000 2020/10/25	0.52%
29	US T N/B 2.75 11/15/23 アメリカ	国債証券	1,093,500,000	100.15 1,095,205,860	99.40 1,087,004,610	2.750000 2023/11/15	0.51%
30	US T N/B 2.125 09/30/21 アメリカ	国債証券	1,093,500,000	98.62 1,078,464,375	98.11 1,072,909,395	2.125000 2021/9/30	0.50%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成30年4月27日現在

種類	投資比率
国債証券	101.79%
合計	101.79%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年4月27日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	SIMON PROPERTY GROUP INC アメリカ	投資証券	127,012	17,338.50 2,202,198,643	16,419.99 2,085,536,531	- -	4.18%
2	PROLOGIS INC アメリカ	投資証券	217,541	6,572.47 1,429,781,710	7,202.88 1,566,922,697	- -	3.14%
3	PUBLIC STORAGE アメリカ	投資証券	61,135	22,605.99 1,382,017,576	21,850.31 1,335,819,129	- -	2.68%
4	UNIBAIL-RODAMCO SE フランス	投資証券	40,517	28,639.07 1,160,369,310	26,054.35 1,055,644,179	- -	2.12%
5	EQUITY RESIDENTIAL アメリカ	投資証券	150,187	7,105.41 1,067,141,341	6,684.56 1,003,934,838	- -	2.01%
6	AVALONBAY COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	56,328	19,972.51 1,125,011,899	17,668.77 995,246,645	- -	2.00%
7	DIGITAL REALTY TRUST INC アメリカ	投資証券	83,799	12,423.31 1,041,061,407	11,317.72 948,414,037	- -	1.90%
8	BOSTON PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	62,943	13,513.08 850,554,028	13,184.32 829,861,251	- -	1.66%
9	WELLTOWER INC アメリカ	投資証券	151,045	7,560.46 1,141,971,121	5,468.59 826,003,705	- -	1.66%
10	LINK REIT 香港	投資証券	886,520	891.68 790,495,895	928.40 823,048,714	- -	1.65%
11	VENTAS INC アメリカ	投資証券	145,243	6,973.42 1,012,841,845	5,190.84 753,933,827	- -	1.51%
12	SCENTRE GROUP オーストラリア	投資信託受益 証券	2,174,522	337.43 733,753,682	326.30 709,567,186	- -	1.42%
13	ESSEX PROPERTY TRUST INC アメリカ	投資証券	26,925	27,690.23 745,559,654	26,001.24 700,083,467	- -	1.40%
14	HOST HOTELS & RESORTS INC アメリカ	投資証券	299,269	2,054.61 614,882,480	2,143.25 641,411,276	- -	1.29%
15	REALTY INCOME CORP アメリカ	投資証券	115,858	5,941.22 688,338,567	5,510.14 638,394,553	- -	1.28%
16	WESTFIELD CORP オーストラリア	投資信託受益 証券	780,425	699.06 545,571,431	737.70 575,725,219	- -	1.16%
17	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT アメリカ	投資証券	41,258	13,256.94 546,955,092	13,483.94 556,320,747	- -	1.12%
18	GGP INC アメリカ	投資証券	257,407	2,468.59 635,434,025	2,155.28 554,786,346	- -	1.11%
19	VORNADO REALTY TRUST アメリカ	投資証券	70,442	7,989.84 562,820,515	7,220.38 508,618,043	- -	1.02%
20	EXTRA SPACE STORAGE INC アメリカ	投資証券	51,350	8,814.45 452,622,090	9,674.19 496,769,887	- -	1.00%
21	GOODMAN GROUP オーストラリア	投資信託受益 証券	654,104	687.56 449,737,944	734.40 480,375,874	- -	0.96%
22	HCP INC アメリカ	投資証券	191,241	3,172.37 606,687,715	2,447.25 468,015,110	- -	0.94%

23	MID AMERICA アメリカ	投資証券	46,286	11,233.07 519,934,082	9,916.95 459,016,017	- -	0.92%
24	LAND SECURITIES GROUP PLC イギリス	投資証券	306,024	1,522.94 466,057,704	1,479.24 452,684,339	- -	0.91%
25	IRON MOUNTAIN INC アメリカ	投資証券	114,621	3,804.12 436,032,724	3,753.98 430,285,571	- -	0.86%
26	UDR INC アメリカ	投資証券	109,212	4,177.90 456,276,900	3,913.63 427,416,069	- -	0.86%
27	DUKE REALTY TRUST アメリカ	投資証券	145,381	3,016.76 438,580,168	2,926.20 425,414,754	- -	0.85%
28	BRITISH LAND CO PLC イギリス	投資証券	404,717	955.84 386,848,337	1,014.36 410,530,848	- -	0.82%
29	SEGRO PLC イギリス	投資証券	404,815	810.63 328,158,168	972.36 393,628,463	- -	0.79%
30	SL GREEN アメリカ	投資証券	36,778	11,219.82 412,642,617	10,680.21 392,796,928	- -	0.79%

(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。

投資有価証券の種類別投資比率

平成30年4月27日現在

種類	投資比率
投資信託受益証券	11.26%
投資証券	85.77%
合計	97.02%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

コモディティインデックス・マザーファンド

平成30年4月27日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	GS Commodity Index Certificate 06/05/2018 イギリス	社債券	122,230	26,997.96 3,299,961,659	28,270.25 3,455,473,329	- 2018/6/5	99.17%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成30年4月27日現在

種類	投資比率
社債券	99.17%
合計	99.17%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

平成30年4月27日現在

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

16	RELIANCE INDUSTRIES LTD インド	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	292,811	1,557.09 455,935,372	1,609.32 471,228,794	- -	0.73%
17	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP インド	株式 貯蓄・抵当・ 不動産金融	150,810	3,114.77 469,739,380	3,053.24 460,459,501	- -	0.71%
18	SBERBANK ADR ロシア	株式 銀行	280,870	1,553.52 436,339,691	1,594.86 447,951,066	- -	0.69%
19	SAMSUNG ELECTRONICS-PFD 韓国	株式 コンピュー タ・周辺機器	1,800	206,601.97 371,883,554	214,696.20 386,453,160	- -	0.60%
20	BANCO BRADESCO SA PREF ブラジル	株式 銀行	332,425	1,059.55 352,222,076	1,091.56 362,863,129	- -	0.56%
21	AMBEV SA ブラジル	株式 飲料	490,295	726.80 356,347,444	732.63 359,206,443	- -	0.56%
22	AMERICA MOVIL SAB DE CV メキシコ	株式 無線通信サー ビス	3,324,278	103.55 344,255,817	101.84 338,577,714	- -	0.52%
23	INFOSYS LTD インド	株式 情報技術サー ビス	172,537	1,860.56 321,015,880	1,941.14 334,918,903	- -	0.52%
24	LUKOIL SPON ADR ロシア	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	44,852	6,951.26 311,778,149	7,112.12 318,992,985	- -	0.49%
25	CNOOC LTD 香港	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	1,761,000	174.24 306,839,510	178.98 315,200,685	- -	0.49%
26	GAZPROM PAO ADR ロシア	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	559,050	497.80 278,297,846	498.63 278,762,455	- -	0.43%
27	PETROLEO BRASILEIRO SA ブラジル	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	385,012	663.26 255,363,913	711.26 273,843,981	- -	0.42%
28	POSCO 韓国	株式 金属・鉱業	7,262	33,958.90 246,609,563	36,495.29 265,028,868	- -	0.41%
29	TATA CONSULTANCY SERVICES LTD インド	株式 情報技術サー ビス	44,975	5,242.54 235,783,253	5,839.76 262,643,318	- -	0.41%
30	JD.COM INC ADR ケイマン諸島	株式 インターネッ ト販売・通信 販売	64,400	4,391.93 282,840,578	3,991.27 257,038,110	- -	0.40%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成30年4月27日現在

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

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

平成30年4月27日現在

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

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

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

MITO ラップ型ファンド(安定型)

該当事項はありません。

MITO ラップ型ファンド(中立型)

該当事項はありません。

MITO ラップ型ファンド(積極型)

該当事項はありません。

(参考)

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

平成30年4月27日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
株価指数先物 取引	大阪取引所	TOPIX 先物 3006月	買建	260	4,445,394,240	4,626,700,000	1.53%

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

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

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

J-REITインデックスファンド・マザーファンド

平成30年4月27日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
不動産投信指 数先物取引	大阪取引所	TREIT 先物 3006月	買建	351	579,165,008	604,597,500	1.86%

(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。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年4月27日現在

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

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

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

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

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年4月27日現在

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

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

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

為替予約取引の数量は、現地通貨建契約金額です。

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年4月27日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
為替予約取引	-	アメリカ・ドル売/円買2018年05月	売建	7,800,000	852,672,600	852,696,000	1.71%
		ユーロ売/円買2018年05月	売建	790,000	104,595,210	104,588,100	0.21%
		オーストラリア・ドル売/円買2018年05月	売建	1,180,000	97,452,660	97,444,400	0.20%
		イギリス・ポンド売/円買2018年05月	売建	530,000	80,638,440	80,639,500	0.16%
		シンガポール・ドル売/円買2018年05月	売建	540,000	44,410,680	44,409,600	0.09%
		香港・ドル売/円買2018年05月	売建	1,850,000	25,781,600	25,770,500	0.05%
		カナダ・ドル売/円買2018年05月	売建	290,000	24,624,480	24,623,900	0.05%
		ニュージーランド・ドル売/円買2018年05月	売建	60,000	4,629,000	4,629,000	0.01%

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

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

為替予約取引の数量は、現地通貨建契約金額です。

コモディティインデックス・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

平成30年4月27日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
為替予約取引	-	アメリカ・ドル買/円 売2018年05月	買建	919,000	100,465,080	100,455,890	0.16%
		アメリカ・ドル売/円 買2018年05月	売建	4,500,000	491,850,000	491,940,000	0.76%
		南アフリカ・ランド 売/円買2018年0 5月	売建	33,600,000	295,108,800	296,016,000	0.46%
株価指数先物 取引	ICE-US	MINI MSCI EMG MKT Jun 18	買建	727	4,655,303,968	4,586,207,890	7.10%

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

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

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

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

直近日(平成30年4月末)、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

MITO ラップ型ファンド(安定型)

	純資産総額 (分配落) (百万円)	純資産総額 (分配付) (百万円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (平成28年10月12日)	328	328	0.9865	0.9865
第2計算期間末 (平成29年10月12日)	288	288	1.0231	1.0231
平成29年4月末日	320	-	1.0068	-
5月末日	321	-	1.0084	-
6月末日	336	-	1.0096	-
7月末日	311	-	1.0112	-
8月末日	304	-	1.0150	-
9月末日	297	-	1.0214	-
10月末日	281	-	1.0262	-
11月末日	276	-	1.0287	-
12月末日	280	-	1.0349	-
平成30年1月末日	273	-	1.0282	-
2月末日	276	-	1.0175	-
3月末日	271	-	1.0145	-
4月末日	255	-	1.0206	-

MITO ラップ型ファンド(中立型)

	純資産総額 (分配落) (百万円)	純資産総額 (分配付) (百万円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (平成28年10月12日)	478	478	0.9443	0.9443
第2計算期間末 (平成29年10月12日)	467	467	1.0284	1.0284
平成29年4月末日	503	-	0.9930	-
5月末日	489	-	0.9982	-
6月末日	481	-	1.0035	-
7月末日	472	-	1.0060	-
8月末日	469	-	1.0112	-
9月末日	478	-	1.0253	-
10月末日	440	-	1.0343	-
11月末日	419	-	1.0364	-
12月末日	422	-	1.0482	-
平成30年1月末日	408	-	1.0350	-
2月末日	401	-	1.0135	-
3月末日	389	-	1.0077	-
4月末日	394	-	1.0206	-

MITO ラップ型ファンド(積極型)

	純資産総額 (分配落) (百万円)	純資産総額 (分配付) (百万円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (平成28年10月12日)	574	574	0.9056	0.9056
第2計算期間末 (平成29年10月12日)	514	514	1.0354	1.0354
平成29年4月末日	616	-	0.9810	-
5月末日	596	-	0.9886	-
6月末日	537	-	0.9992	-
7月末日	521	-	1.0029	-
8月末日	521	-	1.0063	-
9月末日	526	-	1.0296	-
10月末日	487	-	1.0434	-
11月末日	459	-	1.0471	-
12月末日	455	-	1.0646	-
平成30年1月末日	461	-	1.0476	-
2月末日	425	-	1.0129	-
3月末日	414	-	1.0030	-
4月末日	415	-	1.0235	-

【分配の推移】

MITO ラップ型ファンド（安定型）

	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
平成29年10月13日～ 平成30年4月12日	-

MITO ラップ型ファンド（中立型）

	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
平成29年10月13日～ 平成30年4月12日	-

MITO ラップ型ファンド（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
平成29年10月13日～ 平成30年4月12日	-

【収益率の推移】

MITO ラップ型ファンド（安定型）

	収益率(%)
第1計算期間	1.4
第2計算期間	3.7
平成29年10月13日～ 平成30年4月12日	0.5

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

なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

MITO ラップ型ファンド(中立型)

	収益率(%)
第1計算期間	5.6
第2計算期間	8.9
平成29年10月13日～ 平成30年4月12日	1.4

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

なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

MITO ラップ型ファンド(積極型)

	収益率(%)
第1計算期間	9.4
第2計算期間	14.3
平成29年10月13日～ 平成30年4月12日	2.4

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

なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

(4)【設定及び解約の実績】

MITO ラップ型ファンド(安定型)

	設定口数	解約口数
第1計算期間	450,526,549	117,670,883
第2計算期間	106,561,734	157,044,380
平成29年10月13日～ 平成30年4月12日	20,414,406	35,437,690

(注1) 本邦外における設定及び解約はございません。

(注2) 第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

MITO ラップ型ファンド(中立型)

	設定口数	解約口数
第1計算期間	549,915,397	42,826,059
第2計算期間	115,234,237	167,550,937
平成29年10月13日～ 平成30年4月12日	24,481,651	92,248,270

(注1) 本邦外における設定及び解約はございません。

(注2) 第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

MITO ラップ型ファンド(積極型)

	設定口数	解約口数
第1計算期間	813,482,460	179,473,590
第2計算期間	162,105,929	299,455,388
平成29年10月13日～ 平成30年4月12日	38,635,878	122,351,851

(注1) 本邦外における設定及び解約はございません。

(注2) 第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

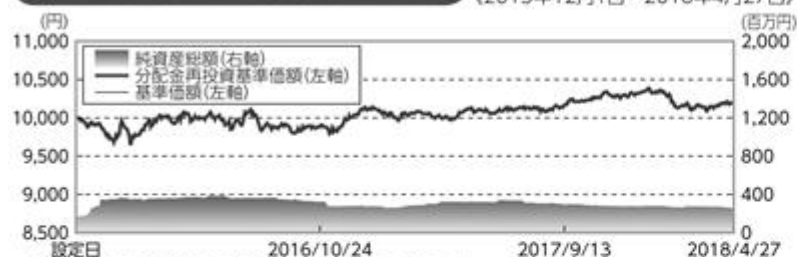
<< 参考情報 >>

データの基準日:2018年4月27日

MITO ラップ型ファンド(安定型)

➤ 基準価額・純資産の推移

(2015年12月1日～2018年4月27日)



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。
 ※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額とは異なります。(設定日:2015年12月1日)
 ※設定時から10年以上経過した場合は、直近10年分を記載しています。

➤ 分配の推移(税引前)

第1期 (2016.10.12)	0円
第2期 (2017.10.12)	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

※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

組入銘柄

順位	銘柄名	比率
1	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	62.50%
2	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	9.42%
3	ISHARES JP MORGAN USD EMERGING MARKETS BOND ETF	7.78%
4	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	4.05%
5	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	3.53%
6	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	2.69%
7	コモディティインデックス・マザーファンド	2.68%
8	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	2.35%
9	J-REITインデックスファンド・マザーファンド	0.24%

➤ 年間収益率の推移(暦年ベース)

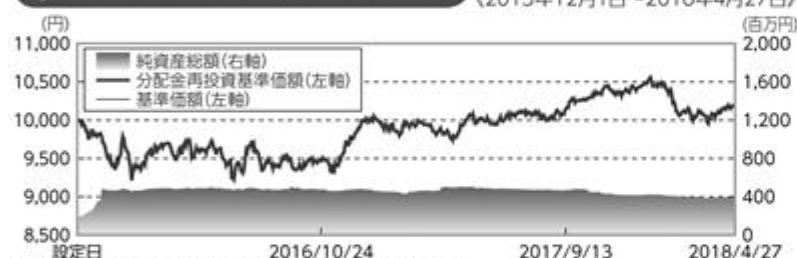


※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。
 ※2015年は設定日から年末までの収益率、および2018年については年初から基準日までの収益率を表示しています。
 ※当ファンドにはベンチマークはありません。

MITO ラップ型ファンド(中立型)

➤ 基準価額・純資産の推移

(2015年12月1日～2018年4月27日)



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。
 ※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額とは異なります。(設定日:2015年12月1日)
 ※設定時から10年以上経過した場合は、直近10年分を記載しています。

➤ 分配の推移(税引前)

第1期 (2016.10.12)	0円
第2期 (2017.10.12)	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たりです。

○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。

主要な資産の状況

※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

組入銘柄

順位	銘柄名	比率
1	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	33.82%
2	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	17.56%
3	ISHARES JP MORGAN USD EMERGING MARKETS BOND ETF	14.40%
4	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	7.21%
5	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	6.21%
6	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	6.07%
7	エマーゼンダ株式パッシブ・マザーファンド	4.90%
8	コモディティインデックス・マザーファンド	4.66%
9	J-REITインデックスファンド・マザーファンド	0.41%

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。

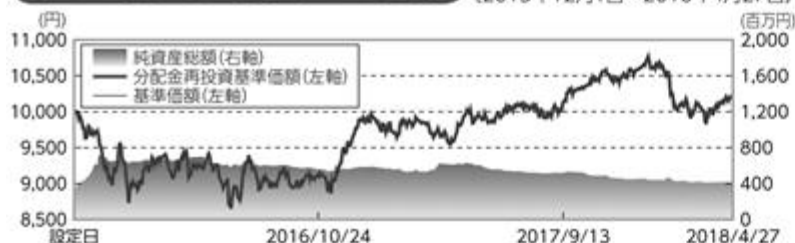
※2015年は設定日から年末までの収益率、および2018年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

※当ファンドにはベンチマークはありません。

MITO ラップ型ファンド(積極型)

基準価額・純資産の推移

(2015年12月1日～2018年4月27日)



※基準価額は1万口当たり、信託報酬控除後の価額です。

※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額とは異なります。(設定日:2015年12月1日)

※設定時から10年以上経過した場合は、直近10年分を記載しています。

分配の推移(税引前)

第1期 (2016.10.12)	0円
第2期 (2017.10.12)	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

※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

組入銘柄

順位	銘柄名	比率
1	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	20.58%
2	ISHARES JP MORGAN USD EMERGING MARKETS BOND ETF	16.55%
3	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	13.57%
4	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	11.36%
5	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	10.32%
6	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	9.92%
7	コモディティインデックス・マザーファンド	5.54%
8	エマーゼンダ株式パッシブ・マザーファンド	5.39%
9	J-REITインデックスファンド・マザーファンド	1.03%

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2018年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

※当ファンドにはベンチマークはありません。

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

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

- ・お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

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

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

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

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

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

- ・お申込価額

お申込日の翌営業日の基準価額 とします。

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

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

< 基準価額の照会方法等 >

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

各ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・ 販売会社へのお問い合わせ
- ・ 委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

・ お申込手数料

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

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

「分配金自動けいぞく投資コース」により、収益分配金を再投資する場合は、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には、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經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6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
iシェアーズ J.P.モルガン・米ドル建て エマージング・マーケット債券 ETF	計算日における金融商品取引所等の最終相場
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。

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)

(2)【保管】

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

(3)【信託期間】

信託期間は、平成27年12月1日から原則として平成37年10月10日までです。

下記(5)イ・償還規定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。また、委託会社は、信託期間満了前に、信託期間の延長が受益者に有利であると認めるときは、受託会社と協議のうえ、信託期間を延長することができます。

(4)【計算期間】

a. 計算期間は、原則として毎年10月13日から翌年10月12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10億口を下回るようになった場合、またはやむを得ない事情が発生した場合は、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

b. 委託会社は、上記a.の事項について、書面による決議(以下「書面決議」といいます。)を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日および信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託契約にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。

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、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

- d. 上記b.の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- e. 上記b.からd.までの規定は、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、信託契約にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記b.からd.までの手続きを行うことが困難な場合にも適用しません。
- 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け出ます。なお、約款は「ロ．信託約款の変更等」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等の事項を定め、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、これを行行使うことができます。なお、知っている受益者が議決権を行行使わないときは、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うことができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- e. 書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。
- f. 上記b.からe.までの規定は、委託会社が重大な約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、約款にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
- g. 上記a.からf.の規定にかかわらず、この信託において併合の書面決議が可決された場合にあっては、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。

また、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3ヶ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。

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10月12日(休業日の場合は翌営業日とします。)および償還時に交付運用報告書を作成し、販売会社を通じて受益者に対して交付します。
- ・運用報告書(全体版)は、委託会社のホームページにおいて開示します。ただし、受益者から運用報告書(全体版)の請求があった場合には、これを交付します。
(URL <http://www.am-one.co.jp/>)

4【受益者の権利等】

(1)収益分配金請求権

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。

(2)償還金請求権

受益者は、持ち分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者(償還日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため、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。

(3)一部解約請求権

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

(4)帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

MITO ラップ型ファンド(安定型)

- (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) 当ファンドの第1期計算期間は信託約款の規定に基づき、平成27年12月1日から平成28年10月12日までとなっております。
- (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2期計算期間(平成28年10月13日から平成29年10月12日まで)の財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人による監査を受けております。

1【財務諸表】

【MITO ラップ型ファンド（安定型）】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第1期 平成28年10月12日現在	第2期 平成29年10月12日現在
資産の部		
流動資産		
預金	731,513	385,148
コール・ローン	19,973,276	10,373,784
投資信託受益証券	22,932,786	11,596,328
親投資信託受益証券	288,479,489	263,783,272
未収入金	-	8,934,000
流動資産合計	332,117,064	295,072,532
資産合計	332,117,064	295,072,532
負債の部		
流動負債		
未払解約金	1,999,999	4,063,589
未払受託者報酬	56,758	68,479
未払委託者報酬	1,689,341	2,038,558
その他未払費用	6,316	7,596
流動負債合計	3,752,414	6,178,222
負債合計	3,752,414	6,178,222
純資産の部		
元本等		
元本	1 332,855,666	1 282,373,020
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2 4,491,016	2 6,521,290
（分配準備積立金）	641,909	6,963,319
元本等合計	328,364,650	288,894,310
純資産合計	328,364,650	288,894,310
負債純資産合計	332,117,064	295,072,532

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期		第2期	
	自	平成27年12月1日 平成28年10月12日	自	平成28年10月13日 平成29年10月12日
営業収益				
受取配当金		849,988		652,976
受取利息		3,039		460
有価証券売買等損益		3,346,903		12,591,763
為替差損益		3,796,972		1,711,454
営業収益合計		402,958		14,956,653
営業費用				
支払利息		6,459		12,347
受託者報酬		128,633		130,251
委託者報酬		3,829,003		3,877,484
その他費用		56,434		34,999
営業費用合計		4,020,529		4,055,081
営業利益又は営業損失（ ）		3,617,571		10,901,572
経常利益又は経常損失（ ）		3,617,571		10,901,572
当期純利益又は当期純損失（ ）		3,617,571		10,901,572
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（ ）		670,864		2,188,609
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		-		4,491,016
剰余金増加額又は欠損金減少額		533,331		2,299,343
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		533,331		1,716,552
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		582,791
剰余金減少額又は欠損金増加額		2,077,640		-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		2,077,640		-
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		4,491,016		6,521,290

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<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>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。</p>
2. 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>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建資産及び負債は、決算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	第1期 平成28年10月12日現在	第2期 平成29年10月12日現在
1. 1 期首元本額 期中追加設定元本額 期中一部解約元本額	167,312,285円 283,214,264円 117,670,883円	332,855,666円 106,561,734円 157,044,380円
2. 受益権の総数	332,855,666口	282,373,020口
3. 2 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は4,491,016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1期 自 平成27年12月1日 至 平成28年10月12日	第2期 自 平成28年10月13日 至 平成29年10月12日
1 . 1 分配金の計算過程	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(641,909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(149,371円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象収益は791,280円(1万口当たり23.77円)であります。なお、分配を行っておりません。なお、分配金の計算過程においては、親投資信託の配当等収益及び収益調整金相当額を充当する方法によっております。</p>	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(2,892,246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(3,689,931円)、信託約款に規定される収益調整金(397,350円)及び分配準備積立金(381,142円)より分配対象収益は7,360,669円(1万口当たり260.67円)であります。なお、分配を行っておりません。なお、分配金の計算過程においては、親投資信託の配当等収益及び収益調整金相当額を充当する方法によっております。</p>

(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1期 自 平成27年12月1日 至 平成28年10月12日	第2期 自 平成28年10月13日 至 平成29年10月12日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、主要投資対象である投資信託受益証券及び親投資信託受益証券が保有する金融商品に係る、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第1期 平成28年10月12日現在	第2期 平成29年10月12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1期 平成28年10月12日現在	第2期 平成29年10月12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）
投資信託受益証券	1,623,710	2,002
親投資信託受益証券	869,250	8,575,123
合計	2,492,960	8,577,125

（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1期 平成28年10月12日現在	第2期 平成29年10月12日現在
	1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	0.9865円 (9,865円)

(4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

平成29年10月12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	アメリカ・ドル	ISHARES JP MORGAN USD EMERGING MARKETS BOND ETF	890.000	103,124.300	
	アメリカ・ドル	小計	890.000	103,124.300 (11,596,328)	
投資信託受益証券 合計			890	11,596,328 (11,596,328)	
親投資信託受益証券	日本円	国内株式パッシブ・ファンド (最適化法)・マザーファンド	5,252,599	13,468,189	
		国内債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	141,771,788	181,595,483	
		J-REITインデックスファ ンド・マザーファンド	390,736	649,637	
		外国株式パッシブ・ファンド・ マザーファンド	2,952,003	9,908,398	
		外国債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	17,683,445	32,640,102	
		外国リート・パッシブ・ファン ド・マザーファンド	6,259,398	7,583,886	
		コモディティインデックス・マ ザーファンド	24,112,594	9,483,483	
		エマージング株式パッシブ・マ ザーファンド	6,887,807	8,454,094	
日本円 小計			205,310,370	263,783,272	
親投資信託受益証券 合計			205,310,370	263,783,272	
合計				275,379,600 (11,596,328)	

投資信託受益証券及び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。

- (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 投資信託受益証券 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	投資信託受益証券 1銘柄	4.01%	4.21%

(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

該当事項はありません。

MITO ラップ型ファンド(中立型)

- (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) 当ファンドの第1期計算期間は信託約款の規定に基づき、平成27年12月1日から平成28年10月12日までとなっております。
- (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2期計算期間(平成28年10月13日から平成29年10月12日まで)の財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人による監査を受けております。

【MITO ラップ型ファンド(中立型)】

(1) 【貸借対照表】

(単位:円)

	第1期 平成28年10月12日現在	第2期 平成29年10月12日現在
資産の部		
流動資産		
預金	1,172,752	788,380
コール・ローン	31,116,562	23,024,770
投資信託受益証券	68,258,055	71,206,663
親投資信託受益証券	381,120,544	384,157,631
未収入金	-	3,119,000
流動資産合計	481,667,913	482,296,444
資産合計	481,667,913	482,296,444
負債の部		
流動負債		
未払解約金	478,858	11,361,145
未払受託者報酬	76,392	104,519
未払委託者報酬	2,273,389	3,110,669
その他未払費用	8,525	11,680
流動負債合計	2,837,164	14,588,013
負債合計	2,837,164	14,588,013
純資産の部		
元本等		
元本	1,507,089,338	1,454,772,638
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	2 28,258,589	2 12,935,793
(分配準備積立金)	3,343,679	18,330,128
元本等合計	478,830,749	467,708,431
純資産合計	478,830,749	467,708,431
負債純資産合計	481,667,913	482,296,444

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第1期		第2期	
	自	平成27年12月1日 至 平成28年10月12日	自	平成28年10月13日 至 平成29年10月12日
営業収益				
受取配当金		2,359,461		2,868,904
受取利息		4,290		1,159
有価証券売買等損益		9,085,336		37,345,883
為替差損益		10,746,611		6,621,567
営業収益合計		17,468,196		46,837,513
営業費用				
支払利息		8,049		18,932
受託者報酬		171,146		204,593
委託者報酬		5,093,832		6,088,950
その他費用		68,739		45,533
営業費用合計		5,341,766		6,358,008
営業利益又は営業損失()		22,809,962		40,479,505
経常利益又は経常損失()		22,809,962		40,479,505
当期純利益又は当期純損失()		22,809,962		40,479,505
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額()		1,723,460		7,361,524
期首剰余金又は期首欠損金()		-		28,258,589
剰余金増加額又は欠損金減少額		567,430		8,558,045
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		567,430		8,558,045
剰余金減少額又は欠損金増加額		7,739,517		481,644
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		7,739,517		481,644
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金()		28,258,589		12,935,793

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<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>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。</p>
2. 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>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建資産及び負債は、決算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	第1期 平成28年10月12日現在	第2期 平成29年10月12日現在
1. 1 期首元本額 期中追加設定元本額 期中一部解約元本額	189,882,036円 360,033,361円 42,826,059円	507,089,338円 115,234,237円 167,550,937円
2. 受益権の総数	507,089,338口	454,772,638口
3. 2 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は28,258,589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1期 自 平成27年12月1日 至 平成28年10月12日	第2期 自 平成28年10月13日 至 平成29年10月12日
1. 1 分配金の計算過程	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(3,343,679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(212,349円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象収益は3,556,028円(1万口当たり70.13円)ですが、分配を行っておりません。なお、分配金の計算過程においては、親投資信託の配当等収益及び収益調整金相当額を充当する方法によっております。</p>	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(7,634,808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(8,350,416円)、信託約款に規定される収益調整金(1,106,662円)及び分配準備積立金(2,344,904円)より分配対象収益は19,436,790円(1万口当たり427.40円)ですが、分配を行っておりません。なお、分配金の計算過程においては、親投資信託の配当等収益及び収益調整金相当額を充当する方法によっております。</p>

（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1期 自 平成27年12月1日 至 平成28年10月12日	第2期 自 平成28年10月13日 至 平成29年10月12日
1． 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2． 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、主要投資対象である投資信託受益証券及び親投資信託受益証券が保有する金融商品に係る、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
3． 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第1期 平成28年10月12日現在	第2期 平成29年10月12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1期 平成28年10月12日現在	第2期 平成29年10月12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)
投資信託受益証券	5,085,670	270,384
親投資信託受益証券	12,366,479	27,425,020
合計	7,280,809	27,695,404

(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1期 平成28年10月12日現在	第2期 平成29年10月12日現在
1口当たり純資産額	0.9443円	1.0284円
(1万口当たり純資産額)	(9,443円)	(10,284円)

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

平成29年10月12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	アメリカ・ドル	ISHARES JP MORGAN USD EMERGING MARKETS BOND ETF	5,465,000	633,229,550	
	アメリカ・ドル	小計	5,465,000	633,229,550 (71,206,663)	
投資信託受益証券 合計			5,465	71,206,663 (71,206,663)	
親投資信託受益証券	日本円	国内株式パッシブ・ファンド (最適化法)・マザーファンド	13,038,380	33,431,710	
		国内債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	127,305,344	163,065,415	
		J-REITインデックスファ ンド・マザーファンド	1,086,594	1,806,571	
		外国株式パッシブ・ファンド・ マザーファンド	7,416,677	24,894,076	
		外国債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	50,060,065	92,400,867	
		外国リート・パッシブ・ファン ド・マザーファンド	17,740,502	21,494,392	
		コモディティインデックス・マ ザーファンド	58,985,902	23,199,155	
	エマージング株式パッシブ・マ ザーファンド	19,443,902	23,865,445		
日本円 小計			295,077,366	384,157,631	
親投資信託受益証券 合計			295,077,366	384,157,631	
合計				455,364,294 (71,206,663)	

投資信託受益証券及び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。

- (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 投資信託受益証券 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	投資信託受益証券 1銘柄	15.22%	15.64%

(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

該当事項はありません。

MITO ラップ型ファンド(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) 当ファンドの第1期計算期間は信託約款の規定に基づき、平成27年12月1日から平成28年10月12日までとなっております。
- (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2期計算期間(平成28年10月13日から平成29年10月12日まで)の財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人による監査を受けております。

【MITO ラップ型ファンド(積極型)】

(1) 【貸借対照表】

(単位:円)

	第1期 平成28年10月12日現在	第2期 平成29年10月12日現在
資産の部		
流動資産		
預金	1,577,817	975,600
コール・ローン	41,747,620	27,992,822
投資信託受益証券	97,254,221	87,949,675
親投資信託受益証券	436,521,336	406,068,347
未収入金	-	6,597,000
流動資産合計	577,100,994	529,583,444
資産合計	577,100,994	529,583,444
負債の部		
流動負債		
未払解約金	-	11,624,594
未払受託者報酬	95,541	120,225
未払委託者報酬	2,843,337	3,578,354
その他未払費用	10,687	13,442
流動負債合計	2,949,565	15,336,615
負債合計	2,949,565	15,336,615
純資産の部		
元本等		
元本	1,634,008,870	1,496,659,411
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	2 59,857,441	2 17,587,418
(分配準備積立金)	6,443,537	26,754,752
元本等合計	574,151,429	514,246,829
純資産合計	574,151,429	514,246,829
負債純資産合計	577,100,994	529,583,444

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第1期		第2期	
	自	平成27年12月1日 至 平成28年10月12日	自	平成28年10月13日 至 平成29年10月12日
営業収益				
受取配当金		3,991,890		3,886,714
受取利息		6,429		1,173
有価証券売買等損益		37,900,023		70,258,322
為替差損益		19,003,285		8,677,261
営業収益合計		52,904,989		82,823,470
営業費用				
支払利息		9,858		21,762
受託者報酬		232,252		241,665
委託者報酬		6,911,725		7,192,592
その他費用		79,851		55,764
営業費用合計		7,233,686		7,511,783
営業利益又は営業損失()		60,138,675		75,311,687
経常利益又は経常損失()		60,138,675		75,311,687
当期純利益又は当期純損失()		60,138,675		75,311,687
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()		11,625,133		19,874,628
期首剰余金又は期首欠損金()		-		59,857,441
剰余金増加額又は欠損金減少額		2,782,973		25,408,414
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		2,782,973		25,408,414
剰余金減少額又は欠損金増加額		14,126,872		3,400,614
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		14,126,872		3,400,614
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金()		59,857,441		17,587,418

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<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>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。</p>
2. 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>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建資産及び負債は、決算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	第1期 平成28年10月12日現在	第2期 平成29年10月12日現在
1. 1 期首元本額 期中追加設定元本額 期中一部解約元本額	355,418,559円 458,063,901円 179,473,590円	634,008,870円 162,105,929円 299,455,388円
2. 受益権の総数	634,008,870口	496,659,411口
3. 2 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は59,857,441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1期	第2期
	自 平成27年12月1日 至 平成28年10月12日	自 平成28年10月13日 至 平成29年10月12日
1. 1 分配金の計算過程	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(6,443,537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(381,778円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象収益は6,825,315円(1万口当たり107.65円)ですが、分配を行っておりません。なお、分配金の計算過程においては、親投資信託の配当等収益及び収益調整金相当額を充当する方法によっております。</p>	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(10,507,282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(12,437,905円)、信託約款に規定される収益調整金(2,016,824円)及び分配準備積立金(3,809,565円)より分配対象収益は28,771,576円(1万口当たり579.30円)ですが、分配を行っておりません。なお、分配金の計算過程においては、親投資信託の配当等収益及び収益調整金相当額を充当する方法によっております。</p>

（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1期 自 平成27年12月1日 至 平成28年10月12日	第2期 自 平成28年10月13日 至 平成29年10月12日
1． 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2． 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、主要投資対象である投資信託受益証券及び親投資信託受益証券が保有する金融商品に係る、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
3． 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第1期 平成28年10月12日現在	第2期 平成29年10月12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1期 平成28年10月12日現在	第2期 平成29年10月12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)
投資信託受益証券	7,014,688	243,401
親投資信託受益証券	33,262,058	49,506,615
合計	26,247,370	49,750,016

(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1期 平成28年10月12日現在	第2期 平成29年10月12日現在
1口当たり純資産額	0.9056円	1.0354円
(1万口当たり純資産額)	(9,056円)	(10,354円)

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

平成29年10月12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	アメリカ・ドル	ISHARES JP MORGAN USD EMERGING MARKETS BOND ETF	6,750,000	782,122,500	
	アメリカ・ドル	小計	6,750,000	782,122,500 (87,949,675)	
投資信託受益証券 合計			6,750	87,949,675 (87,949,675)	
親投資信託受益証券	日本円	国内株式パッシブ・ファンド (最適化法)・マザーファンド	23,681,430	60,721,554	
		国内債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	40,618,516	52,028,257	
		J-REITインデックスファ ンド・マザーファンド	2,923,343	4,860,350	
		外国株式パッシブ・ファンド・ マザーファンド	19,987,131	67,086,805	
		外国債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	58,635,841	108,230,035	
		外国リート・パッシブ・ファン ド・マザーファンド	47,634,574	57,714,049	
		コモディティインデックス・マ ザーファンド	69,776,972	27,443,283	
		エマージング株式パッシブ・マ ザーファンド	22,799,425	27,984,014	
日本円 小計			286,057,232	406,068,347	
親投資信託受益証券 合計			286,057,232	406,068,347	
合計				494,018,022 (87,949,675)	

投資信託受益証券及び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。

- (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 投資信託受益証券 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	投資信託受益証券 1銘柄	17.10%	17.80%

(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

該当事項はありません。

（参考）

「MITO ラップ型ファンド（安定型）」、「MITO ラップ型ファンド（中立型）」、「MITO ラップ型ファンド（積極型）」は、「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」受益証券、「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「J-REITインデックスファンド・マザーファンド」受益証券、「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「コモディティインデックス・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。

「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」の状況

貸借対照表

（単位：円）

科 目	注記 番号	平成28年10月12日現在	平成29年10月12日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		5,889,323,978	6,062,166,668
株式	2	274,144,773,250	297,566,000,230
派生商品評価勘定		90,428,948	214,479,680
未収入金		4,319,728	11,015,998
未収配当金		2,350,262,725	2,352,048,167
流動資産合計		282,479,108,629	306,205,710,743
資産合計		282,479,108,629	306,205,710,743
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		182,916	-
前受金		136,187,200	210,324,000
未払解約金		828,535,000	918,005,000
流動負債合計		964,905,116	1,128,329,000
負債合計		964,905,116	1,128,329,000
純資産の部			
元本等			
元本	1	141,984,682,751	118,980,682,522
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		139,529,520,762	186,096,699,221
元本等合計		281,514,203,513	305,077,381,743
純資産合計		281,514,203,513	305,077,381,743
負債純資産合計		282,479,108,629	306,205,710,743

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	平成28年10月12日現在	平成29年10月12日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	138,472,968,255円	141,984,682,751円
同期中追加設定元本額	37,509,003,652円	20,961,822,659円
同期中一部解約元本額	33,997,289,156円	43,965,822,888円
元本の内訳		
ファンド名		
DIAM DC 国内株式インデックスファンド	6,549,280,589円	7,381,462,783円
DIAM国内株式パッシブ・ファンド	1,575,376,249円	2,140,866,731円
MITO ラップ型ファンド（安定型）	5,822,033円	5,252,599円
MITO ラップ型ファンド（中立型）	12,618,708円	13,038,380円
MITO ラップ型ファンド（積極型）	25,144,181円	23,681,430円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	13,903,705円	13,228,825円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	11,101,393円	13,420,191円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	12,262,597円	15,993,845円
たわらノーロード TOPIX	- 円	82,133,781円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	- 円	5,443,582円
DIAM国内株式インデックスファンド<DC年金>	39,026,844,057円	35,814,315,681円
DIAMバランス・ファンド<DC年金> 1安定型	892,175,848円	797,265,541円
DIAMバランス・ファンド<DC年金> 2安定・成長型	3,085,053,451円	2,772,479,361円
DIAMバランス・ファンド<DC年金> 3成長型	3,110,638,487円	2,863,257,582円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	406,578,514円	352,045,452円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	1,299,706,406円	1,179,965,536円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	1,135,404,057円	1,081,878,743円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	63,391,188円	50,599,626円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	1,361,434,988円	1,191,234,103円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	29,855,862円	25,856,596円
DIAM DC 8資産バランスファンド（新興国10）	34,618,530円	40,016,978円
DIAM DC 8資産バランスファンド（新興国20）	70,908,730円	92,537,042円

D I A M D C 8 資産バランス ファンド(新興国30)	134,667,581円	173,340,139円
投資のソムリエ	1,532,512,647円	3,598,167,045円
クルーズコントロール	1,361,224,064円	1,385,033,156円
投資のソムリエ<DC年金>	42,045,295円	197,160,817円
D I A M 8 資産バランスファン ドN<DC年金>	111,572,421円	146,751,099円
D I A M D C バランス・F (成長型)	107,729,591円	171,592,462円
クルーズコントロール<DC年金 >	435,072円	461,778円
D I A Mコア資産設計ファンド (堅実型)	16,553,351円	7,645,471円
D I A Mコア資産設計ファンド (積極型)	41,655,765円	23,808,944円
投資のソムリエ<DC年金>リス ク抑制型	13,516,086円	62,307,274円
ダイナミック・ナビゲーション	2,259,439円	1,486,477円
リスク抑制世界8資産バランス ファンド	- 円	792,410,147円
投資のソムリエ(ターゲット・イ ヤー2045)	- 円	592,766円
投資のソムリエ(ターゲット・イ ヤー2055)	- 円	592,766円
リスク抑制世界8資産バランス ファンド(DC)	- 円	238,256円
D I A Mアクティブアロケーショ ン私募ファンド(適格機関投資家 限定)	249,214,122円	- 円
D I A Mワールドバランス25V A(適格機関投資家限定)	108,351,515円	76,811,419円
D I A Mグローバル・バランス ファンド25VA(適格機関投資 家限定)	256,516,116円	156,029,386円
D I A Mグローバル・バランス ファンド50VA(適格機関投資 家限定)	448,843,778円	334,296,917円
D I A M国際分散バランスファン ド30VA(適格機関投資家限 定)	32,496,190円	19,939,130円
D I A M国際分散バランスファン ド50VA(適格機関投資家限 定)	138,048,923円	96,956,097円
D I A M国内重視バランスファン ド30VA(適格機関投資家限 定)	35,339,487円	21,537,117円
D I A M国内重視バランスファン ド50VA(適格機関投資家限 定)	44,104,951円	27,179,602円
D I A M世界バランスファンド4 0VA(適格機関投資家限定)	2,613,101,420円	40,415,290円
D I A M世界バランスファンド5 0VA(適格機関投資家限定)	921,644,988円	67,149,356円

D I A Mバランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	1,759,630,851円	1,227,769,114円
D I A Mバランスファンド37.5VA (適格機関投資家限定)	1,488,934,009円	1,159,373,010円
D I A Mバランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	3,941,172,402円	3,132,500,067円
D I A Mグローバル・アセット・バランスVA (適格機関投資家限定)	332,873,979円	230,378,853円
D I A Mグローバル・アセット・バランスVA2 (適格機関投資家限定)	731,561,485円	155,354,227円
D I A M アクサ グローバルバランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	937,888,973円	676,430,709円
D I A M世界アセットバランスファンドVA (適格機関投資家向け)	3,833,571,575円	2,674,063,219円
D I A Mグローバル 私募ファンド (適格機関投資家向け)	51,147,517円	10,313,671円
D I A M世界バランスファンド55VA (適格機関投資家限定)	1,360,969,610円	178,653,922円
D I A M世界バランスファンド35VA (適格機関投資家限定)	5,436,117,474円	2,129,542,429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)	21,190,612,731円	16,798,495,071円
D I A M世界アセットバランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	778,556,088円	603,397,247円
D I A M世界アセットバランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	2,431,224,796円	1,915,844,419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)	13,422,317,174円	10,822,212,577円
D I A Mバランス30VA (適格機関投資家限定)	7,865,270円	3,553,157円
D I A Mバランス50VA (適格機関投資家限定)	3,381,053円	4,968,662円
D I A Mバランス70VA (適格機関投資家限定)	1,215,517円	4,468,394円
D I A M世界アセットバランスファンド4VA (適格機関投資家限定)	12,044,427,017円	9,646,791,837円
D I A M世界バランス25VA (適格機関投資家限定)	109,073,229円	77,974,896円
D I A M国内バランス30VA (適格機関投資家限定)	38,767,272円	30,029,445円
D I A Mバランス20VA (適格機関投資家限定)	43,596,204円	30,306,394円
D I A Mバランス40VA (適格機関投資家限定)	81,496円	69,877円

	D I A Mバランス60VA(適格 機関投資家限定)	128,550円	114,762円
	D I A M世界アセットバランス ファンド7VA(1212)(適 格機関投資家限定)	693,705,071円	547,756,483円
	D I A M世界アセットバランス ファンド7VA(1303)(適 格機関投資家限定)	1,859,845,103円	1,500,552,498円
	D I A M世界アセットバランス ファンド7VA(1306)(適 格機関投資家限定)	2,451,073,369円	1,976,540,138円
	D I A M世界アセットバランス ファンド7VA(1309)(適 格機関投資家限定)	100,992,561円	85,350,145円
	計	141,984,682,751円	118,980,682,522円
2.	受益権の総数	141,984,682,751口	118,980,682,522口
3.	2 差入代用有価証券	株式 2,978,500,000円	株式 3,462,500,000円

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成27年12月1日 至 平成28年10月12日	自 平成28年10月13日 至 平成29年10月12日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価の変動によるリスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成28年10月12日現在	平成29年10月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成28年10月12日現在	平成29年10月12日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
株式	6,416,796,421	32,174,357,497
合計	6,416,796,421	32,174,357,497

(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28年2月9日から平成28年10月12日まで及び平成29年2月8日から平成29年10月12日まで）に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

株式関連

種類	平成28年10月12日 現在				平成29年10月12日 現在			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引								
先物取引								
買 建	7,070,301,600	-	7,160,720,000	90,418,400	7,099,681,000	-	7,314,300,000	214,619,000
合計	7,070,301,600	-	7,160,720,000	90,418,400	7,099,681,000	-	7,314,300,000	214,619,000

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成28年10月12日現在	平成29年10月12日現在
1口当たり純資産額	1.9827円	2.5641円
(1万口当たり純資産額)	(19,827円)	(25,641円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

平成29年10月12日現在

銘柄	株式数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
極洋	5,500	3,585.00	19,717,500	
日本水産	175,200	649.00	113,704,800	
マルハニチロ	25,600	3,460.00	88,576,000	
ハウスイ	1,200	1,233.00	1,479,600	
カネコ種苗	4,800	1,572.00	7,545,600	
サカタのタネ	19,900	3,560.00	70,844,000	
ホクト	13,700	1,941.00	26,591,700	
ホクリヨウ	1,600	1,145.00	1,832,000	
ショーボンドホールディングス	13,000	6,340.00	82,420,000	
ミライト・ホールディングス	41,400	1,374.00	56,883,600	
タマホーム	10,700	752.00	8,046,400	
サンヨーホームズ	3,200	820.00	2,624,000	
ファーストコーポレーション	3,100	1,124.00	3,484,400	
インベスターズクラウド	2,300	6,770.00	15,571,000	
住石ホールディングス	39,800	162.00	6,447,600	
日鉄鉱業	3,700	7,860.00	29,082,000	
三井松島産業	8,000	1,382.00	11,056,000	
国際石油開発帝石	709,500	1,159.00	822,310,500	
日本海洋掘削	4,800	2,137.00	10,257,600	
石油資源開発	21,300	2,310.00	49,203,000	
K&Oエナジーグループ	7,900	1,862.00	14,709,800	
ダイセキ環境ソリューション	3,900	1,391.00	5,424,900	
安藤・間	97,000	852.00	82,644,000	
東急建設	47,900	932.00	44,642,800	
コムシスホールディングス	52,700	2,719.00	143,291,300	
ミサワホーム	16,000	956.00	15,296,000	
ピーアールホールディングス	13,200	398.00	5,253,600	
高松コンストラクショングループ	10,100	3,120.00	31,512,000	
東建コーポレーション	5,000	13,210.00	66,050,000	
ヤマウラ	6,900	951.00	6,561,900	
大成建設	137,000	6,200.00	849,400,000	
大林組	404,000	1,394.00	563,176,000	
清水建設	412,200	1,279.00	527,203,800	
飛島建設	131,700	163.00	21,467,100	
長谷工コーポレーション	157,200	1,546.00	243,031,200	
松井建設	15,000	989.00	14,835,000	
銭高組	1,900	5,530.00	10,507,000	
鹿島建設	592,000	1,154.00	683,168,000	
不動テトラ	109,200	190.00	20,748,000	
大末建設	5,000	997.00	4,985,000	
鉄建建設	8,200	3,590.00	29,438,000	
西松建設	31,000	3,300.00	102,300,000	
三井住友建設	102,800	715.00	73,502,000	

大豊建設	49,000	543.00	26,607,000
前田建設工業	89,000	1,356.00	120,684,000
佐田建設	9,300	474.00	4,408,200
ナカノフドー建設	10,600	632.00	6,699,200
奥村組	22,000	4,275.00	94,050,000
東鉄工業	16,200	3,545.00	57,429,000
イチケン	2,600	2,704.00	7,030,400
浅沼組	45,000	351.00	15,795,000
戸田建設	157,000	867.00	136,119,000
熊谷組	21,200	3,500.00	74,200,000
青木あすなる建設	8,500	1,027.00	8,729,500
北野建設	27,000	495.00	13,365,000
植木組	1,700	2,703.00	4,595,100
三井ホーム	17,000	718.00	12,206,000
矢作建設工業	18,500	994.00	18,389,000
ピーエス三菱	14,500	675.00	9,787,500
日本ハウスホールディングス	25,700	664.00	17,064,800
大東建託	48,800	21,030.00	1,026,264,000
新日本建設	16,200	902.00	14,612,400
NIPPO	31,000	2,266.00	70,246,000
東亜道路工業	2,500	4,380.00	10,950,000
前田道路	42,000	2,407.00	101,094,000
日本道路	4,000	6,420.00	25,680,000
東亜建設工業	11,000	2,149.00	23,639,000
若築建設	7,900	1,924.00	15,199,600
東洋建設	39,100	511.00	19,980,100
五洋建設	149,700	704.00	105,388,800
世紀東急工業	20,000	660.00	13,200,000
福田組	4,400	6,640.00	29,216,000
日本ドライケミカル	1,700	2,409.00	4,095,300
住友林業	92,500	1,833.00	169,552,500
日本基礎技術	15,600	393.00	6,130,800
日成ビルド工業	20,000	1,239.00	24,780,000
ヤマダ・エスバイエルホーム	74,000	89.00	6,586,000
巴コーポレーション	16,800	426.00	7,156,800
大和ハウス工業	397,800	4,065.00	1,617,057,000
ライト工業	25,900	1,112.00	28,800,800
積水ハウス	412,100	1,959.50	807,509,950
日特建設	11,800	599.00	7,068,200
北陸電気工事	6,600	1,039.00	6,857,400
ユアテック	21,000	860.00	18,060,000
西部電気工業	2,200	2,483.00	5,462,600
四電工	1,200	3,060.00	3,672,000
中電工	15,000	3,210.00	48,150,000
関電工	54,000	1,135.00	61,290,000
きんでん	89,400	1,812.00	161,992,800
東京エネシス	13,900	1,195.00	16,610,500
トーエネック	3,800	3,375.00	12,825,000
住友電設	9,300	2,134.00	19,846,200
日本電設工業	20,600	2,367.00	48,760,200

協和エクシオ	52,700	2,378.00	125,320,600
新日本空調	10,400	1,622.00	16,868,800
日本工営	8,500	4,175.00	35,487,500
N D S	2,000	3,610.00	7,220,000
九電工	26,500	4,375.00	115,937,500
三機工業	28,600	1,260.00	36,036,000
日揮	125,700	1,861.00	233,927,700
中外炉工業	4,200	2,215.00	9,303,000
ヤマト	12,300	702.00	8,634,600
太平電業	9,100	2,762.00	25,134,200
高砂熱学工業	37,100	1,883.00	69,859,300
三晃金属工業	1,200	3,715.00	4,458,000
N E C ネットエスアイ	12,900	2,599.00	33,527,100
朝日工業社	3,100	3,525.00	10,927,500
明星工業	24,500	739.00	18,105,500
大気社	17,900	3,155.00	56,474,500
ダイダン	9,100	2,701.00	24,579,100
日比谷総合設備	15,000	2,363.00	35,445,000
東芝プラントシステム	21,800	1,910.00	41,638,000
日本製粉	40,000	1,749.00	69,960,000
日清製粉グループ本社	147,700	1,965.00	290,230,500
日東富士製粉	800	4,045.00	3,236,000
昭和産業	11,000	2,916.00	32,076,000
鳥越製粉	11,000	890.00	9,790,000
中部飼料	14,800	2,099.00	31,065,200
フィード・ワン	82,400	299.00	24,637,600
東洋精糖	2,300	1,204.00	2,769,200
日本甜菜製糖	6,900	2,354.00	16,242,600
三井製糖	9,500	3,980.00	37,810,000
塩水港精糖	16,300	262.00	4,270,600
日新製糖	5,600	2,007.00	11,239,200
L I F U L L	31,400	975.00	30,615,000
ジェイエイシーリクルートメント	8,000	1,867.00	14,936,000
日本M & Aセンター	36,800	5,580.00	205,344,000
メンバーズ	3,300	669.00	2,207,700
中広	1,400	734.00	1,027,600
タケエイ	11,300	1,199.00	13,548,700
トラスト・テック	5,200	3,325.00	17,290,000
コシダカホールディングス	6,000	3,920.00	23,520,000
パソナグループ	9,600	1,464.00	14,054,400
C D S	3,200	1,319.00	4,220,800
リンクアンドモチベーション	21,500	712.00	15,308,000
G C A	11,600	996.00	11,553,600
エス・エム・エス	17,900	3,630.00	64,977,000
パーソルホールディングス	97,400	2,683.00	261,324,200
リニカル	7,600	1,506.00	11,445,600
クックパッド	36,500	763.00	27,849,500
エスクリ	4,700	872.00	4,098,400
アイ・ケイ・ケイ	6,000	897.00	5,382,000
森永製菓	26,400	6,380.00	168,432,000

中村屋	3,200	5,120.00	16,384,000
江崎グリコ	33,800	6,270.00	211,926,000
名糖産業	6,200	1,485.00	9,207,000
不二家	7,800	2,549.00	19,882,200
山崎製パン	98,700	2,108.00	208,059,600
第一屋製パン	2,300	1,214.00	2,792,200
モロゾフ	2,100	7,210.00	15,141,000
亀田製菓	7,500	5,140.00	38,550,000
寿スピリッツ	12,800	4,380.00	56,064,000
カルビー	55,100	4,080.00	224,808,000
森永乳業	24,200	4,555.00	110,231,000
六甲バター	6,100	2,449.00	14,938,900
ヤクルト本社	72,300	8,630.00	623,949,000
明治ホールディングス	79,800	9,060.00	722,988,000
雪印メグミルク	29,100	3,225.00	93,847,500
プリマハム	85,000	801.00	68,085,000
日本ハム	96,000	3,315.00	318,240,000
林兼産業	4,600	984.00	4,526,400
丸大食品	65,000	552.00	35,880,000
S Foods	7,300	4,615.00	33,689,500
伊藤ハム米久ホールディングス	77,800	1,041.00	80,989,800
学情	5,500	1,372.00	7,546,000
スタジオアリス	5,300	2,664.00	14,119,200
シミックホールディングス	6,500	1,564.00	10,166,000
システナ	9,600	2,877.00	27,619,200
N J S	3,000	1,399.00	4,197,000
デジタルアーツ	5,300	4,725.00	25,042,500
新日鉄住金ソリューションズ	18,600	2,425.00	45,105,000
総合警備保障	45,800	5,170.00	236,786,000
キューブシステム	5,600	845.00	4,732,000
いちご	113,400	405.00	45,927,000
日本駐車場開発	144,900	167.00	24,198,300
コア	5,100	1,806.00	9,210,600
カカクコム	88,600	1,596.00	141,405,600
アイロムグループ	3,900	1,741.00	6,789,900
ルネサンス	6,800	1,644.00	11,179,200
ディップ	16,400	2,666.00	43,722,400
S B Sホールディングス	12,000	910.00	10,920,000
オプトホールディング	8,400	1,184.00	9,945,600
新日本科学	13,900	537.00	7,464,300
ツクイ	30,400	778.00	23,651,200
キャリアデザインセンター	2,800	1,620.00	4,536,000
エムスリー	109,000	3,305.00	360,245,000
ツカダ・グローバルホールディング	9,600	576.00	5,529,600
アウトソーシング	34,500	1,537.00	53,026,500
ウェルネット	9,700	1,197.00	11,610,900
ワールドホールディングス	3,000	3,325.00	9,975,000
ディー・エヌ・エー	56,400	2,537.00	143,086,800
博報堂D Yホールディングス	174,300	1,566.00	272,953,800
ぐるなび	18,300	1,722.00	31,512,600

エスアールジータカミヤ	14,100	660.00	9,306,000
ジャパンベストレスキューシステム	15,500	477.00	7,393,500
ファンコミュニケーションズ	32,300	1,240.00	40,052,000
ライク	4,700	2,151.00	10,109,700
WDBホールディングス	4,700	2,702.00	12,699,400
ティア	6,500	873.00	5,674,500
バリューコマース	11,100	904.00	10,034,400
インフォマート	54,500	816.00	44,472,000
サッポロホールディングス	44,300	3,425.00	151,727,500
アサヒグループホールディングス	252,800	4,913.00	1,242,006,400
麒麟ホールディングス	580,200	2,729.50	1,583,655,900
宝ホールディングス	97,700	1,050.00	102,585,000
オエノンホールディングス	36,500	331.00	12,081,500
養命酒製造	4,200	2,188.00	9,189,600
コカ・コーラボトラーズジャパン	84,800	3,855.00	326,904,000
サントリー食品インターナショナル	92,400	5,100.00	471,240,000
ダイドーグループホールディングス	6,200	5,410.00	33,542,000
伊藤園	40,100	3,875.00	155,387,500
キーコーヒー	12,000	2,222.00	26,664,000
ユニカフェ	4,000	1,049.00	4,196,000
ジャパンフーズ	2,100	1,407.00	2,954,700
日清オイリオグループ	15,600	3,845.00	59,982,000
不二製油グループ本社	36,100	3,035.00	109,563,500
J・オイルミルズ	6,300	4,145.00	26,113,500
ローソン	37,400	7,390.00	276,386,000
サンエー	9,000	5,140.00	46,260,000
カワチ薬品	9,200	2,703.00	24,867,600
エービーシー・マート	21,600	5,830.00	125,928,000
ハードオフコーポレーション	5,500	1,130.00	6,215,000
高千穂交易	4,800	1,185.00	5,688,000
アスクル	12,400	3,090.00	38,316,000
ゲオホールディングス	20,000	1,635.00	32,700,000
アダストリア	18,300	2,534.00	46,372,200
ジーフット	7,000	744.00	5,208,000
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	1,900	714.00	1,356,600
伊藤忠食品	2,900	5,040.00	14,616,000
くらコーポレーション	7,000	5,280.00	36,960,000
キャンドウ	5,800	1,857.00	10,770,600
エレマテック	4,700	2,210.00	10,387,000
パルグループホールディングス	6,100	3,225.00	19,672,500
JALUX	3,900	2,607.00	10,167,300
エディオン	45,900	1,070.00	49,113,000
あらた	5,500	4,995.00	27,472,500
サーラコーポレーション	20,500	848.00	17,384,000
ワッツ	5,000	1,250.00	6,250,000
トーマンデバイス	1,900	2,953.00	5,610,700
ハローズ	3,900	2,531.00	9,870,900
J Pホールディングス	37,000	415.00	15,355,000
あみやき亭	2,400	5,020.00	12,048,000
東京エレクトロン デバイス	4,200	2,142.00	8,996,400

ひらまつ	17,100	616.00	10,533,600
フィールズ	9,000	1,116.00	10,044,000
双日	698,900	312.00	218,056,800
ゲンキー	4,800	4,320.00	20,736,000
アルフレッサ ホールディングス	140,200	2,108.00	295,541,600
大黒天物産	2,800	5,420.00	15,176,000
ハニーズホールディングス	10,900	1,193.00	13,003,700
ファーマライズホールディングス	3,100	629.00	1,949,900
キッコーマン	94,400	3,610.00	340,784,000
味の素	277,700	2,267.50	629,684,750
キュービー	68,600	2,804.00	192,354,400
ハウス食品グループ本社	50,000	3,455.00	172,750,000
カゴメ	48,500	3,695.00	179,207,500
焼津水産化学工業	6,800	1,189.00	8,085,200
アリアケジャパン	11,100	8,270.00	91,797,000
ピエトロ	1,700	1,631.00	2,772,700
エバラ食品工業	3,300	2,104.00	6,943,200
ニチレイ	62,700	2,913.00	182,645,100
横浜冷凍	28,200	1,064.00	30,004,800
東洋水産	66,300	4,290.00	284,427,000
イトアンド	1,700	2,477.00	4,210,900
日清食品ホールディングス	52,700	7,090.00	373,643,000
永谷園ホールディングス	7,000	1,316.00	9,212,000
一正蒲鉾	5,000	1,322.00	6,610,000
フジッコ	13,100	2,651.00	34,728,100
ロック・フィールド	13,200	1,991.00	26,281,200
日本たばこ産業	746,600	3,693.00	2,757,193,800
ケンコーマヨネーズ	7,400	2,873.00	21,260,200
わらべや日洋ホールディングス	8,000	2,840.00	22,720,000
なとり	6,900	2,056.00	14,186,400
北の達人コーポレーション	6,000	1,343.00	8,058,000
ユーグレナ	46,800	1,174.00	54,943,200
片倉工業	14,500	1,395.00	20,227,500
グンゼ	9,400	5,090.00	47,846,000
ヒューリック	247,800	1,151.00	285,217,800
神栄	1,800	1,710.00	3,078,000
山下医科器械	1,100	1,706.00	1,876,600
ラサ商事	5,600	1,049.00	5,874,400
アルペン	9,000	2,273.00	20,457,000
ラクーン	5,600	621.00	3,477,600
クオール	13,500	1,935.00	26,122,500
アルコニックス	13,700	1,858.00	25,454,600
神戸物産	7,700	5,090.00	39,193,000
ジンズ	8,100	6,690.00	54,189,000
ビックカメラ	68,200	1,287.00	87,773,400
DCMホールディングス	71,900	1,014.00	72,906,600
ペッパーフードサービス	6,300	5,380.00	33,894,000
MonotaRO	42,200	3,115.00	131,453,000
東京一番フーズ	2,400	599.00	1,437,600
DDホールディングス	2,800	2,826.00	7,912,800

あい ホールディングス	17,000	2,773.00	47,141,000
ディーブイエックス	4,500	1,404.00	6,318,000
きちり	3,600	713.00	2,566,800
アークランドサービスホールディングス	10,000	2,340.00	23,400,000
J.フロント リテイリング	150,200	1,635.00	245,577,000
ドトール・日レスホールディングス	20,700	2,449.00	50,694,300
マツモトキヨシホールディングス	22,500	7,820.00	175,950,000
ブロンコビリー	6,300	2,735.00	17,230,500
スタートトゥデイ	104,800	3,375.00	353,700,000
トレジャー・ファクトリー	3,700	868.00	3,211,600
物語コーポレーション	3,300	7,250.00	23,925,000
ココカラファイン	12,400	6,370.00	78,988,000
三越伊勢丹ホールディングス	236,200	1,256.00	296,667,200
東洋紡	49,900	2,135.00	106,536,500
ユニチカ	34,800	995.00	34,626,000
富士紡ホールディングス	6,200	3,860.00	23,932,000
日清紡ホールディングス	76,500	1,331.00	101,821,500
倉敷紡績	126,000	324.00	40,824,000
ダイワボウホールディングス	10,100	4,705.00	47,520,500
シキボウ	7,100	1,596.00	11,331,600
日東紡績	20,300	3,465.00	70,339,500
トヨタ紡織	42,000	2,407.00	101,094,000
マクニカ・富士エレホールディングス	21,900	2,167.00	47,457,300
Hamee	1,900	1,617.00	3,072,300
ウエルシアホールディングス	31,400	4,260.00	133,764,000
クリエイトSDホールディングス	17,500	2,782.00	48,685,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	22,100	931.00	20,575,100
八洲電機	9,500	932.00	8,854,000
メディアスホールディングス	1,900	2,731.00	5,188,900
UKCホールディングス	7,700	1,957.00	15,068,900
丸善CHIホールディングス	14,100	350.00	4,935,000
OCHIホールディングス	3,300	1,407.00	4,643,100
TOKAIホールディングス	52,200	875.00	45,675,000
ミサワ	1,800	466.00	838,800
ティーライフ	1,700	1,395.00	2,371,500
エー・ピーカンパニー	2,300	737.00	1,695,100
三洋貿易	6,600	2,665.00	17,589,000
チムニー	3,400	2,856.00	9,710,400
シュッピン	4,600	2,775.00	12,765,000
ビューティガレージ	1,100	1,806.00	1,986,600
ウイン・パートナーズ	8,600	1,473.00	12,667,800
ネクステージ	4,000	2,777.00	11,108,000
ジョイフル本田	19,300	2,979.00	57,494,700
鳥貴族	4,400	3,060.00	13,464,000
キリン堂ホールディングス	3,900	1,490.00	5,811,000
ホットランド	4,900	1,501.00	7,354,900
すかいらーく	73,300	1,685.00	123,510,500
綿半ホールディングス	4,900	2,477.00	12,137,300

日本毛織	35,000	1,012.00	35,420,000
ダイトウボウ	20,000	113.00	2,260,000
トーア紡コーポレーション	5,500	602.00	3,311,000
ダイドーリミテッド	14,400	439.00	6,321,600
ヨシックス	1,500	2,303.00	3,454,500
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	39,100	1,071.00	41,876,100
三栄建築設計	4,800	2,196.00	10,540,800
スター・マイカ	4,600	1,632.00	7,507,200
野村不動産ホールディングス	79,100	2,410.00	190,631,000
三重交通グループホールディングス	21,000	468.00	9,828,000
サムティ	10,000	1,552.00	15,520,000
ディア・ライフ	8,800	449.00	3,951,200
エー・ディー・ワークス	220,700	40.00	8,828,000
日本商業開発	6,900	1,691.00	11,667,900
プレサンスコーポレーション	18,600	1,512.00	28,123,200
ユニゾホールディングス	10,000	2,742.00	27,420,000
THEグローバル社	4,900	799.00	3,915,100
日本管理センター	8,000	1,546.00	12,368,000
サンセイラディック	2,700	934.00	2,521,800
エストラスト	2,400	799.00	1,917,600
フージャースホールディングス	15,700	1,106.00	17,364,200
オープンハウス	19,400	4,105.00	79,637,000
東急不動産ホールディングス	287,100	691.00	198,386,100
飯田グループホールディングス	99,000	2,047.00	202,653,000
ムゲンエステート	4,000	1,146.00	4,584,000
帝国繊維	13,200	2,270.00	29,964,000
ブックオフコーポレーション	7,100	817.00	5,800,700
日本コークス工業	104,500	130.00	13,585,000
ゴルフダイジェスト・オンライン	3,900	993.00	3,872,700
ミタチ産業	3,100	1,431.00	4,436,100
B E E N O S	1,500	1,215.00	1,822,500
あさひ	9,000	1,367.00	12,303,000
日本調剤	4,200	3,600.00	15,120,000
コスモス薬品	6,000	25,090.00	150,540,000
シップヘルスケアホールディングス	22,800	3,540.00	80,712,000
トーエル	6,000	938.00	5,628,000
一六堂	3,300	414.00	1,366,200
ソフトクリエイトホールディングス	5,900	1,505.00	8,879,500
セブン&アイ・ホールディングス	496,600	4,427.00	2,198,448,200
薬王堂	6,000	3,340.00	20,040,000
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	32,100	1,176.00	37,749,600
明治電機工業	4,300	1,828.00	7,860,400
ツルハホールディングス	23,800	13,760.00	327,488,000
デリカフーズホールディングス	2,900	1,526.00	4,425,400
スターティア	2,600	628.00	1,632,800
サンマルクホールディングス	7,700	3,245.00	24,986,500
フェリシモ	3,600	1,346.00	4,845,600
トリドールホールディングス	14,600	3,655.00	53,363,000

帝人	102,800	2,249.00	231,197,200
東レ	913,400	1,080.00	986,472,000
クラレ	211,900	2,148.00	455,161,200
旭化成	785,000	1,368.50	1,074,272,500
サカイオーベックス	3,100	2,309.00	7,157,900
TOKYO BASE	1,500	5,280.00	7,920,000
稲葉製作所	6,800	1,427.00	9,703,600
宮地エンジニアリンググループ	3,700	3,030.00	11,211,000
トーカロ	8,300	4,255.00	35,316,500
アルファ	4,300	2,329.00	10,014,700
SUMCO	109,600	1,754.00	192,238,400
川田テクノロジーズ	2,400	6,270.00	15,048,000
RS Technologies	1,200	3,980.00	4,776,000
ファーストブラザーズ	2,600	1,113.00	2,893,800
ハウスドゥ	2,000	1,819.00	3,638,000
シーアールイー	1,800	1,561.00	2,809,800
ケイアイスター不動産	3,300	1,983.00	6,543,900
住江織物	33,000	362.00	11,946,000
日本フェルト	7,800	503.00	3,923,400
イチカワ	9,000	344.00	3,096,000
エコナックホールディングス	22,000	138.00	3,036,000
日東製網	1,500	1,890.00	2,835,000
芦森工業	2,800	3,300.00	9,240,000
アツギ	10,600	1,257.00	13,324,200
コメダホールディングス	21,900	1,839.00	40,274,100
サツドラホールディングス	1,700	2,047.00	3,479,900
ダイユー・リックホールディングス	4,200	949.00	3,985,800
パロックジャパンリミテッド	9,500	983.00	9,338,500
クスリのアオキホールディングス	9,400	6,370.00	59,878,000
ダイニック	5,200	1,163.00	6,047,600
共和レザー	7,300	961.00	7,015,300
スシローグローバルホールディングス	10,800	3,600.00	38,880,000
LIXILピバ	11,300	1,832.00	20,701,600
セーレン	31,400	1,981.00	62,203,400
ソトー	4,500	1,149.00	5,170,500
東海染工	1,800	1,562.00	2,811,600
小松精練	17,900	890.00	15,931,000
ワコールホールディングス	37,300	3,280.00	122,344,000
ホギメディカル	7,900	8,000.00	63,200,000
レナウン	35,700	209.00	7,461,300
クラウディアホールディングス	3,400	574.00	1,951,600
T S Iホールディングス	51,800	956.00	49,520,800
T I S	39,400	3,235.00	127,459,000
ネオス	3,900	469.00	1,829,100
電算システム	4,300	2,176.00	9,356,800
グリー	72,800	807.00	58,749,600
コーエーテクモホールディングス	28,100	2,333.00	65,557,300
三菱総合研究所	4,800	3,275.00	15,720,000
ボルテージ	2,500	1,126.00	2,815,000
電算	1,500	2,346.00	3,519,000

A G S	2,600	1,880.00	4,888,000
ファインデックス	9,100	815.00	7,416,500
ヒト・コミュニケーションズ	2,800	1,820.00	5,096,000
ブレインパッド	1,900	1,206.00	2,291,400
K L a b	22,800	1,727.00	39,375,600
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	8,800	1,550.00	13,640,000
イーブックイニシアティブジャパン	2,100	1,091.00	2,291,100
ネクソン	131,300	3,025.00	397,182,500
アイスタイル	26,100	722.00	18,844,200
エムアップ	3,500	1,346.00	4,711,000
エイチーム	8,200	2,871.00	23,542,200
テクノスジャパン	9,400	1,061.00	9,973,400
e n i s h	3,600	2,566.00	9,237,600
コロブラ	38,200	1,197.00	45,725,400
モバイルクリエイト	8,600	371.00	3,190,600
オルトプラス	5,000	854.00	4,270,000
ブロードリーフ	29,500	928.00	27,376,000
ハーツユナイテッドグループ	6,500	1,525.00	9,912,500
メディアドゥホールディングス	2,700	2,710.00	7,317,000
ブイキューブ	6,900	649.00	4,478,100
サイバーリンクス	2,000	1,550.00	3,100,000
ディー・エル・イー	3,800	440.00	1,672,000
フィックスターズ	1,800	4,125.00	7,425,000
VOYAGE GROUP	6,100	1,521.00	9,278,100
オプティム	2,200	2,701.00	5,942,200
セレス	2,200	1,312.00	2,886,400
特種東海製紙	7,300	4,455.00	32,521,500
ベリサーブ	1,500	3,405.00	5,107,500
ティーガイア	11,800	2,148.00	25,346,400
日本アジアグループ	14,100	443.00	6,246,300
豆蔵ホールディングス	9,200	1,233.00	11,343,600
テクマトリックス	7,600	1,599.00	12,152,400
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	320,300	302.00	96,730,600
GMOペイメントゲートウェイ	8,400	7,560.00	63,504,000
ザッパラス	7,500	412.00	3,090,000
インターネットイニシアティブ	17,600	2,176.00	38,297,600
さくらインターネット	8,800	876.00	7,708,800
GMOクラウド	2,700	3,025.00	8,167,500
S R Aホールディングス	6,300	3,025.00	19,057,500
M I N O R Iソリューションズ	2,700	1,328.00	3,585,600
システムインテグレータ	2,000	815.00	1,630,000
朝日ネット	11,700	541.00	6,329,700
アドソル日進	2,500	1,141.00	2,852,500
フリービット	6,900	965.00	6,658,500
コムチュア	6,300	1,997.00	12,581,100
サイバーコム	1,600	1,017.00	1,627,200
王子ホールディングス	492,000	602.00	296,184,000
日本製紙	56,300	2,138.00	120,369,400

三菱製紙	18,600	754.00	14,024,400
北越紀州製紙	70,500	721.00	50,830,500
中越パルプ工業	5,000	2,147.00	10,735,000
巴川製紙所	21,000	308.00	6,468,000
大王製紙	50,400	1,375.00	69,300,000
メディカル・データ・ビジョン	4,200	2,200.00	9,240,000
gumi	12,800	1,132.00	14,489,600
モバイルファクトリー	2,200	1,455.00	3,201,000
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	1,800	2,025.00	3,645,000
PCIホールディングス	1,500	3,280.00	4,920,000
パイブドHD	1,800	1,135.00	2,043,000
オープンドア	1,200	4,380.00	5,256,000
LINE	33,000	4,110.00	135,630,000
レンゴー	121,500	673.00	81,769,500
トーモク	7,800	1,953.00	15,233,400
ザ・バック	9,000	3,915.00	35,235,000
オークネット	3,800	1,433.00	5,445,400
AOI TYO HOLDINGS	10,000	1,191.00	11,910,000
マクロミル	15,400	2,970.00	45,738,000
昭和電工	83,900	3,590.00	301,201,000
住友化学	927,000	698.00	647,046,000
住友精化	5,200	5,670.00	29,484,000
日産化学工業	68,100	4,025.00	274,102,500
ラサ工業	5,000	2,066.00	10,330,000
クレハ	9,500	6,170.00	58,615,000
多木化学	1,600	4,965.00	7,944,000
テイカ	9,700	2,432.00	23,590,400
石原産業	22,700	1,617.00	36,705,900
片倉コープアグリ	3,400	1,317.00	4,477,800
日東エフシー	7,300	859.00	6,270,700
日本曹達	75,000	688.00	51,600,000
東ソー	182,100	2,437.00	443,777,700
トクヤマ	39,200	2,607.00	102,194,400
セントラル硝子	25,600	2,450.00	62,720,000
東亜合成	73,600	1,481.00	109,001,600
大阪ソーダ	10,900	2,888.00	31,479,200
関東電化工業	25,900	1,165.00	30,173,500
デンカ	49,600	3,755.00	186,248,000
イビデン	84,100	1,832.00	154,071,200
信越化学工業	225,800	10,055.00	2,270,419,000
日本カーバイド工業	4,400	2,320.00	10,208,000
堺化学工業	9,400	2,757.00	25,915,800
エア・ウォーター	103,700	2,070.00	214,659,000
大陽日酸	96,900	1,335.00	129,361,500
日本化学工業	4,800	2,642.00	12,681,600
東邦アセチレン	1,900	1,667.00	3,167,300
日本パーカライジング	64,200	1,738.00	111,579,600
高圧ガス工業	18,500	836.00	15,466,000
チタン工業	1,600	3,245.00	5,192,000

四国化成工業	18,000	1,705.00	30,690,000
戸田工業	2,600	4,675.00	12,155,000
ステラ ケミファ	6,200	4,445.00	27,559,000
保土谷化学工業	4,400	7,490.00	32,956,000
日本触媒	19,800	8,240.00	163,152,000
大日精化工業	10,400	5,060.00	52,624,000
カネカ	170,000	861.00	146,370,000
協和発酵キリン	150,700	1,966.00	296,276,200
三菱瓦斯化学	117,300	2,579.00	302,516,700
三井化学	114,400	3,325.00	380,380,000
J S R	126,500	2,052.00	259,578,000
東京応化工業	23,600	4,030.00	95,108,000
大阪有機化学工業	8,300	1,296.00	10,756,800
三菱ケミカルホールディングス	848,200	1,113.00	944,046,600
K Hネオケム	19,300	2,654.00	51,222,200
ダイセル	169,800	1,345.00	228,381,000
住友ベークライト	111,000	873.00	96,903,000
積水化学工業	280,100	2,228.00	624,062,800
日本ゼオン	106,000	1,416.00	150,096,000
アイカ工業	40,300	3,705.00	149,311,500
宇部興産	63,400	3,240.00	205,416,000
積水樹脂	19,200	2,151.00	41,299,200
タキロンシーアイ	26,000	698.00	18,148,000
旭有機材	8,100	1,438.00	11,647,800
日立化成	69,900	2,975.00	207,952,500
ニチバン	6,300	2,445.00	15,403,500
リケンテクノス	27,400	687.00	18,823,800
大倉工業	30,000	785.00	23,550,000
積水化成成品工業	17,500	1,389.00	24,307,500
群栄化学工業	3,000	3,840.00	11,520,000
タイガースポリマー	6,300	790.00	4,977,000
ミライアル	4,800	1,620.00	7,776,000
ダイキアクシス	4,400	1,254.00	5,517,600
ダイキョーニシカワ	22,100	1,829.00	40,420,900
竹本容器	1,400	1,890.00	2,646,000
日本化薬	82,000	1,709.00	140,138,000
カーリットホールディングス	12,000	753.00	9,036,000
E P Sホールディングス	16,300	2,105.00	34,311,500
ソルクシーズ	4,700	845.00	3,971,500
レグス	3,000	849.00	2,547,000
プレステージ・インターナショナル	24,200	1,129.00	27,321,800
フェイス	5,700	1,278.00	7,284,600
アミューズ	7,000	2,805.00	19,635,000
野村総合研究所	88,700	4,310.00	382,297,000
ドリームインキュベータ	4,000	2,248.00	8,992,000
サイバネットシステム	9,900	761.00	7,533,900
クイック	6,700	1,868.00	12,515,600
T A C	7,700	278.00	2,140,600
C Eホールディングス	3,600	605.00	2,178,000
ケネディクス	159,400	670.00	106,798,000

日本システム技術	1,400	1,415.00	1,981,000
電通	140,100	5,080.00	711,708,000
インテージホールディングス	13,800	1,363.00	18,809,400
テイクアンドギヴ・ニーズ	6,100	840.00	5,124,000
東邦システムサイエンス	4,300	842.00	3,620,600
びあ	3,900	5,220.00	20,358,000
イオンファンタジー	3,700	4,115.00	15,225,500
ソースネクスト	6,800	573.00	3,896,400
シーティーエス	13,800	755.00	10,419,000
ネクシィーズグループ	4,600	2,119.00	9,747,400
メディカルシステムネットワーク	14,000	514.00	7,196,000
日本精化	10,600	948.00	10,048,800
扶桑化学工業	9,000	3,505.00	31,545,000
A D E K A	54,000	1,962.00	105,948,000
日油	48,600	3,240.00	157,464,000
ミヨシ油脂	4,800	1,463.00	7,022,400
新日本理化	21,200	277.00	5,872,400
ハリマ化成グループ	11,000	995.00	10,945,000
花王	295,700	6,668.00	1,971,727,600
第一工業製薬	28,000	676.00	18,928,000
日華化学	4,100	1,147.00	4,702,700
三洋化成工業	7,900	6,540.00	51,666,000
武田薬品工業	472,300	6,145.00	2,902,283,500
アステラス製薬	1,235,700	1,475.50	1,823,275,350
大日本住友製薬	89,200	1,538.00	137,189,600
塩野義製薬	159,700	6,066.00	968,740,200
田辺三菱製薬	146,600	2,563.00	375,735,800
わかもと製薬	7,000	284.00	1,988,000
あすか製薬	13,700	1,870.00	25,619,000
日本新薬	28,900	7,920.00	228,888,000
ピオフェルミン製薬	2,000	2,983.00	5,966,000
中外製薬	125,400	5,030.00	630,762,000
科研製薬	23,500	5,700.00	133,950,000
エーザイ	155,000	5,943.00	921,165,000
理研ビタミン	4,000	4,320.00	17,280,000
ロート製薬	61,800	2,623.00	162,101,400
小野薬品工業	286,100	2,608.50	746,291,850
久光製薬	35,500	5,640.00	200,220,000
有機合成薬品工業	9,400	301.00	2,829,400
持田製薬	8,400	8,390.00	70,476,000
参天製薬	227,600	1,758.00	400,120,800
扶桑薬品工業	4,300	2,826.00	12,151,800
日本ケミファ	1,800	5,110.00	9,198,000
ツムラ	42,300	4,240.00	179,352,000
日医工	29,500	1,756.00	51,802,000
テルモ	184,300	4,620.00	851,466,000
みらかホールディングス	32,100	5,110.00	164,031,000
キッセイ薬品工業	22,300	2,973.00	66,297,900
生化学工業	23,300	2,025.00	47,182,500
栄研化学	10,600	4,405.00	46,693,000

日水製薬	5,200	1,431.00	7,441,200
鳥居薬品	7,600	3,190.00	24,244,000
JCRファーマ	9,800	3,565.00	34,937,000
東和薬品	5,800	5,750.00	33,350,000
富士製薬工業	4,200	3,770.00	15,834,000
沢井製薬	21,400	6,540.00	139,956,000
ゼリア新薬工業	25,800	2,017.00	52,038,600
第一三共	370,600	2,471.00	915,752,600
キョーリン製薬ホールディングス	30,700	2,301.00	70,640,700
大幸薬品	6,500	2,328.00	15,132,000
ダイト	7,400	2,732.00	20,216,800
大塚ホールディングス	249,900	4,533.00	1,132,796,700
大正製薬ホールディングス	26,900	8,730.00	234,837,000
ペプチドリーム	49,200	3,545.00	174,414,000
大日本塗料	14,500	1,679.00	24,345,500
日本ペイントホールディングス	97,200	3,695.00	359,154,000
関西ペイント	132,400	2,669.00	353,375,600
神東塗料	10,000	223.00	2,230,000
中国塗料	36,100	964.00	34,800,400
日本特殊塗料	8,900	1,943.00	17,292,700
藤倉化成	17,200	674.00	11,592,800
太陽ホールディングス	10,300	5,210.00	53,663,000
DIC	49,700	4,090.00	203,273,000
サカタインクス	25,800	2,079.00	53,638,200
東洋インキSCホールディングス	123,000	631.00	77,613,000
T&K TOKA	9,000	1,286.00	11,574,000
アルプス技研	5,100	3,830.00	19,533,000
サニックス	21,000	306.00	6,426,000
ダイオーズ	2,600	1,394.00	3,624,400
日本空調サービス	12,700	717.00	9,105,900
オリエンタルランド	135,800	9,235.00	1,254,113,000
フォーカスシステムズ	5,100	938.00	4,783,800
ダスキン	30,900	3,085.00	95,326,500
パーク24	65,800	2,645.00	174,041,000
明光ネットワークジャパン	14,700	1,533.00	22,535,100
ファルコホールディングス	6,300	1,695.00	10,678,500
クレスコ	2,800	4,055.00	11,354,000
フジ・メディア・ホールディングス	123,400	1,629.00	201,018,600
秀英予備校	2,800	473.00	1,324,400
田谷	2,600	669.00	1,739,400
ラウンドワン	39,300	1,449.00	56,945,700
リゾートトラスト	48,700	2,193.00	106,799,100
オービック	40,900	6,950.00	284,255,000
ジャストシステム	19,300	2,421.00	46,725,300
TDCソフト	5,500	1,135.00	6,242,500
ヤフー	852,400	521.00	444,100,400
ビー・エム・エル	16,500	2,485.00	41,002,500
ワタベウェディング	2,100	867.00	1,820,700
トレンドマイクロ	57,600	5,780.00	332,928,000
りらいあコミュニケーションズ	21,000	1,285.00	26,985,000

インフォメーション・ディベロブメント	3,700	1,500.00	5,550,000	
リソー教育	21,700	874.00	18,965,800	
日本オラクル	19,100	8,940.00	170,754,000	
早稲田アカデミー	1,900	1,726.00	3,279,400	
アルファシステムズ	4,000	2,353.00	9,412,000	
フューチャー	16,400	1,002.00	16,432,800	
CAC Holdings	9,000	1,084.00	9,756,000	
ソフトバンク・テクノロジー	5,900	1,854.00	10,938,600	
トーセ	3,300	2,678.00	8,837,400	
ユー・エス・エス	152,100	2,291.00	348,461,100	
オービックビジネスコンサルタント	6,000	5,780.00	34,680,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	26,900	4,140.00	111,366,000	
アイティフォー	16,300	632.00	10,301,600	
東京個別指導学院	4,300	979.00	4,209,700	
東計電算	2,200	3,270.00	7,194,000	
サイバーエージェント	75,700	3,415.00	258,515,500	
楽天	589,300	1,243.00	732,499,900	
エクスネット	2,600	920.00	2,392,000	
クリーク・アンド・リバー社	4,700	1,125.00	5,287,500	
テー・オー・ダブリュー	10,600	860.00	9,116,000	
大塚商会	35,500	7,330.00	260,215,000	
総合メディカル	5,800	4,920.00	28,536,000	
サイボウズ	16,700	515.00	8,600,500	
ソフトブレーン	9,700	434.00	4,209,800	
セントラルスポーツ	4,400	3,930.00	17,292,000	
バラカ	3,600	2,373.00	8,542,800	
電通国際情報サービス	7,400	2,583.00	19,114,200	
デジタルガレージ	23,200	2,403.00	55,749,600	
イーエムシステムズ	4,200	2,117.00	8,891,400	
ウェザーニューズ	4,100	3,560.00	14,596,000	
C I J	11,400	672.00	7,660,800	
東洋ビジネスエンジニアリング	1,400	1,751.00	2,451,400	
日本エンタープライズ	13,400	255.00	3,417,000	
WOWOW	5,800	3,600.00	20,880,000	
スカラ	7,800	790.00	6,162,000	
フルキャストホールディングス	10,200	2,128.00	21,705,600	
富士フイルムホールディングス	249,700	4,438.00	1,108,168,600	
コニカミノルタ	281,400	948.00	266,767,200	
資生堂	224,100	4,623.00	1,036,014,300	
ライオン	167,600	2,108.00	353,300,800	
高砂香料工業	8,300	3,885.00	32,245,500	
マンダム	25,200	3,120.00	78,624,000	
ミルボン	8,100	6,820.00	55,242,000	
ファンケル	26,900	2,530.00	68,057,000	
コーセー	20,400	13,570.00	276,828,000	
コタ	5,400	1,318.00	7,117,200	
シーズ・ホールディングス	16,400	4,130.00	67,732,000	
シーボン	1,600	2,612.00	4,179,200	
ポーラ・オルビスホールディングス	51,400	3,580.00	184,012,000	

ノエビアホールディングス	7,900	6,350.00	50,165,000
アジュバンコスメジャパン	2,800	1,005.00	2,814,000
エステー	8,700	2,667.00	23,202,900
アグロ カネショウ	5,100	1,905.00	9,715,500
コニシ	19,700	1,956.00	38,533,200
長谷川香料	15,900	2,194.00	34,884,600
星光PMC	7,000	1,198.00	8,386,000
小林製薬	33,700	6,330.00	213,321,000
荒川化学工業	10,800	2,537.00	27,399,600
メック	9,900	1,746.00	17,285,400
日本高純度化学	3,800	2,792.00	10,609,600
タカラバイオ	36,100	1,497.00	54,041,700
JCU	7,900	4,655.00	36,774,500
新田ゼラチン	8,200	781.00	6,404,200
OATアグリオ	1,600	2,076.00	3,321,600
デクセリアルズ	33,200	1,350.00	44,820,000
アース製薬	9,100	5,140.00	46,774,000
北興化学工業	12,800	704.00	9,011,200
大成ラミック	3,800	3,080.00	11,704,000
クミアイ化学工業	54,500	821.00	44,744,500
日本農薬	30,000	645.00	19,350,000
昭和シェル石油	112,400	1,271.00	142,860,400
富士興産	4,300	601.00	2,584,300
ニチレキ	15,400	1,444.00	22,237,600
ユシロ化学工業	6,900	1,683.00	11,612,700
ビービー・カストロール	5,200	1,998.00	10,389,600
富士石油	29,700	429.00	12,741,300
MORESCO	4,500	2,168.00	9,756,000
出光興産	77,700	3,155.00	245,143,500
JXTGホールディングス	1,918,700	557.00	1,068,715,900
コスモエネルギーホールディングス	38,000	2,520.00	95,760,000
横浜ゴム	69,600	2,407.00	167,527,200
東洋ゴム工業	71,300	2,547.00	181,601,100
ブリヂストン	424,900	5,248.00	2,229,875,200
住友ゴム工業	117,800	2,083.00	245,377,400
藤倉ゴム工業	10,800	923.00	9,968,400
オカモト	38,000	1,181.00	44,878,000
アキレス	10,100	2,286.00	23,088,600
フコク	5,200	1,156.00	6,011,200
ニッタ	11,300	4,335.00	48,985,500
クリエートメディック	4,100	1,067.00	4,374,700
住友理工	23,100	1,178.00	27,211,800
三ツ星ベルト	29,000	1,380.00	40,020,000
バンドー化学	22,700	1,169.00	26,536,300
旭硝子	122,900	4,215.00	518,023,500
日本板硝子	57,300	879.00	50,366,700
石塚硝子	1,800	2,452.00	4,413,600
有沢製作所	21,500	1,024.00	22,016,000
日本山村硝子	50,000	197.00	9,850,000
日本電気硝子	52,000	4,395.00	228,540,000

オハラ	4,800	2,062.00	9,897,600
住友大阪セメント	234,000	499.00	116,766,000
太平洋セメント	75,900	4,360.00	330,924,000
リソルホールディングス	1,300	3,990.00	5,187,000
日本ヒューム	12,400	698.00	8,655,200
日本コンクリート工業	28,300	459.00	12,989,700
三谷セキサン	6,300	2,650.00	16,695,000
アジアパイルホールディングス	15,900	623.00	9,905,700
東海カーボン	109,300	1,138.00	124,383,400
日本カーボン	6,200	4,815.00	29,853,000
東洋炭素	7,100	2,641.00	18,751,100
ノリタケカンパニーリミテド	7,100	5,470.00	38,837,000
TOTO	92,500	4,835.00	447,237,500
日本碍子	158,900	2,162.00	343,541,800
日本特殊陶業	103,000	2,445.00	251,835,000
ダントーホールディングス	11,000	179.00	1,969,000
MARUWA	4,700	6,160.00	28,952,000
品川リフラクトリーズ	3,200	3,755.00	12,016,000
黒崎播磨	2,700	5,340.00	14,418,000
ヨータイ	7,000	455.00	3,185,000
イソライト工業	6,500	825.00	5,362,500
東京窯業	16,000	379.00	6,064,000
ニッカトー	4,600	618.00	2,842,800
フジインコーポレーテッド	10,700	2,571.00	27,509,700
エーアンドエーマテリアル	2,800	1,322.00	3,701,600
ニチアス	66,000	1,357.00	89,562,000
新日鐵住金	567,500	2,547.00	1,445,422,500
神戸製鋼所	217,700	882.00	192,011,400
中山製鋼所	14,000	724.00	10,136,000
合同製鐵	7,100	2,199.00	15,612,900
ジェイ エフ イー ホールディングス	344,100	2,200.00	757,020,000
日新製鋼	41,000	1,459.00	59,819,000
東京製鐵	63,800	917.00	58,504,600
共英製鋼	13,500	1,700.00	22,950,000
大和工業	25,200	2,920.00	73,584,000
東京鐵鋼	5,400	2,199.00	11,874,600
大阪製鐵	7,800	2,454.00	19,141,200
淀川製鋼所	17,300	3,065.00	53,024,500
東洋鋼鈑	30,300	508.00	15,392,400
丸一鋼管	42,000	3,225.00	135,450,000
モリ工業	3,900	2,622.00	10,225,800
大同特殊鋼	21,100	6,710.00	141,581,000
日本高周波鋼業	4,600	1,030.00	4,738,000
日本冶金工業	105,100	231.00	24,278,100
山陽特殊製鋼	15,000	2,841.00	42,615,000
愛知製鋼	7,300	4,340.00	31,682,000
日立金属	128,100	1,568.00	200,860,800
日本金属	3,100	3,010.00	9,331,000
大平洋金属	8,200	3,155.00	25,871,000

新日本電工	71,800	453.00	32,525,400
栗本鐵工所	6,000	2,297.00	13,782,000
虹 技	1,900	2,219.00	4,216,100
日本鑄鉄管	14,000	183.00	2,562,000
日本製鋼所	41,700	2,702.00	112,673,400
三菱製鋼	8,700	2,883.00	25,082,100
日亜鋼業	18,100	315.00	5,701,500
日本精線	1,800	4,750.00	8,550,000
大紀アルミニウム工業所	21,000	827.00	17,367,000
日本軽金属ホールディングス	323,900	340.00	110,126,000
三井金属鉱業	34,300	5,750.00	197,225,000
東邦亜鉛	7,100	5,160.00	36,636,000
三菱マテリアル	78,500	3,945.00	309,682,500
住友金属鉱山	162,900	3,923.00	639,056,700
DOWAホールディングス	27,800	4,340.00	120,652,000
古河機械金属	19,600	1,944.00	38,102,400
エス・サイエンス	58,300	78.00	4,547,400
大阪チタニウムテクノロジーズ	13,900	1,627.00	22,615,300
東邦チタニウム	21,500	875.00	18,812,500
U A C J	16,700	3,245.00	54,191,500
古河電気工業	42,300	6,690.00	282,987,000
住友電気工業	474,000	1,849.50	876,663,000
フジクラ	165,700	914.00	151,449,800
昭和電線ホールディングス	15,100	1,031.00	15,568,100
東京特殊電線	1,900	2,418.00	4,594,200
タツタ電線	23,800	825.00	19,635,000
沖電線	1,400	3,235.00	4,529,000
カナレ電気	1,900	2,498.00	4,746,200
平河ヒューテック	6,000	1,501.00	9,006,000
リョービ	14,600	3,045.00	44,457,000
アーレスティ	14,800	963.00	14,252,400
アサヒホールディングス	19,100	2,369.00	45,247,900
東洋製罐グループホールディングス	89,200	1,939.00	172,958,800
ホッカンホールディングス	32,000	425.00	13,600,000
コロナ	6,100	1,175.00	7,167,500
横河ブリッジホールディングス	22,200	2,138.00	47,463,600
OSJBホールディングス	42,400	336.00	14,246,400
駒井ハルテック	2,500	2,440.00	6,100,000
高田機工	1,200	3,145.00	3,774,000
三和ホールディングス	125,000	1,287.00	160,875,000
文化シャッター	35,300	872.00	30,781,600
三協立山	16,500	1,595.00	26,317,500
アルインコ	8,600	1,311.00	11,274,600
東洋シャッター	3,300	647.00	2,135,100
L I X I Lグループ	175,300	3,035.00	532,035,500
日本ファイルコン	9,800	920.00	9,016,000
ノーリツ	26,500	2,018.00	53,477,000
長府製作所	13,300	2,750.00	36,575,000
リンナイ	21,400	9,740.00	208,436,000
ユニプレス	23,200	3,175.00	73,660,000

ダイニチ工業	6,500	810.00	5,265,000
日東精工	16,900	631.00	10,663,900
三洋工業	1,700	2,213.00	3,762,100
岡部	24,100	1,061.00	25,570,100
ジーテクト	13,100	2,282.00	29,894,200
中国工業	2,300	779.00	1,791,700
東プレ	24,200	3,410.00	82,522,000
高周波熱錬	22,800	1,123.00	25,604,400
東京製綱	8,600	1,670.00	14,362,000
サンコール	6,800	703.00	4,780,400
モリテックスチール	7,200	556.00	4,003,200
パイオラックス	19,100	3,120.00	59,592,000
エイチワン	9,700	1,261.00	12,231,700
日本発条	118,100	1,245.00	147,034,500
中央発條	1,400	3,650.00	5,110,000
アドバネクス	2,300	2,980.00	6,854,000
三浦工業	51,400	2,564.00	131,789,600
タクマ	40,300	1,360.00	54,808,000
テクノプロ・ホールディングス	20,500	5,100.00	104,550,000
インターワークス	2,600	1,126.00	2,927,600
K e e P e r 技研	3,000	1,338.00	4,014,000
ファーストロジック	700	2,576.00	1,803,200
デザインワン・ジャパン	2,300	1,322.00	3,040,600
イー・ガーディアン	6,000	2,236.00	13,416,000
リブセンス	8,400	537.00	4,510,800
ジャパンマテリアル	9,200	2,791.00	25,677,200
ベクトル	10,500	1,586.00	16,653,000
ウチヤマホールディングス	6,300	532.00	3,351,600
ライクキッズネクスト	1,100	2,297.00	2,526,700
キャリアリンク	3,100	562.00	1,742,200
I B J	8,900	828.00	7,369,200
アサンテ	4,900	1,968.00	9,643,200
N・フィールド	6,200	1,843.00	11,426,600
バリューHR	1,300	4,345.00	5,648,500
M&Aキャピタルパートナーズ	2,200	5,740.00	12,628,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	3,100	993.00	3,078,300
E R Iホールディングス	3,700	930.00	3,441,000
アピスト	1,700	4,320.00	7,344,000
ウィルグループ	5,400	1,338.00	7,225,200
エスクロー・エージェント・ジャパン	2,900	2,768.00	8,027,200
日本ビューホテル	1,900	1,417.00	2,692,300
リクルートホールディングス	823,500	2,769.00	2,280,271,500
エラン	3,000	1,616.00	4,848,000
ツガミ	34,000	1,004.00	34,136,000
オークマ	16,400	6,520.00	106,928,000
東芝機械	67,000	656.00	43,952,000
アマダホールディングス	168,900	1,256.00	212,138,400
アイダエンジニアリング	35,700	1,306.00	46,624,200
滝澤鉄工所	3,900	1,918.00	7,480,200

富士機械製造	38,300	2,087.00	79,932,100
牧野フライス製作所	63,000	1,013.00	63,819,000
オーエスジー	53,600	2,398.00	128,532,800
ダイジェット工業	1,600	1,920.00	3,072,000
旭ダイヤモンド工業	35,500	1,047.00	37,168,500
D M G 森精機	65,800	2,142.00	140,943,600
ソディック	31,900	1,494.00	47,658,600
ディスコ	14,700	23,680.00	348,096,000
日東工器	7,300	2,795.00	20,403,500
パンチ工業	4,700	1,953.00	9,179,100
富士ダイス	4,700	857.00	4,027,900
日本郵政	668,200	1,300.00	868,660,000
ベルシステム24ホールディングス	19,300	1,264.00	24,395,200
エポラブルアジア	2,400	2,296.00	5,510,400
ストライク	1,100	4,705.00	5,175,500
ソラスト	8,200	2,062.00	16,908,400
豊田自動織機	109,500	6,490.00	710,655,000
豊和工業	7,400	1,957.00	14,481,800
OKK	4,800	1,258.00	6,038,400
石川製作所	3,200	3,940.00	12,608,000
東洋機械金属	8,800	864.00	7,603,200
津田駒工業	30,000	200.00	6,000,000
エンシュウ	34,000	151.00	5,134,000
島精機製作所	16,400	6,040.00	99,056,000
NCホールディングス	4,400	887.00	3,902,800
フリー	7,600	1,137.00	8,641,200
ヤマシンフィルタ	2,600	3,770.00	9,802,000
日阪製作所	16,900	1,002.00	16,933,800
やまびこ	23,100	1,490.00	34,419,000
平田機工	4,200	11,510.00	48,342,000
ペガサスミシン製造	12,400	773.00	9,585,200
ナブテスコ	65,400	4,150.00	271,410,000
三井海洋開発	12,700	2,667.00	33,870,900
レオン自動機	10,700	1,679.00	17,965,300
S M C	37,700	40,650.00	1,532,505,000
新川	10,900	807.00	8,796,300
ホソカワミクロン	4,400	6,150.00	27,060,000
ユニオンツール	5,400	3,525.00	19,035,000
オイレス工業	15,300	2,082.00	31,854,600
日精エー・エス・ビー機械	4,100	4,415.00	18,101,500
サトーホールディングス	15,700	2,681.00	42,091,700
技研製作所	6,000	3,305.00	19,830,000
日本エアーテック	4,400	861.00	3,788,400
日精樹脂工業	10,100	1,504.00	15,190,400
オカダアイオン	2,800	1,826.00	5,112,800
ワイエイシイホールディングス	4,900	1,113.00	5,453,700
小松製作所	580,500	3,455.00	2,005,627,500
住友重機械工業	73,400	4,500.00	330,300,000
日立建機	56,200	3,505.00	196,981,000
日工	3,800	2,203.00	8,371,400

巴工業	5,300	2,230.00	11,819,000
井関農機	12,000	2,453.00	29,436,000
TOWA	10,400	1,796.00	18,678,400
丸山製作所	2,800	1,875.00	5,250,000
北川鉄工所	5,800	2,818.00	16,344,400
シンニッタン	10,400	726.00	7,550,400
ローツェ	6,000	2,845.00	17,070,000
タカキタ	3,600	627.00	2,257,200
クボタ	648,600	1,988.50	1,289,741,100
荏原実業	3,700	1,734.00	6,415,800
東洋エンジニアリング	16,000	1,353.00	21,648,000
三菱化工機	4,200	2,436.00	10,231,200
月島機械	23,700	1,367.00	32,397,900
帝国電機製作所	9,200	1,176.00	10,819,200
東京機械製作所	5,000	615.00	3,075,000
新東工業	28,400	1,274.00	36,181,600
澁谷工業	10,500	3,590.00	37,695,000
アイチコーポレーション	17,900	794.00	14,212,600
小森コーポレーション	30,000	1,394.00	41,820,000
鶴見製作所	9,300	1,982.00	18,432,600
住友精密工業	20,000	365.00	7,300,000
酒井重工業	2,500	3,430.00	8,575,000
荏原製作所	57,000	3,815.00	217,455,000
石井鐵工所	1,900	1,757.00	3,338,300
西島製作所	12,400	1,171.00	14,520,400
北越工業	13,700	1,104.00	15,124,800
千代田化工建設	98,000	628.00	61,544,000
ダイキン工業	164,100	11,835.00	1,942,123,500
オルガノ	4,700	2,691.00	12,647,700
トーヨーカネツ	5,500	4,040.00	22,220,000
栗田工業	69,200	3,280.00	226,976,000
椿本チエイン	71,000	900.00	63,900,000
大同工業	5,000	1,612.00	8,060,000
日機装	41,700	1,039.00	43,326,300
木村化工機	11,300	460.00	5,198,000
新興ブランテック	27,400	941.00	25,783,400
アネスト岩田	21,700	1,124.00	24,390,800
ダイフク	60,000	5,590.00	335,400,000
サムコ	3,300	1,007.00	3,323,100
加藤製作所	6,600	3,230.00	21,318,000
油研工業	2,300	2,633.00	6,055,900
タダノ	62,900	1,322.00	83,153,800
フジテック	34,900	1,549.00	54,060,100
CKD	36,100	2,340.00	84,474,000
キトー	15,300	1,425.00	21,802,500
平和	37,300	2,232.00	83,253,600
理想科学工業	11,900	2,063.00	24,549,700
SANKYO	33,300	3,705.00	123,376,500
日本金銭機械	11,300	1,155.00	13,051,500
マースエンジニアリング	6,800	2,367.00	16,095,600

福島工業	7,500	4,225.00	31,687,500
オーイズミ	5,300	551.00	2,920,300
ダイコク電機	5,000	1,770.00	8,850,000
竹内製作所	22,000	2,250.00	49,500,000
アマノ	37,200	2,677.00	99,584,400
JUKI	17,900	1,645.00	29,445,500
サンデンホールディングス	14,800	2,232.00	33,033,600
蛇の目ミシン工業	11,800	777.00	9,168,600
ブラザー工業	146,800	2,663.00	390,928,400
マックス	18,000	1,559.00	28,062,000
モリタホールディングス	21,000	1,819.00	38,199,000
グローリー	38,400	4,110.00	157,824,000
新晃工業	11,300	1,806.00	20,407,800
大和冷機工業	19,400	1,178.00	22,853,200
セガサミーホールディングス	119,300	1,640.00	195,652,000
日本ピストンリング	4,800	2,431.00	11,668,800
リケン	5,600	5,890.00	32,984,000
T P R	13,500	3,770.00	50,895,000
ツバキ・ナカシマ	12,100	2,413.00	29,197,300
ホシザキ	37,900	10,210.00	386,959,000
大豊工業	9,800	1,697.00	16,630,600
日本精工	247,100	1,512.00	373,615,200
N T N	278,000	492.00	136,776,000
ジェイテクト	127,900	1,609.00	205,791,100
不二越	112,000	649.00	72,688,000
ミネベアミツミ	219,000	1,856.00	406,464,000
日本トムソン	38,800	650.00	25,220,000
T H K	85,000	3,955.00	336,175,000
ユーシン精機	5,400	3,035.00	16,389,000
前澤給装工業	4,400	1,865.00	8,206,000
イーグル工業	13,000	2,063.00	26,819,000
前澤工業	8,600	455.00	3,913,000
日本ビラー工業	12,300	1,642.00	20,196,600
キッツ	57,800	902.00	52,135,600
日立製作所	2,886,000	818.40	2,361,902,400
三菱電機	1,282,400	1,802.00	2,310,884,800
富士電機	362,000	661.00	239,282,000
東洋電機製造	5,000	2,366.00	11,830,000
安川電機	139,400	3,705.00	516,477,000
シンフォニアテクノロジー	78,000	456.00	35,568,000
明電舎	111,000	441.00	48,951,000
オリジン電気	3,600	2,041.00	7,347,600
山洋電気	6,300	6,150.00	38,745,000
デンヨー	11,100	1,934.00	21,467,400
三櫻工業	15,300	950.00	14,535,000
マキタ	156,700	4,470.00	700,449,000
東芝テック	75,000	624.00	46,800,000
芝浦メカトロニクス	20,000	415.00	8,300,000
マブチモーター	33,600	5,540.00	186,144,000
日本電産	155,800	13,990.00	2,179,642,000

ユー・エム・シー・エレクトロニクス	3,000	2,244.00	6,732,000
東光高岳	6,200	1,940.00	12,028,000
ダブル・スコープ	17,500	2,152.00	37,660,000
宮越ホールディングス	4,500	524.00	2,358,000
ダイヘン	66,000	1,009.00	66,594,000
田淵電機	19,100	299.00	5,710,900
ヤーマン	1,500	12,310.00	18,465,000
JVCケンウッド	88,700	322.00	28,561,400
ミマキエンジニアリング	11,000	865.00	9,515,000
第一精工	5,700	2,648.00	15,093,600
日新電機	24,200	1,429.00	34,581,800
大崎電気工業	24,100	878.00	21,159,800
オムロン	127,800	5,920.00	756,576,000
日東工業	17,600	1,951.00	34,337,600
I D E C	14,200	2,365.00	33,583,000
不二電機工業	1,400	1,376.00	1,926,400
ジーエス・ユアサ コーポレーション	232,000	591.00	137,112,000
サクサホールディングス	3,100	2,039.00	6,320,900
メルコホールディングス	6,600	3,530.00	23,298,000
テクノメディカ	2,800	1,943.00	5,440,400
日本電気	165,200	3,060.00	505,512,000
富士通	1,159,000	887.10	1,028,148,900
沖電気工業	52,000	1,512.00	78,624,000
岩崎通信機	5,500	854.00	4,697,000
電気興業	6,800	3,020.00	20,536,000
サンケン電気	71,000	601.00	42,671,000
ナカヨ	2,500	1,907.00	4,767,500
アイホン	6,800	1,862.00	12,661,600
ルネサスエレクトロニクス	62,500	1,236.00	77,250,000
セイコーエプソン	179,000	2,701.00	483,479,000
ワコム	93,700	500.00	46,850,000
アルバック	20,300	7,300.00	148,190,000
アクセル	5,200	806.00	4,191,200
E I Z O	11,900	4,460.00	53,074,000
ジャパンディスプレイ	225,400	241.00	54,321,400
日本信号	33,200	1,220.00	40,504,000
京三製作所	29,000	617.00	17,893,000
能美防災	13,700	1,789.00	24,509,300
ホーチキ	8,800	2,175.00	19,140,000
エレコム	10,400	2,230.00	23,192,000
パナソニック	1,380,800	1,620.00	2,236,896,000
アンリツ	87,700	941.00	82,525,700
富士通ゼネラル	40,900	2,261.00	92,474,900
日立国際電気	31,500	3,020.00	95,130,000
ソニー	849,600	4,062.00	3,451,075,200
T D K	67,700	7,630.00	516,551,000
帝国通信工業	5,200	1,138.00	5,917,600
タムラ製作所	47,000	678.00	31,866,000
アルプス電気	111,000	3,040.00	337,440,000
池上通信機	40,000	165.00	6,600,000

パイオニア	181,000	212.00	38,372,000
日本電波工業	11,800	827.00	9,758,600
鈴木	4,900	990.00	4,851,000
日本トリム	2,900	4,800.00	13,920,000
ローランド ディー.ジー.	6,200	2,960.00	18,352,000
フォスター電機	14,100	2,353.00	33,177,300
クラリオン	64,000	446.00	28,544,000
SMK	31,000	532.00	16,492,000
ヨコオ	8,800	1,405.00	12,364,000
ティアック	92,000	48.00	4,416,000
ホシデン	35,500	1,839.00	65,284,500
ヒロセ電機	19,400	16,110.00	312,534,000
日本航空電子工業	34,000	1,797.00	61,098,000
TOA	14,200	1,192.00	16,926,400
マクセルホールディングス	17,900	2,579.00	46,164,100
古野電気	15,500	742.00	11,501,000
ユニデンホールディングス	37,000	303.00	11,211,000
アルパイン	28,700	2,092.00	60,040,400
スミダコーポレーション	12,400	2,071.00	25,680,400
アイコム	6,700	2,595.00	17,386,500
リオン	4,800	2,324.00	11,155,200
本多通信工業	3,600	1,738.00	6,256,800
船井電機	13,600	889.00	12,090,400
横河電機	130,300	2,044.00	266,333,200
新電元工業	4,700	7,200.00	33,840,000
アズビル	36,000	4,775.00	171,900,000
東亜ディーケーケー	6,200	806.00	4,997,200
日本光電工業	50,200	2,604.00	130,720,800
チノー	4,400	1,305.00	5,742,000
共和電業	14,400	452.00	6,508,800
日本電子材料	5,000	679.00	3,395,000
堀場製作所	23,800	6,520.00	155,176,000
アドバンテスト	82,100	2,307.00	189,404,700
小野測器	5,000	747.00	3,735,000
エスベック	10,700	2,301.00	24,620,700
キーエンス	54,500	60,000.00	3,270,000,000
日置電機	6,300	2,415.00	15,214,500
シスメックス	93,500	7,210.00	674,135,000
日本マイクロニクス	21,100	1,107.00	23,357,700
メガチップス	11,200	3,750.00	42,000,000
OBARA GROUP	7,000	6,560.00	45,920,000
イマジカ・ロボットホールディングス	10,100	890.00	8,989,000
澤藤電機	1,500	2,816.00	4,224,000
デンソー	296,400	5,686.00	1,685,330,400
コーセル	16,800	1,501.00	25,216,800
イリソ電子工業	10,100	5,840.00	58,984,000
新日本無線	9,900	853.00	8,444,700
オブテックスグループ	9,400	4,405.00	41,407,000
千代田インテグレ	5,800	2,702.00	15,671,600

アイ・オー・データ機器	4,000	1,112.00	4,448,000
レーザーテック	26,500	2,361.00	62,566,500
スタンレー電気	85,500	4,005.00	342,427,500
岩崎電気	4,500	1,935.00	8,707,500
ウシオ電機	72,900	1,552.00	113,140,800
岡谷電機産業	7,000	504.00	3,528,000
ヘリオス テクノ ホールディング	11,700	737.00	8,622,900
日本セラミック	12,200	3,185.00	38,857,000
遠藤照明	6,200	1,311.00	8,128,200
古河電池	9,000	1,211.00	10,899,000
双信電機	6,500	630.00	4,095,000
山一電機	11,400	2,027.00	23,107,800
図研	7,900	1,902.00	15,025,800
日本電子	44,000	566.00	24,904,000
カシオ計算機	96,700	1,628.00	157,427,600
ファナック	121,900	24,525.00	2,989,597,500
日本シイエムケイ	26,000	1,210.00	31,460,000
エンプラス	5,500	4,985.00	27,417,500
大真空	4,600	1,892.00	8,703,200
ローム	58,100	9,670.00	561,827,000
浜松ホトニクス	87,400	3,575.00	312,455,000
三井ハイテック	15,900	2,259.00	35,918,100
新光電気工業	45,400	783.00	35,548,200
京セラ	197,300	7,272.00	1,434,765,600
協栄産業	1,500	2,477.00	3,715,500
太陽誘電	58,500	1,778.00	104,013,000
村田製作所	126,100	16,620.00	2,095,782,000
ユーシン	16,800	781.00	13,120,800
双葉電子工業	19,500	2,096.00	40,872,000
日東電工	90,800	9,453.00	858,332,400
北陸電気工業	5,000	1,537.00	7,685,000
東海理化電機製作所	31,600	2,307.00	72,901,200
ニチコン	37,900	1,386.00	52,529,400
日本ケミコン	10,400	3,840.00	39,936,000
K O A	16,700	2,243.00	37,458,100
三井造船	43,400	1,478.00	64,145,200
日立造船	95,400	589.00	56,190,600
三菱重工業	201,500	4,457.00	898,085,500
川崎重工業	93,500	3,810.00	356,235,000
I H I	92,400	3,910.00	361,284,000
名村造船所	36,200	665.00	24,073,000
サノヤスホールディングス	15,000	303.00	4,545,000
日本車輛製造	44,000	298.00	13,112,000
三菱ロジスネクスト	14,500	866.00	12,557,000
近畿車輛	1,900	2,647.00	5,029,300
F P G	42,600	1,227.00	52,270,200
島根銀行	2,800	1,343.00	3,760,400
じもとホールディングス	86,600	209.00	18,099,400
全国保証	33,500	4,580.00	153,430,000
めぶきフィナンシャルグループ	572,200	442.00	252,912,400

東京ＴＹフィナンシャルグループ	17,200	2,939.00	50,550,800	
九州フィナンシャルグループ	194,400	681.00	132,386,400	
かんぽ生命保険	44,700	2,419.00	108,129,300	
ゆうちょ銀行	335,500	1,383.00	463,996,500	
富山第一銀行	30,200	543.00	16,398,600	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	769,500	579.20	445,694,400	
西日本フィナンシャルホールディングス	80,600	1,251.00	100,830,600	
日産自動車	1,417,600	1,089.50	1,544,475,200	
いすゞ自動車	348,500	1,506.50	525,015,250	
トヨタ自動車	1,461,600	6,925.00	10,121,580,000	*
日野自動車	171,700	1,432.00	245,874,400	
三菱自動車工業	440,800	911.00	401,568,800	
エフテック	6,700	1,795.00	12,026,500	
レシップホールディングス	4,300	923.00	3,968,900	
GMB	2,100	1,460.00	3,066,000	
ファルテック	2,200	1,392.00	3,062,400	
武蔵精密工業	14,000	3,590.00	50,260,000	
日産車体	52,900	1,231.00	65,119,900	
新明和工業	48,500	1,027.00	49,809,500	
極東開発工業	24,000	1,861.00	44,664,000	
日信工業	26,800	2,003.00	53,680,400	
トピー工業	9,900	3,730.00	36,927,000	
ティラド	4,700	4,195.00	19,716,500	
曙ブレーキ工業	56,300	373.00	20,999,900	
タチエス	20,500	2,017.00	41,348,500	
NOK	58,100	2,584.00	150,130,400	
フタバ産業	36,800	1,217.00	44,785,600	
KYB	13,500	6,890.00	93,015,000	
市光工業	25,000	823.00	20,575,000	
大同メタル工業	15,200	1,001.00	15,215,200	
プレス工業	63,700	596.00	37,965,200	
ミクニ	15,500	580.00	8,990,000	
太平洋工業	27,200	1,452.00	39,494,400	
ケーヒン	27,600	1,970.00	54,372,000	
河西工業	16,300	1,643.00	26,780,900	
アイシン精機	110,000	5,990.00	658,900,000	
富士機工	12,100	737.00	8,917,700	
マツダ	380,700	1,657.50	631,010,250	
今仙電機製作所	11,200	1,420.00	15,904,000	
本田技研工業	1,081,800	3,407.00	3,685,692,600	
スズキ	238,300	5,851.00	1,394,293,300	
SUBARU	373,300	3,952.00	1,475,281,600	
安永	4,300	3,465.00	14,899,500	
ヤマハ発動機	169,900	3,315.00	563,218,500	
ショーワ	31,300	1,399.00	43,788,700	
小糸製作所	72,100	7,110.00	512,631,000	
TBK	15,700	508.00	7,975,600	
エクセディ	16,200	3,355.00	54,351,000	

ミツバ	22,200	1,775.00	39,405,000
豊田合成	38,700	2,831.00	109,559,700
愛三工業	21,000	1,073.00	22,533,000
盟和産業	1,800	1,274.00	2,293,200
ヨロズ	11,200	2,339.00	26,196,800
エフ・シー・シー	19,700	2,506.00	49,368,200
新家工業	2,800	2,146.00	6,008,800
シマノ	48,500	14,860.00	720,710,000
テイ・エス テック	27,900	3,810.00	106,299,000
ジャムコ	7,100	2,331.00	16,550,100
小野建	10,300	1,872.00	19,281,600
はるやまホールディングス	5,400	1,001.00	5,405,400
ノジマ	18,600	2,380.00	44,268,000
佐島電機	8,800	1,006.00	8,852,800
カッパ・クリエイト	16,800	1,278.00	21,470,400
エコートレーディング	3,000	705.00	2,115,000
伯東	8,100	1,720.00	13,932,000
コンドーテック	9,600	1,177.00	11,299,200
中山福	7,300	783.00	5,715,900
ライトオン	9,300	955.00	8,881,500
ナガイレーベン	15,700	2,823.00	44,321,100
ジーンズメイト	4,000	731.00	2,924,000
三菱食品	13,000	3,340.00	43,420,000
良品計画	15,700	33,050.00	518,885,000
三城ホールディングス	13,700	475.00	6,507,500
松田産業	8,600	1,584.00	13,622,400
第一興商	19,300	5,300.00	102,290,000
メディバルホールディングス	118,600	2,038.00	241,706,800
アドヴァン	12,300	1,031.00	12,681,300
S P K	2,800	3,160.00	8,848,000
萩原電気	4,100	3,405.00	13,960,500
アルビス	3,200	4,225.00	13,520,000
アズワン	9,300	6,160.00	57,288,000
スズデン	4,300	1,436.00	6,174,800
尾家産業	4,400	1,287.00	5,662,800
シモジマ	7,200	1,167.00	8,402,400
ドウシシャ	14,000	2,442.00	34,188,000
小津産業	2,800	2,192.00	6,137,600
コナカ	15,400	588.00	9,055,200
高速	7,100	1,195.00	8,484,500
ハウス オブ ローゼ	1,700	1,569.00	2,667,300
G - 7ホールディングス	3,600	2,244.00	8,078,400
たけびし	4,000	1,563.00	6,252,000
イオン北海道	10,400	643.00	6,687,200
コジマ	18,400	382.00	7,028,800
ヒマラヤ	3,300	983.00	3,243,900
コーナン商事	16,800	2,245.00	37,716,000
黒田電気	16,100	2,008.00	32,328,800
ネットワンシステムズ	51,500	1,207.00	62,160,500
エコス	4,800	1,240.00	5,952,000

ワタミ	14,100	1,511.00	21,305,100
マルシェ	3,100	828.00	2,566,800
リックス	2,800	1,790.00	5,012,000
システムソフト	22,800	142.00	3,237,600
ドンキホーテホールディングス	76,800	4,490.00	344,832,000
丸文	10,300	1,013.00	10,433,900
西松屋チェーン	21,000	1,233.00	25,893,000
ゼンショーホールディングス	61,400	2,086.00	128,080,400
ハピネット	10,000	1,914.00	19,140,000
幸楽苑ホールディングス	7,900	1,729.00	13,659,100
ハークスレイ	3,000	1,152.00	3,456,000
橋本総業ホールディングス	2,500	1,707.00	4,267,500
日本ライフライン	13,500	5,690.00	76,815,000
サイゼリヤ	17,600	3,485.00	61,336,000
エクセル	5,200	2,268.00	11,793,600
V Tホールディングス	40,300	633.00	25,509,900
マルカキカイ	3,900	2,042.00	7,963,800
アルゴグラフィックス	5,500	3,490.00	19,195,000
魚力	3,900	1,185.00	4,621,500
I D O M	32,300	682.00	22,028,600
日本エム・ディ・エム	9,200	1,107.00	10,184,400
ポプラ	3,500	605.00	2,117,500
フジ・コーポレーション	1,900	2,178.00	4,138,200
ユナイテッドアローズ	15,800	4,175.00	65,965,000
進和	7,000	2,370.00	16,590,000
エスケイジャパン	2,400	308.00	739,200
ダイトロン	5,600	2,041.00	11,429,600
ハイデイ日高	13,000	3,205.00	41,665,000
シークス	7,500	4,765.00	35,737,500
京都きもの友禅	8,100	937.00	7,589,700
コロワイド	39,500	2,100.00	82,950,000
ピーシーデポコーポレーション	15,900	857.00	13,626,300
田中商事	3,900	772.00	3,010,800
オーハシテクニカ	6,700	1,647.00	11,034,900
壱番屋	8,400	4,455.00	37,422,000
白銅	3,100	2,132.00	6,609,200
トップカルチャー	5,000	530.00	2,650,000
P L A N T	2,800	1,331.00	3,726,800
スギホールディングス	26,000	5,830.00	151,580,000
島津製作所	154,700	2,260.00	349,622,000
J M S	11,100	692.00	7,681,200
クボテック	2,800	586.00	1,640,800
長野計器	8,500	1,184.00	10,064,000
ブイ・テクノロジー	2,500	19,680.00	49,200,000
スター精密	21,100	1,974.00	41,651,400
東京計器	8,500	1,604.00	13,634,000
愛知時計電機	1,600	3,940.00	6,304,000
インターアクション	4,700	767.00	3,604,900
オーバル	11,800	294.00	3,469,200
東京精密	23,200	4,005.00	92,916,000

マニー	14,700	3,145.00	46,231,500
ニコン	209,500	1,964.00	411,458,000
トプコン	60,600	2,261.00	137,016,600
オリンパス	191,900	3,950.00	758,005,000
理研計器	10,600	2,413.00	25,577,800
S C R E E Nホールディングス	24,700	8,030.00	198,341,000
キヤノン電子	11,000	2,315.00	25,465,000
タムロン	9,700	2,166.00	21,010,200
H O Y A	247,300	6,178.00	1,527,819,400
シード	1,600	3,990.00	6,384,000
ノーリツ鋼機	12,300	1,456.00	17,908,800
エー・アンド・デイ	11,400	530.00	6,042,000
キヤノン	647,000	3,970.00	2,568,590,000
リコー	361,400	1,154.00	417,055,600
シチズン時計	131,200	797.00	104,566,400
リズム時計工業	4,800	2,389.00	11,467,200
大研医器	10,600	778.00	8,246,800
メニコン	8,300	4,790.00	39,757,000
スノーピーク	1,600	2,924.00	4,678,400
パラマウントベッドホールディングス	11,500	4,965.00	57,097,500
トランザクション	5,600	1,060.00	5,936,000
S H O B I	5,000	461.00	2,305,000
ニホンフラッシュ	5,300	1,714.00	9,084,200
前田工織	12,200	1,891.00	23,070,200
永大産業	15,000	558.00	8,370,000
アートネイチャー	13,000	713.00	9,269,000
ダンロップスポーツ	7,700	1,622.00	12,489,400
バンダイナムコホールディングス	132,600	3,835.00	508,521,000
アイフィスジャパン	2,400	553.00	1,327,200
共立印刷	21,600	348.00	7,516,800
S H O E I	5,500	3,350.00	18,425,000
フランスベッドホールディングス	13,800	1,035.00	14,283,000
マーベラス	20,300	955.00	19,386,500
パイロットコーポレーション	21,000	5,440.00	114,240,000
萩原工業	3,400	3,875.00	13,175,000
エイベックス・グループ・ホールディングス	21,900	1,548.00	33,901,200
トッパン・フォームズ	21,600	1,223.00	26,416,800
フジシールインターナショナル	27,000	3,420.00	92,340,000
タカラトミー	46,800	1,716.00	80,308,800
廣済堂	12,700	453.00	5,753,100
アーク	53,400	111.00	5,927,400
レック	7,900	2,806.00	22,167,400
タカノ	5,700	1,288.00	7,341,600
プロネクサス	11,400	1,333.00	15,196,200
ホクシン	9,700	218.00	2,114,600
ウッドワン	4,200	1,850.00	7,770,000
大建工業	8,500	2,793.00	23,740,500
きもと	23,400	261.00	6,107,400
凸版印刷	339,000	1,115.00	377,985,000

大日本印刷	169,300	2,674.00	452,708,200
図書印刷	8,200	1,079.00	8,847,800
共同印刷	3,700	3,710.00	13,727,000
N I S S H A	21,100	3,340.00	70,474,000
光村印刷	300	2,419.00	725,700
藤森工業	9,400	3,715.00	34,921,000
ヴィア・ホールディングス	9,400	827.00	7,773,800
宝印刷	6,200	1,717.00	10,645,400
前澤化成工業	8,300	1,249.00	10,366,700
アシックス	119,500	1,709.00	204,225,500
ツツミ	4,500	2,038.00	9,171,000
J S P	5,900	3,765.00	22,213,500
ニチハ	16,700	4,345.00	72,561,500
エフピコ	11,200	5,840.00	65,408,000
小松ウオール工業	4,000	1,976.00	7,904,000
ヤマハ	81,000	4,340.00	351,540,000
河合楽器製作所	4,800	2,343.00	11,246,400
クリナップ	12,500	892.00	11,150,000
ビジョン	72,700	3,845.00	279,531,500
天馬	8,300	2,310.00	19,173,000
兼松サステック	1,400	2,388.00	3,343,200
キングジム	10,200	1,029.00	10,495,800
リンテック	28,500	2,974.00	84,759,000
信越ポリマー	24,700	1,044.00	25,786,800
東リ	30,000	396.00	11,880,000
イトーキ	25,500	935.00	23,842,500
任天堂	74,100	43,700.00	3,238,170,000
三菱鉛筆	19,800	2,799.00	55,420,200
松風	6,300	1,320.00	8,316,000
タカラスタンダード	24,700	1,947.00	48,090,900
コクヨ	57,600	1,910.00	110,016,000
ナカバヤシ	11,000	687.00	7,557,000
ニフコ	22,100	6,780.00	149,838,000
立川ブラインド工業	5,400	1,258.00	6,793,200
グロープライド	5,900	1,948.00	11,493,200
岡村製作所	42,000	1,240.00	52,080,000
日本バルカー工業	9,800	2,742.00	26,871,600
M U T O Hホールディングス	1,600	2,569.00	4,110,400
伊藤忠商事	869,100	1,864.00	1,620,002,400
丸紅	1,167,700	735.20	858,493,040
スクロール	18,300	392.00	7,173,600
高島	2,100	2,254.00	4,733,400
ヨンドシーホールディングス	12,000	3,020.00	36,240,000
三陽商会	6,800	1,783.00	12,124,400
長瀬産業	71,000	1,887.00	133,977,000
ナイガイ	4,900	588.00	2,881,200
蝶理	7,500	2,093.00	15,697,500
豊田通商	132,200	3,795.00	501,699,000
オンワードホールディングス	81,000	919.00	74,439,000
三共生興	17,000	441.00	7,497,000

兼松	50,600	1,397.00	70,688,200
美津濃	12,900	3,240.00	41,796,000
ツカモトコーポレーション	2,300	1,250.00	2,875,000
ユニー・ファミリーマートホールディングス	52,000	6,140.00	319,280,000
ルック	22,000	412.00	9,064,000
三井物産	1,072,500	1,628.00	1,746,030,000
日本紙パルプ商事	6,200	4,645.00	28,799,000
東京エレクトロン	80,200	17,700.00	1,419,540,000
日立ハイテクノロジーズ	41,100	4,345.00	178,579,500
カメイ	15,400	1,782.00	27,442,800
東都水産	1,900	1,968.00	3,739,200
OUGホールディングス	2,000	2,714.00	5,428,000
スターゼン	5,000	5,540.00	27,700,000
セイコーホールディングス	16,900	2,505.00	42,334,500
山善	45,500	1,198.00	54,509,000
椿本興業	2,800	2,847.00	7,971,600
住友商事	746,600	1,578.50	1,178,508,100
日本ユニシス	32,800	1,743.00	57,170,400
内田洋行	5,500	3,765.00	20,707,500
三菱商事	890,300	2,552.00	2,272,045,600
第一実業	5,400	3,190.00	17,226,000
キヤノンマーケティングジャパン	33,800	2,606.00	88,082,800
西華産業	7,400	2,927.00	21,659,800
佐藤商事	10,500	1,133.00	11,896,500
菱洋エレクトロ	10,900	2,058.00	22,432,200
東京産業	11,700	512.00	5,990,400
ユアサ商事	11,200	3,995.00	44,744,000
神鋼商事	3,100	2,985.00	9,253,500
小林産業	8,900	426.00	3,791,400
阪和興業	23,700	4,035.00	95,629,500
正栄食品工業	6,600	4,715.00	31,119,000
カナデン	11,600	1,237.00	14,349,200
菱電商事	9,300	1,717.00	15,968,100
ニプロ	83,200	1,633.00	135,865,600
フルサト工業	6,400	1,780.00	11,392,000
岩谷産業	26,100	3,400.00	88,740,000
すてきなイスグループ	5,300	1,561.00	8,273,300
昭光通商	46,000	115.00	5,290,000
ニチモウ	1,800	1,998.00	3,596,400
極東貿易	19,000	387.00	7,353,000
イワキ	18,000	552.00	9,936,000
兼松エレクトロニクス	7,500	3,245.00	24,337,500
三愛石油	31,600	1,326.00	41,901,600
稲畑産業	28,300	1,548.00	43,808,400
G S Iクレオス	3,100	1,734.00	5,375,400
明和産業	11,300	476.00	5,378,800
キムラタン	56,600	62.00	3,509,200
ゴールドウイン	5,400	8,540.00	46,116,000
ユニ・チャーム	255,000	2,673.50	681,742,500

デサント	28,700	1,539.00	44,169,300
キング	5,800	491.00	2,847,800
ワキタ	25,300	1,341.00	33,927,300
ヤマトインターナショナル	8,300	458.00	3,801,400
東邦ホールディングス	37,900	2,101.00	79,627,900
サンゲツ	40,000	1,976.00	79,040,000
ミツウロコグループホールディングス	19,200	837.00	16,070,400
シナネンホールディングス	5,000	2,412.00	12,060,000
伊藤忠エネクス	26,000	1,235.00	32,110,000
サンリオ	36,600	1,908.00	69,832,800
サンワテクノス	7,100	2,220.00	15,762,000
リョーサン	15,900	4,415.00	70,198,500
新光商事	13,000	2,062.00	26,806,000
トーヨー	5,500	2,690.00	14,795,000
三信電気	13,100	1,720.00	22,532,000
東陽テクニカ	13,700	1,056.00	14,467,200
モスフードサービス	15,500	3,500.00	54,250,000
加賀電子	10,700	3,630.00	38,841,000
三益半導体工業	9,700	1,794.00	17,401,800
ソーダニッカ	12,600	579.00	7,295,400
立花エレテック	7,900	1,860.00	14,694,000
木曽路	14,600	2,730.00	39,858,000
SRSホールディングス	14,700	937.00	13,773,900
千趣会	21,300	688.00	14,654,400
タカキュー	10,700	209.00	2,236,300
ケーヨー	20,400	757.00	15,442,800
上新電機	14,000	3,810.00	53,340,000
日本瓦斯	21,800	3,635.00	79,243,000
ロイヤルホールディングス	19,800	2,976.00	58,924,800
東天紅	1,000	2,342.00	2,342,000
いなげや	13,200	1,834.00	24,208,800
島忠	30,600	2,934.00	89,780,400
チヨダ	13,900	2,968.00	41,255,200
ライフコーポレーション	8,900	2,932.00	26,094,800
リンガーハット	13,100	2,457.00	32,186,700
さが美	11,000	121.00	1,331,000
MrMaxHD	15,100	586.00	8,848,600
テンアライド	12,500	422.00	5,275,000
AOKIホールディングス	23,500	1,493.00	35,085,500
オークワ	17,000	1,125.00	19,125,000
コメリ	18,200	3,345.00	60,879,000
青山商事	24,700	4,060.00	100,282,000
しまむら	13,800	12,790.00	176,502,000
はせがわ	4,800	501.00	2,404,800
高島屋	199,000	1,037.00	206,363,000
松屋	26,100	1,027.00	26,804,700
エイチ・ツー・オーリテイリング	60,700	2,062.00	125,163,400
近鉄百貨店	4,500	3,635.00	16,357,500
パルコ	11,300	1,497.00	16,916,100
丸井グループ	124,900	1,691.00	211,205,900

クレディセゾン	90,300	2,365.00	213,559,500
アクシアル リテイリング	9,100	4,450.00	40,495,000
井筒屋	7,000	494.00	3,458,000
イオン	488,000	1,712.50	835,700,000
イズミ	21,400	5,850.00	125,190,000
東武ストア	1,500	3,095.00	4,642,500
フォーバル	5,400	738.00	3,985,200
平和堂	24,000	2,410.00	57,840,000
フジ	13,200	3,050.00	40,260,000
ヤオコー	13,500	5,340.00	72,090,000
ゼビオホールディングス	16,000	2,181.00	34,896,000
ケーズホールディングス	50,100	2,536.00	127,053,600
PALTAC	19,000	4,575.00	86,925,000
三谷産業	12,900	414.00	5,340,600
Olympicグループ	7,300	593.00	4,328,900
日産東京販売ホールディングス	17,700	414.00	7,327,800
新生銀行	113,200	1,824.00	206,476,800
あおぞら銀行	75,100	4,285.00	321,803,500
三菱UFJフィナンシャル・グループ	8,903,200	720.90	6,418,316,880
りそなホールディングス	1,388,800	566.10	786,199,680
三井住友トラスト・ホールディングス	247,700	4,126.00	1,022,010,200
三井住友フィナンシャルグループ	950,200	4,307.00	4,092,511,400
第四銀行	14,500	5,310.00	76,995,000
北越銀行	12,900	2,568.00	33,127,200
千葉銀行	458,000	813.00	372,354,000
群馬銀行	258,000	698.00	180,084,000
武蔵野銀行	18,900	3,420.00	64,638,000
千葉興業銀行	33,400	602.00	20,106,800
筑波銀行	50,600	378.00	19,126,800
七十七銀行	37,300	2,783.00	103,805,900
青森銀行	9,200	3,740.00	34,408,000
秋田銀行	7,600	3,375.00	25,650,000
山形銀行	13,300	2,580.00	34,314,000
岩手銀行	7,700	4,530.00	34,881,000
東邦銀行	106,000	422.00	44,732,000
東北銀行	6,500	1,485.00	9,652,500
みちのく銀行	6,300	1,925.00	12,127,500
ふくおかフィナンシャルグループ	482,000	531.00	255,942,000
静岡銀行	313,000	1,033.00	323,329,000
十六銀行	15,900	3,700.00	58,830,000
スルガ銀行	121,500	2,507.00	304,600,500
八十二銀行	228,900	697.00	159,543,300
山梨中央銀行	74,000	474.00	35,076,000
大垣共立銀行	16,500	3,125.00	51,562,500
福井銀行	10,200	2,880.00	29,376,000
北國銀行	12,600	4,905.00	61,803,000
清水銀行	4,100	3,600.00	14,760,000
富山銀行	2,400	4,170.00	10,008,000
滋賀銀行	112,000	618.00	69,216,000
南都銀行	12,000	3,125.00	37,500,000

百五銀行	106,800	498.00	53,186,400
京都銀行	42,500	5,860.00	249,050,000
紀陽銀行	44,600	1,864.00	83,134,400
三重銀行	5,400	2,640.00	14,256,000
ほくほくフィナンシャルグループ	78,900	1,794.00	141,546,600
広島銀行	175,300	893.00	156,542,900
山陰合同銀行	70,300	976.00	68,612,800
中国銀行	82,100	1,559.00	127,993,900
鳥取銀行	4,000	1,754.00	7,016,000
伊予銀行	169,300	912.00	154,401,600
百十四銀行	125,000	390.00	48,750,000
四国銀行	18,200	1,678.00	30,539,600
阿波銀行	101,000	716.00	72,316,000
大分銀行	6,800	4,525.00	30,770,000
宮崎銀行	7,900	3,815.00	30,138,500
佐賀銀行	7,200	2,676.00	19,267,200
十八銀行	74,000	282.00	20,868,000
沖縄銀行	11,500	4,455.00	51,232,500
琉球銀行	24,600	1,683.00	41,401,800
セブン銀行	445,400	405.00	180,387,000
みずほフィナンシャルグループ	16,112,300	197.50	3,182,179,250
高知銀行	4,700	1,291.00	6,067,700
山口フィナンシャルグループ	111,000	1,315.00	145,965,000
アクリーティブ	10,500	399.00	4,189,500
芙蓉総合リース	13,600	7,490.00	101,864,000
興銀リース	22,200	3,065.00	68,043,000
東京センチュリー	23,800	5,080.00	120,904,000
SBIホールディングス	134,100	1,738.00	233,065,800
日本証券金融	52,000	613.00	31,876,000
アイフル	200,300	396.00	79,318,800
日本アジア投資	11,900	406.00	4,831,400
ポケットカード	9,200	1,070.00	9,844,000
長野銀行	4,100	1,980.00	8,118,000
名古屋銀行	9,500	4,285.00	40,707,500
北洋銀行	194,000	344.00	66,736,000
愛知銀行	4,000	6,790.00	27,160,000
第三銀行	7,000	1,857.00	12,999,000
中京銀行	4,800	2,362.00	11,337,600
大光銀行	4,100	2,430.00	9,963,000
愛媛銀行	14,700	1,406.00	20,668,200
トマト銀行	4,900	1,560.00	7,644,000
みなと銀行	10,800	2,088.00	22,550,400
京葉銀行	96,000	530.00	50,880,000
関西アーバン銀行	16,600	1,414.00	23,472,400
栃木銀行	65,700	491.00	32,258,700
北日本銀行	3,800	3,225.00	12,255,000
東和銀行	22,500	1,150.00	25,875,000
福島銀行	13,600	904.00	12,294,400
大東銀行	6,400	1,684.00	10,777,600
リコーリース	9,300	4,355.00	40,501,500

イオンフィナンシャルサービス	75,800	2,436.00	184,648,800
アコム	239,300	473.00	113,188,900
ジャックス	13,200	2,892.00	38,174,400
オリエントコーポレーション	256,000	186.00	47,616,000
日立キャピタル	27,900	2,792.00	77,896,800
アプラスフィナンシャル	60,100	111.00	6,671,100
オリックス	840,200	1,867.00	1,568,653,400
三菱UFJリース	300,600	610.00	183,366,000
ジャフコ	19,900	5,490.00	109,251,000
トモニホールディングス	97,800	513.00	50,171,400
大和証券グループ本社	1,078,000	646.00	696,388,000
野村ホールディングス	2,425,800	643.60	1,561,244,880
岡三証券グループ	100,000	656.00	65,600,000
丸三証券	37,800	974.00	36,817,200
東洋証券	44,000	272.00	11,968,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	135,500	689.00	93,359,500
光世証券	3,000	1,709.00	5,127,000
水戸証券	37,900	353.00	13,378,700
いちよし証券	26,800	1,112.00	29,801,600
松井証券	67,400	881.00	59,379,400
SOMPOホールディングス	248,100	4,270.00	1,059,387,000
だいこう証券ビジネス	6,100	719.00	4,385,900
日本取引所グループ	369,000	2,063.00	761,247,000
マネックスグループ	126,600	307.00	38,866,200
カブドットコム証券	88,800	344.00	30,547,200
極東証券	15,900	1,543.00	24,533,700
岩井コスモホールディングス	11,400	1,343.00	15,310,200
藍澤證券	22,300	810.00	18,063,000
フィデアホールディングス	117,600	202.00	23,755,200
池田泉州ホールディングス	126,200	432.00	54,518,400
アニコムホールディングス	8,100	2,828.00	22,906,800
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	332,100	3,586.00	1,190,910,600
ソニーフィナンシャルホールディングス	113,700	1,807.00	205,455,900
マネーパートナーズグループ	15,600	471.00	7,347,600
小林洋行	4,300	291.00	1,251,300
第一生命ホールディングス	715,700	2,045.00	1,463,606,500
東京海上ホールディングス	477,900	4,468.00	2,135,257,200
イー・ギャランティ	3,700	3,105.00	11,488,500
アサックス	2,300	1,765.00	4,059,500
NECキャピタルソリューション	4,800	2,341.00	11,236,800
T&Dホールディングス	415,000	1,642.00	681,430,000
アドバンスクリエイト	3,000	1,899.00	5,697,000
三井不動産	629,400	2,549.50	1,604,655,300
三菱地所	883,000	2,009.00	1,773,947,000
平和不動産	22,600	2,005.00	45,313,000
東京建物	129,700	1,489.00	193,123,300
ダイビル	30,600	1,295.00	39,627,000

京阪神ビルディング	19,800	771.00	15,265,800
住友不動産	285,000	3,562.00	1,015,170,000
太平洋興発	5,300	1,009.00	5,347,700
大京	22,000	2,256.00	49,632,000
テーオーシー	46,000	1,001.00	46,046,000
東京楽天地	2,000	5,760.00	11,520,000
レオパレス21	147,500	831.00	122,572,500
スターツコーポレーション	16,100	2,915.00	46,931,500
フジ住宅	15,600	878.00	13,696,800
空港施設	14,300	629.00	8,994,700
明和地所	6,800	923.00	6,276,400
ゴールドクレスト	10,800	2,714.00	29,311,200
リログループ	63,000	2,677.00	168,651,000
日本エスリード	4,800	2,129.00	10,219,200
日神不動産	14,300	773.00	11,053,900
日本エスコン	16,700	504.00	8,416,800
タカラレーベン	51,400	549.00	28,218,600
サンヨーハウジング名古屋	6,400	1,164.00	7,449,600
イオンモール	76,500	2,002.00	153,153,000
ファースト住建	4,500	1,846.00	8,307,000
ランド	64,400	18.00	1,159,200
東祥	7,300	2,846.00	20,775,800
トーセイ	15,100	1,092.00	16,489,200
穴吹興産	1,400	3,020.00	4,228,000
エヌ・ティ・ティ都市開発	74,000	1,178.00	87,172,000
サンフロンティア不動産	13,000	1,321.00	17,173,000
エフ・ジェー・ネクスト	10,700	984.00	10,528,800
インテリックス	3,800	986.00	3,746,800
ランドビジネス	8,000	307.00	2,456,000
グランディハウス	11,100	456.00	5,061,600
東武鉄道	128,500	3,155.00	405,417,500
相鉄ホールディングス	38,400	2,784.00	106,905,600
東京急行電鉄	326,500	1,670.00	545,255,000
京浜急行電鉄	164,800	2,347.00	386,785,600
小田急電鉄	192,600	2,166.00	417,171,600
京王電鉄	67,200	4,715.00	316,848,000
京成電鉄	90,200	3,195.00	288,189,000
富士急行	16,500	2,502.00	41,283,000
新京成電鉄	3,000	2,123.00	6,369,000
東日本旅客鉄道	230,300	10,485.00	2,414,695,500
西日本旅客鉄道	115,700	7,831.00	906,046,700
東海旅客鉄道	100,000	20,090.00	2,009,000,000
西武ホールディングス	166,100	1,952.00	324,227,200
鴻池運輸	17,000	1,676.00	28,492,000
西日本鉄道	28,800	2,761.00	79,516,800
ハマキョウレックス	7,900	3,385.00	26,741,500
サカイ引越センター	5,600	6,520.00	36,512,000
近鉄グループホールディングス	121,100	4,245.00	514,069,500
阪急阪神ホールディングス	151,900	4,260.00	647,094,000
南海電気鉄道	50,900	2,852.00	145,166,800

京阪ホールディングス	53,800	3,395.00	182,651,000
神戸電鉄	3,100	3,915.00	12,136,500
名古屋鉄道	87,500	2,468.00	215,950,000
山陽電気鉄道	8,800	2,790.00	24,552,000
トランコム	3,500	6,150.00	21,525,000
日本通運	44,700	7,240.00	323,628,000
ヤマトホールディングス	215,100	2,235.50	480,856,050
山九	31,700	4,575.00	145,027,500
日新	9,900	2,912.00	28,828,800
丸運	6,400	321.00	2,054,400
丸全昭和運輸	40,000	525.00	21,000,000
センコーグループホールディングス	56,400	814.00	45,909,600
トナミホールディングス	2,500	5,450.00	13,625,000
ニッコンホールディングス	40,600	2,791.00	113,314,600
日本石油輸送	1,400	3,465.00	4,851,000
福山通運	14,500	3,600.00	52,200,000
セイノーホールディングス	85,000	1,628.00	138,380,000
神奈川中央交通	2,800	3,665.00	10,262,000
日立物流	25,100	2,855.00	71,660,500
丸和運輸機関	6,100	2,403.00	14,658,300
C & F ロジホールディングス	12,500	1,470.00	18,375,000
日本郵船	101,700	2,339.00	237,876,300
商船三井	63,000	3,360.00	211,680,000
川崎汽船	45,600	3,000.00	136,800,000
NSユナイテッド海運	5,400	2,370.00	12,798,000
明治海運	11,400	442.00	5,038,800
飯野海運	62,300	526.00	32,769,800
共栄タンカー	1,100	2,168.00	2,384,800
九州旅客鉄道	119,500	3,400.00	406,300,000
日本航空	211,200	3,808.00	804,249,600
ANAホールディングス	223,200	4,272.00	953,510,400
パスコ	12,000	354.00	4,248,000
三菱倉庫	39,400	2,883.00	113,590,200
三井倉庫ホールディングス	71,000	346.00	24,566,000
住友倉庫	81,000	779.00	63,099,000
澁澤倉庫	6,200	2,014.00	12,486,800
ヤマタネ	6,200	1,908.00	11,829,600
東陽倉庫	22,200	320.00	7,104,000
乾汽船	9,200	813.00	7,479,600
日本トランスシティ	28,000	477.00	13,356,000
ケイヒン	2,300	1,670.00	3,841,000
中央倉庫	7,300	1,195.00	8,723,500
川西倉庫	2,300	2,359.00	5,425,700
安田倉庫	8,800	895.00	7,876,000
東洋埠頭	3,700	1,916.00	7,089,200
宇徳	9,800	508.00	4,978,400
上組	71,700	2,542.00	182,261,400
サンリツ	1,700	786.00	1,336,200
キムラユニティー	3,200	1,198.00	3,833,600
キューソー流通システム	3,400	3,135.00	10,659,000

郵船ロジスティクス	11,200	1,062.00	11,894,400
近鉄エクスプレス	21,600	1,867.00	40,327,200
東海運	7,100	414.00	2,939,400
エーアイティー	7,700	1,251.00	9,632,700
内外トランスライン	3,800	1,701.00	6,463,800
東京放送ホールディングス	78,300	2,177.00	170,459,100
日本テレビホールディングス	108,500	1,998.00	216,783,000
朝日放送	11,600	895.00	10,382,000
テレビ朝日ホールディングス	32,500	2,266.00	73,645,000
スカパーJ S A Tホールディングス	77,500	510.00	39,525,000
テレビ東京ホールディングス	9,800	2,325.00	22,785,000
日本BS放送	2,800	1,235.00	3,458,000
ビジョン	2,800	2,567.00	7,187,600
U - N E X T	3,300	1,031.00	3,402,300
ワイヤレスゲート	4,100	1,308.00	5,362,800
コネクシオ	8,500	1,999.00	16,991,500
日本通信	102,900	139.00	14,303,100
クロップス	1,400	1,409.00	1,972,600
日本電信電話	952,600	5,220.00	4,972,572,000
K D D I	1,159,100	2,960.50	3,431,515,550
光通信	14,300	13,780.00	197,054,000
N T T ドコモ	873,400	2,601.50	2,272,150,100
エムティーアイ	16,300	664.00	10,823,200
G M O インターネット	43,600	1,465.00	63,874,000
カドカワ	34,600	1,336.00	46,225,600
学研ホールディングス	4,100	3,250.00	13,325,000
ゼンリン	15,800	3,380.00	53,404,000
昭文社	6,900	726.00	5,009,400
インプレスホールディングス	11,100	158.00	1,753,800
東京電力ホールディングス	1,020,100	466.00	475,366,600
中部電力	396,100	1,408.50	557,906,850
関西電力	490,700	1,535.00	753,224,500
中国電力	165,600	1,226.00	203,025,600
北陸電力	118,000	964.00	113,752,000
東北電力	300,300	1,489.00	447,146,700
四国電力	108,400	1,370.00	148,508,000
九州電力	265,500	1,249.00	331,609,500
北海道電力	112,700	831.00	93,653,700
沖縄電力	19,500	2,528.00	49,296,000
電源開発	95,600	2,884.00	275,710,400
エフオン	5,300	1,562.00	8,278,600
イーレックス	15,300	1,104.00	16,891,200
東京瓦斯	256,500	2,876.50	737,822,250
大阪瓦斯	233,200	2,180.00	508,376,000
東邦瓦斯	60,000	3,315.00	198,900,000
北海道瓦斯	31,000	285.00	8,835,000
広島ガス	25,300	357.00	9,032,100
西部瓦斯	13,600	2,852.00	38,787,200
静岡ガス	34,000	900.00	30,600,000
メタウォーター	6,800	3,085.00	20,978,000

アイネット	7,000	1,539.00	10,773,000
松竹	7,800	16,240.00	126,672,000
東宝	77,700	3,980.00	309,246,000
エイチ・アイ・エス	18,000	3,620.00	65,160,000
東映	4,400	12,770.00	56,188,000
ラックランド	2,200	2,127.00	4,679,400
エヌ・ティ・ティ・データ	366,700	1,226.00	449,574,200
共立メンテナンス	20,500	3,340.00	68,470,000
イチネンホールディングス	13,000	1,544.00	20,072,000
建設技術研究所	8,400	1,031.00	8,660,400
スペース	6,700	1,705.00	11,423,500
アインホールディングス	16,900	7,430.00	125,567,000
燦ホールディングス	2,600	2,851.00	7,412,600
ピー・シー・エー	1,800	1,670.00	3,006,000
スバル興業	1,000	7,330.00	7,330,000
東京テアトル	5,200	1,475.00	7,670,000
タナベ経営	2,700	1,395.00	3,766,500
ビジネスブレイン太田昭和	1,700	1,429.00	2,429,300
ナガワ	2,300	4,405.00	10,131,500
よみうりランド	2,500	4,755.00	11,887,500
東京都競馬	8,700	3,490.00	30,363,000
常盤興産	4,900	1,861.00	9,118,900
カナモト	17,600	3,535.00	62,216,000
東京ドーム	50,400	1,046.00	52,718,400
D T S	12,400	3,080.00	38,192,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	45,700	4,345.00	198,566,500
シーイーシー	7,100	2,537.00	18,012,700
カプコン	27,900	2,886.00	80,519,400
西尾レントオール	10,100	3,860.00	38,986,000
アイ・エス・ビー	2,300	1,391.00	3,199,300
アゴラ・ホスピタリティ・グループ	72,000	36.00	2,592,000
日本空港ビルデング	37,900	4,120.00	156,148,000
トランス・コスモス	14,700	2,574.00	37,837,800
乃村工藝社	27,000	2,321.00	62,667,000
ジャステック	7,100	1,343.00	9,535,300
S C S K	32,300	4,855.00	156,816,500
藤田観光	4,200	3,525.00	14,805,000
K N T - C Tホールディングス	7,200	2,002.00	14,414,400
日本管財	10,900	2,052.00	22,366,800
トーカイ	5,600	5,050.00	28,280,000
白洋舎	500	3,385.00	1,692,500
セコム	130,700	8,525.00	1,114,217,500
日本システムウエア	4,100	2,189.00	8,974,900
セントラル警備保障	5,700	2,044.00	11,650,800
アイネス	15,300	1,086.00	16,615,800
丹青社	21,900	1,353.00	29,630,700
メイテック	14,600	5,490.00	80,154,000
T K C	11,000	3,460.00	38,060,000

アサツー ディ・ケイ	21,900	3,800.00	83,220,000
富士ソフト	16,300	3,265.00	53,219,500
応用地質	12,200	1,727.00	21,069,400
船井総研ホールディングス	16,000	3,890.00	62,240,000
NSD	24,700	2,036.00	50,289,200
進学会ホールディングス	5,500	657.00	3,613,500
丸紅建材リース	12,000	239.00	2,868,000
オオバ	9,700	520.00	5,044,000
コナミホールディングス	53,600	5,320.00	285,152,000
学究社	3,500	1,554.00	5,439,000
ベネッセホールディングス	42,100	3,990.00	167,979,000
イオンディライト	14,200	4,225.00	59,995,000
ナック	8,000	984.00	7,872,000
福井コンピュータホールディングス	3,500	2,888.00	10,108,000
ニチイ学館	22,000	1,138.00	25,036,000
ダイセキ	22,000	2,757.00	60,654,000
ステップ	4,400	1,516.00	6,670,400
日鉄住金物産	10,300	5,850.00	60,255,000
元気寿司	3,100	2,727.00	8,453,700
トラスコ中山	24,700	2,739.00	67,653,300
ヤマダ電機	407,300	607.00	247,231,100
オートバックスセブン	43,700	1,919.00	83,860,300
モリト	9,500	1,089.00	10,345,500
アークランドサカモト	20,200	1,727.00	34,885,400
ニトリホールディングス	51,300	16,140.00	827,982,000
グルメ杵屋	9,000	1,139.00	10,251,000
愛眼	9,700	278.00	2,696,600
ケーユーホールディングス	6,200	950.00	5,890,000
吉野家ホールディングス	41,400	1,872.00	77,500,800
加藤産業	18,600	3,440.00	63,984,000
イノテック	10,500	928.00	9,744,000
イエローハット	11,200	3,230.00	36,176,000
松屋フーズ	5,700	4,255.00	24,253,500
JBCホールディングス	10,400	1,072.00	11,148,800
JKホールディングス	11,900	891.00	10,602,900
サガミチェーン	15,200	1,361.00	20,687,200
日伝	9,800	2,373.00	23,255,400
関西スーパーマーケット	9,700	1,414.00	13,715,800
ミロク情報サービス	11,800	2,575.00	30,385,000
北沢産業	11,000	229.00	2,519,000
杉本商事	6,800	1,685.00	11,458,000
因幡電機産業	16,500	4,720.00	77,880,000
王将フードサービス	8,600	4,485.00	38,571,000
ブレナス	13,200	2,326.00	30,703,200
ミニストップ	8,800	2,280.00	20,064,000
アークス	22,100	2,545.00	56,244,500
パローホールディングス	25,500	2,518.00	64,209,000
バイテックホールディングス	4,900	1,824.00	8,937,600
ミスミグループ本社	136,900	2,861.00	391,670,900
アルテック	10,800	305.00	3,294,000

ベルク	5,300	6,050.00	32,065,000	
大 庄	6,600	1,736.00	11,457,600	
タキヒヨー	3,600	2,334.00	8,402,400	
ファーストリテイリング	19,800	34,850.00	690,030,000	
ソフトバンクグループ	534,300	9,840.00	5,257,512,000	
蔵王産業	2,000	1,623.00	3,246,000	
スズケン	54,000	3,950.00	213,300,000	
サンドラッグ	45,200	4,835.00	218,542,000	
サクスパー ホールディングス	11,300	1,352.00	15,277,600	
ジェコス	8,200	1,201.00	9,848,200	
ヤマザワ	2,400	1,735.00	4,164,000	
やまや	2,500	1,693.00	4,232,500	
ルネサスイーストン	10,900	684.00	7,455,600	
ペルーナ	25,600	1,209.00	30,950,400	
合計	148,175,700		297,566,000,230	

*担保として以下の有価証券が差し入れられております。

銘柄	株式数
トヨタ自動車	500,000

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位:円)

科 目	注記 番号	平成28年10月12日現在	平成29年10月12日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		1,747,530,910	2,773,988,288
国債証券		314,821,199,800	297,773,980,000
地方債証券		23,892,646,241	23,371,281,085
特殊債券		20,116,560,490	16,353,704,562
社債券		18,355,103,890	17,026,841,050
未収入金		-	1,631,865,000
未収利息		676,597,865	613,053,882
前払費用		10,464,910	6,261,326
流動資産合計		379,620,104,106	359,550,975,193
資産合計		379,620,104,106	359,550,975,193
負債の部			
流動負債			
未払解約金		531,583,000	1,684,089,000
流動負債合計		531,583,000	1,684,089,000
負債合計		531,583,000	1,684,089,000
純資産の部			
元本等			
元本	1	291,973,791,531	279,387,012,706
剰余金			
剰余金又は欠損金()		87,114,729,575	78,479,873,487
元本等合計		379,088,521,106	357,866,886,193
純資産合計		379,088,521,106	357,866,886,193
負債純資産合計		379,620,104,106	359,550,975,193

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	平成28年10月12日現在	平成29年10月12日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額 同期中追加設定元本額 同期中一部解約元本額	341,377,581,143円 52,776,738,530円 102,180,528,142円	291,973,791,531円 65,137,606,209円 77,724,385,034円
元本の内訳 ファンド名		
D I A M国内債券パッシブ・ファンド	10,458,069,463円	13,850,588,414円
M I T O ラップ型ファンド（安定型）	159,532,734円	141,771,788円
M I T O ラップ型ファンド（中立型）	125,209,751円	127,305,344円
M I T O ラップ型ファンド（積極型）	43,871,381円	40,618,516円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	381,270,488円	358,172,970円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	110,183,872円	131,577,204円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	21,400,757円	27,433,307円
たわらノーロード 国内債券	885,657,182円	2,266,473,066円
たわらノーロード 国内債券<ラップ向け>	755,274円	755,274円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	- 円	10,431,159円
D I A M国内債券インデックスファンド<DC年金>	12,268,043,060円	12,439,230,248円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 1安定型	4,632,761,411円	5,321,123,688円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 2安定・成長型	6,578,817,520円	7,599,189,375円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 3成長型	2,554,204,766円	3,046,531,363円
D I A M DC バランス30インデックスファンド	1,609,638,301円	1,774,839,099円
D I A M DC バランス50インデックスファンド	1,690,614,896円	1,932,538,404円

DIAM DC バランス70インデックスファンド	237,929,018円	288,293,436円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	105,278,258円	95,832,674円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	2,257,679,789円	2,274,223,236円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	3,112,040円	3,002,910円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	302,015,090円	445,818,075円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	221,948,921円	377,197,015円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	50,978,906円	86,300,285円
投資のソムリエ	6,567,663,875円	2,972,951,972円
クルーズコントロール	2,610,923,070円	2,763,991,182円
投資のソムリエ<DC年金>	180,275,881円	163,833,623円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	961,890,169円	1,638,056,047円
DIAM DC バランス・F(成長型)	90,184,473円	186,456,021円
クルーズコントロール<DC年金>	833,577円	921,559円
DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)	8,493,906円	6,110,703円
DIAMコア資産設計ファンド(積極型)	21,306,101円	19,010,322円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	59,777,173円	185,640,863円
ダイナミック・ナビゲーション	1,495,303円	524,853円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	- 円	2,367,373,734円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	- 円	393,977円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	- 円	393,982円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	- 円	705,062円
みずほエマージングボンドオープン	10,801,911円	10,801,911円
DIAM高金利通貨ファンド	9,608,918円	9,608,918円
DIAMエマージング債券ファンド	9,450,010円	9,450,010円
DIAM国内債券パッシブファンド(適格機関投資家向け)	31,050,583,696円	24,403,666,103円
DIAMアクティブアロケーション私募ファンド(適格機関投資家限定)	936,406,293円	- 円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	534,261,862円	497,874,165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)	462,575,957円	369,244,962円

D I A Mグローバル・バランス ファンド5 0 V A (適格機関投資 家限定)	269,246,072円	263,458,483円
D I A M国際分散バランスファン ド3 0 V A (適格機関投資家限 定)	113,762,861円	91,759,912円
D I A M国際分散バランスファン ド5 0 V A (適格機関投資家限 定)	310,994,299円	286,802,833円
D I A M国内重視バランスファン ド3 0 V A (適格機関投資家限 定)	132,470,850円	106,170,065円
D I A M国内重視バランスファン ド5 0 V A (適格機関投資家限 定)	88,267,911円	71,450,932円
D I A M世界バランスファンド4 0 V A (適格機関投資家限定)	5,881,081,105円	119,547,737円
D I A M世界バランスファンド5 0 V A (適格機関投資家限定)	2,074,303,601円	198,613,276円
D I A Mバランスファンド2 5 V A (適格機関投資家限定)	7,043,095,308円	6,457,513,727円
D I A Mバランスファンド3 7 . 5 V A (適格機関投資家限定)	3,351,334,587円	3,429,075,449円
D I A Mバランスファンド5 0 V A (適格機関投資家限定)	5,912,828,633円	6,175,616,959円
D I A Mグローバル・アセット・ バランスV A (適格機関投資家限 定)	749,275,470円	681,893,480円
D I A Mグローバル・アセット・ バランスV A 2 (適格機関投資家 限定)	2,758,515,887円	767,783,699円
D I A M アクサ グローバル バランスファンド3 0 V A (適格 機関投資家限定)	4,223,738,820円	4,008,052,847円
D I A M世界アセットバランス ファンドV A (適格機関投資家向 け)	5,752,830,754円	5,260,342,645円
D I A Mグローバル 私募ファン ド (適格機関投資家向け)	812,385,968円	194,752,933円
D I A M世界バランスファンド5 5 V A (適格機関投資家限定)	6,129,868,013円	1,056,192,407円
D I A M世界バランスファンド3 5 V A (適格機関投資家限定)	6,389,387,464円	3,400,094,687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)	84,823,847,127円	88,333,633,708円
D I A M世界アセットバランス ファンド4 0 V A (適格機関投資 家限定)	1,168,090,154円	1,189,575,143円
D I A M世界アセットバランス ファンド2 5 V A (適格機関投資 家限定)	7,298,174,808円	7,557,095,183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)	26,880,783,364円	28,451,347,956円
D I A Mバランス3 0 V A (適格 機関投資家限定)	94,584,425円	56,158,235円
D I A Mバランス5 0 V A (適格 機関投資家限定)	12,678,405円	24,509,134円
D I A Mバランス7 0 V A (適格 機関投資家限定)	1,822,460円	8,808,986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)	30,149,878,097円	31,707,012,480円
D I A M世界バランス2 5 V A (適格機関投資家限定)	537,946,652円	505,447,523円
D I A M国内バランス3 0 V A (適格機関投資家限定)	135,725,739円	138,180,160円
D I A Mバランス2 0 V A (適格 機関投資家限定)	660,620,390円	599,008,976円
D I A Mバランス4 0 V A (適格 機関投資家限定)	426,081円	479,853円
D I A Mバランス6 0 V A (適格 機関投資家限定)	321,173円	376,479円
計	291,973,791,531円	279,387,012,706円
2 . 受益権の総数	291,973,791,531口	279,387,012,706口

（金融商品に関する注記）

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成27年12月1日 至 平成28年10月12日	自 平成28年10月13日 至 平成29年10月12日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成28年10月12日現在	平成29年10月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成28年10月12日現在	平成29年10月12日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
国債証券	7,967,012,900	177,023,300
地方債証券	30,330,126	98,364,748
特殊債証券	74,212,077	82,026,998
社債証券	78,323,800	89,621,420
合計	7,784,146,897	92,989,866

(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28年2月16日から平成28年10月12日まで及び平成29年2月15日から平成29年10月12日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成28年10月12日現在	平成29年10月12日現在
1口当たり純資産額	1.2984円	1.2809円
(1万口当たり純資産額)	(12,984円)	(12,809円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

平成29年10月12日現在

種 類	銘 柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
国債証券	3 7 2 回 利付国庫債券(2年)	1,000,000,000	1,003,120,000	
	3 7 3 回 利付国庫債券(2年)	1,500,000,000	1,505,010,000	
	3 7 5 回 利付国庫債券(2年)	1,000,000,000	1,003,740,000	
	3 7 6 回 利付国庫債券(2年)	2,000,000,000	2,007,900,000	
	3 7 7 回 利付国庫債券(2年)	1,500,000,000	1,506,240,000	
	3 7 8 回 利付国庫債券(2年)	1,000,000,000	1,004,370,000	
	1 1 6 回 利付国庫債券(5年)	3,500,000,000	3,514,455,000	
	1 1 7 回 利付国庫債券(5年)	4,000,000,000	4,019,960,000	
	1 1 8 回 利付国庫債券(5年)	3,700,000,000	3,721,756,000	
	1 2 0 回 利付国庫債券(5年)	1,500,000,000	1,510,155,000	
	1 2 1 回 利付国庫債券(5年)	2,000,000,000	2,009,660,000	
	1 2 2 回 利付国庫債券(5年)	4,000,000,000	4,020,960,000	
	1 2 3 回 利付国庫債券(5年)	3,000,000,000	3,017,130,000	
	1 2 4 回 利付国庫債券(5年)	3,500,000,000	3,521,595,000	
	1 2 5 回 利付国庫債券(5年)	3,000,000,000	3,019,830,000	
	1 2 6 回 利付国庫債券(5年)	3,000,000,000	3,020,070,000	
	1 2 7 回 利付国庫債券(5年)	3,000,000,000	3,021,120,000	
	1 2 8 回 利付国庫債券(5年)	3,000,000,000	3,022,680,000	
	1 2 9 回 利付国庫債券(5年)	3,500,000,000	3,527,580,000	
	1 3 0 回 利付国庫債券(5年)	3,000,000,000	3,024,510,000	
	1 3 1 回 利付国庫債券(5年)	3,500,000,000	3,529,540,000	
	1 3 2 回 利付国庫債券(5年)	2,000,000,000	2,018,320,000	
	2 回 利付国庫債券(40年)	600,000,000	815,028,000	
	3 回 利付国庫債券(40年)	600,000,000	816,264,000	
	4 回 利付国庫債券(40年)	800,000,000	1,091,056,000	
	5 回 利付国庫債券(40年)	800,000,000	1,046,400,000	
	6 回 利付国庫債券(40年)	700,000,000	895,237,000	
	7 回 利付国庫債券(40年)	800,000,000	974,224,000	
	8 回 利付国庫債券(40年)	900,000,000	1,010,412,000	
	9 回 利付国庫債券(40年)	1,300,000,000	1,040,169,000	
	1 0 回 利付国庫債券(40年)	400,000,000	380,616,000	
	2 9 7 回 利付国庫債券(10年)	1,000,000,000	1,018,290,000	
	2 9 9 回 利付国庫債券(10年)	900,000,000	918,630,000	
	3 0 1 回 利付国庫債券(10年)	2,300,000,000	2,363,779,000	
	3 0 3 回 利付国庫債券(10年)	1,300,000,000	1,338,974,000	
	3 0 5 回 利付国庫債券(10年)	2,500,000,000	2,578,650,000	
3 0 6 回 利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,555,815,000		
3 0 8 回 利付国庫債券(10年)	800,000,000	830,616,000		
3 0 9 回 利付国庫債券(10年)	1,000,000,000	1,032,890,000		
3 1 0 回 利付国庫債券(10年)	2,300,000,000	2,375,693,000		

312回	利付国庫債券(10年)	2,200,000,000	2,291,894,000	
313回	利付国庫債券(10年)	3,000,000,000	3,144,870,000	
315回	利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,571,955,000	
317回	利付国庫債券(10年)	1,000,000,000	1,047,330,000	
318回	利付国庫債券(10年)	1,000,000,000	1,043,380,000	
319回	利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,575,180,000	
320回	利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,568,895,000	
321回	利付国庫債券(10年)	2,500,000,000	2,621,050,000	
324回	利付国庫債券(10年)	2,000,000,000	2,082,600,000	
325回	利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,565,310,000	
326回	利付国庫債券(10年)	500,000,000	520,275,000	
328回	利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,555,140,000	
329回	利付国庫債券(10年)	1,000,000,000	1,049,580,000	
330回	利付国庫債券(10年)	1,700,000,000	1,787,516,000	
332回	利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,560,900,000	
333回	利付国庫債券(10年)	2,000,000,000	2,083,780,000	
334回	利付国庫債券(10年)	2,100,000,000	2,190,699,000	
335回	利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,556,265,000	
336回	利付国庫債券(10年)	1,000,000,000	1,038,490,000	
337回	利付国庫債券(10年)	1,300,000,000	1,331,330,000	
338回	利付国庫債券(10年)	2,000,000,000	2,063,220,000	
339回	利付国庫債券(10年)	1,800,000,000	1,857,402,000	
340回	利付国庫債券(10年)	2,500,000,000	2,580,300,000	
341回	利付国庫債券(10年)	3,500,000,000	3,585,855,000	
342回	利付国庫債券(10年)	3,000,000,000	3,024,000,000	
343回	利付国庫債券(10年)	3,000,000,000	3,022,080,000	
344回	利付国庫債券(10年)	3,500,000,000	3,523,380,000	
345回	利付国庫債券(10年)	4,000,000,000	4,023,760,000	
346回	利付国庫債券(10年)	3,000,000,000	3,016,890,000	
347回	利付国庫債券(10年)	3,500,000,000	3,516,835,000	
1回	利付国庫債券(30年)	100,000,000	131,209,000	
2回	利付国庫債券(30年)	100,000,000	127,123,000	
3回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	252,516,000	
4回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	269,428,000	
5回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	252,594,000	
6回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	259,078,000	
7回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	386,037,000	
8回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	365,538,000	
11回	利付国庫債券(30年)	400,000,000	482,400,000	
12回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	380,070,000	
13回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	375,789,000	
14回	利付国庫債券(30年)	500,000,000	658,685,000	
15回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	267,332,000	
16回	利付国庫債券(30年)	400,000,000	535,304,000	
17回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	264,720,000	
18回	利付国庫債券(30年)	820,000,000	1,072,912,600	
19回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	262,302,000	
20回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	404,040,000	
21回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	393,921,000	
22回	利付国庫債券(30年)	470,000,000	634,467,100	

23回	利付国庫債券(30年)	600,000,000	811,212,000	
24回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	406,209,000	
25回	利付国庫債券(30年)	400,000,000	527,384,000	
26回	利付国庫債券(30年)	700,000,000	936,306,000	
27回	利付国庫債券(30年)	700,000,000	951,993,000	
28回	利付国庫債券(30年)	900,000,000	1,226,754,000	
29回	利付国庫債券(30年)	900,000,000	1,212,489,000	
30回	利付国庫債券(30年)	900,000,000	1,198,422,000	
31回	利付国庫債券(30年)	900,000,000	1,182,492,000	
32回	利付国庫債券(30年)	1,200,000,000	1,604,796,000	
33回	利付国庫債券(30年)	1,300,000,000	1,658,475,000	
34回	利付国庫債券(30年)	1,200,000,000	1,584,564,000	
35回	利付国庫債券(30年)	1,300,000,000	1,663,415,000	
36回	利付国庫債券(30年)	1,300,000,000	1,666,405,000	
37回	利付国庫債券(30年)	1,400,000,000	1,765,946,000	
38回	利付国庫債券(30年)	900,000,000	1,114,875,000	
39回	利付国庫債券(30年)	800,000,000	1,010,040,000	
40回	利付国庫債券(30年)	800,000,000	992,032,000	
41回	利付国庫債券(30年)	800,000,000	973,760,000	
42回	利付国庫債券(30年)	800,000,000	975,136,000	
43回	利付国庫債券(30年)	800,000,000	975,440,000	
44回	利付国庫債券(30年)	800,000,000	975,728,000	
45回	利付国庫債券(30年)	1,000,000,000	1,170,640,000	
46回	利付国庫債券(30年)	900,000,000	1,053,531,000	
47回	利付国庫債券(30年)	1,000,000,000	1,194,810,000	
48回	利付国庫債券(30年)	1,100,000,000	1,259,280,000	
49回	利付国庫債券(30年)	900,000,000	1,030,086,000	
50回	利付国庫債券(30年)	1,000,000,000	993,100,000	
51回	利付国庫債券(30年)	1,100,000,000	950,642,000	
52回	利付国庫債券(30年)	1,100,000,000	1,004,773,000	
53回	利付国庫債券(30年)	1,100,000,000	1,030,876,000	
54回	利付国庫債券(30年)	1,100,000,000	1,085,766,000	
55回	利付国庫債券(30年)	800,000,000	788,648,000	
42回	利付国庫債券(20年)	800,000,000	831,408,000	
43回	利付国庫債券(20年)	860,000,000	910,731,400	
45回	利付国庫債券(20年)	900,000,000	955,377,000	
46回	利付国庫債券(20年)	500,000,000	531,285,000	
47回	利付国庫債券(20年)	950,000,000	1,014,685,500	
48回	利付国庫債券(20年)	500,000,000	541,565,000	
50回	利付国庫債券(20年)	780,000,000	833,687,400	
51回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	646,410,000	
52回	利付国庫債券(20年)	550,000,000	597,520,000	
54回	利付国庫債券(20年)	700,000,000	767,221,000	
55回	利付国庫債券(20年)	810,000,000	885,249,000	
57回	利付国庫債券(20年)	1,130,000,000	1,235,022,200	
58回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	658,620,000	
60回	利付国庫債券(20年)	990,000,000	1,066,180,500	
61回	利付国庫債券(20年)	800,000,000	846,608,000	
62回	利付国庫債券(20年)	800,000,000	839,664,000	
64回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	669,966,000	

65回	利付国庫債券(20年)	1,100,000,000	1,233,309,000	
67回	利付国庫債券(20年)	1,900,000,000	2,138,792,000	
70回	利付国庫債券(20年)	1,250,000,000	1,454,175,000	
72回	利付国庫債券(20年)	1,250,000,000	1,435,350,000	
73回	利付国庫債券(20年)	790,000,000	905,355,800	
75回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,621,284,000	
78回	利付国庫債券(20年)	1,450,000,000	1,663,396,500	
81回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,623,286,000	
83回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,641,094,000	
85回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,646,988,000	
88回	利付国庫債券(20年)	1,200,000,000	1,437,600,000	
90回	利付国庫債券(20年)	1,200,000,000	1,432,512,000	
92回	利付国庫債券(20年)	1,300,000,000	1,546,298,000	
93回	利付国庫債券(20年)	700,000,000	828,814,000	
94回	利付国庫債券(20年)	800,000,000	954,728,000	
95回	利付国庫債券(20年)	1,200,000,000	1,460,712,000	
97回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,696,534,000	
99回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,687,210,000	
100回	利付国庫債券(20年)	1,300,000,000	1,584,921,000	
102回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,741,992,000	
105回	利付国庫債券(20年)	1,300,000,000	1,581,073,000	
107回	利付国庫債券(20年)	1,500,000,000	1,829,610,000	
109回	利付国庫債券(20年)	1,600,000,000	1,920,960,000	
111回	利付国庫債券(20年)	1,600,000,000	1,980,944,000	
113回	利付国庫債券(20年)	1,500,000,000	1,844,940,000	
114回	利付国庫債券(20年)	1,500,000,000	1,848,705,000	
116回	利付国庫債券(20年)	1,600,000,000	1,996,416,000	
118回	利付国庫債券(20年)	1,000,000,000	1,226,320,000	
119回	利付国庫債券(20年)	900,000,000	1,080,702,000	
121回	利付国庫債券(20年)	1,500,000,000	1,823,670,000	
123回	利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	2,116,075,000	
125回	利付国庫債券(20年)	1,600,000,000	2,017,024,000	
128回	利付国庫債券(20年)	700,000,000	855,568,000	
129回	利付国庫債券(20年)	900,000,000	1,088,073,000	
130回	利付国庫債券(20年)	1,500,000,000	1,815,375,000	
132回	利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	2,037,518,000	
134回	利付国庫債券(20年)	900,000,000	1,092,690,000	
135回	利付国庫債券(20年)	800,000,000	960,160,000	
137回	利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	2,041,734,000	
140回	利付国庫債券(20年)	1,600,000,000	1,924,192,000	
141回	利付国庫債券(20年)	1,900,000,000	2,286,137,000	
143回	利付国庫債券(20年)	1,900,000,000	2,259,138,000	
145回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,687,140,000	
146回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,687,700,000	
147回	利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	2,023,799,000	
148回	利付国庫債券(20年)	1,300,000,000	1,527,448,000	
149回	利付国庫債券(20年)	1,900,000,000	2,231,968,000	
150回	利付国庫債券(20年)	1,500,000,000	1,739,205,000	
151回	利付国庫債券(20年)	1,800,000,000	2,026,566,000	
152回	利付国庫債券(20年)	1,300,000,000	1,462,253,000	

	153回 利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	1,939,768,000	
	154回 利付国庫債券(20年)	1,500,000,000	1,685,235,000	
	155回 利付国庫債券(20年)	1,600,000,000	1,740,544,000	
	156回 利付国庫債券(20年)	1,500,000,000	1,470,960,000	
	157回 利付国庫債券(20年)	1,300,000,000	1,226,043,000	
	158回 利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	1,689,766,000	
	159回 利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	1,716,218,000	
	160回 利付国庫債券(20年)	1,300,000,000	1,334,216,000	
	161回 利付国庫債券(20年)	1,600,000,000	1,608,480,000	
国債証券 合計		271,300,000,000	297,773,980,000	
地方債証券	680回 東京都公募公債	200,000,000	206,638,000	
	685回 東京都公募公債	500,000,000	514,825,000	
	688回 東京都公募公債	200,000,000	205,366,000	
	697回 東京都公募公債	500,000,000	519,955,000	
	701回 東京都公募公債	700,000,000	726,656,000	
	708回 東京都公募公債	500,000,000	520,130,000	
	720回 東京都公募公債	300,000,000	314,127,000	
	726回 東京都公募公債	400,000,000	416,500,000	
	5回 東京都公募公債 20年	100,000,000	114,957,000	
	9回 東京都公募公債 20年	200,000,000	239,572,000	
	10回 東京都公募公債 20年	300,000,000	357,813,000	
	21年度6回 北海道公募公債	200,000,000	205,928,000	
	22年度12回 北海道公募公債	200,000,000	208,262,000	
	166回 神奈川県公募公債	300,000,000	307,794,000	
	194回 神奈川県公募公債	300,000,000	311,505,000	
	208回 神奈川県公募公債	300,000,000	309,192,000	
	336回 大阪府公募公債	200,000,000	207,064,000	
	345回 大阪府公募公債	300,000,000	311,808,000	
	356回 大阪府公募公債	200,000,000	208,526,000	
	364回 大阪府公募公債	300,000,000	310,833,000	
	374回 大阪府公募公債	300,000,000	314,928,000	
	26年度11回 京都府公募公債	350,000,000	359,387,000	
	26年度17回 兵庫県公募公債	200,000,000	204,970,000	
	1回 兵庫県公募公債(12年)	300,000,000	319,977,000	
	21年度5回 静岡県公募公債	197,000,000	202,281,570	
	22年度8回 静岡県公募公債	200,000,000	205,928,000	
	23年度9回 静岡県公募公債	200,000,000	208,310,000	
	1回 静岡県公募公債 20年	100,000,000	116,067,000	
	22年度6回 愛知県公募公債	200,000,000	206,446,000	
	23年度20回 愛知県公募公債	500,000,000	523,065,000	
	25年度4回 愛知県公募公債	300,000,000	313,398,000	
	22年度1回 広島県公募公債	200,000,000	207,048,000	
	21年度4回 埼玉県公募公債	200,000,000	205,166,000	
	23年度2回 埼玉県公募公債	200,000,000	208,344,000	
	26年度5回 埼玉県公募公債	400,000,000	414,072,000	
	21年度3回 福岡県公募公債	200,000,000	205,732,000	
	25年度11回 福岡県公募公債	200,000,000	207,720,000	
	21年度6回 千葉県公募公債	200,000,000	205,428,000	
	24年度7回 千葉県公募公債	300,000,000	310,722,000	
	25年度5回 千葉県公募公債	200,000,000	209,060,000	

80回	共同発行市場公募地方債	200,000,000	206,444,000		
94回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	519,955,000		
99回	共同発行市場公募地方債	700,000,000	729,379,000		
106回	共同発行市場公募地方債	300,000,000	311,940,000		
109回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	522,690,000		
111回	共同発行市場公募地方債	700,000,000	727,566,000		
119回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	519,940,000		
121回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	514,205,000		
126回	共同発行市場公募地方債	793,900,000	828,712,515		
127回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	518,260,000		
128回	共同発行市場公募地方債	300,000,000	310,605,000		
137回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	516,055,000		
139回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	515,505,000		
142回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	508,675,000		
144回	共同発行市場公募地方債	400,000,000	410,636,000		
146回	共同発行市場公募地方債	400,000,000	413,216,000		
148回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	516,110,000		
166回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	499,540,000		
488回	名古屋市公募公債 10年	450,000,000	465,601,500		
4回	京都市公募公債 20年	100,000,000	120,646,000		
22年度3回	横浜市公募公債	200,000,000	206,702,000		
22年度5回	横浜市公募公債	200,000,000	207,842,000		
23年度4回	横浜市公募公債	450,000,000	468,535,500		
25年度2回	横浜市公募公債	400,000,000	418,988,000		
25年度4回	札幌市公募公債	200,000,000	208,388,000		
2回	川崎市公募公債 15年	100,000,000	104,320,000		
21年度2回	北九州市公募公債	200,000,000	205,892,000		
23年度1回	千葉市公募公債	200,000,000	209,432,000		
地方債証券 合計		22,440,900,000	23,371,281,085		
特殊債券	48回	高速道路機構債	700,000,000	717,150,000	
	96回	高速道路機構債	700,000,000	725,550,000	
	116回	高速道路機構債	100,000,000	103,642,000	
	9回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	106,650,000	
	18回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	325,917,000	
	78回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	700,000,000	715,554,000	
	82回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	102,625,000	
	89回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	307,881,000	
	149回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	400,000,000	416,876,000	
	180回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	1,000,000,000	1,038,510,000	
	189回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	514,705,000	
	193回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	524,900,000	

195回政保日本高速道路保有・債務返済機構	330,000,000	347,133,600	
241回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	514,300,000	
309回政保日本高速道路保有・債務返済機構	800,000,000	800,000,000	
8回 政保地方公営企業金融機構債券	651,000,000	667,131,780	
3回 政保地方公共団体金融機構債券	101,000,000	103,859,310	
5回 地方公共団体金融機構債券	500,000,000	514,150,000	
8回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	309,102,000	
10回 政保地方公共団体金融機構債券	500,000,000	516,085,000	
15回 政保地方公共団体金融機構債券	200,000,000	205,850,000	
20回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	312,093,000	
24回 地方公共団体金融機構債券	300,000,000	312,738,000	
36回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	312,537,000	
44回 政保地方公共団体金融機構債券	400,000,000	417,592,000	
50回 政保地方公共団体金融機構債券	500,000,000	525,750,000	
56回 政保地方公共団体金融機構債券	542,000,000	566,124,420	
64回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	310,326,000	
37回 住宅金融支援機構債券	300,000,000	308,121,000	
6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	50,511,000	53,693,193	
8回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	35,422,000	37,590,180	
9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	53,088,000	56,374,147	
2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	56,106,000	59,996,390	
13回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	22,612,000	23,491,606	
14回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	114,405,000	118,128,882	
4回貸付債権担保住宅金融公庫債券	33,216,000	33,674,048	
43回貸付債権担保住宅金融公庫債券	19,075,000	20,351,117	
44回貸付債権担保住宅金融公庫債券	71,404,000	75,965,287	
51回貸付債権担保住宅金融公庫債券	53,514,000	56,759,624	
1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,615,000	98,799,398	
29回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	185,165,000	198,680,193	
36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	332,256,000	352,902,387	
い第769号 利付商工債	200,000,000	200,510,000	
い第779号 利付商工債	200,000,000	200,480,000	
764号 利附農林債	500,000,000	501,960,000	
293回 利附信金中金債	400,000,000	401,256,000	
302回 利附信金中金債	300,000,000	300,912,000	
325回 利附信金中金債	400,000,000	398,992,000	
55回 鉄道建設運輸施設債	500,000,000	520,335,000	
特殊債券 合計	15,844,389,000	16,353,704,562	
社債券			
337回 東京交通債	200,000,000	214,722,000	
27回 ラボバンク・ネーデルランド円貨社債	200,000,000	201,156,000	
22回 中日本高速道路債	300,000,000	308,892,000	
7回 キリンホールディングス社債	100,000,000	103,177,000	
9回 日本たばこ産業社債	200,000,000	200,698,000	

4 1 回	住友化学社債	100,000,000	103,041,000	
1 9 回	三菱ケミカルホールディングス社債	100,000,000	101,332,000	
6 回	J Xホールディングス社債	100,000,000	104,740,000	
8 回	ブリヂストン社債	200,000,000	200,628,000	
6 4 回	新日本製鐵社債	100,000,000	103,401,000	
2 3 回	ジェイ エフ イー ホールディングス社債	100,000,000	99,551,000	
3 0 回	豊田自動織機社債	200,000,000	199,688,000	
1 2 回	パナソニック社債	200,000,000	201,356,000	
1 3 回	パナソニック社債	100,000,000	101,536,000	
5 6 回	日産自動車社債	100,000,000	100,985,000	
1 4 回	トヨタ自動車社債	200,000,000	208,878,000	
1 6 回	トヨタ自動車社債	200,000,000	206,044,000	
9 4 回	丸紅社債	100,000,000	104,265,000	
4 5 回	住友商事社債	100,000,000	103,768,000	
4 7 回	住友商事社債	100,000,000	103,284,000	
4 8 回	クレディセゾン社債	100,000,000	103,275,000	
7 回	みずほコーポレート銀行劣後社債	100,000,000	103,772,000	
5 7 回	東京三菱銀行社債	200,000,000	221,234,000	
7 回	東京三菱銀行劣後社債	200,000,000	208,348,000	
2 5 回	三菱東京U F J銀行劣後社債	200,000,000	206,680,000	
2 8 回	三菱東京U F J銀行劣後社債	200,000,000	208,710,000	
3 2 回	三菱東京U F J銀行劣後社債	300,000,000	314,325,000	
4 回	りそな銀行劣後社債	100,000,000	104,274,000	
6 回	りそな銀行劣後社債	100,000,000	104,428,000	
7 回	三菱U F J信託銀行劣後債	200,000,000	207,274,000	
9 回	三菱U F J信託銀行劣後債	100,000,000	104,866,000	
1 2 回	住友信託銀行劣後債	100,000,000	103,523,000	
1 0 回	三井住友信託銀行社債	200,000,000	204,666,000	
1 0 回	セブン銀行社債	100,000,000	103,583,000	
2 0 回	三井住友銀行劣後社債	200,000,000	207,156,000	
2 2 回	三井住友銀行劣後社債	200,000,000	207,168,000	
2 3 回	三井住友銀行劣後社債	400,000,000	417,668,000	
1 4 回	みずほ銀行劣後特約付社債	200,000,000	207,598,000	
1 5 回	トヨタファイナンス社債	200,000,000	209,508,000	
4 7 回	日立キャピタル社債	200,000,000	206,098,000	
1 6 4 回	オリックス社債	100,000,000	101,810,000	
1 4 回	大和証券グループ本社社債	100,000,000	102,804,000	
2 6 回	野村ホールディングス社債	100,000,000	104,113,000	
4 2 回	野村ホールディングス社債	200,000,000	205,732,000	
4 6 回	野村ホールディングス社債	200,000,000	200,980,000	
3 8 回	三井不動産社債	200,000,000	206,642,000	
7 2 回	三菱地所社債	100,000,000	113,746,000	
9 6 回	三菱地所社債	200,000,000	205,266,000	
8 7 回	住友不動産社債	100,000,000	101,473,000	
1 5 回	東日本旅客鉄道社債	300,000,000	322,296,000	
1 9 回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	109,815,000	
2 1 回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	109,384,000	
3 9 回	東日本旅客鉄道社債	300,000,000	342,408,000	

4 2 回	東日本旅客鉄道社債	200,000,000	230,042,000	
9 回	西日本旅客鉄道社債	200,000,000	219,262,000	
1 0 回	西日本旅客鉄道社債	300,000,000	333,576,000	
5 回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	105,891,000	
6 回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	109,907,000	
1 1 回	東海旅客鉄道社債	300,000,000	315,852,000	
1 3 回	東海旅客鉄道社債	200,000,000	222,862,000	
1 4 回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	113,027,000	
1 5 回	東海旅客鉄道社債	200,000,000	206,228,000	
4 回	東京地下鉄社債	120,000,000	142,088,400	
6 0 回	日本電信電話社債	300,000,000	310,977,000	
4 9 6 回	中部電力社債	500,000,000	515,910,000	
5 1 8 回	中部電力社債	200,000,000	199,686,000	
4 9 2 回	関西電力社債	200,000,000	201,602,000	
4 9 3 回	関西電力社債	200,000,000	201,720,000	
3 7 7 回	中国電力社債	400,000,000	420,392,000	
3 7 9 回	中国電力社債	300,000,000	305,001,000	
2 6 0 回	北陸電力社債	100,000,000	105,888,000	
3 0 1 回	北陸電力社債	100,000,000	105,076,000	
3 0 7 回	北陸電力社債	100,000,000	105,774,000	
4 7 1 回	東北電力社債	400,000,000	421,632,000	
4 7 3 回	東北電力社債	300,000,000	304,758,000	
2 5 3 回	四国電力社債	200,000,000	208,774,000	
4 2 3 回	九州電力社債	200,000,000	203,468,000	
4 2 4 回	九州電力社債	200,000,000	211,220,000	
4 2 6 回	九州電力社債	400,000,000	418,956,000	
3 2 0 回	北海道電力社債	200,000,000	203,122,000	
3 2 1 回	北海道電力社債	161,000,000	167,061,650	
3 4 0 回	北海道電力社債	300,000,000	300,822,000	
1 3 回	電源開発社債	200,000,000	225,854,000	
3 8 回	電源開発社債	300,000,000	312,864,000	
2 3 回	東京瓦斯社債	300,000,000	315,003,000	
1 8 回	大阪ガス社債	100,000,000	106,961,000	
2 7 回	NTTデータ社債	100,000,000	103,819,000	
社債券 合計		16,281,000,000	17,026,841,050	
合計		325,866,289,000	354,525,806,697	

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。

「J-REITインデックスファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位:円)

科 目	注記 番号	平成28年10月12日現在	平成29年10月12日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		245,750,070	503,035,033
投資証券		26,253,479,756	32,276,486,900
未収入金		9,520,050	306,611,341
未収配当金		199,681,769	291,821,153
前払金		-	8,249,344
差入委託証拠金		-	6,189,056
流動資産合計		26,708,431,645	33,392,392,827
資産合計		26,708,431,645	33,392,392,827
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		-	9,785,344
未払金		167,325,764	238,708,322
流動負債合計		167,325,764	248,493,666
負債合計		167,325,764	248,493,666
純資産の部			
元本等			
元本	1	15,180,336,252	19,934,508,415
剰余金			
剰余金又は欠損金()		11,360,769,629	13,209,390,746
元本等合計		26,541,105,881	33,143,899,161
純資産合計		26,541,105,881	33,143,899,161
負債純資産合計		26,708,431,645	33,392,392,827

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	平成28年10月12日現在	平成29年10月12日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	14,550,922,737円	15,180,336,252円
同期中追加設定元本額	12,085,387,213円	12,472,142,750円
同期中一部解約元本額	11,455,973,698円	7,717,970,587円
元本の内訳		
ファンド名		
MITO ラップ型ファンド(安定型)	610,789円	390,736円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	1,551,539円	1,086,594円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	3,359,219円	2,923,343円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	1,458,959円	949,386円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	1,365,431円	1,108,712円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	1,638,645円	1,957,452円
たわらノーロード 国内リート	498,813,334円	891,585,001円
たわらノーロード 国内リート<ラップ向け>	32,348,443円	201,188,801円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	- 円	8,337,173円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	15,802,327円	14,836,508円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	344,976,938円	349,167,083円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	5,262,040円	3,270,978円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	11,428,642円	17,580,102円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	31,357,057円	55,469,118円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	67,624,587円	119,349,456円
投資のソムリエ	686,059,285円	2,253,396,923円
投資のソムリエ<DC年金>	18,941,627円	125,316,503円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	36,986,155円	65,007,561円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	3,505,706円	31,750,474円
ダイナミック・ナビゲーション	469,965円	199,701円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	- 円	402,965,199円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	- 円	356,288円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	- 円	356,288円

リスク抑制世界8資産バランス ファンド(DC)	- 円	118,245円
Jリートインデックスファンド (DC)	- 円	5,931,659円
DIAM J-REITインデッ クス私募ファンド201210 (適格機関投資家限定)	978,666,133円	- 円
DIAM J-REITインデッ クス私募ファンド201212 (適格機関投資家限定)	1,054,623,756円	94,475,202円
DIAM J-REITインデッ クス私募ファンド201401 (適格機関投資家限定)	1,900,673,417円	1,832,580,723円
DIAM J-REITインデッ クスファンド(適格機関投資家向 け)	7,772,152,934円	10,545,559,048円
DIAMグローバル 私募ファン ド(適格機関投資家向け)	57,813,260円	14,402,370円
DIAMグローバル・リスクファ クター・パリティ戦略ファンド (適格機関投資家限定)	661,075,280円	1,369,589,007円
DIAMグローバル・リスクファ クター・パリティ戦略ファンドI I(適格機関投資家限定)	954,293,116円	1,523,302,781円
DIAM リスクコントロールJ -REITファンド(適格機関投 資家限定)	37,477,668円	- 円
計	15,180,336,252円	19,934,508,415円
2. 受益権の総数	15,180,336,252口	19,934,508,415口

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成27年12月1日 至 平成28年10月12日	自 平成28年10月13日 至 平成29年10月12日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、不動産投信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、不動産投資信託証券の価格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。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成28年10月12日現在	平成29年10月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 該当事項はありませぬ。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
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。	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	平成28年10月12日現在	平成29年10月12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）
投資証券	1,329,405,736	1,953,363,045
合計	1,329,405,736	1,953,363,045

（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28年6月7日から平成28年10月12日まで及び平成29年6月7日から平成29年10月12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）

不動産投信関連

種類	平成28年10月12日 現在				平成29年10月12日 現在			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引								
不動産投信指数 先物取引								
買 建	-	-	-	-	424,550,400	-	414,848,000	9,702,400
合計	-	-	-	-	424,550,400	-	414,848,000	9,702,400

（注）1．時価の算定方法

不動産投信指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	平成28年10月12日現在	平成29年10月12日現在
1口当たり純資産額	1.7484円	1.6626円
（1万口当たり純資産額）	（17,484円）	（16,626円）

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

平成29年10月12日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
投資証券	GLP投資法人	7,699	893,084,000	
	MCUBS MidCity投資法人	890	318,620,000	
	Oneリート投資法人	481	107,551,600	
	いちごオフィスリート投資法人	3,405	260,482,500	
	いちごホテルリート投資法人	695	80,620,000	
	さくら総合リート投資法人	1,057	95,447,100	
	アクティブア・プロパティーズ投資法人	1,901	859,252,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人	4,071	1,091,842,200	
	イオンリート投資法人	4,176	484,416,000	
	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	2,437	261,246,400	
	インヴィンシブル投資法人	9,900	447,975,000	
	オリックス不動産投資法人	8,484	1,345,562,400	
	グローバル・ワン不動産投資法人	706	268,986,000	
	ケネディクス・オフィス投資法人	1,285	801,840,000	
	ケネディクス・レジデンシャル投資法人	997	291,223,700	
	ケネディクス商業リート投資法人	1,599	366,810,600	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	1,604	373,732,000	
	サムティ・レジデンシャル投資法人	764	67,002,800	
	ジャパン・シニアリビング投資法人	242	33,807,400	
	ジャパン・ホテル・リート投資法人	12,692	927,785,200	
	ジャパンエクセレント投資法人	3,938	540,293,600	
	ジャパンリアルエステイト投資法人	4,157	2,186,582,000	
	スターアジア不動産投資法人	913	96,686,700	
	スターツプロシード投資法人	693	110,880,000	
	トーセイ・リート投資法人	553	61,438,300	
	ヒューリックリート投資法人	2,820	442,740,000	
	フロンティア不動産投資法人	1,496	669,460,000	
	プレミア投資法人	3,972	410,704,800	
	ヘルスケア&メディカル投資法人	542	52,628,200	
	マリモ地方創生リート投資法人	245	25,210,500	
	ユナイテッド・アーバン投資法人	9,699	1,564,448,700	
	ラサールロジポート投資法人	3,317	365,865,100	
	阪急リート投資法人	1,802	236,242,200	
	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	711	236,763,000	
	産業ファンド投資法人	1,195	557,467,500	
	森トラスト・ホテルリート投資法人	952	134,803,200	
森トラスト総合リート投資法人	3,143	511,366,100		
森ヒルズリート投資法人	4,724	625,457,600		
星野リゾート・リート投資法人	547	303,585,000		

積水ハウス・リート投資法人	2,758	357,161,000	
積水ハウス・レジデンシャル投資法人	3,334	365,739,800	
大江戸温泉リート投資法人	559	50,198,200	
大和ハウスリート投資法人	4,523	1,191,810,500	
大和証券オフィス投資法人	948	534,672,000	
投資法人みらい	560	98,448,000	
東急リアル・エステート投資法人	2,948	393,852,800	
日本アコモデーションファンド投資法人	1,461	633,343,500	
日本ビルファンド投資法人	4,258	2,320,610,000	
日本プライムリアルティ投資法人	2,776	1,032,672,000	
日本プロロジスリート投資法人	5,531	1,321,909,000	
日本ヘルスケア投資法人	213	35,251,500	
日本リート投資法人	1,181	377,920,000	
日本リテールファンド投資法人	8,460	1,702,152,000	
日本ロジスティクスファンド投資法人	2,929	597,516,000	
日本賃貸住宅投資法人	4,946	393,207,000	
福岡リート投資法人	2,134	343,787,400	
平和不動産リート投資法人	2,738	251,348,400	
野村不動産マスターファンド投資法人	12,616	1,764,978,400	
投資証券 合計	175,377	32,276,486,900	
合計	175,377	32,276,486,900	

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。

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」の状況

貸借対照表

（単位：円）

科 目	注記 番号	平成28年10月12日現在	平成29年10月12日現在
資産の部			
流動資産			
預金		4,972,546,971	5,651,561,043
コール・ローン		98,225,753	268,115,912
株式		240,970,135,633	282,008,310,018
投資信託受益証券		819,369,297	798,785,653
投資証券		5,741,105,528	6,543,093,181
派生商品評価勘定		36,397,654	201,465,333
未収入金		2,921,921	8,520,388
未収配当金		280,921,804	293,191,790
差入委託証拠金		1,171,790,039	1,597,210,020
流動資産合計		254,093,414,600	297,370,253,338
資産合計		254,093,414,600	297,370,253,338
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		34,581,305	543,550
未払解約金		377,050,000	472,640,000
流動負債合計		411,631,305	473,183,550
負債合計		411,631,305	473,183,550
純資産の部			
元本等			
元本	1	100,403,068,668	88,453,274,390
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		153,278,714,627	208,443,795,398
元本等合計		253,681,783,295	296,897,069,788
純資産合計		253,681,783,295	296,897,069,788
負債純資産合計		254,093,414,600	297,370,253,338

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	平成28年10月12日現在	平成29年10月12日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	98,425,773,739円	100,403,068,668円
同期中追加設定元本額	20,806,177,728円	17,826,557,176円
同期中一部解約元本額	18,828,882,799円	29,776,351,454円
元本の内訳		
ファンド名		
D I A M外国株式パッシブ・ファンド	1,951,069,361円	1,500,759,815円
M I T O ラップ型ファンド(安定型)	6,302,436円	2,952,003円
M I T O ラップ型ファンド(中立型)	15,885,054円	7,416,677円
M I T O ラップ型ファンド(積極型)	34,557,068円	19,987,131円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	15,053,332円	7,484,878円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	13,976,337円	7,682,961円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	16,854,378円	13,499,602円
たわらノーロード 先進国株式	1,925,384,634円	4,471,783,454円
たわらノーロード 先進国株式<ラップ向け>	426,031円	425,029円
たわらノーロード 先進国株式<為替ヘッジあり>	12,210,923円	334,440,710円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	- 円	4,162,856円
D I A M外国株式インデックスファンド<DC年金>	35,775,985,290円	36,248,641,542円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 1 安定型	184,975,989円	163,816,147円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型	953,771,814円	857,026,223円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 3 成長型	1,154,273,058円	1,040,064,596円
D I A M DC バランス30インデックスファンド	154,219,442円	135,530,066円
D I A M DC バランス50インデックスファンド	424,912,023円	389,058,681円
D I A M DC バランス70インデックスファンド	351,218,100円	330,441,705円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	44,877,625円	35,350,510円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	962,087,439円	831,794,009円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	228,191,393円	200,977,464円
D I A M DC 8資産バランスファンド(新興国10)	27,448,009円	30,287,665円

D I A M D C 8 資産バランス ファンド(新興国20)	55,450,918円	70,337,364円
D I A M D C 8 資産バランス ファンド(新興国30)	106,709,231円	132,555,525円
投資のソムリエ	543,340,779円	3,198,792,059円
クルーズコントロール	531,098,739円	529,164,076円
投資のソムリエ<DC年金>	14,886,372円	175,260,706円
D I A M 8 資産バランスファン ドN<DC年金>	87,691,558円	112,222,016円
D I A M D C バランス・F (成長型)	40,468,070円	61,949,596円
クルーズコントロール<DC年金 >	169,726円	176,323円
D I A Mコア資産設計ファンド (堅実型)	4,309,803円	2,336,372円
D I A Mコア資産設計ファンド (積極型)	10,831,563円	7,273,627円
投資のソムリエ<DC年金>リス ク抑制型	4,359,505円	31,606,974円
ダイナミック・ナビゲーション	439,073円	1,646,742円
リスク抑制世界8資産バランス ファンド	- 円	402,698,402円
ワールドアセットバランス(基本 コース)	- 円	376,390,776円
ワールドアセットバランス(リス ク抑制コース)	- 円	1,182,935,075円
投資のソムリエ(ターゲット・イ ヤー2045)	- 円	455,321円
投資のソムリエ(ターゲット・イ ヤー2055)	- 円	455,344円
リスク抑制世界8資産バランス ファンド(DC)	- 円	120,612円
D I A M外国株式インデックス ファンドVA(適格機関投資家専 用)	199,567,957円	110,699,871円
D I A M外国株式パッシブ私募 ファンド(適格機関投資家向け)	3,233,690,106円	2,964,558,782円
D I A Mアクティブアロケーショ ン私募ファンド(適格機関投資家 限定)	147,200,968円	- 円
D I A M先進国株式パッシブファ ンド(適格機関投資家限定)	392,381円	161,291,968円
外国株式パッシブ・ファンド2 (適格機関投資家限定)	- 円	171,807,118円
D I A Mワールドバランス25V A(適格機関投資家限定)	36,367,478円	25,138,484円
D I A Mグローバル・バランス ファンド25VA(適格機関投資 家限定)	201,127,434円	119,155,473円
D I A Mグローバル・バランス ファンド50VA(適格機関投資 家限定)	351,435,122円	255,180,569円

D I A M国際分散バランスファン ド30VA(適格機関投資家限 定)	25,425,328円	15,220,426円
D I A M国際分散バランスファン ド50VA(適格機関投資家限 定)	162,351,419円	111,060,683円
D I A M国内重視バランスファン ド30VA(適格機関投資家限 定)	13,816,919円	8,214,224円
D I A M国内重視バランスファン ド50VA(適格機関投資家限 定)	23,041,123円	13,833,399円
D I A M世界バランスファンド4 0VA(適格機関投資家限定)	2,048,221,117円	30,862,374円
D I A M世界バランスファンド5 0VA(適格機関投資家限定)	1,083,778,037円	76,913,785円
D I A Mバランスファンド25V A(適格機関投資家限定)	919,211,282円	624,620,278円
D I A Mバランスファンド37. 5VA(適格機関投資家限定)	1,021,084,457円	774,320,364円
D I A Mバランスファンド50V A(適格機関投資家限定)	3,089,092,005円	2,391,175,141円
D I A Mグローバル・アセット・ バランスVA(適格機関投資家限 定)	1,300,978,067円	882,809,453円
D I A Mグローバル・アセット・ バランスVA2(適格機関投資家 限定)	1,728,448,000円	358,382,128円
D I A M アクサ グローバル バランスファンド30VA(適格 機関投資家限定)	1,470,108,607円	1,034,110,504円
D I A M世界アセットバランス ファンドVA(適格機関投資家向 け)	999,380,756円	678,263,358円
D I A Mグローバル 私募ファン ド(適格機関投資家向け)	13,494,600円	2,754,975円
D I A M世界バランスファンド5 5VA(適格機関投資家限定)	4,787,679,095円	614,773,286円
D I A M世界バランスファンド3 5VA(適格機関投資家限定)	1,708,239,056円	650,989,428円
D I A M世界アセットバランス ファンド2VA(適格機関投資家 限定)	11,069,827,660円	8,547,165,090円
D I A M世界アセットバランス ファンド40VA(適格機関投資 家限定)	610,228,493円	460,597,770円
D I A M世界アセットバランス ファンド25VA(適格機関投資 家限定)	1,905,576,749円	1,462,455,020円
D I A M世界アセットバランス ファンド3VA(適格機関投資家 限定)	7,010,880,357円	5,509,914,891円

D I A Mバランス30VA(適格 機関投資家限定)	30,570,864円	13,592,785円
D I A Mバランス50VA(適格 機関投資家限定)	10,518,093円	15,185,783円
D I A Mバランス70VA(適格 機関投資家限定)	3,463,728円	12,516,619円
D I A M世界アセットバランス ファンド4VA(適格機関投資家 限定)	9,440,136,846円	7,365,755,184円
D I A Mバランス20VA(適格 機関投資家限定)	103,812,926円	69,571,913円
D I A Mバランス40VA(適格 機関投資家限定)	188,138円	159,561円
D I A Mバランス60VA(適格 機関投資家限定)	298,427円	263,069円
計	100,403,068,668円	88,453,274,390円
2. 受益権の総数	100,403,068,668口	88,453,274,390口

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成27年12月1日 至 平成28年10月12日	自 平成28年10月13日 至 平成29年10月12日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。</p> <p>また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。</p>	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成28年10月12日現在	平成29年10月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成28年10月12日現在	平成29年10月12日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
株式	30,288,208,875	21,429,512,211
投資信託受益証券	49,142,697	6,618,087
投資証券	510,076,515	262,194,403
合計	30,847,428,087	21,685,088,527

(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28年2月16日から平成28年10月12日まで及び平成29年2月16日から平成29年10月12日まで）に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	平成28年10月12日 現在				平成29年10月12日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	426,548,102	-	424,879,200	1,668,902	260,218,350	-	260,759,900	541,550
アメリカ・ドル	261,702,840	-	261,147,600	555,240	162,850,310	-	163,035,800	185,490
イギリス・ポンド	43,453,250	-	43,210,600	242,650	-	-	-	-
オーストラリア・ドル	27,557,260	-	27,422,500	134,760	21,917,700	-	21,934,900	17,200
カナダ・ドル	16,514,808	-	16,430,400	84,408	11,682,000	-	11,742,800	60,800
ユーロ	77,319,944	-	76,668,100	651,844	63,768,340	-	64,046,400	278,060
合計	426,548,102	-	424,879,200	1,668,902	260,218,350	-	260,759,900	541,550

(注) 時価の算定方法

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

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

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

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

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

株式関連

種類	平成28年10月12日 現在				平成29年10月12日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								
先物取引								
買 建	5,952,255,095	-	5,952,402,542	147,447	7,207,430,951	-	7,408,894,284	201,463,333
合計	5,952,255,095	-	5,952,402,542	147,447	7,207,430,951	-	7,408,894,284	201,463,333

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成28年10月12日現在	平成29年10月12日現在
1口当たり純資産額	2.5266円	3.3565円
(1万口当たり純資産額)	(25,266円)	(33,565円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

平成29年10月12日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	AMAZON.COM INC	29,421	995.000	29,273,895.000	
	ABBOTT LABORATORIES	124,816	54.440	6,794,983.040	
	AES CORP	45,579	11.270	513,675.330	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	64,220	147.620	9,480,156.400	
	ADVANCED MICRO DEVICES	59,529	13.880	826,262.520	
	ADOBE SYSTEMS INC	35,138	153.650	5,398,953.700	
	CHUBB LTD	33,654	147.370	4,959,589.980	
	AGCO CORP	5,610	74.720	419,179.200	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	15,019	152.930	2,296,855.670	
	ALLEGHANY CORP	1,054	545.480	574,935.920	
	RALPH LAUREN CORP	4,703	85.200	400,695.600	
	ALLSTATE CORP	25,754	93.090	2,397,439.860	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	52,300	142.720	7,464,256.000	
	AMGEN INC	53,947	184.150	9,934,340.050	
	HESS CORP	20,421	44.330	905,262.930	
	AMERICAN EXPRESS CO	54,985	91.960	5,056,420.600	
	AMERICAN ELECTRIC POWER	34,859	72.760	2,536,340.840	
	AFLAC INC	28,218	83.880	2,366,925.840	
	AMERICAN INTL GROUP	65,596	61.840	4,056,456.640	
	AMERCO	551	363.250	200,150.750	
	ANALOG DEVICES	27,391	88.570	2,426,020.870	
	ANADARKO PETROLEUM CORP	41,003	48.390	1,984,135.170	
	ALEXION PHARMACEUTICALS INC	16,015	141.230	2,261,798.450	
	JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	70,717	41.350	2,924,147.950	
	TIME WARNER	56,495	103.380	5,840,453.100	
	JONES LANG LASALLE INC	2,818	131.240	369,834.320	
	VALERO ENERGY CORP	32,105	77.920	2,501,621.600	
	APACHE CORP	28,309	41.960	1,187,845.640	
	ANSYS INC	5,619	127.140	714,399.660	
	APPLE INC	377,548	156.550	59,105,139.400	
	APPLIED MATERIALS INC	78,309	53.230	4,168,388.070	
	ALBEMARLE CORP	7,904	137.420	1,086,167.680	
	ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	41,382	43.290	1,791,426.780	
	PINNACLE WEST CAPITAL CORP	7,831	86.400	676,598.400	
AMEREN CORP	17,312	59.780	1,034,911.360		
ARROW ELECTRONICS INC	5,756	82.870	476,999.720		

AUTOLIV INC	6,197	127.030	787,204.910
AUTODESK INC	14,259	118.570	1,690,689.630
AUTOMATIC DATA PROCESSING	33,355	113.090	3,772,116.950
AUTOZONE INC	2,015	588.560	1,185,948.400
AVERY DENNISON CORP	6,262	101.210	633,777.020
AVNET INC	10,288	40.690	418,618.720
BALL CORP	24,324	42.300	1,028,905.200
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	90,365	187.460	16,939,822.900
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	73,749	54.880	4,047,345.120
CR BARD INC	5,309	321.580	1,707,268.220
BAXTER INTERNATIONAL INC	34,876	62.010	2,162,660.760
BED BATH & BEYOND INC	10,744	21.990	236,260.560
BECTON DICKINSON & CO	17,020	197.510	3,361,620.200
AMETEK INC	16,775	66.970	1,123,421.750
VERIZON COMM INC	295,798	48.860	14,452,690.280
WR BERKLEY CORP	8,134	67.290	547,336.860
BEST BUY CO INC	21,033	55.470	1,166,700.510
YUM! BRANDS INC	23,738	76.640	1,819,280.320
FIRSTENERGY CORP	30,796	31.830	980,236.680
H&R BLOCK INC	16,114	25.610	412,679.540
BOEING CO	41,419	261.440	10,828,583.360
ROBERT HALF INTL INC	8,158	48.740	397,620.920
BORGWARNER INC	14,648	52.010	761,842.480
BOSTON SCIENTIFIC CORP	102,476	29.270	2,999,472.520
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	9,894	76.700	758,869.800
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	1,838	659.700	1,212,528.600
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	120,268	65.110	7,830,649.480
AFFILIATED MANAGERS GROUP INC	3,788	194.560	736,993.280
INGREDION INC	5,305	122.070	647,581.350
ONEOK INC	28,473	56.380	1,605,307.740
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	6,657	104.860	698,053.020
UNITED RENTALS INC	6,332	142.160	900,157.120
SEMPRA ENERGY	16,912	114.940	1,943,865.280
FEDEX CORP	18,719	222.680	4,168,346.920
VERISIGN INC	6,321	108.290	684,501.090
AMPHENOL CORP	21,490	86.780	1,864,902.200
BROWN-FORMAN CORP	13,612	55.300	752,743.600
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	22,337	55.390	1,237,246.430
SIRIUS XM HOLDINGS INC	127,092	5.720	726,966.240
CSX CORP	66,444	53.080	3,526,847.520
CABOT OIL & GAS CORP	32,261	25.510	822,978.110
CAMPBELL SOUP CO	14,050	45.740	642,647.000

SEAGATE TECHNOLOGY	23,239	33.500	778,506.500
CONSTELLATION BRANDS INC	12,240	207.740	2,542,737.600
CARDINAL HEALTH INC	22,125	65.820	1,456,267.500
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	24,916	67.200	1,674,355.200
CATERPILLAR INC	42,278	128.600	5,436,950.800
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	9,832	117.710	1,157,324.720
CELGENE CORP	57,086	139.560	7,966,922.160
CORE LABORATORIES N.V.	3,612	96.570	348,810.840
CITRIX SYSTEMS INC	10,896	80.570	877,890.720
CENTURYLINK INC	39,384	20.270	798,313.680
CERNER CORP	20,809	71.520	1,488,259.680
JPMORGAN CHASE & CO	257,176	96.840	24,904,923.840
CHURCH & DWIGHT CO INC	18,822	47.400	892,162.800
CIGNA CORP	19,211	186.950	3,591,496.450
CINCINNATI FINANCIAL CORP	10,982	76.940	844,955.080
CINTAS CORP	6,282	150.670	946,508.940
CISCO SYSTEMS INC	360,416	33.590	12,106,373.440
CLOROX COMPANY	9,331	130.540	1,218,068.740
COCA-COLA CO/THE	295,882	46.100	13,640,160.200
COLGATE-PALMOLIVE CO	59,819	74.730	4,470,273.870
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	23,366	114.130	2,666,761.580
COMERICA INC	12,068	76.570	924,046.760
COMCAST CORP-CL A	342,375	37.420	12,811,672.500
CA INC	22,732	33.630	764,477.160
CONAGRA BRANDS INC	31,942	33.790	1,079,320.180
CONSOLIDATED EDISON INC	21,750	82.840	1,801,770.000
CMS ENERGY CORP	22,372	47.350	1,059,314.200
COOPER COS INC	3,794	237.520	901,150.880
MOLSON COORS BREWING CO	13,855	84.140	1,165,759.700
CORNING INC	65,641	29.890	1,962,009.490
WR GRACE & CO	6,303	72.940	459,740.820
SEALED AIR CORP	13,870	44.010	610,418.700
CUMMINS INC	11,239	172.330	1,936,816.870
DR HORTON INC	24,498	41.480	1,016,177.040
DANAHER CORP	44,524	86.960	3,871,807.040
MOODY'S CORP	13,204	142.550	1,882,230.200
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	43,287	73.600	3,185,923.200
TARGET CORP	37,486	59.150	2,217,296.900
DEERE & CO	19,364	127.770	2,474,138.280
MORGAN STANLEY	103,282	49.180	5,079,408.760
REPUBLIC SERVICES INC	17,375	63.320	1,100,185.000
COSTAR GROUP INC	2,278	289.200	658,797.600
THE WALT DISNEY CO	112,920	98.550	11,128,266.000
DOLLAR TREE INC	17,493	91.230	1,595,886.390
DOVER CORP	10,736	93.820	1,007,251.520

OMNICOM GROUP	16,993	74.350	1,263,429.550
DTE ENERGY CO	13,122	109.700	1,439,483.400
DUKE ENERGY CORP	51,971	86.390	4,489,774.690
FLOWSERVE CORP	8,406	43.720	367,510.320
DARDEN RESTAURANTS INC	9,436	79.340	748,652.240
EBAY INC	73,800	38.310	2,827,278.000
BANK OF AMERICA CORP	719,642	25.830	18,588,352.860
CITIGROUP INC	198,735	74.940	14,893,200.900
EASTMAN CHEMICAL CO	10,193	88.150	898,512.950
E*TRADE FINANCIAL CORP	18,740	44.240	829,057.600
EATON CORP PLC	32,234	78.530	2,531,336.020
EATON VANCE CORP	9,184	50.340	462,322.560
CADENCE DESIGN SYS INC	20,877	41.390	864,099.030
DISH NETWORK CORP	16,150	51.650	834,147.500
ECOLAB INC	19,009	132.550	2,519,642.950
ELECTRONIC ARTS INC	23,241	116.050	2,697,118.050
SALESFORCE.COM INC	48,240	96.010	4,631,522.400
EMERSON ELECTRIC CO	45,625	63.430	2,893,993.750
ATMOS ENERGY CORP	8,221	86.200	708,650.200
WEATHERFORD INTL PLC	70,440	4.020	283,168.800
ENTERGY CORP	13,984	80.350	1,123,614.400
EOG RESOURCES INC	43,463	96.930	4,212,868.590
EQUIFAX INC	8,495	110.500	938,697.500
EQT CORP	14,119	63.100	890,908.900
ESTEE LAUDER COS INC/THE	16,134	109.730	1,770,383.820
EXPEDITORS INTERNATIONAL	14,641	60.260	882,266.660
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	42,945	57.710	2,478,355.950
EXXON MOBIL CORP	306,862	82.600	25,346,801.200
FMC CORP	8,970	92.430	829,097.100
NEXTERA ENERGY INC	34,843	149.870	5,221,920.410
ASSURANT INC	4,089	95.320	389,763.480
FASTENAL CO	21,654	44.510	963,819.540
FIFTH THIRD BANCORP	52,173	28.260	1,474,408.980
M&T BANK CORP	9,799	163.150	1,598,706.850
FISERV INC	15,880	126.740	2,012,631.200
FLIR SYSTEMS INC	11,623	42.580	494,907.340
MACY'S INC	24,512	20.470	501,760.640
FORD MOTOR CO	261,895	12.380	3,242,260.100
FRANKLIN RESOURCES INC	22,314	44.930	1,002,568.020
FREEPORT-MCMORAN INC	96,812	14.430	1,396,997.160
FLEX LTD	35,913	17.310	621,654.030
ARTHUR J GALLAGHER & CO	12,176	61.720	751,502.720
GAP INC/THE	18,295	28.420	519,943.900
DENTSPLY SIRONA INC	17,477	57.320	1,001,781.640
GENERAL DYNAMICS CORP	18,563	212.830	3,950,763.290
GENERAL MILLS INC	43,704	50.870	2,223,222.480
GENUINE PARTS CO	11,094	95.500	1,059,477.000
GILEAD SCIENCES INC	94,012	82.570	7,762,570.840

GARTNER INC	7,153	123.990	886,900.470
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	18,097	32.990	597,020.030
MCKESSON CORP	15,054	149.940	2,257,196.760
NVIDIA CORP	44,016	190.940	8,404,415.040
GENERAL ELECTRIC CO	628,464	23.070	14,498,664.480
VW GRAINGER INC	3,832	172.500	661,020.000
NUANCE COMMUNICATIONS INC	22,236	15.800	351,328.800
HALLIBURTON CO	61,528	45.510	2,800,139.280
MONSTER BEVERAGE CORP	29,522	55.700	1,644,375.400
GOLDMAN SACHS GROUP INC	25,381	242.400	6,152,354.400
HARLEY-DAVIDSON INC	12,901	46.270	596,929.270
HARRIS CORP	8,954	136.000	1,217,744.000
HASBRO INC	7,736	96.610	747,374.960
HENRY SCHEIN INC	11,426	80.670	921,735.420
HELMERICH & PAYNE INC	7,213	52.280	377,095.640
HERSHEY FOODS CORP	10,132	109.520	1,109,656.640
HP INC	122,725	20.410	2,504,817.250
F5 NETWORKS INC	4,874	115.990	565,335.260
CROWN HOLDINGS INC NPR	7,781	60.900	473,862.900
UNITED THERAPEUTICS CORP	3,447	120.150	414,157.050
JUNIPER NETWORKS INC	27,740	26.860	745,096.400
HOLLYFRONTIER CORP	13,888	36.520	507,189.760
HOLOGIC INC	22,344	36.660	819,131.040
UNUM GROUP	16,000	52.230	835,680.000
HOME DEPOT INC	86,509	165.250	14,295,612.250
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	12,887	94.930	1,223,362.910
HORMEL FOODS CORP	19,345	31.720	613,623.400
CENTERPOINT ENERGY INC	31,952	29.310	936,513.120
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,337	180.290	421,337.730
HUMANA INC	10,468	240.380	2,516,297.840
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	5,927	105.680	626,365.360
HUNTINGTON BANCSHARES INC	75,161	13.850	1,040,979.850
RED HAT INC	13,799	119.370	1,647,186.630
BIOGEN INC	15,267	333.190	5,086,811.730
IDEX CORP	6,466	123.230	796,805.180
ILLINOIS TOOL WORKS	22,032	151.440	3,336,526.080
INTUIT INC	17,739	143.660	2,548,384.740
IDEXX LABORATORIES INC	6,255	158.080	988,790.400
INGERSOLL-RAND PLC	19,826	91.430	1,812,691.180
INTEL CORP	343,790	39.300	13,510,947.000
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	5,578	147.730	824,037.940
INTERNATIONAL PAPER CO	28,375	57.390	1,628,441.250
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	29,157	20.550	599,176.350
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	7,931	58.010	460,077.310

JACK HENRY & ASSOCIATES INC	4,173	104.880	437,664.240	
INCYTE CORP	12,360	111.620	1,379,623.200	
JOHNSON & JOHNSON	195,199	136.650	26,673,943.350	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	25,530	55.870	1,426,361.100	
KLA-TENCOR CORP	11,724	104.590	1,226,213.160	
DEVON ENERGY CORP	34,184	36.080	1,233,358.720	
WESTAR ENERGY INC	9,911	52.090	516,263.990	
KELLOGG CO	18,922	61.250	1,158,972.500	
EAST WEST BANCORP INC	12,297	59.860	736,098.420	
KEYCORP	85,287	18.440	1,572,692.280	
KIMBERLY-CLARK CORP	25,358	117.840	2,988,186.720	
BLACKROCK INC/NEW YORK	8,616	473.930	4,083,380.880	
KOHL'S CORP	11,357	43.220	490,849.540	
KROGER CO	66,588	20.780	1,383,698.640	
LAM RESEARCH CORP	11,522	186.180	2,145,165.960	
PACKAGING CORP OF AMERICA	6,157	116.700	718,521.900	
AKAMAI TECHNOLOGIES	12,622	50.520	637,663.440	
LEGGETT & PLATT INC	9,588	48.340	463,483.920	
LENNAR CORP	14,850	56.580	840,213.000	
LEUCADIA NATIONAL CORP	21,462	25.270	542,344.740	
ELI LILLY & CO	73,736	86.060	6,345,720.160	
L BRANDS INC	16,262	41.850	680,564.700	
LINCOLN NATIONAL CORP	17,740	75.280	1,335,467.200	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	50,474	118.920	6,002,368.080	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	24,266	66.620	1,616,600.920	
LOCKHEED MARTIN CORP	18,908	318.590	6,023,899.720	
LOEWS CORP	21,346	48.700	1,039,550.200	
RANGE RESOURCES CORP	13,697	19.930	272,981.210	
LOWE'S COS INC	61,289	81.210	4,977,279.690	
DOMINION ENERGY INC	45,131	78.010	3,520,669.310	
SCANA CORP	10,902	49.580	540,521.160	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	32,198	30.900	994,918.200	
MCCORMICK & CO INC	7,476	98.290	734,816.040	
MCDONALD'S CORPORATION	58,807	163.150	9,594,362.050	
S&P GLOBAL INC	18,409	159.000	2,927,031.000	
EVEREST RE GROUP LTD	3,382	222.510	752,528.820	
MANPOWERGROUP INC	4,257	120.710	513,862.470	
MARKEL CORPORATION	989	1,093.890	1,081,857.210	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	15,776	110.470	1,742,774.720	
MARSH & MCLENNAN COS	38,962	83.580	3,256,443.960	
MASCO CORP	23,043	38.960	897,755.280	
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	4,387	203.730	893,763.510	
MATTEL INC	24,003	15.660	375,886.980	
METLIFE INC	64,937	52.850	3,431,920.450	

MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	20,342	49.160	1,000,012.720
MEDTRONIC PLC	100,576	78.240	7,869,066.240
ACTIVISION BLIZZARD INC	53,568	61.360	3,286,932.480
CVS HEALTH CORP	73,660	73.900	5,443,474.000
MERCK & CO. INC.	197,759	63.780	12,613,069.020
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	7,176	149.280	1,071,233.280
MICROSOFT CORP	530,683	76.420	40,554,794.860
MICRON TECH INC	76,146	41.610	3,168,435.060
MIDDLEBY CORP	4,100	123.550	506,555.000
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	15,331	91.930	1,409,378.830
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	26,463	18.510	489,830.130
3M CO	43,383	216.510	9,392,853.330
MOHAWK INDUSTRIES INC	4,963	257.060	1,275,788.780
MOTOROLA SOLUTIONS INC	13,170	89.260	1,175,554.200
KANSAS CITY SOUTHERN	7,247	104.890	760,137.830
MURPHY OIL CORPORATION	12,443	25.750	320,407.250
MYLAN NV	31,344	38.290	1,200,161.760
ILLUMINA INC	10,453	206.690	2,160,530.570
XCEL ENERGY INC	37,554	48.280	1,813,107.120
NATIONAL OILWELL VARCO INC	26,938	34.980	942,291.240
NETAPP INC	20,641	43.510	898,089.910
NEWFIELD EXPLORATION CO	13,740	30.230	415,360.200
NEWELL BRANDS INC	36,206	43.170	1,563,013.020
NEWMONT MINING CORP	38,093	38.080	1,450,581.440
NVR INC	299	2,923.150	874,021.850
NIKE INC-CL B	94,901	51.030	4,842,798.030
NOBLE ENERGY INC	31,005	27.790	861,628.950
NORDSTROM INC	9,487	42.920	407,182.040
NORFOLK SOUTHERN CORP	21,896	131.490	2,879,105.040
EVERSOURCE ENERGY	23,085	61.300	1,415,110.500
NISOURCE INC	22,198	26.420	586,471.160
COACH INC	19,175	38.870	745,332.250
NORTHERN TRUST CORP	16,090	93.730	1,508,115.700
NORTHROP GRUMMAN CORP	11,954	295.190	3,528,701.260
WELLS FARGO & CO	343,529	55.660	19,120,824.140
NUCOR CORP	23,780	57.340	1,363,545.200
MONSANTO CO	32,637	119.800	3,909,912.600
CHENIERE ENERGY INC	15,927	46.500	740,605.500
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	36,430	86.750	3,160,302.500
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	54,121	64.390	3,484,851.190
OGE ENERGY CORP	16,028	36.470	584,541.160
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	6,375	208.420	1,328,677.500
ORACLE CORP	222,369	48.280	10,735,975.320
PACCAR INC	24,457	72.860	1,781,937.020
EXELON CORP	69,910	38.460	2,688,738.600

PARKER HANNIFIN CORP	10,277	177.560	1,824,784.120
PATTERSON COS INC	7,169	36.950	264,894.550
PAYCHEX INC	23,141	63.480	1,468,990.680
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	6,526	55.460	361,931.960
MEDNAX INC	5,672	43.290	245,540.880
ALIGN TECHNOLOGY INC	5,255	192.460	1,011,377.300
PPL CORPORATION	49,957	37.920	1,894,369.440
PEPSICO INC	105,321	111.510	11,744,344.710
PENTAIR PLC	11,775	69.950	823,661.250
PFIZER INC	432,021	36.450	15,747,165.450
CONOCOPHILLIPS	88,450	49.600	4,387,120.000
PVH CORP	5,387	126.210	679,893.270
PG&E CORP	37,651	69.150	2,603,566.650
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	12,158	149.010	1,811,663.580
ALTRIA GROUP INC	140,935	64.870	9,142,453.450
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	34,538	136.490	4,714,091.620
POLARIS INDUSTRIES INC	5,010	105.000	526,050.000
GARMIN LTD	7,795	54.380	423,892.100
AETNA INC	23,744	156.300	3,711,187.200
FLUOR CORP (NEW)	9,821	42.610	418,472.810
PPG INDUSTRIES INC	17,674	112.410	1,986,734.340
PRAXAIR INC	20,519	141.180	2,896,872.420
COSTCO WHOLESALE CORP	31,578	157.870	4,985,218.860
T ROWE PRICE GROUP INC	16,303	92.850	1,513,733.550
QUEST DIAGNOSTICS	10,378	91.450	949,068.100
PROCTER & GAMBLE CO	185,301	91.460	16,947,629.460
PROGRESSIVE CORP	41,336	49.250	2,035,798.000
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	37,115	48.390	1,795,994.850
PULTE GROUP INC	21,209	26.970	572,006.730
NEW YORK COMMUNITY BANCORP INC	30,388	12.840	390,181.920
GLOBAL PAYMENTS INC	10,769	99.070	1,066,884.830
QUALCOMM INC	109,455	54.120	5,923,704.600
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	10,187	86.390	880,054.930
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	3,535	137.730	486,875.550
REGENERON PHARMACEUTICALS	5,659	452.970	2,563,357.230
REINSURANCE GROUP OF AMERICA INC	4,642	142.040	659,349.680
AUTONATION INC	5,772	45.210	260,952.120
RESMED INC	9,394	76.550	719,110.700
US BANCORP	122,040	54.260	6,621,890.400
SEATTLE GENETICS INC /WA	7,317	61.470	449,775.990
ARCH CAPITAL GROUP LTD	8,674	98.590	855,169.660
ROSS STORES INC	28,189	64.550	1,819,599.950

ROLLINS INC	5,357	47.480	254,350.360
ROPER TECHNOLOGIES INC	7,821	249.910	1,954,546.110
ROCKWELL AUTOMATION INC	8,867	183.750	1,629,311.250
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	12,293	125.010	1,536,747.930
RAYTHEON COMPANY	21,099	187.220	3,950,154.780
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	3,848	224.800	865,030.400
ACCENTURE PLC-CL A	44,729	136.910	6,123,847.390
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	109,427	41.710	4,564,200.170
WILLIS TOWERS WATSON PLC	8,849	155.960	1,380,090.040
ROCKWELL COLLINS INC	12,086	134.600	1,626,775.600
THE TRAVELERS COMPANIES INC	19,755	125.610	2,481,425.550
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	22,718	94.640	2,150,031.520
PRICELINE GROUP INC	3,542	1,920.200	6,801,348.400
SCHLUMBERGER LTD	100,396	67.740	6,800,825.040
SCHWAB (CHARLES) CORP	88,912	45.310	4,028,602.720
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	14,175	118.640	1,681,722.000
BUNGE LTD	10,334	67.740	700,025.160
SEI INVESTMENTS CO	11,107	63.550	705,849.850
ANTHEM INC	19,573	189.890	3,716,716.970
AMERISOURCEBERGEN CORP	12,257	80.320	984,482.240
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	21,442	67.300	1,443,046.600
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	5,958	383.040	2,282,152.320
CENTENE CORP	12,713	96.050	1,221,083.650
SVB FINANCIAL GROUP	3,468	188.070	652,226.760
SMITH (A.O.) CORP	9,565	60.650	580,117.250
ACUITY BRANDS INC	3,087	165.060	509,540.220
SNAP-ON INC	3,932	150.940	593,496.080
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	30,203	110.010	3,322,632.030
ADVANCE AUTO PARTS	5,273	89.400	471,406.200
EDISON INTERNATIONAL	24,139	78.420	1,892,980.380
SOUTHERN CO	70,353	50.480	3,551,419.440
BB&T CORP	60,674	47.350	2,872,913.900
SOUTHWEST AIRLINES	11,352	58.550	664,659.600
AT&T INC	446,294	38.190	17,043,967.860
CHEVRON CORP	137,000	119.330	16,348,210.000
STANLEY BLACK & DECKER INC	10,528	156.490	1,647,526.720
STATE STREET CORP	27,099	99.290	2,690,659.710
STARBUCKS CORP	103,854	55.640	5,778,436.560
STEEL DYNAMICS INC	15,309	35.980	550,817.820
STRYKER CORP	24,985	146.410	3,658,053.850
NETFLIX INC	31,957	194.950	6,230,017.150
STERICYCLE INC	6,853	70.710	484,575.630

SUNTRUST BANKS INC	34,756	60.170	2,091,268.520
SYMANTEC CORP	46,581	31.610	1,472,425.410
KNIGHT SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	9,793	40.090	392,601.370
SYNOPSYS INC	10,656	82.860	882,956.160
SYSCO CORP	35,926	53.780	1,932,100.280
INTUITIVE SURGICAL INC	7,788	360.290	2,805,938.520
TELEFLEX INC	3,203	239.890	768,367.670
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	63,853	15.760	1,006,323.280
ANDEAVOR	11,500	106.420	1,223,830.000
TEXAS INSTRUMENTS INC	70,900	92.870	6,584,483.000
TEXTRON INC	19,076	53.920	1,028,577.920
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	28,065	193.460	5,429,454.900
TIFFANY & CO	8,733	93.270	814,526.910
TOLL BROTHERS INC	9,526	43.180	411,332.680
TORCHMARK CORP	7,699	81.100	624,388.900
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	11,279	67.570	762,122.030
DAVITA INC	12,618	54.560	688,438.080
TRACTOR SUPPLY CO	9,276	59.430	551,272.680
TRIMBLE INC	20,073	40.590	814,763.070
TYSON FOODS INC	21,621	70.040	1,514,334.840
UGI CORP	12,068	47.040	567,678.720
MARATHON OIL CORP	66,702	13.680	912,483.360
UNION PACIFIC CORP	58,542	113.050	6,618,173.100
UNITED TECHNOLOGIES CORP	54,787	117.750	6,451,169.250
UNITEDHEALTH GROUP INC	69,757	195.260	13,620,751.820
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	6,351	107.750	684,320.250
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	6,848	100.910	691,031.680
VF CORP	24,309	64.350	1,564,284.150
CBS CORP	26,212	57.100	1,496,705.200
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	17,742	154.020	2,732,622.840
VULCAN MATERIALS CO	9,977	117.280	1,170,102.560
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	66,410	68.920	4,576,977.200
WAL-MART STORES INC	112,246	85.730	9,622,849.580
WASTE MANAGEMENT INC	32,216	77.080	2,483,209.280
WATERS CORP	5,963	185.670	1,107,150.210
ALLERGAN PLC	24,888	206.610	5,142,109.680
JM SMUCKER CO/THE-NEW	8,755	104.270	912,883.850
VAIL RESORTS INC	2,598	216.350	562,077.300
WESTERN DIGITAL CORP	20,516	85.620	1,756,579.920
WABTEC CORP	5,497	75.130	412,989.610
WHIRLPOOL CORP	5,553	176.910	982,381.230

SKYWORKS SOLUTIONS INC	13,529	105.470	1,426,903.630
WYNN RESORTS LTD	6,279	143.270	899,592.330
NASDAQ INC	9,132	75.630	690,653.160
CME GROUP INC	25,327	137.190	3,474,611.130
WILLIAMS COS INC	61,081	30.160	1,842,202.960
DICK'S SPORTING GOODS INC	7,489	25.300	189,471.700
LKQ CORP	22,948	36.960	848,158.080
ALLIANT ENERGY CORP	16,383	42.660	698,898.780
WEC ENERGY GROUP INC	23,117	64.730	1,496,363.410
FOOT LOCKER INC	9,476	32.930	312,044.680
TD AMERITRADE HOLDING CORP	18,631	48.120	896,523.720
CARMAX INC	13,513	76.060	1,027,798.780
XEROX CORP	17,455	32.740	571,476.700
XILINX INC	18,777	72.760	1,366,214.520
CIMAREX ENERGY CO	7,003	115.500	808,846.500
TJX COMPANIES INC	46,499	72.550	3,373,502.450
ZIONS BANCORP	16,584	47.280	784,091.520
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	94,700	7.430	703,621.000
JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	15,700	65.550	1,029,135.000
JARDINE STRATEGIC HOLDINGS LTD	17,100	43.450	742,995.000
SIGNATURE BANK	4,171	125.680	524,211.280
CBRE GROUP INC	20,976	39.230	822,888.480
LIBERTY GLOBAL PLC	16,073	32.460	521,729.580
REGIONS FINANCIAL CORP	84,486	15.040	1,270,669.440
DOMINO'S PIZZA INC	3,256	209.240	681,285.440
T-MOBILE US INC	21,188	61.180	1,296,281.840
LAS VEGAS SANDS CORP	28,387	63.320	1,797,464.840
MOSAIC CO/THE	26,525	21.100	559,677.500
TWENTY-FIRST CENTURY FOX NEWS	37,764	25.480	962,226.720
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC	75,340	26.110	1,967,127.400
MACQUARIE INFRASTRUCTURE CORP	5,473	72.110	394,658.030
CELANESE CORP	10,766	106.560	1,147,224.960
DEXCOM INC	6,161	47.200	290,799.200
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	10,423	20.000	208,460.000
EXPEDIA INC	8,709	147.170	1,281,703.530
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	18,475	34.910	644,962.250
AMERIPRISE FINANCIAL INC	10,578	151.830	1,606,057.740
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	41,818	31.490	1,316,848.820
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	42,085	70.090	2,949,737.650

UNDER ARMOUR INC-CLASS A	14,696	16.520	242,777.920
VIACOM INC-CLASS B	24,612	25.210	620,468.520
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,807	311.490	562,862.430
UNITED CONTINENTAL HOLIDINGS INC	6,191	67.400	417,273.400
TRANSDIGM GROUP INC	3,812	264.560	1,008,502.720
MASTERCARD INC	69,733	146.850	10,240,291.050
LIBERTY INTERACTIVE CORP QVC GROUP	29,531	22.360	660,313.160
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	7,436	108.970	810,300.920
HANESBRANDS INC	27,619	23.660	653,465.540
WESTERN UNION CO	35,222	19.740	695,282.280
LEIDOS HOLDINGS INC	9,322	62.140	579,269.080
AERCAP HOLDINGS NV	11,586	52.000	602,472.000
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT-ADR	18,099	24.370	441,072.630
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	8,330	82.000	683,060.000
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	30,910	18.280	565,034.800
DELTA AIR LINES INC	14,611	53.070	775,405.770
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	6,354	37.640	239,164.560
DISCOVER FINANCIAL	27,177	64.840	1,762,156.680
TE CONNECTIVITY LTD	24,311	86.750	2,108,979.250
CONCHO RESOURCES INC/MIDLAND TX	10,552	135.670	1,431,589.840
WABCO HOLDING INC	3,176	149.840	475,891.840
LULULEMON ATHLETICA INC	6,683	62.690	418,957.270
VMWARE INC	5,491	112.030	615,156.730
MERCADOLIBRE INC	2,861	274.490	785,315.890
ULTA BEAUTY INC	4,332	207.890	900,579.480
INVESCO LTD	29,824	36.290	1,082,312.960
MSCI INC	6,462	121.880	787,588.560
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	112,359	114.260	12,838,139.340
VISA INC	133,087	108.440	14,431,954.280
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	12,572	88.800	1,116,393.600
AMERICAN WATER WORKS CO INC	11,992	84.440	1,012,604.480
SCRIPPS NETWORKS INTERACTIVE	6,585	84.750	558,078.750
SIGNET JEWELERS LTD	4,205	64.090	269,498.450
DISCOVERY COMMUNICATIONS- C	16,085	18.930	304,489.050
MARATHON PETROLEUM CORP	36,673	56.220	2,061,756.060

FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	11,624	66.060	767,881.440	
SPECTRUM BRANDS HOLDINGS INC	1,826	103.940	189,794.440	
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	150,279	19.050	2,862,814.950	
XYLEM INC	14,682	64.310	944,199.420	
ALKERMES PLC	12,053	51.560	621,452.680	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	26,044	97.260	2,533,039.440	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,479	233.930	813,842.470	
SPLUNK INC	10,674	63.480	677,585.520	
HCA HEALTHCARE INC	21,493	75.530	1,623,366.290	
VERISK ANALYTICS INC	12,511	83.360	1,042,916.960	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	3,987	142.570	568,426.590	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	6,544	161.570	1,057,314.080	
FIRST REPUBLIC BANK/SAN FRANCISCO CA	10,668	103.410	1,103,177.880	
CIT GROUP INC	9,287	49.440	459,149.280	
NXP SEMICONDUCTOR NV	22,652	115.460	2,615,399.920	
TARGA RESOURCES CORP	16,445	47.780	785,742.100	
HUTCHISON PORT HOLDINGS TRUST	405,600	0.430	174,408.000	
LEAR CORP	5,132	173.410	889,940.120	
CBOE HOLDINGS INC	8,174	109.100	891,783.400	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	10,633	40.700	432,763.100	
DOLLAR GENERAL CORP	19,355	82.540	1,597,561.700	
FORTINET INC	11,399	38.680	440,913.320	
AON PLC	19,411	147.770	2,868,363.470	
TESLA INC	9,357	354.600	3,317,992.200	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING NV	11,392	48.490	552,398.080	
GENERAL MOTORS CO	100,830	45.470	4,584,740.100	
VANTIV INC	12,141	70.800	859,582.800	
TRIPADVISOR INC	9,263	40.330	373,576.790	
ALLY FINANCIAL INC	31,409	24.350	764,809.150	
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	11,923	47.000	560,381.000	
VOYA FINANCIAL INC	13,525	40.550	548,438.750	
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	19,069	99.250	1,892,598.250	
PHILLIPS 66	30,976	93.680	2,901,831.680	
FACEBOOK INC	171,270	172.740	29,585,179.800	
QUINTILES IMS HOLDINGS INC	10,051	97.760	982,585.760	
DIAMONDBACK ENERGY INC	7,054	101.520	716,122.080	
SERVICENOW INC	13,054	120.680	1,575,356.720	
PALO ALTO NETWORKS INC	7,048	149.000	1,050,152.000	
TESARO INC	2,646	117.910	311,989.860	

WORKDAY INC	10,290	108.510	1,116,567.900
ABBVIE INC	116,610	92.380	10,772,431.800
ZOETIS INC	37,529	64.280	2,412,364.120
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDINGS LTD	12,224	58.800	718,771.200
COTY INC	38,871	16.850	654,976.350
NEWS CORP/NEW-CL A	30,263	13.480	407,945.240
MALLINCKRODT PLC	7,835	35.690	279,631.150
HD SUPPLY HOLDINGS INC	12,891	34.950	450,540.450
CDW CORP	12,723	69.040	878,395.920
SPRINT CORP	63,882	7.190	459,311.580
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	10,199	52.830	538,813.170
ARCONIC INC	27,513	27.350	752,480.550
ENVISION HEALTHCARE CORP	8,692	41.840	363,673.280
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	5,006	44.090	220,714.540
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-C	13,368	43.800	585,518.400
XL GROUP LTD	20,259	39.350	797,191.650
BROADCOM LTD	29,284	250.400	7,332,713.600
DELL TECHNOLOGIES INC	15,074	79.360	1,196,272.640
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	15,410	15.150	233,461.500
BLACK KNIGHT INC	5,445	44.550	242,574.750
BAKER HUGHES A GE CO	28,404	34.390	976,813.560
TECHNIPFMC LTD	32,556	27.270	887,802.120
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	6,291	60.670	381,674.970
MICRO FOCUS INTERNATIONAL PLC ADR	16,697	31.790	530,797.630
ANTERO RESOURCES CORP	13,163	20.210	266,024.230
VEEVA SYSTEMS INC	6,980	57.420	400,791.600
TWITTER INC	43,692	17.730	774,659.160
PLAINS GP HOLDINGS LP	7,837	21.850	171,238.450
COMMSCOPE HOLDING CO INC	12,920	32.340	417,832.800
ALLEGION PLC	7,994	88.150	704,671.100
PERRIGO CO PLC	8,553	87.310	746,762.430
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	14,796	70.220	1,038,975.120
ARAMARK	17,307	41.970	726,374.790
SABRE CORP	17,624	18.190	320,580.560
NAVIENT CORP	22,636	11.790	266,878.440
PARSLEY ENERGY INC	17,454	26.960	470,559.840
ARISTA NETWORKS INC	3,158	192.950	609,336.100
IHS MARKIT LTD	27,511	43.970	1,209,658.670
FNF GROUP	17,760	34.200	607,392.000
SYNCHRONY FINANCIAL	57,485	31.420	1,806,178.700
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	34,845	37.450	1,304,945.250
CDK GLOBAL INC	8,309	64.850	538,838.650
QORVO INC	8,784	72.940	640,704.960
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	11,389	34.650	394,628.850

	LIBERTY BROADBAND CORP-C W/I	7,818	96.860	757,251.480	
	AXALTA COATING SYSTEMS LTD	14,710	28.570	420,264.700	
	NIELSEN HOLDINGS PLC	26,840	39.720	1,066,084.800	
	DOWDUPONT INC	168,213	71.620	12,047,415.060	
	WESTROCK CO	17,744	58.570	1,039,266.080	
	KRAFT HEINZ CO	43,818	78.190	3,426,129.420	
	FORTIVE CORP	21,682	72.350	1,568,692.700	
	WASTE CONNECTIONS INC	18,879	69.860	1,318,886.940	
	ALPHABET INC-CL A	21,455	1,005.650	21,576,220.750	
	HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	121,590	14.940	1,816,554.600	
	PAYPAL HOLDINGS INC	84,248	67.780	5,710,329.440	
	FIRST DATA CORP	22,035	17.830	392,884.050	
	DXC TECHNOLOGY CO	21,001	87.650	1,840,737.650	
	ZILLOW GROUP INC-C	8,134	41.410	336,828.940	
	ALPHABET INC-CL C	22,724	989.250	22,479,717.000	
	L3 TECHNOLOGIES INC	5,892	187.660	1,105,692.720	
	ATHENE HOLDING LTD	8,984	54.750	491,874.000	
	CHARTER COMMUNICATIONS INC	15,503	365.120	5,660,455.360	
	アメリカ・ドル 小計	22,688,783		1,617,975,597.890 (181,941,355,983)	
イギリス・ポンド	ANTOFAGASTA PLC	25,905	10.010	259,309.050	
	ASHTeAD GROUP	35,233	18.530	652,867.490	
	SEVERN TRENT PLC	14,897	21.500	320,285.500	
	BHP BILLITON PLC	153,323	13.665	2,095,158.790	
	BARCLAYS PLC	1,277,859	1.904	2,433,043.530	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	64,682	6.695	433,045.990	
	BT GROUP PLC	631,894	2.760	1,744,027.440	
	SKY PLC	72,210	9.135	659,638.350	
	BUNZL PLC	22,241	23.090	513,544.690	
	EASYJET PLC	13,628	12.890	175,664.920	
	CAPITA PLC	54,894	5.445	298,897.830	
	AVIVA PLC	277,861	4.935	1,371,244.030	
	CRODA INTERNATIONAL	8,407	38.800	326,191.600	
	DIAGEO PLC	179,703	25.585	4,597,701.250	
	SCHRODERS PLC	11,554	34.350	396,879.900	
	DCC PLC	5,936	73.050	433,624.800	
	NATIONAL GRID PLC	252,695	9.430	2,382,913.850	
	GKN PLC	134,180	3.518	472,045.240	
	KINGFISHER PLC	165,680	3.056	506,318.080	
	BAE SYSTEMS PLC	225,176	6.150	1,384,832.400	
	PROVIDENT FINANCIAL PLC	11,987	8.005	95,955.930	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	167,726	49.165	8,246,248.790	
	COBHAM PLC	142,739	1.472	210,111.800	
	NEXT PLC	9,731	50.500	491,415.500	

IMPERIAL BRANDS PLC	71,010	31.540	2,239,655.400
IMI PLC	21,218	12.450	264,164.100
JOHNSON MATTHEY PLC	12,527	33.790	423,287.330
ANGLO AMERICAN PLC	93,573	14.420	1,349,322.660
COMPASS GROUP PLC	115,111	16.100	1,853,287.100
HSBC HOLDINGS PLC	1,445,842	7.584	10,965,265.720
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	423,649	2.634	1,115,891.460
CENTRICA PLC	392,766	1.756	689,697.090
UNILEVER PLC	93,834	44.160	4,143,709.440
MEGGITT PLC	62,181	5.190	322,719.390
MORRISON <WM.> SUPERMARKETS	155,682	2.336	363,673.150
UNITED UTILITIES GROUP PLC	55,599	8.600	478,151.400
RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	80,864	6.150	497,313.600
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	25,308	33.040	836,176.320
PEARSON PLC	65,009	6.165	400,780.480
PERSIMMON PLC	23,150	27.780	643,107.000
PRUDENTIAL PLC	182,973	18.240	3,337,427.520
RIO TINTO PLC	91,556	35.690	3,267,633.640
VODAFONE GROUP PLC	1,906,594	2.150	4,099,177.100
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	47,231	70.380	3,324,117.780
RELX PLC	80,689	16.830	1,357,995.870
OLD MUTUAL PLC	339,296	1.963	666,038.040
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	116,966	9.110	1,065,560.260
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	279,442	2.754	769,583.260
ST JAMES'S PLACE PLC	40,884	11.300	461,989.200
TRAVIS PERKINS PLC	20,357	14.500	295,176.500
SSE PLC	73,043	13.740	1,003,610.820
BP PLC	1,412,206	4.886	6,900,038.510
SHIRE PLC	65,457	38.365	2,511,257.800
SAGE GROUP PLC(THE)	85,271	7.205	614,377.550
SMITHS GROUP PLC	31,720	16.100	510,692.000
STANDARD CHARTERED PLC	237,533	7.650	1,817,127.450
LLOYDS BANKING GROUP PLC	5,323,741	0.665	3,540,287.760
TATE & LYLE PLC	39,915	6.545	261,243.670
TAYLOR WIMPLEY PLC	253,022	2.001	506,297.020
TESCO PLC	562,988	1.872	1,053,913.530
3I GROUP PLC	66,784	9.450	631,108.800
SMITH & NEPHEW PLC	66,155	14.010	926,831.550
GLAXOSMITHKLINE PLC	360,458	15.170	5,468,147.860
WEIR GROUP	18,336	20.020	367,086.720
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	21,888	39.210	858,228.480
BABCOCK INT'L GROUP	21,302	8.220	175,102.440
WPP PLC	90,628	13.720	1,243,416.160

	FERGUSON PLC	18,238	51.850	945,640.300	
	ASTRAZENECA PLC	90,878	51.480	4,678,399.440	
	WHITBREAD PLC	12,159	40.280	489,764.520	
	CARNIVAL PLC	13,153	50.400	662,911.200	
	MARKS & SPENCER GROUP PLC	120,290	3.499	420,894.710	
	JOHN WOOD GROUP PLC	48,988	7.335	359,326.980	
	INTERTEK GROUP PLC	13,339	51.550	687,625.450	
	BURBERRY GROUP PLC	29,893	18.470	552,123.710	
	INVESTEC PLC	50,655	5.520	279,615.600	
	INTERCONTINENTAL HOTELS	12,362	40.990	506,718.380	
	ITV PLC	247,210	1.737	429,403.770	
	SAINSBURY (J) PLC	109,410	2.395	262,036.950	
	RANDGOLD RESOURCES LTD NPR	6,998	74.300	519,951.400	
	G4S PLC	122,250	2.788	340,833.000	
	ADMIRAL GROUP PLC	15,893	18.820	299,106.260	
	THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	10,726	38.350	411,342.100	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	326,760	23.050	7,531,818.000	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	266,594	23.375	6,231,634.750	
	INMARSAT PLC	34,127	6.275	214,146.920	
	HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	11,457	11.620	133,130.340	
	TUI AG-DI	30,153	13.190	397,718.070	
	STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	184,183	4.326	796,775.650	
	EXPERIAN PLC	72,946	15.510	1,131,392.460	
	MONDI PLC	24,061	19.260	463,414.860	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	21,290	14.960	318,498.400	
	FRESNILLO PLC NPR	15,639	14.440	225,827.160	
	GLENCORE PLC	900,291	3.650	3,286,062.150	
	DIXONS CARPHONE PLC	84,639	1.936	163,861.100	
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP PLC	112,694	3.701	417,080.490	
	MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	30,616	6.835	209,260.360	
	COCA-COLA HBC AG	13,406	26.110	350,030.660	
	CONVATEC GROUP PLC	118,400	2.794	330,809.600	
	ROYAL MAIL PLC	55,060	3.855	212,256.300	
	MERLIN ENTERTAINMENTS PLC	50,037	4.636	231,971.530	
	MICRO FOCUS INTERNATIONAL PLC	15,645	24.100	377,044.500	
	AUTO TRADER GROUP PLC	76,348	3.658	279,280.980	
	WORLDPAY GROUP PLC	160,354	4.131	662,422.370	
イギリス・ポンド	小計	22,461,041		139,930,766.100 (20,839,888,995)	
イスラエル・シ ケル	BANK HAPUALIM BM	78,428	24.850	1,948,935.800	

	BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	124,270	19.070	2,369,828.900	
	BEZEQ ISRAELI TELECOMMUNICATION CORP LTD	188,230	4.940	929,856.200	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,760	524.600	923,296.000	
	FRUTAROM INDUSTRIES LTD	2,600	271.800	706,680.000	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	49,411	15.360	758,952.960	
	NICE LTD	4,035	286.300	1,155,220.500	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	10,444	62.900	656,927.600	
イスラエル・シュケル 小計		459,178		9,449,697.960 (304,280,274)	
オーストラリア・ ドル	RAMSAY HEALTH CARE LTD	11,115	63.550	706,358.250	
	AUST AND NZ BANKING GROUP LT	215,285	29.900	6,437,021.500	
	AMCOR LTD	80,741	15.500	1,251,485.500	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	239,994	32.640	7,833,404.160	
	BANK OF QUEENSLAND LTD	30,569	12.940	395,562.860	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	114,125	4.960	566,060.000	
	TELSTRA CORP LTD	272,919	3.480	949,758.120	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD	39,014	11.520	449,441.280	
	AMP LTD	200,498	5.050	1,012,514.900	
	ASX LTD	10,290	53.430	549,794.700	
	BHP BILLITON LTD	232,053	26.630	6,179,571.390	
	CALTEX AUSTRALIA LTD	20,946	32.560	682,001.760	
	HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	60,838	3.910	237,876.580	
	COMPUTERSHARE LT	38,040	14.470	550,438.800	
	CSL LIMITED	32,212	136.700	4,403,380.400	
	REA GROUP LTD	4,119	68.470	282,027.930	
	TRANSURBAN GROUP	149,591	12.060	1,804,067.460	
	COCA-COLA AMATIL LTD	48,601	7.930	385,405.930	
	COCHLEAR LTD	3,992	164.860	658,121.120	
	ORIGIN ENERGY LTD	121,721	7.020	854,481.420	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	125,646	76.350	9,593,072.100	
	BORAL LIMITED	86,101	6.710	577,737.710	
	RIO TINTO LIMITED	26,822	68.770	1,844,548.940	
	APA GROUP	73,253	8.220	602,139.660	
	ARISTOCRAT LEISU	44,406	22.610	1,004,019.660	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	171,471	6.470	1,109,417.370	
	TPG TELECOM LTD	28,719	4.950	142,159.050	
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	6,557	45.420	297,818.940		
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	35,790	17.680	632,767.200		

ORICA LTD	25,308	19.960	505,147.680	
CIMIC GROUP LTD	8,709	46.230	402,617.070	
BLUESCOPE STEEL LTD	36,941	11.490	424,452.090	
SYDNEY AIRPORT	85,130	7.180	611,233.400	
MACQUARIE GROUP LTD	24,521	92.950	2,279,226.950	
SUNCORP GROUP LTD	93,181	13.370	1,245,829.970	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	192,882	31.770	6,127,861.140	
NEWCREST MINING LTD	51,533	22.090	1,138,363.970	
OIL SEARCH LTD	93,715	7.110	666,313.650	
INCITEC PIVOT LTD	136,426	3.660	499,319.160	
QANTAS AIRWAYS LIMITED	43,789	6.240	273,243.360	
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	95,390	10.250	977,747.500	
CHALLENGER FINANCIAL SERVICES	45,707	12.340	564,024.380	
SANTOS LTD	133,862	4.070	544,818.340	
SONIC HEALTHCARE	26,192	21.290	557,627.680	
TABCORP HOLDINGS LTD	70,776	4.300	304,336.800	
WESFARMERS LTD	81,021	41.450	3,358,320.450	
ALUMINA LIMITED	184,613	2.230	411,686.990	
WOODSIDE PETROLEUM LTD	60,249	29.060	1,750,835.940	
WOOLWORTHS LTD	97,477	24.880	2,425,227.760	
SEEK LTD	25,899	17.240	446,498.760	
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES LTD	4,581	46.790	214,344.990	
TATTS GROUP LTD	109,937	3.990	438,648.630	
AUSNET SERVICES	165,066	1.695	279,786.870	
AGL ENERGY LTD	46,315	22.920	1,061,539.800	
BRAMBLES LTD	115,255	9.190	1,059,193.450	
CROWN RESORTS LTD	32,861	11.670	383,487.870	
AURIZON HOLDINGS LTD	139,184	4.880	679,217.920	
TREASURY WINE ESTATES LTD	50,789	14.100	716,124.900	
HEALTHSCOPE LTD	149,047	1.775	264,558.420	
MEDIBANK PVT LTD	177,176	2.990	529,756.240	
SOUTH32 LTD(AUD)	367,057	3.260	1,196,605.820	
オーストラリア・ドル 小計	5,496,017		84,330,452.640 (7,400,840,523)	
カナダ・ドル				
AGNICO EAGLE MINES LTD	16,141	57.620	930,044.420	
ALIMENTATION COUCHE TARD INC	30,728	58.940	1,811,108.320	
BARRICK GOLD CORP	83,648	20.890	1,747,406.720	
ATCO LTD	7,193	46.710	335,985.030	
BANK OF MONTREAL	45,451	97.240	4,419,655.240	
BANK OF NOVA SCOTIA	86,583	80.830	6,998,503.890	
NATIONAL BANK OF CANADA	23,756	61.450	1,459,806.200	
BCE INC	11,568	58.890	681,239.520	
BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT	65,043	52.990	3,446,628.570	

VALEANT PHARMACEUTICALS INTERN	25,819	17.800	459,578.200	
BOMBARDIER INC 'B'	151,615	2.350	356,295.250	
SAPUTO INC	14,101	43.280	610,291.280	
BLACKBERRY LTD	39,652	14.200	563,058.400	
CGI GROUP INC	15,228	65.800	1,002,002.400	
CCL INDUSTRIES INC	11,340	63.940	725,079.600	
CAE INC	23,000	21.500	494,500.000	
CAMECO CORP	32,627	11.380	371,295.260	
ROGERS COMM-CL B	25,967	66.120	1,716,938.040	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	29,471	112.270	3,308,709.170	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	79,420	41.500	3,295,930.000	
CANADIAN TIRE CORP-CL A	4,862	156.770	762,215.740	
CANADIAN UTILITIES LTD	9,119	39.150	357,008.850	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	54,387	100.960	5,490,911.520	
FIRST CAPITAL REALTY INC	11,417	20.010	228,454.170	
AGRIUM INC	9,382	132.690	1,244,897.580	
YAMANA GOLD INC	67,520	3.280	221,465.600	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	13,930	38.750	539,787.500	
OPEN TEXT CORP	19,756	41.890	827,578.840	
EMPIRE CO LTD	15,093	22.190	334,913.670	
KINROSS GOLD CORP	99,741	5.460	544,585.860	
FINNING INTERNATIONAL INC	9,892	29.050	287,362.600	
FORTIS INC	29,002	45.460	1,318,430.920	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	55,296	15.430	853,217.280	
TELUS CORP	18,945	45.000	852,525.000	
GREAT WEST LIFECO INC	19,248	36.270	698,124.960	
IMPERIAL OIL LTD	21,542	39.460	850,047.320	
ENBRIDGE INC	119,607	51.980	6,217,171.860	
IGM FINANCIAL INC	8,426	43.220	364,171.720	
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	87,995	4.080	359,019.600	
MANULIFE FINANCIAL CORP	148,181	25.910	3,839,369.710	
LINAMAR CORP	3,827	78.400	300,036.800	
LOBLAW CO LTD	15,354	68.900	1,057,890.600	
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANCE AND FINANCIAL SERVICES INC	6,524	56.900	371,215.600	
MAGNA INTERNATIONAL INC	25,339	68.270	1,729,893.530	
SUN LIFE FINANCIAL INC	47,058	49.710	2,339,253.180	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,245	645.000	1,448,025.000	
METRO INC	19,965	41.990	838,330.350	
HUSKY ENERGY INC	28,749	15.740	452,509.260	
CRESCENT POINT ENERGY CORP	39,992	9.610	384,323.120	

METHANEX CORP	7,381	62.630	462,272.030
ONEX CORP	6,646	97.640	648,915.440
GOLDCORP INC	70,077	16.630	1,165,380.510
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	61,076	23.770	1,451,776.520
POWER CORP OF CANADA	25,052	32.300	809,179.600
POWER FINANCIAL CORP	17,484	35.350	618,059.400
ROYAL BANK OF CANADA	106,285	98.830	10,504,146.550
SNC-LAVALIN GROUP INC	13,134	56.960	748,112.640
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	10,607	208.440	2,210,923.080
SHAW COMM INC-B	27,548	28.630	788,699.240
SUNCOR ENERGY INC	120,732	42.990	5,190,268.680
ENCANA CORP	69,257	14.350	993,837.950
TECK RESOURCES LTD-CL B	41,016	28.380	1,164,034.080
THOMSON REUTERS CORP	20,469	57.710	1,181,265.990
TORONTO DOMINION BANK (THE) C\$	133,609	71.110	9,500,935.990
TRANSCANADA CORP	62,895	62.460	3,928,421.700
WEST FRASER TIMBER CO LTD	5,696	75.720	431,301.120
WESTON (GEORGE) LTD	3,105	109.950	341,394.750
INTACT FINANCIAL CORP	10,785	102.980	1,110,639.300
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	33,943	25.050	850,272.150
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,494	719.640	1,075,142.160
FRANCO-NEVADA CORP NPR	14,627	99.400	1,453,923.800
CI FINANCIAL CORP	20,695	28.070	580,908.650
TOURMALINE OIL CORP	15,779	22.700	358,183.300
KEYERA CORP	13,728	38.570	529,488.960
ALTAGAS LTD	12,538	28.200	353,571.600
PEMBINA PIPELINE CORP	41,429	43.110	1,786,004.190
DOLLARAMA INC	7,504	136.520	1,024,446.080
GENOVUS ENERGY INC W/I	80,545	12.170	980,232.650
VERMILION ENERGY INC	8,291	42.580	353,030.780
ARC RESOURCES LTD	22,997	16.000	367,952.000
PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	14,493	18.610	269,714.730
ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP	30,631	9.620	294,670.220
INTER PIPELINE LTD	24,083	25.960	625,194.680
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	14,961	32.020	479,051.220
SEVEN GENERATIONS ENERGY LTD	17,231	19.790	341,001.490
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	15,353	81.860	1,256,796.580
SHOPIFY INC	5,021	118.400	594,486.400
HYDRO ONE LTD	26,559	22.620	600,764.580
カナダ・ドル 小計	3,065,501		127,271,194.040

(11,497,679,669)

シンガポール・ドル	SINGAPORE TECH ENG	125,000	3.350	418,750.000	
	SEMBCORP INDUSTRIES	81,400	3.120	253,968.000	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	123,700	2.690	332,753.000	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	692,140	0.380	263,013.200	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	135,700	21.350	2,897,195.000	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	29,000	11.920	345,680.000	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	5,944	40.140	238,592.160	
	SINGAPORE AIRPORT TERMINAL SERVICES LTD	42,300	4.630	195,849.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	68,900	7.620	525,018.000	
	CAPITALAND LTD	192,415	3.670	706,163.050	
	GENTING SINGAPORE PLC	416,400	1.180	491,352.000	
	KEPPEL CORP LTD	119,300	6.730	802,889.000	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	177,900	2.040	362,916.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	225,453	11.340	2,556,637.020	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	591,922	3.680	2,178,272.960	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	47,500	10.180	483,550.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	94,500	24.070	2,274,615.000	
	UOL GROUP LIMITED	40,500	8.640	349,920.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	92,000	3.340	307,280.000	
YANGZIJIANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	188,800	1.455	274,704.000		
GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES LTD	172,100	3.300	567,930.000		
シンガポール・ドル 小計	3,662,874		16,827,047.390 (1,397,822,827)		
スイス・フラン	CREDIT SUISSE GROUP AG	182,508	15.390	2,808,798.120	
	NESTLE SA-REGISTERED	225,201	83.600	18,826,803.600	
	CIE FINANC RICHEMONT	37,438	89.350	3,345,085.300	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	50,677	245.900	12,461,474.300	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2,835	218.700	620,014.500	
	SIKA INHABER	151	7,165.000	1,081,915.000	
	SGS SA-REG	405	2,313.000	936,765.000	
	NOVARTIS AG-REG SHS	160,610	83.800	13,459,118.000	
	BALOISE HOLDING AG -R	4,127	154.900	639,272.300	
	BARRY CALLEBAUT AG	144	1,493.000	214,992.000	
	SWISSCOM AG-REG	1,795	501.500	900,192.500	
	ABB LTD	140,915	24.450	3,445,371.750	
	ADECCO GROUP AG-REG	12,341	75.850	936,064.850	
	GEBERIT AG	2,801	465.600	1,304,145.600	
	LONZA GROUP AG-REG	5,901	265.300	1,565,535.300	

LINDT & SPRUENGLI PART	75	5,640.000	423,000.000	
LINDT & SPRUENGLI NAMEN	9	68,330.000	614,970.000	
GIVAUDAN-REG	692	2,148.000	1,486,416.000	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	11,250	294.600	3,314,250.000	
LAFARGEHOLCIM LTD	32,676	56.700	1,852,729.200	
SONOVA HOLDING AG	3,168	172.900	547,747.200	
KUEHNE & NAGEL INTL AG	3,687	176.000	648,912.000	
STRAUMANN HOLDING AG	600	645.000	387,000.000	
THE SWATCH GROUP AG-B	1,955	399.000	780,045.000	
THE SWATCH GROUP AG-REG	4,592	76.450	351,058.400	
SCHINDLER NAMEN	1,663	213.600	355,216.800	
SWISS LIFE HOLDING AG	2,225	342.300	761,617.500	
VIFOR PHARMA AG	3,050	117.200	357,460.000	
EMS-CHEMIE HOLDING	553	636.500	351,984.500	
SWISS PRIME SITE AG	5,990	86.750	519,632.500	
DUFY GROUP	2,390	155.900	372,601.000	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,272	663.500	843,972.000	
JULIUS BAER GROUP LTD	15,227	57.100	869,461.700	
SWISS RE LTD	23,838	90.600	2,159,722.800	
UBS GROUP AG	268,881	16.690	4,487,623.890	
スイス・フラン 小計	1,211,642		84,030,968.610 (9,707,257,494)	
スウェーデン・ク ローナ				
ATLAS COPCO AB-A SHS	48,377	346.200	16,748,117.400	
ATLAS COPCO AB-B SHS	29,157	315.000	9,184,455.000	
ERICSSON LM-B SHS	221,748	46.540	10,320,151.920	
GETINGE AB-B SHS	13,153	156.000	2,051,868.000	
LUNDBERGS B	3,691	645.000	2,380,695.000	
SKF AB-B SHS	24,866	174.000	4,326,684.000	
SANDVIK AB	76,781	141.200	10,841,477.200	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	117,729	105.200	12,385,090.800	
SKANSKA AB-B SHS	21,179	185.300	3,924,468.700	
SWEDBANK AB	66,507	216.900	14,425,368.300	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	108,388	125.000	13,548,500.000	
VOLVO AB-B SHS	113,672	153.500	17,448,652.000	
SWEDISH MATCH AB	11,481	294.200	3,377,710.200	
TELE2 AB-B SHS	26,976	93.250	2,515,512.000	
NORDEA AB	218,620	110.300	24,113,786.000	
INDUSTRIVARDEN C	11,403	211.000	2,406,033.000	
ELECTROLUX AB-SER B	19,191	277.300	5,321,664.300	
SECURITAS AB-B SHS	24,098	135.000	3,253,230.000	
INVESTOR AB-B SHS	33,412	413.800	13,825,885.600	
HENNES&MAURITZ AB-B SHS	66,448	219.300	14,572,046.400	
ASSA ABLOY AB-B	68,613	177.600	12,185,668.800	
TELIA CO AB	184,927	39.200	7,249,138.400	
LUNDIN PETROLEUM AB	16,790	177.300	2,976,867.000	
BOLIDEN AB	21,855	289.400	6,324,837.000	

	ALFA LAVAL AB	17,411	201.100	3,501,352.100	
	KINNEVIK AB-B	18,310	268.900	4,923,559.000	
	MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR SA	5,332	530.500	2,828,626.000	
	ICA GRUPPEN AB	5,920	310.700	1,839,344.000	
	HUSQVARNA AB-B SHS	33,692	82.100	2,766,113.200	
	HEXAGON AB	20,529	403.300	8,279,345.700	
	ESSITY AB-B	48,083	231.300	11,121,597.900	
スウェーデン・クローナ 小計		1,698,339		250,967,844.920 (3,511,040,150)	
デンマーク・ク ローネ	CARLSBERG AS-B	7,330	715.000	5,240,950.000	
	A P MOLLER A/S	481	11,910.000	5,728,710.000	
	AP MOLLER MAERSK A	273	11,500.000	3,139,500.000	
	DANSKE BANK A/S	57,098	250.600	14,308,758.800	
	GENMAB A/S	4,633	1,420.000	6,578,860.000	
	NOVOZYMES-B SHS	15,904	331.800	5,276,947.200	
	NOVO NORDISK A/S-B	134,315	308.800	41,476,472.000	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	15,808	575.000	9,089,600.000	
	TDC A/S	68,939	37.650	2,595,553.350	
	COLOPLAST-B	8,286	543.500	4,503,441.000	
	DSV A/S	13,040	469.200	6,118,368.000	
	WILLIAM DEMANT	6,537	177.500	1,160,317.500	
	H LUNDBECK A/S	4,840	392.000	1,897,280.000	
	TRYG A/S	11,107	145.100	1,611,625.700	
	PANDORA A/S	8,251	629.000	5,189,879.000	
	CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S	7,708	544.000	4,193,152.000	
ISS A/S	11,125	257.700	2,866,912.500		
DONG ENERGY A/S	11,600	388.000	4,500,800.000		
デンマーク・クローネ 小計		387,275		125,477,127.050 (2,248,550,116)	
ニュージーラン ド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	97,992	6.240	611,470.080	
	FLETCHER BUILDING LTD	75,281	7.750	583,427.750	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	210,161	3.615	759,732.010	
ニュージーランド・ドル 小計		383,434		1,954,629.840 (155,901,275)	
ノルウェー・ク ローネ	MARINE HARVEST	24,816	160.300	3,978,004.800	
	DNB ASA	70,426	159.300	11,218,861.800	
	NORSK HYDRO ASA	91,879	60.000	5,512,740.000	
	TELENOR ASA	53,178	165.000	8,774,370.000	
	SCHIBSTED ASA	9,131	206.000	1,880,986.000	
	ORKLA ASA	61,421	83.450	5,125,582.450	
	STATOIL ASA	81,414	159.700	13,001,815.800	
	YARA INTERNATIONAL ASA	11,279	360.000	4,060,440.000	
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	16,683	143.400	2,392,342.200		
ノルウェー・クローネ 小計		420,227		55,945,143.050	

ユーロ	CRH PLC	58,956	30.820	1,817,023.920
	PADDY POWER BETFAIR PLC	6,246	85.510	534,095.460
	KERRY GROUP PLC-A	11,576	81.600	944,601.600
	UMICORE	7,660	72.410	554,660.600
	AIR LIQUIDE	31,649	104.000	3,291,496.000
	AIRBUS SE	42,646	77.990	3,325,961.540
	AXA	139,550	25.825	3,603,878.750
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	34,622	19.860	687,592.920
	ADIDAS AG	13,503	194.000	2,619,582.000
	ASSICURAZIONI GENERALI	85,995	15.540	1,336,362.300
	ABERTIS INFRASTRUCTURAS SA	38,521	17.380	669,494.980
	DASSAULT AVIATION SA	157	1,335.000	209,595.000
	DANONE	43,686	69.100	3,018,702.600
	SAFRAN SA	22,050	85.620	1,887,921.000
	INTESA SANPAOLO	934,915	2.886	2,698,164.690
	INTESA SANPAOLO-RNC	51,178	2.714	138,897.090
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	22,705	88.390	2,006,894.950
	ACCOR SA	15,604	43.400	677,213.600
	BOSKALIS WESTMINSTER CT	7,563	30.490	230,595.870
	BOUYGUES	13,996	39.855	557,810.580
	BNP PARIBAS	80,451	67.370	5,419,983.870
	RELX NV	70,826	18.330	1,298,240.580
	THALES SA	8,128	95.690	777,768.320
	CAPGEMINI SA	11,481	99.500	1,142,359.500
	CASINO GUICHARD PERRACHON	4,264	50.490	215,289.360
	INGENICO GROUP	4,334	78.890	341,909.260
	UNICREDIT SPA	142,664	17.300	2,468,087.200
	NATIXIS	70,166	6.795	476,777.970
	KONINKLIJKE DSM NV	14,525	70.240	1,020,236.000
	COMMERZBANK AG	72,573	11.700	849,104.100
	EIFFAGE	4,777	87.440	417,700.880
	FRESENIUS SE & CO KGAA	30,156	69.550	2,097,349.800
	UNITED INTERNET	9,882	54.170	535,307.940
	FUCHS PETROLUB SE PREF	5,546	49.930	276,911.780
	PUBLICIS GROUPE	15,068	60.200	907,093.600
	MAN SE	3,396	95.160	323,163.360
	IBERDROLA SA	407,950	6.739	2,749,175.050
	ENI SPA	177,297	13.920	2,467,974.240
	IMERYSA	2,256	75.940	171,320.640
	JERONIMO MARTINS	19,517	16.315	318,419.850
	KBC GROUPE	18,378	71.820	1,319,907.960
	HANNOVER RUECK SE	3,642	105.600	384,595.200
	WARTSILA OYJ	11,645	59.200	689,384.000
	L'OREAL	18,067	185.500	3,351,428.500
	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	20,452	239.400	4,896,208.800

LAGARDERE S.C.A.	9,600	28.280	271,488.000
GEA GROUP AG	14,635	39.995	585,326.820
BOLLORE	71,347	4.110	293,236.170
MEDIOBANCA SPA	42,404	9.160	388,420.640
MICHELIN(CGDE) -B	12,118	122.650	1,486,272.700
CONTINENTAL AG	7,776	215.750	1,677,672.000
DEUTSCHE POST AG-REG	69,944	38.060	2,662,068.640
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	14,426	12.765	184,147.890
NOKIAN RENKAAT OYJ	9,399	38.140	358,477.860
AXEL SPRINGER SE	3,067	56.490	173,254.830
OMV AG	9,766	48.600	474,627.600
PERNOD-RICARD	16,249	121.750	1,978,315.750
PEUGEOT SA	42,232	20.365	860,054.680
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	12,066	55.140	665,319.240
RENAULT SA	12,442	85.040	1,058,067.680
REPSOL SA	94,490	15.400	1,455,146.000
REMY COINTREAU	1,860	109.100	202,926.000
MERCK KGAA	9,551	95.360	910,783.360
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	35,706	49.440	1,765,304.640
SAIPEM	46,575	3.514	163,664.550
RWE AG	39,183	20.485	802,663.750
SEB SA	1,405	163.300	229,436.500
LUXOTTICA GROUP SPA	11,602	47.170	547,266.340
SOCIETE GENERALE-A	56,596	48.590	2,749,999.640
VINCI S.A.	35,362	80.370	2,842,043.940
SODEXO	6,286	103.050	647,772.300
SOLVAY SA	5,036	124.900	628,996.400
SCHNEIDER ELECTRIC SE	41,723	74.010	3,087,919.230
VIVENDI SA	77,297	21.270	1,644,107.190
SAP SE	71,560	94.820	6,785,319.200
TELEFONICA S.A	322,715	9.220	2,975,432.300
TOTAL SA	168,622	45.850	7,731,318.700
VALEO	17,731	63.360	1,123,436.160
E.ON SE	164,012	9.862	1,617,486.340
VOEST-ALPINE AG	9,875	43.770	432,228.750
ZODIAC AEROSPACE	15,282	24.355	372,193.110
HENKEL AG & CO KGAA	7,525	106.350	800,283.750
SIEMENS AG-REG	55,852	119.650	6,682,691.800
UPM-KYMMENE OYJ	36,917	23.810	878,993.770
ING GROEP NV-CVA	289,132	15.745	4,552,383.340
BAYER AG	60,432	117.150	7,079,608.800
STORA ENSO OYJ-R SHS	42,303	12.420	525,403.260
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	13,173	118.550	1,561,659.150
DAIMLER AG	68,086	68.090	4,635,975.740
BASF SE	65,128	89.240	5,812,022.720
BEIERSDORF AG	6,780	91.970	623,556.600

HOCHTIEF AG	1,707	139.900	238,809.300
HEIDELBERGCEMENT AG	11,009	85.960	946,333.640
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	15,048	81.480	1,226,111.040
ORANGE	141,819	13.920	1,974,120.480
SAMPO OYJ-A SHS	33,860	45.800	1,550,788.000
RANDSTAD HOLDINGS	7,794	53.610	417,836.340
ALLIANZ SE	32,540	194.350	6,324,149.000
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	191,094	3.093	591,053.740
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	91,426	15.940	1,457,330.440
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	17,602	29.740	523,483.480
HERMES INTL	2,285	431.950	987,005.750
ENDESA S.A.	21,037	19.430	408,748.910
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	19,748	24.560	485,010.880
ERSTE GROUP BANK AG	23,324	37.290	869,751.960
MUENCHENER RUECKVER AG- REG	11,346	184.250	2,090,500.500
ARCELOR MITTAL (NL)	51,058	22.345	1,140,891.010
SOCIETE BIC SA	2,478	92.150	228,347.700
DASSAULT SYSTEMES SA	8,961	88.130	789,732.930
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	15,049	31.070	467,572.430
HEINEKEN NV	17,373	85.850	1,491,472.050
AKZO NOBEL	18,209	78.660	1,432,319.940
ASML HOLDING NV	27,421	144.650	3,966,447.650
AEGON NV	120,404	4.824	580,828.890
BANKINTER S.A.	57,960	7.941	460,260.360
VOLKSWAGEN AG	2,794	148.550	415,048.700
VOLKSWAGEN AG PFD	13,134	142.300	1,868,968.200
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	490,925	7.365	3,615,662.620
KERING	5,479	357.550	1,959,016.450
CNP ASSURANCES	13,987	19.870	277,921.690
FORTUM OYJ	29,739	17.560	522,216.840
AGEAS	12,993	40.335	524,072.650
UCB SA	8,747	60.750	531,380.250
THYSSENKRUPP AG	29,903	23.605	705,860.310
UNILEVER NV-CVA	120,672	50.390	6,080,662.080
CARREFOUR SA	39,144	17.135	670,732.440
GAS NATURAL SDG SA	29,010	18.695	542,341.950
ATOS SE	7,050	133.050	938,002.500
NOKIA OYJ	417,248	4.986	2,080,398.520
KONINKLIJKE PHILIPS NV	70,960	34.680	2,460,892.800
WOLTERS KLUWER-CVA	20,558	39.985	822,011.630
SANOFI	81,462	84.420	6,877,022.040
STMICROELECTRONICS NV	45,866	16.840	772,383.440
ELISA OYJ	9,517	36.130	343,849.210
BANCO SANTANDER SA	1,155,988	5.646	6,526,708.240

METSO OYJ	8,585	30.860	264,933.100
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	34,596	18.255	631,549.980
QIAGEN N.V.	13,642	29.690	405,030.980
LINDE AG	13,375	175.200	2,343,300.000
DEUTSCHE BANK AG-REG	149,244	14.320	2,137,174.080
BMW VORZUG	4,116	76.600	315,285.600
K & S	14,982	20.850	312,374.700
ENEL SPA	600,898	5.195	3,121,665.110
COLRUYT NV	4,673	44.670	208,742.910
VOPAK (KON.)	5,364	37.125	199,138.500
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	232,897	15.655	3,646,002.530
LEONARDO SPA	26,269	15.310	402,178.390
INFINEON TECHNOLOGIES AG	81,774	21.715	1,775,722.410
KONINKLIJKE KPN NV	228,967	2.984	683,237.520
EUROFINS SCIENTIFIC	794	540.600	429,236.400
UNIPOLSAI SPA	91,992	1.985	182,604.120
DEUTSCHE BOERSE AG	13,844	94.500	1,308,258.000
EURAZEO	2,427	78.570	190,689.390
BANCO SABADELL	367,753	1.684	619,296.050
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	5,814	90.440	525,818.160
FRAPORT AG	3,149	81.510	256,674.990
HEINEKEN HOLDING NV-A	8,014	81.080	649,775.120
INDITEX	79,821	31.400	2,506,379.400
JC DECAUX SA	6,058	32.400	196,279.200
ANDRITZ AG	6,265	48.460	303,601.900
MAPFRE SA	84,474	2.730	230,614.020
ESSILOR INTL	14,632	103.450	1,513,680.400
SNAM SPA	158,419	4.202	665,676.630
CREDIT AGRICOLE SA	85,585	15.050	1,288,054.250
ENAGAS	18,095	24.270	439,165.650
WENDEL	2,220	138.900	308,358.000
TENARIS SA	38,237	11.520	440,490.240
TELECOM ITALIA SPA	792,163	0.771	610,757.670
TELECOM ITALIA-RNC	497,596	0.620	308,509.520
ATLANTIA SPA	34,969	27.480	960,948.120
ILIAD SA	2,102	222.700	468,115.400
PROXIMUS	8,922	28.890	257,756.580
SES FDR	24,585	16.780	412,536.300
TERNA SPA	117,108	4.978	582,963.620
GRIFOLS SA	18,800	24.220	455,336.000
FERROVIAL SA	36,193	18.615	673,732.690
LANXESS AG	6,856	66.250	454,210.000
NESTE OYJ	10,692	39.460	421,906.320
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	9,641	28.140	271,297.740
RECORDATI SPA	6,859	39.830	273,193.970
KONE OYJ	23,717	45.570	1,080,783.690

ENGIE	129,539	14.435	1,869,895.460
ALSTOM	12,046	35.850	431,849.100
TELENET GROUP HOLDING NV	3,634	58.680	213,243.120
EUTELSAT COMMUNICATIONS	12,542	23.195	290,911.690
ELECTRICITE DE FRANCE	34,756	10.905	379,014.180
IPSEN SA	2,487	114.300	284,264.100
DEUTSCHE WOHNEN	26,714	35.690	953,422.660
ARKEMA SA	3,796	103.800	394,024.800
LEGRAND SA	19,920	61.640	1,227,868.800
ADP	2,313	138.650	320,697.450
ORION OYJ	8,051	38.730	311,815.230
RTL GROUP SA	3,446	64.820	223,369.720
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	37,921	15.105	572,796.700
SYMRISE AG	7,926	63.910	506,550.660
SCOR SE	13,875	35.340	490,342.500
REXEL SA	23,245	14.225	330,660.120
PRYSMIAN SPA	14,925	28.490	425,213.250
CAIXABANK	262,372	4.060	1,065,230.320
BUREAU VERITAS SA	21,480	22.265	478,252.200
GROUPE EUROTUNNEL SE	37,646	10.540	396,788.840
SUEZ SA	25,406	15.540	394,809.240
AMADEUS IT GROUP SA	30,169	56.770	1,712,694.130
BRENNTAG AG	9,600	47.600	456,960.000
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GROUP SA	44,747	6.957	311,304.870
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL DE ALIMENTACION SA	48,305	4.450	214,957.250
EVONIK INDUSTRIES AG	11,575	30.385	351,706.370
EDENRED	13,195	23.950	316,020.250
BANKIA SA	63,197	4.047	255,758.250
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	61,541	4.672	287,519.550
HUGO BOSS AG -ORD	5,218	75.700	395,002.600
OSRAM LICHT AG	7,017	63.800	447,684.600
GEMALTO	6,103	34.020	207,624.060
KION GROUP AG	6,125	80.080	490,490.000
VONOVIA SE	35,308	36.450	1,286,976.600
BANK OF IRELAND GROUP PLC	73,287	6.890	504,947.430
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS PLC	16,090	35.200	566,368.000
FERRARI NV	8,338	98.400	820,459.200
METRO AG	10,774	16.905	182,134.470
INNOGY SE	9,769	38.710	378,157.990
CNH INDUSTRIAL NV	78,645	10.160	799,033.200
NN GROUP NV	21,965	35.700	784,150.500
ZALANDO SE	6,674	44.550	297,326.700

	FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	82,323	15.130	1,245,546.990	
	AENA SME SA	5,256	151.150	794,444.400	
	ABN AMRO GROUP NV	29,129	25.945	755,751.900	
	EXOR NV	9,441	55.850	527,279.850	
	ALTICE NV-A	43,403	17.190	746,097.570	
	COVESTRO AG	8,603	70.950	610,382.850	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	54,880	104.750	5,748,680.000	
	POSTE ITALIANE SPA	40,015	6.200	248,093.000	
	SCHAEFFLER AG	12,644	13.710	173,349.240	
ユーロ 小計		14,135,769		289,106,033.330 (38,575,418,027)	
香港・ドル	ASM PACIFIC TECH	16,600	113.100	1,877,460.000	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	164,000	18.920	3,102,880.000	
	BANK OF EAST ASIA	76,260	34.850	2,657,661.000	
	CLP HOLDINGS LTD	119,500	79.600	9,512,200.000	
	PCCW LTD	331,000	4.250	1,406,750.000	
	LI & FUNG LTD	532,400	4.030	2,145,572.000	
	I-CABLE COMMUNICATIONS LTD	26,552	0.244	6,478.680	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	49,000	68.200	3,341,800.000	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	79,040	216.600	17,120,064.000	
	MTR CORP	118,500	45.000	5,332,500.000	
	HANG LUNG GROUP LTD	63,000	28.500	1,795,500.000	
	HANG SENG BANK LTD	56,000	190.400	10,662,400.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	83,844	52.550	4,406,002.200	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	96,500	67.950	6,557,175.000	
	(THE) WHARF HOLDINGS LTD	95,750	70.750	6,774,312.500	
	HONG KONG & CHINA GAS	610,046	14.780	9,016,479.880	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	50,000	37.650	1,882,500.000	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	164,000	53.200	8,724,800.000	
	KERRY PROPERTIES LTD	33,000	33.150	1,093,950.000	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	289,000	38.550	11,140,950.000	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HOLDINGS	50,500	30.300	1,530,150.000	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	441,266	11.920	5,259,890.720	
	SINO LAND CO	255,400	13.920	3,555,168.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	103,000	129.500	13,338,500.000	
	SWIRE PACIFIC LTD A	30,000	76.550	2,296,500.000	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	113,500	42.950	4,874,825.000	
	WHEELLOCK & CO LTD	56,000	56.650	3,172,400.000	
	SJM HOLDINGS LTD	299,000	6.890	2,060,110.000	
	WYNN MACAU LTD	124,400	19.620	2,440,728.000	

MGM CHINA HOLDINGS LTD	64,800	17.540	1,136,592.000	
AIA GROUP LTD	889,227	59.750	53,131,313.250	
HKT TRUST / HKT LTD	282,000	9.550	2,693,100.000	
SANDS CHINA LTD	169,200	37.950	6,421,140.000	
SWIRE PROPERTIES LTD	104,200	27.100	2,823,820.000	
HK ELECTRIC INVESTMENTS & HK ELECTRIC INVESTMENTS LTD	230,000	7.120	1,637,600.000	
WH GROUP LTD	530,500	8.200	4,350,100.000	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	199,332	100.700	20,072,732.400	
CK ASSET HOLDINGS LTD	198,832	64.300	12,784,897.600	
香港・ドル 小計	7,195,149		252,137,002.230 (3,633,294,203)	
合計	83,265,229		282,008,310,018 (282,008,310,018)	

(2) 株式以外の有価証券

平成29年10月12日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	オーストラリア・ドル	DEXUS	63,819.000	596,069.460	
		GOODMAN GROUP	121,619.000	1,014,302.460	
		GPT GROUP	144,955.000	718,976.800	
		LENLEASE GROUP	37,363.000	689,347.350	
		MIRVAC GROUP	295,783.000	695,090.050	
		SCENTRE GROUP	383,688.000	1,507,893.840	
		STOCKLAND	193,279.000	834,965.280	
		VICINITY CENTRES	270,443.000	719,378.380	
		WESTFIELD CORP	140,035.000	1,075,468.800	
	オーストラリア・ドル 小計		1,650,984.000	7,851,492.420 (689,046,975)	
	シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVNT	200,806.000	538,160.080	
		CAPITALAND COMMERCIAL TRUST-RTS	44,753.000	11,859.540	
		CAPITALAND MALL TRUST	199,000.000	407,950.000	
		SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	192,100.000	363,069.000	
シンガポール・ドル 小計		636,659.000	1,321,038.620 (109,738,678)		
投資信託受益証券 合計			2,287,643	798,785,653 (798,785,653)	
投資証券	アメリカ・ドル	AGNC INVESTMENT CORP	25,741.000	553,431.500	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	7,304.000	894,813.040	
		AMERICAN TOWER CORP	30,693.000	4,233,485.490	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	77,528.000	934,987.680	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	10,463.000	1,883,130.740	
		BOSTON PROPERTIES INC	11,168.000	1,432,631.040	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	21,975.000	413,130.000	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	6,285.000	586,956.150	

	COLONY NORTHSTAR INC	39,311.000	488,242.620	
	CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	28,166.000	2,878,846.860	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	15,118.000	1,823,533.160	
	DUKE REALTY TRUST	24,470.000	707,917.100	
	EQUINIX INC	5,753.000	2,640,454.410	
	EQUITY RESIDENTIAL	27,070.000	1,799,342.900	
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	4,524.000	1,168,549.200	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	8,141.000	655,920.370	
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	4,144.000	529,686.080	
	GGP INC	43,463.000	942,277.840	
	HCP INC	34,130.000	903,079.800	
	HOST HOTELS & RESORTS INC	51,147.000	954,914.490	
	IRON MOUNTAIN INC	19,265.000	750,179.100	
	KIMCO REALTY	32,980.000	640,471.600	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	11,649.000	488,908.530	
	MID AMERICA	8,123.000	883,782.400	
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	10,544.000	444,745.920	
	PROLOGIS INC	38,966.000	2,513,307.000	
	PUBLIC STORAGE	11,151.000	2,393,896.680	
	REALTY INCOME CORP	21,640.000	1,226,338.800	
	REGENCY CENTERS CORP	11,294.000	721,799.540	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	9,569.000	1,448,268.150	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	22,664.000	3,741,373.120	
	SL GREEN	8,203.000	860,494.700	
	THE MACERICH COMPANY	9,014.000	521,279.620	
	UDR INC	17,458.000	674,053.380	
	VENTAS INC	25,041.000	1,578,835.050	
	VEREIT INC	72,429.000	605,506.440	
	VORNADO REALTY TRUST	12,211.000	969,064.960	
	WELLTOWER INC	26,516.000	1,801,497.040	
	WEYERHAEUSER CO	51,939.000	1,786,182.210	
	アメリカ・ドル 小計	897,250.000	50,475,314.710 (5,675,949,139)	
	イギリス・ポンド			
	BRITISH LAND CO PLC	71,871.000	434,819.550	
	HAMMERSON PLC	58,616.000	312,716.360	
	INTU PROPERTIES PLC	74,712.000	172,808.850	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	61,201.000	607,725.930	
	SEGRO PLC	61,113.000	334,593.670	
	イギリス・ポンド 小計	327,513.000	1,862,664.360 (277,406,604)	
	カナダ・ドル			
	H & R REAL ESTATE INVESTMENT	10,748.000	232,479.240	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	9,675.000	238,972.500	
	SMART REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	2,582.000	77,924.760	
	カナダ・ドル 小計	23,005.000	549,376.500	

			(49,630,673)	
ユーロ	FONCIERE DES REGIONS	2,343.000	200,865.390	
	GECINA SA	3,670.000	495,266.500	
	ICADE	2,234.000	166,410.660	
	KLEPIERRE	17,042.000	562,386.000	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	7,221.000	1,497,274.350	
ユーロ 小計		32,510.000	2,922,202.900 (389,909,533)	
香港・ドル	LINK REIT	163,500.000	10,423,125.000	
香港・ドル 小計		163,500.000	10,423,125.000 (150,197,232)	
投資証券 合計		1,443,778	6,543,093,181 (6,543,093,181)	
合計			7,341,878,834 (7,341,878,834)	

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 604銘柄	61.28%	-%	-%	64.84%
	投資証券 39銘柄	-%	-%	1.91%	
イギリス・ポンド	株式 104銘柄	7.02%	-%	-%	7.30%
	投資証券 5銘柄	-%	-%	0.09%	
イスラエル・シケル	株式 8銘柄	0.10%	-%	-%	0.11%
オーストラリア・ドル	株式 61銘柄	2.49%	-%	-%	2.80%
	投資信託受 益証券 9銘柄	-%	0.23%	-%	
カナダ・ドル	株式 88銘柄	3.87%	-%	-%	3.99%
	投資証券 3銘柄	-%	-%	0.02%	
シンガポール・ドル	株式 21銘柄	0.47%	-%	-%	0.52%
	投資信託受 益証券 4銘柄	-%	0.04%	-%	
スイス・フラン	株式 35銘柄	3.27%	-%	-%	3.35%
スウェーデン・クローナ	株式 31銘柄	1.18%	-%	-%	1.21%
デンマーク・クローネ	株式 18銘柄	0.76%	-%	-%	0.78%
ニュージーランド・ドル	株式 3銘柄	0.05%	-%	-%	0.05%
ノルウェー・クローネ	株式 9銘柄	0.27%	-%	-%	0.27%
ユーロ	株式 232銘柄	12.99%	-%	-%	13.47%
	投資証券 5銘柄	-%	-%	0.13%	
香港・ドル	株式 38銘柄	1.22%	-%	-%	1.31%
	投資証券 1銘柄	-%	-%	0.05%	

(注) 「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

「外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

（単位：円）

科 目	注記 番号	平成28年10月12日現在	平成29年10月12日現在
資産の部			
流動資産			
預金		4,622,897,664	4,343,884,183
コール・ローン		292,048,366	1,165,606,740
国債証券		248,004,631,992	232,897,983,305
派生商品評価勘定		3,962,181	2,016,904
未収利息		2,264,031,939	2,192,568,974
前払費用		79,137,813	37,619,690
流動資産合計		255,266,709,955	240,639,679,796
資産合計		255,266,709,955	240,639,679,796
負債の部			
流動負債			
未払解約金		663,989,000	330,542,000
流動負債合計		663,989,000	330,542,000
負債合計		663,989,000	330,542,000
純資産の部			
元本等			
元本	1	153,207,422,796	130,195,447,784
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		101,395,298,159	110,113,690,012
元本等合計		254,602,720,955	240,309,137,796
純資産合計		254,602,720,955	240,309,137,796
負債純資産合計		255,266,709,955	240,639,679,796

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	平成28年10月12日現在	平成29年10月12日現在
1 . 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	160,412,378,404円	153,207,422,796円
同期中追加設定元本額	27,602,214,764円	21,978,306,446円
同期中一部解約元本額	34,807,170,372円	44,990,281,458円
元本の内訳		
ファンド名		
DIAM外国債券パッシブ・ファンド	4,923,309,794円	6,759,004,134円
MITO ラップ型ファンド（安定型）	17,010,648円	17,683,445円
MITO ラップ型ファンド（中立型）	50,032,973円	50,060,065円
MITO ラップ型ファンド（積極型）	71,577,949円	58,635,841円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	40,389,489円	44,669,472円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	43,876,816円	51,686,380円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	34,916,201円	39,602,572円
たわらノーロード 先進国債券	425,744,276円	1,039,135,759円
たわらノーロード 先進国債券<ラップ向け>	606,412円	606,412円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	- 円	7,570,532円
DIAM外国債券インデックスファンド<DC年金>	4,782,952,941円	4,916,674,933円

D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 1安定型	445,944,676円	455,372,807円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 2安定・成長型	1,429,659,466円	1,489,280,019円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 3成長型	1,455,334,787円	1,543,316,647円
D I A M D C バランス30イ ンデックスファンド	353,883,541円	358,729,368円
D I A M D C バランス50イ ンデックスファンド	730,899,335円	765,153,538円
D I A M D C バランス70イ ンデックスファンド	531,495,396円	582,487,469円
マネックス資産設計ファンド<隔 月分配型>	27,312,327円	25,451,454円
マネックス資産設計ファンド<育 成型>	581,807,796円	600,460,341円
マネックス資産設計ファンド エ ボリューション	8,340,436円	8,668,156円
D I A M D C 8資産バランス ファンド(新興国10)	12,331,966円	16,036,948円
D I A M D C 8資産バランス ファンド(新興国20)	22,428,978円	33,374,086円
D I A M D C 8資産バランス ファンド(新興国30)	39,976,566円	60,124,279円
クルーズコントロール	2,024,754,282円	2,885,688,666円
D I A M 8資産バランスファン ドN< D C年金>	39,881,567円	59,102,207円
D I A M D C バランス・F (成長型)	51,403,963円	94,306,759円
クルーズコントロール< D C年金 >	646,905円	962,416円
D I A Mコア資産設計ファンド (堅実型)	13,148,246円	8,481,034円
D I A Mコア資産設計ファンド (積極型)	33,073,415円	26,423,326円
ダイナミック・ナビゲーション	333,384円	365,719円
D I A Mパッシブ資産分散ファン ド	1,651,641,769円	1,481,037,130円
D I A M為替フルヘッジ型外国債 券パッシブ私募ファンド(適格機 関投資家向け)	7,895,832,420円	7,003,675,809円
D I A M外国債券パッシブファン ド(適格機関投資家向け)	4,286,933,742円	4,672,682,557円
外国債券パッシブファンド(適格 機関投資家限定)	4,756,637,427円	4,149,925,792円
D I A Mアクティブアロケーショ ン私募ファンド(適格機関投資家 限定)	281,150,448円	- 円
先進国債券パッシブファンド(適 格機関投資家限定)	- 円	576,382,992円
D I A Mワールドバランス25V A(適格機関投資家限定)	127,409,910円	105,167,308円

D I A Mグローバル・バランス ファンド25VA(適格機関投資 家限定)	1,449,457,258円	1,024,861,880円
D I A Mグローバル・バランス ファンド50VA(適格機関投資 家限定)	843,885,824円	730,837,466円
D I A M国際分散バランスファン ド30VA(適格機関投資家限 定)	89,083,952円	63,587,907円
D I A M国際分散バランスファン ド50VA(適格機関投資家限 定)	162,342,227円	132,619,902円
D I A M国内重視バランスファン ド30VA(適格機関投資家限 定)	41,481,518円	29,420,321円
D I A M国内重視バランスファン ド50VA(適格機関投資家限 定)	17,272,003円	12,367,624円
D I A M世界バランスファンド4 0VA(適格機関投資家限定)	4,610,042,461円	82,917,602円
D I A M世界バランスファンド5 0VA(適格機関投資家限定)	1,083,797,795円	91,738,276円
D I A Mバランスファンド25V A(適格機関投資家限定)	4,830,307,899円	3,915,386,296円
D I A Mバランスファンド37. 5VA(適格機関投資家限定)	2,845,837,057円	2,574,346,852円
D I A Mバランスファンド50V A(適格機関投資家限定)	4,634,610,481円	4,279,533,003円
D I A Mグローバル・アセット・ バランスVA(適格機関投資家限 定)	977,493,356円	788,955,022円
D I A Mグローバル・アセット・ バランスVA2(適格機関投資家 限定)	3,036,652,050円	745,760,084円
D I A M アクサ グローバル バランスファンド30VA(適格 機関投資家限定)	4,400,424,719円	3,711,066,612円
D I A M世界アセットバランス ファンドVA(適格機関投資家向 け)	16,488,444,970円	13,443,641,306円
D I A Mグローバル 私募ファン ド(適格機関投資家向け)	64,131,288円	13,975,529円
D I A M世界バランスファンド5 5VA(適格機関投資家限定)	2,401,530,036円	366,009,325円
D I A M世界バランスファンド3 5VA(適格機関投資家限定)	11,168,532,699円	5,331,508,870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)	16,608,296,167円	15,297,076,561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)	21,048,962,914円	19,723,402,912円

D I A Mバランス30 V A (適格 機関投資家限定)	27,742,137円	14,585,789円
D I A Mバランス50 V A (適格 機関投資家限定)	9,926,790円	16,997,854円
D I A Mバランス70 V A (適格 機関投資家限定)	1,425,740円	6,104,411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)	18,889,807,936円	17,579,189,791円
D I A M世界バランス25 V A (適格機関投資家限定)	128,259,731円	106,638,471円
D I A Mバランス20 V A (適格 機関投資家限定)	154,605,081円	124,537,679円
D I A Mバランス40 V A (適格 機関投資家限定)	237,762円	237,498円
D I A Mバランス60 V A (適格 機関投資家限定)	150,698円	156,569円
計	153,207,422,796円	130,195,447,784円
2 . 受益権の総数	153,207,422,796口	130,195,447,784口

（金融商品に関する注記）

1．金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成27年12月1日 至 平成28年10月12日	自 平成28年10月13日 至 平成29年10月12日
1． 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2． 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
3． 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成28年10月12日現在	平成29年10月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成28年10月12日現在	平成29年10月12日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
国債証券	1,779,748,901	356,950,364
合計	1,779,748,901	356,950,364

(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28年2月23日から平成28年10月12日まで及び平成29年2月22日から平成29年10月12日まで）に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	平成28年10月12日 現在				平成29年10月12日 現在			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	710,939,851	-	706,977,670	3,962,181	212,343,756	-	212,334,760	8,996
アメリカ・ドル	368,553,984	-	367,679,240	874,744	106,131,088	-	106,124,480	6,608
イギリス・ポンド	58,094,079	-	57,571,770	522,309	-	-	-	-
ユーロ	284,291,788	-	281,726,660	2,565,128	106,212,668	-	106,210,280	2,388
買 建	-	-	-	-	668,376,422	-	670,384,330	2,007,908
アメリカ・ドル	-	-	-	-	300,629,777	-	301,001,880	372,103
イギリス・ポンド	-	-	-	-	100,188,900	-	100,521,000	332,100
ユーロ	-	-	-	-	267,557,745	-	268,861,450	1,303,705
合計	710,939,851	-	706,977,670	3,962,181	880,720,178	-	882,719,090	2,016,904

(注) 時価の算定方法

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

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

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

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

2. 計算期間末日に対顧客先物売買取相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客電信売買取相場の仲値で評価しております。
3. 換算において円未満の端数は切捨てております。
上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成28年10月12日現在	平成29年10月12日現在
1口当たり純資産額	1.6618円	1.8458円
(1万口当たり純資産額)	(16,618円)	(18,458円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

平成29年10月12日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	US T N/B 0.875 07/31/19	7,000,000.000	6,923,140.000	
		US T N/B 1.0 08/31/19	13,500,000.000	13,372,290.000	
		US T N/B 1.0 09/30/19	5,000,000.000	4,950,150.000	
		US T N/B 1.0 11/30/19	6,500,000.000	6,425,835.000	
		US T N/B 1.125 05/31/19	11,000,000.000	10,937,630.000	
		US T N/B 1.25 01/31/20	10,800,000.000	10,721,484.000	
		US T N/B 1.25 10/31/19	7,000,000.000	6,959,470.000	
		US T N/B 1.25 12/15/18	15,000,000.000	14,966,550.000	
		US T N/B 1.375 01/31/20	2,000,000.000	1,991,240.000	
		US T N/B 1.375 02/28/19	13,000,000.000	12,984,660.000	
		US T N/B 1.375 03/31/20	6,300,000.000	6,266,484.000	
		US T N/B 1.375 04/30/20	12,000,000.000	11,932,440.000	
		US T N/B 1.375 05/31/20	3,500,000.000	3,478,650.000	
		US T N/B 1.375 06/30/23	7,000,000.000	6,744,010.000	
		US T N/B 1.375 09/30/18	30,100,000.000	30,087,960.000	
		US T N/B 1.375 09/30/23	11,000,000.000	10,567,700.000	
		US T N/B 1.5 08/15/26	9,600,000.000	8,981,952.000	
		US T N/B 1.5 12/31/18	17,000,000.000	17,011,900.000	
		US T N/B 1.625 02/15/26	5,500,000.000	5,226,705.000	
		US T N/B 1.625 03/31/19	15,000,000.000	15,032,700.000	
		US T N/B 1.625 05/15/26	8,500,000.000	8,057,065.000	
		US T N/B 1.625 08/15/22	9,500,000.000	9,367,095.000	
		US T N/B 1.625 11/15/22	7,500,000.000	7,373,700.000	
		US T N/B 1.75 01/31/23	5,000,000.000	4,934,750.000	
		US T N/B 1.75 03/31/22	11,700,000.000	11,619,504.000	
		US T N/B 1.75 05/15/22	11,600,000.000	11,526,572.000	
		US T N/B 1.75 05/15/23	7,000,000.000	6,891,710.000	
		US T N/B 1.75 09/30/22	5,000,000.000	4,948,400.000	
		US T N/B 1.75 10/31/20	6,000,000.000	6,013,560.000	
		US T N/B 1.75 12/31/20	9,000,000.000	9,010,530.000	
		US T N/B 1.875 06/30/20	11,000,000.000	11,076,010.000	
		US T N/B 1.875 08/31/22	7,000,000.000	6,972,630.000	
		US T N/B 2.0 02/15/22	17,500,000.000	17,588,725.000	
		US T N/B 2.0 02/15/23	9,500,000.000	9,496,200.000	
		US T N/B 2.0 02/15/25	9,500,000.000	9,362,630.000	
		US T N/B 2.0 02/28/21	6,500,000.000	6,558,370.000	
		US T N/B 2.0 05/31/21	12,000,000.000	12,091,800.000	
		US T N/B 2.0 05/31/24	10,000,000.000	9,908,500.000	
		US T N/B 2.0 08/15/25	9,000,000.000	8,838,900.000	
		US T N/B 2.0 09/30/20	6,000,000.000	6,059,520.000	

US T N/B 2.0 11/15/21	10,400,000.000	10,467,392.000	
US T N/B 2.0 11/15/26	11,000,000.000	10,711,250.000	
US T N/B 2.0 11/30/20	10,500,000.000	10,597,545.000	
US T N/B 2.125 01/31/21	8,000,000.000	8,103,120.000	
US T N/B 2.125 05/15/25	10,500,000.000	10,421,250.000	
US T N/B 2.125 06/30/22	9,500,000.000	9,580,085.000	
US T N/B 2.125 08/15/21	21,000,000.000	21,241,080.000	
US T N/B 2.125 08/31/20	3,000,000.000	3,040,530.000	
US T N/B 2.125 09/30/21	10,000,000.000	10,108,500.000	
US T N/B 2.125 12/31/21	15,700,000.000	15,858,099.000	
US T N/B 2.125 12/31/22	8,000,000.000	8,049,360.000	
US T N/B 2.25 02/15/27	12,000,000.000	11,910,000.000	
US T N/B 2.25 03/31/21	11,500,000.000	11,688,600.000	
US T N/B 2.25 08/15/46	5,500,000.000	4,821,520.000	
US T N/B 2.25 11/15/24	8,600,000.000	8,634,228.000	
US T N/B 2.25 11/15/25	10,000,000.000	9,990,600.000	
US T N/B 2.375 05/15/27	3,000,000.000	3,009,360.000	
US T N/B 2.375 08/15/24	8,900,000.000	9,019,527.000	
US T N/B 2.375 12/31/20	8,300,000.000	8,472,474.000	
US T N/B 2.5 02/15/45	5,500,000.000	5,116,705.000	
US T N/B 2.5 02/15/46	5,000,000.000	4,634,750.000	
US T N/B 2.5 05/15/24	9,000,000.000	9,197,550.000	
US T N/B 2.5 05/15/46	5,000,000.000	4,632,400.000	
US T N/B 2.5 08/15/23	8,000,000.000	8,198,080.000	
US T N/B 2.625 08/15/20	16,500,000.000	16,951,770.000	
US T N/B 2.625 11/15/20	6,000,000.000	6,169,200.000	
US T N/B 2.75 02/15/19	12,000,000.000	12,204,360.000	
US T N/B 2.75 02/15/24	12,600,000.000	13,070,484.000	
US T N/B 2.75 08/15/42	3,300,000.000	3,255,912.000	
US T N/B 2.75 08/15/47	1,100,000.000	1,070,608.000	
US T N/B 2.75 11/15/23	10,000,000.000	10,384,300.000	
US T N/B 2.75 11/15/42	3,400,000.000	3,351,108.000	
US T N/B 2.875 05/15/43	5,170,000.000	5,202,312.500	
US T N/B 2.875 08/15/45	5,500,000.000	5,509,405.000	
US T N/B 2.875 11/15/46	3,500,000.000	3,500,525.000	
US T N/B 3.0 02/15/47	5,200,000.000	5,330,364.000	
US T N/B 3.0 05/15/42	2,270,000.000	2,344,206.300	
US T N/B 3.0 05/15/45	4,700,000.000	4,825,537.000	
US T N/B 3.0 05/15/47	6,900,000.000	7,062,771.000	
US T N/B 3.0 11/15/44	5,800,000.000	5,964,430.000	
US T N/B 3.0 11/15/45	5,000,000.000	5,130,050.000	
US T N/B 3.125 02/15/42	1,800,000.000	1,900,674.000	
US T N/B 3.125 02/15/43	3,600,000.000	3,790,944.000	
US T N/B 3.125 05/15/19	13,000,000.000	13,337,610.000	
US T N/B 3.125 05/15/21	8,000,000.000	8,382,480.000	
US T N/B 3.125 08/15/44	6,100,000.000	6,420,677.000	
US T N/B 3.125 11/15/41	1,800,000.000	1,901,250.000	
US T N/B 3.375 05/15/44	5,200,000.000	5,719,584.000	
US T N/B 3.375 11/15/19	4,000,000.000	4,150,920.000	

US T N/B 3.5 02/15/39	2,000,000.000	2,255,460.000	
US T N/B 3.5 05/15/20	14,000,000.000	14,681,940.000	
US T N/B 3.625 02/15/20	17,000,000.000	17,806,820.000	
US T N/B 3.625 02/15/21	5,500,000.000	5,839,845.000	
US T N/B 3.625 02/15/44	5,000,000.000	5,735,150.000	
US T N/B 3.625 08/15/19	5,000,000.000	5,194,300.000	
US T N/B 3.625 08/15/43	5,200,000.000	5,953,584.000	
US T N/B 3.75 08/15/41	2,400,000.000	2,800,296.000	
US T N/B 3.75 11/15/43	4,900,000.000	5,730,305.000	
US T N/B 3.875 08/15/40	2,100,000.000	2,493,414.000	
US T N/B 4.25 05/15/39	1,630,000.000	2,036,603.500	
US T N/B 4.25 11/15/40	2,000,000.000	2,505,140.000	
US T N/B 4.375 02/15/38	750,000.000	951,615.000	
US T N/B 4.375 05/15/40	2,540,000.000	3,231,946.800	
US T N/B 4.375 05/15/41	2,450,000.000	3,128,331.500	
US T N/B 4.375 11/15/39	1,660,000.000	2,109,611.000	
US T N/B 4.5 02/15/36	2,000,000.000	2,567,340.000	
US T N/B 4.5 05/15/38	1,430,000.000	1,844,242.400	
US T N/B 4.5 08/15/39	1,400,000.000	1,807,190.000	
US T N/B 4.625 02/15/40	2,800,000.000	3,679,368.000	
US T N/B 4.75 02/15/41	1,800,000.000	2,414,250.000	
US T N/B 5.0 05/15/37	800,000.000	1,091,936.000	
US T N/B 5.25 11/15/28	1,500,000.000	1,921,335.000	
US T N/B 5.375 02/15/31	1,500,000.000	2,005,545.000	
US T N/B 5.5 08/15/28	1,800,000.000	2,340,630.000	
US T N/B 6.0 02/15/26	3,200,000.000	4,115,488.000	
US T N/B 6.125 11/15/27	1,400,000.000	1,879,542.000	
US T N/B 6.25 05/15/30	1,400,000.000	1,984,388.000	
US T N/B 6.25 08/15/23	10,000,000.000	12,315,600.000	
US T N/B 8.0 11/15/21	6,000,000.000	7,464,360.000	
US T N/B 8.125 08/15/19	4,000,000.000	4,480,760.000	
US T N/B 8.875 02/15/19	4,000,000.000	4,399,200.000	
アメリカ・ドル 小計	876,100,000.000 (98,517,445,000)	896,460,144.000 (100,806,943,193)	
イギリス・ポンド			
UK TREASURY 0.5 07/22/22	1,350,000.000	1,331,761.500	
UK TREASURY 1.25 07/22/27	1,200,000.000	1,182,672.000	
UK TREASURY 1.5 01/22/21	3,200,000.000	3,293,824.000	
UK TREASURY 1.5 07/22/26	3,150,000.000	3,210,543.000	
UK TREASURY 1.5 07/22/47	2,000,000.000	1,798,400.000	
UK TREASURY 1.75 07/22/19	4,400,000.000	4,500,760.000	
UK TREASURY 1.75 07/22/57	500,000.000	493,100.000	
UK TREASURY 1.75 09/07/22	3,300,000.000	3,453,978.000	
UK TREASURY 1.75 09/07/37	500,000.000	483,250.000	
UK TREASURY 2.0 07/22/20	1,500,000.000	1,560,360.000	

UK TREASURY 2.0 09/07/25	2,900,000.000	3,086,934.000	
UK TREASURY 2.25 09/07/23	2,500,000.000	2,693,375.000	
UK TREASURY 2.5 07/22/65	1,650,000.000	2,051,874.000	
UK TREASURY 2.75 09/07/24	2,000,000.000	2,230,520.000	
UK TREASURY 3.25 01/22/44	3,000,000.000	3,771,900.000	
UK TREASURY 3.5 01/22/45	2,800,000.000	3,691,800.000	
UK TREASURY 3.5 07/22/68	2,120,000.000	3,370,588.000	
UK TREASURY 3.75 07/22/52	2,100,000.000	3,112,200.000	
UK TREASURY 3.75 09/07/19	2,200,000.000	2,338,930.000	
UK TREASURY 3.75 09/07/20	2,900,000.000	3,169,613.000	
UK TREASURY 3.75 09/07/21	1,850,000.000	2,073,110.000	
UK TREASURY 4.0 01/22/60	2,100,000.000	3,486,420.000	
UK TREASURY 4.0 03/07/22	2,300,000.000	2,632,166.000	
UK TREASURY 4.25 03/07/36	2,800,000.000	3,837,960.000	
UK TREASURY 4.25 06/07/32	2,150,000.000	2,857,135.000	
UK TREASURY 4.25 09/07/39	1,700,000.000	2,395,470.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/27	1,700,000.000	2,161,720.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/40	2,150,000.000	3,065,900.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/46	2,180,000.000	3,283,516.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/49	2,070,000.000	3,232,098.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/55	2,190,000.000	3,659,928.000	
UK TREASURY 4.5 03/07/19	1,250,000.000	1,321,100.000	
UK TREASURY 4.5 09/07/34	2,650,000.000	3,686,150.000	
UK TREASURY 4.5 12/07/42	2,300,000.000	3,454,600.000	
UK TREASURY 4.75 03/07/20	1,850,000.000	2,040,346.500	
UK TREASURY 4.75 12/07/30	1,700,000.000	2,332,230.000	
UK TREASURY 4.75 12/07/38	2,000,000.000	2,981,800.000	
UK TREASURY 5.0 03/07/25	2,030,000.000	2,596,938.400	
UK TREASURY 6.0 12/07/28	1,350,000.000	1,984,770.000	
UK TREASURY 8.0 06/07/21	1,700,000.000	2,155,141.000	
イギリス・ポンド 小計	85,290,000.000 (12,702,239,700)	106,064,881.400 (15,796,242,787)	

オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN 4.5 04/15/20	4,400,000.000	4,665,936.000	
	AUSTRALIAN 5.25 03/15/19	3,700,000.000	3,876,749.000	
	AUSTRALIAN 5.75 05/15/21	3,700,000.000	4,153,657.000	
	AUSTRALIAN 1.75 11/21/20	2,400,000.000	2,372,904.000	
	AUSTRALIAN 2.0 12/21/21	1,000,000.000	988,790.000	
	AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	2,400,000.000	2,269,200.000	
	AUSTRALIAN 2.75 04/21/24	3,100,000.000	3,135,929.000	
	AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	900,000.000	839,925.000	
	AUSTRALIAN 2.75 10/21/19	1,500,000.000	1,524,045.000	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	3,200,000.000	3,176,480.000	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/28	2,200,000.000	2,172,324.000	
	AUSTRALIAN 3.0 03/21/47	1,100,000.000	983,389.000	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	3,500,000.000	3,642,205.000	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	1,900,000.000	1,963,080.000	
	AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	900,000.000	878,427.000	
	AUSTRALIAN 3.25 10/21/18	1,700,000.000	1,725,177.000	
	AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	1,650,000.000	1,754,560.500	
	AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	4,000,000.000	4,462,040.000	
	AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	1,800,000.000	2,108,484.000	
	AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	3,100,000.000	3,610,880.000	
AUSTRALIAN 5.5 04/21/23	3,000,000.000	3,472,710.000		
AUSTRALIAN 5.75 07/15/22	4,000,000.000	4,610,840.000		
オーストラリア・ドル 小計		55,150,000.000 (4,839,964,000)	58,387,731.500 (5,124,107,316)	
カナダ・ドル	CANADA 8.0 06/01/27	1,000,000.000	1,512,770.000	
	CANADA 0.5 11/01/18	4,600,000.000	4,554,644.000	
	CANADA 0.75 08/01/19	2,700,000.000	2,661,687.000	
	CANADA 0.75 09/01/20	2,400,000.000	2,342,664.000	
	CANADA 0.75 09/01/21	600,000.000	579,210.000	
	CANADA 1.0 06/01/27	800,000.000	723,560.000	
	CANADA 1.0 09/01/22	800,000.000	771,440.000	
	CANADA 1.5 03/01/20	1,500,000.000	1,497,555.000	
	CANADA 1.5 06/01/23	1,800,000.000	1,767,600.000	
	CANADA 1.5 06/01/26	1,700,000.000	1,626,288.000	
	CANADA 1.75 03/01/19	1,900,000.000	1,907,125.000	
	CANADA 2.25 06/01/25	1,800,000.000	1,834,092.000	
	CANADA 2.5 06/01/24	2,000,000.000	2,072,340.000	
	CANADA 2.75 06/01/22	3,900,000.000	4,075,656.000	
	CANADA 2.75 12/01/48	1,250,000.000	1,329,250.000	
	CANADA 2.75 12/01/64	900,000.000	981,126.000	
	CANADA 3.25 06/01/21	4,700,000.000	4,963,623.000	
	CANADA 3.5 06/01/20	3,800,000.000	3,986,276.000	
	CANADA 3.5 12/01/45	1,900,000.000	2,289,766.000	
	CANADA 3.75 06/01/19	3,700,000.000	3,831,905.000	
CANADA 4.0 06/01/41	2,000,000.000	2,547,740.000		
CANADA 5.0 06/01/37	1,860,000.000	2,609,914.800		
CANADA 5.75 06/01/29	1,600,000.000	2,180,624.000		

	CANADA 5.75 06/01/33	1,800,000.000	2,607,984.000	
カナダ・ドル 小計		51,010,000.000 (4,608,243,400)	55,254,839.800 (4,991,722,228)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE 1.25 10/01/21	1,000,000.000	990,300.000	
	SINGAPORE 2.0 07/01/20	800,000.000	814,080.000	
	SINGAPORE 2.375 06/01/25	500,000.000	515,500.000	
	SINGAPORE 2.75 03/01/46	410,000.000	433,968.600	
	SINGAPORE 2.75 04/01/42	550,000.000	582,175.000	
	SINGAPORE 2.875 07/01/29	400,000.000	427,600.000	
	SINGAPORE 2.875 09/01/30	460,000.000	491,648.000	
	SINGAPORE 3.0 09/01/24	810,000.000	868,725.000	
	SINGAPORE 3.125 09/01/22	1,600,000.000	1,712,800.000	
	SINGAPORE 3.25 09/01/20	1,340,000.000	1,410,618.000	
	SINGAPORE 3.375 09/01/33	480,000.000	543,542.400	
	SINGAPORE 3.5 03/01/27	900,000.000	1,008,243.000	
シンガポール・ドル 小計		9,250,000.000 (768,397,500)	9,799,200.000 (814,019,544)	
スウェーデン・クローナ	SWEDEN 1.0 11/12/26	7,000,000.000	7,175,000.000	
	SWEDEN 1.5 11/13/23	9,700,000.000	10,394,617.000	
	SWEDEN 2.5 05/12/25	10,300,000.000	11,829,859.000	
	SWEDEN 3.5 03/30/39	6,400,000.000	8,503,552.000	
	SWEDEN 3.5 06/01/22	16,370,000.000	18,995,911.700	
	SWEDEN 4.25 03/12/19	8,800,000.000	9,413,448.000	
	SWEDEN 5.0 12/01/20	11,410,000.000	13,307,939.400	
スウェーデン・クローナ 小計		69,980,000.000 (979,020,200)	79,620,327.100 (1,113,888,376)	
デンマーク・クローネ	DENMARK 0.25 11/15/18	4,000,000.000	4,038,840.000	
	DENMARK 0.5 11/15/27	3,000,000.000	2,982,030.000	
	DENMARK 1.5 11/15/23	5,500,000.000	6,009,300.000	
	DENMARK 1.75 11/15/25	13,470,000.000	15,083,032.500	
	DENMARK 3.0 11/15/21	13,000,000.000	14,777,100.000	
	DENMARK 4.0 11/15/19	12,400,000.000	13,596,600.000	
	DENMARK 4.5 11/15/39	15,200,000.000	25,467,448.000	
デンマーク・クローネ 小計		66,570,000.000 (1,192,934,400)	81,954,350.500 (1,468,621,961)	
ノルウェー・クローネ	NORWAY 1.5 02/19/26	6,000,000.000	5,993,400.000	
	NORWAY 1.75 02/17/27	500,000.000	506,210.000	
	NORWAY 1.75 03/13/25	3,800,000.000	3,885,196.000	
	NORWAY 2.0 05/24/23	7,600,000.000	7,917,832.000	
	NORWAY 3.0 03/14/24	7,400,000.000	8,162,940.000	
	NORWAY 3.75 05/25/21	11,500,000.000	12,643,675.000	
	NORWAY 4.5 05/22/19	6,560,000.000	6,978,200.000	
ノルウェー・クローネ 小計		43,360,000.000 (616,145,600)	46,087,453.000 (654,902,707)	
ポーランド・ズロチ	POLAND 1.5 04/25/20	3,000,000.000	2,968,500.000	
	POLAND 1.75 07/25/21	2,200,000.000	2,151,380.000	
	POLAND 2.25 04/25/22	4,000,000.000	3,934,400.000	
	POLAND 2.5 07/25/26	4,200,000.000	3,940,650.000	
	POLAND 2.5 07/25/27	800,000.000	740,320.000	

	POLAND 3.25 07/25/19	4,970,000.000	5,110,651.000	
	POLAND 3.25 07/25/25	5,300,000.000	5,312,243.000	
	POLAND 4.0 10/25/23	3,100,000.000	3,280,885.000	
	POLAND 5.25 10/25/20	6,890,000.000	7,516,990.000	
	POLAND 5.5 10/25/19	2,690,000.000	2,886,370.000	
	POLAND 5.75 04/25/29	1,440,000.000	1,776,614.400	
	POLAND 5.75 09/23/22	3,200,000.000	3,645,120.000	
	POLAND 5.75 10/25/21	3,680,000.000	4,141,472.000	
	ポーランド・ズロチ 小計	45,470,000.000 (1,420,482,800)	47,405,595.400 (1,480,950,800)	
マレーシア・リングgit	MALAYSIA 3.418 08/15/22	3,000,000.000	2,960,580.000	
	MALAYSIA 3.48 03/15/23	1,220,000.000	1,200,541.000	
	MALAYSIA 3.492 03/31/20	2,200,000.000	2,205,500.000	
	MALAYSIA 3.502 05/31/27	2,570,000.000	2,448,130.600	
	MALAYSIA 3.733 06/15/28	2,000,000.000	1,920,560.000	
	MALAYSIA 3.844 04/15/33	1,210,000.000	1,145,386.000	
	MALAYSIA 3.892 03/15/27	800,000.000	784,544.000	
	MALAYSIA 4.127 04/15/32	1,850,000.000	1,797,053.000	
	MALAYSIA 4.16 07/15/21	5,500,000.000	5,612,090.000	
	MALAYSIA 4.181 07/15/24	1,430,000.000	1,453,938.200	
	MALAYSIA 4.378 11/29/19	3,680,000.000	3,759,377.600	
	MALAYSIA 4.392 04/15/26	3,070,000.000	3,143,066.000	
	MALAYSIA 4.498 04/15/30	1,800,000.000	1,817,118.000	
	MALAYSIA 4.935 09/30/43	1,500,000.000	1,523,010.000	
	MALAYSIA 5.248 09/15/28	1,600,000.000	1,732,400.000	
	マレーシア・リングgit 小計	33,430,000.000 (892,246,700)	33,503,294.400 (894,202,928)	
メキシコ・ペソ	MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	13,000,000.000	16,310,710.000	
	MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	35,000,000.000	40,924,450.000	
	MEXICAN BONDS 5.0 12/11/19	26,000,000.000	25,046,840.000	
	MEXICAN BONDS 5.75 03/05/26	5,000,000.000	4,593,850.000	
	MEXICAN BONDS 6.5 06/09/22	26,000,000.000	25,629,760.000	
	MEXICAN BONDS 6.5 06/10/21	38,000,000.000	37,574,020.000	
	MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	10,000,000.000	10,248,100.000	
	MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	10,000,000.000	10,382,200.000	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	22,000,000.000	22,551,540.000	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	7,000,000.000	7,233,450.000	
	MEXICAN BONDS 8.0 06/11/20	30,000,000.000	30,843,300.000	

	MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47	5,000,000.000	5,264,250.000	
	MEXICAN BONDS 8.0 12/07/23	14,000,000.000	14,736,540.000	
	MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	31,000,000.000	34,139,680.000	
	MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	15,000,000.000	16,582,350.000	
	MEXICAN BONDS 8.5 12/13/18	25,500,000.000	25,931,205.000	
	メキシコ・ペソ 小計	312,500,000.000 (1,878,125,000)	327,992,245.000 (1,971,233,392)	
ユーロ	AUSTRIA 0.25 10/18/19	250,000.000	254,325.000	
	AUSTRIA 0.75 10/20/26	2,200,000.000	2,238,126.000	
	AUSTRIA 07/15/23	350,000.000	349,562.500	
	AUSTRIA 1.2 10/20/25	1,300,000.000	1,386,177.000	
	AUSTRIA 1.5 02/20/47	80,000.000	78,576.000	
	AUSTRIA 1.5 11/02/86	530,000.000	447,818.200	
	AUSTRIA 1.65 10/21/24	1,250,000.000	1,376,375.000	
	AUSTRIA 1.75 10/20/23	1,400,000.000	1,546,020.000	
	AUSTRIA 1.95 06/18/19	1,400,000.000	1,461,040.000	
	AUSTRIA 2.4 05/23/34	900,000.000	1,074,483.000	
	AUSTRIA 3.15 06/20/44	910,000.000	1,249,766.700	
	AUSTRIA 3.4 11/22/22	1,500,000.000	1,773,900.000	
	AUSTRIA 3.5 09/15/21	1,900,000.000	2,189,750.000	
	AUSTRIA 3.65 04/20/22	1,200,000.000	1,412,460.000	
	AUSTRIA 3.8 01/26/62	820,000.000	1,346,661.400	
	AUSTRIA 3.9 07/15/20	2,150,000.000	2,412,407.500	
	AUSTRIA 4.15 03/15/37	1,650,000.000	2,487,375.000	
	AUSTRIA 4.35 03/15/19	1,440,000.000	1,542,657.600	
	AUSTRIA 4.85 03/15/26	1,300,000.000	1,785,953.000	
	AUSTRIA 6.25 07/15/27	1,150,000.000	1,776,554.500	
	BELGIUM 0.8 06/22/25	2,000,000.000	2,061,880.000	
	BELGIUM 0.8 06/22/27	500,000.000	502,855.000	
	BELGIUM 1.0 06/22/26	1,800,000.000	1,868,670.000	
	BELGIUM 1.0 06/22/31	1,300,000.000	1,280,630.000	
	BELGIUM 1.6 06/22/47	900,000.000	861,957.000	
	BELGIUM 1.9 06/22/38	1,050,000.000	1,128,886.500	
	BELGIUM 2.15 06/22/66	700,000.000	725,480.000	
	BELGIUM 2.25 06/22/23	1,700,000.000	1,921,425.000	
	BELGIUM 2.6 06/22/24	2,600,000.000	3,017,144.000	
	BELGIUM 3.0 06/22/34	850,000.000	1,072,810.500	
	BELGIUM 3.0 09/28/19	1,300,000.000	1,391,195.000	
	BELGIUM 3.75 06/22/45	1,280,000.000	1,864,332.800	
	BELGIUM 3.75 09/28/20	2,800,000.000	3,154,396.000	
	BELGIUM 4.0 03/28/19	1,050,000.000	1,120,717.500	
	BELGIUM 4.0 03/28/22	1,800,000.000	2,145,438.000	
	BELGIUM 4.0 03/28/32	1,200,000.000	1,668,192.000	
	BELGIUM 4.25 03/28/41	2,200,000.000	3,380,058.000	

BELGIUM 4.25 09/28/21	2,150,000.000	2,546,460.000	
BELGIUM 4.25 09/28/22	2,300,000.000	2,808,254.000	
BELGIUM 4.5 03/28/26	1,600,000.000	2,143,856.000	
BELGIUM 5.0 03/28/35	2,600,000.000	4,133,818.000	
BELGIUM 5.5 03/28/28	2,700,000.000	4,007,367.000	
BUNDESUBL 0.25 10/16/20	1,000,000.000	1,025,600.000	
BUNDESUBL 0.5 04/12/19	3,100,000.000	3,158,621.000	
BUNDESUBL 04/08/22	500,000.000	508,050.000	
BUNDESUBL 04/09/21	2,200,000.000	2,240,700.000	
BUNDESUBL 1.0 10/12/18	1,800,000.000	1,831,680.000	
BUNDESSCHAT 03/15/19	2,600,000.000	2,628,340.000	
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27	3,500,000.000	3,457,930.000	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25	2,700,000.000	2,786,508.000	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26	3,200,000.000	3,276,032.000	
DEUTSCHLAND 08/15/26	2,600,000.000	2,532,816.000	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/24	2,600,000.000	2,780,050.000	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25	3,200,000.000	3,417,280.000	
DEUTSCHLAND 1.5 02/15/23	2,100,000.000	2,294,607.000	
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/23	3,800,000.000	4,159,632.000	
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/24	2,000,000.000	2,204,260.000	
DEUTSCHLAND 1.5 09/04/22	2,200,000.000	2,395,822.000	
DEUTSCHLAND 1.75 02/15/24	1,500,000.000	1,674,600.000	
DEUTSCHLAND 1.75 07/04/22	3,500,000.000	3,847,760.000	
DEUTSCHLAND 2.0 01/04/22	4,400,000.000	4,854,080.000	
DEUTSCHLAND 2.0 08/15/23	2,500,000.000	2,814,750.000	
DEUTSCHLAND 2.25 09/04/20	4,200,000.000	4,553,220.000	
DEUTSCHLAND 2.25 09/04/21	3,500,000.000	3,875,900.000	
DEUTSCHLAND 2.5 01/04/21	2,200,000.000	2,420,660.000	
DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	2,800,000.000	3,621,100.000	
DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	2,780,000.000	3,621,784.000	
DEUTSCHLAND 3.0 07/04/20	3,000,000.000	3,300,900.000	
DEUTSCHLAND 3.25 01/04/20	4,800,000.000	5,226,720.000	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/21	3,500,000.000	3,995,250.000	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	2,050,000.000	2,978,035.000	
DEUTSCHLAND 3.5 07/04/19	4,400,000.000	4,725,028.000	
DEUTSCHLAND 3.75 01/04/19	4,900,000.000	5,174,596.000	
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	2,950,000.000	4,513,942.500	
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	1,800,000.000	2,920,212.000	

DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	1,600,000.000	2,311,760.000	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	2,700,000.000	4,331,421.000	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	2,000,000.000	3,488,800.000	
DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	2,200,000.000	3,540,526.000	
DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	1,860,000.000	2,829,543.600	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/24	1,700,000.000	2,372,367.000	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	1,200,000.000	1,998,684.000	
DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	1,750,000.000	2,775,360.000	
FINLAND 0.375 09/15/20	500,000.000	512,610.000	
FINLAND 0.5 04/15/26	600,000.000	603,948.000	
FINLAND 0.75 04/15/31	450,000.000	441,157.500	
FINLAND 0.875 09/15/25	300,000.000	312,720.000	
FINLAND 09/15/23	230,000.000	229,328.400	
FINLAND 1.5 04/15/23	1,150,000.000	1,247,865.000	
FINLAND 1.625 09/15/22	400,000.000	435,304.000	
FINLAND 2.0 04/15/24	800,000.000	897,464.000	
FINLAND 2.625 07/04/42	690,000.000	897,331.200	
FINLAND 2.75 07/04/28	630,000.000	766,584.000	
FINLAND 3.375 04/15/20	980,000.000	1,076,804.400	
FINLAND 3.5 04/15/21	800,000.000	910,088.000	
FINLAND 4.0 07/04/25	800,000.000	1,027,840.000	
FINLAND 4.375 07/04/19	720,000.000	782,942.400	
FRANCE BTAN 8.5 04/25/23	1,700,000.000	2,505,851.000	
FRANCE OAT 0.25 11/25/26	3,000,000.000	2,894,640.000	
FRANCE OAT 0.5 05/25/25	3,700,000.000	3,736,334.000	
FRANCE OAT 0.5 05/25/26	2,200,000.000	2,189,330.000	
FRANCE OAT 0.5 11/25/19	500,000.000	511,250.000	
FRANCE OAT 05/25/22	2,200,000.000	2,215,554.000	
FRANCE OAT 1.0 05/25/19	1,700,000.000	1,744,030.000	
FRANCE OAT 1.0 05/25/27	2,500,000.000	2,564,400.000	
FRANCE OAT 1.0 11/25/18	1,200,000.000	1,221,312.000	
FRANCE OAT 1.0 11/25/25	4,700,000.000	4,903,839.000	
FRANCE OAT 1.25 05/25/36	2,900,000.000	2,813,870.000	
FRANCE OAT 1.5 05/25/31	4,200,000.000	4,402,440.000	
FRANCE OAT 1.75 05/25/23	4,400,000.000	4,831,816.000	
FRANCE OAT 1.75 05/25/66	1,000,000.000	933,870.000	
FRANCE OAT 1.75 06/25/39	1,000,000.000	1,039,840.000	
FRANCE OAT 1.75 11/25/24	5,060,000.000	5,586,948.400	
FRANCE OAT 2.25 05/25/24	3,200,000.000	3,638,304.000	
FRANCE OAT 2.25 10/25/22	4,000,000.000	4,473,440.000	
FRANCE OAT 2.5 05/25/30	4,300,000.000	5,043,126.000	
FRANCE OAT 2.5 10/25/20	8,700,000.000	9,484,914.000	
FRANCE OAT 2.75 10/25/27	4,940,000.000	5,889,616.200	

FRANCE OAT 3.0 04/25/22	5,300,000.000	6,075,390.000	
FRANCE OAT 3.25 05/25/45	3,200,000.000	4,272,960.000	
FRANCE OAT 3.25 10/25/21	6,300,000.000	7,206,885.000	
FRANCE OAT 3.5 04/25/20	8,300,000.000	9,144,027.000	
FRANCE OAT 3.5 04/25/26	4,840,000.000	6,057,260.000	
FRANCE OAT 3.75 04/25/21	7,200,000.000	8,262,720.000	
FRANCE OAT 3.75 10/25/19	6,600,000.000	7,188,390.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/55	2,400,000.000	3,761,040.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/60	1,840,000.000	2,952,592.800	
FRANCE OAT 4.0 10/25/38	3,710,000.000	5,424,873.300	
FRANCE OAT 4.25 04/25/19	6,200,000.000	6,664,814.000	
FRANCE OAT 4.25 10/25/18	2,400,000.000	2,521,344.000	
FRANCE OAT 4.25 10/25/23	5,900,000.000	7,397,715.000	
FRANCE OAT 4.5 04/25/41	4,000,000.000	6,324,080.000	
FRANCE OAT 4.75 04/25/35	3,600,000.000	5,555,988.000	
FRANCE OAT 5.5 04/25/29	3,650,000.000	5,496,900.000	
FRANCE OAT 5.75 10/25/32	4,200,000.000	6,874,980.000	
FRANCE OAT 6.0 10/25/25	3,590,000.000	5,199,038.000	
FRANCE OAT 8.5 10/25/19	4,200,000.000	4,982,040.000	
IRISH 0.8 03/15/22	800,000.000	834,040.000	
IRISH 1.0 05/15/26	1,200,000.000	1,230,924.000	
IRISH 1.7 05/15/37	510,000.000	518,654.700	
IRISH 2.0 02/18/45	890,000.000	923,499.600	
IRISH 2.4 05/15/30	1,100,000.000	1,262,041.000	
IRISH 3.4 03/18/24	930,000.000	1,117,590.300	
IRISH 3.9 03/20/23	650,000.000	785,694.000	
IRISH 4.4 06/18/19	1,130,000.000	1,223,586.600	
IRISH 4.5 04/18/20	1,330,000.000	1,496,622.400	
IRISH 4.5 10/18/18	530,000.000	557,146.600	
IRISH 5.0 10/18/20	1,000,000.000	1,164,280.000	
IRISH 5.4 03/13/25	1,380,000.000	1,875,944.400	
IRISH 5.9 10/18/19	950,000.000	1,073,129.500	
ITALY BTPS 0.35 11/01/21	1,700,000.000	1,689,613.000	
ITALY BTPS 0.65 11/01/20	3,600,000.000	3,648,960.000	
ITALY BTPS 0.95 03/15/23	2,500,000.000	2,491,750.000	
ITALY BTPS 1.05 12/01/19	2,000,000.000	2,047,700.000	
ITALY BTPS 1.25 12/01/26	2,100,000.000	1,976,688.000	
ITALY BTPS 1.35 04/15/22	2,500,000.000	2,569,125.000	
ITALY BTPS 1.45 09/15/22	1,500,000.000	1,543,425.000	
ITALY BTPS 1.5 06/01/25	2,500,000.000	2,464,600.000	
ITALY BTPS 1.6 06/01/26	1,500,000.000	1,464,150.000	
ITALY BTPS 1.65 03/01/32	3,100,000.000	2,780,607.000	
ITALY BTPS 1.85 05/15/24	600,000.000	615,900.000	
ITALY BTPS 2.0 12/01/25	2,700,000.000	2,740,095.000	
ITALY BTPS 2.15 12/15/21	2,200,000.000	2,341,900.000	
ITALY BTPS 2.2 06/01/27	1,500,000.000	1,513,650.000	
ITALY BTPS 2.25 09/01/36	1,000,000.000	916,400.000	
ITALY BTPS 2.45 09/01/33	1,100,000.000	1,067,143.000	
ITALY BTPS 2.5 12/01/24	4,000,000.000	4,247,800.000	

ITALY BTPS 2.7 03/01/47	1,650,000.000	1,477,080.000	
ITALY BTPS 2.8 03/01/67	1,400,000.000	1,185,520.000	
ITALY BTPS 3.25 09/01/46	2,000,000.000	2,009,480.000	
ITALY BTPS 3.5 03/01/30	3,100,000.000	3,448,161.000	
ITALY BTPS 3.75 03/01/21	3,300,000.000	3,683,889.000	
ITALY BTPS 3.75 05/01/21	2,300,000.000	2,575,310.000	
ITALY BTPS 3.75 08/01/21	2,700,000.000	3,037,770.000	
ITALY BTPS 3.75 09/01/24	1,900,000.000	2,179,376.000	
ITALY BTPS 4.0 02/01/37	4,100,000.000	4,777,320.000	
ITALY BTPS 4.0 09/01/20	4,400,000.000	4,887,520.000	
ITALY BTPS 4.25 02/01/19	3,900,000.000	4,129,359.000	
ITALY BTPS 4.25 03/01/20	4,900,000.000	5,395,880.000	
ITALY BTPS 4.25 09/01/19	6,400,000.000	6,928,576.000	
ITALY BTPS 4.5 02/01/20	4,500,000.000	4,966,650.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/19	7,900,000.000	8,419,820.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/24	3,700,000.000	4,411,769.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/26	3,600,000.000	4,344,120.000	
ITALY BTPS 4.5 05/01/23	1,400,000.000	1,658,020.000	
ITALY BTPS 4.75 08/01/23	2,900,000.000	3,492,180.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/21	3,900,000.000	4,542,720.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/28	2,900,000.000	3,587,996.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/44	2,400,000.000	3,049,512.000	
ITALY BTPS 5.0 03/01/22	4,400,000.000	5,225,880.000	
ITALY BTPS 5.0 03/01/25	3,130,000.000	3,864,172.800	
ITALY BTPS 5.0 08/01/34	3,200,000.000	4,167,040.000	
ITALY BTPS 5.0 08/01/39	2,700,000.000	3,539,160.000	
ITALY BTPS 5.0 09/01/40	2,950,000.000	3,832,345.000	
ITALY BTPS 5.25 11/01/29	3,500,000.000	4,551,750.000	
ITALY BTPS 5.5 09/01/22	3,900,000.000	4,769,544.000	
ITALY BTPS 5.5 11/01/22	2,500,000.000	3,066,500.000	
ITALY BTPS 5.75 02/01/33	2,400,000.000	3,337,200.000	
ITALY BTPS 6.0 05/01/31	4,200,000.000	5,882,100.000	
ITALY BTPS 6.5 11/01/27	3,300,000.000	4,608,450.000	
ITALY BTPS 7.25 11/01/26	2,200,000.000	3,174,160.000	
ITALY BTPS 9.0 11/01/23	2,400,000.000	3,494,160.000	
NETHERLANDS 0.25 01/15/20	2,150,000.000	2,193,580.500	
NETHERLANDS 0.25 07/15/25	1,700,000.000	1,699,065.000	
NETHERLANDS 0.5 07/15/26	1,900,000.000	1,913,870.000	
NETHERLANDS 0.75 07/15/27	1,000,000.000	1,016,870.000	
NETHERLANDS 01/15/22	1,800,000.000	1,824,282.000	
NETHERLANDS 1.25 01/15/19	560,000.000	573,916.000	
NETHERLANDS 1.75 07/15/23	2,000,000.000	2,210,740.000	
NETHERLANDS 2.0 07/15/24	2,000,000.000	2,257,460.000	

NETHERLANDS 2.25 07/15/22	1,550,000.000	1,735,581.500	
NETHERLANDS 2.5 01/15/33	1,740,000.000	2,136,824.400	
NETHERLANDS 2.75 01/15/47	1,650,000.000	2,226,988.500	
NETHERLANDS 3.25 07/15/21	2,060,000.000	2,347,576.000	
NETHERLANDS 3.5 07/15/20	2,270,000.000	2,528,326.000	
NETHERLANDS 3.75 01/15/23	1,700,000.000	2,050,540.000	
NETHERLANDS 3.75 01/15/42	1,900,000.000	2,931,130.000	
NETHERLANDS 4.0 01/15/37	2,000,000.000	3,041,000.000	
NETHERLANDS 4.0 07/15/19	2,750,000.000	2,978,250.000	
NETHERLANDS 5.5 01/15/28	1,600,000.000	2,392,960.000	
SPAIN 0.25 01/31/19	1,900,000.000	1,912,768.000	
SPAIN 0.4 04/30/22	1,300,000.000	1,302,925.000	
SPAIN 0.75 07/30/21	1,700,000.000	1,741,565.000	
SPAIN 1.15 07/30/20	2,100,000.000	2,170,959.000	
SPAIN 1.3 10/31/26	2,600,000.000	2,572,154.000	
SPAIN 1.4 01/31/20	400,000.000	414,008.000	
SPAIN 1.45 10/31/27	1,000,000.000	983,190.000	
SPAIN 1.5 04/30/27	2,000,000.000	1,991,200.000	
SPAIN 1.6 04/30/25	2,500,000.000	2,592,225.000	
SPAIN 1.95 04/30/26	2,500,000.000	2,622,875.000	
SPAIN 1.95 07/30/30	2,700,000.000	2,692,062.000	
SPAIN 2.15 10/31/25	2,600,000.000	2,779,972.000	
SPAIN 2.35 07/30/33	800,000.000	806,400.000	
SPAIN 2.75 04/30/19	2,000,000.000	2,094,000.000	
SPAIN 2.75 10/31/24	2,700,000.000	3,025,647.000	
SPAIN 2.9 10/31/46	1,500,000.000	1,508,835.000	
SPAIN 3.45 07/30/66	800,000.000	849,320.000	
SPAIN 3.75 10/31/18	1,450,000.000	1,512,350.000	
SPAIN 3.8 04/30/24	2,700,000.000	3,204,792.000	
SPAIN 4.0 04/30/20	4,000,000.000	4,417,280.000	
SPAIN 4.2 01/31/37	2,650,000.000	3,370,853.000	
SPAIN 4.3 10/31/19	4,200,000.000	4,588,416.000	
SPAIN 4.4 10/31/23	2,900,000.000	3,531,127.000	
SPAIN 4.6 07/30/19	4,100,000.000	4,457,930.000	
SPAIN 4.65 07/30/25	2,900,000.000	3,659,945.000	
SPAIN 4.7 07/30/41	2,100,000.000	2,856,147.000	
SPAIN 4.8 01/31/24	2,200,000.000	2,743,378.000	
SPAIN 4.85 10/31/20	2,900,000.000	3,330,157.000	
SPAIN 4.9 07/30/40	2,000,000.000	2,773,000.000	
SPAIN 5.15 10/31/28	2,100,000.000	2,793,840.000	
SPAIN 5.15 10/31/44	1,700,000.000	2,456,517.000	
SPAIN 5.4 01/31/23	2,700,000.000	3,387,258.000	
SPAIN 5.5 04/30/21	3,600,000.000	4,290,876.000	
SPAIN 5.75 07/30/32	2,900,000.000	4,250,849.000	

	SPAIN 5.85 01/31/22	3,700,000.000	4,585,225.000	
	SPAIN 5.9 07/30/26	2,500,000.000	3,437,350.000	
	SPAIN 6.0 01/31/29	3,000,000.000	4,297,650.000	
ユーロ 小計		616,790,000.000 (82,298,289,700)	723,537,640.200 (96,541,627,332)	
南アフリカ・ランド	SOUTH AFRICA 10.5 12/21/26	25,000,000.000	27,830,250.000	
	SOUTH AFRICA 6.25 03/31/36	14,700,000.000	10,483,305.000	
	SOUTH AFRICA 6.5 02/28/41	11,760,000.000	8,257,048.800	
	SOUTH AFRICA 6.75 03/31/21	15,160,000.000	14,763,566.000	
	SOUTH AFRICA 7.0 02/28/31	11,600,000.000	9,551,440.000	
	SOUTH AFRICA 7.75 02/28/23	10,000,000.000	9,881,200.000	
	SOUTH AFRICA 8.0 01/31/30	13,110,000.000	11,913,974.700	
	SOUTH AFRICA 8.0 12/21/18	3,000,000.000	3,030,210.000	
	SOUTH AFRICA 8.25 03/31/32	10,000,000.000	9,066,300.000	
	SOUTH AFRICA 8.5 01/31/37	10,910,000.000	9,746,994.000	
	SOUTH AFRICA 8.75 01/31/44	10,000,000.000	8,968,600.000	
	SOUTH AFRICA 8.75 02/28/48	17,000,000.000	15,276,370.000	
	SOUTH AFRICA 8.875 02/28/35	3,000,000.000	2,807,520.000	
	SOUTH AFRICA 9.0 01/31/40	8,000,000.000	7,404,080.000	
南アフリカ・ランド 小計		163,240,000.000 (1,358,156,800)	148,980,858.500 (1,239,520,743)	
国債証券 合計		212,071,690,800 (212,071,690,800)	232,897,983,305 (232,897,983,305)	
合計		212,071,690,800 (212,071,690,800)	232,897,983,305 (232,897,983,305)	

(注) 1. 各種通貨毎の小計の欄における()内の金額は、邦貨換算額であります。

2. 合計欄における()内の金額は、外貨建有価証券の邦貨換算額の合計額であり、内数で表示しております。

3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	有価証券の合計金額 に対する比率
アメリカ・ドル	国債証券 121銘柄	41.95%	43.28%
イギリス・ポンド	国債証券 40銘柄	6.57%	6.78%
オーストラリア・ドル	国債証券 22銘柄	2.13%	2.20%
カナダ・ドル	国債証券 24銘柄	2.08%	2.14%
シンガポール・ドル	国債証券 12銘柄	0.34%	0.35%
スウェーデン・クローナ	国債証券 7銘柄	0.46%	0.48%

デンマーク・クローネ	国債証券	7銘柄	0.61%	0.63%
ノルウェー・クローネ	国債証券	7銘柄	0.27%	0.28%
ポーランド・ズロチ	国債証券	13銘柄	0.62%	0.64%
マレーシア・リングgit	国債証券	15銘柄	0.37%	0.38%
メキシコ・ペソ	国債証券	16銘柄	0.82%	0.85%
ユーロ	国債証券	257銘柄	40.17%	41.45%
南アフリカ・ランド	国債証券	14銘柄	0.52%	0.53%

(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。

「外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成28年10月12日現在	平成29年10月12日現在
資産の部			
流動資産			
預金		72,308,226	182,968,793
コール・ローン		72,617,518	88,895,743
投資信託受益証券		3,799,644,381	5,872,611,317
投資証券		29,332,846,273	47,940,640,288
派生商品評価勘定		-	51,430
未収入金		213,389	39,965,487
未収配当金		124,253,600	150,259,633
流動資産合計		33,401,883,387	54,275,392,691
資産合計		33,401,883,387	54,275,392,691
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		102,960	48
未払金		29,595,231	41,013,388
未払解約金		11,476,000	18,730,000
流動負債合計		41,174,191	59,743,436
負債合計		41,174,191	59,743,436
純資産の部			
元本等			
元本	1	32,289,268,109	44,747,514,208
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		1,071,441,087	9,468,135,047
元本等合計		33,360,709,196	54,215,649,255
純資産合計		33,360,709,196	54,215,649,255
負債純資産合計		33,401,883,387	54,275,392,691

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>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>為替予約取引</p> <p>原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建資産及び負債は、決算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

項目	平成28年10月12日現在	平成29年10月12日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額 同期中追加設定元本額 同期中一部解約元本額	26,841,967,994円 23,087,438,568円 17,640,138,453円	32,289,268,109円 32,488,675,090円 20,030,428,991円
元本の内訳 ファンド名		
D I A M先進国 R E I Tインデックスファンド<為替ヘッジなし> （ファンドラップ）	90,931,487円	205,700,602円
D I A M先進国 R E I Tインデックスファンド<為替ヘッジあり> （ファンドラップ）	27,194,088円	55,826,184円
M I T O ラップ型ファンド（安定型）	10,655,424円	6,259,398円
M I T O ラップ型ファンド（中立型）	26,796,979円	17,740,502円
M I T O ラップ型ファンド（積極型）	58,355,776円	47,634,574円

グローバル8資産ラップファンド (安定型)	25,458,475円	15,606,433円
グローバル8資産ラップファンド (中立型)	23,584,286円	18,192,304円
グローバル8資産ラップファンド (積極型)	28,465,922円	32,172,218円
たわらノーロード 先進国リート	1,069,507,663円	1,496,284,921円
たわらノーロード 先進国リート <ラップ向け>	52,479,179円	284,177,943円
たわらノーロード 先進国リート <為替ヘッジあり>	- 円	94,149,398円
たわらノーロード バランス(8 資産均等型)	- 円	11,546,932円
マネックス資産設計ファンド<隔 月分配型>	25,666,170円	23,585,914円
マネックス資産設計ファンド<育 成型>	550,156,660円	549,048,886円
マネックス資産設計ファンド エ ボリューション	93,463,454円	55,119,951円
D I A M D C 8資産バランス ファンド(新興国10)	18,933,972円	24,664,290円
D I A M D C 8資産バランス ファンド(新興国20)	51,803,674円	77,113,431円
D I A M D C 8資産バランス ファンド(新興国30)	113,496,055円	165,293,844円
投資のソムリエ	2,441,448,202円	6,322,217,084円
投資のソムリエ<DC年金>	66,691,954円	346,135,212円
D I A M 8資産バランスファン ドN<DC年金>	61,217,576円	91,488,902円
投資のソムリエ<DC年金>リス ク抑制型	8,663,431円	87,517,405円
ダイナミック・ナビゲーション	267,265円	281,864円
リスク抑制世界8資産バランス ファンド	- 円	1,114,366,759円
ワールドアセットバランス(基本 コース)	- 円	1,013,678,308円
ワールドアセットバランス(リス ク抑制コース)	- 円	3,185,523,048円
投資のソムリエ(ターゲット・イ ヤー2045)	- 円	917,157円
投資のソムリエ(ターゲット・イ ヤー2055)	- 円	917,157円
リスク抑制世界8資産バランス ファンド(DC)	- 円	332,244円
D I A Mパッシブ資産分散ファン ド	1,447,767,054円	1,236,222,443円
D I A M外国リートインデックス ファンド<DC年金>	6,888,886円	14,433,432円
為替フルヘッジ型外国リート・ パッシブ・ファンド(適格機関投 資家限定)	712,540,766円	- 円

D I A Mアクティブアロケーショ ン私募ファンド(適格機関投資家 限定)	138,086,616円	- 円
D I A M世界アセットバランス ファンドV A(適格機関投資家向 け)	4,638,206,163円	3,745,380,525円
D I A Mグローバル 私募ファン ド(適格機関投資家向け)	50,484,750円	11,580,328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)	12,805,943,579円	11,765,204,391円
D I A Mグローバル・リスクファ クター・パリティ戦略ファンド (適格機関投資家限定)	2,898,424,533円	3,750,764,522円
D I A Mグローバル・リスクファ クター・パリティ戦略ファンドI I(適格機関投資家限定)	4,183,723,745円	4,158,683,455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)	- 円	4,161,300,139円
D I A M海外リートインデックス ファンド(適格機関投資家限定)	561,964,325円	560,452,108円
計	32,289,268,109円	44,747,514,208円
2 . 受益権の総数	32,289,268,109口	44,747,514,208口

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成27年12月1日 至 平成28年10月12日	自 平成28年10月13日 至 平成29年10月12日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成28年10月12日現在	平成29年10月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成28年10月12日現在	平成29年10月12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）
投資信託受益証券	141,205,033	129,995,408
投資証券	1,662,288,644	108,555,624
合計	1,803,493,677	238,551,032

（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28年6月23日から平成28年10月12日まで及び平成29年6月23日から平成29年10月12日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	平成28年10月12日 現在				平成29年10月12日 現在			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
買 建	34,300,860	-	34,197,900	102,960	44,753,738	-	44,805,120	51,382
アメリカ・ドル	34,300,860	-	34,197,900	102,960	41,551,370	-	41,602,800	51,430
ユーロ	-	-	-	-	3,202,368	-	3,202,320	48
合計	34,300,860	-	34,197,900	102,960	44,753,738	-	44,805,120	51,382

（注）時価の算定方法

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

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成28年10月12日現在	平成29年10月12日現在
1口当たり純資産額	1.0332円	1.2116円
(1万口当たり純資産額)	(10,332円)	(12,116円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

平成29年10月12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	ABACUS PROPERTY GROUP	135,430.000	511,925.400	
		ARENA REIT	98,260.000	216,172.000	
		BWP TRUST	194,640.000	587,812.800	
		CHARTER HALL GROUP	192,360.000	1,050,285.600	
		CHARTER HALL LONG WALE REIT	61,240.000	254,146.000	
		CHARTER HALL RETAIL REIT	138,290.000	551,777.100	
		CROMWELL PROPERTY GROUP	518,280.000	513,097.200	
		DEXUS	421,370.000	3,935,595.800	
		FOLKESTONE EDUCATION TRUST	81,940.000	228,612.600	
		GDI PROPERTY GROUP	201,160.000	229,322.400	
		GOODMAN GROUP	664,430.000	5,541,346.200	
		GPT GROUP	749,580.000	3,717,916.800	
		GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA	108,140.000	352,536.400	
		HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD	56,730.000	178,132.200	
		INDUSTRIA REIT	41,950.000	104,455.500	
		INGENIA COMMUNITIES GROUP	88,080.000	239,577.600	
		INVESTA OFFICE FUND	206,940.000	918,813.600	
		MIRVAC GROUP	1,547,590.000	3,636,836.500	
		NATIONAL STORAGE REIT	194,630.000	292,918.150	
		PROPERTYLINK GROUP	220,220.000	219,118.900	
		RURAL FUNDS GROUP	108,070.000	229,108.400	
		SCENTRE GROUP	2,212,490.000	8,695,085.700	
		SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	301,440.000	696,326.400	
		STOCKLAND	1,004,000.000	4,337,280.000	
		VICINITY CENTRES	1,364,540.000	3,629,676.400	
		VIVA ENERGY REIT	186,370.000	398,831.800	
		WESTFIELD CORP	793,930.000	6,097,382.400	
オーストラリア・ドル 小計			11,892,100.000	47,364,089.850 (4,156,672,525)	
カナダ・ドル		KILLAM APARTMENT REIT	15,960.000	213,066.000	
カナダ・ドル 小計			15,960.000	213,066.000 (19,248,383)	
シンガポール・ドル		AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL REIT	218,095.000	310,785.370	

ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	320,000.000	272,000.000	
ASCENDAS REAL ESTATE INVT	1,004,060.000	2,690,880.800	
ASCOTT RESIDENCE TRUST	533,015.000	644,948.150	
CACHE LOGISTICS TRUST	399,980.000	333,983.300	
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	935,310.000	1,529,231.850	
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST-RTS	140,769.000	37,303.780	
CAPITALAND MALL TRUST	1,115,060.000	2,285,873.000	
CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST	222,080.000	368,652.800	
CDL HOSPITALITY TRUSTS	319,000.000	518,375.000	
ESR REIT	425,000.000	244,375.000	
FAR EAST HOSPITALITY TRUST	326,000.000	229,830.000	
FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	244,000.000	329,400.000	
FRASERS CENTREPOINT TRUST	242,000.000	525,140.000	
FRASERS COMMERCIAL TRUST	240,080.000	336,112.000	
FRASERS LOGISTICS & INDUSTRIAL TRUST	473,000.000	520,300.000	
KEPPEL DC REIT	283,000.000	380,635.000	
KEPPEL REIT	737,000.000	869,660.000	
LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST	822,000.000	357,570.000	
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	790,000.000	1,228,450.000	
MAPLETREE GREATER CHINA COMMERCIAL TRUST	738,000.000	859,770.000	
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	489,020.000	924,247.800	
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	859,020.000	1,048,004.400	
QUE HOSPITALITY TRUST	442,320.000	353,856.000	
PARKWAY LIFE REIT	157,000.000	423,900.000	
SABANA SHARIAH COMP IND REIT	335,900.000	157,873.000	
SOILBUILD BUSINESS SPACE REIT	281,000.000	196,700.000	
SPH REIT	279,000.000	284,580.000	
STARHILL GLOBAL REIT	538,000.000	419,640.000	
SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	922,090.000	1,742,750.100	
シンガポール・ドル 小計	14,830,799.000	20,424,827.350 (1,696,690,409)	
投資信託受益証券 合計	26,738,859	5,872,611,317 (5,872,611,317)	

投資証券	アメリカ・ドル			
		ACADIA REALTY TRUST	34,470.000	1,036,512.900
		AGREE REALTY CORP	11,820.000	583,908.000
		ALEXANDER & BALDWIN INC	19,040.000	870,128.000
		ALEXANDER'S INC.	1,600.000	687,680.000
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	39,070.000	4,786,465.700
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	17,100.000	707,427.000
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	57,020.000	2,572,742.400
		AMERICAN HOMES 4 RENT	95,600.000	2,075,476.000
		APARTMENT INVT & MGMT CO-A	65,600.000	2,950,032.000
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	87,810.000	1,667,511.900
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC	19,400.000	274,316.000
		ASHFORD HOSPITALITY PRIME INC	13,350.000	136,837.500
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	36,770.000	254,080.700
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	57,560.000	10,359,648.800
		BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH REIT INC	9,570.000	108,906.600
		BOSTON PROPERTIES INC	64,330.000	8,252,252.400
		BRANDYWINE REALTY TRUST	72,230.000	1,301,584.600
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	127,470.000	2,396,436.000
		CAMDEN PROPERTY TRUST	38,590.000	3,603,920.100
		CARETRUST REIT INC	31,310.000	587,688.700
		CBL & ASSOCIATES	70,590.000	607,779.900
		CEDAR REALTY TRUST INC	30,070.000	172,902.500
		CHATHAM LODGING TRUST	16,230.000	352,191.000
		CHESAPEAKE LODGING TRUST	24,780.000	697,557.000
		CITY OFFICE REIT INC	10,150.000	135,401.000
		CLIPPER REALTY INC	5,515.000	63,643.100
		COLONY NORTHSTAR INC	230,350.000	2,860,947.000
		COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	49,940.000	1,061,724.400
		COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	6,550.000	179,273.500
		CORECIVIC INC	48,660.000	1,264,186.800
		CORESITE REALTY CORP	14,320.000	1,623,028.800
		CORPORATE OFFICE PROPERTIES	40,960.000	1,360,691.200
		COUSINS PROPERTIES INC	175,910.000	1,664,108.600
		CUBESMART	75,400.000	1,970,956.000
		CYRUSONE INC	38,180.000	2,369,069.000
		DCT INDUSTRIAL TRUST INC	38,920.000	2,305,231.600

DDR CORP	125,730.000	1,124,026.200	
DIAMONDRock HOSPITALITY CO	82,540.000	905,463.800	
DIGITAL REALTY TRUST INC	85,290.000	10,287,679.800	
DOUGLAS EMMETT INC	63,990.000	2,583,276.300	
DUKE REALTY TRUST	148,453.000	4,294,745.290	
EAST GROUP	14,130.000	1,280,036.700	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	16,110.000	333,315.900	
EDUCATION REALTY TRUST INC	30,150.000	1,098,967.500	
EMPIRE STATE REALTY TRUST INC	52,590.000	1,092,820.200	
EPR PROPERTIES	26,820.000	1,891,614.600	
EQUITY COMMONWEALTH	51,990.000	1,585,175.100	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	36,340.000	3,171,391.800	
EQUITY RESIDENTIAL	153,110.000	10,177,221.700	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	27,520.000	7,108,416.000	
EXTRA SPACE STORAGE INC	52,550.000	4,233,953.500	
FARMLAND PARTNERS INC	12,200.000	111,020.000	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	30,160.000	3,855,051.200	
FIRST INDUSTRIAL RT	50,000.000	1,544,000.000	
FOREST CITY REALTY TRUST INC	111,440.000	2,850,635.200	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST INC	25,240.000	641,853.200	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	45,560.000	484,302.800	
GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	83,430.000	3,058,543.800	
GEO GROUP INC	51,070.000	1,331,394.900	
GETTY REALTY CORP	13,960.000	410,982.400	
GGP INC	261,220.000	5,663,249.600	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	10,930.000	247,127.300	
GLADSTONE LAND CORP	3,585.000	49,042.800	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	6,945.000	63,546.750	
GLOBAL NET LEASE INC	28,460.000	630,389.000	
GOVERNMENT PROPERTIES INCOME TRUST	39,660.000	758,299.200	
GRAMERCY PROPERTY TRSUT	63,560.000	1,950,020.800	
HCP INC	195,630.000	5,176,369.800	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	51,840.000	1,655,769.600	
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA INC	83,870.000	2,494,293.800	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	16,280.000	308,831.600	

HIGHWOODS PROPERTIES INC	43,170.000	2,280,239.400	
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	68,740.000	1,998,271.800	
HOST HOTELS & RESORTS INC	308,670.000	5,762,868.900	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	64,960.000	2,156,022.400	
INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	34,930.000	367,812.900	
INFREIT INC	16,110.000	366,985.800	
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	51,790.000	325,241.200	
INVITATION HOMES INC	32,090.000	726,517.600	
IRON MOUNTAIN INC	110,330.000	4,296,250.200	
ISTAR INC	30,870.000	372,600.900	
JBG SMITH PROPERTIES	38,450.000	1,265,389.500	
KILROY REALTY CORP	41,090.000	3,000,391.800	
KIMCO REALTY	177,740.000	3,451,710.800	
KITE REALTY GROUP TRUST	34,470.000	699,051.600	
LASALLE HOTEL PROPERTIES	47,400.000	1,410,624.000	
LEXINGTON REALTY TRUST	89,240.000	944,159.200	
LIBERTY PROPERTY TRUST	61,580.000	2,584,512.600	
LIFE STORAGE INC	19,510.000	1,588,309.100	
LTC PROPERTIES INC	16,310.000	766,896.200	
MACK CALI	37,030.000	878,721.900	
MANULIFE US REIT	410,000.000	369,000.000	
MEDEQUITIES REALTY TRUST INC	14,060.000	165,908.000	
MEDICAL PROPERTIES TRUST	152,340.000	1,998,700.800	
MID AMERICA	47,390.000	5,156,032.000	
MONMOUTH RE INVEST CP - CL A	30,690.000	510,988.500	
NATIONAL HEALTH INVS INC	16,880.000	1,300,266.400	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	62,370.000	2,630,766.600	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUST	18,280.000	447,677.200	
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP INC	33,990.000	300,811.500	
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	7,970.000	189,686.000	
NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP	22,880.000	312,312.000	
OMEGA HEALTHCARE INVS INC	82,440.000	2,588,616.000	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	6,990.000	176,217.900	
PARAMOUNT GROUP INC	83,570.000	1,363,026.700	

PARK HOTELS & RESORTS INC	60,270.000	1,689,368.100	
PARKWAY INC	16,170.000	307,876.800	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	28,410.000	1,036,396.800	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	28,220.000	304,776.000	
PHYSICIANS REALTY TRUST	73,240.000	1,291,221.200	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC	59,920.000	1,218,173.600	
PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES INC	13,540.000	263,623.800	
PROLOGIS INC	221,660.000	14,297,070.000	
PS BUSINESS PARKS	8,180.000	1,108,144.600	
PUBLIC STORAGE	62,370.000	13,389,591.600	
QTS REALTY TRUST INC	20,050.000	1,077,487.000	
QUALITY CARE PROPERTIES INC	38,700.000	618,039.000	
RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES	32,790.000	436,434.900	
REALTY INCOME CORP	114,290.000	6,476,814.300	
REGENCY CENTERS CORP	61,770.000	3,947,720.700	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	45,220.000	865,510.800	
RETAIL PROPERTIES OF AMERICA INC	95,100.000	1,270,536.000	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	29,310.000	880,765.500	
RLJ LODGING TRUST	73,210.000	1,604,031.100	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	21,080.000	1,354,390.000	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	73,580.000	1,555,481.200	
SAUL CENTERS INC	4,960.000	319,126.400	
SELECT INCOME REIT	26,550.000	650,209.500	
SENIOR HOUSING PPTYS TRUST	99,410.000	1,929,548.100	
SERITAGE GROWTH PROPERTIES	10,380.000	467,100.000	
SIMON PROPERTY GROUP INC	129,520.000	21,381,161.600	
SL GREEN	41,300.000	4,332,370.000	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	192,000.000	1,633,920.000	
STAG INDUSTRIAL INC	37,990.000	1,065,619.500	
STARWOOD WAYPOINT HOMES	53,690.000	1,953,779.100	
STORE CAPITAL CORP	69,210.000	1,737,863.100	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	42,980.000	680,803.200	
SUN COMMUNITIES INC	33,010.000	2,914,452.900	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	94,310.000	1,548,570.200	

	TANGER FACTORY OUTLET	39,120.000	989,736.000	
	TAUBMAN CENTERS INC	25,000.000	1,277,750.000	
	TERRENO REALTY CORP	21,590.000	795,159.700	
	THE MACERICH COMPANY	45,520.000	2,632,421.600	
	TIER REIT INC	19,780.000	391,644.000	
	UDR INC	111,670.000	4,311,578.700	
	UMH PROPERTIES INC	12,480.000	198,556.800	
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	5,170.000	390,283.300	
	URBAN EDGE PROPERTIES	43,600.000	1,096,976.000	
	URSTADT BIDDLE PROPERTIES	12,820.000	286,655.200	
	VENTAS INC	148,450.000	9,359,772.500	
	VEREIT INC	406,790.000	3,400,764.400	
	VORNADO REALTY TRUST	71,920.000	5,707,571.200	
	WASHINGTON PRIME GROUP INC	76,620.000	674,256.000	
	WASHINGTON REIT	31,690.000	1,055,910.800	
	WEINGARTEN REALTY INVST	50,030.000	1,623,473.500	
	WELLTOWER INC	153,760.000	10,446,454.400	
	WHEELER REIT INC	3,490.000	41,880.000	
	WHITESTONE REIT	16,000.000	216,320.000	
	WP CAREY INC	44,650.000	3,066,562.000	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	43,980.000	965,800.800	
	アメリカ・ドル 小計	9,639,438.000	345,645,165.740 (38,867,798,887)	
イギリス・ポンド	AEW UK LONG LEASE REIT PLC	37,060.000	37,875.320	
	ASSURA PLC	756,820.000	466,201.120	
	BIG YELLOW GROUP PLC	61,700.000	487,430.000	
	BRITISH LAND CO PLC	433,090.000	2,620,194.500	
	CAPITAL & REGIONAL PLC	209,340.000	113,462.280	
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	72,808.000	78,996.680	
	DERWENT LONDON PLC	46,360.000	1,297,152.800	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	232,350.000	232,814.700	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	135,180.000	828,653.400	
	HAMMERSON PLC	331,600.000	1,769,086.000	
	HANSTEEN HOLDINGS PLC	342,770.000	466,509.970	
	INTU PROPERTIES PLC	361,610.000	836,403.930	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	312,230.000	3,100,443.900	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	287,800.000	488,396.600	
	LXI REIT PLC	58,800.000	60,270.000	
	NEWRIVER REIT PLC	129,570.000	443,258.970	

	PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC	254,270.000	308,175.240	
	REDEFINE INTERNATIONAL PLC	546,530.000	207,681.400	
	REGIONAL REIT LTD	120,720.000	124,583.040	
	SAFESTORE HOLDINGS LTD	88,770.000	398,577.300	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT TRUST LTD	201,070.000	123,054.840	
	SEGRO PLC	415,300.000	2,273,767.500	
	SHAFTESBURY PLC	91,900.000	915,783.500	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	564,050.000	829,153.500	
	UNITE GROUP PLC	99,730.000	719,551.950	
	WORKSPACE GROUP PLC	49,570.000	447,617.100	
イギリス・ポンド 小計		6,240,998.000	19,675,095.540 (2,930,211,978)	
イスラエル・シェケル	REIT 1 LTD	69,690.000	986,113.500	
イスラエル・シェケル 小計		69,690.000	986,113.500 (31,752,855)	
カナダ・ドル	AGELLAN COMMERCIAL REIT	7,030.000	83,305.500	
	ALLIED PROPERTIES REIT	19,000.000	777,860.000	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	31,310.000	427,381.500	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	9,620.000	383,549.400	
	CANADIAN APT PPTYS REIT	27,860.000	955,876.600	
	CANADIAN REAL ESTATE INV TRUST	15,300.000	714,663.000	
	CHOICE PROPERTIES REIT	18,220.000	244,512.400	
	COMINAR REAL ESTATE INVT TR	38,500.000	530,915.000	
	CROMBIE REAL ESTATE INV	18,900.000	255,906.000	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	13,700.000	195,636.000	
	DREAM GLOBAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	34,860.000	386,946.000	
	DREAM INDUSTRIAL REIT	12,250.000	111,475.000	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV TRUST	16,160.000	340,006.400	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	9,750.000	494,130.000	
	H & R REAL ESTATE INVESTMENT	58,760.000	1,270,978.800	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	16,990.000	139,827.700	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT	6,120.000	95,778.000	
	MORGUARD REAL ESTATE INVT TR	9,085.000	132,277.600	
	NORTHVIEW APARTMENT REIT	9,570.000	220,110.000	

	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	16,200.000	181,440.000	
	PURE INDUSTRIAL REAL ESTATE TRUST	60,900.000	394,023.000	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	66,190.000	1,634,893.000	
	SLATE OFFICE REIT	11,022.000	90,049.740	
	SLATE RETAIL REIT	7,890.000	106,436.100	
	SMART REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	26,780.000	808,220.400	
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	10,440.000	77,569.200	
カナダ・ドル 小計		572,407.000	11,053,766.340 (998,597,251)	
ニュージーランド・ドル	ARGOSY PROPERTY LTD	352,580.000	364,920.300	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	433,470.000	572,180.400	
	INVESTORE PROPERTY LTD	82,700.000	109,164.000	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	593,360.000	795,102.400	
	PRECINCT PROPERTIES	396,940.000	514,037.300	
	STRIDE STAPLED GROUP	160,040.000	259,264.800	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	128,860.000	287,357.800	
ニュージーランド・ドル 小計		2,147,950.000	2,902,027.000 (231,465,673)	
ユーロ	AEDIFICA	7,590.000	622,380.000	
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	51,500.000	631,390.000	
	ALTAREA	1,520.000	296,324.000	
	AXIARE PATRIMONIO SOCIMI SA	27,910.000	463,445.550	
	BEFIMMO	9,610.000	512,213.000	
	BENI STABILI SPA	431,310.000	307,955.340	
	COFINIMMO SA	8,140.000	884,818.000	
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	20,210.000	737,260.800	
	FONCIERE DES REGIONS	22,230.000	1,905,777.900	
	GECINA SA	19,250.000	2,597,787.500	
	GREEN REIT PLC	292,810.000	442,143.100	
	HAMBORNER REIT AG	33,640.000	310,497.200	
	HIBERNIA REIT PLC	287,880.000	417,426.000	
	HISPANIA ACTIVOS INMOBILIARIOS SOCIMI SA	44,890.000	677,614.550	
	ICADE	18,860.000	1,404,881.400	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE	133,200.000	117,482.400	
	INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	5,975.000	132,764.500	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES REIT PLC	147,360.000	215,882.400	
	KLEPIERRE	86,630.000	2,858,790.000	

	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA	39,080.000	323,387.000	
	MERCIALYS	22,710.000	390,157.800	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	139,230.000	1,557,983.700	
	NSI NV	7,570.000	251,626.800	
	RETAIL ESTATES	2,690.000	194,513.900	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	41,310.000	8,565,628.500	
	VASTNED RETAIL	6,800.000	261,766.000	
	WAREHOUSES DE PAUW	6,720.000	631,209.600	
	WERELDHAVE NV	16,650.000	658,923.750	
	ユーロ 小計	1,933,275.000	28,372,030.690 (3,785,680,055)	
	香港・ドル			
	CHAMPION REIT	846,070.000	4,619,542.200	
	FORTUNE REAL ESTATE (HK)	571,000.000	5,213,230.000	
	LINK REIT	923,020.000	58,842,525.000	
	PROSPERITY REIT	517,000.000	1,721,610.000	
	SPRING REIT	357,000.000	1,242,360.000	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	429,000.000	2,162,160.000	
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	442,000.000	2,196,740.000	
	香港・ドル 小計	4,085,090.000	75,998,167.200 (1,095,133,589)	
	投資証券 合計	24,688,848	47,940,640,288 (47,940,640,288)	
	合計		53,813,251,605 (53,813,251,605)	

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 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	投資証券 160銘柄	-%	71.69%	72.23%
イギリス・ポンド	投資証券 26銘柄	-%	5.40%	5.45%
イスラエル・シケル	投資証券 1銘柄	-%	0.06%	0.06%
オーストラリア・ドル	投資信託受益証券 27銘柄	7.67%	-%	7.72%
カナダ・ドル	投資信託受益証券 1銘柄	0.04%	-%	1.89%
	投資証券 26銘柄	-%	1.84%	
シンガポール・ドル	投資信託受益証券 30銘柄	3.13%	-%	3.15%
ニュージーランド・ドル	投資証券 7銘柄	-%	0.43%	0.43%
ユーロ	投資証券 28銘柄	-%	6.98%	7.03%
香港・ドル	投資証券 7銘柄	-%	2.02%	2.04%

(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。

「コモディティインデックス・マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位:円)

科 目	注記 番号	平成28年10月12日現在	平成29年10月12日現在
資産の部			
流動資産			
預金		29,194,253	4,651,991
コール・ローン		3,273,161	19,203,573
社債券		2,485,876,372	3,364,179,042
流動資産合計		2,518,343,786	3,388,034,606
資産合計		2,518,343,786	3,388,034,606
負債の部			
流動負債			
未払金		22,797,500	-
未払解約金		2,000,000	-
流動負債合計		24,797,500	-
負債合計		24,797,500	-
純資産の部			
元本等			
元本	1	6,786,925,196	8,614,336,937
剰余金			
剰余金又は欠損金()	2	4,293,378,910	5,226,302,331
元本等合計		2,493,546,286	3,388,034,606
純資産合計		2,493,546,286	3,388,034,606
負債純資産合計		2,518,343,786	3,388,034,606

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1 . 有価証券の評価基準及び評価方法	社債券 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 . その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、決算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目		平成28年10月12日現在	平成29年10月12日現在
1.	1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	4,928,968,096円	6,786,925,196円
	同期中追加設定元本額	2,460,719,218円	4,569,254,142円
	同期中一部解約元本額	602,762,118円	2,741,842,401円
	元本の内訳		
	ファンド名		
	D I A Mコモディティパッシブ・ファンド	6,227,100,392円	8,236,606,483円
	M I T O ラップ型ファンド（安定型）	19,989,336円	24,112,594円
	M I T O ラップ型ファンド（中立型）	58,983,541円	58,985,902円
	M I T O ラップ型ファンド（積極型）	84,913,094円	69,776,972円
	グローバル8資産ラップファンド（安定型）	47,644,368円	58,948,562円
	グローバル8資産ラップファンド（中立型）	51,905,759円	60,241,683円
	グローバル8資産ラップファンド（積極型）	41,282,537円	46,777,417円
	D I A Mグローバル 私募ファンド（適格機関投資家向け）	255,106,169円	58,887,324円
	計	6,786,925,196円	8,614,336,937円
2.	受益権の総数	6,786,925,196口	8,614,336,937口
3.	2 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は4,293,378,910円であります。	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は5,226,302,331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 平成27年12月1日 至 平成28年10月12日	自 平成28年10月13日 至 平成29年10月12日
1． 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2． 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク、流動性リスク及び特定の債券への銘柄集中リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
3． 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成28年10月12日現在	平成29年10月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありませぬ。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成28年10月12日現在	平成29年10月12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)
社債券	58,106,317	154,945,197
合計	58,106,317	154,945,197

(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28年1月21日から平成28年10月12日まで平成29年1月21日から平成29年10月12日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成28年10月12日現在	平成29年10月12日現在
1口当たり純資産額	0.3674円	0.3933円
(1万口当たり純資産額)	(3,674円)	(3,933円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

平成29年10月12日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
社債券	アメリカ・ドル	GS Commodity Index Certificate 06/05/2018	135,617,000	29,917,110.200	
	アメリカ・ドル 小計		135,617,000 (15,250,131)	29,917,110.200 (3,364,179,042)	
社債券 合計			15,250,131 (15,250,131)	3,364,179,042 (3,364,179,042)	
合計			15,250,131 (15,250,131)	3,364,179,042 (3,364,179,042)	

(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	社債券 1銘柄	99.30%	100%

(注) 「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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」の状況

貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成28年10月12日現在	平成29年10月12日現在
資産の部			
流動資産			
預金		1,065,962,937	4,636,774,438
コール・ローン		34,538,081	384,445,872
株式		35,920,091,690	56,116,574,203
投資信託受益証券		260,189,850	333,140,623
投資証券		98,681,275	123,998,335
派生商品評価勘定		15,045,065	90,629,467
未収入金		880,097	1,717,251
未収配当金		46,814,137	43,353,024
差入委託証拠金		311,085,929	953,904,110
流動資産合計		37,753,289,061	62,684,537,323
資産合計		37,753,289,061	62,684,537,323
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		699,052	1,590,811
未払金		792,710	3,251,499,722
未払解約金		436,732,000	358,385,000
流動負債合計		438,223,762	3,611,475,533
負債合計		438,223,762	3,611,475,533
純資産の部			
元本等			
元本	1	41,601,299,999	48,129,540,802
剰余金			
剰余金又は欠損金()	2	4,286,234,700	10,943,520,988
元本等合計		37,315,065,299	59,073,061,790
純資産合計		37,315,065,299	59,073,061,790
負債純資産合計		37,753,289,061	62,684,537,323

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	平成28年10月12日現在	平成29年10月12日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	39,619,567,643円	41,601,299,999円
同期中追加設定元本額	18,703,237,598円	25,159,751,529円
同期中一部解約元本額	16,721,505,242円	18,631,510,726円
元本の内訳		
ファンド名		
D I A M新興国株式インデックス ファンド< D C 年金 >	1,460,950,989円	2,533,793,262円
D I A M新興国株式インデックス ファンド< 為替ヘッジなし > (ファンドラップ)	116,851,142円	204,360,039円
M I T O ラップ型ファンド(安 定型)	6,895,928円	6,887,807円
M I T O ラップ型ファンド(中 立型)	20,266,691円	19,443,902円
M I T O ラップ型ファンド(積 極型)	29,076,623円	22,799,425円
グローバル8資産ラップファンド (安定型)	16,465,885円	17,399,331円
グローバル8資産ラップファンド (中立型)	17,826,533円	20,095,548円
グローバル8資産ラップファンド (積極型)	14,181,088円	15,397,583円
たわらノーロード 新興国株式	659,631,630円	2,545,896,989円
たわらノーロード 新興国株式< ラップ向け>	81,047,957円	751,469,487円
たわらノーロード バランス(8 資産均等型)	- 円	11,493,669円
マネックス資産設計ファンド エ ボリューション	539,443,143円	446,953,152円
D I A M D C 8資産バランス ファンド(新興国10)	38,882,124円	41,983,489円
D I A M D C 8資産バランス ファンド(新興国20)	104,443,992円	130,814,607円
D I A M D C 8資産バランス ファンド(新興国30)	226,045,440円	276,648,048円
投資のソムリエ	1,547,904,861円	4,408,438,749円
クルーズコントロール	1,491,958,601円	1,461,599,838円
投資のソムリエ< D C 年金 >	42,390,510円	241,913,905円
D I A M 8資産バランスファン ドN< D C 年金 >	125,353,913円	154,446,565円
クルーズコントロール< D C 年金 >	476,753円	487,557円
D I A Mコア資産設計ファンド (堅実型)	24,199,715円	16,062,214円
D I A Mコア資産設計ファンド (積極型)	60,932,800円	50,216,666円
投資のソムリエ< D C 年金 >リス ク抑制型	10,554,863円	65,363,772円

	ダイナミック・ナビゲーション リスク抑制世界8資産バランス ファンド	1,866,081円 - 円	1,673,502円 834,286,491円
	ワールドアセットバランス(基本 コース)	- 円	1,496,560,495円
	ワールドアセットバランス(リス ク抑制コース)	- 円	4,750,542,159円
	投資のソムリエ(ターゲット・イ ヤー2045)	- 円	667,986円
	投資のソムリエ(ターゲット・イ ヤー2055)	- 円	667,986円
	リスク抑制世界8資産バランス ファンド(DC)	- 円	253,702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)	7,078,939,545円	5,261,664,672円
	新興国株式パッシブ私募ファンド (適格機関投資家限定)	189,946,132円	- 円
	エマージング株式パッシブファン ド(適格機関投資家限定)	2,193,601,345円	2,639,978,774円
	DIAM世界アセットバランス ファンド2VA(適格機関投資家 限定)	15,625,917,469円	11,978,525,624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)	9,875,248,246円	7,720,753,807円
	計	41,601,299,999円	48,129,540,802円
2.	受益権の総数	41,601,299,999口	48,129,540,802口
3.	2 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総 額を下回っており、その差額は 4,286,234,700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 平成27年12月1日 至 平成28年10月12日	自 平成28年10月13日 至 平成29年10月12日
1． 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2． 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。</p> <p>また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。</p>	同左
3． 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成28年10月12日現在	平成29年10月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成28年10月12日現在	平成29年10月12日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
株式	2,165,428,920	6,938,738,614
投資信託受益証券	40,503,003	250,881
投資証券	10,040,595	785,878
合計	2,195,891,328	6,939,775,373

(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28年4月19日から平成28年10月12日まで及び平成29年4月19日から平成29年10月12日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	平成28年10月12日 現在				平成29年10月12日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	436,525,600	-	435,246,000	1,279,600	673,335,817	-	674,057,349	721,532
アメリカ・ドル	436,525,600	-	435,246,000	1,279,600	673,335,817	-	674,057,349	721,532
買 建	-	-	-	-	695,259,082	-	697,541,604	2,282,522
アメリカ・ドル	-	-	-	-	21,923,265	-	21,921,900	1,365
インドネシア・ルピア	-	-	-	-	70,505,722	-	71,190,000	684,278
コロンビア・ペソ	-	-	-	-	12,523,196	-	12,501,250	21,946
タイ・バーツ	-	-	-	-	63,541,367	-	63,647,250	105,883
ブラジル・レアル	-	-	-	-	261,381,708	-	260,543,564	838,144
マレーシア・リングギット	-	-	-	-	63,319,464	-	63,311,640	7,824
南アフリカ・ランド	-	-	-	-	202,064,360	-	204,426,000	2,361,640
合計	436,525,600	-	435,246,000	1,279,600	1,368,594,899	-	1,371,598,953	1,560,990

(注) 時価の算定方法

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

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

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

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

株式関連

種類	平成28年10月12日 現在				平成29年10月12日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								
先物取引								
買 建	991,418,685	-	1,004,485,098	13,066,413	2,399,916,896	-	2,487,394,562	87,477,666
合計	991,418,685	-	1,004,485,098	13,066,413	2,399,916,896	-	2,487,394,562	87,477,666

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成28年10月12日現在	平成29年10月12日現在
1口当たり純資産額	0.8970円	1.2274円
(1万口当たり純資産額)	(8,970円)	(12,274円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

平成29年10月12日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	CTIP.COM INTERNATIONAL LTD ADR	38,200	54.310	2,074,642.000	
	CIA DE MINAS BUENAVENTURA SA ADR	21,000	13.710	287,910.000	
	SURGUTNEFTEGAZ SP ADR PREF	81,000	5.070	410,670.000	
	CREDICORP LTD	6,449	203.580	1,312,887.420	
	SINA CORP	5,600	113.930	638,008.000	
	MOBILE TELESYSTEMS PJSC ADR	49,625	10.810	536,446.250	
	NETEASE INC-ADR	7,600	268.800	2,042,880.000	
	SOUTHERN COPPER CORP	7,680	41.730	320,486.400	
	LUKOIL SPON ADR	42,600	52.550	2,238,630.000	
	GAZPROM PAO ADR	533,700	4.305	2,297,578.500	
	COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK SP GDR	112,727	4.400	495,998.800	
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRADE	96,280	1.591	153,181.480	
	EFG-HERMES HOLDINGS GDR	26,843	2.265	60,799.390	
	SURGUTNEFTEGAZ ADR	76,317	5.110	389,979.870	
	SISTEMA PJSC GDR	15,837	4.765	75,463.300	
	NOVATEK PJSC GDR	9,400	120.400	1,131,760.000	
	BAIDU INC -SPON ADR	26,600	260.320	6,924,512.000	
	NOVOLIPETSK STEEL GDR	14,700	23.300	342,510.000	
	MMC NORILSK NICKEL ADR	65,300	17.580	1,147,974.000	
	ROSTELECOM SPON ADR	22,558	7.100	160,161.800	
	ROSNEFT OIL CO GDR	125,900	5.540	697,486.000	
	NEW ORIENTAL EDUCATION & TECH	13,100	91.340	1,196,554.000	
	SEVERSTAL GDR	20,607	15.680	323,117.760	
	TATNEFT ADR	25,100	44.090	1,106,659.000	
	VTB BANK OJSC GDR	272,000	2.132	579,904.000	
	DP WORLD LTD	15,640	22.200	347,208.000	
	MAGNIT PJSC GDR	31,500	39.450	1,242,675.000	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD ADR	37,700	8.150	307,255.000	
	RUSHYDRO PJSC ADR	128,960	1.455	187,636.800	
	TAL EDUCATION GROUP-ADR	27,200	34.790	946,288.000	
	SBERBANK ADR	266,500	14.485	3,860,252.500	
	PHOSAGRO PJSC GDR	16,500	14.250	235,125.000	
YY INC-ADR	4,000	90.180	360,720.000		
58.COM INC ADR	8,900	65.320	581,348.000		
AUTOHOME INC ADR	5,100	61.820	315,282.000		

	WEIBO CORP ADR	4,600	99.700	458,620.000	
	JD.COM INC ADR	63,700	39.620	2,523,794.000	
	ALIBABA GROUP HOLDING LTD-ADR	110,280	184.690	20,367,613.200	
	MOMO INC SPON ADR	9,800	32.780	321,244.000	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	37,400	42.390	1,585,386.000	
アメリカ・ドル 小計		2,484,503		60,586,647.470 (6,812,968,509)	
アラブ首長国連邦・ディルハム	DUBAI ISLAMIC BANK PJSC	126,000	6.210	782,460.000	
	EMIRATES TELECOMMUNICATIONS GROUP CO PJSC	170,000	18.000	3,060,000.000	
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK PJSC	197,247	7.320	1,443,848.040	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	129,990	10.500	1,364,895.000	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	347,000	8.700	3,018,900.000	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	330,000	2.400	792,000.000	
	EMAAR MALLS PJSC	178,166	2.270	404,436.820	
	DXB ENTERTAINMENTS PJSC	272,783	0.765	208,678.990	
	DAMAC PROPERTIES DUBAI CO PJSC	190,235	3.890	740,014.150	
アラブ首長国連邦・ディルハム 小計		1,941,421		11,815,233.000 (362,373,196)	
インド・ルピー	RELIANCE INDUSTRIES LTD	251,940	840.150	211,667,391.000	
	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	73,890	489.350	36,158,071.500	
	ASIAN PAINTS LTD	26,800	1,160.600	31,104,080.000	
	EICHER MOTORS LTD	1,300	31,243.250	40,616,225.000	
	GRASIM INDUSTRIES LTD	32,060	1,149.900	36,865,794.000	
	MAHINDRA & MAHINDRA LTD	36,550	1,319.450	48,225,897.500	
	SHREE CEMENT LTD	830	18,506.100	15,360,063.000	
	ICICI BANK LTD	230,800	267.600	61,762,080.000	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP LTD	56,690	455.000	25,793,950.000	
	STATE BANK OF INDIA LTD	168,210	251.750	42,346,867.500	
	CONTAINER CORP OF INDIA LTD	3,657	1,308.900	4,786,647.300	
	LIC HOUSING FINANCE LTD	28,660	637.500	18,270,750.000	
	TATA STEEL LTD	29,170	682.300	19,902,691.000	
	TATA MOTORS LTD	156,000	415.500	64,818,000.000	
	JSW STEEL LTD	78,900	256.450	20,233,905.000	
	TATA POWER CO LTD	114,770	81.000	9,296,370.000	
	NESTLE INDIA LTD	2,310	7,288.800	16,837,128.000	
	BHARAT HEAVY ELECTRICALS LTD	73,648	85.000	6,260,080.000	
	GAIL INDIA LTD	49,700	444.400	22,086,680.000	
	VEDANTA LTD	107,239	313.400	33,608,702.600	
AXIS BANK LTD	162,910	515.750	84,020,832.500		
TITAN COMPANY LTD	29,500	610.600	18,012,700.000		

OIL & NATURAL GAS CORP LTD	123,780	169.150	20,937,387.000	
LUPIN LTD	21,100	1,046.050	22,071,655.000	
ACC LTD	5,800	1,715.450	9,949,610.000	
BAJAJ FINANCE LTD	15,400	1,923.550	29,622,670.000	
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP	146,350	1,750.750	256,222,262.500	
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISES LTD	52,260	514.500	26,887,770.000	
INFOSYS LTD	178,540	930.700	166,167,178.000	
WIPRO LTD	113,500	290.650	32,988,775.000	
INDIAN OIL CORP LTD	56,340	418.100	23,555,754.000	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	63,100	1,218.050	76,858,955.000	
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE LTD	9,000	1,076.600	9,689,400.000	
HCL TECHNOLOGIES LTD	55,800	908.950	50,719,410.000	
DABUR INDIA LTD	52,800	317.750	16,777,200.000	
HERO MOTOCORP LTD	4,790	3,689.550	17,672,944.500	
DR REDDYS LABORATORIES LTD	10,700	2,372.150	25,382,005.000	
BHARTI AIRTEL LTD	117,270	403.550	47,324,308.500	
UNITED SPIRITS LTD	5,444	2,402.100	13,077,032.400	
SUN PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD	94,250	526.050	49,580,212.500	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	10,280	7,825.150	80,442,542.000	
GLENMARK PHARMACEUTICALS LTD	11,618	600.700	6,978,932.600	
AUROBINDO PHARMA LTD	25,500	732.100	18,668,550.000	
HAVELLS INDIA LTD	24,800	527.450	13,080,760.000	
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	62,550	352.050	22,020,727.500	
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE CO LTD	14,810	1,099.700	16,286,557.000	
CIPLA LTD/INDIA	33,400	586.150	19,577,410.000	
LARSEN & TOUBRO LTD	46,520	1,133.850	52,746,702.000	
ULTRATECH CEMENT LTD	8,610	3,951.200	34,019,832.000	
ASHOK LEYLAND LTD	113,820	124.550	14,176,281.000	
BOSCH LTD	730	21,148.100	15,438,113.000	
TATA CONSULTANCY SERVICES LTD	44,610	2,500.350	111,540,613.500	
NTPC LTD	155,200	174.850	27,136,720.000	
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	7,680	2,743.450	21,069,696.000	
YES BANK LTD	164,460	363.000	59,698,980.000	
AMBUJA CEMENTS LTD	59,360	274.000	16,264,640.000	
BHARAT FORGE LTD	17,572	639.300	11,233,779.600	
HINDALCO INDUSTRIES LTD	109,900	249.500	27,420,050.000	
ITC LTD	330,700	265.400	87,767,780.000	
UNITED PHOSPHORUS LTD	33,000	813.200	26,835,600.000	
SIEMENS INDIA LTD	6,219	1,239.600	7,709,072.400	

	GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	22,600	979.700	22,141,220.000	
	TECH MAHINDRA LTD	43,655	467.250	20,397,798.750	
	CAIRN INDIA LTD	37,231	285.350	10,623,865.850	
	IDEA CELLULAR LTD	133,167	73.200	9,747,824.400	
	MARICO LTD	45,380	314.050	14,251,589.000	
	POWER FINANCE CORP LTD	65,910	121.200	7,988,292.000	
	ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	68,449	396.950	27,170,830.550	
	RURAL ELECTRIFICATION CORP LTD	59,932	151.550	9,082,694.600	
	BAJAJ FINSERV LTD	3,720	5,301.200	19,720,464.000	
	BAJAJ AUTO LTD	8,000	3,143.900	25,151,200.000	
	COAL INDIA LTD	64,200	282.950	18,165,390.000	
	TATA MOTORS LTD	31,568	235.600	7,437,420.800	
	MAHINDRA & MAHINDRA FINANCIAL SERVICES LTD	23,715	417.250	9,895,083.750	
	BHARTI INFRATEL LTD	54,580	410.500	22,405,090.000	
	INDIABULLS HOUSING FINANCE LTD	31,030	1,260.400	39,110,212.000	
	CADILA HEALTHCARE LTD	18,146	491.250	8,914,222.500	
	IDFC BANK LTD	114,421	57.950	6,630,696.950	
	インド・ルピー 小計	4,948,801		2,732,466,669.050 (4,754,492,004)	
インドネシア・ルピア	AKR CORPORINDO TBK PT	150,400	7,250.000	1,090,400,000.000	
	UNITED TRACTORS TBK PT	157,801	34,250.000	5,404,684,250.000	
	INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK PT	432,000	8,375.000	3,618,000,000.000	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	142,600	48,875.000	6,969,575,000.000	
	PT ASTRA INTERNATIONAL TBK	1,977,600	8,025.000	15,870,240,000.000	
	TELEKOMUNIKASI INDONESIA PERSERO TBK	4,913,700	4,400.000	21,620,280,000.000	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA TBK PT	753,200	2,980.000	2,244,536,000.000	
	GUDANG GARAM TBK PT	48,100	66,000.000	3,174,600,000.000	
	HANJAYA MANDALA SAMPOERNA TBK	926,100	3,820.000	3,537,702,000.000	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA TBK PT	185,100	19,275.000	3,567,802,500.000	
	SUMMARECON AGUNG TBK PT	870,500	1,035.000	900,967,500.000	
	BANK DANAMON INDONESIA TBK PT	290,416	5,475.000	1,590,027,600.000	
	BANK MANDIRI	1,816,500	6,725.000	12,215,962,500.000	
	MATAHARI DEPARTMENT STORE TBK	251,900	9,200.000	2,317,480,000.000	
	BANK RAKYAT INDONESIA	1,078,400	15,275.000	16,472,560,000.000	
	PERUSAHAAN GAS NEGARA PT	1,064,100	1,415.000	1,505,701,500.000	

	BANK NEGARA INDONESIA PERSERO TBK PT	702,200	7,300.000	5,126,060,000.000	
	KALBE FARMA TBK PT	2,086,600	1,730.000	3,609,818,000.000	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK PT	286,500	10,450.000	2,993,925,000.000	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	958,000	20,375.000	19,519,250,000.000	
	XL AXIATA TBK PT	290,700	3,460.000	1,005,822,000.000	
	LIPPO KARAWACI TBK PT	1,560,300	735.000	1,146,820,500.000	
	MEDIA NUSANTARA CITRA TBK PT	468,500	1,450.000	679,325,000.000	
	JASA MARGA PERSERO TBK PT	200,125	6,075.000	1,215,759,375.000	
	BUMI SERPONG DAMAI PT	851,700	1,770.000	1,507,509,000.000	
	ADARO ENERGY PT	1,434,500	1,880.000	2,696,860,000.000	
	PAKUWON JATI TBK	1,912,800	610.000	1,166,808,000.000	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR TBK PT	239,000	8,725.000	2,085,275,000.000	
	TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE TBK PT	180,800	6,500.000	1,175,200,000.000	
	WASKITA KARYA PERSERO TBK PT	392,000	1,815.000	711,480,000.000	
	PT SURYA CITRA MEDIA TBK	511,300	2,150.000	1,099,295,000.000	
インドネシア・ルピア 小計		27,133,442		147,839,725,725.000 (1,241,853,696)	
カタール・リアル	QATAR INSURANCE CO SAQ	13,800	50.000	690,000.000	
	QATAR NATIONAL BANK	21,430	121.800	2,610,174.000	
	COMMERCIAL BANK OF QATAR QSC	16,651	28.440	473,554.440	
	OOREDOO QSC	8,410	85.230	716,784.300	
	DOHA BANK QSC	11,963	28.090	336,040.670	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	2,406	180.000	433,080.000	
	INDUSTRIES QATAR QSC	15,250	97.900	1,492,975.000	
	QATAR ISLAMIC BANK SAQ	5,054	94.200	476,086.800	
	QATAR GAS TRANSPORT CO LTD	36,300	15.700	569,910.000	
	MASRAF AL RAYAN	37,100	36.250	1,344,875.000	
	BARWA REAL ESTATE CO	7,916	31.550	249,749.800	
	EZDAN HOLDING GROUP QSC	81,350	9.400	764,690.000	
カタール・リアル 小計		257,630		10,157,920.010 (307,175,501)	
コロンビア・ペソ	INTERCONEXION ELECTRICA SA ESP	46,600	13,680.000	637,488,000.000	
	ECOPETROL SA	413,049	1,415.000	584,464,335.000	
	GRUPO DE INVERSIONES SURAMERICANA SA-PREF	10,138	40,620.000	411,805,560.000	
	GRUPO AVAL ACCIONES Y VALORES SA-PREF	247,861	1,340.000	332,133,740.000	
	CEMENTOS ARGOS SA	54,300	11,880.000	645,084,000.000	
	GRUPO ARGOS SA	27,199	21,100.000	573,898,900.000	

	BANCOLOMBIA SA	17,700	32,000.000	566,400,000.000	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	45,900	32,920.000	1,511,028,000.000	
	GRUPO DE INVERSIONES SURAMERICANA SA	24,660	41,600.000	1,025,856,000.000	
コロンビア・ペソ	小計	887,407		6,288,158,535.000 (238,950,025)	
タイ・パーツ	BANGKOK BANK PCL	19,700	193.500	3,811,950.000	
	BEC WORLD PLC	86,200	17.100	1,474,020.000	
	BERLI JUCKER PCL NVDR	121,000	54.500	6,594,500.000	
	KRUNG THAI BANK PCL NVDR	348,000	19.100	6,646,800.000	
	ROBINSON PCL-NVDR	39,400	68.000	2,679,200.000	
	SIAM COMMERCIAL BANK PCL NVDR	172,000	150.500	25,886,000.000	
	TRUE CORP PCL NVDR	1,023,055	6.250	6,394,093.750	
	KASIKORNBANK PCL NVDR	57,000	217.000	12,369,000.000	
	TMB BANK PCL -NVDR	1,010,000	2.560	2,585,600.000	
	IRPC PCL NVDR	863,400	6.500	5,612,100.000	
	BANPU PCL PUBLIC CO LTD NVDR	169,100	17.900	3,026,890.000	
	ELECTRICITY GENERATING PCL NVDR	20,700	234.000	4,843,800.000	
	CHAROEN POKPHAND FOODS PCL	293,200	26.750	7,843,100.000	
	ADVANCED INFO SERVICE PCL	97,500	194.000	18,915,000.000	
	HOME PRODUCT CENTER PCL- NVDR	523,520	12.100	6,334,592.000	
	DELTA ELECTRONICS THAI PCL NVDR	44,200	86.750	3,834,350.000	
	PTT PCL	103,000	430.000	44,290,000.000	
	THAI UNION GROUP PCL-NVDR	164,100	19.000	3,117,900.000	
	SIAM CEMENT PCL NVDR	11,650	502.000	5,848,300.000	
	KCE ELECTRONICS PCL-NVDR	24,900	100.500	2,502,450.000	
	AIRPORTS OF THAILAND PCL- NVDR	418,000	59.250	24,766,500.000	
	SIAM CEMENT PCL FOREIGN	26,500	502.000	13,303,000.000	
	KASIKORNBANK PCL - FOREIGN	105,700	220.000	23,254,000.000	
	CENTRAL PATTANA PCL NVDR	131,400	79.250	10,413,450.000	
	BANGKOK DUSIT MEDICAL SERVICES NVDR	397,000	20.900	8,297,300.000	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL- NVDR	37,000	213.000	7,881,000.000	
	MINOR INTERNATIONAL PCL- NVDR	219,010	41.500	9,088,915.000	
	THAI OIL PCL NVDR	81,000	98.750	7,998,750.000	
	GLOW ENERGY PCL NVDR	54,000	90.000	4,860,000.000	
	CP ALL PCL NVDR	482,000	70.000	33,740,000.000	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL	544,800	8.550	4,658,040.000	

	PTT EXPLORATION & PRODUCTION PCL NVDR	136,045	91.750	12,482,128.750	
	INDORAMA VENTURES PCL NVDR	142,022	44.750	6,355,484.500	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	203,308	82.750	16,823,737.000	
	ENERGY ABSOLUTE PCL NVDR	93,000	40.500	3,766,500.000	
	BANGKOK EXPRESSWAY & METRO PCL NVDR	740,700	7.850	5,814,495.000	
タイ・パーツ 小計		9,003,110		368,112,946.000 (1,247,902,887)	
チェコ・コルナ	KOMERCNI BANKA AS	7,100	964.000	6,844,400.000	
	O2 CZECH REPUBLIC AS	5,677	268.100	1,522,003.700	
	CEZ	15,000	450.800	6,762,000.000	
	MONETA MONEY BANK AS	55,000	75.250	4,138,750.000	
チェコ・コルナ 小計		82,777		19,267,153.700 (99,225,841)	
チリ・ペソ	BANCO SANTANDER CHILE	6,514,000	48.630	316,775,820.000	
	BANCO DE CREDITO E INVERSIONES	3,600	41,769.000	150,368,400.000	
	BANCO DE CHILE	2,348,850	99.440	233,569,644.000	
	EMPRESAS CMPC SA	116,370	1,808.900	210,501,693.000	
	EMPRESAS COPEC SA	43,910	9,142.100	401,429,611.000	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	15,170	8,611.800	130,641,006.000	
	ENTEL CHILE SA	15,970	7,283.100	116,311,107.000	
	ENEL GENERACION CHILE SA	322,190	560.750	180,668,042.500	
	ENEL AMERICAS SA	2,717,380	134.360	365,107,176.800	
	COLBUN SA	955,000	155.880	148,865,400.000	
	AGUAS ANDINAS SA	224,116	407.920	91,421,398.720	
	EMBOTELLADORA ANDINA SA	27,270	3,062.900	83,525,283.000	
	LATAM AIRLINES GROUP SA	27,396	8,694.000	238,180,824.000	
	SOCIEDAD QUIMICA Y MINERA DE CHILE SA	9,000	35,727.000	321,543,000.000	
	SACI FALABELLA	70,890	6,102.200	432,584,958.000	
	ITAU CORPBANCA	17,593,000	6.060	106,613,580.000	
	CENCOSUD SA	132,780	1,917.100	254,552,538.000	
	AES GENER SA	257,135	232.130	59,688,747.550	
ENEL CHILE SA	1,934,010	77.470	149,827,754.700		
チリ・ペソ 小計		33,328,037		3,992,175,984.270 (715,797,154)	
トルコ・リラ	AKBANK TAS	213,480	9.430	2,013,116.400	
	ANADOLU EFES BIRACILIK VE MALT SANAYII AS	21,520	20.700	445,464.000	
	ARCELIK	20,062	21.960	440,561.520	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	17,677	26.440	467,379.880	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIKALARI TAS	128,570	8.080	1,038,845.600	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	5,584	47.600	265,798.400	
	KOC HOLDING AS	70,650	16.120	1,138,878.000	

	PETKIM PETROKIMYA HOLDING	80,700	6.250	504,375.000	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI AS	105,585	4.090	431,842.650	
	TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKASI AS	10,370	30.420	315,455.400	
	TURK HAVA YOLLARI	71,400	8.850	631,890.000	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	93,210	13.180	1,228,507.800	
	TURKIYE GARANTI BANKASI AS	224,730	9.900	2,224,827.000	
	TURKIYE IS BANKASI	166,000	6.810	1,130,460.000	
	TUPRAS TURKIYE PETROL RAFINE	12,180	122.500	1,492,050.000	
	ULKER BISKUVI SANAYI AS	13,121	19.650	257,827.650	
	YAPI VE KREDI BANKASI AS	73,599	4.250	312,795.750	
	HACI OMER SABANCI HOLDING AS	93,430	10.020	936,168.600	
	COCA-COLA ICECEK AS	6,451	36.320	234,300.320	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	20,710	74.400	1,540,824.000	
	TURKIYE VAKIFLAR BANKASI TAO	63,608	6.150	391,189.200	
	TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	13,735	17.410	239,126.350	
	TURKIYE HALK BANKASI AS	61,970	11.770	729,386.900	
	TURK TELEKOMUNIKASYON AS	56,200	6.620	372,044.000	
トルコ・リラ 小計		1,644,542		18,783,114.420 (578,895,586)	
ハンガリー・フォロント	RICHTER GEDEON NYRT	13,930	6,670.000	92,913,100.000	
	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NYRT	35,200	3,020.000	106,304,000.000	
	OTP BANK NYRT	23,000	10,540.000	242,420,000.000	
ハンガリー・フォロント 小計		72,130		441,637,100.000 (190,478,080)	
パキスタン・ルピー	ENGRO CORP LTD	23,000	282.980	6,508,540.000	
	LUCKY CEMENT LTD	9,900	507.210	5,021,379.000	
	MCB BANK LTD	39,000	209.390	8,166,210.000	
	OIL & GAS DEVELOPMENT CO LTD	42,300	144.550	6,114,465.000	
	UNITED BANK LTD	51,400	190.780	9,806,092.000	
	HABIB BANK LTD	54,400	167.830	9,129,952.000	
パキスタン・ルピー 小計		220,000		44,746,638.000 (48,326,368)	
フィリピン・ペソ	AYALA LAND INC	694,400	42.500	29,512,000.000	
	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	210,370	75.500	15,882,935.000	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAND	77,686	101.600	7,892,897.600	
	AYALA CORP	24,913	1,052.000	26,208,476.000	

	ALLIANCE GLOBAL GROUP INC	340,600	16.680	5,681,208.000	
	DMCI HOLDINGS INC	351,850	16.300	5,735,155.000	
	GLOBE TELECOM INC	2,785	2,118.000	5,898,630.000	
	INTERNATIONAL CONTAINER TERM SERVICES INC	40,680	104.400	4,246,992.000	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	271,380	77.700	21,086,226.000	
	JOLLIBEE FOODS CORP	44,130	244.000	10,767,720.000	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	65,551	86.500	5,670,161.500	
	BDO UNIBANK INC	191,913	139.900	26,848,628.700	
	MEGAWORLD CORP	962,000	5.390	5,185,180.000	
	PLDT INC	7,900	1,690.000	13,351,000.000	
	ROBINSONS LAND CORP	172,400	26.750	4,611,700.000	
	SECURITY BANK CORP	23,420	250.200	5,859,684.000	
	SM PRIME HOLDINGS INC	819,075	34.900	28,585,717.500	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	88,660	144.000	12,767,040.000	
	SM INVESTMENTS CORP	23,688	928.000	21,982,464.000	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CORP	1,712,100	6.800	11,642,280.000	
	ABOITIZ POWER CORP	122,900	41.750	5,131,075.000	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	8,940	1,209.000	10,808,460.000	
フィリピン・ペソ	小計	6,257,341		285,355,630.300 (622,075,275)	
ブラジル・レアル	BRF SA	43,892	46.960	2,061,168.320	
	VALE SA	267,464	31.100	8,318,130.400	
	CIA PARANAENSE DE ENERGIA	8,018	29.010	232,602.180	
	VALE SA-PREF A	28,000	28.610	801,080.000	
	RAIA DROGASIL SA	21,600	78.350	1,692,360.000	
	TIM PARTICIPACOES SA	81,700	11.850	968,145.000	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	19,450	24.260	471,857.000	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	24,500	21.030	515,235.000	
	BANCO DO BRASIL SA	83,500	37.400	3,122,900.000	
	INVESTIMENTOS ITAU SA	384,086	11.360	4,363,216.960	
	LOJAS AMERICANAS SA	68,974	19.860	1,369,823.640	
	LOJAS AMERICANAS SA	20,670	16.910	349,529.700	
	GERDAU SA	84,430	11.020	930,418.600	
	CIA BRASILEIRA DE DISTRIBUICAO GRUPO PAO DE ACUCAR	14,906	80.850	1,205,150.100	
	PETROLEO BRASILEIRO SA	288,910	16.640	4,807,462.400	
	PETROLEO BRASILEIRO SA	380,812	16.080	6,123,456.960	
	KROTON EDUCACIONAL SA	134,868	19.780	2,667,689.040	
	CCR SA	119,020	18.110	2,155,452.200	
	WEG SA	53,540	22.750	1,218,035.000	
	BANCO BRADESCO SA PREF	296,696	36.900	10,948,082.400	
	BANCO BRADESCO SA	89,035	35.290	3,142,045.150	
	NATURA COSMETICOS SA	14,800	30.800	455,840.000	

	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	61,606	9.650	594,497.900	
	SUZANO PAPEL E CELULOSE SA	37,900	20.390	772,781.000	
	CPFL ENERGIA SA	25,874	27.370	708,171.380	
	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	312,998	45.000	14,084,910.000	
	PORTO SEGURO SA	9,400	38.780	364,532.000	
	FIBRIA CELULOSE SA	24,390	50.540	1,232,670.600	
	BRASKEM SA	17,030	45.890	781,506.700	
	ENGIE BRASIL SA	16,870	37.000	624,190.000	
	LOCALIZA RENT A CAR	15,960	58.000	925,680.000	
	TELEFONICA BRASIL S.A.	44,028	51.600	2,271,844.800	
	LOJAS RENNER SA	69,770	37.090	2,587,769.300	
	EDP - ENERGIAS DO BRASIL SA	31,864	15.490	493,573.360	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	35,352	77.200	2,729,174.400	
	COSAN SA INDUSTRIA E COMERCIO	16,500	38.250	631,125.000	
	EQUATORIAL ENERGIA SA	18,800	61.820	1,162,216.000	
	EMBRAER SA	62,560	17.800	1,113,568.000	
	M DIAS BRANCO SA	10,400	50.610	526,344.000	
	TRANSMISSORA ALIANCA DE ENERGIA ELETRICA SA	16,300	22.510	366,913.000	
	ODONTOPREV SA	22,300	16.000	356,800.000	
	BR MALLS PARTICIPACOES SA	78,065	14.010	1,093,690.650	
	JBS SA	81,500	8.600	700,900.000	
	CIA ENERGETICA DE MINAS GERAIS	75,749	8.360	633,261.640	
	CIA DE SANEAMENTO BASICO DO ESTADO DE SAO PAULO	33,798	33.500	1,132,233.000	
	MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS IMOBILIARIOS SA	8,880	74.860	664,756.800	
	DURATEX SA	27,734	9.990	277,062.660	
	SUL AMERICA SA	17,869	17.750	317,174.750	
	HYPERMARCAS SA	34,900	34.860	1,216,614.000	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BAICAO	201,116	24.040	4,834,828.640	
	QUALICORP SA	22,000	37.900	833,800.000	
	BANCO SANTANDER BRASIL SA	40,500	29.700	1,202,850.000	
	CIELO SA	119,807	21.720	2,602,208.040	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	68,400	29.100	1,990,440.000	
	AMBEV SA	457,795	21.630	9,902,105.850	
	KLABIN SA	55,200	19.240	1,062,048.000	
	RUMO SA	106,000	13.050	1,383,300.000	
ブラジル・リアル	小計	4,808,086		120,095,221.520 (4,253,772,746)	
ポーランド・ズロチ	BANK MILLENNIUM SA	52,647	7.260	382,217.220	
	MBANK	1,530	448.200	685,746.000	

	BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA	2,596	70.530	183,095.880	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	13,900	122.400	1,701,360.000	
	BANK PEKAO SA	14,880	128.000	1,904,640.000	
	ORANGE POLSKA SA	58,600	5.080	297,688.000	
	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	29,200	134.000	3,912,800.000	
	LPP SA	130	8,510.000	1,106,300.000	
	BANK ZACHODNI WBK SA	3,200	363.750	1,164,000.000	
	POWSZECHNA KASA OSZCZEDNOSCI BANK POLSKI SA	91,910	36.610	3,364,825.100	
	CCC SA	2,638	283.250	747,213.500	
	SYNTHOS SA	46,508	4.770	221,843.160	
	EUROCASH SA	9,500	39.250	372,875.000	
	GRUPA LOTOS SA	9,480	67.800	642,744.000	
	POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I GAZOWNICTWO SA	171,960	6.940	1,193,402.400	
	CYFROWY POLSAT SA	22,810	25.400	579,374.000	
	GRUPA AZOTY SA	3,853	75.120	289,437.360	
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	81,100	13.370	1,084,307.000	
	TAURON POLSKA ENERGIA SA	89,318	3.650	326,010.700	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZEN SA	59,250	47.720	2,827,410.000	
	JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA SA	4,403	101.500	446,904.500	
	ALIOR BANK SA	9,250	71.920	665,260.000	
ポーランド・ズロチ	小計	778,663		24,099,453.820 (752,866,937)	
マレーシア・リンギット	AMMB HOLDINGS BHD	138,900	4.450	618,105.000	
	GENTING PLANTATIONS BHD	22,600	10.540	238,204.000	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	438,000	6.290	2,755,020.000	
	DIGI.COM BHD	289,900	4.880	1,414,712.000	
	MALAYSIA AIRPORTS HOLDINGS BHD	84,220	8.350	703,237.000	
	RHB BANK BHD	68,080	5.110	347,888.800	
	HAP SENG CONSOLIDATED BHD	54,700	9.120	498,864.000	
	GAMUDA BHD	194,800	5.270	1,026,596.000	
	GENTING BHD	220,900	9.500	2,098,550.000	
	YTL CORP BHD	370,010	1.380	510,613.800	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP BHD	34,656	17.000	589,152.000	
	HONG LEONG BANK BHD	63,008	15.920	1,003,087.360	
	IJM CORP BHD	294,660	3.280	966,484.800	
	IOI CORP BHD	229,013	4.510	1,032,848.630	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	46,000	24.700	1,136,200.000	
	MALAYAN BANKING BHD	333,075	9.550	3,180,866.250	

ALLIANCE BANK MALAYSIA BHD	86,100	3.890	334,929.000	
MISC BHD	131,080	7.210	945,086.800	
PPB GROUP BHD	47,800	16.780	802,084.000	
PETRONAS DAGANGAN BHD	17,500	24.300	425,250.000	
PETRONAS GAS BHD	68,000	18.500	1,258,000.000	
GENTING MALAYSIA BHD	302,000	5.270	1,591,540.000	
BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD	14,700	43.100	633,570.000	
TELEKOM MALAYSIA BHD	95,000	6.150	584,250.000	
TENAGA NASIONAL BHD	328,250	14.200	4,661,150.000	
UMW HOLDINGS BHD	39,000	5.550	216,450.000	
DIALOG GROUP BHD	243,444	2.200	535,576.800	
PUBLIC BANK BHD(LLOCAL)	280,030	20.560	5,757,416.800	
YTL POWER INTERNATIONAL BHD	145,863	1.410	205,666.830	
AIRASIA BHD	147,900	3.400	502,860.000	
SIME DARBY BERHAD	232,700	9.090	2,115,243.000	
HARTALEGA HOLDINGS BHD	57,600	6.940	399,744.000	
AXIATA GROUP BERHAD	256,000	5.290	1,354,240.000	
MAXIS BHD	188,600	5.850	1,103,310.000	
PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	224,000	7.320	1,639,680.000	
SAPURA ENERGY BHD	319,200	1.450	462,840.000	
ASTRO MALAYSIA HOLDINGS BHD	235,500	2.830	666,465.000	
IHH HEALTHCARE BHD	207,300	5.910	1,225,143.000	
FELDA GLOBAL VENTURES HOLDINGS BHD	126,400	1.830	231,312.000	
WESTPORTS HOLDINGS BHD	83,500	3.870	323,145.000	
IOI PROPERTIES GROUP SDN BHD	174,548	1.980	345,605.040	
マレーシア・リンギット 小計	6,934,537		46,440,986.910 (1,239,509,940)	
メキシコ・ペソ				
ALFA SAB DE CV	287,100	21.140	6,069,294.000	
COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	47,600	137.760	6,557,376.000	
EL PUERTO DE LIVERPOOL SAB DE CV	19,100	143.700	2,744,670.000	
GRUPO FINANCIERO SANTANDER MEXICO	178,000	35.480	6,315,440.000	
GRUPO TELEVISA SAB	238,400	88.200	21,026,880.000	
GRUPO BIMBO SAB DE CV	156,500	45.630	7,141,095.000	
GRUMA SAB DE CV	20,805	267.010	5,555,143.050	
PROMOTORA Y OPERADORA DE INFRAESTRUCTURA	22,030	192.820	4,247,824.600	
GRUPO CARSO SAB DE CV	37,900	68.460	2,594,634.000	
GRUPO FINANCIERO BANORTE SAB DE CV	241,800	123.770	29,927,586.000	
MEXICHEM SAB DE CV	105,825	48.840	5,168,493.000	

	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	14,700	475.150	6,984,705.000	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO SAB DE CV	153,700	35.070	5,390,259.000	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL SURESTE SAB DE CV	19,575	341.130	6,677,619.750	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV	369,352	58.900	21,754,832.800	
	AMERICA MOVIL SAB DE CV	3,240,878	16.430	53,247,625.540	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA SA	214,700	32.810	7,044,307.000	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	43,800	127.310	5,576,178.000	
	WAL-MART DE MEXICO SAB DE CV	507,500	43.970	22,314,775.000	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL PACIFICO SAB DE CV	33,500	184.720	6,188,120.000	
	GENTERA SAB DE CV	103,000	26.360	2,715,080.000	
	INFRAESTRUCTURA ENERGETICA NOVA SAB DE CV	53,200	99.140	5,274,248.000	
	GRUPO LALA SAB DE CV	50,400	30.580	1,541,232.000	
メキシコ・ペソ 小計		6,159,365		242,057,417.740 (1,454,765,079)	
ユーロ	PIRAEUS BANK S.A	25,000	2.440	61,000.000	
	ALPHA BANK A.E.	141,000	1.630	229,830.000	
	NATIONAL BANK OF GREECE	552,000	0.289	159,528.000	
	TITAN CEMENT CO. S.A.	3,518	21.370	75,179.660	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	24,450	10.270	251,101.500	
	FF GROUP	3,130	17.800	55,714.000	
	EUROBANK ERGASIAS	151,630	0.722	109,476.860	
	OPAP SA	22,570	9.000	203,130.000	
	JUMBO SA	10,420	14.180	147,755.600	
ユーロ 小計		933,718		1,292,715.620 (172,487,045)	
韓国・ウォン	CHEIL WORLDWIDE INC	7,097	18,050.000	128,100,850.000	
	HANMI SCIENCE CO LTD	1,142	91,500.000	104,493,000.000	
	HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	3,710	104,000.000	385,840,000.000	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANC	3,020	283,000.000	854,660,000.000	
	DONGBU INSURANCE CO LTD	4,750	74,100.000	351,975,000.000	
	COWAY CO LTD	4,980	94,200.000	469,116,000.000	
	KT&G CORP	11,440	103,000.000	1,178,320,000.000	
	S-1 CORPORATION	1,579	90,000.000	142,110,000.000	
	KOREA GAS CORP	2,997	41,400.000	124,075,800.000	
	CJ CORP	1,490	166,500.000	248,085,000.000	
	KAKAO CORP	3,370	150,500.000	507,185,000.000	
	SK TELECOM CO LTD	1,900	266,500.000	506,350,000.000	
	DAELIM INDUSTRIAL CO	2,890	79,400.000	229,466,000.000	

MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD	35,200	10,100.000	355,520,000.000	
NCISOFT CORPORATION	1,720	447,000.000	768,840,000.000	
DOOSAN HEAVY INDUSTRIES AND CONSTRUCTION CO LTD	4,050	18,200.000	73,710,000.000	
DAEWOO ENGINEERING & CONSTRUCT	13,540	7,080.000	95,863,200.000	
POSCO DAEWOO CORP	3,600	19,200.000	69,120,000.000	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD	930	955,000.000	888,150,000.000	
LG CHEM LTD	4,500	385,000.000	1,732,500,000.000	
LG CHEM LTD	641	254,000.000	162,814,000.000	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD	177	624,000.000	110,448,000.000	
SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD	41,610	50,500.000	2,101,305,000.000	
HYUNDAI DEVELOPMENT CO	5,910	34,550.000	204,190,500.000	
S-OIL CORP	4,230	129,000.000	545,670,000.000	
HANWHA CHEMICAL CORPORATION	7,771	32,600.000	253,334,600.000	
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	6,600	34,950.000	230,670,000.000	
LOTTE CHEMICAL CORPORATION	1,450	377,000.000	546,650,000.000	
HOTEL SHILLA CO LTD	2,955	57,400.000	169,617,000.000	
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	3,080	148,000.000	455,840,000.000	
HYUNDAI MOBIS	6,650	242,000.000	1,609,300,000.000	
SK HYNIX INC	56,500	89,100.000	5,034,150,000.000	
HYUNDAI ENGINEERING & CONSTRUCTION CO LTD	7,478	37,450.000	280,051,100.000	
HYUNDAI MOTOR CO	2,370	92,800.000	219,936,000.000	
HYUNDAI MOTOR CO	14,970	155,000.000	2,320,350,000.000	
HYUNDAI STEEL CO	7,580	52,900.000	400,982,000.000	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	23,903	14,600.000	348,983,800.000	
KCC CORP	600	371,000.000	222,600,000.000	
KIA MOTORS CORP	26,010	32,550.000	846,625,500.000	
KOREA ZINC CO LTD	810	530,000.000	429,300,000.000	
KOREA ELECTRIC POWER CORP	25,190	37,350.000	940,846,500.000	
HANWHA CORP	3,785	46,050.000	174,299,250.000	
KOREAN AIR CO LTD	4,930	29,750.000	146,667,500.000	
OCI COMPANY LTD	1,500	97,300.000	145,950,000.000	
CJ LOGISTICS	860	166,500.000	143,190,000.000	
KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	1,930	71,500.000	137,995,000.000	
KT CORP	2,048	28,950.000	59,289,600.000	
LG ELECTRONICS INC	10,420	87,400.000	910,708,000.000	
LOTTE CONFECTIONERY CO LTD	430	166,000.000	71,380,000.000	
LOTTE CHILSUNG BEVERAGE CO LTD	47	1,354,000.000	63,638,000.000	
HANSSEM CO LTD	1,100	155,000.000	170,500,000.000	

LG CORP	9,334	82,600.000	770,988,400.000	
NH INVESTMENT & SECURITIES CO LTD	15,951	13,850.000	220,921,350.000	
GS ENGINEERING & CONSTRUCTION	5,290	25,750.000	136,217,500.000	
NAVER CORP	2,730	751,000.000	2,050,230,000.000	
HYUNDAI DEPARTMENT STORE CO LTD	1,187	86,100.000	102,200,700.000	
DONGSUH CO INC	2,798	26,900.000	75,266,200.000	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO LTD	4,030	61,300.000	247,039,000.000	
OTTOGI CORP	112	753,000.000	84,336,000.000	
AMOREPACIFIC GROUP	2,750	123,000.000	338,250,000.000	
KANGWON LAND INC	11,170	34,050.000	380,338,500.000	
POSCO	7,190	315,500.000	2,268,445,000.000	
SAMSUNG SDI CO LTD	5,370	217,000.000	1,165,290,000.000	
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO LTD	5,260	105,000.000	552,300,000.000	
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	9,500	2,732,000.000	25,954,000,000.000	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES CO LTD	23,331	11,550.000	269,473,050.000	
HANWHA TECHWIN CO LTD	3,141	34,350.000	107,893,350.000	
SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	1,720	2,208,000.000	3,797,760,000.000	
SHINSEGAE CO LTD	669	187,000.000	125,103,000.000	
HYOSUNG CORP	2,120	141,500.000	299,980,000.000	
YUHAN CORP	733	205,000.000	150,265,000.000	
HANON SYSTEMS	18,967	12,400.000	235,190,800.000	
HYUNDAI MARINE & FIRE INSURANCE CO LTD	6,280	46,800.000	293,904,000.000	
GS HOLDINGS CORP	4,910	65,800.000	323,078,000.000	
LG DISPLAY CO LTD	22,830	30,250.000	690,607,500.000	
SK NETWORKS CO LTD	14,810	7,250.000	107,372,500.000	
CELLTRION INC	7,780	146,000.000	1,135,880,000.000	
HANA FINANCIAL GROUP	28,870	48,700.000	1,405,969,000.000	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	1,753	147,500.000	258,567,500.000	
LOTTE SHOPPING CO	1,058	246,500.000	260,797,000.000	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LTD	6,870	123,000.000	845,010,000.000	
AMOREPACIFIC CORP	3,190	259,000.000	826,210,000.000	
AMOREPACIFIC CORP-PREF	752	149,500.000	112,424,000.000	
SAMSUNG CARD CO	2,877	37,150.000	106,880,550.000	
SK INNOVATION CO LTD	6,310	202,500.000	1,277,775,000.000	
CJ CHEILJEDANG CORP	770	354,000.000	272,580,000.000	
STX PAN OCEAN CO LTD	18,395	5,390.000	99,149,050.000	
KEPCO PLANT SERVICE & ENGINEERING CO LTD	1,825	42,750.000	78,018,750.000	
LG INNOTEK CO LTD	1,440	166,000.000	239,040,000.000	
SK HOLDINGS CO LTD	3,110	296,500.000	922,115,000.000	

	KB FINANCIAL GROUP INC	38,700	57,700.000	2,232,990,000.000	
	MEDY-TOX INC	430	506,600.000	217,838,000.000	
	HYUNDAI WIA CORP	1,454	64,000.000	93,056,000.000	
	KOREA AEROSPACE INDUSTRIES LTD	6,800	47,700.000	324,360,000.000	
	BNK FINANCIAL GROUP INC	26,470	10,150.000	268,670,500.000	
	HANMI PHARM CO LTD	556	463,000.000	257,428,000.000	
	HANWHA LIFE INSURANCE CO LTD	26,430	7,300.000	192,939,000.000	
	O MEDIA HOLDINGS CO LTD	1,950	79,300.000	154,635,000.000	
	E-MART CO LTD	1,970	216,500.000	426,505,000.000	
	DGB FINANCIAL GROUP INC	17,915	10,600.000	189,899,000.000	
	GS RETAIL CO LTD	2,482	34,700.000	86,125,400.000	
	HANKOOK TIRE CO LTD NEW	7,070	59,600.000	421,372,000.000	
	HYUNDAI ROBOTICS CO LTD	930	437,500.000	406,875,000.000	
	ORION CORP REPUBLIC OF KOREA	2,390	91,000.000	217,490,000.000	
	NETMARBLE GAMES CORP	1,710	152,500.000	260,775,000.000	
	BGF RETAIL CO LTD	2,450	84,600.000	207,270,000.000	
	SAMSUNG SDS CO LTD	3,260	177,500.000	578,650,000.000	
	WOORI BANK	36,660	17,800.000	652,548,000.000	
	SAMSUNG C&T CORP	7,420	142,000.000	1,053,640,000.000	
	SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	1,550	347,500.000	538,625,000.000	
	DOOSAN BOBCAT INC	2,980	36,400.000	108,472,000.000	
韓国・ウォン	小計	846,200		86,147,789,800.000 (8,563,090,306)	
香港・ドル	JIANGXI COPPER CO LTD	122,000	12.400	1,512,800.000	
	JIANGSU EXPRESS	124,000	12.080	1,497,920.000	
	CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD	162,000	5.530	895,860.000	
	CHINA MOBILE LIMITED	596,500	78.450	46,795,425.000	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	121,500	30.600	3,717,900.000	
	BEIJING ENTERPRISES	48,500	45.600	2,211,600.000	
	HUANENG POWER INTERNATIONAL IN	424,000	4.970	2,107,280.000	
	ALIBABA HEALTH INFORMATION TECHNOLOGY	276,000	4.210	1,161,960.000	
	YANZHOU COAL MINING CO LTD	186,000	7.900	1,469,400.000	
	HENGAN INTERNATIONAL GROUP	71,000	77.600	5,509,600.000	
	CHONGQING CHANGAN AUTOMOBILE	67,020	10.340	692,986.800	
	CNOOC LTD	1,731,000	10.200	17,656,200.000	
	BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	296,000	21.250	6,290,000.000	
	CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LTD	416,000	13.240	5,507,840.000	

CHINA OVERSEAS LAND & INVESTME	375,120	25.650	9,621,828.000	
CHINA RESOURCES LAND LTD	270,888	24.200	6,555,489.600	
CITIC LTD	568,000	11.620	6,600,160.000	
BEIJING CAPITAL INTERNATIONAL	150,000	12.460	1,869,000.000	
LENOVO GROUP LTD	682,000	4.330	2,953,060.000	
PETRO CHINA CO LTD	2,052,000	5.030	10,321,560.000	
CHINA UNICOM HONG KONG LTD	584,742	11.200	6,549,110.400	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS CO LTD	151,990	22.150	3,366,578.500	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL COR	2,477,200	5.790	14,342,988.000	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	92,000	20.000	1,840,000.000	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	74,000	57.700	4,269,800.000	
KUNLUN ENERGY COMPANY LTD	306,000	7.350	2,249,100.000	
COSCO SHIPPING PORTS LTD	162,000	8.950	1,449,900.000	
CHINA MERCHANTS PORT HOLDINGS CO LTD	124,000	23.650	2,932,600.000	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	374,000	6.760	2,528,240.000	
CHINA EVERBRIGHT LTD	96,000	18.260	1,752,960.000	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	164,000	24.000	3,936,000.000	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LTD	477,000	26.750	12,759,750.000	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LTD	88,000	27.200	2,393,600.000	
BYD CO LTD	63,000	76.500	4,819,500.000	
CHINA TELECOM CORP LTD	1,362,000	4.100	5,584,200.000	
CHINA OILFIELD SERVICES LTD	190,000	7.030	1,335,700.000	
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	1,170,000	1.320	1,544,400.000	
CHINA EVERBRIGHT INTERNATIONAL	235,000	10.400	2,444,000.000	
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	449,192	14.380	6,459,380.960	
AVICHINA INDUSTRY & TECHNOLOGY	225,000	4.810	1,082,250.000	
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS	191,200	14.320	2,737,984.000	
GREAT WALL MOTOR COMPANY LTD	290,000	11.300	3,277,000.000	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	722,000	23.800	17,183,600.000	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD	583,000	2.780	1,620,740.000	
SHANDONG WEIGAO GROUP MEDICAL-H	160,000	5.780	924,800.000	

SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	275,700	9.730	2,682,561.000	
WEICHAI POWER CO LTD	194,440	8.990	1,748,015.600	
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEMICAL	353,000	4.730	1,669,690.000	
SHANGHAI INDUSTRIAL	43,000	25.400	1,092,200.000	
TINGYI HOLDING CORP	186,000	12.300	2,287,800.000	
TSINGTAO BREWERY CO LTD	38,000	32.200	1,223,600.000	
GUANGDONG INVESTMENTS LTD	278,000	11.080	3,080,240.000	
CHINA RESOURCES BEER HOLDINGS	153,333	21.900	3,357,992.700	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO LTD	146,000	9.890	1,443,940.000	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	418,000	8.810	3,682,580.000	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	268,000	22.200	5,949,600.000	
TENCENT HOLDINGS LTD	551,000	351.600	193,731,600.000	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	505,500	62.200	31,442,100.000	
BEIJING ENTERPRISES WATER GROUP LTD	456,000	6.300	2,872,800.000	
GOME RETAIL HOLDINGS LTD	970,240	0.890	863,513.600	
CHINA POWER INTERNATIONAL	272,000	2.470	671,840.000	
AIR CHINA / HONG KONG	162,000	6.690	1,083,780.000	
ZTE CORP	71,288	27.700	1,974,677.600	
SHANGHAI ELECTRIC GROUP CO LTD	250,000	3.460	865,000.000	
CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD	330,500	19.200	6,345,600.000	
BANK OF COMMUNICATIONS	851,205	6.050	5,149,790.250	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT HOLDINGS LTD	192,000	11.620	2,231,040.000	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	71,500	134.500	9,616,750.000	
CHINA CONSTRUCTION BANK	8,151,530	6.900	56,245,557.000	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP HOLDINGS LTD	74,000	63.050	4,665,700.000	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	256,000	11.040	2,826,240.000	
MINTH GROUP LTD	64,000	42.350	2,710,400.000	
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS LTD	167,000	15.900	2,655,300.000	
CHINA NATIONAL BLDG MATERIAL	290,000	5.600	1,624,000.000	
BANK OF CHINA LTD	7,698,200	4.060	31,254,692.000	
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	118,500	17.560	2,080,860.000	
GUANGZHOU R&F PROPERTIES CO LTD	96,800	18.560	1,796,608.000	
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	378,970	29.150	11,046,975.500	

IND & COMM BK OF CHINA - H	7,148,235	6.400	45,748,704.000	
CHINA COMMUNICATIONS SERVICES	199,600	4.700	938,120.000	
CHINA COMMUNICATIONS CONSTRUCTION CO LTD	435,000	9.840	4,280,400.000	
CHINA COAL ENERGY CO	162,000	3.810	617,220.000	
HAITIAN INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	64,000	23.150	1,481,600.000	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC CO LTD	52,500	45.650	2,396,625.000	
HAIER ELECTRONICS GROUP CO LTD	118,000	20.300	2,395,400.000	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD	519,142	12.620	6,551,572.040	
CHINA CITIC BANK-H	872,800	5.140	4,486,192.000	
SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	69,000	127.500	8,797,500.000	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	99,000	34.350	3,400,650.000	
FOSUN INTERNATIONAL	241,528	17.920	4,328,181.760	
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP LTD	376,000	4.050	1,522,800.000	
SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD	302,000	5.190	1,567,380.000	
SOHO CHINA LTD	178,000	4.620	822,360.000	
KINGSOFT CORP LTD	80,000	18.780	1,502,400.000	
GCL POLY ENERGY HOLDINGS LTD	1,314,000	1.110	1,458,540.000	
CHINA RAILWAY GROUP LTD	376,000	6.550	2,462,800.000	
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION CORP	187,500	10.020	1,878,750.000	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	475,000	5.700	2,707,500.000	
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	256,200	34.750	8,902,950.000	
CHINA EVERGRANDE GROUP	317,000	27.750	8,796,750.000	
CRRC CORP LTD - H	387,450	7.300	2,828,385.000	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDINGS LTD	127,000	14.560	1,849,120.000	
SUN ART RETAIL GROUP LTD	235,500	7.470	1,759,185.000	
SINOPHARM GROUP CO	118,400	35.100	4,155,840.000	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD	205,805	19.200	3,951,456.000	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL BANK	212,000	5.160	1,093,920.000	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP CORP	317,000	6.130	1,943,210.000	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD	71,800	20.350	1,461,130.000	

	HUANENG RENEWABLES CORP LTD	472,000	2.660	1,255,520.000	
	SIHUAN PHARMACEUTICAL HOLDINGS GROUP LTD	325,000	2.910	945,750.000	
	SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	201,000	37.000	7,437,000.000	
	LONGFOR PROPERTIES CO LTD	139,000	19.880	2,763,320.000	
	NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	72,700	45.150	3,282,405.000	
	CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	544,880	7.510	4,092,048.800	
	CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD	257,000	3.810	979,170.000	
	AGRICULTURAL BANK OF CHINA	2,531,000	3.660	9,263,460.000	
	FAR EAST HORIZON LTD	202,000	7.590	1,533,180.000	
	CITIC SECURITIES CO LTD	215,500	17.580	3,788,490.000	
	HAITONG SECURITIES CO LTD	306,400	12.940	3,964,816.000	
	PEOPLE'S INSURANCE CO GROUP OF CHINA LTD	670,000	3.580	2,398,600.000	
	SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	49,000	35.900	1,759,100.000	
	SINOPEC ENGINEERING GROUP CO LTD	107,500	6.790	729,925.000	
	CHINA GALAXY SECURITIES CO LTD	335,000	6.970	2,334,950.000	
	HANERGY THIN FILM POWER GROUP	986,000	3.910	3,855,260.000	
	CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS CO LTD	323,000	0.420	135,660.000	
	CHINA STATE CONSTRUCTION INTERNATIONAL-RTS	18,250	0.037	675.250	
	CHINA CINDA ASSET MANAGEMENT CO LTD	842,000	3.070	2,584,940.000	
	CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS LTD	157,000	15.260	2,395,820.000	
	CHINA VANKE CO LTD-H	110,961	26.800	2,973,754.800	
	CGN POWER CO LTD	1,034,000	2.200	2,274,800.000	
	FULLSHARE HOLDINGS LTD	677,500	3.320	2,249,300.000	
	GF SECURITIES CO LTD	133,200	17.620	2,346,984.000	
	FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD	51,200	28.800	1,474,560.000	
	HUATAI SECURITIES CO LTD	155,600	17.940	2,791,464.000	
	3SBIO INC	90,000	13.180	1,186,200.000	
	CHINA HUARONG ASSET MANAGEMENT CO LTD	625,000	3.810	2,381,250.000	
香港・ドル	小計	71,031,709		855,570,138.160 (12,328,765,691)	
台湾・ドル	ACER INC	304,532	15.250	4,644,113.000	
	ASUSTEK COMPUTER INC	68,554	247.000	16,932,838.000	

REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	46,616	109.500	5,104,452.000	
ADVANCED SEMICONDUCTOR ENGINEERING INC	646,806	37.700	24,384,586.200	
ASIA CEMENT CORP	260,928	27.050	7,058,102.400	
TAIWAN BUSINESS BANK	336,171	8.350	2,807,027.850	
TAIWAN FERTILIZER CO LTD	80,000	39.450	3,156,000.000	
VANGUARD INTERNATIONAL SEMICONDUCTOR CORP	78,000	55.000	4,290,000.000	
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO LTD	57,000	64.400	3,670,800.000	
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	46,543	74.400	3,462,799.200	
QUANTA COMPUTER INC	264,858	69.000	18,275,202.000	
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	90,070	40.100	3,611,807.000	
EVA AIRWAYS CORP	158,161	14.900	2,356,598.900	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	63,760	321.500	20,498,840.000	
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	431,755	16.450	7,102,369.750	
CHINA AIRLINES	232,156	11.600	2,693,009.600	
CHENG SHIN RUBBER INDUSTRY CO	186,169	61.200	11,393,542.800	
CHINA STEEL CORP	1,203,058	24.450	29,414,768.100	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD/TAIWAN	254,146	28.700	7,293,990.200	
ADVANTECH CO LTD	33,889	210.000	7,116,690.000	
COMPAL ELECTRONICS INC	405,304	21.750	8,815,362.000	
DELTA ELECTRONICS INC	189,663	156.000	29,587,428.000	
NANYA TECHNOLOGY CORP	68,000	85.800	5,834,400.000	
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	370,327	103.000	38,143,681.000	
AU OPTRONICS CORP	814,194	12.200	9,933,166.800	
TAIWAN MOBILE CO LTD	159,800	108.000	17,258,400.000	
EVERGREEN MARINE CORP	160,392	17.600	2,822,899.200	
FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	332,824	24.550	8,170,829.200	
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	29,825	140.000	4,175,500.000	
ECLAT TEXTILE CO LTD	18,322	357.000	6,540,954.000	
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	59,285	114.000	6,758,490.000	
FORMOSA PLASTICS CORP	400,633	94.400	37,819,755.200	
FORMOSA TAFFETA CO LTD	65,000	31.250	2,031,250.000	
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE CO	284,594	94.400	26,865,673.600	
TRANSCEND INFORMATION INC	22,897	88.100	2,017,225.700	
GIANT MANUFACTURING	30,151	148.000	4,462,348.000	
MEDIATEK INC	146,507	306.000	44,831,142.000	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD	650,936	47.400	30,854,366.400	

HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	700,313	16.650	11,660,211.450	
HOTAI MOTOR CO LTD	25,000	358.000	8,950,000.000	
FAR EASTONE TELECOMMUNICATIONS CO LTD	150,000	72.600	10,890,000.000	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,017,141	13.300	13,527,975.300	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	780,920	49.200	38,421,264.000	
CHINA DEPT FINANCIAL HOLDING	1,278,403	9.250	11,825,227.750	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO LTD	854,028	18.450	15,756,816.600	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	1,510,532	107.000	161,626,924.000	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,045,495	24.100	25,196,429.500	
LARGAN PRECISION CO LTD	10,220	5,420.000	55,392,400.000	
TAISHIN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	927,977	13.300	12,342,094.100	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING CO	813,724	9.330	7,592,044.920	
INVENTEC CO LTD	254,005	23.400	5,943,717.000	
HTC CORPORATION	56,832	71.600	4,069,171.200	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	210,845	43.700	9,213,926.500	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	1,040,533	9.180	9,552,092.940	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,693,048	19.350	32,760,478.800	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO LTD	882,327	19.900	17,558,307.300	
MERIDA INDUSTRY CO LTD	16,950	138.000	2,339,100.000	
POWERTECH TECHNOLOGY INC	68,560	90.500	6,204,680.000	
NAN YA PLASTICS CORP	459,828	74.800	34,395,134.400	
WISTRON CORP	259,301	24.300	6,301,014.300	
POU CHEN CORP	210,990	37.950	8,007,070.500	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CORP	472,297	64.800	30,604,845.600	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	56,392	261.000	14,718,312.000	
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	119,480	107.000	12,784,360.000	
PHISON ELECTRONICS CORP	12,658	366.500	4,639,157.000	
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	90,656	28.600	2,592,761.600	
RUENTEX INDUSTRIES LTD	47,715	45.900	2,190,118.500	
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	88,588	90.700	8,034,931.600	
SILICONWARE PRECISION INDS	191,743	48.350	9,270,774.050	
STANDARD FOODS CORP	64,639	74.000	4,783,286.000	

	SYNNEX TECHNOLOGY INTERNATIONAL CORP	144,899	37.000	5,361,263.000	
	TAIWAN CEMENT CORP	327,874	34.000	11,147,716.000	
	TECO ELECTRIC AND MACHINERY CO LTD	203,000	27.950	5,673,850.000	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR	2,380,083	233.000	554,559,339.000	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	1,122,525	15.800	17,735,895.000	
	YULON MOTOR CO	65,149	26.100	1,700,388.900	
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	142,000	24.900	3,535,800.000	
	INNOLUX CORPORATION	821,345	14.050	11,539,897.250	
	WPG HOLDINGS CO LTD	156,526	41.350	6,472,350.100	
	HIWIN TECHNOLOGIES CORP	20,560	290.500	5,972,680.000	
	TAIMED BIOLOGICS INC	18,000	202.000	3,636,000.000	
	PEGATRON CORP	189,554	82.300	15,600,294.200	
	CHAILLEASE HOLDING CO LTD	112,076	78.500	8,797,966.000	
	ASIA PACIFIC TELECOM CO LTD	188,000	10.050	1,889,400.000	
	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING LTD	48,385	64.900	3,140,186.500	
	TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL HOLDING	732,828	15.950	11,688,606.600	
	GLOBALWAFERS CO LTD	21,000	325.000	6,825,000.000	
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	15,000	332.500	4,987,500.000	
	GENERAL INTERFACE SOLUTION HOLDING LTD	18,000	308.000	5,544,000.000	
台湾・ドル	小計	31,189,770		1,757,143,167.560 (6,536,572,584)	
南アフリカ・ランド	BIDVEST GROUP LTD	31,400	179.790	5,645,406.000	
	TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	43,580	76.950	3,353,481.000	
	DISCOVERY LTD	34,030	140.190	4,770,665.700	
	REDEFINE PROPERTIES LTD	487,300	11.000	5,360,300.000	
	MASSMART HOLDINGS LTD	7,992	111.400	890,308.800	
	GOLD FIELDS LTD	85,000	55.970	4,757,450.000	
	REMGRO LTD	51,380	224.000	11,509,120.000	
	THE FOSCHINI GROUP LTD	21,500	137.930	2,965,495.000	
	MMI HOLDINGS LTD	82,706	18.920	1,564,797.520	
	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	207,700	25.110	5,215,347.000	
	EXXARO RESOURCES LTD	19,985	138.560	2,769,121.600	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	3,850	928.000	3,572,800.000	
	LIBERTY HOLDINGS LTD	14,449	108.250	1,564,104.250	
	MTN GROUP LTD	164,480	125.640	20,665,267.200	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	42,000	127.150	5,340,300.000	
	TELKOM SA SOC LTD	20,227	56.430	1,141,409.610	

FIRSTRAND LTD	325,460	53.700	17,477,202.000	
PSG GROUP LTD	8,084	259.890	2,100,950.760	
NASPERS LTD	42,440	3,220.000	136,656,800.000	
CORONATION FUND MANAGERS LTD	19,000	71.110	1,351,090.000	
NEDBANK GROUP LTD	21,600	212.900	4,598,640.000	
NETCARE LTD	105,400	25.100	2,645,540.000	
PICK'N PAY STORES LTD	30,212	59.500	1,797,614.000	
RMB HOLDINGS LTD	68,300	64.000	4,371,200.000	
ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	6,200	351.260	2,177,812.000	
SAPPI LTD	53,960	93.130	5,025,294.800	
SASOL LTD	54,100	393.020	21,262,382.000	
SHOPRITE HOLDINGS LTD	43,540	217.780	9,482,141.200	
MR PRICE GROUP LTD	23,720	185.690	4,404,566.800	
BRAIT SE	37,060	55.900	2,071,654.000	
STANDARD BANK GROUP LTD	124,760	166.260	20,742,597.600	
SPAR GROUP LTD/THE	18,940	174.000	3,295,560.000	
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	93,400	60.860	5,684,324.000	
IMPERIAL HOLDINGS LTD	13,278	199.090	2,643,517.020	
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LTD	37,870	306.910	11,622,681.700	
BARCLAYS AFRICA GROUP LTD	65,590	146.020	9,577,451.800	
TIGER BRANDS LTD	15,100	389.010	5,874,051.000	
SANLAM LTD	135,570	69.000	9,354,330.000	
INVESTEC LTD	30,200	98.620	2,978,324.000	
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	70,470	32.000	2,255,040.000	
PIONEER FOODS LTD	10,707	117.580	1,258,929.060	
MONDI LTD	11,520	346.890	3,996,172.800	
LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDINGS LTD	130,000	26.500	3,445,000.000	
RMI HOLDINGS	63,840	40.950	2,614,248.000	
VODACOM GROUP PTY LTD	58,000	156.810	9,094,980.000	
SIBANYE GOLD LTD	172,000	15.750	2,709,000.000	
NEPI ROCKCASTLE PLC	31,240	181.570	5,672,246.800	
FORTRESS INCOME FUND LTD-A	102,950	17.500	1,801,625.000	
FORTRESS INCOME FUND LTD	81,000	40.220	3,257,820.000	
STEINHOFF INTERNATIONAL HOLDINGS NV	292,640	60.000	17,558,400.000	
BID CORP LTD	32,520	309.170	10,054,208.400	
南アフリカ・ランド 小計	3,748,250		431,998,768.420 (3,594,229,753)	
合計	214,691,439		56,116,574,203 (56,116,574,203)	

(2) 株式以外の有価証券

平成29年10月12日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	メキシコ・ペソ	CEMEX SAB DE CV	1,417,675.000	21,832,195.000	
		FOMENTO ECONOMICO MEXICANO SAB DE CV	189,300.000	33,598,857.000	
	メキシコ・ペソ 小計		1,606,975.000	55,431,052.000 (333,140,623)	
投資信託受益証券 合計			1,606,975	333,140,623 (333,140,623)	
投資証券	トルコ・リラ	EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATIRIM	162,734.000	429,617.760	
	トルコ・リラ 小計		162,734.000	429,617.760 (13,240,819)	
	メキシコ・ペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	290,000.000	9,108,900.000	
	メキシコ・ペソ 小計		290,000.000	9,108,900.000 (54,744,489)	
	南アフリカ・ランド	HYPROP INVESTMENTS LTD	25,100.000	2,728,621.000	
		RESILIENT REIT LTD	28,600.000	4,003,714.000	
南アフリカ・ランド 小計		53,700.000	6,732,335.000 (56,013,027)		
投資証券 合計			506,434	123,998,335 (123,998,335)	
合計				457,138,958 (457,138,958)	

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 40銘柄	11.53%	-%	-%	12.04%
アラブ首長国連邦・ディ ルハム	株式 9銘柄	0.61%	-%	-%	0.64%
インド・ルピー	株式 78銘柄	8.05%	-%	-%	8.40%
インドネシア・ルピア	株式 31銘柄	2.10%	-%	-%	2.20%
カタール・リアル	株式 12銘柄	0.52%	-%	-%	0.54%
コロンビア・ペソ	株式 9銘柄	0.40%	-%	-%	0.42%
タイ・バーツ	株式 36銘柄	2.11%	-%	-%	2.21%
チェコ・コルナ	株式 4銘柄	0.17%	-%	-%	0.18%
チリ・ペソ	株式 19銘柄	1.21%	-%	-%	1.27%
トルコ・リラ	株式 24銘柄 投資証券 1銘柄	0.98% -%	-% -%	-% 0.02%	1.05%
ハンガリー・フォリント	株式 3銘柄	0.32%	-%	-%	0.34%
パキスタン・ルピー	株式 6銘柄	0.08%	-%	-%	0.09%
フィリピン・ペソ	株式 22銘柄	1.05%	-%	-%	1.10%
ブラジル・リアル	株式 57銘柄	7.20%	-%	-%	7.52%
ポーランド・ズロチ	株式 22銘柄	1.27%	-%	-%	1.33%
マレーシア・リンギット	株式 41銘柄	2.10%	-%	-%	2.19%
メキシコ・ペソ	株式 23銘柄 投資信託受 益証券 2銘柄 投資証券 1銘柄	2.46% -% -%	-% 0.56% -%	-% -% 0.09%	3.26%
ユーロ	株式 9銘柄	0.29%	-%	-%	0.30%
韓国・ウォン	株式 111銘柄	14.50%	-%	-%	15.14%
香港・ドル	株式 136銘柄	20.87%	-%	-%	21.79%
台湾・ドル	株式 89銘柄	11.07%	-%	-%	11.55%
南アフリカ・ランド	株式 51銘柄 投資証券 2銘柄	6.08% -%	-% -%	-% 0.09%	6.45%

(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。

MITO ラップ型ファンド(安定型)

- (1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)並びに同規則第38条の3及び第57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、中間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) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間(平成29年10月13日から平成30年4月12日まで)の中間財務諸表について、新日本有限責任監査法人による中間監査を受けております。

【中間財務諸表】

【MITO ラップ型ファンド(安定型)】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第2期 平成29年10月12日現在	第3期中間計算期間末 平成30年4月12日現在
資産の部		
流動資産		
預金	385,148	523,255
コール・ローン	10,373,784	14,320,474
投資信託受益証券	11,596,328	19,813,416
親投資信託受益証券	263,783,272	239,373,406
未収入金	8,934,000	-
流動資産合計	295,072,532	274,030,551
資産合計	295,072,532	274,030,551
負債の部		
流動負債		
未払解約金	4,063,589	-
未払受託者報酬	68,479	59,578
未払委託者報酬	2,038,558	1,773,616
その他未払費用	7,596	5,879
流動負債合計	6,178,222	1,839,073
負債合計	6,178,222	1,839,073
純資産の部		
元本等		
元本	1,282,373,020	1,267,349,736
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	6,521,290	4,841,742
(分配準備積立金)	6,963,319	6,111,587
元本等合計	288,894,310	272,191,478
純資産合計	288,894,310	272,191,478
負債純資産合計	295,072,532	274,030,551

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第2期中間計算期間 自 平成28年10月13日 至 平成29年4月12日	第3期中間計算期間 自 平成29年10月13日 至 平成30年4月12日
営業収益		
受取配当金	375,141	196,027
受取利息	48	896
有価証券売買等損益	3,645,329	981,339
為替差損益	1,366,032	558,408
営業収益合計	5,386,550	619,854
営業費用		
支払利息	5,644	3,743
受託者報酬	61,772	59,578
委託者報酬	1,838,926	1,773,616
その他費用	14,032	8,380
営業費用合計	1,920,374	1,845,317
営業利益又は営業損失()	3,466,176	1,225,463
経常利益又は経常損失()	3,466,176	1,225,463
中間純利益又は中間純損失()	3,466,176	1,225,463
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額()	620,976	88,055
期首剰余金又は期首欠損金()	4,491,016	6,521,290
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,425,760	454,813
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,131,573	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	294,187	454,813
剰余金減少額又は欠損金増加額	-	820,843
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	820,843
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金()	220,056	4,841,742

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1 . 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>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>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。</p>
2 . 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>
3 . その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建資産及び負債は、決算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第2期 平成29年10月12日現在	第3期中間計算期間末 平成30年4月12日現在
1 . 1 期首元本額	332,855,666円	282,373,020円
期中追加設定元本額	106,561,734円	20,414,406円
期中一部解約元本額	157,044,380円	35,437,690円
2 . 受益権の総数	282,373,020口	267,349,736口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	第2期 平成29年10月12日現在	第3期中間計算期間末 平成30年4月12日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間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、中間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）

該当事項はありません。

（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。

（1口当たり情報に関する注記）

	第2期 平成29年10月12日現在	第3期中間計算期間末 平成30年4月12日現在
1口当たり純資産額	1,0231円	1,0181円
（1万口当たり純資産額）	（10,231円）	（10,181円）

MITO ラップ型ファンド(中立型)

- (1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)並びに同規則第38条の3及び第57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、中間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) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間(平成29年10月13日から平成30年4月12日まで)の中間財務諸表について、新日本有限責任監査法人による中間監査を受けております。

【MITO ラップ型ファンド(中立型)】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第2期 平成29年10月12日現在	第3期中間計算期間末 平成30年4月12日現在
資産の部		
流動資産		
預金	788,380	1,181,088
コール・ローン	23,024,770	21,022,461
投資信託受益証券	71,206,663	56,498,257
親投資信託受益証券	384,157,631	316,321,097
未収入金	3,119,000	-
流動資産合計	482,296,444	395,022,903
資産合計	482,296,444	395,022,903
負債の部		
流動負債		
未払解約金	11,361,145	-
未払受託者報酬	104,519	89,520
未払委託者報酬	3,110,669	2,664,756
その他未払費用	11,680	8,876
流動負債合計	14,588,013	2,763,152
負債合計	14,588,013	2,763,152
純資産の部		
元本等		
元本	1,454,772,638	1,387,006,019
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	12,935,793	5,253,732
(分配準備積立金)	18,330,128	14,675,531
元本等合計	467,708,431	392,259,751
純資産合計	467,708,431	392,259,751
負債純資産合計	482,296,444	395,022,903

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第2期中間計算期間 自 平成28年10月13日 至 平成29年4月12日	第3期中間計算期間 自 平成29年10月13日 至 平成30年4月12日
営業収益		
受取配当金	1,278,466	1,068,159
受取利息	157	1,467
有価証券売買等損益	13,947,331	984,569
為替差損益	4,627,676	3,026,238
営業収益合計	19,853,630	2,941,181
営業費用		
支払利息	8,993	6,017
受託者報酬	100,074	89,520
委託者報酬	2,978,281	2,664,756
その他費用	17,613	17,246
営業費用合計	3,104,961	2,777,539
営業利益又は営業損失()	16,748,669	5,718,720
経常利益又は経常損失()	16,748,669	5,718,720
中間純利益又は中間純損失()	16,748,669	5,718,720
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額()	3,332,405	111,107
期首剰余金又は期首欠損金()	28,258,589	12,935,793
剰余金増加額又は欠損金減少額	5,117,010	785,423
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	5,117,010	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	785,423
剰余金減少額又は欠損金増加額	812,885	2,637,657
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	2,637,657
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	812,885	-
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金()	10,538,200	5,253,732

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1 . 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>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>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。</p>
2 . 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>
3 . その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建資産及び負債は、決算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第2期 平成29年10月12日現在	第3期中間計算期間末 平成30年4月12日現在
1 . 1 期首元本額	507,089,338円	454,772,638円
期中追加設定元本額	115,234,237円	24,481,651円
期中一部解約元本額	167,550,937円	92,248,270円
2 . 受益権の総数	454,772,638口	387,006,019口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	第2期 平成29年10月12日現在	第3期中間計算期間末 平成30年4月12日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間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、中間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）

該当事項はありません。

（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。

（1口当たり情報に関する注記）

	第2期 平成29年10月12日現在	第3期中間計算期間末 平成30年4月12日現在
1口当たり純資産額	1,0284円	1,0136円
（1万口当たり純資産額）	（10,284円）	（10,136円）

MITO ラップ型ファンド(積極型)

- (1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)並びに同規則第38条の3及び第57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、中間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) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間(平成29年10月13日から平成30年4月12日まで)の中間財務諸表について、新日本有限責任監査法人による中間監査を受けております。

【MITO ラップ型ファンド(積極型)】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第2期 平成29年10月12日現在	第3期中間計算期間末 平成30年4月12日現在
資産の部		
流動資産		
預金	975,600	1,454,938
コール・ローン	27,992,822	29,450,993
投資信託受益証券	87,949,675	68,326,266
親投資信託受益証券	406,068,347	321,226,705
未収入金	6,597,000	-
流動資産合計	529,583,444	420,458,902
資産合計	529,583,444	420,458,902
負債の部		
流動負債		
未払解約金	11,624,594	-
未払受託者報酬	120,225	96,499
未払委託者報酬	3,578,354	2,872,096
その他未払費用	13,442	9,563
流動負債合計	15,336,615	2,978,158
負債合計	15,336,615	2,978,158
純資産の部		
元本等		
元本	1,496,659,411	1,412,943,438
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	17,587,418	4,537,306
(分配準備積立金)	26,754,752	20,317,958
元本等合計	514,246,829	417,480,744
純資産合計	514,246,829	417,480,744
負債純資産合計	529,583,444	420,458,902

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第2期中間計算期間 自 平成28年10月13日 至 平成29年4月12日	第3期中間計算期間 自 平成29年10月13日 至 平成30年4月12日
営業収益		
受取配当金	1,836,206	1,304,172
受取利息	242	1,848
有価証券売買等損益	29,617,144	4,812,586
為替差損益	6,018,456	3,656,102
営業収益合計	37,472,048	7,162,668
営業費用		
支払利息	10,707	7,156
受託者報酬	121,440	96,499
委託者報酬	3,614,238	2,872,096
その他費用	23,164	18,399
営業費用合計	3,769,549	2,994,150
営業利益又は営業損失()	33,702,499	10,156,818
経常利益又は経常損失()	33,702,499	10,156,818
中間純利益又は中間純損失()	33,702,499	10,156,818
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額()	7,495,849	559,341
期首剰余金又は期首欠損金()	59,857,441	17,587,418
剰余金増加額又は欠損金減少額	12,767,117	2,051,874
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	12,767,117	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	2,051,874
剰余金減少額又は欠損金増加額	3,485,947	4,385,827
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	4,385,827
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	3,485,947	-
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金()	24,369,621	4,537,306

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1 . 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>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>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。</p>
2 . 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>
3 . その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建資産及び負債は、決算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第2期 平成29年10月12日現在	第3期中間計算期間末 平成30年4月12日現在
1 . 1 期首元本額	634,008,870円	496,659,411円
期中追加設定元本額	162,105,929円	38,635,878円
期中一部解約元本額	299,455,388円	122,351,851円
2 . 受益権の総数	496,659,411口	412,943,438口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	第2期 平成29年10月12日現在	第3期中間計算期間末 平成30年4月12日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間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、中間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）

該当事項はありません。

（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。

（1口当たり情報に関する注記）

	第2期 平成29年10月12日現在	第3期中間計算期間末 平成30年4月12日現在
1口当たり純資産額	1,0354円	1,0110円
（1万口当たり純資産額）	（10,354円）	（10,110円）

(参考)

「MITO ラップ型ファンド(安定型)」、「MITO ラップ型ファンド(中立型)」、「MITO ラップ型ファンド(積極型)」は、「国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド」受益証券、「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「J-REITインデックスファンド・マザーファンド」受益証券、「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「コモディティインデックス・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、中間貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同親投資信託の受益証券であります。

同親投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

「国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成29年10月12日現在	平成30年4月12日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		6,062,166,668	13,368,332,681
株式	2	297,566,000,230	288,424,507,413
派生商品評価勘定		214,479,680	76,120,024
未収入金		11,015,998	220,409
未収配当金		2,352,048,167	2,642,613,683
流動資産合計		306,205,710,743	304,511,794,210
資産合計		306,205,710,743	304,511,794,210
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		-	784,212
前受金		210,324,000	93,980,000
未払金		-	9,984,484,244
未払解約金		918,005,000	177,761,000
流動負債合計		1,128,329,000	10,257,009,456
負債合計		1,128,329,000	10,257,009,456
純資産の部			
元本等			
元本	1	118,980,682,522	112,277,133,743
剰余金			
剰余金又は欠損金()		186,096,699,221	181,977,651,011
元本等合計		305,077,381,743	294,254,784,754
純資産合計		305,077,381,743	294,254,784,754
負債純資産合計		306,205,710,743	304,511,794,210

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	平成29年10月12日現在	平成30年4月12日現在
1 . 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	141,984,682,751円	118,980,682,522円
同期中追加設定元本額	20,961,822,659円	13,296,113,416円
同期中一部解約元本額	43,965,822,888円	19,999,662,195円
元本の内訳		
ファンド名		
DIAM DC 国内株式インデックスファンド	7,381,462,783円	9,562,715,274円
DIAM国内株式パッシブ・ファンド	2,140,866,731円	1,933,758,962円
MITO ラップ型ファンド（安定型）	5,252,599円	4,115,683円
MITO ラップ型ファンド（中立型）	13,038,380円	9,042,847円
MITO ラップ型ファンド（積極型）	23,681,430円	16,007,723円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	13,228,825円	22,367,745円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	13,420,191円	18,721,655円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	15,993,845円	15,039,866円
たわらノーロード TOPIX	82,133,781円	170,909,697円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	5,443,582円	20,229,185円
たわらノーロード バランス（堅実型）	- 円	416,560円
たわらノーロード バランス（標準型）	- 円	2,600,247円

たわらノーロード バランス (積極型)	- 円	7,696,694円
たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(保守型)	- 円	41,970円
たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(安定型)	- 円	1,909,581円
たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(安定成長 型)	- 円	3,099,728円
たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(成長型)	- 円	2,402,708円
たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(積極型)	- 円	5,891,381円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(保守型)	- 円	42,775円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定型)	- 円	57,341円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定成長型)	- 円	404,485円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(成長型)	- 円	423,974円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(積極型)	- 円	1,309,950円
D I A M国内株式インデックス ファンド< D C年金>	35,814,315,681円	37,293,723,212円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 1 安定型	797,265,541円	798,385,215円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 2 安定・成長型	2,772,479,361円	2,743,834,554円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 3 成長型	2,863,257,582円	2,857,763,553円
D I A M D C バランス3 0 インデックスファンド	352,045,452円	338,608,842円
D I A M D C バランス5 0 インデックスファンド	1,179,965,536円	1,131,085,619円
D I A M D C バランス7 0 インデックスファンド	1,081,878,743円	1,063,174,443円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型>	50,599,626円	43,373,703円
マネックス資産設計ファンド< 育成型>	1,191,234,103円	1,084,829,283円
マネックス資産設計ファンド エポリューション	25,856,596円	25,558,900円
D I A M D C 8 資産バラ ンスファンド(新興国1 0)	40,016,978円	41,290,133円
D I A M D C 8 資産バラ ンスファンド(新興国2 0)	92,537,042円	107,162,699円
D I A M D C 8 資産バラ ンスファンド(新興国3 0)	173,340,139円	208,942,359円
投資のソムリエ	3,598,167,045円	1,456,346,648円
クルーズコントロール	1,385,033,156円	1,188,120,569円
投資のソムリエ< D C年金>	197,160,817円	104,068,746円

DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	146,751,099円	166,392,070円
DIAM DC バランス・F(成長型)	171,592,462円	216,687,180円
クルーズコントロール<DC年金>	461,778円	461,773円
DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)	7,645,471円	7,054,198円
DIAMコア資産設計ファンド(積極型)	23,808,944円	22,007,900円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	62,307,274円	34,252,346円
ダイナミック・ナビゲーション	1,486,477円	1,702,235円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	792,410,147円	565,736,630円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	592,766円	564,394円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	592,766円	412,164円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	238,256円	172,550円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	-円	585,580円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	-円	1,272,888円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	76,811,419円	71,978,721円
DIAMグローバル・バランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	156,029,386円	131,297,159円
DIAMグローバル・バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	334,296,917円	293,628,160円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	19,939,130円	16,310,580円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	96,956,097円	71,472,546円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	21,537,117円	17,536,694円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	27,179,602円	20,478,291円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	40,415,290円	30,744,677円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	67,149,356円	55,943,767円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	1,227,769,114円	1,080,873,015円

D I A Mバランスファンド3 7.5 V A (適格機関投資家限 定)	1,159,373,010円	1,017,007,536円
D I A Mバランスファンド50 V A (適格機関投資家限定)	3,132,500,067円	2,784,900,283円
D I A Mグローバル・アセッ ト・バランスV A (適格機関投 資家限定)	230,378,853円	201,920,528円
D I A Mグローバル・アセッ ト・バランスV A 2 (適格機関 投資家限定)	155,354,227円	83,071,670円
D I A M アクサ グローバ ル バランスファンド30 V A (適格機関投資家限定)	676,430,709円	595,340,174円
D I A M世界アセットバランス ファンドV A (適格機関投資家 向け)	2,674,063,219円	1,304,981,514円
D I A Mグローバル 私募ファ ンド(適格機関投資家向け)	10,313,671円	10,313,671円
D I A M世界バランスファンド 55 V A (適格機関投資家限 定)	178,653,922円	21,943,421円
D I A M世界バランスファンド 35 V A (適格機関投資家限 定)	2,129,542,429円	677,637,904円
D I A M世界アセットバランス ファンド2 V A (適格機関投資 家限定)	16,798,495,071円	15,399,217,533円
D I A M世界アセットバランス ファンド40 V A (適格機関投 資家限定)	603,397,247円	550,177,517円
D I A M世界アセットバランス ファンド25 V A (適格機関投 資家限定)	1,915,844,419円	1,760,010,553円
D I A M世界アセットバランス ファンド3 V A (適格機関投資 家限定)	10,822,212,577円	10,093,961,989円
D I A Mバランス30 V A (適 格機関投資家限定)	3,553,157円	5,031,055円
D I A Mバランス50 V A (適 格機関投資家限定)	4,968,662円	273,573円
D I A Mバランス70 V A (適 格機関投資家限定)	4,468,394円	3,720,103円
D I A M世界アセットバランス ファンド4 V A (適格機関投資 家限定)	9,646,791,837円	8,986,233,742円
D I A M世界バランス25 V A (適格機関投資家限定)	77,974,896円	72,431,048円
D I A M国内バランス30 V A (適格機関投資家限定)	30,029,445円	28,338,107円
D I A Mバランス20 V A (適 格機関投資家限定)	30,306,394円	26,228,092円

	D I A Mバランス40VA(適格機関投資家限定)	69,877円	98,961円
	D I A Mバランス60VA(適格機関投資家限定)	114,762円	111,124円
	D I A M世界アセットバランスファンド7VA(1212)(適格機関投資家限定)	547,756,483円	426,902,115円
	D I A M世界アセットバランスファンド7VA(1303)(適格機関投資家限定)	1,500,552,498円	1,323,021,834円
	D I A M世界アセットバランスファンド7VA(1306)(適格機関投資家限定)	1,976,540,138円	1,737,262,933円
	D I A M世界アセットバランスファンド7VA(1309)(適格機関投資家限定)	85,350,145円	73,956,736円
	計	118,980,682,522円	112,277,133,743円
2.	受益権の総数	118,980,682,522口	112,277,133,743口
3.	2 差入代用有価証券	株式 3,462,500,000円	株式 3,436,500,000円

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	平成29年10月12日現在	平成30年4月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

株式関連

種類	平成29年10月12日 現在				平成30年4月12日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
先物取引								
買 建	7,099,681,000	-	7,314,300,000	214,619,000	5,717,585,000	-	5,793,030,000	75,445,000
合計	7,099,681,000	-	7,314,300,000	214,619,000	5,717,585,000	-	5,793,030,000	75,445,000

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成29年10月12日現在	平成30年4月12日現在
1口当たり純資産額	2.5641円	2.6208円
(1万口当たり純資産額)	(25,641円)	(26,208円)

「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成29年10月12日現在	平成30年4月12日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		2,773,988,288	5,849,368,073
国債証券		297,773,980,000	293,937,159,400
地方債証券		23,371,281,085	22,883,336,289
特殊債券		16,353,704,562	14,885,935,169
社債券		17,026,841,050	16,251,086,830
未収入金		1,631,865,000	-
未収利息		613,053,882	568,182,979
前払費用		6,261,326	16,854,005
流動資産合計		359,550,975,193	354,391,922,745
資産合計		359,550,975,193	354,391,922,745
負債の部			
流動負債			
未払金		-	2,202,588,500
未払解約金		1,684,089,000	280,881,000
流動負債合計		1,684,089,000	2,483,469,500
負債合計		1,684,089,000	2,483,469,500
純資産の部			
元本等			
元本	1	279,387,012,706	272,410,762,005
剰余金			
剰余金又は欠損金()		78,479,873,487	79,497,691,240
元本等合計		357,866,886,193	351,908,453,245
純資産合計		357,866,886,193	351,908,453,245
負債純資産合計		359,550,975,193	354,391,922,745

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	平成29年10月12日現在	平成30年4月12日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額 同期中追加設定元本額 同期中一部解約元本額	291,973,791,531円 65,137,606,209円 77,724,385,034円	279,387,012,706円 30,160,720,078円 37,136,970,779円
元本の内訳 ファンド名		
D I A M国内債券パッシブ・ファンド	13,850,588,414円	15,259,915,800円
M I T O ラップ型ファンド（安定型）	141,771,788円	133,392,035円
M I T O ラップ型ファンド（中立型）	127,305,344円	103,531,902円
M I T O ラップ型ファンド（積極型）	40,618,516円	32,375,641円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	358,172,970円	711,138,730円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	131,577,204円	214,285,439円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	27,433,307円	30,402,668円
たわらノーロード 国内債券	2,266,473,066円	3,351,952,381円
たわらノーロード 国内債券<ラップ向け>	755,274円	- 円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	10,431,159円	39,744,913円
たわらノーロード バランス（堅実型）	- 円	7,571,538円
たわらノーロード バランス（標準型）	- 円	12,545,941円
たわらノーロード バランス（積極型）	- 円	3,029,254円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（保守型）	- 円	1,145,317円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（安定型）	- 円	23,634,990円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（安定成長型）	- 円	16,111,089円

たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(成長型)	- 円	5,096,731円
たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(積極型)	- 円	1,992,321円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(保守型)	- 円	998,019円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定型)	- 円	535,415円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定成長型)	- 円	1,687,155円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(成長型)	- 円	521,901円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(積極型)	- 円	77,886円
D I A M国内債券インデックス ファンド< D C年金>	12,439,230,248円	12,599,994,191円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 1 安定型	5,321,123,688円	5,535,324,397円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 2 安定・成長型	7,599,189,375円	8,050,163,530円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 3 成長型	3,046,531,363円	3,239,119,987円
D I A M D C バランス3 0 インデックスファンド	1,774,839,099円	1,802,466,064円
D I A M D C バランス5 0 インデックスファンド	1,932,538,404円	1,980,109,879円
D I A M D C バランス7 0 インデックスファンド	288,293,436円	307,549,092円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型>	95,832,674円	92,933,808円
マネックス資産設計ファンド< 育成型>	2,274,223,236円	2,325,174,416円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	3,002,910円	4,808,536円
D I A M D C 8 資産 balan スファンド(新興国1 0)	445,818,075円	474,981,130円
D I A M D C 8 資産 balan スファンド(新興国2 0)	377,197,015円	442,458,328円
D I A M D C 8 資産 balan スファンド(新興国3 0)	86,300,285円	104,118,291円
投資のソムリエ	2,972,951,972円	3,656,031,803円
クルーズコントロール	2,763,991,182円	2,422,050,966円
投資のソムリエ< D C年金>	163,833,623円	261,049,297円
D I A M 8 資産 バランスファ ンドN< D C年金>	1,638,056,047円	1,910,445,810円
D I A M D C バランス・F (成長型)	186,456,021円	240,000,998円
クルーズコントロール< D C年 金>	921,559円	941,467円
D I A Mコア資産設計ファンド (堅実型)	6,110,703円	5,767,851円
D I A Mコア資産設計ファンド (積極型)	19,010,322円	17,905,608円

投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	185,640,863円	480,733,487円
ダイナミック・ナビゲーションリスク抑制世界8資産バランスファンド	524,853円	415,602円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	2,367,373,734円	8,080,627,460円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	393,977円	627,520円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	393,982円	456,411円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	705,062円	2,438,657円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	-円	1,175,568円
みずほエマージング債券オープン	-円	6,771,354円
DIAM高金利通貨ファンド	10,801,911円	-円
DIAMエマージング債券ファンド	9,608,918円	9,608,918円
DIAM国内債券パッシブファンド(適格機関投資家向け)	9,450,010円	9,450,010円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	24,403,666,103円	22,725,286,246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)	497,874,165円	480,025,025円
DIAMグローバル・バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	369,244,962円	319,735,201円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	263,458,483円	238,173,147円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	91,759,912円	77,264,771円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	286,802,833円	217,543,884円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	106,170,065円	88,973,434円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	71,450,932円	55,403,177円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	119,547,737円	93,566,153円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	198,613,276円	170,277,657円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	6,457,513,727円	5,851,326,088円
	3,429,075,449円	3,096,110,603円

D I A Mバランスファンド50 V A (適格機関投資家限定)	6,175,616,959円	5,651,193,263円
D I A Mグローバル・アセッ ト・バランスV A (適格機関投 資家限定)	681,893,480円	614,350,089円
D I A Mグローバル・アセッ ト・バランスV A 2 (適格機関 投資家限定)	767,783,699円	423,129,817円
D I A M アクサ グローバ ル バランスファンド30V A (適格機関投資家限定)	4,008,052,847円	3,629,758,270円
D I A M世界アセットバランス ファンドV A (適格機関投資家 向け)	5,260,342,645円	2,648,421,629円
D I A Mグローバル 私募ファ ンド(適格機関投資家向け)	194,752,933円	194,752,933円
D I A M世界バランスファンド 55V A (適格機関投資家限 定)	1,056,192,407円	133,416,665円
D I A M世界バランスファンド 35V A (適格機関投資家限 定)	3,400,094,687円	1,109,545,138円
D I A M世界アセットバランス ファンド2V A (適格機関投資 家限定)	88,333,633,708円	83,353,917,764円
D I A M世界アセットバランス ファンド40V A (適格機関投 資家限定)	1,189,575,143円	1,116,300,003円
D I A M世界アセットバランス ファンド25V A (適格機関投 資家限定)	7,557,095,183円	7,146,512,954円
D I A M世界アセットバランス ファンド3V A (適格機関投資 家限定)	28,451,347,956円	27,314,970,571円
D I A Mバランス30V A (適 格機関投資家限定)	56,158,235円	81,853,560円
D I A Mバランス50V A (適 格機関投資家限定)	24,509,134円	1,395,995円
D I A Mバランス70V A (適 格機関投資家限定)	8,808,986円	7,548,153円
D I A M世界アセットバランス ファンド4V A (適格機関投資 家限定)	31,707,012,480円	30,402,487,988円
D I A M世界バランス25V A (適格機関投資家限定)	505,447,523円	481,766,349円
D I A M国内バランス30V A (適格機関投資家限定)	138,180,160円	134,196,130円
D I A Mバランス20V A (適 格機関投資家限定)	599,008,976円	533,089,734円
D I A Mバランス40V A (適 格機関投資家限定)	479,853円	705,557円
D I A Mバランス60V A (適 格機関投資家限定)	376,479円	376,555円

計	279,387,012,706円	272,410,762,005円
2. 受益権の総数	279,387,012,706口	272,410,762,005口

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	平成29年10月12日現在	平成30年4月12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）

該当事項はありません。

（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。

（1口当たり情報に関する注記）

	平成29年10月12日現在	平成30年4月12日現在
1口当たり純資産額	1,2809円	1,2918円
（1万口当たり純資産額）	（12,809円）	（12,918円）

「J-REITインデックスファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位:円)

科 目	注記 番号	平成29年10月12日現在	平成30年4月12日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		503,035,033	462,857,631
投資証券		32,276,486,900	31,197,481,580
派生商品評価勘定		-	16,832,992
未収入金		306,611,341	673,468
未収配当金		291,821,153	323,965,951
前払金		8,249,344	-
差入委託証拠金		6,189,056	10,141,092
流動資産合計		33,392,392,827	32,011,952,714
資産合計		33,392,392,827	32,011,952,714
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		9,785,344	-
前受金		-	13,147,492
未払金		238,708,322	-
未払解約金		-	1,218,300
流動負債合計		248,493,666	14,365,792
負債合計		248,493,666	14,365,792
純資産の部			
元本等			
元本	1	19,934,508,415	18,000,992,215
剰余金			
剰余金又は欠損金()		13,209,390,746	13,996,594,707
元本等合計		33,143,899,161	31,997,586,922
純資産合計		33,143,899,161	31,997,586,922
負債純資産合計		33,392,392,827	32,011,952,714

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	平成29年10月12日現在	平成30年4月12日現在
1 . 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	15,180,336,252円	19,934,508,415円
同期中追加設定元本額	12,472,142,750円	7,932,189,081円
同期中一部解約元本額	7,717,970,587円	9,865,705,281円
元本の内訳		
ファンド名		
MITO ラップ型ファンド（安定型）	390,736円	360,878円
MITO ラップ型ファンド（中立型）	1,086,594円	898,127円
MITO ラップ型ファンド（積極型）	2,923,343円	2,413,791円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	949,386円	1,901,515円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	1,108,712円	2,770,786円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	1,957,452円	2,493,917円
たわらノーロード 国内リート	891,585,001円	1,156,867,584円
たわらノーロード 国内リート<ラップ向け>	201,188,801円	332,394,832円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	8,337,173円	30,060,237円
たわらノーロード バランス（堅実型）	- 円	309,485円
たわらノーロード バランス（標準型）	- 円	5,520,203円
たわらノーロード バランス（積極型）	- 円	11,437,019円

たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(安定型)	- 円	3,413,835円
たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(安定成長 型)	- 円	5,774,120円
たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(成長型)	- 円	4,230,581円
たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(積極型)	- 円	8,192,330円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定型)	- 円	128,381円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定成長型)	- 円	803,009円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(成長型)	- 円	722,106円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(積極型)	- 円	2,180,570円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型>	14,836,508円	14,719,897円
マネックス資産設計ファンド< 育成型>	349,167,083円	368,359,319円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	3,270,978円	3,505,986円
DIAM DC 8資産 balan スファンド(新興国10)	17,580,102円	18,269,982円
DIAM DC 8資産 balan スファンド(新興国20)	55,469,118円	62,876,340円
DIAM DC 8資産 balan スファンド(新興国30)	119,349,456円	138,822,304円
投資のソムリエ	2,253,396,923円	2,143,374,967円
投資のソムリエ<DC年金>	125,316,503円	153,146,183円
DIAM 8資産バランスマ ンダN<DC年金>	65,007,561円	73,594,787円
投資のソムリエ<DC年金>リ スク抑制型	31,750,474円	25,257,376円
ダイナミック・ナビゲーシ ョン	199,701円	466,610円
リスク抑制世界8資産 balan スファンド	402,965,199円	422,389,841円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤ-2045)	356,288円	458,592円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤ-2055)	356,288円	338,960円
リスク抑制世界8資産 balan スファンド(DC)	118,245円	125,642円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤ-2035)	- 円	862,712円
Jリートインデックスファンド (DC)	5,931,659円	7,525,466円
DIAM J-REITイン デックス私募ファンド2012 12(適格機関投資家限定)	94,475,202円	92,487,655円

DIAM J-REITイン デックス私募ファンド2014 01(適格機関投資家限定)	1,832,580,723円	835,468,186円
DIAM J-REITイン デックスファンド(適格機関投 資家向け)	10,545,559,048円	9,929,520,928円
DIAMグローバル 私募ファ ンド(適格機関投資家向け)	14,402,370円	14,402,370円
DIAMグローバル・リスク ファクター・パリティ戦略ファ ンド(適格機関投資家限定)	1,369,589,007円	1,187,943,032円
DIAMグローバル・リスク ファクター・パリティ戦略ファ ンドII(適格機関投資家限 定)	1,523,302,781円	934,201,774円
計	19,934,508,415円	18,000,992,215円
2. 受益権の総数	19,934,508,415口	18,000,992,215口

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	平成29年10月12日現在	平成30年4月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

不動産投信関連

種類	平成29年10月12日 現在				平成30年4月12日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
不動産投信指数先 物取引								
買 建	424,550,400	-	414,848,000	9,702,400	579,127,100	-	595,998,000	16,870,900
合計	424,550,400	-	414,848,000	9,702,400	579,127,100	-	595,998,000	16,870,900

(注) 1. 時価の算定方法

不動産投信指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成29年10月12日現在	平成30年4月12日現在
1口当たり純資産額	1.6626円	1.7775円
(1万口当たり純資産額)	(16,626円)	(17,775円)

「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位:円)

科 目	注記 番号	平成29年10月12日現在	平成30年4月12日現在
資産の部			
流動資産			
預金		5,651,561,043	3,684,657,070
コール・ローン		268,115,912	1,429,751,346
株式		282,008,310,018	281,879,654,456
投資信託受益証券		798,785,653	829,393,875
投資証券		6,543,093,181	6,015,745,653
派生商品評価勘定		201,465,333	69,393,617
未収入金		8,520,388	2,628,932
未収配当金		293,191,790	396,955,182
差入委託証拠金		1,597,210,020	2,215,815,853
流動資産合計		297,370,253,338	296,523,995,984
資産合計		297,370,253,338	296,523,995,984
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		543,550	22,638,559
未払解約金		472,640,000	105,553,000
流動負債合計		473,183,550	128,191,559
負債合計		473,183,550	128,191,559
純資産の部			
元本等			
元本	1	88,453,274,390	89,878,265,003
剰余金			
剰余金又は欠損金()		208,443,795,398	206,517,539,422
元本等合計		296,897,069,788	296,395,804,425
純資産合計		296,897,069,788	296,395,804,425
負債純資産合計		297,370,253,338	296,523,995,984

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項目		平成29年10月12日現在	平成30年4月12日現在
1.	1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	100,403,068,668円	88,453,274,390円
	同期中追加設定元本額	17,826,557,176円	14,626,596,732円
	同期中一部解約元本額	29,776,351,454円	13,201,606,119円
	元本の内訳		
	ファンド名		
	D I A M外国株式パッシブ・ファンド	1,500,759,815円	1,905,409,447円
	M I T O ラップ型ファンド(安定型)	2,952,003円	2,858,059円
	M I T O ラップ型ファンド(中立型)	7,416,677円	8,377,043円
	M I T O ラップ型ファンド(積極型)	19,987,131円	16,819,159円
	グローバル8資産ラップファンド(安定型)	7,484,878円	15,228,505円
	グローバル8資産ラップファンド(中立型)	7,682,961円	17,580,421円
	グローバル8資産ラップファンド(積極型)	13,499,602円	15,817,157円
	たわらノーロード 先進国株式	4,471,783,454円	6,218,451,156円
	たわらノーロード 先進国株式<ラップ向け>	425,029円	424,744円
	たわらノーロード 先進国株式<為替ヘッジあり>	334,440,710円	641,520,031円
	たわらノーロード バランス(8資産均等型)	4,162,856円	16,398,369円
	たわらノーロード バランス(堅実型)	- 円	995,457円
	たわらノーロード バランス(標準型)	- 円	7,879,048円
	たわらノーロード バランス(積極型)	- 円	18,834,834円
	たわらノーロード スマートグローバルバランス(保守型)	- 円	39,311円
	たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定型)	- 円	4,716,106円
	たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定成長型)	- 円	7,151,380円
	たわらノーロード スマートグローバルバランス(成長型)	- 円	5,385,830円
	たわらノーロード スマートグローバルバランス(積極型)	- 円	12,395,046円
	たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	- 円	6,504円
	たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	- 円	54,178円

たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	- 円	398,212円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	- 円	414,869円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	- 円	1,489,876円
D I A M外国株式インデックスファンド< D C年金>	36,248,641,542円	37,972,052,073円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 1 安定型	163,816,147円	168,107,521円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 2 安定・成長型	857,026,223円	862,558,503円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 3 成長型	1,040,064,596円	1,070,957,443円
D I A M D C バランス30インデックスファンド	135,530,066円	131,593,343円
D I A M D C バランス50インデックスファンド	389,058,681円	385,116,497円
D I A M D C バランス70インデックスファンド	330,441,705円	334,545,542円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型>	35,350,510円	31,943,791円
マネックス資産設計ファンド< 育成型>	831,794,009円	799,032,499円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	200,977,464円	206,676,091円
D I A M D C 8資産バランスファンド(新興国10)	30,287,665円	33,634,872円
D I A M D C 8資産バランスファンド(新興国20)	70,337,364円	86,430,217円
D I A M D C 8資産バランスファンド(新興国30)	132,555,525円	168,111,819円
投資のソムリエ	3,198,792,059円	1,184,065,467円
クルーズコントロール	529,164,076円	472,957,603円
投資のソムリエ< D C年金>	175,260,706円	84,376,693円
D I A M 8資産バランスファンドN< D C年金>	112,222,016円	135,297,788円
D I A M D C バランス・F(成長型)	61,949,596円	82,768,903円
クルーズコントロール< D C年金>	176,323円	183,864円
D I A Mコア資産設計ファンド(堅実型)	2,336,372円	2,240,482円
D I A Mコア資産設計ファンド(積極型)	7,273,627円	7,001,260円
投資のソムリエ< D C年金>リスク抑制型	31,606,974円	27,919,504円
ダイナミック・ナビゲーション	1,646,742円	765,335円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	402,698,402円	458,443,471円
ワールドアセットバランス(基本コース)	376,390,776円	679,300,871円

ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	1,182,935,075円	2,591,259,411円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	455,321円	355,096円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	455,344円	259,278円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	120,612円	138,358円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	-円	477,198円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	-円	515,075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)	110,699,871円	92,651,450円
DIAM外国株式パッシブ私募ファンド(適格機関投資家向け)	2,964,558,782円	2,893,521,103円
DIAM先進国株式パッシブファンド(適格機関投資家限定)	161,291,968円	161,121,110円
外国株式パッシブ・ファンド2(適格機関投資家限定)	171,807,118円	208,736,068円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	25,138,484円	24,820,525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)	119,155,473円	105,705,416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)	255,180,569円	236,509,944円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	15,220,426円	13,138,864円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	111,060,683円	86,357,971円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	8,214,224円	7,056,458円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	13,833,399円	10,993,104円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	30,862,374円	24,764,555円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	76,913,785円	67,594,843円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	624,620,278円	580,416,129円

D I A Mバランスファンド3 7.5 V A (適格機関投資家限 定)	774,320,364円	716,960,597円
D I A Mバランスファンド50 V A (適格機関投資家限定)	2,391,175,141円	2,243,922,123円
D I A Mグローバル・アセッ ト・バランスV A (適格機関投 資家限定)	882,809,453円	809,803,654円
D I A Mグローバル・アセッ ト・バランスV A 2 (適格機関 投資家限定)	358,382,128円	202,250,282円
D I A M アクサ グローバ ル バランスファンド30 V A (適格機関投資家限定)	1,034,110,504円	960,463,817円
D I A M世界アセットバランス ファンドV A (適格機関投資家 向け)	678,263,358円	349,339,188円
D I A Mグローバル 私募ファ ンド(適格機関投資家向け)	2,754,975円	2,754,975円
D I A M世界バランスファンド 55 V A (適格機関投資家限 定)	614,773,286円	79,200,060円
D I A M世界バランスファンド 35 V A (適格機関投資家限 定)	650,989,428円	219,694,870円
D I A M世界アセットバランス ファンド2 V A (適格機関投資 家限定)	8,547,165,090円	8,268,346,679円
D I A M世界アセットバランス ファンド40 V A (適格機関投 資家限定)	460,597,770円	443,135,070円
D I A M世界アセットバランス ファンド25 V A (適格機関投 資家限定)	1,462,455,020円	1,417,828,929円
D I A M世界アセットバランス ファンド3 V A (適格機関投資 家限定)	5,509,914,891円	5,419,332,446円
D I A Mバランス30 V A (適 格機関投資家限定)	13,592,785円	20,095,866円
D I A Mバランス50 V A (適 格機関投資家限定)	15,185,783円	896,839円
D I A Mバランス70 V A (適 格機関投資家限定)	12,516,619円	10,943,816円
D I A M世界アセットバランス ファンド4 V A (適格機関投資 家限定)	7,365,755,184円	7,239,045,245円
D I A Mバランス20 V A (適 格機関投資家限定)	69,571,913円	62,627,089円
D I A Mバランス40 V A (適 格機関投資家限定)	159,561円	238,391円
D I A Mバランス60 V A (適 格機関投資家限定)	263,069円	266,917円
計	88,453,274,390円	89,878,265,003円

2 . 受益権の総数	88,453,274,390口	89,878,265,003口
------------	-----------------	-----------------

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	平成29年10月12日現在	平成30年4月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	平成29年10月12日 現在				平成30年4月12日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	260,218,350	-	260,759,900	541,550	-	-	-	-
アメリカ・ドル	162,850,310	-	163,035,800	185,490	-	-	-	-
オーストラリア・ドル	21,917,700	-	21,934,900	17,200	-	-	-	-
カナダ・ドル	11,682,000	-	11,742,800	60,800	-	-	-	-
ユーロ	63,768,340	-	64,046,400	278,060	-	-	-	-
買 建	-	-	-	-	1,299,046,081	-	1,297,297,430	1,748,651
アメリカ・ドル	-	-	-	-	869,142,440	-	867,600,400	1,542,040
イギリス・ポンド	-	-	-	-	96,885,404	-	96,822,880	62,524
オーストラリア・ドル	-	-	-	-	35,082,126	-	35,047,100	35,026
カナダ・ドル	-	-	-	-	41,903,521	-	41,939,510	35,989
ユーロ	-	-	-	-	256,032,590	-	255,887,540	145,050
合計	260,218,350	-	260,759,900	541,550	1,299,046,081	-	1,297,297,430	1,748,651

(注) 時価の算定方法

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

株式関連

種類	平成29年10月12日 現在				平成30年4月12日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
先物取引								
買 建	7,207,430,951	-	7,408,894,284	201,463,333	7,513,507,573	-	7,562,011,282	48,503,709
合計	7,207,430,951	-	7,408,894,284	201,463,333	7,513,507,573	-	7,562,011,282	48,503,709

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成29年10月12日現在	平成30年4月12日現在
1口当たり純資産額	3.3565円	3.2977円
(1万口当たり純資産額)	(33,565円)	(32,977円)

「外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成29年10月12日現在	平成30年4月12日現在
資産の部			
流動資産			
預金		4,343,884,183	2,376,653,631
コール・ローン		1,165,606,740	4,262,685,453
国債証券		232,897,983,305	207,093,087,725
派生商品評価勘定		2,016,904	97,985
未収利息		2,192,568,974	1,946,102,511
前払費用		37,619,690	29,868,399
流動資産合計		240,639,679,796	215,708,495,704
資産合計		240,639,679,796	215,708,495,704
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		-	4,090,580
未払金		-	2,175,786,574
未払解約金		330,542,000	329,722,000
流動負債合計		330,542,000	2,509,599,154
負債合計		330,542,000	2,509,599,154
純資産の部			
元本等			
元本	1	130,195,447,784	117,914,103,470
剰余金			
剰余金又は欠損金()		110,113,690,012	95,284,793,080
元本等合計		240,309,137,796	213,198,896,550
純資産合計		240,309,137,796	213,198,896,550
負債純資産合計		240,639,679,796	215,708,495,704

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	平成29年10月12日現在	平成30年4月12日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	153,207,422,796円	130,195,447,784円
同期中追加設定元本額	21,978,306,446円	13,550,648,868円
同期中一部解約元本額	44,990,281,458円	25,831,993,182円
元本の内訳		
ファンド名		
D I A M外国債券パッシブ・ファンド	6,759,004,134円	6,925,239,502円
M I T O ラップ型ファンド（安定型）	17,683,445円	14,295,981円
M I T O ラップ型ファンド（中立型）	50,060,065円	38,214,549円
M I T O ラップ型ファンド（積極型）	58,635,841円	47,727,917円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	44,669,472円	76,241,137円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	51,686,380円	79,108,387円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	39,602,572円	44,833,056円
たわらノーロード 先進国債券	1,039,135,759円	1,710,671,131円
たわらノーロード 先進国債券<ラップ向け>	606,412円	606,412円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	7,570,532円	29,682,907円
たわらノーロード バランス（堅実型）	- 円	458,186円

たわらノーロード バランス (標準型)	- 円	2,180,390円
たわらノーロード バランス (積極型)	- 円	868,548円
たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(保守型)	- 円	76,538円
たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(安定型)	- 円	4,459,441円
たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(安定成長 型)	- 円	2,825,787円
たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(成長型)	- 円	637,373円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定型)	- 円	83,913円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定成長型)	- 円	393,539円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(成長型)	- 円	220,837円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(積極型)	- 円	337,035円
D I A M外国債券インデックス ファンド< D C年金>	4,916,674,933円	5,079,966,547円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 1 安定型	455,372,807円	491,792,934円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 2 安定・成長型	1,489,280,019円	1,591,909,852円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 3 成長型	1,543,316,647円	1,690,571,535円
D I A M D C バランス3 0 インデックスファンド	358,729,368円	373,223,365円
D I A M D C バランス5 0 インデックスファンド	765,153,538円	794,591,614円
D I A M D C バランス7 0 インデックスファンド	582,487,469円	627,578,064円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型>	25,451,454円	23,962,825円
マネックス資産設計ファンド< 育成型>	600,460,341円	599,670,192円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	8,668,156円	17,303,931円
D I A M D C 8 資産バラ ンスファンド(新興国1 0)	16,036,948円	18,007,015円
D I A M D C 8 資産バラ ンスファンド(新興国2 0)	33,374,086円	40,891,423円
D I A M D C 8 資産バラ ンスファンド(新興国3 0)	60,124,279円	75,523,877円
クルーズコントロール D I A M 8 資産バランスファ ンドN< D C年金>	2,885,688,666円 59,102,207円	2,598,216,481円 72,533,521円
D I A M D C バランス・F (成長型)	94,306,759円	125,520,919円

クルーズコントロール<DC年金>	962,416円	1,009,886円
DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)	8,481,034円	8,241,980円
DIAMコア資産設計ファンド(積極型)	26,423,326円	25,673,925円
ダイナミック・ナビゲーション	365,719円	303,476円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	-円	1,399,728円
DIAMパッシブ資産分散ファンド	1,481,037,130円	1,370,643,849円
DIAM為替フルヘッジ型外国債券パッシブ私募ファンド(適格機関投資家向け)	7,003,675,809円	7,213,878,854円
DIAM外国債券パッシブファンド(適格機関投資家向け)	4,672,682,557円	4,074,076,473円
外国債券パッシブファンド(適格機関投資家限定)	4,149,925,792円	3,312,147,806円
先進国債券パッシブファンド(適格機関投資家限定)	576,382,992円	575,438,442円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	105,167,308円	105,085,382円
DIAMグローバル・バランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	1,024,861,880円	920,591,104円
DIAMグローバル・バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	730,837,466円	685,875,564円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	63,587,907円	55,601,422円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	132,619,902円	104,345,750円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	29,420,321円	25,601,826円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	12,367,624円	9,958,112円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	82,917,602円	67,333,025円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	91,738,276円	81,674,125円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	3,915,386,296円	3,686,897,827円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	2,574,346,852円	2,415,479,945円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	4,279,533,003円	4,069,631,657円

D I A Mグローバル・アセ ト・バランスV A (適格機関投 資家限定)	788,955,022円	736,405,912円
D I A Mグローバル・アセ ト・バランスV A 2 (適格機関 投資家限定)	745,760,084円	426,926,887円
D I A M アクサ グローバ ル バランスファンド30V A (適格機関投資家限定)	3,711,066,612円	3,485,310,971円
D I A M世界アセットバランス ファンドV A (適格機関投資家 向け)	13,443,641,306円	7,004,196,672円
D I A Mグローバル 私募ファ ンド(適格機関投資家向け)	13,975,529円	13,975,529円
D I A M世界バランスファンド 55V A (適格機関投資家限 定)	366,009,325円	48,037,463円
D I A M世界バランスファンド 35V A (適格機関投資家限 定)	5,331,508,870円	1,790,388,008円
D I A M世界アセットバランス ファンド2V A (適格機関投資 家限定)	15,297,076,561円	14,990,214,845円
D I A M世界アセットバランス ファンド3V A (適格機関投資 家限定)	19,723,402,912円	19,656,614,799円
D I A Mバランス30V A (適 格機関投資家限定)	14,585,789円	22,077,367円
D I A Mバランス50V A (適 格機関投資家限定)	16,997,854円	1,004,502円
D I A Mバランス70V A (適 格機関投資家限定)	6,104,411円	5,430,556円
D I A M世界アセットバランス ファンド4V A (適格機関投資 家限定)	17,579,189,791円	17,500,930,240円
D I A M世界バランス25V A (適格機関投資家限定)	106,638,471円	105,728,406円
D I A Mバランス20V A (適 格機関投資家限定)	124,537,679円	115,018,539円
D I A Mバランス40V A (適 格機関投資家限定)	237,498円	362,917円
D I A Mバランス60V A (適 格機関投資家限定)	156,569円	163,038円
計	130,195,447,784円	117,914,103,470円
2 . 受益権の総数	130,195,447,784口	117,914,103,470口

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	平成29年10月12日現在	平成30年4月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	平成29年10月12日 現在				平成30年4月12日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	212,343,756	-	212,334,760	8,996	36,253,762	-	36,252,940	822
アメリカ・ドル	106,131,088	-	106,124,480	6,608	-	-	-	-
ユーロ	106,212,668	-	106,210,280	2,388	36,253,762	-	36,252,940	822
買 建	668,376,422	-	670,384,330	2,007,908	3,774,409,887	-	3,770,416,470	3,993,417
アメリカ・ドル	300,629,777	-	301,001,880	372,103	1,622,948,950	-	1,620,069,500	2,879,450
イギリス・ポンド	100,188,900	-	100,521,000	332,100	301,893,704	-	301,698,880	194,824
オーストラリア・ドル	-	-	-	-	75,401,631	-	75,326,350	75,281
カナダ・ドル	-	-	-	-	113,131,007	-	113,228,170	97,163
ユーロ	267,557,745	-	268,861,450	1,303,705	1,661,034,595	-	1,660,093,570	941,025
合計	880,720,178	-	882,719,090	2,016,904	3,810,663,649	-	3,806,669,410	3,992,595

(注) 時価の算定方法

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

(1口当たり情報に関する注記)

	平成29年10月12日現在	平成30年4月12日現在
1口当たり純資産額	1.8458円	1.8081円
(1万口当たり純資産額)	(18,458円)	(18,081円)

「外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成29年10月12日現在	平成30年4月12日現在
資産の部			
流動資産			
預金		182,968,793	104,017,508
コール・ローン		88,895,743	50,051,202
投資信託受益証券		5,872,611,317	5,694,845,687
投資証券		47,940,640,288	42,523,554,037
派生商品評価勘定		51,430	-
未収入金		39,965,487	18,212,587
未収配当金		150,259,633	168,837,241
流動資産合計		54,275,392,691	48,559,518,262
資産合計		54,275,392,691	48,559,518,262
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		48	-
未払金		41,013,388	-
未払解約金		18,730,000	28,846,000
流動負債合計		59,743,436	28,846,000
負債合計		59,743,436	28,846,000
純資産の部			
元本等			
元本	1	44,747,514,208	44,104,061,016
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		9,468,135,047	4,426,611,246
元本等合計		54,215,649,255	48,530,672,262
純資産合計		54,215,649,255	48,530,672,262
負債純資産合計		54,275,392,691	48,559,518,262

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>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. 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>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建資産及び負債は、決算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	平成29年10月12日現在	平成30年4月12日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	32,289,268,109円	44,747,514,208円
同期中追加設定元本額	32,488,675,090円	20,573,456,119円
同期中一部解約元本額	20,030,428,991円	21,216,909,311円
元本の内訳		
ファンド名		
DIAM先進国REITインデックスファンド<為替ヘッジなし>（ファンドラップ）	205,700,602円	292,879,262円
DIAM先進国REITインデックスファンド<為替ヘッジあり>（ファンドラップ）	55,826,184円	94,801,262円
MITO ラップ型ファンド（安定型）	6,259,398円	5,765,047円
MITO ラップ型ファンド（中立型）	17,740,502円	21,338,908円
MITO ラップ型ファンド（積極型）	47,634,574円	42,539,087円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	15,606,433円	30,749,824円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	18,192,304円	44,713,212円

グローバル8資産ラップファンド(積極型)	32,172,218円	40,331,527円
たわらノーロード 先進国リート	1,496,284,921円	1,970,100,012円
たわらノーロード 先進国リート<ラップ向け>	284,177,943円	494,162,026円
たわらノーロード 先進国リート<為替ヘッジあり>	94,149,398円	130,046,321円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	11,546,932円	48,749,053円
たわらノーロード バランス(堅実型)	- 円	250,724円
たわらノーロード バランス(標準型)	- 円	4,476,370円
たわらノーロード バランス(積極型)	- 円	17,120,275円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定型)	- 円	1,833,194円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定成長型)	- 円	6,504,351円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(成長型)	- 円	6,292,205円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(積極型)	- 円	15,083,508円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	- 円	91,457円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	- 円	863,501円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	- 円	945,636円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	- 円	3,514,626円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	23,585,914円	24,205,250円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	549,048,886円	605,308,573円
マネックス資産設計ファンドエボリューション	55,119,951円	64,548,816円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	24,664,290円	29,922,458円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	77,113,431円	103,624,076円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	165,293,844円	227,469,128円
投資のソムリエ	6,322,217,084円	7,855,565,939円
投資のソムリエ<DC年金>	346,135,212円	561,088,174円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	91,488,902円	120,506,497円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	87,517,405円	82,130,610円
ダイナミック・ナビゲーション	281,864円	257,060円

リスク抑制世界8資産バランス ファンド	1,114,366,759円	1,355,929,896円
ワールドアセットバランス(基 本コース)	1,013,678,308円	1,433,453,250円
ワールドアセットバランス(リ スク抑制コース)	3,185,523,048円	5,155,614,364円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2045)	917,157円	1,509,762円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2055)	917,157円	1,105,725円
リスク抑制世界8資産バランス ファンド(DC)	332,244円	408,952円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2035)	-円	2,821,622円
DIAMパッシブ資産分散ファ ンド	1,236,222,443円	1,235,804,090円
DIAM外国リートインデック スファンド<DC年金>	14,433,432円	26,605,805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)	3,745,380,525円	2,087,041,705円
DIAMグローバル 私募ファ ンド(適格機関投資家向け)	11,580,328円	11,580,328円
DIAM世界アセットバランス ファンド2VA(適格機関投資 家限定)	11,765,204,391円	12,315,042,384円
DIAMグローバル・リスク ファクター・パリティ戦略ファ ンド(適格機関投資家限定)	3,750,764,522円	1,856,690,775円
DIAMグローバル・リスク ファクター・パリティ戦略ファ ンドII(適格機関投資家限 定)	4,158,683,455円	1,465,670,521円
P-Oneマルチアセット戦略 ファンド(適格機関投資家限 定)	4,161,300,139円	3,647,231,593円
DIAM海外リートインデック スファンド(適格機関投資家限 定)	560,452,108円	559,772,275円
計	44,747,514,208円	44,104,061,016円
2. 受益権の総数	44,747,514,208口	44,104,061,016口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	平成29年10月12日現在	平成30年4月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 該当事項はありません。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
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。	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)

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	平成29年10月12日 現在				平成30年4月12日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
買 建	44,753,738	-	44,805,120	51,382	-	-	-	-
アメリカ・ドル	41,551,370	-	41,602,800	51,430	-	-	-	-
ユーロ	3,202,368	-	3,202,320	48	-	-	-	-
合計	44,753,738	-	44,805,120	51,382	-	-	-	-

(注) 時価の算定方法

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

(1口当たり情報に関する注記)

	平成29年10月12日現在	平成30年4月12日現在
1口当たり純資産額	1.2116円	1.1004円
(1万口当たり純資産額)	(12,116円)	(11,004円)

「コモディティインデックス・マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位:円)

科 目	注記 番号	平成29年10月12日現在	平成30年4月12日現在
資産の部			
流動資産			
預金		4,651,991	10,321,057
コール・ローン		19,203,573	39,282,124
社債券		3,364,179,042	3,326,359,947
流動資産合計		3,388,034,606	3,375,963,128
資産合計		3,388,034,606	3,375,963,128
負債の部			
流動負債			
未払解約金		-	12,000,000
流動負債合計		-	12,000,000
負債合計		-	12,000,000
純資産の部			
元本等			
元本	1	8,614,336,937	7,808,042,605
剰余金			
剰余金又は欠損金()	2	5,226,302,331	4,444,079,477
元本等合計		3,388,034,606	3,363,963,128
純資産合計		3,388,034,606	3,363,963,128
負債純資産合計		3,388,034,606	3,375,963,128

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1 . 有価証券の評価基準及び評価方法	社債券 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 . その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、決算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目		平成29年10月12日現在	平成30年4月12日現在
1 .	1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	6,786,925,196円	8,614,336,937円
	同期中追加設定元本額	4,569,254,142円	1,152,608,787円
	同期中一部解約元本額	2,741,842,401円	1,958,903,119円
	元本の内訳		
	ファンド名		
	DIAMコモディティパッシブ・ファンド	8,236,606,483円	7,427,089,920円
	MITO ラップ型ファンド（安定型）	24,112,594円	15,315,018円
	MITO ラップ型ファンド（中立型）	58,985,902円	41,068,358円
	MITO ラップ型ファンド（積極型）	69,776,972円	51,384,803円
	グローバル8資産ラップファンド（安定型）	58,948,562円	80,563,402円
	グローバル8資産ラップファンド（中立型）	60,241,683円	85,346,686円
	グローバル8資産ラップファンド（積極型）	46,777,417円	48,387,094円
	DIAMグローバル 私募ファンド（適格機関投資家向け）	58,887,324円	58,887,324円
	計	8,614,336,937円	7,808,042,605円
2 .	受益権の総数	8,614,336,937口	7,808,042,605口
3 .	2 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は5,226,302,331円でありま す。	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は4,444,079,477円でありま す。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	平成29年10月12日現在	平成30年4月12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）

該当事項はありません。

（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。

（1口当たり情報に関する注記）

	平成29年10月12日現在	平成30年4月12日現在
1口当たり純資産額	0.3933円	0.4308円
（1万口当たり純資産額）	（3,933円）	（4,308円）

「エマージング株式パッシブ・マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成29年10月12日現在	平成30年4月12日現在
資産の部			
流動資産			
預金		4,636,774,438	2,607,397,541
コール・ローン		384,445,872	1,423,682,755
株式		56,116,574,203	61,660,799,446
投資信託受益証券		333,140,623	329,460,400
投資証券		123,998,335	117,511,185
派生商品評価勘定		90,629,467	33,021,622
未収入金		1,717,251	239,592
未収配当金		43,353,024	105,022,935
差入委託証拠金		953,904,110	1,559,291,415
流動資産合計		62,684,537,323	67,836,426,891
資産合計		62,684,537,323	67,836,426,891
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		1,590,811	2,547,914
未払金		3,251,499,722	976,454,229
未払解約金		358,385,000	8,059,000
流動負債合計		3,611,475,533	987,061,143
負債合計		3,611,475,533	987,061,143
純資産の部			
元本等			
元本	1	48,129,540,802	54,221,783,168
剰余金			
剰余金又は欠損金()		10,943,520,988	12,627,582,580
元本等合計		59,073,061,790	66,849,365,748
純資産合計		59,073,061,790	66,849,365,748
負債純資産合計		62,684,537,323	67,836,426,891

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	平成29年10月12日現在	平成30年4月12日現在
1 . 1 本報告書における開示対象ファ ンドの期首における当該親投資 信託の元本額	41,601,299,999円	48,129,540,802円
同期中追加設定元本額	25,159,751,529円	19,828,713,793円
同期中一部解約元本額	18,631,510,726円	13,736,471,427円
元本の内訳		
ファンド名		
D I A M新興国株式インデック スファンド< D C 年金 >	2,533,793,262円	3,436,593,075円
D I A M新興国株式インデック スファンド< 為替ヘッジなし > (ファンドラップ)	204,360,039円	504,683,941円
M I T O ラップ型ファンド (安定型)	6,887,807円	6,013,938円
M I T O ラップ型ファンド (中立型)	19,443,902円	15,725,843円
M I T O ラップ型ファンド (積極型)	22,799,425円	18,210,990円
グローバル8資産ラップファン ド(安定型)	17,399,331円	31,548,302円
グローバル8資産ラップファン ド(中立型)	20,095,548円	33,302,831円
グローバル8資産ラップファン ド(積極型)	15,397,583円	18,874,652円
たわらノーロード 新興国株式	2,545,896,989円	3,514,133,202円
たわらノーロード 新興国株式 <ラップ向け>	751,469,487円	1,097,240,442円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	11,493,669円	43,919,911円
たわらノーロード バランス (堅実型)	- 円	225,442円
たわらノーロード バランス (標準型)	- 円	806,087円
たわらノーロード バランス (積極型)	- 円	2,570,634円
たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(保守型)	- 円	22,478円
たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(安定型)	- 円	1,641,505円
たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(安定成長 型)	- 円	2,495,048円
たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(成長型)	- 円	1,878,514円
たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(積極型)	- 円	4,221,702円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定型)	- 円	20,102円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定成長型)	- 円	96,038円

たわらノーロード 最適化バ ランス(成長型)	- 円	129,858円
たわらノーロード 最適化バ ランス(積極型)	- 円	496,573円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	446,953,152円	429,132,057円
D I A M D C 8資産バラン スファンド(新興国10)	41,983,489円	43,983,763円
D I A M D C 8資産バラン スファンド(新興国20)	130,814,607円	150,861,940円
D I A M D C 8資産バラン スファンド(新興国30)	276,648,048円	331,857,161円
投資のソムリエ	4,408,438,749円	6,969,149,974円
クルーズコントロール	1,461,599,838円	1,270,017,724円
投資のソムリエ<DC年金>	241,913,905円	497,851,493円
D I A M 8資産バランスマ ファンドN<DC年金>	154,446,565円	177,667,170円
クルーズコントロール<DC年 金>	487,557円	493,741円
D I A Mコア資産設計ファンド (堅実型)	16,062,214円	15,100,712円
D I A Mコア資産設計ファンド (積極型)	50,216,666円	47,035,027円
投資のソムリエ<DC年金>リ スク抑制型	65,363,772円	109,132,260円
ダイナミック・ナビゲーション リスク抑制世界8資産バラン スファンド	1,673,502円	1,336,412円
ワールドアセットバランス(基 本コース)	834,286,491円	1,835,055,796円
ワールドアセットバランス(リ スク抑制コース)	1,496,560,495円	1,787,762,556円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2045)	4,750,542,159円	6,173,904,750円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2055)	667,986円	1,198,784円
リスク抑制世界8資産バラン スファンド(DC)	667,986円	876,734円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2035)	253,702円	557,334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)	- 円	2,248,337円
エマージング株式パッシブファ ンド(適格機関投資家限定)	5,261,664,672円	4,783,607,576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)	2,639,978,774円	2,636,951,676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)	11,978,525,624円	11,006,829,417円
計	7,720,753,807円	7,214,319,666円
	48,129,540,802円	54,221,783,168円

2 . 受益権の総数	48,129,540,802口	54,221,783,168口
------------	-----------------	-----------------

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	平成29年10月12日現在	平成30年4月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	平成29年10月12日 現在				平成30年4月12日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	673,335,817	-	674,057,349	721,532	47,980,882	-	47,891,282	89,600
アメリカ・ドル	673,335,817	-	674,057,349	721,532	47,980,882	-	47,891,282	89,600
買 建	695,259,082	-	697,541,604	2,282,522	1,441,422,294	-	1,438,874,380	2,547,914
アメリカ・ドル	21,923,265	-	21,921,900	1,365	1,393,441,412	-	1,390,981,440	2,459,972
インドネシア・ ルピア	70,505,722	-	71,190,000	684,278	-	-	-	-
コロンビア・ペ ソ	12,523,196	-	12,501,250	21,946	-	-	-	-
タイ・バーツ	63,541,367	-	63,647,250	105,883	-	-	-	-
フィリピン・ペ ソ	-	-	-	-	47,980,882	-	47,892,940	87,942
ブラジル・レア ル	261,381,708	-	260,543,564	838,144	-	-	-	-
マレーシア・リ ンギット	63,319,464	-	63,311,640	7,824	-	-	-	-
南アフリカ・ラ ンド	202,064,360	-	204,426,000	2,361,640	-	-	-	-
合計	1,368,594,899	-	1,371,598,953	1,560,990	1,489,403,176	-	1,486,765,662	2,458,314

(注) 時価の算定方法

1. 計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。
 計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。
 計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。
 - ・計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算しております。
 - ・計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。
2. 計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

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

株式関連

種類	平成29年10月12日 現在				平成30年4月12日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								
先物取引								
買 建	2,399,916,896	-	2,487,394,562	87,477,666	4,654,513,407	-	4,687,445,429	32,932,022
合計	2,399,916,896	-	2,487,394,562	87,477,666	4,654,513,407	-	4,687,445,429	32,932,022

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成29年10月12日現在	平成30年4月12日現在
1口当たり純資産額	1.2274円	1.2329円
(1万口当たり純資産額)	(12,274円)	(12,329円)

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

MITO ラップ型ファンド(安定型)

平成30年4月27日現在

資産総額	264,104,798円
負債総額	8,166,184円
純資産総額(-)	255,938,614円
発行済数量	250,768,259口
1口当たり純資産額(/)	1.0206円

MITO ラップ型ファンド(中立型)

平成30年4月27日現在

資産総額	396,832,935円
負債総額	2,303,321円
純資産総額(-)	394,529,614円
発行済数量	386,566,972口
1口当たり純資産額(/)	1.0206円

MITO ラップ型ファンド(積極型)

平成30年4月27日現在

資産総額	416,332,704円
負債総額	1,194,524円
純資産総額(-)	415,138,180円
発行済数量	405,588,715口
1口当たり純資産額(/)	1.0235円

(参考)

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

平成30年4月27日現在

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

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年4月27日現在

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

J - R E I Tインデックスファンド・マザーファンド

平成30年4月27日現在

資産総額	32,721,487,250円
負債総額	173,474,373円
純資産総額(-)	32,548,012,877円
発行済数量	18,056,021,514口
1口当たり純資産額(/)	1.8026円

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年4月27日現在

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

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年4月27日現在

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

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年4月27日現在

資産総額	49,897,565,981円
負債総額	52,027,387円
純資産総額(-)	49,845,538,594円
発行済数量	44,395,309,477口
1口当たり純資産額(/)	1.1228円

コモディティインデックス・マザーファンド

平成30年4月27日現在

資産総額	3,489,268,874円
負債総額	5,000,000円
純資産総額(-)	3,484,268,874円
発行済数量	7,787,599,368口
1口当たり純資産額(/)	0.4474円

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

平成30年4月27日現在

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

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 受益証券の名義書換

該当事項はありません。

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

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

(2) 受益者等名簿

該当事項はありません。

(3) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

(4) 受益権の譲渡制限

譲渡制限はありません。

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

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

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

(5) 受益権の譲渡の対抗要件

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

(6) 受益権の再分割

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

(7) 質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額（平成30年4月27日現在）

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

直近5カ年の資本金の増減：該当事項はありません。

(2) 会社の機構（平成30年4月27日現在）

会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。

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

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

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

また、取締役会の決議によって、取締役社長を定めることができます。

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

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

投資運用の意思決定機構

1. 投資環境見直しおよび運用方針の策定

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

2.運用計画、売買計画の決定

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

2【事業の内容及び営業の概況】

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

平成30年4月27日現在、委託会社の運用する投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除く）

基本的性格	本数	純資産総額（単位：円）
追加型公社債投資信託	38	1,176,800,622,980
追加型株式投資信託	846	12,687,192,173,919
単位型公社債投資信託	53	203,165,104,513
単位型株式投資信託	143	896,110,306,509
合計	1,080	14,963,268,207,921

3【委託会社等の経理状況】

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

(1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

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

（単位：千円）

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

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

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

（単位：千円）

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

（３）【株主資本等変動計算書】

第32期（自平成28年4月1日至平成29年3月31日）

（単位：千円）

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

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

第33期（自平成29年4月1日至平成30年3月31日）

（単位：千円）

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

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

重要な会計方針

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

会計上の見積りの変更

第33期 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)

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

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

追加情報

第33期 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)

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

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

注記事項

(貸借対照表関係)

1. 有形固定資産の減価償却累計額

(千円)

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

(損益計算書関係)

1. 関係会社に対する事項

(千円)

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

2. 固定資産売却益の内訳

(千円)

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

3. 固定資産除却損の内訳

(千円)

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

4. 固定資産売却損の内訳

(千円)

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

5. 本社移転費用の内訳

(千円)

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

(株主資本等変動計算書関係)

第32期(自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

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

第33期(自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

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

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

営業債務である未払手数料は、1年以内の支払期日であります。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

(4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

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

第32期（平成29年3月31日現在）

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

第33期(平成30年3月31日現在)

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

(注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3) 未収委託者報酬及び(4) 未収運用受託報酬

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

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

負 債

(1) 未払手数料

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

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(千円)

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

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

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

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第32期(平成29年3月31日現在)

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

第33期(平成30年3月31日現在)

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

(有価証券関係)

1. 子会社株式及び関連会社株式

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

2. その他有価証券

第32期(平成29年3月31日現在)

(千円)

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

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

第33期(平成30年3月31日現在)

(千円)

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

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

3. 当該事業年度中に売却したその他有価証券

第32期(自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)

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

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

第33期(自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)

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

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

4. 減損処理を行った有価証券

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

第33期において、該当事項はありません。

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

（退職給付関係）

1. 採用している退職給付制度の概要

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

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

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(千円)

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

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

(千円)

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

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

(千円)

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

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(千円)

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

(注) 特別損失に計上しております。

(5) 年金資産に関する事項

年金資産の主な内訳

年金資産合計に対する主な分類ごとの比率は、次のとおりであります。

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

長期期待運用収益率の設定方法

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

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎

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

3. 簡便法を適用した確定給付制度

(1) 簡便法を適用した制度の、退職給付引当金の期首残高と期末残高の調整表

(千円)

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

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

(千円)

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

(3) 退職給付費用

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

4. 確定拠出制度

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

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

繰延税金資産の純額

1,571,992

1,699,533

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

(企業結合等関係)

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

1. 結合当事企業

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

2. 企業結合日

平成28年10月1日

3. 企業結合の方法

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

4. 結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

5. 企業結合の主な目的

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

6. 合併比率

「3. 企業結合の方法」の吸収合併における合併比率は以下の通りであります。

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

(*) 普通株式と種類株式を合算して算定しております。

7. 交付した株式数

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

8. 経済的持分比率(議決権比率)

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

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

9. 取得企業を決定するに至った主な根拠

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

10. 会計処理

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

11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

(1) 財務諸表に含まれる被取得企業の業績の期間

平成29年4月1日から平成30年3月31日まで

(2) 被取得企業の取得原価及びその内訳

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

(3) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

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

(4) 企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

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

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

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

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

12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

(1) 貸借対照表項目

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

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

(2) 損益計算書項目

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

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

(資産除去債務関係)

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

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

(セグメント情報等)

1. セグメント情報

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

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

(1) サービスごとの情報

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

(2) 地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

(1) 親会社及び法人主要株主等

第32期(自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)

該当はありません。

第33期(自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)

該当はありません。

(2) 子会社及び関連会社等

第32期(自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)

該当はありません。

第33期(自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)

該当はありません。

(3) 兄弟会社等

第32期(自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)

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

第33期(自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

株式会社みずほフィナンシャルグループ

(東京証券取引所及びニューヨーク証券取引所に上場)

(2) 重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません。

(1株当たり情報)

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

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

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

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

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

4【利害関係人との取引制限】

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

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

5【その他】

- (1) 定款の変更、事業譲渡又は事業譲受、出資の状況その他の重要事項

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

- (2) 訴訟事件その他の重要事項

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託会社

a. 名称

みずほ信託銀行株式会社

b. 資本金の額

平成29年3月末日現在 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
静岡東海証券株式会社	600	「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。
水戸証券株式会社	12,272	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。

(注) 資本金の額は平成29年3月末日現在

(3)投資顧問会社

a. 名称

水戸証券株式会社

b. 資本金の額

平成29年3月末日現在 12,272百万円

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) 募集の取扱いおよび販売
- (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。

投資顧問会社は、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助言を行います。

3【資本関係】

該当事項はありません。

持株比率5%以上を記載します。

第3【その他】

- (1) 目論見書の表紙等にロゴ・マークや図案を使用し、ファンドの基本的性格を記載することがあります。また目論見書には「目論見書の使用開始日」、「委託会社の金融商品取引業者登録番号」、「金融商品取引法の規定に基づく目論見書である旨」、「投資信託の取引はクーリングオフ適用外である旨」、「請求目論見書の内容やその照会先と請求方法」、「信託財産の管理方法」、「投資信託運用による損益は全て投資家に帰属する旨」、「投資信託の元本は保証されていない旨」等を記載することがあります。
- (2) 目論見書には有価証券届出書の第一部「証券情報」、第二部「ファンド情報」の主要内容を要約し記載することがあります。第二部「ファンド情報」第1 ファンドの状況 5 運用状況には、参考情報として 基準価額・純資産の推移 分配の推移 主要な資産の状況 年間収益率の推移等（ベンチマークを含む）を記載することがあります。（表示されるデータは適宜更新されます。）
- (3) 請求目論見書の巻末に用語説明を掲載する場合があります。
なお、請求目論見書の巻末に信託約款を掲載し参照することで、有価証券届出書の内容の記載とすることがあります。
- (4) ファンドの特色やリスク等について投資者に開示すべき情報のあるファンドは、交付目論見書に「追加的記載事項」と明記して当該情報の内容等を有価証券届出書の記載に従い記載することがあります。
- (5) 交付目論見書の「お申込みメモ」に以下の内容を記載することがあります。
基準価額は、販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。
もしくは、計算日の翌日付の日本経済新聞朝刊の「オープン基準価格」の欄をご参照ください。

独立監査人の監査報告書

平成30年5月30日

アセットマネジメントOne株式会社
取締役会 御中

新日本有限責任監査法人

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

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

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

利害関係

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

以上

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

(注2) XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

平成29年11月29日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会御中

PwCあらた有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 佐々木 貴 司 印
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 鶴 田 光 夫 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているMITO ラップ型ファンド（安定型）の平成28年10月13日から平成29年10月12日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、MITO ラップ型ファンド（安定型）の平成29年10月12日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

平成29年11月29日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会御中

PwCあらた有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 佐々木 貴 司 印
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 鶴 田 光 夫 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているMITO ラップ型ファンド（中立型）の平成28年10月13日から平成29年10月12日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、MITO ラップ型ファンド（中立型）の平成29年10月12日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

平成29年11月29日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会御中

PwCあらた有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 佐々木 貴 司 印
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 鶴 田 光 夫 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているMITO ラップ型ファンド（積極型）の平成28年10月13日から平成29年10月12日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、MITO ラップ型ファンド（積極型）の平成29年10月12日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

平成30年6月1日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 湯原 尚 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているMITO ラップ型ファンド（安定型）の平成29年10月13日から平成30年4月12日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、MITO ラップ型ファンド（安定型）の平成30年4月12日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成29年10月13日から平成30年4月12日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

その他の事項

ファンドの平成29年10月12日をもって終了した前計算期間の中間計算期間に係る中間財務諸表及び前計算期間の財務諸表は、それぞれ、前任監査人によって中間監査及び監査が実施されている。前任監査人は、当該中間財務諸表に対して平成29年5月31日付けで有用な情報を表示している旨の意見を表明しており、また、当該財務諸表に対して平成29年11月29日付けで無限定適正意見を表明している。

利害関係

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

以 上

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

(注2) X B R L データは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の中間監査報告書

平成30年6月1日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 湯原 尚 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているMITO ラップ型ファンド（中立型）の平成29年10月13日から平成30年4月12日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、MITO ラップ型ファンド（中立型）の平成30年4月12日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成29年10月13日から平成30年4月12日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

その他の事項

ファンドの平成29年10月12日をもって終了した前計算期間の中間計算期間に係る中間財務諸表及び前計算期間の財務諸表は、それぞれ、前任監査人によって中間監査及び監査が実施されている。前任監査人は、当該中間財務諸表に対して平成29年5月31日付けで有用な情報を表示している旨の意見を表明しており、また、当該財務諸表に対して平成29年11月29日付けで無限定適正意見を表明している。

利害関係

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

以 上

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

(注2) X B R L データは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の中間監査報告書

平成30年6月1日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 湯原 尚 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているMITO ラップ型ファンド（積極型）の平成29年10月13日から平成30年4月12日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、MITO ラップ型ファンド（積極型）の平成30年4月12日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成29年10月13日から平成30年4月12日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

その他の事項

ファンドの平成29年10月12日をもって終了した前計算期間の中間計算期間に係る中間財務諸表及び前計算期間の財務諸表は、それぞれ、前任監査人によって中間監査及び監査が実施されている。前任監査人は、当該中間財務諸表に対して平成29年5月31日付けで有用な情報を表示している旨の意見を表明しており、また、当該財務諸表に対して平成29年11月29日付けで無限定適正意見を表明している。

利害関係

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

以 上

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

(注2) X B R L データは監査の対象には含まれておりません。