

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2019年2月8日提出
【発行者名】	アセットマネジメントOne株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 菅野 暁
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目8番2号
【事務連絡者氏名】	三木谷 正直
【電話番号】	03-6774-5100
【届出の対象とした募集(売出)内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	コア資産形成ファンド
【届出の対象とした募集(売出)内国投資 信託受益証券の金額】	継続募集額(2019年2月9日から2019年8月8日まで) 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】

コア資産形成ファンド(以下「当ファンド」といいます。)

ただし、愛称として「ビギナズ ラップ」という名称を用いることがあります。

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託の振替内国投資信託受益権（以下「受益権」と称することがあります。）です。

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ることとし、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、以下「振替機関等」といいます。）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（以下、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。

また、当ファンドについて、委託会社の依頼により、信用格付業者から提供され、若しくは閲覧に供された信用格付けまたは信用格付業者から提供され、若しくは閲覧に供される予定の信用格付けはありません。

（３）【発行（売出）価額の総額】

5,000億円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

取得申込日の翌営業日の基準価額とします。

「基準価額」とは、ファンドの資産総額から負債総額を控除して求めた金額（純資産総額）を、計算日における受益権総口数で除した価額をいいます。ただし、便宜上1万口あたりに換算した価額で表示されることがあります。

基準価額については、販売会社または委託会社にお問い合わせください。なお、委託会社に対する照会は下記においてできます。

照会先の名称	ホームページアドレス	電話番号
アセットマネジメントOne株式会社	http://www.am-one.co.jp/	0120-104-694

注：電話番号はコールセンターのもので（以下同じ）。

電話によるお問い合わせは、営業日の午前9時～午後5時までとさせていただきます。（以下同じ。）

（５）【申込手数料】

申込手数料（受益権1口あたり）は、取得申込日の翌営業日の基準価額に、2.16%（税抜2%）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。なお、申込手数料には、消費税ならびに地方消費税に相当する金額（8%、以下「消費税等相当額」といいます。）が課せられます。

申込手数料については、販売会社にお問い合わせください。

「分配金再投資コース」を選択された場合の収益分配金は、毎計算期末の翌営業日に原則として税金を差し引いた後、自動的に無手数料で再投資されます。

（ 6 ）【申込単位】

申込単位は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「分配金再投資コース」による取得申込が可能です。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。なお、「分配金再投資コース」を選択されたお申込者は、収益分配金の再投資に際し、1口の整数倍をもって取得することができます。

申込単位および取扱コースについては、販売会社にお問い合わせください。

当初元本は1口当たり1円です。

（ 7 ）【申込期間】

2019年2月9日から2019年8月8日まで

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】

当ファンドの申込取扱場所（以下「販売会社」といいます。）については、下記の委託会社の照会先までお問い合わせください。

照会先の名称	ホームページアドレス	電話番号
アセットマネジメントOne株式会社	http://www.am-one.co.jp/	0120-104-694

（ 9 ）【払込期日】

取得申込代金は、販売会社が定める期日までに、販売会社にお支払いいただきます。

各取得申込日の発行価額の総額は、追加信託が行われる日に、販売会社により、アセットマネジメントOne株式会社（「委託者」または「委託会社」といいます。）の指定する口座を経由して、みずほ信託銀行株式会社（「受託者」または「受託会社」といいます。）の指定するファンド口座（受託会社が再信託している場合は、当該再信託受託会社の指定するファンド口座）に払い込まれます。

（ 10 ）【払込取扱場所】

取得申込代金は、お申込みの販売会社にお支払いください。なお、払込取扱場所については、下記の委託会社の照会先までお問い合わせください。

照会先の名称	ホームページアドレス	電話番号
アセットマネジメントOne株式会社	http://www.am-one.co.jp/	0120-104-694

（ 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

(1 2) 【その他】

投資信託振替制度における振替受益権について

当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。

ファンドの分配金、償還金、換金代金は、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。

投資信託振替制度(以下「振替制度」といいます。)においては、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します。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。

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】

MHAM日本債券インデックスマザーファンド受益証券、MHAM外国債券インデックスマザーファンド受益証券、MHAM TOPIXマザーファンド受益証券およびMHAM外国株式インデックスマザーファンド受益証券（以下、各々を「主要投資対象マザーファンド受益証券」といいます。）への投資を通じて、国内外の公社債および株式に投資を行い、安定した収益の確保と信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

<ファンドの特色>

国内外の公社債・株式へ分散投資を行い、安定した収益の獲得を目指します。

国内債券、外国債券、国内株式および外国株式を主要投資対象とし、各資産のリスク（価格変動性）や、投資環境分析を勘案して配分比率を決定します。

資産配分比率は、リスク均等配分を基本としつつ、投資環境分析による各資産の魅力判定に応じた機動的な変更を行うことで、安定した収益の獲得を目指します。

* ファンドの特色における「リスク」とは、各資産の価格変動やファンドの基準価額の振れ幅の大きさのことをいいます。

各資産およびファンド全体のリスクの状況を管理し、配分比率を調整することにより、基準価額の変動を抑制することを目指します。

各資産のリスク水準の変化に応じて、各資産への配分比率の変更を行います。また、ファンド全体での価格変動リスクが高いと判断した場合には、MHAM国内短期債券マザーファンド受益証券（以下、各主要投資対象マザーファンド受益証券を含め「マザーファンド受益証券」といいます。）への投資を通じて国内短期債券に投資することや、短期金融商品に直接投資することがあります。

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。

5,000億円を上限に信託金を追加することができます。なお、信託金の上限額については、受託会社と合意のうえ、変更することができます。

一般社団法人投資信託協会が定める分類方法において、以下のように分類・区分されます。

<商品分類>

・商品分類表

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 （収益の源泉となる資産）
---------	--------	------------------------

単位型	国内	株式
	海外	債券
追加型	内外	不動産投信
		その他資産 ()
		資産複合

(注) 当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	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う。
内外	目論見書又は投資信託約款において、国内及び海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。
資産複合	目論見書又は投資信託約款において、「株式」、「債券」、「不動産投信」及び「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う。

< 属性区分 >

・属性区分表

投資対象資産 (実際の組入資産)	決算頻度	投資対象地域	投資形態
株式 一般 大型株 中小型株	年1回	グローバル (日本を含む)	ファミリーファンド ²
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ()	年2回	日本 北米 欧州	ファンド・オブ・ファンズ
不動産投信	年4回	アジア オセアニア	為替ヘッジ ²
その他資産 (投資信託証券) ¹	年6回 (隔月)	中南米 アフリカ 中近東 (中東) エマージング	
資産複合 ()	年12回 (毎月)		あり ()
資産配分固定型 資産配分変更型	日々		なし
	その他 ()		

1 当ファンドが投資信託証券への投資を通じて実質的な投資対象とする資産は、「資産複合（株式・債券）/資産配分変更型」です。

2 「為替ヘッジ」は、対円での為替変動リスクに対するヘッジの有無を記載しております。

(注) 当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)	目論見書又は投資信託約款において、主として「株式」、「債券」及び「不動産投信」以外の資産に投資する旨の記載があるものをいい、括弧内の記載はその該当資産を表す。
資産複合 (株式・債券) 資産配分変更型	目論見書又は投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行う旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないものをいう。なお、括弧内の記載はその該当複数資産を表す。 当ファンドは、主としてマザーファンド受益証券（投資信託証券）への投資を通じて、株式および債券に投資を行います。
年1回	目論見書又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う。
グローバル (日本を含む)	目論見書又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う。
ファミリーファンド	目論見書又は投資信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。）を投資対象として投資するものをいう。
為替ヘッジなし	目論見書又は投資信託約款において、為替のヘッジを行わない旨の記載があるもの又は為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいう。

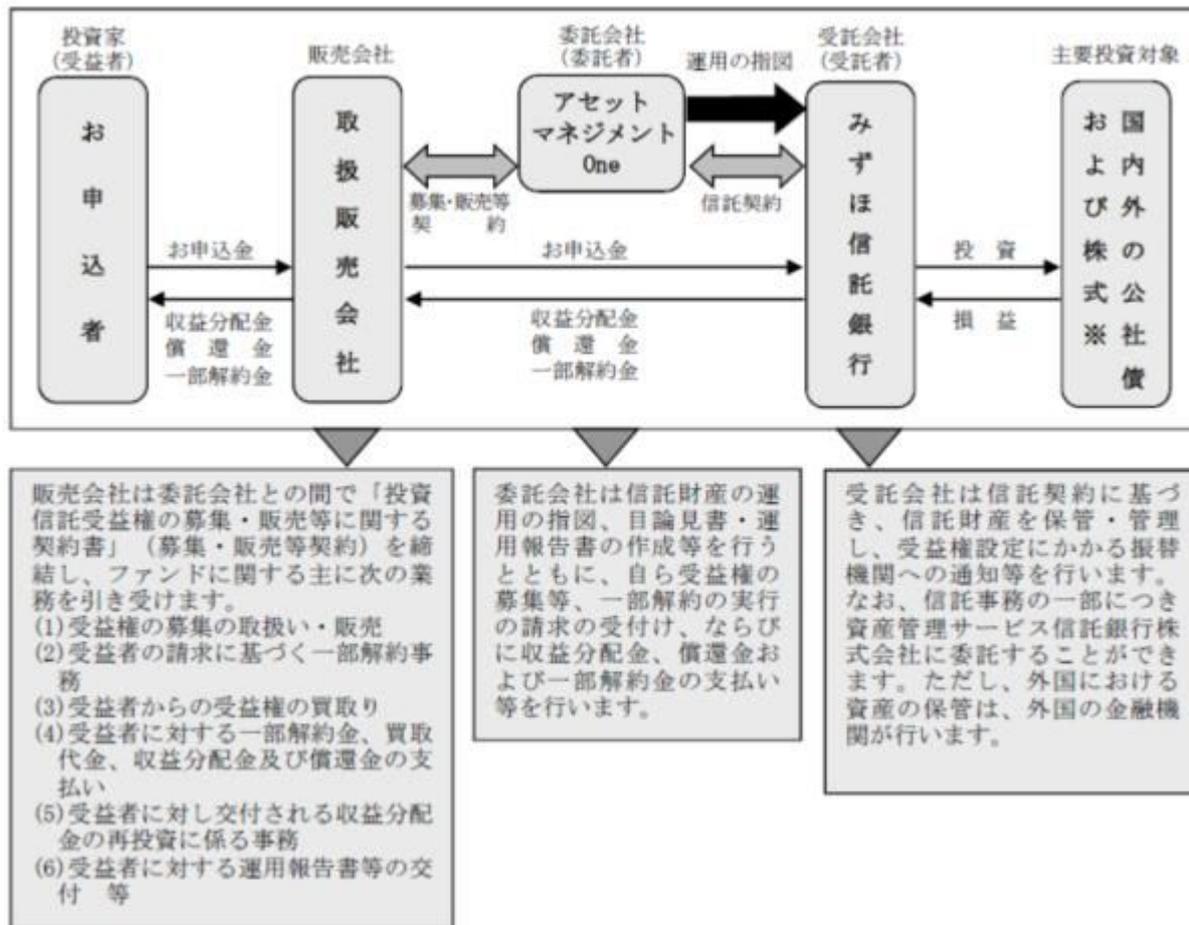
- (注1) 商品分類および属性区分は、委託会社が目論見書または約款の記載内容等に基づいて分類しています。
- (注2) 当ファンドが該当しない商品分類および属性区分の定義につきましては、一般社団法人投資信託協会のホームページ (<https://www.toushin.or.jp/>) でご覧いただけます。
- (注3) 当ファンドはマザーファンド受益証券（投資信託証券）への投資を通じて、株式および債券を主要投資対象とします。したがって、「商品分類」における投資対象資産と、「属性区分」における投資対象資産の分類・区分は異なります。

(2) 【ファンドの沿革】

2015年4月20日	信託契約締結、当ファンドの設定・運用開始
2016年10月1日	ファンドの委託会社としての業務をみずほ投信投資顧問株式会社からアセットマネジメントOne株式会社に承継

(3) 【ファンドの仕組み】

当ファンドの運営の仕組み

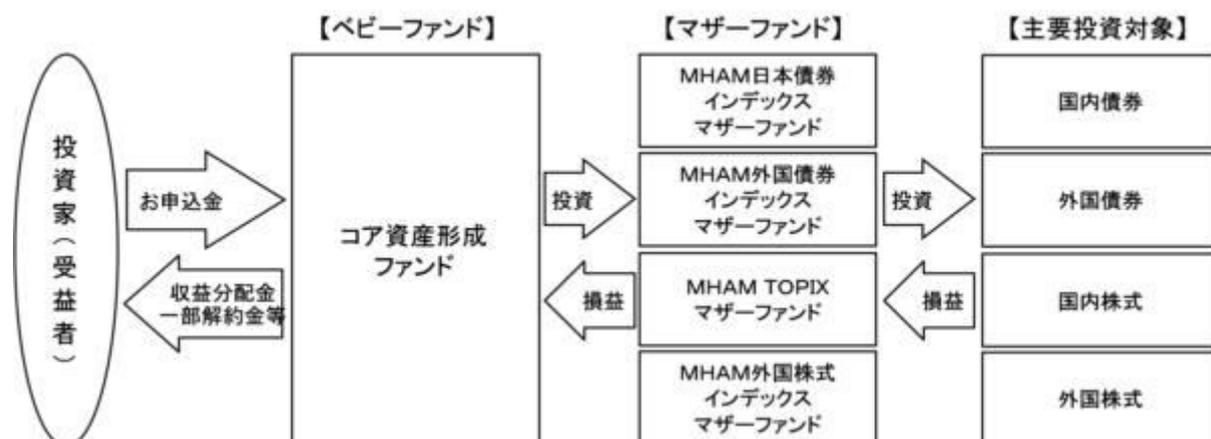


主要投資対象である国内外の公社債および株式には、主として、各マザーファンドを通じて投資を行います。

ファミリーファンド方式の仕組み

当ファンドは、下図のマザーファンドを通じて各資産への投資を行う「ファミリーファンド方式」で運用を行います。

ファミリーファンド方式



ファミリーファンド方式とは、投資家の皆様からお預かりした資金をまとめてベビーファンドとし、その資金をマザーファンドに投資することにより、その実質的な運用をマザーファンドにて行う仕組みです。

資産配分の決定の際、一部のマザーファンド受益証券への投資を行わない場合があります。また、ファンド全体のリスクの状況によっては、上記のマザーファンドを通じた投資のほか、MHAM国内短期債券マザーファンドを通じて国内短期債券に投資する場合や、信託財産の純資産総額の50%を上限に短期金融商品等へ直接投資する

場合があります。

マザーファンドのほかに、株式、公社債等に直接投資する場合があります。

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11月30日現在）

委託会社の沿革

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

大株主の状況

(2018年11月30日現在)

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

1：A種種類株式（15,510株）を含みます。

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

基本方針

この投資信託は、安定した収益の確保と信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

運用方法

1．主要投資対象

MHAM日本債券インデックスマザーファンド受益証券、MHAM外国債券インデックスマザー

ファンド受益証券、MHAM TOPIXマザーファンド受益証券およびMHAM外国株式インデックスマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。

2. 投資態度

- a. 主として、各主要投資対象マザーファンド受益証券への投資を通じて、国内外の公社債および株式に投資を行います。
- b. 各主要投資対象マザーファンド受益証券への投資割合については、各マザーファンドが主要投資対象とする資産のリスク(価格変動性)や、投資環境分析等を勘案のうえ配分比率を決定します。ただし、ファンドの価格変動リスクを勘案し、MHAM国内短期債券マザーファンド受益証券への投資を行う場合、および信託財産の純資産総額の50%を上限に預金等の短期金融商品への直接投資を行う場合があります。
- c. 実質組入 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。
「実質組入」とは、投資対象である当該資産につき、当ファンドの信託財産に属する当該資産の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該資産のうち当ファンドの信託財産に属するとみなした額との合計額をいいます。(以下同じ。)
- d. マザーファンド受益証券の組入比率は、高位を維持することを基本とします。
- e. 市況動向やファンドの資金事情等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

ファンドの投資プロセス

1. 当ファンドの投資プロセス

当ファンドは、以下の投資プロセスにより、各資産への投資割合を決定し、当ファンドを管理します。

各資産への配分比率は、特定の資産へのリスク集中回避を意図した「リスク均等配分」をベースに、投資環境分析やリスクの状況を踏まえて機動的に変更します。

STEP1

各資産のリスクを計測

⇒リスク均等配分となる
ベース配分比率を決定**STEP2**

投資環境分析を実施

⇒ベース配分比率から
機動的に配分比率を変更**STEP3**

リスクの管理

⇒リスクの状況により、
各資産の配分比率を変更**STEP4**

ポートフォリオの構築

STEP1 各資産のリスクを計測

「国内債券」、「外国債券」、「国内株式」および「外国株式」の各資産について、リスクを計測し、ポートフォリオに対するリスク寄与度が均等（リスク均等配分）となるよう、ベース配分比率を決定します。

☞ 下記「☞ リスク均等配分とは」をご参照ください。

STEP2 投資環境分析を実施

マクロ経済の各種指標から世界景気の状態（景気サイクル）を判定する「経済環境分析」と、金融市場の各種指標から金融市場の状態を判定する「市場環境分析」により、投資環境を分析します。この結果をもとに各資産の魅力度を判定し、魅力度に応じて各資産への配分比率をベース配分比率から機動的に変更します。

STEP3 リスクの管理

各資産およびファンド全体のリスクの状況を管理します。資産別のリスク水準の変化に応じて、配分比率の変更を行います。また、ファンド全体での価格変動リスクが高いと判断した場合には、各資産への配分比率を引き下げます[※]。

STEP4 ポートフォリオの構築

STEP1～3で決定した配分比率に従って、各資産への投資を行います。

※**STEP3**において各資産への配分比率の引き下げを行った場合、国内短期債券や短期金融商品への投資を行います。

上記のプロセスは、今後変更される場合があります。

☞ リスク均等配分とは

「リスク均等配分」とは、各資産のリスク（価格変動性）の大きさに着目した分散投資の方法で、リスクが相対的に高い資産の配分比率を低くし、リスクが相対的に低い資産の配分比率を高くすることにより、ファンドに対する各資産のリスク寄与度を均等にすることを旨とする投資手法です。これにより、リスクが高い資産の値動きがファンド全体の値動きに与える影響を抑える効果が期待されます。

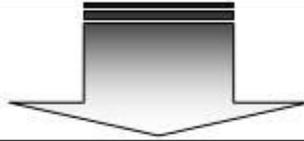
**2. 各マザーファンドの投資プロセス**

<MHAM日本債券インデックスマザーファンドの投資プロセス>

ステップ1

リスクモニタリング（頻度：月次）

- ・債券ポートフォリオモデル[※]等を活用して、パフォーマンス分析やポートフォリオの属性分析、リスク分析などを実施し、リバランスの必要性を判断。



ステップ2

ポートフォリオの構築（頻度：適宜）

- ・債券ポートフォリオモデル[※]等を活用して、銘柄の選択を実施し、NOMURA-BPI総合と連動性の高いポートフォリオを構築。
- ・構築されたポートフォリオに対しステップ1と同様のリスクチェックを行い、必要に応じてポートフォリオを再構築。



ステップ3

売買執行（頻度：適宜）

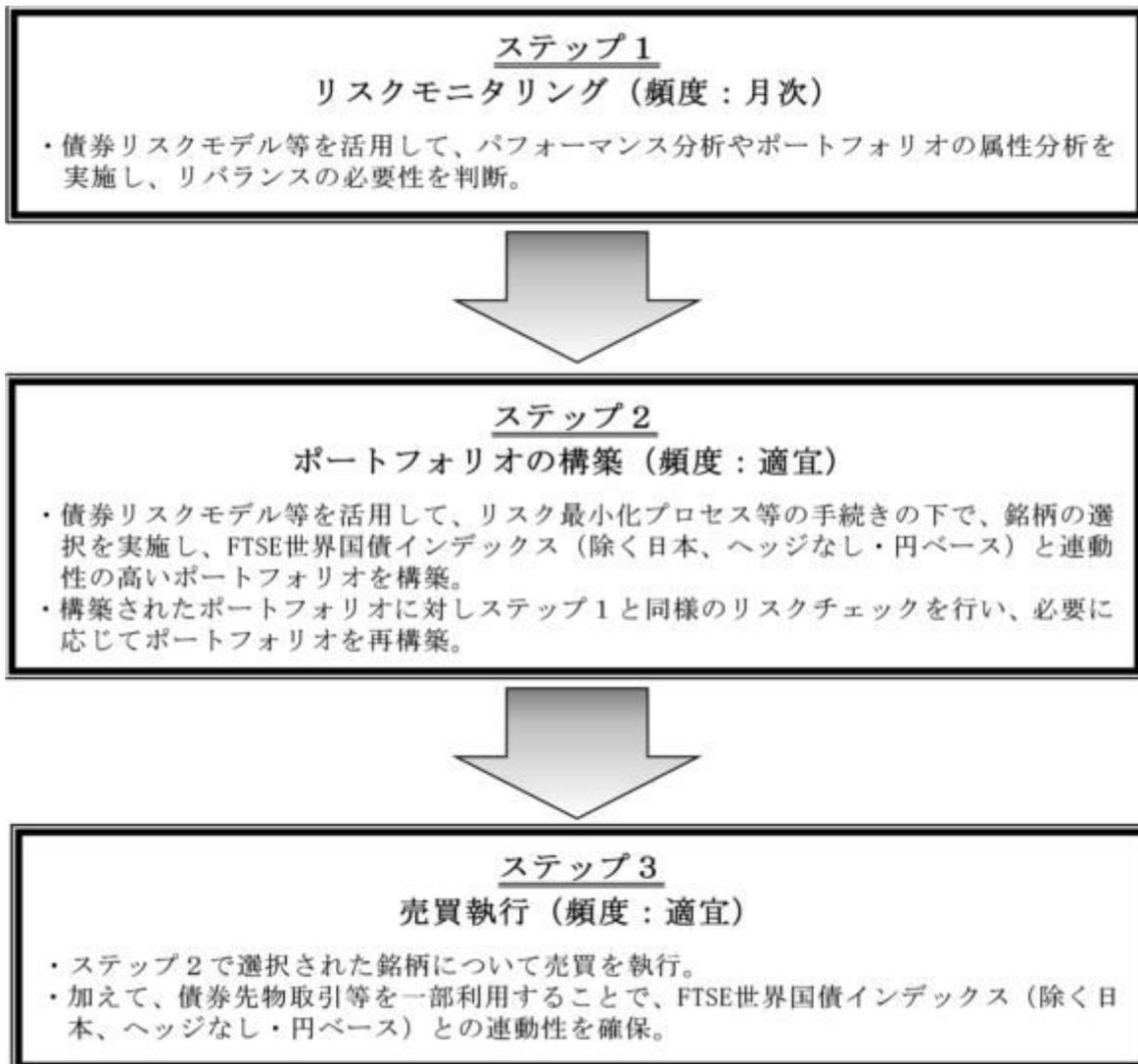
- ・ステップ2で選択された銘柄について売買を執行。
- ・加えて、債券先物取引等を一部利用することで、NOMURA-BPI総合との連動性を確保。

市況動向、設定・解約状況によっては弾力的に対処することがあります。また、モデルおよび使用するファクターについては、市場や経済の構造変化等に対応して、適宜見直しをすることがあります。

< 債券ポートフォリオモデルとは... >

デュレーション、残存期間構成、コンベクシティ等の属性をコントロールしながら、対象指数に連動する銘柄群を効率的に選びだします。

< MHAM外国債券インデックスマザーファンドの投資プロセス >

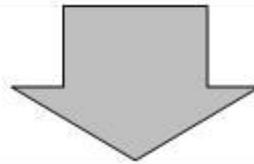


市況動向、設定・解約状況によっては弾力的に対処することがあります。また、使用するモデル等については、市場や経済の構造変化等に対応して、適宜見直しをすることがあります。

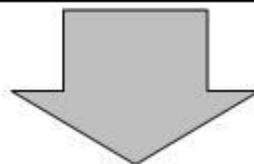
<MHAM TOPIXマザーファンドの投資プロセス>

ステップ 1**リスクモニタリング（頻度：月次）**

- ・日本株式マルチファクターモデル*等を活用して、パフォーマンス分析やポートフォリオの属性分析を実施し、リバランスの必要性を判断。
- ・計量モデル等を活用して、個別銘柄の信用リスクを評価。委託会社のアナリストの意見も参考に保有・売却について判断。

**ステップ 2****ポートフォリオの構築（頻度：適宜）**

- ・日本株式マルチファクターモデルを活用して、リスク最小化プロセス等の手続きの下で銘柄の選択を実施し、東証株価指数（TOPIX）と連動性の高いポートフォリオを構築。
- ・構築されたポートフォリオに対しステップ1と同様のリスクチェックを行い、必要に応じてポートフォリオを再構築。

**ステップ 3****売買執行（頻度：適宜）**

- ・ステップ2で選択された銘柄について売買を執行。
- ・加えて、株価指数先物取引等を一部利用することで、株式と株価指数先物取引等の合計の実質組入比率を高位に維持し、TOPIXとの連動性を確保。

市況動向、設定・解約状況によっては弾力的に対処することがあります。また、使用するモデル等については、市場や経済の構造変化等に対応して、適宜見直しをすることがあります。

< 日本株式マルチファクターモデルとは... >

1988年に構築以来随時改良を加えている、アセットマネジメントOneが独自に開発した複数のリスクファクターによって株式のリターンを分解・説明するモデルです。これにより、TOPIX（東証株価指数）に連動する銘柄群を効率的に選び、定期的に銘柄群の見直しをすることによりTOPIXに対する連動性を高めます。

< MHAM外国株式インデックスマザーファンドの投資プロセス >

ステップ1

リスクモニタリング（頻度：月次）

- ・ BARRAモデル[®]等を活用して、パフォーマンス分析やポートフォリオの属性分析を実施し、リバランスの必要性を判断。



ステップ2

ポートフォリオの構築（頻度：適宜）

- ・ BARRAモデル等を活用して、リスク最小化プロセス等の手続きの下で銘柄の選択を実施し、MSCIコクサイ・インデックス（円ベース・為替ヘッジなし）と連動性の高いポートフォリオを構築。
- ・ 構築されたポートフォリオに対しステップ1と同様のリスクチェックを行い、必要に応じてポートフォリオを再構築。



ステップ3

売買執行（頻度：適宜）

- ・ ステップ2で選択された銘柄について売買を執行。
- ・ 加えて、株価指数先物取引等の一部利用することで、MSCIコクサイ・インデックス（円ベース・為替ヘッジなし）との連動性を確保。

市況動向、設定・解約状況によっては弾力的に対処することがあります。また、使用するモデル等については、市場や経済の構造変化等に対応して、適宜見直しをすることがあります。

< BARRAモデルとは... >

米国バーラ社（現MSCI Inc.）が開発した、株価・債券価格の変動要因を説明する統計的モデルにより、ポートフォリオのリスク管理やパフォーマンス分析を行う投資分析ツールです。

< MHAM国内短期債券マザーファンドの投資プロセス >

ステップ1

ポートフォリオモニタリング（頻度：日次）

有価証券比率や組入債券の残存期間等を確認し、売買の必要性を判断。

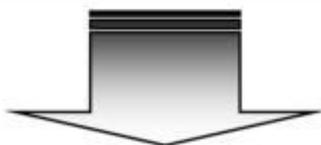


ステップ2

ポートフォリオ構築（頻度：適宜）

残存期間が1年以下の国債等の組入が高位となるように銘柄選択を実施。

なお、投資する個別債券の格付については、S&P グローバル・レーティング（S&P 社）、ムーディーズ・インベスターズ・サービス・インク（Moody's 社）、格付投資情報センター（R&I）、日本格付研究所（JCR）のいずれかの長期信用格付が「AA マイナス」格以上のものとする。



ステップ3

売買執行（頻度：適宜）

ステップ2で選択された銘柄について売買を執行。

市況動向、設定・解約状況によっては弾力的に対処することがあります。

（2）【投資対象】

投資の対象とする資産の種類

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項で定めるものをいいます。以下同じ。）
 - a．有価証券
 - b．デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第25条、第26条および第27条に定めるものに限りません。）
 - c．金銭債権
 - d．約束手形（a.に掲げるものに該当するものを除きます。）
- 2．次に掲げる特定資産以外の資産
 - a．為替手形

有価証券の指図範囲

委託会社は、信託金を、主として下記1.から下記5.までのアセットマネジメントOne株式会社を委託会社とし、みずほ信託銀行株式会社を受託会社として締結された親投資信託の受益証券を含む下記6.から下記27.までの有価証券（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. MHAM日本債券インデックスマザーファンド受益証券
2. MHAM外国債券インデックスマザーファンド受益証券
3. MHAM TOPIXマザーファンド受益証券
4. MHAM外国株式インデックスマザーファンド受益証券
5. MHAM国内短期債券マザーファンド受益証券
6. 株券または新株引受権証書
7. 国債証券
8. 地方債証券
9. 特別の法律により法人が発行する債券
10. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。なお、社債券のうちで、新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているものならびに会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を総称して以下「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）
11. 資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
12. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
13. 協同組織金融機関の優先出資に関する法律に規定する優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
14. 資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
15. コマーシャル・ペーパー
16. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
17. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前記1.から前記16.の証券または証書の性質を有するもの（外国の者の発行する証券または証書で、前記6.から前記11.の証券または証書の性質を有するプリファードセキュリティーズ（ハイブリッド型のプリファードセキュリティーズを含みます。）およびこれらに類するものを含みます。）
18. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
19. 投資証券、投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいい、プリファードセキュリティーズ（投資証券および投資法人債券のハイブリッド型のものを含みます。）に該当するものを含みます。）
20. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
21. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、

有価証券に係るものに限ります。）

22. 預託証券（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
23. 外国法人が発行する譲渡性預金証券
24. 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。）
25. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
26. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
27. 外国の者に対する権利で前記26.の有価証券の性質を有するもの

なお、前記6.の証券または証書、前記17.および前記22.の証券または証書のうち前記6.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、前記7.から前記11.までの証券および前記17.ならびに前記22.の証券または証書のうち前記7.から前記11.までの証券の性質を有するものならびに前記19.の証券のうち投資法人債券および外国投資証券で投資法人債券に類する証券を以下「公社債」といい、前記18.の証券および前記19.の証券（投資法人債券および外国投資証券で投資法人債券に類する証券を除きます。）を以下「投資信託証券」といいます。

金融商品の指図範囲

委託会社は、信託金を、 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。また、 の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときには、委託会社は、信託金を、下記1.から下記4.までに掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

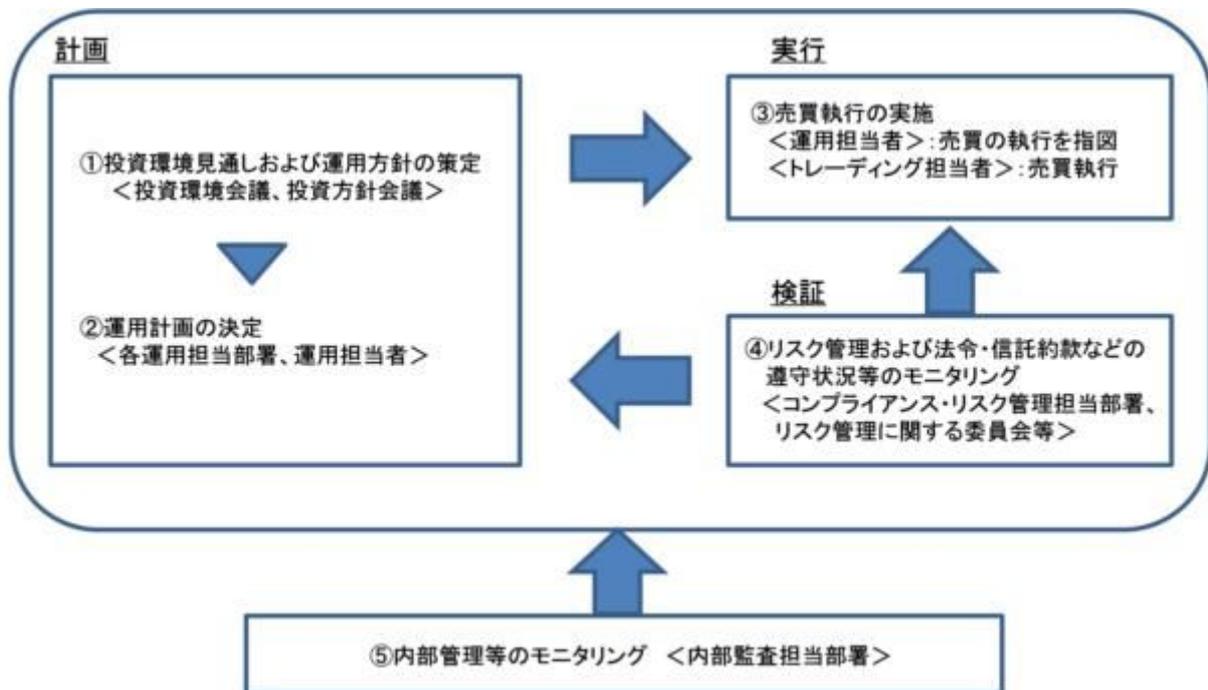
1. 預金
2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
6. 外国の者に対する権利で前記5.の権利の性質を有するもの
7. 金銭債権（ただし、流動性のあるプリファードセキュリティーズに該当するもの限り、前記1.から前記6.で該当するものならびに「 有価証券の指図範囲」の17.および19.に定める証券または証書を除きます。）
8. 投資事業有限責任組合契約または有限責任事業組合契約に基づく権利その他の権利（金融商品取引法第2条第2項第5号に定めるものをいいます。）
9. 外国の法律に基づく権利であって前記8.に掲げる権利に類するもの（リミテッド・パートナーシップ（LP）（マスター・リミテッド・パートナーシップ（MLP）に該当するものを含みます。）を含みます。）
10. 合名会社もしくは合資会社の社員権または合同会社の社員権（金融商品取引法第2条第2項第3号で定めるものをいいます。）
11. 外国法人の社員権で前記10.に掲げる権利の性質を有するもの（リミテッド・ライアビリティ・カンパニー（LLC）（マスター・リミテッド・パートナーシップ（MLP）に該当するものを含みます。）を含みます。）

なお、前記5.、前記6.および前記8.から前記11.までの権利等を以下「みなし有価証券」とい

います。

(3) 【運用体制】

a. ファンドの運用体制



投資環境見通しおよび運用方針の策定

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

運用計画の決定

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

売買執行の実施

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

モニタリング

運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署（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。

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

内部管理等のモニタリング

内部監査担当部署（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

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11月30日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

上記体制は、マザーファンドを通じた実質的な運用体制を記載しております。

(4) 【分配方針】

収益分配方針

毎計算期末(原則として5月8日。ただし、休業日の場合は翌日以降の最初の営業日)に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。

1. 分配対象額の範囲は、経費控除後の配当等収益(繰越分および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。))を含みます。)および売買益(評価益を含み、みなし配当等収益を控除して得た額)等の全額とします。
2. 分配金額は、委託会社が基準価額の水準や市況動向等を勘案して決定します。ただし、必ず分配を行うものではありません。
3. 収益分配に充てなかった利益については、運用の基本方針に基づいて運用を行います。

将来の収益分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

収益分配金の支払い

1. 収益分配金は、原則として毎計算期間終了日から起算して5営業日までに販売会社において支払いが開始されます。
2. 収益分配金の再投資に関する契約に基づいて収益分配金を再投資すること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。

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、当該収益分配金に係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。)に対し、お支払いします。

(5) 【投資制限】

a. 約款で定める投資制限

株式、新株引受権証券および新株予約権証券(約款 運用の基本方針 運用方法(3) 投資制限、約款第17条および約款第20条)

1. 株式への実質投資割合 には制限を設けません。

「実質投資割合」とは、投資対象である当該資産につき、当ファンドの信託財産に属する当該資産の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該資産のうち当ファンドの信託財産に属するとみなした額との合計額の当ファンドの信託財産の純資産総額に対する割合をいいます。(以下同じ。)

2. 委託会社は、新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合が、信託財産の純資産総額の100分の20を超えることとなる投資の指図をしません。

3. 同一銘柄の株式への実質投資割合には制限を設けません。

4. 同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合には制限を設けません。

5. 委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、取引所(金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号口に規定する外国金融商品市場をいいます。以下同じ。)に上場されている株式の発行会社の発行するものおよび取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。なお、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、委託会社が投資することを指図することができるものとします。

みなし有価証券(約款第17条)

委託会社は、みなし有価証券への実質投資割合が、信託財産の純資産総額の100分の50以上となる投資の指図をしません。

投資信託証券(約款第17条)

委託会社は、投資信託証券(マザーファンド受益証券および取引所金融商品市場(金融商品取引法第2条第17項に規定する金融商品市場をいいます。)または外国金融商品市場に上場等(不動産投資信託証券については、予定を含みます。以下同じ。)され、かつこれらの市場において常時売却可能(市場の急変等により一時的に流動性が低下している場合を除きます。)な投資信託証券(以下「上場投資信託証券」といいます。)を除きます。)への実質投資割合が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

転換社債等(約款第21条)

委託会社は、同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合が、信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

外貨建資産(約款 運用の基本方針 運用方法(3)投資制限および約款第31条)

外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。ただし、外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

外国為替予約(約款第32条)

委託会社は、信託財産に属する外貨建資産とマザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。)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。

信用リスク集中回避のための投資制限（約款第22条）

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100分の10、合計で100分の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、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

デリバティブ取引等(約款 運用の基本方針 運用方法(3)投資制限、約款第23条)

委託会社は、デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引、選択権付債券売買および商品投資等取引（投資信託及び投資法人に関する法律施行令第3条第10号に規定するものをいいます。）を含みます。（ただし、この信託において取引可能なものに限ります。以下同じ。）。）について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

信用取引（約款第24条）

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

有価証券先物取引等（約款第25条）

1. 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします（以下同じ。）。
2. 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに為替変動リスクを回避するため、わが国の取引所における通貨に係る先物取引ならびに外国の取引所における通貨に係る先物取引およびオプション取引を行うことの指図をすることができます。
3. 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における金利に係る先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所

におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

スワップ取引（約款第26条）

- 1．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。
- 2．スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として当ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 3．スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- 4．委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供または受入れが必要と認めるときは、担保の提供または担保の受入れの指図を行うものとします。

金利先渡取引および為替先渡取引（約款第27条）

- 1．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。
- 2．金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として当ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 3．金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- 4．委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供または受入れが必要と認めるときは、担保の提供または担保の受入れの指図を行うものとします。

有価証券の貸付（約款第28条）

- 1．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を以下の範囲内で貸付の指図をすることができます。
 - a．株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
 - b．公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
- 2．前記1．に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかにその超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- 3．委託会社は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

公社債の空売り（約款第29条）

- 1．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、公社債（信託財産により借入れた公社債を含みます。）の引き渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

- 2．前記1．の売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 3．信託財産の一部解約等の事由により、前記2．の売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかにその超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。

公社債の借入れ（約款第30条）

- 1．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図を行うものとします。
- 2．前記1．の指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 3．信託財産の一部解約等の事由により、前記2．の借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。
- 4．前記1．の借入れにかかる品借料は信託財産中から支弁します。

資金の借入れ（約款第38条）

- 1．委託会社は、信託財産の効率的な運用および運用の安定性に資するため、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、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金等および償還金の合計額を限度とします。ただし、資金借入額は、借入指図を行う日における信託財産の純資産総額の10%を上回らない範囲内とします。
- 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。

b．法令で定める投資制限

同一の法人の発行する株式の取得割合（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を、運用の指図を行うすべ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の総数が、当該株式にかかる議決権の総数に100分の50の率を乗じて得た数を超えることとなる場合においては、信託財産をもって取得することを委託会社に指図しないものとします。

<各マザーファンドの投資方針および主な投資制限>

「MHAM日本債券インデックスマザーファンド」

1. 基本方針

この投資信託は、NOMURA-BPI総合の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

NOMURA-BPI総合とは、野村證券株式会社が、国内で発行された公募利付債券の流通市場全体の動向を的確に表すために開発した経過利子込時価総額加重型の投資収益指数です。NOMURA-BPI総合は、銘柄種類別・残存年数別に分類した各セクターポートフォリオに対して、それぞれの投資収益指数が用意され、一定の組入基準にもとづいて構成されたインデックス・ポートフォリオのパフォーマンスをもとに計算され、機関投資家に広く認知されています。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。

2. 運用方法

(1) 投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

主として、わが国の公社債に投資を行い、NOMURA-BPI総合の動きに連動する投資成果を目指します。

公社債の組入比率は、高位を維持することを基本とします。

運用の効率化をはかるため、債券先物取引等を活用することがあります。このため、公社債の組入時価総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が信託財産の純資産総額を超えることがあります。

市況動向やファンドの資金事情等によっては、上記のような運用が行えない場合があります。

(3) 投資制限

株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限り、）の行使、株主割当または社債権者割当により取得したものに限り行えるものとし、その投資割合は信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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5%以下とします。

同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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。

外貨建資産への投資は行いません。

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、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

「MHAM外国債券インデックスマザーファンド」

1. 基本方針

この投資信託は、FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）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。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いません。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。

2. 運用方法

(1) 投資対象

FTSE世界国債インデックス（除く日本）に採用されている国・地域の公社債を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

主として、FTSE世界国債インデックス（除く日本）に採用されている国・地域の公社債に投資を行い、FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の動きに連動する投資成果を目指します。

公社債の組入比率は、高位を維持することを基本とします。

運用の効率化をはかるため、債券先物取引等を活用することがあります。このため、公社債の組入時価総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が信託財産の純資産総額を超えることがあります。

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。

市況動向やファンドの資金事情等によっては、上記のような運用が行えない場合があります。

(3) 投資制限

株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限り、）の行使、株主割当または社債権者割当により取得したものに限り行えるものとし、その投資割合は信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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5%以下とします。

同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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。

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

外国為替の売買の予約取引は、約款第30条の範囲で行います。

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、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

「MHAM TOPIXマザーファンド」

1. 基本方針

この投資信託は、わが国の株式を中心に投資を行い、東証株価指数（TOPIX）と連動する投資成果を目標として運用を行います。

東証株価指数(TOPIX=Tokyo Stock Price Index)とは、東京証券取引所第一部全銘柄を対象とした株価指数で、基準時（1968年1月4日終値）の時価総額を100として、その後の時価総額を指数化したものです。

*1 TOPIXの指数値およびTOPIXの商標は、株式会社東京証券取引所（以下「株東京証券取引所」といいます。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利・ノウハウおよびTOPIXの商標に関するすべての権利は株東京証券取引所が有しています。

*2 株東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出もしくは公表の方法の変更、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 株東京証券取引所は、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 株東京証券取引所は、TOPIXの指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、株東京証券取引所は、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 MHAM TOPIXマザーファンドおよびMHAM TOPIXマザーファンドに投資するファンドは、(株)東京証券取引所により提供、保証または販売されるものではありません。
- *6 (株)東京証券取引所は、MHAM TOPIXマザーファンドおよびMHAM TOPIX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、MHAM TOPIXマザーファンドおよびMHAM TOPIX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 (株)東京証券取引所は、委託会社またはMHAM TOPIXマザーファンドおよびMHAM TOPIX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、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、(株)東京証券取引所はMHAM TOPIXマザーファンドおよびMHAM TOPIX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。

2. 運用方法

(1) 投資対象

東京証券取引所第一部に上場されている株式を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

現物株への投資よりTOPIX先物等を活用する方が有利と認められるときは、TOPIX先物等を活用することがあります。

株価指数等の先物取引を含む株式の実質組入比率は、原則信託財産の純資産総額の範囲内となるよう運用を行います。ただし、一時的に株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が信託財産の純資産総額を超えることがあります。

組入対象銘柄は、東京証券取引所第一部上場株式とします。ただし、流動性に著しく欠ける銘柄や信用リスクが高いと判断される銘柄等は組入れません。

上記 から について、市況動向、設定・解約状況によっては弾力的に対処することがあります。

(3) 投資制限

株式の組入比率には、制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行いません。

新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。

同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

有価証券先物取引等は約款第15条の範囲で行います。

スワップ取引は約款第16条の範囲で行います。

金利先渡取引は約款第17条の範囲で行います。

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、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

「MHAM外国株式インデックスマザーファンド」

1. 基本方針

この投資信託は、MSCIコクサイ・インデックス（円ベース・為替ヘッジなし）^{1, 2}の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

1 MSCIコクサイ・インデックス（円ベース・為替ヘッジなし）とは、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。

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。

2 税引き前配当再投資ベースとします(以下同じ。)

2. 運用方法

(1) 投資対象

MSCIコクサイ・インデックスを構成している国(地域を含みます。)の株式を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

主として、MSCIコクサイ・インデックスを構成している国(地域を含みます。)の株式に投資を行い、MSCIコクサイ・インデックス(円ベース・為替ヘッジなし)の動きに連動する投資成果を目指します。

株式の組入比率は、高位を維持することを基本とします。

運用の効率化をはかるため、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の組入時価総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が信託財産の純資産総額を超えることがあります。

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。

市況動向やファンドの資金事情等によっては、上記のような運用が行えない場合があります。

(3) 投資制限

株式への投資割合には、制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以下とします。

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。(ただし、MSCIコクサイ・インデックスを構成している株式を除きます。)

同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権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。

同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

投資信託証券(上場投資信託証券を除きます。)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。

外国為替の売買の予約取引は、約款第29条の範囲で行います。

みなし有価証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の50%未満とします。

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、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

「MHAM国内短期債券マザーファンド」

1. 基本方針

この投資信託は、主としてわが国の短期の国債、地方債、政府保証債、金融債等(以下「国債等」といいます。)に投資を行い、安定した収益の確保と信託財産の着実な成長を目指して運用を行います。

2. 運用方法

(1) 投資対象

この投資信託は、わが国の短期の国債等を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

わが国の短期の国債等を主要投資対象とし、安定した収益の確保と信託財産の着実な成長を目指します。

投資する個別債券の格付については、S&Pグローバル・レーティング(S&P社)、ムーディーズ・インベスターズ・サービス・インク(Moody's社)、格付投資情報センター(R&I)、日本格付研究所(JCR)のいずれかの長期信用格付が「AAマイナス」格以上のものとします。

投資する個別債券の残存期間については、原則として1年以下とします。

市場動向および資金動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、通貨に係る先物オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。

(3) 投資制限

株式(新株引受権証券を含みます。)への投資は行いません。

同一発行体が発行する有価証券への投資割合は、国債、地方債、特別の法律により法人の発行する債券を除き、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

同一銘柄の転換社債等への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

外貨建資産への投資は行いません。

有価証券先物取引等は、約款第19条の範囲で行います。

スワップ取引は、約款第20条の範囲で行います。

金利先渡取引は、約款第21条の範囲で行います。

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、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

3【投資リスク】

(1) 当ファンドにおける主として想定されるリスクと収益性に与える影響度合い

- ・当ファンドは、主として各マザーファンド受益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。したがって、元本や一定の投資成果が保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被ることがあります。
- ・運用により信託財産に生じた利益および損失は、すべて受益者の皆様に帰属します。
- ・投資信託は預金商品や保険商品ではなく、預金保険、保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。
- ・登録金融機関およびアセットマネジメントOne株式会社が取扱う投資信託は、投資者保護基金の対象ではありません。
- ・投資信託は預貯金とは異なります。
- ・当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。

当ファンドにおいて主として想定されるリスクは以下の通りですが、基準価額の変動要因はこれらに限定されるものではありません。

なお、以下のリスクは、主にマザーファンドを通じて当ファンドが行う有価証券等への投資により発生します。

資産配分リスク

資産配分リスクとは、複数資産への投資（資産配分）を行った場合に、投資成果の悪い資産への配分が大きかったため、投資全体の成果も悪くしてしまうリスクをいいます。

一般に、投資に際して資産配分を行う場合には、そのうちの1資産の価値変動が投資全体の成果に及ぼす影響度合いを小さくする効果が期待されますが、その場合にも、それぞれの資産の価値変動は、当該資産への資産配分の比率に応じて、投資全体の成果に影響を及ぼします。当ファンドは、国内外の公社債および株式に資産配分を行いますが、配分比率が高い資産の価値が下落した場合や、複数の資産の価値が同時に下落した場合等には、当ファンドの基準価額が下落する可能性があります。

金利変動リスク

金利変動リスクとは、金利変動により公社債の価格が下落するリスクをいいます。

一般に金利が上昇した場合には、既に発行されて流通している公社債の価格は下落します。金利上昇

は、当ファンドが投資する公社債の価格に影響を及ぼし、当ファンドの基準価額を下落させる要因となります。また、金利変動により株式市場と公社債市場の間で資金シフトが起こる場合があります、その場合、金利変動の影響は株式市場にも及びます。

株価変動リスク

株価変動リスクとは、株式市場および投資先となっている企業の株価が下落するリスクをいいます。

当ファンドが投資する企業の株価が下落した場合には、当ファンドの基準価額が下落する要因となります。また、当ファンドが投資する企業が業績悪化や倒産等に陥った場合には、当該企業の株価が大きく下落することや無くなることもあり、当ファンドの基準価額に大きな影響を及ぼすことがあります。

為替変動リスク

為替変動リスクとは、為替変動により外貨建資産の円換算価格が下落するリスクをいいます。当ファンドでは、外貨建資産への投資にあたり、原則として為替ヘッジを行わないため、投資対象通貨と円との外国為替相場が円高となった場合には、当ファンドの基準価額が下落する要因となります。

信用リスク

信用リスクとは、公社債等の発行体が財政難、経営不振、その他の理由により、利息や償還金をあらかじめ決められた条件で支払うことができなくなる（債務不履行）リスクをいいます。

一般に債務不履行が生じた場合、またはその可能性が高まった場合には、当該発行体が発行する公社債および短期金融商品（コマーシャル・ペーパー等）の価格は下落します。また、当該発行体が企業の場合には、一般にその企業の株価が下落する要因となります。当ファンドが投資する公社債等の発行体や株式の発行企業がこうした状況に陥った場合には、当ファンドの基準価額が下落する要因となる可能性があります。

流動性リスク

流動性リスクとは、有価証券を売却（または購入）しようとする際に、需要（または供給）がないため、有価証券を希望する時期に、希望する価格で売却（または購入）することができなくなるリスクをいいます。

一般に規模が小さい市場での売買や、取引量の少ない有価証券の売買にあたっては、流動性リスクへの留意が特に必要とされます。また、一般に市場を取り巻く外部環境の急変があった場合には、市場実勢価格での売買ができなくなる可能性が高まります。当ファンドが投資する株式・公社債等の流動性が損なわれた場合には、当ファンドの基準価額が下落する要因となる可能性があります。

カントリーリスク

カントリーリスクとは、投資先となっている国（地域）の政治・経済・社会・国際関係等が不安定な状態、あるいは混乱した状態等に陥った場合に、当該国における資産価値や当該国通貨の価値が下落するリスクをいいます。

当ファンドの投資先となっている国（地域）がこうした状態に陥った場合には、当ファンドの基準価額が下落する要因となる可能性があります。

<その他>

- ・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。
- ・投資対象国において、税制、決済ルールの変更などにより税金や費用が新たに発生した場合や、外国為替取引規制や外国からの投資規制の実施などがあった場合は、当ファンドの基準価額に影響を与える場合があります。

- ・当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行います。当該方式は、運用の効率化に資するものですが、一方で、当ファンドが投資対象とするマザーファンドに対し、他のベビーファンドにより多額の追加設定・一部解約等がなされた場合には、マザーファンドにおける売買ならびに組入比率の変化等により、当ファンドの基準価額や運用が影響を受ける場合があります。
- ・当ファンドは、一部解約の実行の請求金額が多額な場合や取引所等における取引の停止等があるときには、一部解約の実行の請求の受け付けを中止すること、およびすでに受け付けた一部解約の実行の請求の受け付けを取り消すことがあります。

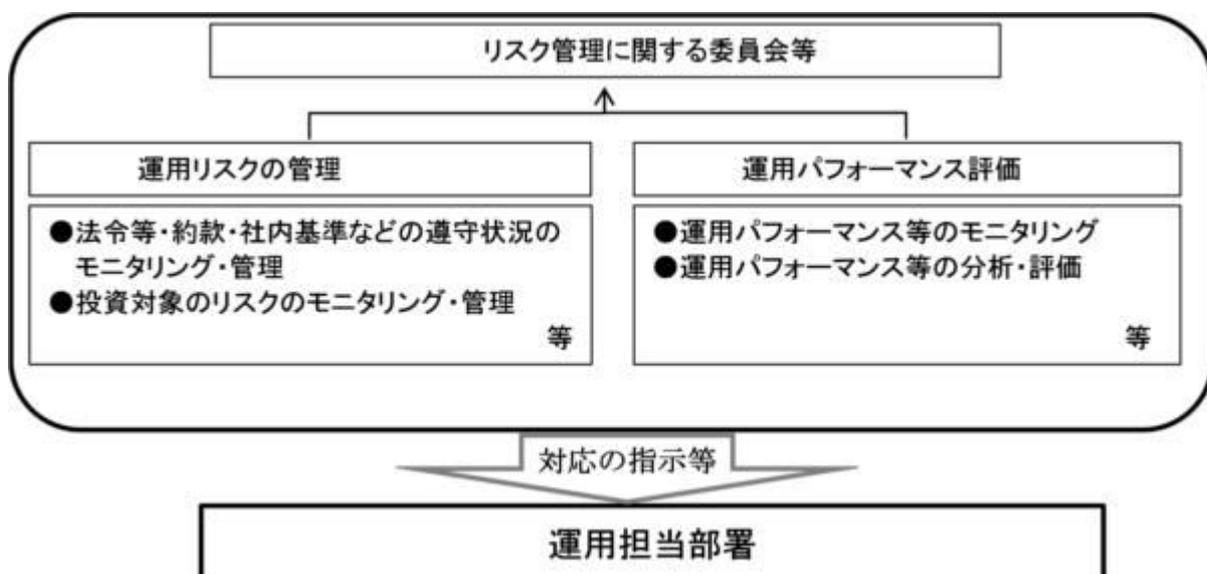
< 収益分配金に関する留意点 >

- ・投資信託の分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。
- ・分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、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。また、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。
- ・投資家（受益者）のファンドの取得価額によっては、分配金の一部または全部が、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。ファンド取得後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がり小さかった場合も同様です。

(2) 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11月30日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

<参考情報>

ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



- * 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。(以下同じ。)
- * 年間騰落率(各月末時点について1年前と比較したものは、分配金再投資基準価額をもとに計算していますので、基準価額をもとに計算した騰落率とは異なる場合があります。)
- * なお、当ファンドは2015年4月20日に設定しているため、年間騰落率については2016年4月以降の騰落率を表示しています。また、分配金再投資基準価額については2015年4月末より表示しています。

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



- * 上記は、当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、2013年12月～2018年11月の5年間に於ける年間騰落率(各月末時点について1年前と比較したものの)の平均・最大・最小を表示したものです。
- * 当ファンドの年間騰落率は、分配金再投資基準価額をもとに計算していますので、基準価額をもとに計算した騰落率とは異なる場合があります。なお、当ファンドは2015年4月20日に設定しているため、当ファンドの年間騰落率については2016年4月以降の平均・最大・最小を表示しています。
- * 代表的な資産クラスは比較対象として記載しているため、当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・ディバースファイド(円ベース)
- (注)海外の指数は為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

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

申込手数料(受益権1口当たり)は、取得申込日の翌営業日の基準価額に、2.16%(税抜2%)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。なお、申込手数料には消費税等相当額が課せられます。

申込手数料については、販売会社にお問い合わせください。

「分配金再投資コース」における収益分配金は、毎計算期末の翌営業日に原則として税金を差し引いた後、自動的に無手数料で再投資されます。

< 申込手数料を対価とする役務の内容 >

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

(2) 【換金（解約）手数料】

ありません。

(3) 【信託報酬等】

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年0.972%（税抜0.90%）の率を乗じて得た額とします。

信託報酬の配分（税抜）については、以下の通りとします。

委託会社	販売会社	受託会社
0.53%	0.33%	0.04%

信託報酬は、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日および毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁するものとします。なお、信託報酬にかかる消費税等相当額を信託報酬支弁の時に信託財産中から支弁します。

$$\text{信託報酬} = \text{運用期間中の基準価額} \times \text{信託報酬率}$$

< 信託報酬等を対価とする役務の内容 >

委託会社	信託財産の運用、目論見書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価
販売会社	購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価
受託会社	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

(4) 【その他の手数料等】

信託財産に関する租税、特定資産の価格等の調査に要する費用および当該費用に係る消費税等相当額、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産の財務諸表の監査に要する費用および当該費用に係る消費税等相当額、外国における資産の保管等に要する費用、信託財産に属する資産のデフォルト等の発生に伴う諸費用、受託会社の立替えた立替金の利息および資金の借入れを行った際の当該借入金の利息は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。なお、信託財産の財務諸表の監査に要する費用は、当該費用に係る消費税等相当額とともに毎計算期間の最初の6ヵ月終了日および毎計算期末または信託終了のとき、信託財産中から支弁します。

当ファンドの組入有価証券の売買時の売買委託手数料、先物・オプション取引等に要する費用およびこれら手数料ならびに費用にかかる消費税等相当額は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

上記、 の手数料等（借入金の利息および財務諸表の監査に要する費用を除きます。）については、当ファンドが投資対象とするマザーファンドにおいて発生する場合、マザーファンドの信託財産中から支弁されます。これらはマザーファンドの基準価額に反映されるため、結果として当ファンドの受益者が間接的に負担することとなります。

（５）【課税上の取扱い】

当ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

個人の受益者に対する課税

収益分配時

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

詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

解約時および償還時

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

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

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

損益通算について

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

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

NISAおよびジュニアNISAは、上場株式や公募株式投資信託などにかかる非課税制度です。毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が一定

期間非課税となります。ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。なお、同非課税口座内で少額上場株式等にかかる譲渡損失が生じた場合には、課税上譲渡損失はないものとみなされ、他の口座の上場株式等の譲渡益および上場株式等の配当所得等の金額との損益通算を行うことはできませんので、ご注意ください。

法人の受益者に対する課税

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

なお、益金不算入制度の適用はありません。

上記は、2018年11月末現在のものです。税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。

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

個別元本方式について

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

< 個別元本について >

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

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

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

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

< 収益分配金の課税について >

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

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

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

税法が改正された場合等は、上記内容が変更になることがあります。

5【運用状況】

以下の運用状況は平成30年11月30日現在です。

投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。なお、小数点第3位を切捨てており、端数調整は行っておりません。

（1）【投資状況】

コア資産形成ファンド

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	359,023,754	98.71
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4,660,288	1.28
合計(純資産総額)		363,684,042	100.00

（参考）MHAM日本債券インデックスマザーファンド

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	日本	121,219,363,250	83.76
地方債証券	日本	7,754,664,872	5.35
特殊債券	日本	8,639,051,817	5.96
社債券	日本	5,185,200,800	3.58
	フランス	199,674,000	0.13
	オランダ	100,387,000	0.06
	スウェーデン	100,291,000	0.06
	オーストラリア	100,168,000	0.06
	小計	5,685,720,800	3.92
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,414,316,525	0.97
合計(純資産総額)		144,713,117,264	100.00

（参考）MHAM外国債券インデックスマザーファンド

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	アメリカ	8,855,299,463	45.34
	フランス	1,943,577,608	9.95
	イタリア	1,704,140,059	8.72
	ドイツ	1,302,871,020	6.67

イギリス	1,207,142,625	6.18
スペイン	1,048,075,200	5.36
ベルギー	497,120,083	2.54
オランダ	421,998,489	2.16
オーストラリア	394,664,333	2.02
カナダ	376,342,667	1.92
オーストリア	289,226,631	1.48
アイルランド	139,965,619	0.71
フィンランド	118,686,401	0.60
メキシコ	117,442,361	0.60
南アフリカ	107,380,718	0.54
ポーランド	100,236,567	0.51
デンマーク	99,460,126	0.50
マレーシア	85,999,092	0.44
スウェーデン	68,702,508	0.35
シンガポール	60,224,666	0.30
ノルウェー	44,225,547	0.22
小計	18,982,781,783	97.20
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	545,335,187	2.79
合計(純資産総額)	19,528,116,970	100.00

(参考)MHAM TOPIXマザーファンド

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	42,957,360,040	98.01
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		869,518,663	1.98
合計(純資産総額)		43,826,878,703	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類	建別	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	日本	1,200,960,000	2.74

(注) 株価指数先物取引の時価の算定方法については、取引所の発表する計算日の清算値段により評価しております。

(参考)MHAM外国株式インデックスマザーファンド

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	アメリカ	15,766,393,807	60.77
	イギリス	1,537,664,962	5.92
	カナダ	917,258,311	3.53

	フランス	913,394,915	3.52
	スイス	881,950,320	3.39
	ドイツ	797,779,295	3.07
	オーストラリア	594,258,851	2.29
	オランダ	437,380,798	1.68
	アイルランド	433,874,842	1.67
	スペイン	284,796,198	1.09
	香港	227,305,280	0.87
	スウェーデン	223,093,011	0.86
	イタリア	174,975,758	0.67
	デンマーク	158,909,824	0.61
	ジャージー	122,123,379	0.47
	シンガポール	112,646,702	0.43
	フィンランド	111,676,628	0.43
	バミューダ	108,334,517	0.41
	ベルギー	92,190,995	0.35
	ノルウェー	69,601,741	0.26
	ケイマン諸島	59,608,812	0.22
	イスラエル	51,674,229	0.19
	キュラソー	44,624,483	0.17
	ルクセンブルグ	27,766,755	0.10
	オーストリア	21,869,371	0.08
	ニュージーランド	20,911,544	0.08
	パナマ	18,254,347	0.07
	ポルトガル	14,030,423	0.05
	リベリア	13,287,322	0.05
	パプアニューギニア	5,113,896	0.01
	英ヴァージン諸島	4,622,087	0.01
	マン島	3,686,624	0.01
	モーリシャス	782,206	0.00
	小計	24,251,842,233	93.48
投資信託受益証券	香港	3,929,393	0.01
投資証券	アメリカ	507,898,232	1.95
	オーストラリア	43,132,920	0.16
	フランス	30,845,560	0.11
	イギリス	18,653,071	0.07
	香港	15,015,995	0.05
	シンガポール	10,524,878	0.04
	カナダ	5,517,629	0.02
	小計	631,588,285	2.43
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,053,423,828	4.06
合計(純資産総額)		25,940,783,739	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類	建別	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	2,086,275,305	8.04
	買建	ドイツ	520,434,163	2.00
	買建	イギリス	184,226,504	0.71
	買建	オーストラリア	47,737,768	0.18

(注) 株価指数先物取引の時価の算定方法については、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により評価しております。

(2) 【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

コア資産形成ファンド

イ. 評価額上位銘柄明細

順位	国/地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	親投資信託 受益証券	MHAM日本債券インデックス マザーファンド	196,269,218	1.2300	241,415,126	1.2301	241,430,765	66.38
2	日本	親投資信託 受益証券	MHAM外国債券インデックス マザーファンド	51,477,035	1.2442	64,049,593	1.2594	64,830,177	17.82
3	日本	親投資信託 受益証券	MHAM外国株式インデックス マザーファンド	15,134,894	1.8833	28,504,173	1.8486	27,978,365	7.69
4	日本	親投資信託 受益証券	MHAM TOPIXマザー ファンド	12,699,553	2.0634	26,204,424	1.9516	24,784,447	6.81

ロ. 種類別投資比率

種類	国内/外国	投資比率(%)
親投資信託受益証券	国内	98.71
合計		98.71

(参考) MHAM日本債券インデックスマザーファンド

イ. 評価額上位銘柄明細

順位	国/地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
1	日本	国債証券	第127回利付 国債(5年)	1,550,000,000	100.63	1,559,796,000	100.55	1,558,556,000	0.1	2021年3 月20日	1.07
2	日本	国債証券	第329回利付 国債(10年)	1,430,000,000	104.62	1,496,066,000	104.18	1,489,774,000	0.8	2023年6 月20日	1.02
3	日本	国債証券	第332回利付 国債(10年)	1,420,000,000	103.78	1,473,795,000	103.57	1,470,779,200	0.6	2023年12 月20日	1.01

4	日本	国債証券	第328回利付 国債(10年)	1,390,000,000	103.44	1,437,899,400	103.10	1,433,187,300	0.6	2023年3 月20日	0.99
5	日本	国債証券	第333回利付 国債(10年)	1,380,000,000	104.00	1,435,269,000	103.72	1,431,391,200	0.6	2024年3 月20日	0.98
6	日本	国債証券	第135回利付 国債(5年)	1,410,000,000	101.04	1,424,716,100	100.94	1,423,380,900	0.1	2023年3 月20日	0.98
7	日本	国債証券	第339回利付 国債(10年)	1,370,000,000	103.12	1,412,847,000	103.09	1,412,333,000	0.4	2025年6 月20日	0.97
8	日本	国債証券	第350回利付 国債(10年)	1,400,000,000	100.48	1,406,858,000	100.46	1,406,468,000	0.1	2028年3 月20日	0.97
9	日本	国債証券	第123回利付 国債(5年)	1,400,000,000	100.41	1,405,740,000	100.31	1,404,438,000	0.1	2020年3 月20日	0.97
10	日本	国債証券	第134回利付 国債(5年)	1,390,000,000	100.97	1,403,538,600	100.91	1,402,718,500	0.1	2022年12 月20日	0.96
11	日本	国債証券	第124回利付 国債(5年)	1,370,000,000	100.46	1,376,302,000	100.37	1,375,192,300	0.1	2020年6 月20日	0.95
12	日本	国債証券	第133回利付 国債(5年)	1,360,000,000	100.83	1,371,317,500	100.85	1,371,668,800	0.1	2022年9 月20日	0.94
13	日本	国債証券	第340回利付 国債(10年)	1,310,000,000	103.22	1,352,220,500	103.13	1,351,120,900	0.4	2025年9 月20日	0.93
14	日本	国債証券	第131回利付 国債(5年)	1,340,000,000	100.79	1,350,716,400	100.76	1,350,184,000	0.1	2022年3 月20日	0.93
15	日本	国債証券	第335回利付 国債(10年)	1,270,000,000	103.61	1,315,872,400	103.43	1,313,662,600	0.5	2024年9 月20日	0.90
16	日本	国債証券	第341回利付 国債(10年)	1,260,000,000	102.59	1,292,634,000	102.51	1,291,638,600	0.3	2025年12 月20日	0.89
17	日本	国債証券	第128回利付 国債(5年)	1,280,000,000	100.70	1,288,998,400	100.60	1,287,680,000	0.1	2021年6 月20日	0.88
18	日本	国債証券	第312回利付 国債(10年)	1,240,000,000	103.14	1,279,004,000	102.73	1,273,963,600	1.2	2020年12 月20日	0.88
19	日本	国債証券	第126回利付 国債(5年)	1,260,000,000	100.57	1,267,270,200	100.50	1,266,325,200	0.1	2020年12 月20日	0.87
20	日本	国債証券	第130回利付 国債(5年)	1,250,000,000	100.75	1,259,445,000	100.70	1,258,787,500	0.1	2021年12 月20日	0.86
21	日本	国債証券	第125回利付 国債(5年)	1,230,000,000	100.52	1,236,420,600	100.44	1,235,424,300	0.1	2020年9 月20日	0.85
22	日本	国債証券	第347回利付 国債(10年)	1,220,000,000	100.59	1,227,255,300	100.76	1,229,369,600	0.1	2027年6 月20日	0.84
23	日本	国債証券	第325回利付 国債(10年)	1,180,000,000	103.97	1,226,846,000	103.50	1,221,406,200	0.8	2022年9 月20日	0.84
24	日本	国債証券	第342回利付 国債(10年)	1,200,000,000	101.02	1,212,240,000	101.09	1,213,164,000	0.1	2026年3 月20日	0.83
25	日本	国債証券	第122回利付 国債(5年)	1,200,000,000	100.36	1,204,368,000	100.25	1,203,012,000	0.1	2019年12 月20日	0.83
26	日本	国債証券	第343回利付 国債(10年)	1,190,000,000	100.81	1,199,652,500	101.05	1,202,602,100	0.1	2026年6 月20日	0.83
27	日本	国債証券	第338回利付 国債(10年)	1,150,000,000	103.01	1,184,670,000	103.00	1,184,534,500	0.4	2025年3 月20日	0.81
28	日本	国債証券	第346回利付 国債(10年)	1,160,000,000	100.79	1,169,164,000	100.87	1,170,103,600	0.1	2027年3 月20日	0.80
29	日本	国債証券	第334回利付 国債(10年)	1,110,000,000	103.97	1,154,174,000	103.87	1,153,001,400	0.6	2024年6 月20日	0.79
30	日本	国債証券	第132回利付 国債(5年)	1,120,000,000	100.86	1,129,721,600	100.80	1,128,971,200	0.1	2022年6 月20日	0.78

□.種類別投資比率

種類	国内/外国	投資比率(%)
国債証券	国内	83.76

地方債証券	国内	5.35
特殊債券	国内	5.96
社債券	国内	3.58
	外国	0.34
合計		99.02

(参考)MHAM外国債券インデックスマザーファンド

イ.評価額上位銘柄明細

順位	国/地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
1	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.875%	1,380,000	11,347.44	156,594,717	11,355.86	156,710,934	2.875	2020年10 月31日	0.80
2	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.625%	1,280,000	10,799.59	138,234,827	10,849.68	138,875,933	1.625	2022年 8 月31日	0.71
3	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.625%	1,170,000	11,264.11	131,790,131	11,288.49	132,075,356	2.625	2021年 6 月15日	0.67
4	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.5%	1,130,000	11,274.75	127,404,692	11,290.26	127,579,994	2.5	2020年 6 月30日	0.65
5	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.5%	1,070,000	11,129.81	119,088,981	11,149.31	119,297,659	1.5	2020年 4 月15日	0.61
6	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2%	1,060,000	10,492.90	111,224,760	10,550.05	111,830,535	2	2026年11 月15日	0.57
7	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.875%	970,000	11,327.94	109,881,024	11,355.86	110,151,889	2.875	2021年10 月15日	0.56
8	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI 5%	750,000	14,828.16	111,211,273	14,630.76	109,730,756	5	2025年 3 月 1日	0.56
9	フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF) 2.25%	750,000	14,163.93	106,229,526	14,169.55	106,271,694	2.25	2022年10 月25日	0.54
10	フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF) 3.75%	730,000	14,413.65	105,219,674	14,228.98	103,871,603	3.75	2021年 4 月25日	0.53
11	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.75%	900,000	11,273.42	101,460,795	11,318.63	101,867,692	2.75	2021年 9 月15日	0.52
12	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.625%	890,000	11,330.82	100,844,335	11,304.00	100,605,649	2.625	2020年11 月15日	0.51
13	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.625%	835,000	11,337.65	94,669,440	11,311.54	94,451,364	2.625	2020年 8 月15日	0.48
14	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.375%	850,000	10,945.42	93,036,092	11,029.63	93,751,928	2.375	2024年 8 月15日	0.48
15	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.125%	850,000	10,769.43	91,540,221	10,835.25	92,099,628	1.125	2021年 9 月30日	0.47
16	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.375%	770,000	11,161.28	85,941,868	11,172.36	86,027,192	1.375	2020年 1 月15日	0.44
17	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.875%	760,000	11,243.28	85,448,938	11,238.84	85,415,252	1.875	2019年12 月31日	0.43
18	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.625%	750,000	11,167.04	83,752,827	11,230.87	84,231,529	2.625	2023年 6 月30日	0.43
19	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI 4.75%	580,000	14,210.38	82,420,223	14,345.25	83,202,494	4.75	2023年 8 月 1日	0.42
20	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.875%	740,000	11,067.31	81,898,125	11,189.20	82,800,122	2.875	2028年 8 月15日	0.42
21	フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF) 0.25%	640,000	12,633.92	80,857,115	12,698.08	81,267,745	0.25	2026年11 月25日	0.41
22	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.875%	720,000	11,298.76	81,351,137	11,195.41	80,606,960	2.875	2028年 5 月15日	0.41

23	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25%	720,000	10,888.80	78,399,430	10,933.01	78,717,685	2.25	2024年11 月15日	0.40
24	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.125%	710,000	11,025.20	78,278,963	11,023.43	78,266,375	2.125	2022年12 月31日	0.40
25	フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF) 0%	600,000	13,019.76	78,118,609	13,013.30	78,079,852	0	2021年 5 月25日	0.39
26	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.625%	680,000	11,346.54	77,156,514	11,307.99	76,894,364	2.625	2020年 8 月31日	0.39
27	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25%	710,000	10,640.59	75,548,216	10,726.46	76,157,872	2.25	2027年 2 月15日	0.38
28	フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF) 4.75%	380,000	19,901.84	75,627,026	19,939.18	75,768,902	4.75	2035年 4 月25日	0.38
29	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.125%	690,000	10,764.18	74,272,853	10,802.69	74,538,620	2.125	2025年 5 月15日	0.38
30	フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF) 4.25%	475,000	15,861.30	75,341,186	15,682.37	74,491,277	4.25	2023年10 月25日	0.38

ロ.種類別投資比率

種類	国内/外国	投資比率(%)
国債証券	外国	97.20
合計		97.20

(参考)MHAM TOPIXマザーファンド

イ.評価額上位銘柄明細

順位	国/地域	種類	銘柄名	業種	数量又は 額面総額	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	202,700	6,994.16	1,417,716,977	6,803.00	1,378,968,100	3.14
2	日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1,251,700	722.44	904,287,810	624.50	781,686,650	1.78
3	日本	株式	ソニー	電気機器	122,100	5,456.65	666,258,066	5,937.00	724,907,700	1.65
4	日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	74,700	8,865.01	662,216,878	9,526.00	711,592,200	1.62
5	日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	122,100	5,022.44	613,240,113	4,680.00	571,428,000	1.30
6	日本	株式	キーエンス	電気機器	8,900	64,661.47	575,487,122	61,600.00	548,240,000	1.25
7	日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	126,500	4,594.33	581,183,825	4,183.00	529,149,500	1.20
8	日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	153,500	3,675.74	564,226,366	3,202.00	491,507,000	1.12
9	日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	2,441,700	197.18	481,476,423	188.30	459,772,110	1.04
10	日本	株式	KDDI	情報・通信業	157,400	2,745.98	432,217,414	2,664.00	419,313,600	0.95
11	日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	124,600	2,585.06	322,099,648	3,123.00	389,125,800	0.88
12	日本	株式	任天堂	その他製品	11,200	46,655.77	522,544,699	34,610.00	387,632,000	0.88
13	日本	株式	三菱商事	卸売業	125,700	3,028.75	380,714,477	3,062.00	384,893,400	0.87
14	日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	16,300	20,447.35	333,291,874	23,325.00	380,197,500	0.86
15	日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	75,100	4,536.22	340,670,341	4,943.00	371,219,300	0.84

16	日本	株式	花王	化学	44,200	7,831.64	346,158,530	8,358.00	369,423,600	0.84
17	日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	65,000	5,072.23	329,695,470	5,605.00	364,325,000	0.83
18	日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	128,100	2,773.46	355,280,588	2,628.50	336,710,850	0.76
19	日本	株式	ファナック	電気機器	17,300	26,220.22	453,609,922	19,390.00	335,447,000	0.76
20	日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	32,300	9,946.44	321,270,215	10,320.00	333,336,000	0.76
21	日本	株式	日本電産	電気機器	21,900	17,013.37	372,592,820	15,120.00	331,128,000	0.75
22	日本	株式	村田製作所	電気機器	19,100	15,764.69	301,105,592	17,315.00	330,716,500	0.75
23	日本	株式	信越化学工業	化学	31,400	11,098.76	348,501,328	10,135.00	318,239,000	0.72
24	日本	株式	キヤノン	電気機器	98,000	3,883.90	380,623,096	3,220.00	315,560,000	0.72
25	日本	株式	ダイキン工業	機械	24,900	12,339.55	307,255,011	12,610.00	313,989,000	0.71
26	日本	株式	武田薬品工業	医薬品	71,900	5,484.16	394,311,617	4,255.00	305,934,500	0.69
27	日本	株式	日本たばこ産業	食料品	105,500	3,014.15	317,993,133	2,823.50	297,879,250	0.67
28	日本	株式	アステラス製薬	医薬品	167,900	1,598.76	268,432,248	1,744.50	292,901,550	0.66
29	日本	株式	三菱電機	電気機器	182,200	1,732.23	315,613,149	1,498.00	272,935,600	0.62
30	日本	株式	日立製作所	電気機器	82,000	3,991.25	327,282,748	3,288.00	269,616,000	0.61

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.11
		鉱業	0.30
		建設業	2.91
		食料品	4.29
		繊維製品	0.65
		パルプ・紙	0.28
		化学	7.19
		医薬品	5.13
		石油・石炭製品	0.74
		ゴム製品	0.81
		ガラス・土石製品	0.89
		鉄鋼	0.98
		非鉄金属	0.78
		金属製品	0.58
		機械	4.96
		電気機器	12.74
		輸送用機器	7.88
		精密機器	1.80
		その他製品	2.04
		電気・ガス業	1.86
陸運業	4.50		
海運業	0.16		
空運業	0.58		

	倉庫・運輸関連業	0.19
	情報・通信業	7.40
	卸売業	4.86
	小売業	5.18
	銀行業	6.57
	証券、商品先物取引業	0.91
	保険業	2.35
	その他金融業	1.18
	不動産業	2.31
	サービス業	4.75
合計		98.01

(参考)MHAM外国株式インデックスマザーファンド

イ.評価額上位銘柄明細

順位	国/地域	種類	銘柄名	業種	数量又は 額面総額	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	30,414	21,672.77	659,155,627	20,373.53	619,640,800	2.38
2	アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	45,162	11,255.08	508,302,343	12,503.25	564,672,197	2.17
3	アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	2,552	188,668.83	481,482,875	189,899.98	484,624,769	1.86
4	アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	16,600	14,282.46	237,088,984	16,549.59	274,723,352	1.05
5	アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	21,064	12,538.43	264,109,595	12,488.50	263,057,937	1.01
6	アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	1,944	123,028.71	239,167,818	123,489.40	240,063,396	0.92
7	アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORPORATION	エネルギー	26,193	8,968.66	234,916,342	8,970.93	234,975,784	0.90
8	アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	メディア・娯楽	14,843	20,046.74	297,553,835	15,736.01	233,569,739	0.90
9	アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	1,847	123,681.16	228,439,112	124,201.99	229,401,080	0.88
10	アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	7,908	22,641.80	179,051,384	24,702.41	195,346,729	0.75
11	アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	5,947	27,159.04	161,514,838	32,060.94	190,666,461	0.73
12	アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	59,578	3,379.13	201,322,200	3,181.69	189,559,251	0.73
13	アメリカ	株式	PFIZER INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	36,197	4,122.36	149,217,249	5,164.01	186,922,021	0.72
14	スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	19,242	8,914.95	171,541,526	9,704.28	186,729,756	0.71
15	アメリカ	株式	WELLS FARGO & COMPANY	銀行	28,639	6,021.85	172,459,846	6,131.91	175,612,023	0.67
16	アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	11,050	15,018.88	165,958,726	15,783.67	174,409,631	0.67

17	アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	電気通信サービス	25,582	5,531.66	141,510,990	6,745.79	172,570,838	0.66
18	アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	15,569	8,394.51	130,694,135	10,532.28	163,977,151	0.63
19	アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	11,824	14,189.42	167,775,744	13,485.90	159,457,394	0.61
20	アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	29,107	5,213.94	151,762,341	5,371.66	156,353,193	0.60
21	アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	28,833	5,928.80	170,945,306	5,412.51	156,059,160	0.60
22	アメリカ	株式	AT & T INC	電気通信サービス	44,966	3,582.24	161,079,359	3,468.77	155,977,067	0.60
23	アメリカ	株式	MERCK & CO. INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	16,649	6,754.86	112,461,816	8,840.44	147,184,614	0.56
24	アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	7,138	21,259.73	151,752,019	19,932.14	142,275,617	0.54
25	アメリカ	株式	COCA-COLA COMPANY	食品・飲料・タバコ	25,010	4,862.18	121,603,360	5,557.76	138,999,593	0.53
26	スイス	株式	NOVARTIS AG-REG	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	13,410	8,957.09	120,114,658	10,292.00	138,015,774	0.53
27	アメリカ	株式	BOEING CO	資本財	3,423	39,250.40	134,354,145	38,870.28	133,052,979	0.51
28	アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	ソフトウェア・サービス	5,736	21,997.29	126,176,480	22,315.01	127,998,899	0.49
29	アメリカ	株式	COMCAST CORP CL-A	メディア・娯楽	28,422	3,734.29	106,136,209	4,472.98	127,131,248	0.49
30	スイス	株式	ROCHE HOLDING AG-GENUSS CHEIN	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	4,346	26,206.11	113,891,762	28,953.37	125,831,389	0.48

ロ. 種類別及び業種別の投資比率

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	6.23
		素材	4.18
		資本財	6.62
		商業・専門サービス	1.06
		運輸	1.98
		自動車・自動車部品	1.19
		耐久消費財・アパレル	1.64
		消費者サービス	1.84
		メディア・娯楽	5.45
		小売	4.42
		食品・生活必需品小売り	1.51
		食品・飲料・タバコ	4.74
家庭用品・パーソナル用品	1.96		

		ヘルスケア機器・サービス	4.88
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.51
		銀行	8.37
		各種金融	4.20
		保険	3.68
		不動産	0.52
		ソフトウェア・サービス	8.00
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.10
		電気通信サービス	2.44
		公益事業	3.16
		半導体・半導体製造装置	2.68
投資信託受益証券	外国		0.01
投資証券	外国		2.43
合計			95.93

【投資不動産物件】

コア資産形成ファンド

該当事項はありません。

（参考）MHAM日本債券インデックスマザーファンド

該当事項はありません。

（参考）MHAM外国債券インデックスマザーファンド

該当事項はありません。

（参考）MHAM TOPIXマザーファンド

該当事項はありません。

（参考）MHAM外国株式インデックスマザーファンド

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

コア資産形成ファンド

該当事項はありません。

（参考）MHAM日本債券インデックスマザーファンド

該当事項はありません。

（参考）MHAM外国債券インデックスマザーファンド

該当事項はありません。

（参考）MHAM TOPIXマザーファンド

資産の種類	取引所	資産の名称	建別	数量	通貨	帳簿価額 （円）	評価額 （円）	投資比率 （％）
株価指数先物取引	大阪取引所	東証株価指数先物	買建	72	日本・円	1,200,173,328	1,200,960,000	2.74

（注）時価の算定方法

取引所の発表する計算日の清算値段により評価しています。

（参考）MHAM外国株式インデックスマザーファンド

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	建別	数量	通貨	帳簿価額	帳簿価額 （円）	評価額	評価額 （円）	投資比率 （％）
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴ商業取引所	SP EMIN 1812	買建	134	米・ドル	18,472,887.5	2,096,118,544	18,386,140	2,086,275,305	8.04
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EURO 1812	買建	127	ユーロ	4,023,450	519,789,505	4,028,440	520,434,163	2.00
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 1812	買建	4	オーストラリア・ドル	611,450	50,799,266	574,600	47,737,768	0.18
	イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	FTSE100 1812	買建	18	英・ポンド	1,268,120	183,890,081	1,270,440	184,226,504	0.71

（注）時価の算定方法

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または最終相場により評価しております。

（3）【運用実績】

【純資産の推移】

コア資産形成ファンド

平成30年11月末日及び同日前1年以内における各月末ならびに下記決算期末の純資産の推移は次の通りです。

期別	純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1計算期間末（平成28年 5月 9日）	93	93	0.9889	0.9889
第2計算期間末（平成29年 5月 8日）	219	219	1.0052	1.0052
第3計算期間末（平成30年 5月 8日）	276	276	1.0243	1.0243
平成29年11月末日	232		1.0340	
12月末日	230		1.0410	
平成30年 1月末日	241		1.0405	
2月末日	242		1.0275	

3月末日	259	1.0210
4月末日	275	1.0253
5月末日	297	1.0217
6月末日	312	1.0234
7月末日	327	1.0252
8月末日	335	1.0214
9月末日	349	1.0289
10月末日	351	0.9995
11月末日	363	1.0058

(注) 表中の末日とは当該月の最終営業日を指します。

【分配の推移】

コア資産形成ファンド

期	計算期間	1口当たりの分配金(円)
第1計算期間	平成27年 4月20日～平成28年 5月 9日	0.0000
第2計算期間	平成28年 5月10日～平成29年 5月 8日	0.0000
第3計算期間	平成29年 5月 9日～平成30年 5月 8日	0.0000

【収益率の推移】

コア資産形成ファンド

期	計算期間	収益率(%)
第1計算期間	平成27年 4月20日～平成28年 5月 9日	1.11
第2計算期間	平成28年 5月10日～平成29年 5月 8日	1.65
第3計算期間	平成29年 5月 9日～平成30年 5月 8日	1.90
第4中間計算期間	平成30年 5月 9日～平成30年11月 8日	1.86

(注1) 収益率は期間騰落率。

(注2) 小数点第3位四捨五入。

(4) 【設定及び解約の実績】

コア資産形成ファンド

期	計算期間	設定口数(口)	解約口数(口)	発行済み口数(口)
第1計算期間	平成27年 4月20日～平成28年 5月 9日	97,026,713	2,647,305	94,379,408
第2計算期間	平成28年 5月10日～平成29年 5月 8日	146,988,315	23,166,841	218,200,882
第3計算期間	平成29年 5月 9日～平成30年 5月 8日	135,796,963	84,429,344	269,568,501

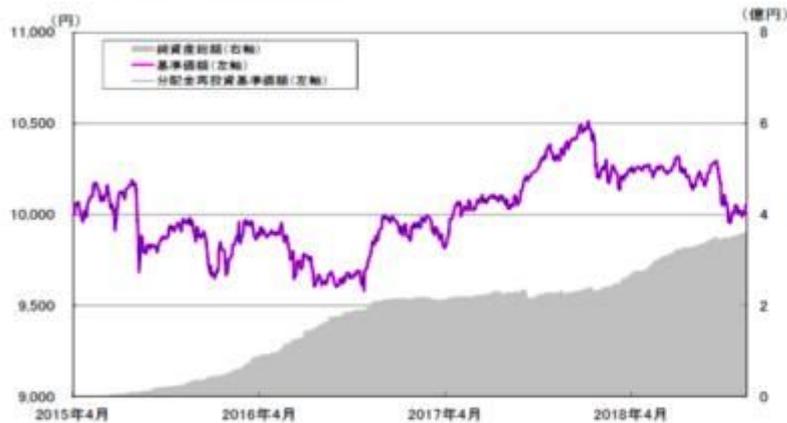
第4中間計算期間	平成30年 5月 9日～平成30年11月 8日	106,661,194	25,132,807	351,096,888
----------	-------------------------	-------------	------------	-------------

(注)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11月30日

基準価額・純資産の推移 (2015年4月20日～2018年11月30日)



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。
 ※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額とは異なります。(設定日:2015年4月20日)

分配の推移 (税引前)

2018年 5月	0円
2017年 5月	0円
2016年 5月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たりです。

主要な資産の状況

■組入銘柄 ※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率(小数点第二位四捨五入)です。

順位	銘柄名	比率(%)
1	MHAM日本債券インデックスマザーファンド	66.4
2	MHAM外国債券インデックスマザーファンド	17.8
3	MHAM外国株式インデックスマザーファンド	7.7
4	MHAM TOPIXマザーファンド	6.8

■MHAM日本債券インデックスマザーファンド

組入上位5銘柄 ※比率(%)は、当該マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率(小数点第二位四捨五入)です。

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還期限	比率(%)
1	第127回利付国債(5年)	国債証券	日本	0.100	2021年3月20日	1.1
2	第329回利付国債(10年)	国債証券	日本	0.800	2023年6月20日	1.0
3	第332回利付国債(10年)	国債証券	日本	0.600	2023年12月20日	1.0
4	第328回利付国債(10年)	国債証券	日本	0.600	2023年3月20日	1.0
5	第333回利付国債(10年)	国債証券	日本	0.600	2024年3月20日	1.0

■MHAM外国債券インデックスマザーファンド

組入上位5銘柄 ※比率(%)は、当該マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率(小数点第二位四捨五入)です。

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還期限	比率(%)
1	米国国債	国債証券	アメリカ	2.875	2020年10月31日	0.8
2	米国国債	国債証券	アメリカ	1.625	2022年8月31日	0.7
3	米国国債	国債証券	アメリカ	2.625	2021年6月15日	0.7
4	米国国債	国債証券	アメリカ	2.500	2020年6月30日	0.7
5	米国国債	国債証券	アメリカ	1.500	2020年4月15日	0.6

○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

■MHAM TOPIXマザーファンド

組入上位5銘柄 ※比率(%)は、当該マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率(小数点第二位四捨五入)です。

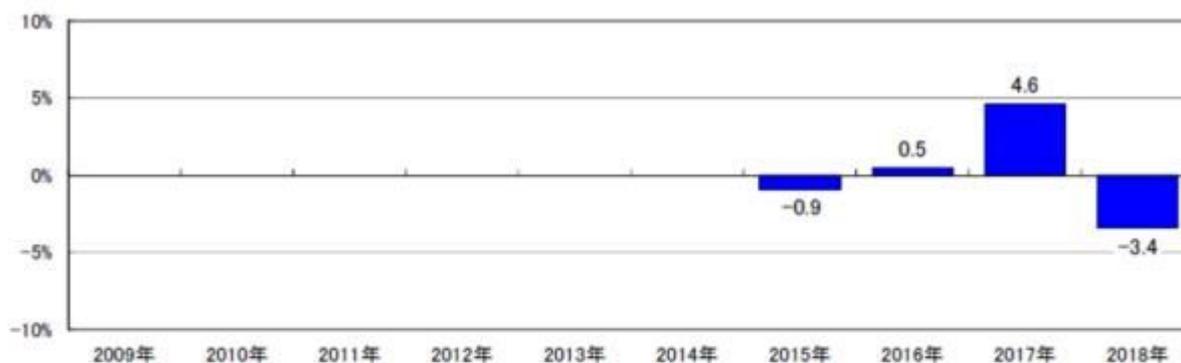
順位	銘柄名	種類	国/地域	業種	比率(%)
1	トヨタ自動車	株式	日本	輸送用機器	3.1
2	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	日本	銀行業	1.8
3	ソニー	株式	日本	電気機器	1.7
4	ソフトバンクグループ	株式	日本	情報・通信業	1.6
5	日本電信電話	株式	日本	情報・通信業	1.3

■MHAM外国株式インデックスマザーファンド

組入上位5銘柄 ※比率(%)は、当該マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率(小数点第二位四捨五入)です。

順位	銘柄名	種類	国/地域	業種	比率(%)
1	アップル	株式	アメリカ	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	2.4
2	マイクロソフト	株式	アメリカ	ソフトウェア・サービス	2.2
3	アマゾン ドット コム	株式	アメリカ	小売	1.9
4	ジョンソン・エンド・ジョンソン	株式	アメリカ	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	1.1
5	JPモルガン・チェース・アンド・カンパニー	株式	アメリカ	銀行	1.0

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。

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

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

第2【管理及び運営】

1【申込(販売)手続等】

(1) 当ファンドのお申込みは、原則として委託会社および販売会社の営業日の午後3時までにお買付けのお

申込みが行われ、かつ当該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分のお申込みといたします。この時間を過ぎてのお申込みおよび所定の事務手続き完了分については翌営業日のお取扱いとなります。ただし、取得申込日が、ニューヨーク証券取引所、ロンドン証券取引所、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あたる場合には、お申込みの受付はいたしません。

- (2) 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、追加信託により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。
- (3) お申込みには、収益の分配がなされた場合に分配金を受領する「分配金受取コース」と、分配金は原則として税金を差し引いた後、自動的に無手数料で再投資される「分配金再投資コース」の2つのお申込方法があります。ただし、販売会社によっては、どちらか一方のコースのみのお取扱いとなる場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。
- (4) 申込単位は、各販売会社が定める単位とします。申込単位については、販売会社にお問い合わせください。
- (5) 取得申込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。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。
- (6) 取得申込みにかかる受益権の価額は、取得申込日の翌営業日の基準価額に、販売会社が別に定める申込手数料および申込手数料にかかる消費税等相当額を加算した価額とします。
- (7) 販売会社において金額買付（申込単位が金額にて表示されている場合）によるお申込みをされた場合、申込手数料および申込手数料にかかる消費税等相当額はお申込代金の中から差し引かれます。
- (8) 収益分配金の再投資に関する契約に基づき、収益分配金を再投資する際は、1口単位で購入できるものとします。なお、その際の受益権の価額は、原則として各計算期間終了日の基準価額とします。
- (9) 信託財産の効率的な運用または受益者に対する公平性を期する運用が妨げられると委託会社が合理的に判断する場合、取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、販売会社は、受益権の取得申込みの受付を中止すること、およびすでに受付けた取得申込みの受付を取り消すことができます。

2【換金（解約）手続等】

- (1) 受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託会社に各販売会社が定める単位をもって解約を請求することができます。
解約単位は、販売会社にお問い合わせください。
- (2) 解約の請求を行う受益者は、振替制度にかかる口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求にかかるこの信託契約の一部解約を委託会社が行うのと引換えに、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、解約の請求を受益者が行う際は、販売会社に対し振替受益権をもって行うものとします。
- (3) 解約請求の受付については、原則として委託会社および販売会社の営業日の午後3時までには解約のお申込みが行われ、かつ当該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

分のお申込みとします。この時間を過ぎてのお申込みおよび所定の事務手続き完了分については、翌営業日のお取扱いとなります。ただし、解約請求受付日が、ニューヨーク証券取引所、ロンドン証券取引所、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あたる場合には、解約請求の受け付けはいたしません。

- (4) 解約の価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。詳しくは、販売会社または委託会社にお問い合わせください。なお、委託会社に対する照会は下記においてできます。

照会先の名称	電話番号
アセットマネジメントOne株式会社	0120-104-694

電話によるお問い合わせは、営業日の午前9時～午後5時までとさせていただきます。（以下同じ。）

- (5) 解約代金は、受益者の解約請求を受付けた日から起算して、原則として、6営業日目から販売会社において受益者に支払われます。
- (6) 信託財産の資金管理を円滑に行うために、大口の解約請求には制限を設ける場合があります。
- (7) 委託会社は、信託財産の効率的な運用または受益者に対する公平性を期する運用が妨げられると委託会社が合理的に判断する場合（一部解約の実行の請求金額が多額な場合を含みます。）、取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受け付けを中止すること、およびすでに受付けた一部解約の実行の請求の受け付けを取り消すことができます。この場合、受益者は当該受付中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できません。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日（この日が前記(3)に規定する一部解約の実行の請求を受付けない日であるときは、この計算日以降の最初の一部解約の実行の請求を受付けることができる日とします。）に一部解約の実行の請求を受付けたものとして、前記(4)の規定に準じて算出した価額とします。

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

基準価額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および借入有価証券を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則に従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（「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。

<主な投資対象の時価評価方法の原則>

投資対象	評価方法
マザーファンド受益証券	計算日の基準価額
株式	計算日における取引所の最終相場
公社債等	計算日における以下のいずれかの価額 ・日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値） ・金融商品取引業者、銀行などの提示する価額（売り気配相場を除きます。） ・価格情報会社の提供する価額
外貨建資産の円換算	計算日の国内における対顧客電信売買相場の仲値

外国で取引されているものについては、計算日の直近の日とします。

当ファンドの基準価額は、委託会社の毎営業日（土曜日、日曜日、「国民の祝日に関する法律」に定

める休日ならびに12月31日、1月2日および1月3日以外の日とします。)に計算されます。基準価額については、販売会社または委託会社にお問い合わせください。なお、委託会社に対する照会は下記においてできます。基準価額は1万口単位で表示されたものが発表されます。

照会先の名称	ホームページアドレス	電話番号
アセットマネジメントOne株式会社	http://www.am-one.co.jp/	0120-104-694

(2)【保管】

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

2015年4月20日から2028年5月8日までとします。

ただし、委託会社が、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】

原則として毎年5月9日から翌年5月8日までとします。ただし、第1計算期間は2015年4月20日から2016年5月8日までとします。

上記の規定にかかわらず、計算期間終了日に該当する日(以下「当該日」といいます。)が休業日のとき、計算期間終了日は、当該日の翌日以降の最初の営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。

(5)【その他】

信託契約の解約

1. 委託会社は、次のいずれかに該当する場合、受託会社と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了(繰上償還)させることがあります。この場合、委託会社は書面による決議(以下「書面決議」といいます。)を行います。ただし、当該信託契約の解約についての委託会社による提案につき、この信託契約に係るすべての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには書面決議は行いません。また、信託財産の状況に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、書面決議の手続きを行うことが困難な場合にも書面決議は行いません。

a. 信託終了前に、この信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるとき。

b. やむを得ない事情が発生したとき。

c. 信託契約の一部解約により、受益権の口数が10億口を下回ることとなるとき。

2. 前記1.により信託契約を解約する場合には、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。

3. 委託会社は、次の事象が起きた場合、信託契約を解約し、信託を終了(繰上償還)させます。

a. 委託会社が監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたとき。

b. 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。ただし、監督官庁が、この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、この信託は、「信託約款の変更等」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。

- c. 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において、委託会社が新受託会社を選任できないとき。

信託約款の変更等

1. 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、この信託約款を変更することまたはこの信託と他の信託との併合（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、この信託約款は「信託約款の変更等」および「書面決議」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、
2. 委託会社は、前記1.の事項（前記1.の変更事項にあっては、その変更の内容が重大なものに該当する場合に限り、前記1.の併合事項にあっては、その併合が受益者の利益に及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。ただし、当該重大な約款の変更等についての委託会社による提案につき、この信託約款に係るすべての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには書面決議は行いません。
3. この投資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又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。
4. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、上記の規定にしたがいます。

書面決議

1. 委託会社は、信託契約の解約または重大な約款の変更等に係る書面決議を行う場合には、あらかじめ、書面決議の日および当該決議の内容に応じて次の事項をそれぞれ定め、当該決議の日の2週間前までに、この信託契約または信託約款に係る知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発送します。
 - a. 信託契約の解約の場合 信託契約の解約の理由など
 - b. 重大な約款の変更等の場合 重大な約款の変更等の内容およびその理由など
2. 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係る受益者としての受託会社を除きます。以下この2.において同じ。）は受益権の口数に応じて議決権を有し、これを行行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
3. 書面決議は、議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
4. 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。
5. この信託は、受益者が一部解約の実行の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、信託契約の解約または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の買取請求の規定の適用を受けません。

償還金の支払い

償還金は、原則として償還日（償還日が休業日の場合には当該償還日の翌営業日）から起算して5営

業日までに、販売会社において支払いが開始されます。

償還金は、償還日に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せん。）に対し、お支払いします。

委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い

- 1．委託会社は、事業の全部または一部を譲渡することがあり、これに伴ない、この信託契約に関する事業を譲渡することがあります。
- 2．委託会社は、分割により事業の全部または一部を承継させることがあり、これに伴ない、この信託契約に関する事業を承継させることがあります。

関係法人との契約の更改ならびに受託会社の辞任または解任に伴う取扱い

- 1．委託会社と販売会社との間の募集・販売等契約は、締結日から原則1年間とし、期間終了の3ヵ月前までに別段の意思表示のない時は、同一条件にて継続されます。
- 2．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。また、受託会社と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し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、「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、委託会社はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。

信託事務処理の再信託

受託会社は、当ファンドにかかる信託事務処理の一部について、資産管理サービス信託銀行株式会社と再信託契約を締結し、これを委託することがあります。その場合には、再信託にかかる契約書類に基づいて所定の事務を行います。

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、次のアドレスに掲載します。

<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ます。

運用報告書

委託会社は、決算時および信託終了時に期中の運用経過のほか、信託財産の内容、有価証券売買状況などを記載した「運用報告書」を作成します。

- ・交付運用報告書は、販売会社を通じて交付いたします。
- ・運用報告書（全体版）は、次のアドレスに掲載します。ただし、受益者から運用報告書（全体版）の交付の請求があった場合には、交付いたします。

<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、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、「分配金再投資コース」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、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】

コア資産形成ファンド

(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)ならびに同規則第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期計算期間の財務諸表について、新日本有限責任監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

【コア資産形成ファンド】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第2期計算期間 (平成29年 5月 8日現在)	第3期計算期間 (平成30年 5月 8日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	66,598,581	5,135,201
親投資信託受益証券	153,969,186	273,164,079
流動資産合計	220,567,767	278,299,280
資産合計	220,567,767	278,299,280
負債の部		
流動負債		
未払解約金	203,085	1,007,609
未払受託者報酬	45,371	51,964
未払委託者報酬	975,315	1,117,146
未払利息	147	12
その他未払費用	4,479	5,138
流動負債合計	1,228,397	2,181,869
負債合計	1,228,397	2,181,869
純資産の部		
元本等		
元本	218,200,882	269,568,501
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	1,138,488	6,548,910
(分配準備積立金)	5,045,759	6,234,282
元本等合計	219,339,370	276,117,411
純資産合計	219,339,370	276,117,411
負債純資産合計	220,567,767	278,299,280

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第2期計算期間 (自 平成28年 5月10日 至 平成29年 5月 8日)	第3期計算期間 (自 平成29年 5月 9日 至 平成30年 5月 8日)
営業収益		
受取利息	356	27
有価証券売買等損益	7,069,974	6,529,893
その他収益	-	2,027
営業収益合計	7,070,330	6,531,947
営業費用		
支払利息	36,051	22,992
受託者報酬	78,131	100,927
委託者報酬	1,679,582	2,169,859
その他費用	7,691	9,977
営業費用合計	1,801,455	2,303,755
営業利益又は営業損失()	5,268,875	4,228,192
経常利益又は経常損失()	5,268,875	4,228,192
当期純利益又は当期純損失()	5,268,875	4,228,192
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()	156,598	1,459,211
期首剰余金又は期首欠損金()	1,045,339	1,138,488
剰余金増加額又は欠損金減少額	417,030	3,291,216
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	417,030	-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	3,291,216
剰余金減少額又は欠損金増加額	3,345,480	649,775
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	649,775
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	3,345,480	-
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金()	1,138,488	6,548,910

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第3期計算期間 (自 平成29年 5月 9日 至 平成30年 5月 8日)
	1 有価証券の評価基準及び評価方法
2 収益・費用の計上基準	有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

第2期計算期間 (平成29年 5月 8日現在)		第3期計算期間 (平成30年 5月 8日現在)	
1	計算期間末における受益権の総数 218,200,882口	1	計算期間末における受益権の総数 269,568,501口
2	計算期間末における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産の額 1.0052円 (1万口当たり純資産の額) (10,052円)	2	計算期間末における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産の額 1.0243円 (1万口当たり純資産の額) (10,243円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第2期計算期間 (自 平成28年 5月10日 至 平成29年 5月 8日)	第3期計算期間 (自 平成29年 5月 9日 至 平成30年 5月 8日)
1 分配金の計算過程 計算期間末における費用控除後の配当等収益(1,457,523円)、有価証券売買等損益(3,478,563円)、収益調整金(489,766円)、分配準備積立金(109,673円)より、分配対象収益は5,535,525円(1万口当たり253円)であります。当期の収益分配金につきましては、見送りとなりました。	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(1,528,058円)、有価証券売買等損益(1,240,923円)、収益調整金(3,496,911円)、分配準備積立金(3,465,301円)より、分配対象収益は9,731,193円(1万口当たり360円)であります。当期の収益分配金につきましては、見送りとなりました。

（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期計算期間 (自 平成28年 5月10日 至 平成29年 5月 8日)	第3期計算期間 (自 平成29年 5月 9日 至 平成30年 5月 8日)
1 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める投資を目的とする証券投資信託であり、証券投資信託約款および投資ガイドラインに基づいて運用しております。	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。 なお、詳細は附属明細表をご参照下さい。 これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。	同左
3 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。 リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。 なお、具体的には以下のリスクの管理を行っております。 市場リスクの管理 市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。 信用リスクの管理 信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。 流動性リスクの管理 流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。	同左

項目	第2期計算期間 (自平成28年5月10日 至平成29年5月8日)	第3期計算期間 (自平成29年5月9日 至平成30年5月8日)
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については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第2期計算期間 (平成29年5月8日現在)	第3期計算期間 (平成30年5月8日現在)
1 貸借対照表日における貸借対照表の科目ごとの計上額・時価・時価との差額	貸借対照表に計上している金融商品は、原則として時価評価としているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2 貸借対照表の科目ごとの時価の算定方法	(1)有価証券 親投資信託受益証券 原則として、親投資信託受益証券の基準価額で評価しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 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、時価は帳簿価額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。	(1)有価証券 親投資信託受益証券 同左 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

第2期計算期間(自平成28年5月10日 至 平成29年5月8日)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	9,345,699
合計	9,345,699

第3期計算期間(自平成29年5月9日至平成30年5月8日)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	3,443,751
合計	3,443,751

(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)

第2期計算期間 (自平成28年5月10日 至平成29年5月8日)	第3期計算期間 (自平成29年5月9日 至平成30年5月8日)
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はありません。	同左

(その他の注記)

期別	第2期計算期間 (平成29年5月8日現在)	第3期計算期間 (平成30年5月8日現在)
項目		
期首元本額	94,379,408円	218,200,882円
期中追加設定元本額	146,988,315円	135,796,963円
期中一部解約元本額	23,166,841円	84,429,344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 5月 8日現在）

種類	通貨	銘柄	口数	評価額	備考
親投資信託受益証券	日本・円	MHAM日本債券インデックスマザーファンド	164,868,710	203,184,198	
		MHAM外国株式インデックスマザーファンド	9,340,628	16,779,504	
		MHAM外国債券インデックスマザーファンド	30,203,446	37,585,168	
		MHAM TOPIXマザーファンド	7,574,683	15,615,209	
	小計	銘柄数：4 組入時価比率：98.9%	211,987,467	273,164,079 100.0%	
合計				273,164,079	

（注1）比率は左より組入時価の純資産総額に対する比率、及び各小計欄の合計金額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）

当ファンドは、「MHAM日本債券インデックスマザーファンド」受益証券、「MHAM外国債券インデックスマザーファンド」受益証券、「MHAM TOPIXマザーファンド」受益証券、及び「MHAM外国株式インデックスマザーファンド」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、すべて同マザーファンドの受益証券です。なお、同マザーファンドの状況は次の通りです。

MHAM日本債券インデックスマザーファンド

なお、以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

（単位：円）

（平成30年 5月 8日現在）

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,577,712,564
国債証券	130,409,122,550
地方債証券	7,462,391,800
特殊債券	8,518,486,265
社債券	5,166,585,000
未収利息	269,868,785

(平成30年 5月 8日現在)

前払費用	33,602,260
流動資産合計	153,437,769,224
資産合計	153,437,769,224
負債の部	
流動負債	
未払金	781,578,800
未払解約金	41,320,000
未払利息	3,711
流動負債合計	822,902,511
負債合計	822,902,511
純資産の部	
元本等	
元本	123,838,085,315
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	28,776,781,398
元本等合計	152,614,866,713
純資産合計	152,614,866,713
負債純資産合計	153,437,769,224

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	(自 平成29年 5月 9日 至 平成30年 5月 8日)
1 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券 原則として時価で評価しております。
2 収益・費用の計上基準	有価証券売買等損益及び派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	(平成30年 5月 8日現在)
1 計算期間末日における受益権の総数	123,838,085,315口
2 計算期間末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産の額 1.2324円 (1万口当たり純資産の額) (12,324円)

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	(自 平成29年 5月 9日 至 平成30年 5月 8日)
1 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める投資を目的とする証券投資信託であり、証券投資信託約款および投資ガイドラインに基づいて運用しております。
2 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 なお、詳細は附属明細表をご参照下さい。 これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドは信託財産に属する資産の効率的な運用に資することを目的として、債券先物取引を行っており、当該デリバティブ取引は対象とする株価指数等に係る価格変動リスクを有しております。
3 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。 リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。 なお、具体的には以下のリスクの管理を行っております。 市場リスクの管理 市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。 信用リスクの管理 信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。 流動性リスクの管理 流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。
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については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成30年 5月 8日現在)
1 貸借対照表日における貸借対照表の科目ごとの計上額・時価・時価との差額	貸借対照表に計上している金融商品は、原則として時価評価としているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

項目	(平成30年 5月 8日現在)
2 貸借対照表の科目ごとの時価の算定方法	<p>(1)有価証券</p> <p>国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券</p> <p>わが国の金融商品取引所または海外取引所に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）（外貨建証券を除く）、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除く）または価格情報会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できない場合または入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>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、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

（自 平成29年 5月 9日 至 平成30年 5月 8日）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	149,098,650
地方債証券	41,109,400
特殊債券	34,538,280
社債券	29,304,000
合計	254,050,330

（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。

（その他の注記）

項目	期別 (平成30年 5月 8日現在)
期首	平成29年 5月 9日
親投資信託の期首における元本額	85,488,693,568円
期中追加設定元本額	66,817,740,491円
期中一部解約元本額	28,468,348,744円
期末元本額及びその内訳として当該親投資信託受益証券を投資対象とする委託者指図型投資信託ごとの元本額	
期末元本額	123,838,085,315円
動的パッケージファンド<DC年金>	173,532,925円
コア資産形成ファンド	164,868,710円
MHAM日本債券インデックスファンド(ファンドラップ)	64,428,693,190円
MHAM日本債券インデックスファンド	184,911,086円
MHAM動的パッケージファンド[適格機関投資家限定]	42,854,922,587円
MHAM日本債券パッシブファンド[適格機関投資家限定]	9,461,135,572円
MHAM動的パッケージ4資産ファンド[適格機関投資家限定]	6,570,021,245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 5月 8日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	日本・円	第377回利付国債(2年)	240,000,000	240,621,600	
		第378回利付国債(2年)	550,000,000	551,529,000	
		第379回利付国債(2年)	250,000,000	250,745,000	
		第380回利付国債(2年)	1,790,000,000	1,795,692,200	
		第381回利付国債(2年)	960,000,000	963,244,800	
		第382回利付国債(2年)	150,000,000	150,537,000	
		第383回利付国債(2年)	400,000,000	401,508,000	
		第384回利付国債(2年)	200,000,000	200,794,000	
		第385回利付国債(2年)	500,000,000	502,085,000	

第386回利付国債(2年)	690,000,000	693,001,500	
第118回利付国債(5年)	600,000,000	602,244,000	
第119回利付国債(5年)	430,000,000	431,126,600	
第120回利付国債(5年)	900,000,000	904,059,000	
第121回利付国債(5年)	440,000,000	441,381,600	
第122回利付国債(5年)	1,200,000,000	1,204,368,000	
第123回利付国債(5年)	1,400,000,000	1,405,740,000	
第124回利付国債(5年)	1,790,000,000	1,798,341,400	
第125回利付国債(5年)	1,230,000,000	1,236,420,600	
第126回利付国債(5年)	1,260,000,000	1,267,270,200	
第127回利付国債(5年)	1,550,000,000	1,559,796,000	
第128回利付国債(5年)	1,280,000,000	1,288,998,400	
第129回利付国債(5年)	1,560,000,000	1,571,856,000	
第130回利付国債(5年)	1,470,000,000	1,481,745,300	
第131回利付国債(5年)	1,690,000,000	1,704,094,600	
第132回利付国債(5年)	1,120,000,000	1,129,721,600	
第133回利付国債(5年)	1,460,000,000	1,473,446,600	
第134回利付国債(5年)	1,390,000,000	1,403,538,600	
第135回利付国債(5年)	560,000,000	565,745,600	
第1回利付国債(40年)	110,000,000	158,736,600	
第2回利付国債(40年)	190,000,000	265,361,600	
第3回利付国債(40年)	180,000,000	252,644,400	
第4回利付国債(40年)	300,000,000	423,051,000	
第5回利付国債(40年)	260,000,000	352,523,600	
第6回利付国債(40年)	290,000,000	385,363,600	
第7回利付国債(40年)	330,000,000	418,598,400	
第8回利付国債(40年)	360,000,000	423,295,200	
第9回利付国債(40年)	470,000,000	400,806,600	
第10回利付国債(40年)	480,000,000	484,180,800	
第301回利付国債(10年)	510,000,000	519,307,500	
第302回利付国債(10年)	350,000,000	355,999,000	
第303回利付国債(10年)	590,000,000	602,401,800	
第304回利付国債(10年)	330,000,000	336,484,500	
第305回利付国債(10年)	1,020,000,000	1,043,623,200	
第306回利付国債(10年)	540,000,000	555,373,800	
第307回利付国債(10年)	270,000,000	277,182,000	

第308回利付国債(10年)	360,000,000	370,875,600	
第309回利付国債(10年)	600,000,000	615,582,000	
第310回利付国債(10年)	680,000,000	698,156,000	
第311回利付国債(10年)	350,000,000	357,686,000	
第312回利付国債(10年)	1,970,000,000	2,038,240,800	
第313回利付国債(10年)	940,000,000	978,342,600	
第314回利付国債(10年)	370,000,000	382,964,800	
第315回利付国債(10年)	830,000,000	864,519,700	
第316回利付国債(10年)	330,000,000	342,695,100	
第317回利付国債(10年)	410,000,000	426,982,200	
第318回利付国債(10年)	1,180,000,000	1,224,887,200	
第319回利付国債(10年)	480,000,000	501,268,800	
第320回利付国債(10年)	780,000,000	811,730,400	
第321回利付国債(10年)	820,000,000	855,473,200	
第322回利付国債(10年)	850,000,000	883,473,000	
第323回利付国債(10年)	890,000,000	927,157,500	
第324回利付国債(10年)	810,000,000	840,464,100	
第325回利付国債(10年)	1,180,000,000	1,226,846,000	
第326回利付国債(10年)	520,000,000	539,416,800	
第327回利付国債(10年)	820,000,000	854,423,600	
第328回利付国債(10年)	1,390,000,000	1,437,899,400	
第329回利付国債(10年)	1,630,000,000	1,705,420,100	
第330回利付国債(10年)	1,160,000,000	1,216,004,800	
第331回利付国債(10年)	460,000,000	477,245,400	
第332回利付国債(10年)	1,560,000,000	1,620,294,000	
第333回利付国債(10年)	1,380,000,000	1,435,269,000	
第334回利付国債(10年)	1,360,000,000	1,415,950,400	
第335回利付国債(10年)	1,270,000,000	1,315,872,400	
第336回利付国債(10年)	640,000,000	663,801,600	
第337回利付国債(10年)	920,000,000	941,997,200	
第338回利付国債(10年)	1,320,000,000	1,361,368,800	
第339回利付国債(10年)	1,330,000,000	1,372,732,900	
第340回利付国債(10年)	1,360,000,000	1,404,730,400	
第341回利付国債(10年)	1,610,000,000	1,651,811,700	
第342回利付国債(10年)	1,450,000,000	1,464,848,000	
第343回利付国債(10年)	1,200,000,000	1,211,700,000	

第344回利付国債(10年)	1,390,000,000	1,402,801,900	
第345回利付国債(10年)	1,100,000,000	1,109,471,000	
第346回利付国債(10年)	1,330,000,000	1,340,586,800	
第347回利付国債(10年)	1,160,000,000	1,168,433,200	
第348回利付国債(10年)	1,050,000,000	1,057,350,000	
第349回利付国債(10年)	1,080,000,000	1,086,717,600	
第350回利付国債(10年)	710,000,000	713,834,000	
第1回利付国債(30年)	10,000,000	13,041,900	
第11回利付国債(30年)	50,000,000	60,427,000	
第12回利付国債(30年)	30,000,000	38,100,300	
第13回利付国債(30年)	50,000,000	62,820,000	
第14回利付国債(30年)	50,000,000	65,999,000	
第15回利付国債(30年)	60,000,000	80,290,800	
第16回利付国債(30年)	90,000,000	120,701,700	
第17回利付国債(30年)	70,000,000	92,971,900	
第18回利付国債(30年)	80,000,000	105,091,200	
第19回利付国債(30年)	80,000,000	105,360,000	
第20回利付国債(30年)	130,000,000	175,758,700	
第21回利付国債(30年)	110,000,000	145,110,900	
第22回利付国債(30年)	70,000,000	94,902,500	
第23回利付国債(30年)	150,000,000	203,722,500	
第24回利付国債(30年)	80,000,000	108,837,600	
第25回利付国債(30年)	130,000,000	172,347,500	
第26回利付国債(30年)	220,000,000	296,135,400	
第27回利付国債(30年)	200,000,000	273,526,000	
第28回利付国債(30年)	410,000,000	562,224,800	
第29回利付国債(30年)	430,000,000	583,716,400	
第30回利付国債(30年)	370,000,000	496,758,300	
第31回利付国債(30年)	340,000,000	451,142,600	
第32回利付国債(30年)	440,000,000	594,915,200	
第33回利付国債(30年)	490,000,000	634,035,500	
第34回利付国債(30年)	440,000,000	589,837,600	
第35回利付国債(30年)	520,000,000	676,821,600	
第36回利付国債(30年)	490,000,000	639,200,100	
第37回利付国債(30年)	640,000,000	822,995,200	
第38回利付国債(30年)	320,000,000	404,828,800	

第39回利付国債(30年)	370,000,000	477,063,200	
第40回利付国債(30年)	230,000,000	291,405,400	
第41回利付国債(30年)	240,000,000	298,617,600	
第42回利付国債(30年)	300,000,000	373,464,000	
第43回利付国債(30年)	400,000,000	498,212,000	
第44回利付国債(30年)	330,000,000	411,701,400	
第45回利付国債(30年)	400,000,000	479,868,000	
第46回利付国債(30年)	430,000,000	515,948,400	
第47回利付国債(30年)	550,000,000	673,552,000	
第48回利付国債(30年)	440,000,000	517,272,800	
第49回利付国債(30年)	360,000,000	423,216,000	
第50回利付国債(30年)	490,000,000	502,005,000	
第51回利付国債(30年)	510,000,000	457,240,500	
第52回利付国債(30年)	390,000,000	368,483,700	
第53回利付国債(30年)	490,000,000	474,917,800	
第54回利付国債(30年)	430,000,000	438,741,900	
第55回利付国債(30年)	350,000,000	356,737,500	
第56回利付国債(30年)	470,000,000	478,530,500	
第57回利付国債(30年)	420,000,000	427,156,800	
第58回利付国債(30年)	240,000,000	243,818,400	
第46回利付国債(20年)	40,000,000	41,977,200	
第59回利付国債(20年)	10,000,000	10,837,300	
第64回利付国債(20年)	30,000,000	33,219,600	
第65回利付国債(20年)	60,000,000	66,721,200	
第67回利付国債(20年)	50,000,000	55,831,500	
第70回利付国債(20年)	50,000,000	57,584,500	
第71回利付国債(20年)	40,000,000	45,576,000	
第72回利付国債(20年)	110,000,000	125,185,500	
第73回利付国債(20年)	40,000,000	45,458,400	
第74回利付国債(20年)	40,000,000	45,724,000	
第75回利付国債(20年)	40,000,000	45,922,400	
第76回利付国債(20年)	70,000,000	79,399,600	
第77回利付国債(20年)	40,000,000	45,646,800	
第78回利付国債(20年)	60,000,000	68,329,800	
第79回利付国債(20年)	50,000,000	57,298,500	
第80回利付国債(20年)	90,000,000	103,779,000	

第81回利付国債(20年)	160,000,000	184,116,800	
第82回利付国債(20年)	140,000,000	162,136,800	
第83回利付国債(20年)	70,000,000	81,412,800	
第84回利付国債(20年)	170,000,000	196,418,000	
第85回利付国債(20年)	150,000,000	175,111,500	
第86回利付国債(20年)	120,000,000	141,980,400	
第87回利付国債(20年)	120,000,000	141,034,800	
第88回利付国債(20年)	240,000,000	285,256,800	
第89回利付国債(20年)	10,000,000	11,804,400	
第90回利付国債(20年)	170,000,000	201,460,200	
第91回利付国債(20年)	110,000,000	131,278,400	
第92回利付国債(20年)	290,000,000	342,324,700	
第93回利付国債(20年)	120,000,000	141,145,200	
第94回利付国債(20年)	220,000,000	260,715,400	
第95回利付国債(20年)	200,000,000	241,488,000	
第96回利付国債(20年)	120,000,000	142,708,800	
第97回利付国債(20年)	160,000,000	192,520,000	
第98回利付国債(20年)	160,000,000	191,025,600	
第99回利付国債(20年)	300,000,000	359,373,000	
第100回利付国債(20年)	230,000,000	278,668,000	
第101回利付国債(20年)	130,000,000	160,061,200	
第102回利付国債(20年)	140,000,000	173,023,200	
第103回利付国債(20年)	160,000,000	196,131,200	
第104回利付国債(20年)	110,000,000	132,627,000	
第105回利付国債(20年)	240,000,000	290,292,000	
第106回利付国債(20年)	150,000,000	182,977,500	
第107回利付国債(20年)	300,000,000	363,984,000	
第108回利付国債(20年)	390,000,000	464,961,900	
第109回利付国債(20年)	340,000,000	406,419,000	
第110回利付国債(20年)	240,000,000	292,051,200	
第111回利付国債(20年)	170,000,000	209,358,400	
第112回利付国債(20年)	450,000,000	549,234,000	
第113回利付国債(20年)	740,000,000	905,826,600	
第114回利付国債(20年)	490,000,000	601,494,600	
第115回利付国債(20年)	160,000,000	198,240,000	
第116回利付国債(20年)	360,000,000	447,321,600	

第117回利付国債(20年)	370,000,000	455,421,900	
第118回利付国債(20年)	185,000,000	226,260,550	
第119回利付国債(20年)	330,000,000	395,491,800	
第120回利付国債(20年)	220,000,000	258,416,400	
第121回利付国債(20年)	310,000,000	376,095,100	
第122回利付国債(20年)	330,000,000	396,353,100	
第123回利付国債(20年)	380,000,000	471,751,000	
第124回利付国債(20年)	180,000,000	221,094,000	
第125回利付国債(20年)	210,000,000	263,827,200	
第126回利付国債(20年)	170,000,000	209,292,100	
第127回利付国債(20年)	220,000,000	268,076,600	
第128回利付国債(20年)	450,000,000	549,517,500	
第129回利付国債(20年)	250,000,000	302,082,500	
第130回利付国債(20年)	550,000,000	665,863,000	
第131回利付国債(20年)	170,000,000	203,595,400	
第132回利付国債(20年)	350,000,000	419,590,500	
第133回利付国債(20年)	350,000,000	424,511,500	
第134回利付国債(20年)	320,000,000	388,800,000	
第135回利付国債(20年)	170,000,000	204,258,400	
第136回利付国債(20年)	260,000,000	308,890,400	
第137回利付国債(20年)	250,000,000	300,857,500	
第138回利付国債(20年)	260,000,000	305,767,800	
第139回利付国債(20年)	270,000,000	321,227,100	
第140回利付国債(20年)	560,000,000	674,951,200	
第141回利付国債(20年)	400,000,000	482,464,000	
第142回利付国債(20年)	230,000,000	280,864,500	
第143回利付国債(20年)	390,000,000	465,449,400	
第144回利付国債(20年)	250,000,000	294,782,500	
第145回利付国債(20年)	600,000,000	725,652,000	
第146回利付国債(20年)	620,000,000	750,262,000	
第147回利付国債(20年)	780,000,000	932,653,800	
第148回利付国債(20年)	620,000,000	732,102,200	
第149回利付国債(20年)	700,000,000	827,211,000	
第150回利付国債(20年)	720,000,000	840,283,200	
第151回利付国債(20年)	630,000,000	715,207,500	
第152回利付国債(20年)	830,000,000	941,585,200	

		第153回利付国債（20年）	670,000,000	770,908,700	
		第154回利付国債（20年）	630,000,000	714,161,700	
		第155回利付国債（20年）	840,000,000	922,941,600	
		第156回利付国債（20年）	550,000,000	547,261,000	
		第157回利付国債（20年）	640,000,000	613,196,800	
		第158回利付国債（20年）	760,000,000	766,444,800	
		第159回利付国債（20年）	540,000,000	552,960,000	
		第160回利付国債（20年）	480,000,000	499,128,000	
		第161回利付国債（20年）	490,000,000	499,853,900	
		第162回利付国債（20年）	500,000,000	508,825,000	
		第163回利付国債（20年）	530,000,000	538,501,200	
		第164回利付国債（20年）	340,000,000	338,470,000	
	小計	銘柄数：237 組入時価比率：85.4%	120,565,000,000	130,409,122,550 86.1%	
	合計			130,409,122,550	
地方債証券	日本・円	第1回東京都公募公債（20年）	100,000,000	107,684,000	
		第7回東京都公募公債（20年）	100,000,000	115,276,000	
		第18回東京都公募公債（20年）	100,000,000	121,153,000	
		第21回東京都公募公債（20年）	100,000,000	121,834,000	
		第681回東京都公募公債	100,000,000	102,540,000	
		第687回東京都公募公債	100,000,000	102,563,000	
		第719回東京都公募公債	200,000,000	208,014,000	
		第760回東京都公募公債	100,000,000	99,346,000	
		平成28年度第6回北海道公募公債	100,000,000	99,358,000	
		第3回神奈川県公募公債（30年）	100,000,000	135,533,000	
		第176回神奈川県公募公債	100,000,000	102,658,000	
		第213回神奈川県公募公債	100,000,000	103,064,000	
		第13回大阪府公募公債（20年）	100,000,000	110,189,000	
		第368回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	103,731,000	
		第413回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	98,859,000	
		第419回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	100,140,000	
		第2回兵庫県公募公債（30年）	100,000,000	131,843,000	
		第5回兵庫県公募公債（12年）	100,000,000	104,289,000	
		第2回静岡県公募公債（15年）	100,000,000	110,866,000	

第4回静岡県公募公債（15年）	100,000,000	111,182,000	
平成24年度第12回愛知県公募公債（30年）	100,000,000	129,009,000	
第13回埼玉県公募公債（20年）	100,000,000	116,837,000	
平成25年度第8回埼玉県公募公債	100,000,000	103,639,000	
平成24年度第1回福岡県公募公債（15年）	100,000,000	110,750,000	
平成28年度第8回福岡県公募公債	100,000,000	100,661,000	
平成25年度第6回千葉県公募公債	100,000,000	104,055,000	
平成27年度第9回千葉県公募公債	100,000,000	99,767,000	
平成25年度第2回新潟県公募公債	100,000,000	103,532,000	
第7回群馬県公募公債（10年）	100,000,000	102,663,000	
第77回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,945,000	
第80回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,332,000	
第87回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,671,000	
第94回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,272,000	
第97回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,975,000	
第100回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,765,000	
第105回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,752,000	
第115回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,411,000	
第118回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,791,000	
第127回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,434,000	
第132回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,515,000	
第146回共同発行市場公募地方債	200,000,000	206,528,000	
第153回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,754,000	
第157回共同発行市場公募地方債	120,000,000	119,590,800	
第174回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,676,000	
第178回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,381,000	
平成23年度第2回堺市公募公債	100,000,000	103,696,000	
平成26年度第1回長崎県公募公債	100,000,000	103,050,000	
平成22年度第1回栃木県公募公債	100,000,000	102,600,000	
平成23年度第1回新潟市公募公債（10年）	100,000,000	103,710,000	
平成27年度第1回奈良県公募公債	100,000,000	100,169,000	
平成26年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	102,835,000	
平成26年度第1回浜松市公募公債	100,000,000	101,668,000	
第6回大阪市公募公債（20年）	200,000,000	241,170,000	

		第16回名古屋市公募公債(20年)	100,000,000	115,864,000	
		第467回名古屋市公募公債(10年)	100,000,000	101,770,000	
		平成26年度第4回神戸市公募公債	100,000,000	103,306,000	
		平成23年度第5回横浜市公募公債	100,000,000	103,631,000	
		第29回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	116,035,000	
		平成26年度第4回札幌市公募公債(10年)	100,000,000	102,863,000	
		第41回川崎市公募公債(5年)	100,000,000	100,175,000	
		第6回北九州市公募公債(20年)	100,000,000	118,718,000	
		平成26年度第3回広島市公募公債	100,000,000	102,326,000	
		第8回さいたま市公募公債	100,000,000	103,087,000	
		平成26年度第1回相模原市公募公債	100,000,000	102,878,000	
		平成26年度第1回三重県公募公債	100,000,000	102,481,000	
		第7回広島県・広島市折半保証広島高速道路債券	100,000,000	102,749,000	
		第119回福岡北九州高速道路債券	100,000,000	101,783,000	
	小計	銘柄数:67 組入時価比率:4.9%	7,020,000,000	7,462,391,800	4.9%
	合計			7,462,391,800	
特殊債券	日本・円	第19回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	103,341,000	
		第78回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	100,218,000	
		第28回道路債券	100,000,000	134,840,000	
		第75回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	120,256,000	
		第89回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,851,000	
		第95回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,007,000	
		第97回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	121,337,000	
		第98回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,298,000	
		第101回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	206,500,000	

第116回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	122,277,000	
第124回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	101,000,000	104,269,370	
第124回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	115,584,000	
第133回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	116,000,000	120,579,680	
第139回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,434,000	
第142回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,400,000	
第147回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,566,000	
第153回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	119,490,000	
第155回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	111,647,000	
第162回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	121,411,000	
第170回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,568,000	
第177回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,792,000	
第188回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	114,529,000	
第195回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,816,000	
第202回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	105,000,000	109,053,000	
第211回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,777,000	
第218回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,876,000	
第220回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	207,652,000	
第250回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	112,909,000	
第254回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,915,000	
第300回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,153,000	
第337回政府保証日本高速道路保	100,000,000	100,920,000	

有・債務返済機構債券			
第11回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,797,000	
第13回地方公共団体金融機構債券 (20年)	100,000,000	121,780,000	
第15回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,426,000	
第23回地方公共団体金融機構債券 (20年)	100,000,000	117,064,000	
第24回政府保証地方公共団体金融 機構債券	100,000,000	103,430,000	
第29回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,381,000	
第36回政府保証地方公共団体金融 機構債券	100,000,000	103,737,000	
第36回地方公共団体金融機構債券 (20年)	100,000,000	115,925,000	
第38回政府保証地方公共団体金融 機構債券	100,000,000	103,620,000	
第40回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,328,000	
第44回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,370,000	
第59回地方公共団体金融機構債券 (20年)	100,000,000	100,577,000	
第71回政府保証地方公共団体金融 機構債券	100,000,000	102,451,000	
第98回政府保証地方公共団体金融 機構債券	100,000,000	100,408,000	
第103回政府保証地方公共団体金 融機構債券	100,000,000	100,094,000	
F147回地方公共団体金融機構債 券	200,000,000	219,196,000	
第30回政府保証日本政策金融公庫 債券	100,000,000	100,406,000	
第23回国際協力銀行債券	100,000,000	114,781,000	
第93回都市再生債券	100,000,000	108,677,000	
第20回独立行政法人福祉医療機構 債券	100,000,000	101,916,000	
第21回政府保証中部国際空港債券	100,000,000	102,839,000	
第4回貸付債権担保住宅金融支援機 構債券	18,209,000	19,298,626	
第27回貸付債権担保住宅金融支援 機構債券	29,202,000	31,425,440	
第38回貸付債権担保住宅金融支援 機構債券	41,266,000	43,507,156	

第44回貸付債権担保住宅金融公庫債券	17,021,000	18,079,365	
第49回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	38,959,000	41,388,093	
第52回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	45,496,000	48,006,924	
第53回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	47,407,000	49,991,629	
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	55,364,000	58,153,238	
第76回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	52,793,000	55,239,955	
第82回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	60,705,000	62,979,616	
第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	62,899,000	65,314,950	
第86回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	65,741,000	68,247,704	
第90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	68,654,000	70,801,497	
第93回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	74,101,000	75,236,968	
第96回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	82,412,000	84,386,591	
第99回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	83,307,000	86,032,805	
第117回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,505,000	96,154,434	
第118回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,890,000	96,691,640	
第119回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,894,000	96,610,328	
第124回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	111,433,000	
第130回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	199,774,000	200,431,256	
第159回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	108,867,000	
第172回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,654,000	
い第770号商工債	100,000,000	100,121,000	
い第777号商工債	100,000,000	100,170,000	

小計		い第780号商工債	100,000,000	100,254,000	
		い第785号商工債	100,000,000	100,258,000	
		い第772号農林債	100,000,000	100,284,000	
		第326回信金中金債(5年)	100,000,000	99,795,000	
		第331回信金中金債(5年)	100,000,000	99,855,000	
		第18回国際協力機構債券	100,000,000	104,011,000	
		第78回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	105,337,000	
		銘柄数: 84	8,052,599,000	8,518,486,265	
		組入時価比率: 5.6%		5.6%	
合計				8,518,486,265	
社債券	日本・円	第8回ノルデア・バンク・アクツイエポラーク・プブリクト円貨社債(2015)	100,000,000	100,260,000	
		第11回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債(2016)	100,000,000	99,965,000	
		第344回東京交通債券	100,000,000	107,445,000	
		第16回成田国際空港株式会社社債	100,000,000	102,660,000	
		第11回ナショナル・オーストラリア銀行円貨社債(2015)	100,000,000	100,161,000	
		第27回コーペラティブ・セントラル・ライフアイゼン・ポエレンリーバンク・ビーエー(ラボバンク)円貨社債(2015)	100,000,000	100,459,000	
		第26回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,301,000	
		第56回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	103,480,000	
		第26回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	103,041,000	
		第22回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	100,179,000	
		第10回麒麟ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	102,405,000	
		第9回日本たばこ産業株式会社社債	100,000,000	100,264,000	
		第8回株式会社セブン&アイ・ホールディングス無担保社債	100,000,000	100,280,000	
		第49回住友化学株式会社無担保社債	100,000,000	104,024,000	
		第4回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	100,000,000	100,563,000	

第65回新日鐵住金株式会社無担保社債	100,000,000	101,969,000	
第23回株式会社豊田自動織機無担保社債	100,000,000	101,082,000	
第36回富士通株式会社無担保社債	100,000,000	101,190,000	
第17回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	100,823,000	
第29回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	102,500,000	
第53回株式会社クレディセゾン無担保社債	100,000,000	100,553,000	
第57回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	109,364,000	
第88回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	117,990,000	
第12回株式会社りそな銀行無担保社債	100,000,000	116,766,000	
第9回株式会社セブン銀行無担保社債	100,000,000	100,712,000	
第38回株式会社みずほ銀行無担保社債	100,000,000	100,292,000	
第12回東京センチュリーリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,263,000	
第31回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	100,727,000	
第60回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	100,132,000	
第29回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,199,000	
第16回株式会社大和証券グループ本社無担保社債	100,000,000	101,399,000	
第112回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	101,059,000	
第86回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	100,576,000	
第71回東京急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	102,792,000	
第64回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	102,194,000	
第65回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	120,627,000	
第21回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	120,873,000	

	第7回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	108,486,000	
	第62回日本電信電話株式会社電信電話債券	100,000,000	102,892,000	
	第527回中部電力株式会社社債	100,000,000	101,205,000	
	第484回関西電力株式会社社債	100,000,000	102,237,000	
	第382回中国電力株式会社社債	100,000,000	101,282,000	
	第311回北陸電力株式会社社債	100,000,000	104,324,000	
	第488回東北電力株式会社社債	100,000,000	99,363,000	
	第428回九州電力株式会社社債	100,000,000	103,848,000	
	第321回北海道電力株式会社社債	100,000,000	103,642,000	
	第54回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	99,787,000	
	第34回東京瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	103,364,000	
	第30回大阪瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	103,019,000	
	第27回株式会社エヌ・ティ・ティ・データ無担保社債	100,000,000	103,567,000	
小計	銘柄数：50 組入時価比率：3.4%	5,000,000,000	5,166,585,000	3.4%
合計			5,166,585,000	
	合計		151,556,585,615	

（注1）比率は左より組入時価の純資産総額に対する比率、及び各小計欄の合計金額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。

MHAM外国債券インデックスマザーファンド

なお、以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

(単位：円)

(平成30年 5月 8日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	131,770,527
コール・ローン	293,141,245
国債証券	15,438,574,316
派生商品評価勘定	35,468
未収利息	98,412,936
前払金	52,014,954
前払費用	27,781,145
流動資産合計	16,041,730,591
資産合計	16,041,730,591
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	460,572
未払金	108,328,253
未払解約金	100,000
未払利息	689
流動負債合計	108,889,514
負債合計	108,889,514
純資産の部	
元本等	
元本	12,804,000,846
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金()	3,128,840,231
元本等合計	15,932,841,077
純資産合計	15,932,841,077
負債純資産合計	16,041,730,591

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	(自 平成29年 5月 9日 至 平成30年 5月 8日)
1 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 原則として時価で評価しております。
2 派生商品等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として時価で評価しております。

項目	(自 平成29年 5月 9日 至 平成30年 5月 8日)
3 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算し、為替予約の評価は計算期間末日に残高がある場合、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。
4 収益・費用の計上基準	有価証券売買等損益、派生商品取引等損益及び為替差損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	(平成30年 5月 8日現在)
1 計算期間末日における受益権の総数	12,804,000,846口
2 計算期間末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産の額 1.2444円 (1万口当たり純資産の額) (12,444円)

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	(自 平成29年 5月 9日 至 平成30年 5月 8日)
1 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める投資を目的とする証券投資信託であり、証券投資信託約款および投資ガイドラインに基づいて運用しております。
2 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 なお、詳細は附属明細表をご参照下さい。 これらは、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 当ファンドは信託財産に属する資産の効率的な運用に資することを目的として、債券先物取引を行っており、当該デリバティブ取引は対象とする株価指数等に係る価格変動リスクを有しております。 また、外貨建証券の売買等の決済に伴い必要となる外貨の売買のために、為替予約取引を行っております。

項目	(自 平成29年 5月 9日 至 平成30年 5月 8日)
3 金融商品に係るリスク管理体制	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>なお、具体的には以下のリスクの管理を行っております。</p> <p>市場リスクの管理 市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。</p> <p>信用リスクの管理 信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。</p> <p>流動性リスクの管理 流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。</p>
4 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>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る場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。</p>

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成30年 5月 8日現在)
1 貸借対照表日における貸借対照表の科目ごとの計上額・時価・時価との差額	<p>貸借対照表に計上している金融商品は、原則として時価評価としているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
2 貸借対照表の科目ごとの時価の算定方法	<p>(1)有価証券</p> <p>国債証券</p> <p>わが国の金融商品取引所または海外取引所に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）（外貨建証券を除く）、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除く）または価格情報会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できない場合または入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認められた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認められた価額で評価しております。</p>

項目	(平成30年 5月 8日現在)
	(2)デリバティブ取引 為替予約取引 デリバティブ取引等に関する注記に記載しております。
	(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 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、時価は帳簿価額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。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

(自 平成29年 5月 9日 至 平成30年 5月 8日)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額 (円)
国債証券	187,940,026
合計	187,940,026

(デリバティブ取引等に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(通貨関連)

(平成30年 5月 8日現在)

区分	種類	契約額等 (円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	289,250,000	-	288,824,896	425,104
	米・ドル	124,720,000	-	124,674,206	45,794
	カナダ・ドル	6,030,000	-	6,016,833	13,167
	メキシコ・ペソ	3,710,000	-	3,673,916	36,084
	ユーロ	115,050,000	-	114,732,182	317,818
	英・ポンド	18,360,000	-	18,395,468	35,468
	スウェーデン・クローナ	2,430,000	-	2,422,142	7,858
	ノルウェー・クローネ	1,680,000	-	1,677,514	2,486
	デンマーク・クローネ	4,020,000	-	4,008,507	11,493

	オーストラリア・ドル	4,670,000	-	4,663,451	6,549
	シンガポール・ドル	4,360,000	-	4,352,797	7,203
	南アフリカ・ランド	4,220,000	-	4,207,880	12,120
	合計	289,250,000	-	288,824,896	425,104

(注) 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

(その他の注記)

項目	期別 (平成30年 5月 8日現在)
期首	平成29年 5月 9日
親投資信託の期首における元本額	9,414,646,557円
期中追加設定元本額	9,053,609,467円
期中一部解約元本額	5,664,255,178円
期末元本額及びその内訳として当該親投資信託受益証券を投資対象とする委託者指図型投資信託ごとの元本額	
期末元本額	12,804,000,846円
動的パッケージファンド<DC年金>	31,750,047円
コア資産形成ファンド	30,203,446円
MHAM外国債券インデックスファンド(ファンドラップ)	857,483,042円
MHAM外国債券インデックスファンド	70,035,970円
MHAM外国債券インデックスファンド<為替ヘッジあり>(ファンドラップ)	592,393,466円
MHAM動的パッケージファンド[適格機関投資家限定]	7,858,020,540円
MHAM外国債券パッシブファンド[適格機関投資家限定]	3,364,114,335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 5月 8日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	米・ドル	US TREASURY N/B 0.75%	340,000.00	333,678.12	
		US TREASURY N/B 0.75%	330,000.00	323,271.09	
		US TREASURY N/B 0.875%	310,000.00	305,519.53	
		US TREASURY N/B 0.875%	160,000.00	157,462.50	
		US TREASURY N/B 1.125%	150,000.00	146,800.78	
		US TREASURY N/B 1.125%	130,000.00	126,709.37	
		US TREASURY N/B 1.125%	140,000.00	136,237.50	
		US TREASURY N/B 1.125%	220,000.00	211,010.93	
		US TREASURY N/B 1.125%	340,000.00	324,195.31	
		US TREASURY N/B 1.125%	140,000.00	133,273.43	
		US TREASURY N/B 1.125%	380,000.00	361,266.00	
		US TREASURY N/B 1.125%	850,000.00	806,735.00	
		US TREASURY N/B 1.25%	100,000.00	98,992.18	
		US TREASURY N/B 1.25%	400,000.00	395,468.75	
		US TREASURY N/B 1.25%	490,000.00	483,913.28	
		US TREASURY N/B 1.25%	320,000.00	315,275.00	
		US TREASURY N/B 1.25%	130,000.00	127,328.90	
		US TREASURY N/B 1.25%	120,000.00	117,375.00	
		US TREASURY N/B 1.25%	600,000.00	576,703.12	
		US TREASURY N/B 1.25%	300,000.00	285,609.37	
		US TREASURY N/B 1.25%	150,000.00	138,675.00	
		US TREASURY N/B 1.375%	200,000.00	197,593.75	
		US TREASURY N/B 1.375%	120,000.00	117,965.62	
		US TREASURY N/B 1.375%	130,000.00	127,613.28	
		US TREASURY N/B 1.375%	220,000.00	215,771.87	
		US TREASURY N/B 1.375%	330,000.00	323,451.56	
		US TREASURY N/B 1.375%	250,000.00	244,804.68	
		US TREASURY N/B 1.375%	300,000.00	293,343.75	
		US TREASURY N/B 1.375%	300,000.00	292,992.18	
		US TREASURY N/B 1.375%	250,000.00	243,281.25	
		US TREASURY N/B 1.375%	190,000.00	184,671.09	
		US TREASURY N/B 1.375%	610,000.00	592,128.90	
		US TREASURY N/B 1.375%	110,000.00	106,382.03	
		US TREASURY N/B 1.375%	160,000.00	154,162.50	
US TREASURY N/B 1.375%	110,000.00	105,840.62			
US TREASURY N/B 1.375%	100,000.00	93,190.00			
US TREASURY N/B 1.375%	110,000.00	102,196.87			

US TREASURY N/B 1.375%	230,000.00	213,348.00	
US TREASURY N/B 1.5%	210,000.00	208,178.90	
US TREASURY N/B 1.5%	251,400.00	247,982.53	
US TREASURY N/B 1.5%	300,000.00	295,640.62	
US TREASURY N/B 1.5%	1,070,000.00	1,049,519.53	
US TREASURY N/B 1.5%	100,000.00	97,984.37	
US TREASURY N/B 1.5%	250,000.00	244,785.15	
US TREASURY N/B 1.5%	1,290,000.00	1,262,587.50	
US TREASURY N/B 1.5%	210,000.00	200,910.93	
US TREASURY N/B 1.5%	240,000.00	226,162.50	
US TREASURY N/B 1.5%	420,000.00	395,292.18	
US TREASURY N/B 1.5%	390,000.00	348,928.12	
US TREASURY N/B 1.625%	200,000.00	198,687.50	
US TREASURY N/B 1.625%	250,000.00	247,910.15	
US TREASURY N/B 1.625%	310,000.00	307,166.40	
US TREASURY N/B 1.625%	300,000.00	296,976.56	
US TREASURY N/B 1.625%	325,000.00	320,632.81	
US TREASURY N/B 1.625%	80,000.00	78,731.25	
US TREASURY N/B 1.625%	250,000.00	245,175.78	
US TREASURY N/B 1.625%	270,000.00	264,515.62	
US TREASURY N/B 1.625%	280,000.00	273,153.12	
US TREASURY N/B 1.625%	150,000.00	143,203.12	
US TREASURY N/B 1.625%	140,000.00	133,579.68	
US TREASURY N/B 1.625%	230,000.00	218,931.25	
US TREASURY N/B 1.625%	100,000.00	94,585.93	
US TREASURY N/B 1.625%	230,000.00	217,278.12	
US TREASURY N/B 1.625%	90,000.00	84,546.00	
US TREASURY N/B 1.625%	840,000.00	764,071.87	
US TREASURY N/B 1.625%	440,000.00	398,921.87	
US TREASURY N/B 1.75%	260,000.00	257,603.12	
US TREASURY N/B 1.75%	200,000.00	195,921.87	
US TREASURY N/B 1.75%	140,000.00	136,882.81	
US TREASURY N/B 1.75%	160,000.00	154,812.50	
US TREASURY N/B 1.75%	200,000.00	192,953.12	
US TREASURY N/B 1.75%	80,000.00	77,106.25	
US TREASURY N/B 1.75%	180,000.00	173,306.25	
US TREASURY N/B 1.75%	250,000.00	240,625.00	
US TREASURY N/B 1.75%	290,000.00	278,966.40	
US TREASURY N/B 1.75%	260,000.00	249,929.05	
US TREASURY N/B 1.75%	210,000.00	201,206.25	
US TREASURY N/B 1.75%	260,000.00	248,157.80	
US TREASURY N/B 1.75%	390,000.00	370,957.03	

US TREASURY N/B 1.875%	760,000.00	753,053.12
US TREASURY N/B 1.875%	120,000.00	118,331.25
US TREASURY N/B 1.875%	250,000.00	245,449.22
US TREASURY N/B 1.875%	250,000.00	243,105.47
US TREASURY N/B 1.875%	110,000.00	106,700.00
US TREASURY N/B 1.875%	320,000.00	310,144.00
US TREASURY N/B 1.875%	110,000.00	106,474.50
US TREASURY N/B 1.875%	100,000.00	96,750.00
US TREASURY N/B 1.875%	1,060,000.00	1,024,804.68
US TREASURY N/B 1.875%	290,000.00	279,897.58
US TREASURY N/B 1.875%	210,000.00	202,485.93
US TREASURY N/B 1.875%	630,000.00	606,916.40
US TREASURY N/B 1.875%	200,000.00	192,546.87
US TREASURY N/B 1.875%	120,000.00	113,165.62
US TREASURY N/B 1%	300,000.00	295,440.00
US TREASURY N/B 1%	20,000.00	19,642.18
US TREASURY N/B 1%	450,000.00	440,402.34
US TREASURY N/B 1%	170,000.00	166,228.12
US TREASURY N/B 2.125%	210,000.00	207,883.59
US TREASURY N/B 2.125%	200,000.00	197,343.75
US TREASURY N/B 2.125%	190,000.00	186,853.12
US TREASURY N/B 2.125%	990,000.00	972,597.65
US TREASURY N/B 2.125%	250,000.00	245,332.03
US TREASURY N/B 2.125%	250,000.00	244,882.81
US TREASURY N/B 2.125%	220,000.00	214,671.87
US TREASURY N/B 2.125%	710,000.00	689,864.84
US TREASURY N/B 2.125%	130,000.00	125,281.00
US TREASURY N/B 2.125%	150,000.00	144,210.93
US TREASURY N/B 2.125%	230,000.00	220,823.00
US TREASURY N/B 2.125%	180,000.00	172,371.09
US TREASURY N/B 2.125%	180,000.00	172,096.87
US TREASURY N/B 2.125%	180,000.00	171,829.68
US TREASURY N/B 2.125%	450,000.00	427,781.25
US TREASURY N/B 2.25%	300,000.00	298,734.37
US TREASURY N/B 2.25%	340,000.00	338,432.81
US TREASURY N/B 2.25%	90,000.00	89,100.00
US TREASURY N/B 2.25%	170,000.00	168,127.34
US TREASURY N/B 2.25%	180,000.00	177,918.75
US TREASURY N/B 2.25%	300,000.00	295,945.31
US TREASURY N/B 2.25%	280,000.00	271,468.75
US TREASURY N/B 2.25%	160,000.00	154,976.00
US TREASURY N/B 2.25%	250,000.00	240,664.06
US TREASURY N/B 2.25%	440,000.00	423,362.50

US TREASURY N/B 2.25%	220,000.00	211,492.18	
US TREASURY N/B 2.25%	450,000.00	429,679.68	
US TREASURY N/B 2.25%	860,000.00	813,909.37	
US TREASURY N/B 2.25%	440,000.00	415,078.12	
US TREASURY N/B 2.25%	630,000.00	593,479.66	
US TREASURY N/B 2.25%	260,000.00	217,709.37	
US TREASURY N/B 2.375%	200,000.00	198,750.00	
US TREASURY N/B 2.375%	300,000.00	297,890.62	
US TREASURY N/B 2.375%	230,000.00	228,310.93	
US TREASURY N/B 2.375%	340,000.00	333,917.18	
US TREASURY N/B 2.375%	440,000.00	427,487.50	
US TREASURY N/B 2.375%	500,000.00	477,500.00	
US TREASURY N/B 2.5%	330,000.00	325,668.75	
US TREASURY N/B 2.5%	300,000.00	295,429.68	
US TREASURY N/B 2.5%	1,120,000.00	1,097,949.99	
US TREASURY N/B 2.5%	220,000.00	214,740.62	
US TREASURY N/B 2.5%	420,000.00	373,209.37	
US TREASURY N/B 2.5%	260,000.00	230,221.87	
US TREASURY N/B 2.5%	250,000.00	221,152.34	
US TREASURY N/B 2.625%	85,000.00	85,132.81	
US TREASURY N/B 2.625%	250,000.00	250,156.25	
US TREASURY N/B 2.625%	250,000.00	248,261.72	
US TREASURY N/B 2.625%	240,000.00	235,875.00	
US TREASURY N/B 2.75%	660,000.00	657,525.00	
US TREASURY N/B 2.75%	390,000.00	388,080.47	
US TREASURY N/B 2.75%	320,000.00	317,150.00	
US TREASURY N/B 2.75%	600,000.00	589,781.25	
US TREASURY N/B 2.75%	130,000.00	122,392.96	
US TREASURY N/B 2.75%	286,000.00	269,018.75	
US TREASURY N/B 2.75%	290,000.00	269,382.80	
US TREASURY N/B 2.75%	280,000.00	259,962.49	
US TREASURY N/B 2.875%	450,000.00	432,175.77	
US TREASURY N/B 2.875%	480,000.00	458,850.00	
US TREASURY N/B 2.875%	260,000.00	248,096.87	
US TREASURY N/B 2%	240,000.00	238,087.50	
US TREASURY N/B 2%	210,000.00	207,440.62	
US TREASURY N/B 2%	150,000.00	147,949.21	
US TREASURY N/B 2%	180,000.00	177,285.93	
US TREASURY N/B 2%	110,000.00	108,238.28	
US TREASURY N/B 2%	300,000.00	294,843.75	
US TREASURY N/B 2%	120,000.00	117,684.37	
US TREASURY N/B 2%	210,000.00	205,406.25	

US TREASURY N/B 2%	210,000.00	205,094.53
US TREASURY N/B 2%	360,000.00	351,590.62
US TREASURY N/B 2%	190,000.00	185,279.68
US TREASURY N/B 2%	250,000.00	243,574.22
US TREASURY N/B 2%	250,000.00	242,539.06
US TREASURY N/B 2%	320,000.00	309,700.00
US TREASURY N/B 2%	460,000.00	444,978.12
US TREASURY N/B 2%	390,000.00	376,380.46
US TREASURY N/B 2%	160,000.00	152,416.00
US TREASURY N/B 2%	130,000.00	123,784.37
US TREASURY N/B 2%	480,000.00	456,480.00
US TREASURY N/B 2%	650,000.00	614,199.22
US TREASURY N/B 2%	660,000.00	620,554.68
US TREASURY N/B 2%	390,000.00	362,395.31
US TREASURY N/B 3.125%	260,000.00	262,112.50
US TREASURY N/B 3.125%	300,000.00	304,031.25
US TREASURY N/B 3.125%	105,000.00	105,771.09
US TREASURY N/B 3.125%	100,000.00	100,695.31
US TREASURY N/B 3.125%	190,000.00	190,905.46
US TREASURY N/B 3.125%	370,000.00	371,011.71
US TREASURY N/B 3.375%	305,000.00	309,074.61
US TREASURY N/B 3.375%	480,000.00	502,762.49
US TREASURY N/B 3.5%	215,000.00	219,081.64
US TREASURY N/B 3.5%	90,000.00	96,482.81
US TREASURY N/B 3.625%	220,000.00	223,368.75
US TREASURY N/B 3.625%	200,000.00	203,937.50
US TREASURY N/B 3.625%	270,000.00	277,171.87
US TREASURY N/B 3.625%	320,000.00	349,000.00
US TREASURY N/B 3.625%	310,000.00	338,408.59
US TREASURY N/B 3.75%	110,000.00	122,254.68
US TREASURY N/B 3.75%	315,000.00	350,585.15
US TREASURY N/B 3.875%	280,000.00	316,553.12
US TREASURY N/B 3%	110,000.00	108,375.78
US TREASURY N/B 3%	420,000.00	411,600.00
US TREASURY N/B 3%	280,000.00	274,290.62
US TREASURY N/B 3%	320,000.00	313,150.00
US TREASURY N/B 3%	460,000.00	449,829.68
US TREASURY N/B 3%	440,000.00	430,031.24
US TREASURY N/B 3%	370,000.00	361,414.83
US TREASURY N/B 4.25%	80,000.00	95,031.25
US TREASURY N/B 4.25%	130,000.00	154,943.75
US TREASURY N/B 4.375%	50,000.00	60,054.68
US TREASURY N/B 4.375%	100,000.00	120,937.50

	US TREASURY N/B 4.375%	170,000.00	205,806.25	
	US TREASURY N/B 4.375%	100,000.00	121,460.93	
	US TREASURY N/B 4.5%	110,000.00	132,833.59	
	US TREASURY N/B 4.5%	60,000.00	73,307.81	
	US TREASURY N/B 4.5%	85,000.00	104,377.34	
	US TREASURY N/B 4.625%	260,000.00	324,918.74	
	US TREASURY N/B 4.75%	110,000.00	140,207.02	
	US TREASURY N/B 5.25%	65,000.00	78,446.87	
	US TREASURY N/B 5.375%	80,000.00	100,381.25	
	US TREASURY N/B 5.5%	50,000.00	61,230.46	
	US TREASURY N/B 5%	55,000.00	70,859.76	
	US TREASURY N/B 6.125%	80,000.00	101,018.75	
	US TREASURY N/B 6.25%	70,000.00	81,823.43	
	US TREASURY N/B 6.25%	49,000.00	65,189.14	
	US TREASURY N/B 6.5%	50,000.00	63,453.12	
	US TREASURY N/B 6%	60,000.00	72,900.00	
	US TREASURY N/B 8%	35,000.00	41,215.23	
小計	銘柄数：224	62,266,400.00	61,016,414.67	
			(6,645,297,721)	
	組入時価比率：41.7%		43.1%	
カナダ・ドル	CANADIAN GOVT 0.5%	110,000.00	103,527.60	
	CANADIAN GOVT 0.75%	230,000.00	227,145.70	
	CANADIAN GOVT 0.75%	170,000.00	165,377.70	
	CANADIAN GOVT 0.75%	320,000.00	308,886.40	
	CANADIAN GOVT 0.75%	80,000.00	76,632.80	
	CANADIAN GOVT 1.25%	270,000.00	267,297.30	
	CANADIAN GOVT 1.5%	170,000.00	168,750.50	
	CANADIAN GOVT 1.5%	100,000.00	96,752.00	
	CANADIAN GOVT 1.5%	110,000.00	103,555.10	
	CANADIAN GOVT 1.75%	100,000.00	99,930.00	
	CANADIAN GOVT 1.75%	110,000.00	109,631.50	
	CANADIAN GOVT 1.75%	100,000.00	98,150.00	
	CANADIAN GOVT 1%	200,000.00	190,674.00	
	CANADIAN GOVT 1%	150,000.00	133,828.50	
	CANADIAN GOVT 2.25%	90,000.00	89,864.10	
	CANADIAN GOVT 2.5%	120,000.00	121,870.80	
	CANADIAN GOVT 2.75%	110,000.00	112,722.50	
	CANADIAN GOVT 2.75%	120,000.00	128,640.00	
	CANADIAN GOVT 2.75%	50,000.00	55,137.50	
	CANADIAN GOVT 2%	60,000.00	58,200.00	
	CANADIAN GOVT 3.25%	85,000.00	88,082.10	
	CANADIAN GOVT 3.5%	70,000.00	72,268.00	

小計	CANADIAN GOVT 3.5%	130,000.00	159,532.10
	CANADIAN GOVT 3.75%	150,000.00	153,198.00
	CANADIAN GOVT 4%	140,000.00	178,647.00
	CANADIAN GOVT 5.75%	90,000.00	119,644.20
	CANADIAN GOVT 5.75%	100,000.00	142,657.00
	CANADIAN GOVT 5%	110,000.00	155,599.40
	CANADIAN GOVT 8%	40,000.00	58,489.20
	銘柄数：29	3,685,000.00	3,844,691.00 (325,068,624)
	組入時価比率：2.0%		2.1%
メキシコ・ペソ	MEX BONOS DESARR 10%	2,394,000.00	2,711,470.73
	MEX BONOS DESARR 10%	911,000.00	1,118,799.10
	MEX BONOS DESARR 5.75%	1,429,000.00	1,283,553.52
	MEX BONOS DESARR 5%	1,088,000.00	1,050,464.00
	MEX BONOS DESARR 6.5%	2,086,000.00	2,034,058.60
	MEX BONOS DESARR 6.5%	2,434,000.00	2,355,868.60
	MEX BONOS DESARR 7.5%	1,475,000.00	1,460,456.50
	MEX BONOS DESARR 7.75%	1,000,000.00	1,010,300.00
	MEX BONOS DESARR 7.75%	500,000.00	503,450.00
	MEX BONOS DESARR 7.75%	1,386,000.00	1,391,821.20
	MEX BONOS DESARR 8.5%	840,000.00	898,623.60
	MEX BONOS DESARR 8.5%	700,000.00	757,260.00
	MEX BONOS DESARR 8%	2,223,000.00	2,253,455.10
	MEX BONOS DESARR 8%	1,000,000.00	1,027,085.00
	MEX BONOS DESARR 8%	869,000.00	881,930.72
	銘柄数：15	20,335,000.00	20,738,596.67 (116,343,527)
	組入時価比率：0.7%		0.8%
ユーロ	BELGIUM KINGDOM 0.2%	90,000.00	90,351.00
	BELGIUM KINGDOM 0.5%	20,000.00	20,232.00
	BELGIUM KINGDOM 0.8%	110,000.00	113,036.00
	BELGIUM KINGDOM 0.8%	80,000.00	80,896.00
	BELGIUM KINGDOM 0.8%	190,000.00	189,259.00
	BELGIUM KINGDOM 1.25%	30,000.00	30,144.00
	BELGIUM KINGDOM 1.45%	10,000.00	10,114.00
	BELGIUM KINGDOM 1.6%	80,000.00	79,376.00
	BELGIUM KINGDOM 1.9%	40,000.00	43,400.00
	BELGIUM KINGDOM 1%	90,000.00	93,150.00
	BELGIUM KINGDOM 1%	80,000.00	79,480.00
	BELGIUM KINGDOM 2.15%	30,000.00	32,475.00
	BELGIUM KINGDOM 2.25%	110,000.00	122,518.00
	BELGIUM KINGDOM 2.25%	20,000.00	22,496.00
	BELGIUM KINGDOM 2.6%	280,000.00	319,816.00

BELGIUM KINGDOM 3.75%	150,000.00	165,075.00
BELGIUM KINGDOM 3.75%	80,000.00	118,544.00
BELGIUM KINGDOM 3%	130,000.00	136,357.00
BELGIUM KINGDOM 3%	40,000.00	50,336.00
BELGIUM KINGDOM 4.25%	110,000.00	126,797.00
BELGIUM KINGDOM 4.25%	150,000.00	178,440.00
BELGIUM KINGDOM 4.25%	125,000.00	193,875.00
BELGIUM KINGDOM 4.5%	70,000.00	91,945.00
BELGIUM KINGDOM 4%	90,000.00	104,841.00
BELGIUM KINGDOM 4%	50,000.00	69,125.00
BELGIUM KINGDOM 5.5%	145,000.00	211,772.50
BELGIUM KINGDOM 5%	240,000.00	379,440.00
BONOS Y OBLIG DEL 0.4%	130,000.00	131,833.00
BONOS Y OBLIG DEL 0.45%	180,000.00	182,070.00
BONOS Y OBLIG DEL 0.75%	160,000.00	164,448.00
BONOS Y OBLIG DEL 1.15%	120,000.00	123,840.00
BONOS Y OBLIG DEL 1.3%	130,000.00	132,691.00
BONOS Y OBLIG DEL 1.4%	150,000.00	154,515.00
BONOS Y OBLIG DEL 1.4%	140,000.00	141,722.00
BONOS Y OBLIG DEL 1.45%	200,000.00	204,600.00
BONOS Y OBLIG DEL 1.5%	120,000.00	123,708.00
BONOS Y OBLIG DEL 1.6%	270,000.00	286,173.00
BONOS Y OBLIG DEL 1.95%	140,000.00	150,668.00
BONOS Y OBLIG DEL 1.95%	140,000.00	146,496.00
BONOS Y OBLIG DEL 2.15%	130,000.00	142,131.60
BONOS Y OBLIG DEL 2.35%	90,000.00	96,390.00
BONOS Y OBLIG DEL 2.7%	100,000.00	106,660.00
BONOS Y OBLIG DEL 2.75%	180,000.00	185,589.00
BONOS Y OBLIG DEL 2.75%	145,000.00	164,567.75
BONOS Y OBLIG DEL 2.9%	110,000.00	122,839.20
BONOS Y OBLIG DEL 3.45%	50,000.00	60,715.00
BONOS Y OBLIG DEL 3.8%	120,000.00	142,992.00
BONOS Y OBLIG DEL 4.2%	150,000.00	203,175.00
BONOS Y OBLIG DEL 4.3%	50,000.00	53,481.50
BONOS Y OBLIG DEL 4.4%	130,000.00	158,060.50
BONOS Y OBLIG DEL 4.6%	155,000.00	164,532.50
BONOS Y OBLIG DEL 4.65%	385,000.00	489,912.50
BONOS Y OBLIG DEL 4.7%	140,000.00	205,940.00
BONOS Y OBLIG DEL 4.8%	140,000.00	174,300.00
BONOS Y OBLIG DEL 4.85%	120,000.00	134,400.00
BONOS Y OBLIG DEL 4.9%	240,000.00	357,960.00
BONOS Y OBLIG DEL 4%	120,000.00	130,186.80
BONOS Y OBLIG DEL 5.15%	140,000.00	192,108.00

BONOS Y OBLIG DEL 5.15%	80,000.00	126,488.00	
BONOS Y OBLIG DEL 5.4%	370,000.00	458,615.00	
BONOS Y OBLIG DEL 5.5%	180,000.00	210,204.00	
BONOS Y OBLIG DEL 5.75%	185,000.00	281,662.50	
BONOS Y OBLIG DEL 5.85%	175,000.00	213,193.75	
BONOS Y OBLIG DEL 5.9%	135,000.00	187,515.00	
BONOS Y OBLIG DEL 6%	300,000.00	440,100.00	
BUNDES OblIGATION 0.25%	120,000.00	121,503.60	
BUNDES OblIGATION 0.25%	140,000.00	142,615.20	
BUNDES OblIGATION 0%	190,000.00	192,122.30	
BUNDES OblIGATION 0%	120,000.00	121,564.80	
BUNDES OblIGATION 0%	210,000.00	212,622.90	
BUNDES OblIGATION 0%	100,000.00	101,062.00	
BUNDES OblIGATION 0%	280,000.00	282,192.40	
BUNDES OblIGATION 0%	170,000.00	170,657.90	
BUNDESREPUB. DEUT 0.25%	270,000.00	266,643.90	
BUNDESREPUB. DEUT 0.5%	240,000.00	245,457.60	
BUNDESREPUB. DEUT 0.5%	180,000.00	183,067.20	
BUNDESREPUB. DEUT 0.5%	170,000.00	170,669.80	
BUNDESREPUB. DEUT 0.5%	160,000.00	159,608.00	
BUNDESREPUB. DEUT 0%	230,000.00	223,635.90	
BUNDESREPUB. DEUT 1.25%	80,000.00	80,843.20	
BUNDESREPUB. DEUT 1.5%	130,000.00	139,675.90	
BUNDESREPUB. DEUT 1.5%	110,000.00	118,643.80	
BUNDESREPUB. DEUT 1.5%	90,000.00	97,183.80	
BUNDESREPUB. DEUT 1.5%	130,000.00	141,202.10	
BUNDESREPUB. DEUT 1.75%	140,000.00	151,690.00	
BUNDESREPUB. DEUT 1.75%	130,000.00	142,888.20	
BUNDESREPUB. DEUT 1%	110,000.00	116,190.80	
BUNDESREPUB. DEUT 1%	170,000.00	179,632.20	
BUNDESREPUB. DEUT 2.25%	100,000.00	106,504.00	
BUNDESREPUB. DEUT 2.25%	120,000.00	130,550.40	
BUNDESREPUB. DEUT 2.5%	300,000.00	324,018.00	
BUNDESREPUB. DEUT 2.5%	240,000.00	313,632.00	
BUNDESREPUB. DEUT 2.5%	180,000.00	237,636.00	
BUNDESREPUB. DEUT 2%	170,000.00	184,509.50	
BUNDESREPUB. DEUT 2%	110,000.00	121,850.30	
BUNDESREPUB. DEUT 3.25%	480,000.00	511,161.60	
BUNDESREPUB. DEUT 3.25%	140,000.00	156,293.20	
BUNDESREPUB. DEUT 3.25%	170,000.00	248,359.80	
BUNDESREPUB. DEUT 3.5%	110,000.00	115,304.20	
BUNDESREPUB. DEUT 3%	200,000.00	215,376.00	

BUNDESREPUB. DEUT 4.25%	100,000.00	161,750.00
BUNDESREPUB. DEUT 4.75%	100,000.00	141,944.00
BUNDESREPUB. DEUT 4.75%	260,000.00	412,578.40
BUNDESREPUB. DEUT 4.75%	100,000.00	173,857.00
BUNDESREPUB. DEUT 4%	200,000.00	304,314.00
BUNDESREPUB. DEUT 5.5%	110,000.00	174,391.80
BUNDESREPUB. DEUT 5.625%	90,000.00	133,884.00
BUNDESREPUB. DEUT 6.25%	70,000.00	94,696.70
BUNDESREPUB. DEUT 6.25%	70,000.00	114,569.00
BUNDESREPUB. DEUT 6.5%	70,000.00	108,362.80
BUONI POLIENNALI 0.2%	50,000.00	50,370.00
BUONI POLIENNALI 0.35%	110,000.00	111,265.00
BUONI POLIENNALI 0.35%	70,000.00	70,448.00
BUONI POLIENNALI 0.45%	60,000.00	60,744.00
BUONI POLIENNALI 0.65%	100,000.00	101,880.00
BUONI POLIENNALI 0.65%	110,000.00	109,406.00
BUONI POLIENNALI 0.7%	70,000.00	71,262.10
BUONI POLIENNALI 0.9%	80,000.00	81,592.00
BUONI POLIENNALI 0.95%	220,000.00	223,652.00
BUONI POLIENNALI 1.05%	160,000.00	163,384.00
BUONI POLIENNALI 1.2%	160,000.00	165,424.00
BUONI POLIENNALI 1.25%	90,000.00	88,182.00
BUONI POLIENNALI 1.35%	160,000.00	166,288.00
BUONI POLIENNALI 1.45%	160,000.00	166,816.00
BUONI POLIENNALI 1.45%	270,000.00	276,210.00
BUONI POLIENNALI 1.5%	110,000.00	112,537.70
BUONI POLIENNALI 1.5%	190,000.00	193,439.00
BUONI POLIENNALI 1.6%	110,000.00	111,397.00
BUONI POLIENNALI 1.65%	200,000.00	188,260.00
BUONI POLIENNALI 1.85%	140,000.00	147,210.00
BUONI POLIENNALI 2.05%	240,000.00	247,992.00
BUONI POLIENNALI 2.15%	140,000.00	149,674.00
BUONI POLIENNALI 2.2%	320,000.00	335,488.00
BUONI POLIENNALI 2.25%	90,000.00	87,975.00
BUONI POLIENNALI 2.45%	130,000.00	133,003.00
BUONI POLIENNALI 2.5%	150,000.00	154,233.00
BUONI POLIENNALI 2.5%	427,000.00	465,173.80
BUONI POLIENNALI 2.7%	180,000.00	177,336.00
BUONI POLIENNALI 2.8%	30,000.00	28,260.00
BUONI POLIENNALI 2.95%	60,000.00	63,720.00
BUONI POLIENNALI 2%	130,000.00	136,149.00
BUONI POLIENNALI 3.25%	110,000.00	120,450.00
BUONI POLIENNALI 3.45%	130,000.00	145,158.00

BUONI POLIENNALI 3.5%	330,000.00	380,985.00
BUONI POLIENNALI 3.75%	520,000.00	575,276.00
BUONI POLIENNALI 3.75%	150,000.00	166,560.00
BUONI POLIENNALI 3.75%	220,000.00	245,872.00
BUONI POLIENNALI 3.75%	160,000.00	186,592.00
BUONI POLIENNALI 4.25%	160,000.00	169,700.80
BUONI POLIENNALI 4.25%	180,000.00	194,815.80
BUONI POLIENNALI 4.5%	225,000.00	243,697.50
BUONI POLIENNALI 4.5%	120,000.00	142,656.00
BUONI POLIENNALI 4.5%	160,000.00	192,544.00
BUONI POLIENNALI 4.5%	120,000.00	147,852.00
BUONI POLIENNALI 4.75%	180,000.00	207,504.00
BUONI POLIENNALI 4.75%	160,000.00	193,456.00
BUONI POLIENNALI 4.75%	180,000.00	229,554.00
BUONI POLIENNALI 4.75%	120,000.00	163,980.00
BUONI POLIENNALI 4%	180,000.00	197,298.00
BUONI POLIENNALI 4%	200,000.00	247,200.00
BUONI POLIENNALI 5.25%	230,000.00	308,614.00
BUONI POLIENNALI 5.5%	170,000.00	206,839.00
BUONI POLIENNALI 5.5%	110,000.00	134,343.00
BUONI POLIENNALI 5.75%	150,000.00	215,415.00
BUONI POLIENNALI 5%	155,000.00	182,698.50
BUONI POLIENNALI 5%	150,000.00	187,965.00
BUONI POLIENNALI 5%	170,000.00	231,557.00
BUONI POLIENNALI 5%	300,000.00	416,940.00
BUONI POLIENNALI 5%	220,000.00	305,404.00
BUONI POLIENNALI 6.5%	200,000.00	285,000.00
BUONI POLIENNALI 6%	230,000.00	331,959.00
BUONI POLIENNALI 7.25%	60,000.00	87,528.00
BUONI POLIENNALI 9%	80,000.00	115,288.00
FINNISH GOVT 0.375%	40,000.00	40,756.00
FINNISH GOVT 0.5%	40,000.00	40,132.00
FINNISH GOVT 0.5%	10,000.00	9,878.00
FINNISH GOVT 0.75%	50,000.00	48,835.00
FINNISH GOVT 0.875%	20,000.00	20,712.00
FINNISH GOVT 0%	30,000.00	30,168.00
FINNISH GOVT 0%	20,000.00	19,901.00
FINNISH GOVT 1.125%	20,000.00	20,074.00
FINNISH GOVT 1.5%	50,000.00	53,645.00
FINNISH GOVT 1.625%	50,000.00	53,782.50
FINNISH GOVT 2.625%	30,000.00	39,141.00
FINNISH GOVT 2.75%	30,000.00	36,036.00

FINNISH GOVT 2%	80,000.00	88,572.00
FINNISH GOVT 3.375%	110,000.00	118,288.50
FINNISH GOVT 3.5%	50,000.00	55,667.50
FINNISH GOVT 4.375%	220,000.00	232,540.00
FINNISH GOVT 4%	50,000.00	62,915.00
FRANCE (GOVT OF) 0.25%	250,000.00	253,725.00
FRANCE (GOVT OF) 0.25%	190,000.00	184,756.00
FRANCE (GOVT OF) 0.5%	240,000.00	243,432.00
FRANCE (GOVT OF) 0.5%	410,000.00	413,608.00
FRANCE (GOVT OF) 0.5%	190,000.00	189,677.00
FRANCE (GOVT OF) 0%	90,000.00	90,531.00
FRANCE (GOVT OF) 0%	150,000.00	151,432.50
FRANCE (GOVT OF) 0%	600,000.00	604,680.00
FRANCE (GOVT OF) 0%	180,000.00	180,018.00
FRANCE (GOVT OF) 1.25%	180,000.00	179,100.00
FRANCE (GOVT OF) 1.5%	390,000.00	413,127.00
FRANCE (GOVT OF) 1.75%	210,000.00	228,270.00
FRANCE (GOVT OF) 1.75%	220,000.00	240,834.00
FRANCE (GOVT OF) 1.75%	90,000.00	95,751.00
FRANCE (GOVT OF) 1.75%	70,000.00	69,062.00
FRANCE (GOVT OF) 1%	260,000.00	263,484.00
FRANCE (GOVT OF) 1%	160,000.00	166,944.00
FRANCE (GOVT OF) 1%	300,000.00	308,910.00
FRANCE (GOVT OF) 2.25%	180,000.00	198,684.00
FRANCE (GOVT OF) 2.25%	250,000.00	280,625.00
FRANCE (GOVT OF) 2.5%	230,000.00	246,307.00
FRANCE (GOVT OF) 2.5%	450,000.00	529,245.00
FRANCE (GOVT OF) 2.75%	250,000.00	297,650.00
FRANCE (GOVT OF) 2%	140,000.00	151,340.00
FRANCE (GOVT OF) 3.25%	300,000.00	336,705.00
FRANCE (GOVT OF) 3.25%	200,000.00	275,220.00
FRANCE (GOVT OF) 3.5%	235,000.00	253,463.95
FRANCE (GOVT OF) 3.5%	260,000.00	322,088.00
FRANCE (GOVT OF) 3.75%	300,000.00	318,090.00
FRANCE (GOVT OF) 3.75%	210,000.00	235,683.00
FRANCE (GOVT OF) 3%	310,000.00	348,471.00
FRANCE (GOVT OF) 4.25%	475,000.00	583,181.25
FRANCE (GOVT OF) 4.5%	300,000.00	482,370.00
FRANCE (GOVT OF) 4.75%	185,000.00	286,898.00
FRANCE (GOVT OF) 4%	280,000.00	414,708.00
FRANCE (GOVT OF) 4%	170,000.00	275,553.00
FRANCE (GOVT OF) 4%	110,000.00	183,722.00
FRANCE (GOVT OF) 5.5%	190,000.00	283,347.00

FRANCE (GOVT OF) 5.75%	280,000.00	457,016.00
FRANCE (GOVT OF) 6%	370,000.00	524,327.00
FRANCE (GOVT OF) 8.5%	80,000.00	90,592.00
FRANCE (GOVT OF) 8.5%	120,000.00	170,496.00
FRANCE(GOVT OF) 0.75%	210,000.00	209,202.00
FRANCE(GOVT OF) 0%	240,000.00	238,848.00
IRISH TSY 0.8%	50,000.00	51,700.00
IRISH TSY 0.9%	70,000.00	69,587.00
IRISH TSY 0%	30,000.00	29,940.00
IRISH TSY 1.3%	10,000.00	9,911.00
IRISH TSY 1.7%	40,000.00	41,044.00
IRISH TSY 1%	90,000.00	92,169.00
IRISH TSY 2.4%	70,000.00	80,038.00
IRISH TSY 2%	60,000.00	63,858.00
IRISH TSY 3.4%	50,000.00	59,050.00
IRISH TSY 3.9%	40,000.00	47,392.00
IRISH TSY 4.4%	80,000.00	84,320.00
IRISH TSY 4.5%	160,000.00	175,470.40
IRISH TSY 5.4%	160,000.00	213,152.00
IRISH TSY 5.9%	100,000.00	109,245.00
IRISH TSY 5%	60,000.00	67,947.00
NETHERLANDS GOVT 0.25%	90,000.00	90,963.00
NETHERLANDS GOVT 0.25%	120,000.00	119,424.00
NETHERLANDS GOVT 0.5%	80,000.00	80,320.00
NETHERLANDS GOVT 0.75%	120,000.00	121,536.00
NETHERLANDS GOVT 0.75%	60,000.00	59,940.00
NETHERLANDS GOVT 0%	280,000.00	282,492.00
NETHERLANDS GOVT 0%	270,000.00	267,246.00
NETHERLANDS GOVT 1.75%	110,000.00	119,790.00
NETHERLANDS GOVT 2.25%	90,000.00	99,216.00
NETHERLANDS GOVT 2.5%	120,000.00	147,000.00
NETHERLANDS GOVT 2.75%	120,000.00	165,108.00
NETHERLANDS GOVT 2%	90,000.00	100,125.00
NETHERLANDS GOVT 3.25%	140,000.00	155,722.00
NETHERLANDS GOVT 3.5%	110,000.00	119,735.00
NETHERLANDS GOVT 3.75%	40,000.00	47,236.00
NETHERLANDS GOVT 3.75%	120,000.00	186,228.00
NETHERLANDS GOVT 4%	130,000.00	136,682.00
NETHERLANDS GOVT 4%	110,000.00	166,430.00
NETHERLANDS GOVT 5.5%	100,000.00	145,920.00
NETHERLANDS GOVT 7.5%	70,000.00	94,962.00
REP OF AUSTRIA 0.25%	60,000.00	60,630.00

	REP OF AUSTRIA 0.5%	170,000.00	168,317.00
	REP OF AUSTRIA 0.75%	70,000.00	71,176.00
	REP OF AUSTRIA 0.75%	60,000.00	60,216.00
	REP OF AUSTRIA 0%	160,000.00	160,608.00
	REP OF AUSTRIA 0%	30,000.00	29,805.00
	REP OF AUSTRIA 1.2%	90,000.00	95,193.00
	REP OF AUSTRIA 1.5%	20,000.00	18,040.00
	REP OF AUSTRIA 1.5%	40,000.00	40,300.00
	REP OF AUSTRIA 1.65%	70,000.00	76,237.00
	REP OF AUSTRIA 1.75%	70,000.00	76,342.00
	REP OF AUSTRIA 1.95%	60,000.00	61,656.00
	REP OF AUSTRIA 2.1%	30,000.00	33,129.00
	REP OF AUSTRIA 2.4%	50,000.00	59,505.00
	REP OF AUSTRIA 3.15%	50,000.00	69,600.00
	REP OF AUSTRIA 3.4%	120,000.00	139,032.00
	REP OF AUSTRIA 3.5%	105,000.00	118,335.00
	REP OF AUSTRIA 3.65%	70,000.00	80,538.50
	REP OF AUSTRIA 3.8%	30,000.00	51,084.00
	REP OF AUSTRIA 3.9%	230,000.00	252,045.50
	REP OF AUSTRIA 4.15%	100,000.00	150,660.00
	REP OF AUSTRIA 4.85%	50,000.00	67,125.00
	REP OF AUSTRIA 6.25%	85,000.00	128,188.50
小計	銘柄数：292	42,812,000.00	49,557,040.60 (6,440,432,996)
	組入時価比率：40.4%		41.7%
英・ポンド	UK TSY 0.5%	240,000.00	235,320.00
	UK TSY 0.75%	190,000.00	185,250.00
	UK TSY 1.25%	180,000.00	177,336.00
	UK TSY 1.5%	330,000.00	334,950.00
	UK TSY 1.5%	150,000.00	152,250.00
	UK TSY 1.5%	240,000.00	223,056.00
	UK TSY 1.625%	30,000.00	30,126.00
	UK TSY 1.75%	170,000.00	172,006.00
	UK TSY 1.75%	200,000.00	206,220.00
	UK TSY 1.75%	70,000.00	69,363.00
	UK TSY 1.75%	120,000.00	123,024.00
	UK TSY 2.25%	120,000.00	126,192.00
	UK TSY 2.5%	150,000.00	193,035.00
	UK TSY 2.75%	90,000.00	98,478.00
	UK TSY 2%	110,000.00	112,827.00
	UK TSY 2%	160,000.00	168,000.00
	UK TSY 3.25%	200,000.00	256,320.00
	UK TSY 3.5%	190,000.00	254,600.00

	UK TSY 3.5%	140,000.00	229,600.00
	UK TSY 3.75%	110,000.00	114,367.00
	UK TSY 3.75%	150,000.00	160,275.00
	UK TSY 3.75%	110,000.00	120,307.00
	UK TSY 3.75%	170,000.00	256,887.00
	UK TSY 4.25%	135,000.00	169,033.50
	UK TSY 4.25%	100,000.00	131,890.00
	UK TSY 4.25%	240,000.00	330,384.00
	UK TSY 4.25%	110,000.00	157,036.00
	UK TSY 4.25%	130,000.00	187,850.00
	UK TSY 4.25%	140,000.00	214,242.00
	UK TSY 4.25%	97,000.00	153,745.00
	UK TSY 4.25%	152,000.00	259,160.00
	UK TSY 4.5%	210,000.00	291,627.00
	UK TSY 4.5%	165,000.00	251,443.50
	UK TSY 4.75%	160,000.00	171,584.00
	UK TSY 4.75%	85,000.00	114,750.00
	UK TSY 4.75%	125,000.00	188,075.00
	UK TSY 4%	110,000.00	122,727.00
	UK TSY 4%	110,000.00	187,616.00
	UK TSY 5%	165,000.00	205,639.50
	UK TSY 6%	80,000.00	115,144.00
	UK TSY 8%	60,000.00	73,056.00
小計	銘柄数：41	5,994,000.00	7,324,791.50 (1,082,750,679)
	組入時価比率：6.8%		7.0%
スイス・フラン	SWITZERLAND 2.25%	30,000.00	31,977.00
	SWITZERLAND 2%	20,000.00	21,566.00
	SWITZERLAND 4%	30,000.00	36,462.00
	SWITZERLAND 4%	50,000.00	69,880.00
小計	銘柄数：4	130,000.00	159,885.00 (17,376,301)
	組入時価比率：0.1%		0.1%
スウェーデン・クローナ	SWEDISH GOVT 0.75%	440,000.00	443,396.80
	SWEDISH GOVT 1.5%	530,000.00	571,976.00
	SWEDISH GOVT 1%	540,000.00	562,663.80
	SWEDISH GOVT 2.5%	520,000.00	600,007.20
	SWEDISH GOVT 3.5%	890,000.00	1,024,568.00
	SWEDISH GOVT 3.5%	370,000.00	516,427.50
	SWEDISH GOVT 5%	790,000.00	902,527.60
小計	銘柄数：7	4,080,000.00	4,621,566.90 (56,983,919)
	組入時価比率：0.4%		0.4%

ノルウェー・ク ローネ	NORWEGIAN GOVT 1.5%	350,000.00	343,630.00		
	NORWEGIAN GOVT 1.75%	190,000.00	191,007.00		
	NORWEGIAN GOVT 1.75%	350,000.00	347,305.00		
	NORWEGIAN GOVT 2%	500,000.00	512,800.00		
	NORWEGIAN GOVT 3.75%	720,000.00	775,584.00		
	NORWEGIAN GOVT 3%	520,000.00	561,132.00		
	小計	銘柄数：6 組入時価比率：0.2%	2,630,000.00	2,731,458.00 (36,901,997) 0.2%	
デンマーク・ク ローネ	KINGDOM OF DENMARK 0.5%	510,000.00	507,909.00		
	KINGDOM OF DENMARK 1.5%	390,000.00	421,551.00		
	KINGDOM OF DENMARK 1.75%	660,000.00	731,940.00		
	KINGDOM OF DENMARK 3%	670,000.00	748,189.00		
	KINGDOM OF DENMARK 4.5%	1,070,000.00	1,791,501.00		
	KINGDOM OF DENMARK 4%	870,000.00	931,161.00		
	小計	銘柄数：6 組入時価比率：0.6%	4,170,000.00	5,132,251.00 (89,506,457) 0.6%	
ポーランド・ズロ チ	POLAND GOVT 1.5%	250,000.00	249,250.00		
	POLAND GOVT 1.75%	230,000.00	224,250.00		
	POLAND GOVT 2.25%	340,000.00	339,320.00		
	POLAND GOVT 2.5%	40,000.00	39,960.00		
	POLAND GOVT 2.5%	290,000.00	278,690.00		
	POLAND GOVT 2.5%	210,000.00	198,975.00		
	POLAND GOVT 2.75%	80,000.00	77,600.00		
	POLAND GOVT 2%	120,000.00	120,360.00		
	POLAND GOVT 3.25%	250,000.00	251,250.00		
	POLAND GOVT 4%	250,000.00	270,750.00		
	POLAND GOVT 5.25%	120,000.00	130,320.00		
	POLAND GOVT 5.5%	90,000.00	95,341.50		
	POLAND GOVT 5.75%	200,000.00	224,600.00		
	POLAND GOVT 5.75%	230,000.00	261,970.00		
	POLAND GOVT 5.75%	100,000.00	123,860.00		
	小計	銘柄数：15 組入時価比率：0.6%	2,800,000.00	2,886,496.50 (88,067,008) 0.6%	
	オーストラリア・ ドル	AUSTRALIAN GOVT 1.75%	240,000.00	237,948.00	
AUSTRALIAN GOVT 2.25%		90,000.00	89,537.40		
AUSTRALIAN GOVT 2.25%		180,000.00	172,150.74		
AUSTRALIAN GOVT 2.75%		120,000.00	121,353.60		
AUSTRALIAN GOVT 2.75%		190,000.00	192,403.50		
AUSTRALIAN GOVT 2.75%		200,000.00	199,998.80		
AUSTRALIAN GOVT 2.75%		200,000.00	199,635.20		

小計	AUSTRALIAN GOVT 2.75%	50,000.00	49,775.00		
	AUSTRALIAN GOVT 2.75%	50,000.00	48,085.00		
	AUSTRALIAN GOVT 2%	240,000.00	237,984.00		
	AUSTRALIAN GOVT 3.25%	245,000.00	255,094.00		
	AUSTRALIAN GOVT 3.25%	260,000.00	271,882.00		
	AUSTRALIAN GOVT 3.25%	60,000.00	61,008.00		
	AUSTRALIAN GOVT 3.75%	95,000.00	104,272.00		
	AUSTRALIAN GOVT 3%	100,000.00	95,157.50		
	AUSTRALIAN GOVT 4.25%	240,000.00	267,144.00		
	AUSTRALIAN GOVT 4.5%	200,000.00	209,360.00		
	AUSTRALIAN GOVT 4.5%	110,000.00	130,735.00		
	AUSTRALIAN GOVT 4.75%	330,000.00	382,569.00		
	AUSTRALIAN GOVT 5.5%	200,000.00	228,620.00		
	AUSTRALIAN GOVT 5.75%	190,000.00	209,760.00		
	AUSTRALIAN GOVT 5.75%	180,000.00	204,606.00		
	銘柄数：22	3,770,000.00	3,969,078.74	(325,107,239)	
	組入時価比率：2.0%			2.1%	
シンガポール・ドル	SINGAPORE GOVT 1.25%	20,000.00	19,436.00		
	SINGAPORE GOVT 1.625%	110,000.00	109,703.00		
	SINGAPORE GOVT 1.75%	40,000.00	39,184.76		
	SINGAPORE GOVT 2.125%	30,000.00	29,205.00		
	SINGAPORE GOVT 2.25%	60,000.00	60,282.60		
	SINGAPORE GOVT 2.25%	30,000.00	27,414.00		
	SINGAPORE GOVT 2.375%	20,000.00	19,886.00		
	SINGAPORE GOVT 2.75%	40,000.00	40,840.00		
	SINGAPORE GOVT 2.75%	40,000.00	38,880.00		
	SINGAPORE GOVT 2.75%	40,000.00	38,442.00		
	SINGAPORE GOVT 2.875%	10,000.00	10,188.80		
	SINGAPORE GOVT 2.875%	20,000.00	20,271.40		
	SINGAPORE GOVT 3.125%	20,000.00	20,829.20		
	SINGAPORE GOVT 3.25%	35,000.00	35,994.00		
	SINGAPORE GOVT 3.375%	40,000.00	42,632.00		
	SINGAPORE GOVT 3.5%	60,000.00	64,438.80		
	SINGAPORE GOVT 3%	40,000.00	41,382.00		
	銘柄数：17	655,000.00	659,009.56	(53,775,180)	
組入時価比率：0.3%			0.3%		
マレーシア・リンギット	MALAYSIA GOVT 3.492%	800,000.00	796,960.00		
	MALAYSIA GOVT 3.955%	300,000.00	295,470.00		
	MALAYSIA GOVT 4.181%	150,000.00	151,049.40		
	MALAYSIA GOVT 4.498%	600,000.00	598,416.00		

小計	MALAYSIA GOVT 4.762%	440,000.00	439,560.00
	銘柄数：5	2,290,000.00	2,281,455.40 (62,990,983)
	組入時価比率：0.4%		0.4%
南アフリカ・ランド	REP SOUTH AFRICA 10.5%	2,340,000.00	2,647,944.00
	REP SOUTH AFRICA 6.25%	1,000,000.00	753,300.00
	REP SOUTH AFRICA 6.5%	520,000.00	388,180.00
	REP SOUTH AFRICA 6.75%	260,000.00	255,437.00
	REP SOUTH AFRICA 7.75%	500,000.00	499,850.00
	REP SOUTH AFRICA 7%	750,000.00	645,900.00
	REP SOUTH AFRICA 8.25%	700,000.00	662,970.00
	REP SOUTH AFRICA 8.5%	1,090,000.00	1,029,941.00
	REP SOUTH AFRICA 8.75%	1,140,000.00	1,084,482.00
	REP SOUTH AFRICA 8.75%	1,660,000.00	1,586,130.00
	REP SOUTH AFRICA 8.875%	560,000.00	552,160.00
	REP SOUTH AFRICA 8%	600,000.00	567,660.00
	REP SOUTH AFRICA 9%	610,000.00	600,118.00
	小計	銘柄数：13	11,730,000.00
	組入時価比率：0.6%		0.6%
合計			15,438,574,316 (15,438,574,316)

(注1) 比率は左より組入時価の純資産総額に対する比率、及び各小計欄の合計金額に対する比率であります。

(注2) 通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額であります。

(注3) 合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係わるもので、内書であります。

有価証券明細表注記

外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
米・ドル	国債証券 224銘柄	100.0%	43.1%
カナダ・ドル	国債証券 29銘柄	100.0%	2.1%
メキシコ・ペソ	国債証券 15銘柄	100.0%	0.8%
ユーロ	国債証券 292銘柄	100.0%	41.7%
英・ポンド	国債証券 41銘柄	100.0%	7.0%
スイス・フラン	国債証券 4銘柄	100.0%	0.1%
スウェーデン・クローナ	国債証券 7銘柄	100.0%	0.4%
ノルウェー・クローネ	国債証券 6銘柄	100.0%	0.2%
デンマーク・クローネ	国債証券 6銘柄	100.0%	0.6%
ポーランド・ズロチ	国債証券 15銘柄	100.0%	0.6%
オーストラリア・ドル	国債証券 22銘柄	100.0%	2.1%

シンガポール・ドル	国債証券	17銘柄	100.0%	0.3%
マレーシア・リングgit	国債証券	5銘柄	100.0%	0.4%
南アフリカ・ランド	国債証券	13銘柄	100.0%	0.6%

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」に記載しております。

MHAM TOPIXマザーファンド

なお、以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

(単位：円)

(平成30年 5月 8日現在)

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	998,767,651
株式	43,007,457,770
派生商品評価勘定	56,199,728
未収入金	794,352
未収配当金	421,318,699
差入委託証拠金	35,550,000
流動資産合計	44,520,088,200
資産合計	44,520,088,200
負債の部	
流動負債	
前受金	49,540,000
未払解約金	27,884,000
未払利息	2,349
流動負債合計	77,426,349
負債合計	77,426,349
純資産の部	
元本等	
元本	21,558,763,595
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金()	22,883,898,256
元本等合計	44,442,661,851
純資産合計	44,442,661,851
負債純資産合計	44,520,088,200

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	(自 平成30年 3月13日 至 平成30年 5月 8日)
1 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 原則として時価で評価しております。
2 派生商品等の評価基準及び評価方法	先物取引 原則として時価で評価しております。
3 収益・費用の計上基準	受取配当金 受取配当金は、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。 有価証券売買等損益及び派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	(平成30年 5月 8日現在)
1 計算期間末日における受益権の総数	21,558,763,595口
2 計算期間末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産の額 2.0615円 (1万口当たり純資産の額) (20,615円)

(金融商品に関する注記)

1.金融商品の状況に関する事項

項目	(自 平成30年 3月13日 至 平成30年 5月 8日)
1 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める投資を目的とする証券投資信託であり、証券投資信託約款および投資ガイドラインに基づいて運用しております。

項目	(自 平成30年 3月13日 至 平成30年 5月 8日)
2 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>なお、詳細は附属明細表をご参照下さい。</p> <p>これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。</p> <p>また、当ファンドは信託財産に属する資産の効率的な運用に資することを目的として、株価指数先物取引を行っており、当該デリバティブ取引は対象とする株価指数等に係る価格変動リスクを有しております。</p>
3 金融商品に係るリスク管理体制	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>なお、具体的には以下のリスクの管理を行っております。</p> <p>市場リスクの管理 市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。</p> <p>信用リスクの管理 信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。</p> <p>流動性リスクの管理 流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。</p>
4 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>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。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。</p>

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成30年 5月 8日現在)
1 貸借対照表日における貸借対照表の科目ごとの計上額・時価・時価との差額	<p>貸借対照表に計上している金融商品は、原則として時価評価としているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
2 貸借対照表の科目ごとの時価の算定方法	<p>(1)有価証券</p> <p>株式</p>

項目	(平成30年 5月 8日現在)
	<p>わが国の金融商品取引所または海外取引所に上場されている有価証券 当該有価証券については、原則として上記の取引所における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）で評価しております。</p> <p>時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できない場合または入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認められた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認められた価額で評価しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引</p> <p>先物取引</p> <p>デリバティブ取引等に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>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、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

(自 平成30年 3月13日 至 平成30年 5月 8日)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額 (円)
株式	931,423,940
合計	931,423,940

(デリバティブ取引等に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(株式関連)

(平成30年 5月 8日現在)

区分	種類	契約額等 (円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	1,334,540,272	-	1,390,740,000	56,199,728
	合計	1,334,540,272	-	1,390,740,000	56,199,728

（注）時価の算定方法

株価指数先物取引の時価の算定方法については、取引所の発表する計算日の清算値段により評価しております。

（その他の注記）

項目	期別 (平成30年 5月 8日現在)
期首	平成30年 3月13日
親投資信託の期首における元本額	22,650,169,786円
期中追加設定元本額	720,379,174円
期中一部解約元本額	1,811,785,365円
期末元本額及びその内訳として当該親投資信託受益証券を投資対象とする委託者指図型投資信託ごとの元本額	
期末元本額	21,558,763,595円
MHAMスリーウェイオープン	864,954,698円
MHAM TOPIXオープン	4,575,287,083円
MHAM日本株式インデックスファンド（ファンドラップ）	12,029,190,137円
動的パッケージファンド＜DC年金＞	7,969,674円
コア資産形成ファンド	7,574,683円
MHAM TOPIXファンドVA（適格機関投資家専用）	177,218,487円
MHAM動的パッケージファンド [適格機関投資家限定]	1,963,528,181円
MHAM日本株式パッシブファンド [適格機関投資家限定]	1,933,040,652円

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

(平成30年 5月 8日現在)

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
日本・円	極洋	700	3,825.00	2,677,500	
	日本水産	21,400	599.00	12,818,600	
	マルハニチロ	3,600	3,900.00	14,040,000	
	カネコ種苗	600	1,663.00	997,800	
	サカタのタネ	2,800	3,980.00	11,144,000	
	ホクト	1,900	1,953.00	3,710,700	
	ホクリヨウ	300	1,279.00	383,700	
	住石ホールディングス	5,100	166.00	846,600	
	日鉄鉱業	500	6,710.00	3,355,000	
	三井松島産業	1,000	1,571.00	1,571,000	

国際石油開発帝石	92,900	1,388.00	128,945,200
石油資源開発	3,000	2,794.00	8,382,000
K&Oエナジーグループ	1,100	1,810.00	1,991,000
ヒノキヤグループ	500	3,935.00	1,967,500
ショーボンドホールディングス	1,800	8,170.00	14,706,000
ミライト・ホールディングス	5,800	1,613.00	9,355,400
タマホーム	1,500	1,260.00	1,890,000
サンヨーホームズ	400	1,180.00	472,000
日本アクア	600	447.00	268,200
ファーストコーポレーション	600	1,317.00	790,200
ベステラ	400	1,651.00	660,400
TATERU	1,700	1,957.00	3,326,900
ダイセキ環境ソリューション	500	1,141.00	570,500
第一カッター興業	300	2,397.00	719,100
安藤・間	14,700	873.00	12,833,100
東急建設	7,300	1,156.00	8,438,800
コムシスホールディングス	6,700	2,917.00	19,543,900
ミサワホーム	1,600	914.00	1,462,400
ビーアールホールディングス	1,900	422.00	801,800
高松コンストラクショングループ	1,200	2,955.00	3,546,000
東建コーポレーション	700	10,800.00	7,560,000
ソネック	300	799.00	239,700
ヤマウラ	1,000	902.00	902,000
大成建設	18,800	5,900.00	110,920,000
大林組	56,800	1,236.00	70,204,800
清水建設	57,900	1,053.00	60,968,700
飛鳥建設	17,400	190.00	3,306,000
長谷工コーポレーション	22,100	1,711.00	37,813,100
松井建設	2,000	884.00	1,768,000
銭高組	300	5,610.00	1,683,000
鹿島建設	83,000	1,028.00	85,324,000
不動テトラ	14,400	187.00	2,692,800
大末建設	600	1,012.00	607,200
鉄建建設	1,200	3,335.00	4,002,000
西松建設	4,400	3,095.00	13,618,000
三井住友建設	13,700	660.00	9,042,000
大豊建設	7,000	670.00	4,690,000
前田建設工業	13,500	1,309.00	17,671,500
佐田建設	1,200	488.00	585,600
ナカノフドー建設	1,500	639.00	958,500
奥村組	3,100	4,520.00	14,012,000
東鉄工業	2,300	3,415.00	7,854,500

イチケン	300	2,513.00	753,900
浅沼組	7,000	457.00	3,199,000
戸田建設	22,000	897.00	19,734,000
熊谷組	3,000	3,755.00	11,265,000
青木あすなる建設	1,200	1,017.00	1,220,400
北野建設	4,000	402.00	1,608,000
植木組	200	2,690.00	538,000
三井ホーム	2,000	719.00	1,438,000
矢作建設工業	2,600	864.00	2,246,400
ピーエス三菱	2,300	721.00	1,658,300
日本ハウスホールディングス	3,700	584.00	2,160,800
大東建託	6,700	18,295.00	122,576,500
新日本建設	2,300	1,239.00	2,849,700
N I P P O	4,400	2,488.00	10,947,200
東亜道路工業	400	3,935.00	1,574,000
前田道路	5,900	2,356.00	13,900,400
日本道路	500	5,430.00	2,715,000
東亜建設工業	1,600	2,814.00	4,502,400
若築建設	1,000	1,743.00	1,743,000
東洋建設	6,000	527.00	3,162,000
五洋建設	22,600	863.00	19,503,800
世紀東急工業	2,600	722.00	1,877,200
福田組	600	6,690.00	4,014,000
住友林業	12,100	1,848.00	22,360,800
日本基礎技術	2,300	403.00	926,900
日成ビルド工業	2,800	1,290.00	3,612,000
巴コーポレーション	2,400	615.00	1,476,000
大和ハウス工業	55,900	4,104.00	229,413,600
ライト工業	3,600	1,191.00	4,287,600
積水ハウス	61,600	2,010.00	123,816,000
日特建設	1,600	629.00	1,006,400
北陸電気工事	1,000	1,273.00	1,273,000
ユアテック	2,600	981.00	2,550,600
西部電気工業	300	2,985.00	895,500
四電工	300	2,818.00	845,400
中電工	2,400	2,985.00	7,164,000
関電工	7,600	1,291.00	9,811,600
きんでん	12,600	1,888.00	23,788,800
東京エネシス	2,200	1,346.00	2,961,200
トーエネック	500	3,295.00	1,647,500
住友電設	1,500	2,210.00	3,315,000
日本電設工業	2,900	2,475.00	7,177,500

協和エクシオ	6,800	2,773.00	18,856,400
新日本空調	1,400	1,630.00	2,282,000
N D S	300	4,325.00	1,297,500
九電工	3,700	5,170.00	19,129,000
三機工業	4,000	1,199.00	4,796,000
日揮	16,400	2,678.00	43,919,200
中外炉工業	600	2,910.00	1,746,000
ヤマト	1,600	712.00	1,139,200
太平電業	1,300	2,903.00	3,773,900
高砂熱学工業	5,200	2,014.00	10,472,800
三晃金属工業	200	3,665.00	733,000
朝日工業社	400	3,505.00	1,402,000
明星工業	3,500	813.00	2,845,500
大気社	2,400	3,820.00	9,168,000
ダイダン	1,300	2,598.00	3,377,400
日比谷総合設備	2,100	2,167.00	4,550,700
東芝プラントシステム	4,100	2,282.00	9,356,200
O S J Bホールディングス	8,400	311.00	2,612,400
東洋エンジニアリング	2,300	1,091.00	2,509,300
千代田化工建設	12,400	1,106.00	13,714,400
新興プランテック	3,700	1,024.00	3,788,800
日本製粉	5,600	1,770.00	9,912,000
日清製粉グループ本社	20,700	2,418.00	50,052,600
日東富士製粉	100	5,300.00	530,000
昭和産業	1,500	2,870.00	4,305,000
鳥越製粉	1,500	998.00	1,497,000
中部飼料	2,100	2,064.00	4,334,400
フィード・ワン	11,500	243.00	2,794,500
東洋精糖	300	1,271.00	381,300
日本甜菜製糖	900	2,435.00	2,191,500
三井製糖	1,300	4,245.00	5,518,500
塩水港精糖	2,300	264.00	607,200
日新製糖	800	2,105.00	1,684,000
森永製菓	4,000	5,250.00	21,000,000
中村屋	400	4,860.00	1,944,000
江崎グリコ	4,700	5,800.00	27,260,000
名糖産業	800	1,761.00	1,408,800
井村屋グループ	700	3,565.00	2,495,500
不二家	1,100	2,695.00	2,964,500
山崎製パン	13,900	2,328.00	32,359,200
第一屋製パン	400	1,219.00	487,600
モロゾフ	300	6,680.00	2,004,000

亀田製菓	1,100	5,380.00	5,918,000
寿スピリッツ	1,600	5,250.00	8,400,000
カルビー	7,700	3,815.00	29,375,500
森永乳業	3,400	4,655.00	15,827,000
六甲バター	1,100	2,601.00	2,861,100
ヤクルト本社	9,900	7,820.00	77,418,000
明治ホールディングス	11,200	8,770.00	98,224,000
雪印メグミルク	4,100	3,155.00	12,935,500
プリマハム	12,000	673.00	8,076,000
日本ハム	7,300	4,770.00	34,821,000
丸大食品	9,000	537.00	4,833,000
S Foods	1,200	4,540.00	5,448,000
伊藤ハム米久ホールディングス	10,900	999.00	10,889,100
サッポロホールディングス	6,200	3,125.00	19,375,000
アサヒグループホールディングス	35,500	5,510.00	195,605,000
キリンホールディングス	81,500	3,066.00	249,879,000
宝ホールディングス	12,800	1,321.00	16,908,800
オエノンホールディングス	4,900	472.00	2,312,800
養命酒製造	500	2,494.00	1,247,000
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	11,900	4,645.00	55,275,500
サントリー食品インターナショナル	13,000	5,380.00	69,940,000
ダイドーグループホールディングス	900	6,610.00	5,949,000
伊藤園	5,600	4,395.00	24,612,000
キーコーヒー	1,700	2,193.00	3,728,100
ユニカフェ	600	1,126.00	675,600
ジャパンフーズ	300	1,473.00	441,900
日清オイリオグループ	2,000	3,185.00	6,370,000
不二製油グループ本社	4,600	3,440.00	15,824,000
かどや製油	200	6,410.00	1,282,000
J - オイルミルズ	900	3,735.00	3,361,500
キッコーマン	13,300	4,890.00	65,037,000
味の素	39,100	2,030.00	79,373,000
キューピー	9,500	2,633.00	25,013,500
ハウス食品グループ本社	6,500	3,830.00	24,895,000
カゴメ	6,800	3,780.00	25,704,000
焼津水産化学工業	800	1,245.00	996,000
アリアケジャパン	1,500	9,340.00	14,010,000
ピエトロ	300	1,649.00	494,700
エバラ食品工業	400	2,139.00	855,600
ニチレイ	8,100	3,045.00	24,664,500
東洋水産	9,300	4,305.00	40,036,500
イートアンド	500	2,158.00	1,079,000

大冷	200	2,028.00	405,600
ヨシムラ・フード・ホールディングス	400	972.00	388,800
日清食品ホールディングス	7,400	8,180.00	60,532,000
永谷園ホールディングス	2,000	1,493.00	2,986,000
一正蒲鉾	700	1,360.00	952,000
フジッコ	1,800	2,512.00	4,521,600
ロック・フィールド	1,800	2,059.00	3,706,200
日本たばこ産業	104,900	3,050.00	319,945,000
ケンコーマヨネーズ	1,100	3,990.00	4,389,000
わらべや日洋ホールディングス	1,100	2,769.00	3,045,900
なとり	1,000	1,973.00	1,973,000
イフジ産業	400	808.00	323,200
ピクルスコーポレーション	400	2,054.00	821,600
北の達人コーポレーション	5,200	807.00	4,196,400
ユーグレナ	6,800	1,029.00	6,997,200
ミヨシ油脂	600	1,420.00	852,000
理研ビタミン	600	4,070.00	2,442,000
片倉工業	2,100	1,392.00	2,923,200
ゲンゼ	1,300	6,870.00	8,931,000
東洋紡	6,600	2,112.00	13,939,200
ユニチカ	5,300	710.00	3,763,000
富士紡ホールディングス	1,000	4,250.00	4,250,000
倉敷紡績	18,000	365.00	6,570,000
シキボウ	900	1,388.00	1,249,200
日本毛織	5,000	1,152.00	5,760,000
トーア紡コーポレーション	800	587.00	469,600
ダイドーリミテッド	2,300	470.00	1,081,000
帝国繊維	1,800	2,271.00	4,087,800
帝人	14,600	2,062.00	30,105,200
東レ	128,600	1,003.50	129,050,100
サカイオーベックス	400	2,403.00	961,200
住江織物	400	2,865.00	1,146,000
日本フェルト	900	521.00	468,900
イチカワ	1,000	373.00	373,000
日東製網	200	1,805.00	361,000
アツギ	1,200	1,239.00	1,486,800
ダイニック	700	1,032.00	722,400
セーレン	4,100	2,043.00	8,376,300
ソトー	600	1,069.00	641,400
東海染工	300	1,487.00	446,100
小松精練	2,700	1,135.00	3,064,500
ワコールホールディングス	4,900	3,315.00	16,243,500

ホギメディカル	2,200	4,615.00	10,153,000
クラウディアホールディングス	600	560.00	336,000
T S Iホールディングス	6,100	851.00	5,191,100
マツオカコーポレーション	400	3,125.00	1,250,000
三陽商会	1,000	2,465.00	2,465,000
ナイガイ	800	578.00	462,400
オンワードホールディングス	10,700	909.00	9,726,300
ルックホールディングス	3,000	372.00	1,116,000
ゴールドウイン	1,000	7,180.00	7,180,000
デサント	4,000	1,990.00	7,960,000
キング	900	581.00	522,900
ヤマトインターナショナル	1,100	643.00	707,300
特種東海製紙	1,000	4,245.00	4,245,000
王子ホールディングス	75,000	764.00	57,300,000
日本製紙	8,000	2,084.00	16,672,000
三菱製紙	2,800	686.00	1,920,800
北越紀州製紙	10,200	669.00	6,823,800
中越パルプ工業	700	1,943.00	1,360,100
大王製紙	7,100	1,527.00	10,841,700
阿波製紙	500	657.00	328,500
レンゴー	17,200	938.00	16,133,600
トーモク	1,000	2,160.00	2,160,000
ザ・パック	1,200	4,070.00	4,884,000
クラレ	29,800	1,784.00	53,163,200
旭化成	110,400	1,507.00	166,372,800
共和レザー	900	1,003.00	902,700
昭和電工	11,800	3,770.00	44,486,000
住友化学	130,000	638.00	82,940,000
住友精化	700	5,220.00	3,654,000
日産化学工業	10,300	4,820.00	49,646,000
ラサ工業	600	2,350.00	1,410,000
クレハ	1,500	7,460.00	11,190,000
多木化学	200	4,635.00	927,000
テイカ	1,300	3,040.00	3,952,000
石原産業	3,200	1,198.00	3,833,600
片倉コープアグリ	500	1,251.00	625,500
日東エフシー	1,000	749.00	749,000
日本曹達	12,000	632.00	7,584,000
東ソー	25,600	1,906.00	48,793,600
トクヤマ	5,200	3,785.00	19,682,000
セントラル硝子	3,600	2,619.00	9,428,400
東亜合成	10,400	1,233.00	12,823,200

大阪ソーダ	1,700	3,015.00	5,125,500
関東電化工業	4,300	1,016.00	4,368,800
デンカ	6,500	3,960.00	25,740,000
信越化学工業	29,500	11,090.00	327,155,000
日本カーバイド工業	600	2,219.00	1,331,400
堺化学工業	1,200	2,912.00	3,494,400
エア・ウォーター	14,600	2,135.00	31,171,000
大陽日酸	13,700	1,680.00	23,016,000
日本化学工業	700	3,420.00	2,394,000
東邦アセチレン	200	1,432.00	286,400
日本パーカライジング	9,000	1,731.00	15,579,000
高圧ガス工業	2,500	988.00	2,470,000
四国化成工業	2,500	1,573.00	3,932,500
戸田工業	400	3,910.00	1,564,000
ステラ ケミファ	900	3,665.00	3,298,500
保土谷化学工業	600	4,650.00	2,790,000
日本触媒	2,800	7,230.00	20,244,000
大日精化工業	1,300	4,420.00	5,746,000
カネカ	24,000	1,083.00	25,992,000
三菱瓦斯化学	14,600	2,532.00	36,967,200
三井化学	16,100	3,150.00	50,715,000
J S R	17,800	2,080.00	37,024,000
東京応化工業	3,100	3,945.00	12,229,500
大阪有機化学工業	1,500	1,436.00	2,154,000
三菱ケミカルホールディングス	118,500	1,026.00	121,581,000
K Hネオケム	2,700	3,200.00	8,640,000
ダイセル	23,900	1,278.00	30,544,200
住友ベークライト	14,000	978.00	13,692,000
積水化学工業	36,800	1,848.00	68,006,400
日本ゼオン	15,000	1,399.00	20,985,000
アイカ工業	4,900	3,960.00	19,404,000
宇部興産	8,900	3,275.00	29,147,500
積水樹脂	2,700	2,324.00	6,274,800
タキロンシーアイ	3,600	677.00	2,437,200
旭有機材	1,000	1,836.00	1,836,000
日立化成	8,800	2,359.00	20,759,200
ニチバン	900	3,455.00	3,109,500
リケンテクノス	3,800	560.00	2,128,000
大倉工業	4,000	614.00	2,456,000
積水化成品工業	2,200	1,424.00	3,132,800
群栄化学工業	400	3,675.00	1,470,000
タイガースポリマー	800	813.00	650,400

ミライアル	600	1,618.00	970,800
ダイキアクシス	600	1,506.00	903,600
ダイキョーニシカワ	3,500	1,892.00	6,622,000
竹本容器	300	3,350.00	1,005,000
森六ホールディングス	900	3,140.00	2,826,000
日本化薬	11,500	1,359.00	15,628,500
カーリットホールディングス	1,700	1,086.00	1,846,200
日本精化	1,400	1,201.00	1,681,400
扶桑化学工業	1,700	2,467.00	4,193,900
トリケミカル研究所	400	4,335.00	1,734,000
A D E K A	7,600	1,941.00	14,751,600
日油	6,800	3,020.00	20,536,000
新日本理化	2,900	262.00	759,800
ハリマ化成グループ	1,300	935.00	1,215,500
花王	41,500	7,737.00	321,085,500
第一工業製薬	3,000	745.00	2,235,000
石原ケミカル	400	2,065.00	826,000
日華化学	600	1,247.00	748,200
ニイタカ	300	1,835.00	550,500
三洋化成工業	1,100	5,450.00	5,995,000
有機合成薬品工業	1,500	307.00	460,500
大日本塗料	2,000	1,545.00	3,090,000
日本ペイントホールディングス	13,700	4,495.00	61,581,500
関西ペイント	18,600	2,423.00	45,067,800
神東塗料	1,400	231.00	323,400
中国塗料	5,100	1,139.00	5,808,900
日本特殊塗料	1,100	2,208.00	2,428,800
藤倉化成	2,100	693.00	1,455,300
太陽ホールディングス	1,400	4,300.00	6,020,000
D I C	7,000	3,655.00	25,585,000
サカタインクス	3,600	1,616.00	5,817,600
東洋インキS Cホールディングス	17,000	672.00	11,424,000
T & K T O K A	1,200	1,245.00	1,494,000
富士フイルムホールディングス	35,100	4,222.00	148,192,200
資生堂	31,500	7,279.00	229,288,500
ライオン	23,500	2,348.00	55,178,000
高砂香料工業	1,100	3,420.00	3,762,000
マンダム	3,300	3,735.00	12,325,500
ミルボン	2,300	5,220.00	12,006,000
ファンケル	4,100	4,515.00	18,511,500
コーセー	2,900	20,950.00	60,755,000
コタ	800	1,651.00	1,320,800

シーズ・ホールディングス	2,000	5,650.00	11,300,000
シーボン	200	3,255.00	651,000
ポーラ・オルビスホールディングス	7,200	5,030.00	36,216,000
ノエビアホールディングス	1,100	7,700.00	8,470,000
アジュバンコスメジャパン	400	988.00	395,200
エステー	1,200	2,669.00	3,202,800
アグロ カネショウ	700	2,705.00	1,893,500
コニシ	2,800	1,819.00	5,093,200
長谷川香料	2,000	2,434.00	4,868,000
星光PMC	1,000	1,227.00	1,227,000
小林製薬	4,700	9,610.00	45,167,000
荒川化学工業	1,500	2,012.00	3,018,000
メック	1,200	1,854.00	2,224,800
日本高純度化学	500	2,568.00	1,284,000
タカラバイオ	4,400	2,219.00	9,763,600
JCU	2,000	2,375.00	4,750,000
新田ゼラチン	1,200	886.00	1,063,200
OATアグリオ	300	3,940.00	1,182,000
デクセリアルズ	4,400	1,113.00	4,897,200
アース製薬	1,300	5,440.00	7,072,000
北興化学工業	1,800	675.00	1,215,000
大成ラミック	500	3,145.00	1,572,500
クミアイ化学工業	7,800	701.00	5,467,800
日本農薬	4,100	698.00	2,861,800
アキレス	1,300	2,275.00	2,957,500
有沢製作所	2,800	1,012.00	2,833,600
日東電工	12,800	8,475.00	108,480,000
レック	1,000	4,355.00	4,355,000
きもと	3,100	318.00	985,800
藤森工業	1,400	3,635.00	5,089,000
前澤化成工業	1,100	1,231.00	1,354,100
JSP	1,000	3,390.00	3,390,000
エフピコ	1,400	6,550.00	9,170,000
天馬	1,300	2,056.00	2,672,800
信越ポリマー	3,500	1,064.00	3,724,000
東リ	4,100	383.00	1,570,300
ニフコ	6,200	3,885.00	24,087,000
日本バルカー工業	1,400	3,030.00	4,242,000
ユニ・チャーム	35,900	3,063.00	109,961,700
協和発酵キリン	21,200	2,338.00	49,565,600
武田薬品工業	62,200	4,638.00	288,483,600
アステラス製薬	173,600	1,666.50	289,304,400

大日本住友製薬	12,600	1,964.00	24,746,400
塩野義製薬	23,800	5,685.00	135,303,000
田辺三菱製薬	20,600	2,150.00	44,290,000
わかもと製薬	2,100	302.00	634,200
あすか製薬	1,900	1,682.00	3,195,800
日本新薬	4,400	7,660.00	33,704,000
Bioフェルミン製薬	300	2,837.00	851,100
中外製薬	17,600	5,820.00	102,432,000
科研製薬	3,000	6,420.00	19,260,000
エーザイ	20,200	7,405.00	149,581,000
ロート製薬	9,300	3,195.00	29,713,500
小野薬品工業	39,900	2,540.50	101,365,950
久光製薬	5,000	8,900.00	44,500,000
持田製薬	1,200	7,780.00	9,336,000
参天製薬	32,000	1,866.00	59,712,000
扶桑薬品工業	600	2,915.00	1,749,000
日本ケミファ	200	4,655.00	931,000
ツムラ	6,100	4,000.00	24,400,000
日医工	4,500	1,765.00	7,942,500
キッセイ薬品工業	3,000	3,095.00	9,285,000
生化学工業	3,300	1,850.00	6,105,000
栄研化学	2,700	2,447.00	6,606,900
日水製薬	700	1,407.00	984,900
鳥居薬品	1,100	2,871.00	3,158,100
JCRファーマ	1,200	5,650.00	6,780,000
東和薬品	800	6,900.00	5,520,000
富士製薬工業	600	4,535.00	2,721,000
沢井製薬	3,400	4,750.00	16,150,000
ゼリア新薬工業	3,600	2,307.00	8,305,200
第一三共	48,400	3,998.00	193,503,200
キョーリン製薬ホールディングス	4,700	2,156.00	10,133,200
大幸薬品	900	2,171.00	1,953,900
ダイト	1,000	3,710.00	3,710,000
大塚ホールディングス	35,100	5,632.00	197,683,200
大正製薬ホールディングス	3,800	10,690.00	40,622,000
ペプチドリーム	7,700	4,705.00	36,228,500
日本コークス工業	14,900	115.00	1,713,500
昭和シェル石油	15,800	1,571.00	24,821,800
ニチレキ	2,200	1,183.00	2,602,600
ユシロ化学工業	900	1,794.00	1,614,600
ビーピー・カストロール	700	1,690.00	1,183,000
富士石油	4,200	453.00	1,902,600

MORESCO	600	1,964.00	1,178,400
出光興産	14,200	3,970.00	56,374,000
JXTGホールディングス	269,800	707.30	190,829,540
コスモエネルギーホールディングス	4,900	3,740.00	18,326,000
横浜ゴム	9,800	2,554.00	25,029,200
東洋ゴム工業	10,000	1,799.00	17,990,000
ブリヂストン	55,800	4,514.00	251,881,200
住友ゴム工業	17,500	1,916.00	33,530,000
藤倉ゴム工業	1,500	781.00	1,171,500
オカモト	6,000	1,097.00	6,582,000
フコク	800	989.00	791,200
ニッタ	1,700	4,200.00	7,140,000
住友理工	3,300	1,186.00	3,913,800
三ツ星ベルト	4,000	1,273.00	5,092,000
バンドー化学	3,200	1,321.00	4,227,200
日東紡績	2,500	2,355.00	5,887,500
旭硝子	17,000	4,520.00	76,840,000
日本板硝子	8,600	901.00	7,748,600
石塚硝子	200	2,579.00	515,800
日本山村硝子	7,000	188.00	1,316,000
日本電気硝子	7,300	3,155.00	23,031,500
オハラ	700	2,379.00	1,665,300
住友大阪セメント	33,000	496.00	16,368,000
太平洋セメント	10,700	4,070.00	43,549,000
日本ヒューム	1,700	840.00	1,428,000
日本コンクリート工業	3,700	451.00	1,668,700
三谷セキサン	900	2,536.00	2,282,400
アジアパイルホールディングス	2,200	654.00	1,438,800
東海カーボン	15,400	1,512.00	23,284,800
日本カーボン	900	5,600.00	5,040,000
東洋炭素	1,100	3,280.00	3,608,000
ノリタケカンパニーリミテド	900	4,795.00	4,315,500
TOTO	13,000	5,700.00	74,100,000
日本碍子	20,600	2,054.00	42,312,400
日本特殊陶業	14,500	3,010.00	43,645,000
MARUWA	600	9,450.00	5,670,000
品川リフラクトリーズ	400	3,025.00	1,210,000
黒崎播磨	300	5,110.00	1,533,000
ヨータイ	1,400	808.00	1,131,200
イソライト工業	900	834.00	750,600
東京窯業	2,300	460.00	1,058,000
ニッカトー	800	1,174.00	939,200

フジインコーポレーテッド	1,500	2,312.00	3,468,000
クニミネ工業	400	1,030.00	412,000
エーアンドエーマテリアル	400	1,295.00	518,000
ニチアス	9,000	1,508.00	13,572,000
ニチハ	2,500	4,335.00	10,837,500
新日鐵住金	74,700	2,440.50	182,305,350
神戸製鋼所	30,700	1,170.00	35,919,000
中山製鋼所	2,300	769.00	1,768,700
合同製鐵	900	2,517.00	2,265,300
ジェイ エフ イー ホールディングス	45,100	2,369.00	106,841,900
日新製鋼	4,600	1,490.00	6,854,000
東京製鐵	9,000	900.00	8,100,000
共英製鋼	1,900	2,224.00	4,225,600
大和工業	3,600	3,750.00	13,500,000
東京鐵鋼	700	1,884.00	1,318,800
大阪製鐵	1,100	2,288.00	2,516,800
淀川製鋼所	2,400	3,040.00	7,296,000
東洋鋼鈑	4,300	717.00	3,083,100
丸一鋼管	5,900	3,700.00	21,830,000
モリ工業	500	3,420.00	1,710,000
大同特殊鋼	3,000	5,930.00	17,790,000
日本高周波鋼業	700	835.00	584,500
日本冶金工業	13,900	293.00	4,072,700
山陽特殊製鋼	1,900	2,753.00	5,230,700
愛知製鋼	900	4,700.00	4,230,000
日立金属	18,000	1,291.00	23,238,000
日本金属	400	2,304.00	921,600
大平洋金属	1,100	3,580.00	3,938,000
新日本電工	10,100	361.00	3,646,100
栗本鐵工所	800	2,043.00	1,634,400
虹技	200	2,021.00	404,200
日本鑄鉄管	2,000	170.00	340,000
三菱製鋼	1,200	2,527.00	3,032,400
日亜鋼業	2,400	356.00	854,400
日本精線	300	4,875.00	1,462,500
シンニッタン	2,500	502.00	1,255,000
新家工業	400	2,160.00	864,000
大紀アルミニウム工業所	2,800	741.00	2,074,800
日本輕金属ホールディングス	48,900	297.00	14,523,300
三井金属鈹業	4,500	4,690.00	21,105,000
東邦亜鉛	900	4,975.00	4,477,500
三菱マテリアル	11,000	3,310.00	36,410,000

住友金属鉱山	21,400	4,707.00	100,729,800
DOWAホールディングス	4,200	4,105.00	17,241,000
古河機械金属	2,800	2,218.00	6,210,400
大阪チタニウムテクノロジーズ	1,800	2,011.00	3,619,800
東邦チタニウム	3,000	1,239.00	3,717,000
UACJ	2,600	2,834.00	7,368,400
CKサンエツ	300	4,855.00	1,456,500
古河電気工業	5,600	5,360.00	30,016,000
住友電気工業	62,400	1,675.50	104,551,200
フジクラ	20,300	753.00	15,285,900
昭和電線ホールディングス	2,200	927.00	2,039,400
東京特殊電線	200	3,125.00	625,000
タツタ電線	3,400	652.00	2,216,800
カナレ電気	300	2,379.00	713,700
平河ヒューテック	800	1,429.00	1,143,200
リョービ	2,100	2,853.00	5,991,300
アーレスティ	2,000	1,048.00	2,096,000
アサヒホールディングス	2,900	2,035.00	5,901,500
稲葉製作所	1,000	1,432.00	1,432,000
宮地エンジニアリンググループ	500	2,176.00	1,088,000
トーカロ	4,600	1,402.00	6,449,200
アルファCo	600	1,755.00	1,053,000
SUMCO	15,400	2,668.00	41,087,200
川田テクノロジーズ	300	6,260.00	1,878,000
RS Technologies	300	6,810.00	2,043,000
東洋製罐グループホールディングス	11,500	1,706.00	19,619,000
ホッカホールディングス	4,000	395.00	1,580,000
コロナ	900	1,338.00	1,204,200
横河ブリッジホールディングス	3,100	2,395.00	7,424,500
駒井ハルテック	400	2,536.00	1,014,400
高田機工	100	3,515.00	351,500
三和ホールディングス	16,000	1,404.00	22,464,000
文化シャッター	4,900	1,069.00	5,238,100
三協立山	2,300	1,617.00	3,719,100
アルインコ	1,200	1,091.00	1,309,200
東洋シャッター	400	680.00	272,000
LIXILグループ	24,700	2,529.00	62,466,300
日本ファイルコン	1,300	640.00	832,000
ノーリツ	3,700	2,061.00	7,625,700
長府製作所	1,900	2,549.00	4,843,100
リンナイ	3,000	10,920.00	32,760,000
ダイニチ工業	900	836.00	752,400

日東精工	2,300	804.00	1,849,200
三洋工業	200	2,103.00	420,600
岡部	3,400	1,022.00	3,474,800
ジーテクト	1,800	2,121.00	3,817,800
中国工業	400	733.00	293,200
東プレ	3,100	3,490.00	10,819,000
高周波熱錬	3,200	1,104.00	3,532,800
東京製綱	1,200	2,338.00	2,805,600
サンコール	900	737.00	663,300
モリテック スチール	1,400	730.00	1,022,000
パイオラックス	2,500	3,140.00	7,850,000
エイチワン	1,600	1,274.00	2,038,400
日本発條	16,700	1,223.00	20,424,100
中央発條	200	3,625.00	725,000
アドバネクス	300	2,578.00	773,400
立川ブラインド工業	700	1,528.00	1,069,600
三益半導体工業	1,300	1,932.00	2,511,600
日本ドライケミカル	200	2,519.00	503,800
日本製鋼所	5,500	3,570.00	19,635,000
三浦工業	7,200	3,215.00	23,148,000
タクマ	5,700	1,202.00	6,851,400
ツガミ	4,000	1,316.00	5,264,000
オークマ	2,000	6,740.00	13,480,000
東芝機械	9,000	720.00	6,480,000
アマダホールディングス	25,800	1,305.00	33,669,000
アイダエンジニアリング	4,300	1,269.00	5,456,700
滝澤鉄工所	500	1,953.00	976,500
F U J I	5,000	1,871.00	9,355,000
牧野フライス製作所	9,000	1,022.00	9,198,000
オーエスジー	7,700	2,544.00	19,588,800
ダイジェット工業	200	1,998.00	399,600
旭ダイヤモンド工業	5,000	1,068.00	5,340,000
D M G 森精機	9,300	2,106.00	19,585,800
ソディック	3,700	1,325.00	4,902,500
ディスコ	2,300	20,800.00	47,840,000
日東工器	1,000	2,891.00	2,891,000
日進工具	400	3,000.00	1,200,000
パンチ工業	1,400	1,228.00	1,719,200
富士ダイス	900	1,011.00	909,900
豊和工業	1,000	1,109.00	1,109,000
O K K	700	1,144.00	800,800
東洋機械金属	1,300	785.00	1,020,500

津田駒工業	4,000	242.00	968,000
島精機製作所	2,100	6,870.00	14,427,000
オプトラン	1,600	3,060.00	4,896,000
NCホールディングス	600	838.00	502,800
フリー	1,200	977.00	1,172,400
ヤマシンフィルタ	2,500	1,157.00	2,892,500
日阪製作所	2,400	1,195.00	2,868,000
やまびこ	3,200	1,557.00	4,982,400
平田機工	600	10,160.00	6,096,000
ペガサスマシン製造	1,600	786.00	1,257,600
ナプテスコ	9,200	3,685.00	33,902,000
三井海洋開発	1,800	3,130.00	5,634,000
レオン自動機	1,500	2,071.00	3,106,500
S M C	5,300	42,540.00	225,462,000
新川	1,500	1,042.00	1,563,000
ホソカワミクロン	600	7,660.00	4,596,000
ユニオンツール	800	4,280.00	3,424,000
オイレス工業	2,200	2,385.00	5,247,000
日精エー・エス・ビー機械	500	6,140.00	3,070,000
サトーホールディングス	2,200	3,035.00	6,677,000
技研製作所	1,100	2,566.00	2,822,600
日本エアーテック	600	926.00	555,600
カワタ	300	1,775.00	532,500
日精樹脂工業	1,400	1,387.00	1,941,800
オカダアイオン	600	1,594.00	956,400
ワイエイシイホールディングス	600	1,067.00	640,200
小松製作所	81,600	3,605.00	294,168,000
住友重機械工業	9,700	4,045.00	39,236,500
日立建機	7,900	3,980.00	31,442,000
日工	400	2,495.00	998,000
巴工業	700	2,102.00	1,471,400
井関農機	1,700	2,224.00	3,780,800
T O W A	1,300	1,425.00	1,852,500
丸山製作所	400	1,960.00	784,000
北川鉄工所	800	2,859.00	2,287,200
ローツェ	800	2,625.00	2,100,000
タカキタ	600	779.00	467,400
クボタ	90,700	1,832.50	166,207,750
荏原実業	500	2,388.00	1,194,000
三菱化工機	600	2,285.00	1,371,000
月島機械	3,300	1,527.00	5,039,100
帝国電機製作所	1,200	1,679.00	2,014,800

新東工業	4,000	1,172.00	4,688,000
澁谷工業	1,500	3,595.00	5,392,500
アイチ コーポレーション	2,900	765.00	2,218,500
小森コーポレーション	4,300	1,403.00	6,032,900
鶴見製作所	1,400	2,164.00	3,029,600
住友精密工業	3,000	388.00	1,164,000
酒井重工業	300	4,655.00	1,396,500
荏原製作所	7,000	4,175.00	29,225,000
石井鐵工所	300	1,978.00	593,400
西島製作所	1,700	1,054.00	1,791,800
北越工業	1,900	1,150.00	2,185,000
ダイキン工業	23,100	12,895.00	297,874,500
オルガノ	600	3,270.00	1,962,000
トーヨーカネツ	700	3,390.00	2,373,000
栗田工業	9,100	3,380.00	30,758,000
椿本チエイン	10,000	934.00	9,340,000
大同工業	600	1,511.00	906,600
木村化工機	1,500	507.00	760,500
アネスト岩田	2,800	1,181.00	3,306,800
ダイフク	8,600	5,990.00	51,514,000
サムコ	500	1,286.00	643,000
加藤製作所	800	2,604.00	2,083,200
油研工業	300	2,947.00	884,100
タダノ	8,200	1,516.00	12,431,200
フジテック	5,400	1,497.00	8,083,800
CKD	4,700	2,216.00	10,415,200
キトー	1,300	2,179.00	2,832,700
平和	5,300	2,303.00	12,205,900
理想科学工業	1,700	2,223.00	3,779,100
SANKYO	4,200	3,925.00	16,485,000
日本金銭機械	1,600	1,277.00	2,043,200
マースエンジニアリング	1,100	2,526.00	2,778,600
福島工業	1,000	5,050.00	5,050,000
オーイズミ	800	575.00	460,000
ダイコク電機	800	1,793.00	1,434,400
竹内製作所	2,800	2,492.00	6,977,600
アマノ	5,200	2,790.00	14,508,000
JUKI	2,500	1,238.00	3,095,000
サンデンホールディングス	2,100	1,615.00	3,391,500
蛇の目マシン工業	1,600	739.00	1,182,400
マックス	2,600	1,508.00	3,920,800
グローリー	5,000	3,835.00	19,175,000

新晃工業	1,700	1,744.00	2,964,800
大和冷機工業	2,700	1,206.00	3,256,200
セガサミーホールディングス	16,800	1,833.00	30,794,400
日本ピストンリング	600	2,256.00	1,353,600
リケン	800	6,140.00	4,912,000
T P R	1,900	3,270.00	6,213,000
ツバキ・ナカシマ	1,700	2,578.00	4,382,600
ホシザキ	5,300	10,180.00	53,954,000
大豊工業	1,400	1,506.00	2,108,400
日本精工	34,700	1,457.00	50,557,900
N T N	39,300	480.00	18,864,000
ジェイテクト	18,000	1,670.00	30,060,000
不二越	16,000	567.00	9,072,000
日本トムソン	5,500	794.00	4,367,000
T H K	10,500	3,830.00	40,215,000
ユーシン精機	1,500	1,581.00	2,371,500
前澤給装工業	600	1,927.00	1,156,200
イーグル工業	2,100	1,978.00	4,153,800
前澤工業	1,300	473.00	614,900
日本ピラー工業	1,700	1,610.00	2,737,000
キッツ	6,900	943.00	6,506,700
マキタ	22,000	4,935.00	108,570,000
日立造船	13,600	595.00	8,092,000
三菱重工業	28,300	4,110.00	116,313,000
I H I	13,000	3,690.00	47,970,000
スター精密	2,700	1,940.00	5,238,000
日清紡ホールディングス	10,400	1,587.00	16,504,800
イビデン	10,400	1,666.00	17,326,400
コニカミノルタ	39,600	947.00	37,501,200
ブラザー工業	20,600	2,415.00	49,749,000
ミネベアミツミ	31,400	2,237.00	70,241,800
日立製作所	406,000	858.00	348,348,000
三菱電機	168,900	1,631.00	275,475,900
富士電機	51,000	777.00	39,627,000
東洋電機製造	700	1,876.00	1,313,200
安川電機	19,600	4,510.00	88,396,000
シンフォニアテクノロジー	11,000	414.00	4,554,000
明電舎	14,000	426.00	5,964,000
オリジン電気	500	1,797.00	898,500
山洋電気	800	9,640.00	7,712,000
デンヨー	1,500	1,934.00	2,901,000
東芝テック	12,000	606.00	7,272,000

芝浦メカトロニクス	3,000	458.00	1,374,000
マブチモーター	4,700	5,320.00	25,004,000
日本電産	20,300	16,745.00	339,923,500
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	600	3,115.00	1,869,000
トレックス・セミコンダクター	500	1,401.00	700,500
東光高岳	900	1,881.00	1,692,900
ダブル・スコープ	2,500	1,732.00	4,330,000
ダイヘン	9,000	844.00	7,596,000
ヤーマン	2,500	2,461.00	6,152,500
JVCケンウッド	12,500	357.00	4,462,500
ミマキエンジニアリング	1,500	901.00	1,351,500
第一精工	800	2,231.00	1,784,800
日新電機	4,000	1,136.00	4,544,000
大崎電気工業	3,700	788.00	2,915,600
オムロン	18,000	6,020.00	108,360,000
日東工業	2,700	1,880.00	5,076,000
I D E C	2,100	2,575.00	5,407,500
不二電機工業	200	1,415.00	283,000
ジーエス・ユアサ コーポレーション	30,000	589.00	17,670,000
サクサホールディングス	400	2,201.00	880,400
メルコホールディングス	800	4,290.00	3,432,000
テクノメディカ	400	2,084.00	833,600
日本電気	21,900	3,025.00	66,247,500
富士通	174,000	685.60	119,294,400
沖電気工業	6,900	1,502.00	10,363,800
岩崎通信機	800	834.00	667,200
電気興業	1,000	3,230.00	3,230,000
サンケン電気	10,000	727.00	7,270,000
ナカヨ	300	1,946.00	583,800
アイホン	1,000	1,846.00	1,846,000
ルネサスエレクトロニクス	8,800	1,071.00	9,424,800
セイコーエプソン	25,200	2,014.00	50,752,800
ワコム	13,200	564.00	7,444,800
アルバック	3,900	6,150.00	23,985,000
アクセル	800	874.00	699,200
E I Z O	1,500	5,300.00	7,950,000
ジャパンディスプレイ	35,100	142.00	4,984,200
日本信号	4,700	1,093.00	5,137,100
京三製作所	3,900	708.00	2,761,200
能美防災	2,200	2,313.00	5,088,600
ホーチキ	1,200	2,221.00	2,665,200
星和電機	600	650.00	390,000

エレコム	1,500	2,537.00	3,805,500
パナソニック	193,000	1,596.50	308,124,500
シャープ	15,700	3,180.00	49,926,000
アンリツ	12,400	1,420.00	17,608,000
富士通ゼネラル	5,200	1,762.00	9,162,400
ソニー	113,000	5,182.00	585,566,000
TDK	8,800	9,740.00	85,712,000
帝国通信工業	700	1,302.00	911,400
タムラ製作所	6,600	835.00	5,511,000
アルプス電気	14,600	2,542.00	37,113,200
池上通信機	6,000	174.00	1,044,000
パイオニア	28,700	174.00	4,993,800
日本電波工業	1,800	680.00	1,224,000
鈴木	800	1,114.00	891,200
日本トリム	400	4,595.00	1,838,000
ローランド ディー・ジー	900	2,606.00	2,345,400
フォスター電機	2,000	1,979.00	3,958,000
クラリオン	9,000	295.00	2,655,000
SMK	4,000	388.00	1,552,000
ヨコオ	1,100	2,232.00	2,455,200
ホシデン	4,300	1,316.00	5,658,800
ヒロセ電機	2,900	15,620.00	45,298,000
日本航空電子工業	4,000	1,884.00	7,536,000
TOA	1,800	1,233.00	2,219,400
マクセルホールディングス	3,400	1,800.00	6,120,000
古野電気	2,000	917.00	1,834,000
ユニデンホールディングス	5,000	280.00	1,400,000
アルパイン	4,000	2,109.00	8,436,000
スミダコーポレーション	1,800	1,392.00	2,505,600
アイコム	900	2,726.00	2,453,400
リオン	700	2,364.00	1,654,800
本多通信工業	1,300	1,146.00	1,489,800
船井電機	1,800	755.00	1,359,000
横河電機	16,900	2,372.00	40,086,800
新電元工業	600	6,850.00	4,110,000
アズビル	5,100	5,050.00	25,755,000
東亜ディーケーケー	800	1,365.00	1,092,000
日本光電工業	7,100	3,020.00	21,442,000
チノー	600	1,605.00	963,000
共和電業	2,000	447.00	894,000
日本電子材料	700	866.00	606,200
堀場製作所	3,300	8,000.00	26,400,000

アドバンテスト	9,500	2,691.00	25,564,500
小野測器	700	840.00	588,000
エスベック	1,500	2,657.00	3,985,500
キーエンス	8,300	67,010.00	556,183,000
日置電機	900	4,200.00	3,780,000
シスメックス	13,200	9,680.00	127,776,000
日本マイクロニクス	2,700	1,228.00	3,315,600
メガチップス	1,400	3,700.00	5,180,000
OBARA GROUP	1,000	6,340.00	6,340,000
澤藤電機	200	1,994.00	398,800
コーセル	2,400	1,455.00	3,492,000
イリソ電子工業	1,400	6,810.00	9,534,000
新日本無線	1,100	885.00	973,500
オプテックスグループ	2,800	3,450.00	9,660,000
千代田インテグレ	800	2,535.00	2,028,000
アイ・オー・データ機器	700	1,108.00	775,600
レーザーテック	3,500	3,865.00	13,527,500
スタンレー電気	12,900	3,945.00	50,890,500
岩崎電気	700	1,689.00	1,182,300
ウシオ電機	10,300	1,573.00	16,201,900
岡谷電機産業	1,400	626.00	876,400
ヘリオス テクノ ホールディング	1,400	907.00	1,269,800
日本セラミック	1,700	2,866.00	4,872,200
遠藤照明	900	996.00	896,400
古河電池	1,200	1,001.00	1,201,200
双信電機	800	646.00	516,800
山一電機	1,200	1,944.00	2,332,800
図研	1,100	1,700.00	1,870,000
日本電子	6,000	965.00	5,790,000
カシオ計算機	13,600	1,671.00	22,725,600
ファナック	16,100	23,700.00	381,570,000
日本シイエムケイ	3,000	840.00	2,520,000
エンブラス	800	3,270.00	2,616,000
大真空	700	1,340.00	938,000
ローム	7,600	10,440.00	79,344,000
浜松ホトニクス	12,300	4,360.00	53,628,000
三井ハイテック	2,300	1,604.00	3,689,200
新光電気工業	6,400	935.00	5,984,000
京セラ	27,700	6,695.00	185,451,500
太陽誘電	7,600	1,977.00	15,025,200
村田製作所	17,700	14,310.00	253,287,000
ユーシン	2,600	734.00	1,908,400

双葉電子工業	2,700	2,277.00	6,147,900
北陸電気工業	700	1,535.00	1,074,500
ニチコン	5,400	1,252.00	6,760,800
日本ケミコン	1,400	2,634.00	3,687,600
K O A	2,400	2,304.00	5,529,600
市光工業	2,500	1,168.00	2,920,000
小糸製作所	10,100	7,540.00	76,154,000
ミツバ	3,100	1,621.00	5,025,100
S C R E E Nホールディングス	3,200	9,470.00	30,304,000
キャノン電子	1,600	2,537.00	4,059,200
キャノン	90,900	3,784.00	343,965,600
リコー	50,900	1,044.00	53,139,600
象印マホービン	3,200	1,565.00	5,008,000
M U T O Hホールディングス	200	2,473.00	494,600
東京エレクトロン	11,300	21,055.00	237,921,500
トヨタ紡織	4,900	2,219.00	10,873,100
芦森工業	400	2,552.00	1,020,800
ユニプレス	3,300	2,575.00	8,497,500
豊田自動織機	13,600	6,720.00	91,392,000
モリタホールディングス	2,700	2,333.00	6,299,100
三櫻工業	2,200	778.00	1,711,600
デンソー	37,500	5,597.00	209,887,500
東海理化電機製作所	4,500	2,198.00	9,891,000
三井E & Sホールディングス	6,200	1,659.00	10,285,800
川崎重工業	13,200	3,505.00	46,266,000
名村造船所	5,100	663.00	3,381,300
サノヤスホールディングス	2,100	272.00	571,200
日本車輛製造	7,000	281.00	1,967,000
三菱ロジスネクスト	2,100	1,117.00	2,345,700
近畿車輛	300	2,723.00	816,900
日産自動車	199,300	1,113.00	221,820,900
いすゞ自動車	49,000	1,668.00	81,732,000
トヨタ自動車	205,300	7,155.00	1,468,921,500
日野自動車	24,200	1,281.00	31,000,200
三菱自動車工業	62,600	793.00	49,641,800
エフテック	1,100	1,405.00	1,545,500
レシップホールディングス	700	835.00	584,500
G M B	300	1,535.00	460,500
ファルテック	300	1,338.00	401,400
武蔵精密工業	1,800	3,965.00	7,137,000
日産車体	6,600	1,130.00	7,458,000
新明和工業	7,400	1,198.00	8,865,200

極東開発工業	3,100	1,719.00	5,328,900
日信工業	3,500	1,929.00	6,751,500
トピー工業	1,400	3,325.00	4,655,000
ティラド	600	3,865.00	2,319,000
曙ブレーキ工業	8,200	286.00	2,345,200
タチエス	2,900	2,006.00	5,817,400
NOK	9,100	2,255.00	20,520,500
フタバ産業	5,200	853.00	4,435,600
KYB	1,800	5,170.00	9,306,000
大同メタル工業	2,200	1,303.00	2,866,600
プレス工業	9,000	621.00	5,589,000
ミクニ	2,100	638.00	1,339,800
太平洋工業	3,500	1,570.00	5,495,000
ケーヒン	3,900	2,215.00	8,638,500
河西工業	2,100	1,515.00	3,181,500
アイシン精機	13,900	5,970.00	82,983,000
マツダ	53,100	1,462.00	77,632,200
今仙電機製作所	1,600	1,224.00	1,958,400
本田技研工業	152,000	3,630.00	551,760,000
スズキ	33,500	5,829.00	195,271,500
SUBARU	52,400	3,676.00	192,622,400
安永	800	2,344.00	1,875,200
ヤマハ発動機	23,900	3,375.00	80,662,500
ショーワ	4,400	1,984.00	8,729,600
TBK	2,000	560.00	1,120,000
エクセディ	2,000	3,705.00	7,410,000
豊田合成	6,200	2,906.00	18,017,200
愛三工業	3,000	1,105.00	3,315,000
盟和産業	200	1,344.00	268,800
日本プラスト	900	1,028.00	925,200
ヨロズ	1,700	1,838.00	3,124,600
エフ・シー・シー	2,800	2,978.00	8,338,400
シマノ	6,800	14,770.00	100,436,000
テイ・エス テック	3,900	4,760.00	18,564,000
ジャムコ	900	2,615.00	2,353,500
テルモ	25,900	6,060.00	156,954,000
クリエートメディック	500	1,381.00	690,500
日機装	5,900	1,206.00	7,115,400
島津製作所	20,200	2,980.00	60,196,000
JMS	1,500	643.00	964,500
長野計器	1,300	1,324.00	1,721,200
バイ・テクノロジー	400	28,490.00	11,396,000

東京計器	1,100	1,228.00	1,350,800
愛知時計電機	200	4,170.00	834,000
インターアクション	900	1,200.00	1,080,000
オーバル	1,900	306.00	581,400
東京精密	3,100	4,195.00	13,004,500
マニー	2,100	4,635.00	9,733,500
ニコン	29,500	1,915.00	56,492,500
トプコン	9,100	2,105.00	19,155,500
オリンパス	25,200	4,035.00	101,682,000
理研計器	1,600	2,537.00	4,059,200
タムロン	1,400	2,319.00	3,246,600
HOYA	34,000	5,824.00	198,016,000
シード	200	6,950.00	1,390,000
ノーリツ鋼機	1,700	2,876.00	4,889,200
エー・アンド・デイ	1,600	750.00	1,200,000
シチズン時計	20,200	819.00	16,543,800
リズム時計工業	600	2,391.00	1,434,600
大研医器	1,500	749.00	1,123,500
メニコン	2,300	2,883.00	6,630,900
シンシア	200	742.00	148,400
松風	800	1,435.00	1,148,000
セイコーホールディングス	2,600	2,850.00	7,410,000
ニプロ	11,700	1,541.00	18,029,700
中本パックス	400	1,829.00	731,600
スノーピーク	500	1,499.00	749,500
パラマウントベッドホールディングス	1,800	5,470.00	9,846,000
トランザクション	900	1,009.00	908,100
SHO-BI	700	438.00	306,600
ニホンフラッシュ	800	2,967.00	2,373,600
前田工織	1,900	1,834.00	3,484,600
永大産業	2,100	560.00	1,176,000
アートネイチャー	1,800	741.00	1,333,800
バンダイナムコホールディングス	17,500	3,800.00	66,500,000
アイフィスジャパン	400	705.00	282,000
共立印刷	2,800	371.00	1,038,800
SHOEI	800	4,110.00	3,288,000
フランスベッドホールディングス	2,000	991.00	1,982,000
パイロットコーポレーション	2,900	6,160.00	17,864,000
萩原工業	900	1,993.00	1,793,700
トッパン・フォームズ	3,700	1,234.00	4,565,800
フジシールインターナショナル	3,800	4,095.00	15,561,000
タカラトミー	7,100	1,115.00	7,916,500

廣濟堂	1,600	543.00	868,800
A s - m e エステール	500	891.00	445,500
アーク	9,200	128.00	1,177,600
タカノ	700	982.00	687,400
プロネクサス	1,600	1,346.00	2,153,600
ホクシン	1,500	179.00	268,500
ウッドワン	600	1,538.00	922,800
大建工業	1,300	2,749.00	3,573,700
凸版印刷	48,000	919.00	44,112,000
大日本印刷	22,100	2,364.00	52,244,400
図書印刷	1,100	1,029.00	1,131,900
共同印刷	500	3,370.00	1,685,000
N I S S H A	3,500	2,832.00	9,912,000
光村印刷	200	2,515.00	503,000
宝印刷	900	2,055.00	1,849,500
アシックス	16,800	2,073.00	34,826,400
ツツミ	500	2,085.00	1,042,500
小松ウオール工業	600	2,426.00	1,455,600
ヤマハ	11,400	5,720.00	65,208,000
河合楽器製作所	600	3,940.00	2,364,000
クリナップ	1,600	891.00	1,425,600
ビジョン	10,200	5,210.00	53,142,000
兼松サステック	100	2,191.00	219,100
キングジム	1,500	1,097.00	1,645,500
リンテック	4,000	3,115.00	12,460,000
イトーキ	3,600	671.00	2,415,600
任天堂	10,400	47,240.00	491,296,000
三菱鉛筆	2,800	2,241.00	6,274,800
タカラスタンダード	3,500	1,864.00	6,524,000
コクヨ	8,100	2,015.00	16,321,500
ナカバヤシ	1,600	643.00	1,028,800
グローブライド	800	3,325.00	2,660,000
オカムラ	5,900	1,578.00	9,310,200
美津濃	1,700	3,600.00	6,120,000
東京電力ホールディングス	134,800	597.00	80,475,600
中部電力	51,600	1,809.50	93,370,200
関西電力	68,800	1,669.00	114,827,200
中国電力	23,400	1,428.00	33,415,200
北陸電力	16,900	1,148.00	19,401,200
東北電力	39,500	1,511.00	59,684,500
四国電力	15,300	1,414.00	21,634,200
九州電力	37,300	1,371.00	51,138,300

北海道電力	17,100	815.00	13,936,500
沖縄電力	2,700	3,270.00	8,829,000
電源開発	13,400	3,060.00	41,004,000
エフオン	800	1,546.00	1,236,800
イーレックス	2,700	900.00	2,430,000
レノバ	800	1,123.00	898,400
東京瓦斯	36,100	2,933.00	105,881,300
大阪瓦斯	32,800	2,346.00	76,948,800
東邦瓦斯	8,400	3,435.00	28,854,000
北海道瓦斯	4,000	304.00	1,216,000
広島ガス	3,400	382.00	1,298,800
西部瓦斯	2,000	2,956.00	5,912,000
静岡ガス	4,800	987.00	4,737,600
メタウォーター	1,000	3,135.00	3,135,000
S B Sホールディングス	1,700	1,360.00	2,312,000
東武鉄道	17,900	3,370.00	60,323,000
相鉄ホールディングス	5,400	3,165.00	17,091,000
東京急行電鉄	46,000	1,848.00	85,008,000
京浜急行電鉄	23,300	1,973.00	45,970,900
小田急電鉄	25,300	2,358.00	59,657,400
京王電鉄	9,500	4,885.00	46,407,500
京成電鉄	11,800	3,555.00	41,949,000
富士急行	2,300	3,105.00	7,141,500
新京成電鉄	400	2,294.00	917,600
東日本旅客鉄道	30,300	10,690.00	323,907,000
西日本旅客鉄道	15,200	8,069.00	122,648,800
東海旅客鉄道	15,100	21,445.00	323,819,500
西武ホールディングス	21,600	1,919.00	41,450,400
鴻池運輸	2,400	1,911.00	4,586,400
西日本鉄道	4,700	3,085.00	14,499,500
ハマキョウレックス	1,200	3,845.00	4,614,000
サカイ引越センター	900	5,850.00	5,265,000
近鉄グループホールディングス	16,000	4,475.00	71,600,000
阪急阪神ホールディングス	21,300	4,300.00	91,590,000
南海電気鉄道	7,600	3,025.00	22,990,000
京阪ホールディングス	7,100	3,545.00	25,169,500
神戸電鉄	400	4,015.00	1,606,000
名古屋鉄道	12,800	2,863.00	36,646,400
山陽電気鉄道	1,300	2,791.00	3,628,300
日本通運	6,300	8,320.00	52,416,000
ヤマトホールディングス	28,100	3,037.00	85,339,700
山九	4,100	5,430.00	22,263,000

丸運	800	348.00	278,400
丸全昭和運輸	5,000	522.00	2,610,000
センコーグループホールディングス	9,600	897.00	8,611,200
トナミホールディングス	400	7,410.00	2,964,000
ニッコンホールディングス	6,000	3,030.00	18,180,000
日本石油輸送	200	3,400.00	680,000
福山通運	2,300	4,760.00	10,948,000
セイノーホールディングス	12,000	2,071.00	24,852,000
エスライン	400	1,217.00	486,800
神奈川中央交通	400	3,730.00	1,492,000
日立物流	3,500	3,175.00	11,112,500
丸和運輸機関	800	3,355.00	2,684,000
C & F ロジホールディングス	1,700	1,491.00	2,534,700
九州旅客鉄道	13,400	3,505.00	46,967,000
S Gホールディングス	15,100	2,371.00	35,802,100
日本郵船	13,500	2,424.00	32,724,000
商船三井	10,200	3,310.00	33,762,000
川崎汽船	7,500	2,435.00	18,262,500
N S ユナイテッド海運	700	2,201.00	1,540,700
飯野海運	8,200	516.00	4,231,200
共栄タンカー	100	1,872.00	187,200
乾汽船	1,300	862.00	1,120,600
日本航空	29,700	4,130.00	122,661,000
A N Aホールディングス	31,100	4,230.00	131,553,000
パスコ	2,000	337.00	674,000
トランコム	400	8,460.00	3,384,000
日新	1,400	2,891.00	4,047,400
三菱倉庫	5,600	2,486.00	13,921,600
三井倉庫ホールディングス	10,000	357.00	3,570,000
住友倉庫	11,000	747.00	8,217,000
澁澤倉庫	900	1,878.00	1,690,200
東陽倉庫	3,000	370.00	1,110,000
日本トランスシティ	3,600	539.00	1,940,400
ケイヒン	300	1,642.00	492,600
中央倉庫	900	1,140.00	1,026,000
川西倉庫	300	2,091.00	627,300
安田倉庫	1,500	1,007.00	1,510,500
東洋埠頭	500	1,737.00	868,500
宇徳	1,300	496.00	644,800
上組	9,900	2,490.00	24,651,000
サンリツ	500	800.00	400,000
キムラユニティー	400	1,179.00	471,600

キユーソー流通システム	500	2,818.00	1,409,000
近鉄エクスプレス	3,100	2,086.00	6,466,600
東海運	1,000	398.00	398,000
エーアイテイー	1,100	1,200.00	1,320,000
内外トランスライン	600	1,810.00	1,086,000
日本コンセプト	300	1,511.00	453,300
NECネットエスアイ	1,800	2,752.00	4,953,600
システナ	1,300	4,290.00	5,577,000
デジタルアーツ	800	4,475.00	3,580,000
新日鉄住金ソリューションズ	2,500	3,085.00	7,712,500
キューブシステム	1,000	824.00	824,000
エイジア	300	1,491.00	447,300
コア	800	1,506.00	1,204,800
ソリトンシステムズ	700	1,541.00	1,078,700
ソフトクリエイトホールディングス	800	1,813.00	1,450,400
T I S	5,500	4,315.00	23,732,500
ネオス	500	407.00	203,500
電算システム	600	2,037.00	1,222,200
グリー	9,000	660.00	5,940,000
コーエーテクモホールディングス	2,800	2,293.00	6,420,400
三菱総合研究所	600	4,340.00	2,604,000
ボルテージ	400	945.00	378,000
電算	200	2,369.00	473,800
A G S	1,000	928.00	928,000
ファインデックス	1,400	836.00	1,170,400
ヒト・コミュニケーションズ	400	2,073.00	829,200
ブレインパッド	400	2,809.00	1,123,600
K L a b	3,200	1,894.00	6,060,800
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	1,200	1,978.00	2,373,600
イーブックイニシアティブジャパン	300	1,253.00	375,900
ネクソン	37,300	1,633.00	60,910,900
アイスタイル	4,200	1,193.00	5,010,600
エムアップ	600	1,471.00	882,600
エイチーム	1,000	2,310.00	2,310,000
テクノスジャパン	1,500	1,002.00	1,503,000
コロブラ	4,700	819.00	3,849,300
モバイルクリエイト	1,400	381.00	533,400
ブロードリーフ	8,300	538.00	4,465,400
クロス・マーケティンググループ	500	648.00	324,000
ハーツユナイテッドグループ	900	1,835.00	1,651,500
メディアドゥホールディングス	600	2,041.00	1,224,600
バイキューブ	1,100	620.00	682,000

サイバーリンクス	300	1,200.00	360,000
フィックスターズ	1,600	1,441.00	2,305,600
VOYAGE GROUP	900	1,174.00	1,056,600
オプティム	300	2,672.00	801,600
セレス	500	2,009.00	1,004,500
ベリサーブ	200	3,295.00	659,000
ティーガイア	1,700	2,979.00	5,064,300
セック	200	2,785.00	557,000
日本アジアグループ	1,800	544.00	979,200
豆蔵ホールディングス	1,200	1,336.00	1,603,200
テクマトリックス	900	1,724.00	1,551,600
プロシップ	200	2,894.00	578,800
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	45,000	298.00	13,410,000
GMOペイメントゲートウェイ	1,400	11,200.00	15,680,000
ザッパラス	1,100	385.00	423,500
システムリサーチ	200	2,331.00	466,200
インターネットイニシアティブ	2,700	2,086.00	5,632,200
さくらインターネット	2,000	854.00	1,708,000
ヴィンクス	500	1,573.00	786,500
GMOクラウド	400	2,524.00	1,009,600
SRAホールディングス	900	3,100.00	2,790,000
Minorityソリューションズ	300	1,712.00	513,600
システムインテグレータ	300	1,159.00	347,700
朝日ネット	1,600	538.00	860,800
eBASE	500	1,417.00	708,500
アバント	400	907.00	362,800
アドソル日進	600	1,337.00	802,200
フリービット	1,100	1,149.00	1,263,900
コムチュア	800	3,880.00	3,104,000
サイバーコム	300	2,353.00	705,900
インフォテリア	800	1,355.00	1,084,000
メディカル・データ・ビジョン	1,200	1,525.00	1,830,000
gumi	1,900	1,001.00	1,901,900
ショーケース・ティービー	300	1,437.00	431,100
モバイルファクトリー	400	1,469.00	587,600
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	700	1,267.00	886,900
PCIホールディングス	300	3,105.00	931,500
パイブドHD	300	1,044.00	313,200
アイビーシー	300	1,325.00	397,500
ネオジャパン	400	1,346.00	538,400
オープンドア	700	2,056.00	1,439,200

マイネット	400	1,320.00	528,000
アカツキ	400	4,885.00	1,954,000
ベネフィットジャパン	100	1,175.00	117,500
Ubicomホールディングス	200	970.00	194,000
LINE	5,000	4,025.00	20,125,000
シンクロ・フード	600	977.00	586,200
オークネット	700	1,412.00	988,400
AOI TYO Holdings	1,400	1,605.00	2,247,000
マクロミル	2,100	2,768.00	5,812,800
ビーグリー	400	1,741.00	696,400
オロ	200	2,064.00	412,800
ソルクシーズ	700	1,333.00	933,100
フェイス	600	1,153.00	691,800
ハイマックス	200	1,796.00	359,200
野村総合研究所	10,500	5,480.00	57,540,000
サイバネットシステム	1,400	882.00	1,234,800
CEホールディングス	500	942.00	471,000
日本システム技術	300	1,364.00	409,200
インテージホールディングス	2,000	1,230.00	2,460,000
東邦システムサイエンス	500	876.00	438,000
ソースネクスト	2,400	856.00	2,054,400
フォーカスシステムズ	1,000	967.00	967,000
クレスコ	400	3,820.00	1,528,000
フジ・メディア・ホールディングス	17,400	1,763.00	30,676,200
オービック	5,200	9,300.00	48,360,000
ジャストシステム	2,700	2,610.00	7,047,000
TDCソフト	700	1,401.00	980,700
ヤフー	119,700	404.00	48,358,800
トレンドマイクロ	8,100	6,510.00	52,731,000
インフォメーション・ディベロプメント	500	1,446.00	723,000
日本オラクル	2,700	8,960.00	24,192,000
アルファシステムズ	500	2,423.00	1,211,500
フューチャー	2,300	1,461.00	3,360,300
CAC Holdings	1,300	1,097.00	1,426,100
ソフトバンク・テクノロジー	700	1,710.00	1,197,000
トーセ	500	1,240.00	620,000
オービックビジネスコンサルタント	800	7,820.00	6,256,000
伊藤忠テクノソリューションズ	7,600	2,037.00	15,481,200
アイティフォー	2,100	1,196.00	2,511,600
東計電算	300	3,170.00	951,000
エクスネット	300	898.00	269,400
大塚商会	10,000	4,480.00	44,800,000

サイボウズ	2,300	553.00	1,271,900
ソフトブレーン	1,300	524.00	681,200
電通国際情報サービス	1,000	3,245.00	3,245,000
デジタルガレージ	3,000	3,805.00	11,415,000
EMシステムズ	1,200	1,306.00	1,567,200
ウェザーニューズ	600	3,535.00	2,121,000
C I J	1,400	756.00	1,058,400
東洋ビジネスエンジニアリング	200	1,850.00	370,000
日本エンタープライズ	1,900	241.00	457,900
WOWOW	800	3,445.00	2,756,000
スカラ	1,400	844.00	1,181,600
イマジカ・ロボット ホールディングス	1,400	1,238.00	1,733,200
ネットワンシステムズ	6,800	1,893.00	12,872,400
システムソフト	4,200	145.00	609,000
アルゴグラフィックス	800	3,795.00	3,036,000
マーベラス	2,800	937.00	2,623,600
エイベックス	3,100	1,533.00	4,752,300
日本ユニシス	4,600	2,299.00	10,575,400
兼松エレクトロニクス	1,000	3,670.00	3,670,000
東京放送ホールディングス	9,200	2,387.00	21,960,400
日本テレビホールディングス	15,200	1,890.00	28,728,000
朝日放送グループホールディングス	1,600	870.00	1,392,000
テレビ朝日ホールディングス	4,600	2,560.00	11,776,000
スカパーJ S A Tホールディングス	12,700	502.00	6,375,400
テレビ東京ホールディングス	1,400	2,962.00	4,146,800
日本BS放送	600	1,445.00	867,000
ビジョン	400	3,220.00	1,288,000
USEN-NEXT HOLDINGS	500	935.00	467,500
ワイヤレスゲート	800	1,446.00	1,156,800
コネクシオ	1,200	2,168.00	2,601,600
クロップス	400	932.00	372,800
日本電信電話	118,900	5,284.00	628,267,600
KDDI	149,300	2,905.50	433,791,150
光通信	2,000	17,500.00	35,000,000
NTTドコモ	118,900	2,801.50	333,098,350
エムティーアイ	1,900	687.00	1,305,300
GMOインターネット	6,100	2,123.00	12,950,300
アイドママーケティングコミュニケーション	400	669.00	267,600
カドカワ	4,900	1,187.00	5,816,300
学研ホールディングス	600	5,270.00	3,162,000
ゼンリン	3,000	2,563.00	7,689,000
昭文社	800	850.00	680,000

インプレスホールディングス	1,500	210.00	315,000
アイネット	1,000	1,687.00	1,687,000
松竹	1,100	16,250.00	17,875,000
東宝	10,900	3,880.00	42,292,000
東映	600	12,150.00	7,290,000
エヌ・ティ・ティ・データ	51,600	1,215.00	62,694,000
ピー・シー・エー	300	1,789.00	536,700
ビジネスブレイン太田昭和	300	2,284.00	685,200
D T S	1,700	3,985.00	6,774,500
スクウェア・エニックス・ホールディングス	7,700	4,690.00	36,113,000
シーイーシー	1,000	3,460.00	3,460,000
カプコン	7,100	2,179.00	15,470,900
アイ・エス・ビー	300	2,079.00	623,700
ジャステック	1,000	1,239.00	1,239,000
S C S K	3,800	4,935.00	18,753,000
日本システムウエア	600	2,558.00	1,534,800
アイネス	2,100	1,214.00	2,549,400
T K C	1,400	4,335.00	6,069,000
富士ソフト	2,300	4,295.00	9,878,500
N S D	2,700	2,313.00	6,245,100
コナミホールディングス	6,800	5,470.00	37,196,000
福井コンピュータホールディングス	500	2,218.00	1,109,000
J B C C ホールディングス	1,300	1,095.00	1,423,500
ミロク情報サービス	1,500	3,120.00	4,680,000
ソフトバンクグループ	75,100	8,489.00	637,523,900
ハウスイ	300	1,185.00	355,500
高千穂交易	700	1,137.00	795,900
伊藤忠食品	400	6,230.00	2,492,000
エレマテック	800	2,507.00	2,005,600
J A L U X	500	2,990.00	1,495,000
あらた	800	6,230.00	4,984,000
トーマンデバイス	200	2,953.00	590,600
東京エレクトロン デバイス	600	2,129.00	1,277,400
フィールズ	1,300	1,174.00	1,526,200
双日	98,600	412.00	40,623,200
アルフレッサ ホールディングス	18,500	2,466.00	45,621,000
横浜冷凍	4,400	1,107.00	4,870,800
ラサ商事	800	940.00	752,000
ラクーン	1,000	672.00	672,000
アルコニックス	1,800	2,023.00	3,641,400
神戸物産	1,100	5,230.00	5,753,000
ペッパーフードサービス	1,200	5,690.00	6,828,000

あい ホールディングス	2,700	2,971.00	8,021,700
ディービーエックス	600	1,360.00	816,000
ダイワボウホールディングス	1,400	5,130.00	7,182,000
マクニカ・富士エレホールディングス	3,200	1,854.00	5,932,800
ラクト・ジャパン	300	4,995.00	1,498,500
バイタルケーエスケー・ホールディングス	3,100	1,064.00	3,298,400
八洲電機	1,300	949.00	1,233,700
メディアスホールディングス	900	1,088.00	979,200
U K Cホールディングス	1,100	2,299.00	2,528,900
ジューテックホールディングス	400	1,170.00	468,000
大光	400	889.00	355,600
O C H Iホールディングス	500	1,615.00	807,500
T O K A Iホールディングス	8,800	1,099.00	9,671,200
C o m i n i x	300	986.00	295,800
三洋貿易	800	2,168.00	1,734,400
ビューティガレージ	200	2,430.00	486,000
ウイン・パートナーズ	1,200	1,470.00	1,764,000
ミタチ産業	400	1,186.00	474,400
シップヘルスケアホールディングス	3,500	3,775.00	13,212,500
明治電機工業	600	2,014.00	1,208,400
デリカフーズホールディングス	300	1,659.00	497,700
スターティアホールディングス	400	930.00	372,000
コメダホールディングス	3,100	2,163.00	6,705,300
富士興産	700	635.00	444,500
協栄産業	200	2,088.00	417,600
小野建	1,400	1,898.00	2,657,200
佐鳥電機	1,200	1,150.00	1,380,000
エコートレーディング	500	734.00	367,000
伯東	1,000	1,855.00	1,855,000
コンドーテック	1,300	950.00	1,235,000
中山福	900	748.00	673,200
ナガイレーベン	2,400	2,915.00	6,996,000
三菱食品	1,800	3,150.00	5,670,000
松田産業	1,200	1,902.00	2,282,400
第一興商	2,500	5,820.00	14,550,000
メディパルホールディングス	16,700	2,344.00	39,144,800
S P K	300	2,818.00	845,400
萩原電気ホールディングス	600	3,045.00	1,827,000
アズワン	1,300	7,170.00	9,321,000
スズデン	600	1,696.00	1,017,600
尾家産業	500	1,371.00	685,500
シモジマ	1,000	1,186.00	1,186,000

ドウシシャ	1,800	2,539.00	4,570,200
小津産業	400	2,353.00	941,200
高速	1,000	1,358.00	1,358,000
たけびし	600	1,771.00	1,062,600
リックス	400	2,111.00	844,400
丸文	1,500	1,000.00	1,500,000
ハピネット	1,200	1,560.00	1,872,000
橋本総業ホールディングス	300	1,836.00	550,800
日本ライフライン	4,700	2,617.00	12,299,900
エクセル	700	2,869.00	2,008,300
マルカキカイ	500	2,116.00	1,058,000
I D O M	5,100	795.00	4,054,500
日本エム・ディ・エム	1,200	1,109.00	1,330,800
進和	1,000	2,574.00	2,574,000
エスケイジャパン	500	585.00	292,500
ダイトロン	800	2,088.00	1,670,400
シークス	2,100	2,243.00	4,710,300
田中商事	500	723.00	361,500
オーハシテクニカ	900	1,788.00	1,609,200
白銅	600	2,248.00	1,348,800
伊藤忠商事	122,100	2,083.00	254,334,300
丸紅	136,800	859.80	117,620,640
高島	300	2,209.00	662,700
長瀬産業	10,000	1,947.00	19,470,000
蝶理	1,000	2,114.00	2,114,000
豊田通商	18,600	4,060.00	75,516,000
三共生興	2,900	499.00	1,447,100
兼松	7,100	1,691.00	12,006,100
ツカモトコーポレーション	400	1,291.00	516,400
三井物産	141,300	1,923.50	271,790,550
日本紙パルプ商事	900	4,520.00	4,068,000
日立ハイテクノロジーズ	5,800	4,995.00	28,971,000
カメイ	2,200	1,512.00	3,326,400
東都水産	200	1,913.00	382,600
O U Gホールディングス	300	2,683.00	804,900
スターゼン	700	5,610.00	3,927,000
山善	6,500	1,118.00	7,267,000
椿本興業	400	3,860.00	1,544,000
住友商事	104,900	1,995.50	209,327,950
内田洋行	800	3,060.00	2,448,000
三菱商事	116,700	3,177.00	370,755,900
第一実業	800	3,320.00	2,656,000

キヤノンマーケティングジャパン	4,800	2,471.00	11,860,800
西華産業	1,000	2,801.00	2,801,000
佐藤商事	1,300	1,220.00	1,586,000
菱洋エレクトロ	1,600	1,900.00	3,040,000
東京産業	1,600	563.00	900,800
ユアサ商事	1,600	3,575.00	5,720,000
神鋼商事	400	3,415.00	1,366,000
小林産業	1,300	365.00	474,500
阪和興業	3,100	4,770.00	14,787,000
正栄食品工業	900	4,520.00	4,068,000
カナデン	1,500	1,374.00	2,061,000
菱電商事	1,200	1,801.00	2,161,200
フルサト工業	900	1,883.00	1,694,700
岩谷産業	3,700	4,045.00	14,966,500
すてきナイスグループ	700	1,446.00	1,012,200
昭光通商	8,000	110.00	880,000
極東貿易	2,000	526.00	1,052,000
イワキ	2,500	414.00	1,035,000
三愛石油	4,400	1,708.00	7,515,200
稲畑産業	4,000	1,674.00	6,696,000
G S Iクレオス	500	1,722.00	861,000
明和産業	1,600	533.00	852,800
ワキタ	3,600	1,207.00	4,345,200
東邦ホールディングス	4,900	2,710.00	13,279,000
サンゲツ	5,600	2,264.00	12,678,400
ミツウロコグループホールディングス	2,400	917.00	2,200,800
シナネンホールディングス	700	2,711.00	1,897,700
伊藤忠エネクス	3,700	1,074.00	3,973,800
サンリオ	4,700	2,051.00	9,639,700
サンワテクノス	1,100	1,635.00	1,798,500
リョーサン	2,100	4,150.00	8,715,000
新光商事	1,800	1,886.00	3,394,800
トーヨー	800	2,625.00	2,100,000
三信電気	1,500	2,402.00	3,603,000
東陽テクニカ	2,000	970.00	1,940,000
モスフードサービス	2,200	3,305.00	7,271,000
加賀電子	1,500	2,775.00	4,162,500
ソーダニッカ	1,700	744.00	1,264,800
立花エレテック	1,100	2,027.00	2,229,700
フォーバル	700	889.00	622,300
P A L T A C	2,300	5,460.00	12,558,000
三谷産業	1,800	423.00	761,400

太平洋興発	800	1,047.00	837,600
西本Wismettacホールディングス	500	4,725.00	2,362,500
ヤマシタヘルスケアホールディングス	200	1,570.00	314,000
ヤマタネ	900	1,960.00	1,764,000
丸紅建材リース	2,000	236.00	472,000
日鉄住金物産	1,300	6,070.00	7,891,000
泉州電業	600	3,125.00	1,875,000
トラスコ中山	3,500	2,746.00	9,611,000
オートバックスセブン	6,600	2,151.00	14,196,600
モリト	1,400	1,045.00	1,463,000
加藤産業	2,600	4,035.00	10,491,000
イノテック	1,500	1,403.00	2,104,500
イエローハット	1,600	3,315.00	5,304,000
J Kホールディングス	1,700	935.00	1,589,500
日伝	1,400	2,126.00	2,976,400
北沢産業	1,900	309.00	587,100
杉本商事	800	2,061.00	1,648,800
因幡電機産業	2,200	4,910.00	10,802,000
バイテックホールディングス	800	2,614.00	2,091,200
東テク	600	2,606.00	1,563,600
ミスミグループ本社	19,400	3,110.00	60,334,000
タキヒヨー	600	2,394.00	1,436,400
蔵王産業	300	1,772.00	531,600
スズケン	7,600	4,700.00	35,720,000
ジェコス	1,100	1,147.00	1,261,700
ルネサスイーストン	1,600	696.00	1,113,600
ローソン	4,200	6,970.00	29,274,000
サンエー	1,300	5,740.00	7,462,000
カワチ薬品	1,300	2,557.00	3,324,100
エービーシー・マート	3,000	7,150.00	21,450,000
ハードオフコーポレーション	700	1,151.00	805,700
アスクル	1,500	3,395.00	5,092,500
ゲオホールディングス	3,100	1,640.00	5,084,000
アダストリア	2,600	1,687.00	4,386,200
ジーフット	1,000	794.00	794,000
くらコーポレーション	1,000	7,960.00	7,960,000
キャンドウ	800	1,826.00	1,460,800
パルグループホールディングス	900	2,920.00	2,628,000
エディオン	6,500	1,267.00	8,235,500
サーラコーポレーション	2,900	694.00	2,012,600
ワッツ	600	1,189.00	713,400
ハローズ	600	2,672.00	1,603,200

あみやき亭	400	5,490.00	2,196,000
ひらまつ	2,400	506.00	1,214,400
大黒天物産	400	5,920.00	2,368,000
ハニーズホールディングス	1,600	1,062.00	1,699,200
ファーマライズホールディングス	400	720.00	288,000
アルペン	1,300	2,472.00	3,213,600
ハブ	400	1,142.00	456,800
クオール	1,800	2,141.00	3,853,800
ジンス	1,100	5,790.00	6,369,000
ビックカメラ	8,900	1,838.00	16,358,200
D C Mホールディングス	9,000	1,082.00	9,738,000
MonotaRO	5,900	4,160.00	24,544,000
東京一番フーズ	500	691.00	345,500
DDホールディングス	400	2,838.00	1,135,200
きちり	500	734.00	367,000
アークランドサービスホールディングス	1,400	2,504.00	3,505,600
J.フロント リテイリング	19,900	1,776.00	35,342,400
ドトール・日レスホールディングス	2,900	2,347.00	6,806,300
マツモトキヨシホールディングス	6,900	5,010.00	34,569,000
ブロンコビリー	900	4,530.00	4,077,000
スタートトゥデイ	16,400	3,475.00	56,990,000
トレジャー・ファクトリー	500	812.00	406,000
物語コーポレーション	500	13,220.00	6,610,000
ココカラファイン	1,700	7,810.00	13,277,000
三越伊勢丹ホールディングス	31,200	1,219.00	38,032,800
Hamee	400	1,615.00	646,000
ウエルシアホールディングス	4,400	5,730.00	25,212,000
クリエイトSDホールディングス	2,500	3,220.00	8,050,000
丸善CHIホールディングス	2,100	360.00	756,000
ミサワ	400	430.00	172,000
ティーライフ	200	1,326.00	265,200
エー・ピーカンパニー	400	789.00	315,600
チムニー	500	2,958.00	1,479,000
シュッピン	1,000	1,299.00	1,299,000
ネクステージ	1,800	1,155.00	2,079,000
ジョイフル本田	2,400	3,970.00	9,528,000
鳥貴族	600	2,836.00	1,701,600
麒麟堂ホールディングス	600	3,000.00	1,800,000
ホットランド	1,000	1,359.00	1,359,000
すかいらーく	10,400	1,608.00	16,723,200
綿半ホールディングス	600	3,920.00	2,352,000
ヨシックス	300	3,535.00	1,060,500

ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	5,500	1,410.00	7,755,000
ブックオフコーポレーション	1,000	828.00	828,000
ゴルフダイジェスト・オンライン	700	1,198.00	838,600
B E E N O S	400	1,559.00	623,600
あさひ	1,300	1,337.00	1,738,100
日本調剤	600	3,320.00	1,992,000
コスモス薬品	800	24,270.00	19,416,000
トーエル	800	1,047.00	837,600
一六堂	500	422.00	211,000
オンリー	300	1,006.00	301,800
セブン&アイ・ホールディングス	69,700	4,800.00	334,560,000
薬王堂	700	4,050.00	2,835,000
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	4,500	1,382.00	6,219,000
ツルハホールディングス	3,600	16,090.00	57,924,000
サンマルクホールディングス	1,200	3,150.00	3,780,000
フェリシモ	400	1,375.00	550,000
トリドールホールディングス	2,100	3,705.00	7,780,500
T O K Y O B A S E	1,500	1,062.00	1,593,000
ウイルプラスホールディングス	200	1,145.00	229,000
サツドラホールディングス	300	2,491.00	747,300
ダイユー・リックホールディングス	800	1,046.00	836,800
パロックジャパンリミテッド	1,300	1,180.00	1,534,000
クスリのアオキホールディングス	1,300	7,700.00	10,010,000
力の源ホールディングス	400	1,916.00	766,400
スシローグローバルホールディングス	1,800	5,830.00	10,494,000
L I X I L ビバ	2,100	1,955.00	4,105,500
メディカルシステムネットワーク	2,000	539.00	1,078,000
総合メディカル	1,400	2,596.00	3,634,400
はるやまホールディングス	700	1,098.00	768,600
ノジマ	2,900	2,609.00	7,566,100
カッパ・クリエイト	2,200	1,525.00	3,355,000
ライトオン	1,400	1,050.00	1,470,000
ジーンズメイト	500	877.00	438,500
良品計画	2,200	38,800.00	85,360,000
三城ホールディングス	2,100	516.00	1,083,600
アドヴァン	1,700	1,011.00	1,718,700
アルビス	500	3,895.00	1,947,500
コナカ	2,100	598.00	1,255,800
ハウス オブ ローゼ	200	1,818.00	363,600
G - 7ホールディングス	500	2,454.00	1,227,000
イオン北海道	1,700	810.00	1,377,000

コジマ	2,600	468.00	1,216,800
ヒマラヤ	600	1,183.00	709,800
コーナン商事	2,400	2,812.00	6,748,800
エコス	700	1,824.00	1,276,800
マルシェ	700	814.00	569,800
ドンキホーテホールディングス	10,800	5,920.00	63,936,000
西松屋チェーン	3,700	1,318.00	4,876,600
ゼンショーホールディングス	8,700	2,580.00	22,446,000
幸楽苑ホールディングス	1,100	1,875.00	2,062,500
ハークスレイ	400	1,093.00	437,200
サイゼリヤ	2,800	2,563.00	7,176,400
V Tホールディングス	5,700	503.00	2,867,100
魚力	500	1,480.00	740,000
フジ・コーポレーション	300	2,551.00	765,300
ユナイテッドアローズ	2,100	4,130.00	8,673,000
ハイデイ日高	2,200	2,832.00	6,230,400
京都きもの友禅	1,200	714.00	856,800
コロワイド	5,600	2,792.00	15,635,200
ピーシーデポコーポレーション	2,500	718.00	1,795,000
壱番屋	1,200	4,575.00	5,490,000
P L A N T	400	1,360.00	544,000
スギホールディングス	3,700	6,430.00	23,791,000
ヴィア・ホールディングス	2,200	699.00	1,537,800
スクロール	2,500	442.00	1,105,000
ヨンドシーホールディングス	1,700	2,679.00	4,554,300
ユニー・ファミリーマートホールディングス	5,300	10,670.00	56,551,000
木曽路	2,100	2,818.00	5,917,800
S R Sホールディングス	2,200	981.00	2,158,200
千趣会	3,300	567.00	1,871,100
タカキュー	1,800	217.00	390,600
ケーヨー	3,200	566.00	1,811,200
上新電機	2,000	4,250.00	8,500,000
日本瓦斯	3,100	5,470.00	16,957,000
ロイヤルホールディングス	3,000	2,866.00	8,598,000
東天紅	200	1,953.00	390,600
いなげや	1,900	1,858.00	3,530,200
島忠	3,800	3,485.00	13,243,000
チヨダ	2,000	2,730.00	5,460,000
ライフコーポレーション	1,300	2,779.00	3,612,700
リンガーハット	2,100	2,676.00	5,619,600
M r M a x H D	2,100	704.00	1,478,400
テンアライド	2,000	483.00	966,000

AOKIホールディングス	3,300	1,632.00	5,385,600
オークワ	2,000	1,187.00	2,374,000
コメリ	2,600	2,985.00	7,761,000
青山商事	3,200	4,170.00	13,344,000
しまむら	1,900	12,620.00	23,978,000
はせがわ	900	494.00	444,600
高島屋	26,000	928.00	24,128,000
松屋	3,400	1,385.00	4,709,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	7,900	2,050.00	16,195,000
近鉄百貨店	700	3,920.00	2,744,000
パルコ	1,600	1,373.00	2,196,800
丸井グループ	16,000	2,243.00	35,888,000
アクシアル リテイリング	1,400	4,195.00	5,873,000
イオン	64,100	2,159.00	138,391,900
イズミ	3,000	7,060.00	21,180,000
東武ストア	200	3,055.00	611,000
平和堂	3,400	2,640.00	8,976,000
フジ	2,000	2,307.00	4,614,000
ヤオコー	1,900	6,240.00	11,856,000
ゼビオホールディングス	2,300	2,013.00	4,629,900
ケーズホールディングス	14,600	1,453.00	21,213,800
Olympicグループ	1,000	562.00	562,000
日産東京販売ホールディングス	2,400	405.00	972,000
Genky DrugStores	700	4,410.00	3,087,000
アインホールディングス	2,200	7,380.00	16,236,000
元気寿司	400	2,957.00	1,182,800
ヤマダ電機	55,800	590.00	32,922,000
アークランドサカモト	2,800	1,762.00	4,933,600
ニトリホールディングス	6,600	18,595.00	122,727,000
グルメ杵屋	1,000	1,182.00	1,182,000
愛眼	1,600	524.00	838,400
ケーユーホールディングス	800	1,137.00	909,600
吉野家ホールディングス	5,500	2,033.00	11,181,500
松屋フーズ	800	3,870.00	3,096,000
サガミチェーン	2,300	1,433.00	3,295,900
関西スーパーマーケット	1,300	1,152.00	1,497,600
王将フードサービス	1,200	5,570.00	6,684,000
ブレナス	1,900	1,947.00	3,699,300
ミニストップ	1,300	2,245.00	2,918,500
アークス	3,100	3,010.00	9,331,000
パローホールディングス	3,900	2,933.00	11,438,700
藤久	200	1,511.00	302,200

ベルク	700	5,790.00	4,053,000
大庄	1,000	1,741.00	1,741,000
ファーストリテイリング	2,200	48,730.00	107,206,000
サンドラッグ	7,000	5,560.00	38,920,000
サクスパー ホールディングス	1,600	1,159.00	1,854,400
ヤマザワ	300	1,795.00	538,500
やまや	300	4,005.00	1,201,500
ペルーナ	4,100	1,224.00	5,018,400
島根銀行	300	1,331.00	399,300
じもとホールディングス	11,300	190.00	2,147,000
めぶきフィナンシャルグループ	86,700	422.00	36,587,400
東京きらぼしフィナンシャルグループ	2,300	2,899.00	6,667,700
九州フィナンシャルグループ	27,400	542.00	14,850,800
ゆうちょ銀行	47,200	1,525.00	71,980,000
富山第一銀行	4,100	503.00	2,062,300
コンコルディア・フィナンシャルグループ	99,600	623.00	62,050,800
西日本フィナンシャルホールディングス	10,700	1,310.00	14,017,000
関西みらいフィナンシャルグループ	7,300	865.00	6,314,500
三十三フィナンシャルグループ	1,400	2,273.00	3,182,200
新生銀行	14,500	1,705.00	24,722,500
あおぞら銀行	9,900	4,380.00	43,362,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,167,000	715.00	834,405,000
りそなホールディングス	182,900	611.40	111,825,060
三井住友トラスト・ホールディングス	32,800	4,643.00	152,290,400
三井住友フィナンシャルグループ	126,100	4,488.00	565,936,800
第四銀行	2,000	4,840.00	9,680,000
北越銀行	1,600	2,424.00	3,878,400
千葉銀行	59,100	878.00	51,889,800
群馬銀行	34,100	638.00	21,755,800
武蔵野銀行	2,600	3,550.00	9,230,000
千葉興業銀行	4,600	498.00	2,290,800
筑波銀行	7,000	393.00	2,751,000
七十七銀行	5,200	2,664.00	13,852,800
青森銀行	1,300	3,350.00	4,355,000
秋田銀行	1,000	3,025.00	3,025,000
山形銀行	1,900	2,400.00	4,560,000
岩手銀行	1,200	4,275.00	5,130,000
東邦銀行	15,000	414.00	6,210,000
東北銀行	800	1,493.00	1,194,400
みちのく銀行	1,100	1,778.00	1,955,800
ふくおかフィナンシャルグループ	68,000	576.00	39,168,000
静岡銀行	44,100	1,106.00	48,774,600

十六銀行	2,200	2,852.00	6,274,400
スルガ銀行	17,100	1,422.00	24,316,200
八十二銀行	30,400	543.00	16,507,200
山梨中央銀行	10,000	485.00	4,850,000
大垣共立銀行	2,700	2,807.00	7,578,900
福井銀行	1,400	2,472.00	3,460,800
北國銀行	1,900	4,280.00	8,132,000
清水銀行	500	3,160.00	1,580,000
富山銀行	300	4,100.00	1,230,000
滋賀銀行	16,000	555.00	8,880,000
南都銀行	2,000	2,969.00	5,938,000
百五銀行	16,100	501.00	8,066,100
京都銀行	6,400	6,350.00	40,640,000
紀陽銀行	6,300	1,766.00	11,125,800
ほくほくフィナンシャルグループ	11,100	1,602.00	17,782,200
広島銀行	24,800	827.00	20,509,600
山陰合同銀行	9,900	1,036.00	10,256,400
中国銀行	11,700	1,286.00	15,046,200
鳥取銀行	500	1,739.00	869,500
伊予銀行	23,900	850.00	20,315,000
百十四銀行	18,000	364.00	6,552,000
四国銀行	2,600	1,540.00	4,004,000
阿波銀行	13,000	726.00	9,438,000
大分銀行	900	4,035.00	3,631,500
宮崎銀行	1,100	3,530.00	3,883,000
佐賀銀行	1,000	2,535.00	2,535,000
十八銀行	10,000	302.00	3,020,000
沖縄銀行	1,600	4,520.00	7,232,000
琉球銀行	3,200	1,682.00	5,382,400
セブン銀行	62,700	373.00	23,387,100
みずほフィナンシャルグループ	2,265,000	198.20	448,923,000
高知銀行	600	1,313.00	787,800
山口フィナンシャルグループ	21,000	1,380.00	28,980,000
長野銀行	500	1,859.00	929,500
名古屋銀行	1,300	4,105.00	5,336,500
北洋銀行	25,200	365.00	9,198,000
愛知銀行	600	5,240.00	3,144,000
中京銀行	700	2,317.00	1,621,900
大光銀行	500	2,389.00	1,194,500
愛媛銀行	2,300	1,283.00	2,950,900
トマト銀行	600	1,533.00	919,800
京葉銀行	15,000	501.00	7,515,000

栃木銀行	8,600	409.00	3,517,400
北日本銀行	500	2,895.00	1,447,500
東和銀行	2,900	1,458.00	4,228,200
福島銀行	1,700	813.00	1,382,100
大東銀行	800	1,334.00	1,067,200
トモニホールディングス	13,700	487.00	6,671,900
フィデアホールディングス	16,200	192.00	3,110,400
池田泉州ホールディングス	17,700	425.00	7,522,500
F P G	5,300	1,497.00	7,934,100
マーキュリアインベストメント	500	1,086.00	543,000
S B Iホールディングス	18,900	2,887.00	54,564,300
ジャフコ	2,400	4,695.00	11,268,000
大和証券グループ本社	143,000	662.50	94,737,500
野村ホールディングス	287,000	606.50	174,065,500
岡三証券グループ	14,000	590.00	8,260,000
丸三証券	5,300	1,014.00	5,374,200
東洋証券	6,000	282.00	1,692,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	18,600	739.00	13,745,400
光世証券	500	1,414.00	707,000
水戸証券	4,900	402.00	1,969,800
いちよし証券	3,500	1,312.00	4,592,000
松井証券	8,200	1,013.00	8,306,600
だいこう証券ビジネス	900	589.00	530,100
マネックスグループ	17,100	714.00	12,209,400
カブドットコム証券	10,800	405.00	4,374,000
極東証券	2,200	1,519.00	3,341,800
岩井コスモホールディングス	1,700	1,517.00	2,578,900
藍澤證券	3,100	792.00	2,455,200
マネーパートナーズグループ	2,200	477.00	1,049,400
かんぽ生命保険	6,300	2,652.00	16,707,600
S O M P Oホールディングス	32,700	4,634.00	151,531,800
アニコムホールディングス	1,100	3,565.00	3,921,500
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	43,500	3,662.00	159,297,000
ソニーフィナンシャルホールディングス	13,700	2,046.00	28,030,200
第一生命ホールディングス	94,300	2,131.50	201,000,450
東京海上ホールディングス	62,700	5,245.00	328,861,500
アドバンテッジリスクマネジメント	600	1,392.00	835,200
T & Dホールディングス	51,600	1,809.00	93,344,400
アドバンスクリエイト	400	2,057.00	822,800
全国保証	4,700	4,795.00	22,536,500
ジェイリース	300	846.00	253,800

イントラスト	400	745.00	298,000
アルヒ	1,900	1,516.00	2,880,400
クレディセゾン	12,700	1,958.00	24,866,600
アクリーティブ	1,000	347.00	347,000
芙蓉総合リース	1,900	7,550.00	14,345,000
興銀リース	3,100	3,040.00	9,424,000
東京センチュリー	3,400	6,980.00	23,732,000
日本証券金融	6,800	694.00	4,719,200
アイフル	28,100	388.00	10,902,800
リコーリース	1,300	3,780.00	4,914,000
イオンフィナンシャルサービス	11,800	2,627.00	30,998,600
アコム	33,600	495.00	16,632,000
ジャックス	2,000	2,493.00	4,986,000
オリエントコーポレーション	36,300	168.00	6,098,400
日立キャピタル	4,600	2,969.00	13,657,400
アプラスフィナンシャル	8,500	117.00	994,500
オリックス	111,100	2,008.50	223,144,350
三菱UFJリース	42,300	728.00	30,794,400
九州リースサービス	700	803.00	562,100
日本取引所グループ	47,800	2,041.00	97,559,800
イー・ギャランティ	900	2,403.00	2,162,700
アサックス	200	2,034.00	406,800
NECキャピタルソリューション	700	2,103.00	1,472,100
いちご	23,900	484.00	11,567,600
日本駐車場開発	20,200	185.00	3,737,000
ヒューリック	34,800	1,231.00	42,838,800
三栄建築設計	700	1,949.00	1,364,300
スター・マイカ	800	2,632.00	2,105,600
野村不動産ホールディングス	11,100	2,785.00	30,913,500
三重交通グループホールディングス	3,400	542.00	1,842,800
サムティ	1,400	2,089.00	2,924,600
ディア・ライフ	1,900	599.00	1,138,100
コーセーアールイー	400	982.00	392,800
日本商業開発	900	1,871.00	1,683,900
プレサンスコーポレーション	2,300	1,687.00	3,880,100
ユニゾホールディングス	2,000	2,629.00	5,258,000
THEグローバル社	800	941.00	752,800
日本管理センター	1,100	1,650.00	1,815,000
サンセイランディック	500	1,345.00	672,500
エストラスト	300	1,025.00	307,500
フージャースホールディングス	4,100	817.00	3,349,700
オープンハウス	2,700	6,070.00	16,389,000

東急不動産ホールディングス	40,500	854.00	34,587,000
飯田グループホールディングス	13,900	2,165.00	30,093,500
イーランド	300	1,227.00	368,100
ムゲンエステート	1,000	1,375.00	1,375,000
ビーロッド	300	2,192.00	657,600
ファーストブラザーズ	500	1,412.00	706,000
ハウズドゥ	300	4,830.00	1,449,000
シーアールイー	300	1,813.00	543,900
ケイアイスター不動産	600	2,887.00	1,732,200
パーク24	9,300	3,170.00	29,481,000
パラカ	400	2,420.00	968,000
三井不動産	83,300	2,774.50	231,115,850
三菱地所	124,400	1,998.50	248,613,400
平和不動産	3,000	2,425.00	7,275,000
東京建物	18,300	1,631.00	29,847,300
ダイビル	4,300	1,230.00	5,289,000
京阪神ビルディング	2,800	916.00	2,564,800
住友不動産	40,000	4,387.00	175,480,000
大京	2,700	2,396.00	6,469,200
テーオーシー	5,800	974.00	5,649,200
東京楽天地	300	5,660.00	1,698,000
レオパレス21	19,900	965.00	19,203,500
スターツコーポレーション	2,300	3,045.00	7,003,500
フジ住宅	2,100	945.00	1,984,500
空港施設	1,700	638.00	1,084,600
明和地所	900	767.00	690,300
ゴールドクレスト	1,300	2,336.00	3,036,800
日本エスリード	600	2,041.00	1,224,600
日神不動産	2,200	828.00	1,821,600
日本エスコン	3,000	998.00	2,994,000
タカラレーベン	7,900	467.00	3,689,300
サンヨーハウジング名古屋	900	1,224.00	1,101,600
イオンモール	10,800	2,215.00	23,922,000
ファースト住建	600	1,613.00	967,800
カチタス	2,300	3,650.00	8,395,000
トーセイ	2,100	1,366.00	2,868,600
穴吹興産	200	3,270.00	654,000
エヌ・ティ・ティ都市開発	10,500	1,298.00	13,629,000
サンフロンティア不動産	2,000	1,329.00	2,658,000
エフ・ジェー・ネクスト	1,300	880.00	1,144,000
インテリックス	500	1,117.00	558,500
グランディハウス	1,500	511.00	766,500

日本空港ビルデング	4,900	4,540.00	22,246,000
日本工営	1,100	3,220.00	3,542,000
L I F U L L	5,600	963.00	5,392,800
ジェイエイシーリクルートメント	1,300	2,317.00	3,012,100
日本M&Aセンター	11,200	3,310.00	37,072,000
メンバーズ	500	1,145.00	572,500
中広	200	758.00	151,600
タケエイ	1,700	1,337.00	2,272,900
トラスト・テック	800	3,750.00	3,000,000
コシダカホールディングス	1,100	6,950.00	7,645,000
パソナグループ	1,500	1,738.00	2,607,000
C D S	400	1,501.00	600,400
リンクアンドモチベーション	3,000	1,191.00	3,573,000
G C A	1,900	994.00	1,888,600
エス・エム・エス	3,200	3,820.00	12,224,000
パーソルホールディングス	14,900	2,667.00	39,738,300
リニカル	1,000	1,827.00	1,827,000
クックパッド	5,100	663.00	3,381,300
エスクリ	600	901.00	540,600
アイ・ケイ・ケイ	1,000	786.00	786,000
学情	700	1,385.00	969,500
スタジオアリス	800	2,470.00	1,976,000
シミックホールディングス	900	2,525.00	2,272,500
N J S	400	1,661.00	664,400
総合警備保障	6,400	5,500.00	35,200,000
カカクコム	12,200	2,071.00	25,266,200
アイロムグループ	600	2,748.00	1,648,800
セントケア・ホールディング	700	822.00	575,400
サイネックス	300	864.00	259,200
ルネサンス	800	1,931.00	1,544,800
ディップ	2,300	2,787.00	6,410,100
オプトホールディング	1,200	1,741.00	2,089,200
ツクイ	3,900	868.00	3,385,200
キャリアデザインセンター	400	2,227.00	890,800
エムスリー	17,000	4,210.00	71,570,000
ツカダ・グローバルホールディング	1,400	657.00	919,800
プラス	200	913.00	182,600
アウトソーシング	4,800	1,990.00	9,552,000
ウェルネット	1,600	1,301.00	2,081,600
ワールドホールディングス	500	4,005.00	2,002,500
ディー・エヌ・エー	8,700	2,157.00	18,765,900
博報堂D Yホールディングス	22,400	1,585.00	35,504,000

ぐるなび	2,600	1,601.00	4,162,600
エスアールジータカミヤ	1,900	682.00	1,295,800
ジャパンベストレスキューシステム	1,300	872.00	1,133,600
ファンコミュニケーションズ	4,500	730.00	3,285,000
ライク	700	2,121.00	1,484,700
ビジネス・ブレイクスルー	800	490.00	392,000
WDBホールディングス	700	3,715.00	2,600,500
ティア	800	1,107.00	885,600
CDG	200	1,941.00	388,200
バリューコマース	1,500	1,744.00	2,616,000
インフォマート	8,200	1,055.00	8,651,000
J Pホールディングス	5,200	329.00	1,710,800
E P Sホールディングス	2,400	2,107.00	5,056,800
レッグス	400	1,032.00	412,800
プレステージ・インターナショナル	3,400	1,279.00	4,348,600
アミューズ	1,100	3,260.00	3,586,000
ドリームインキュベータ	500	2,611.00	1,305,500
クイック	1,000	1,742.00	1,742,000
ケネディクス	21,500	639.00	13,738,500
電通	19,700	5,260.00	103,622,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	800	1,193.00	954,400
ぴあ	500	6,840.00	3,420,000
イオンファンタジー	500	6,180.00	3,090,000
シーティーエス	1,600	851.00	1,361,600
ネクシーズグループ	500	1,770.00	885,000
みらかホールディングス	4,800	4,255.00	20,424,000
アルプス技研	1,400	2,710.00	3,794,000
ダイオーズ	300	1,398.00	419,400
日本空調サービス	1,600	827.00	1,323,200
オリエンタルランド	19,100	11,480.00	219,268,000
ダスキン	4,300	2,816.00	12,108,800
明光ネットワークジャパン	2,100	1,282.00	2,692,200
ファルコホールディングス	800	1,848.00	1,478,400
田谷	600	671.00	402,600
ラウンドワン	5,000	1,751.00	8,755,000
リゾートトラスト	6,900	2,329.00	16,070,100
ビー・エム・エル	2,100	2,755.00	5,785,500
ワタベウェディング	400	604.00	241,600
りらいあコミュニケーションズ	2,600	1,395.00	3,627,000
リソー教育	2,800	854.00	2,391,200
早稲田アカデミー	200	1,690.00	338,000
ユー・エス・エス	19,700	2,372.00	46,728,400

東京個別指導学院	600	1,262.00	757,200
サイバーエージェント	10,000	6,220.00	62,200,000
楽天	82,900	813.70	67,455,730
クリーク・アンド・リバー社	900	1,205.00	1,084,500
テー・オー・ダブリュー	1,500	969.00	1,453,500
セントラルスポーツ	600	3,860.00	2,316,000
フルキャストホールディングス	1,400	2,456.00	3,438,400
リソルホールディングス	200	4,445.00	889,000
テクノプロ・ホールディングス	3,000	6,760.00	20,280,000
アトラ	300	1,142.00	342,600
インターワークス	400	1,050.00	420,000
Keep Per 技研	500	1,508.00	754,000
ファーストロジック	300	882.00	264,600
三機サービス	300	1,855.00	556,500
Gunosy	1,000	1,771.00	1,771,000
デザインワン・ジャパン	300	1,447.00	434,100
イー・ガーディアン	800	2,968.00	2,374,400
リブセンス	1,100	495.00	544,500
ジャパンマテリアル	4,400	1,488.00	6,547,200
ベクトル	2,000	2,196.00	4,392,000
ウチヤマホールディングス	900	656.00	590,400
ライクキッズネクスト	400	1,055.00	422,000
キャリアリンク	600	585.00	351,000
I B J	1,300	1,052.00	1,367,600
アサンテ	600	2,024.00	1,214,400
N・フィールド	900	2,197.00	1,977,300
バリューHR	400	1,965.00	786,000
M&Aキャピタルパートナーズ	400	9,130.00	3,652,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	700	1,095.00	766,500
E R Iホールディングス	500	1,171.00	585,500
アビスト	300	5,220.00	1,566,000
シグマクシス	900	1,879.00	1,691,100
ウィルグループ	700	1,373.00	961,100
エスクロー・エージェント・ジャパン	2,200	435.00	957,000
日本ビューホテル	500	1,541.00	770,500
リクルートホールディングス	124,600	2,637.50	328,632,500
エラン	400	1,995.00	798,000
土木管理総合試験所	500	611.00	305,500
日本郵政	91,500	1,340.00	122,610,000
ベルシステム24ホールディングス	2,700	1,688.00	4,557,600
鎌倉新書	300	3,765.00	1,129,500
一蔵	200	1,037.00	207,400

LITALICO	400	1,647.00	658,800
グローバルグループ	200	1,300.00	260,000
エボラブルアジア	500	2,025.00	1,012,500
ストライク	200	6,970.00	1,394,000
ソラスト	1,000	2,898.00	2,898,000
セラク	400	824.00	329,600
インソース	400	2,321.00	928,400
キャリアインデックス	200	2,392.00	478,400
MS - Japan	200	6,430.00	1,286,000
船場	300	1,295.00	388,500
フルテック	200	1,277.00	255,400
グリーンズ	400	1,556.00	622,400
リログループ	8,800	2,589.00	22,783,200
東祥	1,000	4,310.00	4,310,000
エイチ・アイ・エス	2,500	3,745.00	9,362,500
ラックランド	300	2,583.00	774,900
共立メンテナンス	2,900	5,280.00	15,312,000
イチネンホールディングス	1,800	1,472.00	2,649,600
建設技術研究所	1,100	1,496.00	1,645,600
スペース	1,000	1,512.00	1,512,000
長大	700	796.00	557,200
燦ホールディングス	400	2,854.00	1,141,600
スバル興業	100	7,040.00	704,000
東京テアトル	700	1,468.00	1,027,600
タナベ経営	300	2,139.00	641,700
ナガワ	300	4,590.00	1,377,000
よみうりランド	400	5,050.00	2,020,000
東京都競馬	1,200	4,500.00	5,400,000
常磐興産	700	1,911.00	1,337,700
カナモト	2,500	3,675.00	9,187,500
東京ドーム	6,600	1,086.00	7,167,600
西尾レントオール	1,600	3,335.00	5,336,000
トランス・コスモス	1,800	2,610.00	4,698,000
乃村工藝社	3,800	2,204.00	8,375,200
藤田観光	700	3,355.00	2,348,500
KNT - CTホールディングス	1,000	1,776.00	1,776,000
日本管財	1,700	2,126.00	3,614,200
トーカイ	1,600	2,479.00	3,966,400
白洋舎	200	3,270.00	654,000
セコム	17,100	8,324.00	142,340,400
セントラル警備保障	800	4,130.00	3,304,000
丹青社	3,300	1,316.00	4,342,800

	メイテック	1,900	5,990.00	11,381,000	
	応用地質	1,800	1,574.00	2,833,200	
	船井総研ホールディングス	3,300	2,607.00	8,603,100	
	進学会ホールディングス	700	634.00	443,800	
	オオバ	1,300	686.00	891,800	
	いであ	300	1,164.00	349,200	
	学究社	600	1,814.00	1,088,400	
	ベネッセホールディングス	5,900	4,165.00	24,573,500	
	イオンディライト	2,000	3,830.00	7,660,000	
	ナック	1,200	932.00	1,118,400	
	ニチイ学館	3,100	1,216.00	3,769,600	
	ダイセキ	2,700	3,430.00	9,261,000	
	ステップ	600	1,727.00	1,036,200	
小計	銘柄数：2,036	20,437,500		43,007,457,770	
	組入時価比率：96.8%			100.0%	
合計		20,437,500		43,007,457,770	

（注1）比率は左より組入時価の純資産総額に対する比率、及び各小計欄の合計金額に対する比率であります。

（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」に記載しております。

MHAM外国株式インデックスマザーファンド

なお、以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

（単位：円）

（平成30年 5月 8日現在）

資産の部	
流動資産	
預金	516,841,093
コール・ローン	116,016,002
株式	23,516,921,899

(平成30年 5月 8日現在)

投資信託受益証券	3,174,652
投資証券	571,186,192
派生商品評価勘定	19,700,078
未収入金	2,875,882
未収配当金	35,380,720
前払金	73,392,035
差入委託証拠金	39,612,226
流動資産合計	24,895,100,779
資産合計	24,895,100,779
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	293,163
未払解約金	4,626,400
未払利息	272
流動負債合計	4,919,835
負債合計	4,919,835
純資産の部	
元本等	
元本	13,855,813,168
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	11,034,367,776
元本等合計	24,890,180,944
純資産合計	24,890,180,944
負債純資産合計	24,895,100,779

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	(自平成29年 5月 9日 至平成30年 5月 8日)
1 有価証券の評価基準及び評価方法	株式、投資信託受益証券、投資証券 原則として時価で評価しております。
2 派生商品等の評価基準及び評価方法	先物取引、為替予約取引 原則として時価で評価しております。
3 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客電信売相場場の仲値によって計算し、為替予約の評価は計算期間末日に残高がある場合、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相場場の仲値によって計算しております。
4 収益・費用の計上基準	受取配当金 受取配当金は、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。

項目	(自 平成29年 5月 9日 至 平成30年 5月 8日)
	有価証券売買等損益、派生商品取引等損益及び為替差損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	(平成30年 5月 8日現在)	
1 計算期間末日における受益権の総数		13,855,813,168口
2 計算期間末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産の額	1.7964円
	(1万口当たり純資産の額)	(17,964円)

(金融商品に関する注記)

1.金融商品の状況に関する事項

項目	(自 平成29年 5月 9日 至 平成30年 5月 8日)
1 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める投資を目的とする証券投資信託であり、証券投資信託約款および投資ガイドラインに基づいて運用しております。
2 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>なお、詳細は附属明細表をご参照下さい。</p> <p>これらは、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。</p> <p>当ファンドは信託財産に属する資産の効率的な運用に資することを目的として、株価指数先物取引を行っており、当該デリバティブ取引は対象とする株価指数等に係る価格変動リスクを有しております。</p> <p>また、外貨建証券の売買等の決済に伴い必要となる外貨の売買のために、為替予約取引を行っております。</p>

項目	(自 平成29年 5月 9日 至 平成30年 5月 8日)
3 金融商品に係るリスク管理体制	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>なお、具体的には以下のリスクの管理を行っております。</p> <p>市場リスクの管理 市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。</p> <p>信用リスクの管理 信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。</p> <p>流動性リスクの管理 流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。</p>
4 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>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。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。</p>

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成30年 5月 8日現在)
1 貸借対照表日における貸借対照表の科目ごとの計上額・時価・時価との差額	<p>貸借対照表に計上している金融商品は、原則として時価評価としているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
2 貸借対照表の科目ごとの時価の算定方法	<p>(1) 有価証券</p> <p>株式、投資信託受益証券、投資証券</p> <p>わが国の金融商品取引所または海外取引所に上場されている有価証券 当該有価証券については、原則として上記の取引所における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）で評価しております。</p> <p>時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できない場合または入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認められた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認められた価額で評価しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引</p>

項目	(平成30年 5月 8日現在)
	先物取引、為替予約取引 デリバティブ取引等に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 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、時価は帳簿価額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。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

(自 平成29年 5月 9日 至 平成30年 5月 8日)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額 (円)
株式	1,630,634,008
投資信託受益証券	141,232
投資証券	11,099,747
合計	1,619,675,493

(デリバティブ取引等に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(株式関連)

(平成30年 5月 8日現在)

区分	種類	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引	株価指数先物取引 買建	786,921,910	-	806,365,194	19,443,284
	合計	786,921,910	-	806,365,194	19,443,284

(注) 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価の算定方法については、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により評価しております。

(通貨関連)

(平成30年 5月 8日現在)

区分	種類	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)

市場取引以外の取引	為替予約取引 買建	99,050,000	-	99,013,631	36,369
	米・ドル	99,050,000	-	99,013,631	36,369
合計		99,050,000	-	99,013,631	36,369

（注）時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

（その他の注記）

項目	期別 (平成30年 5月 8日現在)
期首	平成29年 5月 9日
親投資信託の期首における元本額	20,537,714,304円
期中追加設定元本額	4,152,771,311円
期中一部解約元本額	10,834,672,447円
期末元本額及びその内訳として当該親投資信託受益証券を投資対象とする委託者指図型投資信託ごとの元本額	
期末元本額	13,855,813,168円
動的パッケージファンド<DC年金>	9,308,161円
コア資産形成ファンド	9,340,628円
MHAM外国株式インデックスファンド（ファンドラップ）	9,964,644,736円
MHAM外国株式インデックスファンド	291,492,234円
MHAM外国株式インデックスファンド<為替ヘッジあり>（ファンドラップ）	57,134,323円
MHAM動的パッケージファンド〔適格機関投資家限定〕	2,284,434,369円
MHAM外国株式パッシブファンド〔適格機関投資家限定〕	1,239,458,717円

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

(平成30年 5月 8日現在)

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
米・ドル	ANADARKO PETROLEUM CORP	3,526	66.00	232,716.00	
	ANDEAVOR	884	139.63	123,432.92	
	ANTERO RESOURCES CORP	1,281	18.25	23,378.25	
	APACHE CORPORATION	2,261	39.47	89,241.67	
	BAKER HUGHES A GE CO	2,426	35.63	86,438.38	
	CABOT OIL & GAS CORP	2,736	23.02	62,982.72	
	CHENIERE ENERGY INC	1,208	62.49	75,487.92	
	CHEVRON CORP	11,432	124.94	1,428,314.08	
	CIMAREX ENERGY CO	555	97.30	54,001.50	
	CONCHO RESOURCES INC	882	155.27	136,948.14	
	CONOCOPHILLIPS	7,465	66.77	498,438.05	
	CONTINENTAL RESOURCES INC	495	64.66	32,006.70	
	DEVON ENERGY CORPORATION	2,962	37.89	112,230.18	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	523	130.24	68,115.52	
	EOG RESOURCES INC	3,419	113.89	389,389.91	
	EQT CORP	1,497	49.40	73,951.80	
	EXXON MOBIL CORPORATION	25,519	77.74	1,983,847.06	
	HALLIBURTON CO	5,222	52.03	271,700.66	
	HELMERICH & PAYNE	647	68.67	44,429.49	
	HESS CORP	1,700	59.22	100,674.00	
	HOLLY FRONTIER CORP	1,108	65.60	72,684.80	
	KINDER MORGAN INC	11,995	16.21	194,438.95	
	MARATHON OIL CORP	5,057	19.77	99,976.89	
	MARATHON PETROLEUM CORP	2,922	76.50	223,533.00	
	NATIONAL OILWELL VARCO INC	2,272	38.60	87,699.20	
	NEWFIELD EXPLORATION CO	1,172	27.34	32,042.48	
	NOBLE ENERGY INC	2,744	32.87	90,195.28	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	4,569	77.28	353,092.32	
	ONEOK INC	2,290	64.07	146,720.30	
	PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	1,189	32.15	38,226.35	
PHILLIPS 66	2,586	115.41	298,450.26		
PIONEER NATURAL RESOURCES COMPANY	1,013	195.80	198,345.40		
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	862	25.26	21,774.12		

RANGE RESOURCES	1,803	14.12	25,458.36
SCHLUMBERGER LTD	8,356	69.21	578,318.76
TARGA RESOURCES CORP	1,283	46.55	59,723.65
TECHNIPFMC PLC	2,645	32.80	86,756.00
VALERO ENERGY CORP	2,788	113.67	316,911.96
WILLIAMS COS INC	4,940	26.27	129,773.80
AIR PRODUCTS & CHEMICAL INC	1,302	163.45	212,811.90
ALBEMARLE CORP	662	100.11	66,272.82
AVERY DENNISON CORP	526	105.65	55,571.90
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	1,433	31.63	45,325.79
BALL CORP	1,981	38.22	75,713.82
CELANESE CORP-SERIES A	810	108.54	87,917.40
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	1,400	37.73	52,822.00
CHEMOURS CO/THE	1,112	50.42	56,067.04
CROWN HOLDINGS	896	45.44	40,714.24
DOWDUPONT INC	14,107	64.92	915,826.44
EASTMAN CHEMICAL CO	860	105.07	90,360.20
ECOLAB INC	1,554	145.79	226,557.66
FMC CORP	804	87.82	70,607.28
FREEMONT-MCMORAN INC	8,311	15.26	126,825.86
INTERNATIONAL FLAV&F	470	126.89	59,638.30
INTERNATIONAL PAPER CO	2,349	51.89	121,889.61
LYONDELLBASELL INDU-CL A	2,009	104.60	210,141.40
MARTIN MARIETTA MATERIALS	376	204.61	76,933.36
MONSANTO CO	2,631	125.05	329,006.55
MOSAIC CO/THE	2,198	27.56	60,576.88
NEWMONT MINING CORP	3,583	39.87	142,854.21
NUCOR CORPORATION	1,907	62.84	119,835.88
PACKAGING CORP OF AMERICA	565	114.10	64,466.50
PPG INDUSTRIES INC	1,522	106.21	161,651.62
PRAXAIR INC	1,718	155.26	266,736.68
SEALED AIR CORP	1,018	44.12	44,914.16
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	504	378.65	190,839.60
STEEL DYNAMICS INC	1,425	46.40	66,120.00
VULCAN MATERIALS CO	791	123.43	97,633.13

WESTROCK CO	1,525	60.00	91,500.00
WR GRACE&CO	430	69.99	30,095.70
3M CO	3,590	200.26	718,933.40
ACUITY BRANDS INC	250	110.22	27,555.00
AERCAP HOLDINGS NV	791	54.14	42,824.74
AGCO CORP	407	61.68	25,103.76
ALLEGION PLC	563	75.74	42,641.62
AMETEK INC	1,370	72.80	99,736.00
ARCONIC INC	2,676	17.56	46,990.56
BOEING CO	3,419	340.43	1,163,930.17
CATERPILLAR INC	3,595	149.82	538,602.90
CUMMINS INC	942	144.96	136,552.32
DEERE & COMPANY	1,636	140.22	229,399.92
DOVER CORP	928	92.56	85,895.68
EATON CORP PLC	2,633	74.70	196,685.10
EMERSON ELECTRIC CO	4,081	69.30	282,813.30
FASTENAL CO	1,713	51.40	88,048.20
FLOWSERVE CORP	775	46.39	35,952.25
FLUOR CORP	907	44.49	40,352.43
FORTIVE CORP	1,865	73.54	137,152.10
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	899	55.02	49,462.98
GENERAL DYNAMICS CORP	1,517	196.45	298,014.65
GENERAL ELECTRIC CO	52,253	14.07	735,199.71
HARRIS CORP	712	149.88	106,714.56
HD SUPPLY HOLDINGS INC	1,148	38.82	44,565.36
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	4,351	144.16	627,240.16
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES	270	215.84	58,276.80
IDEX CORP	454	136.27	61,866.58
ILLINOIS TOOL WORKS	1,849	144.79	267,716.71
INGERSOLL-RAND PLC	1,533	87.39	133,968.87
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	781	56.71	44,290.51
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	1,628	60.30	98,168.40
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	1,661	35.60	59,131.60
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL	5,527	36.65	202,564.55
L3 TECHNOLOGIES INC	464	188.40	87,417.60

LENNOX INTERNATIONAL INC	223	201.92	45,028.16
LOCKHEED MARTIN CORP	1,598	317.71	507,700.58
MASCO CORP	1,876	38.30	71,850.80
MIDDLEBY CORP	331	128.96	42,685.76
NORTHROP GRUMMAN CORP	989	317.13	313,641.57
NVENT ELECTRIC PLC	1,023	25.34	25,922.82
OWENS CORNING	664	65.39	43,418.96
PACCAR INC	2,176	64.50	140,352.00
PARKER HANNIFIN CORP	797	170.51	135,896.47
PENTAIR PLC	1,023	44.43	45,451.89
RAYTHEON COMPANY	1,729	205.17	354,738.93
ROCKWELL AUTOMATION INC	767	174.05	133,496.35
ROCKWELL COLLINS INC.	995	133.44	132,772.80
ROPER INDUSTRIES INC	670	270.62	181,315.40
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	1,020	50.80	51,816.00
SMITH (A.O.)CORP	866	62.71	54,306.86
SNAP-ON INC	337	146.60	49,404.20
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	692	83.52	57,795.84
STANLEY BLACK & DECKER INC	911	139.13	126,747.43
TEXTRON INC	1,569	63.88	100,227.72
TRANSDIGM GROUP INC	311	329.11	102,353.21
UNITED RENTALS INC	507	159.49	80,861.43
UNITED TECHNOLOGIES CORP	4,566	120.89	551,983.74
WABCO HOLDINGS INC	341	129.06	44,009.46
WABTEC CORPORATION	568	91.13	51,761.84
WW GRAINGER INC	324	289.37	93,755.88
XYLEM INC	1,069	70.02	74,851.38
CINTAS CORP	540	175.75	94,905.00
COSTAR GROUP INC	216	386.01	83,378.16
EQUIFAX INC	716	113.00	80,908.00
IHS MARKIT LTD	2,376	50.16	119,180.16
MANPOWERGROUP INC	442	96.13	42,489.46
NIELSEN HOLDINGS PLC	2,118	30.10	63,751.80
REPUBLIC SERVICES INC	1,384	68.04	94,167.36
ROBERT HALF INTL INC	745	61.91	46,122.95

ROLLINS INC	579	50.07	28,990.53
STERICYCLE INC	562	63.95	35,939.90
TRANSUNION	1,024	67.81	69,437.44
VERISK ANALYTICS INC	922	103.69	95,602.18
WASTE CONNECTIONS INC	1,566	74.95	117,371.70
WASTE MANAGEMENT INC	2,583	83.22	214,957.26
AMERCO	51	332.08	16,936.08
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	834	42.44	35,394.96
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	834	82.43	68,746.62
CSX CORP	5,087	60.50	307,763.50
DELTA AIR LINES INC	1,100	51.90	57,090.00
EXPEDITORS INTL WASH INC	1,060	63.97	67,808.20
FEDEX CORP	1,606	243.12	390,450.72
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	525	118.10	62,002.50
KANSAS CITY SOUTHERN	619	106.89	66,164.91
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	703	38.96	27,388.88
MACQUARIE INFRASTRUCTURE CORP	591	38.99	23,043.09
NORFOLK SOUTHERN CORP	1,715	145.47	249,481.05
OLD DOMINION FREIGHT LINE	372	137.93	51,309.96
SOUTHWEST AIRLINES CO	916	52.00	47,632.00
UNION PACIFIC CORP	4,746	134.90	640,235.40
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS	457	67.52	30,856.64
UNITED PARCEL SERVICE -CL B	4,292	112.12	481,219.04
APTIV PLC	1,590	93.28	148,315.20
AUTOLIV INC	518	139.71	72,369.78
BORGWARNER INC	1,257	49.19	61,831.83
FORD MOTOR CO	22,154	11.34	251,226.36
GENERAL MOTORS CO	8,094	36.34	294,135.96
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	1,460	25.16	36,733.60
HARLEY-DAVIDSON INC	1,002	40.75	40,831.50
LEAR CORP	402	191.33	76,914.66
TESLA INC	805	302.77	243,729.85
D R HORTON INC	2,125	44.99	95,603.75
GARMIN LTD	721	59.37	42,805.77
HANESBRANDS INC	2,448	16.84	41,224.32

HASBRO INC	666	88.03	58,627.98
LEGETT & PLATT INC	857	41.55	35,608.35
LENNAR CORP	1,761	54.33	95,675.13
LULULEMON ATHLETICA INC	606	97.17	58,885.02
MATTEL INC	2,046	14.47	29,605.62
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	908	61.55	55,887.40
MOHAWK INDUSTRIES INC	375	215.41	80,778.75
NEWELL BRANDS INC	2,925	27.58	80,671.50
NIKE INC CLASS-B	8,142	69.34	564,566.28
NVR INC	21	3,108.62	65,281.02
POLARIS INDUSTRIES INC	355	109.92	39,021.60
PULTE GROUP INC	1,573	31.01	48,778.73
PVH CORP	462	151.52	70,002.24
RALPH LAUREN CORP	330	106.19	35,042.70
TAPESTRY INC	1,694	45.41	76,924.54
TOLL BROTHERS INC	1,018	43.52	44,303.36
UNDER ARMOUR INC -CLASS C	1,584	16.25	25,740.00
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	950	17.87	16,976.50
VF CORP	2,005	76.47	153,322.35
WHIRLPOOL CORP	428	153.40	65,655.20
ARAMARK	1,459	37.05	54,055.95
CARNIVAL CORP	2,080	62.93	130,894.40
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	152	419.62	63,782.24
DARDEN RESTAURANTS INC	737	91.91	67,737.67
DOMINO'S PIZZA INC	262	250.50	65,631.00
H&R BLOCK INC	1,246	27.67	34,476.82
HILTON WORLDWIDE HOLDING	1,726	81.35	140,410.10
LAS VEGAS SANDS CORP	2,367	76.88	181,974.96
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	1,989	136.64	271,776.96
MCDONALD'S CORP	4,808	165.00	793,320.00
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT	1,100	32.75	36,025.00
MGM RESORTS INTERNATIONAL	2,712	31.61	85,726.32
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDINGS	1,270	50.31	63,893.70
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	1,025	105.06	107,686.50
STARBUCKS CORP	8,870	57.45	509,581.50

VAIL RESORTS INC	241	228.24	55,005.84
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	607	106.92	64,900.44
WYNN RESORTS LTD	556	191.91	106,701.96
YUM! BRANDS INC	2,113	83.11	175,611.43
21ST CENTURY FOX IN	6,308	38.04	239,956.32
21ST CENTURY FOX NEWS CORP	2,625	37.48	98,385.00
CBS CORP-CLASS B NON VOTING	2,142	52.42	112,283.64
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	1,166	278.10	324,264.60
COMCAST CORP CL-A	28,106	32.39	910,353.34
DISCOVERY INC-A	1,056	23.39	24,699.84
DISCOVERY INC-C	1,646	22.13	36,425.98
DISH NETWORK CORP-A	1,355	33.90	45,934.50
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	2,304	23.55	54,259.20
LIBERTY BROADBAND-C	636	73.44	46,707.84
LIBERTY GLOBAL PLC-A	1,312	32.91	43,177.92
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	3,208	31.62	101,436.96
LIBERTY MEDIA CORP LIBERTY FORMULA	1,350	31.90	43,065.00
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	1,120	42.55	47,656.00
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	494	42.56	21,024.64
LIVE NATION ENTERTAINMENT INC	983	45.07	44,303.81
NEWS CORP-CL A	2,258	16.39	37,008.62
OMNICOM GROUP	1,366	74.05	101,152.30
SIRIUS XM HOLDINGS INC	9,564	6.71	64,174.44
THE WALT DISNEY COMPANY	9,091	102.48	931,645.68
TIME WARNER INC	4,853	92.56	449,193.68
VIACOM INC-CLASS B	2,104	30.70	64,592.80
ADVANCE AUTO PARTS INC	423	116.14	49,127.22
AMAZON.COM INC	2,473	1,600.14	3,957,146.22
AUTONATION INC	231	47.55	10,984.05
AUTOZONE INC	164	648.85	106,411.40
BEST BUY CO INC	1,610	75.50	121,555.00
BOOKING HOLDINGS INC	294	2,194.96	645,318.24
CARMAX INC	1,088	64.17	69,816.96
DOLLAR GENERAL CORP	1,632	94.00	153,408.00
DOLLAR TREE INC	1,417	92.80	131,497.60

EXPEDIA GROUP INC	751	110.95	83,323.45
GAP INC/THE	1,391	28.35	39,434.85
GENUINE PARTS CO	871	89.80	78,215.80
HOME DEPOT INC	7,041	183.56	1,292,445.96
KOHL'S CORP	1,008	60.38	60,863.04
L BRANDS INC	1,440	34.03	49,003.20
LKQ CORP	1,841	30.64	56,408.24
LOWE'S COS INC	5,185	83.85	434,762.25
MACYS INC	1,817	30.05	54,600.85
NETFLIX INC	2,614	326.26	852,843.64
NORDSTROM INC	823	48.52	39,931.96
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	508	263.17	133,690.36
QURATE RETAIL GROUP INC	2,816	24.04	67,696.64
ROSS STORES INC	2,303	79.44	182,950.32
TARGET CORP	3,088	69.33	214,091.04
TIFFANY & CO	739	102.08	75,437.12
TJX COMPANIES INC	3,985	81.89	326,331.65
TRACTOR SUPPLY COMPANY	747	66.81	49,907.07
TRIPADVISOR INC	674	39.43	26,575.82
ULTA BEAUTY INC	345	253.07	87,309.15
COSTCO WHOLESALE CORP	2,632	193.06	508,133.92
CVS HEALTH CORP	6,301	61.75	389,086.75
KROGER CO	5,261	23.98	126,158.78
SYSCO CORP	2,954	63.48	187,519.92
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	5,031	62.30	313,431.30
WALMART INC	9,007	85.47	769,828.29
ALTRIA GROUP INC	11,478	55.71	639,439.38
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	3,338	43.69	145,837.22
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	1,530	55.64	85,129.20
BUNGE LTD	840	69.36	58,262.40
CAMPBELL SOUP CO	1,068	41.03	43,820.04
COCA-COLA COMPANY	24,352	42.14	1,026,193.28
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	1,408	37.88	53,335.04
CONAGRA BRANDS INC	2,429	37.37	90,771.73
CONSTELLATION BRNDS INC-A	1,031	223.80	230,737.80

DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	1,081	119.09	128,736.29
GENERAL MILLS INC	3,392	42.34	143,617.28
HERSHEY CO/THE	850	91.66	77,911.00
HORMEL FOODS CORP	1,720	35.53	61,111.60
INGREDION INC	427	111.51	47,614.77
JM SMUCKER CO/THE	677	112.65	76,264.05
KELLOGG CO	1,544	60.49	93,396.56
KRAFT HEINZ CO/THE	3,639	58.83	214,082.37
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	750	104.05	78,037.50
MOLSON COORS BREWING CO	1,127	59.63	67,203.01
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	9,335	38.69	361,171.15
MONSTER BEVERAGE CORP	2,364	53.31	126,024.84
PEPSICO INC	8,547	98.23	839,571.81
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	9,350	81.51	762,118.50
TYSON FOODS INC	1,777	67.22	119,449.94
CHURCH & DWIGHT CO INC	1,484	47.52	70,519.68
CLOROX COMPANY	768	120.83	92,797.44
COLGATE-PALMOLIVE CO	4,970	62.82	312,215.40
COTY INC-CL A	2,912	16.24	47,290.88
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	1,347	133.79	180,215.13
KIMBERLY-CLARK CORP	2,103	103.16	216,945.48
PROCTER & GAMBLE CO	15,246	71.98	1,097,407.08
SPECTRUM BRANDS HLD INC	95	73.95	7,025.25
ABBOTT LABORATORIES	10,512	59.32	623,571.84
AETNA INC	1,956	171.40	335,258.40
ALIGN TECHNOLOGY INC	458	265.03	121,383.74
AMERISOURCEBERGEN CORP	983	84.69	83,250.27
ANTHEM INC	1,541	229.26	353,289.66
BAXTER INTERNATIONAL INC	2,947	70.33	207,262.51
BECTON DICKINSON	1,595	225.18	359,162.10
BOSTON SCIENTIFIC CORP	8,239	29.94	246,675.66
CARDINAL HEALTH INC	1,887	52.77	99,576.99
CENTENE CORP	1,036	115.49	119,647.64
CERNER CORP	1,796	58.06	104,275.76
CIGNA CORP	1,479	172.59	255,260.61

COOPER COS INC/THE	294	225.57	66,317.58
DANAHER CORPORATION	3,772	99.58	375,615.76
DAVITA INC	882	66.02	58,229.64
DENTSPLY SIRONA INC	1,376	46.92	64,561.92
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	1,270	136.09	172,834.30
ENVISION HEALTHCARE CORP	606	36.90	22,361.40
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	3,396	69.69	236,667.24
HCA HEALTHCARE INC	1,701	97.62	166,051.62
HENRY SCHEIN INC	940	76.27	71,693.80
HOLOGIC INC	1,654	36.92	61,065.68
HUMANA INC	857	283.77	243,190.89
IDEXX LABORATORIES INC	525	207.53	108,953.25
INTUITIVE SURGICAL INC	678	465.40	315,541.20
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	612	171.11	104,719.32
MCKESSON CORP	1,250	144.28	180,350.00
MEDTRONIC PLC	8,153	84.82	691,537.46
QUEST DIAGNOSTICS	818	101.10	82,699.80
RESMED INC	854	97.85	83,563.90
STRYKER CORP	2,021	167.48	338,477.08
TELEFLEX INC	271	272.39	73,817.69
UNITEDHEALTH GROUP INC	5,851	233.78	1,367,846.78
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	525	117.38	61,624.50
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	552	117.50	64,860.00
VEEVA SYSTEMS INC	690	73.57	50,763.30
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	1,215	116.99	142,142.85
ABBVIE INC	9,649	99.63	961,329.87
AGILENT TECHNOLOGIES INC	1,941	67.39	130,803.99
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	1,337	118.41	158,314.17
ALKERMES PLC	921	43.80	40,339.80
ALLERGAN PLC	1,993	147.09	293,150.37
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	531	97.42	51,730.02
AMGEN INC	4,070	168.06	684,004.20
BIOGEN INC	1,266	269.70	341,440.20
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	1,051	86.97	91,405.47
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	10,130	51.32	519,871.60

CELGENE CORP	4,918	84.57	415,915.26
ELI LILLY & CO	6,178	78.63	485,776.14
GILEAD SCIENCES INC	7,887	64.88	511,708.56
ILLUMINA INC	876	256.89	225,035.64
INCYTE CORP	1,074	62.87	67,522.38
IQVIA HOLDINGS INC	816	98.17	80,106.72
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	361	147.03	53,077.83
JOHNSON & JOHNSON	16,205	123.59	2,002,775.95
MERCK & CO. INC	16,417	57.38	942,007.46
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL INC	154	552.90	85,146.60
MYLAN NV	2,736	36.11	98,796.96
PERRIGO CO PLC	762	77.24	58,856.88
PFIZER INC	35,961	34.93	1,256,117.73
REGENERON PHARMACEUTICALS	474	288.54	136,767.96
SEATTLE GENETICS INC	652	54.05	35,240.60
TESARO INC	316	46.96	14,839.36
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	5,483	18.62	102,093.46
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	2,418	208.98	505,313.64
UNITED THERAPEUTICS CORP	225	102.40	23,040.00
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	1,515	149.50	226,492.50
WATERS CORP	480	192.61	92,452.80
ZOETIS INC	2,929	82.15	240,617.35
BANK OF AMERICA CORP	59,774	29.64	1,771,701.36
BB & T CORP	5,025	53.73	269,993.25
CIT GROUP INC	785	53.04	41,636.40
CITIGROUP INC	15,921	68.50	1,090,588.50
CITIZENS FINANCIAL GROUP	2,943	41.07	120,869.01
COMERICA INC	1,041	94.05	97,906.05
EAST WEST BANCORP INC	858	67.82	58,189.56
FIFTH THIRD BANCORP	4,373	32.82	143,521.86
FIRST REPUBLIC BANK/CA	938	95.91	89,963.58
HUNTINGTON BANCSHARES INC	6,444	14.73	94,920.12
JPMORGAN CHASE & CO	20,918	109.37	2,287,801.66
KEYCORP	6,421	19.73	126,686.33
M & T BANK CORP	807	180.92	146,002.44

NEW YORK COMMUNITY BANCORP	3,134	11.71	36,699.14
PEOPLES UNITED FINANCIAL INC	1,993	18.47	36,810.71
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	2,970	145.90	433,323.00
REGIONS FINANCIAL CORP	6,937	18.75	130,068.75
SIGNATURE BANK	361	129.45	46,731.45
SUNTRUST BANKS INC	3,080	66.82	205,805.60
SVB FINANCIAL GROUP	316	307.32	97,113.12
US BANCORP	9,897	50.36	498,412.92
WELLS FARGO & COMPANY	28,193	52.66	1,484,643.38
ZIONS BANCORPORATION	1,190	55.51	66,056.90
AFFILIATED MANAGERS GROUP	331	162.45	53,770.95
ALLY FINANCIAL INC	2,640	26.54	70,065.60
AMERICAN EXPRESS COMPANY	4,411	98.58	434,836.38
AMERIPRISE FINANCIAL INC	884	134.10	118,544.40
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	6,097	55.59	338,932.23
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	7,643	197.06	1,506,129.58
BLACKROCK INC	753	523.60	394,270.80
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	3,068	88.92	272,806.56
CBOE GLOBAL MARKETS INC	610	103.16	62,927.60
CME GROUP INC	2,134	159.22	339,775.48
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	2,172	71.84	156,036.48
E*TRADE FINANCIAL CORP	1,602	62.15	99,564.30
EATON VANCE CORP	733	55.76	40,872.08
FRANKLIN RESOURCES INC	1,969	33.49	65,941.81
GOLDMAN SACHS GROUP INC	2,155	237.20	511,166.00
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	3,491	70.57	246,359.87
INVESCO LTD	2,423	28.47	68,982.81
LEUCADIA NATIONAL CORP	2,126	24.64	52,384.64
MOODYS CORP	1,029	167.39	172,244.31
MORGAN STANLEY	8,486	52.39	444,581.54
MSCI INC	538	154.92	83,346.96
NASDAQ INC	683	88.66	60,554.78
NORTHERN TRUST CORPORATION	1,290	105.36	135,914.40
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	774	91.20	70,588.80
S&P GLOBAL INC	1,520	193.38	293,937.60

SCHWAB CHARLES CORP	7,551	56.97	430,180.47
SEI INVESTMENTS COMPANY	795	62.43	49,631.85
STATE STREET CORP	2,218	98.50	218,473.00
SYNCHRONY FINANCIAL	4,682	32.72	153,195.04
T ROWE PRICE GROUP INC	1,442	113.47	163,623.74
TD AMERITRADE HOLDING CORP	1,783	59.93	106,855.19
VOYA FINANCIAL INC	1,073	52.45	56,278.85
AFLAC INC	4,696	44.59	209,394.64
ALLEGHANY CORP	99	575.75	56,999.25
ALLSTATE CORP	2,118	95.06	201,337.08
AMERICAN FINANCIAL GROUP	442	110.60	48,885.20
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	5,351	53.28	285,101.28
AON PLC	1,493	140.37	209,572.41
ARCH CAPITAL GROUP	773	79.13	61,167.49
ARTHUR J GALLAGHER & CO	1,078	69.02	74,403.56
ASSURANT INC	313	87.29	27,321.77
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	892	46.67	41,629.64
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	500	57.84	28,920.00
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	496	50.30	24,948.80
CHUBB LTD	2,774	132.71	368,137.54
CINCINNATI FINL CORP	923	69.80	64,425.40
EVEREST RE GROUP LTD	244	226.54	55,275.76
FNF GROUP	1,548	37.71	58,375.08
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	2,168	52.63	114,101.84
LINCOLN NATIONAL CORP	1,309	68.62	89,823.58
LOEWS CORP	1,698	51.20	86,937.60
MARKEL CORP	82	1,134.63	93,039.66
MARSH & MCLENNAN COS	3,049	81.26	247,761.74
METLIFE INC	5,351	46.95	251,229.45
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	1,724	57.16	98,543.84
PROGRESSIVE CORP	3,480	60.70	211,236.00
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	2,530	100.50	254,265.00
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	417	153.28	63,917.76
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	332	128.27	42,585.64
TORCHMARK CORP	647	85.44	55,279.68

TRAVELERS COS INC/THE	1,637	128.99	211,156.63
UNUM GROUP	1,335	39.61	52,879.35
WILLIS TOWERS WATSON PLC	771	151.32	116,667.72
WR BERKLEY CORP	612	75.15	45,991.80
XL GROUP PLC	1,525	55.05	83,951.25
CBRE GROUP INC	1,825	46.28	84,461.00
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	6,849	7.24	49,586.76
JONES LANG LASALLE INC	270	170.41	46,010.70
ACCENTURE PLC-CL A	3,703	152.30	563,966.90
ACTIVISION BLIZZARD INC	4,304	70.37	302,872.48
ADOBE SYSTEMS INC	2,979	230.99	688,119.21
AKAMAI TECHNOLOGIES	1,010	73.12	73,851.20
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	298	199.10	59,331.80
ALPHABET INC-CL A	1,801	1,059.46	1,908,087.46
ALPHABET INC-CL C	1,898	1,054.79	2,001,991.42
ANSYS INC	508	165.73	84,190.84
AUTODESK INC	1,183	131.57	155,647.31
AUTOMATIC DATA PROCESSING	2,654	125.57	333,262.78
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	695	108.45	75,372.75
CA INC	1,864	34.56	64,419.84
CADENCE DESIGN SYS INC	1,691	41.07	69,449.37
CDK GLOBAL INC	738	65.00	47,970.00
CHECK POINT SOFTWARE TECH	785	99.47	78,083.95
CITRIX SYSTEMS INC	899	106.58	95,815.42
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	3,529	77.86	274,767.94
DELL TECHNOLOGIES INC	1,218	72.49	88,292.82
DXC TECHNOLOGY CO	1,709	101.36	173,224.24
EBAY INC	5,940	37.80	224,532.00
ELECTRONIC ARTS INC	1,844	123.92	228,508.48
FACEBOOK INC-A	14,392	177.97	2,561,344.24
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	1,982	102.21	202,580.22
FIRST DATA CORP	3,361	19.19	64,497.59
FISERV INC	2,474	70.41	174,194.34
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	537	203.07	109,048.59
FORTINET INC	834	55.69	46,445.46

GARTNER INC	542	123.79	67,094.18
GLOBAL PAYMENTS INC	954	113.65	108,422.10
IAC/INTERACTIVECORP	457	135.87	62,092.59
INTL BUSINESS MACHINES CORP	5,298	143.22	758,779.56
INTUIT INC	1,462	189.56	277,136.72
JACK HENRY & ASSOCIATES	445	121.80	54,201.00
LEIDOS HOLDINGS INC	857	60.83	52,131.31
MASTERCARD INC-CLASS A	5,668	189.10	1,071,818.80
MERCADOLIBRE INC	252	339.31	85,506.12
MICROSOFT CORP	44,251	96.22	4,257,831.22
ORACLE CORPORATION	18,877	46.07	869,663.39
PAYCHEX INC	1,931	62.56	120,803.36
PAYPAL HOLDINGS INC	7,112	74.67	531,053.04
RED HAT INC	1,061	168.76	179,054.36
SABRE CORP	1,313	23.14	30,382.82
SALESFORCE.COM INC	4,137	126.97	525,274.89
SERVICENOW INC	1,036	176.02	182,356.72
SPLUNK INC	840	109.94	92,349.60
SQUARE INC - A	1,681	51.12	85,932.72
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	1,452	48.75	70,785.00
SYMANTEC CORP	3,706	28.44	105,398.64
SYNOPSYS INC	898	89.00	79,922.00
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	713	110.20	78,572.60
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	992	86.39	85,698.88
TWITTER INC	3,783	31.33	118,521.39
VERISIGN INC	529	122.42	64,760.18
VISA INC-CLASS A SHARES	10,942	129.26	1,414,362.92
VMWARE INC-CLASS A	427	135.82	57,995.14
WESTERN UNION CO	2,726	19.78	53,920.28
WORKDAY INC	822	133.13	109,432.86
WORLDPAY INC-CLASS A	1,778	84.06	149,458.68
ZILLOW GROUP INC-C	805	55.91	45,007.55
AMPHENOL CORP-CL A	1,806	85.82	154,990.92
APPLE INC	30,996	185.16	5,739,219.36
ARISTA NETWORKS INC	285	252.36	71,922.60

ARROW ELECTRONICS INC	581	74.44	43,249.64
AVNET INC	710	39.27	27,881.70
CDW CORP/DE	915	76.37	69,878.55
CISCO SYSTEMS INC	29,871	45.73	1,366,000.83
COGNEX CORP	1,039	46.34	48,147.26
COMMSCOPE HOLDING CO INC	1,108	28.95	32,076.60
CORNING INC	5,194	26.96	140,030.24
F5 NETWORKS INC	371	169.20	62,773.20
FLEX LTD	3,144	14.08	44,267.52
FLIR SYSTEMS INC	826	54.44	44,967.44
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	9,547	17.30	165,163.10
HP INC	10,003	21.79	217,965.37
IPG PHOTONICS CORP	225	233.98	52,645.50
JUNIPER NETWORKS INC	2,225	25.93	57,694.25
MOTOROLA SOLUTIONS INC	966	107.31	103,661.46
NETAPP INC	1,597	68.84	109,937.48
PALO ALTO NETWORKS INC	550	198.54	109,197.00
SEAGATE TECHNOLOGY	1,733	55.95	96,961.35
TE CONNECTIVITY LTD	2,282	92.94	212,089.08
TRIMBLE INC	1,502	35.65	53,546.30
WESTERN DIGITAL CORP	1,770	78.52	138,980.40
XEROX CORP	1,430	28.46	40,697.80
AT & T INC	36,986	32.04	1,185,031.44
CENTURYLINK INC	5,759	18.48	106,426.32
SPRINT CORP	5,383	5.24	28,206.92
T-MOBILE US INC	1,746	56.54	98,718.84
VERIZON COMMUNICATIONS	24,858	47.73	1,186,472.34
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	1,012	34.68	35,096.16
AES CORP	4,363	12.37	53,970.31
ALLIANT ENERGY CORP	1,353	42.94	58,097.82
AMEREN CORPORATION	1,433	58.54	83,887.82
AMERICAN ELECTRIC POWER	2,931	68.78	201,594.18
AMERICAN WATER WORKS CO INC	1,060	84.80	89,888.00
ATMOS ENERGY CORP	620	88.86	55,093.20
CENTERPOINT ENERGY INC	2,424	26.63	64,551.12

CMS ENERGY CORP	1,665	46.02	76,623.30
CONSOLIDATED EDISON INC	1,842	78.36	144,339.12
DOMINION ENERGY INC	3,841	65.08	249,972.28
DTE ENERGY COMPANY	1,064	104.15	110,815.60
DUKE ENERGY CORP	4,388	79.50	348,846.00
EDISON INTERNATIONAL	1,941	63.09	122,457.69
ENTERGY CORP	1,069	81.55	87,176.95
EVERSOURCE ENERGY	1,882	58.73	110,529.86
EXELON CORP	5,730	41.30	236,649.00
FIRSTENERGY CORP	2,653	34.13	90,546.89
NEXTERA ENERGY INC	2,921	163.35	477,145.35
NISOURCE INC	2,170	25.48	55,291.60
OGE ENERGY CORP	1,315	34.33	45,143.95
PG & E CORPORATION	3,071	44.62	137,028.02
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	653	79.75	52,076.75
PPL CORPORATION	4,090	28.58	116,892.20
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	3,017	51.88	156,521.96
SCANA CORP	900	36.43	32,787.00
SEMPRA ENERGY	1,421	110.68	157,276.28
SOUTHERN CO	5,987	45.45	272,109.15
UGI CORP	1,016	48.39	49,164.24
VISTRA ENERGY CORP	2,537	23.80	60,380.60
WEC ENERGY GROUP INC	1,872	64.03	119,864.16
WESTAR ENERGY INC	827	54.29	44,897.83
XCEL ENERGY INC	3,054	46.13	140,881.02
ADVANCED MICRO DEVICES	4,912	11.59	56,930.08
ANALOG DEVICES INC	2,204	90.50	199,462.00
APPLIED MATERIALS INC	6,705	52.59	352,615.95
BROADCOM INC	2,457	235.97	579,778.29
INTEL CORP	28,247	53.33	1,506,412.51
KLA-TENCOR CORP	936	106.71	99,880.56
LAM RESEARCH CORP	970	193.48	187,675.60
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	2,406	20.80	50,044.80
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS INC	1,683	56.41	94,938.03
MICROCHIP TECHNOLOGY	1,399	88.74	124,147.26

	MICRON TECHNOLOGY INC	6,908	48.48	334,899.84	
	NVIDIA CORPORATION	3,661	248.68	910,417.48	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	2,027	98.46	199,578.42	
	QORVO INC	760	79.64	60,526.40	
	QUALCOMM INC	9,132	53.01	484,087.32	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	1,097	95.34	104,587.98	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	5,939	104.51	620,684.89	
	XILINX INC	1,499	67.23	100,777.77	
小計	銘柄数：601	1,849,300		141,155,352.46	
				(15,373,229,436)	
	組入時価比率：61.8%			65.3%	
カナダ・ドル	ALTAGAS LTD	991	25.01	24,784.91	
	ARC RESOURCES LTD	2,600	13.62	35,412.00	
	CAMECO CORP	2,981	14.59	43,492.79	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	6,566	45.30	297,439.80	
	CENOVUS ENERGY INC	6,279	13.49	84,703.71	
	CRESCENT POINT ENERGY CORP	4,039	10.15	40,995.85	
	ENBRIDGE INC	9,927	40.70	404,028.90	
	ENCANA CORP	5,845	16.95	99,072.75	
	HUSKY ENERGY INC	2,153	18.44	39,701.32	
	IMPERIAL OIL LTD	1,967	40.29	79,250.43	
	INTER PIPELINE LTD	2,407	24.11	58,032.77	
	KEYERA CORP	1,206	35.79	43,162.74	
	PEMBINA PIPELINE CORP	3,037	44.08	133,870.96	
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	1,343	27.96	37,550.28	
	SEVEN GENERATIONS ENERGY-A	1,476	17.30	25,534.80	
	SUNCOR ENERGY INC	9,997	49.55	495,351.35	
	TOURMALINE OIL CORP	1,403	23.73	33,293.19	
	TRANSCANADA CORP	5,237	55.60	291,177.20	
	VERMILION ENERGY INC	801	43.73	35,027.73	
	AGNICO EAGLE MINES	1,396	55.13	76,961.48	
	BARRICK GOLD CORP	6,989	17.21	120,280.69	
	CCL INDUSTRIES INC CL B	948	62.27	59,031.96	
	FRANCO-NEVADA CORP	1,116	95.66	106,756.56	
	GOLDCORP INC	5,209	17.46	90,949.14	

KINROSS GOLD CORP	8,389	5.19	43,538.91
LUNDIN MINING CORP	4,716	8.24	38,859.84
METHANEX CORP	514	80.93	41,598.02
NUTRIEN LTD	3,877	59.99	232,581.23
TECK RESOURCES LTD-CLS B	3,478	33.58	116,791.24
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	6,787	3.80	25,790.60
WEST FRASER TIMBER CO LTD	450	89.66	40,347.00
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	2,662	27.47	73,125.14
CAE INC	1,643	24.27	39,875.61
FINNING INTERNATIONAL INC	1,038	32.84	34,087.92
SNC-LAVALIN GROUP INC	1,160	55.73	64,646.80
CANADIAN NATL RAILWAY CO	4,513	101.37	457,482.81
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	877	236.41	207,331.57
LINAMAR CORP	493	72.37	35,678.41
MAGNA INTERNATIONAL INC	2,104	78.44	165,037.76
GILDAN ACTIVEWEAR INC	1,497	37.28	55,808.16
RESTAURANT BRANDS INERNATIONAL INC	1,368	70.28	96,143.04
SHAW COMMUNICATIONS INC	2,787	26.02	72,517.74
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	384	176.35	67,718.40
DOLLARAMA INC	639	149.12	95,287.68
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	2,595	54.46	141,323.70
EMPIRE CO LTD	1,045	24.99	26,114.55
GEORGE WESTON LTD	319	103.90	33,144.10
JEAN COUTU GROUP INC-CLASS A	481	24.48	11,774.88
LOBLAW COMPANIES LTD	1,284	65.07	83,549.88
METRO INC	1,486	40.52	60,212.72
SAPUTO INC	1,209	41.74	50,463.66
BANK OF MONTREAL	3,901	98.53	384,365.53
BANK OF NOVA SCOTIA	7,448	79.35	590,998.80
CANADIAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	2,626	113.34	297,630.84
NATIONAL BANK OF CANADA	2,010	61.79	124,197.90
ROYAL BANK OF CANADA	8,782	98.76	867,310.32
TORONTO DOMINION BK	11,134	73.35	816,678.90
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	5,072	51.29	260,142.88
CI FINANCIAL CORP	1,705	26.34	44,909.70

	ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP	1,538	4.82	7,413.16
	IGM FINANCIAL INC	686	38.46	26,383.56
	ONEX CORPORATION	545	92.76	50,554.20
	THOMSON REUTERS CORP	1,730	50.28	86,984.40
	FAIRFAX FINANCIAL HOLDINGS LTD	169	711.19	120,191.11
	GREAT-WEST LIFE CO INC	2,007	33.66	67,555.62
	INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANCE & FIN	679	52.79	35,844.41
	INTACT FINANCIAL CORP	881	96.51	85,025.31
	MANULIFE FINANCIAL CORP	11,933	24.49	292,239.17
	POWER CORP OF CANADA	2,323	30.00	69,690.00
	POWER FINANCIAL CORP	1,645	32.80	53,956.00
	SUN LIFE FINANCIAL INC	3,703	52.79	195,481.37
	FIRST CAPITAL REALTY INC	1,200	20.45	24,540.00
	BLACKBERRY LIMITED	3,056	14.18	43,334.08
	CGI GROUP INC	1,557	77.38	120,480.66
	CONSTELLATION SOFTWARE	122	960.15	117,138.30
	OPEN TEXT CORP	1,757	47.16	82,860.12
	SHOPIFY INC-CLASS A	546	178.55	97,488.30
	BCE INC	942	53.52	50,415.84
	ROGERS COMMUNICATIONS-CL B	2,207	60.43	133,369.01
	TELUS CORP	600	46.04	27,624.00
	ATCO LTD/CANADA	600	39.78	23,868.00
	CANADIAN UTILITIES LTD	801	33.28	26,657.28
	EMERA INC	274	41.14	11,272.36
	FORTIS INC	2,555	43.36	110,784.80
	HYDRO ONE LTD	1,851	20.49	37,926.99
小計	銘柄数：85	232,293		10,552,007.60 (892,172,242)
	組入時価比率：3.6%			3.8%
ユーロ	ENAGAS	1,410	24.35	34,333.50
	ENI SPA	14,873	16.66	247,843.67
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	3,151	16.46	51,881.21
	KONINKLIJKE VOPAK NV	646	41.51	26,815.46
	NESTE OYJ	839	64.94	54,484.66
	OMV AG	968	52.58	50,897.44

REPSOL SA	7,404	16.24	120,277.98
SNAM SPA	13,344	4.01	53,576.16
TENARIS SA	2,813	16.49	46,386.37
TOTAL SA	14,433	52.71	760,763.43
AIR LIQUIDE	2,566	108.50	278,411.00
AKZO NOBEL	1,507	75.80	114,230.60
ARCELORMITTAL(NA)	3,990	29.35	117,106.50
ARKEMA	436	106.00	46,216.00
BASF SE	5,528	85.65	473,473.20
COVESTRO AG	975	76.24	74,334.00
CRH PLC(IE)	5,060	30.19	152,761.40
EVONIK INDUSTRIES AG	835	30.39	25,375.65
FUCHS PETROLUB SE-PREF	627	45.60	28,591.20
HEIDELBERGCEMENT AG	891	83.68	74,558.88
IMERYS SA	352	75.90	26,716.80
K+S AG	938	24.12	22,624.56
KONINKLIJKE DSM NV	1,091	86.42	94,284.22
LANXESS	592	66.44	39,332.48
LINDE AG	1,116	190.95	213,100.20
SOLVAY SA	440	113.00	49,720.00
STORA ENSO OYJ-R SHS	3,300	16.72	55,176.00
SYMRISE AG	793	67.88	53,828.84
THYSSENKRUPP AG	2,630	22.40	58,912.00
UMICORE	1,264	47.55	60,103.20
UPM-KYMMENE OYJ	3,191	30.51	97,357.41
VOESTALPINE AG	750	44.71	33,532.50
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERVICIOS,S.A.	1,409	36.45	51,358.05
AIRBUS SE	3,621	100.42	363,620.82
ALSTOM	995	38.03	37,839.85
ANDRITZ AG	303	44.34	13,435.02
BOSKALIS WESTMINSTER-CVA	521	25.05	13,051.05
BOUYGUES	1,280	42.82	54,809.60
BRENNTAG AG	991	48.02	47,587.82
CNH INDUSTRIAL NV	6,129	10.57	64,814.17
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	2,968	44.07	130,814.60

DASSAULT AVIATION SA	14	1,670.00	23,380.00
EIFFAGE	481	100.15	48,172.15
FERROVIAL SA	2,860	17.88	51,136.80
GEA GROUP AG	1,206	33.51	40,413.06
HOCHTIEF AG	143	154.80	22,136.40
KION GROUP AG	464	72.80	33,779.20
KONE OYJ-B	2,010	41.67	83,756.70
LEGRAND SA	1,579	65.62	103,613.98
LEONARDO SPA	2,653	9.64	25,590.83
MAN SE	200	96.35	19,270.00
METSO OYJ	667	29.49	19,669.83
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	310	151.90	47,089.00
OSRAM LICHT AG	640	52.54	33,625.60
PRYSMIAN SPA	1,317	25.13	33,096.21
REXEL SA	1,788	13.00	23,244.00
SAFRAN SA	1,993	98.28	195,872.04
SCHNEIDER ELECTRIC SE	3,395	75.06	254,828.70
SIEMENS AG	4,605	109.70	505,168.50
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENER	1,401	14.00	19,614.00
THALES SA	622	110.10	68,482.20
VINCI S.A	3,040	85.10	258,704.00
WARTSILA OYJ	2,631	17.62	46,371.37
BUREAU VERITAS SA	1,669	21.57	36,000.33
EDENRED	1,334	28.74	38,339.16
RANDSTAD NV	773	53.08	41,030.84
RELX NV	5,740	17.79	102,114.60
SOCIETE BIC SA	161	83.85	13,499.85
TELEPERFORMANCE	342	136.70	46,751.40
WOLTERS KLUWER	1,727	45.74	78,992.98
ABERTIS INFRASTRUCTURAS SA	4,127	18.28	75,441.56
ADP	153	183.50	28,075.50
AENA SME SA	402	176.75	71,053.50
ATLANTIA SPA	2,716	28.39	77,107.24
BOLLORE	3,830	4.28	16,392.40
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	1,330	25.25	33,582.50

DEUTSCHE POST AG-REG	5,835	37.15	216,770.25
FRAPORT AG	195	83.18	16,220.10
GETLINK	3,046	11.70	35,653.43
INTL CONSOLIDATED AIRLINES	3,844	7.69	29,575.73
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	1,975	91.56	180,831.00
BAYERISCHE MOTOREN WERKE(PFD)	327	79.90	26,127.30
CONTINENTAL AG	659	228.20	150,383.80
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	5,772	66.83	385,742.76
FAURECIA	454	69.62	31,607.48
FERRARI NV	736	118.05	86,884.80
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	6,450	19.22	124,020.60
MICHELIN(CGDE)-B	1,020	116.60	118,932.00
NOKIAN RENKAAT OYJ	681	33.00	22,473.00
PEUGEOT SA	3,493	20.09	70,174.37
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	919	71.60	65,800.40
RENAULT SA	1,143	89.75	102,584.25
SCHAEFFLER AG	991	13.08	12,967.23
VALEO SA	1,426	57.56	82,080.56
VOLKSWAGEN AG	192	171.30	32,889.60
VOLKSWAGEN AG-PFD	1,115	176.22	196,485.30
ADIDAS AG	1,127	195.05	219,821.35
HERMES INTERNATIONAL	188	551.40	103,663.20
HUGO BOSS AG	418	74.60	31,182.80
KERING	454	478.00	217,012.00
LUXOTTICA GROUP SPA	1,000	52.22	52,220.00
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON	1,678	290.95	488,214.10
SEB SA	132	161.00	21,252.00
ACCOR SA	1,220	47.31	57,718.20
PADDY POWER BETFAIR PLC	486	78.20	38,005.20
SODEXO	533	82.50	43,972.50
ALTICE NV -A	3,103	7.62	23,644.86
AXEL SPRINGER SE	285	68.95	19,650.75
EUTELSAT COMMUNICATIONS	1,296	18.17	23,554.80
JC DECAUX SA	426	29.76	12,677.76
LAGARDERE S.C.A	657	22.69	14,907.33

PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	1,482	30.70	45,497.40
PUBLICIS GROUPE	1,226	62.00	76,012.00
RTL GROUP	137	70.65	9,679.05
SES	2,373	12.93	30,682.89
TELENET GROUP HOLDING NV	307	49.00	15,043.00
VIVENDI	6,187	23.16	143,290.92
INDITEX	6,500	26.62	173,030.00
ZALANDO SE	665	43.65	29,027.25
CARREFOUR SA	3,452	16.75	57,821.00
CASINO GUICHARD PERRACHON	407	43.10	17,541.70
COLRUYT SA	351	46.52	16,328.52
JERONIMO MARTINS	1,318	13.70	18,056.60
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	7,636	19.10	145,847.60
METRO AG	1,337	12.08	16,157.64
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	4,741	82.08	389,141.28
DANONE	3,614	65.19	235,596.66
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	3,569	6.20	22,145.64
HEINEKEN HOLDING NV	688	83.55	57,482.40
HEINEKEN NV	1,552	86.86	134,806.72
KERRY GROUP PLC-A(1E)	961	88.90	85,432.90
PERNOD-RICARD SA	1,269	138.10	175,248.90
REMY COINTREAU	206	116.20	23,937.20
BEIERSDORF AG	657	94.48	62,073.36
HENKEL AG & CO KGAA	622	97.95	60,924.90
HENKEL AG & KGAA VORZUG	1,068	105.60	112,780.80
L'OREAL	1,507	198.15	298,612.05
UNILEVER NV-CVA	9,790	46.33	453,570.70
BIOMERIEUX	282	68.80	19,401.60
ESSILOR INTERNATIONAL	1,245	114.60	142,677.00
FRESENIUS MEDICAL CARE AG	1,303	84.62	110,259.86
FRESENIUS SE & CO KGAA	2,501	66.04	165,166.04
KONINKLIJKE PHILIPS NV	5,682	35.28	200,460.96
SIEMENS HEALTHINEERS AG	1,086	33.10	35,946.60
BAYER AG	4,986	102.10	509,070.60
EUROFINS SCIENTIFIC	71	449.60	31,921.60

GRIFOLS SA	1,961	24.27	47,593.47
IPSEN	229	132.55	30,353.95
MERCK KGAA	786	82.66	64,970.76
ORION OYJ	499	24.85	12,400.15
QIAGEN N.V.	1,333	28.85	38,457.05
RECORDATI SPA	637	30.92	19,696.04
SANOFI	6,841	65.84	450,411.44
UCB SA	762	62.26	47,442.12
ABN AMRO GROUP NV-CVA	2,518	25.75	64,838.50
AIB GROUP PLC	5,466	4.93	26,958.31
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA	41,801	6.78	283,745.18
BANCO DE SABADELL SA	31,781	1.67	53,264.95
BANCO SANTANDER SA	96,304	5.38	518,115.52
BANK OF IRELAND GROUP PLC	5,553	7.12	39,565.12
BANKIA SA	8,280	3.56	29,534.76
BANKINTER SA	4,267	8.71	37,165.57
BNP PARIBAS	6,737	62.37	420,186.69
CAIXABANK	21,383	4.19	89,723.06
COMMERZBANK AG	6,394	10.64	68,070.52
CREDIT AGRICOLE SA	6,801	13.44	91,439.44
ERSTE GROUP BANK AG	1,805	38.81	70,052.05
ING GROEP NV-CVA	23,232	13.97	324,736.89
INTESA SANPAOLO	79,391	3.16	250,994.64
INTESA SANPAOLO-RSP	6,928	3.30	22,883.18
KBC GROEP NV	1,498	69.70	104,410.60
MEDIOBANCA SPA	3,680	10.27	37,812.00
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	890	29.22	26,005.80
SOCIETE GENERALE	4,587	42.27	193,892.49
UNICREDIT SPA	11,992	17.89	214,584.84
AMUNDI SA	419	73.30	30,712.70
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	12,380	11.52	142,691.88
DEUTSCHE BOERSE AG	1,155	116.60	134,673.00
EURAZEO SE	263	71.25	18,738.75
EXOR NV	701	65.08	45,621.08
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	525	92.74	48,688.50

NATIXIS	6,253	6.86	42,920.59
WENDEL SA	173	126.50	21,884.50
AEGON NV	10,657	5.90	62,876.30
AGEAS	1,113	44.77	49,829.01
ALLIANZ SE-REG	2,681	201.00	538,881.00
ASSICURAZIONI GENERALI	7,460	16.78	125,178.80
AXA	11,609	22.65	262,943.85
CNP ASSURANCES	999	20.44	20,419.56
HANNOVER RUECK SE	371	118.60	44,000.60
MAPFRE SA	6,151	2.89	17,782.54
MUNCHENER RUECKVER AG-REG	928	192.15	178,315.20
NN GROUP NV	1,826	38.89	71,013.14
POSTE ITALIANE SPA	4,375	8.11	35,507.50
SAMPO OYJ-A SHS	2,661	44.35	118,015.35
SCOR SE	1,013	33.20	33,631.60
UNIPOLSAI SPA	5,579	2.24	12,519.27
DEUTSCHE WOHNEN SE	2,120	39.73	84,227.60
VONOVIA SE	2,904	41.34	120,051.36
AMADEUS IT GROUP SA	2,619	63.00	164,997.00
ATOS SE	564	111.05	62,632.20
CAPGEMINI SA	960	114.65	110,064.00
DASSAULT SYSTEMES SA	773	109.30	84,488.90
SAP SE	5,914	96.00	567,744.00
UBISOFT ENTERTAINMENT	441	85.28	37,608.48
UNITED INTERNET AG	778	56.64	44,065.92
WIRECARD AG	707	119.55	84,521.85
INGENICO GROUP	386	72.84	28,116.24
NOKIA OYJ	34,925	5.23	182,657.75
1&1 DRILLISCH AG	356	62.70	22,321.20
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	19,996	14.56	291,241.74
ELISA OYJ	913	36.16	33,014.08
ILIAD SA	174	164.95	28,701.30
KONINKLIJKE KPN NV	20,147	2.54	51,233.82
ORANGE S.A	11,937	15.08	180,009.96
PROXIMUS	892	24.68	22,014.56

	TELECOM ITALIA SPA	72,995	0.86	62,950.88	
	TELECOM ITALIA-RSP	30,288	0.74	22,534.27	
	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	5,551	4.14	23,003.34	
	TELEFONICA SA	29,692	8.28	245,938.83	
	E.ON SE	13,201	9.52	125,699.92	
	EDP - ENERGIAS DE PORTUGAL SA	15,249	3.05	46,509.45	
	ELECTRICITE DE FRANCE	3,658	11.74	42,963.21	
	ENDESA SA	1,848	19.67	36,350.16	
	ENEL SPA	51,525	5.38	277,616.70	
	ENGIE	10,902	14.70	160,259.40	
	FORTUM OYJ	2,660	19.52	51,936.50	
	GAS NATURAL SDG SA	2,061	21.21	43,713.81	
	IBERDROLA SA	33,982	6.57	223,261.74	
	INNOGY SE	831	36.75	30,539.25	
	RED ELECTRICA CORP	2,527	17.51	44,260.40	
	RWE AG	3,108	20.29	63,061.32	
	SUEZ	2,425	12.11	29,378.87	
	TERNA SPA	9,111	5.05	46,028.77	
	UNIPER SE	1,297	26.89	34,876.33	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	2,852	20.77	59,236.04	
	ASML HOLDING NV	2,342	163.20	382,214.40	
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	6,813	23.52	160,241.76	
	STMICROELECTRONICS NV	3,818	19.91	76,035.47	
小計	銘柄数：239	1,189,217		24,730,580.67	
				(3,213,986,263)	
	組入時価比率：12.9%			13.7%	
英・ポンド	BP PLC	118,553	5.58	661,644.29	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	27,710	25.78	714,363.80	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	22,164	26.55	588,565.02	
	WOOD GROUP (JOHN) PLC	3,988	5.71	22,771.48	
	ANGLO AMERICAN PLC	8,070	17.51	141,337.98	
	ANTOFAGASTA PLC	2,496	9.96	24,860.16	
	BHP BILLITON PLC	12,811	16.01	205,155.35	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	1,004	44.68	44,858.72	
	FRESNILLO PLC	1,300	13.09	17,017.00	

GLENCORE PLC	77,477	3.60	278,917.20
JOHNSON MATTHEY PLC	1,153	33.16	38,233.48
MONDI PLC	2,183	19.35	42,251.96
RANDGOLD RESOURCES LTD	557	60.50	33,698.50
RIO TINTO PLC	7,308	40.75	297,801.00
ASHTED GROUP PLC	2,984	20.87	62,276.08
BAE SYSTEMS PLC	18,980	6.13	116,423.32
BUNZL PLC	1,966	21.67	42,603.22
COBHAM PLC	14,132	1.18	16,810.01
DCC PLC	523	73.05	38,205.15
FERGUSON PLC	1,487	55.70	82,825.90
IMI PLC	1,694	10.78	18,261.32
MEGGITT PLC	6,469	4.78	30,954.16
MELROSE INDUSTRIES PLC	29,000	2.31	67,135.00
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	9,883	8.35	82,602.11
ROLLS-ROYCE-C SHARE	701,693	0.001	701.69
SMITHS GROUP PLC	2,572	16.37	42,103.64
TRAVIS PERKINS PLC	1,593	12.76	20,334.64
WEIR GROUP PLC/THE	1,336	21.72	29,017.92
BABCOCK INTL GROUP PLC	1,428	7.35	10,498.65
CAPITA PLC	5,084	2.00	10,168.00
EXPERIAN PLC	5,569	17.05	94,951.45
G4S PLC	9,161	2.60	23,864.40
INTERTEK GROUP PLC	958	50.10	47,995.80
RELX PLC	6,138	15.72	96,520.05
EASYJET PLC	996	16.41	16,344.36
ROYAL MAIL PLC	5,325	5.98	31,886.10
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	5,947	5.61	33,398.35
BERKELEY GROUP HOLDINGS	756	40.76	30,814.56
BURBERRY GROUP PLC	2,530	18.75	47,437.50
PERSIMMON PLC	1,829	27.30	49,931.70
TAYLOR WIMPEY PLC	19,288	1.93	37,225.84
CARNIVAL PLC	1,097	47.54	52,151.38
COMPASS GROUP PLC	9,438	15.60	147,232.80
GVC HOLDINGS PLC	2,978	8.71	25,938.38

INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP	1,076	46.67	50,216.92
MERLIN ENTERTAINMENTS	4,361	3.72	16,222.92
TUI AG-DI	2,614	17.29	45,209.13
WHITBREAD PLC	1,086	42.40	46,046.40
ITV PLC	23,458	1.51	35,480.22
PEARSON PLC	4,813	8.93	43,008.96
SKY PLC	6,156	13.72	84,491.10
WPP PLC	7,516	12.81	96,279.96
KINGFISHER PLC	12,766	2.81	35,897.99
MARKS & SPENCER GROUP PLC	10,550	2.88	30,478.95
NEXT PLC	867	51.44	44,598.48
J SAINSBURY PLC	10,454	3.01	31,497.90
TESCO PLC	58,084	2.40	139,808.18
WM MORRISON SUPERMARKETS	14,442	2.46	35,527.32
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	2,121	27.06	57,394.26
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC(GB)	13,785	38.88	535,960.80
COCA-COLA HBC AG-CDI	1,196	24.50	29,302.00
DIAGEO PLC	14,925	26.63	397,452.75
IMPERIAL BRANDS PLC	5,695	26.00	148,070.00
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	4,168	57.27	238,701.36
UNILEVER PLC	7,674	39.81	305,501.94
CONVATEC GROUP PLC	8,178	2.28	18,662.19
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	2,367	6.94	16,426.98
SMITH & NEPHEW PLC	5,237	12.98	67,976.26
ASTRAZENECA PLC	7,838	52.05	407,967.90
GLAXOSMITHKLINE PLC	29,520	14.69	433,707.84
SHIRE PLC	5,436	38.56	209,612.16
BARCLAYS PLC	101,925	2.05	209,557.80
HSBC HOLDINGS PLC	119,885	7.14	856,458.44
LLOYDS BANKING GROUP PLC	430,199	0.65	281,264.10
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	21,438	2.72	58,354.23
STANDARD CHARTERED PLC	19,717	7.48	147,483.16
3I GROUP PLC	5,748	9.45	54,318.60
HARGREAVES LANSDOWN PLC	1,543	17.96	27,712.28
INVESTEC PLC	3,933	5.72	22,528.22

	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	1,855	43.30	80,321.50	
	SCHRODERS PLC	570	33.45	19,066.50	
	ST JAMES'S PLACE PLC	3,448	11.59	39,962.32	
	STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	15,935	3.62	57,732.50	
	ADMIRAL GROUP PLC	1,595	19.90	31,740.50	
	AVIVA PLC	23,926	5.37	128,482.62	
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP	8,017	3.65	29,286.10	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	35,499	2.72	96,770.27	
	OLD MUTUAL PLC	29,488	2.51	74,073.85	
	PRUDENTIAL PLC	15,419	18.93	291,958.76	
	RSA INSURANCE GROUP PLC	6,001	6.37	38,238.37	
	AUTO TRADER GROUP PLC	6,145	3.72	22,902.41	
	MICRO FOCUS INTERNATIONAL	2,729	12.60	34,385.40	
	SAGE GROUP PLC/THE	6,422	6.48	41,614.56	
	BT GROUP PLC	50,358	2.34	118,290.94	
	VODAFONE GROUP PLC	159,430	2.10	335,600.15	
	CENTRICA PLC	33,327	1.54	51,540.20	
	NATIONAL GRID PLC	19,890	8.51	169,263.90	
	SEVERN TRENT	1,537	20.04	30,801.48	
	SSE PLC	6,034	13.95	84,204.47	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	4,478	7.69	34,435.82	
小計	銘柄数：100	2,562,482		11,587,939.74	
				(1,712,929,252)	
	組入時価比率：6.9%			7.3%	
スイス・フラン	CLARIANT AG	1,402	23.72	33,255.44	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG	39	620.00	24,180.00	
	GIVAUDAN-REG	55	2,227.00	122,485.00	
	LAFARGEHOLCIM LTD	2,731	56.34	153,864.54	
	SIKA AG-BR	13	7,440.00	96,720.00	
	ABB LTD-REG	11,039	23.82	262,948.98	
	GEBERIT AG-REG	220	445.70	98,054.00	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	83	208.80	17,330.40	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	262	215.80	56,539.60	
	ADECCO GROUP AG-REG	966	67.44	65,147.04	
	SGS SA-REGB	32	2,456.00	78,592.00	

	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	324	156.20	50,608.80	
	CIE FINANCIERE RICHEMON	3,122	95.64	298,588.08	
	SWATCH GROUP AG/THE	183	88.20	16,140.60	
	THE SWATCH GROUP AG-B	209	475.20	99,316.80	
	DUFREY AG-REG	226	142.00	32,092.00	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	13	1,844.00	23,972.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT	1	74,700.00	74,700.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	7	6,305.00	44,135.00	
	NESTLE SA-REG	18,751	77.56	1,454,327.56	
	SONOVA HOLDING AG-REG	341	170.95	58,293.95	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	63	692.00	43,596.00	
	LONZA GROUP AG-REG	451	265.70	119,830.70	
	NOVARTIS AG-REG	13,414	77.60	1,040,926.40	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSS CHEIN	4,235	227.85	964,944.75	
	VIFOR PHARMA AG	296	159.35	47,167.60	
	CREDIT SUISSE GROUP AG	14,555	16.57	241,249.12	
	JULIUS BAER GROUP LTD	1,340	61.02	81,766.80	
	PARGESA HOLDING SA	368	94.05	34,610.40	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	104	739.00	76,856.00	
	UBS GROUP AG	22,939	16.00	367,138.69	
	BALOISE-HOLDING AG	316	156.10	49,327.60	
	SWISS LIFE HOLDING	194	350.50	67,997.00	
	SWISS RE LTD	1,879	93.62	175,911.98	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	907	317.90	288,335.30	
	SWISS PRIME SITE	453	93.75	42,468.75	
	SWISSCOM AG-REG	156	460.70	71,869.20	
小計	銘柄数：37	101,689		6,875,288.08	
				(747,206,308)	
	組入時価比率：3.0%			3.2%	
スウェーデン・ クローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	1,144	259.10	296,410.40	
	BOLIDEN AB	1,729	319.50	552,415.50	
	ALFA LAVAL AB	1,921	226.70	435,490.70	
	ASSA ABLOY AB-B	5,976	190.15	1,136,336.40	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	4,027	351.10	1,413,879.70	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	2,335	319.00	744,865.00	

	SANDVIK AB	6,758	154.60	1,044,786.80	
	SKANSKA AB-B SHS	2,200	172.15	378,730.00	
	SKF AB-B SHARES	2,476	182.65	452,241.40	
	VOLVO AB-B SHS	9,364	154.85	1,450,015.40	
	SECURITAS AB-B SHS	1,834	141.00	258,594.00	
	ELECTROLUX AB-SER B	1,602	232.80	372,945.60	
	HUSQVARNA AB-B SHS	3,832	86.00	329,552.00	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	5,655	147.50	834,112.50	
	ICA GRUPPEN AB	450	274.20	123,390.00	
	SWEDISH MATCH AB	1,138	398.70	453,720.60	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	3,623	230.60	835,463.80	
	GETINGE AB-B SHS	1,640	87.58	143,631.20	
	NORDEA BANK AB	18,127	89.04	1,614,028.08	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB	9,002	84.38	759,588.76	
	SVENSKA HANDELSBANKEN AB-SHS	9,096	98.64	897,229.44	
	SWEDBANK AB - A SHARES	5,394	189.40	1,021,623.60	
	INDUSTRIVARDEN AB	956	195.50	186,898.00	
	INVESTOR AB-B SHS	2,713	392.10	1,063,767.30	
	KINNEVIK AB	1,484	316.40	469,537.60	
	LUNDBERGS AB-B SHS	137	601.00	82,337.00	
	ERICSSON LM-B SHS	18,386	69.56	1,278,930.16	
	HEXAGON AB-B SHS	1,549	486.30	753,278.70	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	307	571.00	175,297.00	
	TELE2 AB-B SHS	2,178	113.90	248,074.20	
	TELIA COMPANY AB	17,181	43.43	746,170.83	
小計	銘柄数：31	144,214		20,553,341.67	
				(253,422,702)	
	組入時価比率：1.0%			1.1%	
ノルウェー・ク ローネ	STATOIL ASA	6,847	209.30	1,433,077.10	
	NORSK HYDRO ASA	9,354	50.06	468,261.24	
	YARA INTERNATIONAL ASA	1,155	342.40	395,472.00	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	565	215.50	121,757.50	
	MARINE HARVEST	2,348	178.10	418,178.80	
	ORKLA ASA	5,179	74.44	385,524.76	
	DNB ASA	5,762	152.15	876,688.30	

小計	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	1,102	127.20	140,174.40	
	TELENOR ASA	4,473	175.50	785,011.50	
	銘柄数：9	36,785		5,024,145.60	(67,876,207)
	組入時価比率：0.3%				0.3%
デンマーク・クローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	649	578.20	375,251.80	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	1,342	307.90	413,201.80	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	1,282	432.00	553,824.00	
	ISS A/S	1,034	218.20	225,618.80	
	A P MOELLER-MAERSK A/S-B	41	9,932.00	407,212.00	
	AP MOLLER - MAERSK A/S	20	9,395.00	187,900.00	
	DSV A/S	1,131	507.20	573,643.20	
	PANDORA A/S	635	689.60	437,896.00	
	CARLSBERG AS-B	635	707.60	449,326.00	
	COLOPLAST-B	708	573.80	406,250.40	
	WILLIAM DEMANT HOLDING	697	257.40	179,407.80	
	GENMAB A/S	347	1,293.50	448,844.50	
	H LUNDBECK A/S	415	372.20	154,463.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	11,519	301.10	3,468,370.90	
	DANSKE BANK A/S	4,450	214.90	956,305.00	
	TRYG A/S	663	144.60	95,869.80	
	ORSTED A/S	1,121	414.00	464,094.00	
	小計	銘柄数：17	26,689		9,797,479.00
	組入時価比率：0.7%				0.7%
オーストラリア・ドル	CALTEX AUSTRALIA LTD	1,663	30.98	51,519.74	
	OIL SEARCH LIMITED	8,824	8.00	70,592.00	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	10,461	9.97	104,296.17	
	SANTOS LTD	12,247	6.12	74,951.64	
	WOODSIDE PETROLEUM LIMITED	5,505	32.55	179,187.75	
	ALUMINA LTD	15,360	2.85	43,776.00	
	AMCOR LTD	6,797	13.30	90,400.10	
	BHP BILLITON LTD	19,420	31.95	620,469.00	
	BLUESCOPE STEEL LTD	3,153	17.53	55,272.09	

BORAL LTD	6,898	6.55	45,181.90
FORTESCUE METALS GROUP LTD	10,526	4.79	50,419.54
INCITEC PIVOT LTD	8,692	3.74	32,508.08
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	2,847	23.27	66,249.69
NEWCREST MINING LIMITED	4,510	21.82	98,408.20
ORICA LIMITED	2,418	19.00	45,942.00
RIO TINTO LIMITED	2,603	81.00	210,843.00
SOUTH32 LTD	31,497	3.85	121,263.45
CIMIC GROUP LIMITED	556	45.19	25,125.64
BRAMBLES LIMITED	9,312	9.82	91,443.84
SEEK LTD	1,905	20.36	38,785.80
AURIZON HOLDINGS LTD	13,445	4.58	61,578.10
SYDNEY AIRPORT CO LTD	6,452	7.15	46,131.80
TRANSURBAN GROUP	13,213	11.90	157,234.70
ARISTOCRAT LEISURE LTD	3,219	27.68	89,101.92
CROWN RESORTS LTD	2,452	13.26	32,513.52
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES	523	42.00	21,966.00
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	343	59.44	20,387.92
TABCORP HOLDINGS LIMITED	11,254	4.26	47,942.04
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	2,969	3.47	10,302.43
WESFARMERS LTD	6,725	43.94	295,496.50
WOOLWORTHS GROUP LTD	7,715	28.70	221,420.50
COCA-COLA AMATIL LIMITED	3,086	9.34	28,823.24
TREASURY WINE ESTATES LTD	4,306	19.54	84,139.24
COCHLEAR LTD	335	195.57	65,515.95
HEALTHSCOPE LTD	10,205	2.40	24,492.00
RAMSAY HEALTH CARE LTD	908	64.99	59,010.92
SONIC HEALTHCARE LTD	2,517	23.75	59,778.75
CSL LIMITED	2,705	169.96	459,741.80
AUST AND NZ BANKING GROUP LTD	18,335	27.62	506,412.70
BANK OF QUEENSLAND LTD	1,699	10.22	17,363.78
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	4,498	10.70	48,128.60
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	10,437	72.71	758,874.27
NATIONAL AUSTRALIA BANK LIMITED	15,980	28.91	461,981.80
WESTPAC BANKING CORPORATION	21,048	29.34	617,548.32

	AMP LTD	16,991	4.12	70,002.92	
	ASX LTD	1,214	60.68	73,665.52	
	CHALLENGER LTD	3,718	11.83	43,983.94	
	MACQUARIE GROUP LTD	1,921	110.09	211,482.89	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	13,939	8.06	112,348.34	
	MEDIABANK PRIVATE LTD	17,787	3.02	53,716.74	
	QBE INSURANCE GROUP LIMITED	7,999	10.20	81,589.80	
	SUNCORP GROUP LTD	7,597	14.09	107,041.73	
	LENDLEASE GROUP	3,613	18.17	65,648.21	
	COMPUTERSHARE LTD	2,726	17.62	48,032.12	
	REA GROUP LTD	305	82.95	25,299.75	
	TELSTRA CORP LTD	24,442	3.25	79,436.50	
	TPG TELECOM LTD	2,902	5.65	16,396.30	
	AGL ENERGY LTD	3,863	22.09	85,333.67	
	APA GROUP	7,236	8.38	60,637.68	
	AUSNET SERVICES	9,421	1.75	16,533.85	
小計	銘柄数：60	455,237		7,463,672.39	
				(611,349,405)	
	組入時価比率：2.5%			2.6%	
ニュージーランド・ドル	FLETCHER BUILDING LIMITED	3,971	6.30	25,017.30	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	5,467	6.48	35,426.16	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	3,903	12.79	49,919.37	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	2,305	10.60	24,433.00	
	SPARK NEW ZEALAND LIMITED	11,528	3.53	40,693.84	
	MERCURY NZ LTD	3,877	3.25	12,600.25	
	MERIDIAN ENERGY LTD	8,666	2.95	25,564.70	
小計	銘柄数：7	39,717		213,654.62	
				(16,342,441)	
	組入時価比率：0.1%			0.1%	
香港・ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	15,613	90.95	1,420,002.35	
	NWS HOLDINGS LTD	11,000	14.82	163,020.00	
	MTR CORP	8,941	44.15	394,745.15	
	MINTH GROUP LTD	4,000	37.05	148,200.00	
	LI & FUNG LTD	35,000	4.07	142,450.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	9,156	44.85	410,646.60	

YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	5,500	22.50	123,750.00
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	13,904	68.20	948,252.80
MGM CHINA HOLDINGS LTD	6,200	23.25	144,150.00
SANDS CHINA LTD	14,200	45.60	647,520.00
SHANGRI-LA ASIA LTD	10,000	15.16	151,600.00
SJM HOLDINGS LTD	16,000	8.78	140,480.00
WYNN MACAU LTD	9,553	30.35	289,933.55
WH GROUP LIMITED	52,500	7.97	418,425.00
BANK OF EAST ASIA	7,657	33.10	253,446.70
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	21,995	40.50	890,797.50
HANG SENG BANK LTD	4,696	196.30	921,824.80
FIRST PACIFIC CO	18,000	3.97	71,460.00
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	6,851	252.00	1,726,452.00
KINGSTON FINANCIAL GROUP LIMITED	28,000	3.94	110,320.00
AIA GROUP LTD	74,889	68.35	5,118,663.15
CK ASSET HOLDINGS LTD	15,363	66.00	1,013,958.00
HANG LUNG GROUP LTD	3,000	23.80	71,400.00
HANG LUNG PROPERTIES LTD	13,000	18.20	236,600.00
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	7,705	49.15	378,700.75
HYSAN DEVELOPMENT CO	3,000	43.55	130,650.00
KERRY PROPERTIES LIMITED	4,500	37.55	168,975.00
NEW WORLD DEVELOPMENT	34,000	11.12	378,080.00
SINO LAND CO	19,800	13.06	258,588.00
SUN HUNG KAI PROPERTIES	9,065	122.80	1,113,182.00
SWIRE PACIFIC LTD 'A'	2,520	75.50	190,260.00
SWIRE PROPERTIES LTD	6,800	27.75	188,700.00
WHARF HOLDINGS LTD	8,385	25.20	211,302.00
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	7,385	57.10	421,683.50
WHEELOCK AND COMPANY LTD	5,144	55.80	287,035.20
PCCW LTD	25,000	4.87	121,750.00
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	3,814	61.85	235,895.90
CLP HOLDINGS LIMITED	9,296	80.75	750,652.00
HK ELECTRIC INVESTMENTS AND HK ELECTRIC	14,500	7.30	105,850.00
HONG KONG & CHINA GAS	49,986	16.56	827,768.16

小計	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	8,320	58.20	484,224.00
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	1,800	100.00	180,000.00
	銘柄数：42	626,038		22,391,394.11 (310,568,636)
	組入時価比率：1.2%			1.3%
シンガポール・ ドル	KEPPEL CORP LTD	9,200	8.13	74,796.00
	SEBACORP INDUSTRIES LTD	6,734	3.05	20,538.70
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	8,900	3.47	30,883.00
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING	16,100	1.18	18,998.00
	COMFORTDELGRO CORP LTD	9,518	2.19	20,844.42
	SATS LTD	4,900	5.49	26,901.00
	SINGAPORE AIRLINES LTD	3,200	11.16	35,712.00
	GENTING SINGAPORE PLC	38,393	1.17	44,919.81
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	9,100	2.67	24,297.00
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	704	34.03	23,957.12
	GOLDEN AGRI RESOURCES LIMITED	42,129	0.35	14,955.79
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	9,600	3.20	30,720.00
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	10,810	28.97	313,165.70
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	18,845	13.17	248,188.65
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	7,966	29.29	233,324.14
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	4,100	7.66	31,406.00
	CAPITALAND LTD	16,375	3.74	61,242.50
	CITY DEVELOPMENTS LTD	2,500	12.44	31,100.00
	UOL GROUP LTD	3,000	8.56	25,680.00
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	49,008	3.50	171,528.00
	STARHUB LTD	4,200	2.26	9,492.00
小計	銘柄数：21	275,282		1,492,649.83 (121,800,226)
	組入時価比率：0.5%			0.5%
イスラエル・新 シェケル	FRUTAROM INDUSTRIES LTD	235	355.00	83,425.00
	ISRAEL CHEMICALS LTD	4,641	16.49	76,530.09
	ELBIT SYSTEMS LTD	141	415.40	58,571.40
	BANK HAPUALIM LTD	6,346	25.54	162,076.84
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	8,674	21.99	190,741.26

	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	825	66.53	54,887.25	
	AZRIELI GROUP	356	164.60	58,597.60	
	NICE LTD	335	345.40	115,709.00	
	BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	7,676	4.29	32,930.04	
小計	銘柄数：9	29,229		833,468.48	
				(25,170,748)	
	組入時価比率：0.1%			0.1%	
合計		7,568,172		23,516,921,899	
				(23,516,921,899)	

(注1) 比率は左より組入時価の純資産総額に対する比率、及び各小計欄の合計金額に対する比率であります。

(注2) 通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額であります。

(注3) 合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係わるもので、内書であります。

(2) 株式以外の有価証券

(平成30年 5月 8日現在)

種類	通貨	銘柄	口数	評価額	備考
投資信託受益証券	香港・ドル	HKT TRUST AND HKT LTD	22,136	228,886.24	
	小計	銘柄数：1	22,136	228,886.24	
		組入時価比率：0.0%		(3,174,652)	0.6%
	合計			3,174,652	(3,174,652)
投資証券	米・ドル	AGNC INVESTMENT CORP	2,235	42,777.90	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	568	73,726.40	
		AMERICAN TOWER CORP	2,694	372,149.16	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT (REIT)	7,246	75,793.16	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	819	135,298.80	
		BOSTON PROPERTIES INC	917	113,845.55	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	2,000	29,460.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	608	52,804.80	
		CROWN CASTLE INTL CORP	2,571	263,681.76	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	1,225	130,658.50	
		DUKE REALTY CORP	2,096	59,547.36	
		EQUINIX INC	467	184,072.72	

	EQUITY RESIDENTIAL	2,121	132,562.50
	ESSEX PROPERTY TRUST	391	94,473.42
	EXTRA SPACE STORAGE INC	749	69,986.56
	FEDERAL REALTY INVS TRUST(REIT)	425	50,511.25
	GGP INC	3,480	69,982.80
	HCP INC	2,782	66,155.96
	HOST HOTELS & RESORTS INC	4,409	88,709.08
	HUTCHISON PORT HOLDINGS TRST	46,700	15,878.00
	INVITATION HOMES INC	1,835	43,177.55
	IRON MOUNTAIN INC	1,694	58,341.36
	KIMCO REALTY CORP	2,839	41,534.57
	LIBERTY PROPERTY TRUST	969	41,918.94
	MACERICH CO/THE	709	41,575.76
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	670	62,343.50
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES	986	39,548.46
	PROLOGIS INC	3,151	206,358.99
	PUBLIC STORAGE	933	195,911.34
	REALTY INCOME CORP	1,668	87,853.56
	REGENCY CENTERS CORP	901	53,068.90
	SBA COMMUNICATIONS CORP	704	110,950.40
	SIMON PROPERTY GROUP INC	1,964	313,788.28
	SL GREEN REALTY CORP	582	58,409.52
	UDR INC	1,575	57,361.50
	VENTAS INC	2,182	116,409.70
	VEREIT INC	6,490	45,365.10
	VORNADO REALTY TRUST	1,014	71,405.88
	WELLTOWER INC	2,202	122,673.42
	WEYERHAEUSER CO	4,471	164,175.12
小計	銘柄数：40	122,042	4,054,247.53 (441,548,098)
	組入時価比率：1.8%		76.8%
カナダ・ドル	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	883	18,392.89
	RIOCAN REIT	981	23,122.17
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INVESTMENT	600	17,478.00
小計	銘柄数：3	2,464	58,993.06

			(4,987,863)	
	組入時価比率：0.0%		0.9%	
ユーロ	FONCIERE DES REGIONS	238	22,978.90	
	GECINA SA	310	44,547.00	
	ICADE	232	18,223.60	
	KLEPIERRE	1,287	43,539.21	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	577	113,957.50	
小計	銘柄数：5	2,644	243,246.21	
			(31,612,277)	
	組入時価比率：0.1%		5.5%	
英・ポンド	BRITISH LAND CO PLC	5,610	37,699.20	
	HAMMERSON PLC	5,076	28,141.34	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	4,341	42,541.80	
	SEGRO PLC	6,537	41,836.80	
	小計	銘柄数：4	21,564	150,219.14
			(22,205,393)	
	組入時価比率：0.1%		3.9%	
オーストラリア・ドル	DEXUS	6,558	62,366.58	
	GOODMAN GROUP	10,451	95,626.65	
	GPT GROUP	11,431	55,897.59	
	MIRVAC GROUP	23,783	53,987.41	
	SCENTRE GROUP	31,065	127,366.50	
	STOCKLAND	13,675	57,298.25	
	VICINITY CENTRES	18,289	46,088.28	
	WESTFIELD CORP	11,660	106,106.00	
	小計	銘柄数：8	126,912	604,737.26
			(49,534,028)	
	組入時価比率：0.2%		8.6%	
香港・ドル	LINK REIT	12,716	845,614.00	
	小計	銘柄数：1	12,716	845,614.00
			(11,728,666)	
	組入時価比率：0.0%		2.0%	
シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TR	14,672	38,880.80	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	14,981	26,815.99	
	CAPITALAND MALL TRUST	10,900	22,781.00	
	SUNTEC REIT	15,000	28,800.00	

小計	銘柄数：4	55,553	117,277.79 (9,569,867)	1.7%
	組入時価比率：0.0%			
合計			571,186,192 (571,186,192)	
合計			574,360,844 (574,360,844)	

(注1) 比率は左より組入時価の純資産総額に対する比率、及び各小計欄の合計金額に対する比率であります。

(注2) 通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額であります。

(注3) 合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係わるもので、内書であります。

有価証券明細表注記

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	合計金額に 対する比率
米・ドル	株式 601銘柄	97.2%			63.8%
	投資証券 40銘柄			2.8%	1.8%
カナダ・ドル	株式 85銘柄	99.4%			3.7%
	投資証券 3銘柄			0.6%	0.0%
ユーロ	株式 239銘柄	99.0%			13.4%
	投資証券 5銘柄			1.0%	0.1%
英・ポンド	株式 100銘柄	98.7%			7.1%
	投資証券 4銘柄			1.3%	0.1%
スイス・フラン	株式 37銘柄	100.0%			3.1%
スウェーデン・ク ローナ	株式 31銘柄	100.0%			1.1%
ノルウェー・クロー ネ	株式 9銘柄	100.0%			0.3%
デンマーク・クロー ネ	株式 17銘柄	100.0%			0.7%
オーストラリア・ド ル	株式 60銘柄	92.5%			2.5%
	投資証券 8銘柄			7.5%	0.2%
ニュージーランド・ ドル	株式 7銘柄	100.0%			0.1%
香港・ドル	株式 42銘柄	95.4%			1.4%

	投資信託受益証券	1銘柄		1.0%		0.0%
	投資証券	1銘柄			3.6%	0.0%
シンガポール・ドル	株式	21銘柄	92.7%			0.5%
	投資証券	4銘柄			7.3%	0.0%
イスラエル・新シエケル	株式	9銘柄	100.0%			0.1%

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」に記載しております。

【中間財務諸表】

コア資産形成ファンド

- (1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)ならびに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。
なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第4期中間計算期間の中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人により中間監査を受けております。

【コア資産形成ファンド】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第4期中間計算期間 (平成30年11月 8日現在)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	6,384,837
親投資信託受益証券	348,458,738
流動資産合計	354,843,575
資産合計	354,843,575
負債の部	
流動負債	
未払解約金	330,428
未払受託者報酬	70,556
未払委託者報酬	1,516,968
未払利息	17
その他未払費用	6,909
流動負債合計	1,924,878
負債合計	1,924,878
純資産の部	
元本等	
元本	351,096,888
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金()	1,821,809
(分配準備積立金)	5,755,561
元本等合計	352,918,697
純資産合計	352,918,697
負債純資産合計	354,843,575

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

第4期中間計算期間 (自 平成30年 5月 9日 至 平成30年11月 8日)	
営業収益	
受取利息	17
有価証券売買等損益	4,880,341
営業収益合計	4,880,324
営業費用	
支払利息	3,761
受託者報酬	70,556
委託者報酬	1,516,968
その他費用	6,909
営業費用合計	1,598,194
営業利益又は営業損失()	6,478,518
経常利益又は経常損失()	6,478,518
中間純利益又は中間純損失()	6,478,518
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額()	56,951
期首剰余金又は期首欠損金()	6,548,910
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,303,960
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	2,303,960
剰余金減少額又は欠損金増加額	609,494
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	609,494
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-
分配金	-
中間剰余金又は中間欠損金()	1,821,809

(3)【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第4期中間計算期間 (自平成30年5月9日 至平成30年11月8日)
1 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 基準価額で評価しております。
2 収益・費用の計上基準	有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。

(中間貸借対照表に関する注記)

第4期中間計算期間 (平成30年11月8日現在)	
1 中間計算期間末日における受益権の総数	351,096,888口
2 中間計算期間末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産の額	1.0052円
(1万口当たり純資産の額)	(10,052円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	第4期中間計算期間 (平成30年11月8日現在)
1 貸借対照表日における貸借対照表の科目ごとの計上額・時価・時価との差額	中間貸借対照表に計上している金融商品は、原則として時価評価としているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。

項目	第4期中間計算期間 (平成30年11月 8日現在)
2 貸借対照表の科目ごとの時価の算定方法	<p>(1)有価証券</p> <p>親投資信託受益証券</p> <p>原則として、親投資信託受益証券の基準価額で評価しております。</p> <p>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>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、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>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。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。</p>

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

項目	期別 第4期中間計算期間 (平成30年11月 8日現在)
期首元本額	269,568,501円
期中追加設定元本額	106,661,194円
期中一部解約元本額	25,132,807円

（参考）

当ファンドは、「MHAM日本債券インデックスマザーファンド」受益証券、「MHAM外国債券インデックスマザーファンド」受益証券、「MHAM TOPIXマザーファンド」受益証券、及び「MHAM外国株式インデックスマザーファンド」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、すべて同マザーファンドの受益証券です。なお、同マザーファンドの状況は次の通りです。

MHAM日本債券インデックスマザーファンド

なお、以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

(単位：円)

(平成30年11月 8日現在)

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	858,217,068
国債証券	125,046,500,450
地方債証券	7,736,428,964
特殊債券	8,624,009,517
社債券	5,679,149,600
未収利息	271,561,177
前払費用	27,654,268
流動資産合計	148,243,521,044
資産合計	148,243,521,044
負債の部	
流動負債	
未払解約金	47,162,000
未払利息	2,380
流動負債合計	47,164,380
負債合計	47,164,380
純資産の部	
元本等	
元本	121,055,777,167
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	27,140,579,497
元本等合計	148,196,356,664
純資産合計	148,196,356,664
負債純資産合計	148,243,521,044

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	(自 平成30年 5月 9日 至 平成30年11月 8日)
1 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券 原則として時価で評価しております。
2 収益・費用の計上基準	有価証券売買等損益及び派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	(平成30年11月 8日現在)	
1 計算期間末日における受益権の総数		121,055,777,167口
2 計算期間末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産の額	1.2242円
	(1万口当たり純資産の額)	(12,242円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成30年11月 8日現在)
1 貸借対照表日における貸借対照表の科目ごとの計上額・時価・時価との差額	貸借対照表に計上している金融商品は、原則として時価評価としているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2 貸借対照表の科目ごとの時価の算定方法	<p>(1)有価証券</p> <p>国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券</p> <p>わが国の金融商品取引所または海外取引所に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）（外貨建証券を除く）、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除く）または価格情報会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できない場合または入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>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、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>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。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。</p>

（有価証券に関する注記）
 該当事項はありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

項目	期別 (平成30年11月 8日現在)
期首	平成30年 5月 9日
親投資信託の期首における元本額	123,838,085,315円
期中追加設定元本額	20,248,224,436円
期中一部解約元本額	23,030,532,584円
期末元本額及びその内訳として当該親投資信託受益証券を投資対象とする委託者指図型投資信託ごとの元本額	
期末元本額	121,055,777,167円
動的パッケージファンド<DC年金>	184,926,286円
コア資産形成ファンド	190,704,617円
MHAM日本債券インデックスファンド（ファンドラップ）	65,111,428,324円
MHAM日本債券インデックスファンド	188,248,579円
MHAM動的パッケージファンド [適格機関投資家限定]	40,817,178,664円
MHAM日本債券パッシブファンド [適格機関投資家限定]	7,796,699,777円
MHAM動的パッケージ4資産ファンド [適格機関投資家限定]	6,766,590,920円

MHAM外国債券インデックスマザーファンド

なお、以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

（単位：円）

（平成30年11月 8日現在）

資産の部	
流動資産	
預金	428,540,460
コール・ローン	4,872,918

(平成30年11月 8日現在)

国債証券	18,950,649,662
未収利息	112,779,015
前払金	50,000,225
前払費用	35,331,750
流動資産合計	19,582,174,030
資産合計	19,582,174,030
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	5,723
前受収益	1,241
未払金	116,391,631
未払解約金	5,623,600
未払利息	13
流動負債合計	122,022,208
負債合計	122,022,208
純資産の部	
元本等	
元本	15,492,302,495
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	3,967,849,327
元本等合計	19,460,151,822
純資産合計	19,460,151,822
負債純資産合計	19,582,174,030

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	(自平成30年 5月 9日 至平成30年11月 8日)
1 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 原則として時価で評価しております。
2 派生商品等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として時価で評価しております。
3 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算し、為替予約の評価は計算期間末日に残高がある場合、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。
4 収益・費用の計上基準	有価証券売買等損益、派生商品取引等損益及び為替差損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	(平成30年11月 8日現在)	
1 計算期間末日における受益権の総数		15,492,302,495口
2 計算期間末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産の額	1.2561円
	(1万口当たり純資産の額)	(12,561円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成30年11月 8日現在)
1 貸借対照表日における貸借対照表の科目ごとの計上額・時価・時価との差額	貸借対照表に計上している金融商品は、原則として時価評価としているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2 貸借対照表の科目ごとの時価の算定方法	<p>(1)有価証券</p> <p>国債証券</p> <p>わが国の金融商品取引所または海外取引所に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）（外貨建証券を除く）、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除く）または価格情報会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できない場合または入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認められた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認められた価額で評価しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引</p> <p>為替予約取引</p> <p>デリバティブ取引等に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>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、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

項目	(平成30年11月 8日現在)
3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>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る場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。</p>

(有価証券に関する注記)
 該当事項はありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(通貨関連)
 (平成30年11月 8日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	6,400,000	-	6,405,723	5,723
	ユーロ	6,400,000	-	6,405,723	5,723
	合計	6,400,000	-	6,405,723	5,723

(注) 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

(その他の注記)

項目	期別 (平成30年11月 8日現在)
期首	平成30年 5月 9日
親投資信託の期首における元本額	12,804,000,846円
期中追加設定元本額	6,729,575,557円

項目	期別 (平成30年11月 8日現在)
期中一部解約元本額	4,041,273,908円
期末元本額及びその内訳として当該親投資信託受益証券を投資対象とする委託者指図型投資信託ごとの元本額	
期末元本額	15,492,302,495円
動的パッケージファンド<DC年金>	49,085,530円
コア資産形成ファンド	50,263,208円
MHAM外国債券インデックスファンド(ファンドラップ)	756,912,820円
MHAM外国債券インデックスファンド	75,017,004円
MHAM外国債券インデックスファンド<為替ヘッジあり>(ファンドラップ)	625,169,916円
MHAM動的パッケージファンド[適格機関投資家限定]	10,764,795,557円
MHAM外国債券パッシブファンド[適格機関投資家限定]	3,171,058,460円

MHAM TOPIXマザーファンド

なお、以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

(単位：円)

(平成30年11月 8日現在)

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	843,614,806
株式	41,350,446,460
派生商品評価勘定	38,021,024
未収配当金	376,668,404
差入委託証拠金	45,510,000
流動資産合計	42,654,260,694
資産合計	42,654,260,694
負債の部	
流動負債	
前受金	19,175,000
未払解約金	16,089,400
未払利息	2,339
流動負債合計	35,266,739
負債合計	35,266,739
純資産の部	
元本等	
元本	21,664,377,723
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金()	20,954,616,232
元本等合計	42,618,993,955
純資産合計	42,618,993,955
負債純資産合計	42,654,260,694

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	(自平成30年3月13日 至平成30年11月8日)
1 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 原則として時価で評価しております。
2 派生商品等の評価基準及び評価方法	先物取引 原則として時価で評価しております。
3 収益・費用の計上基準	受取配当金 受取配当金は、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。 有価証券売買等損益及び派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	(平成30年11月8日現在)
1 計算期間末日における受益権の総数	21,664,377,723口
2 計算期間末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産の額 1.9672円 (1万口当たり純資産の額) (19,672円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成30年11月8日現在)
1 貸借対照表日における貸借対照表の科目ごとの計上額・時価・時価との差額	貸借対照表に計上している金融商品は、原則として時価評価としているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。

項目	(平成30年11月 8日現在)
2 貸借対照表の科目ごとの時価の算定方法	<p>(1)有価証券</p> <p>株式</p> <p>わが国の金融商品取引所または海外取引所に上場されている有価証券 当該有価証券については、原則として上記の取引所における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）で評価しております。</p> <p>時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できない場合または入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認められた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認められた価額で評価しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引</p> <p>先物取引</p> <p>デリバティブ取引等に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>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、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>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る場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。</p>

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（株式関連）

（平成30年11月 8日現在）

区分	種類	契約額等（円）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）

市場取引	株価指数先物取引 買建				
		1,206,288,976	-	1,244,310,000	38,021,024
	合計	1,206,288,976	-	1,244,310,000	38,021,024

（注）時価の算定方法

株価指数先物取引の時価の算定方法については、取引所の発表する計算日の清算値段により評価しております。

（その他の注記）

項目	期別 (平成30年11月 8日現在)
期首	平成30年 3月13日
親投資信託の期首における元本額	22,650,169,786円
期中追加設定元本額	4,513,366,429円
期中一部解約元本額	5,499,158,492円
期末元本額及びその内訳として当該親投資信託受益証券を投資対象とする委託者指図型投資信託ごとの元本額	
期末元本額	21,664,377,723円
MHAMスリーウェイオープン	864,954,698円
MHAM TOPIXオープン	4,500,176,547円
MHAM日本株式インデックスファンド（ファンドラップ）	11,777,546,878円
動的パッケージファンド＜DC年金＞	12,041,561円
コア資産形成ファンド	12,547,297円
MHAM TOPIXファンドVA（適格機関投資家専用）	169,505,002円
MHAM動的パッケージファンド〔適格機関投資家限定〕	2,703,565,997円
MHAM日本株式パッシブファンド〔適格機関投資家限定〕	1,624,039,743円

MHAM外国株式インデックスマザーファンド

なお、以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

（単位：円）

（平成30年11月 8日現在）

資産の部	
流動資産	
預金	741,931,108
コール・ローン	15,622,429
株式	25,005,499,109
投資信託受益証券	3,782,304
投資証券	618,062,857
派生商品評価勘定	22,413,266
未収入金	23,413,266

(平成30年11月 8日現在)

未収配当金	19,362,402
前払金	128,167,292
差入委託証拠金	53,160,314
流動資産合計	26,631,414,347
資産合計	26,631,414,347
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	13,088,151
未払解約金	7,818,500
未払利息	43
流動負債合計	20,906,694
負債合計	20,906,694
純資産の部	
元本等	
元本	14,035,037,639
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	12,575,470,014
元本等合計	26,610,507,653
純資産合計	26,610,507,653
負債純資産合計	26,631,414,347

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	(自平成30年 5月 9日 至平成30年11月 8日)
1 有価証券の評価基準及び評価方法	株式、投資信託受益証券、投資証券 原則として時価で評価しております。
2 派生商品等の評価基準及び評価方法	先物取引、為替予約取引 原則として時価で評価しております。
3 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算し、為替予約の評価は計算期間末日に残高がある場合、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。
4 収益・費用の計上基準	受取配当金 受取配当金は、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。 有価証券売買等損益、派生商品取引等損益及び為替差損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	(平成30年11月 8日現在)	
1 計算期間末日における受益権の総数		14,035,037,639口
2 計算期間末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産の額	1.8960円
	(1万口当たり純資産の額)	(18,960円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成30年11月 8日現在)
1 貸借対照表日における貸借対照表の科目ごとの計上額・時価・時価との差額	貸借対照表に計上している金融商品は、原則として時価評価としているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2 貸借対照表の科目ごとの時価の算定方法	<p>(1) 有価証券</p> <p>株式、投資信託受益証券、投資証券</p> <p>わが国の金融商品取引所または海外取引所に上場されている有価証券 当該有価証券については、原則として上記の取引所における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）で評価しております。</p> <p>時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できない場合または入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認められた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認められた価額で評価しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引</p> <p>先物取引、為替予約取引</p> <p>デリバティブ取引等に関する注記に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>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、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

項目	(平成30年11月 8日現在)
3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>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る場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。</p>

(有価証券に関する注記)
 該当事項はありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(株式関連)
 (平成30年11月 8日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	1,030,452,241	-	1,039,780,643	9,328,402
	合計	1,030,452,241	-	1,039,780,643	9,328,402

(注) 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価の算定方法については、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により評価しております。

(通貨関連)
 (平成30年11月 8日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建 ユーロ	10,420,000 10,420,000	- -	10,423,287 10,423,287	3,287 3,287
	合計	10,420,000	-	10,423,287	3,287

(注) 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

(その他の注記)

期別	(平成30年11月 8日現在)
項目	
期首	平成30年 5月 9日
親投資信託の期首における元本額	13,855,813,168円
期中追加設定元本額	4,047,987,582円
期中一部解約元本額	3,868,763,111円
期末元本額及びその内訳として当該親投資信託受益証券を投資対象とする委託者指図型投資信託ごとの元本額	
期末元本額	14,035,037,639円
動的パッケージファンド<DC年金>	14,047,217円
コア資産形成ファンド	14,335,174円
MHAM外国株式インデックスファンド(ファンドラップ)	9,044,155,504円
MHAM外国株式インデックスファンド	297,377,098円
MHAM外国株式インデックスファンド<為替ヘッジあり>(ファンドラップ)	60,990,724円
MHAM動的パッケージファンド[適格機関投資家限定]	3,163,131,752円
MHAM外国株式パッシブファンド[適格機関投資家限定]	1,441,000,170円

2【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は平成30年11月30日現在です。

【純資産額計算書】

コア資産形成ファンド

資産総額	363,954,040円
負債総額	269,998円
純資産総額（ - ）	363,684,042円
発行済口数	361,581,948口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0058円

（参考）MHAM日本債券インデックスマザーファンド

資産総額	144,914,261,304円
負債総額	201,144,040円
純資産総額（ - ）	144,713,117,264円
発行済口数	117,639,836,869口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2301円

（参考）MHAM外国債券インデックスマザーファンド

資産総額	19,538,880,326円
負債総額	10,763,356円
純資産総額（ - ）	19,528,116,970円
発行済口数	15,505,836,334口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2594円

（参考）MHAM TOPIXマザーファンド

資産総額	45,814,375,824円
負債総額	1,987,497,121円
純資産総額（ - ）	43,826,878,703円
発行済口数	22,456,622,486口
1口当たり純資産額（ / ）	1.9516円

（参考）MHAM外国株式インデックスマザーファンド

資産総額	25,970,729,120円
負債総額	29,945,381円
純資産総額（ - ）	25,940,783,739円
発行済口数	14,032,801,573口
1口当たり純資産額（ / ）	1.8486円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 受益証券の名義書換

該当事項はありません。

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

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

(2) 受益者等名簿

該当事項はありません。

(3) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

(4) 受益権の譲渡制限

譲渡制限はありません。

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

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

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

(5) 受益権の譲渡の対抗要件

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

とができません。

(6) 受益権の再分割

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

(7) 質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額(2018年11月30日現在)

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

直近5カ年の資本金の増減：該当事項はありません。

(2) 会社の機構(2018年11月30日現在)

会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。

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

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

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

また、取締役会の決議によって、取締役社長を定めることができます。

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

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

投資運用の意思決定機構

1. 投資環境見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11月30日現在、委託会社の運用する投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除く）

基本的性格	本数	純資産総額（単位：円）
追加型公社債投資信託	38	1,205,923,689,410
追加型株式投資信託	854	13,003,927,185,717
単位型公社債投資信託	46	183,614,446,405
単位型株式投資信託	153	1,116,875,953,733
合計	1,091	15,510,341,275,265

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	1,156,953
器具備品	1	656,235	476,504
建設仮勘定		295	10,368
無形固定資産		1,614,084	1,934,700
商標権		5	-
ソフトウェア		1,511,558	1,026,319
ソフトウェア仮勘定		98,483	904,389
電話加入権		3,934	3,931
電信電話専用施設利用権		103	60
投資その他の資産		10,055,336	7,427,316
投資有価証券		3,265,786	1,721,433
関係会社株式		3,306,296	3,229,196
長期差入保証金		1,800,827	1,518,725
前払年金費用		686,322	-
繰延税金資産		893,887	856,537
その他		102,215	101,425
	固定資産計	13,569,764	11,005,844
	資産合計	73,646,227	90,745,010

（単位：千円）

	第32期 （平成29年3月31日現在）	第33期 （平成30年3月31日現在）
（負債の部）		
流動負債		
預り金	1,169,128	1,003,550
未払金	4,745,195	5,081,728

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

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

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

(単位：千円)

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

(3) 【株主資本等変動計算書】

第32期(自平成28年4月1日至平成29年3月31日)

(単位:千円)

	株主資本			
	資本剰余金		利益剰余金	
				その他利益剰余金

	資本金	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	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	評価・換算 差額等合計	
	利益剰余金 合計		有価証券 評価差額金		
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 準備金	利益剰余金			
		資本準備金	その他 資本剰余金	資本剰余金 合計		その他利益剰余金			
						別途 積立金	研究開発 積立金	運用責 任準備 積立金	繰越利益 剰余金

当期首残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	24,580,000	300,000	200,000	6,696,350
当期変動額									
剰余金の配当									3,200,000
当期純利益									15,650,211
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)									
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	-	-	12,450,211
当期末残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	24,580,000	300,000	200,000	19,146,562

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

重要な会計方針

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 子会社株式及び関連会社株式 ：移動平均法による原価法</p> <p>(2) その他有価証券 時価のあるもの：決算日の市場価格等に基づく時価法 （評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定） 時価のないもの：移動平均法による原価法</p>
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
3. 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産 定率法を採用しております。 ただし、平成28年4月1日以降に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。</p> <p>(2) 無形固定資産 定額法を採用しております。 なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法を採用しております。</p>
4. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、期末日の直物等為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。

5. 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金は、従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当事業年度に見合う分を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金は、役員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当事業年度に見合う分を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金は、従業員の退職給付に備えるため、退職一時金制度について、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき計上しております。</p> <p>退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。</p> <p>数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 過去勤務費用については、その発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年または10年）による定額法により按分した額を費用処理しております。</p> <p>数理計算上の差異については、各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年または10年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生翌事業年度から費用処理しております。</p> <p>(4) 時効後支払損引当金は、時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。</p> <p>(5) 本社移転費用引当金は、本社移転に関連して発生する損失に備えるため、発生すると見込まれる額を計上しております。</p>
6. 消費税等の会計処理	消費税及び地方消費税の会計処理は税抜き方式によっております。

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）
<p>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。</p> <p>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。</p>

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）
<p>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。</p> <p>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。</p>

注記事項

（貸借対照表関係）

1. 有形固定資産の減価償却累計額

（千円）

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

(損益計算書関係)

1. 関係会社に対する事項

(千円)

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

2. 固定資産売却益の内訳

(千円)

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

3. 固定資産除却損の内訳

(千円)

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

4. 固定資産売却損の内訳

(千円)

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

5. 本社移転費用の内訳

(千円)

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

(株主資本等変動計算書関係)

第32期（自平成28年4月1日 至平成29年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

決議	株式の 種類	配当の 原資	配当金の総 額（千円）	1株当たり配 当額（円）	基準日	効力発生日
平成29年6月21日 定時株主総会	普通 株式 A種種類 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

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 A種種類 株式	3,200,000	80,000	平成29年3月31日	平成29年6月22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

平成30年6月20日開催予定の定時株主総会において、以下のとおり決議を予定しております。

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

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

営業債務である未払手数料は、1年以内の支払期日であります。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

(4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

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

第32期（平成29年3月31日現在）

	貸借対照表計上額 （千円）	時価 （千円）	差額 （千円）

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

第33期（平成30年3月31日現在）

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

(注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3) 未収委託者報酬及び(4) 未収運用受託報酬

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

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

負 債

(1) 未払手数料

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

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(千円)

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

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

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

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第32期(平成29年3月31日現在)

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

第32期(平成29年3月31日現在)

(千円)

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

(注) 非上場株式(貸借対照表計上額337,468千円)については、市場価格がなく、時価を把握すること

が極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

第33期（平成30年3月31日現在）

（千円）

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

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

3. 当該事業年度中に売却したその他有価証券

第32期（自平成28年4月1日 至平成29年3月31日）

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

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

第33期（自平成29年4月1日 至平成30年3月31日）

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

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

4. 減損処理を行った有価証券

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

第33期において、該当事項はありません。

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

（退職給付関係）

1. 採用している退職給付制度の概要

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

なお、当社は平成29年10月1日付で、確定給付企業年金制度を確定拠出年金制度等に移行するとともに、

退職一時金制度を改定しました。

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(千円)

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

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

(千円)

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

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

(千円)

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

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(千円)

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

(注) 特別損失に計上しております。

(5) 年金資産に関する事項

年金資産の主な内訳

年金資産合計に対する主な分類ごとの比率は、次のとおりであります。

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

長期期待運用収益率の設定方法

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

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎

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

3. 簡便法を適用した確定給付制度

(1) 簡便法を適用した制度の、退職給付引当金の期首残高と期末残高の調整表

(千円)

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

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

	(千円)	
	第32期 (平成29年3月31日現在)	第33期 (平成30年3月31日現在)
積立型制度の退職給付債務	789,261	-
年金資産	1,150,443	-
	361,181	-
非積立型制度の退職給付債務	60,254	-
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	300,927	-
退職給付引当金	60,254	-
前払年金費用	361,181	-
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	300,927	-

(3) 退職給付費用

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

4. 確定拠出制度

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

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

繰延税金負債		
前払年金費用	210,151	-
その他有価証券評価差額金	159,429	281,720
繰延税金負債合計	369,581	281,720
繰延税金資産の純額	1,571,992	1,699,533

2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主要な項目別の内訳

法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため、注記を省略しております。

（企業結合等関係）

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

1. 結合当事企業

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

2. 企業結合日

平成28年10月1日

3. 企業結合の方法

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

4. 結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

5. 企業結合の主な目的

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

6. 合併比率

「3. 企業結合の方法」の吸収合併における合併比率は以下の通りであります。

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

（*）普通株式と種類株式を合算して算定しております。

7. 交付した株式数

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

8. 経済的持分比率（議決権比率）

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

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

9. 取得企業を決定するに至った主な根拠

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

10. 会計処理

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

11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

(1) 財務諸表に含まれる被取得企業の業績の期間

平成29年4月1日から平成30年3月31日まで

(2) 被取得企業の取得原価及びその内訳

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

(3) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

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

(4) 企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

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

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

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

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

12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

(1) 貸借対照表項目

流動資産	- 千円
固定資産	114,270,495千円
資産合計	114,270,495千円

流動負債	- 千円
固定負債	13,059,836千円
負債合計	13,059,836千円
純資産	101,210,659千円

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

（2）損益計算書項目

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

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

（資産除去債務関係）

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

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

（セグメント情報等）

1. セグメント情報

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

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

（1）サービスごとの情報

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

（2）地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

（3）主要な顧客ごとの情報

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

（関連当事者情報）

1. 関連当事者との取引

（1）親会社及び法人主要株主等

第32期（自平成28年4月1日 至平成29年3月31日）

該当はありません。

第33期（自平成29年4月1日 至平成30年3月31日）

該当はありません。

(2) 子会社及び関連会社等

第32期（自平成28年4月1日 至平成29年3月31日）

該当はありません。

第33期（自平成29年4月1日 至平成30年3月31日）

該当はありません。

(3) 兄弟会社等

第32期（自平成28年4月1日 至平成29年3月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は 出資金	事業の 内容又 は職業	議決権 等の所 有(被 所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員 の兼 任等	事業上 の関 係				
親 会 社 の 子 会 社	株式会社 みずほ銀 行	東京都 千代田 区	14,040 億円	銀行業	-	-	当社設定 投資信託 の販売	投資信託の 販売代行手 数料	4,530,351	未払 手数料	767,732
	資産管理 サービス 信託銀行 株式会社	東京都 中央区	500 億円	資産管 理等	-	-	当社信託 財産の運 用	信託元本の 払戻（純 額） 信託報酬の 支払	100,000 7,080	金銭の 信託	12,366,219
	みずほ証 券株式会 社	東京都 千代田 区	1,251 億円	証券業	-	-	当社設定 投資信託 の販売	投資信託の 販売代行手 数料	5,061,766	未払 手数料	1,166,212
	みずほ信 託銀行株 式会社	東京都 中央区	2,473 億円	信託銀 行業	-	-	投資一任 契約の締 結	運用受託報 酬の受取	2,520,431	未収運 用受託 報酬	2,722,066

第33期（自平成29年4月1日 至平成30年3月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は 出資金	事業の 内容又 は職業	議決権 等の所 有(被 所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員 の兼 任等	事業上 の関 係				
親 会 社 の 子 会 社	株式会社 みずほ銀 行	東京都 千代田 区	14,040 億円	銀行業	-	-	当社設定 投資信託 の販売	投資信託の 販売代行手 数料	6,470,802	未払 手数料	894,336
	みずほ証 券株式会 社	東京都 千代田 区	1,251 億円	証券業	-	-	当社設定 投資信託 の販売	投資信託の 販売代行手 数料	9,079,083	未払 手数料	1,549,208

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 投資信託の販売代行手数料は、一般的取引条件を勘案した個別契約により決定しております。

(注2) 信託報酬は、一般的取引条件を勘案した料率が適用されております。

(注3) 運用受託報酬は、一般的取引条件を勘案した個別契約により決定しております。

(注4) 上記の取引金額には消費税等が含まれておりません。期末残高には、消費税等が含まれております。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

株式会社みずほフィナンシャルグループ

(東京証券取引所及びニューヨーク証券取引所に上場)

(2) 重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません。

(1株当たり情報)

	第32期 (自 平成28年4月 1日 至 平成29年3月31日)	第33期 (自 平成29年4月 1日 至 平成30年3月31日)
1株当たり純資産額	1,349,261円64銭	1,667,445円37銭
1株当たり当期純利益金額	201,491円22銭	391,255円29銭

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

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

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

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

(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
ソフトウェア		875,280
ソフトウェア仮勘定		1,787,307
電話加入権		3,931
電信電話専用施設利用権		40
投資その他の資産		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)

	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	評価・換算 差額等合計	
	利益剰余金 合計		有価証券 評価差額金		
当期首残高	44,349,855	65,902,812	795,002	795,002	66,697,815
当中間期変動額					
剰余金の配当	12,520,000	12,520,000			12,520,000
中間純利益	7,224,913	7,224,913			7,224,913
別途積立金の積立	7,100,000	7,100,000			7,100,000
研究開発積立金の取崩	300,000	300,000			300,000
運用責任準備積立金の取崩	200,000	200,000			200,000
繰越利益剰余金の取崩	6,600,000	6,600,000			6,600,000
株主資本以外の項目の当中間期変動額(純額)			496,300	496,300	496,300

当中間期変動額 合計	5,295,086	5,295,086	496,300	496,300	4,798,786
当中間期末残高	39,054,769	60,607,726	1,291,302	1,291,302	61,899,028

重要な会計方針

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 子会社株式及び関連会社株式 ：移動平均法による原価法</p> <p>(2) その他有価証券 時価のあるもの：中間決算日の市場価格等に基づく時価法 （評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定） 時価のないもの：移動平均法による原価法</p>
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
3. 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産 定率法を採用しております。 ただし、平成28年4月1日以降に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。 なお、主な耐用年数は次のとおりであります。</p> <p>建物 … 6～18年 器具備品 … 2～20年</p> <p>(2) 無形固定資産 定額法を採用しております。 なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。</p>
4. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、中間決算日の直物等為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。

5. 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金は、従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当中間会計期間に見合う分を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金は、役員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当中間会計期間に見合う分を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金は、従業員の退職給付に備えるため、退職一時金制度について、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。</p> <p>退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当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。</p> <p>数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 過去勤務費用については、その発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数(5年)による定額法により按分した額を費用処理しております。</p> <p>数理計算上の差異については、各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数(5年または10年)による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌事業年度から費用処理しております。</p> <p>(4) 時効後支払損引当金は、時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。</p>
6. 消費税等の会計処理	消費税及び地方消費税の会計処理は税抜き方式によっております。

表示方法の変更

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

注記事項

(中間貸借対照表関係)

項目	第34期中間会計期間末 (平成30年9月30日現在)	
1. 有形固定資産の減価償却累計額	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)
非上場株式	272,464
関係会社株式	3,229,196

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

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

(有価証券関係)

第34期中間会計期間末
(平成30年9月30日現在)

1. 子会社株式

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

2. その他有価証券

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

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

（企業結合等関係）

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

1. 結合当事企業

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

2. 企業結合日

平成28年10月1日

3. 企業結合の方法

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

4. 結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

5. 企業結合の主な目的

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

躍を目指してまいります。

6. 合併比率

「3. 企業結合の方法」の吸収合併における合併比率は以下の通りであります。

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

(*) 普通株式と種類株式を合算して算定しております。

7. 交付した株式数

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

8. 経済的持分比率（議決権比率）

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

MHFGが企業結合日に追加取得した当社に対する経済的持分比率 20.00%

MHFGの追加取得後の当社に対する経済的持分比率 70.00%

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

9. 取得企業を決定するに至った主な根拠

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

10. 会計処理

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

11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

(1) 中間財務諸表に含まれる被取得企業の業績の期間

平成30年4月1日から平成30年9月30日まで

(2) 被取得企業の取得原価及びその内訳

取得の対価 MHAMの普通株式 144,212,500千円

取得原価 144,212,500千円

(3) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

a. 発生したのれん金額 76,224,837千円

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

c. のれんの償却方法及び償却期間 20年間の均等償却

(4) 企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

a. 資産の額 資産合計 40,451,657千円

うち現金・預金 11,605,537千円

うち金銭の信託 11,792,364千円

b. 負債の額 負債合計 9,256,209千円

うち未払手数料及び未払費用 4,539,592千円

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

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

加重平均償却期間

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

12.被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

(1)貸借対照表項目

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

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

(2)損益計算書項目

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

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

(資産除去債務関係)

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

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

(セグメント情報等)

第34期中間会計期間(自平成30年4月1日 至平成30年9月30日)

1.セグメント情報

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2.関連情報

(1)サービスごとの情報

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

(2)地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

(1株当たり情報)

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

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

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

資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

5【その他】

(1) 定款の変更、事業譲渡又は事業譲受、出資の状況その他の重要事項

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

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

(2) 訴訟事件その他の重要事項

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

	名称	資本金の額 (百万円)	事業の内容	
(1) 受託会社	みずほ信託銀行株式会社	247,369	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律（兼営法）に基づき信託業務を行っています。	
(2) 販売会社	株式会社SBI証券	48,323	「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います。	
	高木証券株式会社	11,069		
	楽天証券株式会社	7,495		
	株式会社大垣共立銀行	46,773		
	株式会社西京銀行	23,497		
	株式会社七十七銀行	24,658		
	株式会社島根銀行	6,636		
	株式会社名古屋銀行	25,090		
	株式会社広島銀行	54,573		
	株式会社北都銀行	12,500		
	株式会社北陸銀行	140,409		
	株式会社三重銀行	15,295		
	第一勧業信用組合	11,699		協同組合による金融事業に関する法律に基づき金融事業を営んでいます。
	みずほ信託銀行株式会社	247,369		銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律（兼営法）に基づき信託業務を行っています。

(注) 資本金の額 2018年3月末日現在

第一勧業信用組合の資本金の額の欄には出資の額を記載しております。

2【関係業務の概要】

(1) 受託会社

当ファンドの受託会社として、信託財産を保管・管理し、受益権設定にかかる振替機関への通知等を行います。

(2) 販売会社

当ファンドの販売会社として、受益権の募集の取扱い、販売、一部解約の実行の請求の受付けならびに収益分配金、償還金および一部解約金の支払い等を行います。

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。）

<参考：再信託受託会社の概要>

名称：資産管理サービス信託銀行株式会社

業務の概要：銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

再信託の目的：原信託契約にかかる信託業務の一部（信託財産の管理）を原信託受託会社から再信託受託会社（資産管理サービス信託銀行株式会社）へ委託するため、原信託財産の全てを再信託受託会社へ移管することを目的とします。

第3【その他】

(1)目論見書の表紙等にロゴ・マーク、図案を使用し、ファンドの基本的性格を記載する場合があります。また、以下の内容を記載することがあります。

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

(2)有価証券届出書第一部「証券情報」、第二部「ファンド情報」に記載の内容について、投資家の理解を助けるため、その内容を説明した図表等を付加して目論見書のその内容に関する箇所に記載することがあります。

す。また、第二部「ファンド情報」第1「ファンドの状況」5「運用状況」について、有価証券届出書提出後の随時入手可能な直近の情報および同情報についての表での表示に加えて、グラフで表示した情報を目論見書に記載することがあります。

- (3)投資信託説明書(請求目論見書)に約款の全文を掲載します。
- (4)目論見書は電子媒体等として使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。
- (5)目論見書は目論見書の別称として「投資信託説明書」と称して使用することがあります。
- (6)投信評価機関、投信評価会社などによる評価を取得・使用することがあります。

独立監査人の監査報告書

平成30年5月30日

アセットマネジメントOne株式会社
取締役会 御中

新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 湯原 尚 印

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 山野 浩 印

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

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

利害関係

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

以上

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

（注2）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6月22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

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、「ファンドの経理状況」に掲げられているコア資産形成ファンドの平成29年5月9日から平成30年5月8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、コア資産形成ファンドの平成30年5月8日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

2.XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

平成30年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	公認会計士	湯原	尚 印
業務執行社員			
指定有限責任社員	公認会計士	山野	浩 印
業務執行社員			

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「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。

独立監査人の中間監査報告書

平成30年12月21日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員

公認会計士 山野 浩 印

業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているコア資産形成ファンドの平成30年5月9日から平成30年11月8日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な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、コア資産形成ファンドの平成30年11月8日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成30年5月9日から平成30年11月8日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

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、当社が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。

2.XBRLデータは監査の対象には含まれていません。