【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	2019年1月11日
【発行者名】	アセットマネジメントOne株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長　　菅野　暁
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目８番２号
【事務連絡者氏名】	三木谷　正直
【電話番号】	03-6774-5100
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	グローバル８資産ラップファンド（安定型） グローバル８資産ラップファンド（中立型） グローバル８資産ラップファンド（積極型）
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】	グローバル８資産ラップファンド（安定型） 5,000億円を上限とします。 グローバル８資産ラップファンド（中立型） 5,000億円を上限とします。 グローバル８資産ラップファンド（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】

グローバル８資産ラップファンド（安定型）
グローバル８資産ラップファンド（中立型）
グローバル８資産ラップファンド（積極型）
（以下、総称して「グローバル８資産ラップファンド」、「グローバル８資産ラップファンド（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、「グローバル８資産ラップファンド（安定型）」は「安定型」、「グローバル８資産ラップファンド（中立型）」は「中立型」、「グローバル８資産ラップファンド（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「グロ８」または「グロ８（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、「グローバル８資産ラップファンド（安定型）」の愛称として「グロ８（安定型）」、「グローバル８資産ラップファンド（中立型）」の愛称として「グロ８（中立型）」、「グローバル８資産ラップファンド（積極型）」の愛称として「グロ８（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1万口当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：2019年1月12日から2019年7月12日まで

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

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

（８）【申込取扱場所】

ファンドのお申込みにかかる取扱い等は販売会社が行っております。

※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。

（１０）【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）

（１１）【振替機関に関する事項】

ファンドの受益権にかかる振替機関は以下の通りです。

株式会社証券保管振替機構

（１２）【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】

①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。

②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。

③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、対円での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処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、購入時手数料がかかる場合があります。販売会社によっては、スイッチングの取扱いを行わない場合があります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

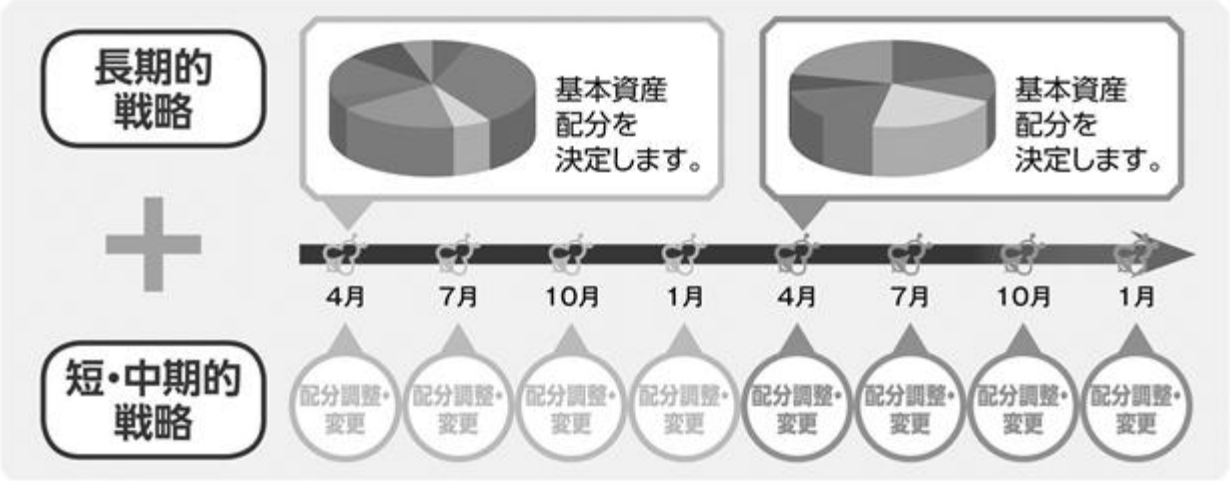
3 各資産への投資割合の決定にあたっては、水戸証券株式会社の投資助言を受けます。

・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。

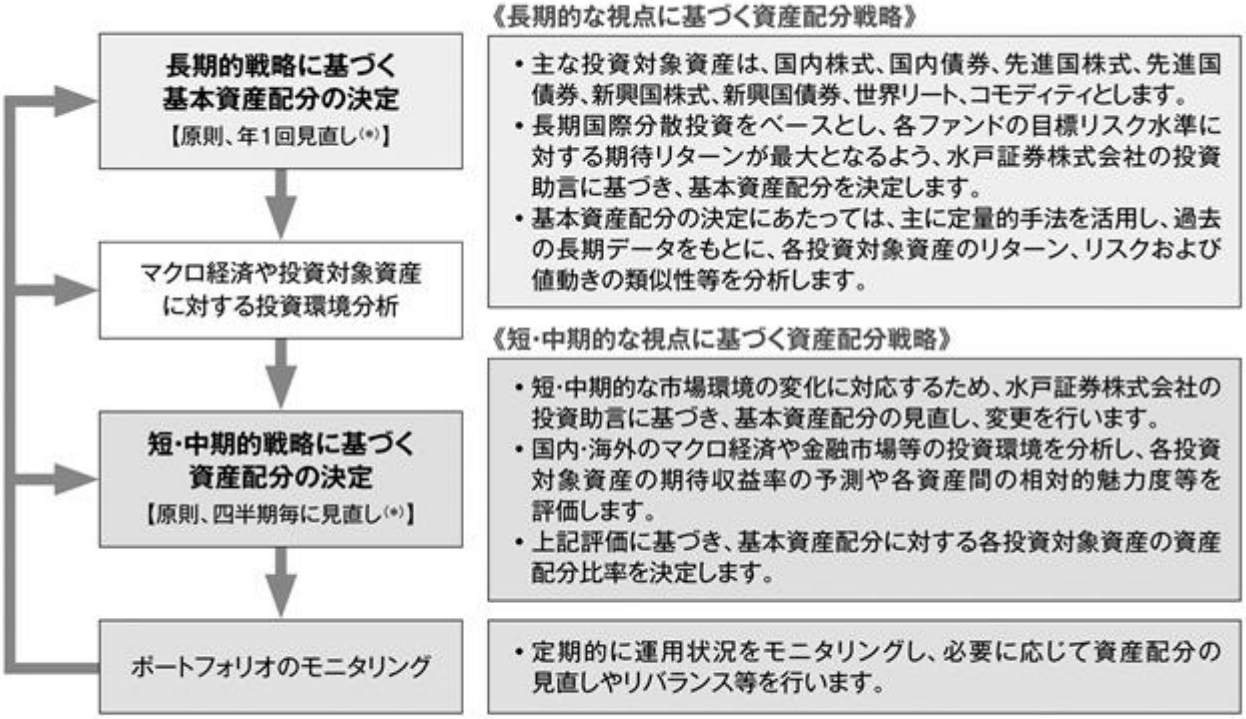
※市場環境等によっては、一部の資産への投資割合がゼロとなる場合があります。
※コモディティへの投資割合は、原則として、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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



《長期的な視点に基づく資産配分戦略》

- 主な投資対象資産は、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、コモディティとします。
- 長期国際分散投資をベースとし、各ファンドの目標リスク水準に対する期待リターンが最大となるよう、水戸証券株式会社の投資助言に基づき、基本資産配分を決定します。
- 基本資産配分の決定にあたっては、主に定量的手法を活用し、過去の長期データをもとに、各投資対象資産のリターン、リスクおよび値動きの類似性等を分析します。

《短･中期的な視点に基づく資産配分戦略》

- 短･中期的な市場環境の変化に対応するため、水戸証券株式会社の投資助言に基づき、基本資産配分の見直し、変更を行います。
- 国内･海外のマクロ経済や金融市場等の投資環境を分析し、各投資対象資産の期待収益率の予測や各資産間の相対的魅力度等を評価します。
- 上記評価に基づき、基本資産配分に対する各投資対象資産の資産配分比率を決定します。

- 定期的に運用状況をモニタリングし、必要に応じて資産配分の見直しやリバランス等を行います。

※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 追加型投信	国　内 海　外 内　外	株　式 債　券 不動産投信 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 債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 （　　） 不動産投信 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）） 資産複合 （　　） 資産配分固定型 資産配分変更型	年1回 年2回 年4回 年6回 （隔月） 年12回 （毎月） 日々 その他 （　　）	グローバル （日本含む） 日本 北米 欧州 アジア オセアニア 中南米 アフリカ 中近東 （中東） エマージング	ファミリーファンド ファンド・オブ・ファンズ	あり （　　） なし

※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

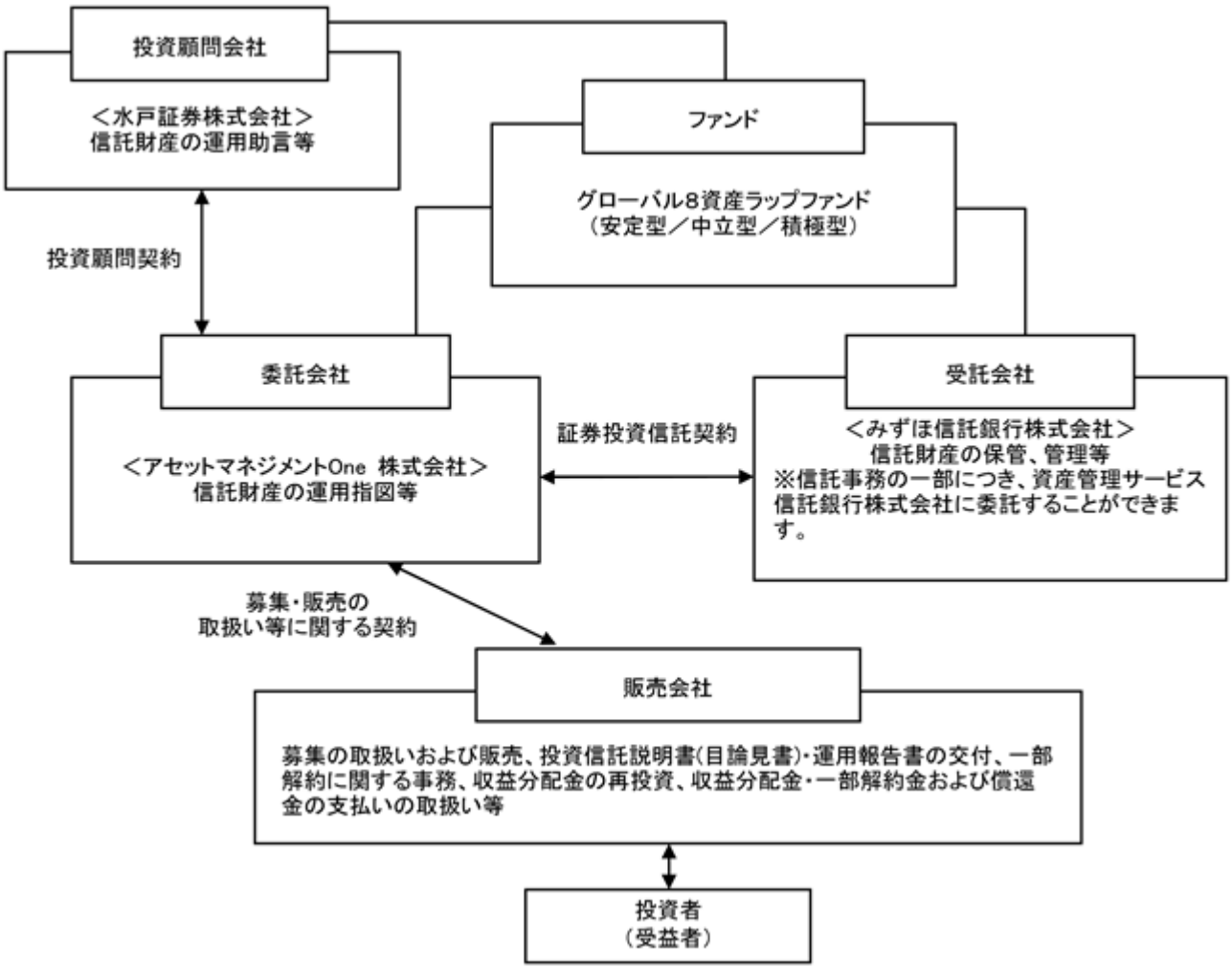
その他資産（投資信託証券（資産複合（株式、債券、不動産投信）資産配分変更型））	目論見書または投資信託約款において、投資信託証券への投資を通じて、主として複数の資産（株式、債券、不動産投信）を実質的な投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行う旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないものをいいます。 （注）商品分類表の投資対象資産は資産複合に分類され、属性区分表の投資対象資産はその他資産（投資信託証券（資産複合（株式、債券、不動産投信）資産配分変更型））に分類されます。
年1回	目論見書または投資信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。
グローバル（日本含む）	目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本を含む世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
ファンド・オブ・ファンズ	「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。
為替ヘッジなし	目論見書または投資信託約款において、対円での為替のヘッジを行なわない旨の記載があるものまたは対円での為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいいます。

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

（２）【ファンドの沿革】

2015年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

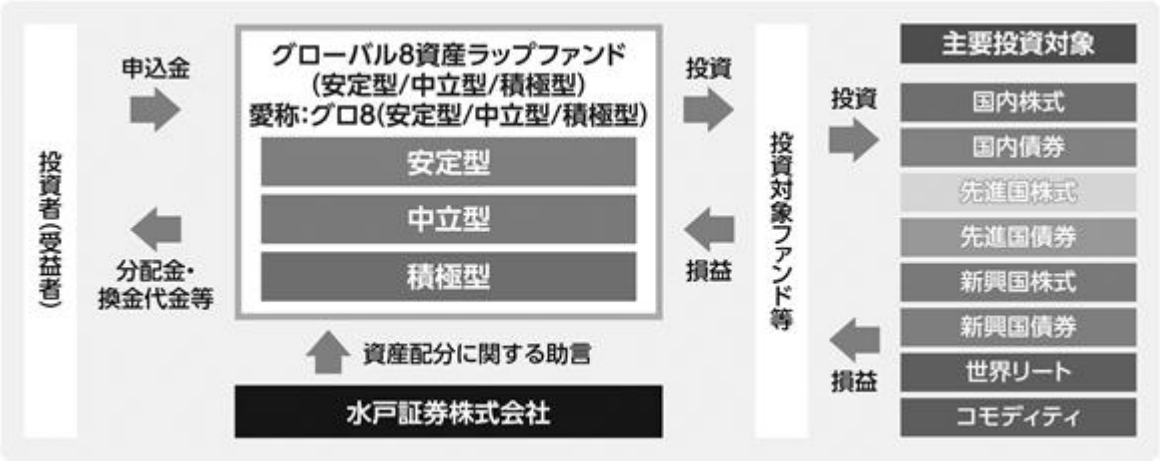
委託会社と販売会社との間においては、募集・販売の取扱い等に関する契約を締結しております。当該契約の内容は、証券投資信託の募集・販売の取扱い、一部解約に関する事務、収益分配金の再投資、収益分配金・一部解約金および償還金の受益者への支払い等に関する包括的な規則を定めたものです。

・「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）との間においては、各ファンドの運用にかかる助言契約が締結されております。当該契約の内容は、投資顧問サービスの内容、助言の基本方針、運用の責任等について規定したものです。

●ファンド・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（2018年10月31日現在）

委託会社の沿革

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

大株主の状況

（2018年10月31日現在）

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

※1：A種種類株式（15,510株）を含みます。

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

2【投資方針】

（1）【投資方針】

＜基本方針＞

信託財産の成長を図ることを目的として、運用を行います。

＜投資対象＞

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＞

①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に実質的に投資を行います。

②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て決定します。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。

③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。

④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。

⑤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。

⑥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。

⑦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】

①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

②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。)

③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②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。)

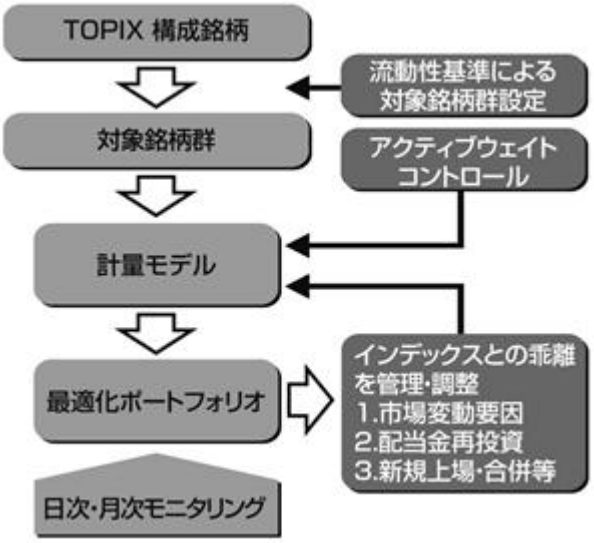
3. コール・ローン

4. 手形割引市場において売買される手形

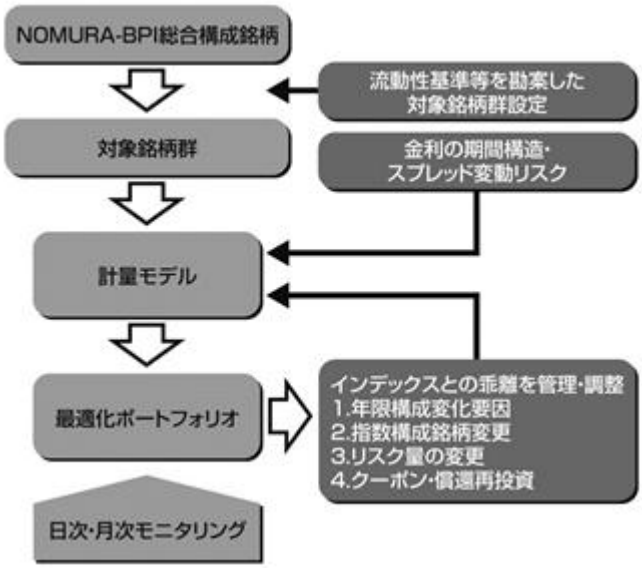
（参考）各ファンドが投資対象とする投資信託証券の概要

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	1.主として東京証券取引所第1部に上場されている株式に投資し、「東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）（配当込み）※」に連動する投資成果をめざして運用を行います。 2.最適化法によるポートフォリオ構築を行い、運用コストの最小化と徹底したリスク管理を行います。 3.株式（株価指数先物取引を含みます。）の組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。 4.株式の組入比率の調整には、株価指数先物取引等を活用します。 5.非株式割合は原則として信託財産総額の50%以下とします。また、外貨建資産割合は原則として信託財産総額の10%以下とします。 ※①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「㈱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㈱東京証券取引所が有しています。 ②㈱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。 ③㈱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。 ④㈱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、㈱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。 ⑤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、㈱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。 ⑥㈱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。 ⑦㈱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。 ⑧以上の項目に限らず、㈱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。

運用プロセス	1.流動性基準による対象銘柄群設定 マーケットインパクトの低減を図る為、ＴＯＰＩＸ採用銘柄のうち、流動性が低い銘柄を除外して投資対象銘柄群を設定します。 2.最適化法によるポートフォリオの構築 インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差（アクティブウェイト）を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。 3.インデックスとの乖離を管理 日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。 インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。 ・市場変動に伴うもの：推定トラッキングエラーの増加に伴い実施 ・新規上場、合併等に伴うもの：指数に与える影響を勘案し、決定 ・配当金再投資に伴うもの：キャッシュ比率の上昇に伴い実施 
主な投資制限	1.株式への投資割合には、制限を設けません。 2.デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 3.外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。 4.一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
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－ＢＰＩ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	1.主としてわが国の公社債に投資し、「ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合」※に連動する投資成果をめざして運用を行います。 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。 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。 ※ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ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。
運用プロセス	1.流動性基準等による対象銘柄群設定 ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ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。 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。 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 

主な投資制限	1.株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限ります。 2.株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 3.同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 4.同一銘柄の転換社債、ならびに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。

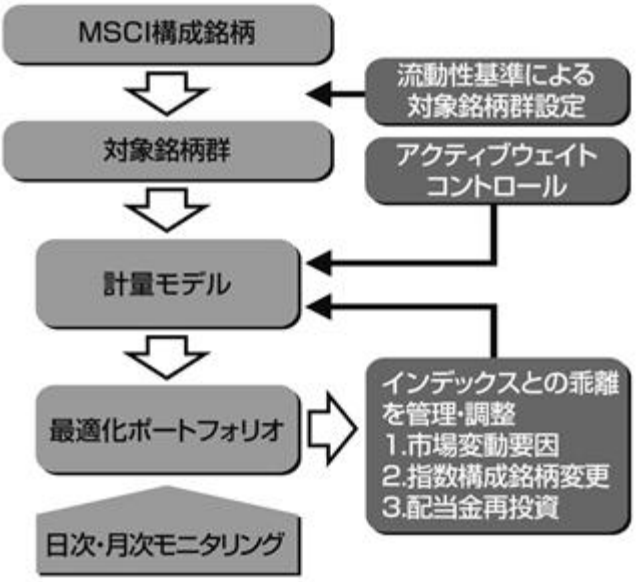
ファンド名	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。
主な投資対象	海外の株式を主要投資対象とします。

投資態度	**1.主に海外の株式に投資を行い、ＭＳＣＩコクサイ・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）※に連動する投資成果をめざして運用を行います。** **2.株式への投資は原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。** **3.組入外貨建資産については原則為替ヘッジは行いませんが、金利・為替状況によってはヘッジを実施する可能性があります。**

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

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

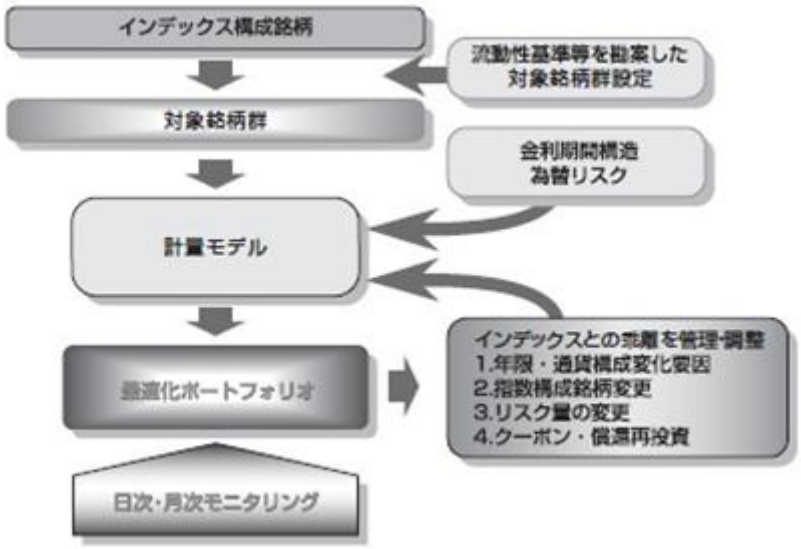
本証券、本商品もしくは本ファンドの購入者、販売者もしくは所有者、またはその他いかなる者もしくは団体も、MSCIの承認が必要か否かの確認を事前にMSCIに求めることなく、本証券を保証、推奨、販売、または宣伝するためにMSCIのトレードネーム、トレードマークまたはサービスマークを使用したり、それらに言及することはできません。いかなる状況においても、いかなる者ま

	たは団体も、事前にMSCIの書面による承認を得ることなくMSCIとの関係を主張することはできません。
運用プロセス	1.流動性基準による対象銘柄群設定 取引コスト、マーケットインパクトの低減を図る為、ＭＳＣＩコクサイ・インデックス構成銘柄のうち、流動性が著しく低くかつ時価総額比率が小さい銘柄を除外して投資銘柄群を設定します。 2.最適化法によるポートフォリオの構築 インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差（アクティブウェイト）を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。 3.インデックスとの乖離を管理 日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理して、必要な場合は速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。 インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。 ・市場変動に伴うもの：推定トラッキングエラーの増加に伴い実施 ・ベンチマーク構成銘柄の変更に伴うもの：四半期に一度の銘柄入替、コーポレートアクションおよび指数構築手法の変更に伴い実施 ・配当金再投資に伴うもの：キャッシュ比率の上昇に伴い実施 

主な投資制限	1.株式への投資割合には、制限を設けません。 2.新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において、原則として信託財産の純資産総額の20%以下とします。 3.同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、原則として信託財産の純資産総額の10%以下とします。 4.外貨建資産への投資には、制限を設けません。 5.デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 6.外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。 7.一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
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	**1.主に日本を除く世界主要国の公社債に投資し、「FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）」※に連動する投資成果をめざして運用を行います。** **2.外国債券への投資は原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。** **3.外貨建資産については原則為替ヘッジは行いませんが、金利・為替状況によってはヘッジを実施する可能性があります。** **※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。** **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。**

運用プロセス	**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。** **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。** **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。** **・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	1.株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限ります。 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 2.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。 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。 4.外貨建資産への投資には、制限を設けません。 5.デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 6.外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。 7.一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
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。

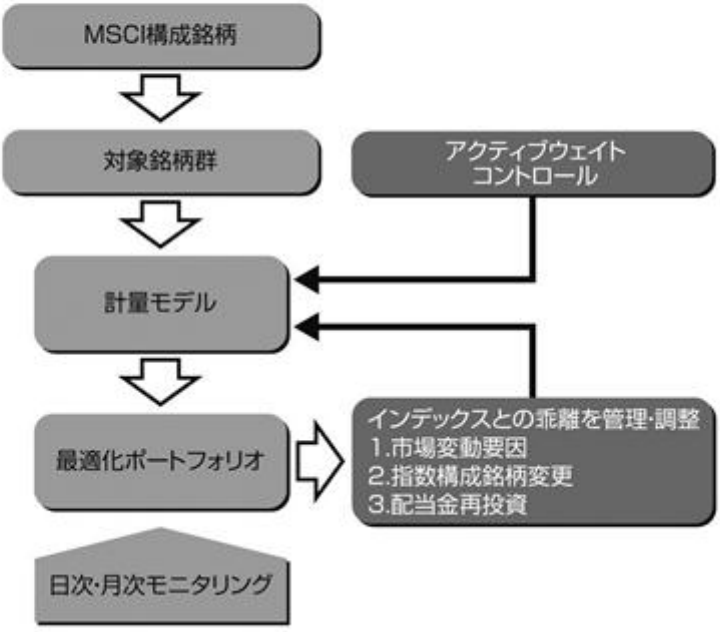
ファンド名	エマージング株式パッシブ・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、主として海外の証券取引所に上場している株式（＊）に投資し、ＭＳＣＩエマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。 （＊）ＤＲ（預託証券）もしくは株式と同等の投資効果が得られる権利を表示する証券および証書等を含みます。
主な投資対象	海外の証券取引所に上場している株式を主要投資対象とします。

投資態度	**1.主として海外の証券取引所に上場している株式に投資し、ＭＳＣＩエマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）※の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。** **2.原則として、株式の組入比率は高位を維持します。** **3.外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。**

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

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

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

	たは団体も、事前にMSCIの書面による承認を得ることなくMSCIとの関係を主張することはできません。
運用プロセス	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。 
主な投資制限	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。

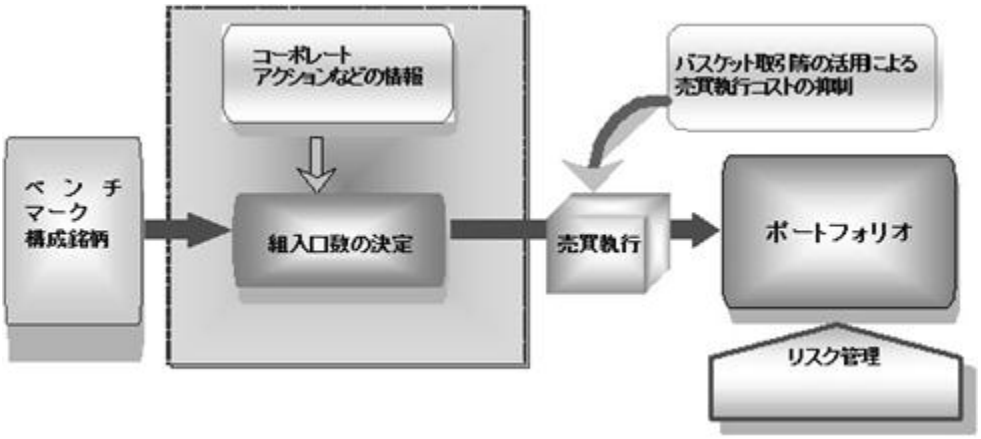
ファンド名	iシェアーズ J.P.モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券 ETF
ファンドの形態等	オープンエンド型の外国投資信託（契約型）

表示通貨	米ドル
ファンドの目的および基本的性格	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）をあげることを目標としています。 ※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。
主要関係法人	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
投資の基本方針	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。
主な投資制限	当ファンドは、原則として以下を行いません。 ・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 など
運用報酬等	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。

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－ＲＥＩＴ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。**
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	**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。** **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。** **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。** **※①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「㈱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㈱東京証券取引所が有しています。** **②㈱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。** **③㈱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。** **④㈱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、㈱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。** **⑤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、㈱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。** **⑥㈱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。** **⑦㈱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。** **⑧以上の項目に限らず、㈱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。**

運用プロセス	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。 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。 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。 
主な投資制限	1.投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 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。 3.株式への投資は行いません。 4.外貨建資産への投資は行いません。 5.デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動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。 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	外国リート・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、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。

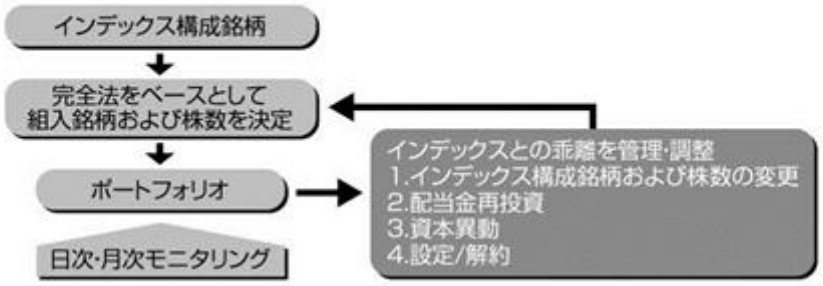
主な投資対象	**日本を除く世界各国の不動産投資信託証券※を主要投資対象とします。** **※海外の証券取引所に上場（これに準ずるものを含みます。）されている不動産投資信託証券とします。**

投資態度	**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 ＲＥＩＴ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 ＲＥＩＴ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 ＲＥＩＴ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 ＲＥＩＴ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 ＲＥＩＴ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 ＲＥＩＴ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。

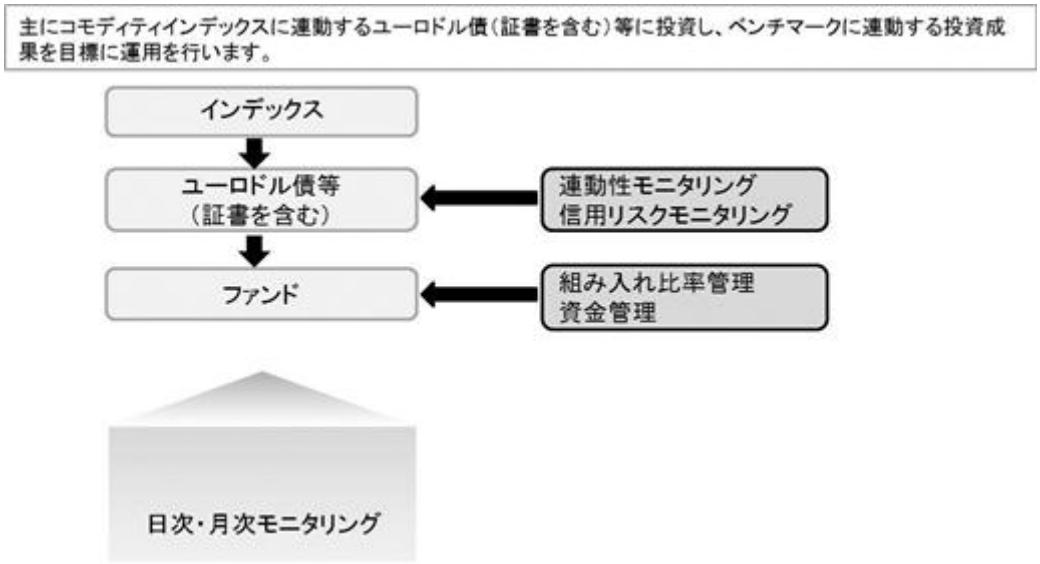
S&P Dow Jones Indicesは、Ｓ＆Ｐ 先進国 ＲＥＩＴインデックスまたはその関連データ、あるいは口頭または書面の通信（電子通信も含む）を含むがこれに限定されないあらゆる通信について、その妥当性、正確性、適時性、または完全性を保証しません。S&P Dow Jones Indicesは、これに含まれる過誤、遺漏または中断に対して、いかなる義務または責任も負わないものとします。

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 ＲＥＩＴ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

	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。
運用プロセス	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。 
主な投資制限	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（証書を含みます。）を主要投資対象とします。
投資態度	1.主として、S&P GSCI商品指数※に連動するユーロドル債（証書を含みます。）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。 2.ユーロドル債（証書を含みます。）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。 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。 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。 ※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サーのいずれも、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。

運用プロセス	
主な投資制限	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。
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。

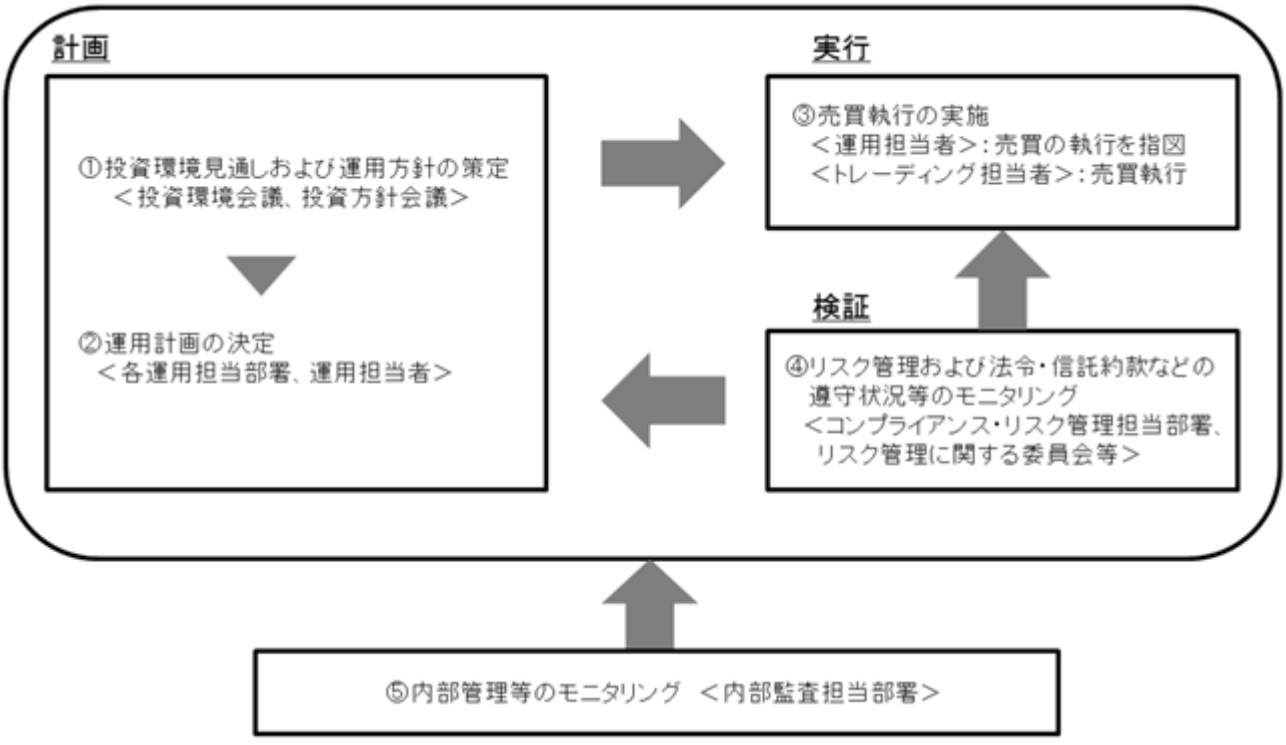
(注1)上記内容は原則として、2018年10月末時点の情報をもとに作成したものであり、今後、投資信託証券は追加・除外・入替等が行われることがあります。

(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



① 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。

② 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。

③ 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。

④ 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。
定期的に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。

⑤　内部管理等のモニタリング

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

ｂ．ファンドの関係法人に関する管理

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

ｃ．運用体制に関する社内規則

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

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

※運用体制は2018年10月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

※上記体制は、マザーファンドを通じた実質的な運用体制を記載しております。

（４）【分配方針】

①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。

②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」と言います。）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。

③収益分配金の支払い

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

①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）

②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）

③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）

④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）

⑤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）

⑥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）

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）

⑧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。

⑨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。

⑩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。

⑪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。

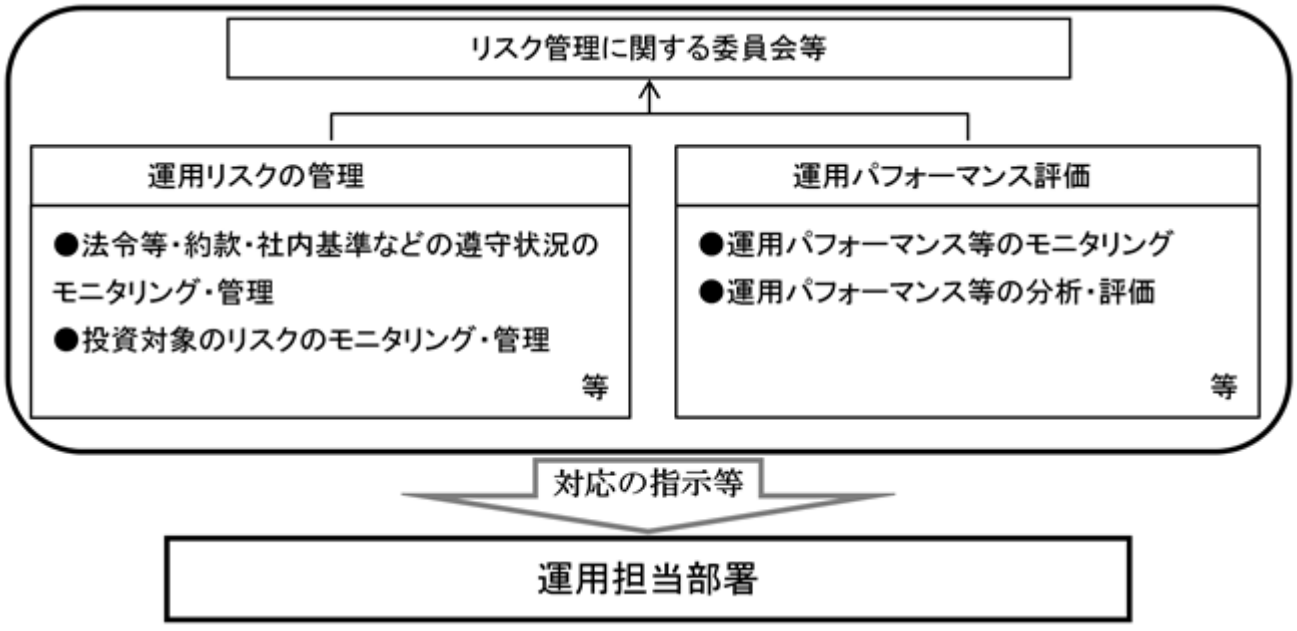
○注意事項

- **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、これによる損失は購入者が負担することとなります。**

＜リスク管理体制＞

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

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



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

<参考情報>

ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移

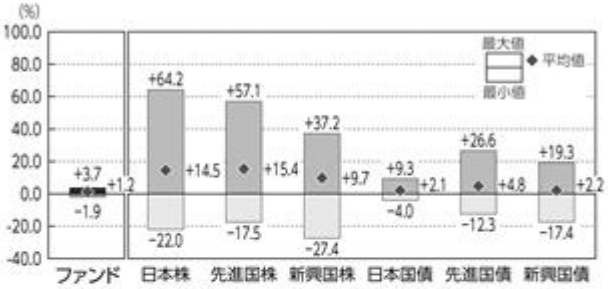
「安定型」

「中立型」

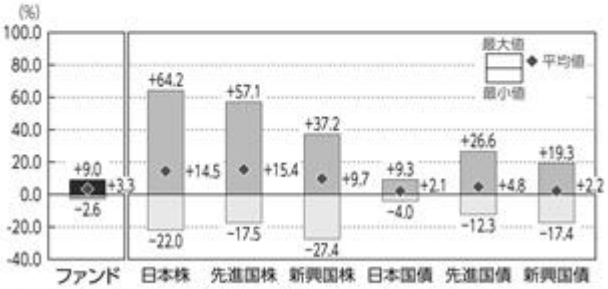
「積極型」

*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。

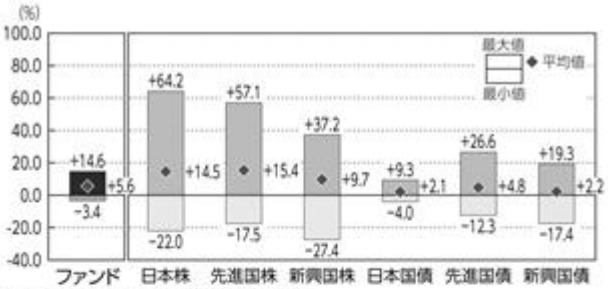
ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



ファンド:2016年12月～2018年10月
代表的な資産クラス:2013年11月～2018年10月



ファンド:2016年12月～2018年10月
代表的な資産クラス:2013年11月～2018年10月



ファンド:2016年12月～2018年10月
代表的な資産クラス:2013年11月～2018年10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)
日本国債… NOMURA-BPI国債
先進国債… FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)
新興国債… JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイド(円ベース)
(注)海外の指数は為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

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

<table>
<tr><td>各ファンド</td><td>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。
<table>
<tr><th>支払先</th><th>内訳（税抜）</th><th>主な役務</th></tr>
<tr><td>委託会社</td><td>年率0.69%</td><td>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</td></tr>
<tr><td>販売会社</td><td>年率0.50%</td><td>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</td></tr>
<tr><td>受託会社</td><td>年率0.04%</td><td>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</td></tr>
</table>
※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。</td></tr>
<tr><td>投資対象とする外国投資信託</td><td>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0.39%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、2018年9月末時点のものです。</td></tr>
</table>

実質的な負担	各ファンドの日々の純資産総額に対して年率1.3459500%～1.4180532%程度（税抜1.2475500%～1.3196532%程度）（概算） ※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（2018年9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。

◆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。

①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。

②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。

③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。

④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

①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。

②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。

③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ます。）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、ご留意ください。

○法人の受益者に対する課税

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

なお、益金不算入制度の適用はありません。

※上記は、2018年10月末現在のものです。税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。

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

◇個別元本方式について

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

＜個別元本について＞

①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。

②受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。

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

③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、①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、②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】

グローバル８資産ラップファンド（安定型）

平成30年10月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券		118,560,114	7.33
	内　アメリカ	118,560,114	7.33
親投資信託受益証券		1,421,343,575	87.82
	内　日本	1,421,343,575	87.82
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		78,544,838	4.85
純資産総額		1,618,448,527	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。

グローバル８資産ラップファンド（中立型）

平成30年10月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券		128,321,088	14.44
	内　アメリカ	128,321,088	14.44
親投資信託受益証券		721,614,678	81.18
	内　日本	721,614,678	81.18
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		39,004,176	4.39
純資産総額		888,939,942	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。

グローバル８資産ラップファンド（積極型）

平成30年10月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券		70,945,610	16.84
	内　アメリカ	70,945,610	16.84
親投資信託受益証券		337,550,742	80.11
	内　日本	337,550,742	80.11
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		12,887,368	3.06
純資産総額		421,383,720	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。
（注2）資産の種類の内書は、当該資産の発行体又は上場金融商品取引所の国/地域別に表示しています。

（参考）

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

平成30年10月31日現在

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

その他資産の投資状況

平成30年10月31日現在

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

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年10月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券		284,261,100,800	83.80
	内　日本	284,261,100,800	83.80
地方債証券		21,800,069,774	6.43
	内　日本	21,800,069,774	6.43
特殊債券		17,180,972,111	5.06
	内　日本	17,180,972,111	5.06
社債券		15,034,055,890	4.43
	内　日本	14,634,211,890	4.31
	内　オランダ	200,744,000	0.06
	内　フランス	199,100,000	0.06
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		936,234,209	0.28
純資産総額		339,212,432,784	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド

平成30年10月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券		29,886,239,950	97.06
	内　日本	29,886,239,950	97.06
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		905,049,781	2.94
純資産総額		30,791,289,731	100.00

その他資産の投資状況

平成30年10月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率(%)
不動産投信指数先物取引（買建）		610,740,000	1.98
	内　日本	610,740,000	1.98

（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10月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
株式		298,982,448,414	93.15
	内　アメリカ	194,588,081,245	60.62
	内　イギリス	19,054,175,902	5.94
	内　フランス	11,432,683,287	3.56
	内　カナダ	11,375,215,990	3.54
	内　スイス	10,774,253,060	3.36
	内　ドイツ	10,364,122,028	3.23
	内　オーストラリア	7,166,785,643	2.23
	内　オランダ	5,273,318,705	1.64
	内　アイルランド	4,909,992,354	1.53
	内　スペイン	3,452,035,639	1.08
	内　スウェーデン	2,767,082,552	0.86
	内　香港	2,647,518,136	0.82
	内　イタリア	2,157,110,526	0.67
	内　デンマーク	1,917,056,462	0.60
	内　ジャージィー	1,560,970,632	0.49
	内　フィンランド	1,415,947,069	0.44
	内　シンガポール	1,306,866,169	0.41
	内　バミューダ	1,209,827,608	0.38
	内　ベルギー	1,130,962,988	0.35
	内　ノルウェー	865,664,721	0.27
	内　ケイマン諸島	749,854,631	0.23
	内　オランダ領キュラソー	660,242,609	0.21
	内　イスラエル	583,951,232	0.18
	内　ルクセンブルグ	381,635,708	0.12
	内　オーストリア	257,292,411	0.08
	内　ニュージーランド	242,501,908	0.08
	内　パナマ	194,479,226	0.06
	内　ポルトガル	177,560,541	0.06
	内　リベリア	141,750,590	0.04
	内　パプアニューギニア	85,872,387	0.03
	内　イギリス領バージン諸島	75,130,080	0.02
	内　マン島	48,359,034	0.02
	内　モーリシャス	14,147,341	0.00
投資信託受益証券		734,859,972	0.23
	内　オーストラリア	602,011,483	0.19

	内　シンガポール	132,848,489	0.04
投資証券		6,944,092,029	2.16
	内　アメリカ	6,095,664,613	1.90
	内　イギリス	245,383,025	0.08
	内　オランダ	212,964,578	0.07
	内　フランス	174,477,976	0.05
	内　香港	170,223,774	0.05
	内　カナダ	45,378,063	0.01
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		14,324,223,077	4.46
純資産総額		320,985,623,492	100.00

その他資産の投資状況

平成30年10月31日現在

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

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。
（注2）資産の種類の内書は、当該資産の発行体又は上場金融商品取引所の国/地域別に表示しています。
（注3）為替予約取引の時価は、原則としてわが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しています。
（注4）先物取引の時価は、原則として計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年10月31日現在

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

その他資産の投資状況

平成30年10月31日現在

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

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年10月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
投資信託受益証券		4,065,605,012	10.11
	内　オーストラリア	2,719,203,589	6.76
	内　シンガポール	1,327,917,443	3.30
	内　カナダ	18,483,980	0.05
投資証券		35,823,029,429	89.10
	内　アメリカ	28,949,287,907	72.00
	内　イギリス	2,091,055,754	5.20
	内　オランダ	1,061,959,614	2.64
	内　フランス	940,314,803	2.34
	内　香港	828,626,919	2.06
	内　カナダ	731,665,334	1.82
	内　ベルギー	307,406,783	0.76
	内　スペイン	299,836,464	0.75
	内　ニュージーランド	170,022,291	0.42
	内　ドイツ	112,105,073	0.28
	内　アイルランド	99,672,967	0.25
	内　シンガポール	88,662,910	0.22
	内　ガーンジィ	56,154,354	0.14
	内　イタリア	43,254,183	0.11
	内　イスラエル	24,166,196	0.06
	内　マン島	18,837,877	0.05
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		316,353,858	0.79
純資産総額		40,204,988,299	100.00

その他資産の投資状況

平成30年10月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率(%)
為替予約取引（買建）		10,627,500	0.03
	―	10,627,500	0.03
為替予約取引（売建）		151,122,500	△0.38
	―	151,122,500	△0.38

（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10月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
社債券		3,785,640,243	99.46
	内　イギリス	3,785,640,243	99.46
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		20,729,061	0.54
純資産総額		3,806,369,304	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10月31日現在

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

その他資産の投資状況

平成30年10月31日現在

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

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。
（注2）資産の種類の内書は、当該資産の発行体又は上場金融商品取引所の国/地域別に表示しています。
（注3）為替予約取引の時価は、原則としてわが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しています。
（注4）先物取引の時価は、原則として計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

（２）【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

グローバル８資産ラップファンド（安定型）

平成30年10月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率(%) 償還日	投資比率
1	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	808,008,087	1.2785 1,033,119,140	1.2822 1,036,027,969	－ －	64.01%
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	83,910,052	1.7962 150,727,626	1.8016 151,172,349	－ －	9.34%
3	ISHARES JP MORGAN USD EMERGING MARKETS BOND ETF アメリカ	投資信託受益証券	9,960	11,956.85 119,090,307	11,903.62 118,560,114	－ －	7.33%
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	20,140,771	3.4565 69,618,589	3.4147 68,774,690	－ －	4.25%
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	23,465,281	2.6229 61,549,432	2.5366 59,522,031	－ －	3.68%
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	30,075,924	1.1742 35,318,157	1.2199 36,689,619	－ －	2.27%
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	79,586,203	0.4730 37,652,232	0.4593 36,553,943	－ －	2.26%
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	27,572,726	1.0653 29,375,982	1.0537 29,053,381	－ －	1.80%
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	1,911,261	1.8569 3,549,021	1.8572 3,549,593	－ －	0.22%

（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。

投資有価証券の種類別投資比率

平成30年10月31日現在

種類	投資比率
投資信託受益証券	7.33%
親投資信託受益証券	87.82%
合計	95.15%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

グローバル８資産ラップファンド（中立型）

平成30年10月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率(%) 償還日	投資比率
1	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	242,214,024	1.2785 309,694,851	1.2822 310,566,821	－ －	34.94%
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	86,584,078	1.7962 155,530,979	1.8016 155,989,874	－ －	17.55%
3	ISHARES JP MORGAN USD EMERGING MARKETS BOND ETF アメリカ	投資信託受益証券	10,780	11,956.85 128,894,931	11,903.62 128,321,088	－ －	14.44%
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	23,048,530	3.4565 79,669,548	3.4147 78,703,815	－ －	8.85%
5	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	43,636,068	1.1742 51,241,834	1.2199 53,231,639	－ －	5.99%
6	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	19,553,564	2.6229 51,288,998	2.5366 49,599,570	－ －	5.58%
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	83,269,917	0.4730 39,394,997	0.4593 38,245,872	－ －	4.30%
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	28,537,703	1.0653 30,404,068	1.0537 30,070,177	－ －	3.38%
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	2,803,635	1.8568 5,206,069	1.8572 5,206,910	－ －	0.59%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成30年10月31日現在

種類	投資比率
投資信託受益証券	14.44%
親投資信託受益証券	81.18%
合計	95.61%

（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。

グローバル８資産ラップファンド（積極型）

平成30年10月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率(%) 償還日	投資比率
1	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	49,368,545	1.7962 88,680,717	1.8016 88,942,370	－ －	21.11%
2	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	20,870,949	3.4566 72,142,523	3.4147 71,268,029	－ －	16.91%
3	ISHARES JP MORGAN USD EMERGING MARKETS BOND ETF アメリカ	投資信託受益証券	5,960	11,956.85 71,262,874	11,903.62 70,945,610	－ －	16.84%
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	39,542,249	1.1742 46,434,463	1.2199 48,237,589	－ －	11.45%
5	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	34,579,469	1.2785 44,213,309	1.2822 44,337,795	－ －	10.52%
6	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	15,762,405	2.6229 41,344,788	2.5366 39,982,916	－ －	9.49%
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	50,701,226	0.4730 23,986,750	0.4593 23,287,073	－ －	5.53%
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	16,073,343	1.0653 17,124,539	1.0537 16,936,481	－ －	4.02%
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	2,454,496	1.8568 4,557,753	1.8572 4,558,489	－ －	1.08%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成30年10月31日現在

種類	投資比率
投資信託受益証券	16.84%
親投資信託受益証券	80.11%
合計	96.94%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

（参考）

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

平成30年10月31日現在

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

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

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成30年10月31日現在

種類	投資比率
株式	96.38%
合計	96.38%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

平成30年10月31日現在

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

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年10月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率(%) 償還日	投資比率
1	１２２回　利付国庫債券（５年） 日本	国債証券	4,000,000,000	100.42 4,016,960,000	100.27 4,010,880,000	0.100000 2019/12/20	1.18%
2	３５０回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	3,400,000,000	100.53 3,418,236,500	100.09 3,403,162,000	0.100000 2028/3/20	1.00%
3	３４０回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	3,100,000,000	103.16 3,198,092,000	102.93 3,190,861,000	0.400000 2025/9/20	0.94%
4	３３９回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	3,100,000,000	103.17 3,198,423,500	102.85 3,188,567,000	0.400000 2025/6/20	0.94%
5	３３８回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	3,100,000,000	103.03 3,194,050,500	102.81 3,187,234,000	0.400000 2025/3/20	0.94%
6	３４１回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	3,060,000,000	102.43 3,134,418,000	102.24 3,128,819,400	0.300000 2025/12/20	0.92%
7	３４２回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	3,000,000,000	100.80 3,024,240,000	100.77 3,023,250,000	0.100000 2026/3/20	0.89%
8	３４３回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	3,000,000,000	100.74 3,022,470,000	100.72 3,021,720,000	0.100000 2026/6/20	0.89%
9	１３０回　利付国庫債券（５年） 日本	国債証券	3,000,000,000	100.77 3,023,130,000	100.69 3,020,760,000	0.100000 2021/12/20	0.89%
10	１２８回　利付国庫債券（５年） 日本	国債証券	3,000,000,000	100.70 3,021,090,000	100.59 3,017,820,000	0.100000 2021/6/20	0.89%
11	１２７回　利付国庫債券（５年） 日本	国債証券	3,000,000,000	100.65 3,019,500,000	100.54 3,016,470,000	0.100000 2021/3/20	0.89%
12	３４６回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	3,000,000,000	100.54 3,016,290,000	100.50 3,015,030,000	0.100000 2027/3/20	0.89%
13	１２５回　利付国庫債券（５年） 日本	国債証券	3,000,000,000	100.54 3,016,350,000	100.44 3,013,320,000	0.100000 2020/9/20	0.89%
14	１２３回　利付国庫債券（５年） 日本	国債証券	3,000,000,000	100.47 3,014,100,000	100.33 3,009,960,000	0.100000 2020/3/20	0.89%
15	３２５回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	2,900,000,000	104.00 3,016,047,000	103.53 3,002,370,000	0.800000 2022/9/20	0.89%

16	３２８回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	2,890,000,000	103.38 2,987,876,100	103.05 2,978,347,300	0.600000 2023/3/20	0.88%
17	３４７回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	2,900,000,000	100.51 2,914,810,000	100.38 2,911,194,000	0.100000 2027/6/20	0.86%
18	３４８回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	2,900,000,000	100.47 2,913,805,000	100.30 2,908,961,000	0.100000 2027/9/20	0.86%
19	３３５回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	2,750,000,000	103.45 2,844,882,000	103.27 2,840,090,000	0.500000 2024/9/20	0.84%
20	３４４回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	2,800,000,000	100.68 2,819,100,000	100.62 2,817,612,000	0.100000 2026/9/20	0.83%
21	３５１回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	2,740,000,000	99.97 2,739,208,400	99.95 2,738,684,800	0.100000 2028/6/20	0.81%
22	３４５回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	2,700,000,000	100.61 2,716,610,000	100.56 2,715,336,000	0.100000 2026/12/20	0.80%
23	３３４回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	2,600,000,000	104.11 2,706,919,000	103.73 2,696,980,000	0.600000 2024/6/20	0.80%
24	３４９回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	2,610,000,000	100.45 2,621,796,700	100.22 2,615,898,600	0.100000 2027/12/20	0.77%
25	３３３回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	2,500,000,000	103.99 2,599,920,000	103.61 2,590,450,000	0.600000 2024/3/20	0.76%
26	３３２回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	2,460,000,000	103.80 2,553,553,300	103.50 2,546,223,000	0.600000 2023/12/20	0.75%
27	１２６回　利付国庫債券（５年） 日本	国債証券	2,500,000,000	100.59 2,514,950,000	100.51 2,512,825,000	0.100000 2020/12/20	0.74%
28	１３３回　利付国庫債券（５年） 日本	国債証券	2,460,000,000	100.89 2,481,984,000	100.81 2,480,147,400	0.100000 2022/9/20	0.73%
29	１２９回　利付国庫債券（５年） 日本	国債証券	2,420,000,000	100.72 2,437,464,500	100.63 2,435,391,200	0.100000 2021/9/20	0.72%
30	３２９回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	2,270,000,000	104.73 2,377,375,100	104.14 2,363,978,000	0.800000 2023/6/20	0.70%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成30年10月31日現在

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

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド

平成30年10月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率(%) 償還日	投資比率
1	日本ビルファンド投資法人 日本	投資証券	3,406	623,872.38 2,124,909,342	645,000.00 2,196,870,000	－ －	7.13%
2	ジャパンリアルエステイト投資法人 日本	投資証券	3,518	571,216.96 2,009,541,270	582,000.00 2,047,476,000	－ －	6.65%
3	野村不動産マスターファンド投資法人 日本	投資証券	10,426	153,453.97 1,599,911,150	146,300.00 1,525,323,800	－ －	4.95%
4	日本リテールファンド投資法人 日本	投資証券	6,648	200,045.76 1,329,904,243	208,400.00 1,385,443,200	－ －	4.50%
5	ユナイテッド・アーバン投資法人 日本	投資証券	7,758	170,976.07 1,326,432,384	171,900.00 1,333,600,200	－ －	4.33%
6	オリックス不動産投資法人 日本	投資証券	7,009	172,998.93 1,212,549,513	172,600.00 1,209,753,400	－ －	3.93%
7	大和ハウスリート投資法人 日本	投資証券	4,404	260,815.06 1,148,629,566	247,000.00 1,087,788,000	－ －	3.53%
8	日本プロロジスリート投資法人 日本	投資証券	4,718	227,527.52 1,073,474,856	227,600.00 1,073,816,800	－ －	3.49%
9	アドバンス・レジデンス投資法人 日本	投資証券	3,428	285,366.68 978,237,002	288,200.00 987,949,600	－ －	3.21%
10	ＧＬＰ投資法人 日本	投資証券	8,716	118,422.15 1,032,167,511	111,700.00 973,577,200	－ －	3.16%
11	日本プライムリアルティ投資法人 日本	投資証券	2,227	400,651.24 892,250,329	403,000.00 897,481,000	－ －	2.91%
12	ジャパン・ホテル・リート投資法人 日本	投資証券	10,185	82,231.79 837,530,846	80,300.00 817,855,500	－ －	2.66%

13	アクティビア・プロパティーズ投資法人 日本	投資証券	1,686	487,565.02 822,034,627	468,000.00 789,048,000	－ －	2.56%
14	ケネディクス・オフィス投資法人 日本	投資証券	1,088	676,151.34 735,652,667	699,000.00 760,512,000	－ －	2.47%
15	積水ハウス・リート投資法人 日本	投資証券	9,076	71,332.64 647,415,127	70,500.00 639,858,000	－ －	2.08%
16	日本アコモデーションファンド投資法人 日本	投資証券	1,169	497,734.20 581,851,286	517,000.00 604,373,000	－ －	1.96%
17	インヴィンシブル投資法人 日本	投資証券	12,309	49,602.10 610,552,371	46,700.00 574,830,300	－ －	1.87%
18	森ヒルズリート投資法人 日本	投資証券	4,034	139,415.48 562,402,063	139,600.00 563,146,400	－ －	1.83%
19	大和証券オフィス投資法人 日本	投資証券	812	646,826.89 525,223,441	689,000.00 559,468,000	－ －	1.82%
20	日本ロジスティクスファンド投資法人 日本	投資証券	2,321	222,986.37 517,551,371	225,200.00 522,689,200	－ －	1.70%
21	フロンティア不動産投資法人 日本	投資証券	1,197	450,587.28 539,352,979	432,500.00 517,702,500	－ －	1.68%
22	ヒューリックリート投資法人 日本	投資証券	2,844	167,121.17 475,292,633	164,100.00 466,700,400	－ －	1.52%
23	産業ファンド投資法人 日本	投資証券	4,098	119,981.65 491,684,835	113,300.00 464,303,400	－ －	1.51%
24	ジャパンエクセレント投資法人 日本	投資証券	3,150	144,102.88 453,924,095	146,400.00 461,160,000	－ －	1.50%
25	イオンリート投資法人 日本	投資証券	3,611	122,366.47 441,865,355	124,500.00 449,569,500	－ －	1.46%
26	日本リート投資法人 日本	投資証券	1,135	333,964.12 379,049,287	367,000.00 416,545,000	－ －	1.35%
27	森トラスト総合リート投資法人 日本	投資証券	2,514	160,646.27 403,864,726	160,000.00 402,240,000	－ －	1.31%
28	プレミア投資法人 日本	投資証券	3,344	107,371.14 359,049,112	116,700.00 390,244,800	－ －	1.27%
29	東急リアル・エステート投資法人 日本	投資証券	2,358	149,841.16 353,325,466	158,900.00 374,686,200	－ －	1.22%
30	コンフォリア・レジデンシャル投資法人 日本	投資証券	1,342	262,084.15 351,716,933	270,100.00 362,474,200	－ －	1.18%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成30年10月31日現在

種類	投資比率
投資証券	97.06%
合計	97.06%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年10月31日現在

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

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

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

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成30年10月31日現在

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

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

平成30年10月31日現在

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

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

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年10月31日現在

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

24	FRANCE OAT 2.5 10/25/20 フランス	国債証券	1,001,754,000	107.59 1,077,827,198	106.02 1,062,149,748	2.500000 2020/10/25	0.54%
25	US T N/B 2.125 06/30/22 アメリカ	国債証券	1,075,970,000	98.05 1,055,031,623	97.27 1,046,628,298	2.125000 2022/6/30	0.53%
26	US T N/B 2.625 08/31/20 アメリカ	国債証券	1,047,655,000	99.65 1,044,061,543	99.62 1,043,757,723	2.625000 2020/8/31	0.53%
27	US T N/B 2.0 02/15/23 アメリカ	国債証券	1,075,970,000	96.94 1,043,142,155	96.25 1,035,696,442	2.000000 2023/2/15	0.52%
28	US T N/B 1.625 08/15/22 アメリカ	国債証券	1,075,970,000	95.83 1,031,198,888	95.36 1,026,120,309	1.625000 2022/8/15	0.52%
29	US T N/B 2.0 02/15/25 アメリカ	国債証券	1,075,970,000	94.75 1,019,481,575	94.22 1,013,843,492	2.000000 2025/2/15	0.51%
30	US T N/B 1.75 12/31/20 アメリカ	国債証券	1,019,340,000	98.21 1,001,175,361	97.70 995,925,760	1.750000 2020/12/31	0.50%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成30年10月31日現在

種類	投資比率
国債証券	97.92%
合計	97.92%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年10月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資比率
1	SIMON PROPERTY GROUP INC アメリカ	投資証券	99,123	19,394.69 1,922,460,114	21,264.56 2,107,807,476	－ －	5.24%
2	PROLOGIS INC アメリカ	投資証券	201,769	7,273.62 1,467,592,039	7,432.12 1,499,571,662	－ －	3.73%
3	PUBLIC STORAGE アメリカ	投資証券	48,017	24,889.77 1,195,132,275	23,525.23 1,129,611,189	－ －	2.81%
4	WELLTOWER INC アメリカ	投資証券	119,186	6,815.91 812,362,014	7,870.43 938,045,951	－ －	2.33%
5	UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD オランダ	投資証券	44,095	23,824.14 1,050,525,846	20,600.17 908,364,584	－ －	2.26%
6	AVALONBAY COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	44,281	19,462.72 861,828,718	20,229.36 895,776,670	－ －	2.23%
7	EQUITY RESIDENTIAL アメリカ	投資証券	117,985	7,193.97 848,780,630	7,450.24 879,016,896	－ －	2.19%
8	DIGITAL REALTY TRUST INC アメリカ	投資証券	66,018	12,415.78 819,665,596	11,775.64 777,404,346	－ －	1.93%
9	VENTAS INC アメリカ	投資証券	114,166	6,299.75 719,217,580	6,678.94 762,508,115	－ －	1.90%
10	LINK REIT 香港	投資証券	686,520	1,024.53 703,364,511	1,041.12 714,752,448	－ －	1.78%
11	BOSTON PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	49,452	13,915.41 688,145,252	13,249.15 655,197,203	－ －	1.63%
12	REALTY INCOME CORP アメリカ	投資証券	92,882	6,169.27 573,015,043	6,954.16 645,916,660	－ －	1.61%
13	ESSEX PROPERTY TRUST INC アメリカ	投資証券	21,150	26,777.84 566,351,432	28,953.78 612,372,582	－ －	1.52%
14	SCENTRE GROUP オーストラリア	投資信託受益証券	1,717,562	345.98 594,258,785	320.95 551,268,699	－ －	1.37%
15	HOST HOTELS & RESORTS INC アメリカ	投資証券	237,407	2,419.06 574,301,863	2,148.54 510,078,958	－ －	1.27%
16	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT アメリカ	投資証券	33,848	14,267.47 482,925,562	14,038.57 475,177,754	－ －	1.18%
17	HCP INC アメリカ	投資証券	150,364	2,834.76 426,246,170	3,097.66 465,776,698	－ －	1.16%
18	GOODMAN GROUP オーストラリア	投資信託受益証券	517,251	803.48 415,601,787	843.32 436,209,354	－ －	1.08%
19	VORNADO REALTY TRUST アメリカ	投資証券	55,395	8,278.11 458,566,069	7,698.28 426,446,342	－ －	1.06%
20	EXTRA SPACE STORAGE INC アメリカ	投資証券	40,476	11,078.40 448,409,533	10,303.26 417,034,840	－ －	1.04%
21	MID AMERICA アメリカ	投資証券	36,414	11,241.27 409,339,899	11,326.00 412,424,964	－ －	1.03%
22	REGENCY CENTERS CORP アメリカ	投資証券	54,208	7,057.28 382,561,156	7,349.44 398,398,519	－ －	0.99%

23	UDR INC アメリカ	投資証券	85,626	4,233.18 362,470,896	4,568.90 391,217,350	－ －	0.97%
24	DUKE REALTY TRUST アメリカ	投資証券	114,274	3,239.20 370,156,476	3,169.01 362,135,997	－ －	0.90%
25	FEDERAL REALTY INVS TRUST アメリカ	投資証券	23,501	14,071.69 330,698,946	14,373.82 337,799,298	－ －	0.84%
26	IRON MOUNTAIN INC アメリカ	投資証券	91,496	3,931.45 359,712,609	3,580.14 327,569,276	－ －	0.81%
27	SUN COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	27,610	11,046.52 304,994,470	11,517.40 317,995,673	－ －	0.79%
28	CAMDEN PROPERTY TRUST アメリカ	投資証券	29,976	10,414.73 312,192,031	10,508.26 314,995,685	－ －	0.78%
29	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES アメリカ	投資証券	28,646	10,410.34 298,214,825	10,937.51 313,316,146	－ －	0.78%
30	LAND SECURITIES GROUP PLC イギリス	投資証券	240,157	1,343.79 322,722,421	1,236.10 296,858,307	－ －	0.74%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成30年10月31日現在

種類	投資比率
投資信託受益証券	10.11%
投資証券	89.10%
合計	99.21%

（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10月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資比率
1	GS Commodity Index Certificate 06/14/2019 イギリス	社債券	133,239	29,400.93 3,917,351,428	28,412.40 3,785,640,243	－ 2019/6/14	99.46%

投資有価証券の種類別投資比率

平成30年10月31日現在

種類	投資比率
社債券	99.46%
合計	99.46%

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

平成30年10月31日現在

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

14	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP インド	株式 貯蓄・抵当・不動産金融	135,245	2,933.49 396,741,005	2,591.44 350,479,979	－ －	0.75%
15	LUKOIL SPON ADR ロシア	株式 石油・ガス・消耗燃料	42,079	7,409.36 311,778,656	8,265.71 347,813,013	－ －	0.74%
16	SK HYNIX INC 韓国	株式 半導体・半導体製造装置	49,265	8,322.08 409,987,379	6,785.89 334,307,363	－ －	0.71%
17	BANK OF CHINA LTD 中国	株式 銀行	6,712,200	59.25 397,754,184	47.65 319,849,754	－ －	0.68%
18	HON HAI PRECISION INDUSTRY 台湾	株式 電子装置・機器・部品	1,117,225	386.65 431,983,504	279.62 312,402,923	－ －	0.67%
19	BANCO BRADESCO SA PREF ブラジル	株式 銀行	288,125	1,017.46 293,156,702	1,064.04 306,577,965	－ －	0.65%
20	INFOSYS LTD インド	株式 情報技術サービス	295,401	886.37 261,836,605	1,022.37 302,012,074	－ －	0.64%
21	SBERBANK ADR ロシア	株式 銀行	231,040	1,608.86 371,712,696	1,300.22 300,403,937	－ －	0.64%
22	CNOOC LTD 香港	株式 石油・ガス・消耗燃料	1,506,000	181.00 272,592,788	195.80 294,884,438	－ －	0.63%
23	PETROLEO BRASILEIRO SA ブラジル	株式 石油・ガス・消耗燃料	333,212	629.36 209,712,889	857.35 285,682,640	－ －	0.61%
24	SAMSUNG ELECTRONICS-PFD 韓国	株式 コンピュータ・周辺機器	72,684	4,024.20 292,495,348	3,492.44 253,845,235	－ －	0.54%
25	GAZPROM PAO ADR ロシア	株式 石油・ガス・消耗燃料	468,810	515.21 241,537,903	526.20 246,690,616	－ －	0.53%
26	PETROLEO BRASILEIRO SA ブラジル	株式 石油・ガス・消耗燃料	250,610	710.93 178,167,179	934.52 234,200,658	－ －	0.50%
27	AMERICA MOVIL SAB DE CV メキシコ	株式 無線通信サービス	2,854,078	99.47 283,896,698	80.08 228,577,398	－ －	0.49%
28	TATA CONSULTANCY SERVICES LTD インド	株式 情報技術サービス	77,574	2,507.56 194,521,972	2,936.93 227,830,183	－ －	0.49%
29	QATAR NATIONAL BANK カタール	株式 銀行	37,758	4,834.25 182,531,669	5,764.59 217,659,766	－ －	0.46%
30	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL COR 中国	株式 石油・ガス・消耗燃料	2,139,200	106.37 227,566,671	94.43 202,020,913	－ －	0.43%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成30年10月31日現在

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

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

平成30年10月31日現在

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

自動車部品	0.56%
バイオテクノロジー	0.55%
紙製品・林産品	0.51%
専門小売り	0.46%
ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス	0.45%
各種消費者サービス	0.45%
家庭用品	0.42%
家庭用耐久財	0.31%
陸運・鉄道	0.30%
旅客航空輸送業	0.25%
電気設備	0.24%
水道	0.22%
消費者金融	0.22%
ライフサイエンス・ツール／サービス	0.22%
エクイティ不動産投資信託（ＲＥＩＴｓ）	0.20%
航空宇宙・防衛	0.19%
商業サービス・用品	0.13%
ヘルスケア機器・用品	0.12%
海運業	0.11%
エネルギー設備・サービス	0.10%
レジャー用品	0.09%
容器・包装	0.08%
総合公益事業	0.08%
ソフトウェア	0.07%
ヘルスケア・テクノロジー	0.06%
航空貨物・物流サービス	0.06%
通信機器	0.05%
商社・流通業	0.05%
専門サービス	0.03%
建設関連製品	0.03%
販売	0.03%
合計	94.83%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

グローバル８資産ラップファンド（安定型）

該当事項はありません。

グローバル８資産ラップファンド（中立型）

該当事項はありません。

グローバル８資産ラップファンド（積極型）

該当事項はありません。

（参考）

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

平成30年10月31日現在

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

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド

平成30年10月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/売建	数量	簿価金額（円）	評価金額（円）	投資比率
不動産投信指数先物取引	大阪取引所	ＴＲＥＩＴ先物　３０１２月	買建	351	607,969,908	610,740,000	1.98%

（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10月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/売建	数量	簿価金額（円）	評価金額（円）	投資比率
為替予約取引	－	アメリカ・ドル買／円売２０１８年１１月	買建	19,756,000	2,223,249,300	2,237,357,550	0.70%
		ユーロ買／円売２０１８年１１月	買建	4,241,000	542,864,100	544,671,630	0.17%
		イギリス・ポンド買／円売２０１８年１１月	買建	1,477,000	212,737,131	212,525,530	0.07%
		カナダ・ドル買／円売２０１８年１１月	買建	1,351,000	115,956,201	116,753,420	0.04%
		オーストラリア・ドル買／円売２０１８年１１月	買建	1,027,000	81,713,246	82,396,210	0.03%
株価指数先物取引	シカゴ商品取引所	Ｓ&Ｐ５００ ＥＭＩＮＩ ＦＵＴ Ｄｅｃ１８	買建	660	10,345,581,799	10,036,336,695	3.13%
	ＥＵＲＥＸ取引所	ＤＪ ＥＵＲＯ ＳＴＯＸＸ ５０ Ｄｅｃ１８	買建	608	2,529,049,981	2,454,225,379	0.76%
	ＩＣＥ－ＥＵ	ＦＴＳＥ １００ ＩＮＤＥＸ ＦＵＴＵＲＥ Ｄｅｃ１８	買建	94	963,383,878	949,702,586	0.30%
	モントリオール取引所	Ｓ&Ｐ／ＴＳＥ ６０ ＩＸ ＦＵＴ Ｄｅｃ１８	買建	35	551,900,493	536,401,866	0.17%
	シドニー先物取引所	ＳＰＩ ２００ ＦＵＴＵＲＥＳ Ｄｅｃ１８	買建	31	365,110,054	358,937,592	0.11%

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。
（注2）先物取引の時価は、原則として計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。
（注3）為替予約取引の時価は、原則としてわが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しています。
為替予約取引の数量は、現地通貨建契約金額です。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年10月31日現在

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

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。
（注2）為替予約取引の時価は、原則としてわが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しています。
為替予約取引の数量は、現地通貨建契約金額です。

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年10月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/売建	数量	簿価金額（円）	評価金額（円）	投資比率
為替予約取引	－	シンガポール・ドル買／円売２０１８年１１月	買建	130,000	10,536,916	10,627,500	0.03%
		アメリカ・ドル売／円買２０１８年１１月	売建	950,000	107,585,600	107,587,500	△0.27%
		ユーロ売／円買２０１８年１１月	売建	90,000	11,557,296	11,558,700	△0.03%
		オーストラリア・ドル売／円買２０１８年１１月	売建	140,000	11,232,340	11,232,200	△0.03%
		イギリス・ポンド売／円買２０１８年１１月	売建	70,000	10,072,048	10,072,300	△0.03%
		シンガポール・ドル売／円買２０１８年１１月	売建	60,000	4,903,566	4,903,800	△0.01%
		香港・ドル売／円買２０１８年１１月	売建	250,000	3,608,500	3,607,500	△0.01%
		カナダ・ドル売／円買２０１８年１１月	売建	25,000	2,160,432	2,160,500	△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10月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/売建	数量	簿価金額（円）	評価金額（円）	投資比率
為替予約取引	－	アメリカ・ドル買／円売２０１８年１１月	買建	1,009,000	113,731,540	114,266,290	0.24%
株価指数先物取引	ＩＣＥ－ＵＳ	ＭＩＮＩ　ＭＳＣＩ　ＥＭＧ　ＭＫＴ　Ｄｅｃ１８	買建	395	2,234,892,190	2,115,422,144	4.51%

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。
（注2）先物取引の時価は、原則として計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。
（注3）為替予約取引の時価は、原則としてわが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しています。
為替予約取引の数量は、現地通貨建契約金額です。

（３）【運用実績】

①【純資産の推移】

直近日（平成30年10月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

グローバル８資産ラップファンド（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)	789	789	0.9850	0.9850
第2計算期間末 (平成29年10月12日)	728	728	1.0192	1.0192
第3計算期間末 (平成30年10月12日)	1,618	1,618	1.0026	1.0026
平成29年10月末日	760	－	1.0222	－
11月末日	981	－	1.0248	－
12月末日	1,160	－	1.0302	－
平成30年1月末日	1,254	－	1.0236	－
2月末日	1,387	－	1.0136	－
3月末日	1,404	－	1.0106	－
4月末日	1,488	－	1.0166	－
5月末日	1,538	－	1.0133	－
6月末日	1,562	－	1.0140	－
7月末日	1,596	－	1.0175	－
8月末日	1,602	－	1.0118	－
9月末日	1,657	－	1.0180	－
10月末日	1,618	－	1.0025	－

グローバル８資産ラップファンド（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)	421	421	0.9420	0.9420
第2計算期間末 (平成29年10月12日)	494	494	1.0229	1.0229
第3計算期間末 (平成30年10月12日)	879	879	1.0022	1.0022
平成29年10月末日	486	－	1.0286	－
11月末日	555	－	1.0304	－
12月末日	589	－	1.0416	－
平成30年1月末日	669	－	1.0289	－
2月末日	706	－	1.0078	－
3月末日	753	－	1.0021	－
4月末日	830	－	1.0155	－
5月末日	846	－	1.0097	－
6月末日	852	－	1.0124	－
7月末日	892	－	1.0215	－
8月末日	901	－	1.0174	－
9月末日	914	－	1.0311	－
10月末日	888	－	1.0014	－

グローバル８資産ラップファンド（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)	279	279	0.9010	0.9010
第2計算期間末 (平成29年10月12日)	352	352	1.0277	1.0277
第3計算期間末 (平成30年10月12日)	447	447	1.0024	1.0024
平成29年10月末日	328	－	1.0355	－
11月末日	342	－	1.0393	－
12月末日	323	－	1.0567	－
平成30年1月末日	311	－	1.0391	－
2月末日	308	－	1.0046	－
3月末日	333	－	0.9945	－
4月末日	401	－	1.0150	－
5月末日	411	－	1.0091	－
6月末日	412	－	1.0144	－
7月末日	432	－	1.0281	－
8月末日	447	－	1.0270	－
9月末日	472	－	1.0461	－
10月末日	421	－	1.0002	－

②【分配の推移】

グローバル８資産ラップファンド（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
第3計算期間	0.0000

グローバル８資産ラップファンド（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
第3計算期間	0.0000

グローバル８資産ラップファンド（積極型）

	１口当たりの分配金(円)
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000

③【収益率の推移】

グローバル８資産ラップファンド（安定型）

	収益率(%)
第1計算期間	△1.5
第2計算期間	3.5
第3計算期間	△1.6

（注）各計算期間の収益率は、計算期間末の基準価額（分配落の額）に当該計算期間の分配金を加算し、当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額（分配落の額。以下「前期末基準価額」といいます。）を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じた数です。ただし、第1計算期間については、前期末基準価額の代わりに、設定時の基準価額10,000円（1万口当たり）を用いております。
なお、小数点以下２桁目を四捨五入し、小数点以下１桁目まで表示しております。

グローバル８資産ラップファンド（中立型）

	収益率(%)
第1計算期間	△5.8
第2計算期間	8.6
第3計算期間	△2.0

（注）各計算期間の収益率は、計算期間末の基準価額（分配落の額）に当該計算期間の分配金を加算し、当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額（分配落の額。以下「前期末基準価額」といいます。）を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じた数です。ただし、第1計算期間については、前期末基準価額の代わりに、設定時の基準価額10,000円（1万口当たり）を用いております。
なお、小数点以下２桁目を四捨五入し、小数点以下１桁目まで表示しております。

グローバル８資産ラップファンド（積極型）

	収益率(%)
第1計算期間	△9.9
第2計算期間	14.1
第3計算期間	△2.5

（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。

（４）【設定及び解約の実績】

グローバル８資産ラップファンド（安定型）

	設定口数	解約口数
第1計算期間	966,188,060	164,729,152
第2計算期間	436,506,967	522,888,416
第3計算期間	981,245,785	82,018,752

（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。

グローバル８資産ラップファンド（中立型）

	設定口数	解約口数
第1計算期間	460,757,286	12,980,810
第2計算期間	144,786,279	109,550,283
第3計算期間	491,977,537	97,236,996

（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。

グローバル８資産ラップファンド（積極型）

	設定口数	解約口数
第1計算期間	320,872,310	10,138,060
第2計算期間	78,508,735	46,286,043
第3計算期間	215,931,335	111,997,615

（注1） 本邦外における設定及び解約はございません。
（注2） 第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

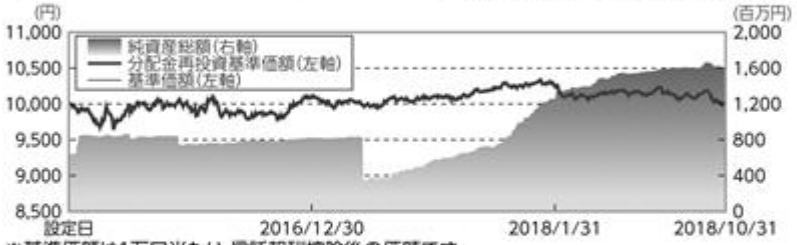
＜＜参考情報＞＞

データの基準日:2018年10月31日

グローバル8資産ラップファンド(安定型)

基準価額・純資産の推移

(2015年12月1日～2018年10月31日)



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。
※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額とは異なります。(設定日:2015年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
第3期 (2018.10.12)	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	64.01%
2	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	9.34%
3	ISHARES JP MORGAN USD EMERGING MARKETS BOND ETF	7.33%
4	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	4.25%
5	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	3.68%
6	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	2.27%
7	コモディティインデックス・マザーファンド	2.26%
8	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	1.80%
9	J-REITインデックスファンド・マザーファンド	0.22%

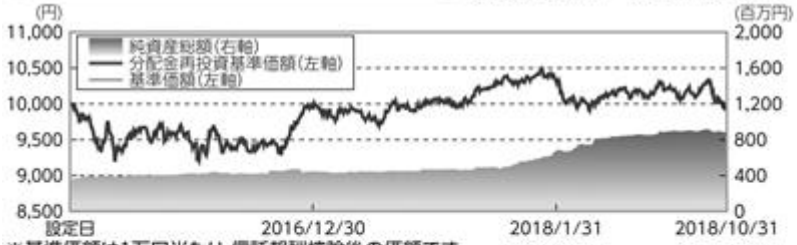
年間収益率の推移(暦年ベース)

※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。

グローバル8資産ラップファンド(中立型)

基準価額・純資産の推移

(2015年12月1日～2018年10月31日)



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。
※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額とは異なります。(設定日:2015年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
第3期 (2018.10.12)	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	34.94%
2	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	17.55%
3	ISHARES JP MORGAN USD EMERGING MARKETS BOND ETF	14.44%
4	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	8.85%
5	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	5.99%
6	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	5.58%
7	コモディティインデックス・マザーファンド	4.30%
8	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	3.38%
9	J-REITインデックスファンド・マザーファンド	0.59%

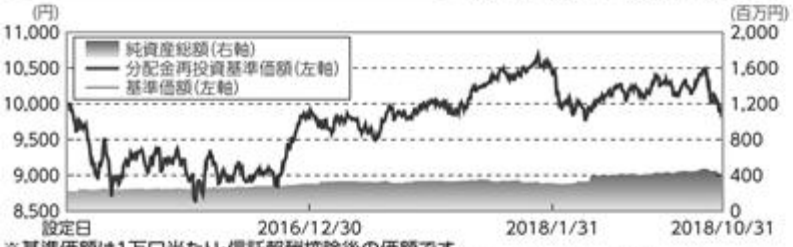
年間収益率の推移(暦年ベース)

※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。

グローバル8資産ラップファンド(積極型)

基準価額・純資産の推移

〈2015年12月1日～2018年10月31日〉



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。
※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額とは異なります。(設定日:2015年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
第3期 (2018.10.12)	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	21.11%
2	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	16.91%
3	ISHARES JP MORGAN USD EMERGING MARKETS BOND ETF	16.84%
4	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	11.45%
5	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	10.52%
6	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	9.49%
7	コモディティインデックス・マザーファンド	5.53%
8	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	4.02%
9	J-REITインデックスファンド・マザーファンド	1.08%

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。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。

・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1万口当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経由して受託会社の指定するファンド口座（受託会社が信託事務の一部について委託を行っている場合は当該委託先の口座）に払込まれます。

2【換金（解約）手続等】

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

解約の請求の受付は、原則として販売会社の毎営業日の午後3時までに行われ、かつ、解約の受付にかかる販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。

なお、信託財産の資金管理を円滑に行うため、大口の解約請求に制限を設ける場合があります。

※海外休業日には、解約の受付を行いません。

※解約の請求を行う受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求にかかる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】

該当事項はありません。

（３）【信託期間】

信託期間は、2015年12月1日から原則として2025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たときは、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、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発します。

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。受託会社が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.の変更事項にあっては、その内容が重大なものに該当する場合に限り、上記a.の併合事項にあっては、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発します。

c.上記b.の書面決議において、受益者（委託会社およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

d.上記b.の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。

e.書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。

f.上記b.からe.までの規定は、委託会社が重大な約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、約款にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。

g.上記a.からf.の規定にかかわらず、この信託において併合の書面決議が可決された場合にあっても、当該併合にかかる一または複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。

h.委託会社は、監督官庁の命令に基づいて約款を変更しようとするときは、上記a.からg.の規定にしたがいます。

i.この信託は、受益者が一部解約請求を行ったときは、委託会社が信託契約の一部の解約をすることにより当該請求に応じ、当該受益権の公正な価格が当該受益者に一部解約金として支払われることとなる委託者指図型投資信託に該当するため、重大な約款の変更等を行う場合において、投資信託及び投資法人に関する法律第18条第1項に定める反対受益者による受益権買取請求の規定の適用を受けません。

ハ.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。

ニ.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ます。）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ます。）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】

グローバル８資産ラップファンド（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）当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第3期計算期間（平成29年10月13日から平成30年10月12日まで）の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

１【財務諸表】

【グローバル８資産ラップファンド（安定型）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第2期 平成29年10月12日現在	第3期 平成30年10月12日現在
資産の部		
流動資産		
預金	915,864	3,887,840
コール・ローン	39,206,103	80,329,476
投資信託受益証券	28,013,600	117,965,227
親投資信託受益証券	665,305,301	1,446,193,185
流動資産合計	733,440,868	1,648,375,728
資産合計	733,440,868	1,648,375,728
負債の部		
流動負債		
未払解約金	1,007,123	19,441,996
未払受託者報酬	117,522	340,212
未払委託者報酬	3,497,553	10,122,409
その他未払費用	13,135	33,807
流動負債合計	4,635,333	29,938,424
負債合計	4,635,333	29,938,424
純資産の部		
元本等		
元本	※1 715,077,459	※1 1,614,304,492
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	13,728,076	4,132,812
（分配準備積立金）	11,433,888	12,371,088
元本等合計	728,805,535	1,618,437,304
純資産合計	728,805,535	1,618,437,304
負債純資産合計	733,440,868	1,648,375,728

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第2期 自　平成28年10月13日 至　平成29年10月12日	第3期 自　平成29年10月13日 至　平成30年10月12日
営業収益		
受取配当金	1,389,838	3,196,066
受取利息	836	10,979
有価証券売買等損益	24,929,357	△18,230,920
為替差損益	4,459,000	3,508,233
営業収益合計	30,779,031	△11,515,642
営業費用		
支払利息	30,563	66,439
受託者報酬	282,367	586,747
委託者報酬	8,402,899	17,458,251
その他費用	52,166	78,582
営業費用合計	8,767,995	18,190,019
営業利益又は営業損失（△）	22,011,036	△29,705,661
経常利益又は経常損失（△）	22,011,036	△29,705,661
当期純利益又は当期純損失（△）	22,011,036	△29,705,661
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（△）	6,880,865	△426,045
期首剰余金又は期首欠損金（△）	△11,983,096	13,728,076
剰余金増加額又は欠損金減少額	10,581,001	21,346,636
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	7,473,699	－
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	3,107,302	21,346,636
剰余金減少額又は欠損金増加額	－	1,662,284
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	－	1,662,284
分配金	※1 －	※1 －
期末剰余金又は期末欠損金（△）	13,728,076	4,132,812

（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	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。 親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
２．　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。
３．　その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、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		第2期 平成29年10月12日現在	第3期 平成30年10月12日現在
１．　※１	期首元本額	801,458,908円	715,077,459円
	期中追加設定元本額	436,506,967円	981,245,785円
	期中一部解約元本額	522,888,416円	82,018,752円
２．	受益権の総数	715,077,459口	1,614,304,492口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	第2期 自　平成28年10月13日 至　平成29年10月12日	第3期 自　平成29年10月13日 至　平成30年10月12日
１．　※１　分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益（5,831,860円）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（4,913,550円）、信託約款に規定される収益調整金（2,294,188円）及び分配準備積立金（688,478円）より分配対象収益は13,728,076円（1万口当たり191.98円）でありますが、分配を行っておりません。なお、分配金の計算過程においては、親投資信託の配当等収益及び収益調整金相当額を充当する方法によっております。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（1,797,882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（19,634,561円）及び分配準備積立金（10,573,206円）より分配対象収益は32,005,649円（1万口当たり198.26円）でありますが、分配を行っておりません。なお、分配金の計算過程においては、親投資信託の配当等収益及び収益調整金相当額を充当する方法によっております。

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

項目	第2期 自　平成28年10月13日 至　平成29年10月12日	第3期 自　平成29年10月13日 至　平成30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2期 平成29年10月12日現在	第3期 平成30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2期 平成29年10月12日現在	第3期 平成30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	136,621	△8,382,804
親投資信託受益証券	16,495,468	△9,213,452
合計	16,632,089	△17,596,256

（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2期 平成29年10月12日現在	第3期 平成30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）	1.0192円 (10,192円)	1.0026円 (10,026円)

（４）【附属明細表】

第１　有価証券明細表

（１）株式

該当事項はありません。

（２）株式以外の有価証券

平成30年10月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	9,960.000	1,051,477.200	
	アメリカ・ドル　小計		9,960.000	1,051,477.200 (117,965,227)	
投資信託受益証券　合計			9,960	117,965,227 (117,965,227)	
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	23,906,761	62,707,434	
		国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	822,678,821	1,051,877,140	
		Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド	1,947,882	3,617,022	
		外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	20,527,857	70,956,590	
		外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	85,434,297	153,465,627	
		外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	30,645,626	35,987,158	
		コモディティインデックス・マザーファンド	79,586,203	37,652,232	
		エマージング株式パッシブ・マザーファンド	28,092,719	29,929,982	
	日本円　小計		1,092,820,166	1,446,193,185	
親投資信託受益証券　合計			1,092,820,166	1,446,193,185	
合計				1,564,158,412 (117,965,227)	

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	7.29%	7.54%

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

グローバル８資産ラップファンド（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）当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第3期計算期間（平成29年10月13日から平成30年10月12日まで）の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

【グローバル８資産ラップファンド（中立型）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第2期 平成29年10月12日現在	第3期 平成30年10月12日現在
資産の部		
流動資産		
預金	856,080	2,211,683
コール・ローン	28,351,703	33,207,818
投資信託受益証券	72,574,769	127,677,224
親投資信託受益証券	396,381,996	722,431,344
流動資産合計	498,164,548	885,528,069
資産合計	498,164,548	885,528,069
負債の部		
流動負債		
未払解約金	1,011,179	－
未払受託者報酬	99,899	188,344
未払委託者報酬	2,973,499	5,604,516
その他未払費用	11,153	18,666
流動負債合計	4,095,730	5,811,526
負債合計	4,095,730	5,811,526
純資産の部		
元本等		
元本	※1 483,012,472	※1 877,753,013
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	11,056,346	1,963,530
（分配準備積立金）	15,522,043	18,788,593
元本等合計	494,068,818	879,716,543
純資産合計	494,068,818	879,716,543
負債純資産合計	498,164,548	885,528,069

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第2期 自　平成28年10月13日 至　平成29年10月12日	第3期 自　平成29年10月13日 至　平成30年10月12日
営業収益		
受取配当金	2,689,368	4,220,572
受取利息	998	10,523
有価証券売買等損益	35,738,405	△12,902,308
為替差損益	5,755,896	1,312,396
営業収益合計	44,184,667	△7,358,817
営業費用		
支払利息	20,384	38,743
受託者報酬	195,592	321,661
委託者報酬	5,822,066	9,571,888
その他費用	44,192	56,025
営業費用合計	6,082,234	9,988,317
営業利益又は営業損失（△）	38,102,433	△17,347,134
経常利益又は経常損失（△）	38,102,433	△17,347,134
当期純利益又は当期純損失（△）	38,102,433	△17,347,134
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（△）	4,718,297	△101,067
期首剰余金又は期首欠損金（△）	△25,989,864	11,056,346
剰余金増加額又は欠損金減少額	6,037,926	10,374,906
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	6,037,926	－
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	－	10,374,906
剰余金減少額又は欠損金増加額	2,375,852	2,221,655
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	－	2,221,655
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	2,375,852	－
分配金	※1 －	※1 －
期末剰余金又は期末欠損金（△）	11,056,346	1,963,530

（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	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。 親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
２．　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。
３．　その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、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		第2期 平成29年10月12日現在	第3期 平成30年10月12日現在
１．　※１	期首元本額	447,776,476円	483,012,472円
	期中追加設定元本額	144,786,279円	491,977,537円
	期中一部解約元本額	109,550,283円	97,236,996円
２．	受益権の総数	483,012,472口	877,753,013口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	第2期 自　平成28年10月13日 至　平成29年10月12日	第3期 自　平成29年10月13日 至　平成30年10月12日
１．　※１　分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益（7,680,014円）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（5,557,284円）、信託約款に規定される収益調整金（1,234,484円）及び分配準備積立金（2,284,745円）より分配対象収益は16,756,527円（1万口当たり346.92円）でありますが、分配を行っておりません。なお、分配金の計算過程においては、親投資信託の配当等収益及び収益調整金相当額を充当する方法によっております。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（5,326,976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（17,229,354円）及び分配準備積立金（13,461,617円）より分配対象収益は36,017,947円（1万口当たり410.34円）でありますが、分配を行っておりません。なお、分配金の計算過程においては、親投資信託の配当等収益及び収益調整金相当額を充当する方法によっております。

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

項目	第2期 自　平成28年10月13日 至　平成29年10月12日	第3期 自　平成29年10月13日 至　平成30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2期 平成29年10月12日現在	第3期 平成30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2期 平成29年10月12日現在	第3期 平成30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	457,329	△10,429,656
親投資信託受益証券	27,399,910	△3,065,727
合計	27,857,239	△13,495,383

（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2期 平成29年10月12日現在	第3期 平成30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）	1.0229円 (10,229円)	1.0022円 (10,022円)

（４）【附属明細表】

第１　有価証券明細表

（１）株式

該当事項はありません。

（２）株式以外の有価証券

平成30年10月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	10,780.000	1,138,044.600	
	アメリカ・ドル　小計		10,780.000	1,138,044.600 (127,677,224)	
投資信託受益証券　合計			10,780	127,677,224 (127,677,224)	
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	19,553,564	51,288,998	
		国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	242,214,024	309,694,851	
		Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド	2,803,635	5,206,069	
		外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	23,048,530	79,669,548	
		外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	86,584,078	155,530,979	
		外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	43,636,068	51,241,834	
		コモディティインデックス・マザーファンド	83,269,917	39,394,997	
		エマージング株式パッシブ・マザーファンド	28,537,703	30,404,068	
	日本円　小計		529,647,519	722,431,344	
親投資信託受益証券　合計			529,647,519	722,431,344	
合計				850,108,568 (127,677,224)	

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	14.51%	15.02%

(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。

グローバル８資産ラップファンド（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）当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第3期計算期間（平成29年10月13日から平成30年10月12日まで）の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

【グローバル８資産ラップファンド（積極型）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第2期 平成29年10月12日現在	第3期 平成30年10月12日現在
資産の部		
流動資産		
預金	681,541	1,520,152
コール・ローン	19,236,634	14,891,644
投資信託受益証券	58,893,708	76,037,827
親投資信託受益証券	274,089,849	357,490,482
未収入金	2,795,000	5,941,000
流動資産合計	355,696,732	455,881,105
資産合計	355,696,732	455,881,105
負債の部		
流動負債		
未払解約金	1,015,335	5,058,843
未払受託者報酬	72,236	92,279
未払委託者報酬	2,150,168	2,746,563
その他未払費用	8,053	9,102
流動負債合計	3,245,792	7,906,787
負債合計	3,245,792	7,906,787
純資産の部		
元本等		
元本	※1 342,956,942	※1 446,890,662
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	9,493,998	1,083,656
（分配準備積立金）	16,692,058	16,388,215
元本等合計	352,450,940	447,974,318
純資産合計	352,450,940	447,974,318
負債純資産合計	355,696,732	455,881,105

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第2期 自　平成28年10月13日 至　平成29年10月12日	第3期 自　平成29年10月13日 至　平成30年10月12日
営業収益		
受取配当金	2,212,909	2,480,653
受取利息	777	6,050
有価証券売買等損益	39,284,694	△5,829,950
為替差損益	3,991,148	695,054
営業収益合計	45,489,528	△2,648,193
営業費用		
支払利息	14,231	21,350
受託者報酬	138,851	162,912
委託者報酬	4,133,287	4,849,516
その他費用	32,708	37,889
営業費用合計	4,319,077	5,071,667
営業利益又は営業損失（△）	41,170,451	△7,719,860
経常利益又は経常損失（△）	41,170,451	△7,719,860
当期純利益又は当期純損失（△）	41,170,451	△7,719,860
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（△）	3,763,357	1,217,949
期首剰余金又は期首欠損金（△）	△30,754,735	9,493,998
剰余金増加額又は欠損金減少額	4,167,188	3,464,617
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	4,167,188	－
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	－	3,464,617
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,325,549	2,937,150
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	－	2,937,150
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,325,549	－
分配金	※1 －	※1 －
期末剰余金又は期末欠損金（△）	9,493,998	1,083,656

（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	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。 親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
２．　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。
３．　その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、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			第2期 平成29年10月12日現在	第3期 平成30年10月12日現在
１．	※１	期首元本額	310,734,250円	342,956,942円
		期中追加設定元本額	78,508,735円	215,931,335円
		期中一部解約元本額	46,286,043円	111,997,615円
２．		受益権の総数	342,956,942口	446,890,662口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	第2期 自　平成28年10月13日 至　平成29年10月12日	第3期 自　平成29年10月13日 至　平成30年10月12日
１．　※１　分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益（7,066,262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（7,161,028円）、信託約款に規定される収益調整金（969,286円）及び分配準備積立金（2,464,768円）より分配対象収益は17,661,344円（1万口当たり514.97円）でありますが、分配を行っておりません。なお、分配金の計算過程においては、親投資信託の配当等収益及び収益調整金相当額を充当する方法によっております。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（4,365,886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（11,151,250円）及び分配準備積立金（12,022,329円）より分配対象収益は27,539,465円（1万口当たり616.25円）でありますが、分配を行っておりません。なお、分配金の計算過程においては、親投資信託の配当等収益及び収益調整金相当額を充当する方法によっております。

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

項目	第2期 自　平成28年10月13日 至　平成29年10月12日	第3期 自　平成29年10月13日 至　平成30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2期 平成29年10月12日現在	第3期 平成30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2期 平成29年10月12日現在	第3期 平成30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	193,286	△5,927,492
親投資信託受益証券	32,700,056	△1,664,867
合計	32,893,342	△7,592,359

（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2期 平成29年10月12日現在	第3期 平成30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）	1.0277円 (10,277円)	1.0024円 (10,024円)

（４）【附属明細表】

第１　有価証券明細表

（１）株式

該当事項はありません。

（２）株式以外の有価証券

平成30年10月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	6,420.000	677,759.400	
	アメリカ・ドル　小計		6,420.000	677,759.400 (76,037,827)	
投資信託受益証券　合計			6,420	76,037,827 (76,037,827)	
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	16,730,426	43,883,907	
		国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	36,643,048	46,851,801	
		Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド	2,608,500	4,843,723	
		外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	22,143,577	76,541,488	
		外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	52,316,242	93,975,665	
		外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	41,934,413	49,243,581	
		コモディティインデックス・マザーファンド	50,701,226	23,986,750	
		エマージング株式パッシブ・マザーファンド	17,048,590	18,163,567	
	日本円　小計		240,126,022	357,490,482	
親投資信託受益証券　合計			240,126,022	357,490,482	
合計				433,528,309 (76,037,827)	

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	16.97%	17.54%

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

「グローバル８資産ラップファンド（安定型）」「グローバル８資産ラップファンド（中立型）」「グローバル８資産ラップファンド（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29年10月12日現在	平成30年10月12日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		6,062,166,668	5,541,292,683
株式	※２	297,566,000,230	275,713,338,725
派生商品評価勘定		214,479,680	－
未収入金		11,015,998	11,886,304
未収配当金		2,352,048,167	2,479,578,947
前払金		－	343,139,000
流動資産合計		306,205,710,743	284,089,235,659
資産合計		306,205,710,743	284,089,235,659
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		－	256,768,108
前受金		210,324,000	－
未払金		－	99,013,076
未払解約金		918,005,000	218,203,000
流動負債合計		1,128,329,000	573,984,184
負債合計		1,128,329,000	573,984,184
純資産の部			
元本等			
元本	※１	118,980,682,522	108,086,790,523
剰余金			
剰余金又は欠損金（△）		186,096,699,221	175,428,460,952
元本等合計		305,077,381,743	283,515,251,475
純資産合計		305,077,381,743	283,515,251,475
負債純資産合計		306,205,710,743	284,089,235,659

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	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	27,800,268,030円
同期中一部解約元本額	43,965,822,888円	38,694,160,029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	10,894,193,839円
ＤＩＡＭ国内株式パッシブ・ファンド	2,140,866,731円	2,191,345,986円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	5,252,599円	3,392,166円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	13,038,380円	7,399,968円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	23,681,430円	12,999,220円
グローバル８資産ラップファンド（安定型）	13,228,825円	23,906,761円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	13,420,191円	19,553,564円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	15,993,845円	16,730,426円
たわらノーロード　ＴＯＰＩＸ	82,133,781円	285,478,397円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	5,443,582円	58,149,026円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	－円	1,496,735円
たわらノーロード　バランス（標準型）	－円	10,718,179円

たわらノーロード　バランス（積極型）	－円	25,761,119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	183,257円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（安定型）	－円	5,735,251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	18,753,835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	15,568,481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	37,051,050円
たわらノーロード　最適化バランス（保守型）	－円	40,828円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	－円	70,944円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	－円	624,356円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	－円	535,203円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	－円	1,596,424円
ＤＩＡＭ国内株式インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	35,814,315,681円	37,182,114,438円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型	797,265,541円	816,531,612円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型	2,772,479,361円	2,847,785,821円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型	2,863,257,582円	2,997,103,644円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド	352,045,452円	335,014,767円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド	1,179,965,536円	1,133,587,915円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０インデックスファンド	1,081,878,743円	1,076,982,515円
マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	50,599,626円	41,354,593円
マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	1,191,234,103円	1,081,393,977円
マネックス資産設計ファンド　エボリューション	25,856,596円	25,211,643円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	40,016,978円	270,349,553円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	92,537,042円	169,556,877円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	173,340,139円	302,458,993円
投資のソムリエ	3,598,167,045円	2,603,577,387円
クルーズコントロール	1,385,033,156円	1,094,278,101円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	197,160,817円	226,394,802円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	146,751,099円	185,086,296円

ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス・Ｆ（成長型）	171,592,462円	241,068,650円
クルーズコントロール＜ＤＣ年金＞	461,778円	633,819円
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（堅実型）	7,645,471円	9,690,606円
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（積極型）	23,808,944円	25,515,262円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	62,307,274円	73,476,645円
ダイナミック・ナビゲーション	1,486,477円	1,319,223円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	792,410,147円	1,388,764,282円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	592,766円	1,099,505円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	592,766円	793,044円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	238,256円	436,709円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	－円	1,452,537円
４資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	－円	13,612,792円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	－円	235,255,917円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	－円	18,666円
ＤＩＡＭワールドバランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	76,811,419円	62,827,883円
日米資産配分戦略ファンド（インカム重視型）（為替ヘッジあり）（適格機関投資家限定）	－円	55,539,660円
ＤＩＡＭグローバル・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	156,029,386円	110,246,818円
ＤＩＡＭグローバル・バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	334,296,917円	270,358,342円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	19,939,130円	14,259,379円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	96,956,097円	60,980,777円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	21,537,117円	15,221,233円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	27,179,602円	14,774,325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	29,165,799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	51,769,778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	971,742,856円
ＤＩＡＭバランスファンド３７．５ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,159,373,010円	921,626,851円
ＤＩＡＭバランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	3,132,500,067円	2,591,259,916円
ＤＩＡＭグローバル・アセット・バランスＶＡ（適格機関投資家限定）	230,378,853円	183,476,305円
ＤＩＡＭグローバル・アセット・バランスＶＡ２（適格機関投資家限定）	155,354,227円	49,363,658円
ＤＩＡＭ　アクサ　グローバルバランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	676,430,709円	524,439,521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）	2,674,063,219円	421,703,927円
ＤＩＡＭグローバルβ私募ファンド（適格機関投資家向け）	10,313,671円	10,313,671円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	178,653,922円	7,124,683円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド３５ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,129,542,429円	57,585,354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）	16,798,495,071円	10,226,006,007円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	603,397,247円	378,222,399円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,915,844,419円	1,642,740,603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）	10,822,212,577円	9,442,344,440円
ＤＩＡＭバランス３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	3,553,157円	3,071,696円
ＤＩＡＭバランス５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	4,968,662円	2,949,084円
ＤＩＡＭバランス７０ＶＡ（適格機関投資家限定）	4,468,394円	3,687,674円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド４ＶＡ（適格機関投資家限定）	9,646,791,837円	8,430,015,213円
ＤＩＡＭ世界バランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	77,974,896円	65,631,920円
ＤＩＡＭ国内バランス３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	30,029,445円	26,139,818円
ＤＩＡＭバランス２０ＶＡ（適格機関投資家限定）	30,306,394円	24,002,219円

ＤＩＡＭバランス４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	69,877円	96,992円
ＤＩＡＭバランス６０ＶＡ（適格機関投資家限定）	114,762円	110,708円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド７ＶＡ（１２１２）（適格機関投資家限定）	547,756,483円	405,365,089円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド７ＶＡ（１３０３）（適格機関投資家限定）	1,500,552,498円	1,261,532,817円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド７ＶＡ（１３０６）（適格機関投資家限定）	1,976,540,138円	1,669,062,351円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド７ＶＡ（１３０９）（適格機関投資家限定）	85,350,145円	68,825,151円
計	118,980,682,522円	108,086,790,523円
２．　受益権の総数	118,980,682,522口	108,086,790,523口
３．　※２　差入代用有価証券	株式　3,462,500,000円	株式　3,304,000,000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28年10月13日 至　平成29年10月12日	自　平成29年10月13日 至　平成30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29年10月12日現在	平成30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 「（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った場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成29年10月12日現在	平成30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	32,174,357,497	△7,357,253,208
合計	32,174,357,497	△7,357,253,208

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成29年2月8日から平成29年10月12日まで及び平成30年2月8日から平成30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29年10月12日 現在				平成30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	7,099,681,000	－	7,314,300,000	214,619,000	5,208,993,500	－	4,952,320,000	△256,673,500
合計	7,099,681,000	－	7,314,300,000	214,619,000	5,208,993,500	－	4,952,320,000	△256,673,500

（注）１．時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

２．先物取引の残高表示は、契約額によっております。

３．契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	平成29年10月12日現在	平成30年10月12日現在
１口当たり純資産額	2.5641円	2.6230円
（1万口当たり純資産額）	(25,641円)	(26,230円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

（１）株式

平成30年10月12日現在

銘　柄	株　式　数	評価額（円）		備考
		単　価	金　額	
極洋	5,000	3,175.00	15,875,000	
日本水産	143,200	714.00	102,244,800	
マルハニチロ	24,100	4,085.00	98,448,500	
ホウスイ	900	1,018.00	916,200	
カネコ種苗	4,300	1,519.00	6,531,700	
サカタのタネ	18,800	3,800.00	71,440,000	
ホクト	12,900	1,917.00	24,729,300	
ホクリヨウ	2,100	771.00	1,619,100	
ヒノキヤグループ	3,200	2,728.00	8,729,600	
ショーボンドホールディングス	12,000	8,280.00	99,360,000	
ミライト・ホールディングス	43,600	1,798.00	78,392,800	
タマホーム	9,500	1,105.00	10,497,500	
サンヨーホームズ	2,200	927.00	2,039,400	
日本アクア	3,500	361.00	1,263,500	
ファーストコーポレーション	4,300	1,107.00	4,760,100	
ベステラ	2,300	1,450.00	3,335,000	
ＴＡＴＥＲＵ	18,100	578.00	10,461,800	
スペースバリューホールディングス	18,800	1,102.00	20,717,600	
住石ホールディングス	32,900	132.00	4,342,800	
日鉄鉱業	3,500	4,860.00	17,010,000	
三井松島ホールディングス	6,400	1,856.00	11,878,400	
国際石油開発帝石	618,400	1,346.50	832,675,600	
石油資源開発	20,200	2,430.00	49,086,000	
Ｋ＆Ｏエナジーグループ	7,500	1,607.00	12,052,500	
ダイセキ環境ソリューション	2,900	887.00	2,572,300	
第一カッター興業	1,700	2,216.00	3,767,200	
安藤・間	103,800	820.00	85,116,000	
東急建設	49,000	1,042.00	51,058,000	
コムシスホールディングス	48,947	3,165.00	154,917,255	
ミサワホーム	10,600	888.00	9,412,800	
ビーアールホールディングス	12,600	447.00	5,632,200	
高松コンストラクショングループ	8,200	3,005.00	24,641,000	
東建コーポレーション	4,800	7,310.00	35,088,000	
ソネック	1,600	764.00	1,222,400	
ヤマウラ	5,900	877.00	5,174,300	
大成建設	126,600	5,040.00	638,064,000	
大林組	381,300	1,049.00	399,983,700	
清水建設	389,000	995.00	387,055,000	
飛島建設	11,500	1,774.00	20,401,000	
長谷工コーポレーション	148,400	1,445.00	214,438,000	
松井建設	14,000	845.00	11,830,000	
錢高組	1,800	5,310.00	9,558,000	
鹿島建設	279,400	1,572.00	439,216,800	

不動テトラ	9,500	1,901.00	18,059,500	
大末建設	4,100	1,200.00	4,920,000	
鉄建建設	7,700	2,784.00	21,436,800	
西松建設	29,400	2,776.00	81,614,400	
三井住友建設	91,700	728.00	66,757,600	
大豊建設	9,200	3,050.00	28,060,000	
前田建設工業	90,700	1,441.00	130,698,700	
佐田建設	8,200	415.00	3,403,000	
ナカノフドー建設	9,700	642.00	6,227,400	
奥村組	20,900	3,455.00	72,209,500	
東鉄工業	15,300	2,803.00	42,885,900	
イチケン	2,300	2,133.00	4,905,900	
富士ピー・エス	3,400	545.00	1,853,000	
淺沼組	4,500	3,315.00	14,917,500	
戸田建設	147,800	797.00	117,796,600	
熊谷組	20,000	3,035.00	60,700,000	
青木あすなろ建設	8,400	902.00	7,576,800	
北野建設	2,600	3,840.00	9,984,000	
植木組	1,600	2,622.00	4,195,200	
矢作建設工業	17,200	810.00	13,932,000	
ピーエス三菱	15,100	576.00	8,697,600	
日本ハウスホールディングス	24,300	613.00	14,895,900	
大東建託	45,300	14,495.00	656,623,500	
新日本建設	15,100	1,105.00	16,685,500	
ＮＩＰＰＯ	29,500	1,922.00	56,699,000	
東亜道路工業	2,500	3,560.00	8,900,000	
前田道路	39,800	2,216.00	88,196,800	
日本道路	3,400	6,400.00	21,760,000	
東亜建設工業	10,300	2,247.00	23,144,100	
若築建設	6,800	1,518.00	10,322,400	
東洋建設	39,900	458.00	18,274,200	
五洋建設	151,200	716.00	108,259,200	
世紀東急工業	17,100	667.00	11,405,700	
福田組	4,100	5,080.00	20,828,000	
日本ドライケミカル	2,900	1,241.00	3,598,900	
住友林業	81,300	1,854.00	150,730,200	
日本基礎技術	14,100	377.00	5,315,700	
巴コーポレーション	15,800	455.00	7,189,000	
大和ハウス工業	375,700	3,366.00	1,264,606,200	
ライト工業	24,400	1,490.00	36,356,000	
積水ハウス	413,800	1,659.00	686,494,200	
日特建設	10,800	724.00	7,819,200	
北陸電気工事	7,000	989.00	6,923,000	
ユアテック	17,800	879.00	15,646,200	
四電工	1,800	2,668.00	4,802,400	
中電工	16,400	2,505.00	41,082,000	
関電工	50,600	1,102.00	55,761,200	
きんでん	84,600	1,727.00	146,104,200	
東京エネシス	14,400	1,038.00	14,947,200	
トーエネック	3,500	3,110.00	10,885,000	

住友電設	10,000	1,735.00	17,350,000	
日本電設工業	19,500	2,282.00	44,499,000	
協和エクシオ	48,438	3,165.00	153,306,270	
新日本空調	9,800	1,678.00	16,444,400	
日本工営	7,300	2,776.00	20,264,800	
九電工	25,100	4,210.00	105,671,000	
三機工業	27,000	1,132.00	30,564,000	
日揮	109,500	2,396.00	262,362,000	
中外炉工業	3,900	2,639.00	10,292,100	
ヤマト	10,400	666.00	6,926,400	
太平電業	8,600	2,858.00	24,578,800	
高砂熱学工業	35,000	1,933.00	67,655,000	
三晃金属工業	1,400	3,285.00	4,599,000	
ＮＥＣネッツエスアイ	12,300	2,430.00	29,889,000	
朝日工業社	2,500	3,260.00	8,150,000	
明星工業	23,000	843.00	19,389,000	
大氣社	16,100	3,460.00	55,706,000	
ダイダン	8,500	2,575.00	21,887,500	
日比谷総合設備	14,200	1,846.00	26,213,200	
東芝プラントシステム	27,600	2,292.00	63,259,200	
日本製粉	37,800	1,901.00	71,857,800	
日清製粉グループ本社	139,400	2,432.00	339,020,800	
日東富士製粉	800	5,250.00	4,200,000	
昭和産業	10,400	2,844.00	29,577,600	
鳥越製粉	10,000	998.00	9,980,000	
中部飼料	13,900	1,425.00	19,807,500	
フィード・ワン	76,500	197.00	15,070,500	
東洋精糖	1,900	1,189.00	2,259,100	
日本甜菜製糖	6,500	1,930.00	12,545,000	
三井製糖	9,000	3,020.00	27,180,000	
塩水港精糖	13,500	252.00	3,402,000	
日新製糖	5,500	2,228.00	12,254,000	
ＬＩＦＵＬＬ	37,700	566.00	21,338,200	
ジェイエイシーリクルートメント	8,800	2,350.00	20,680,000	
日本M&Aセンター	75,100	3,195.00	239,944,500	
メンバーズ	3,600	1,172.00	4,219,200	
中広	1,200	708.00	849,600	
タケエイ	11,300	781.00	8,825,300	
Ｅ・Ｊホールディングス	1,400	1,344.00	1,881,600	
トラスト・テック	5,300	3,825.00	20,272,500	
コシダカホールディングス	29,000	1,490.00	43,210,000	
アルトナー	1,700	968.00	1,645,600	
パソナグループ	10,300	1,517.00	15,625,100	
ＣＤＳ	2,700	1,366.00	3,688,200	
リンクアンドモチベーション	20,000	1,282.00	25,640,000	
ＧＣＡ	11,000	927.00	10,197,000	
エス・エム・エス	42,800	1,990.00	85,172,000	
パーソルホールディングス	100,100	2,383.00	238,538,300	
リニカル	7,000	1,684.00	11,788,000	
クックパッド	34,100	417.00	14,219,700	

エスクリ	3,800	725.00	2,755,000	
アイ・ケイ・ケイ	5,300	767.00	4,065,100	
森永製菓	26,800	4,365.00	116,982,000	
中村屋	2,800	4,615.00	12,922,000	
江崎グリコ	31,800	5,600.00	178,080,000	
名糖産業	5,500	1,515.00	8,332,500	
井村屋グループ	4,500	3,170.00	14,265,000	
不二家	6,300	2,475.00	15,592,500	
山崎製パン	93,200	2,123.00	197,863,600	
第一屋製パン	1,900	1,120.00	2,128,000	
モロゾフ	1,800	5,610.00	10,098,000	
亀田製菓	7,100	5,070.00	35,997,000	
寿スピリッツ	11,000	4,500.00	49,500,000	
カルビー	51,900	3,655.00	189,694,500	
森永乳業	22,800	2,996.00	68,308,800	
六甲バター	8,300	2,440.00	20,252,000	
ヤクルト本社	66,300	8,900.00	590,070,000	
明治ホールディングス	75,400	7,530.00	567,762,000	
雪印メグミルク	27,500	2,735.00	75,212,500	
プリマハム	16,000	2,354.00	37,664,000	
日本ハム	49,300	4,120.00	203,116,000	
林兼産業	4,000	681.00	2,724,000	
丸大食品	12,100	2,013.00	24,357,300	
Ｓ　Ｆｏｏｄｓ	8,000	4,535.00	36,280,000	
伊藤ハム米久ホールディングス	73,300	740.00	54,242,000	
学情	4,400	1,658.00	7,295,200	
スタジオアリス	5,500	2,466.00	13,563,000	
シミックホールディングス	6,000	2,230.00	13,380,000	
システナ	35,700	1,443.00	51,515,100	
ＮＪＳ	2,300	1,778.00	4,089,400	
デジタルアーツ	5,500	5,060.00	27,830,000	
新日鉄住金ソリューションズ	16,600	3,475.00	57,685,000	
綜合警備保障	43,100	4,700.00	202,570,000	
キューブシステム	6,400	922.00	5,900,800	
いちご	160,100	361.00	57,796,100	
エイジア	2,200	1,375.00	3,025,000	
日本駐車場開発	135,200	168.00	22,713,600	
コア	4,700	1,277.00	6,001,900	
カカクコム	81,700	2,099.00	171,488,300	
アイロムグループ	3,700	1,748.00	6,467,600	
セントケア・ホールディング	4,600	650.00	2,990,000	
サイネックス	1,600	752.00	1,203,200	
ルネサンス	5,300	2,444.00	12,953,200	
ディップ	15,300	2,659.00	40,682,700	
ＳＢＳホールディングス	11,200	1,504.00	16,844,800	
オプトホールディング	6,700	2,979.00	19,959,300	
新日本科学	13,200	559.00	7,378,800	
ツクイ	25,500	1,030.00	26,265,000	
キャリアデザインセンター	2,700	1,516.00	4,093,200	
エムスリー	228,200	2,275.00	519,155,000	

ツカダ・グローバルホールディング	6,900	617.00	4,257,300	
ブラス	800	651.00	520,800	
アウトソーシング	56,700	1,581.00	89,642,700	
ウェルネット	10,900	1,037.00	11,303,300	
ワールドホールディングス	3,000	3,110.00	9,330,000	
ディー・エヌ・エー	58,500	1,897.00	110,974,500	
博報堂ＤＹホールディングス	150,700	1,930.00	290,851,000	
ぐるなび	17,100	917.00	15,680,700	
エスアールジータカミヤ	12,900	644.00	8,307,600	
ジャパンベストレスキューシステム	8,600	1,138.00	9,786,800	
ファンコミュニケーションズ	29,800	660.00	19,668,000	
ライク	4,300	1,628.00	7,000,400	
ビジネス・ブレークスルー	5,100	396.00	2,019,600	
ＷＤＢホールディングス	5,000	3,550.00	17,750,000	
ティア	5,000	859.00	4,295,000	
ＣＤＧ	1,000	1,593.00	1,593,000	
バリューコマース	7,300	2,201.00	16,067,300	
インフォマート	59,400	1,264.00	75,081,600	
サッポロホールディングス	41,700	2,299.00	95,868,300	
アサヒグループホールディングス	238,600	4,798.00	1,144,802,800	
キリンホールディングス	515,400	2,702.00	1,392,610,800	
宝ホールディングス	85,300	1,667.00	142,195,100	
オエノンホールディングス	32,300	400.00	12,920,000	
養命酒製造	3,400	2,386.00	8,112,400	
コカ・コーラ　ボトラーズジャパンホールディングス	87,200	2,952.00	257,414,400	
サントリー食品インターナショナル	76,200	4,460.00	339,852,000	
ダイドーグループホールディングス	5,800	5,630.00	32,654,000	
伊藤園	37,700	5,120.00	193,024,000	
キーコーヒー	11,200	2,085.00	23,352,000	
ユニカフェ	3,400	1,268.00	4,311,200	
ジャパンフーズ	1,600	1,395.00	2,232,000	
日清オイリオグループ	13,400	3,275.00	43,885,000	
不二製油グループ本社	30,900	3,410.00	105,369,000	
かどや製油	1,200	6,150.00	7,380,000	
Ｊ－オイルミルズ	5,900	3,755.00	22,154,500	
ローソン	28,200	6,770.00	190,914,000	
サンエー	8,500	5,010.00	42,585,000	
カワチ薬品	8,700	2,158.00	18,774,600	
エービーシー・マート	20,300	6,480.00	131,544,000	
ハードオフコーポレーション	4,900	953.00	4,669,700	
高千穂交易	4,300	1,012.00	4,351,600	
アスクル	9,700	3,300.00	32,010,000	
ゲオホールディングス	18,600	1,643.00	30,559,800	
アダストリア	17,200	1,723.00	29,635,600	
ジーフット	6,800	746.00	5,072,800	
シー・ヴイ・エス・ベイエリア	1,500	765.00	1,147,500	
伊藤忠食品	2,700	5,750.00	15,525,000	
くらコーポレーション	6,500	6,720.00	43,680,000	
キャンドゥ	5,400	1,683.00	9,088,200	

エレマテック	5,300	2,580.00	13,674,000	
パルグループホールディングス	5,700	2,870.00	16,359,000	
ＪＡＬＵＸ	3,100	2,829.00	8,769,900	
エディオン	43,400	1,222.00	53,034,800	
あらた	5,600	5,040.00	28,224,000	
サーラコーポレーション	22,700	657.00	14,913,900	
ワッツ	3,700	886.00	3,278,200	
トーメンデバイス	1,700	2,591.00	4,404,700	
ハローズ	4,100	2,631.00	10,787,100	
ＪＰホールディングス	34,100	296.00	10,093,600	
あみやき亭	2,400	4,260.00	10,224,000	
東京エレクトロン　デバイス	4,100	1,817.00	7,449,700	
ひらまつ	15,400	435.00	6,699,000	
フィールズ	8,600	911.00	7,834,600	
双日	661,600	394.00	260,670,400	
アルフレッサ　ホールディングス	124,200	2,916.00	362,167,200	
大黒天物産	2,700	4,310.00	11,637,000	
ハニーズホールディングス	10,800	917.00	9,903,600	
ファーマライズホールディングス	2,500	595.00	1,487,500	
キッコーマン	82,000	6,530.00	535,460,000	
味の素	262,000	1,835.00	480,770,000	
キユーピー	63,500	2,588.00	164,338,000	
ハウス食品グループ本社	43,400	3,350.00	145,390,000	
カゴメ	45,700	3,045.00	139,156,500	
焼津水産化学工業	5,500	1,065.00	5,857,500	
アリアケジャパン	10,400	10,610.00	110,344,000	
ピエトロ	1,500	1,635.00	2,452,500	
エバラ食品工業	2,400	2,146.00	5,150,400	
ニチレイ	54,200	2,895.00	156,909,000	
横浜冷凍	29,200	883.00	25,783,600	
東洋水産	62,500	4,230.00	264,375,000	
イートアンド	3,600	1,662.00	5,983,200	
大冷	1,300	1,941.00	2,523,300	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	2,300	890.00	2,047,000	
日清食品ホールディングス	44,700	7,430.00	332,121,000	
永谷園ホールディングス	5,800	2,908.00	16,866,400	
一正蒲鉾	4,500	992.00	4,464,000	
フジッコ	12,400	2,268.00	28,123,200	
ロック・フィールド	12,300	1,790.00	22,017,000	
日本たばこ産業	657,800	2,869.50	1,887,557,100	
ケンコーマヨネーズ	7,600	2,563.00	19,478,800	
わらべや日洋ホールディングス	7,500	1,892.00	14,190,000	
なとり	6,300	1,804.00	11,365,200	
イフジ産業	1,900	765.00	1,453,500	
ピックルスコーポレーション	2,200	2,320.00	5,104,000	
北の達人コーポレーション	34,800	655.00	22,794,000	
ユーグレナ	45,400	734.00	33,323,600	
片倉工業	13,600	1,272.00	17,299,200	
グンゼ	8,900	5,260.00	46,814,000	
ヒューリック	233,700	1,000.00	233,700,000	

神栄	1,600	1,176.00	1,881,600	
ラサ商事	4,900	981.00	4,806,900	
アルペン	8,600	1,955.00	16,813,000	
ハブ	2,800	899.00	2,517,200	
ラクーン	6,600	583.00	3,847,800	
クオールホールディングス	12,400	2,414.00	29,933,600	
アルコニックス	11,900	1,446.00	17,207,400	
神戸物産	8,500	6,270.00	53,295,000	
ソリトンシステムズ	6,200	976.00	6,051,200	
ジンズ	7,600	6,060.00	46,056,000	
ビックカメラ	59,700	1,426.00	85,132,200	
ＤＣＭホールディングス	60,300	1,055.00	63,616,500	
ペッパーフードサービス	8,800	3,635.00	31,988,000	
ＭｏｎｏｔａＲＯ	70,700	3,040.00	214,928,000	
東京一番フーズ	2,300	647.00	1,488,100	
ＤＤホールディングス	2,400	2,629.00	6,309,600	
あい　ホールディングス	17,900	2,327.00	41,653,300	
ディーブイエックス	4,000	1,402.00	5,608,000	
きちり	3,000	806.00	2,418,000	
アークランドサービスホールディングス	8,200	2,190.00	17,958,000	
Ｊ．フロント　リテイリング	133,500	1,551.00	207,058,500	
ドトール・日レスホールディングス	19,700	2,002.00	39,439,400	
マツモトキヨシホールディングス	46,200	4,225.00	195,195,000	
ブロンコビリー	5,800	3,370.00	19,546,000	
ＺＯＺＯ	109,800	3,135.00	344,223,000	
トレジャー・ファクトリー	3,300	722.00	2,382,600	
物語コーポレーション	3,200	10,140.00	32,448,000	
ココカラファイン	11,700	6,700.00	78,390,000	
三越伊勢丹ホールディングス	209,100	1,258.00	263,047,800	
東洋紡	43,900	1,735.00	76,166,500	
ユニチカ	34,600	632.00	21,867,200	
富士紡ホールディングス	6,600	3,385.00	22,341,000	
日清紡ホールディングス	73,800	1,303.00	96,161,400	
倉敷紡績	12,000	2,694.00	32,328,000	
ダイワボウホールディングス	9,500	6,860.00	65,170,000	
シキボウ	5,800	1,246.00	7,226,800	
日東紡績	16,800	2,503.00	42,050,400	
トヨタ紡織	33,100	2,019.00	66,828,900	
マクニカ・富士エレホールディングス	21,400	1,828.00	39,119,200	
Ｈａｍｅｅ	2,800	1,692.00	4,737,600	
ラクト・ジャパン	2,400	7,140.00	17,136,000	
ウエルシアホールディングス	29,600	5,910.00	174,936,000	
クリエイトＳＤホールディングス	16,500	2,813.00	46,414,500	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	21,000	1,203.00	25,263,000	
八洲電機	8,700	876.00	7,621,200	
メディアスホールディングス	6,100	842.00	5,136,200	
ＵＫＣホールディングス	7,200	2,414.00	17,380,800	
ジューテックホールディングス	2,500	1,039.00	2,597,500	

丸善ＣＨＩホールディングス	13,000	351.00	4,563,000	
大光	2,800	699.00	1,957,200	
ＯＣＨＩホールディングス	3,200	1,324.00	4,236,800	
ＴＯＫＡＩホールディングス	59,100	1,028.00	60,754,800	
黒谷	1,800	505.00	909,000	
ミサワ	1,800	468.00	842,400	
ティーライフ	1,500	1,052.00	1,578,000	
Ｃｏｍｉｎｉｘ	1,700	868.00	1,475,600	
エー・ピーカンパニー	2,100	597.00	1,253,700	
三洋貿易	5,600	1,935.00	10,836,000	
チムニー	3,400	2,869.00	9,754,600	
シュッピン	6,700	1,365.00	9,145,500	
ビューティガレージ	1,600	2,148.00	3,436,800	
ウイン・パートナーズ	8,100	1,172.00	9,493,200	
ネクステージ	17,100	930.00	15,903,000	
ジョイフル本田	32,700	1,657.00	54,183,900	
鳥貴族	3,700	2,193.00	8,114,100	
キリン堂ホールディングス	4,000	1,579.00	6,316,000	
ホットランド	5,800	1,334.00	7,737,200	
すかいらーくホールディングス	104,200	1,686.00	175,681,200	
綿半ホールディングス	4,200	2,592.00	10,886,400	
日本毛織	36,600	883.00	32,317,800	
ダイトウボウ	18,300	95.00	1,738,500	
トーア紡コーポレーション	4,700	544.00	2,556,800	
ダイドーリミテッド	13,100	371.00	4,860,100	
ヨシックス	1,800	2,796.00	5,032,800	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	37,100	1,276.00	47,339,600	
三栄建築設計	4,500	1,672.00	7,524,000	
スター・マイカ	5,200	1,608.00	8,361,600	
野村不動産ホールディングス	74,500	2,133.00	158,908,500	
三重交通グループホールディングス	22,700	518.00	11,758,600	
サムティ	15,500	1,637.00	25,373,500	
ディア・ライフ	13,400	511.00	6,847,400	
コーセーアールイー	2,500	872.00	2,180,000	
エー・ディー・ワークス	149,400	38.00	5,677,200	
日本商業開発	6,300	1,724.00	10,861,200	
プレサンスコーポレーション	15,500	1,332.00	20,646,000	
ユニゾホールディングス	15,400	2,059.00	31,708,600	
ＴＨＥグローバル社	5,300	806.00	4,271,800	
日本管理センター	7,400	1,231.00	9,109,400	
サンセイランディック	2,900	1,174.00	3,404,600	
エストラスト	1,600	831.00	1,329,600	
フージャースホールディングス	27,200	664.00	18,060,800	
オープンハウス	18,200	4,950.00	90,090,000	
東急不動産ホールディングス	271,000	650.00	176,150,000	
飯田グループホールディングス	93,400	1,960.00	183,064,000	
イーグランド	1,800	774.00	1,393,200	
ムゲンエステート	7,700	672.00	5,174,400	
帝国繊維	12,500	2,604.00	32,550,000	

日本コークス工業	95,800	111.00	10,633,800	
ゴルフダイジェスト・オンライン	4,500	965.00	4,342,500	
ミタチ産業	2,800	839.00	2,349,200	
ＢＥＥＮＯＳ	2,600	1,817.00	4,724,200	
あさひ	8,300	1,393.00	11,561,900	
日本調剤	4,000	3,575.00	14,300,000	
コスモス薬品	5,600	23,920.00	133,952,000	
シップヘルスケアホールディングス	23,300	4,115.00	95,879,500	
トーエル	5,400	934.00	5,043,600	
一六堂	2,400	374.00	897,600	
ソフトクリエイトホールディングス	5,400	1,697.00	9,163,800	
オンリー	1,800	906.00	1,630,800	
セブン&アイ・ホールディングス	468,600	4,848.00	2,271,772,800	
薬王堂	4,900	3,710.00	18,179,000	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	30,100	1,248.00	37,564,800	
明治電機工業	3,800	1,900.00	7,220,000	
ツルハホールディングス	24,200	12,850.00	310,970,000	
デリカフーズホールディングス	2,100	1,522.00	3,196,200	
スターティアホールディングス	2,500	634.00	1,585,000	
サンマルクホールディングス	8,000	2,580.00	20,640,000	
フェリシモ	2,800	1,310.00	3,668,000	
トリドールホールディングス	13,800	2,057.00	28,386,600	
帝人	97,600	2,050.00	200,080,000	
東レ	862,500	808.60	697,417,500	
クラレ	187,600	1,580.00	296,408,000	
旭化成	741,500	1,538.00	1,140,427,000	
サカイオーベックス	2,900	2,223.00	6,446,700	
ＴＯＫＹＯ　ＢＡＳＥ	9,900	583.00	5,771,700	
稲葉製作所	6,300	1,354.00	8,530,200	
宮地エンジニアリンググループ	3,200	2,794.00	8,940,800	
トーカロ	31,200	1,015.00	31,668,000	
アルファ	4,000	1,413.00	5,652,000	
ＳＵＭＣＯ	124,000	1,606.00	199,144,000	
川田テクノロジーズ	2,200	6,750.00	14,850,000	
ＲＳ　Ｔｅｃｈｎｏｌｏｇｉｅｓ	2,200	4,740.00	10,428,000	
ビーロット	1,800	1,263.00	2,273,400	
ファーストブラザーズ	3,000	1,229.00	3,687,000	
ハウスドゥ	4,100	2,064.00	8,462,400	
シーアールイー	3,700	893.00	3,304,100	
プロパティエージェント	900	1,045.00	940,500	
ケイアイスター不動産	4,000	2,142.00	8,568,000	
アグレ都市デザイン	1,200	813.00	975,600	
グッドコムアセット	1,900	1,879.00	3,570,100	
ジェイ・エス・ビー	400	4,940.00	1,976,000	
住江織物	3,000	2,881.00	8,643,000	
日本フエルト	6,200	499.00	3,093,800	
イチカワ	1,600	1,612.00	2,579,200	
エコナックホールディングス	21,200	119.00	2,522,800	
日東製網	1,300	1,622.00	2,108,600	

芦森工業	2,300	2,103.00	4,836,900	
アツギ	7,900	1,133.00	8,950,700	
ウイルプラスホールディングス	1,000	925.00	925,000	
ジャパンミート	4,200	2,063.00	8,664,600	
コメダホールディングス	20,800	2,297.00	47,777,600	
サツドラホールディングス	1,800	2,021.00	3,637,800	
ダイユー・リックホールディングス	5,300	1,076.00	5,702,800	
バロックジャパンリミテッド	9,000	946.00	8,514,000	
クスリのアオキホールディングス	8,900	8,410.00	74,849,000	
ダイニック	4,500	903.00	4,063,500	
共和レザー	6,900	920.00	6,348,000	
力の源ホールディングス	2,400	1,029.00	2,469,600	
スシローグローバルホールディングス	12,300	5,920.00	72,816,000	
ＬＩＸＩＬビバ	14,200	1,666.00	23,657,200	
セーレン	27,400	1,783.00	48,854,200	
ソトー	4,300	995.00	4,278,500	
東海染工	1,700	1,300.00	2,210,000	
小松マテーレ	18,200	1,009.00	18,363,800	
ワコールホールディングス	32,400	3,085.00	99,954,000	
ホギメディカル	15,000	3,425.00	51,375,000	
レナウン	32,400	119.00	3,855,600	
クラウディアホールディングス	2,700	513.00	1,385,100	
ＴＳＩホールディングス	41,000	743.00	30,463,000	
マツオカコーポレーション	2,800	3,175.00	8,890,000	
ＴＩＳ	37,100	5,130.00	190,323,000	
ネオス	3,300	1,000.00	3,300,000	
電算システム	4,300	2,111.00	9,077,300	
グリー	59,800	494.00	29,541,200	
コーエーテクモホールディングス	22,800	1,851.00	42,202,800	
三菱総合研究所	4,400	4,075.00	17,930,000	
ボルテージ	2,200	742.00	1,632,400	
電算	1,200	2,198.00	2,637,600	
ＡＧＳ	6,200	755.00	4,681,000	
ファインデックス	9,300	743.00	6,909,900	
ヒト・コミュニケーションズ	2,500	1,811.00	4,527,500	
ブレインパッド	2,300	6,640.00	15,272,000	
ＫＬａｂ	19,900	1,055.00	20,994,500	
ポールトゥウィン・ピットクルーホールディングス	8,100	2,614.00	21,173,400	
イーブックイニシアティブジャパン	1,800	2,356.00	4,240,800	
ネクソン	282,900	1,385.00	391,816,500	
アイスタイル	28,300	1,161.00	32,856,300	
エムアップ	3,700	2,597.00	9,608,900	
エイチーム	6,900	1,826.00	12,599,400	
テクノスジャパン	10,000	964.00	9,640,000	
ｅｎｉｓｈ	3,800	649.00	2,466,200	
コロプラ	31,800	699.00	22,228,200	
オルトプラス	6,600	509.00	3,359,400	
ブロードリーフ	55,200	720.00	39,744,000	
クロス・マーケティンググループ	3,100	507.00	1,571,700	

デジタルハーツホールディングス	5,900	1,578.00	9,310,200	
メディアドゥホールディングス	3,600	2,280.00	8,208,000	
じげん	11,800	761.00	8,979,800	
ブイキューブ	5,900	563.00	3,321,700	
サイバーリンクス	1,700	1,117.00	1,898,900	
ディー・エル・イー	7,300	331.00	2,416,300	
フィックスターズ	10,600	1,428.00	15,136,800	
ＶＯＹＡＧＥ　ＧＲＯＵＰ	5,800	1,376.00	7,980,800	
オプティム	1,900	4,360.00	8,284,000	
セレス	3,600	2,039.00	7,340,400	
特種東海製紙	6,500	4,455.00	28,957,500	
ベリサーブ	1,500	4,760.00	7,140,000	
ティーガイア	11,100	2,738.00	30,391,800	
セック	1,500	5,100.00	7,650,000	
日本アジアグループ	11,800	408.00	4,814,400	
豆蔵ホールディングス	8,300	886.00	7,353,800	
テクマトリックス	5,500	2,158.00	11,869,000	
プロシップ	1,600	2,666.00	4,265,600	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	268,400	216.00	57,974,400	
ＧＭＯペイメントゲートウェイ	18,300	6,370.00	116,571,000	
ザッパラス	5,400	397.00	2,143,800	
システムリサーチ	1,500	5,030.00	7,545,000	
インターネットイニシアティブ	18,100	2,169.00	39,258,900	
さくらインターネット	13,200	679.00	8,962,800	
ヴィンクス	3,100	1,469.00	4,553,900	
ＧＭＯクラウド	2,400	3,650.00	8,760,000	
ＳＲＡホールディングス	5,900	3,320.00	19,588,000	
ＭＩＮＯＲＩソリューションズ	2,100	1,383.00	2,904,300	
システムインテグレータ	1,600	2,491.00	3,985,600	
朝日ネット	10,100	503.00	5,080,300	
ｅＢＡＳＥ	2,900	1,716.00	4,976,400	
アバント	3,000	1,483.00	4,449,000	
アドソル日進	4,300	2,102.00	9,038,600	
フリービット	7,400	972.00	7,192,800	
コムチュア	5,600	4,030.00	22,568,000	
サイバーコム	1,900	1,901.00	3,611,900	
アステリア	5,500	1,010.00	5,555,000	
王子ホールディングス	500,400	793.00	396,817,200	
日本製紙	53,300	2,000.00	106,600,000	
三菱製紙	16,900	617.00	10,427,300	
北越コーポレーション	66,400	567.00	37,648,800	
中越パルプ工業	4,800	1,540.00	7,392,000	
巴川製紙所	3,500	1,315.00	4,602,500	
大王製紙	47,400	1,520.00	72,048,000	
阿波製紙	2,800	598.00	1,674,400	
マークラインズ	3,800	1,737.00	6,600,600	
メディカル・データ・ビジョン	9,800	1,899.00	18,610,200	
ｇｕｍｉ	12,900	656.00	8,462,400	
ショーケース・ティービー	2,300	972.00	2,235,600	

モバイルファクトリー	3,100	1,780.00	5,518,000	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	4,900	1,605.00	7,864,500	
ＰＣＩホールディングス	1,900	2,815.00	5,348,500	
パイプドＨＤ	1,800	1,085.00	1,953,000	
アイビーシー	1,800	1,502.00	2,703,600	
ネオジャパン	2,600	981.00	2,550,600	
ＰＲ　ＴＩＭＥＳ	700	2,432.00	1,702,400	
ランドコンピュータ	1,100	1,108.00	1,218,800	
オープンドア	4,400	2,868.00	12,619,200	
マイネット	3,500	1,137.00	3,979,500	
アカツキ	2,900	4,675.00	13,557,500	
ベネフィットジャパン	600	860.00	516,000	
Ｕｂｉｃｏｍホールディングス	1,600	1,073.00	1,716,800	
ＬＩＮＥ	33,900	4,020.00	136,278,000	
カナミックネットワーク	1,700	1,992.00	3,386,400	
ノムラシステムコーポレーション	900	1,081.00	972,900	
レンゴー	114,600	939.00	107,609,400	
トーモク	6,800	1,986.00	13,504,800	
ザ・パック	8,400	3,385.00	28,434,000	
シンクロ・フード	3,800	786.00	2,986,800	
オークネット	5,800	1,251.00	7,255,800	
ＡＯＩ　ＴＹＯ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	12,100	1,370.00	16,577,000	
マクロミル	14,000	2,344.00	32,816,000	
ビーグリー	2,100	1,411.00	2,963,100	
オロ	1,100	5,680.00	6,248,000	
昭和電工	73,900	5,640.00	416,796,000	
住友化学	875,200	600.00	525,120,000	
住友精化	5,000	6,040.00	30,200,000	
日産化学	68,200	5,900.00	402,380,000	
ラサ工業	4,200	2,068.00	8,685,600	
クレハ	10,200	8,040.00	82,008,000	
多木化学	1,600	8,000.00	12,800,000	
テイカ	9,100	2,509.00	22,831,900	
石原産業	21,300	1,518.00	32,333,400	
片倉コープアグリ	2,800	1,199.00	3,357,200	
日東エフシー	6,900	748.00	5,161,200	
日本曹達	16,600	3,220.00	53,452,000	
東ソー	171,800	1,611.00	276,769,800	
トクヤマ	34,500	2,880.00	99,360,000	
セントラル硝子	24,200	2,752.00	66,598,400	
東亞合成	69,800	1,159.00	80,898,200	
大阪ソーダ	11,800	2,777.00	32,768,600	
関東電化工業	28,400	1,114.00	31,637,600	
デンカ	43,700	3,910.00	170,867,000	
イビデン	69,500	1,460.00	101,470,000	
信越化学工業	195,900	9,172.00	1,796,794,800	
日本カーバイド工業	3,800	1,694.00	6,437,200	
堺化学工業	8,200	2,761.00	22,640,200	
第一稀元素化学工業	9,100	1,239.00	11,274,900	

エア・ウォーター	98,000	1,932.00	189,336,000	
大陽日酸	91,600	1,662.00	152,239,200	
日本化学工業	4,400	3,315.00	14,586,000	
東邦アセチレン	1,700	1,466.00	2,492,200	
日本パーカライジング	60,700	1,434.00	87,043,800	
高圧ガス工業	17,600	836.00	14,713,600	
チタン工業	1,300	2,487.00	3,233,100	
四国化成工業	17,100	1,392.00	23,803,200	
戸田工業	2,300	2,764.00	6,357,200	
ステラ　ケミファ	6,000	3,735.00	22,410,000	
保土谷化学工業	3,900	2,988.00	11,653,200	
日本触媒	18,700	8,070.00	150,909,000	
大日精化工業	9,200	3,370.00	31,004,000	
カネカ	32,100	5,010.00	160,821,000	
協和発酵キリン	142,200	2,011.00	285,964,200	
三菱瓦斯化学	98,000	2,126.00	208,348,000	
三井化学	108,100	2,648.00	286,248,800	
ＪＳＲ	119,600	1,905.00	227,838,000	
東京応化工業	19,100	3,175.00	60,642,500	
大阪有機化学工業	10,300	1,512.00	15,573,600	
三菱ケミカルホールディングス	796,300	979.30	779,816,590	
ＫＨネオケム	16,800	3,815.00	64,092,000	
ダイセル	160,300	1,265.00	202,779,500	
住友ベークライト	19,300	4,370.00	84,341,000	
積水化学工業	243,000	1,883.00	457,569,000	
日本ゼオン	100,300	1,183.00	118,654,900	
アイカ工業	33,400	4,180.00	139,612,000	
宇部興産	59,900	2,717.00	162,748,300	
積水樹脂	18,300	2,059.00	37,679,700	
タキロンシーアイ	24,000	583.00	13,992,000	
旭有機材	7,000	2,515.00	17,605,000	
日立化成	58,700	1,986.00	116,578,200	
ニチバン	5,800	2,431.00	14,099,800	
リケンテクノス	25,600	544.00	13,926,400	
大倉工業	5,600	2,004.00	11,222,400	
積水化成品工業	14,900	941.00	14,020,900	
群栄化学工業	2,700	3,095.00	8,356,500	
タイガースポリマー	5,800	720.00	4,176,000	
ミライアル	3,900	1,025.00	3,997,500	
ダイキアクシス	3,900	1,271.00	4,956,900	
ダイキョーニシカワ	23,500	1,135.00	26,672,500	
竹本容器	1,900	2,917.00	5,542,300	
森六ホールディングス	5,900	2,904.00	17,133,600	
日本化薬	77,200	1,289.00	99,510,800	
カーリットホールディングス	11,000	867.00	9,537,000	
ＥＰＳホールディングス	16,400	2,253.00	36,949,200	
ソルクシーズ	4,800	936.00	4,492,800	
レッグス	2,700	1,238.00	3,342,600	
プレステージ・インターナショナル	22,500	1,355.00	30,487,500	
フェイス	3,900	1,179.00	4,598,100	

ハイマックス	1,500	1,876.00	2,814,000	
アミューズ	7,200	2,981.00	21,463,200	
野村総合研究所	70,800	5,450.00	385,860,000	
ドリームインキュベータ	3,600	1,943.00	6,994,800	
サイバネットシステム	9,200	673.00	6,191,600	
クイック	6,700	1,894.00	12,689,800	
ＴＡＣ	6,500	261.00	1,696,500	
ＣＥホールディングス	2,800	784.00	2,195,200	
ケネディクス	101,400	594.00	60,231,600	
日本システム技術	1,800	2,301.00	4,141,800	
電通	132,100	5,410.00	714,661,000	
インテージホールディングス	13,100	935.00	12,248,500	
テイクアンドギヴ・ニーズ	5,100	2,006.00	10,230,600	
東邦システムサイエンス	3,700	866.00	3,204,200	
ぴあ	3,600	5,310.00	19,116,000	
イオンファンタジー	3,500	4,220.00	14,770,000	
ソースネクスト	16,600	1,269.00	21,065,400	
シーティーエス	10,700	760.00	8,132,000	
ネクシィーズグループ	3,300	2,018.00	6,659,400	
メディカルシステムネットワーク	12,900	480.00	6,192,000	
日本精化	9,800	1,191.00	11,671,800	
扶桑化学工業	11,300	2,354.00	26,600,200	
トリケミカル研究所	2,700	4,570.00	12,339,000	
ＦＩＧ	9,900	320.00	3,168,000	
ＡＤＥＫＡ	51,100	1,857.00	94,892,700	
日油	46,000	3,440.00	158,240,000	
ミヨシ油脂	4,400	1,263.00	5,557,200	
新日本理化	18,800	215.00	4,042,000	
ハリマ化成グループ	9,200	945.00	8,694,000	
花王	279,100	8,529.00	2,380,443,900	
第一工業製薬	4,500	3,265.00	14,692,500	
石原ケミカル	2,800	2,154.00	6,031,200	
日華化学	3,700	1,208.00	4,469,600	
ニイタカ	1,700	1,808.00	3,073,600	
三洋化成工業	7,500	5,350.00	40,125,000	
武田薬品工業	418,100	4,394.00	1,837,131,400	
アステラス製薬	1,116,300	1,828.50	2,041,154,550	
大日本住友製薬	84,100	2,539.00	213,529,900	
塩野義製薬	160,000	7,236.00	1,157,760,000	
田辺三菱製薬	138,500	1,752.00	242,652,000	
わかもと製薬	13,600	281.00	3,821,600	
あすか製薬	12,900	1,492.00	19,246,800	
日本新薬	29,700	6,910.00	205,227,000	
ビオフェルミン製薬	1,800	2,785.00	5,013,000	
中外製薬	118,400	6,740.00	798,016,000	
科研製薬	20,400	5,760.00	117,504,000	
エーザイ	135,900	10,270.00	1,395,693,000	
理研ビタミン	4,300	3,850.00	16,555,000	
ロート製薬	62,300	3,795.00	236,428,500	
小野薬品工業	268,000	2,929.00	784,972,000	

久光製薬	33,500	7,100.00	237,850,000	
有機合成薬品工業	7,800	259.00	2,020,200	
持田製薬	7,900	8,660.00	68,414,000	
参天製薬	215,200	1,728.00	371,865,600	
扶桑薬品工業	3,900	2,741.00	10,689,900	
日本ケミファ	1,500	4,450.00	6,675,000	
ツムラ	40,600	3,610.00	146,566,000	
日医工	29,900	1,564.00	46,763,600	
テルモ	174,000	6,840.00	1,190,160,000	
みらかホールディングス	32,300	2,823.00	91,182,900	
キッセイ薬品工業	20,100	3,320.00	66,732,000	
生化学工業	22,000	1,652.00	36,344,000	
栄研化学	18,400	2,406.00	44,270,400	
日水製薬	4,800	1,309.00	6,283,200	
鳥居薬品	6,100	2,564.00	15,640,400	
ＪＣＲファーマ	8,000	5,810.00	46,480,000	
東和薬品	5,500	8,640.00	47,520,000	
富士製薬工業	7,700	1,852.00	14,260,400	
沢井製薬	22,800	5,870.00	133,836,000	
ゼリア新薬工業	24,300	2,223.00	54,018,900	
第一三共	324,800	4,467.00	1,450,881,600	
キョーリン製薬ホールディングス	31,700	2,550.00	80,835,000	
大幸薬品	6,000	1,877.00	11,262,000	
ダイト	6,600	3,635.00	23,991,000	
大塚ホールディングス	216,200	5,347.00	1,156,021,400	
大正製薬ホールディングス	25,400	12,690.00	322,326,000	
ペプチドリーム	51,900	4,260.00	221,094,000	
大日本塗料	13,600	1,211.00	16,469,600	
日本ペイントホールディングス	91,700	3,680.00	337,456,000	
関西ペイント	124,900	1,792.00	223,820,800	
神東塗料	8,800	206.00	1,812,800	
中国塗料	34,100	1,021.00	34,816,100	
日本特殊塗料	7,500	2,352.00	17,640,000	
藤倉化成	15,000	641.00	9,615,000	
太陽ホールディングス	9,200	4,250.00	39,100,000	
ＤＩＣ	50,300	3,550.00	178,565,000	
サカタインクス	24,200	1,256.00	30,395,200	
東洋インキＳＣホールディングス	23,500	2,707.00	63,614,500	
Ｔ＆Ｋ　ＴＯＫＡ	8,000	1,092.00	8,736,000	
アルプス技研	9,500	2,442.00	23,199,000	
サニックス	17,200	265.00	4,558,000	
ダイオーズ	2,100	1,312.00	2,755,200	
日本空調サービス	11,300	790.00	8,927,000	
オリエンタルランド	128,100	10,765.00	1,378,996,500	
フォーカスシステムズ	6,300	967.00	6,092,100	
ダスキン	29,200	2,634.00	76,912,800	
パーク２４	65,300	3,145.00	205,368,500	
明光ネットワークジャパン	13,700	914.00	12,521,800	
ファルコホールディングス	5,500	1,725.00	9,487,500	
クレスコ	2,500	3,235.00	8,087,500	

フジ・メディア・ホールディングス	115,600	1,962.00	226,807,200	
秀英予備校	2,300	489.00	1,124,700	
田谷	1,900	658.00	1,250,200	
ラウンドワン	33,700	1,418.00	47,786,600	
リゾートトラスト	45,900	1,703.00	78,167,700	
オービック	35,100	10,600.00	372,060,000	
ジャストシステム	18,100	2,472.00	44,743,200	
ＴＤＣソフト	9,700	1,177.00	11,416,900	
ヤフー	803,200	380.00	305,216,000	
ビー・エム・エル	13,900	3,450.00	47,955,000	
ワタベウェディング	1,800	528.00	950,400	
トレンドマイクロ	59,300	6,910.00	409,763,000	
りらいあコミュニケーションズ	17,100	1,375.00	23,512,500	
インフォメーション・ディベロプメント	3,500	1,571.00	5,498,500	
リソー教育	18,300	1,016.00	18,592,800	
日本オラクル	18,000	8,260.00	148,680,000	
早稲田アカデミー	1,600	1,929.00	3,086,400	
アルファシステムズ	3,700	2,807.00	10,385,900	
フューチャー	15,100	1,665.00	25,141,500	
ＣＡＣ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	8,400	1,035.00	8,694,000	
ソフトバンク・テクノロジー	4,700	3,005.00	14,123,500	
トーセ	3,000	995.00	2,985,000	
ユー・エス・エス	132,500	2,016.00	267,120,000	
オービックビジネスコンサルタント	5,600	9,450.00	52,920,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	50,700	2,256.00	114,379,200	
アイティフォー	13,500	960.00	12,960,000	
東京個別指導学院	3,800	1,556.00	5,912,800	
東計電算	1,700	3,170.00	5,389,000	
サイバーエージェント	66,800	5,290.00	353,372,000	
楽天	505,600	821.30	415,249,280	
エックスネット	1,800	1,073.00	1,931,400	
クリーク・アンド・リバー社	5,500	1,137.00	6,253,500	
テー・オー・ダブリュー	10,300	841.00	8,662,300	
大塚商会	60,300	3,875.00	233,662,500	
サイボウズ	13,000	639.00	8,307,000	
ソフトブレーン	8,800	495.00	4,356,000	
セントラルスポーツ	4,100	4,220.00	17,302,000	
パラカ	2,800	2,078.00	5,818,400	
電通国際情報サービス	6,900	3,990.00	27,531,000	
デジタルガレージ	20,100	3,270.00	65,727,000	
イーエムシステムズ	7,700	1,182.00	9,101,400	
ウェザーニューズ	3,800	3,340.00	12,692,000	
ＣＩＪ	8,700	749.00	6,516,300	
東洋ビジネスエンジニアリング	1,100	2,187.00	2,405,700	
日本エンタープライズ	11,500	232.00	2,668,000	
WOWOW	5,400	3,415.00	18,441,000	
スカラ	9,000	1,031.00	9,279,000	
フルキャストホールディングス	10,800	2,350.00	25,380,000	
エン・ジャパン	9,200	5,390.00	49,588,000	

富士フイルムホールディングス	235,800	4,808.00	1,133,726,400	
コニカミノルタ	265,700	1,158.00	307,680,600	
資生堂	225,600	7,583.00	1,710,724,800	
ライオン	158,100	2,167.00	342,602,700	
高砂香料工業	7,100	3,745.00	26,589,500	
マンダム	22,100	3,410.00	75,361,000	
ミルボン	14,000	4,865.00	68,110,000	
ファンケル	27,600	4,810.00	132,756,000	
コーセー	19,200	19,430.00	373,056,000	
コタ	5,500	1,530.00	8,415,000	
シーズ・ホールディングス	13,700	3,685.00	50,484,500	
シーボン	1,400	2,707.00	3,789,800	
ポーラ・オルビスホールディングス	48,500	3,640.00	176,540,000	
ノエビアホールディングス	7,200	5,420.00	39,024,000	
アジュバンコスメジャパン	2,500	967.00	2,417,500	
エステー	8,100	2,003.00	16,224,300	
アグロ　カネショウ	4,600	2,331.00	10,722,600	
コニシ	18,700	1,668.00	31,191,600	
長谷川香料	13,500	2,145.00	28,957,500	
星光ＰＭＣ	7,600	1,010.00	7,676,000	
小林製薬	31,800	7,580.00	241,044,000	
荒川化学工業	10,200	1,726.00	17,605,200	
メック	7,800	1,721.00	13,423,800	
日本高純度化学	3,000	2,345.00	7,035,000	
タカラバイオ	29,700	3,010.00	89,397,000	
ＪＣＵ	13,700	2,569.00	35,195,300	
新田ゼラチン	7,800	804.00	6,271,200	
ＯＡＴアグリオ	1,600	3,225.00	5,160,000	
デクセリアルズ	29,200	1,063.00	31,039,600	
アース製薬	8,600	5,260.00	45,236,000	
北興化学工業	11,600	602.00	6,983,200	
大成ラミック	3,400	3,075.00	10,455,000	
クミアイ化学工業	46,900	773.00	36,253,700	
日本農薬	27,200	669.00	18,196,800	
昭和シェル石油	106,200	2,461.00	261,358,200	
富士興産	4,300	618.00	2,657,400	
ニチレキ	14,500	1,118.00	16,211,000	
ユシロ化学工業	6,300	1,431.00	9,015,300	
ビーピー・カストロール	4,100	1,542.00	6,322,200	
富士石油	27,600	467.00	12,889,200	
ＭＯＲＥＳＣＯ	4,100	1,611.00	6,605,100	
出光興産	95,300	6,000.00	571,800,000	
ＪＸＴＧホールディングス	1,811,500	798.10	1,445,758,150	
コスモエネルギーホールディングス	32,900	4,585.00	150,846,500	
横浜ゴム	65,700	2,266.00	148,876,200	
東洋ゴム工業	58,200	1,862.00	108,368,400	
ブリヂストン	348,900	4,220.00	1,472,358,000	
住友ゴム工業	101,900	1,608.00	163,855,200	
藤倉ゴム工業	9,900	549.00	5,435,100	
オカモト	8,000	5,240.00	41,920,000	

アキレス	8,600	2,248.00	19,332,800	
フコク	5,000	928.00	4,640,000	
ニッタ	11,700	4,050.00	47,385,000	
クリエートメディック	3,800	1,193.00	4,533,400	
住友理工	22,000	1,047.00	23,034,000	
三ツ星ベルト	13,600	2,919.00	39,698,400	
バンドー化学	21,600	1,242.00	26,827,200	
ＡＧＣ	114,500	4,440.00	508,380,000	
日本板硝子	57,400	1,196.00	68,650,400	
石塚硝子	1,600	2,397.00	3,835,200	
有沢製作所	19,100	925.00	17,667,500	
日本山村硝子	4,700	1,773.00	8,333,100	
日本電気硝子	49,100	3,440.00	168,904,000	
オハラ	4,500	2,793.00	12,568,500	
住友大阪セメント	21,500	4,580.00	98,470,000	
太平洋セメント	71,700	3,380.00	242,346,000	
リソルホールディングス	1,200	4,300.00	5,160,000	
日本ヒューム	11,400	946.00	10,784,400	
日本コンクリート工業	24,400	324.00	7,905,600	
三谷セキサン	5,900	2,712.00	16,000,800	
アジアパイルホールディングス	14,600	713.00	10,409,800	
東海カーボン	103,100	2,093.00	215,788,300	
日本カーボン	5,500	7,870.00	43,285,000	
東洋炭素	6,600	3,200.00	21,120,000	
ノリタケカンパニーリミテド	6,200	6,230.00	38,626,000	
ＴＯＴＯ	87,300	4,580.00	399,834,000	
日本碍子	138,500	1,686.00	233,511,000	
日本特殊陶業	95,700	2,966.00	283,846,200	
ダントーホールディングス	8,800	130.00	1,144,000	
ＭＡＲＵＷＡ	3,900	6,420.00	25,038,000	
品川リフラクトリーズ	3,000	4,800.00	14,400,000	
黒崎播磨	2,200	8,210.00	18,062,000	
ヨータイ	9,100	842.00	7,662,200	
イソライト工業	5,800	531.00	3,079,800	
東京窯業	14,400	464.00	6,681,600	
ニッカトー	5,200	1,113.00	5,787,600	
フジミインコーポレーテッド	10,100	2,722.00	27,492,200	
クニミネ工業	3,000	1,001.00	3,003,000	
エーアンドエーマテリアル	2,400	1,127.00	2,704,800	
ニチアス	31,200	2,716.00	84,739,200	
新日鐵住金	502,400	2,228.00	1,119,347,200	
神戸製鋼所	205,400	1,001.00	205,605,400	
中山製鋼所	15,600	661.00	10,311,600	
合同製鐵	6,000	2,083.00	12,498,000	
ジェイ　エフ　イー　ホールディングス	303,200	2,469.50	748,752,400	
日新製鋼	31,000	1,575.00	48,825,000	
東京製鐵	60,100	804.00	48,320,400	
共英製鋼	12,700	2,080.00	26,416,000	
大和工業	23,900	3,190.00	76,241,000	

東京鐵鋼	4,600	1,698.00	7,810,800	
大阪製鐵	7,500	2,060.00	15,450,000	
淀川製鋼所	16,500	2,549.00	42,058,500	
丸一鋼管	39,700	3,410.00	135,377,000	
モリ工業	3,600	2,670.00	9,612,000	
大同特殊鋼	19,900	4,985.00	99,201,500	
日本高周波鋼業	4,200	746.00	3,133,200	
日本冶金工業	92,900	305.00	28,334,500	
山陽特殊製鋼	12,900	2,638.00	34,030,200	
愛知製鋼	6,300	4,045.00	25,483,500	
日立金属	120,900	1,303.00	157,532,700	
日本金属	2,800	1,513.00	4,236,400	
大平洋金属	6,900	3,960.00	27,324,000	
新日本電工	67,200	279.00	18,748,800	
栗本鐵工所	5,600	1,754.00	9,822,400	
虹　技	1,700	1,765.00	3,000,500	
日本鋳鉄管	1,200	1,501.00	1,801,200	
日本製鋼所	36,600	2,544.00	93,110,400	
三菱製鋼	8,300	2,028.00	16,832,400	
日亜鋼業	16,400	328.00	5,379,200	
日本精線	1,800	3,920.00	7,056,000	
エンビプロ・ホールディングス	2,300	723.00	1,662,900	
大紀アルミニウム工業所	18,500	704.00	13,024,000	
日本軽金属ホールディングス	327,700	235.00	77,009,500	
三井金属鉱業	30,300	3,180.00	96,354,000	
東邦亜鉛	6,200	4,165.00	25,823,000	
三菱マテリアル	74,200	3,240.00	240,408,000	
住友金属鉱山	143,500	3,753.00	538,555,500	
ＤＯＷＡホールディングス	28,400	3,355.00	95,282,000	
古河機械金属	18,500	1,526.00	28,231,000	
エス・サイエンス	53,200	73.00	3,883,600	
大阪チタニウムテクノロジーズ	11,700	1,944.00	22,744,800	
東邦チタニウム	20,100	1,356.00	27,255,600	
ＵＡＣＪ	17,000	2,586.00	43,962,000	
ＣＫサンエツ	2,100	3,145.00	6,604,500	
古河電気工業	37,400	3,355.00	125,477,000	
住友電気工業	419,700	1,567.00	657,669,900	
フジクラ	135,500	503.00	68,156,500	
昭和電線ホールディングス	14,100	749.00	10,560,900	
東京特殊電線	1,500	2,064.00	3,096,000	
タツタ電線	22,300	573.00	12,777,900	
カナレ電気	1,800	2,070.00	3,726,000	
平河ヒューテック	5,500	1,668.00	9,174,000	
リョービ	13,800	3,740.00	51,612,000	
アーレスティ	13,700	799.00	10,946,300	
アサヒホールディングス	19,200	1,988.00	38,169,600	
東洋製罐グループホールディングス	71,500	2,307.00	164,950,500	
ホッカンホールディングス	5,600	2,079.00	11,642,400	
コロナ	6,200	1,189.00	7,371,800	
横河ブリッジホールディングス	20,800	2,101.00	43,700,800	

ＯＳＪＢホールディングス	56,100	294.00	16,493,400	
駒井ハルテック	2,400	2,266.00	5,438,400	
高田機工	1,100	2,764.00	3,040,400	
三和ホールディングス	107,700	1,298.00	139,794,600	
文化シヤッター	33,100	826.00	27,340,600	
三協立山	15,600	1,406.00	21,933,600	
アルインコ	8,100	1,013.00	8,205,300	
東洋シヤッター	2,800	640.00	1,792,000	
ＬＩＸＩＬグループ	165,500	2,061.00	341,095,500	
日本フイルコン	8,600	589.00	5,065,400	
ノーリツ	25,100	1,647.00	41,339,700	
長府製作所	11,400	2,410.00	27,474,000	
リンナイ	20,100	8,220.00	165,222,000	
ユニプレス	21,900	2,188.00	47,917,200	
ダイニチ工業	6,000	754.00	4,524,000	
日東精工	15,500	659.00	10,214,500	
三洋工業	1,400	2,101.00	2,941,400	
岡部	22,800	1,022.00	23,301,600	
ジーテクト	12,400	1,658.00	20,559,200	
中国工業	1,700	613.00	1,042,100	
東プレ	20,900	2,542.00	53,127,800	
高周波熱錬	21,600	1,055.00	22,788,000	
東京製綱	8,000	1,351.00	10,808,000	
サンコール	6,300	803.00	5,058,900	
モリテックスチール	8,800	526.00	4,628,800	
パイオラックス	16,600	2,542.00	42,197,200	
エイチワン	11,000	1,300.00	14,300,000	
日本発条	111,900	1,098.00	122,866,200	
中央発條	1,300	3,645.00	4,738,500	
アドバネクス	1,800	1,892.00	3,405,600	
三浦工業	48,600	3,280.00	159,408,000	
タクマ	38,100	1,453.00	55,359,300	
テクノプロ・ホールディングス	20,400	6,540.00	133,416,000	
アトラ	2,100	676.00	1,419,600	
インターワークス	2,400	899.00	2,157,600	
ＫｅｅＰｅｒ技研	3,500	1,114.00	3,899,000	
ファーストロジック	2,000	939.00	1,878,000	
三機サービス	1,700	2,363.00	4,017,100	
Ｇｕｎｏｓｙ	6,600	2,081.00	13,734,600	
デザインワン・ジャパン	2,100	677.00	1,421,700	
イー・ガーディアン	5,200	2,631.00	13,681,200	
リブセンス	5,900	345.00	2,035,500	
ジャパンマテリアル	29,600	1,441.00	42,653,600	
ベクトル	13,000	2,215.00	28,795,000	
ウチヤマホールディングス	5,400	495.00	2,673,000	
ライクキッズネクスト	2,200	1,235.00	2,717,000	
キャリアリンク	3,600	478.00	1,720,800	
ＩＢＪ	7,300	769.00	5,613,700	
アサンテ	3,900	2,284.00	8,907,600	
Ｎ・フィールド	7,000	1,767.00	12,369,000	

バリューＨＲ	2,200	2,191.00	4,820,200	
M&Aキャピタルパートナーズ	2,700	6,200.00	16,740,000	
ライドオンエクスプレスホールディングス	4,500	1,453.00	6,538,500	
ＥＲＩホールディングス	3,000	1,035.00	3,105,000	
アビスト	1,700	3,920.00	6,664,000	
シグマクシス	5,700	1,151.00	6,560,700	
ウィルグループ	4,700	1,000.00	4,700,000	
エスクロー・エージェント・ジャパン	14,900	482.00	7,181,800	
日本ビューホテル	3,400	1,392.00	4,732,800	
リクルートホールディングス	836,800	3,469.00	2,902,859,200	
エラン	3,700	3,180.00	11,766,000	
ツガミ	30,200	1,013.00	30,592,600	
オークマ	13,000	6,160.00	80,080,000	
東芝機械	12,700	2,248.00	28,549,600	
アマダホールディングス	173,300	1,097.00	190,110,100	
アイダエンジニアリング	28,500	955.00	27,217,500	
滝澤鉄工所	3,500	1,661.00	5,813,500	
ＦＵＪＩ	33,600	1,663.00	55,876,800	
牧野フライス製作所	11,500	4,505.00	51,807,500	
オーエスジー	55,200	2,316.00	127,843,200	
ダイジェット工業	1,400	1,872.00	2,620,800	
旭ダイヤモンド工業	33,400	751.00	25,083,400	
DMG森精機	71,000	1,728.00	122,688,000	
ソディック	24,500	882.00	21,609,000	
ディスコ	15,200	17,500.00	266,000,000	
日東工器	6,900	2,617.00	18,057,300	
日進工具	3,000	2,957.00	8,871,000	
パンチ工業	9,300	696.00	6,472,800	
冨士ダイス	5,600	835.00	4,676,000	
土木管理総合試験所	4,700	603.00	2,834,100	
日本郵政	615,500	1,339.00	824,154,500	
ベルシステム２４ホールディングス	18,200	1,696.00	30,867,200	
鎌倉新書	7,900	1,353.00	10,688,700	
一蔵	1,400	809.00	1,132,600	
ＬＩＴＡＬＩＣＯ	2,400	2,119.00	5,085,600	
グローバルグループ	1,300	1,732.00	2,251,600	
エボラブルアジア	3,100	2,430.00	7,533,000	
アトラエ	2,000	2,278.00	4,556,000	
ストライク	2,700	3,435.00	9,274,500	
ソラスト	19,800	1,350.00	26,730,000	
セラク	2,400	703.00	1,687,200	
インソース	3,600	2,282.00	8,215,200	
豊田自動織機	91,900	5,910.00	543,129,000	
豊和工業	6,200	869.00	5,387,800	
ＯＫＫ	4,300	1,106.00	4,755,800	
石川製作所	2,900	1,457.00	4,225,300	
東洋機械金属	8,800	699.00	6,151,200	
津田駒工業	2,400	2,224.00	5,337,600	
エンシュウ	2,900	1,469.00	4,260,100	

島精機製作所	14,200	4,590.00	65,178,000	
オプトラン	10,900	2,630.00	28,667,000	
ＮＣホールディングス	3,500	658.00	2,303,000	
フリュー	8,000	922.00	7,376,000	
ヤマシンフィルタ	17,000	765.00	13,005,000	
日阪製作所	16,200	1,096.00	17,755,200	
やまびこ	21,800	1,309.00	28,536,200	
平田機工	4,200	7,870.00	33,054,000	
ペガサスミシン製造	10,500	955.00	10,027,500	
ナブテスコ	61,700	2,730.00	168,441,000	
三井海洋開発	12,000	3,680.00	44,160,000	
レオン自動機	10,000	2,091.00	20,910,000	
ＳＭＣ	35,600	33,500.00	1,192,600,000	
新川	9,200	549.00	5,050,800	
ホソカワミクロン	4,000	5,830.00	23,320,000	
ユニオンツール	4,900	3,965.00	19,428,500	
オイレス工業	14,500	2,290.00	33,205,000	
日精エー・エス・ビー機械	3,200	3,970.00	12,704,000	
サトーホールディングス	14,800	3,530.00	52,244,000	
技研製作所	7,700	3,425.00	26,372,500	
日本エアーテック	3,500	741.00	2,593,500	
カワタ	2,200	2,224.00	4,892,800	
日精樹脂工業	9,400	1,107.00	10,405,800	
オカダアイヨン	3,800	1,688.00	6,414,400	
ワイエイシイホールディングス	3,800	782.00	2,971,600	
小松製作所	548,000	3,283.00	1,799,084,000	
住友重機械工業	64,900	3,775.00	244,997,500	
日立建機	53,100	3,615.00	191,956,500	
日工	3,100	2,503.00	7,759,300	
巴工業	4,900	2,272.00	11,132,800	
井関農機	11,300	1,984.00	22,419,200	
ＴＯＷＡ	8,900	973.00	8,659,700	
丸山製作所	2,400	1,698.00	4,075,200	
北川鉄工所	5,500	2,841.00	15,625,500	
シンニッタン	17,400	422.00	7,342,800	
ローツェ	5,500	1,938.00	10,659,000	
タカキタ	4,000	700.00	2,800,000	
クボタ	608,900	1,867.00	1,136,816,300	
荏原実業	3,300	2,012.00	6,639,600	
東洋エンジニアリング	15,000	835.00	12,525,000	
三菱化工機	3,900	1,797.00	7,008,300	
月島機械	22,500	1,384.00	31,140,000	
帝国電機製作所	7,900	1,558.00	12,308,200	
東京機械製作所	4,400	404.00	1,777,600	
新東工業	27,000	1,043.00	28,161,000	
澁谷工業	9,900	3,855.00	38,164,500	
アイチコーポレーション	19,600	613.00	12,014,800	
小森コーポレーション	28,500	1,301.00	37,078,500	
鶴見製作所	9,500	1,749.00	16,615,500	
住友精密工業	1,800	3,745.00	6,741,000	

酒井重工業	2,100	3,600.00	7,560,000	
荏原製作所	50,300	3,540.00	178,062,000	
石井鐵工所	1,800	1,829.00	3,292,200	
酉島製作所	11,600	987.00	11,449,200	
北越工業	12,800	1,215.00	15,552,000	
千代田化工建設	82,600	812.00	67,071,200	
ダイキン工業	155,000	14,180.00	2,197,900,000	
オルガノ	4,100	2,971.00	12,181,100	
トーヨーカネツ	4,600	2,695.00	12,397,000	
栗田工業	61,400	2,880.00	176,832,000	
椿本チエイン	13,400	4,715.00	63,181,000	
大同工業	4,900	1,108.00	5,429,200	
日機装	36,600	1,441.00	52,740,600	
木村化工機	9,400	406.00	3,816,400	
新興プランテック	24,500	1,053.00	25,798,500	
アネスト岩田	19,100	1,025.00	19,577,500	
ダイフク	57,700	5,180.00	298,886,000	
サムコ	3,100	1,291.00	4,002,100	
加藤製作所	5,400	3,485.00	18,819,000	
油研工業	2,200	2,184.00	4,804,800	
タダノ	54,700	1,277.00	69,851,900	
フジテック	35,000	1,369.00	47,915,000	
ＣＫＤ	31,500	1,308.00	41,202,000	
キトー	8,600	1,877.00	16,142,200	
平和	35,100	2,464.00	86,486,400	
理想科学工業	11,300	2,493.00	28,170,900	
ＳＡＮＫＹＯ	28,400	4,245.00	120,558,000	
日本金銭機械	10,400	1,189.00	12,365,600	
マースグループホールディングス	7,200	2,262.00	16,286,400	
福島工業	7,000	5,460.00	38,220,000	
オーイズミ	4,700	490.00	2,303,000	
ダイコク電機	5,200	1,669.00	8,678,800	
竹内製作所	19,000	2,479.00	47,101,000	
アマノ	35,100	2,260.00	79,326,000	
ＪＵＫＩ	15,800	1,309.00	20,682,200	
サンデンホールディングス	13,800	1,416.00	19,540,800	
蛇の目ミシン工業	10,300	645.00	6,643,500	
ブラザー工業	138,600	2,142.00	296,881,200	
マックス	17,400	1,530.00	26,622,000	
モリタホールディングス	18,200	2,329.00	42,387,800	
グローリー	33,900	2,702.00	91,597,800	
新晃工業	11,500	1,680.00	19,320,000	
大和冷機工業	16,400	1,151.00	18,876,400	
セガサミーホールディングス	112,500	1,525.00	171,562,500	
日本ピストンリング	4,100	2,219.00	9,097,900	
リケン	5,300	5,760.00	30,528,000	
ＴＰＲ	12,800	2,828.00	36,198,400	
ツバキ・ナカシマ	17,100	2,189.00	37,431,900	
ホシザキ	33,200	11,250.00	373,500,000	
大豊工業	9,200	1,180.00	10,856,000	

日本精工	233,200	1,214.00	283,104,800	
ＮＴＮ	262,700	443.00	116,376,100	
ジェイテクト	121,000	1,605.00	194,205,000	
不二越	10,500	4,995.00	52,447,500	
ミネベアミツミ	210,700	1,832.00	386,002,400	
日本トムソン	36,200	669.00	24,217,800	
ＴＨＫ	70,800	2,579.00	182,593,200	
ユーシン精機	10,000	1,126.00	11,260,000	
前澤給装工業	4,500	1,866.00	8,397,000	
イーグル工業	14,000	1,355.00	18,970,000	
前澤工業	8,300	437.00	3,627,100	
日本ピラー工業	11,500	1,472.00	16,928,000	
キッツ	46,000	893.00	41,078,000	
日立製作所	545,000	3,502.00	1,908,590,000	
三菱電機	1,135,100	1,429.50	1,622,625,450	
富士電機	68,300	4,150.00	283,445,000	
東洋電機製造	4,500	1,638.00	7,371,000	
安川電機	131,600	3,190.00	419,804,000	
シンフォニア　テクノロジー	14,600	1,509.00	22,031,400	
明電舎	19,300	1,720.00	33,196,000	
オリジン電気	3,300	1,658.00	5,471,400	
山洋電気	5,500	4,720.00	25,960,000	
デンヨー	10,500	1,737.00	18,238,500	
アイモバイル	2,200	727.00	1,599,400	
キャリアインデックス	2,900	1,623.00	4,706,700	
ＭＳ－Ｊａｐａｎ	4,300	1,973.00	8,483,900	
船場	1,800	1,051.00	1,891,800	
グレイステクノロジー	2,500	3,185.00	7,962,500	
フルテック	1,200	1,125.00	1,350,000	
グリーンズ	2,300	1,400.00	3,220,000	
ツナグ・ソリューションズ	1,000	902.00	902,000	
日総工産	3,500	2,709.00	9,481,500	
キュービーネットホールディングス	5,500	2,101.00	11,555,500	
三櫻工業	14,400	707.00	10,180,800	
マキタ	148,000	5,130.00	759,240,000	
東芝テック	16,200	3,325.00	53,865,000	
芝浦メカトロニクス	1,700	3,485.00	5,924,500	
マブチモーター	31,400	3,930.00	123,402,000	
日本電産	136,600	14,730.00	2,012,118,000	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	4,800	2,129.00	10,219,200	
トレックス・セミコンダクター	3,200	1,625.00	5,200,000	
東光高岳	5,700	1,662.00	9,473,400	
ダブル・スコープ	16,600	956.00	15,869,600	
宮越ホールディングス	4,200	917.00	3,851,400	
ダイヘン	12,500	2,564.00	32,050,000	
田淵電機	15,700	185.00	2,904,500	
ヤーマン	16,500	2,033.00	33,544,500	
ＪＶＣケンウッド	93,400	295.00	27,553,000	
ミマキエンジニアリング	10,100	1,168.00	11,796,800	
第一精工	4,700	1,467.00	6,894,900	

日新電機	26,600	890.00	23,674,000	
大崎電気工業	24,300	818.00	19,877,400	
オムロン	120,600	4,515.00	544,509,000	
日東工業	18,200	1,900.00	34,580,000	
ＩＤＥＣ	14,000	2,169.00	30,366,000	
不二電機工業	1,300	1,363.00	1,771,900	
ジーエス・ユアサ　コーポレーション	40,900	2,474.00	101,186,600	
サクサホールディングス	2,800	2,060.00	5,768,000	
メルコホールディングス	5,500	4,035.00	22,192,500	
テクノメディカ	2,600	2,035.00	5,291,000	
日本電気	146,900	3,030.00	445,107,000	
富士通	116,700	7,340.00	856,578,000	
沖電気工業	46,100	1,405.00	64,770,500	
岩崎通信機	5,000	779.00	3,895,000	
電気興業	6,400	3,010.00	19,264,000	
サンケン電気	13,200	2,498.00	32,973,600	
ナカヨ	2,100	1,565.00	3,286,500	
アイホン	6,400	1,597.00	10,220,800	
ルネサスエレクトロニクス	117,500	671.00	78,842,500	
セイコーエプソン	169,000	1,860.00	314,340,000	
ワコム	88,000	421.00	37,048,000	
アルバック	26,100	3,865.00	100,876,500	
アクセル	4,800	625.00	3,000,000	
ＥＩＺＯ	10,400	4,675.00	48,620,000	
ジャパンディスプレイ	233,100	109.00	25,407,900	
日本信号	31,300	1,066.00	33,365,800	
京三製作所	26,600	549.00	14,603,400	
能美防災	15,000	2,422.00	36,330,000	
ホーチキ	8,200	1,534.00	12,578,800	
星和電機	3,900	447.00	1,743,300	
エレコム	10,000	2,700.00	27,000,000	
パナソニック	1,296,700	1,249.50	1,620,226,650	
シャープ	112,500	2,026.00	227,925,000	
アンリツ	82,800	1,800.00	149,040,000	
富士通ゼネラル	34,700	1,795.00	62,286,500	
ソニー	760,600	6,258.00	4,759,834,800	
ＴＤＫ	59,400	10,690.00	634,986,000	
帝国通信工業	5,000	1,247.00	6,235,000	
タムラ製作所	43,800	634.00	27,769,200	
アルプス電気	97,700	2,793.00	272,876,100	
池上通信機	3,600	1,259.00	4,532,400	
パイオニア	189,300	113.00	21,390,900	
日本電波工業	10,200	504.00	5,140,800	
鈴木	5,500	742.00	4,081,000	
日本トリム	2,400	5,450.00	13,080,000	
ローランド　ディー．ジー．	5,700	2,588.00	14,751,600	
フォスター電機	13,200	1,396.00	18,427,200	
クラリオン	11,900	1,812.00	21,562,800	
ＳＭＫ	2,900	2,763.00	8,012,700	
ヨコオ	7,300	1,356.00	9,898,800	

ティアック	8,300	277.00	2,299,100	
ホシデン	28,600	1,003.00	28,685,800	
ヒロセ電機	18,500	10,830.00	200,355,000	
日本航空電子工業	29,200	1,831.00	53,465,200	
ＴＯＡ	12,200	1,188.00	14,493,600	
マクセルホールディングス	22,600	1,589.00	35,911,400	
古野電気	13,500	1,314.00	17,739,000	
ユニデンホールディングス	3,100	2,543.00	7,883,300	
アルパイン	27,100	2,056.00	55,717,600	
スミダコーポレーション	9,600	1,285.00	12,336,000	
アイコム	6,200	2,413.00	14,960,600	
リオン	4,800	2,491.00	11,956,800	
本多通信工業	8,900	751.00	6,683,900	
船井電機	11,500	643.00	7,394,500	
横河電機	113,600	2,350.00	266,960,000	
新電元工業	4,000	5,100.00	20,400,000	
アズビル	68,000	2,272.00	154,496,000	
東亜ディーケーケー	5,600	1,298.00	7,268,800	
日本光電工業	46,900	3,535.00	165,791,500	
チノー	3,900	1,497.00	5,838,300	
共和電業	11,900	416.00	4,950,400	
日本電子材料	4,500	793.00	3,568,500	
堀場製作所	22,500	5,390.00	121,275,000	
アドバンテスト	63,300	2,173.00	137,550,900	
小野測器	5,300	837.00	4,436,100	
エスペック	10,000	1,850.00	18,500,000	
キーエンス	55,700	58,200.00	3,241,740,000	
日置電機	5,900	3,255.00	19,204,500	
シスメックス	88,400	8,640.00	763,776,000	
日本マイクロニクス	18,300	703.00	12,864,900	
メガチップス	9,000	2,075.00	18,675,000	
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	6,600	5,070.00	33,462,000	
ＩＭＡＧＩＣＡ　ＧＲＯＵＰ	9,400	599.00	5,630,600	
澤藤電機	1,200	2,115.00	2,538,000	
デンソー	251,900	5,274.00	1,328,520,600	
コーセル	15,800	1,133.00	17,901,400	
イリソ電子工業	9,500	5,780.00	54,910,000	
オプテックスグループ	20,000	2,176.00	43,520,000	
千代田インテグレ	4,800	2,298.00	11,030,400	
アイ・オー・データ機器	4,700	1,301.00	6,114,700	
レーザーテック	23,300	3,275.00	76,307,500	
スタンレー電気	86,600	3,840.00	332,544,000	
岩崎電気	4,400	1,519.00	6,683,600	
ウシオ電機	68,900	1,380.00	95,082,000	
岡谷電機産業	8,100	486.00	3,936,600	
ヘリオス　テクノ　ホールディング	9,600	823.00	7,900,800	
日本セラミック	11,500	2,854.00	32,821,000	
遠藤照明	5,700	802.00	4,571,400	
古河電池	8,100	850.00	6,885,000	
双信電機	5,000	468.00	2,340,000	

山一電機	8,200	1,401.00	11,488,200	
図研	7,400	1,711.00	12,661,400	
日本電子	20,400	2,174.00	44,349,600	
カシオ計算機	91,300	1,743.00	159,135,900	
ファナック	107,900	19,450.00	2,098,655,000	
日本シイエムケイ	20,000	764.00	15,280,000	
エンプラス	5,200	3,155.00	16,406,000	
大真空	4,200	1,215.00	5,103,000	
ローム	50,900	7,420.00	377,678,000	
浜松ホトニクス	81,400	4,160.00	338,624,000	
三井ハイテック	15,000	1,280.00	19,200,000	
新光電気工業	42,800	860.00	36,808,000	
京セラ	186,300	6,365.00	1,185,799,500	
協栄産業	1,400	1,861.00	2,605,400	
太陽誘電	55,100	2,460.00	135,546,000	
村田製作所	119,100	16,495.00	1,964,554,500	
ユーシン	17,000	752.00	12,784,000	
双葉電子工業	18,600	1,845.00	34,317,000	
日東電工	85,800	7,947.00	681,852,600	
北陸電気工業	4,600	1,208.00	5,556,800	
東海理化電機製作所	29,900	2,245.00	67,125,500	
ニチコン	35,700	1,006.00	35,914,200	
日本ケミコン	9,200	2,689.00	24,738,800	
ＫＯＡ	15,700	1,604.00	25,182,800	
三井Ｅ＆Ｓホールディングス	41,000	2,074.00	85,034,000	
日立造船	90,000	440.00	39,600,000	
三菱重工業	190,200	4,293.00	816,528,600	
川崎重工業	88,300	3,120.00	275,496,000	
ＩＨＩ	87,200	4,295.00	374,524,000	
名村造船所	34,100	548.00	18,686,800	
サノヤスホールディングス	13,900	228.00	3,169,200	
スプリックス	3,000	2,800.00	8,400,000	
日本車輌製造	4,100	2,801.00	11,484,100	
三菱ロジスネクスト	13,500	1,339.00	18,076,500	
近畿車輌	1,700	2,408.00	4,093,600	
ＦＰＧ	35,800	1,046.00	37,446,800	
島根銀行	2,300	1,200.00	2,760,000	
じもとホールディングス	75,600	172.00	13,003,200	
全国保証	31,500	4,245.00	133,717,500	
めぶきフィナンシャルグループ	581,700	378.00	219,882,600	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	15,100	2,006.00	30,290,600	
九州フィナンシャルグループ	183,800	522.00	95,943,600	
かんぽ生命保険	42,300	2,675.00	113,152,500	
ゆうちょ銀行	317,200	1,319.00	418,386,800	
富山第一銀行	28,400	444.00	12,609,600	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	668,500	544.00	363,664,000	
ジェイリース	2,000	649.00	1,298,000	
西日本フィナンシャルホールディングス	71,800	1,243.00	89,247,400	

マーキュリアインベストメント	4,300	916.00	3,938,800	
イントラスト	2,300	551.00	1,267,300	
アルヒ	12,800	1,971.00	25,228,800	
日産自動車	1,338,600	1,007.00	1,347,970,200	
いすゞ自動車	328,900	1,600.50	526,404,450	
トヨタ自動車	1,379,900	6,608.00	9,118,379,200	＊
日野自動車	162,000	1,147.00	185,814,000	
三菱自動車工業	420,100	726.00	304,992,600	
エフテック	7,200	1,200.00	8,640,000	
レシップホールディングス	4,100	798.00	3,271,800	
ＧＭＢ	1,800	1,278.00	2,300,400	
ファルテック	1,900	1,022.00	1,941,800	
武蔵精密工業	24,100	1,666.00	40,150,600	
日産車体	44,300	923.00	40,888,900	
新明和工業	49,400	1,450.00	71,630,000	
極東開発工業	21,100	1,738.00	36,671,800	
日信工業	23,100	1,733.00	40,032,300	
トピー工業	9,300	3,160.00	29,388,000	
ティラド	4,100	2,947.00	12,082,700	
曙ブレーキ工業	52,800	237.00	12,513,600	
タチエス	19,300	1,631.00	31,478,300	
ＮＯＫ	61,000	1,733.00	105,713,000	
フタバ産業	34,800	722.00	25,125,600	
ＫＹＢ	11,800	4,505.00	53,159,000	
市光工業	16,900	855.00	14,449,500	
大同メタル工業	14,600	903.00	13,183,800	
プレス工業	60,300	542.00	32,682,600	
ミクニ	14,400	705.00	10,152,000	
太平洋工業	23,800	1,828.00	43,506,400	
ケーヒン	26,100	2,263.00	59,064,300	
河西工業	13,900	1,078.00	14,984,200	
アイシン精機	93,500	4,900.00	458,150,000	
マツダ	356,200	1,286.50	458,251,300	
今仙電機製作所	10,500	1,074.00	11,277,000	
本田技研工業	1,021,400	3,092.00	3,158,168,800	
スズキ	225,000	5,903.00	1,328,175,000	
ＳＵＢＡＲＵ	352,400	3,266.00	1,150,938,400	
安永	5,500	1,846.00	10,153,000	
ヤマハ発動機	160,300	2,852.00	457,175,600	
ショーワ	29,500	1,534.00	45,253,000	
小糸製作所	68,000	6,420.00	436,560,000	
ＴＢＫ	13,400	477.00	6,391,800	
エクセディ	13,700	3,405.00	46,648,500	
ミツバ	20,800	936.00	19,468,800	
豊田合成	41,300	2,539.00	104,860,700	
愛三工業	20,000	873.00	17,460,000	
盟和産業	1,700	1,218.00	2,070,600	
日本プラスト	6,100	937.00	5,715,700	
ヨロズ	11,500	1,618.00	18,607,000	
エフ・シー・シー	18,600	2,950.00	54,870,000	

新家工業	2,500	1,881.00	4,702,500	
シマノ	45,800	15,970.00	731,426,000	
テイ・エス　テック	26,400	3,410.00	90,024,000	
関西みらいフィナンシャルグループ	49,000	989.00	48,461,000	
三十三フィナンシャルグループ	9,400	2,177.00	20,463,800	
第四北越フィナンシャルグループ	19,350	4,375.00	84,656,250	
ジャムコ	5,600	3,020.00	16,912,000	
小野建	9,900	1,685.00	16,681,500	
はるやまホールディングス	5,300	922.00	4,886,600	
ノジマ	19,800	2,288.00	45,302,400	
佐鳥電機	8,200	1,077.00	8,831,400	
カッパ・クリエイト	13,900	1,339.00	18,612,100	
エコートレーディング	2,400	645.00	1,548,000	
伯東	6,800	1,523.00	10,356,400	
コンドーテック	8,700	1,053.00	9,161,100	
中山福	6,200	679.00	4,209,800	
ライトオン	9,400	950.00	8,930,000	
ナガイレーベン	16,200	2,513.00	40,710,600	
ジーンズメイト	3,400	616.00	2,094,400	
三菱食品	12,300	2,886.00	35,497,800	
良品計画	14,800	32,700.00	483,960,000	
三城ホールディングス	13,800	479.00	6,610,200	
松田産業	8,200	1,467.00	12,029,400	
第一興商	16,600	5,190.00	86,154,000	
メディパルホールディングス	112,100	2,323.00	260,408,300	
アドヴァン	11,400	1,055.00	12,027,000	
ＳＰＫ	2,300	2,379.00	5,471,700	
萩原電気ホールディングス	4,100	3,010.00	12,341,000	
アルビス	3,600	3,030.00	10,908,000	
アズワン	8,800	8,030.00	70,664,000	
スズデン	3,900	1,336.00	5,210,400	
尾家産業	3,200	1,433.00	4,585,600	
シモジマ	6,800	1,000.00	6,800,000	
ドウシシャ	11,900	2,358.00	28,060,200	
小津産業	2,400	1,971.00	4,730,400	
コナカ	14,200	495.00	7,029,000	
高速	6,600	1,161.00	7,662,600	
ハウス　オブ　ローゼ	1,400	1,785.00	2,499,000	
Ｇ－７ホールディングス	3,300	2,691.00	8,880,300	
たけびし	3,900	1,580.00	6,162,000	
イオン北海道	11,200	806.00	9,027,200	
コジマ	16,500	529.00	8,728,500	
ヒマラヤ	3,500	1,007.00	3,524,500	
コーナン商事	15,900	2,701.00	42,945,900	
ネットワンシステムズ	45,500	2,419.00	110,064,500	
エコス	4,500	1,871.00	8,419,500	
ワタミ	13,200	1,300.00	17,160,000	
マルシェ	2,900	801.00	2,322,900	
リックス	2,500	1,585.00	3,962,500	
システムソフト	26,600	115.00	3,059,000	

ドンキホーテホールディングス	72,400	6,880.00	498,112,000	
丸文	9,800	781.00	7,653,800	
西松屋チェーン	24,500	1,048.00	25,676,000	
ゼンショーホールディングス	58,000	2,073.00	120,234,000	
ハピネット	7,600	1,732.00	13,163,200	
幸楽苑ホールディングス	7,100	1,616.00	11,473,600	
ハークスレイ	2,600	1,028.00	2,672,800	
橋本総業ホールディングス	2,200	1,482.00	3,260,400	
日本ライフライン	31,800	2,166.00	68,878,800	
サイゼリヤ	18,400	2,045.00	37,628,000	
タカショー	5,000	471.00	2,355,000	
エクセル	4,500	1,792.00	8,064,000	
ＶＴホールディングス	37,900	470.00	17,813,000	
マルカキカイ	3,600	2,247.00	8,089,200	
アルゴグラフィックス	5,200	4,780.00	24,856,000	
魚力	3,100	1,461.00	4,529,100	
ＩＤＯＭ	33,900	330.00	11,187,000	
日本エム・ディ・エム	7,500	1,478.00	11,085,000	
ポプラ	2,900	630.00	1,827,000	
フジ・コーポレーション	2,200	2,288.00	5,033,600	
ユナイテッドアローズ	13,800	4,590.00	63,342,000	
進和	6,600	2,035.00	13,431,000	
エスケイジャパン	2,700	615.00	1,660,500	
ダイトロン	5,100	1,988.00	10,138,800	
ハイデイ日高	14,700	2,238.00	32,898,600	
シークス	14,200	1,679.00	23,841,800	
京都きもの友禅	7,000	506.00	3,542,000	
コロワイド	37,200	2,780.00	103,416,000	
ピーシーデポコーポレーション	16,600	567.00	9,412,200	
田中商事	3,400	657.00	2,233,800	
オーハシテクニカ	6,300	1,491.00	9,393,300	
壱番屋	7,900	4,525.00	35,747,500	
白銅	4,000	1,870.00	7,480,000	
トップカルチャー	4,000	422.00	1,688,000	
ＰＬＡＮＴ	2,500	1,212.00	3,030,000	
スギホールディングス	24,500	5,390.00	132,055,000	
島津製作所	135,600	3,225.00	437,310,000	
ＪＭＳ	10,400	603.00	6,271,200	
クボテック	2,400	379.00	909,600	
長野計器	9,000	1,012.00	9,108,000	
ブイ・テクノロジー	2,600	14,510.00	37,726,000	
スター精密	18,100	1,820.00	32,942,000	
東京計器	7,200	1,070.00	7,704,000	
愛知時計電機	1,500	4,350.00	6,525,000	
インターアクション	6,000	1,673.00	10,038,000	
オーバル	11,200	286.00	3,203,200	
東京精密	20,500	2,892.00	59,286,000	
マニー	13,800	5,340.00	73,692,000	
ニコン	197,800	1,979.00	391,446,200	
トプコン	60,900	1,938.00	118,024,200	

オリンパス	169,100	4,230.00	715,293,000	
理研計器	10,800	2,229.00	24,073,200	
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	21,500	6,410.00	137,815,000	
キヤノン電子	10,400	2,203.00	22,911,200	
タムロン	10,000	2,201.00	22,010,000	
ＨＯＹＡ	228,500	6,179.00	1,411,901,500	
シード	4,800	1,831.00	8,788,800	
ノーリツ鋼機	11,500	2,790.00	32,085,000	
エー・アンド・デイ	10,300	892.00	9,187,600	
キヤノン	611,000	3,496.00	2,136,056,000	
リコー	341,200	1,200.00	409,440,000	
シチズン時計	135,500	685.00	92,817,500	
リズム時計工業	3,800	2,014.00	7,653,200	
大研医器	10,100	827.00	8,352,700	
メニコン	15,600	2,589.00	40,388,400	
シンシア	1,700	628.00	1,067,600	
中本パックス	2,900	1,793.00	5,199,700	
スノーピーク	4,000	1,675.00	6,700,000	
パラマウントベッドホールディングス	12,000	5,120.00	61,440,000	
トランザクション	6,100	722.00	4,404,200	
ＳＨＯ‐ＢＩ	3,300	387.00	1,277,100	
ニホンフラッシュ	5,300	2,028.00	10,748,400	
前田工繊	12,500	2,316.00	28,950,000	
永大産業	14,800	487.00	7,207,600	
アートネイチャー	12,100	707.00	8,554,700	
バンダイナムコホールディングス	117,300	4,090.00	479,757,000	
アイフィスジャパン	2,500	778.00	1,945,000	
共立印刷	18,800	330.00	6,204,000	
ＳＨＯＥＩ	5,500	4,410.00	24,255,000	
フランスベッドホールディングス	13,100	951.00	12,458,100	
マーベラス	18,900	856.00	16,178,400	
パイロットコーポレーション	19,800	6,550.00	129,690,000	
萩原工業	6,300	1,815.00	11,434,500	
エイベックス	20,600	1,547.00	31,868,200	
トッパン・フォームズ	24,300	1,015.00	24,664,500	
フジシールインターナショナル	25,400	3,510.00	89,154,000	
タカラトミー	47,500	1,139.00	54,102,500	
廣済堂	10,500	473.00	4,966,500	
エステールホールディングス	3,300	739.00	2,438,700	
アーク	57,700	106.00	6,116,200	
レック	13,400	2,437.00	32,655,800	
タカノ	5,000	952.00	4,760,000	
三光合成	8,700	404.00	3,514,800	
プロネクサス	9,700	1,130.00	10,961,000	
ホクシン	8,000	167.00	1,336,000	
ウッドワン	3,700	1,252.00	4,632,400	
大建工業	8,900	2,094.00	18,636,600	
きもと	19,300	285.00	5,500,500	
凸版印刷	160,100	1,729.00	276,812,900	
大日本印刷	148,600	2,542.00	377,741,200	

図書印刷	7,600	814.00	6,186,400	
共同印刷	3,500	2,773.00	9,705,500	
ＮＩＳＳＨＡ	23,300	2,007.00	46,763,100	
光村印刷	1,000	2,321.00	2,321,000	
藤森工業	9,500	3,605.00	34,247,500	
ヴィア・ホールディングス	13,600	704.00	9,574,400	
宝印刷	5,900	1,819.00	10,732,100	
前澤化成工業	7,800	1,120.00	8,736,000	
アシックス	112,700	1,594.00	179,643,800	
ツツミ	3,500	2,089.00	7,311,500	
ウェーブロックホールディングス	2,900	910.00	2,639,000	
ＪＳＰ	6,600	2,668.00	17,608,800	
ニチハ	17,100	2,636.00	45,075,600	
エフピコ	9,300	6,160.00	57,288,000	
小松ウオール工業	3,800	2,044.00	7,767,200	
ヤマハ	74,300	5,260.00	390,818,000	
河合楽器製作所	3,800	4,630.00	17,594,000	
クリナップ	10,500	727.00	7,633,500	
ピジョン	68,600	5,960.00	408,856,000	
天馬	8,900	1,850.00	16,465,000	
兼松サステック	900	1,844.00	1,659,600	
キングジム	9,400	939.00	8,826,600	
象印マホービン	21,100	1,371.00	28,928,100	
リンテック	27,000	2,766.00	74,682,000	
信越ポリマー	23,300	838.00	19,525,400	
東リ	28,200	333.00	9,390,600	
イトーキ	20,900	603.00	12,602,700	
任天堂	69,900	40,000.00	2,796,000,000	
三菱鉛筆	18,700	1,872.00	35,006,400	
松風	5,500	1,300.00	7,150,000	
タカラスタンダード	23,500	1,841.00	43,263,500	
コクヨ	54,400	1,885.00	102,544,000	
ナカバヤシ	11,200	618.00	6,921,600	
ニフコ	41,700	2,798.00	116,676,600	
立川ブラインド工業	5,000	1,121.00	5,605,000	
グローブライド	5,100	2,875.00	14,662,500	
オカムラ	39,600	1,431.00	56,667,600	
バルカー	9,200	2,843.00	26,155,600	
ＭＵＴＯＨホールディングス	1,600	2,283.00	3,652,800	
伊藤忠商事	820,400	2,174.00	1,783,549,600	
丸紅	918,700	975.10	895,824,370	
スクロール	17,200	622.00	10,698,400	
高島	1,800	2,033.00	3,659,400	
ヨンドシーホールディングス	11,400	2,334.00	26,607,600	
三陽商会	6,700	2,216.00	14,847,200	
長瀬産業	67,400	1,836.00	123,746,400	
ナイガイ	4,300	507.00	2,180,100	
蝶理	7,100	1,960.00	13,916,000	
豊田通商	124,800	4,155.00	518,544,000	
オンワードホールディングス	68,900	679.00	46,783,100	

三共生興	19,000	464.00	8,816,000	
兼松	47,600	1,594.00	75,874,400	
美津濃	11,200	2,710.00	30,352,000	
ツカモトコーポレーション	2,000	1,203.00	2,406,000	
ユニー・ファミリーマートホールディングス	35,700	12,730.00	454,461,000	
ルックホールディングス	4,100	1,203.00	4,932,300	
三井物産	921,100	1,975.00	1,819,172,500	
日本紙パルプ商事	5,800	4,310.00	24,998,000	
東京エレクトロン	75,600	14,730.00	1,113,588,000	
日立ハイテクノロジーズ	38,800	3,615.00	140,262,000	
カメイ	14,600	1,414.00	20,644,400	
東都水産	1,700	2,338.00	3,974,600	
ＯＵＧホールディングス	1,800	2,735.00	4,923,000	
スターゼン	4,500	4,500.00	20,250,000	
セイコーホールディングス	17,500	2,959.00	51,782,500	
山善	43,600	1,297.00	56,549,200	
椿本興業	2,500	3,215.00	8,037,500	
住友商事	705,100	1,822.00	1,284,692,200	
日本ユニシス	31,000	2,789.00	86,459,000	
内田洋行	5,200	2,784.00	14,476,800	
三菱商事	784,500	3,420.00	2,682,990,000	
第一実業	5,100	3,825.00	19,507,500	
キヤノンマーケティングジャパン	31,900	2,179.00	69,510,100	
西華産業	6,800	1,883.00	12,804,400	
佐藤商事	9,900	1,127.00	11,157,300	
菱洋エレクトロ	10,400	1,707.00	17,752,800	
東京産業	11,100	729.00	8,091,900	
ユアサ商事	10,600	3,900.00	41,340,000	
神鋼商事	2,500	3,100.00	7,750,000	
小林産業	6,700	327.00	2,190,900	
阪和興業	20,900	3,610.00	75,449,000	
正栄食品工業	5,800	4,225.00	24,505,000	
カナデン	10,700	1,151.00	12,315,700	
菱電商事	8,100	1,576.00	12,765,600	
ニプロ	78,600	1,475.00	115,935,000	
フルサト工業	6,100	1,715.00	10,461,500	
岩谷産業	24,800	3,900.00	96,720,000	
すてきナイスグループ	4,700	1,254.00	5,893,800	
昭光通商	4,000	878.00	3,512,000	
ニチモウ	1,700	1,610.00	2,737,000	
極東貿易	3,100	2,076.00	6,435,600	
イワキ	13,300	598.00	7,953,400	
兼松エレクトロニクス	7,100	3,610.00	25,631,000	
三愛石油	30,000	1,301.00	39,030,000	
稲畑産業	26,900	1,673.00	45,003,700	
ＧＳＩクレオス	2,900	1,429.00	4,144,100	
明和産業	10,300	469.00	4,830,700	
キムラタン	54,600	33.00	1,801,800	
ゴールドウイン	6,700	8,750.00	58,625,000	

ユニ・チャーム	240,700	3,300.00	794,310,000	
デサント	27,100	2,418.00	65,527,800	
キング	5,800	455.00	2,639,000	
ワキタ	23,900	1,314.00	31,404,600	
ヤマトインターナショナル	7,300	468.00	3,416,400	
東邦ホールディングス	33,100	2,865.00	94,831,500	
サンゲツ	36,600	2,081.00	76,164,600	
ミツウロコグループホールディングス	16,200	770.00	12,474,000	
シナネンホールディングス	4,600	2,622.00	12,061,200	
伊藤忠エネクス	24,700	1,100.00	27,170,000	
サンリオ	31,300	2,256.00	70,612,800	
サンワ　テクノス	7,200	1,299.00	9,352,800	
リョーサン	12,400	3,695.00	45,818,000	
新光商事	12,300	1,515.00	18,634,500	
トーホー	5,100	2,192.00	11,179,200	
三信電気	10,300	1,915.00	19,724,500	
東陽テクニカ	12,900	886.00	11,429,400	
モスフードサービス	14,700	3,005.00	44,173,500	
加賀電子	10,100	2,476.00	25,007,600	
三益半導体工業	8,800	1,563.00	13,754,400	
ソーダニッカ	11,500	632.00	7,268,000	
立花エレテック	7,600	1,764.00	13,406,400	
木曽路	13,700	2,686.00	36,798,200	
ＳＲＳホールディングス	13,100	997.00	13,060,700	
千趣会	20,200	403.00	8,140,600	
タカキュー	8,800	199.00	1,751,200	
ケーヨー	20,600	540.00	11,124,000	
上新電機	13,100	2,992.00	39,195,200	
日本瓦斯	20,500	4,865.00	99,732,500	
ロイヤルホールディングス	19,900	2,827.00	56,257,300	
東天紅	800	1,606.00	1,284,800	
いなげや	12,500	1,613.00	20,162,500	
島忠	25,300	3,465.00	87,664,500	
チヨダ	13,200	2,215.00	29,238,000	
ライフコーポレーション	8,500	2,828.00	24,038,000	
リンガーハット	13,700	2,321.00	31,797,700	
ＭｒＭａｘＨＤ	14,000	517.00	7,238,000	
テンアライド	10,200	442.00	4,508,400	
ＡＯＫＩホールディングス	22,400	1,471.00	32,950,400	
オークワ	15,600	1,180.00	18,408,000	
コメリ	17,200	2,583.00	44,427,600	
青山商事	21,500	3,375.00	72,562,500	
しまむら	13,000	9,580.00	124,540,000	
はせがわ	5,700	481.00	2,741,700	
高島屋	87,700	1,770.00	155,229,000	
松屋	22,500	1,122.00	25,245,000	
エイチ・ツー・オー　リテイリング	53,000	1,745.00	92,485,000	
近鉄百貨店	4,300	3,650.00	15,695,000	
パルコ	10,700	1,166.00	12,476,200	
丸井グループ	102,400	2,483.00	254,259,200	

クレディセゾン	85,000	1,793.00	152,405,000	
アクシアル　リテイリング	9,200	3,845.00	35,374,000	
井筒屋	6,100	259.00	1,579,900	
イオン	430,200	2,556.50	1,099,806,300	
イズミ	20,200	6,310.00	127,462,000	
フォーバル	4,900	998.00	4,890,200	
平和堂	22,700	2,985.00	67,759,500	
フジ	13,300	2,271.00	30,204,300	
ヤオコー	12,700	6,470.00	82,169,000	
ゼビオホールディングス	15,200	1,628.00	24,745,600	
ケーズホールディングス	98,600	1,360.00	134,096,000	
ＰＡＬＴＡＣ	15,700	5,030.00	78,971,000	
三谷産業	12,900	335.00	4,321,500	
Ｏｌｙｍｐｉｃグループ	6,600	842.00	5,557,200	
日産東京販売ホールディングス	16,500	341.00	5,626,500	
新生銀行	91,300	1,760.00	160,688,000	
あおぞら銀行	66,700	3,865.00	257,795,500	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	7,796,700	685.60	5,345,417,520	
りそなホールディングス	1,228,500	611.90	751,719,150	
三井住友トラスト・ホールディングス	220,100	4,485.00	987,148,500	
三井住友フィナンシャルグループ	838,100	4,436.00	3,717,811,600	
千葉銀行	396,500	756.00	299,754,000	
群馬銀行	223,900	554.00	124,040,600	
武蔵野銀行	17,900	3,060.00	54,774,000	
千葉興業銀行	30,700	475.00	14,582,500	
筑波銀行	46,500	261.00	12,136,500	
七十七銀行	35,100	2,501.00	87,785,100	
青森銀行	8,700	3,205.00	27,883,500	
秋田銀行	7,200	2,803.00	20,181,600	
山形銀行	12,600	2,361.00	29,748,600	
岩手銀行	7,800	4,645.00	36,231,000	
東邦銀行	100,100	404.00	40,440,400	
東北銀行	5,700	1,322.00	7,535,400	
みちのく銀行	7,200	1,778.00	12,801,600	
ふくおかフィナンシャルグループ	90,900	3,015.00	274,063,500	
静岡銀行	281,800	1,000.00	281,800,000	
十六銀行	15,000	2,770.00	41,550,000	
スルガ銀行	114,500	598.00	68,471,000	
八十二銀行	202,600	505.00	102,313,000	
山梨中央銀行	13,800	1,811.00	24,991,800	
大垣共立銀行	17,700	2,762.00	48,887,400	
福井銀行	9,500	2,166.00	20,577,000	
北國銀行	12,700	4,095.00	52,006,500	
清水銀行	4,500	2,051.00	9,229,500	
富山銀行	2,100	4,050.00	8,505,000	
滋賀銀行	21,000	2,770.00	58,170,000	
南都銀行	13,000	2,749.00	35,737,000	
百五銀行	107,500	433.00	46,547,500	
京都銀行	42,700	5,510.00	235,277,000	
紀陽銀行	42,200	1,647.00	69,503,400	

ほくほくフィナンシャルグループ	74,500	1,481.00	110,334,500	
広島銀行	165,200	747.00	123,404,400	
山陰合同銀行	66,400	927.00	61,552,800	
中国銀行	77,400	1,068.00	82,663,200	
鳥取銀行	3,500	1,631.00	5,708,500	
伊予銀行	159,800	676.00	108,024,800	
百十四銀行	11,900	3,105.00	36,949,500	
四国銀行	17,100	1,294.00	22,127,400	
阿波銀行	17,900	3,125.00	55,937,500	
大分銀行	6,400	3,895.00	24,928,000	
宮崎銀行	7,500	3,135.00	23,512,500	
佐賀銀行	6,800	2,190.00	14,892,000	
十八銀行	6,900	3,525.00	24,322,500	
沖縄銀行	10,900	3,915.00	42,673,500	
琉球銀行	23,900	1,297.00	30,998,300	
セブン銀行	420,300	332.00	139,539,600	
みずほフィナンシャルグループ	15,213,000	193.20	2,939,151,600	
高知銀行	4,100	1,069.00	4,382,900	
山口フィナンシャルグループ	139,800	1,184.00	165,523,200	
アクリーティブ	6,200	414.00	2,566,800	
芙蓉総合リース	12,900	6,490.00	83,721,000	
興銀リース	21,000	2,807.00	58,947,000	
東京センチュリー	22,600	6,470.00	146,222,000	
ＳＢＩホールディングス	126,700	3,180.00	402,906,000	
日本証券金融	45,900	663.00	30,431,700	
アイフル	187,900	326.00	61,255,400	
日本アジア投資	10,100	283.00	2,858,300	
長野銀行	3,700	1,662.00	6,149,400	
名古屋銀行	9,100	3,690.00	33,579,000	
北洋銀行	168,700	361.00	60,900,700	
愛知銀行	3,800	4,715.00	17,917,000	
中京銀行	4,600	2,284.00	10,506,400	
大光銀行	3,700	2,176.00	8,051,200	
愛媛銀行	15,700	1,178.00	18,494,600	
トマト銀行	4,200	1,420.00	5,964,000	
京葉銀行	49,700	866.00	43,040,200	
栃木銀行	57,900	364.00	21,075,600	
北日本銀行	3,500	2,550.00	8,925,000	
東和銀行	19,700	1,013.00	19,956,100	
福島銀行	10,500	671.00	7,045,500	
大東銀行	5,400	1,064.00	5,745,600	
リコーリース	8,800	3,505.00	30,844,000	
イオンフィナンシャルサービス	79,400	2,231.00	177,141,400	
アコム	225,000	423.00	95,175,000	
ジャックス	13,600	2,259.00	30,722,400	
オリエントコーポレーション	242,300	165.00	39,979,500	
日立キャピタル	30,800	2,974.00	91,599,200	
アプラスフィナンシャル	53,800	103.00	5,541,400	
オリックス	746,900	1,826.50	1,364,212,850	
三菱ＵＦＪリース	284,100	633.00	179,835,300	

ジャフコ	16,100	4,220.00	67,942,000	
九州リースサービス	4,800	702.00	3,369,600	
トモニホールディングス	92,400	456.00	42,134,400	
大和証券グループ本社	958,200	665.90	638,065,380	
野村ホールディングス	1,926,100	538.10	1,036,434,410	
岡三証券グループ	95,400	557.00	53,137,800	
丸三証券	35,600	931.00	33,143,600	
東洋証券	39,900	247.00	9,855,300	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	123,900	624.00	77,313,600	
光世証券	2,600	1,172.00	3,047,200	
水戸証券	32,300	373.00	12,047,900	
いちよし証券	23,500	1,079.00	25,356,500	
松井証券	54,800	1,168.00	64,006,400	
ＳＯＭＰＯホールディングス	219,500	4,619.00	1,013,870,500	
だいこう証券ビジネス	5,500	515.00	2,832,500	
日本取引所グループ	321,300	1,880.00	604,044,000	
マネックスグループ	114,100	530.00	60,473,000	
カブドットコム証券	71,600	375.00	26,850,000	
極東証券	15,000	1,355.00	20,325,000	
岩井コスモホールディングス	11,500	1,486.00	17,089,000	
藍澤證券	20,900	720.00	15,048,000	
フィデアホールディングス	108,600	160.00	17,376,000	
池田泉州ホールディングス	118,900	369.00	43,874,100	
アニコム　ホールディングス	7,700	3,350.00	25,795,000	
ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホールディングス	292,700	3,587.00	1,049,914,900	
ソニーフィナンシャルホールディングス	92,000	2,451.00	225,492,000	
マネーパートナーズグループ	14,300	374.00	5,348,200	
小林洋行	3,200	281.00	899,200	
第一生命ホールディングス	633,300	2,288.00	1,448,990,400	
東京海上ホールディングス	421,700	5,375.00	2,266,637,500	
アドバンテッジリスクマネジメント	3,600	1,093.00	3,934,800	
イー・ギャランティ	11,900	1,147.00	13,649,300	
アサックス	4,600	595.00	2,737,000	
ＮＥＣキャピタルソリューション	4,600	1,837.00	8,450,200	
Ｔ＆Ｄホールディングス	346,200	1,886.00	652,933,200	
アドバンスクリエイト	2,600	2,321.00	6,034,600	
三井不動産	559,000	2,514.50	1,405,605,500	
三菱地所	833,300	1,805.50	1,504,523,150	
平和不動産	19,800	2,014.00	39,877,200	
東京建物	122,400	1,208.00	147,859,200	
ダイビル	28,800	1,159.00	33,379,200	
京阪神ビルディング	18,600	821.00	15,270,600	
住友不動産	268,700	3,901.00	1,048,198,700	
太平洋興発	4,700	920.00	4,324,000	
大京	17,800	2,124.00	37,807,200	
テーオーシー	38,600	770.00	29,722,000	
東京楽天地	1,800	4,825.00	8,685,000	

レオパレス２１	133,600	569.00	76,018,400	
スターツコーポレーション	15,200	2,318.00	35,233,600	
フジ住宅	14,300	828.00	11,840,400	
空港施設	11,200	612.00	6,854,400	
明和地所	6,100	636.00	3,879,600	
ゴールドクレスト	8,900	1,782.00	15,859,800	
リログループ	59,300	2,942.00	174,460,600	
日本エスリード	4,400	1,490.00	6,556,000	
日神不動産	14,900	548.00	8,165,200	
日本エスコン	20,200	731.00	14,766,200	
タカラレーベン	52,400	332.00	17,396,800	
サンヨーハウジング名古屋	6,300	1,050.00	6,615,000	
イオンモール	72,100	2,033.00	146,579,300	
ファースト住建	4,200	1,434.00	6,022,800	
ランド	302,700	12.00	3,632,400	
カチタス	15,300	2,967.00	45,395,100	
東祥	6,700	4,705.00	31,523,500	
トーセイ	15,400	1,012.00	15,584,800	
穴吹興産	1,200	3,105.00	3,726,000	
エヌ・ティ・ティ都市開発	69,600	1,306.00	90,897,600	
サンフロンティア不動産	13,500	1,131.00	15,268,500	
エフ・ジェー・ネクスト	8,600	859.00	7,387,400	
インテリックス	3,100	769.00	2,383,900	
ランドビジネス	5,600	559.00	3,130,400	
グランディハウス	9,700	465.00	4,510,500	
東武鉄道	119,700	3,115.00	372,865,500	
相鉄ホールディングス	36,300	3,515.00	127,594,500	
東京急行電鉄	308,300	1,875.00	578,062,500	
京浜急行電鉄	155,500	1,802.00	280,211,000	
小田急電鉄	168,800	2,498.00	421,662,400	
京王電鉄	63,400	5,950.00	377,230,000	
京成電鉄	79,000	3,690.00	291,510,000	
富士急行	15,500	3,305.00	51,227,500	
新京成電鉄	2,900	2,191.00	6,353,900	
東日本旅客鉄道	201,800	9,790.00	1,975,622,000	
西日本旅客鉄道	101,700	7,550.00	767,835,000	
東海旅客鉄道	101,600	22,250.00	2,260,600,000	
西武ホールディングス	144,700	2,045.00	295,911,500	
鴻池運輸	16,100	1,780.00	28,658,000	
西日本鉄道	31,400	2,865.00	89,961,000	
ハマキョウレックス	8,100	3,880.00	31,428,000	
サカイ引越センター	5,900	5,940.00	35,046,000	
近鉄グループホールディングス	107,500	4,310.00	463,325,000	
阪急阪神ホールディングス	143,400	3,790.00	543,486,000	
南海電気鉄道	50,900	2,747.00	139,822,300	
京阪ホールディングス	47,900	4,200.00	201,180,000	
神戸電鉄	2,500	4,020.00	10,050,000	
名古屋鉄道	86,100	2,685.00	231,178,500	
山陽電気鉄道	8,300	2,489.00	20,658,700	
トランコム	3,000	7,480.00	22,440,000	

日本通運	42,200	6,920.00	292,024,000	
ヤマトホールディングス	188,500	3,295.00	621,107,500	
山九	27,600	6,000.00	165,600,000	
日新	9,200	2,380.00	21,896,000	
丸運	5,800	334.00	1,937,200	
丸全昭和運輸	7,600	2,953.00	22,442,800	
センコーグループホールディングス	64,600	870.00	56,202,000	
トナミホールディングス	2,500	6,130.00	15,325,000	
ニッコンホールディングス	40,900	2,756.00	112,720,400	
日本石油輸送	1,300	2,788.00	3,624,400	
福山通運	15,800	4,445.00	70,231,000	
セイノーホールディングス	80,500	1,572.00	126,546,000	
エスライン	2,900	1,255.00	3,639,500	
神奈川中央交通	2,600	3,670.00	9,542,000	
日立物流	23,700	2,962.00	70,199,400	
丸和運輸機関	5,600	3,910.00	21,896,000	
Ｃ＆Ｆロジホールディングス	11,800	1,286.00	15,174,800	
日本郵船	89,900	2,049.00	184,205,100	
商船三井	68,100	3,115.00	212,131,500	
川崎汽船	49,700	2,102.00	104,469,400	
ＮＳユナイテッド海運	5,100	2,683.00	13,683,300	
明治海運	11,400	389.00	4,434,600	
飯野海運	54,800	520.00	28,496,000	
共栄タンカー	800	1,849.00	1,479,200	
九州旅客鉄道	90,200	3,230.00	291,346,000	
ＳＧホールディングス	101,500	2,877.00	292,015,500	
日本航空	196,800	3,803.00	748,430,400	
ＡＮＡホールディングス	208,800	3,671.00	766,504,800	
パスコ	2,100	1,272.00	2,671,200	
西本Ｗｉｓｍｅｔｔａｃホールディングス	2,500	5,020.00	12,550,000	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	900	1,376.00	1,238,400	
Ｇｅｎｋｙ　ＤｒｕｇＳｔｏｒｅｓ	4,400	4,080.00	17,952,000	
国際紙パルプ商事	19,600	345.00	6,762,000	
総合メディカルホールディングス	9,700	2,407.00	23,347,900	
ブックオフグループホールディングス	6,300	716.00	4,510,800	
三菱倉庫	37,200	2,790.00	103,788,000	
三井倉庫ホールディングス	12,300	1,930.00	23,739,000	
住友倉庫	37,500	1,415.00	53,062,500	
澁澤倉庫	5,800	1,676.00	9,720,800	
ヤマタネ	5,500	2,037.00	11,203,500	
東陽倉庫	19,400	333.00	6,460,200	
乾汽船	8,300	976.00	8,100,800	
日本トランスシティ	26,000	468.00	12,168,000	
ケイヒン	2,000	1,545.00	3,090,000	
中央倉庫	6,500	1,124.00	7,306,000	
川西倉庫	2,100	1,589.00	3,336,900	
安田倉庫	9,600	880.00	8,448,000	
東洋埠頭	3,100	1,625.00	5,037,500	
宇徳	9,200	526.00	4,839,200	

上組	66,300	2,377.00	157,595,100	
サンリツ	2,700	717.00	1,935,900	
キムラユニティー	2,800	1,175.00	3,290,000	
キユーソー流通システム	2,700	2,730.00	7,371,000	
近鉄エクスプレス	20,200	1,941.00	39,208,200	
東海運	5,900	327.00	1,929,300	
エーアイテイー	7,700	1,159.00	8,924,300	
内外トランスライン	3,400	1,728.00	5,875,200	
日本コンセプト	2,900	1,160.00	3,364,000	
東京放送ホールディングス	61,500	2,194.00	134,931,000	
日本テレビホールディングス	102,200	1,863.00	190,398,600	
朝日放送グループホールディングス	11,100	795.00	8,824,500	
テレビ朝日ホールディングス	30,600	2,120.00	64,872,000	
スカパーＪＳＡＴホールディングス	85,000	512.00	43,520,000	
テレビ東京ホールディングス	9,200	2,655.00	24,426,000	
日本ＢＳ放送	3,800	1,269.00	4,822,200	
ビジョン	3,400	4,675.00	15,895,000	
ＵＳＥＮ－ＮＥＸＴ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	4,200	1,388.00	5,829,600	
ワイヤレスゲート	4,900	613.00	3,003,700	
コネクシオ	7,900	1,921.00	15,175,900	
日本通信	100,500	156.00	15,678,000	
クロップス	2,300	767.00	1,764,100	
日本電信電話	799,300	4,889.00	3,907,777,700	
ＫＤＤＩ	981,500	2,932.00	2,877,758,000	
光通信	13,100	20,670.00	270,777,000	
ＮＴＴドコモ	799,800	2,911.50	2,328,617,700	
エムティーアイ	12,900	597.00	7,701,300	
GMOインターネット	40,600	1,653.00	67,111,800	
アイドママーケティングコミュニケーション	2,300	665.00	1,529,500	
カドカワ	32,500	1,150.00	37,375,000	
学研ホールディングス	3,700	5,680.00	21,016,000	
ゼンリン	20,200	3,375.00	68,175,000	
昭文社	5,100	618.00	3,151,800	
インプレスホールディングス	9,200	182.00	1,674,400	
東京電力ホールディングス	906,200	565.00	512,003,000	
中部電力	347,300	1,642.50	570,440,250	
関西電力	463,100	1,671.50	774,071,650	
中国電力	156,900	1,422.00	223,111,800	
北陸電力	111,200	1,112.00	123,654,400	
東北電力	265,800	1,489.00	395,776,200	
四国電力	102,200	1,413.00	144,408,600	
九州電力	250,700	1,339.00	335,687,300	
北海道電力	113,800	709.00	80,684,200	
沖縄電力	23,000	2,253.00	51,819,000	
電源開発	90,300	3,075.00	277,672,500	
エフオン	6,800	1,205.00	8,194,000	
イーレックス	17,900	958.00	17,148,200	
レノバ	11,800	1,206.00	14,230,800	

東京瓦斯	238,600	2,697.00	643,504,200	
大阪瓦斯	220,200	2,100.50	462,530,100	
東邦瓦斯	56,200	4,045.00	227,329,000	
北海道瓦斯	6,000	1,491.00	8,946,000	
広島ガス	23,400	370.00	8,658,000	
西部瓦斯	13,700	2,551.00	34,948,700	
静岡ガス	35,000	929.00	32,515,000	
メタウォーター	6,400	2,987.00	19,116,800	
アイネット	6,300	1,726.00	10,873,800	
松竹	7,400	13,110.00	97,014,000	
東宝	73,300	3,560.00	260,948,000	
エイチ・アイ・エス	19,300	3,580.00	69,094,000	
東映	4,200	13,020.00	54,684,000	
ラックランド	2,000	3,000.00	6,000,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	346,000	1,502.00	519,692,000	
共立メンテナンス	19,400	4,905.00	95,157,000	
イチネンホールディングス	12,200	1,395.00	17,019,000	
建設技術研究所	7,500	1,630.00	12,225,000	
スペース	7,000	1,309.00	9,163,000	
長　大	4,300	874.00	3,758,200	
アインホールディングス	15,000	8,560.00	128,400,000	
燦ホールディングス	2,500	2,672.00	6,680,000	
ピー・シー・エー	1,700	1,907.00	3,241,900	
スバル興業	800	5,580.00	4,464,000	
東京テアトル	4,600	1,343.00	6,177,800	
タナベ経営	2,000	1,728.00	3,456,000	
ビジネスブレイン太田昭和	1,900	2,195.00	4,170,500	
ナガワ	2,100	5,250.00	11,025,000	
よみうりランド	2,300	4,300.00	9,890,000	
東京都競馬	7,100	4,060.00	28,826,000	
常磐興産	4,400	1,778.00	7,823,200	
カナモト	15,300	4,030.00	61,659,000	
東京ドーム	43,900	989.00	43,417,100	
ＤＴＳ	11,600	4,280.00	49,648,000	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	51,800	4,260.00	220,668,000	
シーイーシー	13,200	2,456.00	32,419,200	
カプコン	47,700	2,663.00	127,025,100	
西尾レントオール	11,000	3,775.00	41,525,000	
アイ・エス・ビー	2,100	2,432.00	5,107,200	
アゴーラ・ホスピタリティー・グループ	60,400	30.00	1,812,000	
日本空港ビルデング	32,700	4,610.00	150,747,000	
トランス・コスモス	12,100	2,752.00	33,299,200	
乃村工藝社	25,300	2,497.00	63,174,100	
ジャステック	6,400	1,161.00	7,430,400	
ＳＣＳＫ	25,700	4,990.00	128,243,000	
藤田観光	4,300	3,315.00	14,254,500	
ＫＮＴ－ＣＴホールディングス	6,700	1,222.00	8,187,400	
日本管財	11,600	2,058.00	23,872,800	

トーカイ	10,500	2,416.00	25,368,000	
白洋舎	1,200	3,030.00	3,636,000	
セコム	115,100	9,340.00	1,075,034,000	
日本システムウエア	3,700	1,864.00	6,896,800	
セントラル警備保障	5,300	5,440.00	28,832,000	
アイネス	14,100	1,239.00	17,469,900	
丹青社	22,200	1,116.00	24,775,200	
メイテック	12,700	5,010.00	63,627,000	
ＴＫＣ	9,400	4,590.00	43,146,000	
富士ソフト	16,600	5,410.00	89,806,000	
応用地質	11,700	1,394.00	16,309,800	
船井総研ホールディングス	22,500	2,311.00	51,997,500	
ＮＳＤ	18,300	2,458.00	44,981,400	
進学会ホールディングス	5,000	617.00	3,085,000	
丸紅建材リース	1,100	2,402.00	2,642,200	
オオバ	8,600	673.00	5,787,800	
コナミホールディングス	45,600	4,450.00	202,920,000	
いであ	2,100	1,112.00	2,335,200	
学究社	3,900	1,747.00	6,813,300	
ベネッセホールディングス	39,700	3,065.00	121,680,500	
イオンディライト	13,300	3,845.00	51,138,500	
ナック	7,200	997.00	7,178,400	
福井コンピュータホールディングス	3,200	1,878.00	6,009,600	
ニチイ学館	20,500	920.00	18,860,000	
ダイセキ	18,200	2,829.00	51,487,800	
ステップ	4,000	1,551.00	6,204,000	
日鉄住金物産	8,800	5,080.00	44,704,000	
泉州電業	3,700	2,897.00	10,718,900	
元気寿司	2,800	6,230.00	17,444,000	
トラスコ中山	23,300	2,914.00	67,896,200	
ヤマダ電機	382,200	569.00	217,471,800	
オートバックスセブン	44,400	1,898.00	84,271,200	
モリト	8,200	849.00	6,961,800	
アークランドサカモト	19,000	1,445.00	27,455,000	
ニトリホールディングス	44,400	15,250.00	677,100,000	
グルメ杵屋	7,800	1,184.00	9,235,200	
愛眼	9,100	338.00	3,075,800	
ケーユーホールディングス	5,800	934.00	5,417,200	
吉野家ホールディングス	36,700	1,757.00	64,481,900	
加藤産業	17,500	3,645.00	63,787,500	
イノテック	9,600	1,249.00	11,990,400	
イエローハット	10,500	2,834.00	29,757,000	
松屋フーズホールディングス	5,400	3,510.00	18,954,000	
ＪＢＣＣホールディングス	8,800	1,370.00	12,056,000	
ＪＫホールディングス	11,200	749.00	8,388,800	
サガミホールディングス	15,000	1,362.00	20,430,000	
日伝	9,200	1,890.00	17,388,000	
関西スーパーマーケット	8,500	1,097.00	9,324,500	
ミロク情報サービス	9,800	2,260.00	22,148,000	
北沢産業	9,200	226.00	2,079,200	

杉本商事	6,000	1,911.00	11,466,000	
因幡電機産業	14,800	4,650.00	68,820,000	
王将フードサービス	8,200	7,770.00	63,714,000	
プレナス	12,600	1,785.00	22,491,000	
ミニストップ	8,300	2,086.00	17,313,800	
アークス	20,900	2,918.00	60,986,200	
バローホールディングス	26,000	2,452.00	63,752,000	
バイテックホールディングス	5,100	2,414.00	12,311,400	
東テク	3,700	3,030.00	11,211,000	
ミスミグループ本社	129,900	2,584.00	335,661,600	
藤久	900	1,050.00	945,000	
アルテック	8,200	287.00	2,353,400	
ベルク	5,000	5,710.00	28,550,000	
大　庄	5,900	1,670.00	9,853,000	
タキヒヨー	3,700	1,992.00	7,370,400	
ファーストリテイリング	15,000	56,070.00	841,050,000	
ソフトバンクグループ	504,200	9,976.00	5,029,899,200	
蔵王産業	1,800	1,492.00	2,685,600	
スズケン	51,000	5,230.00	266,730,000	
サンドラッグ	42,100	3,940.00	165,874,000	
サックスバー　ホールディングス	10,500	943.00	9,901,500	
ジェコス	7,700	1,140.00	8,778,000	
ヤマザワ	2,200	1,695.00	3,729,000	
やまや	2,300	2,872.00	6,605,600	
ルネサスイーストン	10,200	512.00	5,222,400	
ベルーナ	27,500	1,256.00	34,540,000	
合計	130,846,435		275,713,338,725	

*担保として以下の有価証券が差し入れられております。

銘　柄	株　式　数
トヨタ自動車	500,000

（２）株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

（単位：円）

科　　目	注記番号	平成29年10月12日現在	平成30年10月12日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		2,773,988,288	1,789,467,326
国債証券		297,773,980,000	285,051,548,800
地方債証券		23,371,281,085	21,978,991,778
特殊債券		16,353,704,562	17,157,003,948
社債券		17,026,841,050	15,127,644,060
未収入金		1,631,865,000	－
未収利息		613,053,882	531,500,447
前払費用		6,261,326	20,245,776
流動資産合計		359,550,975,193	341,656,402,135
資産合計		359,550,975,193	341,656,402,135
負債の部			
流動負債			
未払金		－	1,222,747,000
未払解約金		1,684,089,000	352,701,000
流動負債合計		1,684,089,000	1,575,448,000
負債合計		1,684,089,000	1,575,448,000
純資産の部			
元本等			
元本	※1	279,387,012,706	265,980,959,111
剰余金			
剰余金又は欠損金（△）		78,479,873,487	74,099,995,024
元本等合計		357,866,886,193	340,080,954,135
純資産合計		357,866,886,193	340,080,954,135
負債純資産合計		359,550,975,193	341,656,402,135

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	291,973,791,531円	279,387,012,706円
同期中追加設定元本額	65,137,606,209円	86,394,187,497円
同期中一部解約元本額	77,724,385,034円	99,800,241,092円
元本の内訳		
ファンド名		
ＤＩＡＭ国内債券パッシブ・ファンド	13,850,588,414円	17,213,319,359円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	141,771,788円	116,744,280円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	127,305,344円	91,662,889円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	40,618,516円	28,460,338円
グローバル８資産ラップファンド（安定型）	358,172,970円	822,678,821円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	131,577,204円	242,214,024円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	27,433,307円	36,643,048円
たわらノーロード　国内債券	2,266,473,066円	4,817,544,677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	118,661,211円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	－円	28,242,803円
たわらノーロード　バランス（標準型）	－円	53,757,715円
たわらノーロード　バランス（積極型）	－円	10,644,651円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（保守型）	－円	5,245,008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	74,013,081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	94,847,777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	26,936,285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	13,511,245円
たわらノーロード　最適化バランス（保守型）	－円	1,245,980円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	－円	660,435円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	－円	2,989,789円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	－円	675,145円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	－円	17,517円
ＤＩＡＭ国内債券インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	12,439,230,248円	12,871,301,141円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型	5,321,123,688円	5,951,215,208円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型	7,599,189,375円	8,557,028,547円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型	3,046,531,363円	3,470,237,031円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド	1,774,839,099円	1,837,771,482円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド	1,932,538,404円	2,032,813,435円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０インデックスファンド	288,293,436円	316,274,220円
マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	95,832,674円	88,374,891円
マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	2,274,223,236円	2,317,324,650円
マネックス資産設計ファンド　エボリューション	3,002,910円	4,391,950円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	445,818,075円	3,186,425,011円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	377,197,015円	756,301,058円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	86,300,285円	161,357,166円
投資のソムリエ	2,972,951,972円	9,687,855,915円
クルーズコントロール	2,763,991,182円	2,306,772,131円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	163,833,623円	841,937,321円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	1,638,056,047円	2,259,771,712円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス・Ｆ（成長型）	186,456,021円	286,078,562円
クルーズコントロール＜ＤＣ年金＞	921,559円	1,335,920円
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（堅実型）	6,110,703円	6,776,762円
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（積極型）	19,010,322円	17,808,694円

投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	185,640,863円	644,288,090円
ダイナミック・ナビゲーション	524,853円	515,269円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	2,367,373,734円	12,200,329,309円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	393,977円	2,416,181円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	393,982円	1,740,009円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	705,062円	3,821,192円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	－円	3,490,471円
４資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	－円	75,271,661円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	－円	758,397,642円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	－円	290,676円
みずほエマージングボンドオープン	10,801,911円	－円
ＤＩＡＭ高金利通貨ファンド	9,608,918円	－円
ＤＩＡＭエマージング債券ファンド	9,450,010円	9,450,010円
ＤＩＡＭ国内債券パッシブファンド（適格機関投資家向け）	24,403,666,103円	22,706,710,305円
ＤＩＡＭワールドバランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	497,874,165円	451,828,315円
ＤＩＡＭグローバル・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	369,244,962円	289,466,887円
ＤＩＡＭグローバル・バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	263,458,483円	236,494,470円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	91,759,912円	72,823,300円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	286,802,833円	200,165,850円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	106,170,065円	83,310,095円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	71,450,932円	43,155,088円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	119,547,737円	95,738,566円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	198,613,276円	169,898,524円
ＤＩＡＭバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	6,457,513,727円	5,671,947,788円

ＤＩＡＭバランスファンド３７．５ＶＡ（適格機関投資家限定）	3,429,075,449円	3,025,448,569円
ＤＩＡＭバランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	6,175,616,959円	5,669,701,197円
ＤＩＡＭグローバル・アセット・バランスＶＡ（適格機関投資家限定）	681,893,480円	602,332,656円
ＤＩＡＭグローバル・アセット・バランスＶＡ２（適格機関投資家限定）	767,783,699円	269,865,242円
ＤＩＡＭ　アクサ　グローバルバランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	4,008,052,847円	3,452,703,759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）	5,260,342,645円	923,203,788円
ＤＩＡＭグローバルβ私募ファンド（適格機関投資家向け）	194,752,933円	194,752,933円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,056,192,407円	46,910,967円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド３５ＶＡ（適格機関投資家限定）	3,400,094,687円	97,843,684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）	88,333,633,708円	59,694,379,629円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,189,575,143円	827,727,378円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	7,557,095,183円	7,191,254,876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）	28,451,347,956円	27,546,015,188円
ＤＩＡＭバランス３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	56,158,235円	53,798,122円
ＤＩＡＭバランス５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	24,509,134円	16,094,725円
ＤＩＡＭバランス７０ＶＡ（適格機関投資家限定）	8,808,986円	8,024,060円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド４ＶＡ（適格機関投資家限定）	31,707,012,480円	30,749,110,925円
ＤＩＡＭ世界バランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	505,447,523円	469,748,503円
ＤＩＡＭ国内バランス３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	138,180,160円	133,450,015円
ＤＩＡＭバランス２０ＶＡ（適格機関投資家限定）	599,008,976円	526,036,110円
ＤＩＡＭバランス４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	479,853円	737,508円
ＤＩＡＭバランス６０ＶＡ（適格機関投資家限定）	376,479円	400,694円

計	279,387,012,706円	265,980,959,111円
2．受益権の総数	279,387,012,706口	265,980,959,111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28年10月13日 至　平成29年10月12日	自　平成29年10月13日 至　平成30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29年10月12日現在	平成30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29年10月12日現在	平成30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	177,023,300	△3,401,685,400
地方債証券	△98,364,748	△133,288,487
特殊債券	△82,026,998	△147,774,035
社債券	△89,621,420	△105,227,190
合計	△92,989,866	△3,787,975,112

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成29年2月15日から平成29年10月12日まで及び平成30年2月15日から平成30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29年10月12日現在	平成30年10月12日現在
１口当たり純資産額	1.2809円	1.2786円
（1万口当たり純資産額）	(12,809円)	(12,786円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

（１）株式

該当事項はありません。

（２）株式以外の有価証券

平成30年10月12日現在

種　類	銘　柄	券面総額 （円）	評価額 （円）	備考
国債証券	３８４回　利付国庫債券（２年）	1,000,000,000	1,002,940,000	
	３８６回　利付国庫債券（２年）	1,000,000,000	1,003,250,000	
	３８７回　利付国庫債券（２年）	1,000,000,000	1,003,450,000	
	３８８回　利付国庫債券（２年）	800,000,000	802,912,000	
	３９０回　利付国庫債券（２年）	1,200,000,000	1,204,620,000	
	３９１回　利付国庫債券（２年）	1,400,000,000	1,405,656,000	
	１２２回　利付国庫債券（５年）	4,000,000,000	4,011,080,000	
	１２３回　利付国庫債券（５年）	3,000,000,000	3,009,840,000	
	１２４回　利付国庫債券（５年）	2,200,000,000	2,208,316,000	
	１２５回　利付国庫債券（５年）	3,000,000,000	3,012,750,000	
	１２６回　利付国庫債券（５年）	2,500,000,000	2,511,750,000	
	１２７回　利付国庫債券（５年）	3,000,000,000	3,015,330,000	
	１２８回　利付国庫債券（５年）	3,000,000,000	3,016,500,000	
	１２９回　利付国庫債券（５年）	2,420,000,000	2,434,229,600	
	１３０回　利付国庫債券（５年）	3,000,000,000	3,018,660,000	
	１３１回　利付国庫債券（５年）	2,020,000,000	2,033,190,600	
	１３２回　利付国庫債券（５年）	2,000,000,000	2,013,640,000	
	１３３回　利付国庫債券（５年）	2,460,000,000	2,477,441,400	
	１３４回　利付国庫債券（５年）	1,790,000,000	1,803,120,700	
	１３５回　利付国庫債券（５年）	2,100,000,000	2,115,834,000	
	１３６回　利付国庫債券（５年）	750,000,000	755,805,000	
	２回　利付国庫債券（４０年）	460,000,000	616,832,400	
	３回　利付国庫債券（４０年）	460,000,000	618,621,800	
	４回　利付国庫債券（４０年）	770,000,000	1,038,198,700	
	５回　利付国庫債券（４０年）	700,000,000	907,186,000	
	６回　利付国庫債券（４０年）	700,000,000	887,481,000	
	７回　利付国庫債券（４０年）	750,000,000	907,515,000	
	８回　利付国庫債券（４０年）	840,000,000	939,750,000	
	９回　利付国庫債券（４０年）	1,210,000,000	975,090,600	
	１０回　利付国庫債券（４０年）	1,120,000,000	1,071,067,200	
	１１回　利付国庫債券（４０年）	390,000,000	358,807,800	
	３０５回　利付国庫債券（１０年）	1,500,000,000	1,525,455,000	
	３０６回　利付国庫債券（１０年）	1,500,000,000	1,532,805,000	
	３０７回　利付国庫債券（１０年）	1,400,000,000	1,428,616,000	
	３０８回　利付国庫債券（１０年）	800,000,000	819,184,000	
	３０９回　利付国庫債券（１０年）	1,000,000,000	1,020,610,000	
	３１０回　利付国庫債券（１０年）	2,300,000,000	2,349,864,000	
	３１１回　利付国庫債券（１０年）	1,020,000,000	1,038,166,200	
	３１２回　利付国庫債券（１０年）	2,200,000,000	2,263,228,000	
	３１３回　利付国庫債券（１０年）	1,790,000,000	1,851,414,900	

３１４回　利付国庫債券（１０年）	1,500,000,000	1,544,175,000	
３１５回　利付国庫債券（１０年）	1,500,000,000	1,552,590,000	
３１６回　利付国庫債券（１０年）	500,000,000	516,185,000	
３１７回　利付国庫債券（１０年）	1,000,000,000	1,035,280,000	
３１８回　利付国庫債券（１０年）	1,600,000,000	1,651,744,000	
３１９回　利付国庫債券（１０年）	1,500,000,000	1,557,180,000	
３２０回　利付国庫債券（１０年）	1,500,000,000	1,552,395,000	
３２１回　利付国庫債券（１０年）	1,100,000,000	1,141,217,000	
３２２回　利付国庫債券（１０年）	1,000,000,000	1,034,030,000	
３２４回　利付国庫債券（１０年）	2,000,000,000	2,065,320,000	
３２５回　利付国庫債券（１０年）	2,900,000,000	3,000,630,000	
３２６回　利付国庫債券（１０年）	500,000,000	516,250,000	
３２７回　利付国庫債券（１０年）	1,450,000,000	1,503,200,500	
３２８回　利付国庫債券（１０年）	2,890,000,000	2,975,977,500	
３２９回　利付国庫債券（１０年）	2,270,000,000	2,362,162,000	
３３０回　利付国庫債券（１０年）	1,200,000,000	1,250,724,000	
３３１回　利付国庫債券（１０年）	650,000,000	671,047,000	
３３２回　利付国庫債券（１０年）	2,960,000,000	3,059,130,400	
３３３回　利付国庫債券（１０年）	2,500,000,000	2,586,300,000	
３３４回　利付国庫債券（１０年）	2,600,000,000	2,692,404,000	
３３５回　利付国庫債券（１０年）	2,750,000,000	2,834,920,000	
３３６回　利付国庫債券（１０年）	1,150,000,000	1,186,271,000	
３３７回　利付国庫債券（１０年）	1,500,000,000	1,528,755,000	
３３８回　利付国庫債券（１０年）	2,650,000,000	2,718,979,500	
３３９回　利付国庫債券（１０年）	3,100,000,000	3,181,747,000	
３４０回　利付国庫債券（１０年）	3,100,000,000	3,183,731,000	
３４１回　利付国庫債券（１０年）	3,060,000,000	3,121,414,200	
３４２回　利付国庫債券（１０年）	3,000,000,000	3,015,540,000	
３４３回　利付国庫債券（１０年）	3,000,000,000	3,013,770,000	
３４４回　利付国庫債券（１０年）	2,800,000,000	2,809,940,000	
３４５回　利付国庫債券（１０年）	2,700,000,000	2,707,668,000	
３４６回　利付国庫債券（１０年）	3,000,000,000	3,005,010,000	
３４７回　利付国庫債券（１０年）	2,900,000,000	2,902,494,000	
３４８回　利付国庫債券（１０年）	2,900,000,000	2,900,000,000	
３４９回　利付国庫債券（１０年）	2,610,000,000	2,607,624,900	
３５０回　利付国庫債券（１０年）	3,400,000,000	3,393,642,000	
３５１回　利付国庫債券（１０年）	2,340,000,000	2,332,161,000	
１回　利付国庫債券（３０年）	100,000,000	127,950,000	
２回　利付国庫債券（３０年）	100,000,000	124,417,000	
３回　利付国庫債券（３０年）	200,000,000	247,312,000	
４回　利付国庫債券（３０年）	200,000,000	262,856,000	
５回　利付国庫債券（３０年）	200,000,000	247,316,000	
６回　利付国庫債券（３０年）	200,000,000	253,412,000	
７回　利付国庫債券（３０年）	300,000,000	377,877,000	
８回　利付国庫債券（３０年）	200,000,000	239,298,000	
１１回　利付国庫債券（３０年）	200,000,000	237,034,000	
１２回　利付国庫債券（３０年）	300,000,000	373,173,000	
１３回　利付国庫債券（３０年）	300,000,000	369,222,000	
１４回　利付国庫債券（３０年）	500,000,000	645,775,000	
１５回　利付国庫債券（３０年）	200,000,000	261,774,000	

１６回　利付国庫債券（３０年）	400,000,000	524,628,000	
１７回　利付国庫債券（３０年）	200,000,000	259,604,000	
１８回　利付国庫債券（３０年）	420,000,000	539,263,200	
１９回　利付国庫債券（３０年）	200,000,000	257,006,000	
２０回　利付国庫債券（３０年）	300,000,000	395,820,000	
２１回　利付国庫債券（３０年）	300,000,000	386,658,000	
２２回　利付国庫債券（３０年）	470,000,000	621,683,100	
２３回　利付国庫債券（３０年）	600,000,000	794,922,000	
２４回　利付国庫債券（３０年）	300,000,000	398,079,000	
２５回　利付国庫債券（３０年）	400,000,000	517,404,000	
２６回　利付国庫債券（３０年）	700,000,000	918,981,000	
２７回　利付国庫債券（３０年）	700,000,000	933,240,000	
２８回　利付国庫債券（３０年）	900,000,000	1,202,751,000	
２９回　利付国庫債券（３０年）	900,000,000	1,189,458,000	
３０回　利付国庫債券（３０年）	960,000,000	1,253,548,800	
３１回　利付国庫債券（３０年）	900,000,000	1,161,297,000	
３２回　利付国庫債券（３０年）	1,060,000,000	1,391,557,400	
３３回　利付国庫債券（３０年）	1,300,000,000	1,632,163,000	
３４回　利付国庫債券（３０年）	1,140,000,000	1,480,073,400	
３５回　利付国庫債券（３０年）	1,250,000,000	1,574,200,000	
３６回　利付国庫債券（３０年）	1,300,000,000	1,640,132,000	
３７回　利付国庫債券（３０年）	1,450,000,000	1,801,117,500	
３８回　利付国庫債券（３０年）	900,000,000	1,099,629,000	
３９回　利付国庫債券（３０年）	800,000,000	995,728,000	
４０回　利付国庫債券（３０年）	650,000,000	795,021,500	
４１回　利付国庫債券（３０年）	680,000,000	816,822,800	
４２回　利付国庫債券（３０年）	800,000,000	961,264,000	
４３回　利付国庫債券（３０年）	800,000,000	961,568,000	
４４回　利付国庫債券（３０年）	650,000,000	781,508,000	
４５回　利付国庫債券（３０年）	870,000,000	1,006,181,100	
４６回　利付国庫債券（３０年）	980,000,000	1,133,360,200	
４７回　利付国庫債券（３０年）	1,010,000,000	1,191,577,800	
４８回　利付国庫債券（３０年）	940,000,000	1,063,788,600	
４９回　利付国庫債券（３０年）	990,000,000	1,120,115,700	
５０回　利付国庫債券（３０年）	1,000,000,000	985,590,000	
５１回　利付国庫債券（３０年）	930,000,000	801,018,300	
５２回　利付国庫債券（３０年）	1,060,000,000	963,200,800	
５３回　利付国庫債券（３０年）	900,000,000	838,359,000	
５４回　利付国庫債券（３０年）	900,000,000	881,622,000	
５５回　利付国庫債券（３０年）	980,000,000	958,743,800	
５６回　利付国庫債券（３０年）	900,000,000	879,336,000	
５７回　利付国庫債券（３０年）	930,000,000	907,456,800	
５８回　利付国庫債券（３０年）	1,130,000,000	1,101,139,800	
５９回　利付国庫債券（３０年）	800,000,000	758,080,000	
４５回　利付国庫債券（２０年）	900,000,000	932,562,000	
４６回　利付国庫債券（２０年）	500,000,000	519,625,000	
４７回　利付国庫債券（２０年）	250,000,000	261,242,500	
４８回　利付国庫債券（２０年）	500,000,000	528,560,000	
５０回　利付国庫債券（２０年）	780,000,000	818,142,000	
５１回　利付国庫債券（２０年）	600,000,000	633,966,000	

５２回　利付国庫債券（２０年）	550,000,000	585,607,000	
５４回　利付国庫債券（２０年）	700,000,000	751,254,000	
５５回　利付国庫債券（２０年）	410,000,000	439,483,100	
５８回　利付国庫債券（２０年）	600,000,000	646,848,000	
６０回　利付国庫債券（２０年）	590,000,000	626,497,400	
６１回　利付国庫債券（２０年）	500,000,000	523,760,000	
６４回　利付国庫債券（２０年）	600,000,000	658,002,000	
６５回　利付国庫債券（２０年）	550,000,000	605,550,000	
６７回　利付国庫債券（２０年）	520,000,000	574,714,400	
７０回　利付国庫債券（２０年）	750,000,000	853,440,000	
７２回　利付国庫債券（２０年）	350,000,000	393,946,000	
７３回　利付国庫債券（２０年）	790,000,000	887,928,400	
７５回　利付国庫債券（２０年）	440,000,000	499,386,800	
７８回　利付国庫債券（２０年）	640,000,000	720,736,000	
８１回　利付国庫債券（２０年）	240,000,000	272,985,600	
８３回　利付国庫債券（２０年）	780,000,000	896,009,400	
８５回　利付国庫債券（２０年）	440,000,000	507,306,800	
８８回　利付国庫債券（２０年）	1,200,000,000	1,407,084,000	
９０回　利付国庫債券（２０年）	1,200,000,000	1,403,268,000	
９２回　利付国庫債券（２０年）	1,300,000,000	1,515,267,000	
９３回　利付国庫債券（２０年）	700,000,000	812,840,000	
９４回　利付国庫債券（２０年）	800,000,000	935,664,000	
９５回　利付国庫債券（２０年）	1,200,000,000	1,429,008,000	
９７回　利付国庫債券（２０年）	1,100,000,000	1,305,062,000	
９９回　利付国庫債券（２０年）	1,400,000,000	1,654,716,000	
１００回　利付国庫債券（２０年）	850,000,000	1,015,758,500	
１０２回　利付国庫債券（２０年）	660,000,000	803,596,200	
１０５回　利付国庫債券（２０年）	950,000,000	1,132,941,500	
１０６回　利付国庫債券（２０年）	350,000,000	420,829,500	
１０７回　利付国庫債券（２０年）	650,000,000	777,094,500	
１０８回　利付国庫債券（２０年）	750,000,000	881,610,000	
１０９回　利付国庫債券（２０年）	770,000,000	907,406,500	
１１０回　利付国庫債券（２０年）	400,000,000	479,588,000	
１１１回　利付国庫債券（２０年）	770,000,000	933,948,400	
１１２回　利付国庫債券（２０年）	750,000,000	901,822,500	
１１３回　利付国庫債券（２０年）	1,500,000,000	1,808,745,000	
１１４回　利付国庫債券（２０年）	1,100,000,000	1,329,284,000	
１１５回　利付国庫債券（２０年）	300,000,000	365,817,000	
１１６回　利付国庫債券（２０年）	740,000,000	904,835,000	
１１７回　利付国庫債券（２０年）	950,000,000	1,151,010,500	
１１８回　利付国庫債券（２０年）	700,000,000	841,876,000	
１１９回　利付国庫債券（２０年）	700,000,000	825,937,000	
１２０回　利付国庫債券（２０年）	600,000,000	693,888,000	
１２１回　利付国庫債券（２０年）	1,130,000,000	1,348,361,200	
１２２回　利付国庫債券（２０年）	500,000,000	590,815,000	
１２３回　利付国庫債券（２０年）	1,130,000,000	1,377,922,000	
１２４回　利付国庫債券（２０年）	500,000,000	603,785,000	
１２５回　利付国庫債券（２０年）	720,000,000	888,681,600	
１２６回　利付国庫債券（２０年）	450,000,000	544,257,000	
１２７回　利付国庫債券（２０年）	350,000,000	419,100,500	

	１２８回　利付国庫債券（２０年）	700,000,000	839,881,000	
	１２９回　利付国庫債券（２０年）	700,000,000	831,299,000	
	１３０回　利付国庫債券（２０年）	900,000,000	1,070,046,000	
	１３１回　利付国庫債券（２０年）	450,000,000	529,411,500	
	１３２回　利付国庫債券（２０年）	660,000,000	777,645,000	
	１３３回　利付国庫債券（２０年）	910,000,000	1,083,755,400	
	１３４回　利付国庫債券（２０年）	900,000,000	1,072,863,000	
	１３５回　利付国庫債券（２０年）	500,000,000	589,590,000	
	１３６回　利付国庫債券（２０年）	350,000,000	408,201,500	
	１３７回　利付国庫債券（２０年）	690,000,000	814,786,500	
	１３８回　利付国庫債券（２０年）	640,000,000	738,489,600	
	１３９回　利付国庫債券（２０年）	580,000,000	676,848,400	
	１４０回　利付国庫債券（２０年）	1,350,000,000	1,595,268,000	
	１４１回　利付国庫債券（２０年）	1,100,000,000	1,301,498,000	
	１４２回　利付国庫債券（２０年）	750,000,000	897,525,000	
	１４３回　利付国庫債券（２０年）	970,000,000	1,134,958,200	
	１４４回　利付国庫債券（２０年）	760,000,000	878,826,000	
	１４５回　利付国庫債券（２０年）	1,400,000,000	1,659,238,000	
	１４６回　利付国庫債券（２０年）	1,400,000,000	1,659,938,000	
	１４７回　利付国庫債券（２０年）	1,500,000,000	1,757,610,000	
	１４８回　利付国庫債券（２０年）	1,300,000,000	1,504,503,000	
	１４９回　利付国庫債券（２０年）	1,520,000,000	1,760,190,400	
	１５０回　利付国庫債券（２０年）	1,500,000,000	1,714,380,000	
	１５１回　利付国庫債券（２０年）	1,410,000,000	1,567,130,400	
	１５２回　利付国庫債券（２０年）	1,400,000,000	1,554,658,000	
	１５３回　利付国庫債券（２０年）	1,360,000,000	1,531,033,600	
	１５４回　利付国庫債券（２０年）	1,500,000,000	1,663,905,000	
	１５５回　利付国庫債券（２０年）	1,600,000,000	1,721,120,000	
	１５６回　利付国庫債券（２０年）	1,370,000,000	1,335,188,300	
	１５７回　利付国庫債券（２０年）	1,300,000,000	1,219,803,000	
	１５８回　利付国庫債券（２０年）	1,330,000,000	1,311,646,000	
	１５９回　利付国庫債券（２０年）	1,420,000,000	1,421,164,400	
	１６０回　利付国庫債券（２０年）	1,300,000,000	1,321,567,000	
	１６１回　利付国庫債券（２０年）	1,200,000,000	1,195,980,000	
	１６２回　利付国庫債券（２０年）	1,200,000,000	1,193,904,000	
	１６３回　利付国庫債券（２０年）	1,210,000,000	1,200,695,100	
	１６４回　利付国庫債券（２０年）	1,460,000,000	1,419,762,400	
	１６５回　利付国庫債券（２０年）	1,220,000,000	1,183,936,800	
国債証券　合計		264,340,000,000	285,051,548,800	
地方債証券	６８０回　東京都公募公債	200,000,000	203,924,000	
	６８５回　東京都公募公債	500,000,000	509,340,000	
	６８８回　東京都公募公債	200,000,000	203,558,000	
	６９７回　東京都公募公債	500,000,000	514,540,000	
	７０１回　東京都公募公債	700,000,000	719,782,000	
	７０８回　東京都公募公債	500,000,000	515,745,000	
	７２０回　東京都公募公債	300,000,000	311,430,000	
	７２６回　東京都公募公債	400,000,000	413,540,000	
	５回　東京都公募公債　２０年	100,000,000	112,770,000	
	９回　東京都公募公債　２０年	200,000,000	234,800,000	
	１０回　東京都公募公債　２０年	300,000,000	350,874,000	

２２年度１２回　北海道公募公債	200,000,000	205,758,000	
１９４回　神奈川県公募公債	300,000,000	309,156,000	
２０８回　神奈川県公募公債	300,000,000	307,563,000	
３３６回　大阪府公募公債	200,000,000	204,212,000	
３４５回　大阪府公募公債	300,000,000	308,088,000	
３５６回　大阪府公募公債	200,000,000	206,436,000	
３６４回　大阪府公募公債	300,000,000	308,526,000	
３７４回　大阪府公募公債	300,000,000	312,138,000	
２６年度１１回　京都府公募公債	350,000,000	357,539,000	
２６年度１７回　兵庫県公募公債	200,000,000	203,970,000	
１回　兵庫県公募公債（１２年）	300,000,000	316,656,000	
２２年度８回　静岡県公募公債	200,000,000	203,880,000	
２３年度９回　静岡県公募公債	200,000,000	206,264,000	
１回　静岡県公募公債　２０年	100,000,000	114,017,000	
２２年度６回　愛知県公募公債	200,000,000	204,160,000	
２３年度２０回　愛知県公募公債	500,000,000	517,915,000	
２５年度４回　愛知県公募公債	300,000,000	310,881,000	
２２年度１回　広島県公募公債	200,000,000	204,376,000	
２３年度２回　埼玉県公募公債	200,000,000	206,072,000	
２６年度５回　埼玉県公募公債	400,000,000	411,536,000	
２５年度１１回　福岡県公募公債	200,000,000	206,352,000	
２４年度２回　福岡県公募公債（２０年）	300,000,000	344,730,000	
２４年度７回　千葉県公募公債	300,000,000	308,529,000	
２５年度５回　千葉県公募公債	200,000,000	207,372,000	
８０回　共同発行市場公募地方債	200,000,000	203,406,000	
９４回　共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,777,000	
９９回　共同発行市場公募地方債	700,000,000	721,539,000	
１０６回　共同発行市場公募地方債	300,000,000	309,108,000	
１０９回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	517,730,000	
１１１回　共同発行市場公募地方債	700,000,000	721,707,000	
１１９回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	516,010,000	
１２１回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	511,300,000	
１２６回　共同発行市場公募地方債	793,900,000	822,496,278	
１２７回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	514,915,000	
１２８回　共同発行市場公募地方債	300,000,000	308,712,000	
１３７回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	513,130,000	
１３９回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	512,700,000	
１４２回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	506,685,000	
１４４回　共同発行市場公募地方債	400,000,000	408,672,000	
１４６回　共同発行市場公募地方債	400,000,000	410,812,000	
１４８回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	513,705,000	
１６６回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	498,895,000	
２９年度４回　大阪市公募公債	200,000,000	198,422,000	
４８８回　名古屋市公募公債　１０年	450,000,000	462,820,500	
４回　京都市公募公債　２０年	100,000,000	118,229,000	
２２年度３回　横浜市公募公債	200,000,000	204,438,000	
２２年度５回　横浜市公募公債	200,000,000	205,386,000	
２３年度４回　横浜市公募公債	450,000,000	463,932,000	
２５年度２回　横浜市公募公債	400,000,000	415,500,000	
２５年度４回　札幌市公募公債	200,000,000	206,822,000	

	２回　川崎市公募公債　１５年	100,000,000	102,724,000	
	２１年度２回　北九州市公募公債	200,000,000	203,216,000	
	２３年度１回　千葉市公募公債	200,000,000	206,774,000	
地方債証券　合計		21,243,900,000	21,978,991,778	
特殊債券	７８回　日本政策投資銀行債券	200,000,000	199,664,000	
	１９回　高速道路機構債	150,000,000	211,464,000	
	２６回　高速道路機構債	200,000,000	267,224,000	
	９６回　高速道路機構債	700,000,000	720,391,000	
	１１６回　高速道路機構債	100,000,000	103,235,000	
	９回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	104,735,000	
	１８回政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	319,203,000	
	１２１回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	583,505,000	
	１４９回政保日本高速道路保有・債務返済機構	400,000,000	412,728,000	
	１８０回政保日本高速道路保有・債務返済機構	1,000,000,000	1,030,460,000	
	１８９回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	511,820,000	
	１９３回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	520,305,000	
	１９５回政保日本高速道路保有・債務返済機構	330,000,000	344,018,400	
	２４１回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	511,705,000	
	２６０回政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	220,850,000	
	３０９回政保日本高速道路保有・債務返済機構	800,000,000	797,968,000	
	３１９回政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	197,402,000	
	２８回　日本道路・機構承継債	400,000,000	529,292,000	
	１回　地方公共団体金融機構債券　２０年	200,000,000	234,426,000	
	８回　政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	305,103,000	
	１０回　政保地方公共団体金融機構債券	500,000,000	509,455,000	
	１５回　政保地方公共団体金融機構債券	200,000,000	203,806,000	
	２０回　政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	308,430,000	
	２４回　地方公共団体金融機構債券	300,000,000	309,318,000	
	１９回　政保地方公共団体金融機構債券	200,000,000	234,350,000	
	３６回　政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	309,789,000	
	４４回　政保地方公共団体金融機構債券	400,000,000	413,988,000	
	５０回　政保地方公共団体金融機構債券	500,000,000	521,035,000	
	５６回　政保地方公共団体金融機構債券	542,000,000	562,010,640	
	６４回　政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	308,475,000	
	４４回　地方公共団体金融機構債券　２０年	200,000,000	219,698,000	
	３９回　住宅金融支援機構債券	200,000,000	237,930,000	
	７５回　住宅金融支援機構債券	350,000,000	418,278,000	
	２２２回　住宅金融支援機構債券	300,000,000	298,149,000	

	６回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	44,469,000	46,779,609	
	８回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	31,276,000	32,960,838	
	９回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	46,818,000	49,376,603	
	２回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	49,590,000	52,645,239	
	１３回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	18,125,000	18,663,675	
	１４回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	91,320,000	93,583,822	
	４３回貸付債権担保住宅金融公庫債券	16,636,000	17,601,387	
	４４回貸付債権担保住宅金融公庫債券	62,808,000	66,288,191	
	５１回貸付債権担保住宅金融公庫債券	47,139,000	49,678,849	
	１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	79,800,000	83,605,662	
	２９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	165,570,000	177,207,915	
	３６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	288,768,000	306,391,511	
	１２６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	288,900,000	288,238,419	
	１２８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	290,259,000	289,437,567	
	１３１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	294,219,000	292,736,136	
	１３２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	294,663,000	293,145,485	
	い第７７９号　利付商工債	200,000,000	200,428,000	
	い第７８３号　利付商工債	300,000,000	300,897,000	
	３０２回　利附信金中金債	300,000,000	300,618,000	
	３２５回　利附信金中金債	400,000,000	399,360,000	
	２２０号　利附商工債（３年）	300,000,000	299,970,000	
	５５回　鉄道建設運輸施設債	500,000,000	517,180,000	
特殊債券　合計		16,282,360,000	17,157,003,948	
社債券	１回　ＢＰＣＥ　ＳＡ円貨社債（ソーシャルボンド）	200,000,000	198,916,000	
	３３７回　東京交通債	200,000,000	210,518,000	
	２７回　ラボバンク・ネダーランド円貨社債	200,000,000	200,742,000	
	２２回　中日本高速道路債券	300,000,000	305,892,000	
	３４回　政保西日本高速道路債券	200,000,000	201,172,000	
	７回　キリンホールディングス社債	100,000,000	101,628,000	
	９回　日本たばこ産業社債	200,000,000	200,478,000	
	１９回　三菱ケミカルホールディングス社債	100,000,000	101,208,000	
	６回　ＪＸホールディングス社債	100,000,000	104,182,000	
	２３回　ジェイ　エフ　イー　ホールディングス社債	100,000,000	99,671,000	
	３０回　豊田自動織機社債	200,000,000	199,802,000	
	１２回　パナソニック社債	200,000,000	200,820,000	
	１３回　パナソニック社債	100,000,000	101,335,000	
	５６回　日産自動車社債	100,000,000	100,620,000	
	１４回　トヨタ自動車社債	200,000,000	207,256,000	
	１６回　トヨタ自動車社債	200,000,000	204,948,000	
	９４回　丸紅社債	100,000,000	103,738,000	

４５回　住友商事社債	100,000,000	103,182,000	
４７回　住友商事社債	100,000,000	102,908,000	
４８回　クレディセゾン社債	100,000,000	103,385,000	
５７回　東京三菱銀行社債	200,000,000	216,846,000	
７回　東京三菱銀行劣後社債	200,000,000	204,774,000	
２５回　三菱東京ＵＦＪ銀行劣後社債	200,000,000	204,822,000	
２８回　三菱東京ＵＦＪ銀行劣後社債	200,000,000	206,390,000	
３２回　三菱東京ＵＦＪ銀行劣後社債	300,000,000	311,637,000	
６回　りそな銀行劣後社債	100,000,000	102,757,000	
７回　三菱ＵＦＪ信託銀行劣後債	200,000,000	204,920,000	
９回　三菱ＵＦＪ信託銀行劣後債	100,000,000	103,871,000	
１２回　住友信託銀行劣後債	100,000,000	102,534,000	
１０回　三井住友信託銀行社債	200,000,000	203,716,000	
１０回　セブン銀行社債	100,000,000	103,004,000	
２２回　三井住友銀行劣後社債	200,000,000	204,998,000	
２３回　三井住友銀行劣後社債	400,000,000	412,676,000	
１５回　トヨタファイナンス社債	200,000,000	206,340,000	
４７回　日立キャピタル社債	200,000,000	205,232,000	
１４回　大和証券グループ本社社債	100,000,000	101,707,000	
２６回　野村ホールディングス社債	100,000,000	102,793,000	
４２回　野村ホールディングス社債	200,000,000	203,726,000	
４６回　野村ホールディングス社債	200,000,000	200,628,000	
３８回　三井不動産社債	200,000,000	203,968,000	
７２回　三菱地所社債	100,000,000	111,899,000	
８７回　住友不動産社債	100,000,000	100,966,000	
１５回　東日本旅客鉄道社債	300,000,000	314,619,000	
１９回　東日本旅客鉄道社債	100,000,000	107,615,000	
２１回　東日本旅客鉄道社債	100,000,000	107,493,000	
３９回　東日本旅客鉄道社債	300,000,000	336,519,000	
４２回　東日本旅客鉄道社債	200,000,000	225,830,000	
９回　西日本旅客鉄道社債	200,000,000	214,988,000	
１０回　西日本旅客鉄道社債	300,000,000	327,804,000	
５回　東海旅客鉄道社債	100,000,000	103,342,000	
６回　東海旅客鉄道社債	100,000,000	107,653,000	
１１回　東海旅客鉄道社債	300,000,000	312,807,000	
１３回　東海旅客鉄道社債	200,000,000	219,094,000	
１４回　東海旅客鉄道社債	100,000,000	110,929,000	
４回　東京地下鉄社債	120,000,000	139,432,800	
６０回　日本電信電話社債	300,000,000	307,875,000	
４９６回　中部電力社債	500,000,000	510,510,000	
５１８回　中部電力社債	200,000,000	199,912,000	
３７７回　中国電力社債	400,000,000	416,756,000	
３７９回　中国電力社債	300,000,000	303,621,000	
２６０回　北陸電力社債	100,000,000	103,640,000	
３０１回　北陸電力社債	100,000,000	104,107,000	
３０７回　北陸電力社債	100,000,000	105,011,000	
４７１回　東北電力社債	400,000,000	417,784,000	
４７３回　東北電力社債	300,000,000	303,516,000	
２５３回　四国電力社債	200,000,000	207,106,000	
４２４回　九州電力社債	200,000,000	209,510,000	

	４２６回　九州電力社債	400,000,000	415,704,000	
	３２０回　北海道電力社債	200,000,000	202,544,000	
	３２１回　北海道電力社債	161,000,000	165,936,260	
	３４０回　北海道電力社債	300,000,000	299,628,000	
	１３回　電源開発社債	200,000,000	222,122,000	
	３８回　電源開発社債	300,000,000	310,599,000	
	２３回　東京瓦斯社債	300,000,000	312,150,000	
	１８回　大阪ガス社債	100,000,000	105,559,000	
	２７回　ＮＴＴデータ社債	100,000,000	103,323,000	
社債券　合計		14,581,000,000	15,127,644,060	
合計		316,447,260,000	339,315,188,586	

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29年10月12日現在	平成30年10月12日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		503,035,033	412,192,140
投資証券		32,276,486,900	30,974,659,260
派生商品評価勘定		－	2,770,092
未収入金		306,611,341	4,123,781,900
未収配当金		291,821,153	372,030,177
前払金		8,249,344	－
差入委託証拠金		6,189,056	10,492,092
流動資産合計		33,392,392,827	35,895,925,661
資産合計		33,392,392,827	35,895,925,661
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		9,785,344	－
前受金		－	8,561,592
未払金		238,708,322	－
未払解約金		－	933,441,100
流動負債合計		248,493,666	942,002,692
負債合計		248,493,666	942,002,692
純資産の部			
元本等			
元本	※1	19,934,508,415	18,823,627,962
剰余金			
剰余金又は欠損金（△）		13,209,390,746	16,130,295,007
元本等合計		33,143,899,161	34,953,922,969
純資産合計		33,143,899,161	34,953,922,969
負債純資産合計		33,392,392,827	35,895,925,661

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	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	15,779,427,934円
同期中一部解約元本額	7,717,970,587円	16,890,308,387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	280,843円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	1,086,594円	1,043,545円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	2,923,343円	2,059,335円
グローバル８資産ラップファンド（安定型）	949,386円	1,947,882円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	1,108,712円	2,803,635円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	1,957,452円	2,608,500円
たわらノーロード　国内リート	891,585,001円	1,507,521,334円
たわらノーロード　国内リート＜ラップ向け＞	201,188,801円	581,568,842円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	8,337,173円	84,219,485円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	－円	1,085,989円
たわらノーロード　バランス（標準型）	－円	22,327,336円
たわらノーロード　バランス（積極型）	－円	37,826,155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	10,219,217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	34,805,451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	23,100,049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	47,696,714円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	－円	158,328円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	－円	1,390,993円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	－円	916,194円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	－円	2,509,126円
マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	14,836,508円	14,015,062円
マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	349,167,083円	367,133,345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	2,122,432円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	17,580,102円	113,081,002円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	55,469,118円	98,264,882円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	119,349,456円	199,795,556円
投資のソムリエ	2,253,396,923円	2,696,770,852円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	125,316,503円	234,092,796円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	65,007,561円	80,069,705円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	31,750,474円	93,638,129円
ダイナミック・ナビゲーション	199,701円	535,629円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	402,965,199円	1,777,279,186円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	356,288円	713,168円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	356,288円	517,033円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	118,245円	559,025円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	－円	1,030,966円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	－円	298,782,794円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	－円	8,057円
Ｊリートインデックスファンド（ＤＣ）	5,931,659円	7,708,043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）	94,475,202円	90,762,161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）	1,832,580,723円	820,082,232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	7,928,752,440円
日米資産配分戦略ファンド（インカム重視型）（為替ヘッジあり）（適格機関投資家限定）	－円	63,619,023円
ＤＩＡＭグローバルβ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	880,959,211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	672,843,910円
計	19,934,508,415円	18,823,627,962円
２．　受益権の総数	19,934,508,415口	18,823,627,962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28年10月13日 至　平成29年10月12日	自　平成29年10月13日 至　平成30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、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。	同左
３．　金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	平成29年10月12日現在	平成30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 「（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った場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成29年10月12日現在	平成30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	△1,953,363,045	135,809,448
合計	△1,953,363,045	135,809,448

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成29年6月7日から平成29年10月12日まで及び平成30年6月7日から平成30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29年10月12日 現在				平成30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	607,932,000	－	610,740,000	2,808,000
合計	424,550,400	－	414,848,000	△9,702,400	607,932,000	－	610,740,000	2,808,000

（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29年10月12日現在	平成30年10月12日現在
１口当たり純資産額	1.6626円	1.8569円
（1万口当たり純資産額）	(16,626円)	(18,569円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

（１）株式

該当事項はありません。

（２）株式以外の有価証券

平成30年10月12日現在

種　類	銘　柄	券面総額 （円）	評価額 （円）	備考
投資証券	ＣＲＥロジスティクスファンド投資法人	365	39,493,000	
	ＧＬＰ投資法人	9,045	999,472,500	
	ＭＣＵＢＳ　ＭｉｄＣｉｔｙ投資法人	4,113	349,193,700	
	Ｏｎｅリート投資法人	532	127,946,000	
	いちごオフィスリート投資法人	3,028	280,090,000	
	いちごホテルリート投資法人	638	88,235,400	
	さくら総合リート投資法人	790	70,547,000	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	1,749	839,520,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人	3,557	1,019,436,200	
	イオンリート投資法人	3,747	454,511,100	
	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	21,637	346,841,110	
	インヴィンシブル投資法人	12,773	598,415,050	
	オリックス不動産投資法人	7,273	1,265,502,000	
	グローバル・ワン不動産投資法人	2,334	266,542,800	
	ケネディクス・オフィス投資法人	1,129	804,977,000	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	2,165	371,297,500	
	ケネディクス商業リート投資法人	1,338	322,591,800	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	1,392	372,638,400	
	サムティ・レジデンシャル投資法人	731	65,570,700	
	ザイマックス・リート投資法人	337	38,350,600	
	ジャパン・ホテル・リート投資法人	10,569	860,316,600	
	ジャパンエクセレント投資法人	3,269	488,715,500	
	ジャパンリアルエステイト投資法人	3,650	2,113,350,000	
	スターアジア不動産投資法人	1,133	117,038,900	
	スターツプロシード投資法人	575	98,210,000	
	タカラレーベン不動産投資法人	546	47,938,800	
	トーセイ・リート投資法人	587	67,152,800	
	ヒューリックリート投資法人	2,632	427,700,000	
	フロンティア不動産投資法人	1,242	541,512,000	
	プレミア投資法人	3,470	404,255,000	
	ヘルスケア＆メディカル投資法人	483	54,627,300	
	マリモ地方創生リート投資法人	314	35,011,000	
	ユナイテッド・アーバン投資法人	8,050	1,402,310,000	
	ラサールロジポート投資法人	2,754	282,009,600	
	阪急阪神リート投資法人	1,514	212,868,400	
	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	623	204,967,000	
	三菱地所物流リート投資法人	386	95,380,600	
	産業ファンド投資法人	4,253	485,267,300	
	森トラスト・ホテルリート投資法人	856	118,128,000	

	森トラスト総合リート投資法人	2,609	417,179,100	
	森ヒルズリート投資法人	4,186	586,040,000	
	星野リゾート・リート投資法人	555	304,695,000	
	積水ハウス・リート投資法人	9,418	680,921,400	
	大江戸温泉リート投資法人	589	50,771,800	
	大和ハウスリート投資法人	4,570	1,166,721,000	
	大和証券オフィス投資法人	842	564,140,000	
	投資法人みらい	849	162,498,600	
	東急リアル・エステート投資法人	2,447	381,487,300	
	日本アコモデーションファンド投資法人	1,213	612,565,000	
	日本ビルファンド投資法人	3,535	2,280,075,000	
	日本プライムリアルティ投資法人	2,311	927,866,500	
	日本プロロジスリート投資法人	4,896	1,096,214,400	
	日本ヘルスケア投資法人	167	29,642,500	
	日本リート投資法人	1,178	429,381,000	
	日本リテールファンド投資法人	6,899	1,404,636,400	
	日本ロジスティクスファンド投資法人	2,408	537,947,200	
	日本賃貸住宅投資法人	4,106	366,665,800	
	福岡リート投資法人	1,888	323,036,800	
	平和不動産リート投資法人	2,273	251,393,800	
	野村不動産マスターファンド投資法人	10,819	1,622,850,000	
投資証券　合計		193,337	30,974,659,260	
合計		193,337	30,974,659,260	

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29年10月12日現在	平成30年10月12日現在
資産の部			
流動資産			
預金		5,651,561,043	10,075,136,166
コール・ローン		268,115,912	596,850,688
株式		282,008,310,018	290,425,195,264
投資信託受益証券		798,785,653	698,118,371
投資証券		6,543,093,181	6,303,157,544
派生商品評価勘定		201,465,333	18,567,265
未収入金		8,520,388	188,087,295
未収配当金		293,191,790	336,342,104
差入委託証拠金		1,597,210,020	2,833,142,613
流動資産合計		297,370,253,338	311,474,597,310
資産合計		297,370,253,338	311,474,597,310
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		543,550	727,057,421
未払解約金		472,640,000	887,541,000
流動負債合計		473,183,550	1,614,598,421
負債合計		473,183,550	1,614,598,421
純資産の部			
元本等			
元本	※1	88,453,274,390	89,642,239,133
剰余金			
剰余金又は欠損金（△）		208,443,795,398	220,217,759,756
元本等合計		296,897,069,788	309,859,998,889
純資産合計		296,897,069,788	309,859,998,889
負債純資産合計		297,370,253,338	311,474,597,310

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。** **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。** **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。** **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。**
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。**
４．　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	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	25,396,342,560円
同期中一部解約元本額	29,776,351,454円	24,207,377,817円
元本の内訳		
ファンド名		
ＤＩＡＭ外国株式パッシブ・ファンド	1,500,759,815円	2,638,181,967円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	2,952,003円	2,913,395円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	7,416,677円	8,722,459円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	19,987,131円	17,210,299円
グローバル８資産ラップファンド（安定型）	7,484,878円	20,527,857円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	7,682,961円	23,048,530円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	13,499,602円	22,143,577円
たわらノーロード　先進国株式	4,471,783,454円	7,715,472,661円
たわらノーロード　先進国株式＜ラップ向け＞	425,029円	424,170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	913,386,536円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	4,162,856円	43,357,338円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	－円	3,180,770円
たわらノーロード　バランス（標準型）	－円	30,643,847円
たわらノーロード　バランス（積極型）	－円	58,912,437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	200,628円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（安定型）	－円	13,473,000円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（安定成長型）	－円	39,630,983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	30,040,456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	70,805,494円
たわらノーロード　最適化バランス（保守型）	－円	14,928円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	－円	61,750円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	－円	642,860円

たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	－円	554,670円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	－円	1,827,756円
ＤＩＡＭ外国株式インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	36,248,641,542円	39,512,031,956円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型	163,816,147円	158,416,607円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型	857,026,223円	838,916,152円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型	1,040,064,596円	1,056,140,169円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド	135,530,066円	123,352,569円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド	389,058,681円	357,204,541円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０インデックスファンド	330,441,705円	318,837,293円
マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	35,350,510円	30,441,363円
マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	831,794,009円	796,380,003円
マネックス資産設計ファンド　エボリューション	200,977,464円	209,146,305円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	30,287,665円	196,337,172円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	70,337,364円	124,912,903円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	132,555,525円	221,831,396円
投資のソムリエ	3,198,792,059円	2,561,519,510円
クルーズコントロール	529,164,076円	407,756,197円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	175,260,706円	222,689,229円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	112,222,016円	135,266,314円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス・Ｆ（成長型）	61,949,596円	85,144,549円
クルーズコントロール＜ＤＣ年金＞	176,323円	236,244円
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（堅実型）	2,336,372円	2,405,749円
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（積極型）	7,273,627円	6,300,167円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	31,606,974円	70,852,416円
ダイナミック・ナビゲーション	1,646,742円	1,428,890円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	402,698,402円	1,340,930,384円
ワールドアセットバランス（基本コース）	376,390,776円	609,630,220円
ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）	1,182,935,075円	2,115,016,080円

投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	455,321円	1,288,905円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	455,344円	928,926円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	120,612円	419,590円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	－円	1,765,184円
４資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	－円	5,073,861円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	－円	225,974,073円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	－円	13,989円
ＤＩＡＭ外国株式インデックスファンドＶＡ（適格機関投資家専用）	110,699,871円	91,118,948円
ＤＩＡＭ外国株式パッシブ私募ファンド（適格機関投資家向け）	2,964,558,782円	2,865,678,103円
ＤＩＡＭ先進国株式パッシブファンド（適格機関投資家限定）	161,291,968円	158,341,575円
外国株式パッシブ・ファンド２（適格機関投資家限定）	171,807,118円	206,237,678円
ＤＩＡＭワールドバランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	25,138,484円	20,111,940円
ＤＩＡＭグローバル・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	119,155,473円	82,409,794円
ＤＩＡＭグローバル・バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	255,180,569円	202,104,662円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	15,220,426円	10,658,870円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	111,060,683円	68,391,773円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	8,214,224円	5,688,290円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	13,833,399円	7,362,707円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	30,862,374円	21,802,018円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	76,913,785円	58,081,886円
ＤＩＡＭバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	624,620,278円	484,094,127円
ＤＩＡＭバランスファンド３７．５ＶＡ（適格機関投資家限定）	774,320,364円	602,767,403円
ＤＩＡＭバランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,391,175,141円	1,936,996,412円

ＤＩＡＭグローバル・アセット・バランスＶＡ（適格機関投資家限定）	882,809,453円	684,969,447円
ＤＩＡＭグローバル・アセット・バランスＶＡ２（適格機関投資家限定）	358,382,128円	110,822,092円
ＤＩＡＭ　アクサ　グローバルバランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,034,110,504円	785,732,551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）	678,263,358円	104,542,172円
ＤＩＡＭグローバルβ私募ファンド（適格機関投資家向け）	2,754,975円	2,754,975円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	614,773,286円	24,066,858円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド３５ＶＡ（適格機関投資家限定）	650,989,428円	17,108,371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）	8,547,165,090円	5,094,268,968円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	460,597,770円	282,718,187円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,462,455,020円	1,227,955,973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）	5,509,914,891円	4,705,201,284円
ＤＩＡＭバランス３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	13,592,785円	11,502,672円
ＤＩＡＭバランス５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	15,185,783円	8,825,591円
ＤＩＡＭバランス７０ＶＡ（適格機関投資家限定）	12,516,619円	10,114,789円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド４ＶＡ（適格機関投資家限定）	7,365,755,184円	6,301,456,431円
ＤＩＡＭバランス２０ＶＡ（適格機関投資家限定）	69,571,913円	53,919,416円
ＤＩＡＭバランス４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	159,561円	217,282円
ＤＩＡＭバランス６０ＶＡ（適格機関投資家限定）	263,069円	248,614円
計	88,453,274,390円	89,642,239,133円
２．　受益権の総数	88,453,274,390口	89,642,239,133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28年10月13日 至　平成29年10月12日	自　平成29年10月13日 至　平成30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、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
３．　金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	平成29年10月12日現在	平成30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 「（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った場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成29年10月12日現在	平成30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	21,429,512,211	△2,167,164,903
投資信託受益証券	△6,618,087	41,132,512
投資証券	262,194,403	68,180,059
合計	21,685,088,527	△2,057,852,332

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成29年2月16日から平成29年10月12日まで及び平成30年2月16日から平成30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29年10月12日 現在				平成30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	260,218,350	－	260,759,900	△541,550	321,129,975	－	321,057,130	72,845
アメリカ・ドル	162,850,310	－	163,035,800	△185,490	235,085,760	－	234,750,880	334,880
イギリス・ポンド	－	－	－	－	18,254,184	－	18,270,420	△16,236
オーストラリア・ドル	21,917,700	－	21,934,900	△17,200	2,144,097	－	2,158,110	△14,013
カナダ・ドル	11,682,000	－	11,742,800	△60,800	12,395,952	－	12,398,400	△2,448
ユーロ	63,768,340	－	64,046,400	△278,060	53,249,982	－	53,479,320	△229,338
買　建	－	－	－	－	5,214,820,752	－	5,214,526,160	△294,592
アメリカ・ドル	－	－	－	－	3,748,545,733	－	3,748,275,040	△270,693
イギリス・ポンド	－	－	－	－	185,983,473	－	185,972,080	△11,393
オーストラリア・ドル	－	－	－	－	135,581,801	－	135,561,280	△20,521
カナダ・ドル	－	－	－	－	200,971,870	－	200,957,400	△14,470
ユーロ	－	－	－	－	943,737,875	－	943,760,360	22,485
合計	260,218,350	－	260,759,900	△541,550	5,535,950,727	－	5,535,583,290	△221,747

（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。

①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。

②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29年10月12日 現在				平成30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	7,207,430,951	－	7,408,894,284	201,463,333	18,032,835,931	－	17,324,567,522	△708,268,409
合計	7,207,430,951	－	7,408,894,284	201,463,333	18,032,835,931	－	17,324,567,522	△708,268,409

（注）１．時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

２．先物取引の残高表示は、契約額によっております。

３．契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	平成29年10月12日現在	平成30年10月12日現在
１口当たり純資産額	3.3565円	3.4566円
（1万口当たり純資産額）	(33,565円)	(34,566円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

（１）株式

平成30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	30,663	1,719.360	52,720,735.680	
	ABBOTT LABORATORIES	129,962	68.380	8,886,801.560	
	AES CORP	45,579	14.440	658,160.760	
	ABIOMED INC	3,100	367.540	1,139,374.000	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	68,075	139.020	9,463,786.500	
	ADVANCED MICRO DEVICES	68,629	25.300	1,736,313.700	
	ADOBE INC	36,476	238.590	8,702,808.840	
	CHUBB LTD	34,634	126.820	4,392,283.880	
	AGCO CORP	5,610	56.220	315,394.200	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	16,380	157.090	2,573,134.200	
	ALLEGHANY CORP	1,054	599.340	631,704.360	
	RALPH LAUREN CORP	3,497	117.650	411,422.050	
	ALLSTATE CORP	25,754	93.170	2,399,500.180	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	55,523	153.620	8,529,443.260	
	AMGEN INC	49,209	193.850	9,539,164.650	
	HESS CORP	20,421	65.500	1,337,575.500	
	AMERICAN EXPRESS CO	53,581	101.580	5,442,757.980	
	AMERICAN ELECTRIC POWER	36,659	71.220	2,610,853.980	
	AFLAC INC	56,436	44.490	2,510,837.640	
	AMERICAN INTL GROUP	66,725	50.140	3,345,591.500	
	AMERCO	551	332.220	183,053.220	
	ANALOG DEVICES	27,711	83.670	2,318,579.370	
	ANADARKO PETROLEUM CORP	39,893	66.280	2,644,108.040	
	ALEXION PHARMACEUTICALS INC	16,015	119.310	1,910,749.650	
	JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	69,855	33.730	2,356,209.150	
	JONES LANG LASALLE INC	2,818	131.300	370,003.400	
	VALERO ENERGY CORP	32,105	106.890	3,431,703.450	
	APACHE CORP	30,595	44.630	1,365,454.850	
	ANSYS INC	6,519	153.510	1,000,731.690	
	APPLE INC	365,473	214.450	78,375,684.850	
	APPLIED MATERIALS INC	77,970	32.790	2,556,636.300	
	ALBEMARLE CORP	7,904	94.360	745,821.440	
	ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	42,401	48.670	2,063,656.670	
	PINNACLE WEST CAPITAL CORP	7,831	81.300	636,660.300	
	AMEREN CORP	17,312	64.040	1,108,660.480	

ARROW ELECTRONICS INC	5,756	67.500	388,530.000	
AUTOLIV INC	6,197	80.500	498,858.500	
AUTODESK INC	16,259	130.890	2,128,140.510	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	33,092	138.180	4,572,652.560	
AUTOZONE INC	2,015	769.010	1,549,555.150	
AVERY DENNISON CORP	6,262	97.190	608,603.780	
AVNET INC	10,288	39.480	406,170.240	
BALL CORP	24,324	43.510	1,058,337.240	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	94,579	205.190	19,406,665.010	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	73,749	49.190	3,627,713.310	
BAXTER INTERNATIONAL INC	37,776	70.170	2,650,741.920	
BECTON DICKINSON & CO	19,749	238.490	4,709,939.010	
AMETEK INC	16,775	71.850	1,205,283.750	
VERIZON COMM INC	306,879	53.330	16,365,857.070	
WR BERKLEY CORP	8,134	74.410	605,250.940	
BEST BUY CO INC	19,210	70.750	1,359,107.500	
YUM! BRANDS INC	23,738	87.070	2,066,867.660	
FIRSTENERGY CORP	35,496	37.210	1,320,806.160	
H&R BLOCK INC	16,114	25.970	418,480.580	
BOEING CO	41,469	358.110	14,850,463.590	
ROBERT HALF INTL INC	8,158	64.400	525,375.200	
BORGWARNER INC	14,648	37.870	554,719.760	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	101,641	36.000	3,659,076.000	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	9,894	91.110	901,442.340	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	8,731	122.260	1,067,452.060	
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	1,838	554.450	1,019,079.100	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	121,395	57.500	6,980,212.500	
AFFILIATED MANAGERS GROUP INC	3,788	123.190	466,643.720	
INGREDION INC	5,305	100.000	530,500.000	
ONEOK INC	30,787	65.220	2,007,928.140	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	5,900	104.060	613,954.000	
UNITED RENTALS INC	6,332	139.840	885,466.880	
SEMPRA ENERGY	18,112	114.470	2,073,280.640	
FEDEX CORP	18,964	217.420	4,123,152.880	
VERISIGN INC	7,896	139.120	1,098,491.520	
AMPHENOL CORP	23,100	84.260	1,946,406.000	
BROWN-FORMAN CORP	19,683	45.750	900,497.250	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	127,092	5.970	758,739.240	
CSX CORP	62,392	68.770	4,290,697.840	
CABOT OIL & GAS CORP	32,261	23.190	748,132.590	
CAMPBELL SOUP CO	14,050	37.140	521,817.000	

SEAGATE TECHNOLOGY	20,613	43.340	893,367.420	
CONSTELLATION BRANDS INC	12,969	217.770	2,824,259.130	
CARDINAL HEALTH INC	22,125	51.530	1,140,101.250	
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	31,716	57.850	1,834,770.600	
CATERPILLAR INC	44,558	140.970	6,281,341.260	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	9,832	110.270	1,084,174.640	
CELGENE CORP	56,186	80.710	4,534,772.060	
CITRIX SYSTEMS INC	10,896	102.110	1,112,590.560	
CENTURYLINK INC	73,540	20.140	1,481,095.600	
CERNER CORP	22,947	61.600	1,413,535.200	
JPMORGAN CHASE & CO	254,725	108.130	27,543,414.250	
CHURCH & DWIGHT CO INC	18,822	54.870	1,032,763.140	
CIGNA CORP	18,009	206.000	3,709,854.000	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	10,982	72.960	801,246.720	
CINTAS CORP	6,282	184.020	1,156,013.640	
CISCO SYSTEMS INC	349,354	44.120	15,413,498.480	
CLOROX COMPANY	9,331	142.180	1,326,681.580	
COCA-COLA CO/THE	298,559	44.640	13,327,673.760	
COPART INC	15,900	49.050	779,895.000	
COGNEX CORP	11,508	43.660	502,439.280	
COLGATE-PALMOLIVE CO	62,296	62.350	3,884,155.600	
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	22,744	114.630	2,607,144.720	
COMERICA INC	12,068	85.800	1,035,434.400	
COMCAST CORP-CL A	345,846	33.670	11,644,634.820	
CA INC	22,732	43.470	988,160.040	
CONAGRA BRANDS INC	28,323	34.870	987,623.010	
CONSOLIDATED EDISON INC	23,350	76.050	1,775,767.500	
CMS ENERGY CORP	19,291	49.210	949,310.110	
COOPER COS INC	3,794	250.590	950,738.460	
MOLSON COORS BREWING CO	13,855	59.590	825,619.450	
CORNING INC	61,112	31.340	1,915,250.080	
SEALED AIR CORP	13,870	34.940	484,617.800	
CUMMINS INC	11,239	145.470	1,634,937.330	
DR HORTON INC	24,498	37.920	928,964.160	
DANAHER CORP	47,175	101.270	4,777,412.250	
MOODY'S CORP	12,963	153.310	1,987,357.530	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	43,966	70.290	3,090,370.140	
TARGET CORP	37,486	82.800	3,103,840.800	
DEERE & CO	22,801	146.470	3,339,662.470	
MORGAN STANLEY	99,843	43.490	4,342,172.070	
REPUBLIC SERVICES INC	17,375	70.100	1,217,987.500	
COSTAR GROUP INC	2,786	375.000	1,044,750.000	
THE WALT DISNEY CO	112,062	111.150	12,455,691.300	
DOLLAR TREE INC	17,493	79.510	1,390,868.430	

DOVER CORP	10,736	81.340	873,266.240	
OMNICOM GROUP	16,993	68.070	1,156,713.510	
DTE ENERGY CO	13,122	110.580	1,451,030.760	
DUKE ENERGY CORP	52,625	79.980	4,208,947.500	
FLOWSERVE CORP	8,406	49.420	415,424.520	
DARDEN RESTAURANTS INC	9,436	104.050	981,815.800	
EBAY INC	71,564	31.400	2,247,109.600	
BANK OF AMERICA CORP	722,337	28.360	20,485,477.320	
CITIGROUP INC	190,608	68.380	13,033,775.040	
EASTMAN CHEMICAL CO	10,193	82.050	836,335.650	
E*TRADE FINANCIAL CORP	18,740	49.520	928,004.800	
EATON CORP PLC	32,234	79.530	2,563,570.020	
EATON VANCE CORP	9,184	46.660	428,525.440	
CADENCE DESIGN SYS INC	20,877	39.130	816,917.010	
DISH NETWORK CORP	16,150	31.870	514,700.500	
ECOLAB INC	19,009	145.950	2,774,363.550	
ELECTRONIC ARTS INC	23,050	103.600	2,387,980.000	
SALESFORCE.COM INC	52,600	139.240	7,324,024.000	
EMERSON ELECTRIC CO	47,931	71.200	3,412,687.200	
ATMOS ENERGY CORP	8,221	93.350	767,430.350	
ENTERGY CORP	13,599	81.200	1,104,238.800	
EOG RESOURCES INC	43,300	121.620	5,266,146.000	
EQUIFAX INC	8,495	118.520	1,006,827.400	
EQT CORP	20,049	45.350	909,222.150	
ESTEE LAUDER COS INC/THE	16,134	128.080	2,066,442.720	
EXPEDITORS INTERNATIONAL	12,550	66.480	834,324.000	
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	41,833	93.740	3,921,425.420	
EXXON MOBIL CORP	315,280	81.600	25,726,848.000	
FMC CORP	10,614	83.160	882,660.240	
NEXTERA ENERGY INC	35,113	169.090	5,937,257.170	
ASSURANT INC	4,089	103.150	421,780.350	
FASTENAL CO	21,654	51.250	1,109,767.500	
FIFTH THIRD BANCORP	52,173	27.230	1,420,670.790	
M&T BANK CORP	10,399	160.450	1,668,519.550	
FISERV INC	30,704	75.900	2,330,433.600	
FLIR SYSTEMS INC	11,623	55.200	641,589.600	
MACY'S INC	24,741	32.140	795,175.740	
FORD MOTOR CO	278,818	8.810	2,456,386.580	
FRANKLIN RESOURCES INC	22,314	28.540	636,841.560	
FREEPORT-MCMORAN INC	96,812	13.230	1,280,822.760	
FLEX LTD	35,913	11.790	423,414.270	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	12,176	71.290	868,027.040	
GAP INC/THE	18,295	26.630	487,195.850	
DENTSPLY SIRONA INC	17,477	35.680	623,579.360	
GENERAL DYNAMICS CORP	19,047	192.940	3,674,928.180	
GENERAL MILLS INC	44,775	42.850	1,918,608.750	
GENUINE PARTS CO	11,759	94.750	1,114,165.250	
GILEAD SCIENCES INC	97,302	72.500	7,054,395.000	

GARTNER INC	7,153	145.050	1,037,542.650	
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	18,097	20.500	370,988.500	
MCKESSON CORP	15,054	129.240	1,945,578.960	
NVIDIA CORP	42,765	235.130	10,055,334.450	
GENERAL ELECTRIC CO	641,549	12.720	8,160,503.280	
WW GRAINGER INC	3,832	309.000	1,184,088.000	
HALLIBURTON CO	66,065	39.750	2,626,083.750	
MONSTER BEVERAGE CORP	32,522	52.830	1,718,137.260	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	26,624	212.970	5,670,113.280	
HARLEY-DAVIDSON INC	12,901	40.930	528,037.930	
HARRIS CORP	8,954	154.220	1,380,885.880	
HASBRO INC	9,136	97.810	893,592.160	
HENRY SCHEIN INC	11,426	83.540	954,528.040	
HELMERICH & PAYNE INC	7,213	68.240	492,215.120	
HERSHEY FOODS CORP	10,132	102.090	1,034,375.880	
HP INC	122,725	23.010	2,823,902.250	
F5 NETWORKS INC	4,874	164.710	802,796.540	
CROWN HOLDINGS INC NPR	10,472	45.500	476,476.000	
UNITED THERAPEUTICS CORP	3,447	121.380	418,396.860	
JUNIPER NETWORKS INC	27,740	26.780	742,877.200	
HOLLYFRONTIER CORP	12,551	66.040	828,868.040	
HOLOGIC INC	19,133	39.340	752,692.220	
UNUM GROUP	16,000	36.910	590,560.000	
HOME DEPOT INC	85,485	189.740	16,219,923.900	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	12,887	97.300	1,253,905.100	
HORMEL FOODS CORP	19,345	39.680	767,609.600	
CENTERPOINT ENERGY INC	31,952	27.150	867,496.800	
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,337	198.500	463,894.500	
HUMANA INC	10,468	319.910	3,348,817.880	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	5,927	110.290	653,688.830	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	82,761	14.700	1,216,586.700	
RED HAT INC	13,147	117.380	1,543,194.860	
NEKTAR THERAPEUTICS	12,000	47.900	574,800.000	
BIOGEN INC	15,971	327.270	5,226,829.170	
IDEX CORP	5,924	134.180	794,882.320	
ILLINOIS TOOL WORKS	22,895	129.350	2,961,468.250	
INTUIT INC	18,126	200.690	3,637,706.940	
IDEXX LABORATORIES INC	6,255	214.110	1,339,258.050	
INGERSOLL-RAND PLC	18,874	95.930	1,810,582.820	
INTEL CORP	348,219	44.230	15,401,726.370	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	5,578	132.630	739,810.140	
INTERNATIONAL PAPER CO	28,375	42.820	1,215,017.500	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	29,157	21.600	629,791.200	

JACOBS ENGINEERING GROUP INC	9,631	72.190	695,261.890	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	5,919	147.320	871,987.080	
INCYTE CORP	12,360	61.750	763,230.000	
JOHNSON & JOHNSON	198,834	133.840	26,611,942.560	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	25,530	46.820	1,195,314.600	
KLA-TENCOR CORP	11,724	91.770	1,075,911.480	
DEVON ENERGY CORP	39,484	36.040	1,423,003.360	
KELLOGG CO	18,922	67.620	1,279,505.640	
EAST WEST BANCORP INC	11,000	57.290	630,190.000	
KEYCORP	79,276	19.240	1,525,270.240	
KIMBERLY-CLARK CORP	26,156	108.130	2,828,248.280	
BLACKROCK INC/NEW YORK	8,949	417.680	3,737,818.320	
KOHLS CORP	11,357	70.820	804,302.740	
KROGER CO	60,317	26.740	1,612,876.580	
LAM RESEARCH CORP	12,122	137.620	1,668,229.640	
PACKAGING CORP OF AMERICA	7,057	88.360	623,556.520	
AKAMAI TECHNOLOGIES	12,622	61.340	774,233.480	
LEGGETT & PLATT INC	9,588	39.060	374,507.280	
LENNAR CORP	21,933	43.310	949,918.230	
JEFFERIES FINANCIAL GROUP INC	21,462	20.770	445,765.740	
ELI LILLY & CO	73,039	107.910	7,881,638.490	
L BRANDS INC	16,262	30.210	491,275.020	
LINCOLN NATIONAL CORP	16,362	63.990	1,047,004.380	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	51,308	113.760	5,836,798.080	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	25,175	64.890	1,633,605.750	
LOCKHEED MARTIN CORP	19,173	326.260	6,255,382.980	
LOEWS CORP	21,346	47.240	1,008,385.040	
LOWE'S COS INC	60,996	104.230	6,357,613.080	
DOMINION ENERGY INC	48,002	71.780	3,445,583.560	
SCANA CORP	10,902	39.770	433,572.540	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	40,298	25.950	1,045,733.100	
MCCORMICK & CO INC	9,307	131.670	1,225,452.690	
MCDONALD'S CORPORATION	58,315	162.970	9,503,595.550	
S&P GLOBAL INC	18,409	180.030	3,314,172.270	
EVEREST RE GROUP LTD	2,855	215.000	613,825.000	
MANPOWERGROUP INC	4,257	75.880	323,021.160	
MARKEL CORPORATION	989	1,131.050	1,118,608.450	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	16,081	139.770	2,247,641.370	
MARSH & MCLENNAN COS	37,853	79.640	3,014,612.920	
MASCO CORP	23,043	32.600	751,201.800	

MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	4,387	168.860	740,788.820	
MATTEL INC	24,003	13.990	335,801.970	
METLIFE INC	64,937	43.760	2,841,643.120	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	20,342	51.520	1,048,019.840	
MEDTRONIC PLC	100,647	93.110	9,371,242.170	
ACTIVISION BLIZZARD INC	54,568	73.850	4,029,846.800	
CVS HEALTH CORP	75,876	73.190	5,553,364.440	
MERCK & CO.INC.	201,289	68.370	13,762,128.930	
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	31,900	16.360	521,884.000	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	7,176	168.250	1,207,362.000	
MICROSOFT CORP	542,300	105.910	57,434,993.000	
MICRON TECH INC	86,870	41.970	3,645,933.900	
MIDDLEBY CORP	4,100	114.110	467,851.000	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	17,529	67.700	1,186,713.300	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	45,086	17.720	798,923.920	
3M CO	44,134	196.730	8,682,481.820	
MOHAWK INDUSTRIES INC	4,873	157.220	766,133.060	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	12,062	117.940	1,422,592.280	
KANSAS CITY SOUTHERN	7,247	102.950	746,078.650	
MYLAN NV	38,244	32.600	1,246,754.400	
ILLUMINA INC	11,065	307.450	3,401,934.250	
XCEL ENERGY INC	37,554	47.620	1,788,321.480	
NATIONAL OILWELL VARCO INC	26,938	41.900	1,128,702.200	
NETAPP INC	20,587	73.960	1,522,614.520	
NEWFIELD EXPLORATION CO	13,740	25.180	345,973.200	
NEWELL BRANDS INC	36,206	17.670	639,760.020	
NEWMONT MINING CORP	38,093	32.720	1,246,402.960	
NVR INC	236	2,272.880	536,399.680	
NIKE INC-CL B	95,097	74.510	7,085,677.470	
NOBLE ENERGY INC	36,582	30.980	1,133,310.360	
NORDSTROM INC	9,487	59.290	562,484.230	
NORFOLK SOUTHERN CORP	21,159	168.130	3,557,462.670	
EVERSOURCE ENERGY	23,085	61.680	1,423,882.800	
NISOURCE INC	31,548	24.650	777,658.200	
TAPESTRY INC	22,269	42.680	950,440.920	
NORTHERN TRUST CORP	16,090	99.160	1,595,484.400	
NORTHROP GRUMMAN CORP	12,188	297.620	3,627,392.560	
WELLS FARGO & CO	344,095	51.440	17,700,246.800	
NUCOR CORP	23,780	60.460	1,437,738.800	
CHENIERE ENERGY INC	15,927	63.900	1,017,735.300	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	36,024	90.940	3,276,022.560	

OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	56,876	76.530	4,352,720.280	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	4,917	136.310	670,236.270	
OGE ENERGY CORP	16,028	36.280	581,495.840	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	6,375	330.350	2,105,981.250	
ORACLE CORP	227,904	46.780	10,661,349.120	
PACCAR INC	26,537	62.850	1,667,850.450	
EXELON CORP	69,910	42.730	2,987,254.300	
PARKER HANNIFIN CORP	9,885	165.600	1,636,956.000	
PAYCHEX INC	23,141	67.530	1,562,711.730	
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	6,526	54.860	358,016.360	
ALIGN TECHNOLOGY INC	5,854	312.860	1,831,482.440	
PPL CORPORATION	52,183	29.970	1,563,924.510	
PEPSICO INC	104,692	105.060	10,998,941.520	
PENTAIR PLC	11,775	39.200	461,580.000	
PFIZER INC	433,636	42.810	18,563,957.160	
CONOCOPHILLIPS	87,473	72.790	6,367,159.670	
PVH CORP	5,387	124.300	669,604.100	
PG&E CORP	38,695	46.620	1,803,960.900	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	12,758	171.660	2,190,038.280	
ALTRIA GROUP INC	141,336	61.120	8,638,456.320	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	35,408	131.610	4,660,046.880	
POLARIS INDUSTRIES INC	3,845	93.170	358,238.650	
GARMIN LTD	7,795	62.970	490,851.150	
AETNA INC	23,744	198.950	4,723,868.800	
FLUOR CORP (NEW)	9,821	46.530	456,971.130	
PPG INDUSTRIES INC	19,079	96.380	1,838,834.020	
IPG PHOTONICS CORP	2,441	131.860	321,870.260	
PRAXAIR INC	21,319	154.260	3,288,668.940	
COSTCO WHOLESALE CORP	32,871	221.820	7,291,445.220	
T ROWE PRICE GROUP INC	18,363	98.510	1,808,939.130	
QUEST DIAGNOSTICS	10,378	100.440	1,042,366.320	
PROCTER & GAMBLE CO	186,535	78.870	14,712,015.450	
PROGRESSIVE CORP	43,996	66.970	2,946,412.120	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	37,115	53.590	1,988,992.850	
PULTE GROUP INC	21,209	23.310	494,381.790	
NEW YORK COMMUNITY BANCORP INC	30,388	10.120	307,526.560	
GLOBAL PAYMENTS INC	11,769	112.780	1,327,307.820	
QUALCOMM INC	104,477	64.290	6,716,826.330	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	10,187	87.720	893,603.640	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	2,550	133.110	339,430.500	

REGENERON PHARMACEUTICALS	5,659	371.670	2,103,280.530	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA INC	4,642	136.280	632,611.760	
RESMED INC	10,594	101.840	1,078,892.960	
US BANCORP	116,678	51.820	6,046,253.960	
SEATTLE GENETICS INC /WA	7,317	70.880	518,628.960	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	31,422	27.320	858,449.040	
ROSS STORES INC	28,189	94.320	2,658,786.480	
ROLLINS INC	8,252	55.550	458,398.600	
ROPER TECHNOLOGIES INC	7,723	273.270	2,110,464.210	
ROCKWELL AUTOMATION INC	9,567	170.600	1,632,130.200	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	12,293	116.850	1,436,437.050	
RAYTHEON COMPANY	21,317	190.990	4,071,333.830	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	3,848	211.690	814,583.120	
ACCENTURE PLC-CL A	47,780	156.000	7,453,680.000	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	111,556	41.190	4,594,991.640	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	9,849	136.070	1,340,153.430	
ROCKWELL COLLINS INC	12,086	134.340	1,623,633.240	
THE TRAVELERS COMPANIES INC	19,755	124.310	2,455,744.050	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	24,562	101.170	2,484,937.540	
BOOKING HOLDINGS INC	3,571	1,781.710	6,362,486.410	
SCHLUMBERGER LTD	103,099	59.120	6,095,212.880	
SCHWAB (CHARLES) CORP	90,105	48.130	4,336,753.650	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	15,475	121.150	1,874,796.250	
BUNGE LTD	10,334	66.610	688,347.740	
SEI INVESTMENTS CO	9,315	54.830	510,741.450	
ANTHEM INC	19,325	268.520	5,189,149.000	
AMERISOURCEBERGEN CORP	12,257	87.310	1,070,158.670	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	21,442	55.620	1,192,604.040	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	6,319	407.220	2,573,223.180	
CENTENE CORP	15,113	138.930	2,099,649.090	
SVB FINANCIAL GROUP	4,107	292.890	1,202,899.230	
IAC INTERACTIVE CORP	5,766	193.200	1,113,991.200	
SMITH (A.O.) CORP	9,565	47.870	457,876.550	
ACUITY BRANDS INC	3,087	119.440	368,711.280	
SNAP-ON INC	3,932	167.820	659,868.240	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	31,808	97.700	3,107,641.600	
ADVANCE AUTO PARTS	5,273	161.040	849,163.920	
EDISON INTERNATIONAL	24,600	68.410	1,682,886.000	
SOUTHERN CO	75,642	43.540	3,293,452.680	
BB&T CORP	59,388	47.440	2,817,366.720	

SOUTHWEST AIRLINES	11,352	57.030	647,404.560	
AT&T INC	540,606	31.750	17,164,240.500	
CHEVRON CORP	141,261	118.430	16,729,540.230	
STANLEY BLACK & DECKER INC	11,629	130.920	1,522,468.680	
STATE STREET CORP	27,099	81.730	2,214,801.270	
STARBUCKS CORP	104,312	54.860	5,722,556.320	
STEEL DYNAMICS INC	19,030	42.330	805,539.900	
STRYKER CORP	25,320	168.720	4,271,990.400	
NETFLIX INC	32,015	321.100	10,280,016.500	
STERICYCLE INC	6,853	52.990	363,140.470	
SUNTRUST BANKS INC	34,756	63.460	2,205,615.760	
SYMANTEC CORP	47,004	19.460	914,697.840	
KNIGHT SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	9,793	30.720	300,840.960	
SYNOPSYS INC	10,656	85.750	913,752.000	
SYSCO CORP	35,926	68.490	2,460,571.740	
INTUITIVE SURGICAL INC	8,408	508.220	4,273,113.760	
TELEFLEX INC	3,203	244.550	783,293.650	
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	71,553	20.450	1,463,258.850	
TEXAS INSTRUMENTS INC	73,391	99.530	7,304,606.230	
TEXTRON INC	19,076	65.070	1,241,275.320	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	30,141	226.090	6,814,578.690	
TIFFANY & CO	8,733	111.450	973,292.850	
TOLL BROTHERS INC	9,526	31.350	298,640.100	
TORCHMARK CORP	7,699	83.580	643,482.420	
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	11,279	90.150	1,016,801.850	
DAVITA INC	10,878	70.170	763,309.260	
TRACTOR SUPPLY CO	9,276	85.230	790,593.480	
TRIMBLE INC	20,073	37.970	762,171.810	
TYSON FOODS INC	21,621	60.230	1,302,232.830	
UGI CORP	12,068	53.730	648,413.640	
MARATHON OIL CORP	64,347	19.960	1,284,366.120	
UNION PACIFIC CORP	57,263	152.090	8,709,129.670	
UNITED TECHNOLOGIES CORP	56,111	129.370	7,259,080.070	
UNITEDHEALTH GROUP INC	71,700	257.120	18,435,504.000	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	6,351	120.850	767,518.350	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	6,848	103.970	711,986.560	
VF CORP	24,309	85.470	2,077,690.230	
CBS CORP	27,376	53.820	1,473,376.320	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	19,280	175.660	3,386,724.800	
VULCAN MATERIALS CO	10,136	100.370	1,017,350.320	

WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	63,286	70.900	4,486,977.400	
WALMART INC	109,762	93.920	10,308,847.040	
WASTE MANAGEMENT INC	32,216	88.040	2,836,296.640	
WATERS CORP	5,963	178.320	1,063,322.160	
ALLERGAN PLC	25,196	182.220	4,591,215.120	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	8,855	102.170	904,715.350	
VAIL RESORTS INC	3,098	239.610	742,311.780	
WESTERN DIGITAL CORP	22,254	54.130	1,204,609.020	
WABTEC CORP	5,497	96.890	532,604.330	
WHIRLPOOL CORP	5,553	104.350	579,455.550	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	13,529	85.260	1,153,482.540	
WYNN RESORTS LTD	7,179	116.220	834,343.380	
NASDAQ INC	9,132	79.650	727,363.800	
CME GROUP INC	25,415	176.030	4,473,802.450	
WILLIAMS COS INC	89,081	26.590	2,368,663.790	
LKQ CORP	22,948	28.320	649,887.360	
ALLIANT ENERGY CORP	16,383	42.620	698,243.460	
WEC ENERGY GROUP INC	23,117	67.520	1,560,859.840	
TD AMERITRADE HOLDING CORP	21,581	49.770	1,074,086.370	
CARMAX INC	13,513	67.850	916,857.050	
XEROX CORP	17,455	24.740	431,836.700	
XILINX INC	19,197	73.990	1,420,386.030	
CIMAREX ENERGY CO	7,003	94.560	662,203.680	
TJX COMPANIES INC	47,171	107.760	5,083,146.960	
ZIONS BANCORP NA	16,584	49.180	815,601.120	
DAIRY FARM INTERNATIONAL HLDNGS	27,400	8.530	233,722.000	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	76,400	6.080	464,512.000	
JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	15,700	57.990	910,443.000	
JARDINE STRATEGIC HOLDINGS LTD	17,100	33.780	577,638.000	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	6,051	79.300	479,844.300	
SIGNATURE BANK	4,171	111.870	466,609.770	
CBRE GROUP INC	24,276	39.010	947,006.760	
LIBERTY GLOBAL PLC	12,435	24.880	309,382.800	
REGIONS FINANCIAL CORP	84,486	17.740	1,498,781.640	
DOMINO'S PIZZA INC	3,256	270.880	881,985.280	
WESTLAKE CHEMICAL CORP	3,000	79.540	238,620.000	
T-MOBILE US INC	25,388	66.210	1,680,939.480	
LAS VEGAS SANDS CORP	30,271	55.490	1,679,737.790	
MOSAIC CO/THE	26,525	32.690	867,102.250	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX NEWS	32,515	44.790	1,456,346.850	

TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC	78,440	45.110	3,538,428.400	
CELANESE CORP	9,491	98.310	933,060.210	
DISCOVERY INC-A	10,423	31.020	323,321.460	
EXPEDIA GROUP INC	8,709	115.690	1,007,544.210	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	18,475	51.130	944,626.750	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	10,578	135.380	1,432,049.640	
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	41,818	24.370	1,019,104.660	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	43,585	72.490	3,159,476.650	
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	14,696	18.230	267,908.080	
VIACOM INC-CLASS B	24,612	31.190	767,648.280	
LIVE NATION	8,864	49.500	438,768.000	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,807	433.930	784,111.510	
UNITED CONTINENTAL HOLIDINGS INC	6,191	80.120	496,022.920	
TRANSDIGM GROUP INC	3,812	321.130	1,224,147.560	
MASTERCARD INC	69,052	194.510	13,431,304.520	
QURATE RETAIL INC	35,733	20.870	745,747.710	
HANESBRANDS INC	27,619	16.170	446,599.230	
WESTERN UNION CO	35,222	17.670	622,372.740	
OWENS CORNING	7,333	51.460	377,356.180	
LEIDOS HOLDINGS INC	9,322	64.750	603,599.500	
AERCAP HOLDINGS NV	11,586	52.840	612,204.240	
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLDINGS INC	9,175	83.080	762,259.000	
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT-ADR	18,099	18.200	329,401.800	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	8,330	115.730	964,030.900	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	22,746	16.470	374,626.620	
DELTA AIR LINES INC	13,898	51.480	715,469.040	
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	6,354	59.110	375,584.940	
DISCOVER FINANCIAL	25,202	74.180	1,869,484.360	
TE CONNECTIVITY LTD	26,204	78.660	2,061,206.640	
CONCHO RESOURCES INC/MIDLAND TX	14,552	150.560	2,190,949.120	
WABCO HOLDING INC	4,076	109.130	444,813.880	
LULULEMON ATHLETICA INC	7,883	140.510	1,107,640.330	
VMWARE INC	5,491	141.490	776,921.590	
MERCADOLIBRE INC	3,215	304.860	980,124.900	
ULTA BEAUTY INC	4,332	267.570	1,159,113.240	
INVESCO LTD	29,824	20.070	598,567.680	
MSCI INC	6,462	151.590	979,574.580	

PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	114,627	82.310	9,434,948.370	
VISA INC	134,179	133.730	17,943,757.670	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	13,492	87.450	1,179,875.400	
DISCOVERY INC-C	23,054	28.450	655,886.300	
MARATHON PETROLEUM CORP	53,981	78.730	4,249,924.130	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	11,624	48.000	557,952.000	
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	147,783	17.420	2,574,379.860	
XYLEM INC	12,873	69.040	888,751.920	
ALKERMES PLC	12,053	41.590	501,284.270	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	24,984	97.030	2,424,197.520	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,479	233.080	810,885.320	
SPLUNK INC	10,674	99.090	1,057,686.660	
HCA HEALTHCARE INC	21,696	132.430	2,873,201.280	
VERISK ANALYTICS INC	11,859	113.330	1,343,980.470	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	3,987	155.380	619,500.060	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	6,544	200.600	1,312,726.400	
FIRST REPUBLIC BANK/SAN FRANCISCO CA	11,868	90.840	1,078,089.120	
CIT GROUP INC	9,287	49.270	457,570.490	
NXP SEMICONDUCTOR NV	25,955	77.290	2,006,061.950	
TARGA RESOURCES CORP	16,445	55.290	909,244.050	
LEAR CORP	5,132	137.540	705,855.280	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	8,640	100.800	870,912.000	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	17,000	49.510	841,670.000	
DOLLAR GENERAL CORP	19,686	101.960	2,007,184.560	
FORTINET INC	11,399	77.120	879,090.880	
AON PLC	18,487	148.220	2,740,143.140	
TESLA INC	9,463	252.230	2,386,852.490	
GENERAL MOTORS CO	95,770	32.310	3,094,328.700	
WORLDPAY INC	21,000	92.090	1,933,890.000	
XPO LOGISTICS INC	9,000	99.240	893,160.000	
TRIPADVISOR INC	9,263	44.650	413,592.950	
ALLY FINANCIAL INC	31,409	25.960	815,377.640	
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	12,138	61.960	752,070.480	
VOYA FINANCIAL INC	13,525	47.260	639,191.500	
APTIV PLC	19,069	73.920	1,409,580.480	
PHILLIPS 66	32,776	109.460	3,587,660.960	
FACEBOOK INC	178,452	153.350	27,365,614.200	
IQVIA HOLDINGS INC	11,751	122.580	1,440,437.580	
DIAMONDBACK ENERGY INC	7,054	124.630	879,140.020	

SERVICENOW INC	12,906	174.970	2,258,162.820	
PALO ALTO NETWORKS INC	7,006	203.170	1,423,409.020	
WORKDAY INC	10,417	124.750	1,299,520.750	
ABBVIE INC	112,000	90.700	10,158,400.000	
ZOETIS INC	36,976	87.000	3,216,912.000	
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDINGS LTD	16,470	50.620	833,711.400	
COTY INC	38,541	11.130	428,961.330	
NEWS CORP/NEW-CL A	30,263	12.700	384,340.100	
HD SUPPLY HOLDINGS INC	12,891	38.030	490,244.730	
CDW CORP	10,824	80.370	869,924.880	
SPRINT CORP	63,882	6.210	396,707.220	
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	10,199	31.270	318,922.730	
ARCONIC INC	27,513	21.170	582,450.210	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	13,175	32.780	431,876.500	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	5,006	40.660	203,543.960	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-C	13,368	40.690	543,943.920	
DELL TECHNOLOGIES INC	15,074	91.740	1,382,888.760	
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	15,410	16.820	259,196.200	
BAKER HUGHES A GE CO	31,904	30.660	978,176.640	
TECHNIPFMC LTD	32,556	29.830	971,145.480	
BROADCOM INC	30,394	228.900	6,957,186.600	
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	6,291	43.200	271,771.200	
ANTERO RESOURCES CORP	13,163	18.850	248,122.550	
VEEVA SYSTEMS INC	9,087	89.200	810,560.400	
TWITTER INC	51,498	27.000	1,390,446.000	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING PLC	11,392	44.640	508,538.880	
EVERGY INC	21,000	55.540	1,166,340.000	
PLAINS GP HOLDINGS LP	7,837	23.900	187,304.300	
COMMSCOPE HOLDING CO INC	12,920	25.180	325,325.600	
ALLEGION PLC	7,325	82.760	606,217.000	
PERRIGO CO PLC	10,553	69.790	736,493.870	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	20,000	73.100	1,462,000.000	
ARAMARK	17,307	39.350	681,030.450	
SABRE CORP	17,624	23.000	405,352.000	
PARSLEY ENERGY INC	17,454	28.540	498,137.160	
ARISTA NETWORKS INC	3,748	215.460	807,544.080	
IHS MARKIT LTD	30,253	50.480	1,527,171.440	
FNF GROUP	20,660	35.010	723,306.600	
SYNCHRONY FINANCIAL	53,885	29.730	1,602,001.050	
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	34,845	36.990	1,288,916.550	
CDK GLOBAL INC	8,309	56.890	472,699.010	

	KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	14,300	60.440	864,292.000	
	QORVO INC	8,784	71.390	627,089.760	
	ZAYO GROUP HOLDINGS INC	16,089	30.930	497,632.770	
	LIBERTY BROADBAND CORP-C W/I	7,818	78.040	610,116.720	
	AXALTA COATING SYSTEMS LTD	14,710	25.860	380,400.600	
	GODADDY INC	11,400	72.000	820,800.000	
	NIELSEN HOLDINGS PLC	26,840	25.750	691,130.000	
	TRANSUNION	13,841	67.110	928,869.510	
	SQUARE INC	20,423	69.030	1,409,799.690	
	DOWDUPONT INC	173,668	58.980	10,242,938.640	
	COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS PLC	17,100	42.620	728,802.000	
	WESTROCK CO	17,744	41.950	744,360.800	
	KRAFT HEINZ CO	46,854	53.820	2,521,682.280	
	FORTIVE CORP	23,630	78.580	1,856,845.400	
	WASTE CONNECTIONS INC	18,879	75.040	1,416,680.160	
	ALPHABET INC-CL A	22,200	1,090.740	24,214,428.000	
	HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	113,242	14.630	1,656,730.460	
	PAYPAL HOLDINGS INC	83,973	75.900	6,373,550.700	
	FIRST DATA CORP	35,404	22.350	791,279.400	
	DXC TECHNOLOGY CO	21,351	85.870	1,833,410.370	
	ZILLOW GROUP INC-C	8,134	38.160	310,393.440	
	ALPHABET INC-CL C	23,300	1,079.320	25,148,156.000	
	L3 TECHNOLOGIES INC	5,892	195.180	1,150,000.560	
	CHEMOURS CO	12,723	35.290	448,994.670	
	ATHENE HOLDING LTD	11,784	48.390	570,227.760	
	CHARTER COMMUNICATIONS INC	12,506	301.920	3,775,811.520	
	VISTRA ENERGY CORP	30,000	24.210	726,300.000	
アメリカ・ドル　小計		22,730,381		1,755,779,598.630 (196,980,913,171)	
イギリス・ポンド	ANTOFAGASTA PLC	25,905	7.680	198,950.400	
	ASHTEAD GROUP	35,233	19.790	697,261.070	
	SEVERN TRENT PLC	14,897	18.500	275,594.500	
	BHP BILLITON PLC	153,323	15.640	2,397,971.720	
	BARCLAYS PLC	1,292,957	1.680	2,172,167.760	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	64,682	4.878	315,518.790	
	BT GROUP PLC	638,910	2.370	1,514,216.700	
	BUNZL PLC	26,515	21.930	581,473.950	
	EASYJET PLC	13,628	11.780	160,537.840	
	AVIVA PLC	303,368	4.388	1,331,178.780	
	CRODA INTERNATIONAL	10,645	45.140	480,515.300	
	DIAGEO PLC	183,390	25.235	4,627,846.650	
	SCHRODERS PLC	10,932	28.820	315,060.240	
	DCC PLC	5,936	62.350	370,109.600	

NATIONAL GRID PLC	253,078	7.990	2,022,093.220	
KINGFISHER PLC	165,680	2.534	419,833.120	
BAE SYSTEMS PLC	225,176	5.822	1,310,974.670	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	169,676	34.050	5,777,467.800	
NEXT PLC	9,731	52.540	511,266.740	
IMPERIAL BRANDS PLC	72,328	26.780	1,936,943.840	
JOHNSON MATTHEY PLC	15,017	30.890	463,875.130	
ANGLO AMERICAN PLC	79,906	16.200	1,294,477.200	
COMPASS GROUP PLC	115,111	15.550	1,789,976.050	
HSBC HOLDINGS PLC	1,488,734	6.301	9,380,512.930	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	423,649	2.459	1,041,752.890	
CENTRICA PLC	392,766	1.471	577,758.780	
UNILEVER PLC	91,931	39.445	3,626,218.290	
MEGGITT PLC	62,181	4.973	309,226.110	
MORRISON <WM.> SUPERMARKETS	155,682	2.483	386,558.400	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	54,487	7.044	383,806.420	
RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	80,864	5.510	445,560.640	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	25,308	23.060	583,602.480	
PEARSON PLC	65,009	7.800	507,070.200	
PERSIMMON PLC	23,150	21.780	504,207.000	
PRUDENTIAL PLC	193,029	15.820	3,053,718.780	
RIO TINTO PLC	90,035	36.290	3,267,370.150	
VODAFONE GROUP PLC	1,993,578	1.509	3,008,309.200	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	50,208	64.490	3,237,913.920	
RELX PLC	147,464	14.940	2,203,112.160	
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	116,966	8.716	1,019,475.650	
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	330,000	2.442	805,860.000	
ST JAMES'S PLACE PLC	40,884	10.570	432,143.880	
TRAVIS PERKINS PLC	20,357	10.040	204,384.280	
SSE PLC	73,043	11.240	821,003.320	
BP PLC	1,481,204	5.544	8,211,794.970	
SHIRE PLC	67,647	42.525	2,876,688.670	
SAGE GROUP PLC(THE)	85,271	5.560	474,106.760	
SMITHS GROUP PLC	31,720	13.530	429,171.600	
STANDARD CHARTERED PLC	210,236	5.702	1,198,765.670	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	5,397,548	0.579	3,125,180.290	
TAYLOR WIMPLEY PLC	253,022	1.578	399,268.710	
TESCO PLC	740,567	2.183	1,616,657.760	
3I GROUP PLC	66,784	8.494	567,263.290	
SMITH & NEPHEW PLC	66,155	12.925	855,053.370	
GLAXOSMITHKLINE PLC	369,384	14.516	5,361,978.140	

WEIR GROUP	18,336	15.975	292,917.600	
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	21,888	40.770	892,373.760	
BABCOCK INT'L GROUP	21,302	6.480	138,036.960	
WPP PLC	90,628	10.650	965,188.200	
FERGUSON PLC	17,278	55.670	961,866.260	
ASTRAZENECA PLC	94,694	56.160	5,318,015.040	
WHITBREAD PLC	12,159	45.550	553,842.450	
CARNIVAL PLC	13,153	43.150	567,551.950	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	120,290	2.916	350,765.640	
JOHN WOOD GROUP PLC	48,988	7.236	354,477.160	
INTERTEK GROUP PLC	11,273	44.350	499,957.550	
BURBERRY GROUP PLC	29,893	17.405	520,287.660	
INVESTEC PLC	50,655	4.667	236,406.880	
INTERCONTINENTAL HOTELS	12,362	42.150	521,058.300	
ITV PLC	247,210	1.559	385,400.390	
SAINSBURY (J) PLC	137,215	3.064	420,426.760	
RANDGOLD RESOURCES LTD NPR	6,998	57.060	399,305.880	
G4S PLC	122,250	2.170	265,282.500	
ADMIRAL GROUP PLC	15,893	19.325	307,132.220	
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	10,726	33.100	355,030.600	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	341,563	24.850	8,487,840.550	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	279,650	25.200	7,047,180.000	
TUI AG-DI	30,153	13.480	406,462.440	
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	184,183	2.789	513,686.380	
EXPERIAN PLC	71,068	17.285	1,228,410.380	
MONDI PLC	28,318	17.750	502,644.500	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	21,290	18.505	393,971.450	
FRESNILLO PLC NPR	15,639	8.390	131,211.210	
INFORMA PLC	102,475	7.166	734,335.850	
GLENCORE PLC	861,237	3.112	2,680,169.540	
GVC HOLDINGS PLC	36,000	9.000	324,000.000	
NMC HEALTH PLC	8,149	31.380	255,715.620	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP PLC	112,694	3.221	362,987.370	
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	30,616	4.474	136,975.980	
COCA-COLA HBC AG	13,406	23.170	310,617.020	
CONVATEC GROUP PLC	118,400	2.218	262,611.200	
ROYAL MAIL PLC	55,060	3.412	187,864.720	
MERLIN ENTERTAINMENTS PLC	50,037	3.749	187,588.710	

	MICRO FOCUS INTERNATIONAL PLC	32,342	13.455	435,161.610	
	AUTO TRADER GROUP PLC	76,348	4.050	309,209.400	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	335,000	1.705	571,175.000	
イギリス・ポンド　小計		22,481,706		131,655,948.470 (19,558,807,704)	
イスラエル・シュケル	BANK HAPOALIM BM	78,428	25.500	1,999,914.000	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	103,061	23.180	2,388,953.980	
	BEZEQ ISRAELI TELECOMMUNICATION CORP LTD	188,230	4.149	780,966.270	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,760	435.800	767,008.000	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	49,411	22.050	1,089,512.550	
	NICE LTD	4,035	386.500	1,559,527.500	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	10,444	62.710	654,943.240	
	AZRIELI GROUP	4,428	180.400	798,811.200	
	INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCES INC	647	485.200	313,924.400	
イスラエル・シュケル　小計		440,444		10,353,561.140 (319,510,897)	
オーストラリア・ドル	RAMSAY HEALTH CARE LTD	11,115	53.620	595,986.300	
	AUST AND NZ BANKING GROUP LT	218,921	26.010	5,694,135.210	
	AMCOR LTD	80,741	13.330	1,076,277.530	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	253,113	26.290	6,654,340.770	
	BANK OF QUEENSLAND LTD	30,569	10.380	317,306.220	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	114,125	3.760	429,110.000	
	TELSTRA CORP LTD	272,919	3.110	848,778.090	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD	39,014	10.000	390,140.000	
	AMP LTD	200,498	3.050	611,518.900	
	ASX LTD	15,573	58.700	914,135.100	
	BHP BILLITON LTD	239,570	33.400	8,001,638.000	
	CALTEX AUSTRALIA LTD	20,946	29.470	617,278.620	
	HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	22,182	3.430	76,084.260	
	COMPUTERSHARE LT	38,040	19.650	747,486.000	
	CSL LIMITED	34,057	185.500	6,317,573.500	
	REA GROUP LTD	4,119	77.520	319,304.880	
	TRANSURBAN GROUP	167,883	10.900	1,829,924.700	
	COCA-COLA AMATIL LTD	48,601	9.900	481,149.900	
	COCHLEAR LTD	3,992	186.570	744,787.440	
	ORIGIN ENERGY LTD	121,721	8.250	1,004,198.250	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	129,233	67.000	8,658,611.000	
	BORAL LIMITED	86,101	6.390	550,185.390	

	RIO TINTO LIMITED	30,902	76.610	2,367,402.220	
	APA GROUP	77,562	9.810	760,883.220	
	ARISTOCRAT LEISU	43,933	27.310	1,199,810.230	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	171,471	6.990	1,198,582.290	
	TPG TELECOM LTD	28,719	7.680	220,561.920	
	FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	3,275	51.030	167,123.250	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	28,489	19.400	552,686.600	
	ORICA LTD	25,308	16.310	412,773.480	
	CIMIC GROUP LTD	8,709	47.020	409,497.180	
	BLUESCOPE STEEL LTD	36,941	14.670	541,924.470	
	SYDNEY AIRPORT	85,130	6.610	562,709.300	
	MACQUARIE GROUP LTD	24,250	115.490	2,800,632.500	
	SUNCORP GROUP LTD	93,181	13.730	1,279,375.130	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	202,508	26.000	5,265,208.000	
	NEWCREST MINING LTD	59,818	19.300	1,154,487.400	
	OIL SEARCH LTD	93,715	8.530	799,388.950	
	INCITEC PIVOT LTD	136,426	3.910	533,425.660	
	QBE INSURANCE GROUP LIMITED	95,390	11.360	1,083,630.400	
	CHALLENGER FINANCIAL SERVICES	45,707	10.440	477,181.080	
	SANTOS LTD	133,862	6.970	933,018.140	
	SONIC HEALTHCARE	26,192	23.950	627,298.400	
	TABCORP HOLDINGS LTD	126,348	4.620	583,727.760	
	WESFARMERS LTD	84,335	47.450	4,001,695.750	
	ALUMINA LIMITED	184,613	2.610	481,839.930	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	68,074	36.650	2,494,912.100	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	99,142	27.820	2,758,130.440	
	SEEK LTD	25,899	19.830	513,577.170	
	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES LTD	4,581	51.730	236,975.130	
	AUSNET SERVICES	165,066	1.635	269,882.910	
	AGL ENERGY LTD	46,315	19.030	881,374.450	
	BRAMBLES LTD	115,255	10.390	1,197,499.450	
	CROWN RESORTS LTD	32,861	13.070	429,493.270	
	AURIZON HOLDINGS LTD	139,184	4.020	559,519.680	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	50,789	16.140	819,734.460	
	HEALTHSCOPE LTD	149,047	2.030	302,565.410	
	MEDIBANK PVT LTD	177,176	2.800	496,092.800	
	SOUTH32 LTD(AUD)	367,057	3.810	1,398,487.170	
オーストラリア・ドル　小計		5,440,263		87,653,057.760 (7,007,861,967)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	16,141	48.710	786,228.110	

ALIMENTATION COUCHE TARD INC	30,728	61.460	1,888,542.880	
BARRICK GOLD CORP	83,648	16.440	1,375,173.120	
ATCO LTD	7,193	35.350	254,272.550	
BANK OF MONTREAL	47,406	103.150	4,889,928.900	
BANK OF NOVA SCOTIA	87,876	71.990	6,326,193.240	
NATIONAL BANK OF CANADA	23,756	60.910	1,446,977.960	
BCE INC	11,568	50.880	588,579.840	
BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT	63,537	54.000	3,430,998.000	
BAUSCH HEALTH COS INC	25,819	31.350	809,425.650	
BOMBARDIER INC 'B'	151,615	3.820	579,169.300	
SAPUTO INC	18,601	38.350	713,348.350	
BLACKBERRY LTD	39,652	12.400	491,684.800	
CGI GROUP INC	19,367	77.500	1,500,942.500	
CCL INDUSTRIES INC	11,340	54.350	616,329.000	
CAE INC	23,000	24.170	555,910.000	
CAMECO CORP	32,627	15.100	492,667.700	
ROGERS COMM-CL B	25,967	64.470	1,674,092.490	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	32,680	115.700	3,781,076.000	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	91,420	37.650	3,441,963.000	
CANADIAN TIRE CORP-CL A	4,862	146.530	712,428.860	
CANADIAN UTILITIES LTD	9,119	29.370	267,825.030	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	54,813	109.770	6,016,823.010	
FIRST CAPITAL REALTY INC	11,417	18.810	214,753.770	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	13,930	37.570	523,350.100	
OPEN TEXT CORP	19,756	44.270	874,598.120	
EMPIRE CO LTD	15,093	22.980	346,837.140	
KINROSS GOLD CORP	99,741	3.850	384,002.850	
FINNING INTERNATIONAL INC	9,892	31.340	310,015.280	
FORTIS INC	33,302	41.110	1,369,045.220	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	55,296	14.690	812,298.240	
TELUS CORP	15,945	44.270	705,885.150	
GREAT WEST LIFECO INC	19,248	30.070	578,787.360	
IMPERIAL OIL LTD	21,542	42.440	914,242.480	
ENBRIDGE INC	125,330	41.490	5,199,941.700	
IGM FINANCIAL INC	8,426	32.220	271,485.720	
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	87,995	2.500	219,987.500	
MANULIFE FINANCIAL CORP	145,162	20.310	2,948,240.220	
LINAMAR CORP	3,827	54.970	210,370.190	
LOBLAW CO LTD	15,354	62.670	962,235.180	
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANCE AND FINANCIAL SERVICES INC	6,524	47.760	311,586.240	

MAGNA INTERNATIONAL INC	25,339	61.860	1,567,470.540	
SUN LIFE FINANCIAL INC	45,976	48.190	2,215,583.440	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,985	656.380	1,302,914.300	
METRO INC	19,226	39.250	754,620.500	
HUSKY ENERGY INC	28,749	19.930	572,967.570	
CRESCENT POINT ENERGY CORP	39,992	7.550	301,939.600	
EMERA INC	6,509	38.420	250,075.780	
METHANEX CORP	5,281	96.170	507,873.770	
ONEX CORP	6,646	83.140	552,548.440	
GOLDCORP INC	66,602	14.100	939,088.200	
POWER CORP OF CANADA	25,052	26.960	675,401.920	
POWER FINANCIAL CORP	17,484	28.260	494,097.840	
ROYAL BANK OF CANADA	106,200	98.700	10,481,940.000	
SNC-LAVALIN GROUP INC	13,134	44.360	582,624.240	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	10,607	264.970	2,810,536.790	
SHAW COMM INC-B	35,748	24.020	858,666.960	
SUNCOR ENERGY INC	122,908	46.360	5,698,014.880	
LUNDIN MINING CORP	35,268	5.960	210,197.280	
ENCANA CORP	69,257	14.760	1,022,233.320	
TECK RESOURCES LTD-CL B	41,016	30.530	1,252,218.480	
THOMSON REUTERS CORP	20,469	57.920	1,185,564.480	
TORONTO DOMINION BANK (THE) C$	136,076	74.110	10,084,592.360	
TRANSCANADA CORP	68,885	51.290	3,533,111.650	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	5,696	64.750	368,816.000	
WESTON (GEORGE) LTD	3,105	90.380	280,629.900	
INTACT FINANCIAL CORP	10,785	102.560	1,106,109.600	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	33,943	23.410	794,605.630	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,494	888.370	1,327,224.780	
FRANCO-NEVADA CORP NPR	14,687	86.250	1,266,753.750	
CI FINANCIAL CORP	20,695	19.000	393,205.000	
TOURMALINE OIL CORP	15,779	21.280	335,777.120	
KEYERA CORP	13,728	34.150	468,811.200	
ALTAGAS LTD	23,944	20.990	502,584.560	
PEMBINA PIPELINE CORP	38,497	43.450	1,672,694.650	
DOLLARAMA INC	22,512	38.000	855,456.000	
CENOVUS ENERGY INC W/I	80,545	11.690	941,571.050	
VERMILION ENERGY INC	12,923	39.900	515,627.700	
ARC RESOURCES LTD	22,997	13.880	319,198.360	
INTER PIPELINE LTD	24,083	21.880	526,936.040	
NUTRIEN LTD	45,351	70.430	3,194,070.930	
WSP GLOBAL INC	8,400	65.350	548,940.000	
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	14,961	21.750	325,401.750	

	SEVEN GENERATIONS ENERGY LTD	17,231	15.280	263,289.680	
	RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	17,753	73.280	1,300,939.840	
	AURORA CANNABIS INC	50,000	12.620	631,000.000	
	SHOPIFY INC	6,500	166.720	1,083,680.000	
	HYDRO ONE LTD	27,340	19.230	525,748.200	
カナダ・ドル　小計		3,101,873		127,201,596.830 (10,954,601,519)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE TECH ENG	125,000	3.430	428,750.000	
	SEMBCORP INDUSTRIES	81,400	2.870	233,618.000	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	123,700	2.650	327,805.000	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	692,140	0.240	166,113.600	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	134,800	24.310	3,276,988.000	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	29,000	8.160	236,640.000	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	5,944	28.220	167,739.680	
	SINGAPORE AIRPORT TERMINAL SERVICES LTD	42,300	4.850	205,155.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	68,900	6.860	472,654.000	
	CAPITALAND LTD	192,415	3.100	596,486.500	
	GENTING SINGAPORE LTD	416,400	0.950	395,580.000	
	KEPPEL CORP LTD	98,400	6.700	659,280.000	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	177,900	2.140	380,706.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	225,453	10.680	2,407,838.040	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	591,922	3.140	1,858,635.080	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	47,500	9.180	436,050.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	94,500	25.230	2,384,235.000	
	UOL GROUP LIMITED	40,500	6.210	251,505.000	
	VENTURE CORP LTD	21,000	16.280	341,880.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	142,300	3.060	435,438.000	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	188,800	1.230	232,224.000	
シンガポール・ドル　小計		3,540,274		15,895,320.900 (1,297,535,046)	
スイス・フラン	CREDIT SUISSE GROUP AG	187,381	13.380	2,507,157.780	
	NESTLE SA-REGISTERED	231,295	78.700	18,202,916.500	
	CIE FINANC RICHEMONT	39,186	72.160	2,827,661.760	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	52,431	234.750	12,308,177.250	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2,835	221.200	627,102.000	
	SIKA INHABER	9,060	127.700	1,156,962.000	
	SGS SA-REG	405	2,293.000	928,665.000	
	NOVARTIS AG-REG SHS	160,986	81.460	13,113,919.560	

	BALOISE HOLDING AG -R	4,127	145.000	598,415.000	
	BARRY CALLEBAUT AG	144	1,800.000	259,200.000	
	CLARIANT AG-REG	19,496	22.770	443,923.920	
	SWISSCOM AG-REG	1,795	431.700	774,901.500	
	ABB LTD	139,628	21.170	2,955,924.760	
	ADECCO GROUP AG-REG	12,341	48.680	600,759.880	
	GEBERIT AG	2,801	426.000	1,193,226.000	
	LONZA GROUP AG-REG	5,389	308.600	1,663,045.400	
	LINDT & SPRUENGLI PART	75	6,430.000	482,250.000	
	LINDT & SPRUENGLI NAMEN	9	75,700.000	681,300.000	
	GIVAUDAN-REG	692	2,283.000	1,579,836.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	11,199	301.200	3,373,138.800	
	LAFARGEHOLCIM LTD	35,730	44.830	1,601,775.900	
	TEMENOS GROUP	4,521	129.400	585,017.400	
	SONOVA HOLDING AG	4,142	163.850	678,666.700	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG	3,687	141.750	522,632.250	
	STRAUMANN HOLDING AG	782	664.500	519,639.000	
	THE SWATCH GROUP AG-B	2,311	338.800	782,966.800	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	4,592	66.000	303,072.000	
	SCHINDLER NAMEN	1,663	215.200	357,877.600	
	SWISS LIFE HOLDING AG	2,614	360.700	942,869.800	
	VIFOR PHARMA AG	3,050	142.350	434,167.500	
	EMS-CHEMIE HOLDING	553	535.000	295,855.000	
	SWISS PRIME SITE AG	5,990	78.800	472,012.000	
	PARGESA HOLDING PORTEUR	3,000	72.500	217,500.000	
	DUFRY GROUP	2,390	104.850	250,591.500	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,272	707.000	899,304.000	
	JULIUS BAER GROUP LTD	17,849	45.200	806,774.800	
	SWISS RE LTD	24,162	88.500	2,138,337.000	
	UBS GROUP AG	285,455	14.130	4,033,479.150	
スイス・フラン　小計		1,285,038		82,121,021.510 (9,309,238,998)	
スウェーデン・クローナ	ATLAS COPCO AB-A SHS	48,377	230.900	11,170,249.300	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	30,899	213.700	6,603,116.300	
	ERICSSON LM-B SHS	221,748	74.580	16,537,965.840	
	LUNDBERGS B	7,382	280.400	2,069,912.800	
	SKF AB-B SHS	24,866	157.550	3,917,638.300	
	SANDVIK AB	85,032	141.950	12,070,292.400	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	128,935	92.800	11,965,168.000	
	SKANSKA AB-B SHS	21,179	166.500	3,526,303.500	
	SWEDBANK AB	66,507	194.450	12,932,286.150	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	108,388	104.700	11,348,223.600	
	VOLVO AB-B SHS	113,672	144.900	16,471,072.800	
	SWEDISH MATCH AB	11,481	438.300	5,032,122.300	

	TELE2 AB-B SHS	26,976	107.450	2,898,571.200	
	INDUSTRIVARDEN C	11,403	186.050	2,121,528.150	
	ELECTROLUX AB-SER B	19,191	186.950	3,587,757.450	
	SECURITAS AB-B SHS	24,098	146.700	3,535,176.600	
	INVESTOR AB-B SHS	33,412	385.200	12,870,302.400	
	HENNES&MAURITZ AB-B SHS	66,448	162.300	10,784,510.400	
	ASSA ABLOY AB-B	77,223	170.950	13,201,271.850	
	TELIA CO AB	216,239	41.080	8,883,098.120	
	LUNDIN PETROLEUM AB	16,790	289.000	4,852,310.000	
	BOLIDEN AB	21,855	239.250	5,228,808.750	
	ALFA LAVAL AB	23,343	224.600	5,242,837.800	
	KINNEVIK AB-B	18,310	250.500	4,586,655.000	
	MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR SA	5,332	500.000	2,666,000.000	
	ICA GRUPPEN AB	5,920	278.400	1,648,128.000	
	HUSQVARNA AB-B SHS	33,692	70.680	2,381,350.560	
	HEXAGON AB	18,360	469.200	8,614,512.000	
	EPIROC AB-A	48,377	94.540	4,573,561.580	
	EPIROC AB-B	30,899	86.730	2,679,870.270	
	ESSITY AB-B	46,071	219.000	10,089,549.000	
	NORDEA BANK ABP	218,620	87.470	19,122,691.400	
スウェーデン・クローナ　小計		1,831,025		243,212,841.820 (3,042,592,651)	
デンマーク・クローネ	CARLSBERG AS-B	7,330	723.600	5,303,988.000	
	A P MOLLER A/S	481	8,244.000	3,965,364.000	
	AP MOLLER MAERSK A	273	7,765.000	2,119,845.000	
	DANSKE BANK A/S	54,380	141.200	7,678,456.000	
	GENMAB A/S	4,613	894.400	4,125,867.200	
	NOVOZYMES-B SHS	15,904	325.700	5,179,932.800	
	NOVO NORDISK A/S-B	135,241	267.300	36,149,919.300	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	15,808	393.700	6,223,609.600	
	COLOPLAST-B	8,286	605.200	5,014,687.200	
	DSV A/S	14,452	541.800	7,830,093.600	
	WILLIAM DEMANT	6,537	200.600	1,311,322.200	
	H LUNDBECK A/S	4,840	375.300	1,816,452.000	
	TRYG A/S	11,107	154.700	1,718,252.900	
	PANDORA A/S	8,251	390.000	3,217,890.000	
	CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S	7,708	596.000	4,593,968.000	
	ISS A/S	11,125	213.600	2,376,300.000	
	ORSTED A/S	15,020	409.500	6,150,690.000	
デンマーク・クローネ　小計		321,356		104,776,637.800 (1,827,304,563)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	71,110	6.820	484,970.200	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	29,894	12.550	375,169.700	
	A2 MILK CO LTD	55,091	9.040	498,022.640	
	FISHER & PAYKEL	42,678	13.900	593,224.200	

	FLETCHER BUILDING LTD	64,104	6.180	396,162.720	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	159,623	3.825	610,557.970	
	MERIDIAN ENERGY LTD	90,173	3.140	283,143.220	
ニュージーランド・ドル　小計		512,673		3,241,250.650 (237,324,372)	
ノルウェー・クローネ	MARINE HARVEST	33,000	184.500	6,088,500.000	
	DNB ASA	70,426	161.550	11,377,320.300	
	NORSK HYDRO ASA	91,879	42.660	3,919,558.140	
	TELENOR ASA	53,178	152.350	8,101,668.300	
	ORKLA ASA	61,421	67.000	4,115,207.000	
	EQUINOR ASA	87,000	221.300	19,253,100.000	
	YARA INTERNATIONAL ASA	16,000	383.400	6,134,400.000	
	AKER BP ASA	8,552	307.200	2,627,174.400	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	16,683	128.200	2,138,760.600	
	SCHIBSTED ASA	7,445	257.500	1,917,087.500	
ノルウェー・クローネ　小計		445,584		65,672,776.240 (898,403,579)	
ユーロ	CRH PLC	65,287	26.280	1,715,742.360	
	PADDY POWER BETFAIR PLC	6,246	68.150	425,664.900	
	KERRY GROUP PLC-A	11,576	87.700	1,015,215.200	
	UMICORE	15,320	40.740	624,136.800	
	AIR LIQUIDE	32,310	106.550	3,442,630.500	
	AIRBUS SE	43,659	97.330	4,249,330.470	
	AXA	146,116	22.620	3,305,143.920	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	39,913	16.705	666,746.660	
	ADIDAS AG	14,139	192.650	2,723,878.350	
	ASSICURAZIONI GENERALI	88,233	14.280	1,259,967.240	
	DASSAULT AVIATION SA	157	1,417.000	222,469.000	
	DANONE	46,365	63.930	2,964,114.450	
	SAFRAN SA	25,571	106.500	2,723,311.500	
	INTESA SANPAOLO	1,068,877	2.034	2,174,095.810	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	24,725	74.300	1,837,067.500	
	ACCOR SA	16,000	41.160	658,560.000	
	BOUYGUES	16,412	36.010	590,996.120	
	BNP PARIBAS	82,934	50.190	4,162,457.460	
	THALES SA	8,128	110.150	895,299.200	
	CAPGEMINI SA	11,481	101.950	1,170,487.950	
	CASINO GUICHARD PERRACHON	4,264	37.190	158,578.160	
	INGENICO GROUP	4,334	67.840	294,018.560	
	UNICREDIT SPA	150,691	11.938	1,798,949.150	
	NATIXIS	70,166	5.370	376,791.420	
	KONINKLIJKE DSM NV	13,216	79.520	1,050,936.320	
	COMMERZBANK AG	83,118	8.556	711,157.600	
	EIFFAGE	5,949	89.560	532,792.440	
	FRESENIUS SE & CO KGAA	30,924	67.780	2,096,028.720	

UNITED INTERNET	9,882	36.280	358,518.960	
FUCHS PETROLUB SE PREF	5,546	44.840	248,682.640	
PUBLICIS GROUPE	15,068	51.160	770,878.880	
MAN SE	3,396	91.000	309,036.000	
FAURECIA	6,117	45.410	277,772.970	
IBERDROLA SA	445,063	6.214	2,765,621.480	
ENI SPA	190,886	15.710	2,998,819.060	
IMERYS SA	2,256	56.750	128,028.000	
JERONIMO MARTINS	19,517	11.285	220,249.340	
KBC GROUPE	18,378	64.220	1,180,235.160	
HANNOVER RUECK SE	4,868	116.100	565,174.800	
WARTSILA OYJ	34,935	14.540	507,954.900	
L'OREAL	18,584	187.600	3,486,358.400	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	20,764	261.950	5,439,129.800	
GEA GROUP AG	11,838	26.170	309,800.460	
BOLLORE	71,347	3.552	253,424.540	
MEDIOBANCA SPA	42,404	7.744	328,376.570	
MICHELIN(CGDE)-B	12,118	98.940	1,198,954.920	
CONTINENTAL AG	8,317	137.000	1,139,429.000	
DEUTSCHE POST AG-REG	73,325	28.190	2,067,031.750	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	14,426	9.380	135,315.880	
NOKIAN RENKAAT OYJ	9,399	32.680	307,159.320	
AXEL SPRINGER SE	3,067	57.200	175,432.400	
OMV AG	9,766	48.410	472,772.060	
PERNOD-RICARD	15,401	130.100	2,003,670.100	
PEUGEOT SA	42,232	20.750	876,314.000	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	10,591	53.420	565,771.220	
RENAULT SA	14,378	70.650	1,015,805.700	
REPSOL SA	103,827	16.440	1,706,915.880	
REMY COINTREAU	1,860	101.000	187,860.000	
MERCK KGAA	9,551	86.160	822,914.160	
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	35,706	33.305	1,189,188.330	
RWE AG	39,183	17.320	678,649.560	
SEB SA	1,405	143.600	201,758.000	
LUXOTTICA GROUP SPA	11,602	53.080	615,834.160	
SOCIETE GENERALE-A	58,110	36.070	2,096,027.700	
VINCI S.A.	37,228	77.560	2,887,403.680	
SODEXO	6,286	87.040	547,133.440	
SOLVAY SA	5,036	105.550	531,549.800	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	39,729	61.820	2,456,046.780	
VIVENDI SA	79,680	21.450	1,709,136.000	
SAP SE	73,011	97.080	7,087,907.880	
TELEFONICA S.A	358,674	7.013	2,515,380.760	
TOTAL SA	178,965	53.210	9,522,727.650	
VALEO	17,731	30.980	549,306.380	

E.ON SE	164,012	8.343	1,368,352.110	
VOEST-ALPINE AG	9,875	36.400	359,450.000	
HENKEL AG & CO KGAA	7,858	83.700	657,714.600	
SIEMENS AG-REG	56,716	100.500	5,699,958.000	
UPM-KYMMENE OYJ	41,197	30.040	1,237,557.880	
ING GROEP NV-CVA	290,820	10.820	3,146,672.400	
PUMA AG	600	416.000	249,600.000	
BAYER AG	69,537	77.320	5,376,600.840	
STORA ENSO OYJ-R SHS	42,303	14.285	604,298.350	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	13,222	94.620	1,251,065.640	
DAIMLER AG	67,488	52.700	3,556,617.600	
BASF SE	68,209	70.000	4,774,630.000	
BEIERSDORF AG	6,780	89.620	607,623.600	
HOCHTIEF AG	1,707	133.100	227,201.700	
HEIDELBERGCEMENT AG	11,009	61.800	680,356.200	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	16,408	85.020	1,395,008.160	
ORANGE	141,819	13.700	1,942,920.300	
SAMPO OYJ-A SHS	32,949	41.080	1,353,544.920	
RANDSTAD NV	7,794	42.860	334,050.840	
ALLIANZ SE	32,994	182.280	6,014,146.320	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	189,631	3.080	584,063.480	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	93,187	19.152	1,784,717.420	
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	17,602	21.460	377,738.920	
HERMES INTL	2,285	498.400	1,138,844.000	
ENDESA S.A.	21,037	17.970	378,034.890	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	15,963	18.875	301,301.620	
ERSTE GROUP BANK AG	20,754	35.900	745,068.600	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	11,602	183.750	2,131,867.500	
ARCELOR MITTAL (NL)	47,245	24.200	1,143,329.000	
SOCIETE BIC SA	2,478	72.250	179,035.500	
DASSAULT SYSTEMES SA	8,961	113.200	1,014,385.200	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	19,033	34.070	648,454.310	
HEINEKEN NV	20,425	75.580	1,543,721.500	
AKZO NOBEL	18,209	73.720	1,342,367.480	
ASML HOLDING NV	30,496	150.000	4,574,400.000	
AEGON NV	120,404	5.332	641,994.120	
BANKINTER S.A.	57,960	7.950	460,782.000	
VOLKSWAGEN AG	2,329	137.800	320,936.200	
VOLKSWAGEN AG PFD	13,901	140.480	1,952,812.480	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	504,414	5.289	2,667,845.640	
KERING	5,479	372.300	2,039,831.700	
CNP ASSURANCES	13,987	19.790	276,802.730	
FORTUM OYJ	29,739	19.845	590,170.450	

AGEAS	12,993	43.520	565,455.360	
UCB SA	8,747	72.540	634,507.380	
THYSSENKRUPP AG	29,903	19.920	595,667.760	
UNILEVER NV-CVA	114,914	45.855	5,269,381.470	
CARREFOUR SA	39,144	15.675	613,582.200	
NATURGY ENERGY GROUP SA	29,010	21.990	637,929.900	
ATOS SE	7,050	95.660	674,403.000	
NOKIA OYJ	417,248	4.441	1,852,998.360	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	73,000	35.115	2,563,395.000	
WOLTERS KLUWER-CVA	20,558	49.040	1,008,164.320	
SANOFI	84,037	75.420	6,338,070.540	
STMICROELECTRONICS NV	50,879	14.405	732,911.990	
ELISA OYJ	9,517	35.800	340,708.600	
BANCO SANTANDER SA	1,201,199	4.260	5,117,107.740	
METSO OYJ	8,585	28.550	245,101.750	
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	34,596	18.095	626,014.620	
QIAGEN N.V.	17,387	29.540	513,611.980	
1&1 DRILLISCH AG	3,149	37.620	118,465.380	
DEUTSCHE BANK AG-REG	149,244	9.471	1,413,489.920	
BMW VORZUG	4,116	64.600	265,893.600	
K & S	14,982	17.600	263,683.200	
ENEL SPA	607,499	4.346	2,640,190.650	
COLRUYT NV	4,673	47.930	223,976.890	
VOPAK (KON.)	5,364	40.710	218,368.440	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	246,287	14.000	3,448,018.000	
SARTORIUS AG	2,712	120.700	327,338.400	
LEONARDO SPA	26,269	9.798	257,383.660	
UBISOFT ENTERTAINMENT	5,911	86.580	511,774.380	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	81,774	18.075	1,478,065.050	
KONINKLIJKE KPN NV	228,967	2.321	531,432.400	
EUROFINS SCIENTIFIC	794	406.800	322,999.200	
TELEPERFORMANCE	4,436	145.700	646,325.200	
DEUTSCHE BOERSE AG	13,844	108.950	1,508,303.800	
EURAZEO	4,725	64.700	305,707.500	
BANCO SABADELL	367,753	1.286	472,930.350	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	5,814	81.440	473,492.160	
FRAPORT AG	3,149	67.380	212,179.620	
HEINEKEN HOLDING NV-A	8,014	73.250	587,025.500	
INDITEX	82,035	24.850	2,038,569.750	
JC DECAUX SA	6,058	28.600	173,258.800	
ANDRITZ AG	6,265	46.640	292,199.600	
MAPFRE SA	84,474	2.590	218,787.660	
ESSILORLUXOTTICA	15,607	115.250	1,798,706.750	
SNAM SPA	158,419	3.561	564,130.050	
CREDIT AGRICOLE SA	85,585	12.244	1,047,902.740	
ENAGAS	18,095	22.860	413,651.700	
WENDEL	2,220	114.100	253,302.000	

WIRECARD AG	8,803	159.550	1,404,518.650	
TENARIS SA	36,959	14.070	520,013.130	
TELECOM ITALIA SPA	792,163	0.502	397,665.820	
TELECOM ITALIA-RNC	497,596	0.432	214,961.470	
ATLANTIA SPA	34,969	17.400	608,460.600	
ILIAD SA	2,102	103.850	218,292.700	
PROXIMUS	14,283	21.870	312,369.210	
SES FDR	24,585	19.080	469,081.800	
TERNA SPA	112,686	4.480	504,833.280	
BIOMERIEUX	3,248	63.100	204,948.800	
GRIFOLS SA	23,518	22.000	517,396.000	
FERROVIAL SA	37,657	17.355	653,537.230	
LANXESS AG	6,856	59.360	406,972.160	
NESTE OYJ	8,839	69.660	615,724.740	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	9,641	23.820	229,648.620	
RECORDATI SPA	6,859	28.930	198,430.870	
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	35,583	6.505	231,467.410	
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	3,960	173.600	687,456.000	
KONE OYJ	23,717	41.400	981,883.800	
ENGIE	139,590	11.860	1,655,537.400	
ALSTOM	12,046	37.040	446,183.840	
TELENET GROUP HOLDING NV	3,634	44.000	159,896.000	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	12,542	21.510	269,778.420	
ELECTRICITE DE FRANCE	43,198	14.655	633,066.690	
IPSEN SA	2,487	123.700	307,641.900	
DEUTSCHE WOHNEN	26,714	39.360	1,051,463.040	
ARKEMA SA	5,230	98.120	513,167.600	
LEGRAND SA	19,920	57.740	1,150,180.800	
ADP	2,313	178.400	412,639.200	
ORION OYJ	8,051	29.650	238,712.150	
RTL GROUP SA	3,446	58.850	202,797.100	
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	37,921	15.850	601,047.850	
SYMRISE AG	9,628	71.460	688,016.880	
SCOR SE	13,875	39.990	554,861.250	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	17,397	28.620	497,902.140	
REXEL SA	23,245	11.665	271,152.920	
PRYSMIAN SPA	14,925	17.590	262,530.750	
CAIXABANK	262,372	3.864	1,013,805.400	
BUREAU VERITAS SA	21,480	19.500	418,860.000	
GETLINK	37,646	10.805	406,765.030	
SUEZ SA	25,406	12.875	327,102.250	
AMADEUS IT GROUP SA	32,520	71.560	2,327,131.200	
BRENNTAG AG	12,353	47.640	588,496.920	

	INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GROUP SA	44,747	6.654	297,746.530	
	EVONIK INDUSTRIES AG	11,575	28.030	324,447.250	
	EDENRED	18,306	30.620	560,529.720	
	BANKIA SA	100,675	3.236	325,784.300	
	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	61,541	3.472	213,670.350	
	HUGO BOSS AG -ORD	5,218	61.880	322,889.840	
	OSRAM LICHT AG	7,017	30.000	210,510.000	
	KION GROUP AG	4,686	45.450	212,978.700	
	VONOVIA SE	35,308	38.980	1,376,305.840	
	BANK OF IRELAND GROUP PLC	73,287	6.305	462,074.530	
	SIEMENS HEALTHINEERS AG	10,000	33.495	334,950.000	
	FERRARI NV	9,503	100.900	958,852.700	
	METRO AG	10,774	13.335	143,671.290	
	CNH INDUSTRIAL NV	78,645	9.732	765,373.140	
	AIB GROUP PLC	52,322	4.380	229,170.360	
	LINDE AG-TENDER	13,854	197.400	2,734,779.600	
	INNOGY SE-TEMPORARY	9,769	36.730	358,815.370	
	MONCLER SPA	14,353	31.280	448,961.840	
	NN GROUP NV	21,965	37.740	828,959.100	
	ZALANDO SE	6,674	31.970	213,367.780	
	FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	76,719	14.040	1,077,134.760	
	AENA SME SA	5,256	138.000	725,328.000	
	ABN AMRO GROUP NV	34,251	22.800	780,922.800	
	EXOR NV	7,726	51.840	400,515.840	
	COVESTRO AG	14,459	61.720	892,409.480	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	57,180	73.520	4,203,873.600	
	POSTE ITALIANE SPA	40,015	6.276	251,134.140	
	AMUNDI SA	3,894	59.860	233,094.840	
	SCHAEFFLER AG	12,644	9.954	125,858.370	
	PIRELLI & C SPA	34,086	6.112	208,333.630	
	UNIPER SE	13,897	24.880	345,757.360	
	DELIVERY HERO SE	7,238	34.540	250,000.520	
ユーロ　小計		14,444,530		273,485,065.350 (35,585,876,704)	
香港・ドル	ASM PACIFIC TECH	16,600	74.250	1,232,550.000	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	164,000	14.080	2,309,120.000	
	BANK OF EAST ASIA	76,260	26.800	2,043,768.000	
	CLP HOLDINGS LTD	119,500	88.000	10,516,000.000	
	PCCW LTD	331,000	4.240	1,403,440.000	
	LI & FUNG LTD	532,400	1.650	878,460.000	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	49,000	60.650	2,971,850.000	

	HONG KONG EXCHANGES &CLEAR	89,040	196.700	17,514,168.000	
	MTR CORP	118,500	39.300	4,657,050.000	
	HANG LUNG GROUP LTD	63,000	19.500	1,228,500.000	
	HANG SENG BANK LTD	56,000	204.600	11,457,600.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	92,228	37.150	3,426,270.200	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	96,500	53.300	5,143,450.000	
	(THE) WHARF HOLDINGS LTD	95,750	18.980	1,817,335.000	
	HONG KONG & CHINA GAS	671,050	14.820	9,944,961.000	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	50,000	38.050	1,902,500.000	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	186,000	42.800	7,960,800.000	
	KERRY PROPERTIES LTD	33,000	24.250	800,250.000	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	262,000	34.100	8,934,200.000	
	NWS HOLDINGS LTD	135,000	15.240	2,057,400.000	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HOLDINGS	50,500	20.500	1,035,250.000	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	441,266	9.950	4,390,596.700	
	SHANGRI-LA ASIA LTD	104,000	10.640	1,106,560.000	
	SINO LAND CO	255,400	12.200	3,115,880.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	114,000	105.400	12,015,600.000	
	SWIRE PACIFIC LTD A	30,000	82.450	2,473,500.000	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	113,500	44.750	5,079,125.000	
	WHEELOCK & CO LTD	56,000	42.250	2,366,000.000	
	MINTH GROUP LTD	44,000	26.300	1,157,200.000	
	SJM HOLDINGS LTD	156,000	6.390	996,840.000	
	WYNN MACAU LTD	124,400	15.920	1,980,448.000	
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	64,800	11.600	751,680.000	
	AIA GROUP LTD	904,027	60.500	54,693,633.500	
	HKT TRUST / HKT LTD	282,000	10.960	3,090,720.000	
	SANDS CHINA LTD	169,200	33.150	5,608,980.000	
	SWIRE PROPERTIES LTD	104,200	27.200	2,834,240.000	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT CO LTD	95,750	49.100	4,701,325.000	
	HK ELECTRIC INVESTMENTS & HK ELECTRIC INVESTMENTS LTD	230,000	7.560	1,738,800.000	
	WH GROUP LTD	701,500	5.840	4,096,760.000	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	199,332	81.900	16,325,290.800	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	184,332	54.450	10,036,877.400	
香港・ドル　小計		7,661,035		237,794,978.600 (3,405,224,093)	
合計		84,236,182		290,425,195,264 (290,425,195,264)	

（２）株式以外の有価証券

平成30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	80,596.000	822,079.200	
		GOODMAN GROUP	121,619.000	1,225,919.520	
		GPT GROUP	144,955.000	724,775.000	
		LENDLEASE GROUP	37,363.000	673,281.260	
		MIRVAC GROUP	295,783.000	680,300.900	
		SCENTRE GROUP	383,688.000	1,481,035.680	
		STOCKLAND	194,018.000	779,952.360	
		VICINITY CENTRES	270,443.000	708,560.660	
	オーストラリア・ドル　小計		1,528,465.000	7,095,904.580 (567,317,571)	
	シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	200,806.000	497,998.880	
		CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	206,300.000	346,584.000	
		CAPITALAND MALL TRUST	199,000.000	413,920.000	
		SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	192,100.000	343,859.000	
	シンガポール・ドル　小計		798,206.000	1,602,361.880 (130,800,800)	
投資信託受益証券　合計			2,326,671	698,118,371 (698,118,371)	
投資証券	アメリカ・ドル	AGNC INVESTMENT CORP	32,741.000	582,789.800	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	7,304.000	874,946.160	
		AMERICAN TOWER CORP	32,749.000	4,607,129.320	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	77,528.000	766,751.920	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	10,542.000	1,825,768.980	
		BOSTON PROPERTIES INC	11,168.000	1,277,284.160	
		BROOKFIELD PROPERTY REIT INC	19,124.000	371,961.800	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	6,285.000	561,061.950	
		CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	30,388.000	3,199,248.640	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	15,118.000	1,625,185.000	
		DUKE REALTY TRUST	24,470.000	656,774.800	
		EQUINIX INC	5,887.000	2,337,609.960	
		EQUITY RESIDENTIAL	27,070.000	1,701,890.900	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	5,024.000	1,204,202.560	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	9,741.000	824,186.010	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	6,000.000	715,260.000	
		HCP INC	34,130.000	846,765.300	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	51,147.000	984,068.280	
		INVITATION HOMES INC	22,567.000	477,743.390	

		IRON MOUNTAIN INC	19,265.000	606,847.500	
		KIMCO REALTY	32,980.000	494,700.000	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	11,649.000	471,784.500	
		MID AMERICA	8,123.000	778,102.170	
		NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	10,544.000	455,922.560	
		PROLOGIS INC	49,313.000	3,098,828.920	
		PUBLIC STORAGE	11,851.000	2,319,003.680	
		REALTY INCOME CORP	22,285.000	1,247,068.600	
		REGENCY CENTERS CORP	11,294.000	696,500.980	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	8,169.000	1,197,983.850	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	23,209.000	3,954,813.600	
		SL GREEN	7,097.000	643,343.050	
		THE MACERICH COMPANY	9,014.000	451,330.980	
		UDR INC	21,658.000	829,284.820	
		VENTAS INC	25,041.000	1,336,187.760	
		VEREIT INC	72,429.000	501,208.680	
		VORNADO REALTY TRUST	12,211.000	827,905.800	
		WELLTOWER INC	26,516.000	1,636,832.680	
		WEYERHAEUSER CO	56,867.000	1,620,709.500	
	アメリカ・ドル　小計		868,498.000	48,608,988.560 (5,453,442,426)	
	イギリス・ポンド	BRITISH LAND CO PLC	71,871.000	413,258.250	
		HAMMERSON PLC	58,616.000	254,393.440	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	59,062.000	491,632.080	
		SEGRO PLC	82,914.000	502,293.010	
	イギリス・ポンド　小計		272,463.000	1,661,576.780 (246,843,846)	
	カナダ・ドル	H & R REAL ESTATE INVESTMENT	10,748.000	203,997.040	
		RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	9,675.000	229,781.250	
		SMARTCENTRES REIT	2,582.000	75,962.440	
	カナダ・ドル　小計		23,005.000	509,740.730 (43,898,871)	
	ユーロ	COVIVIO	2,343.000	197,749.200	
		GECINA SA	3,670.000	485,908.000	
		ICADE	2,234.000	163,305.400	
		KLEPIERRE	17,042.000	494,729.260	
		UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	10,338.000	1,666,692.360	
	ユーロ　小計		35,627.000	3,008,384.220 (391,450,955)	
	香港・ドル	LINK REIT	163,500.000	11,698,425.000	
	香港・ドル　小計		163,500.000	11,698,425.000 (167,521,446)	
投資証券　合計			1,363,093	6,303,157,544 (6,303,157,544)	
合計				7,001,275,915	

		(7,001,275,915)	

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

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

通貨	銘柄数	組入株式時価比率	組入投資信託受益証券時価比率	組入投資証券時価比率	有価証券の合計金額に対する比率
アメリカ・ドル	株式 596銘柄	63.57%	-%	-%	68.06%
	投資証券 38銘柄	-%	-%	1.76%	
イギリス・ポンド	株式 96銘柄	6.31%	-%	-%	6.66%
	投資証券 4銘柄	-%	-%	0.08%	
イスラエル・シュケル	株式 9銘柄	0.10%	-%	-%	0.11%
オーストラリア・ドル	株式 59銘柄	2.26%	-%	-%	2.55%
	投資信託受益証券 8銘柄	-%	0.18%	-%	
カナダ・ドル	株式 88銘柄	3.54%	-%	-%	3.70%
	投資証券 3銘柄	-%	-%	0.01%	
シンガポール・ドル	株式 21銘柄	0.42%	-%	-%	0.48%
	投資信託受益証券 4銘柄	-%	0.04%	-%	
スイス・フラン	株式 38銘柄	3.00%	-%	-%	3.13%
スウェーデン・クローナ	株式 32銘柄	0.98%	-%	-%	1.02%
デンマーク・クローネ	株式 17銘柄	0.59%	-%	-%	0.61%
ニュージーランド・ドル	株式 7銘柄	0.08%	-%	-%	0.08%
ノルウェー・クローネ	株式 10銘柄	0.29%	-%	-%	0.30%
ユーロ	株式 238銘柄	11.48%	-%	-%	12.10%
	投資証券 5銘柄	-%	-%	0.13%	
香港・ドル	株式 41銘柄	1.10%	-%	-%	1.20%
	投資証券 1銘柄	-%	-%	0.05%	

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

「外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

（単位：円）

科　　目	注記番号	平成29年10月12日現在	平成30年10月12日現在
資産の部			
流動資産			
預金		4,343,884,183	2,752,784,135
コール・ローン		1,165,606,740	1,828,346,767
国債証券		232,897,983,305	196,712,880,950
派生商品評価勘定		2,016,904	3,641,715
未収入金		－	319,943,440
未収利息		2,192,568,974	1,780,970,670
前払費用		37,619,690	26,041,528
流動資産合計		240,639,679,796	203,424,609,205
資産合計		240,639,679,796	203,424,609,205
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		－	719,032
未払金		－	1,192,646,625
未払解約金		330,542,000	217,931,000
流動負債合計		330,542,000	1,411,296,657
負債合計		330,542,000	1,411,296,657
純資産の部			
元本等			
元本	※1	130,195,447,784	112,458,205,288
剰余金			
剰余金又は欠損金（△）		110,113,690,012	89,555,107,260
元本等合計		240,309,137,796	202,013,312,548
純資産合計		240,309,137,796	202,013,312,548
負債純資産合計		240,639,679,796	203,424,609,205

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 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。
２．　デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算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。
３．　その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、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	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	29,059,648,109円
	同期中一部解約元本額	44,990,281,458円	46,796,890,605円
	元本の内訳		
ファンド名			
	ＤＩＡＭ外国債券パッシブ・ファンド	6,759,004,134円	7,828,695,366円
	ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	17,683,445円	12,133,962円
	ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	50,060,065円	32,672,527円
	ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	58,635,841円	40,635,275円
	グローバル８資産ラップファンド（安定型）	44,669,472円	85,434,297円
	グローバル８資産ラップファンド（中立型）	51,686,380円	86,584,078円
	グローバル８資産ラップファンド（積極型）	39,602,572円	52,316,242円
	たわらノーロード　先進国債券	1,039,135,759円	2,746,620,338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	87,793,845円
	たわらノーロード　バランス（堅実型）	－円	1,694,648円

たわらノーロード　バランス（標準型）	－円	9,240,402円
たわらノーロード　バランス（積極型）	－円	3,039,080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	278,668円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（安定型）	－円	15,745,793円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（安定成長型）	－円	24,978,110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	7,894,293円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（積極型）	－円	3,760,811円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	－円	126,040円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	－円	954,451円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	－円	439,864円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	－円	717,124円
ＤＩＡＭ外国債券インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	4,916,674,933円	5,130,305,928円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型	455,372,807円	508,593,929円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型	1,489,280,019円	1,661,755,217円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型	1,543,316,647円	1,750,297,361円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド	358,729,368円	375,375,876円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド	765,153,538円	812,877,584円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０インデックスファンド	582,487,469円	646,291,543円
マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	25,451,454円	22,797,155円
マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	600,460,341円	597,658,723円
マネックス資産設計ファンド　エボリューション	8,668,156円	16,493,279円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	16,036,948円	116,556,212円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	33,374,086円	67,061,918円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	60,124,279円	112,693,813円
クルーズコントロール	2,885,688,666円	2,461,568,454円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	59,102,207円	81,966,152円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス・Ｆ（成長型）	94,306,759円	145,173,468円

クルーズコントロール＜ＤＣ年金＞	962,416円	1,425,658円
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（堅実型）	8,481,034円	7,283,621円
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（積極型）	26,423,326円	18,963,158円
ダイナミック・ナビゲーション	365,719円	364,709円
４資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	－円	15,420,153円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	－円	11,075円
ＤＩＡＭパッシブ資産分散ファンド	1,481,037,130円	1,315,797,580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	6,773,540,012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	4,135,915,089円
外国債券パッシブファンド（適格機関投資家限定）	4,149,925,792円	3,316,290,366円
先進国債券パッシブファンド（適格機関投資家限定）	576,382,992円	6,087,743,818円
ＤＩＡＭワールドバランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	105,167,308円	95,731,710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	806,989,317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	659,285,763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	50,717,767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	92,921,832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	23,232,912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	7,499,874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	66,675,797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	79,005,779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	3,456,312,316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	2,282,689,021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	3,948,633,035円

	ＤＩＡＭグローバル・アセット・バランスＶＡ（適格機関投資家限定）	788,955,022円	699,334,985円
	ＤＩＡＭグローバル・アセット・バランスＶＡ２（適格機関投資家限定）	745,760,084円	263,420,576円
	ＤＩＡＭ　アクサ　グローバルバランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	3,711,066,612円	3,216,272,025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）	13,443,641,306円	2,354,914,119円
	ＤＩＡＭグローバルβ私募ファンド（適格機関投資家向け）	13,975,529円	13,975,529円
	ＤＩＡＭ世界バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	366,009,325円	16,311,743円
	ＤＩＡＭ世界バランスファンド３５ＶＡ（適格機関投資家限定）	5,331,508,870円	156,842,701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）	15,297,076,561円	10,386,113,603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）	19,723,402,912円	19,186,986,411円
	ＤＩＡＭバランス３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	14,585,789円	14,080,569円
	ＤＩＡＭバランス５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	16,997,854円	11,257,433円
	ＤＩＡＭバランス７０ＶＡ（適格機関投資家限定）	6,104,411円	5,627,956円
	ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド４ＶＡ（適格機関投資家限定）	17,579,189,791円	17,130,207,794円
	ＤＩＡＭ世界バランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	106,638,471円	100,006,763円
	ＤＩＡＭバランス２０ＶＡ（適格機関投資家限定）	124,537,679円	110,036,727円
	ＤＩＡＭバランス４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	237,498円	369,121円
	ＤＩＡＭバランス６０ＶＡ（適格機関投資家限定）	156,569円	168,633円
	計	130,195,447,784円	112,458,205,288円
２．	受益権の総数	130,195,447,784口	112,458,205,288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28年10月13日 至　平成29年10月12日	自　平成29年10月13日 至　平成30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29年10月12日現在	平成30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 「（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った場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成29年10月12日現在	平成30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	△356,950,364	△3,527,726,683
合計	△356,950,364	△3,527,726,683

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成29年2月22日から平成29年10月12日まで及び平成30年2月22日から平成30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29年10月12日 現在				平成30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	212,343,756	－	212,334,760	8,996	－	－	－	－
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	－	－	－	－
買　建	668,376,422	－	670,384,330	2,007,908	1,350,330,000	－	1,353,252,683	2,922,683
アメリカ・ドル	300,629,777	－	301,001,880	372,103	504,760,000	－	504,040,968	△719,032
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	845,570,000	－	849,211,715	3,641,715
合計	880,720,178	－	882,719,090	2,016,904	1,350,330,000	－	1,353,252,683	2,922,683

（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。

①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。

②計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

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

・計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。

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

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

（関連当事者との取引に関する注記）
該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	平成29年10月12日現在	平成30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）	1.8458円 (18,458円)	1.7963円 (17,963円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

（１）株式

該当事項はありません。

（２）株式以外の有価証券

平成30年10月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 1.0 11/30/19	6,500,000.000	6,375,525.000	
		US T N/B 1.25 01/31/20	10,800,000.000	10,593,180.000	
		US T N/B 1.25 10/31/19	15,000,000.000	14,777,250.000	
		US T N/B 1.375 01/31/20	8,600,000.000	8,449,500.000	
		US T N/B 1.375 03/31/20	6,300,000.000	6,173,496.000	
		US T N/B 1.375 04/30/20	12,000,000.000	11,743,080.000	
		US T N/B 1.375 04/30/21	11,210,000.000	10,793,996.900	
		US T N/B 1.375 05/31/20	3,500,000.000	3,420,130.000	
		US T N/B 1.375 06/30/23	7,000,000.000	6,506,710.000	
		US T N/B 1.375 09/30/23	5,900,000.000	5,462,515.000	
		US T N/B 1.5 08/15/26	7,000,000.000	6,223,420.000	
		US T N/B 1.5 10/31/19	5,180,000.000	5,116,234.200	
		US T N/B 1.625 02/15/26	5,500,000.000	4,971,890.000	
		US T N/B 1.625 05/15/26	8,500,000.000	7,657,225.000	
		US T N/B 1.625 05/31/23	5,300,000.000	4,990,268.000	
		US T N/B 1.625 08/15/22	9,500,000.000	9,042,765.000	
		US T N/B 1.625 11/15/22	11,050,000.000	10,481,919.500	
		US T N/B 1.625 11/30/20	8,510,000.000	8,291,888.700	
		US T N/B 1.75 01/31/23	10,000,000.000	9,506,200.000	
		US T N/B 1.75 03/31/22	11,700,000.000	11,242,881.000	
		US T N/B 1.75 05/15/22	11,600,000.000	11,130,548.000	
		US T N/B 1.75 05/15/23	7,000,000.000	6,631,380.000	
		US T N/B 1.75 09/30/22	10,230,000.000	9,769,650.000	
		US T N/B 1.75 10/31/20	6,000,000.000	5,868,720.000	
		US T N/B 1.75 12/31/20	9,000,000.000	8,784,810.000	
		US T N/B 1.875 02/28/22	1,680,000.000	1,622,762.400	
		US T N/B 1.875 06/30/20	11,000,000.000	10,826,310.000	
		US T N/B 1.875 08/31/22	12,000,000.000	11,524,680.000	
		US T N/B 1.875 08/31/24	5,760,000.000	5,404,492.800	
		US T N/B 2.0 02/15/22	15,390,000.000	14,935,379.400	
		US T N/B 2.0 02/15/23	9,500,000.000	9,124,370.000	
		US T N/B 2.0 02/15/25	9,500,000.000	8,923,255.000	
		US T N/B 2.0 05/31/21	12,000,000.000	11,726,160.000	
		US T N/B 2.0 05/31/24	6,180,000.000	5,854,561.200	
		US T N/B 2.0 08/15/25	9,000,000.000	8,405,820.000	
		US T N/B 2.0 09/30/20	6,000,000.000	5,903,400.000	
		US T N/B 2.0 11/15/21	10,400,000.000	10,119,200.000	
		US T N/B 2.0 11/15/26	7,000,000.000	6,443,780.000	
		US T N/B 2.0 11/30/20	10,500,000.000	10,312,050.000	
		US T N/B 2.0 11/30/22	6,590,000.000	6,343,336.300	

		US T N/B 2.125 01/31/21	5,000,000.000	4,915,600.000	
		US T N/B 2.125 05/15/25	9,980,000.000	9,422,517.200	
		US T N/B 2.125 06/30/22	9,500,000.000	9,226,115.000	
		US T N/B 2.125 08/15/21	11,000,000.000	10,765,370.000	
		US T N/B 2.125 08/31/20	3,000,000.000	2,960,610.000	
		US T N/B 2.125 09/30/21	10,000,000.000	9,774,200.000	
		US T N/B 2.125 09/30/24	6,780,000.000	6,444,661.200	
		US T N/B 2.125 12/31/21	12,880,000.000	12,563,023.200	
		US T N/B 2.125 12/31/22	8,000,000.000	7,731,840.000	
		US T N/B 2.25 02/15/27	8,000,000.000	7,481,200.000	
		US T N/B 2.25 03/31/21	11,500,000.000	11,325,660.000	
		US T N/B 2.25 08/15/27	8,000,000.000	7,459,360.000	
		US T N/B 2.25 08/15/46	4,500,000.000	3,634,425.000	
		US T N/B 2.25 11/15/24	10,600,000.000	10,132,858.000	
		US T N/B 2.25 11/15/25	7,000,000.000	6,630,260.000	
		US T N/B 2.25 11/15/27	8,100,000.000	7,538,022.000	
		US T N/B 2.25 12/31/23	6,610,000.000	6,371,907.800	
		US T N/B 2.375 05/15/27	6,330,000.000	5,978,874.900	
		US T N/B 2.375 08/15/24	8,900,000.000	8,587,076.000	
		US T N/B 2.375 12/31/20	8,300,000.000	8,211,107.000	
		US T N/B 2.5 02/15/45	4,500,000.000	3,863,295.000	
		US T N/B 2.5 02/15/46	5,000,000.000	4,276,150.000	
		US T N/B 2.5 03/31/23	1,020,000.000	999,671.400	
		US T N/B 2.5 05/15/24	9,000,000.000	8,760,870.000	
		US T N/B 2.5 05/15/46	4,400,000.000	3,758,876.000	
		US T N/B 2.5 08/15/23	8,000,000.000	7,824,960.000	
		US T N/B 2.625 03/31/25	4,080,000.000	3,977,020.800	
		US T N/B 2.625 06/30/23	1,820,000.000	1,791,262.200	
		US T N/B 2.625 08/15/20	16,500,000.000	16,436,805.000	
		US T N/B 2.625 08/31/20	9,250,000.000	9,214,202.500	
		US T N/B 2.625 11/15/20	6,000,000.000	5,970,180.000	
		US T N/B 2.75 02/15/24	9,400,000.000	9,284,662.000	
		US T N/B 2.75 02/15/28	5,950,000.000	5,765,907.000	
		US T N/B 2.75 02/28/25	5,810,000.000	5,708,731.700	
		US T N/B 2.75 05/31/23	3,270,000.000	3,238,052.100	
		US T N/B 2.75 06/30/25	790,000.000	774,934.700	
		US T N/B 2.75 07/31/23	6,500,000.000	6,431,425.000	
		US T N/B 2.75 08/15/42	2,800,000.000	2,546,012.000	
		US T N/B 2.75 08/15/47	5,150,000.000	4,599,568.000	
		US T N/B 2.75 08/31/23	2,170,000.000	2,147,280.100	
		US T N/B 2.75 08/31/25	1,640,000.000	1,607,446.000	
		US T N/B 2.75 11/15/23	10,000,000.000	9,886,700.000	
		US T N/B 2.75 11/15/42	3,400,000.000	3,090,532.000	
		US T N/B 2.75 11/15/47	3,230,000.000	2,895,113.600	
		US T N/B 2.875 05/15/28	7,120,000.000	6,968,700.000	
		US T N/B 2.875 05/15/43	3,880,000.000	3,601,105.600	
		US T N/B 2.875 07/31/25	3,390,000.000	3,349,726.800	
		US T N/B 2.875 08/15/28	1,570,000.000	1,536,260.700	
		US T N/B 2.875 08/15/45	4,900,000.000	4,526,375.000	

	US T N/B 2.875 11/15/46	4,400,000.000	4,054,864.000	
	US T N/B 3.0 02/15/47	4,430,000.000	4,183,559.100	
	US T N/B 3.0 02/15/48	4,020,000.000	3,786,960.600	
	US T N/B 3.0 05/15/42	980,000.000	932,293.600	
	US T N/B 3.0 05/15/45	5,000,000.000	4,733,200.000	
	US T N/B 3.0 05/15/47	4,680,000.000	4,399,902.000	
	US T N/B 3.0 08/15/48	2,920,000.000	2,752,100.000	
	US T N/B 3.0 11/15/44	5,100,000.000	4,829,037.000	
	US T N/B 3.0 11/15/45	3,900,000.000	3,689,127.000	
	US T N/B 3.125 02/15/42	1,800,000.000	1,752,750.000	
	US T N/B 3.125 02/15/43	2,600,000.000	2,523,404.000	
	US T N/B 3.125 05/15/21	8,000,000.000	8,045,600.000	
	US T N/B 3.125 05/15/48	4,350,000.000	4,202,839.500	
	US T N/B 3.125 08/15/44	4,600,000.000	4,458,044.000	
	US T N/B 3.125 11/15/41	1,800,000.000	1,753,308.000	
	US T N/B 3.375 05/15/44	3,910,000.000	3,958,562.200	
	US T N/B 3.375 11/15/19	4,000,000.000	4,028,400.000	
	US T N/B 3.5 02/15/39	1,300,000.000	1,349,764.000	
	US T N/B 3.5 05/15/20	14,000,000.000	14,150,920.000	
	US T N/B 3.625 02/15/20	15,300,000.000	15,469,065.000	
	US T N/B 3.625 02/15/21	5,500,000.000	5,590,860.000	
	US T N/B 3.625 02/15/44	4,510,000.000	4,758,365.700	
	US T N/B 3.625 08/15/43	2,790,000.000	2,942,557.200	
	US T N/B 3.75 08/15/41	2,000,000.000	2,148,740.000	
	US T N/B 3.75 11/15/43	4,120,000.000	4,433,490.800	
	US T N/B 3.875 08/15/40	2,100,000.000	2,296,203.000	
	US T N/B 4.25 05/15/39	720,000.000	828,050.400	
	US T N/B 4.25 11/15/40	2,000,000.000	2,305,460.000	
	US T N/B 4.375 02/15/38	750,000.000	873,337.500	
	US T N/B 4.375 05/15/40	2,000,000.000	2,341,080.000	
	US T N/B 4.375 05/15/41	2,000,000.000	2,347,640.000	
	US T N/B 4.375 11/15/39	1,660,000.000	1,939,859.400	
	US T N/B 4.5 02/15/36	2,000,000.000	2,345,620.000	
	US T N/B 4.5 05/15/38	1,100,000.000	1,302,202.000	
	US T N/B 4.5 08/15/39	1,400,000.000	1,662,052.000	
	US T N/B 4.625 02/15/40	2,300,000.000	2,777,963.000	
	US T N/B 4.75 02/15/41	1,800,000.000	2,218,626.000	
	US T N/B 5.0 05/15/37	800,000.000	999,624.000	
	US T N/B 5.25 02/15/29	1,000,000.000	1,186,010.000	
	US T N/B 5.25 11/15/28	1,500,000.000	1,771,515.000	
	US T N/B 5.375 02/15/31	1,500,000.000	1,839,135.000	
	US T N/B 5.5 08/15/28	1,100,000.000	1,319,395.000	
	US T N/B 6.0 02/15/26	2,360,000.000	2,812,435.600	
	US T N/B 6.125 11/15/27	1,400,000.000	1,731,618.000	
	US T N/B 6.25 05/15/30	1,400,000.000	1,820,098.000	
	US T N/B 6.25 08/15/23	1,000,000.000	1,147,100.000	
	US T N/B 8.0 11/15/21	6,000,000.000	6,897,600.000	
アメリカ・ドル　小計		813,800,000.000 (91,300,222,000)	793,151,589.500 (88,983,676,826)	

イギリス・ポンド	UK TREASURY 0.5 07/22/22	2,350,000.000	2,298,135.500	
	UK TREASURY 0.75 07/22/23	1,360,000.000	1,329,155.200	
	UK TREASURY 1.25 07/22/27	2,730,000.000	2,656,808.700	
	UK TREASURY 1.5 01/22/21	2,700,000.000	2,735,694.000	
	UK TREASURY 1.5 07/22/26	2,400,000.000	2,404,920.000	
	UK TREASURY 1.5 07/22/47	2,400,000.000	2,104,560.000	
	UK TREASURY 1.625 10/22/28	820,000.000	816,080.400	
	UK TREASURY 1.625 10/22/71	430,000.000	380,240.400	
	UK TREASURY 1.75 07/22/57	1,530,000.000	1,421,523.000	
	UK TREASURY 1.75 09/07/22	3,000,000.000	3,073,020.000	
	UK TREASURY 1.75 09/07/37	1,250,000.000	1,194,000.000	
	UK TREASURY 2.0 09/07/25	930,000.000	967,851.000	
	UK TREASURY 2.25 09/07/23	2,800,000.000	2,935,772.000	
	UK TREASURY 2.5 07/22/65	2,000,000.000	2,310,480.000	
	UK TREASURY 2.75 09/07/24	2,000,000.000	2,161,820.000	
	UK TREASURY 3.25 01/22/44	2,600,000.000	3,188,120.000	
	UK TREASURY 3.5 01/22/45	2,520,000.000	3,230,640.000	
	UK TREASURY 3.5 07/22/68	1,900,000.000	2,801,360.000	
	UK TREASURY 3.75 07/22/52	1,780,000.000	2,521,370.000	
	UK TREASURY 3.75 09/07/20	2,900,000.000	3,057,470.000	
	UK TREASURY 3.75 09/07/21	1,850,000.000	1,997,204.500	
	UK TREASURY 4.0 01/22/60	1,600,000.000	2,498,080.000	
	UK TREASURY 4.0 03/07/22	2,000,000.000	2,198,820.000	
	UK TREASURY 4.25 03/07/36	2,450,000.000	3,268,545.000	
	UK TREASURY 4.25 06/07/32	1,850,000.000	2,383,725.000	

		UK TREASURY 4.25 09/07/39	1,550,000.000	2,131,870.000	
		UK TREASURY 4.25 12/07/27	1,700,000.000	2,091,867.000	
		UK TREASURY 4.25 12/07/40	1,980,000.000	2,753,586.000	
		UK TREASURY 4.25 12/07/46	1,930,000.000	2,817,607.000	
		UK TREASURY 4.25 12/07/49	1,560,000.000	2,341,404.000	
		UK TREASURY 4.25 12/07/55	1,940,000.000	3,063,454.000	
		UK TREASURY 4.5 09/07/34	1,680,000.000	2,268,672.000	
		UK TREASURY 4.5 12/07/42	1,720,000.000	2,514,124.000	
		UK TREASURY 4.75 12/07/30	1,500,000.000	1,989,450.000	
		UK TREASURY 4.75 12/07/38	1,610,000.000	2,338,686.000	
		UK TREASURY 5.0 03/07/25	2,030,000.000	2,483,116.300	
		UK TREASURY 6.0 12/07/28	1,350,000.000	1,903,500.000	
		UK TREASURY 8.0 06/07/21	1,700,000.000	2,013,786.000	
	イギリス・ポンド　小計		72,400,000.000 (10,755,744,000)	86,646,517.000 (12,872,206,566)	
	オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN 5.75 05/15/21	3,700,000.000	4,043,878.000	
		AUSTRALIAN 1.75 11/21/20	2,400,000.000	2,386,128.000	
		AUSTRALIAN 2.0 12/21/21	1,770,000.000	1,764,690.000	
		AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	2,570,000.000	2,467,457.000	
		AUSTRALIAN 2.25 11/21/22	890,000.000	891,771.100	
		AUSTRALIAN 2.75 04/21/24	3,100,000.000	3,160,760.000	
		AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	900,000.000	870,048.000	
		AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	2,900,000.000	2,907,511.000	
		AUSTRALIAN 2.75 11/21/28	2,700,000.000	2,704,239.000	
		AUSTRALIAN 2.75 11/21/29	1,560,000.000	1,558,330.800	
		AUSTRALIAN 3.0 03/21/47	1,250,000.000	1,201,062.500	
		AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	3,100,000.000	3,240,368.000	

	AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	3,100,000.000	3,244,212.000	
	AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	900,000.000	919,377.000	
	AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	1,200,000.000	1,318,728.000	
	AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	3,600,000.000	4,008,924.000	
	AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	1,500,000.000	1,784,490.000	
	AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	3,600,000.000	4,173,624.000	
	AUSTRALIAN 5.5 04/21/23	3,000,000.000	3,419,010.000	
	AUSTRALIAN 5.75 07/15/22	3,500,000.000	3,953,145.000	
オーストラリア・ドル　小計		47,240,000.000 (3,776,838,000)	50,017,753.400 (3,998,919,384)	
カナダ・ドル	CANADA　8.0 06/01/27	1,000,000.000	1,425,500.000	
	CANADA 0.75 03/01/21	1,090,000.000	1,051,784.600	
	CANADA 0.75 09/01/20	2,400,000.000	2,334,408.000	
	CANADA 0.75 09/01/21	600,000.000	574,122.000	
	CANADA 1.0 06/01/27	800,000.000	708,200.000	
	CANADA 1.0 09/01/22	800,000.000	760,376.000	
	CANADA 1.5 03/01/20	2,300,000.000	2,278,886.000	
	CANADA 1.5 06/01/23	2,300,000.000	2,213,221.000	
	CANADA 1.5 06/01/26	1,700,000.000	1,586,032.000	
	CANADA 1.75 03/01/23	1,160,000.000	1,130,582.400	
	CANADA 1.75 05/01/20	2,770,000.000	2,750,582.300	
	CANADA 2.0 06/01/28	1,020,000.000	976,517.400	
	CANADA 2.0 12/01/51	150,000.000	133,297.500	
	CANADA 2.25 06/01/25	1,500,000.000	1,481,775.000	
	CANADA 2.5 06/01/24	1,600,000.000	1,607,504.000	
	CANADA 2.75 06/01/22	3,900,000.000	3,956,589.000	
	CANADA 2.75 12/01/48	1,450,000.000	1,526,995.000	
	CANADA 2.75 12/01/64	750,000.000	809,265.000	
	CANADA 3.25 06/01/21	4,700,000.000	4,814,492.000	
	CANADA 3.5 06/01/20	2,800,000.000	2,857,204.000	
	CANADA 3.5 12/01/45	1,900,000.000	2,269,303.000	
	CANADA 4.0 06/01/41	1,800,000.000	2,256,624.000	
	CANADA 5.0 06/01/37	1,400,000.000	1,912,722.000	
	CANADA 5.75 06/01/29	1,600,000.000	2,081,264.000	
	CANADA 5.75 06/01/33	1,550,000.000	2,160,514.000	
カナダ・ドル　小計		43,040,000.000 (3,706,604,800)	45,657,760.200 (3,932,046,308)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE 1.25 10/01/21	1,000,000.000	973,200.000	
	SINGAPORE 2.25 08/01/36	200,000.000	182,020.000	
	SINGAPORE 2.375 06/01/25	500,000.000	497,000.000	
	SINGAPORE 2.75 03/01/46	660,000.000	637,725.000	
	SINGAPORE 2.75 04/01/42	550,000.000	533,225.000	

	SINGAPORE 2.875 07/01/29	400,000.000	408,520.000	
	SINGAPORE 2.875 09/01/30	460,000.000	467,360.000	
	SINGAPORE 3.0 09/01/24	810,000.000	835,515.000	
	SINGAPORE 3.125 09/01/22	1,600,000.000	1,651,200.000	
	SINGAPORE 3.25 09/01/20	1,340,000.000	1,370,083.000	
	SINGAPORE 3.375 09/01/33	480,000.000	510,537.600	
	SINGAPORE 3.5 03/01/27	900,000.000	963,900.000	
シンガポール・ドル　小計		8,900,000.000 (726,507,000)	9,030,285.600 (737,142,214)	
スウェーデン・クローナ	SWEDEN 0.75 05/12/28	4,970,000.000	4,981,629.800	
	SWEDEN 1.0 11/12/26	7,000,000.000	7,237,090.000	
	SWEDEN 1.5 11/13/23	9,700,000.000	10,358,242.000	
	SWEDEN 2.5 05/12/25	7,300,000.000	8,313,021.000	
	SWEDEN 3.5 03/30/39	6,200,000.000	8,476,330.000	
	SWEDEN 3.5 06/01/22	12,870,000.000	14,533,190.100	
スウェーデン・クローナ　小計		48,040,000.000 (600,980,400)	53,899,502.900 (674,282,781)	
デンマーク・クローネ	DENMARK 0.5 11/15/27	7,130,000.000	7,154,028.100	
	DENMARK 1.5 11/15/23	5,500,000.000	5,932,575.000	
	DENMARK 1.75 11/15/25	9,470,000.000	10,490,676.600	
	DENMARK 3.0 11/15/21	13,000,000.000	14,342,900.000	
	DENMARK 4.5 11/15/39	15,240,000.000	25,770,230.400	
デンマーク・クローネ　小計		50,340,000.000 (877,929,600)	63,690,410.100 (1,110,760,752)	
ノルウェー・クローネ	NORWAY 1.5 02/19/26	6,000,000.000	5,836,800.000	
	NORWAY 1.75 02/17/27	3,970,000.000	3,900,644.100	
	NORWAY 1.75 03/13/25	3,800,000.000	3,780,506.000	
	NORWAY 2.0 05/24/23	7,600,000.000	7,723,728.000	
	NORWAY 3.0 03/14/24	6,200,000.000	6,606,100.000	
ノルウェー・クローネ　小計		27,570,000.000 (377,157,600)	27,847,778.100 (380,957,604)	
ポーランド・ズロチ	POLAND 1.5 04/25/20	3,000,000.000	3,001,140.000	
	POLAND 1.75 07/25/21	2,200,000.000	2,198,460.000	
	POLAND 2.0 04/25/21	1,130,000.000	1,137,345.000	
	POLAND 2.25 04/25/22	4,000,000.000	4,014,400.000	
	POLAND 2.5 01/25/23	1,350,000.000	1,354,050.000	
	POLAND 2.5 07/25/26	4,200,000.000	4,029,690.000	
	POLAND 2.5 07/25/27	3,000,000.000	2,840,580.000	
	POLAND 2.75 04/25/28	960,000.000	920,784.000	
	POLAND 3.25 07/25/25	3,300,000.000	3,359,895.000	
	POLAND 4.0 10/25/23	3,100,000.000	3,309,715.000	
	POLAND 5.25 10/25/20	4,900,000.000	5,259,170.000	
	POLAND 5.75 04/25/29	1,440,000.000	1,770,163.200	
	POLAND 5.75 09/23/22	3,200,000.000	3,613,376.000	
	POLAND 5.75 10/25/21	3,680,000.000	4,096,024.000	

ポーランド・ズロチ　小計		39,460,000.000 (1,192,086,600)	40,904,792.200 (1,235,733,772)	
マレーシア・リンギット	MALAYSIA 3.418 08/15/22	3,000,000.000	2,962,350.000	
	MALAYSIA 3.48 03/15/23	1,220,000.000	1,202,700.400	
	MALAYSIA 3.492 03/31/20	2,200,000.000	2,199,934.000	
	MALAYSIA 3.502 05/31/27	2,570,000.000	2,445,663.400	
	MALAYSIA 3.733 06/15/28	2,000,000.000	1,938,660.000	
	MALAYSIA 3.844 04/15/33	1,210,000.000	1,118,753.900	
	MALAYSIA 3.892 03/15/27	800,000.000	785,088.000	
	MALAYSIA 4.127 04/15/32	1,850,000.000	1,765,399.500	
	MALAYSIA 4.16 07/15/21	4,000,000.000	4,053,880.000	
	MALAYSIA 4.181 07/15/24	2,430,000.000	2,456,001.000	
	MALAYSIA 4.378 11/29/19	3,680,000.000	3,717,940.800	
	MALAYSIA 4.392 04/15/26	3,070,000.000	3,125,382.800	
	MALAYSIA 4.498 04/15/30	1,800,000.000	1,805,544.000	
	MALAYSIA 4.935 09/30/43	2,000,000.000	2,016,780.000	
	MALAYSIA 5.248 09/15/28	1,600,000.000	1,701,072.000	
マレーシア・リンギット　小計		33,430,000.000 (902,944,300)	33,295,149.800 (899,301,996)	
メキシコ・ペソ	MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	13,000,000.000	15,103,010.000	
	MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	35,000,000.000	38,375,400.000	
	MEXICAN BONDS 5.75 03/05/26	14,859,000.000	12,944,120.670	
	MEXICAN BONDS 6.5 06/09/22	26,000,000.000	24,801,400.000	
	MEXICAN BONDS 6.5 06/10/21	38,000,000.000	36,685,200.000	
	MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	10,000,000.000	9,596,000.000	
	MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	10,000,000.000	9,617,000.000	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	22,000,000.000	20,748,200.000	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	7,000,000.000	6,679,400.000	
	MEXICAN BONDS 8.0 06/11/20	30,000,000.000	30,036,000.000	
	MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47	5,000,000.000	4,837,250.000	
	MEXICAN BONDS 8.0 12/07/23	14,000,000.000	14,002,660.000	
	MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	31,000,000.000	31,687,580.000	
	MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	15,000,000.000	15,307,500.000	
メキシコ・ペソ　小計		270,859,000.000 (1,603,485,280)	270,420,720.670 (1,600,890,666)	
ユーロ	AUSTRIA 0.5 04/20/27	500,000.000	494,945.000	

		AUSTRIA 0.75 10/20/26	1,300,000.000	1,322,568.000	
		AUSTRIA 07/15/23	350,000.000	349,352.500	
		AUSTRIA 09/20/22	1,790,000.000	1,798,144.500	
		AUSTRIA 1.2 10/20/25	1,000,000.000	1,058,100.000	
		AUSTRIA 1.5 02/20/47	230,000.000	231,851.500	
		AUSTRIA 1.5 11/02/86	290,000.000	258,662.600	
		AUSTRIA 1.65 10/21/24	1,250,000.000	1,358,325.000	
		AUSTRIA 1.75 10/20/23	1,400,000.000	1,520,120.000	
		AUSTRIA 2.1 09/20/17	100,000.000	109,372.000	
		AUSTRIA 2.4 05/23/34	900,000.000	1,064,880.000	
		AUSTRIA 3.15 06/20/44	810,000.000	1,124,919.900	
		AUSTRIA 3.4 11/22/22	1,500,000.000	1,718,055.000	
		AUSTRIA 3.5 09/15/21	1,900,000.000	2,113,750.000	
		AUSTRIA 3.65 04/20/22	1,200,000.000	1,363,620.000	
		AUSTRIA 3.8 01/26/62	820,000.000	1,387,292.400	
		AUSTRIA 3.9 07/15/20	1,700,000.000	1,830,900.000	
		AUSTRIA 4.15 03/15/37	1,480,000.000	2,200,020.000	
		AUSTRIA 4.85 03/15/26	1,100,000.000	1,459,128.000	
		AUSTRIA 6.25 07/15/27	1,150,000.000	1,704,461.000	
		BELGIUM 0.2 10/22/23	150,000.000	150,210.000	
		BELGIUM 0.5 10/22/24	1,070,000.000	1,080,518.100	
		BELGIUM 0.8 06/22/25	2,000,000.000	2,047,820.000	
		BELGIUM 0.8 06/22/27	1,100,000.000	1,102,937.000	
		BELGIUM 0.8 06/22/28	690,000.000	683,631.300	
		BELGIUM 1.0 06/22/26	1,500,000.000	1,542,735.000	
		BELGIUM 1.0 06/22/31	1,300,000.000	1,279,057.000	
		BELGIUM 1.25 04/22/33	510,000.000	508,791.300	
		BELGIUM 1.45 06/22/37	440,000.000	436,176.400	
		BELGIUM 1.6 06/22/47	900,000.000	863,712.000	
		BELGIUM 1.9 06/22/38	800,000.000	851,824.000	
		BELGIUM 2.15 06/22/66	700,000.000	713,860.000	
		BELGIUM 2.25 06/22/23	1,700,000.000	1,875,236.000	
		BELGIUM 2.25 06/22/57	280,000.000	299,303.200	
		BELGIUM 2.6 06/22/24	1,510,000.000	1,708,912.300	
		BELGIUM 3.0 06/22/34	850,000.000	1,050,982.500	
		BELGIUM 3.75 06/22/45	1,130,000.000	1,624,634.900	
		BELGIUM 3.75 09/28/20	2,200,000.000	2,383,282.000	
		BELGIUM 4.0 03/28/22	1,500,000.000	1,719,330.000	
		BELGIUM 4.0 03/28/32	950,000.000	1,288,304.500	
		BELGIUM 4.25 03/28/41	1,740,000.000	2,612,749.200	
		BELGIUM 4.25 09/28/21	1,870,000.000	2,124,207.800	
		BELGIUM 4.25 09/28/22	1,950,000.000	2,287,369.500	
		BELGIUM 4.5 03/28/26	1,200,000.000	1,547,520.000	
		BELGIUM 5.0 03/28/35	2,200,000.000	3,388,880.000	
		BELGIUM 5.5 03/28/28	2,500,000.000	3,572,875.000	
		BUNDESOBL 0.25 10/16/20	1,500,000.000	1,524,525.000	
		BUNDESOBL 04/08/22	3,000,000.000	3,034,620.000	
		BUNDESOBL 04/09/21	2,200,000.000	2,227,236.000	
		BUNDESOBL 10/07/22	2,730,000.000	2,756,863.200	

		BUNDESSCHAT 12/13/19	800,000.000	805,848.000	
		DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27	2,680,000.000	2,659,605.200	
		DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28	890,000.000	867,153.700	
		DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25	2,200,000.000	2,254,560.000	
		DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26	2,690,000.000	2,744,553.200	
		DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28	2,210,000.000	2,218,066.500	
		DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27	2,700,000.000	2,724,354.000	
		DEUTSCHLAND 08/15/26	2,800,000.000	2,738,624.000	
		DEUTSCHLAND 1.0 08/15/24	2,600,000.000	2,745,678.000	
		DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25	2,500,000.000	2,642,900.000	
		DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48	1,060,000.000	1,091,598.600	
		DEUTSCHLAND 1.5 02/15/23	2,100,000.000	2,255,400.000	
		DEUTSCHLAND 1.5 05/15/23	2,500,000.000	2,690,775.000	
		DEUTSCHLAND 1.5 05/15/24	2,000,000.000	2,167,740.000	
		DEUTSCHLAND 1.5 09/04/22	1,650,000.000	1,764,592.500	
		DEUTSCHLAND 1.75 02/15/24	1,500,000.000	1,643,010.000	
		DEUTSCHLAND 1.75 07/04/22	2,700,000.000	2,907,414.000	
		DEUTSCHLAND 2.0 01/04/22	2,700,000.000	2,908,170.000	
		DEUTSCHLAND 2.0 08/15/23	1,500,000.000	1,654,050.000	
		DEUTSCHLAND 2.25 09/04/20	4,200,000.000	4,426,128.000	
		DEUTSCHLAND 2.25 09/04/21	1,070,000.000	1,153,567.000	
		DEUTSCHLAND 2.5 01/04/21	2,200,000.000	2,350,062.000	
		DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	2,700,000.000	3,565,296.000	
		DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	2,700,000.000	3,607,281.000	
		DEUTSCHLAND 3.0 07/04/20	3,000,000.000	3,187,170.000	
		DEUTSCHLAND 3.25 01/04/20	3,600,000.000	3,775,752.000	

		DEUTSCHLAND 3.25 07/04/21	3,150,000.000	3,470,166.000	
		DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	1,650,000.000	2,430,070.500	
		DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	2,600,000.000	3,967,808.000	
		DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	1,660,000.000	2,695,026.600	
		DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	1,420,000.000	1,999,814.400	
		DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	2,200,000.000	3,488,760.000	
		DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	1,480,000.000	2,585,737.600	
		DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	2,050,000.000	3,229,406.000	
		DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	1,600,000.000	2,356,640.000	
		DEUTSCHLAND 6.25 01/04/24	1,700,000.000	2,260,337.000	
		DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	1,100,000.000	1,783,485.000	
		DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	1,120,000.000	1,712,860.800	
		FINLAND 0.375 09/15/20	500,000.000	508,565.000	
		FINLAND 0.5 04/15/26	600,000.000	601,560.000	
		FINLAND 0.5 09/15/27	300,000.000	296,004.000	
		FINLAND 0.75 04/15/31	450,000.000	440,181.000	
		FINLAND 0.875 09/15/25	300,000.000	310,428.000	
		FINLAND 04/15/22	320,000.000	322,160.000	
		FINLAND 09/15/23	230,000.000	229,353.700	
		FINLAND 1.125 04/15/34	420,000.000	423,477.600	
		FINLAND 1.5 04/15/23	950,000.000	1,015,170.000	
		FINLAND 1.625 09/15/22	400,000.000	427,472.000	
		FINLAND 2.0 04/15/24	680,000.000	749,244.400	
		FINLAND 2.625 07/04/42	660,000.000	856,026.600	
		FINLAND 2.75 07/04/28	630,000.000	750,021.300	
		FINLAND 3.375 04/15/20	980,000.000	1,038,045.400	
		FINLAND 3.5 04/15/21	700,000.000	769,013.000	
		FINLAND 4.0 07/04/25	800,000.000	994,984.000	
		FRANCE BTAN 8.5 04/25/23	1,700,000.000	2,354,636.000	
		FRANCE OAT 0.25 11/25/26	3,000,000.000	2,915,760.000	
		FRANCE OAT 0.5 05/25/25	3,700,000.000	3,730,377.000	
		FRANCE OAT 0.5 05/25/26	3,560,000.000	3,550,601.600	
		FRANCE OAT 0.5 11/25/19	500,000.000	505,835.000	
		FRANCE OAT 0.75 05/25/28	3,590,000.000	3,568,998.500	

		FRANCE OAT 0.75 11/25/28	1,370,000.000	1,353,409.300	
		FRANCE OAT 03/25/23	1,900,000.000	1,897,397.000	
		FRANCE OAT 05/25/21	2,510,000.000	2,533,092.000	
		FRANCE OAT 05/25/22	3,000,000.000	3,017,190.000	
		FRANCE OAT 1.0 05/25/27	4,000,000.000	4,105,400.000	
		FRANCE OAT 1.0 11/25/25	3,700,000.000	3,842,450.000	
		FRANCE OAT 1.25 05/25/34	400,000.000	399,968.000	
		FRANCE OAT 1.25 05/25/36	2,840,000.000	2,791,152.000	
		FRANCE OAT 1.5 05/25/31	4,980,000.000	5,227,755.000	
		FRANCE OAT 1.75 05/25/23	4,400,000.000	4,746,940.000	
		FRANCE OAT 1.75 05/25/66	1,250,000.000	1,185,250.000	
		FRANCE OAT 1.75 06/25/39	1,200,000.000	1,259,580.000	
		FRANCE OAT 1.75 11/25/24	4,500,000.000	4,898,655.000	
		FRANCE OAT 2.0 05/25/48	1,710,000.000	1,817,097.300	
		FRANCE OAT 2.25 05/25/24	4,000,000.000	4,455,320.000	
		FRANCE OAT 2.25 10/25/22	3,400,000.000	3,720,518.000	
		FRANCE OAT 2.5 05/25/30	3,900,000.000	4,546,659.000	
		FRANCE OAT 2.5 10/25/20	7,800,000.000	8,273,148.000	
		FRANCE OAT 2.75 10/25/27	4,000,000.000	4,715,760.000	
		FRANCE OAT 3.0 04/25/22	5,300,000.000	5,897,681.000	
		FRANCE OAT 3.25 05/25/45	2,700,000.000	3,650,265.000	
		FRANCE OAT 3.25 10/25/21	5,200,000.000	5,760,560.000	
		FRANCE OAT 3.5 04/25/20	6,500,000.000	6,903,325.000	
		FRANCE OAT 3.5 04/25/26	3,430,000.000	4,198,663.000	
		FRANCE OAT 3.75 04/25/21	4,640,000.000	5,127,246.400	
		FRANCE OAT 4.0 04/25/55	1,900,000.000	3,006,750.000	
		FRANCE OAT 4.0 04/25/60	1,600,000.000	2,592,800.000	
		FRANCE OAT 4.0 10/25/38	3,100,000.000	4,520,544.000	
		FRANCE OAT 4.25 10/25/23	5,000,000.000	6,044,450.000	
		FRANCE OAT 4.5 04/25/41	3,620,000.000	5,710,188.000	
		FRANCE OAT 4.75 04/25/35	3,100,000.000	4,739,156.000	
		FRANCE OAT 5.5 04/25/29	3,650,000.000	5,355,535.500	
		FRANCE OAT 5.75 10/25/32	3,390,000.000	5,441,967.000	
		FRANCE OAT 6.0 10/25/25	2,900,000.000	4,023,518.000	

		IRISH 0.8 03/15/22	950,000.000	977,084.500	
		IRISH 0.9 05/15/28	340,000.000	334,808.200	
		IRISH 1.0 05/15/26	1,200,000.000	1,220,592.000	
		IRISH 1.3 05/15/33	450,000.000	436,878.000	
		IRISH 1.7 05/15/37	750,000.000	753,975.000	
		IRISH 2.0 02/18/45	960,000.000	991,718.400	
		IRISH 2.4 05/15/30	1,100,000.000	1,233,837.000	
		IRISH 3.4 03/18/24	930,000.000	1,082,315.400	
		IRISH 3.9 03/20/23	700,000.000	816,284.000	
		IRISH 4.5 04/18/20	1,130,000.000	1,214,411.000	
		IRISH 5.0 10/18/20	850,000.000	942,905.000	
		IRISH 5.4 03/13/25	1,260,000.000	1,641,893.400	
		ITALY BTPS 0.35 11/01/21	1,700,000.000	1,601,876.000	
		ITALY BTPS 0.65 10/15/23	2,100,000.000	1,883,847.000	
		ITALY BTPS 0.65 11/01/20	3,600,000.000	3,518,640.000	
		ITALY BTPS 0.9 08/01/22	980,000.000	917,368.200	
		ITALY BTPS 0.95 03/15/23	2,500,000.000	2,308,000.000	
		ITALY BTPS 1.05 12/01/19	2,000,000.000	1,998,100.000	
		ITALY BTPS 1.25 12/01/26	2,000,000.000	1,724,800.000	
		ITALY BTPS 1.35 04/15/22	2,500,000.000	2,394,725.000	
		ITALY BTPS 1.45 09/15/22	1,500,000.000	1,430,955.000	
		ITALY BTPS 1.45 11/15/24	2,020,000.000	1,833,473.200	
		ITALY BTPS 1.5 06/01/25	2,500,000.000	2,249,725.000	
		ITALY BTPS 1.6 06/01/26	1,500,000.000	1,338,300.000	
		ITALY BTPS 1.65 03/01/32	2,260,000.000	1,818,554.200	
		ITALY BTPS 1.85 05/15/24	2,100,000.000	1,970,220.000	
		ITALY BTPS 2.0 02/01/28	1,130,000.000	1,008,152.100	
		ITALY BTPS 2.0 12/01/25	2,700,000.000	2,490,345.000	
		ITALY BTPS 2.05 08/01/27	2,780,000.000	2,502,083.400	
		ITALY BTPS 2.15 12/15/21	2,200,000.000	2,178,880.000	
		ITALY BTPS 2.2 06/01/27	2,040,000.000	1,864,968.000	
		ITALY BTPS 2.25 09/01/36	1,500,000.000	1,224,300.000	
		ITALY BTPS 2.45 09/01/33	1,100,000.000	951,291.000	
		ITALY BTPS 2.5 12/01/24	970,000.000	937,737.800	
		ITALY BTPS 2.7 03/01/47	1,650,000.000	1,344,915.000	

		ITALY BTPS 2.8 03/01/67	830,000.000	658,937.000	
		ITALY BTPS 2.8 12/01/28	650,000.000	609,290.500	
		ITALY BTPS 2.95 09/01/38	800,000.000	702,056.000	
		ITALY BTPS 3.25 09/01/46	2,000,000.000	1,799,880.000	
		ITALY BTPS 3.45 03/01/48	1,430,000.000	1,305,518.500	
		ITALY BTPS 3.5 03/01/30	2,950,000.000	2,912,210.500	
		ITALY BTPS 3.75 03/01/21	3,300,000.000	3,423,288.000	
		ITALY BTPS 3.75 05/01/21	2,300,000.000	2,380,730.000	
		ITALY BTPS 3.75 08/01/21	3,200,000.000	3,311,360.000	
		ITALY BTPS 3.75 09/01/24	1,900,000.000	1,959,622.000	
		ITALY BTPS 4.0 02/01/37	3,020,000.000	3,105,164.000	
		ITALY BTPS 4.0 09/01/20	3,700,000.000	3,843,449.000	
		ITALY BTPS 4.25 03/01/20	4,600,000.000	4,769,556.000	
		ITALY BTPS 4.5 02/01/20	4,500,000.000	4,672,485.000	
		ITALY BTPS 4.5 03/01/24	3,700,000.000	3,951,489.000	
		ITALY BTPS 4.5 03/01/26	2,900,000.000	3,123,880.000	
		ITALY BTPS 4.5 05/01/23	1,400,000.000	1,494,136.000	
		ITALY BTPS 4.75 08/01/23	1,900,000.000	2,051,620.000	
		ITALY BTPS 4.75 09/01/21	2,470,000.000	2,625,116.000	
		ITALY BTPS 4.75 09/01/28	2,400,000.000	2,651,808.000	
		ITALY BTPS 4.75 09/01/44	1,790,000.000	1,989,441.800	
		ITALY BTPS 5.0 03/01/22	3,600,000.000	3,872,880.000	
		ITALY BTPS 5.0 03/01/25	2,400,000.000	2,645,568.000	
		ITALY BTPS 5.0 08/01/34	2,800,000.000	3,203,480.000	
		ITALY BTPS 5.0 08/01/39	2,430,000.000	2,764,125.000	
		ITALY BTPS 5.0 09/01/40	2,490,000.000	2,821,917.000	
		ITALY BTPS 5.25 11/01/29	2,900,000.000	3,326,300.000	
		ITALY BTPS 5.5 09/01/22	3,900,000.000	4,287,621.000	
		ITALY BTPS 5.5 11/01/22	2,500,000.000	2,750,100.000	
		ITALY BTPS 5.75 02/01/33	2,400,000.000	2,916,480.000	
		ITALY BTPS 6.0 05/01/31	3,100,000.000	3,803,080.000	
		ITALY BTPS 6.5 11/01/27	3,300,000.000	4,057,680.000	
		ITALY BTPS 7.25 11/01/26	1,800,000.000	2,283,660.000	
		ITALY BTPS 9.0 11/01/23	1,900,000.000	2,430,860.000	

		NETHERLANDS 0.25 01/15/20	2,150,000.000	2,174,574.500	
		NETHERLANDS 0.25 07/15/25	1,700,000.000	1,699,439.000	
		NETHERLANDS 0.5 07/15/26	1,700,000.000	1,714,960.000	
		NETHERLANDS 0.75 07/15/27	1,450,000.000	1,477,811.000	
		NETHERLANDS 0.75 07/15/28	950,000.000	960,896.500	
		NETHERLANDS 01/15/22	1,900,000.000	1,918,278.000	
		NETHERLANDS 01/15/24	1,680,000.000	1,673,901.600	
		NETHERLANDS 1.75 07/15/23	2,000,000.000	2,171,020.000	
		NETHERLANDS 2.0 07/15/24	1,560,000.000	1,728,682.800	
		NETHERLANDS 2.25 07/15/22	1,550,000.000	1,695,343.500	
		NETHERLANDS 2.5 01/15/33	1,480,000.000	1,804,786.000	
		NETHERLANDS 2.75 01/15/47	1,350,000.000	1,868,724.000	
		NETHERLANDS 3.25 07/15/21	1,860,000.000	2,049,180.600	
		NETHERLANDS 3.5 07/15/20	1,670,000.000	1,789,638.800	
		NETHERLANDS 3.75 01/15/23	590,000.000	688,235.000	
		NETHERLANDS 3.75 01/15/42	1,540,000.000	2,397,472.000	
		NETHERLANDS 4.0 01/15/37	1,700,000.000	2,565,640.000	
		NETHERLANDS 5.5 01/15/28	1,600,000.000	2,317,120.000	
		SPAIN 0.05 01/31/21	400,000.000	400,124.000	
		SPAIN 0.35 07/30/23	900,000.000	887,373.000	
		SPAIN 0.4 04/30/22	2,200,000.000	2,208,162.000	
		SPAIN 0.45 10/31/22	800,000.000	800,952.000	
		SPAIN 0.75 07/30/21	1,700,000.000	1,731,433.000	
		SPAIN 1.15 07/30/20	2,100,000.000	2,148,951.000	
		SPAIN 1.3 10/31/26	2,000,000.000	1,993,040.000	
		SPAIN 1.4 01/31/20	5,460,000.000	5,578,318.200	
		SPAIN 1.4 04/30/28	1,920,000.000	1,890,489.600	
		SPAIN 1.4 07/30/28	1,550,000.000	1,516,070.500	
		SPAIN 1.45 10/31/27	2,540,000.000	2,526,817.400	
		SPAIN 1.5 04/30/27	2,000,000.000	2,006,800.000	
		SPAIN 1.6 04/30/25	2,500,000.000	2,590,950.000	
		SPAIN 1.95 04/30/26	1,790,000.000	1,877,226.700	
		SPAIN 1.95 07/30/30	2,240,000.000	2,265,289.600	
		SPAIN 2.15 10/31/25	2,100,000.000	2,240,259.000	

	SPAIN 2.35 07/30/33	1,480,000.000	1,522,920.000	
	SPAIN 2.7 10/31/48	600,000.000	594,414.000	
	SPAIN 2.75 10/31/24	2,700,000.000	2,987,766.000	
	SPAIN 2.9 10/31/46	1,800,000.000	1,878,066.000	
	SPAIN 3.45 07/30/66	1,000,000.000	1,108,050.000	
	SPAIN 3.8 04/30/24	1,720,000.000	1,993,101.600	
	SPAIN 4.0 04/30/20	2,400,000.000	2,556,168.000	
	SPAIN 4.2 01/31/37	1,960,000.000	2,535,103.200	
	SPAIN 4.3 10/31/19	4,200,000.000	4,403,574.000	
	SPAIN 4.4 10/31/23	2,300,000.000	2,718,002.000	
	SPAIN 4.65 07/30/25	2,600,000.000	3,204,500.000	
	SPAIN 4.7 07/30/41	2,100,000.000	2,912,931.000	
	SPAIN 4.8 01/31/24	2,200,000.000	2,656,984.000	
	SPAIN 4.85 10/31/20	2,900,000.000	3,191,363.000	
	SPAIN 4.9 07/30/40	2,000,000.000	2,835,000.000	
	SPAIN 5.15 10/31/28	2,380,000.000	3,158,022.000	
	SPAIN 5.15 10/31/44	1,500,000.000	2,222,430.000	
	SPAIN 5.4 01/31/23	2,800,000.000	3,382,512.000	
	SPAIN 5.5 04/30/21	3,600,000.000	4,096,908.000	
	SPAIN 5.75 07/30/32	2,400,000.000	3,500,688.000	
	SPAIN 5.85 01/31/22	2,300,000.000	2,722,188.000	
	SPAIN 5.9 07/30/26	2,500,000.000	3,348,725.000	
	SPAIN 6.0 01/31/29	2,750,000.000	3,878,352.500	
ユーロ　小計		541,810,000.000 (70,500,317,200)	608,811,808.500 (79,218,592,522)	
南アフリカ・ランド	SOUTH AFRICA 10.5 12/21/26	25,000,000.000	26,734,500.000	
	SOUTH AFRICA 6.25 03/31/36	14,700,000.000	10,213,266.000	
	SOUTH AFRICA 6.5 02/28/41	11,760,000.000	7,988,568.000	
	SOUTH AFRICA 7.0 02/28/31	11,600,000.000	9,324,080.000	
	SOUTH AFRICA 7.75 02/28/23	10,000,000.000	9,682,500.000	
	SOUTH AFRICA 8.0 01/31/30	13,110,000.000	11,629,225.500	
	SOUTH AFRICA 8.25 03/31/32	10,000,000.000	8,825,400.000	
	SOUTH AFRICA 8.5 01/31/37	10,910,000.000	9,486,463.200	
	SOUTH AFRICA 8.75 01/31/44	10,000,000.000	8,697,500.000	
	SOUTH AFRICA 8.75 02/28/48	20,280,000.000	17,582,962.800	
	SOUTH AFRICA 8.875 02/28/35	12,510,000.000	11,394,108.000	
	SOUTH AFRICA 9.0 01/31/40	8,000,000.000	7,190,720.000	
南アフリカ・ランド　小計		157,870,000.000	138,749,293.500	

		(1,215,599,000)	(1,068,369,560)	
国債証券　合計		187,536,415,780 (187,536,415,780)	196,712,880,950 (196,712,880,950)	
合計		187,536,415,780 (187,536,415,780)	196,712,880,950 (196,712,880,950)	

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

通貨	銘柄数		組入債券 時価比率	有価証券の合計金額 に対する比率
アメリカ・ドル	国債証券	136銘柄	44.05%	45.24%
イギリス・ポンド	国債証券	38銘柄	6.37%	6.54%
オーストラリア・ドル	国債証券	20銘柄	1.98%	2.03%
カナダ・ドル	国債証券	25銘柄	1.95%	2.00%
シンガポール・ドル	国債証券	12銘柄	0.36%	0.37%
スウェーデン・クローナ	国債証券	6銘柄	0.33%	0.34%
デンマーク・クローネ	国債証券	5銘柄	0.55%	0.56%
ノルウェー・クローネ	国債証券	5銘柄	0.19%	0.19%
ポーランド・ズロチ	国債証券	14銘柄	0.61%	0.63%
マレーシア・リンギット	国債証券	15銘柄	0.45%	0.46%
メキシコ・ペソ	国債証券	14銘柄	0.79%	0.81%
ユーロ	国債証券	270銘柄	39.21%	40.27%
南アフリカ・ランド	国債証券	12銘柄	0.53%	0.54%

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

「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10月12日現在
資産の部			
流動資産			
預金		182,968,793	294,634,390
コール・ローン		88,895,743	539,303,592
投資信託受益証券		5,872,611,317	5,118,845,237
投資証券		47,940,640,288	38,370,724,101
派生商品評価勘定		51,430	513,182
未収入金		39,965,487	5,903,572,159
未収配当金		150,259,633	191,643,696
流動資産合計		54,275,392,691	50,419,236,357
資産合計		54,275,392,691	50,419,236,357
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		48	342,141
未払金		41,013,388	－
未払解約金		18,730,000	557,043,000
流動負債合計		59,743,436	557,385,141
負債合計		59,743,436	557,385,141
純資産の部			
元本等			
元本	※1	44,747,514,208	42,461,597,968
剰余金			
剰余金又は欠損金（△）		9,468,135,047	7,400,253,248
元本等合計		54,215,649,255	49,861,851,216
純資産合計		54,215,649,255	49,861,851,216
負債純資産合計		54,275,392,691	50,419,236,357

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。** **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	**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。**
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。**
４．　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	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	35,027,236,989円
	同期中一部解約元本額	20,030,428,991円	37,313,153,229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	245,882,806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	91,619,154円
	ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	6,259,398円	4,347,931円
	ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	17,740,502円	16,514,233円
	ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	47,634,574円	32,595,652円
	グローバル８資産ラップファンド（安定型）	15,606,433円	30,645,626円
	グローバル８資産ラップファンド（中立型）	18,192,304円	43,636,068円
	グローバル８資産ラップファンド（積極型）	32,172,218円	41,934,413円
	たわらノーロード　先進国リート	1,496,284,921円	2,782,419,098円
	たわらノーロード　先進国リート＜ラップ向け＞	284,177,943円	476,186,868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	134,698,862円
	たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	11,546,932円	128,981,698円
	たわらノーロード　バランス（堅実型）	－円	829,408円
	たわらノーロード　バランス（標準型）	－円	17,050,297円
	たわらノーロード　バランス（積極型）	－円	53,328,227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	5,181,872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	37,066,332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	35,155,142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	94,871,775円
	たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	－円	106,587円
	たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	－円	1,412,707円

たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	－円	1,210,693円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	－円	4,036,986円
マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	23,585,914円	23,065,104円
マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	549,048,886円	603,261,794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	39,383,601円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	24,664,290円	172,886,995円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	77,113,431円	150,229,482円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	165,293,844円	302,213,922円
投資のソムリエ	6,322,217,084円	7,747,585,548円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	346,135,212円	671,952,334円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	91,488,902円	120,383,081円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	87,517,405円	306,243,675円
ダイナミック・ナビゲーション	281,864円	805,560円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	1,114,366,759円	5,796,933,677円
ワールドアセットバランス（基本コース）	1,013,678,308円	1,228,816,340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	4,269,406,350円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	917,157円	2,147,459円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	917,157円	1,538,625円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	332,244円	1,814,787円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	－円	2,946,447円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	－円	985,394,183円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	－円	12,333円
ＤＩＡＭパッシブ資産分散ファンド	1,236,222,443円	1,103,861,552円
ＤＩＡＭ外国リートインデックスファンド＜ＤＣ年金＞	14,433,432円	28,707,690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	634,397,425円
ＤＩＡＭグローバルβ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	7,696,523,460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	1,401,016,372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	1,078,666,100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	3,241,156,712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	558,954,597円
計	44,747,514,208円	42,461,597,968円
２．　受益権の総数	44,747,514,208口	42,461,597,968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28年10月13日 至　平成29年10月12日	自　平成29年10月13日 至　平成30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29年10月12日現在	平成30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 「（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った場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成29年10月12日現在	平成30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	△129,995,408	△140,992,745
投資証券	△108,555,624	△2,172,134,960
合計	△238,551,032	△2,313,127,705

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成29年6月23日から平成29年10月12日まで及び平成30年6月23日から平成30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29年10月12日 現在				平成30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	－	－	－	－	6,686,188,721	－	6,686,017,680	171,041
アメリカ・ドル	－	－	－	－	4,755,927,440	－	4,755,584,000	343,440
イギリス・ポンド	－	－	－	－	378,800,205	－	378,777,000	23,205
イスラエル・シュケル	－	－	－	－	4,562,248	－	4,567,280	△5,032
オーストラリア・ドル	－	－	－	－	489,787,630	－	489,970,900	△183,270
カナダ・ドル	－	－	－	－	127,437,176	－	127,428,000	9,176
シンガポール・ドル	－	－	－	－	230,862,421	－	230,930,300	△67,879
ニュージーランド・ドル	－	－	－	－	30,870,860	－	30,890,400	△19,540
ユーロ	－	－	－	－	506,154,741	－	506,166,800	△12,059
香港・ドル	－	－	－	－	161,786,000	－	161,703,000	83,000
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	6,686,188,721	－	6,686,017,680	171,041

（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。

①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。

②計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

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

・計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。

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

３．換算において円未満の端数は切捨てております。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	平成29年10月12日現在	平成30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）	1.2116円 (12,116円)	1.1743円 (11,743円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

（１）株式

該当事項はありません。

（２）株式以外の有価証券

平成30年10月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	131,242.000	422,599.240	
		ARENA REIT	108,676.000	255,388.600	
		BWP TRUST	195,018.000	639,659.040	
		CHARTER HALL GROUP	190,240.000	1,308,851.200	
		CHARTER HALL LONG WALE REIT	72,501.000	303,779.190	
		CHARTER HALL RETAIL REIT	131,982.000	547,725.300	
		CROMWELL PROPERTY GROUP	609,874.000	634,268.960	
		DEXUS	419,104.000	4,274,860.800	
		FOLKESTONE EDUCATION TRUST	88,555.000	241,755.150	
		GDI PROPERTY GROUP	208,566.000	279,478.440	
		GOODMAN GROUP	659,856.000	6,651,348.480	
		GPT GROUP	737,537.000	3,687,685.000	
		GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA	100,372.000	366,357.800	
		HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD	62,650.000	192,962.000	
		INDUSTRIA REIT	42,579.000	114,111.720	
		INGENIA COMMUNITIES GROUP	90,384.000	266,632.800	
		INVESTA OFFICE FUND	209,299.000	1,155,330.480	
		MIRVAC GROUP	1,522,187.000	3,501,030.100	
		NATIONAL STORAGE REIT	264,889.000	431,769.070	
		PROPERTYLINK GROUP	162,771.000	186,372.790	
		RURAL FUNDS GROUP	130,171.000	269,453.970	
		SCENTRE GROUP	2,193,246.000	8,465,929.560	
		SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	306,029.000	731,409.310	
		STOCKLAND	1,010,885.000	4,063,757.700	
		VICINITY CENTRES	1,320,060.000	3,458,557.200	
		VIVA ENERGY REIT	183,737.000	393,197.180	
	オーストラリア・ドル　小計		11,152,410.000	42,844,271.080 (3,425,399,473)	
	カナダ・ドル	KILLAM APARTMENT REIT	16,557.000	258,289.200	
	カナダ・ドル　小計		16,557.000	258,289.200 (22,243,866)	
	シンガポール・ドル	AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL REIT	223,495.000	303,953.200	

		ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	317,200.000	249,002.000	
		ASCENDAS REAL ESTATE INVT	1,057,160.000	2,621,756.800	
		ASCOTT RESIDENCE TRUST	495,715.000	525,457.900	
		CACHE LOGISTICS TRUST	466,580.000	328,938.900	
		CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	1,146,679.000	1,926,420.720	
		CAPITALAND MALL TRUST	1,117,860.000	2,325,148.800	
		CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST	241,380.000	330,690.600	
		CDL HOSPITALITY TRUSTS	309,000.000	469,680.000	
		ESR REIT	539,430.000	258,926.400	
		FAR EAST HOSPITALITY TRUST	353,000.000	211,800.000	
		FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	238,200.000	276,312.000	
		FRASERS CENTREPOINT TRUST	239,800.000	527,560.000	
		FRASERS COMMERCIAL TRUST	267,080.000	368,570.400	
		FRASERS LOGISTICS & INDUSTRIAL TRUST	670,350.000	683,757.000	
		KEPPEL DC REIT	398,700.000	518,310.000	
		KEPPEL REIT	736,100.000	839,154.000	
		LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST	817,600.000	204,400.000	
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	778,300.000	1,221,931.000	
		MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	516,320.000	986,171.200	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	858,020.000	1,029,624.000	
		MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL TRUST	875,000.000	962,500.000	
		OUE HOSPITALITY TRUST	490,620.000	333,621.600	
		PARKWAY LIFE REIT	153,400.000	397,306.000	
		SABANA SHARIAH COMP IND REIT	357,200.000	148,238.000	
		SOILBUILD BUSINESS SPACE REIT	276,100.000	158,757.500	
		SPH REIT	251,100.000	247,333.500	
		STARHILL GLOBAL REIT	567,800.000	377,587.000	
		SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	916,190.000	1,639,980.100	
	シンガポール・ドル　小計		15,675,379.000	20,472,888.620 (1,671,201,898)	
投資信託受益証券　合計			26,844,346	5,118,845,237 (5,118,845,237)	
投資証券	**アメリカ・ドル**	ACADIA REALTY TRUST	28,681.000	770,658.470	

AGREE REALTY CORP	10,870.000	560,783.300	
ALEXANDER'S INC.	1,318.000	440,277.900	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	37,594.000	4,503,385.260	
AMERICAN ASSETS TRUST INC	13,194.000	473,664.600	
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	48,573.000	1,919,604.960	
AMERICAN HOMES 4 RENT	91,074.000	1,846,069.980	
AMERICOLD REALTY TRUST	20,048.000	487,166.400	
APARTMENT INVT & MGMT CO-A	55,826.000	2,351,949.380	
APPLE HOSPITALITY REIT INC	76,550.000	1,260,778.500	
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	35,470.000	201,824.300	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	49,180.000	8,517,484.200	
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH REIT INC	8,916.000	80,333.160	
BOSTON PROPERTIES INC	54,924.000	6,281,657.880	
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	13,863.000	144,036.570	
BRANDYWINE REALTY TRUST	62,975.000	916,286.250	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	107,190.000	1,678,595.400	
BRT APARTMENTS CORP	4,756.000	52,125.760	
CAMDEN PROPERTY TRUST	32,953.000	2,941,714.310	
CARETRUST REIT INC	28,292.000	480,115.240	
CBL & ASSOCIATES	74,111.000	271,246.260	
CEDAR REALTY TRUST INC	39,696.000	161,562.720	
CHATHAM LODGING TRUST	18,605.000	365,774.300	
CHESAPEAKE LODGING TRUST	21,199.000	628,338.360	
CITY OFFICE REIT INC	14,463.000	167,626.170	
CLIPPER REALTY INC	5,169.000	65,387.850	
COLONY CAPITAL INC	172,789.000	971,074.180	
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	41,586.000	887,029.380	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	6,974.000	199,037.960	
CORECIVIC INC	41,826.000	978,728.400	
CORESITE REALTY CORP	12,981.000	1,298,749.050	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	36,443.000	998,173.770	
COUSINS PROPERTIES INC	148,625.000	1,236,560.000	
CUBESMART	65,862.000	1,797,373.980	
CYRUSONE INC	37,106.000	2,172,185.240	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	73,149.000	781,231.320	

DIGITAL REALTY TRUST INC	73,325.000	7,882,437.500	
DOUGLAS EMMETT INC	57,238.000	2,067,436.560	
DUKE REALTY TRUST	126,915.000	3,406,398.600	
EAST GROUP	12,626.000	1,144,294.380	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	20,980.000	379,738.000	
EMPIRE STATE REALTY TRUST INC	47,582.000	747,513.220	
EPR PROPERTIES	26,341.000	1,756,944.700	
EQUITY COMMONWEALTH	42,943.000	1,234,611.250	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	31,634.000	2,897,674.400	
EQUITY RESIDENTIAL	131,035.000	8,238,170.450	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	23,488.000	5,629,838.720	
EXTRA SPACE STORAGE INC	44,948.000	3,803,050.280	
FARMLAND PARTNERS INC	14,523.000	88,445.070	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	26,098.000	3,111,142.580	
FIRST INDUSTRIAL RT	44,563.000	1,331,988.070	
FOREST CITY REALTY TRUST INC	94,790.000	2,380,176.900	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST INC	23,427.000	588,486.240	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	42,731.000	312,790.920	
FRONT YARD RESIDENTIAL CORP	21,318.000	201,668.280	
GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	71,296.000	2,428,341.760	
GEO GROUP INC	42,981.000	1,013,921.790	
GETTY REALTY CORP	13,357.000	364,646.100	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	11,089.000	202,041.580	
GLADSTONE LAND CORP	5,903.000	70,304.730	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	8,278.000	74,005.320	
GLOBAL NET LEASE INC	24,906.000	473,712.120	
GOVERNMENT PROPERTIES INCOME TRUST	40,598.000	413,693.620	
HCP INC	166,982.000	4,142,823.420	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	44,270.000	1,210,341.800	
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA INC	73,554.000	1,854,296.340	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	14,668.000	298,200.440	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	36,643.000	1,630,613.500	

		HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	58,193.000	1,544,442.220	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	263,700.000	5,073,588.000	
		HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	55,513.000	1,707,024.750	
		INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	35,389.000	342,565.520	
		INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES TRUST	8,484.000	182,999.880	
		INFRAREIT INC	16,796.000	340,790.840	
		INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES INC	2,926.000	129,329.200	
		INVESTORS REAL ESTATE TRUST	47,370.000	254,376.900	
		INVITATION HOMES INC	105,247.000	2,228,078.990	
		IRON MOUNTAIN INC	101,628.000	3,201,282.000	
		JBG SMITH PROPERTIES	38,311.000	1,369,235.140	
		KILROY REALTY CORP	35,716.000	2,452,260.560	
		KIMCO REALTY	149,472.000	2,242,080.000	
		KITE REALTY GROUP TRUST	29,182.000	447,068.240	
		LASALLE HOTEL PROPERTIES	39,028.000	1,250,457.120	
		LEXINGTON REALTY TRUST	74,842.000	583,019.180	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	52,422.000	2,123,091.000	
		LIFE STORAGE INC	16,493.000	1,479,916.890	
		LTC PROPERTIES INC	13,900.000	595,754.000	
		MACK CALI	31,683.000	617,818.500	
		MANULIFE US REIT	507,900.000	391,083.000	
		MEDEQUITIES REALTY TRUST INC	13,143.000	116,052.690	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST	129,297.000	1,824,380.670	
		MID AMERICA	40,441.000	3,873,843.390	
		MONMOUTH RE INVEST CP -CL A	32,241.000	486,194.280	
		NATIONAL HEALTH INVS INC	14,891.000	1,064,706.500	
		NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	55,702.000	2,408,554.480	
		NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUST	19,749.000	491,947.590	
		NEW SENIOR INVESTMENT GROUP INC	34,578.000	196,403.040	
		NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	7,762.000	261,657.020	
		NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP	21,513.000	279,669.000	
		OMEGA HEALTHCARE INVS INC	71,067.000	2,282,672.040	

ONE LIBERTY PROPERTIES INC	5,545.000	140,454.850	
PARAMOUNT GROUP INC	73,007.000	1,032,318.980	
PARK HOTELS & RESORTS INC	71,342.000	2,108,869.520	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	24,300.000	784,647.000	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	28,137.000	250,982.040	
PHYSICIANS REALTY TRUST	64,271.000	1,036,048.520	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC	45,200.000	810,436.000	
PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES INC	16,100.000	268,065.000	
PROLOGIS INC	224,091.000	14,081,878.440	
PS BUSINESS PARKS	7,029.000	854,023.500	
PUBLIC STORAGE	53,328.000	10,435,223.040	
QTS REALTY TRUST INC	17,940.000	711,859.200	
RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES	27,788.000	350,962.440	
REALTY INCOME CORP	103,146.000	5,772,050.160	
REGENCY CENTERS CORP	60,201.000	3,712,595.670	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	39,639.000	702,799.470	
RETAIL PROPERTIES OF AMERICA INC	77,381.000	904,583.890	
RETAIL VALUE INC	6,244.000	188,943.440	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	32,211.000	972,450.090	
RLJ LODGING TRUST	61,973.000	1,236,361.350	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	18,162.000	1,427,896.440	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	63,074.000	1,375,643.940	
SAFETY INCOME & GROWTH INC	4,225.000	72,247.500	
SAUL CENTERS INC	4,786.000	246,431.140	
SELECT INCOME REIT	26,222.000	521,555.580	
SENIOR HOUSING PPTYS TRUST	84,080.000	1,389,001.600	
SERITAGE GROWTH PROPERTIES	11,250.000	479,925.000	
SIMON PROPERTY GROUP INC	110,087.000	18,758,824.800	
DDR CORP	51,172.000	613,552.280	
SL GREEN	30,731.000	2,785,765.150	
SPIRIT MTA REIT	17,097.000	189,263.790	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	151,405.000	1,140,079.650	
STAG INDUSTRIAL INC	36,838.000	937,158.720	
STORE CAPITAL CORP	64,821.000	1,776,095.400	

		SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	36,560.000	463,946.400	
		SUN COMMUNITIES INC	30,662.000	2,944,471.860	
		SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	80,669.000	1,197,127.960	
		TANGER FACTORY OUTLET	33,003.000	717,815.250	
		TAUBMAN CENTERS INC	21,549.000	1,161,706.590	
		TERRENO REALTY CORP	20,544.000	719,040.000	
		THE MACERICH COMPANY	37,494.000	1,877,324.580	
		TIER REIT INC	17,663.000	388,762.630	
		UDR INC	95,100.000	3,641,379.000	
		UMH PROPERTIES INC	13,794.000	205,944.420	
		UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	5,390.000	378,162.400	
		URBAN EDGE PROPERTIES	40,147.000	801,735.590	
		URSTADT BIDDLE PROPERTIES	11,757.000	232,318.320	
		VENTAS INC	126,789.000	6,765,461.040	
		VEREIT INC	343,243.000	2,375,241.560	
		VICI PROPERTIES INC	24,592.000	507,332.960	
		VORNADO REALTY TRUST	61,528.000	4,171,598.400	
		WASHINGTON PRIME GROUP INC	64,777.000	420,402.730	
		WASHINGTON REIT	27,683.000	777,338.640	
		WEINGARTEN REALTY INVST	42,086.000	1,160,731.880	
		WELLTOWER INC	132,367.000	8,171,014.910	
		WHITESTONE REIT	15,682.000	203,552.360	
		WP CAREY INC	38,038.000	2,393,731.340	
		XENIA HOTELS & RESORTS INC	39,447.000	875,723.400	
アメリカ・ドル　小計			8,251,827.000	272,731,539.840 (30,597,751,454)	
イギリス・ポンド		ASSURA PLC	833,187.000	462,418.780	
		BIG YELLOW GROUP PLC	54,961.000	474,038.620	
		BRITISH LAND CO PLC	352,752.000	2,028,324.000	
		CAPITAL & REGIONAL PLC	226,616.000	90,873.010	
		CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	81,480.000	86,368.800	
		DERWENT LONDON PLC	39,209.000	1,089,618.110	
		EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	223,053.000	212,123.400	
		GREAT PORTLAND ESTATES PLC	99,224.000	657,061.320	
		HAMMERSON PLC	280,871.000	1,218,980.140	
		HANSTEEN HOLDINGS PLC	167,573.000	162,043.090	
		INTU PROPERTIES PLC	302,574.000	553,105.270	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	266,738.000	2,220,327.110	

		LONDONMETRIC PROPERTY PLC	242,483.000	429,437.390	
		LXI REIT PLC	73,400.000	82,575.000	
		NEWRIVER REIT PLC	106,233.000	274,081.140	
		PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC	253,742.000	279,623.680	
		RDI REIT PLC	528,881.000	174,530.730	
		REGIONAL REIT LTD	118,301.000	117,472.890	
		SAFESTORE HOLDINGS LTD	73,132.000	374,435.840	
		SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT TRUST LTD	215,249.000	127,212.150	
		SEGRO PLC	358,320.000	2,170,702.560	
		SHAFTESBURY PLC	81,270.000	717,614.100	
		TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING REIT PLC	86,466.000	89,924.640	
		TRITAX BIG BOX REIT PLC	519,849.000	753,781.050	
		UK COMMERCIAL PROPERTY REIT LTD	232,175.000	199,902.670	
		UNITE GROUP PLC	92,831.000	779,316.240	
		WORKSPACE GROUP PLC	45,418.000	426,929.200	
イギリス・ポンド　小計			5,955,988.000	16,252,820.930 (2,414,519,077)	
イスラエル・シュケル		REIT 1 LTD	61,301.000	904,189.750	
イスラエル・シュケル　小計			61,301.000	904,189.750 (27,903,296)	
カナダ・ドル		AGELLAN COMMERCIAL REIT	7,030.000	88,507.700	
		ALLIED PROPERTIES REIT	17,200.000	708,984.000	
		ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	25,727.000	288,656.940	
		BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	7,797.000	374,879.760	
		CANADIAN APT PPTYS REIT	25,044.000	1,134,743.640	
		CHOICE PROPERTIES REIT	47,331.000	560,872.350	
		COMINAR REAL ESTATE INVT TR	30,644.000	347,196.520	
		CROMBIE REAL ESTATE INV	14,636.000	184,559.960	
		CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	12,724.000	153,960.400	
		DREAM GLOBAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	32,490.000	437,640.300	
		DREAM INDUSTRIAL REIT	16,864.000	156,497.920	
		DREAM OFFICE REAL ESTATE INV TRUST	9,964.000	229,969.120	
		GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	7,744.000	407,179.520	
		H & R REAL ESTATE INVESTMENT	49,205.000	933,910.900	
		INTERRENT REAL ESTATE INVEST	17,332.000	198,278.080	

	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT	7,446.000	117,274.500	
	NORTHVIEW APARTMENT REIT	11,387.000	280,803.420	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	16,839.000	178,156.620	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	53,909.000	1,280,338.750	
	SLATE OFFICE REIT	12,079.000	92,162.770	
	SLATE RETAIL REIT	7,739.000	95,886.210	
	SMARTCENTRES REIT	22,912.000	674,071.040	
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	17,461.000	152,609.140	
	TRUE NORTH COMMERCIAL REIT	13,972.000	88,722.200	
カナダ・ドル　小計		485,476.000	9,165,861.760 (789,364,015)	
ニュージーランド・ドル	ARGOSY PROPERTY LTD	333,057.000	363,032.130	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	431,670.000	656,138.400	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	590,230.000	799,761.650	
	PRECINCT PROPERTIES	419,292.000	591,201.720	
	STRIDE STAPLED GROUP	154,189.000	294,500.990	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	132,691.000	274,670.370	
ニュージーランド・ドル　小計		2,061,129.000	2,979,305.260 (218,144,732)	
ユーロ	AEDIFICA	6,371.000	476,550.800	
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	55,526.000	687,967.140	
	ALTAREA	1,263.000	241,233.000	
	BEFIMMO	8,029.000	393,019.550	
	BENI STABILI SPA	351,757.000	250,450.980	
	COFINIMMO SA	7,469.000	775,282.200	
	COVIVIO	19,101.000	1,612,124.400	
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	14,208.000	437,322.240	
	GECINA SA	19,471.000	2,577,960.400	
	GREEN REIT PLC	227,925.000	333,226.350	
	HAMBORNER REIT AG	29,345.000	257,942.550	
	HIBERNIA REIT PLC	240,684.000	334,550.760	
	ICADE	15,948.000	1,165,798.800	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE	20,030.000	118,457.420	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA	104,285.000	886,943.920	
	INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	7,065.000	152,604.000	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES REIT PLC	140,481.000	199,483.020	
	KLEPIERRE	73,619.000	2,137,159.570	

		LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA	27,341.000	220,641.870	
		MERCIALYS	22,420.000	293,702.000	
		MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	129,787.000	1,457,508.010	
		NSI NV	6,300.000	208,845.000	
		RETAIL ESTATES	2,885.000	200,219.000	
		UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	48,976.000	7,895,910.720	
		VASTNED RETAIL	6,823.000	224,476.700	
		WAREHOUSES DE PAUW	5,938.000	642,491.600	
		WERELDHAVE NV	14,068.000	415,006.000	
	ユーロ　小計		1,607,115.000	24,596,878.000 (3,200,545,765)	
	香港・ドル	CHAMPION REIT	833,070.000	4,398,609.600	
		FORTUNE REAL ESTATE (HK)	582,000.000	5,092,500.000	
		LINK REIT	877,520.000	62,786,556.000	
		PROSPERITY REIT	528,000.000	1,525,920.000	
		SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	420,000.000	2,087,400.000	
		YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	521,000.000	2,495,590.000	
	香港・ドル　小計		3,761,590.000	78,386,575.600 (1,122,495,762)	
投資証券　合計			22,184,426	38,370,724,101 (38,370,724,101)	
合計				43,489,569,338 (43,489,569,338)	

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　158銘柄	-%	61.37%	70.36%
イギリス・ポンド	投資証券　27銘柄	-%	4.84%	5.55%
イスラエル・シュケル	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　26銘柄	6.87%	-%	7.88%
カナダ・ドル	投資信託受益証券　1銘柄 投資証券　24銘柄	0.04% -%	-% 1.58%	1.87%
シンガポール・ドル	投資信託受益証券　29銘柄	3.35%	-%	3.84%
ニュージーランド・ドル	投資証券　6銘柄	-%	0.44%	0.50%
ユーロ	投資証券　27銘柄	-%	6.42%	7.36%
香港・ドル	投資証券　6銘柄	-%	2.25%	2.58%

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

「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10月12日現在
資産の部			
流動資産			
預金		4,651,991	11,791,744
コール・ローン		19,203,573	16,631,091
社債券		3,364,179,042	3,947,543,935
流動資産合計		3,388,034,606	3,975,966,770
資産合計		3,388,034,606	3,975,966,770
負債の部			
流動負債			
流動負債合計		－	－
負債合計		－	－
純資産の部			
元本等			
元本	※1	8,614,336,937	8,403,792,682
剰余金			
剰余金又は欠損金（△）	※2	△5,226,302,331	△4,427,825,912
元本等合計		3,388,034,606	3,975,966,770
純資産合計		3,388,034,606	3,975,966,770
負債純資産合計		3,388,034,606	3,975,966,770

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	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	2,046,803,081円
		同期中一部解約元本額	2,741,842,401円	2,257,347,336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	8,057,380,673円
		ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	24,112,594円	11,436,219円
		ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	58,985,902円	31,373,713円
		ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	69,776,972円	39,050,957円
		グローバル８資産ラップファンド（安定型）	58,948,562円	79,586,203円
		グローバル８資産ラップファンド（中立型）	60,241,683円	83,269,917円
		グローバル８資産ラップファンド（積極型）	46,777,417円	50,701,226円
		ＤＩＡＭグローバルβ私募ファンド（適格機関投資家向け）	58,887,324円	50,993,774円
	計		8,614,336,937円	8,403,792,682円
２．	受益権の総数		8,614,336,937口	8,403,792,682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4,427,825,912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28年10月13日 至　平成29年10月12日	自　平成29年10月13日 至　平成30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29年10月12日現在	平成30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29年10月12日現在	平成30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	154,945,197	20,590,407
合計	154,945,197	20,590,407

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成29年1月21日から平成29年10月12日まで平成30年1月21日から平成30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29年10月12日現在	平成30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）	0.3933円 (3,933円)	0.4731円 (4,731円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

（１）株式

該当事項はありません。

（２）株式以外の有価証券

平成30年10月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 06/14/2019	134,839.000	35,186,237.050	
	アメリカ・ドル　小計		134,839.000 (15,127,587)	35,186,237.050 (3,947,543,935)	
社債券　合計			15,127,587 (15,127,587)	3,947,543,935 (3,947,543,935)	
合計			15,127,587 (15,127,587)	3,947,543,935 (3,947,543,935)	

（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	99.29%	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29年10月12日現在	平成30年10月12日現在
資産の部			
流動資産			
預金		4,636,774,438	3,683,826,146
コール・ローン		384,445,872	580,368,131
株式		56,116,574,203	48,275,462,755
投資信託受益証券		333,140,623	279,126,129
投資証券		123,998,335	93,277,428
派生商品評価勘定		90,629,467	1,236,237
未収入金		1,717,251	2,566,448
未収配当金		43,353,024	78,401,183
差入委託証拠金		953,904,110	1,058,690,063
流動資産合計		62,684,537,323	54,052,954,520
資産合計		62,684,537,323	54,052,954,520
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		1,590,811	168,414,282
未払金		3,251,499,722	30,827,011
未払解約金		358,385,000	682,226,000
流動負債合計		3,611,475,533	881,467,293
負債合計		3,611,475,533	881,467,293
純資産の部			
元本等			
元本	※1	48,129,540,802	49,906,024,818
剰余金			
剰余金又は欠損金（△）		10,943,520,988	3,265,462,409
元本等合計		59,073,061,790	53,171,487,227
純資産合計		59,073,061,790	53,171,487,227
負債純資産合計		62,684,537,323	54,052,954,520

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。** **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。** **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。** **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。**
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。**
４．　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	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	36,612,850,989円
	同期中一部解約元本額	18,631,510,726円	34,836,366,973円
	元本の内訳		
	ファンド名		
	ＤＩＡＭ新興国株式インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	2,533,793,262円	3,998,466,681円
	ＤＩＡＭ新興国株式インデックスファンド＜為替ヘッジなし＞（ファンドラップ）	204,360,039円	526,663,191円
	ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	6,887,807円	3,985,301円
	ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	19,443,902円	10,799,409円
	ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	22,799,425円	13,414,427円
	グローバル８資産ラップファンド（安定型）	17,399,331円	28,092,719円
	グローバル８資産ラップファンド（中立型）	20,095,548円	28,537,703円
	グローバル８資産ラップファンド（積極型）	15,397,583円	17,048,590円
	たわらノーロード　新興国株式	2,545,896,989円	4,143,846,622円
	たわらノーロード　新興国株式＜ラップ向け＞	751,469,487円	1,771,389,117円
	たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	11,493,669円	141,717,362円
	たわらノーロード　バランス（堅実型）	－円	911,236円
	たわらノーロード　バランス（標準型）	－円	3,704,213円
	たわらノーロード　バランス（積極型）	－円	9,490,560円
	たわらノーロード　スマートグローバルバランス（保守型）	－円	108,437円
	たわらノーロード　スマートグローバルバランス（安定型）	－円	5,437,197円
	たわらノーロード　スマートグローバルバランス（安定成長型）	－円	16,630,235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	12,267,696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	35,053,630円
	たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	－円	27,969円
	たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	－円	369,091円

たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	－円	293,335円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	－円	668,349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	447,212,307円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	41,983,489円	314,439,194円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	130,814,607円	267,422,836円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	276,648,048円	533,698,629円
投資のソムリエ	4,408,438,749円	3,362,324,690円
クルーズコントロール	1,461,599,838円	1,329,932,944円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	241,913,905円	292,031,702円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	154,446,565円	211,686,781円
クルーズコントロール＜ＤＣ年金＞	487,557円	770,395円
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（堅実型）	16,062,214円	19,663,281円
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（積極型）	50,216,666円	51,388,252円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	65,363,772円	100,151,426円
ダイナミック・ナビゲーション	1,673,502円	564,769円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	834,286,491円	1,889,566,731円
ワールドアセットバランス（基本コース）	1,496,560,495円	1,897,818,968円
ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）	4,750,542,159円	6,652,378,641円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	667,986円	1,147,064円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	667,986円	824,219円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	253,702円	595,341円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	－円	1,488,465円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	－円	270,188,548円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	－円	20,870円
エマージング株式パッシブファンドＶＡ（適格機関投資家専用）	5,261,664,672円	3,861,381,492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）	2,639,978,774円	2,126,266,886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）	11,978,525,624円	8,067,518,091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）	7,720,753,807円	7,436,619,226円
計	48,129,540,802円	49,906,024,818円
２．　受益権の総数	48,129,540,802口	49,906,024,818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28年10月13日 至　平成29年10月12日	自　平成29年10月13日 至　平成30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、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
３．　金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	平成29年10月12日現在	平成30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 「（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った場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成29年10月12日現在	平成30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	6,938,738,614	△7,072,834,005
投資信託受益証券	250,881	△4,748,395
投資証券	785,878	△18,247,921
合計	6,939,775,373	△7,095,830,321

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成29年4月19日から平成29年10月12日まで及び平成30年4月19日から平成30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29年10月12日 現在				平成30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	673,335,817	－	674,057,349	△721,532	2,435,402,841	－	2,435,203,604	199,237
アメリカ・ドル	673,335,817	－	674,057,349	△721,532	1,346,331,040	－	1,346,035,970	295,070
カタール・リアル	－	－	－	－	20,803,121	－	20,642,634	160,487
タイ・バーツ	－	－	－	－	68,598,680	－	68,400,000	198,680
フィリピン・ペソ	－	－	－	－	51,848,000	－	51,750,000	98,000
マレーシア・リンギット	－	－	－	－	148,368,000	－	148,445,000	△77,000
韓国・ウォン	－	－	－	－	395,040,000	－	396,000,000	△960,000
香港・ドル	－	－	－	－	42,939,000	－	42,930,000	9,000
台湾・ドル	－	－	－	－	361,475,000	－	361,000,000	475,000
買　建	695,259,082	－	697,541,604	2,282,522	20,803,121	－	20,536,771	△266,350
アメリカ・ドル	21,923,265	－	21,921,900	△1,365	20,803,121	－	20,536,771	△266,350
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	2,456,205,962	－	2,455,740,375	△67,113

（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。

①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。

②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29年10月12日 現在				平成30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	2,399,916,896	－	2,487,394,562	87,477,666	2,110,229,391	－	1,943,118,459	△167,110,932
合計	2,399,916,896	－	2,487,394,562	87,477,666	2,110,229,391	－	1,943,118,459	△167,110,932

（注）１．時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

２．先物取引の残高表示は、契約額によっております。

３．契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	平成29年10月12日現在	平成30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）	1.2274円 (12,274円)	1.0654円 (10,654円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

（１）株式

平成30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	CTRIP.COM INTERNATIONAL LTD ADR	37,000	35.150	1,300,550.000	
	CIA DE MINAS BUENAVENTURA SA ADR	18,800	14.000	263,200.000	
	SURGUTNEFTEGAZ SP ADR PREF	69,900	5.447	380,745.300	
	CREDICORP LTD	6,349	214.290	1,360,527.210	
	SINA CORP	6,000	59.010	354,060.000	
	MOBILE TELESYSTEMS PJSC ADR	48,925	7.930	387,975.250	
	NETEASE INC-ADR	7,300	211.400	1,543,220.000	
	SOUTHERN COPPER CORP	7,580	42.690	323,590.200	
	LUKOIL SPON ADR	39,430	72.400	2,854,732.000	
	GAZPROM PAO ADR	501,010	4.900	2,454,949.000	
	COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK SP GDR	110,249	4.255	469,109.490	
	INNER MONGOLIA YITAI COAL CO	105,800	1.146	121,246.800	
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRADE	96,280	1.283	123,527.240	
	SURGUTNEFTEGAZ ADR	74,317	3.996	296,970.730	
	51JOB INC ADR	2,300	58.400	134,320.000	
	X5 RETAIL GROUP NV GDR	12,426	19.400	241,064.400	
	NOVATEK PJSC GDR	8,459	169.900	1,437,184.100	
	BAIDU INC -SPON ADR	25,200	198.000	4,989,600.000	
	NOVOLIPETSK STEEL GDR	13,240	25.200	333,648.000	
	MMC NORILSK NICKEL ADR	61,384	16.850	1,034,320.400	
	ROSNEFT OIL CO GDR	114,000	6.944	791,616.000	
	NEW ORIENTAL EDUCATION & TECH	12,900	58.570	755,553.000	
	SEVERSTAL GDR	21,907	16.000	350,512.000	
	TATNEFT ADR	23,860	70.400	1,679,744.000	
	MAGNITOGORSK IRON & STEEL SPON GDR	19,500	9.410	183,495.000	
	VTB BANK OJSC GDR	192,000	1.273	244,416.000	
	DP WORLD LTD	15,686	18.500	290,191.000	
	MAGNIT PJSC GDR	33,117	12.295	407,173.510	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD ADR	43,400	5.060	219,604.000	
	FANG HOLDINGS LTD ADR	19,300	2.200	42,460.000	
	RUSHYDRO PJSC ADR	141,960	0.829	117,684.840	
	TAL EDUCATION GROUP-ADR	32,200	21.480	691,656.000	
	NOAH HOLDINGS LTD ADR	2,700	35.140	94,878.000	

	SBERBANK ADR	249,900	11.440	2,858,856.000	
	PHOSAGRO PJSC GDR	13,784	13.010	179,329.840	
	HUAZHU GROUP LTD ADR	11,800	26.680	314,824.000	
	YY INC-ADR	4,700	68.030	319,741.000	
	GDS HOLDINGS LTD ADR	5,600	25.890	144,984.000	
	58.COM INC ADR	8,400	61.870	519,708.000	
	AUTOHOME INC ADR	5,400	65.910	355,914.000	
	WEIBO CORP ADR	4,700	55.820	262,354.000	
	JD.COM INC ADR	65,500	23.480	1,537,940.000	
	ALIBABA GROUP HOLDING LTD-ADR	104,880	141.900	14,882,472.000	
	MOMO INC SPON ADR	13,100	35.510	465,181.000	
	BAOZUN INC-SPN ADR	3,400	36.880	125,392.000	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	33,200	32.050	1,064,060.000	
	POLYUS PJSC GDR	6,012	32.150	193,285.800	
アメリカ・ドル　小計		2,454,855		49,497,565.110 (5,553,131,831)	
アラブ首長国連邦・ディルハム	DUBAI ISLAMIC BANK PJSC	168,000	5.250	882,000.000	
	EMIRATES TELECOMMUNICATIONS GROUP CO PJSC	156,450	16.540	2,587,683.000	
	DUBAI INVESTMENTS PJSC	169,895	1.720	292,219.400	
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK PJSC	194,762	7.880	1,534,724.560	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	127,622	14.640	1,868,386.080	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	322,486	4.880	1,573,731.680	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	356,142	1.700	605,441.400	
	EMAAR DEVELOPMENT PJSC	77,463	5.150	398,934.450	
	EMAAR MALLS PJSC	178,166	1.820	324,262.120	
	DAMAC PROPERTIES DUBAI CO PJSC	190,235	1.940	369,055.900	
アラブ首長国連邦・ディルハム　小計		1,941,221		10,436,438.590 (319,250,656)	
インド・ルピー	RELIANCE INDUSTRIES LTD	258,730	1,087.800	281,446,494.000	
	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	66,548	278.150	18,510,326.200	
	ASIAN PAINTS LTD	26,486	1,219.050	32,287,758.300	
	EICHER MOTORS LTD	1,197	22,357.450	26,761,867.650	
	GRASIM INDUSTRIES LTD	28,851	878.350	25,341,275.850	
	MAHINDRA & MAHINDRA LTD	67,342	730.150	49,169,761.300	
	SHREE CEMENT LTD	830	14,823.750	12,303,712.500	
	ICICI BANK LTD	213,994	311.700	66,701,929.800	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP LTD	58,463	207.950	12,157,380.850	
	STATE BANK OF INDIA LTD	162,789	262.150	42,675,136.350	
	CONTAINER CORP OF INDIA LTD	15,148	594.400	9,003,971.200	

LIC HOUSING FINANCE LTD	26,242	410.750	10,778,901.500	
TATA STEEL LTD	31,902	555.150	17,710,395.300	
TATA MOTORS LTD	138,820	182.950	25,397,119.000	
JSW STEEL LTD	76,971	361.700	27,840,410.700	
TATA POWER CO LTD	114,770	62.250	7,144,432.500	
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	2,743	5,570.200	15,279,058.600	
NESTLE INDIA LTD	2,343	9,384.400	21,987,649.200	
BHARAT HEAVY ELECTRICALS LTD	92,082	73.300	6,749,610.600	
GAIL INDIA LTD	70,027	350.250	24,526,956.750	
VEDANTA LTD	110,581	207.900	22,989,789.900	
AXIS BANK LTD	162,278	580.850	94,259,176.300	
TITAN COMPANY LTD	27,648	778.900	21,535,027.200	
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	122,655	152.950	18,760,082.250	
LUPIN LTD	22,500	836.550	18,822,375.000	
BAJAJ FINANCE LTD	15,656	2,162.100	33,849,837.600	
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP	144,729	1,684.550	243,803,236.950	
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISES LTD	43,870	463.900	20,351,293.000	
INFOSYS LTD	318,055	673.350	214,162,334.250	
WIPRO LTD	100,958	313.050	31,604,901.900	
INDIAN OIL CORP LTD	139,469	131.000	18,270,439.000	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	59,221	1,526.100	90,377,168.100	
HCL TECHNOLOGIES LTD	50,316	1,009.000	50,768,844.000	
DABUR INDIA LTD	52,045	393.350	20,471,900.750	
HERO MOTOCORP LTD	4,509	2,871.000	12,945,339.000	
DR REDDYS LABORATORIES LTD	10,085	2,459.000	24,799,015.000	
BHARTI AIRTEL LTD	125,025	285.350	35,675,883.750	
UNITED SPIRITS LTD	28,139	496.700	13,976,641.300	
SUN PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD	75,490	586.700	44,289,983.000	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	9,620	6,875.500	66,142,310.000	
GLENMARK PHARMACEUTICALS LTD	13,988	598.100	8,366,222.800	
AUROBINDO PHARMA LTD	23,572	756.250	17,826,325.000	
HAVELLS INDIA LTD	24,800	579.950	14,382,760.000	
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	64,460	228.550	14,732,333.000	
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE CO LTD	15,042	1,046.350	15,739,196.700	
PETRONET LNG LTD	52,875	212.100	11,214,787.500	
CIPLA LTD/INDIA	31,870	616.200	19,638,294.000	
LARSEN & TOUBRO LTD	42,451	1,225.850	52,038,558.350	
ULTRATECH CEMENT LTD	9,111	3,688.750	33,608,201.250	
ASHOK LEYLAND LTD	110,886	111.800	12,397,054.800	
BOSCH LTD	774	18,283.650	14,151,545.100	

	TATA CONSULTANCY SERVICES LTD	83,649	1,979.950	165,620,837.550	
	NTPC LTD	175,055	163.150	28,560,223.250	
	PIRAMAL ENTERPRISES LTD	7,474	2,232.350	16,684,583.900	
	YES BANK LTD	153,758	240.200	36,932,671.600	
	AMBUJA CEMENTS LTD	54,635	207.850	11,355,884.750	
	BHARAT FORGE LTD	18,421	555.250	10,228,260.250	
	HINDALCO INDUSTRIES LTD	99,935	216.500	21,635,927.500	
	ITC LTD	310,220	265.200	82,270,344.000	
	PIDILITE INDUSTRIES LTD	11,666	959.650	11,195,276.900	
	UNITED PHOSPHORUS LTD	32,882	605.150	19,898,542.300	
	SIEMENS INDIA LTD	7,396	886.650	6,557,663.400	
	GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	32,823	727.950	23,893,502.850	
	TECH MAHINDRA LTD	42,065	695.450	29,254,104.250	
	VODAFONE IDEA LTD	196,527	34.550	6,790,007.850	
	MARICO LTD	45,380	305.750	13,874,935.000	
	PAGE INDUSTRIES LTD	528	28,058.800	14,815,046.400	
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	149,485	185.700	27,759,364.500	
	ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	49,342	313.500	15,468,717.000	
	RURAL ELECTRIFICATION CORP LTD	55,173	100.000	5,517,300.000	
	BAJAJ FINSERV LTD	3,603	5,592.000	20,147,976.000	
	BAJAJ AUTO LTD	8,027	2,525.800	20,274,596.600	
	COAL INDIA LTD	62,457	266.600	16,651,036.200	
	MAHINDRA & MAHINDRA FINANCIAL SERVICES LTD	32,995	372.400	12,287,338.000	
	BHARTI INFRATEL LTD	32,296	259.750	8,388,886.000	
	INDIABULLS HOUSING FINANCE LTD	25,466	891.700	22,708,032.200	
	TATA STEEL LTD-PARTLY PAID	2,333	113.500	264,795.500	
	CADILA HEALTHCARE LTD	16,962	374.400	6,350,572.800	
	AVENUE SUPERMARTS LTD	11,937	1,326.100	15,829,655.700	
	INTERGLOBE AVIATION LTD	8,300	760.800	6,314,640.000	
インド・ルピー　小計		5,199,746		2,723,255,727.150 (4,166,581,263)	
インドネシア・ルピア	UNITED TRACTORS TBK PT	163,401	31,400.000	5,130,791,400.000	
	INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK PT	359,200	5,525.000	1,984,580,000.000	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	137,500	44,100.000	6,063,750,000.000	
	PT ASTRA INTERNATIONAL TBK	1,798,100	6,725.000	12,092,222,500.000	
	TELEKOMUNIKASI INDONESIA PERSERO TBK	4,532,900	3,570.000	16,182,453,000.000	

	CHAROEN POKPHAND INDONESIA TBK PT	675,600	4,930.000	3,330,708,000.000	
	GUDANG GARAM TBK PT	48,600	74,725.000	3,631,635,000.000	
	HANJAYA MANDALA SAMPOERNA TBK	924,800	3,870.000	3,578,976,000.000	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA TBK PT	185,600	16,475.000	3,057,760,000.000	
	INDAH KIAT PULP AND PAPER CORP TBK PT	262,000	14,025.000	3,674,550,000.000	
	BANK DANAMON INDONESIA TBK PT	261,316	6,925.000	1,809,613,300.000	
	BANK MANDIRI	1,666,500	6,275.000	10,457,287,500.000	
	MATAHARI DEPARTMENT STORE TBK	276,500	6,000.000	1,659,000,000.000	
	BANK RAKYAT INDONESIA	4,985,300	2,910.000	14,507,223,000.000	
	PERUSAHAAN GAS NEGARA PT	1,064,100	2,140.000	2,277,174,000.000	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSERO TBK PT	669,100	6,725.000	4,499,697,500.000	
	KALBE FARMA TBK PT	1,822,200	1,255.000	2,286,861,000.000	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK PT	276,500	8,900.000	2,460,850,000.000	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	900,100	22,725.000	20,454,772,500.000	
	JASA MARGA PERSERO TBK PT	200,125	4,310.000	862,538,750.000	
	BUMI SERPONG DAMAI PT	851,700	965.000	821,890,500.000	
	ADARO ENERGY PT	1,434,500	1,720.000	2,467,340,000.000	
	PAKUWON JATI TBK	1,912,800	440.000	841,632,000.000	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR TBK PT	239,000	8,575.000	2,049,425,000.000	
	TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE TBK PT	180,800	4,780.000	864,224,000.000	
	BANK TABUNGAN NEGARA TBK PT	480,300	2,300.000	1,104,690,000.000	
	WASKITA KARYA PERSERO TBK PT	392,000	1,575.000	617,400,000.000	
	PT SURYA CITRA MEDIA TBK	511,300	1,730.000	884,549,000.000	
インドネシア・ルピア　小計		27,211,842		129,653,593,950.000 (959,436,595)	
オフショア・人民元	LUXSHARE PRECISION INDUSTRY CO LTD	9,600	14.680	140,928.000	
	FOCUS MEDIA INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD	26,300	7.290	191,727.000	
	IFLYTEK CO LTD	6,400	24.210	154,944.000	
	YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD	2,300	70.230	161,529.000	
	JIANGSU YANGHE BREWERY JOINT-STOCK CO LTD	2,500	111.000	277,500.000	
	WULIANGYE YIBIN CO LTD	4,500	58.720	264,240.000	
	SUNING.COM CO LTD	29,500	12.030	354,885.000	

BOE TECHNOLOGY GROUP CO LTD	79,900	2.730	218,127.000	
CHINA MERCHANTS SHEKOU INDUSTRIAL ZONE HOLDINGS CO LTD	12,300	16.100	198,030.000	
GREE ELECTRIC APPLIANCES INC OF ZHUHAI	5,700	37.050	211,185.000	
MIDEA GROUP CO LTD	8,000	40.300	322,400.000	
HANGZHOU HIKVISION DIGITAL TECHNOLOGY CO LTD	12,000	23.810	285,720.000	
PING AN BANK CO LTD	27,200	9.860	268,192.000	
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO LTD	79,000	4.020	317,580.000	
CHINA VANKE CO LTD	13,700	20.930	286,741.000	
WEICHAI POWER CO LTD	29,900	8.090	241,891.000	
GF SECURITIES CO LTD	22,700	13.170	298,959.000	
BYD CO LTD	7,500	42.820	321,150.000	
BANK OF SHANGHAI CO LTD	20,900	11.260	235,334.000	
PETROCHINA CO LTD	32,800	8.830	289,624.000	
INDUSTRIAL & COMMERCIAL BANK OF CHINA LTD	75,500	5.400	407,700.000	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA LTD	82,500	3.650	301,125.000	
BANK OF CHINA LTD	74,500	3.500	260,750.000	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL CORP	51,300	6.400	328,320.000	
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	32,300	28.450	918,935.000	
PING AN INSURANCE GROUP CO OF CHINA LTD	14,000	61.850	865,900.000	
INDUSTRIAL BANK CO LTD	27,400	15.020	411,548.000	
SHANGHAI PUDONG DEVELOPMENT BANK CO LTD	36,700	9.800	359,660.000	
CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	73,320	5.960	436,987.200	
SAIC MOTOR CORP LTD	10,900	28.460	310,214.000	
KWEICHOW MOUTAI CO LTD	1,800	644.990	1,160,982.000	
BANK OF COMMUNICATIONS CO LTD	79,200	5.500	435,600.000	
CITIC SECURITIES CO LTD	33,200	15.170	503,644.000	
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	10,900	32.800	357,520.000	
CHINA YANGTZE POWER CO LTD	26,500	15.370	407,305.000	
DAQIN RAILWAY CO LTD	30,100	7.590	228,459.000	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD	60,800	3.710	225,568.000	
CHINA STATE CONSTRUCTION ENGINEERING CORP LTD	61,600	5.100	314,160.000	

HAITONG SECURITIES CO LTD	36,000	7.920	285,120.000	
HUAXIA BANK CO LTD	23,200	7.550	175,160.000	
INNER MONGOLIA YILI INDUSTRIAL GROUP CO LTD	10,400	24.190	251,576.000	
BANK OF BEIJING CO LTD	42,800	5.700	243,960.000	
BAOSHAN IRON & STEEL CO LTD	29,200	7.180	209,656.000	
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	4,200	33.490	140,658.000	
CHINA MERCHANTS SECURITIES CO LTD	22,800	12.100	275,880.000	
POLY REAL ESTATE GROUP CO LTD	20,400	10.980	223,992.000	
CRRC CORP LTD	38,600	8.180	315,748.000	
JIANGSU HENGRUI MEDICINE CO LTD	4,900	55.550	272,195.000	
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION CORP LTD	27,400	11.010	301,674.000	
HUATAI SECURITIES CO LTD	30,600	14.230	435,438.000	
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD	21,100	8.220	173,442.000	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	11,000	27.980	307,780.000	
FOUNDER SECURITIES CO LTD	31,000	4.790	148,490.000	
KANGMEI PHARMACEUTICAL CO LTD	14,300	21.680	310,024.000	
CHINA INTERNATIONAL TRAVEL SERVICE CORP LTD	3,900	60.500	235,950.000	
AVIC CAPITAL CO LTD	49,800	4.360	217,128.000	
METALLURGICAL CORP OF CHINA LTD	54,400	3.300	179,520.000	
POWER CONSTRUCTION CORP OF CHINA LTD	36,100	4.880	176,168.000	
SICHUAN CHUANTOU ENERGY CO LTD	23,700	7.920	187,704.000	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD	9,900	19.290	190,971.000	
AECC AVIATION POWER CO LTD	9,500	21.910	208,145.000	
JOINTOWN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	16,000	14.440	231,040.000	
INDUSTRIAL SECURITIES CO LTD	53,200	4.040	214,928.000	
BEIJING TONGRENTANG CO LTD	6,400	29.090	186,176.000	
SHANDONG GOLD MINING CO LTD	8,000	25.790	206,320.000	

	YONGHUI SUPERSTORES CO LTD	24,000	7.440	178,560.000	
	AISINO CORP	6,400	24.120	154,368.000	
	CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD	28,600	5.850	167,310.000	
	ZHANGZHOU PIENTZEHUANG PHARMACEUTICAL CO LTD	1,800	88.460	159,228.000	
	HENGTONG OPTIC-ELECTRIC CO LTD	8,100	20.250	164,025.000	
	FOSHAN HAITIAN FLAVOURING & FOOD CO LTD	6,200	72.460	449,252.000	
	GUOTAI JUNAN SECURITIES CO LTD	33,800	13.780	465,764.000	
	CHINA NATIONAL NUCLEAR POWER CO LTD	51,300	5.600	287,280.000	
	BANK OF JIANGSU CO LTD	32,400	6.040	195,696.000	
	ORIENT SECURITIES CO LTD/CHINA	24,800	7.950	197,160.000	
	EVERBRIGHT SECURITIES CO LTD	24,000	8.270	198,480.000	
オフショア・人民元　小計		2,095,420		22,197,029.200 (361,367,635)	
カタール・リアル	QATAR INSURANCE CO SAQ	14,417	37.120	535,159.040	
	QATAR NATIONAL BANK	42,093	180.000	7,576,740.000	
	COMMERCIAL BANK OF QATAR QSC	18,202	38.020	692,040.040	
	OOREDOO QSC	8,410	67.660	569,020.600	
	DOHA BANK QSC	18,035	21.200	382,342.000	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	4,887	190.010	928,578.870	
	INDUSTRIES QATAR QSC	16,138	130.000	2,097,940.000	
	QATAR ISLAMIC BANK SAQ	10,281	139.010	1,429,161.810	
	MASRAF AL RAYAN	32,079	37.270	1,195,584.330	
	BARWA REAL ESTATE CO	9,376	36.460	341,848.960	
	EZDAN HOLDING GROUP QSC	84,431	10.330	872,172.230	
カタール・リアル　小計		258,349		16,620,587.880 (513,077,548)	
コロンビア・ペソ	INTERCONEXION ELECTRICA SA ESP	45,324	12,720.000	576,521,280.000	
	ECOPETROL SA	412,135	3,900.000	1,607,326,500.000	
	GRUPO DE INVERSIONES SURAMERICANA SA-PREF	10,138	32,020.000	324,618,760.000	
	GRUPO AVAL ACCIONES Y VALORES SA-PREF	341,831	1,125.000	384,559,875.000	
	CEMENTOS ARGOS SA	37,720	7,400.000	279,128,000.000	
	GRUPO ARGOS SA	28,217	15,300.000	431,720,100.000	
	BANCOLOMBIA SA	20,855	30,260.000	631,072,300.000	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	42,495	30,840.000	1,310,545,800.000	
	GRUPO DE INVERSIONES SURAMERICANA SA	25,428	33,360.000	848,278,080.000	

コロンビア・ペソ　小計		964,143		6,393,770,695.000 (232,093,876)	
タイ・バーツ	BANGKOK BANK PCL	27,700	210.000	5,817,000.000	
	BERLI JUCKER PCL NVDR	116,700	56.000	6,535,200.000	
	KRUNG THAI BANK PCL NVDR	348,000	19.500	6,786,000.000	
	ROBINSON PCL-NVDR	38,800	65.250	2,531,700.000	
	SIAM COMMERCIAL BANK PCL NVDR	162,900	140.500	22,887,450.000	
	TRUE CORP PCL NVDR	1,030,755	5.850	6,029,916.750	
	KASIKORNBANK PCL NVDR	60,200	209.000	12,581,800.000	
	TMB BANK PCL -NVDR	1,010,000	2.280	2,302,800.000	
	IRPC PCL NVDR	1,065,500	6.300	6,712,650.000	
	BANPU PCL PUBLIC CO LTD NVDR	172,000	18.300	3,147,600.000	
	ELECTRICITY GENERATING PCL NVDR	13,100	231.000	3,026,100.000	
	CHAROEN POKPHAND FOODS PCL	311,500	23.900	7,444,850.000	
	ADVANCED INFO SERVICE PCL	92,800	196.000	18,188,800.000	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	380,520	14.900	5,669,748.000	
	DELTA ELECTRONICS THAI PCL NVDR	44,200	69.000	3,049,800.000	
	PTT PCL	946,600	51.000	48,276,600.000	
	THAI UNION GROUP PCL-NVDR	162,600	16.100	2,617,860.000	
	LAND AND HOUSES PCL NVDR	263,900	10.700	2,823,730.000	
	SIAM CEMENT PCL NVDR	33,850	422.000	14,284,700.000	
	AIRPORTS OF THAILAND PCL-NVDR	387,600	62.500	24,225,000.000	
	KASIKORNBANK PCL - FOREIGN	106,000	211.000	22,366,000.000	
	CENTRAL PATTANA PCL NVDR	119,200	79.250	9,446,600.000	
	BANGKOK DUSIT MEDICAL SERVICES NVDR	373,900	24.800	9,272,720.000	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR	38,900	186.000	7,235,400.000	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	236,810	38.000	8,998,780.000	
	THAI OIL PCL NVDR	98,500	82.500	8,126,250.000	
	GLOW ENERGY PCL NVDR	54,000	82.250	4,441,500.000	
	CP ALL PCL NVDR	453,300	67.250	30,484,425.000	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL	531,300	9.450	5,020,785.000	
	PTT EXPLORATION & PRODUCTION PCL NVDR	120,745	146.000	17,628,770.000	
	INDORAMA VENTURES PCL NVDR	166,322	57.000	9,480,354.000	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	196,708	77.000	15,146,516.000	

	ENERGY ABSOLUTE PCL NVDR	118,000	45.750	5,398,500.000	
	BANGKOK EXPRESSWAY & METRO PCL NVDR	740,700	8.250	6,110,775.000	
タイ・バーツ　小計		10,023,610		364,096,679.750 (1,248,851,612)	
チェコ・コルナ	KOMERCNI BANKA AS	7,067	893.000	6,310,831.000	
	O2 CZECH REPUBLIC AS	5,677	252.000	1,430,604.000	
	CEZ	15,014	559.500	8,400,333.000	
	MONETA MONEY BANK AS	57,258	79.900	4,574,914.200	
チェコ・コルナ　小計		85,016		20,716,682.200 (104,412,078)	
チリ・ペソ	BANCO SANTANDER CHILE	5,959,453	51.400	306,315,884.200	
	BANCO DE CREDITO E INVERSIONES	4,581	43,306.000	198,384,786.000	
	BANCO DE CHILE	2,321,052	98.270	228,089,780.040	
	EMPRESAS CMPC SA	116,383	2,520.700	293,366,628.100	
	EMPRESAS COPEC SA	34,981	9,873.700	345,391,899.700	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	15,170	9,015.500	136,765,135.000	
	ENTEL CHILE SA	16,500	5,316.800	87,727,200.000	
	ENEL AMERICAS SA	2,523,913	100.310	253,173,713.030	
	COLBUN SA	780,648	137.880	107,635,746.240	
	AGUAS ANDINAS SA	224,014	350.550	78,528,107.700	
	EMBOTELLADORA ANDINA SA	27,270	2,494.200	68,016,834.000	
	LATAM AIRLINES GROUP SA	26,485	6,447.700	170,767,334.500	
	SOCIEDAD QUIMICA Y MINERA DE CHILE SA	10,624	29,298.000	311,261,952.000	
	SACI FALABELLA	68,025	5,240.100	356,457,802.500	
	ITAU CORPBANCA	13,236,977	6.619	87,615,550.760	
	CENCOSUD SA	125,078	1,548.900	193,733,314.200	
	ENEL CHILE SA	2,764,879	62.620	173,136,722.980	
チリ・ペソ　小計		28,256,033		3,396,368,390.950 (559,721,510)	
トルコ・リラ	AKBANK TAS	185,577	6.430	1,193,260.110	
	ANADOLU EFES BIRACILIK VE MALT SANAYII AS	21,520	18.700	402,424.000	
	ARCELIK	30,429	12.700	386,448.300	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	31,766	26.260	834,175.160	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIKALARI TAS	125,960	10.650	1,341,474.000	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	5,919	66.000	390,654.000	
	KOC HOLDING AS	67,325	16.450	1,107,496.250	
	PETKIM PETROKIMYA HOLDING	88,174	5.200	458,504.800	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI AS	79,624	5.290	421,210.960	
	TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKASI AS	17,797	22.400	398,652.800	

	TURK HAVA YOLLARI	57,827	16.500	954,145.500	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	98,512	10.620	1,046,197.440	
	TURKIYE GARANTI BANKASI AS	201,717	7.120	1,436,225.040	
	TURKIYE IS BANKASI	162,502	4.020	653,258.040	
	TUPRAS TURKIYE PETROL RAFINE	11,716	137.000	1,605,092.000	
	ULKER BISKUVI SANAYI AS	13,121	16.340	214,397.140	
	YAPI VE KREDI BANKASI AS	143,015	1.660	237,404.900	
	HACI OMER SABANCI HOLDING AS	98,354	7.420	729,786.680	
	COCA-COLA ICECEK AS	6,451	30.460	196,497.460	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	19,011	80.500	1,530,385.500	
	TURKIYE VAKIFLAR BANKASI TAO	90,731	3.590	325,724.290	
	TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	13,735	27.340	375,514.900	
	TURKIYE HALK BANKASI AS	61,970	6.930	429,452.100	
トルコ・リラ　小計		1,632,753		16,668,381.370 (316,032,511)	
ハンガリー・フォリント	RICHTER GEDEON NYRT	14,830	5,120.000	75,929,600.000	
	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NYRT	30,013	2,902.000	87,097,726.000	
	OTP BANK NYRT	20,222	9,835.000	198,883,370.000	
ハンガリー・フォリント　小計		65,065		361,910,696.000 (144,872,852)	
パキスタン・ルピー	LUCKY CEMENT LTD	9,900	448.310	4,438,269.000	
	MCB BANK LTD	39,000	192.820	7,519,980.000	
	OIL & GAS DEVELOPMENT CO LTD	74,500	151.390	11,278,555.000	
	UNITED BANK LTD	51,400	139.580	7,174,412.000	
	HABIB BANK LTD	54,400	133.870	7,282,528.000	
パキスタン・ルピー　小計		229,200		37,693,744.000 (32,416,620)	
フィリピン・ペソ	AYALA LAND INC	641,100	38.500	24,682,350.000	
	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	188,940	46.550	8,795,157.000	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAND	88,540	81.900	7,251,426.000	
	AYALA CORP	21,583	882.000	19,036,206.000	
	ALLIANCE GLOBAL GROUP INC	307,700	11.480	3,532,396.000	
	DMCI HOLDINGS INC	351,850	12.180	4,285,533.000	
	GLOBE TELECOM INC	2,785	2,148.000	5,982,180.000	
	INTERNATIONAL CONTAINER TERM SERVICES INC	40,680	93.000	3,783,240.000	

	JG SUMMIT HOLDINGS INC	290,050	45.400	13,168,270.000	
	JOLLIBEE FOODS CORP	44,130	254.000	11,209,020.000	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	82,037	65.350	5,361,117.950	
	BDO UNIBANK INC	172,483	108.900	18,783,398.700	
	MEGAWORLD CORP	962,000	4.080	3,924,960.000	
	PLDT INC	9,520	1,364.000	12,985,280.000	
	ROBINSONS LAND CORP	218,722	19.100	4,177,590.200	
	SECURITY BANK CORP	23,420	133.200	3,119,544.000	
	SM PRIME HOLDINGS INC	900,475	33.700	30,346,007.500	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	90,210	128.000	11,546,880.000	
	SM INVESTMENTS CORP	23,458	850.500	19,951,029.000	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CORP	1,148,900	4.970	5,710,033.000	
	ABOITIZ POWER CORP	128,200	33.500	4,294,700.000	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	24,000	357.000	8,568,000.000	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	9,387	671.000	6,298,677.000	
フィリピン・ペソ	小計	5,770,170		236,792,995.350 (490,161,500)	
ブラジル・レアル	BRF SA	47,492	20.440	970,736.480	
	VALE SA	287,921	56.480	16,261,778.080	
	RAIA DROGASIL SA	20,600	67.480	1,390,088.000	
	TIM PARTICIPACOES SA	76,300	11.430	872,109.000	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	19,450	23.990	466,605.500	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	23,000	19.720	453,560.000	
	BANCO DO BRASIL SA	77,600	37.200	2,886,720.000	
	INVESTIMENTOS ITAU SA	424,160	10.750	4,559,720.000	
	LOJAS AMERICANAS SA	68,374	17.130	1,171,246.620	
	GERDAU SA	90,630	15.740	1,426,516.200	
	CIA BRASILEIRA DE DISTRIBUICAO GRUPO PAO DE ACUCAR	14,606	80.300	1,172,861.800	
	PETROLEO BRASILEIRO SA	267,910	28.100	7,528,271.000	
	PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	32,800	24.250	795,400.000	
	PETROLEO BRASILEIRO SA	354,512	25.290	8,965,608.480	
	KROTON EDUCACIONAL SA	122,968	11.150	1,371,093.200	
	CCR SA	121,420	9.890	1,200,843.800	
	WEG SA	74,072	18.430	1,365,146.960	
	BANCO BRADESCO SA PREF	306,225	31.930	9,777,764.250	
	BANCO BRADESCO SA	90,118	27.960	2,519,699.280	
	NATURA COSMETICOS SA	19,400	28.650	555,810.000	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	61,606	9.140	563,078.840	
	SUZANO PAPEL E CELULOSE SA	39,900	41.540	1,657,446.000	
	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	294,598	47.500	13,993,405.000	

	PORTO SEGURO SA	8,800	54.390	478,632.000	
	FIBRIA CELULOSE SA	22,490	72.420	1,628,725.800	
	BRASKEM SA	17,030	52.320	891,009.600	
	ENGIE BRASIL SA	17,370	35.440	615,592.800	
	LOCALIZA RENT A CAR	45,880	24.100	1,105,708.000	
	TELEFONICA BRASIL S.A.	39,428	38.300	1,510,092.400	
	LOJAS RENNER SA	62,870	34.450	2,165,871.500	
	EDP - ENERGIAS DO BRASIL SA	31,864	13.610	433,669.040	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	32,152	40.220	1,293,153.440	
	COSAN SA	16,500	34.230	564,795.000	
	EQUATORIAL ENERGIA SA	16,700	58.810	982,127.000	
	EMBRAER SA	63,360	18.450	1,168,992.000	
	M DIAS BRANCO SA	10,400	44.200	459,680.000	
	ODONTOPREV SA	32,200	12.480	401,856.000	
	BR MALLS PARTICIPACOES SA	85,565	11.320	968,595.800	
	JBS SA	89,900	9.140	821,686.000	
	CIA ENERGETICA DE MINAS GERAIS	96,249	10.150	976,927.350	
	CIA DE SANEAMENTO BASICO DO ESTADO DE SAO PAULO	34,698	27.180	943,091.640	
	MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS IMOBILIARIOS SA	31,140	20.650	643,041.000	
	SUL AMERICA SA	17,869	23.440	418,849.360	
	HYPERA SA	33,300	30.920	1,029,636.000	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BAICAO	185,916	23.820	4,428,519.120	
	MAGAZINE LUIZA SA	7,300	150.700	1,100,110.000	
	BANCO SANTANDER BRASIL SA	37,100	39.330	1,459,143.000	
	CIELO SA	111,307	12.430	1,383,546.010	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	62,400	27.150	1,694,160.000	
	ATACADAO DISTRIBUICAO COMERCIO E INDUSTRIA LTDA	37,300	14.550	542,715.000	
	AMBEV SA	427,595	16.990	7,264,839.050	
	KLABIN SA	64,800	17.670	1,145,016.000	
	RUMO SA	97,800	15.360	1,502,208.000	
	IRB BRASIL RESSEGUROS S/A	10,500	63.220	663,810.000	
ブラジル・レアル　小計		4,783,445		122,611,306.400 (3,637,877,461)	
ポーランド・ズロチ	BANK MILLENNIUM SA	49,782	8.800	438,081.600	
	MBANK	1,595	400.200	638,319.000	

	BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA	2,596	71.600	185,873.600	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	11,899	84.600	1,006,655.400	
	BANK PEKAO SA	16,219	101.950	1,653,527.050	
	ORANGE POLSKA SA	58,600	4.410	258,426.000	
	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	26,492	93.620	2,480,181.040	
	LPP SA	130	8,220.000	1,068,600.000	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	3,142	345.800	1,086,503.600	
	CD PROJEKT RED SA	6,015	152.000	914,280.000	
	POWSZECHNA KASA OSZCZEDNOSCI BANK POLSKI SA	77,884	39.630	3,086,542.920	
	CCC SA	2,763	211.000	582,993.000	
	GRUPA LOTOS SA	9,480	71.480	677,630.400	
	POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I GAZOWNICTWO SA	167,192	6.340	1,059,997.280	
	CYFROWY POLSAT SA	23,495	23.440	550,722.800	
	GRUPA AZOTY SA	3,853	27.580	106,265.740	
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	70,529	9.510	670,730.790	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZEN SA	53,451	38.700	2,068,553.700	
	JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA SA	6,170	65.200	402,284.000	
	ALIOR BANK SA	9,405	62.000	583,110.000	
	DINO POLSKA SA	4,709	88.150	415,098.350	
	PLAY COMMUNICATIONS SA	15,228	17.160	261,312.480	
ポーランド・ズロチ　小計		620,629		20,195,688.750 (610,111,757)	
マレーシア・リンギット	AMMB HOLDINGS BHD	195,500	3.950	772,225.000	
	GENTING PLANTATIONS BHD	18,800	9.360	175,968.000	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	419,200	5.660	2,372,672.000	
	DIGI.COM BHD	288,700	4.390	1,267,393.000	
	MALAYSIA AIRPORTS HOLDINGS BHD	91,320	8.350	762,522.000	
	RHB BANK BHD	108,980	5.260	573,234.800	
	HAP SENG CONSOLIDATED BHD	70,000	9.570	669,900.000	
	TOP GLOVE CORP BHD	66,900	10.700	715,830.000	
	GAMUDA BHD	194,600	2.300	447,580.000	
	GENTING BHD	200,900	7.140	1,434,426.000	
	YTL CORP BHD	283,710	1.150	326,266.500	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP BHD	20,256	18.720	379,192.320	
	HONG LEONG BANK BHD	62,308	20.300	1,264,852.400	
	IJM CORP BHD	230,360	1.540	354,754.400	
	IOI CORP BHD	187,213	4.510	844,330.630	

	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	43,200	24.680	1,066,176.000	
	FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	12,800	35.640	456,192.000	
	MALAYAN BANKING BHD	343,775	9.280	3,190,232.000	
	ALLIANCE BANK MALAYSIA BHD	88,400	4.100	362,440.000	
	MISC BHD	90,280	5.660	510,984.800	
	NESTLE MALAYSIA BHD	5,800	145.000	841,000.000	
	PPB GROUP BHD	57,360	16.760	961,353.600	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	19,600	26.000	509,600.000	
	PETRONAS GAS BHD	60,400	17.240	1,041,296.000	
	GENTING MALAYSIA BHD	281,900	4.410	1,243,179.000	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD	14,700	34.500	507,150.000	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	132,500	2.640	349,800.000	
	SP SETIA BHD	178,500	2.130	380,205.000	
	TENAGA NASIONAL BHD	281,150	14.280	4,014,822.000	
	UMW HOLDINGS BHD	39,000	4.400	171,600.000	
	DIALOG GROUP BHD	320,544	3.310	1,061,000.640	
	PUBLIC BANK BHD(LOCAL)	262,930	24.900	6,546,957.000	
	AIRASIA GROUP BHD	147,900	2.700	399,330.000	
	MY EG SERVICES BHD	165,800	1.470	243,726.000	
	SIME DARBY BERHAD	232,700	2.600	605,020.000	
	HARTALEGA HOLDINGS BHD	145,400	6.150	894,210.000	
	AXIATA GROUP BERHAD	264,600	4.010	1,061,046.000	
	MAXIS BHD	203,300	5.450	1,107,985.000	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	228,600	9.220	2,107,692.000	
	ASTRO MALAYSIA HOLDINGS BHD	140,500	1.460	205,130.000	
	IHH HEALTHCARE BHD	220,400	5.000	1,102,000.000	
	FGV HOLDINGS BHD	126,400	1.390	175,696.000	
	WESTPORTS HOLDINGS BHD	130,000	3.500	455,000.000	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDINGS BHD	153,100	4.830	739,473.000	
	SIME DARBY PROPERTY BHD	232,700	1.070	248,989.000	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	216,100	5.240	1,132,364.000	
	IOI PROPERTIES GROUP SDN BHD	174,548	1.380	240,876.240	
マレーシア・リンギット　小計		7,453,634		46,293,672.330 (1,250,392,090)	
メキシコ・ペソ	ALFA SAB DE CV	264,100	22.960	6,063,736.000	
	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	51,400	115.930	5,958,802.000	
	EL PUERTO DE LIVERPOOL SAB DE CV	19,100	141.060	2,694,246.000	
	GRUPO TELEVISA SAB	219,600	62.570	13,740,372.000	
	GRUPO BIMBO SAB DE CV	149,100	38.610	5,756,751.000	

	GRUMA SAB DE CV	19,445	229.310	4,458,932.950	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INFRAESTRUCTURA	20,260	196.220	3,975,417.200	
	GRUPO CARSO SAB DE CV	37,600	60.600	2,278,560.000	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE SAB DE CV	234,700	132.080	30,999,176.000	
	MEXICHEM SAB DE CV	103,425	63.410	6,558,179.250	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	14,695	335.300	4,927,233.500	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO SAB DE CV	156,700	31.320	4,907,844.000	
	ALSEA SAB DE CV	43,700	59.090	2,582,233.000	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL SURESTE SAB DE CV	17,990	354.440	6,376,375.600	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV	318,352	51.330	16,341,008.160	
	AMERICA MOVIL SAB DE CV	3,050,278	14.750	44,991,600.500	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA SA	198,800	28.600	5,685,680.000	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	43,400	116.080	5,037,872.000	
	WAL-MART DE MEXICO SAB DE CV	474,900	53.740	25,521,126.000	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL PACIFICO SAB DE CV	31,200	191.540	5,976,048.000	
	INFRAESTRUCTURA ENERGETICA NOVA SAB DE CV	53,200	89.310	4,751,292.000	
	BANCO SANTANDER MEXICO SA-B	174,090	28.230	4,914,560.700	
メキシコ・ペソ　小計		5,696,035		214,497,045.860 (1,269,822,511)	
ユーロ	PIRAEUS BANK S.A	25,000	1.170	29,250.000	
	ALPHA BANK A.E.	125,732	1.156	145,346.190	
	NATIONAL BANK OF GREECE	46,501	1.568	72,913.560	
	TITAN CEMENT CO. S.A.	5,217	19.000	99,123.000	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	24,351	9.520	231,821.520	
	FF GROUP	3,130	4.800	15,024.000	
	EUROBANK ERGASIAS	194,100	0.501	97,244.100	
	MOTOR OIL HELLAS CORINTH REFIN	5,847	22.400	130,972.800	
	OPAP SA	19,846	8.370	166,111.020	
	JUMBO SA	10,420	12.200	127,124.000	
ユーロ　小計		460,144		1,114,930.190 (145,074,716)	
韓国・ウォン	CHEIL WORLDWIDE INC	7,097	21,450.000	152,230,650.000	
	HANMI SCIENCE CO LTD	1,164	75,800.000	88,231,200.000	
	HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	3,477	75,800.000	263,556,600.000	

SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANC	2,595	277,500.000	720,112,500.000	
DB INSURANCE CO LTD	5,060	69,700.000	352,682,000.000	
COWAY CO LTD	4,439	80,800.000	358,671,200.000	
KT&G CORP	10,519	99,400.000	1,045,588,600.000	
S-1 CORPORATION	1,444	90,100.000	130,104,400.000	
KOREA GAS CORP	2,997	58,000.000	173,826,000.000	
CJ CORP	1,547	117,500.000	181,772,500.000	
KAKAO CORP	4,774	98,500.000	470,239,000.000	
CJ ENM CO LTD	987	238,000.000	234,906,000.000	
SK TELECOM CO LTD	1,859	270,000.000	501,930,000.000	
DAELIM INDUSTRIAL CO	2,649	79,600.000	210,860,400.000	
MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD	40,612	7,110.000	288,751,320.000	
NCSOFT CORPORATION	1,574	404,500.000	636,683,000.000	
LG UPLUS CORP	20,384	16,850.000	343,470,400.000	
DOOSAN HEAVY INDUSTRIES AND CONSTRUCTION CO LTD	7,766	12,600.000	97,851,600.000	
DAEWOO ENGINEERING & CONSTRUCT	13,540	5,210.000	70,543,400.000	
POSCO DAEWOO CORP	3,600	19,750.000	71,100,000.000	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD	810	1,047,000.000	848,070,000.000	
LG CHEM LTD	4,012	307,000.000	1,231,684,000.000	
LG CHEM LTD	726	180,000.000	130,680,000.000	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD	201	659,000.000	132,459,000.000	
SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD	37,095	43,900.000	1,628,470,500.000	
S-OIL CORP	4,133	129,000.000	533,157,000.000	
HANWHA CHEMICAL CORPORATION	10,493	16,750.000	175,757,750.000	
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	5,997	28,500.000	170,914,500.000	
LOTTE CHEMICAL CORPORATION	1,576	268,000.000	422,368,000.000	
HOTEL SHILLA CO LTD	2,826	82,200.000	232,297,200.000	
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	3,604	127,500.000	459,510,000.000	
HYUNDAI MOBIS	6,133	195,500.000	1,199,001,500.000	
SK HYNIX INC	52,126	69,000.000	3,596,694,000.000	
HYUNDAI ENGINEERING & CONSTRUCTION CO LTD	7,403	53,900.000	399,021,700.000	
HYUNDAI MOTOR CO	2,642	69,300.000	183,090,600.000	
HYUNDAI MOTOR CO	13,513	116,000.000	1,567,508,000.000	
HYUNDAI STEEL CO	7,476	49,950.000	373,426,200.000	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	22,788	14,300.000	325,868,400.000	
KCC CORP	554	295,500.000	163,707,000.000	
KIA MOTORS CORP	22,988	33,100.000	760,902,800.000	
KOREA ZINC CO LTD	834	392,500.000	327,345,000.000	

KOREA ELECTRIC POWER CORP	22,108	23,850.000	527,275,800.000	
HANWHA CORP	3,785	28,900.000	109,386,500.000	
KOREAN AIR CO LTD	5,301	25,450.000	134,910,450.000	
OCI COMPANY LTD	1,829	99,100.000	181,253,900.000	
CJ LOGISTICS	860	140,000.000	120,400,000.000	
KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	1,930	81,600.000	157,488,000.000	
KT CORP	2,048	29,000.000	59,392,000.000	
HLB INC	2,994	84,200.000	252,094,800.000	
LG ELECTRONICS INC	8,926	62,300.000	556,089,800.000	
LOTTE CORP	3,366	58,300.000	196,237,800.000	
HANSSEM CO LTD	1,100	63,900.000	70,290,000.000	
LG CORP	8,649	62,900.000	544,022,100.000	
NH INVESTMENT & SECURITIES CO LTD	13,362	12,100.000	161,680,200.000	
GS ENGINEERING & CONSTRUCTION	4,872	49,350.000	240,433,200.000	
NAVER CORP	2,531	704,000.000	1,781,824,000.000	
HYUNDAI DEPARTMENT STORE CO LTD	1,249	88,100.000	110,036,900.000	
DONGSUH CO INC	3,149	20,400.000	64,239,600.000	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO LTD	4,223	62,100.000	262,248,300.000	
OTTOGI CORP	112	670,000.000	75,040,000.000	
AMOREPACIFIC GROUP	2,818	73,200.000	206,277,600.000	
KANGWON LAND INC	10,655	28,150.000	299,938,250.000	
POSCO	6,891	257,000.000	1,770,987,000.000	
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	15,569	18,200.000	283,355,800.000	
SAMSUNG SDI CO LTD	4,950	227,000.000	1,123,650,000.000	
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO LTD	4,863	125,000.000	607,875,000.000	
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	436,407	43,100.000	18,809,141,700.000	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES CO LTD	42,202	7,250.000	305,964,500.000	
SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	77,783	34,650.000	2,695,180,950.000	
SHINSEGAE CO LTD	646	288,000.000	186,048,000.000	
YUHAN CORP	836	206,500.000	172,634,000.000	
HANON SYSTEMS	19,093	11,900.000	227,206,700.000	
HYUNDAI MARINE & FIRE INSURANCE CO LTD	6,480	39,800.000	257,904,000.000	
GS HOLDINGS CORP	4,842	51,700.000	250,331,400.000	
LG DISPLAY CO LTD	22,210	17,350.000	385,343,500.000	
CELLTRION INC	7,192	271,500.000	1,952,628,000.000	
VIROMED CO LTD	1,302	211,100.000	274,852,200.000	
HANA FINANCIAL GROUP	25,829	43,200.000	1,115,812,800.000	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	1,800	110,500.000	198,900,000.000	

	CELLTRION PHARM INC	1,457	68,900.000	100,387,300.000	
	LOTTE SHOPPING CO	1,227	202,500.000	248,467,500.000	
	SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LTD	6,421	90,900.000	583,668,900.000	
	AMOREPACIFIC CORP	2,661	197,500.000	525,547,500.000	
	AMOREPACIFIC CORP-PREF	848	116,000.000	98,368,000.000	
	SAMSUNG CARD CO	2,877	34,800.000	100,119,600.000	
	SK INNOVATION CO LTD	5,628	206,000.000	1,159,368,000.000	
	CJ CHEILJEDANG CORP	870	312,000.000	271,440,000.000	
	STX PAN OCEAN CO LTD	18,395	4,725.000	86,916,375.000	
	KEPCO PLANT SERVICE & ENGINEERING CO LTD	2,170	30,200.000	65,534,000.000	
	LG INNOTEK CO LTD	1,440	118,000.000	169,920,000.000	
	SK HOLDINGS CO LTD	2,618	268,500.000	702,933,000.000	
	KB FINANCIAL GROUP INC	35,095	52,800.000	1,853,016,000.000	
	MEDY-TOX INC	409	517,800.000	211,780,200.000	
	KOREA AEROSPACE INDUSTRIES LTD	6,602	30,600.000	202,021,200.000	
	BNK FINANCIAL GROUP INC	25,264	8,210.000	207,417,440.000	
	HANMI PHARM CO LTD	610	433,500.000	264,435,000.000	
	HANWHA LIFE INSURANCE CO LTD	27,836	4,795.000	133,473,620.000	
	E-MART CO LTD	1,699	205,500.000	349,144,500.000	
	DGB FINANCIAL GROUP INC	18,575	10,100.000	187,607,500.000	
	GS RETAIL CO LTD	2,482	40,800.000	101,265,600.000	
	HANKOOK TIRE CO LTD NEW	6,590	45,600.000	300,504,000.000	
	HDC HYUNDAI DEVELOPMENT CO-ENGINEERING & CONSTRUCTION	3,444	42,200.000	145,336,800.000	
	HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOLDIMGS CO LTD	942	375,000.000	353,250,000.000	
	BGF RETAIL CO LTD	854	205,000.000	175,070,000.000	
	ORION CORP REPUBLIC OF KOREA	2,071	96,800.000	200,472,800.000	
	ORANGE LIFE INSURANCE LTD	3,735	30,650.000	114,477,750.000	
	NETMARBLE CORP	2,446	126,000.000	308,196,000.000	
	SAMSUNG SDS CO LTD	3,043	204,000.000	620,772,000.000	
	WOORI BANK	41,071	16,150.000	663,296,650.000	
	SAMSUNG C&T CORP	6,626	115,000.000	761,990,000.000	
	SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	1,432	467,000.000	668,744,000.000	
	PEARL ABYSS CORP	534	197,400.000	105,411,600.000	
	DOOSAN BOBCAT INC	2,723	38,050.000	103,610,150.000	
	SILLAJEN INC	5,635	79,600.000	448,546,000.000	
	CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	3,490	80,500.000	280,945,000.000	
韓国・ウォン　小計		1,380,596		70,856,872,655.000 (7,014,830,393)	
香港・ドル	JIANGXI COPPER CO LTD	138,000	8.300	1,145,400.000	

JIANGSU EXPRESS	124,000	9.500	1,178,000.000	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD	156,000	4.130	644,280.000	
ANGANG STEEL CO LTD-H	104,000	6.280	653,120.000	
CHINA MOBILE LIMITED	559,000	78.500	43,881,500.000	
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	111,500	42.600	4,749,900.000	
DATANG INTERNATIONAL POWER GEN	288,000	1.820	524,160.000	
BEIJING ENTERPRISES	52,500	41.750	2,191,875.000	
HUANENG POWER INTERNATIONAL IN	400,000	4.710	1,884,000.000	
ALIBABA HEALTH INFORMATION TECHNOLOGY	322,000	6.160	1,983,520.000	
YANZHOU COAL MINING CO LTD	188,000	8.500	1,598,000.000	
HENGAN INTERNATIONAL GROUP	65,000	65.300	4,244,500.000	
HUADIAN POWER INTL CORP-H	144,000	2.730	393,120.000	
CHONGQING CHANGAN AUTOMOBILE	63,600	5.430	345,348.000	
CHINA EASTERN AIRLINES CORP LT	124,000	4.180	518,320.000	
CNOOC LTD	1,617,000	14.280	23,090,760.000	
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	270,000	10.760	2,905,200.000	
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LTD	426,000	15.080	6,424,080.000	
CHINA OVERSEAS LAND & INVESTME	343,120	22.600	7,754,512.000	
CHINA RESOURCES LAND LTD	252,888	24.200	6,119,889.600	
CITIC LTD	521,000	11.500	5,991,500.000	
CHINA TRAVEL INTERNATIONAL INV	198,000	2.220	439,560.000	
BEIJING CAPITAL INTERNATIONAL	162,000	8.070	1,307,340.000	
LENOVO GROUP LTD	642,000	4.670	2,998,140.000	
PETRO CHINA CO LTD	1,894,000	5.990	11,345,060.000	
SKYWORTH DIGITAL HOLDINGS LTD	162,000	2.010	325,620.000	
CHINA UNICOM HONG KONG LTD	552,742	8.810	4,869,657.020	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS CO LTD	145,390	24.650	3,583,863.500	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL COR	2,283,200	6.720	15,343,104.000	
TONG REN TANG TECHNOLOGIES CO	54,000	10.560	570,240.000	

TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	90,000	17.140	1,542,600.000	
KINGDEE INTERNATIONAL SOFTWARE GROUP CO LTD	220,000	6.810	1,498,200.000	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	68,800	65.800	4,527,040.000	
KUNLUN ENERGY COMPANY LTD	288,000	8.620	2,482,560.000	
TOWNGAS CHINA CO LTD	91,000	5.480	498,680.000	
COSCO SHIPPING PORTS LTD	162,000	8.350	1,352,700.000	
YUEXIU PROPERTY CO LTD	696,000	1.230	856,080.000	
CHINA MERCHANTS PORT HOLDINGS CO LTD	132,000	13.340	1,760,880.000	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	374,000	3.140	1,174,360.000	
SHENZHEN INTERNATIONAL HOLDING	84,500	14.620	1,235,390.000	
CHINA EVERBRIGHT LTD	82,000	12.580	1,031,560.000	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	157,400	21.000	3,305,400.000	
KINGBOARD HOLDINGS LTD	63,500	22.950	1,457,325.000	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LTD	448,000	12.900	5,779,200.000	
SHENZHEN INVESTMENT LTD	306,000	2.140	654,840.000	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LTD	86,000	31.300	2,691,800.000	
BYD CO LTD	55,500	47.500	2,636,250.000	
CHINA TELECOM CORP LTD	1,244,000	4.010	4,988,440.000	
CHINA OILFIELD SERVICES LTD	172,000	7.620	1,310,640.000	
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	1,220,000	0.940	1,146,800.000	
SINOTRANS LTD	190,000	2.900	551,000.000	
CHINA EVERBRIGHT INTERNATIONAL	324,592	6.290	2,041,683.680	
MMG LTD	220,000	3.080	677,600.000	
LEE & MAN PAPER MANUFACTURING LTD	170,000	6.670	1,133,900.000	
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	625,788	8.590	5,375,518.920	
AVICHINA INDUSTRY & TECHNOLOGY	225,000	4.570	1,028,250.000	
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS	197,200	13.280	2,618,816.000	
GREAT WALL MOTOR COMPANY LTD	300,500	4.650	1,397,325.000	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	680,000	16.660	11,328,800.000	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD	561,000	2.750	1,542,750.000	
SHANDONG WEIGAO GROUP MEDICAL-H	176,000	6.780	1,193,280.000	

SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	274,700	6.920	1,900,924.000	
WEICHAI POWER CO LTD	176,440	8.280	1,460,923.200	
CHINA SHIPPING DEVELOPMENT CO	100,000	4.100	410,000.000	
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEMICAL	353,000	3.640	1,284,920.000	
SHANGHAI INDUSTRIAL	46,000	16.020	736,920.000	
TINGYI HOLDING CORP	178,000	12.460	2,217,880.000	
TSINGTAO BREWERY CO LTD	40,000	33.700	1,348,000.000	
GUANGDONG INVESTMENTS LTD	266,000	14.120	3,755,920.000	
CHINA TRADITIONAL CHINESE MEDICINE HOLDINGS CO LTD	208,000	4.480	931,840.000	
CHINA RESOURCES BEER HOLDINGS	133,333	27.300	3,639,990.900	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO LTD	146,000	6.280	916,880.000	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	634,500	6.190	3,927,555.000	
CHINA SHIPPING CONTAINER LINES	247,000	0.920	227,240.000	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	248,000	22.700	5,629,600.000	
TENCENT HOLDINGS LTD	517,100	267.000	138,065,700.000	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	474,500	72.100	34,211,450.000	
BEIJING ENTERPRISES WATER GROUP LTD	560,000	3.810	2,133,600.000	
GOME RETAIL HOLDINGS LTD	970,240	0.720	698,572.800	
CHINA POWER INTERNATIONAL	350,000	1.610	563,500.000	
AIR CHINA / HONG KONG	198,000	6.550	1,296,900.000	
ZTE CORP	71,288	10.920	778,464.960	
SHANGHAI ELECTRIC GROUP CO LTD	250,000	2.510	627,500.000	
CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD	306,500	17.820	5,461,830.000	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO LTD	248,500	2.880	715,680.000	
BANK OF COMMUNICATIONS	752,205	5.520	4,152,171.600	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT HOLDINGS LTD	206,250	7.620	1,571,625.000	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	66,500	69.950	4,651,675.000	
CHINA CONSTRUCTION BANK	8,756,530	6.090	53,327,267.700	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP HOLDINGS LTD	69,000	84.000	5,796,000.000	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	262,000	7.620	1,996,440.000	

AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	160,000	8.820	1,411,200.000	
SSY GROUP LTD	144,000	6.450	928,800.000	
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS LTD	168,000	7.670	1,288,560.000	
CHINA NATIONAL BLDG MATERIAL	364,000	5.910	2,151,240.000	
BANK OF CHINA LTD	7,192,200	3.270	23,518,494.000	
SHUI ON LAND LTD	335,500	1.600	536,800.000	
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	122,500	15.180	1,859,550.000	
GREENTOWN CHINA HOLDINGS LTD	82,000	5.150	422,300.000	
GUANGZHOU R&F PROPERTIES CO LTD	100,400	12.080	1,212,832.000	
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	349,470	28.600	9,994,842.000	
IND & COMM BK OF CHINA - H	6,295,235	5.160	32,483,412.600	
ZHAOJIN MINING INDUSTRY CO LTD	96,000	6.280	602,880.000	
KINGBOARD LAMINATES HOLDING	104,000	6.300	655,200.000	
CHINA COMMUNICATIONS SERVICES	227,600	6.490	1,477,124.000	
CHINA COMMUNICATIONS CONSTRUCTION CO LTD	397,000	7.720	3,064,840.000	
CHINA COAL ENERGY CO	178,000	3.240	576,720.000	
HAITIAN INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	64,000	15.620	999,680.000	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC CO LTD	51,000	41.050	2,093,550.000	
HAIER ELECTRONICS GROUP CO LTD	129,000	17.640	2,275,560.000	
CHINA AGRI-INDUSTRIES HOLDINGS LTD	191,000	2.620	500,420.000	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD	684,142	7.980	5,459,453.160	
CHINA MOLYBDENUM CO LTD	369,000	2.720	1,003,680.000	
CHINA CITIC BANK-H	811,800	4.760	3,864,168.000	
KWG GROUP HOLDINGS LTD	121,000	5.670	686,070.000	
SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	64,700	71.300	4,613,110.000	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	97,000	30.350	2,943,950.000	
FOSUN INTERNATIONAL	230,028	11.980	2,755,735.440	
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP LTD	502,000	2.970	1,490,940.000	
SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD	308,500	2.850	879,225.000	
SOHO CHINA LTD	172,500	2.700	465,750.000	

KINGSOFT CORP LTD	76,000	12.080	918,080.000	
GCL POLY ENERGY HOLDINGS LTD	1,362,000	0.485	660,570.000	
SINOTRUK HONG KONG LTD	64,500	13.240	853,980.000	
CHINA RAILWAY GROUP LTD	338,000	7.410	2,504,580.000	
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS LTD	122,000	7.850	957,700.000	
BYD ELECTRONIC INTERNATIONAL CO LTD	79,000	8.690	686,510.000	
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION CORP	178,000	10.180	1,812,040.000	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	450,000	5.540	2,493,000.000	
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	232,000	27.500	6,380,000.000	
CHINA EVERGRANDE GROUP	237,000	19.300	4,574,100.000	
CRRC CORP LTD - H	386,450	6.810	2,631,724.500	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDINGS LTD	126,000	8.720	1,098,720.000	
CHONG SING HOLDINGS FINTECH GROUP LTD	1,656,000	0.390	645,840.000	
SUN ART RETAIL GROUP LTD	240,000	9.350	2,244,000.000	
BBMG CORP	222,000	2.320	515,040.000	
CHINA ZHONGWANG HOLDINGS LTD	145,200	3.290	477,708.000	
SINOPHARM GROUP CO	107,600	36.750	3,954,300.000	
CHINA RESOURCES CEMENT	248,000	7.930	1,966,640.000	
METALLURGICAL CORP OF CHINA LTD	276,000	2.020	557,520.000	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD	274,527	7.300	2,004,047.100	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL BANK	285,000	3.980	1,134,300.000	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP CORP	317,000	6.170	1,955,890.000	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD	79,100	17.320	1,370,012.000	
HUANENG RENEWABLES CORP LTD	472,000	2.160	1,019,520.000	
SIHUAN PHARMACEUTICAL HOLDINGS GROUP LTD	325,000	1.560	507,000.000	
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	218,000	19.980	4,355,640.000	
YUZHOU PROPERTIES CO LTD	166,000	2.800	464,800.000	
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	128,500	17.200	2,210,200.000	
NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	75,800	35.200	2,668,160.000	
CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	563,156	5.420	3,052,305.520	
KAISA GROUP HOLDINGS LTD	203,000	2.230	452,690.000	

XINJIANG GOLDWIND SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	60,000	6.570	394,200.000	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD	257,000	3.240	832,680.000	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA	2,697,000	3.530	9,520,410.000	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS LTD	55,000	15.600	858,000.000	
FAR EAST HORIZON LTD	199,000	7.050	1,402,950.000	
CITIC SECURITIES CO LTD	184,000	12.020	2,211,680.000	
FUTURE LAND DEVELOPMENT HOLDINGS LTD	172,000	4.160	715,520.000	
HAITONG SECURITIES CO LTD	294,000	6.550	1,925,700.000	
CHINA INTERNATIONAL MARINE CONTAINERS GROUP CO LTD	39,400	7.270	286,438.000	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROUP OF CHINA LTD	706,000	3.390	2,393,340.000	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	46,000	26.350	1,212,100.000	
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	334,000	3.040	1,015,360.000	
SINOPEC ENGINEERING GROUP CO LTD	121,500	8.000	972,000.000	
CHINA GALAXY SECURITIES CO LTD	328,500	3.330	1,093,905.000	
HANERGY THIN FILM POWER GROUP	986,000	0.000	0.000	
NEXTEER AUTOMOTIVE GROUP LTD	85,000	10.320	877,200.000	
CHINA HUISHAN DAIRY HOLDINGS CO LTD	323,000	0.000	0.000	
GREENTOWN SERVICE GROUP CO LTD	96,000	5.180	497,280.000	
JIAYUAN INTERNATIONAL GROUP LTD	94,000	13.240	1,244,560.000	
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO LTD	42,400	15.500	657,200.000	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA CO LTD	267,000	4.680	1,249,560.000	
GENSCRIPT BIOTECH CORP	74,000	11.500	851,000.000	
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLDINGS CO LTD	95,000	10.980	1,043,100.000	
CHINA FIRST CAPITAL GROUP LTD	308,000	3.510	1,081,080.000	
CHINA TOWER CORP LTD	3,154,000	1.100	3,469,400.000	
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	276,000	2.270	626,520.000	

	CHINA CINDA ASSET MANAGEMENT CO LTD	796,000	1.830	1,456,680.000	
	LOGAN PROPERTY HOLDINGS CO LTD	134,000	7.380	988,920.000	
	CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS LTD	147,500	23.600	3,481,000.000	
	CHINA VANKE CO LTD-H	113,761	21.750	2,474,301.750	
	LUYE PHARMA GROUP LTD	108,000	5.740	619,920.000	
	CAR INC	68,000	6.190	420,920.000	
	HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	39,000	13.080	510,120.000	
	CGN POWER CO LTD	981,000	1.790	1,755,990.000	
	FULLSHARE HOLDINGS LTD	702,500	3.090	2,170,725.000	
	BAIC MOTOR CORP LTD	163,500	5.110	835,485.000	
	GF SECURITIES CO LTD	127,400	8.960	1,141,504.000	
	FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD	51,200	25.600	1,310,720.000	
	HUATAI SECURITIES CO LTD	112,600	10.600	1,193,560.000	
	3SBIO INC	130,000	11.340	1,474,200.000	
	LEGEND HOLDINGS CORP	31,500	20.750	653,625.000	
	CHINA RESOURCES PHARMACEUTICAL GROUP LTD	146,000	11.440	1,670,240.000	
	CHINA HUARONG ASSET MANAGEMENT CO LTD	904,000	1.360	1,229,440.000	
	CHINA LITERATURE LTD	17,200	40.950	704,340.000	
	DALI FOODS GROUP CO LTD	188,000	5.300	996,400.000	
	CHINA RAILWAY SIGNAL & COMMUNICATION CORP LTD	141,000	5.200	733,200.000	
	CHINA REINSURANCE GROUP CORP	525,000	1.390	729,750.000	
	MEITU INC	152,500	4.670	712,175.000	
	BOC AVIATION LTD	20,300	54.900	1,114,470.000	
	ZHONGAN ONLINE P&C INSURANCE CO LTD	15,500	26.300	407,650.000	
	CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CORP LTD	101,600	11.880	1,207,008.000	
	WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	44,500	62.400	2,776,800.000	
	HENGTEN NETWORKS GROUP LTD	2,096,000	0.280	586,880.000	
香港・ドル　小計		88,299,075		753,390,117.950 (10,788,546,489)	
台湾・ドル	ACER INC	278,532	20.650	5,751,685.800	
	ASUSTEK COMPUTER INC	64,554	239.000	15,428,406.000	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	46,616	105.000	4,894,680.000	
	ASIA CEMENT CORP	209,928	38.150	8,008,753.200	
	WALSIN TECHNOLOGY CORP	31,000	156.500	4,851,500.000	
	TAIWAN BUSINESS BANK	371,457	10.450	3,881,725.650	

VANGUARD INTERNATIONAL SEMICONDUCTOR CORP	85,000	54.000	4,590,000.000	
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO LTD	65,000	74.400	4,836,000.000	
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	54,975	54.500	2,996,137.500	
QUANTA COMPUTER INC	235,858	48.800	11,509,870.400	
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	90,070	45.600	4,107,192.000	
EVA AIRWAYS CORP	149,269	13.700	2,044,985.300	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	59,760	277.500	16,583,400.000	
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	509,345	17.500	8,913,537.500	
CHINA AIRLINES	232,156	8.980	2,084,760.880	
CHENG SHIN RUBBER INDUSTRY CO	188,169	43.350	8,157,126.150	
CHINA STEEL CORP	1,122,058	24.200	27,153,803.600	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD/TAIWAN	279,994	28.500	7,979,829.000	
ADVANTECH CO LTD	29,889	195.000	5,828,355.000	
COMPAL ELECTRONICS INC	360,304	17.450	6,287,304.800	
DELTA ELECTRONICS INC	188,663	111.500	21,035,924.500	
NANYA TECHNOLOGY CORP	110,000	48.500	5,335,000.000	
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	348,327	108.500	37,793,479.500	
AU OPTRONICS CORP	810,194	11.300	9,155,192.200	
TAIWAN MOBILE CO LTD	146,800	108.000	15,854,400.000	
EVERGREEN MARINE CORP	187,590	11.550	2,166,664.500	
FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	275,824	32.350	8,922,906.400	
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	29,825	162.500	4,846,562.500	
ECLAT TEXTILE CO LTD	18,322	341.000	6,247,802.000	
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	51,285	123.500	6,333,697.500	
FORMOSA PLASTICS CORP	402,633	103.000	41,471,199.000	
FORMOSA TAFFETA CO LTD	61,000	33.250	2,028,250.000	
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE CO	318,594	114.000	36,319,716.000	
GIANT MANUFACTURING	30,151	115.000	3,467,365.000	
MEDIATEK INC	135,507	210.500	28,524,223.500	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD	598,936	49.650	29,737,172.400	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	701,232	17.500	12,271,560.000	
HOTAI MOTOR CO LTD	25,000	228.500	5,712,500.000	
FAR EASTONE TELECOMMUNICATIONS CO LTD	144,000	71.800	10,339,200.000	

YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	876,141	14.950	13,098,307.950	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	737,920	50.100	36,969,792.000	
CHINA DEPT FINANCIAL HOLDING	1,183,403	10.200	12,070,710.600	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO LTD	947,168	21.600	20,458,828.800	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	1,492,532	70.100	104,626,493.200	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LTD	981,495	26.500	26,009,617.500	
LARGAN PRECISION CO LTD	10,220	3,235.000	33,061,700.000	
TAISHIN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	956,589	13.900	13,296,587.100	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING CO	831,061	10.450	8,684,587.450	
INVENTEC CO LTD	268,005	23.800	6,378,519.000	
HTC CORPORATION	79,832	30.400	2,426,892.800	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	218,845	33.050	7,232,827.250	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	990,443	10.250	10,152,040.750	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,580,048	21.150	33,418,015.200	
MACRONIX INTERNATIONAL	196,861	19.150	3,769,888.150	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO LTD	915,220	19.950	18,258,639.000	
POWERTECH TECHNOLOGY INC	61,560	69.400	4,272,264.000	
NAN YA PLASTICS CORP	465,828	76.100	35,449,510.800	
WISTRON CORP	266,916	17.000	4,537,572.000	
POU CHEN CORP	183,990	29.200	5,372,508.000	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CORP	435,297	70.200	30,557,849.400	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	51,392	319.000	16,394,048.000	
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	108,480	126.500	13,722,720.000	
PHISON ELECTRONICS CORP	16,658	194.500	3,239,981.000	
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	54,393	45.400	2,469,442.200	
RUENTEX INDUSTRIES LTD	68,715	54.000	3,710,610.000	
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	94,588	64.000	6,053,632.000	
STANDARD FOODS CORP	34,639	43.650	1,511,992.350	
SYNNEX TECHNOLOGY INTERNATIONAL CORP	144,899	34.000	4,926,566.000	
TAIWAN CEMENT CORP	406,561	37.600	15,286,693.600	
TECO ELECTRIC AND MACHINERY CO LTD	161,000	19.200	3,091,200.000	
TAIWAN SEMICONDUCTOR	2,233,083	227.500	508,026,382.500	

	UNITED MICROELECTRONICS CORP	1,073,525	13.750	14,760,968.750	
	WINBOND ELECTRONICS CORP	324,000	12.050	3,904,200.000	
	YAGEO CORP	23,160	388.000	8,986,080.000	
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	192,000	27.050	5,193,600.000	
	INNOLUX CORPORATION	820,345	9.110	7,473,342.950	
	WPG HOLDINGS CO LTD	130,203	37.750	4,915,163.250	
	HIWIN TECHNOLOGIES CORP	23,073	201.500	4,649,209.500	
	TAIMED BIOLOGICS INC	18,000	183.500	3,303,000.000	
	PEGATRON CORP	178,554	53.800	9,606,205.200	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	13,000	233.500	3,035,500.000	
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	38,000	109.000	4,142,000.000	
	CHAILEASE HOLDING CO LTD	101,737	92.000	9,359,804.000	
	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING LTD	48,385	62.600	3,028,901.000	
	TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL HOLDING	828,412	17.500	14,497,210.000	
	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	311,903	61.800	19,275,605.400	
	GLOBALWAFERS CO LTD	21,000	246.500	5,176,500.000	
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	15,000	198.500	2,977,500.000	
	GENERAL INTERFACE SOLUTION HOLDING LTD	18,000	105.000	1,890,000.000	
台湾・ドル　小計		30,279,896		1,578,163,076.430 (5,697,168,706)	
南アフリカ・ランド	BIDVEST GROUP LTD	29,572	175.910	5,202,010.520	
	CLICKS GROUP LTD	22,975	156.140	3,587,316.500	
	TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	44,326	78.000	3,457,428.000	
	DISCOVERY LTD	31,052	154.800	4,806,849.600	
	REDEFINE PROPERTIES LTD	469,360	9.550	4,482,388.000	
	GOLD FIELDS LTD	81,159	38.600	3,132,737.400	
	REMGRO LTD	46,304	186.840	8,651,439.360	
	THE FOSCHINI GROUP LTD	19,873	162.190	3,223,201.870	
	MMI HOLDINGS LTD	111,471	16.500	1,839,271.500	
	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	260,960	23.060	6,017,737.600	
	EXXARO RESOURCES LTD	25,340	146.500	3,712,310.000	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	3,704	968.520	3,587,398.080	
	LIBERTY HOLDINGS LTD	15,137	107.000	1,619,659.000	
	MTN GROUP LTD	151,630	84.000	12,736,920.000	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	38,047	136.880	5,207,873.360	
	TELKOM SA SOC LTD	31,588	49.700	1,569,923.600	
	FIRSTRAND LTD	303,471	60.050	18,223,433.550	

	PSG GROUP LTD	15,546	210.500	3,272,433.000	
	NASPERS LTD	39,866	2,681.280	106,891,908.480	
	CORONATION FUND MANAGERS LTD	26,700	49.230	1,314,441.000	
	NEDBANK GROUP LTD	36,512	238.140	8,694,967.680	
	NETCARE LTD	105,465	23.860	2,516,394.900	
	PICK'N PAY STORES LTD	31,255	64.910	2,028,762.050	
	RMB HOLDINGS LTD	61,174	68.400	4,184,301.600	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	6,200	475.990	2,951,138.000	
	SAPPI LTD	48,883	81.900	4,003,517.700	
	SASOL LTD	50,151	520.820	26,119,643.820	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	40,566	181.670	7,369,625.220	
	MR PRICE GROUP LTD	23,411	222.050	5,198,412.550	
	STANDARD BANK GROUP LTD	116,717	159.000	18,558,003.000	
	SPAR GROUP LTD/THE	16,512	168.000	2,774,016.000	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	88,009	48.040	4,227,952.360	
	IMPERIAL HOLDINGS LTD	16,774	157.750	2,646,098.500	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LTD	34,576	154.690	5,348,561.440	
	ABSA GROUP LTD	64,032	144.620	9,260,307.840	
	TIGER BRANDS LTD	16,282	246.000	4,005,372.000	
	SANLAM LTD	154,608	71.040	10,983,352.320	
	INVESTEC LTD	29,312	90.770	2,660,650.240	
	KUMBA IRON ORE LTD	5,327	290.990	1,550,103.730	
	PIONEER FOODS LTD	15,500	78.490	1,216,595.000	
	MONDI LTD	10,866	347.470	3,775,609.020	
	LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDINGS LTD	135,845	23.460	3,186,923.700	
	RMI HOLDINGS	55,278	34.710	1,918,699.380	
	VODACOM GROUP PTY LTD	55,182	119.560	6,597,559.920	
	NEPI ROCKCASTLE PLC	32,983	125.960	4,154,538.680	
	OLD MUTUAL LTD	443,070	21.130	9,362,069.100	
	REINET INVESTMENTS SCA	14,237	254.460	3,622,747.020	
	FORTRESS REIT LTD-A	102,950	17.060	1,756,327.000	
	BID CORP LTD	29,931	275.620	8,249,582.220	
南アフリカ・ランド　小計		3,609,689		371,458,512.410 (2,860,230,545)	
合計		228,770,566		48,275,462,755 (48,275,462,755)	

（２）株式以外の有価証券

平成30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	1,300,875.000	15,090,150.000	
		FOMENTO ECONOMICO MEXICANO SAB DE CV	175,900.000	32,059,534.000	
	メキシコ・ペソ　小計		1,476,775.000	47,149,684.000 (279,126,129)	
投資信託受益証券　合計			1,476,775	279,126,129 (279,126,129)	
投資証券	トルコ・リラ	EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATIRIM	231,071.000	404,374.250	
	トルコ・リラ　小計		231,071.000	404,374.250 (7,666,936)	
	メキシコ・ペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	316,200.000	7,794,330.000	
	メキシコ・ペソ　小計		316,200.000	7,794,330.000 (46,142,434)	
	南アフリカ・ランド	FORTRESS REIT LTD-B	95,302.000	1,477,181.000	
		HYPROP INVESTMENTS LTD	22,174.000	1,998,320.880	
		RESILIENT REIT LTD	28,600.000	1,650,220.000	
	南アフリカ・ランド　小計		146,076.000	5,125,721.880 (39,468,058)	
投資証券　合計			693,347	93,277,428 (93,277,428)	
合計				372,403,557 (372,403,557)	

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

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

通貨	銘柄数		組入株式時価比率	組入投資信託受益証券時価比率	組入投資証券時価比率	有価証券の合計金額に対する比率
アメリカ・ドル	株式	47銘柄	10.44%	-%	-%	11.41%
アラブ首長国連邦・ディルハム	株式	10銘柄	0.60%	-%	-%	0.66%
インド・ルピー	株式	80銘柄	7.84%	-%	-%	8.56%
インドネシア・ルピア	株式	28銘柄	1.80%	-%	-%	1.97%
オフショア・人民元	株式	76銘柄	0.68%	-%	-%	0.74%
カタール・リアル	株式	11銘柄	0.96%	-%	-%	1.05%
コロンビア・ペソ	株式	9銘柄	0.44%	-%	-%	0.48%
タイ・バーツ	株式	34銘柄	2.35%	-%	-%	2.57%
チェコ・コルナ	株式	4銘柄	0.20%	-%	-%	0.21%
チリ・ペソ	株式	17銘柄	1.05%	-%	-%	1.15%
トルコ・リラ	株式	23銘柄	0.59%	-%	-%	0.67%
	投資証券	1銘柄	-%	-%	0.01%	
ハンガリー・フォリント	株式	3銘柄	0.27%	-%	-%	0.30%
パキスタン・ルピー	株式	5銘柄	0.06%	-%	-%	0.07%
フィリピン・ペソ	株式	23銘柄	0.92%	-%	-%	1.01%
ブラジル・レアル	株式	54銘柄	6.84%	-%	-%	7.48%
ポーランド・ズロチ	株式	22銘柄	1.15%	-%	-%	1.25%
マレーシア・リンギット	株式	47銘柄	2.35%	-%	-%	2.57%
メキシコ・ペソ	株式	22銘柄	2.39%	-%	-%	3.28%
	投資信託受益証券	2銘柄	-%	0.52%	-%	
	投資証券	1銘柄	-%	-%	0.09%	
ユーロ	株式	10銘柄	0.27%	-%	-%	0.30%
韓国・ウォン	株式	115銘柄	13.19%	-%	-%	14.42%
香港・ドル	株式	205銘柄	20.29%	-%	-%	22.18%
台湾・ドル	株式	89銘柄	10.71%	-%	-%	11.71%
南アフリカ・ランド	株式	49銘柄	5.38%	-%	-%	5.96%
	投資証券	3銘柄	-%	-%	0.07%	

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

２【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

グローバル８資産ラップファンド（安定型）

平成30年10月31日現在

Ⅰ　資産総額	**1,619,569,185円**
Ⅱ　負債総額	**1,120,658円**
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	**1,618,448,527円**
Ⅳ　発行済数量	**1,614,371,391口**
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	**1.0025円**

グローバル８資産ラップファンド（中立型）

平成30年10月31日現在

Ⅰ　資産総額	**889,555,338円**
Ⅱ　負債総額	**615,396円**
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	**888,939,942円**
Ⅳ　発行済数量	**887,723,195口**
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	**1.0014円**

グローバル８資産ラップファンド（積極型）

平成30年10月31日現在

Ⅰ　資産総額	**421,687,382円**
Ⅱ　負債総額	**303,662円**
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	**421,383,720円**
Ⅳ　発行済数量	**421,303,153口**
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	**1.0002円**

（参考）

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

平成30年10月31日現在

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

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年10月31日現在

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

Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド

平成30年10月31日現在

Ⅰ　資産総額	**31,097,176,975円**
Ⅱ　負債総額	**305,887,244円**
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	**30,791,289,731円**
Ⅳ　発行済数量	**16,579,522,055口**
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	**1.8572円**

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年10月31日現在

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

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年10月31日現在

Ⅰ　資産総額	**198,452,581,465円**
Ⅱ　負債総額	**41,261,000円**
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	**198,411,320,465円**
Ⅳ　発行済数量	**110,130,597,297口**
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	**1.8016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10月31日現在

Ⅰ　資産総額	**40,250,020,654円**
Ⅱ　負債総額	**45,032,355円**
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	**40,204,988,299円**
Ⅳ　発行済数量	**32,956,854,859口**
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	**1.2199円**

コモディティインデックス・マザーファンド

平成30年10月31日現在

Ⅰ　資産総額	**3,806,369,304円**
Ⅱ　負債総額	**0円**
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	**3,806,369,304円**
Ⅳ　発行済数量	**8,287,428,965口**
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	**0.4593円**

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

平成30年10月31日現在

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

①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。

②上記①の申請のある場合には、上記①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①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。

③上記①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たときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

(5)受益権の譲渡の対抗要件

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

(6)受益権の再分割

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

(7)質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第１【委託会社等の概況】

１【委託会社等の概況】

（1）資本金の額（2018年10月31日現在）

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

※種類株式の発行が可能

直近５カ年の資本金の増減：該当事項はありません。

（2）会社の機構（2018年10月31日現在）

①　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。

②　投資運用の意思決定機構

1.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。

2.運用計画、売買計画の決定

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

2【事業の内容及び営業の概況】

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

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

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

３【委託会社等の経理状況】

１．委託会社であるアセットマネジメントOne株式会社（以下「委託会社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。
また、中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）、ならびに同規則第38条及び第57条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。

２．財務諸表及び中間財務諸表の金額は、千円未満の端数を切り捨てて記載しております。

３．委託会社は、第33期事業年度（自平成29年4月1日至平成30年3月31日）の財務諸表について、新日本有限責任監査法人の監査を受け、第34期中間会計期間（自平成30年4月1日至平成30年9月30日）の中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の中間監査を受けております。

（１）【貸借対照表】

（単位：千円）

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

（単位：千円）

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

（２）【損益計算書】

（単位：千円）

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

（単位：千円）

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

（３）【株主資本等変動計算書】

第32期（自平成28年4月1日至平成29年3月31日）

（単位：千円）

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

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

第33期（自平成29年4月1日至平成30年3月31日）

（単位：千円）

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

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

重要な会計方針

1．有価証券の評価基準及び評価方法	(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 (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
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	(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。 (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エアについては、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。
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	(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。 (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。 (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。 ①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。 ②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。 数理計算上の差異については、各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年または10年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌事業年度から費用処理しております。 (4) 時効後支払損引当金は、時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。 (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。
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
ソフトウエア	2,821	28,472
電話加入権	16,052	3

※4. 固定資産売却損の内訳

（千円）

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

※5. 本社移転費用の内訳

（千円）

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

（株主資本等変動計算書関係）

第32期（自平成28年4月1日 至平成29年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

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

2. 配当に関する事項

（1）配当金支払額

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

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

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

第33期（自平成29年4月1日 至平成30年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

（1）配当金支払額

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

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

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

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

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

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

（2）金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

営業債務である未払手数料は、１年以内の支払期日であります。

（3）金融商品に係るリスク管理体制

①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。

②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。

③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 その他有価証券	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）
①非上場株式	337,468	272,464
②関係会社株式	3,306,296	3,229,196

①非上場株式は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券」には含めておりません。

②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			
①株式	609,710	146,101	463,608
②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			
①株式	―	―	―
②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			
①株式	1,267,157	146,101	1,121,055
②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			
①株式	－	－	－
②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 （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 （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）
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 （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	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

①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%	―

②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)
繰延税金資産	（千円）	（千円）
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

①MHAM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、②TB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、③DIAM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」③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」③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A種種類株式15,510株を交付しました。

8. 経済的持分比率（議決権比率）

MHFGが企業結合直前に所有していた当社に対する経済的持分比率　50.00%
MHFGが企業結合日に追加取得した当社に対する経済的持分比率　20.00%
MHFGの追加取得後の当社に対する経済的持分比率　70.00%
なお、MHFGが所有する議決権比率については50.00%から51.00%に異動しております。

9. 取得企業を決定するに至った主な根拠

「3. 企業結合の方法」③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」①の吸収合併及び②の吸収分割については共通支配下の取引として処理し、③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.発生したのれんの金額	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

①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。

②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。

(1) 中間貸借対照表

（単位：千円）

		第34期中間会計期間末 （平成30年9月30日現在）
（資産の部）		
流動資産		
現金・預金		34,067,025
金銭の信託		18,936,052
未収委託者報酬		12,755,452
未収運用受託報酬		3,856,616
未収投資助言報酬		346,291
未収収益		58,816
前払費用		722,476
その他		443,661
流動資産計		71,186,392
固定資産		
有形固定資産		1,564,959
建物	※1	1,139,616
器具備品	※1	425,343
無形固定資産		2,666,559
ソフトウエア		875,280
ソフトウエア仮勘定		1,787,307
電話加入権		3,931
電信電話専用施設利用権		40
投資その他の資産		8,242,396
投資有価証券		2,436,769
関係会社株式		3,229,196
長期差入保証金		1,318,800
繰延税金資産		1,167,835
その他		89,794
固定資産計		12,473,915
資産合計		83,660,307

（単位：千円）

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

(2) 中間損益計算書

（単位：千円）

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

（単位：千円）

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

(3) 中間株主資本等変動計算書

第34期中間会計期間（自平成30年4月1日至平成30年9月30日）

（単位：千円）

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

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

重要な会計方針

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

表示方法の変更

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

注記事項

（中間貸借対照表関係）

項目	第34期中間会計期間末 （平成30年9月30日現在）
※1.有形固定資産の減価償却累計額	建物　…　184,810千円 器具備品　…　860,618千円

（中間損益計算書関係）

項目	第34期中間会計期間 （自平成30年4月1日 至平成30年9月30日）
※1.減価償却実施額	有形固定資産　…　112,547千円 無形固定資産　…　181,894千円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第34期中間会計期間（自平成30年4月1日 至平成30年9月30日）

1.発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2.配当に関する事項

（1）配当金支払額

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

（2）基準日が当中間会計期間に属する配当のうち、配当の効力発生日が当中間会計期間後となるもの

該当事項はありません。

（金融商品関係）

第34期中間会計期間末（平成30年9月30日現在）

金融商品の時価等に関する事項

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

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

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

（注1）金融商品の時価の算定方法

資　産

（1）現金・預金

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

（2）金銭の信託

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

(3) 未収委託者報酬及び(4) 未収運用受託報酬

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

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

負　債

(1) 未払手数料

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

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

区分	中間貸借対照表計上額 （千円）
①非上場株式	272,464
②関係会社株式	3,229,196

①非上場株式は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(5) 有価証券及び投資有価証券　その他有価証券」には含めておりません。

②関係会社株式は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載しておりません。

（有価証券関係）

第34期中間会計期間末
（平成30年9月30日現在）

1.子会社株式

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

2.その他有価証券

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

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

（企業結合等関係）

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

1.結合当事企業

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

2.企業結合日

平成28年10月1日

3.企業結合の方法

①MHAM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、②TB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、③DIAM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」③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」③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A種種類株式15,510株を交付しました。

8.経済的持分比率（議決権比率）

MHFGが企業結合直前に所有していた当社に対する経済的持分比率　50.00%
MHFGが企業結合日に追加取得した当社に対する経済的持分比率　20.00%
MHFGの追加取得後の当社に対する経済的持分比率　70.00%
なお、MHFGが所有する議決権比率については50.00%から51.00%に異動しております。

9.取得企業を決定するに至った主な根拠

「3. 企業結合の方法」③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」①の吸収合併及び②の吸収分割については共通支配下の取引として処理し、③の吸収合併については逆取得として処理しております。

11.被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

（1）中間財務諸表に含まれる被取得企業の業績の期間

平成30年4月1日から平成30年9月30日まで

（2）被取得企業の取得原価及びその内訳

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

（3）発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

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

（4）企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

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

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

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

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

12.被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

（1）貸借対照表項目

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

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

（2）損益計算書項目

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

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

（資産除去債務関係）

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

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

（セグメント情報等）

第34期中間会計期間（自平成30年4月1日 至平成30年9月30日）

1.セグメント情報

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2.関連情報

（１）サービスごとの情報

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

（２）地域ごとの情報

①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。

②有形固定資産

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

（３）主要な顧客ごとの情報

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

（1株当たり情報）

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

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

1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

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

（重要な後発事象）

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

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) 通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下（4）（5）において同じ。）または子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引または店頭デリバティブ取引を行うこと。

(4) 委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。

(5) 上記（3）（4）に掲げるもののほか、委託会社の親法人等または子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

５【その他】

(1) 定款の変更、事業譲渡又は事業譲受、出資の状況その他の重要事項

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

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

(2) 訴訟事件その他の重要事項

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

第２【その他の関係法人の概況】

１【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託会社

a. 名称

みずほ信託銀行株式会社

b. 資本金の額

2018年3月末日現在　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
めぶき証券株式会社	3,000	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。

（注）資本金の額は2018年3月末日現在

(3)投資顧問会社

a. 名称

水戸証券株式会社

b. 資本金の額

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

・金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書である旨
・委託会社の金融商品取引業者登録番号
・詳細情報の入手方法
①委託会社のホームページアドレス、電話番号および受付時間など
②請求目論見書の入手方法およびファンドの投資信託約款の全文が請求目論見書に掲載されている旨
・目論見書の使用開始日
・届出の効力に関する事項について、次に掲げるいずれかの内容を記載することがあります。
①届出をした日および当該届出の効力の発生の有無を確認する方法
②届出をした日、届出が効力を生じている旨および効力発生日
・ファンドの内容に関して重大な変更を行う場合には、投資信託及び投資法人に関する法律（昭和26年法律第198号）に基づき事前に受益者の意向を確認する旨
・投資信託の財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されている旨
・請求目論見書は投資者の請求により販売会社から交付される旨および当該請求を行った場合にはその旨の記録をしておくべきである旨
・「ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください」との趣旨を示す記載

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

(3)投資信託説明書（請求目論見書）に約款の全文を掲載します。

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

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

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

独立監査人の監査報告書

平成３０年5月３０日

アセットマネジメントOne株式会社
取　締　役　会　　御　中

新日本有限責任監査法人

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

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

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

監査人の責任
当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。
監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。
当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

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

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

以　上

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

（注２）ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

平成３０年１１月２２日

アセットマネジメントOne株式会社
取　締　役　会　　御　中

EY新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　湯原　尚　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、「ファンドの経理状況」に掲げられているグローバル８資産ラップファンド（安定型）の平成２９年１０月１３日から平成３０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、グローバル８資産ラップファンド（安定型）の平成３０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。

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財務諸表は、前任監査人によって監査されている。前任監査人は、当該財務諸表に対して平成２９年１１月２９日付けで無限定適正意見を表明している。

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

以　上

（注１）上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
（注２）ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

平成３０年１１月２２日

アセットマネジメントOne株式会社
取 締 役 会 御 中

EY新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 湯原 尚 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、「ファンドの経理状況」に掲げられているグローバル８資産ラップファンド（中立型）の平成２９年１０月１３日から平成３０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、グローバル８資産ラップファンド（中立型）の平成３０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。

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財務諸表は、前任監査人によって監査されている。前任監査人は、当該財務諸表に対して平成２９年１１月２９日付けで無限定適正意見を表明している。

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

以 上

（注１）上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
（注２）ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

平成３０年１１月２２日

アセットマネジメントOne株式会社
取 締 役 会 御 中

EY新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 湯原 尚 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、「ファンドの経理状況」に掲げられているグローバル８資産ラップファンド（積極型）の平成２９年１０月１３日から平成３０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、グローバル８資産ラップファンド（積極型）の平成３０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。

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財務諸表は、前任監査人によって監査されている。前任監査人は、当該財務諸表に対して平成２９年１１月２９日付けで無限定適正意見を表明している。

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

以 上

（注１）上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
（注２）ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の中間監査報告書

平成３０年１１月３０日

アセットマネジメントOne株式会社
取　締　役　会　　御　中

EY新日本有限責任監査法人

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

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

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

利害関係

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

以　　上

（注１）上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
（注２）ＸＢＲＬデータは中間監査の対象には含まれておりません。