

**【表紙】**

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	平成30年10月11日
【発行者名】	アセットマネジメントOne株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 菅野 暁
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目8番2号
【事務連絡者氏名】	三木谷 正直
【電話番号】	03-6774-5100
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	リスク抑制世界8資産バランスファンド
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】	2兆円を上限とします。
【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】

リスク抑制世界8資産バランスファンド

ただし、愛称として「しあわせの一步」という名称を用いる場合があります。

(以下「ファンド」または「当ファンド」といいます。)

### (2)【内国投資信託受益証券の形態等】

契約型の追加型証券投資信託の受益権(以下「受益権」といいます。)

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

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

### (3)【発行(売出)価額の総額】

2兆円を上限とします。

### (4)【発行(売出)価格】

お申込日の翌営業日の基準価額とします。

ただし、収益分配金を再投資する場合は、各計算期間終了日の基準価額とします。

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

#### <基準価額の照会方法等>

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

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

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

### (5)【申込手数料】

お申込日の翌営業日の基準価額に、1.08%(税抜1.00%)を上限に各販売会社が定める手数料率を乗じて得た額とします。

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

収益分配金を再投資する場合は、お申込手数料はかかりません。

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

#### （ 6 ）【申込単位】

各販売会社が定める単位とします。

収益分配金を再投資する場合は、1口単位となります。

お申込単位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】

継続申込期間：平成30年10月12日から平成31年4月11日まで

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

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

#### （ 8 ）【申込取扱場所】

当ファンドのお申込みにかかる取扱い等は販売会社が行います。

販売会社は、以下の方法でご確認ください。

・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

#### （ 9 ）【払込期日】

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

#### （ 1 0 ）【払込取扱場所】

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

払込取扱場所についてご不明な点は、以下の方法でご確認ください。

・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

#### （ 1 1 ）【振替機関に関する事項】

振替機関は以下の通りです。

・株式会社証券保管振替機構

(12)【その他】

お申込みの際は、販売会社所定の方法でお申込みください。

申込形態について詳しくは販売会社にお問い合わせください。

収益分配金を再投資する場合、取得申込者は販売会社との間で「自動けいぞく投資約款」にしたがって分配金再投資に関する契約を締結します。

なお、販売会社によっては、当該契約または規定について同様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約または規定を使用することがあり、この場合、当該別の名称に読み替えるものとします。

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

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

ただし、海外休業日にはお申込みの受付を行いません。

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

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

### 振替受益権について

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

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

#### （参考）

##### 投資信託振替制度

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

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### （1）【ファンドの目的及び基本的性格】

当ファンドは、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行います。

当ファンドの信託金限度額は、2兆円とします。ただし、委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

#### <ファンドの特色>



国内外の8資産に分散投資を行い、中長期的に安定的なリターンの獲得をめざします。

- 主に国内外の公社債、株式および不動産投資信託証券(リート)の8資産にマザーファンド<sup>※1</sup>を通じて実質的に投資します<sup>※2※3</sup>。
- 基本配分戦略に基づき、資産価格に影響を与える「変動要因」の偏りをなくすように、月次で投資対象資産の基本配分比率および通貨配分比率を決定します。
- 実質組入外貨建資産は投資環境に応じて弾力的に対円での為替ヘッジ<sup>※4</sup>を行い、一部または全部の為替リスクの軽減を図ります。

※1 国内債券バッシブ・ファンド・マザーファンド、国内株式バッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド、為替フルヘッジ外国債券バッシブ・ファンド・マザーファンド、外国株式バッシブ・ファンド・マザーファンド、J-REITインデックスファンド・マザーファンド、外国リート・バッシブ・ファンド・マザーファンド、エマージング債券バッシブ・マザーファンド、エマージング株式バッシブ・マザーファンド。

※2 一部のマザーファンドへの投資配分比率がゼロとなる場合があります。

※3 有価証券指数等先物取引等、指数に連動する投資成果をめざす上場している投資信託証券(ETF)へ直接投資する場合もあります。

※4 一部の実質組入外貨建資産の通貨については、委託会社はその通貨との相関が高いと判断する通貨を用いて、円に対する為替ヘッジを行う「代替ヘッジ」を行うことがあります。為替ヘッジにより、実質組入外貨建資産の為替リスクの軽減を図ります。



基準価額の変動リスク<sup>※1</sup>を年率2%程度<sup>※2</sup>に抑えながら、市場下落局面でも負けにくい安定的な運用をめざします。

- 基本配分戦略による「変動要因」の徹底した分散に加えて、機動的配分戦略により相場環境の日々の変化をいち早く察知し、組入資産の下落の危険性が高まったと判定した場合は、組入資産を安定資産<sup>※3</sup>や現金等<sup>※4</sup>へ入れ替えることで基準価額の下落の抑制をめざします。

※1 基準価額の変動の大きさを表し、この値が小さいほど、基準価額の変動が小さいことを意味します。

※2 上記数値は目標値であり、常にリスク水準が一定であること、あるいは目標値が達成されることのいずれかを約束するものではありません。また、上記数値は当ファンドの長期的なリスク水準の目標を表すものであり、当ファンドが年率2%程度の収益を目標とすることを意味するものではありません。上記数値が達成されるかどうかを問わず、実際の運用成績がマイナスとなる可能性があります。

※3 当ファンドでは、投資対象資産のうち国内債券、為替ヘッジ先進国債券を「安定資産」、それ以外の資産を「リスク性資産」とします。

※4 現金等とは、短期国債、コール・ローンなどの短期金融資産等をいい、当該資産への投資は、「DIAMマネーマザーファンド」を通じてまたは直接投資を行います。



年6回の決算時(毎年1月、3月、5月、7月、9月および11月の各11日(休業日の場合は翌営業日))に、利子・配当金などを基礎として、安定的な分配を行うことをめざします。なお、基準価額の水準により、値上がり益からも分配することがあります。

※将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

※分配金額は、分配方針に基づいて委託会社が決定します。あらかじめ一定の額の分配をお約束するものではありません。分配金が支払われない場合もあります。



## 収益分配金に関する留意事項

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。なお、分配金の有無や金額は確定したものではありません。

投資信託から分配金が  
支払われるイメージ



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。

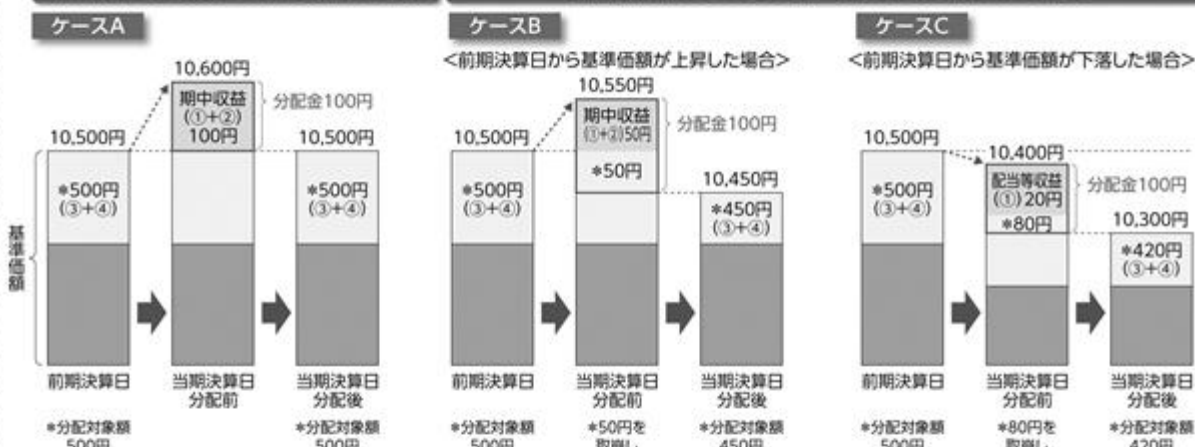
### 分配金額と基準価額の関係（イメージ）

分配金は、分配方針に基づき、以下の分配対象額から支払われます。

①配当等収益（経費控除後）、②有価証券売買益・評価益（経費控除後）、③分配準備積立金、④収益調整金

計算期間中に発生した収益の中から支払われる場合

計算期間中に発生した収益を超えて支払われる場合



上図のそれぞれのケースにおいて、前期決算日から当期決算日まで保有した場合の損益を見ると、次の通りとなります。

ケースA: 分配金受取額100円+当期決算日と前期決算日との基準価額の差0円=100円

ケースB: 分配金受取額100円+当期決算日と前期決算日との基準価額の差▲50円=50円

ケースC: 分配金受取額100円+当期決算日と前期決算日との基準価額の差▲200円=▲100円

★A、B、Cのケースにおいては、分配金受取額はすべて同額ですが、基準価額の増減により、投資信託の損益状況はそれぞれ異なった結果となっています。このように、投資信託の収益については、分配金だけに注目するのではなく、「分配金の受取額」と「投資信託の基準価額の増減額」の合計額でご判断ください。

※上記はイメージであり、実際の分配金額や基準価額を示唆するものではないのでご注意ください。

投資者（受益者）のファンドの購入価額によっては、分配金の一部ないし全部が、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。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりりが小さかった場合も同様です。

分配金の一部が元本の一部払戻しに相当する場合



普通分配金

元本払戻金(特別分配金) : 個別元本(投資者(受益者)のファンドの購入価額)を上回る部分からの分配金です。

: 個別元本を下回る部分からの分配金です。分配後の投資者(受益者)の個別元本は、元本払戻金(特別分配金)の額だけ減少します。

分配金の全部が元本の一部払戻しに相当する場合



## 運用プロセス

■基本配分戦略に基づき、各資産への投資比率(0%~100%)を決定します。

- ・基本配分戦略では、統計的手法を用い、ファンドに含まれる複数のリスク要因を抽出した上で、これらの各リスク要因からファンドが受ける影響が均等になるように資産配分比率、および通貨配分比率を決定します。
- ・基本配分戦略は月次で行います。

■機動的配分戦略に基づき、急な投資環境の変化に対応することをめざします。

- ・機動的配分戦略では、市場リスクの高まりに対し、リスクが比較的低い資産の組入比率を増やす等、機動的に各資産への投資比率(0%~100%)を変更します。
- ・機動的配分戦略は日次で行います。

## 基本配分戦略

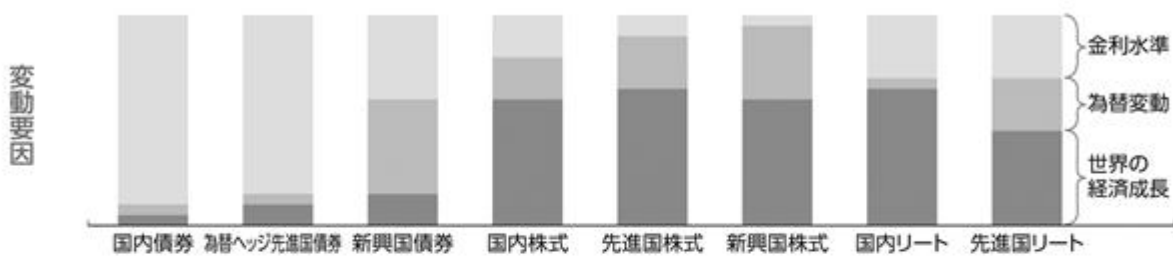
(月次戦略)

資産価格は様々な要因により変動し、またその要因も刻々と変化していきます。

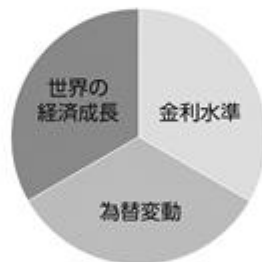
当ファンドは、資産価格に影響を与える「変動要因」に着目し、この比率を均等に配分することで、各時点においてもっとも分散効果が期待できる資産配分比率を決定します。

### 基本配分比率決定のイメージ

各資産における変動要因と要因の比率(例)

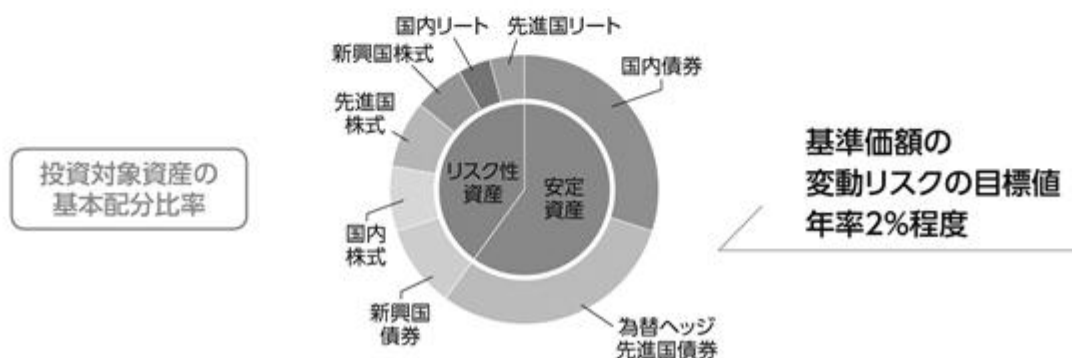


変動要因の比率を均等に配分



着目する変動要因は各時点において適宜変更します。

変動要因の分散から最適と判断される資産配分の比率を決定



※上記はイメージであり、実際にはこれと異なる場合があります。また、変動要因の全てを網羅したものではありません。



## 機動的配分戦略

市場環境に応じて、組入資産を安定資産や現金等\*に入れ替えます。

(日次戦略)

リスク性資産が大きく下落する市場環境の場合、リスク性資産を売却し、最大ですべてのリスク性資産を安定資産に入れ替えます。金利が急激に上昇して、安定資産が大きく下落する市場環境の場合、最大で基本配分比率の安定資産の半分を売却し現金等に入れ替えます。

\*現金等とは、短期国債、コール・ローンなどの短期金融資産等をいい、当該資産への投資は、「DIAMマネーマザーファンド」を通じて、または直接投資を行います。

※基準価額の下落を完全に抑制できるものではありません。

## 配分方針

年6回の決算時(毎年1月、3月、5月、7月、9月および11月の各11日(休業日の場合は翌営業日))に、経費控除後の配当等収益および売買益(評価益を含みます。)等の全額を対象として、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して、配分金額を決定します。

※将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

※分配金額は、配分方針に基づいて委託会社が決定します。あらかじめ一定の額の分配をお約束するものではありません。分配金が支払われない場合もあります。

商品分類表

単位型投信 追加型投信	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)
単位型投信	国内	株式 債券
追加型投信	海外	不動産投信
	内外	その他資産 ( ) 資産複合

(注) 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

追加型投信	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいいます。
内外	目論見書または投資信託約款において、国内及び海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。
資産複合	目論見書または投資信託約款において、株式、債券、不動産投信およびその他資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。

## 属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ
株式 一般 大型株 中小型株	年1回  年2回	グローバル (日本を含む)  日本		
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ( )	年4回  年6回 (隔月)  年12回 (毎月)	北米  欧州  アジア	ファミリー ファンド	あり (一部ヘッジ)
不動産投信  その他資産 (投資信託証券(資 産複合(債券、株 式、不動産投信)資 産配分変更型))  資産複合 ( ) 資産配分固定型 資産配分変更型	日々  その他 ( )	中南海  アフリカ  中近東 (中東)  エマージング	ファンド・オ ブ・ファンズ	なし

属性区分に記載している「為替ヘッジ」は、対円での為替リスクに対するヘッジの有無を記載しております。

(注) 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

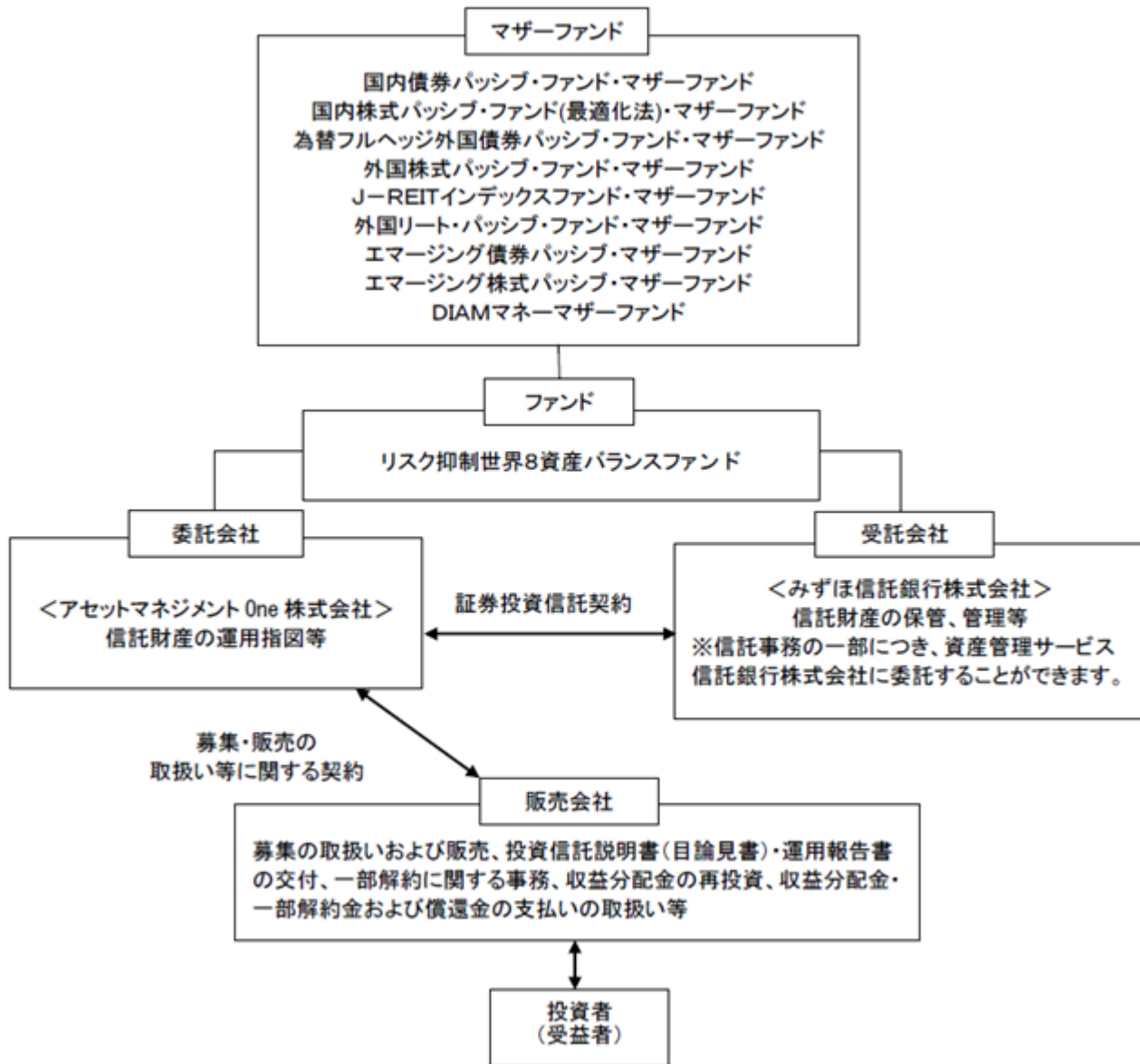
その他資産（投資信託証券（資産複合（債券、株式、不動産投信）資産配分変更型））	目論見書または投資信託約款において、投資信託証券への投資を通じて、主として複数の資産（債券、株式、不動産投信）を実質的な投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行う旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないものをいいます。 (注)商品分類表の投資対象資産は資産複合に分類され、属性区分表の投資対象資産はその他資産（投資信託証券（資産複合（債券、株式、不動産投信）資産配分変更型））に分類されます。
年6回（隔月）	目論見書または投資信託約款において、年6回（隔月）決算する旨の記載があるものをいいます。
グローバル（日本を含む）	目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本を含む世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
ファミリーファンド	目論見書または投資信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。）を投資対象として投資するものをいいます。
為替ヘッジあり	目論見書または投資信託約款において、対円での為替のフルヘッジ又は一部の資産に対円での為替のヘッジを行う旨の記載があるものをいいます。

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

## （２）【ファンドの沿革】

平成28年10月24日 信託契約締結、ファンドの設定、ファンドの運用開始

## (3) 【ファンドの仕組み】



## ・「証券投資信託契約」の概要

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

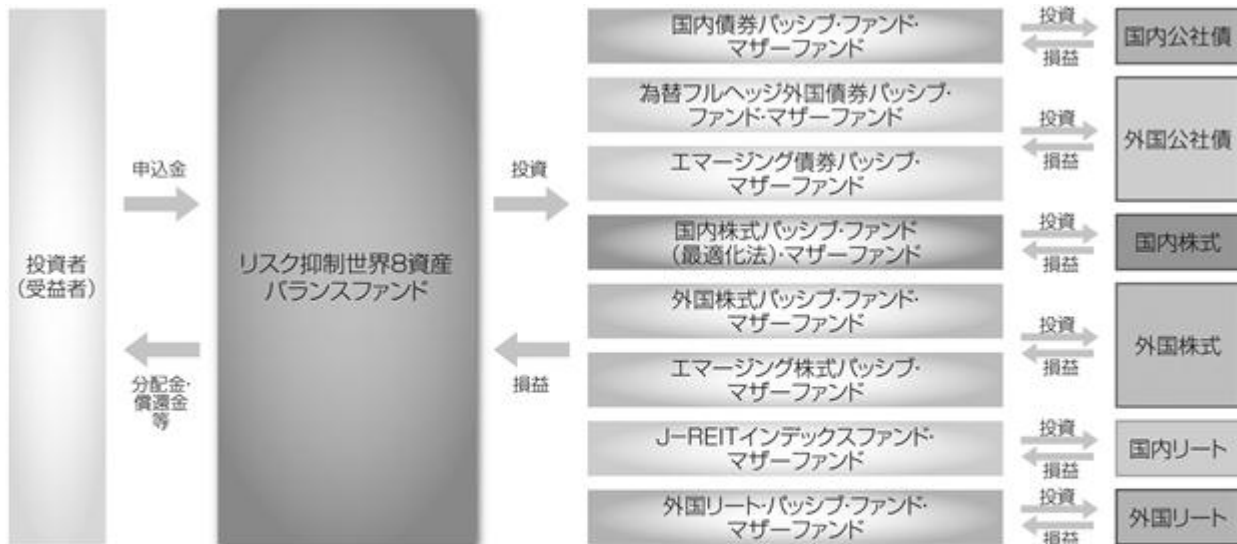
## ・「募集・販売の取扱い等に関する契約」の概要

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

## ファミリーファンド方式とは

当ファンドは「ファミリーファンド方式」により運用を行います。

「ファミリーファンド方式」とは、複数のファンドを合同運用する仕組みで、投資者からの資金をまとめてベビーファンド（当ファンド）とし、その資金の全部または一部をマザーファンド受益証券に投資して、その実質的な運用をマザーファンドにて行う仕組みです。



※当ファンドは、有価証券指数等先物取引等、指数に連動する投資成果をめざす上場している投資信託証券(ETF)に投資する場合があります。

また、現金等(短期国債およびコール・ローンなどの短期金融資産等)への投資は、「DIAMマネーマザーファンド」を通じてまたは直接投資を行います。

## 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（平成30年7月31日現在）

## 委託会社の沿革

昭和60年7月1日	会社設立
平成10年3月31日	「証券投資信託法」に基づく証券投資信託の委託会社の免許取得
平成10年12月1日	証券投資信託法の改正に伴う証券投資信託委託業のみなし認可
平成11年10月1日	第一ライフ投信投資顧問株式会社を存続会社として興銀エヌダブリュ・アセットマネジメント株式会社および日本興業投信株式会社と合併し、社名を興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社とする。
平成20年1月1日	「興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社」から「DIAMアセットマネジメント株式会社」に商号変更
平成28年10月1日	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

（平成30年7月31日現在）

株主名	住所	所有株数	所有比率
株式会社みずほフィナンシャルグループ	東京都千代田区大手町一丁目5番5号	28,000株 <sup>1</sup>	70.0% <sup>2</sup>
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% <sup>2</sup>

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】

## &lt;基本方針&gt;

この投資信託は、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行います。

## &lt;投資対象&gt;

「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」受益証券、「為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「J-REITインデックスファンド・マザーファンド」受益証券、「外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「エマージング債券パッシブ・マザーファンド」受益証券、「エマージング株式パッシブ・マザーファンド」受益証券を主要投資対象とします。なお、有価証券指数等先物取引等、指数に連動する投資成果をめざす上場している投資信託証券（ETF）、「DIAMマネーマザーファンド」受益証券や短期金融資産等に投資する場合があります。

## &lt;投資態度&gt;

国内外の8資産に分散投資を行い、中長期的に安定的なリターンの獲得をめざします。

- ・主に国内外の公社債、株式および不動産投資信託証券（リート）に、以下のマザーファンドを通じて実質的に投資します。

- 1)国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
- 2)国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド
- 3)為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
- 4)外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
- 5)J-REITインデックスファンド・マザーファンド
- 6)外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド
- 7)エマージング債券パッシブ・マザーファンド
- 8)エマージング株式パッシブ・マザーファンド

一部のマザーファンドへの投資配分比率がゼロとなる場合があります。

（上記1)から8)に掲げるマザーファンドおよびDIAMマネーマザーファンドを以下「各マザーファンド」、または総称して「マザーファンド」ということがあります。）

- ・基本配分戦略に基づき、統計的手法を用いて、資産価格に影響を与える「変動要因」の偏りをなくすように、月次で投資対象資産の基本配分比率および通貨配分比率を決定します。
- ・実質組入外貨建資産は投資環境に応じて弾力的に対円での為替ヘッジを行い、一部または全部の為替リスクの軽減を図ります。  
一部の実質組入外貨建資産の通貨については、委託会社はその通貨との相関が高いと判断される通貨を用いて、円に対する為替ヘッジを行う「代替ヘッジ」を行うことがあります。為替ヘッジにより、実質組入外貨建資産の為替リスクの軽減を図ります。
- ・上記のほか、有価証券指数等先物取引等、指数に連動する投資成果をめざす上場している投資信託証券(ETF)へ直接投資する場合があります。

基準価額の変動リスクを年率2%程度<sup>1</sup>に抑えながら、市場下落局面でも安定的な運用をめざします。

- ・基本配分戦略による「変動要因」の分散に加えて、機動的配分戦略に基づき相場環境の変化を日々判定し、組入資産を安定資産<sup>2</sup>や現金等<sup>3</sup>へ入れ替えることで基準価額の下落の抑制をめざします。

1 上記数値は目標値であり、常にリスク水準が一定であること、あるいは目標値が達成されることのいずれを約束するものではありません。また、上記数値は当ファンドの長期的なリスク水準の目標を表すものであり、当ファンドが年率2%程度の収益を目標とすることを意味するものではありません。上記数値が達成されるかどうかを問わず、実際の運用成績がマイナスとなる可能性があります。

2 当ファンドでは、投資対象資産のうち国内債券、為替ヘッジ先進国債券を「安定資産」、それ以外の資産を「リスク性資産」とします。

3 現金等とは、短期国債、コール・ローンなどの短期金融資産等をいい、当該資産への投資は、「DIAMマネーマザーファンド」を通じてまたは直接投資を行います。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

## (2)【投資対象】

投資の対象とする資産の種類(約款第16条)

この信託において投資の対象とする資産の種類は次に掲げるものとします。

1.次に掲げる特定資産(「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項に定めるものをいいます。以下同じ。)

イ.有価証券

ロ.デリバティブ取引にかかる権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第22条、第23条および第24条に定めるものに限りません。)

ハ.金銭債権

ニ.約束手形

2.次に掲げる特定資産以外の資産

イ.為替手形

運用の指図範囲等(約款第17条第1項)

委託会社は、信託金を、アセットマネジメントOne株式会社を委託会社とし、みずほ信託銀行株式会社を受託会社として締結された証券投資信託である国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド、国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド、為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド、外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド、J-REITインデックスファンド・マザーファンド、外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド、エマージング債券パッシブ・マザーファンド、エマージング株式パッシブ・マザーファンド、DIAMマネーマザーファンド各受益証券のほか次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することを指図します。

1. 株券または新株引受権証券
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券(新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。))の新株引受権証券を除きます。なお、社債券のうちで、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。)
6. 資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
7. 投資法人債券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいい、振替投資法人債を含みます。)
8. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券(金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。)
9. 協同組織金融機関の優先出資に関する法律に規定する優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。)
10. 資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券(金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。)
11. コマーシャル・ペーパー
12. 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。)、新株予約権証券および新投資口予約権証券
13. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、1.~12.の証券または証書の性質を有するもの
14. 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいい、振替受益権を含みます。)
15. 投資証券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
16. 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
17. オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限ります。)
18. 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
19. 外国法人が発行する譲渡性預金証書



20. 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)

21. 抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)

22. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの

23. 外国の者に対する権利で22.の有価証券の性質を有するもの

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

運用の指図範囲等(約款第17条第2項)

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

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

(参考)当ファンドが投資対象とするマザーファンドの概要

ファンド名	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、NOMURA - B P I 総合に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主な投資対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	<p>1.主としてわが国の公社債に投資し、「NOMURA - B P I 総合」に連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>2.公社債(債券先物取引等を含みます。)の組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</p> <p>3.公社債の組入比率の調整には、債券先物取引等を活用する場合があります。</p> <div style="border: 1px solid black; padding: 5px;"> <p>NOMURA - B P I 総合の知的財産権その他一切の権利は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。</p> </div>

## 運用プロセス

## 1.流動性基準等による対象銘柄群設定

NOMURA - B P I 総合構成銘柄のうち、流動性基準等を勘案して投資対象銘柄群を設定します。

## 2.最適化法によるポートフォリオの構築

1) 債券種別・格付けから発生するベンチマーク乖離要因

2) 金利の期間構造、スプレッドの期間構造から発生するベンチマーク乖離要因

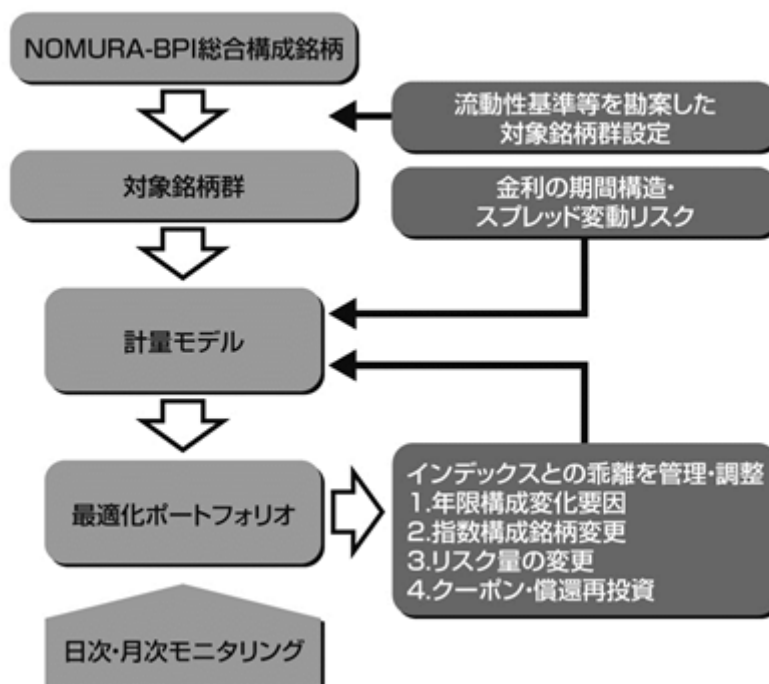
1)、2)が最小になると判断されるポートフォリオを構築します。

## 3.インデックスとの乖離を管理

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

インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。

- ・ 年限構成変化要因    ・ 指数構成銘柄変更
- ・ リスク量の変更    ・ クーポン、償還再投資



主な投資制限	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. 株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限りします。</li> <li>2. 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</li> <li>3. 同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</li> <li>4. 同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの(以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。)への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</li> <li>5. 外貨建資産への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</li> <li>6. デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます。)は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</li> <li>7. 外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。</li> <li>8. 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</li> </ol>
--------	--

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

## 投資態度

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

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

株東京証券取引所は、東証株価指数(TOPIX)の指数値の算出もしくは公表の方法の変更、東証株価指数(TOPIX)の指数値の算出もしくは公表の停止またはTOPIXの商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。

株東京証券取引所は、東証株価指数(TOPIX)の指数値およびTOPIXの商標の使用に関して得られる結果ならびに特定日の東証株価指数(TOPIX)の指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。

株東京証券取引所は、東証株価指数(TOPIX)の指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、株東京証券取引所は、東証株価指数(TOPIX)の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。

当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドは、株東京証券取引所により提供、保証または販売されるものではありません。

株東京証券取引所は、当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドの購入者または公衆に対し、当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を持ちません。

株東京証券取引所は、委託会社または当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドの購入者のニーズを、東証株価指数(TOPIX)の指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。

以上の項目に限らず、株東京証券取引所は当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドの発行または売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を負いません。

## 運用プロセス

## 1.流動性基準による対象銘柄群設定

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

## 2.最適化法によるポートフォリオの構築

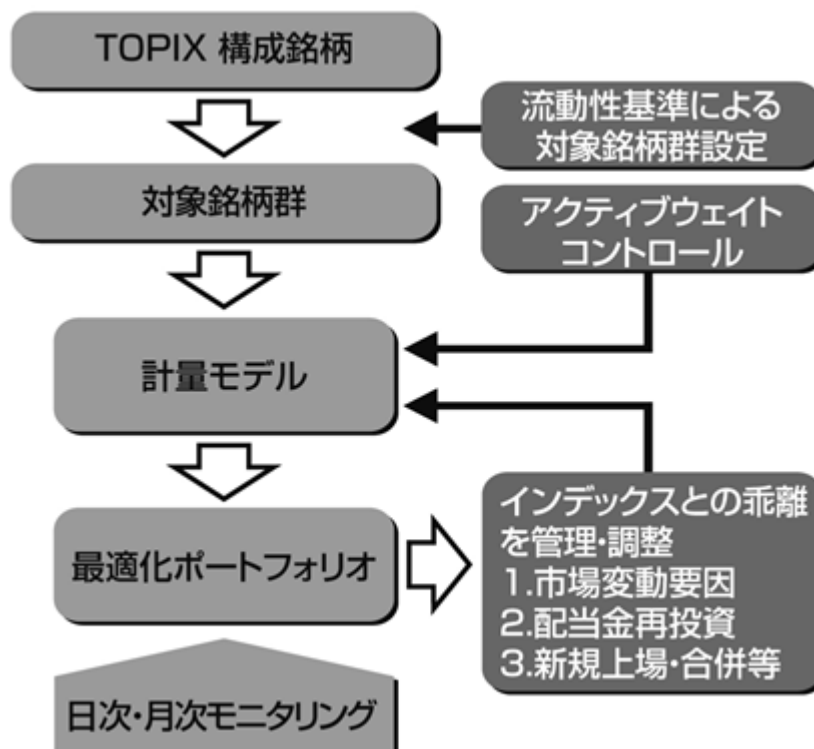
インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差（アクティブウェイト）を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。

## 3.インデックスとの乖離を管理

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

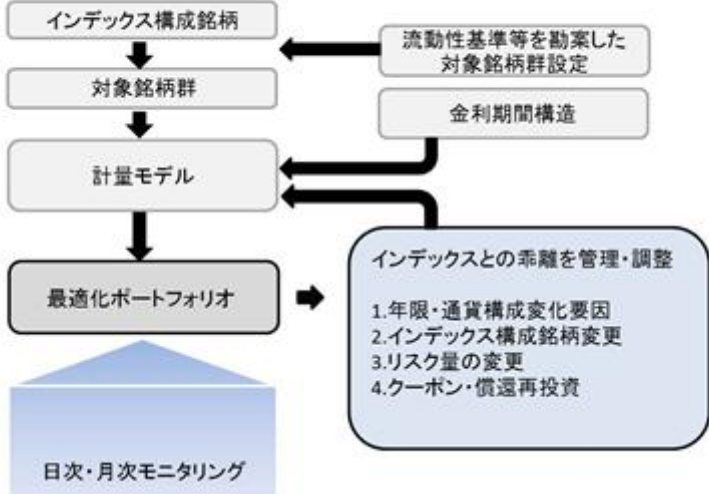
インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。

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



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

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

運用プロセス	<p>流動性基準等を勘案した投資対象銘柄群を設定し、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。</p>  <pre> graph TD     A[インデックス構成銘柄] --&gt; B[対象銘柄群]     B --&gt; C[計量モデル]     C --&gt; D[最適化ポートフォリオ]     D --&gt; E[日次・月次モニタリング]          F[流動性基準等を勘案した対象銘柄群設定] --&gt; B     G[金利期間構造] --&gt; C          H[インデックスとの乖離を管理・調整]     I[1.年限・通貨構成変化要因] --&gt; H     J[2.インデックス構成銘柄変更] --&gt; H     K[3.リスク量の変更] --&gt; H     L[4.クーポン・償還再投資] --&gt; H          D --&gt; H   </pre>
主な投資制限	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. 株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限ります。</li> <li>2. 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</li> <li>3. 同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</li> <li>4. 同一銘柄の転換社債等への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</li> <li>5. 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</li> <li>6. デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</li> <li>7. 外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。</li> <li>8. 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</li> </ol>

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

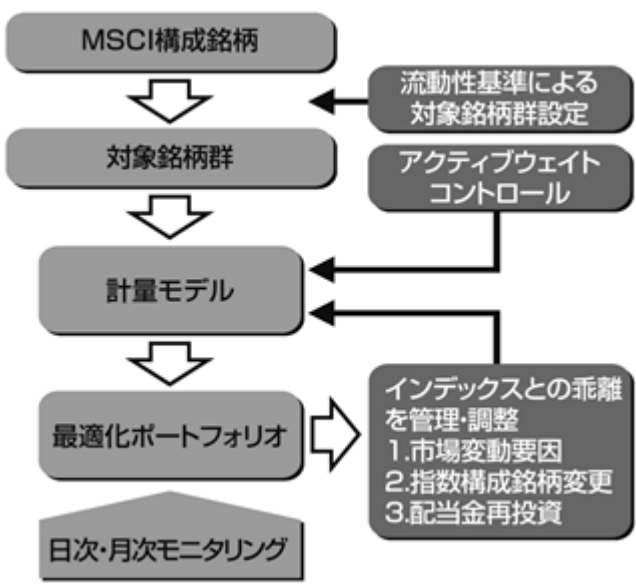
投資態度	<ol style="list-style-type: none"><li>1.主に海外の株式に投資を行い、MSCIコクサイ・インデックス(円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)に連動する投資成果をめざして運用を行います。</li><li>2.株式への投資は原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</li><li>3.組入外貨建資産については原則為替ヘッジは行いませんが、金利・為替状況によってはヘッジを実施する可能性があります。</li></ol>
------	--



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、

	<p>事前にMSCIの書面による承認を得ることなくMSCIとの関係を主張することはできません。</p>
<p>運用プロセス</p>	<p>1.流動性基準による対象銘柄群設定        取引コスト、マーケットインパクトの低減を図る為、MSCIコクサイ・インデックス構成銘柄のうち、流動性が著しく低くかつ時価総額比率が小さい銘柄を除外して投資銘柄群を設定します。</p> <p>2.最適化法によるポートフォリオの構築        インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差(アクティブウェイト)を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。</p> <p>3.インデックスとの乖離を管理        日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理して、必要な場合は速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。        インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>・市場変動に伴うもの：推定トラッキングエラーの増加に伴い実施</li> <li>・ベンチマーク構成銘柄の変更に伴うもの：四半期に一度の銘柄入替、コーポレートアクションおよび指数構築手法の変更に伴い実施</li> <li>・配当金再投資に伴うもの：キャッシュ比率の上昇に伴い実施</li> </ul>  <pre>       graph TD         A[MSCI構成銘柄] --&gt; B[対象銘柄群]         C[流動性基準による対象銘柄群設定] --&gt; B         B --&gt; D[計量モデル]         E[アクティブウェイトコントロール] --&gt; D         D --&gt; F[最適化ポートフォリオ]         G[インデックスとの乖離を管理・調整 1.市場変動要因 2.指数構成銘柄変更 3.配当金再投資] --&gt; F         F --&gt; H[日次・月次モニタリング]       </pre>

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

<p>ファンド名</p>	<p>J - R E I T インデックスファンド・マザーファンド</p>
<p>基本方針</p>	<p>この投資信託は、東証 R E I T 指数（配当込み）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。</p>
<p>主な投資対象</p>	<p>東京証券取引所に上場し、東証 R E I T 指数に採用されている（または採用予定の）不動産投資信託証券（一般社団法人投資信託協会規則に定める不動産投信等をいいます。以下同じ。）を主要投資対象とします。</p>

## 投資態度

1. 東京証券取引所に上場し、東証REIT指数に採用されている(または採用予定の)不動産投資信託証券を主要投資対象とし、東証REIT指数(配当込み)の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。
2. 不動産投資信託証券への投資は、原則として高位を維持することをめざします。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。
3. 但し、ファンドの資金動向、市況動向等に急激な変化が生じたとき、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときならびに東証REIT指数(配当込み)が改廃されたとき等、やむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。

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

株東京証券取引所は、東証REIT指数の指数値の算出もしくは公表の方法の変更、東証REIT指数の指数値の算出もしくは公表の停止または東証REIT指数の商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。

株東京証券取引所は、東証REIT指数の指数値および東証REIT指数の商標の使用に関して得られる結果ならびに特定日の東証REIT指数の指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。

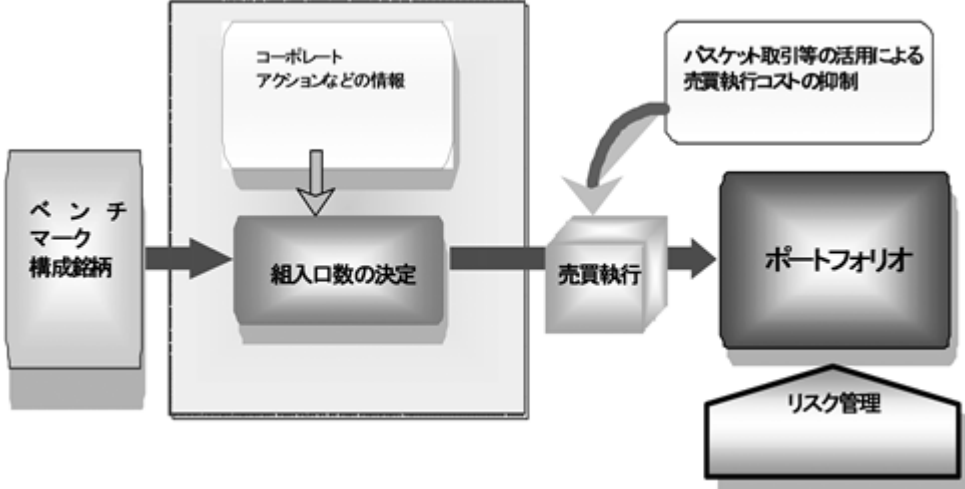
株東京証券取引所は、東証REIT指数の指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、株東京証券取引所は、東証REIT指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。

当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドは、株東京証券取引所により提供、保証または販売されるものではありません。

株東京証券取引所は、当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドの購入者または公衆に対し、当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を持ちません。

株東京証券取引所は、委託会社または当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドの購入者のニーズを、東証REIT指数の指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。

以上の項目に限らず、株東京証券取引所は当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドの発行または売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を負いません。

<p>運用プロセス</p>	<ul style="list-style-type: none"> <li>・原則としてベンチマーク構成全銘柄をその構成比率で保有します。ベンチマーク構成銘柄および採用予定銘柄を投資対象銘柄とします。</li> <li>・新規上場、公募増資、第三者割当等ベンチマーク構成の変更情報を事前を取得し、最適な執行方法によりリバランスを実施します。</li> <li>・配当金入金等によりキャッシュ比率が上昇した場合にもリバランスを実施します。</li> </ul> 
---------------	---

<p>主な投資制限</p>	<p>投資信託証券への投資割合には制限を設けません。</p> <p>同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として信託財産の純資産総額の30%を超えないものとします。ただし、東証REIT指数採用の不動産投資信託証券の上場時価総額の合計額に占める同一銘柄の不動産投資信託証券の時価総額の割合が30%を超えている場合、当該同一銘柄の不動産投資信託証券への投資割合は、原則として当該同一銘柄の不動産投資信託証券の時価総額が東証REIT指数採用の不動産投資信託証券の上場時価総額の合計額に占める割合の範囲で投資することができるものとします。</p> <p>株式への投資は行いません。</p> <p>外貨建資産への投資は行いません。</p> <p>デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動および金利変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>
---------------	--

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

主な投資対象	<p>日本を除く世界各国の不動産投資信託証券 を主要投資対象とします。</p> <p>海外の証券取引所に上場(これに準ずるものを含まず。)されている不動産投資信託証券(一般社団法人投資信託協会規則に定める不動産投資信託の受益証券(振替投資信託受益権を含まず。))および不動産投資法人の投資証券。以下同じ。)とします。</p>
--------	--

投資態度	<ol style="list-style-type: none"><li>1.主に日本を除く世界各国の不動産投資信託証券を主要投資対象とし、S &amp; P先進国REITインデックス(除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)に連動する投資成果をめざして運用を行います。</li><li>2.不動産投資信託証券への投資割合は、原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</li><li>3.外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。ただし、金利・為替状況によってはヘッジを行う場合があります。</li></ol>
------	---

S & P 先進国 REIT インデックスは、S&P Globalの一部門であるS&Pダウ・ジョーンズ・インデックスLLCまたはその関連会社(「SPDJI」)の商品であり、これを利用するライセンスが委託会社に付与されています。Standard & Poor's®およびS&P®は、S&P Globalの一部門であるスタンダード・プアーズ・ファイナンシャル・サービスズLLC(「S&P」)の登録商標で、Dow Jones®は、ダウ・ジョーンズ・トレードマーク・ホールディングズLLC(「Dow Jones」)の登録商標です。指数に直接投資することはできません。本商品は、SPDJI、Dow Jones、S&P、それらの各関連会社(総称して「S&P Dow Jones Indices」)によってスポンサー、保証、販売、または販売促進されているものではありません。S&P Dow Jones Indicesは、本商品の所有者またはいかなる一般人に対して、有価証券全般または具体的な商品への投資の妥当性、あるいは全般的な市場のパフォーマンスを追跡するS & P 先進国 REIT インデックスの能力に関して、明示または黙示を問わず、いかなる表明または保証もしません。指数の過去のパフォーマンスは、将来の成績を示唆または保証するものでもありません。S & P 先進国 REIT インデックスに関して、S&P Dow Jones Indicesと委託会社との間にある唯一の関係は、当指数とS&P Dow Jones Indicesおよび/または特定の商標、サービスマーク、および/または商標名のライセンス供与です。S & P 先進国 REIT インデックスは委託会社または本商品に関係なく、S&P Dow Jones Indicesによって決定、構成、計算されます。S&P Dow Jones Indicesは、S & P 先進国 REIT インデックスの決定、構成または計算において委託会社または本商品の所有者のニーズを考慮する義務を負いません。S&P Dow Jones Indicesは、本商品の価格および数量、または本商品の発行または販売のタイミングの決定、もしくは場合によっては本商品が将来換金、譲渡、または償還される計算式の決定または計算に関して、責任を負わず、またこれに関与したこともありません。S&P Dow Jones Indicesは、本商品の管理、マーケティング、または取引に関して、いかなる義務または責任も負いません。S & P 先進国 REIT インデックスに基づく投資商品が、指数のパフォーマンスを正確に追跡する、またはプラスの投資収益率を提供する保証はありません。S&P Dow Jones Indices LLCは投資または税務の顧問会社ではありません。免税証券のポートフォリオへの影響や特定の投資決断の税効果の評価は、税務顧問会社に相談してください。指数に証券が含まれることは、S&P Dow Jones Indicesがかかる証券の売り、買い、またはホールドの推奨を意味するものではなく、投資アドバイスとして見なしではありません。

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

S&P Dow Jones Indicesは、明示的または黙示的を問わず、いかなる保証もせず、商品性、特定の目的または使用への適合性、もしくはS & P 先進国 REIT インデックスを使用することによって、またはそれに関連するデータに関して、委託会社、本商品の所有者、またはその他の人物や組織が得られる結果について、一切の保証を明示的に否認します。上記を制限することなく、いかなる場合においても、S&P Dow Jones Indicesは、利益の逸失、営業損失、時間または信用の喪失を含むがこれらに限定されない、間接的、特別、懲罰的、または派生的損害に対して、たとえその可能性について知らされていたとしても、契約の記述、不法行為、または厳格責任の有無を問わず、一切の責任を負



	<p>わないものとしします。S&amp;P Dow Jones Indicesのライセンサーを除き、S&amp;P Dow Jones Indicesと委託会社との間の契約または取り決めの第三者受益者は存在しません。</p>
運用プロセス	<p>ポートフォリオの構築にあたっては、原則としてインデックスである「S&amp;P先進国REITインデックス(除く日本)」を構成する全ての銘柄を、その時価構成比で組み入れることをめざします。インデックスに対する連動性を随時確認し、必要に応じてポートフォリオのリバランスを実施します。</p> <pre> graph TD     A[インデックス構成銘柄] --&gt; B[完全法をベースとして 組入銘柄および株数を決定]     B --&gt; C[ポートフォリオ]     C --&gt; D[日々・月次モニタリング]     C --&gt; E[インデックスとの乖離を管理・調整 1.インデックス構成銘柄および株数の変更 2.配当金再投資 3.資本異動 4.設定/解約]     E --&gt; B   </pre>
主な投資制限	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. 投資信託証券への投資割合には制限を設けません。</li> <li>2. 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</li> <li>3. 株式への直接投資は行いません。</li> <li>4. 同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として信託財産の純資産総額の30%以内とします。ただし、S &amp; P 先進国 REITインデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）における時価の構成割合が30%を超える不動産投資信託証券がある場合には、指数との連動性を維持するために当該不動産投資信託証券をS &amp; P 先進国 REITインデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）の構成割合の範囲で組み入れることができますものとしします。</li> <li>5. デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</li> <li>6. 外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。</li> <li>7. 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</li> </ol>

ファンド名	エマージング債券パッシブ・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、主として新興国の債券に投資し、JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース・為替ヘッジなし）の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。
主な投資対象	新興国の公社債を主要投資対象とします。

投資態度	<p>1.主として新興国の債券に投資し、JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース・為替ヘッジなし）の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>2.原則として、新興国の債券の組入比率は高位を維持します。</p> <p>3.組入債券は、当初組入時において、S&amp;PもしくはMoody'sの外貨建て長期格付がBB-格もしくはBa3格以上を取得している債券とします。但し、両社が格付を付与している場合には、どちらか低い方の格付を基準とします。また、当ファンドが保有する債券の格付が上記基準未滿となった場合は、当該債券を速やかに売却するものとします。</p> <p>4.外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。</p> <p>JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラスに関する著作権等の知的財産その他一切の権利はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。</p>
運用プロセス	<p>信用格付基準等を勘案した投資対象銘柄群を設定し、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。</p> <pre> graph TD     A[インデックス構成銘柄] --&gt; B[対象銘柄群]     B --&gt; C[計量モデル]     C --&gt; D[最適化ポートフォリオ]     E[信用格付基準等を勘案した対象銘柄群設定] --&gt; B     F[金利期間構造] --&gt; C     D --&gt; G[インデックスとの乖離を管理・調整]     G --&gt; H[日次・月次モニタリング]     G --- I["1. 年限・通貨構成変化要因 2. インデックス構成銘柄変更 3. リスク量の変更 4. クーポン・償還再投資"]   </pre>
主な投資制限	<p>1. 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>2. 外貨建資産への投資には、制限を設けません。</p> <p>3. 投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>4. デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</p> <p>5. 外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。</p> <p>6. 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>

ファンド名	エマージング株式パッシブ・マザーファンド
-------	----------------------

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

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

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、

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

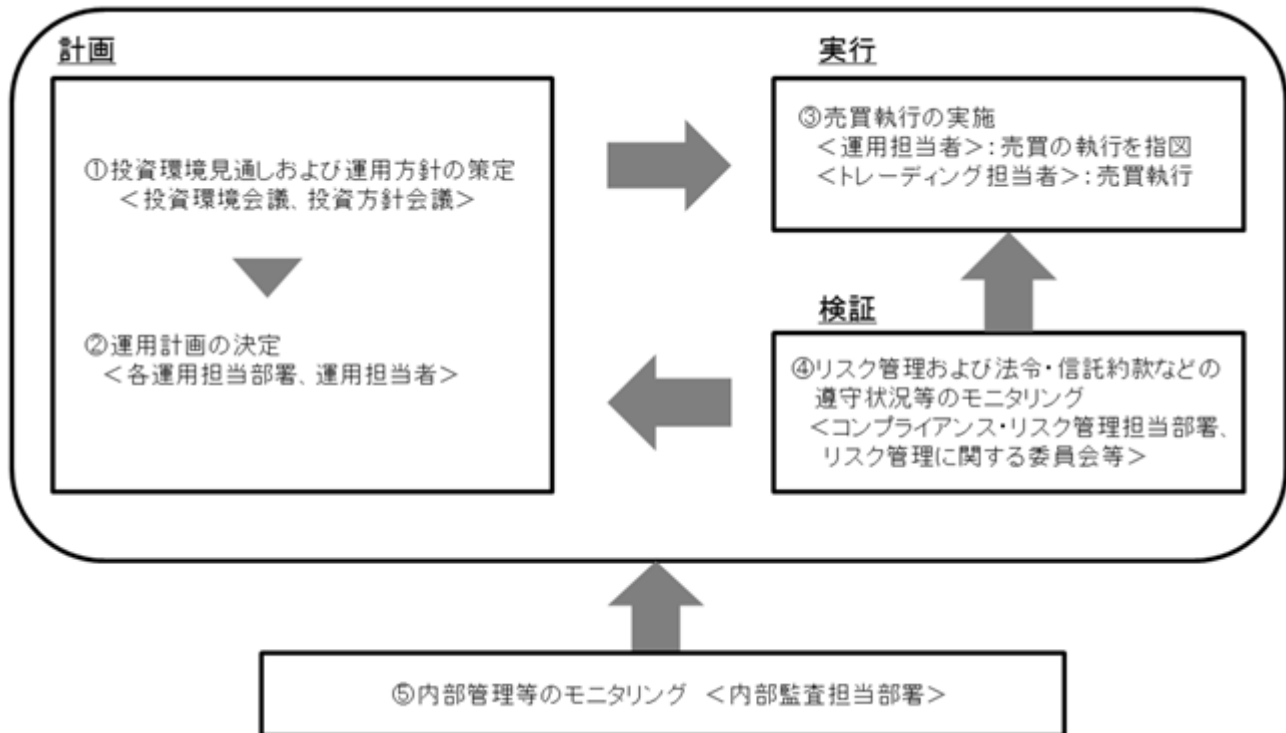
ファンド名	DIAMマネーマザーファンド
基本方針	この投資信託は、安定した収益の確保をめざします。
主な投資対象	国内発行体の公社債、転換社債、ユーロ円債、資産担保証券ならびにCD、CP、コールローン等の国内短期金融資産を主要投資対象とします。

投資態度	<p>国内の国債、政府保証債、政府機関債、地方債等のほか、取得時において主要格付機関<sup>(*)</sup>の長期発行体格付(複数の格付機関が付与している場合は高い方の格付)がAA-格相当以上の社債、転換社債、ユーロ円債、資産担保証券、さらに、国内格付機関の短期格付がa-1格相当以上のCD、CPを主要投資対象とします。</p> <p>(*)主要格付機関とは、R&amp;I、JCR、Moody's、S&amp;Pとします。</p> <p>国債および政府保証債を除き、原則として、ファンドの元本総額に対する1発行体当たりの有価証券の額面総額の割合は5%以内とします。</p> <p>ポートフォリオ全体の修正デュレーションは1年未満を基本として運用します。</p>
運用プロセス	<p>マクロ経済分析を主体としたファンダメンタルズ分析、投資家の需給動向等分析および信用リスク市場の分析等に基づき、短期金利の方向性見通し、セクター別のクレジットスプレッドの拡縮等を予測し、ファンドのデュレーションおよびセクター配分を決定します(トップダウンアプローチ)。</p>
主な投資制限	<p>株式への投資割合は、純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の株式への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>新株引受権証券及び新株予約権証券への投資割合は、取得時において、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建て資産への投資は行いません。</p> <p>デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます。)は、価格変動および金利変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>

資金動向、市況動向等によっては、上記の運用ができない場合があります。

## (3) 【運用体制】

## a. ファンドの運用体制



## 投資環境見通しおよび運用方針の策定

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

## 運用計画の決定

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

## 売買執行の実施

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

## モニタリング

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

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



#### 内部管理等のモニタリング

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

#### b．ファンドの関係法人に関する管理

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

#### c．運用体制に関する社内規則

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

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

運用体制は平成30年7月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

上記体制は、マザーファンドを通じた実質的な運用体制を記載しております。

### （４）【分配方針】

#### 収益分配方針

毎決算時（原則として毎年1月、3月、5月、7月、9月および11月の各11日（休業日の場合は翌営業日。））に、原則として以下の方針に基づき収益分配を行います。

##### (1) 分配対象額の範囲

経費控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。

##### (2) 分配対象額についての分配方針

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

##### (3) 留保益の運用方針

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

#### 収益の分配方式

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

- 1) 信託財産に属する配当等収益（配当金、利子、貸付有価証券にかかる品貸料およびこれ等に類する収益から支払利息を控除した額をいいます。以下同じ。）とマザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち信託財産に属するとみなした額（以下「みなし配当等収益」といいます。）との合計額から、諸経費、監査費用および当該監査費用にかかる消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）に相当する金額、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除した後、その残金を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。

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

#### 収益分配金の支払い

収益分配金は、決算日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者(当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため委託会社または販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者としてします。)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。再投資する場合の収益分配金は税引き後無手数料で再投資されますが、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

#### (5) 【投資制限】

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

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

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

マザーファンド受益証券以外の投資信託証券(上場投資信託証券を除きます。)への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。(約款「運用の基本方針」2. 運用方法(3)投資制限)

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

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する実質比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。(約款「運用の基本方針」2. 運用方法(3)投資制限)

投資する株式等の範囲(約款第20条)

- 1) 委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとしてします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。

2)上記1)の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、委託会社が投資することを指図することができるものとします。

#### 信用取引の指図範囲(約款第21条)

1)委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引き渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

2)上記1)の信用取引の指図は、次の1.~6.に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行うことができるものとし、かつ次の1.~6.に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。

- 1.信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
- 2.株式分割により取得する株券
- 3.有償増資により取得する株券
- 4.売出しにより取得する株券
- 5.信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権(転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限り、)の行使により取得可能な株券
- 6.信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権(5.に定めるものを除きます。 )の行使により取得可能な株券

#### 先物取引等の運用指図(約款第22条)

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

- 1.先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする有価証券(以下「ヘッジ対象有価証券」といいます。 )の時価総額とマザーファンドの信託財産に属するヘッジ対象有価証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占めるヘッジ対象有価証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。 )との合計額の範囲内とします。
- 2.先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象有価証券の組入可能額(信託財産の組入ヘッジ対象有価証券およびマザーファンドの組入ヘッジ対象有価証券のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める組入ヘッジ対象有価証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。 )を差し引いた額)に信託財産が限月までに受取る組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券および組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金とマザーファンドが限月までに受取る組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券および組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産

の純資産総額に占める組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券および組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金の割合を乗じて得た額をいいます。)を加えた額を限度とし、かつ信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに上記(2)投資対象 運用の指図範囲等1.~4.に掲げる金融商品で運用している額(以下「金融商品運用額」といいます。)とマザーファンドが限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに金融商品運用額のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占めるマザーファンドが限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに金融商品運用額の割合を乗じて得た額をいいます。)の合計額の範囲内とします。

3.コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、 で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

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

1.先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の売予約と合せてヘッジ対象とする外貨建資産の時価総額とマザーファンドの信託財産に属するヘッジ対象とする外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占めるヘッジ対象とする外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。)との合計額の範囲内とします。

2.先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の買予約と合せて、外貨建有価証券とマザーファンドの信託財産に属する外貨建有価証券のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める外貨建有価証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。)を加えた額の買付代金等実需の範囲内とします。

3.コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点の保有外貨建資産の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

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

1.先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする金利商品(信託財産が1年以内に受取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに上記(2)投資対象 運用の指図範囲等1.~4.に掲げる金融商品で運用されているものをいい、以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。)の時価総額とマザーファンドの信託財産に属するヘッジ対象金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占めるヘッジ対象金利商品の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。)の合計額の範囲内とします。

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

#### スワップ取引の運用指図(約款第23条)

- 1) 委託会社は、信託財産に属する資産の価格変動リスクや為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利、または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行うことの指図をすることができます。
- 2) スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとし、ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 3) スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。以下3)において同じ。)が、信託財産の純資産総額を超えないものとし、なお、信託財産の一部解約等の事由により、当該純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとし、
- 4) 上記3)においてマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- 5) スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとし、

6) 委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供または受入れが必要と認めるときは、担保の提供または受入れの指図を行うものとします。

金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図（約款第24条）

1) 委託会社は、信託財産に属する資産の価格変動リスクや為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。

2) 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

3) 金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（「金利先渡取引の想定元本の合計額」といいます。以下3）において同じ。）が、信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額とマザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（「ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額」といいます。以下3）において同じ。）を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額が減少して、金利先渡取引の想定元本の合計額がヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかにその超える額に相当する金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。

4) 上記3）においてマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

5) 為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（「為替先渡取引の想定元本の合計額」といいます。以下5）において同じ。）が、信託財産にかかるヘッジ対象とする外貨建資産（「ヘッジ対象外貨建資産」といいます。以下5）において同じ。）の時価総額とマザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（「ヘッジ対象外貨建資産の時価総額の合計額」といいます。以下5）において同じ。）を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、ヘッジ対象外貨建資産の時価総額の合計額が減少して、為替先渡取引の想定元本の合計額がヘッジ対象外貨建資産の時価総額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかにその超える額に相当する為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。

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

ンドの信託財産にかかるヘッジ対象外貨建資産の時価総額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

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

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

デリバティブ取引等にかかる投資制限(約款第25条)

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

有価証券の貸付の指図および範囲(約款第26条)

1) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の1.2.の範囲内で貸付の指図をすることができます。

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

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

2) 上記1)1.2.に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。

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

特別な場合の外貨建有価証券への投資制限(約款第27条)

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

外国為替予約取引の指図(約款第28条)

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

2) 上記1)の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約とマザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約のうち信託財産に属するとみなした額との合計額と、信託財産にかかる売予約とマザーファンドの信託財産にかかる為替の売予約のうち信託財産に属するとみなした額との合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産(マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額を含みます。)の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。

3) 上記2)においてマザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産にかかる為替の売予約のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる為替の売予約の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

4) 上記2)の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

#### 資金の借入れ(約款第34条)

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

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

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

### 3【投資リスク】

#### <基準価額の主な変動要因>

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

また、投資信託は預貯金と異なります。



### 資産配分リスク

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

当ファンドは短期金融資産等の保有比率を増加させることにより、基準価額の下落リスクの低減をめざして運用を行います。当手法が効果的に機能しない場合等により、基準価額の下落リスクを低減できない場合や、市場全体の上昇に追従できない場合があります。

### 株価変動リスク

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

### 金利リスク

一般的に金利が上昇すると債券、リートの価格は下落します。当ファンドは、実質的に債券、リートに投資をしますので、金利変動により基準価額が上下します。

### リートの価格変動リスク

リートの価格は、リートが投資対象とする不動産等の価値、当該不動産等による賃貸収入の増減、不動産市況の変動、景気や株式市況等の動向などによって変動します。

当ファンドは、実質的にリートに投資をしますので、これらの影響を受け、基準価額が上下します。

### 為替リスク

当ファンドは実質組入外貨建資産について、弾力的に対円での為替ヘッジを行います。

為替ヘッジを行わない場合、為替変動の影響を受けます。このため為替相場が当該実質組入資産の通貨に対して円高になった場合には基準価額が下がる要因となります。

為替ヘッジを行う場合、為替リスクの低減をめざしますが、為替リスクを完全に排除できるものではなく為替相場の影響を受ける場合があります。なお、実質組入通貨の直接ヘッジのほか、先進国通貨を用いた代替ヘッジを行う場合があります。その場合、通貨間の値動きが異なる場合が想定されますので、十分な為替ヘッジ効果が得られない可能性や、円と当該代替通貨との為替変動の影響を受ける可能性があります。また、為替ヘッジには円金利がヘッジ対象通貨の金利よりも低い場合、その金利差相当分程度のコストがかかることにご留意ください。

### 信用リスク

当ファンドが実質的に投資する株式・債券の発行者が経営不安・倒産に陥った場合、当ファンドが実質的に投資するリートが、収益性の悪化や資金繰り悪化等により清算される場合、またこうした状況に陥ると予想される場合等には、投資した資産の価格が下落したりその価値がなくなることがあり、基準価額が下がる要因となります。

### 流動性リスク

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

## カントリーリスク

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

基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

## <その他の留意点>

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。

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

収益分配金に関する留意点として、以下の事項にご留意ください。

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

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

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

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

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

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、お申込みの受付または解約の受付を中止することおよびすでに受付けたお申込みの受付または解約の受付を取り消すことができるものとします。

当ファンドは、信託契約を解約することが受益者のために有利であると認める場合、受益権口数が10億口を下回ることとなった場合、マザーファンドのベンチマークである対象インデックスが改廃された場合、その他やむを得ない事情が発生した場合は、当初定められていた信託期間の途中でも信託を終了（繰上償還）する場合があります。

## 注意事項

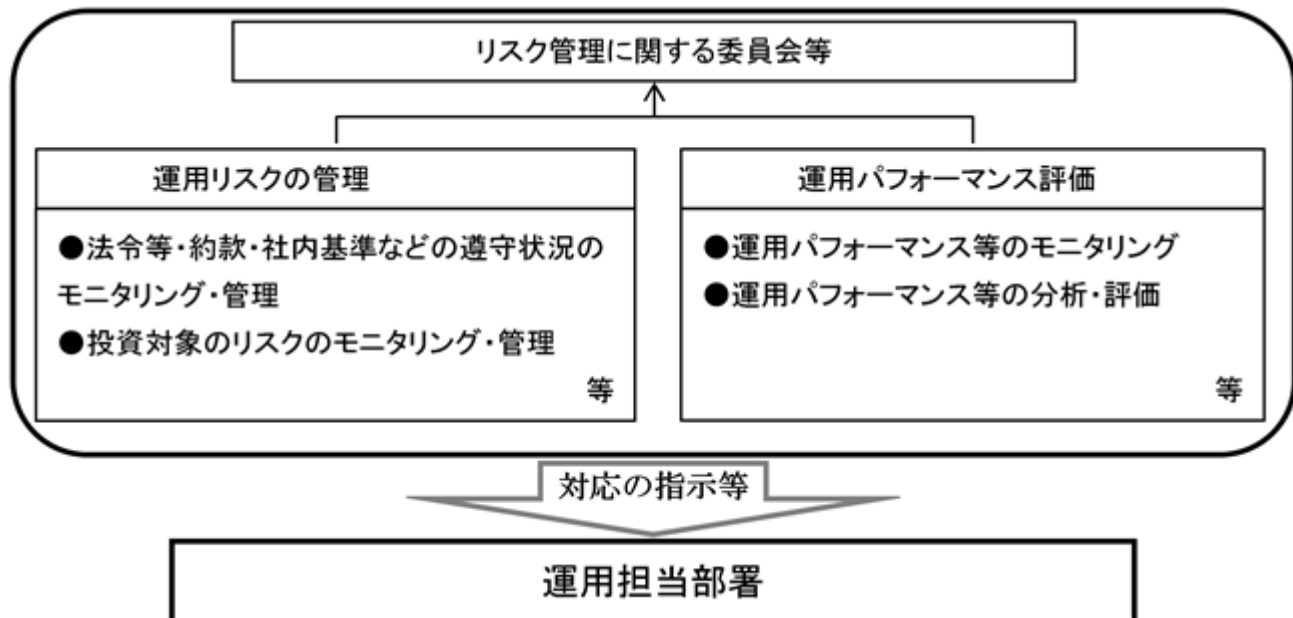
- ・当ファンドは、実質的に債券、株式、不動産投資信託証券（リート）など値動きのある有価証券（外貨建資産には為替リスクもあります。）に投資しますので、基準価額は変動します。
- ・投資信託は、預金等や保険契約ではありません。また、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。加えて、証券会社を通して購入していない場合には投資者保護基金の対象にもなりません。
- ・投資信託は、購入金額について元本保証および利回り保証のいずれもありません。

- ・投資信託は、投資した資産の価値が減少して購入金額を下回る場合があります、これによる損失は購入者が負担することとなります。

#### < リスク管理体制 >

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

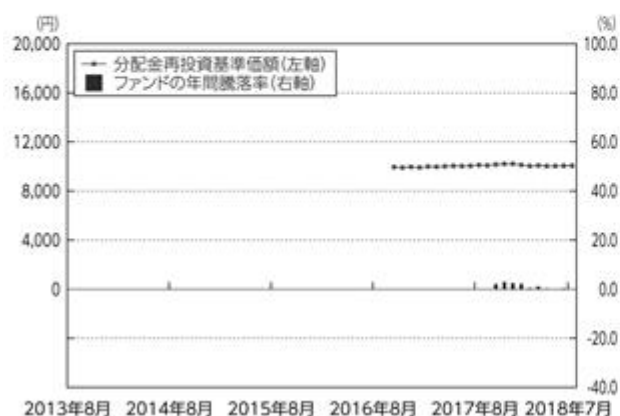
- ・運用リスクの管理：運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。
- ・運用パフォーマンス評価：運用担当部署から独立したリスク管理担当部署が、ファンドの運用パフォーマンスについて定期的に分析を行い、結果の評価を行います。
- ・リスク管理に関する委員会等：上記のとおり運用リスクの管理状況、運用パフォーマンス評価等の報告を受け、リスク管理に関する委員会等は総合的な見地から運用状況全般の管理・評価を行います。



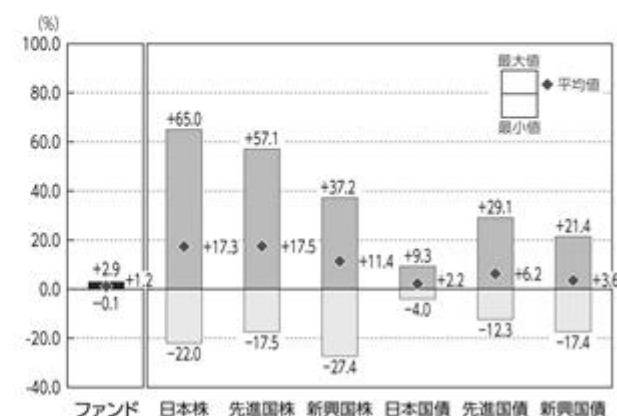
上記体制は平成30年7月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

## <参考情報>

### ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



### ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



ファンド:2017年10月~2018年7月

代表的な資産クラス:2013年8月~2018年7月

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

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

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

\*全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

#### \*各資産クラスの指数

- 日本株… 東証株価指数(TOPIX)(配当込み)
  - 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… JPMオルガン・グローバル・ディバーシファイド(円ベース)
- (注)海外の指数は為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

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

#### 4【手数料等及び税金】

##### (1)【申込手数料】

お申込時に、お申込日の翌営業日の基準価額に、1.08%(税抜1.00%)を上限に各販売会社が定める手数料率を乗じて得た額とします。

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

収益分配金を再投資する場合には、お申込手数料はかかりません。

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

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

##### (2)【換金（解約）手数料】

ありません。

##### (3)【信託報酬等】

ファンドの日々の純資産総額に対して年率0.7452%(税抜0.69%)

支払先	内訳（税抜）	主な役務
委託会社	年率0.33%	信託財産の運用、目論見書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価
販売会社	年率0.33%	購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価
受託会社	年率0.03%	運用財産の保管・管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率

信託報酬は、毎日計上され、毎計算期末または信託終了のときに信託報酬にかかる消費税等相当額とともに信託財産から支払われます。

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

##### (4)【その他の手数料等】

- ・ 信託財産留保額

ありません。

- ・ その他の費用

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

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

監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用は、受益者の負担とし、毎日計上され、毎計算期末または信託終了のとき、当該監査に要する費用にかかる消費税等相当額とともに信託財産から支払われます。

有価証券の売買時の売買委託手数料および有価証券取引にかかる手数料・税金、先物・オプション取引に要する費用、当該手数料にかかる消費税等相当額および外貨建資産の保管等に関する費用は、受益者の負担とし、信託財産から支払われます。

マザーファンドで負担する有価証券の売買時の売買委託手数料および有価証券取引にかかる手数料・税金、先物・オプション取引に要する費用、当該手数料にかかる消費税等相当額および外貨建資産の保管等に要する費用は、間接的に当ファンドで負担することになります。

上記の「その他の費用」については、運用状況等により変動するものであり、事前に料率、上限額等を示すことができません。

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

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

#### (5)【課税上の取扱い】

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、平成30年7月末現在のものです。税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。

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

#### 個別元本方式について

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

##### < 個別元本について >

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

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

ただし、同一ファンドの受益権を複数の販売会社で取得する場合には販売会社毎に個別元本の算出が行われます。また、同一販売会社であっても複数支店等で同一ファンドの受益権を取得する場合は当該支店等毎に、申込形態が異なる場合で同一ファンドの受益権を取得する場合は申込形態別に個別元本の算出が行われる場合があります。

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

##### < 収益分配金の課税について >

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

収益分配の際、当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本と同額の場合または当該受益者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となり、当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本を下回っている場合には、そ

の下回る部分の額が元本払戻金(特別分配金)となり、当該収益分配金から当該元本払戻金(特別分配金)を控除した額が普通分配金となります。

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

税法が改正された場合等は、上記内容が変更になることがあります。



## 5【運用状況】

## (1)【投資状況】

平成30年7月31日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99,014,230,384	97.61
内 日本	99,014,230,384	97.61
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	2,423,657,167	2.39
純資産総額	101,437,887,551	100.00

## その他資産の投資状況

平成30年7月31日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引(買建)	4,382,787,200	4.32
-	4,382,787,200	4.32
為替予約取引(売建)	13,426,387,200	13.24
-	13,426,387,200	13.24

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

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

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

(参考)

## 国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

平成30年7月31日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	290,442,666,020	96.36
内 日本	290,442,666,020	96.36
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	10,963,109,662	3.64
純資産総額	301,405,775,682	100.00

## その他資産の投資状況

平成30年7月31日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引(買建)	10,767,680,000	3.57
内 日本	10,767,680,000	3.57

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

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

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

## 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	284,473,597,300	82.87
内 日本	284,473,597,300	82.87
地方債証券	22,407,273,145	6.53
内 日本	22,407,273,145	6.53
特殊債券	16,808,892,217	4.90
内 日本	16,808,892,217	4.90
社債券	15,482,006,470	4.51
内 日本	15,281,148,470	4.45
内 オランダ	200,858,000	0.06
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	4,100,823,474	1.19
純資産総額	343,272,592,606	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

## J-REITインデックスファンド・マザーファンド

平成30年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	36,703,968,650	97.90
内 日本	36,703,968,650	97.90
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	788,977,385	2.10
純資産総額	37,492,946,035	100.00

## その他資産の投資状況

平成30年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
不動産投信指数先物取引（買建）	617,058,000	1.65
内 日本	617,058,000	1.65

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

## 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	302,012,547,573	95.38
内 アメリカ	191,517,411,682	60.48
内 イギリス	20,142,770,666	6.36
内 フランス	11,960,117,691	3.78
内 カナダ	11,740,119,075	3.71
内 ドイツ	11,716,700,729	3.70
内 スイス	10,733,398,636	3.39
内 オーストラリア	7,609,895,896	2.40
内 オランダ	5,997,575,826	1.89
内 アイルランド	4,492,778,951	1.42
内 スペイン	3,728,316,042	1.18
内 スウェーデン	3,154,966,969	1.00
内 香港	2,939,024,255	0.93
内 イタリア	2,371,642,425	0.75
内 デンマーク	2,087,550,692	0.66
内 ジャージー	1,589,400,324	0.50
内 シンガポール	1,429,354,300	0.45
内 バミューダ	1,418,762,002	0.45
内 ベルギー	1,299,944,397	0.41
内 フィンランド	1,238,398,426	0.39
内 ノルウェー	890,319,699	0.28
内 ケイマン諸島	779,153,406	0.25
内 オランダ領キュラソー	773,454,450	0.24
内 イスラエル	645,154,978	0.20
内 ルクセンブルグ	411,436,749	0.13
内 オーストリア	289,151,141	0.09
内 ニュージーランド	258,433,379	0.08
内 パナマ	206,776,182	0.07
内 ポルトガル	204,985,775	0.06
内 リベリア	151,516,637	0.05
内 イギリス領バージン諸島	89,160,063	0.03
内 パプアニューギニア	68,260,187	0.02
内 マン島	60,525,453	0.02
内 モーリシャス	16,090,490	0.01
投資信託受益証券	739,566,117	0.23
内 オーストラリア	600,869,665	0.19
内 シンガポール	138,696,452	0.04
投資証券	6,597,126,346	2.08
内 アメリカ	5,652,526,952	1.79
内 イギリス	273,393,121	0.09
内 オランダ	254,405,174	0.08
内 フランス	191,594,860	0.06
内 香港	179,749,447	0.06
内 カナダ	45,456,792	0.01
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	7,304,494,041	2.31

純資産総額	316,653,734,077	100.00
-------	-----------------	--------

## その他資産の投資状況

平成30年7月31日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引(買建)	26,399,600	0.01
-	26,399,600	0.01
為替予約取引(売建)	68,685,380	0.02
-	68,685,380	0.02
株価指数先物取引(買建)	7,138,544,354	2.25
内 アメリカ	4,901,223,324	1.55
内 ドイツ	1,290,633,669	0.41
内 イギリス	489,943,814	0.15
内 カナダ	264,803,750	0.08
内 オーストラリア	191,939,797	0.06

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

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

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

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

## 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	5,427,852,894	10.19
内 オーストラリア	3,630,924,227	6.82
内 シンガポール	1,777,204,940	3.34
内 カナダ	19,723,727	0.04
投資証券	47,561,505,903	89.31
内 アメリカ	37,801,547,393	70.99
内 イギリス	2,948,264,980	5.54
内 オランダ	1,626,983,727	3.06
内 フランス	1,292,668,999	2.43
内 香港	1,163,740,040	2.19
内 カナダ	950,326,775	1.78
内 スペイン	552,947,120	1.04
内 ベルギー	429,749,755	0.81
内 ニュージーランド	231,383,237	0.43
内 ドイツ	144,802,336	0.27
内 アイルランド	137,405,994	0.26
内 シンガポール	127,631,202	0.24
内 イタリア	60,576,424	0.11
内 ガーンジー	36,317,125	0.07
内 イスラエル	30,115,308	0.06
内 マン島	27,045,488	0.05
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	263,167,870	0.49
純資産総額	53,252,526,667	100.00

## その他資産の投資状況

平成30年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引（買建）	42,349,680	0.08
-	42,349,680	0.08
為替予約取引（売建）	22,200,000	0.04
-	22,200,000	0.04

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

## 為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	305,626,586,133	97.52
内 アメリカ	136,512,218,965	43.56
内 フランス	32,041,541,738	10.22
内 イタリア	28,316,729,931	9.04
内 イギリス	21,062,609,736	6.72
内 ドイツ	20,835,505,020	6.65
内 スペイン	18,311,783,084	5.84
内 ベルギー	8,071,941,178	2.58
内 オランダ	6,740,328,436	2.15
内 オーストラリア	6,384,393,347	2.04
内 カナダ	6,176,444,111	1.97
内 オーストリア	5,188,241,772	1.66
内 アイルランド	2,558,972,697	0.82
内 メキシコ	2,451,228,606	0.78
内 フィンランド	2,096,044,486	0.67
内 ポーランド	1,775,600,434	0.57
内 南アフリカ	1,715,666,608	0.55
内 デンマーク	1,625,931,042	0.52
内 マレーシア	1,156,791,278	0.37
内 シンガポール	979,654,305	0.31
内 スウェーデン	950,537,315	0.30
内 ノルウェー	674,422,044	0.22
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	7,759,890,928	2.48
純資産総額	313,386,477,061	100.00

## その他資産の投資状況

平成30年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引（売建）	314,120,160,059	100.23
-	314,120,160,059	100.23

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

## エマージング株式パッシブ・マザーファンド

平成30年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	64,019,055,927	94.60
内 ケイマン諸島	10,857,165,239	16.04
内 韓国	9,063,802,870	13.39
内 台湾	7,499,655,887	11.08
内 中国	6,471,665,732	9.56
内 インド	5,806,005,055	8.58
内 南アフリカ	4,204,620,910	6.21
内 ブラジル	4,200,473,048	6.21
内 香港	2,286,458,290	3.38
内 ロシア	2,201,871,977	3.25
内 メキシコ	1,610,622,603	2.38
内 マレーシア	1,538,741,711	2.27
内 タイ	1,475,992,251	2.18
内 インドネシア	1,263,326,988	1.87
内 ポーランド	772,358,099	1.14
内 チリ	731,875,250	1.08
内 バミューダ	666,960,490	0.99
内 フィリピン	647,593,668	0.96
内 カタール	566,323,317	0.84
内 トルコ	434,282,508	0.64
内 アラブ首長国連邦	425,356,701	0.63
内 コロンビア	300,345,176	0.44
内 アメリカ	208,129,274	0.31
内 ギリシャ	196,723,995	0.29
内 ハンガリー	169,960,448	0.25
内 チェコ	120,448,325	0.18
内 エジプト	66,638,930	0.10
内 オランダ	48,741,524	0.07
内 ルクセンブルグ	46,955,966	0.07
内 マン島	43,579,086	0.06
内 パキスタン	41,428,400	0.06
内 ペルー	28,549,995	0.04
内 シンガポール	22,402,214	0.03
投資信託受益証券	352,792,363	0.52
内 メキシコ	352,792,363	0.52
投資証券	120,828,327	0.18
内 メキシコ	62,023,377	0.09
内 南アフリカ	49,722,566	0.07
内 トルコ	9,082,384	0.01
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	3,180,928,390	4.70
純資産総額	67,673,605,007	100.00

## その他資産の投資状況

平成30年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引（買建）	317,682,000	0.47
-	317,682,000	0.47
株価指数先物取引（買建）	3,154,965,255	4.66
内 アメリカ	3,154,965,255	4.66

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

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

## エマージング債券パッシブ・マザーファンド

平成30年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	108,514,885,215	96.60
内 メキシコ	15,278,023,887	13.60
内 トルコ	13,952,010,652	12.42
内 ロシア	12,554,631,515	11.18
内 ブラジル	12,052,992,339	10.73
内 インドネシア	11,087,522,047	9.87
内 コロンビア	9,872,591,645	8.79
内 フィリピン	7,974,208,411	7.10
内 パナマ	5,584,811,413	4.97
内 ハンガリー	5,196,316,709	4.63
内 ペルー	4,971,306,434	4.43
内 南アフリカ	4,349,297,420	3.87
内 クロアチア	3,193,115,394	2.84
内 ルーマニア	2,448,057,349	2.18
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	3,815,894,173	3.40
純資産総額	112,330,779,388	100.00

## その他資産の投資状況

平成30年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引（買建）	166,500,000	0.15
-	166,500,000	0.15
為替予約取引（売建）	166,485,000	0.15
-	166,485,000	0.15

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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



## (2) 【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

平成30年7月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	為替フルヘッジ外国債券 パッシブ・ファンド・マ ザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	48,848,188,730	1.3284 64,892,853,018	1.3212 64,538,226,950	- -	63.62%
2	エマージング債券パッシ ブ・マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	6,082,520,356	1.8240 11,094,707,139	1.8309 11,136,486,519	- -	10.98%
3	国内債券パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	6,293,536,789	1.2937 8,142,139,512	1.2901 8,119,291,811	- -	8.00%
4	外国リート・パッシブ・ ファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	3,324,820,413	1.2354 4,107,571,983	1.2163 4,043,979,068	- -	3.99%
5	エマージング株式パッシ ブ・マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	2,556,846,801	1.1796 3,016,312,171	1.1979 3,062,846,782	- -	3.02%
6	国内株式パッシブ・ファン ド(最適化法)・マザー ファンド 日本	親投資信託受 益証券	1,137,829,748	2.6004 2,958,858,192	2.6787 3,047,904,545	- -	3.00%
7	J-REITインデックス ファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	1,368,694,121	1.8572 2,542,016,032	1.8619 2,548,371,583	- -	2.51%
8	外国株式パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	704,228,276	3.5571 2,505,035,558	3.5743 2,517,123,126	- -	2.48%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 投資有価証券の種類別投資比率

平成30年7月31日現在

種類	投資比率
親投資信託受益証券	97.61%
合計	97.61%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

(参考)

## 国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

平成30年7月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	1,411,200	7,353.87 10,377,786,345	7,305.00 10,308,816,000	- -	3.42%
2	三菱UFJフィナンシャル・ グループ 日本	株式 銀行業	8,017,300	789.07 6,326,237,988	689.40 5,527,126,620	- -	1.83%
3	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	515,800	8,663.60 4,468,688,360	9,260.00 4,776,308,000	- -	1.58%
4	ソニー 日本	株式 電気機器	777,600	5,411.76 4,208,186,809	5,828.00 4,531,852,800	- -	1.50%
5	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	817,500	4,995.06 4,083,466,930	5,168.00 4,224,840,000	- -	1.40%
6	三井住友フィナンシャルグ ループ 日本	株式 銀行業	866,800	4,791.32 4,153,117,332	4,445.00 3,852,926,000	- -	1.28%
7	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	1,044,500	3,838.03 4,008,829,431	3,355.00 3,504,297,500	- -	1.16%
8	キーエンス 日本	株式 電気機器	57,000	64,031.51 3,649,796,094	58,910.00 3,357,870,000	- -	1.11%
9	KDDI 日本	株式 情報・通信業	1,003,900	2,674.23 2,684,662,699	3,113.00 3,125,140,700	- -	1.04%
10	みずほフィナンシャルグルー プ 日本	株式 銀行業	15,556,900	199.50 3,103,658,490	194.60 3,027,372,740	- -	1.00%
11	任天堂 日本	株式 その他製品	71,500	44,902.63 3,210,538,396	36,760.00 2,628,340,000	- -	0.87%
12	リクルートホールディングス 日本	株式 サービス業	856,100	2,477.02 2,120,583,308	3,055.00 2,615,385,500	- -	0.87%
13	三菱商事 日本	株式 卸売業	802,300	2,958.44 2,373,562,664	3,117.00 2,500,769,100	- -	0.83%
14	ファナック 日本	株式 電気機器	110,300	27,144.55 2,994,044,085	21,920.00 2,417,776,000	- -	0.80%
15	東海旅客鉄道 日本	株式 陸運業	104,000	20,244.20 2,105,397,760	23,245.00 2,417,480,000	- -	0.80%
16	村田製作所 日本	株式 電気機器	121,800	15,196.94 1,850,987,684	19,500.00 2,375,100,000	- -	0.79%
17	NTTドコモ 日本	株式 情報・通信業	817,600	2,668.82 2,182,031,540	2,873.00 2,348,964,800	- -	0.78%
18	花王 日本	株式 化学	285,500	7,687.57 2,194,801,419	8,137.00 2,323,113,500	- -	0.77%
19	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	431,400	4,965.41 2,142,078,650	5,301.00 2,286,851,400	- -	0.76%
20	日本電産 日本	株式 電気機器	139,700	16,216.97 2,265,510,748	16,180.00 2,260,346,000	- -	0.75%

21	キヤノン 日本	株式 電気機器	624,600	4,052.58 2,531,245,392	3,617.00 2,259,178,200	- -	0.75%
22	信越化学工業 日本	株式 化学	200,400	11,520.24 2,308,656,944	11,270.00 2,258,508,000	- -	0.75%
23	セブン&アイ・ホールディングス 日本	株式 小売業	479,200	4,463.47 2,138,896,768	4,555.00 2,182,756,000	- -	0.72%
24	東日本旅客鉄道 日本	株式 陸運業	208,500	10,438.62 2,176,454,112	10,440.00 2,176,740,000	- -	0.72%
25	日立製作所 日本	株式 電気機器	2,787,000	811.45 2,261,513,650	778.60 2,169,958,200	- -	0.72%
26	日本たばこ産業 日本	株式 食料品	672,700	3,289.46 2,212,826,210	3,176.00 2,136,495,200	- -	0.71%
27	ダイキン工業 日本	株式 機械	158,500	12,218.86 1,936,690,552	13,320.00 2,111,220,000	- -	0.70%
28	アステラス製薬 日本	株式 医薬品	1,141,800	1,468.95 1,677,252,355	1,817.50 2,075,221,500	- -	0.69%
29	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	427,800	5,994.30 2,564,363,530	4,675.00 1,999,965,000	- -	0.66%
30	パナソニック 日本	株式 電気機器	1,326,200	1,597.31 2,118,356,926	1,438.00 1,907,075,600	- -	0.63%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

平成30年7月31日現在

種類	投資比率
株式	96.36%
合計	96.36%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 投資株式の業種別投資比率

平成30年7月31日現在

業種	国内/外国	投資比率
電気機器	国内	13.08%
輸送用機器		8.37%
情報・通信業		7.48%
化学		7.22%
銀行業		6.68%
機械		4.98%
小売業		4.65%
医薬品		4.62%
卸売業		4.58%
サービス業		4.37%
陸運業		4.15%
食料品		4.07%
建設業		3.07%
不動産業		2.31%
保険業		2.20%
その他製品		1.97%
精密機器		1.69%
電気・ガス業		1.68%
その他金融業		1.16%
鉄鋼		1.01%
ガラス・土石製品		0.98%
証券、商品先物取引業		0.88%
非鉄金属		0.82%
石油・石炭製品		0.80%
ゴム製品		0.74%
金属製品		0.63%
繊維製品		0.61%
空運業		0.57%
鉱業		0.29%
パルプ・紙		0.26%
海運業	0.19%	
倉庫・運輸関連業	0.18%	
水産・農林業	0.11%	
合計		96.36%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年7月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	122回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	4,000,000,000	100.42 4,016,960,000	100.31 4,012,480,000	0.100000 2019/12/20	1.17%
2	348回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,250,000,000	100.47 3,265,450,000	100.72 3,273,692,500	0.100000 2027/9/20	0.95%
3	340回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,100,000,000	103.16 3,198,092,000	103.18 3,198,766,000	0.400000 2025/9/20	0.93%
4	339回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,100,000,000	103.17 3,198,423,500	103.07 3,195,263,000	0.400000 2025/6/20	0.93%
5	341回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,060,000,000	102.43 3,134,418,000	102.48 3,135,888,000	0.300000 2025/12/20	0.91%
6	342回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,000,000,000	100.80 3,024,240,000	100.99 3,029,820,000	0.100000 2026/3/20	0.88%
7	343回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,000,000,000	100.74 3,022,470,000	100.94 3,028,410,000	0.100000 2026/6/20	0.88%
8	346回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	3,000,000,000	100.54 3,016,290,000	100.81 3,024,570,000	0.100000 2027/3/20	0.88%
9	130回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	3,000,000,000	100.77 3,023,130,000	100.71 3,021,390,000	0.100000 2021/12/20	0.88%
10	128回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	3,000,000,000	100.70 3,021,090,000	100.62 3,018,660,000	0.100000 2021/6/20	0.88%
11	127回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	3,000,000,000	100.65 3,019,500,000	100.58 3,017,430,000	0.100000 2021/3/20	0.88%
12	125回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	3,000,000,000	100.54 3,016,350,000	100.47 3,014,130,000	0.100000 2020/9/20	0.88%
13	123回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	3,000,000,000	100.47 3,014,100,000	100.35 3,010,770,000	0.100000 2020/3/20	0.88%
14	325回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,900,000,000	104.00 3,016,047,000	103.73 3,008,402,000	0.800000 2022/9/20	0.88%
15	335回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,900,000,000	103.58 3,004,037,000	103.44 3,000,021,000	0.500000 2024/9/20	0.87%

16	347回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	2,900,000,000	100.51 2,914,810,000	100.79 2,923,142,000	0.100000 2027/6/20	0.85%
17	133回 利付国庫債券（5年） 日本	国債証券	2,860,000,000	100.89 2,885,679,000	100.85 2,884,338,600	0.100000 2022/9/20	0.84%
18	344回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	2,800,000,000	100.68 2,819,100,000	100.93 2,826,208,000	0.100000 2026/9/20	0.82%
19	338回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	2,650,000,000	103.10 2,732,346,000	103.02 2,730,268,500	0.400000 2025/3/20	0.80%
20	345回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	2,700,000,000	100.61 2,716,610,000	100.88 2,723,760,000	0.100000 2026/12/20	0.79%
21	350回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	2,700,000,000	100.65 2,717,783,500	100.57 2,715,525,000	0.100000 2028/3/20	0.79%
22	334回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	2,600,000,000	104.11 2,706,919,000	103.92 2,702,128,000	0.600000 2024/6/20	0.79%
23	333回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	2,500,000,000	103.99 2,599,920,000	103.78 2,594,700,000	0.600000 2024/3/20	0.76%
24	305回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	2,500,000,000	102.64 2,566,200,000	101.97 2,549,275,000	1.300000 2019/12/20	0.74%
25	126回 利付国庫債券（5年） 日本	国債証券	2,500,000,000	100.59 2,514,950,000	100.52 2,513,150,000	0.100000 2020/12/20	0.73%
26	329回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	2,270,000,000	104.73 2,377,375,100	104.36 2,369,108,200	0.800000 2023/6/20	0.69%
27	310回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	2,300,000,000	102.89 2,366,654,000	102.39 2,355,177,000	1.000000 2020/9/20	0.69%
28	332回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	2,210,000,000	103.92 2,296,693,300	103.65 2,290,665,000	0.600000 2023/12/20	0.67%
29	312回 利付国庫債券（10年） 日本	国債証券	2,200,000,000	103.74 2,282,456,000	103.15 2,269,476,000	1.200000 2020/12/20	0.66%
30	124回 利付国庫債券（5年） 日本	国債証券	2,200,000,000	100.50 2,211,060,000	100.41 2,209,130,000	0.100000 2020/6/20	0.64%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 投資有価証券の種類別投資比率

平成30年7月31日現在

種類	投資比率
国債証券	82.87%
地方債証券	6.53%
特殊債券	4.90%
社債券	4.51%
合計	98.81%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

## J-REITインデックスファンド・マザーファンド

平成30年7月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	日本ビルファンド投資法人 日本	投資証券	4,197	620,605.54 2,604,681,459	622,000.00 2,610,534,000	- -	6.96%
2	ジャパンリアルエステイト投資法人 日本	投資証券	4,334	568,292.14 2,462,978,143	585,000.00 2,535,390,000	- -	6.76%
3	野村不動産マスターファンド投資法人 日本	投資証券	12,845	153,353.43 1,969,824,932	158,400.00 2,034,648,000	- -	5.43%
4	日本リテールファンド投資法人 日本	投資証券	8,191	198,997.47 1,629,988,278	203,900.00 1,670,144,900	- -	4.45%
5	ユナイテッド・アーバン投資法人 日本	投資証券	9,558	170,445.86 1,629,121,620	173,400.00 1,657,357,200	- -	4.42%
6	オリックス不動産投資法人 日本	投資証券	8,635	172,647.35 1,490,809,893	174,200.00 1,504,217,000	- -	4.01%
7	大和ハウスリート投資法人 日本	投資証券	5,426	260,714.16 1,414,635,082	276,000.00 1,497,576,000	- -	3.99%
8	日本プロロジスリート投資法人 日本	投資証券	5,813	228,836.15 1,330,224,557	226,100.00 1,314,319,300	- -	3.51%
9	アドバンス・レジデンス投資法人 日本	投資証券	4,224	285,002.94 1,203,852,436	290,900.00 1,228,761,600	- -	3.28%
10	GLP投資法人 日本	投資証券	9,581	120,830.17 1,157,673,902	119,400.00 1,143,971,400	- -	3.05%
11	日本プライムリアルティ投資法人 日本	投資証券	2,743	400,370.40 1,098,216,032	402,500.00 1,104,057,500	- -	2.94%
12	アクティピア・プロパティーズ投資法人 日本	投資証券	2,077	486,989.21 1,011,476,603	499,000.00 1,036,423,000	- -	2.76%

13	ジャパン・ホテル・リート投資法人 日本	投資証券	12,548	82,157.21 1,030,908,708	81,900.00 1,027,681,200	- -	2.74%
14	ケネディクス・オフィス投資法人 日本	投資証券	1,341	671,155.00 900,018,860	678,000.00 909,198,000	- -	2.42%
15	積水ハウス・リート投資法人 日本	投資証券	11,181	71,225.71 796,374,676	72,200.00 807,268,200	- -	2.15%
16	日本アコモデーションファンド投資法人 日本	投資証券	1,440	494,190.85 711,634,828	529,000.00 761,760,000	- -	2.03%
17	大和証券オフィス投資法人 日本	投資証券	1,000	639,220.09 639,220,096	681,000.00 681,000,000	- -	1.82%
18	フロンティア不動産投資法人 日本	投資証券	1,474	451,788.25 665,935,893	450,000.00 663,300,000	- -	1.77%
19	森ヒルズリート投資法人 日本	投資証券	4,655	138,765.69 645,954,315	138,100.00 642,855,500	- -	1.71%
20	インヴィンシブル投資法人 日本	投資証券	12,746	50,266.69 640,699,294	49,350.00 629,015,100	- -	1.68%
21	日本ロジスティクスファンド投資法人 日本	投資証券	2,894	224,182.78 648,784,971	216,000.00 625,104,000	- -	1.67%
22	産業ファンド投資法人 日本	投資証券	5,049	120,700.57 609,417,228	120,600.00 608,909,400	- -	1.62%
23	ジャパンエクセレント投資法人 日本	投資証券	3,881	143,782.26 558,018,962	143,700.00 557,699,700	- -	1.49%
24	ヒューリックリート投資法人 日本	投資証券	3,125	168,097.48 525,304,640	172,900.00 540,312,500	- -	1.44%
25	イオンリート投資法人 日本	投資証券	4,448	122,800.99 546,218,828	119,500.00 531,536,000	- -	1.42%
26	森トラスト総合リート投資法人 日本	投資証券	3,097	160,218.55 496,196,853	162,100.00 502,023,700	- -	1.34%
27	日本リート投資法人 日本	投資証券	1,399	328,776.94 459,958,943	346,500.00 484,753,500	- -	1.29%
28	プレミア投資法人 日本	投資証券	4,120	105,902.21 436,317,120	112,800.00 464,736,000	- -	1.24%
29	日本賃貸住宅投資法人 日本	投資証券	4,874	86,856.33 423,337,794	91,000.00 443,534,000	- -	1.18%
30	東急リアル・エステート投資法人 日本	投資証券	2,906	148,931.16 432,793,968	152,500.00 443,165,000	- -	1.18%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。



## 投資有価証券の種類別投資比率

平成30年7月31日現在

種類	投資比率
投資証券	97.90%
合計	97.90%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

## 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年7月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	APPLE INC アメリカ	株式 コンピュータ・周辺機器	376,469	18,631.21 7,014,073,621	21,081.90 7,936,685,236	- -	2.51%
2	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフトウェア	542,300	10,098.60 5,476,472,135	11,697.12 6,343,350,182	- -	2.00%
3	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 インターネット販売・通信販売	30,466	161,428.67 4,918,086,047	197,511.21 6,017,376,590	- -	1.90%
4	FACEBOOK INC アメリカ	株式 インターネットソフトウェア・サービス	177,316	19,936.39 3,535,041,995	18,989.37 3,367,119,237	- -	1.06%
5	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	254,725	12,773.62 3,253,761,679	12,958.19 3,300,776,807	- -	1.04%
6	ALPHABET INC-CL C アメリカ	株式 インターネットソフトウェア・サービス	23,300	118,964.56 2,771,874,259	135,403.33 3,154,897,761	- -	1.00%
7	ALPHABET INC-CL A アメリカ	株式 インターネットソフトウェア・サービス	22,200	119,293.94 2,648,325,679	136,546.74 3,031,337,636	- -	0.96%
8	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	198,834	14,402.27 2,863,662,351	14,672.19 2,917,330,564	- -	0.92%
9	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 石油・ガス・消耗燃料	315,280	8,491.67 2,677,256,039	9,073.95 2,860,837,289	- -	0.90%
10	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 銀行	722,337	3,552.92 2,566,408,296	3,475.72 2,510,643,396	- -	0.79%
11	WELLS FARGO & CO アメリカ	株式 銀行	348,201	6,606.72 2,300,468,036	6,492.97 2,260,860,353	- -	0.71%
12	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	231,295	8,676.04 2,006,726,621	9,112.39 2,107,651,632	- -	0.67%
13	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 各種金融サービス	94,579	22,294.89 2,108,628,727	22,100.98 2,090,288,672	- -	0.66%
14	VISA INC アメリカ	株式 情報技術サービス	134,179	13,422.13 1,800,968,377	15,150.64 2,032,898,368	- -	0.64%

15	UNITEDHEALTH GROUP INC アメリカ	株式 ヘルスケア・ プロバイ ダー/ヘルス ケア・サービ ス	71,700	25,416.15 1,822,338,070	28,178.77 2,020,418,411	- -	0.64%
16	CHEVRON CORP アメリカ	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	141,261	12,611.28 1,781,483,017	14,190.40 2,004,551,266	- -	0.63%
17	AT&T INC アメリカ	株式 各種電気通信 サービス	540,606	3,904.38 2,110,732,550	3,552.31 1,920,405,505	- -	0.61%
18	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 専門小売り	86,514	20,503.60 1,773,849,245	21,900.05 1,894,661,167	- -	0.60%
19	PFIZER INC アメリカ	株式 医薬品	440,510	3,915.85 1,724,974,646	4,283.87 1,887,090,172	- -	0.60%
20	INTEL CORP アメリカ	株式 半導体・半導 体製造装置	348,219	5,060.96 1,762,324,671	5,294.06 1,843,494,681	- -	0.58%
21	VERIZON COMM INC アメリカ	株式 各種電気通信 サービス	306,879	5,486.30 1,683,630,746	5,826.91 1,788,157,817	- -	0.56%
22	CISCO SYSTEMS INC アメリカ	株式 通信機器	357,260	4,681.70 1,672,586,320	4,681.29 1,672,438,272	- -	0.53%
23	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品	186,535	8,955.75 1,670,561,306	8,903.00 1,660,721,478	- -	0.52%
24	BOEING CO アメリカ	株式 航空宇宙・防 衛	41,469	38,398.80 1,592,360,081	38,971.17 1,616,095,473	- -	0.51%
25	HSBC HOLDINGS PLC イギリス	株式 銀行	1,488,734	1,090.63 1,623,658,627	1,057.41 1,574,214,158	- -	0.50%
26	COCA-COLA CO/THE アメリカ	株式 飲料	298,559	4,893.35 1,460,954,645	5,131.99 1,532,202,489	- -	0.48%
27	NOVARTIS AG-REG SHS スイス	株式 医薬品	164,138	8,913.21 1,462,996,741	9,332.62 1,531,837,844	- -	0.48%
28	CITIGROUP INC アメリカ	株式 銀行	190,608	8,510.01 1,622,077,658	8,024.91 1,529,612,598	- -	0.48%
29	MASTERCARD INC アメリカ	株式 情報技術サー ビス	69,052	19,165.80 1,323,437,282	21,965.54 1,516,765,068	- -	0.48%
30	MERCK & CO. INC. アメリカ	株式 医薬品	201,289	6,093.64 1,226,584,120	7,194.55 1,448,185,405	- -	0.46%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 投資有価証券の種類別投資比率

平成30年7月31日現在

種類	投資比率
株式	95.38%
投資信託受益証券	0.23%
投資証券	2.08%
合計	97.69%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 投資株式の業種別投資比率

平成30年7月31日現在

業種	国内/外国	投資比率
銀行	外国	8.93%
石油・ガス・消耗燃料		6.50%
医薬品		5.29%
ソフトウェア		4.59%
保険		3.75%
インターネットソフトウェア・サービス		3.42%
情報技術サービス		3.30%
半導体・半導体製造装置		2.96%
資本市場		2.91%
コンピュータ・周辺機器		2.83%
インターネット販売・通信販売		2.64%
化学		2.47%
ヘルスケア機器・用品		2.37%
航空宇宙・防衛		2.29%
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス		2.18%
バイオテクノロジー		2.08%
各種電気通信サービス		2.01%
メディア		1.94%
飲料		1.89%
食品		1.75%
電力		1.74%
ホテル・レストラン・レジャー		1.74%
専門小売り		1.60%
機械		1.53%
コングロマリット		1.49%
食品・生活必需品小売り		1.49%
金属・鉱業		1.48%
繊維・アパレル・贅沢品		1.36%
家庭用品		1.14%
タバコ		1.08%
陸運・鉄道		1.02%
総合公益事業		0.96%
各種金融サービス		0.94%
自動車		0.90%
通信機器		0.87%
電気設備		0.73%
パーソナル用品		0.69%
専門サービス		0.67%

ライフサイエンス・ツール/サービス	0.64%
航空貨物・物流サービス	0.58%
不動産管理・開発	0.52%
エネルギー設備・サービス	0.52%
電子装置・機器・部品	0.49%
消費者金融	0.46%
自動車部品	0.42%
商業サービス・用品	0.42%
複合小売り	0.41%
家庭用耐久財	0.39%
建設関連製品	0.37%
建設・土木	0.35%
商社・流通業	0.34%
無線通信サービス	0.31%
建設資材	0.30%
容器・包装	0.29%
運送インフラ	0.20%
ガス	0.15%
旅客航空輸送業	0.13%
紙製品・林産品	0.12%
ヘルスケア・テクノロジー	0.07%
水道	0.07%
販売	0.07%
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.07%
レジャー用品	0.06%
海運業	0.06%
各種消費者サービス	0.01%
貯蓄・抵当・不動産金融	0.01%
合計	95.38%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年7月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	SIMON PROPERTY GROUP INC アメリカ	投資証券	129,967	18,828.73 2,447,114,448	19,078.17 2,479,533,638	- -	4.66%
2	PROLOGIS INC アメリカ	投資証券	223,407	7,105.26 1,587,364,875	7,215.64 1,612,026,719	- -	3.03%
3	PUBLIC STORAGE アメリカ	投資証券	62,778	24,674.44 1,549,012,445	23,811.64 1,494,847,449	- -	2.81%
4	UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD オランダ	投資証券	56,584	24,517.16 1,387,279,140	24,608.74 1,392,461,057	- -	2.61%
5	DIGITAL REALTY TRUST INC アメリカ	投資証券	86,317	11,945.88 1,031,133,174	13,404.45 1,157,032,558	- -	2.17%
6	AVALONBAY COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	57,925	18,871.47 1,093,130,391	19,112.59 1,107,096,874	- -	2.08%
7	EQUITY RESIDENTIAL アメリカ	投資証券	154,324	6,983.47 1,077,718,160	7,079.10 1,092,476,216	- -	2.05%
8	WELLTOWER INC アメリカ	投資証券	155,903	6,553.44 1,021,702,461	6,849.31 1,067,829,068	- -	2.01%
9	LINK REIT 香港	投資証券	900,020	985.23 886,732,906	1,099.38 989,468,487	- -	1.86%
10	VENTAS INC アメリカ	投資証券	149,362	6,129.66 915,538,796	6,152.17 918,901,042	- -	1.73%
11	BOSTON PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	64,714	13,600.75 880,159,150	13,550.99 876,938,812	- -	1.65%
12	SCENTRE GROUP オーストラリア	投資信託受益 証券	2,240,058	358.74 803,618,622	349.39 782,659,464	- -	1.47%
13	REALTY INCOME CORP アメリカ	投資証券	119,262	5,947.99 709,369,549	6,146.62 733,058,635	- -	1.38%
14	ESSEX PROPERTY TRUST INC アメリカ	投資証券	27,699	26,051.61 721,603,678	25,954.13 718,903,668	- -	1.35%
15	HOST HOTELS & RESORTS INC アメリカ	投資証券	310,901	2,396.45 745,060,948	2,296.79 714,076,453	- -	1.34%
16	GGP INC アメリカ	投資証券	265,349	2,302.38 610,936,690	2,348.97 623,297,265	- -	1.17%
17	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT アメリカ	投資証券	43,207	14,029.63 606,178,586	13,634.24 589,094,961	- -	1.11%
18	VORNADO REALTY TRUST アメリカ	投資証券	72,609	8,122.99 589,802,534	7,777.36 564,706,375	- -	1.06%
19	HCP INC アメリカ	投資証券	197,118	2,742.34 540,565,276	2,828.53 557,555,122	- -	1.05%
20	EXTRA SPACE STORAGE INC アメリカ	投資証券	52,918	11,060.86 585,319,052	10,380.54 549,317,685	- -	1.03%
21	GOODMAN GROUP オーストラリア	投資信託受益 証券	672,647	813.59 547,263,647	798.25 536,946,588	- -	1.01%
22	MID AMERICA アメリカ	投資証券	47,756	10,976.67 524,202,285	10,951.13 522,982,474	- -	0.98%

23	DUKE REALTY TRUST アメリカ	投資証券	149,884	3,192.01 478,432,555	3,171.55 475,365,454	- -	0.89%
24	UDR INC アメリカ	投資証券	112,343	4,093.49 459,875,897	4,112.92 462,057,827	- -	0.87%
25	IRON MOUNTAIN INC アメリカ	投資証券	118,152	3,857.50 455,771,988	3,875.35 457,881,428	- -	0.86%
26	REGENCY CENTERS CORP アメリカ	投資証券	61,888	6,809.62 421,433,798	6,960.32 430,760,717	- -	0.81%
27	LAND SECURITIES GROUP PLC イギリス	投資証券	315,475	1,375.46 433,925,185	1,357.39 428,223,786	- -	0.80%
28	FEDERAL REALTY INVS TRUST アメリカ	投資証券	30,747	13,739.22 422,439,995	13,592.06 417,915,204	- -	0.78%
29	SL GREEN アメリカ	投資証券	37,133	11,130.83 413,321,295	11,159.83 414,398,164	- -	0.78%
30	SEGRO PLC イギリス	投資証券	423,888	962.92 408,172,248	970.58 411,420,088	- -	0.77%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

平成30年7月31日現在

種類	投資比率
投資信託受益証券	10.19%
投資証券	89.31%
合計	99.51%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

## 為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年7月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	US T N/B 0.875 09/15/19 アメリカ	国債証券	2,497,725,000	98.11 2,450,592,929	98.21 2,453,115,631	0.875000 2019/9/15	0.78%
2	US T N/B 1.375 05/31/20 アメリカ	国債証券	2,375,614,000	97.78 2,323,089,174	97.71 2,321,402,488	1.375000 2020/5/31	0.74%
3	US T N/B 3.625 02/15/20 アメリカ	国債証券	2,164,695,000	101.75 2,202,642,103	101.52 2,197,749,892	3.625000 2020/2/15	0.70%
4	US T N/B 1.75 05/31/22 アメリカ	国債証券	2,220,200,000	96.33 2,138,829,670	96.15 2,134,855,512	1.750000 2022/5/31	0.68%
5	US T N/B 1.625 07/31/20 アメリカ	国債証券	2,136,942,500	97.92 2,092,701,111	97.96 2,093,348,873	1.625000 2020/7/31	0.67%
6	FRANCE OAT 4.25 10/25/23 フランス	国債証券	1,669,600,500	123.46 2,061,379,520	122.47 2,044,909,996	4.250000 2023/10/25	0.65%
7	US T N/B 2.125 08/31/20 アメリカ	国債証券	1,907,151,800	99.03 1,888,824,071	98.86 1,885,543,770	2.125000 2020/8/31	0.60%
8	US T N/B 2.375 12/31/20 アメリカ	国債証券	1,881,619,500	99.42 1,870,875,452	99.18 1,866,246,668	2.375000 2020/12/31	0.60%
9	US T N/B 1.0 11/30/19 アメリカ	国債証券	1,887,170,000	97.91 1,847,860,248	97.96 1,848,747,218	1.000000 2019/11/30	0.59%
10	US T N/B 1.375 01/31/21 アメリカ	国債証券	1,887,170,000	96.86 1,828,044,963	96.72 1,825,384,054	1.375000 2021/1/31	0.58%
11	US T N/B 1.0 11/15/19 アメリカ	国債証券	1,776,160,000	97.98 1,740,281,568	98.05 1,741,666,972	1.000000 2019/11/15	0.56%
12	US T N/B 1.625 11/15/22 アメリカ	国債証券	1,785,040,800	95.35 1,702,054,253	95.15 1,698,644,825	1.625000 2022/11/15	0.54%
13	US T N/B 1.625 08/15/22 アメリカ	国債証券	1,765,059,000	95.62 1,687,890,620	95.47 1,685,278,333	1.625000 2022/8/15	0.54%
14	US T N/B 1.75 05/15/22 アメリカ	国債証券	1,750,627,700	96.40 1,687,640,115	96.20 1,684,278,910	1.750000 2022/5/15	0.54%
15	US T N/B 1.75 09/30/22 アメリカ	国債証券	1,731,756,000	96.00 1,662,485,760	95.81 1,659,230,058	1.750000 2022/9/30	0.53%
16	US T N/B 2.25 12/31/24 アメリカ	国債証券	1,665,150,000	96.43 1,605,820,705	96.10 1,600,225,801	2.250000 2024/12/31	0.51%
17	US T N/B 1.75 06/30/22 アメリカ	国債証券	1,665,150,000	96.26 1,602,956,647	96.07 1,599,709,605	1.750000 2022/6/30	0.51%
18	US T N/B 1.125 12/31/19 アメリカ	国債証券	1,609,645,000	97.96 1,576,808,242	97.97 1,577,001,399	1.125000 2019/12/31	0.50%
19	US T N/B 2.0 02/15/23 アメリカ	国債証券	1,554,140,000	96.70 1,502,900,004	96.48 1,499,496,437	2.000000 2023/2/15	0.48%
20	US T N/B 2.625 08/15/20 アメリカ	国債証券	1,481,983,500	100.09 1,483,421,023	99.91 1,480,708,994	2.625000 2020/8/15	0.47%
21	FRANCE OAT 1.5 05/25/31 フランス	国債証券	1,382,455,200	107.66 1,488,445,779	106.60 1,473,780,190	1.500000 2031/5/25	0.47%
22	US T N/B 1.125 07/31/21 アメリカ	国債証券	1,543,039,000	95.43 1,472,630,130	95.28 1,470,346,432	1.125000 2021/7/31	0.47%
23	US T N/B 2.125 12/31/22 アメリカ	国債証券	1,498,635,000	97.32 1,458,591,472	97.06 1,454,724,994	2.125000 2022/12/31	0.46%



24	US T N/B 2.25 01/31/24 アメリカ	国債証券	1,487,534,000	97.10 1,444,529,392	96.75 1,439,293,272	2.250000 2024/1/31	0.46%
25	US T N/B 1.875 03/31/22 アメリカ	国債証券	1,476,433,000	96.97 1,431,785,666	96.77 1,428,788,507	1.875000 2022/3/31	0.46%
26	US T N/B 1.5 06/15/20 アメリカ	国債証券	1,443,130,000	97.98 1,414,094,224	97.89 1,412,737,682	1.500000 2020/6/15	0.45%
27	US T N/B 2.0 08/31/21 アメリカ	国債証券	1,432,029,000	97.93 1,402,428,960	97.72 1,399,464,660	2.000000 2021/8/31	0.45%
28	US T N/B 2.0 09/30/20 アメリカ	国債証券	1,405,386,600	98.70 1,387,257,112	98.54 1,384,952,278	2.000000 2020/9/30	0.44%
29	US T N/B 2.0 07/31/20 アメリカ	国債証券	1,398,726,000	98.84 1,382,542,740	98.69 1,380,472,625	2.000000 2020/7/31	0.44%
30	US T N/B 2.125 09/30/24 アメリカ	国債証券	1,443,130,000	95.92 1,384,264,727	95.58 1,379,415,810	2.125000 2024/9/30	0.44%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

平成30年7月31日現在

種類	投資比率
国債証券	97.52%
合計	97.52%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

## エマージング株式パッシブ・マザーファンド

平成30年7月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	TENCENT HOLDINGS LTD ケイマン諸島	株式 インターネット ソフトウェア・サービス	620,300	5,629.67 3,492,086,696	5,192.20 3,220,726,622	- -	4.76%
2	ALIBABA GROUP HOLDING LTD- ADR ケイマン諸島	株式 インターネット ソフトウェア・サービス	125,780	20,051.13 2,522,032,366	20,516.86 2,580,611,682	- -	3.81%
3	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD 韓国	株式 コンピュータ・周辺機器	523,300	4,955.77 2,593,355,821	4,617.45 2,416,311,585	- -	3.57%
4	TAIWAN SEMICONDUCTOR 台湾	株式 半導体・半導 体製造装置	2,673,083	858.59 2,295,095,683	891.16 2,382,158,011	- -	3.52%
5	NASPERS LTD 南アフリカ	株式 メディア	47,680	25,719.95 1,226,327,504	27,946.12 1,332,471,211	- -	1.97%
6	CHINA CONSTRUCTION BANK 中国	株式 銀行	10,455,530	111.21 1,162,818,244	100.67 1,052,629,302	- -	1.56%
7	BAIDU INC -SPON ADR ケイマン諸島	株式 インターネット ソフトウェア・サービス	30,000	26,500.54 795,016,340	27,907.91 837,237,420	- -	1.24%
8	CHINA MOBILE LIMITED 香港	株式 無線通信サー ビス	666,500	1,023.94 682,461,911	989.09 659,230,484	- -	0.97%
9	IND & COMM BK OF CHINA - H 中国	株式 銀行	7,577,235	92.61 701,735,532	82.29 623,567,038	- -	0.92%
10	PING AN INSURANCE GROUP CO-H 中国	株式 保険	563,000	1,137.66 640,503,500	1,042.82 587,110,475	- -	0.87%
11	RELIANCE INDUSTRIES LTD インド	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	309,113	1,552.73 479,969,346	1,876.78 580,137,714	- -	0.86%
12	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP インド	株式 貯蓄・抵当・ 不動産金融	171,720	3,084.29 529,635,808	3,306.86 567,854,428	- -	0.84%
13	VALE SA ブラジル	株式 金属・鉱業	346,221	1,389.51 481,080,216	1,616.31 559,603,061	- -	0.83%
14	HON HAI PRECISION INDUSTRY 台湾	株式 電子装置・機 器・部品	1,789,532	314.04 562,001,485	305.64 546,963,297	- -	0.81%
15	SK HYNIX INC 韓国	株式 半導体・半導 体製造装置	63,598	8,305.35 528,203,927	8,529.86 542,482,672	- -	0.80%

16	ITAU UNIBANCO HOLDING SA ブラジル	株式 銀行	350,298	1,481.14 518,840,819	1,397.35 489,491,537	- -	0.72%
17	SBERBANK ADR ロシア	株式 銀行	300,890	1,576.90 474,474,587	1,535.26 461,946,878	- -	0.68%
18	BANK OF CHINA LTD 中国	株式 銀行	8,631,200	58.02 500,824,103	52.31 451,567,121	- -	0.67%
19	INFOSYS LTD インド	株式 情報技術サービス	190,912	1,864.25 355,907,815	2,202.12 420,413,042	- -	0.62%
20	LUKOIL SPON ADR ロシア	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	47,903	7,111.71 340,672,355	7,832.86 375,217,760	- -	0.55%
21	CNOOC LTD 香港	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	1,953,000	177.24 346,151,652	182.68 356,791,226	- -	0.53%
22	SAMSUNG ELECTRONICS-PFD 韓国	株式 コンピュータ・周辺機器	93,419	4,016.11 375,181,593	3,808.15 355,754,031	- -	0.53%
23	AMERICA MOVIL SAB DE CV メキシコ	株式 無線通信サービス	3,644,478	105.64 385,011,973	95.54 348,195,250	- -	0.51%
24	BANCO BRADESCO SA PREF ブラジル	株式 銀行	365,225	988.55 361,043,193	926.11 338,241,263	- -	0.50%
25	TATA CONSULTANCY SERVICES LTD インド	株式 情報技術サービス	100,131	2,636.98 264,044,353	3,169.69 317,385,030	- -	0.47%
26	JD.COM INC ADR ケイマン諸島	株式 インターネット販売・通信販売	79,200	4,397.71 348,299,394	3,903.11 309,126,438	- -	0.46%
27	AMBEV SA ブラジル	株式 飲料	513,995	675.66 347,290,813	586.07 301,239,619	- -	0.45%
28	GAZPROM PAO ADR ロシア	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	603,820	504.95 304,902,529	492.10 297,144,248	- -	0.44%
29	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL COR 中国	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	2,727,200	104.16 284,082,112	106.19 289,605,186	- -	0.43%
30	POSCO 韓国	株式 金属・鉱業	8,590	33,293.36 285,990,042	32,620.04 280,206,229	- -	0.41%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 投資有価証券の種類別投資比率

平成30年7月31日現在

種類	投資比率
株式	94.60%
投資信託受益証券	0.52%
投資証券	0.18%
合計	95.30%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 投資株式の業種別投資比率

平成30年7月31日現在

業種	国内/外国	投資比率
銀行	外国	15.37%
インターネットソフトウェア・サービス		11.13%
石油・ガス・消耗燃料		7.02%
半導体・半導体製造装置		5.34%
コンピュータ・周辺機器		4.95%
保険		3.45%
金属・鉱業		3.20%
無線通信サービス		2.85%
電子装置・機器・部品		2.65%
不動産管理・開発		2.43%
化学		2.41%
メディア		2.35%
自動車		1.91%
食品・生活必需品小売り		1.74%
情報技術サービス		1.69%
食品		1.67%
医薬品		1.47%
コングロマリット		1.42%
各種電気通信サービス		1.21%
各種金融サービス		1.16%
資本市場		1.11%
建設資材		0.99%
貯蓄・抵当・不動産金融		0.99%
電力		0.95%
インターネット販売・通信販売		0.87%
飲料		0.87%
運送インフラ		0.86%
パーソナル用品		0.74%
建設・土木		0.73%
ホテル・レストラン・レジャー		0.72%
機械		0.71%
ガス		0.61%
繊維・アパレル・贅沢品		0.60%
自動車部品		0.59%
タバコ		0.57%
複合小売り		0.57%
バイオテクノロジー		0.54%
独立系発電事業者・エネルギー販売業者		0.54%

紙製品・林産品	0.53%
各種消費者サービス	0.50%
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	0.44%
家庭用品	0.42%
専門小売り	0.41%
ソフトウェア	0.35%
家庭用耐久財	0.34%
旅客航空輸送業	0.26%
消費者金融	0.25%
陸運・鉄道	0.24%
水道	0.22%
ライフサイエンス・ツール/サービス	0.22%
エクイティ不動産投資信託(REITs)	0.20%
電気設備	0.19%
航空宇宙・防衛	0.17%
海運業	0.10%
商業サービス・用品	0.10%
ヘルスケア機器・用品	0.09%
エネルギー設備・サービス	0.08%
容器・包装	0.07%
総合公益事業	0.07%
ヘルスケア・テクノロジー	0.06%
航空貨物・物流サービス	0.06%
商社・流通業	0.05%
レジャー用品	0.05%
専門サービス	0.05%
販売	0.04%
通信機器	0.04%
建設関連製品	0.03%
合計	94.60%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## エマージング債券パッシブ・マザーファンド

平成30年7月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	RUSSIAN FEDERATION 5.25 06/23/47 ロシア	国債証券	2,708,644,000	96.14 2,604,206,902	99.07 2,683,616,129	5.250000 2047/6/23	2.39%
2	RUSSIA FOREIGN BOND 5.0 04/29/20 ロシア	国債証券	1,798,362,000	102.18 1,837,715,267	102.75 1,847,816,955	5.000000 2020/4/29	1.64%
3	PERU 5.625 11/18/50 ペルー	国債証券	1,509,736,000	120.52 1,819,672,589	118.48 1,788,810,699	5.625000 2050/11/18	1.59%
4	COLOMBIA 5.0 06/15/45 コロンビア	国債証券	1,731,756,000	101.63 1,760,130,156	100.02 1,732,188,939	5.000000 2045/6/15	1.54%
5	BRAZIL 4.25 01/07/25 ブラジル	国債証券	1,765,059,000	99.53 1,756,785,979	97.32 1,717,843,671	4.250000 2025/1/7	1.53%
6	UNITED MEXICAN STATES 4.75 03/08/44 メキシコ	国債証券	1,731,756,000	97.64 1,690,959,825	94.75 1,640,838,810	4.750000 2044/3/8	1.46%
7	RUSSIAN FEDERATION 03/31/30 ロシア	国債証券	1,427,644,105	111.93 1,598,006,555	111.54 1,592,536,999	7.500000 2030/3/31	1.42%
8	PERU 7.35 07/21/25 ペルー	国債証券	1,221,110,000	124.22 1,516,896,145	122.20 1,492,257,475	7.350000 2025/7/21	1.33%
9	UNITED MEXICAN STATES 6.05 01/11/40 メキシコ	国債証券	1,321,019,000	113.92 1,504,970,895	110.94 1,465,670,580	6.050000 2040/1/11	1.30%
10	UNITED MEXICAN STATES 4.0 10/02/23 メキシコ	国債証券	1,343,221,000	102.40 1,375,531,459	100.73 1,353,120,538	4.000000 2023/10/2	1.20%
11	PANAMA 6.7 01/26/36 パナマ	国債証券	1,087,898,000	125.71 1,367,632,099	123.66 1,345,403,456	6.700000 2036/1/26	1.20%
12	UNITED MEXICAN STATES 4.15 03/28/27 メキシコ	国債証券	1,287,716,000	100.80 1,298,106,536	99.13 1,276,603,010	4.150000 2027/3/28	1.14%
13	RUSSIAN FEDERATION 4.75 05/27/26 ロシア	国債証券	1,243,312,000	100.68 1,251,863,322	101.49 1,261,862,215	4.750000 2026/5/27	1.12%
14	COLOMBIA 6.125 01/18/41 コロンビア	国債証券	1,110,100,000	115.02 1,276,837,020	113.37 1,258,575,875	6.125000 2041/1/18	1.12%
15	BRAZIL 5.0 01/27/45 ブラジル	国債証券	1,465,332,000	87.93 1,288,561,230	85.60 1,254,324,192	5.000000 2045/1/27	1.12%
16	UNITED MEXICAN STATES 5.55 01/21/45 メキシコ	国債証券	1,154,504,000	109.71 1,266,635,423	107.12 1,236,762,410	5.550000 2045/1/21	1.10%
17	COLOMBIA 4.375 07/12/21 コロンビア	国債証券	1,198,908,000	103.39 1,239,593,165	102.57 1,229,779,881	4.375000 2021/7/12	1.09%
18	RUSSIAN FEDERATION 5.625 04/04/42 ロシア	国債証券	1,132,302,000	104.71 1,185,689,817	107.43 1,216,454,684	5.625000 2042/4/4	1.08%

19	RUSSIAN FEDERATION 4.875 09/16/23 ロシア	国債証券	1,154,504,000	103.04 1,189,670,635	104.44 1,205,821,702	4.875000 2023/9/16	1.07%
20	INDONESIA 4.125 01/15/25 インドネシア	国債証券	1,198,908,000	101.00 1,210,970,346	99.52 1,193,273,132	4.125000 2025/1/15	1.06%
21	TURKEY 6.0 03/25/27 トルコ	国債証券	1,265,514,000	100.38 1,270,362,472	92.24 1,167,373,389	6.000000 2027/3/25	1.04%
22	TURKEY 7.375 02/05/25 トルコ	国債証券	1,143,403,000	109.41 1,251,066,048	101.97 1,166,042,379	7.375000 2025/2/5	1.04%
23	BRAZIL 4.625 01/13/28 ブラジル	国債証券	1,221,110,000	94.63 1,155,558,595	94.27 1,151,201,452	4.625000 2028/1/13	1.02%
24	BRAZIL 4.875 01/22/21 ブラジル	国債証券	1,110,100,000	103.90 1,153,438,304	102.57 1,138,629,570	4.875000 2021/1/22	1.01%
25	HUNGARY 6.375 03/29/21 ハンガリー	国債証券	1,043,494,000	108.58 1,133,114,371	107.41 1,120,858,645	6.375000 2021/3/29	1.00%
26	UNITED MEXICAN STATES 4.6 01/23/46 メキシコ	国債証券	1,176,706,000	95.78 1,127,073,429	93.25 1,097,278,345	4.600000 2046/1/23	0.98%
27	HUNGARY 5.75 11/22/23 ハンガリー	国債証券	999,090,000	110.41 1,103,140,561	109.08 1,089,847,335	5.750000 2023/11/22	0.97%
28	PHILIPPINES 9.5 02/02/30 フィリピン	国債証券	732,666,000	149.81 1,097,643,567	147.63 1,081,671,449	9.500000 2030/2/2	0.96%
29	COLOMBIA 5.625 02/26/44 コロンビア	国債証券	999,090,000	109.44 1,093,437,399	108.10 1,080,016,290	5.625000 2044/2/26	0.96%
30	UNITED MEXICAN STATES 5.75 10/12/2110 メキシコ	国債証券	1,065,696,000	102.89 1,096,512,376	100.42 1,070,193,237	5.750000 2110/10/12	0.95%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

平成30年7月31日現在

種類	投資比率
国債証券	96.60%
合計	96.60%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

平成30年7月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
為替予約取引	-	ユーロ買/円売2018年08月	買建	15,540,000	2,021,287,800	2,019,112,200	1.99%
		アメリカ・ドル買/円売2018年08月	買建	9,080,000	1,004,248,000	1,006,336,400	0.99%
		イギリス・ポンド買/円売2018年08月	買建	5,360,000	787,116,000	780,416,000	0.77%
		オーストラリア・ドル買/円売2018年08月	買建	4,780,000	392,199,000	392,342,400	0.39%
		カナダ・ドル買/円売2018年08月	買建	2,170,000	182,692,300	184,580,200	0.18%
		ユーロ売/円買2018年08月	売建	34,760,000	4,521,712,400	4,516,366,800	4.45%
		イギリス・ポンド売/円買2018年08月	売建	26,080,000	3,829,553,538	3,797,248,000	3.74%
		オーストラリア・ドル売/円買2018年08月	売建	23,130,000	1,898,252,040	1,898,510,400	1.87%
		カナダ・ドル売/円買2018年08月	売建	20,120,000	1,694,282,920	1,711,407,200	1.69%
		アメリカ・ドル売/円買2018年08月	売建	13,560,000	1,499,894,085	1,502,854,800	1.48%

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

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

為替予約取引の数量は、現地通貨建契約金額です。

(参考)

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

平成30年7月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
株価指数先物取引	大阪取引所	TOPIX先物 3009月	買建	616	10,686,219,584	10,767,680,000	3.57%

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

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

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。



## J-REITインデックスファンド・マザーファンド

平成30年7月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
不動産投信指 数先物取引	大阪取引所	TREIT 先物 3009月	買建	351	602,140,500	617,058,000	1.65%

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

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

## 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年7月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
為替予約取引	-	カナダ・ドル買/円売 2018年08月	買建	310,000	26,372,940	26,399,600	0.01%
		アメリカ・ドル売/円 買2018年08月	売建	232,000	25,759,916	25,752,000	0.01%
		ユーロ売/円買201 8年08月	売建	186,000	24,111,556	24,166,980	0.01%
		イギリス・ポンド売/ 円買2018年08月	売建	113,000	16,458,140	16,461,840	0.01%
		オーストラリア・ドル 売/円買2018年0 8月	売建	27,000	2,219,497	2,219,400	0.00%
		カナダ・ドル売/円買 2018年08月	売建	1,000	85,168	85,160	0.00%
株価指数先物 取引	シカゴ商品 取引所	S&P500 EMI NI FUT Sep 18	買建	315	4,838,120,799	4,901,223,324	1.55%
	EUREX 取引所	DJ EURO ST OXX 50 Sep 18	買建	283	1,259,342,627	1,290,633,669	0.41%
	ICE-E U	FTSE 100 I NDEX FUTUR E Sep18	買建	44	485,835,356	489,943,814	0.15%
	モン トル オール 取引 所	S&P/TSE 6 0 IX FUT S ep18	買建	16	262,290,213	264,803,750	0.08%
	シド ニー 先 物 取引 所	SPI 200 FU TURES Sep1 8	買建	15	188,606,182	191,939,797	0.06%

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

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

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

為替予約取引の数量は、現地通貨建契約金額です。

## 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年7月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
為替予約取引	-	シンガポール・ドル 買/円売2018年0 8月	買建	172,000	14,011,403	14,027,870	0.03%
		ユーロ買/円売201 8年08月	買建	60,000	7,796,004	7,795,800	0.01%
		オーストラリア・ドル 買/円売2018年0 8月	買建	86,000	7,069,372	7,068,340	0.01%
		イギリス・ポンド買/ 円売2018年08月	買建	39,000	5,681,910	5,681,520	0.01%
		ニュージーランド・ド ル買/円売2018年 08月	買建	40,000	3,031,280	3,031,200	0.01%
		カナダ・ドル買/円売 2018年08月	買建	30,000	2,555,064	2,554,800	0.00%
		香港・ドル買/円売2 018年08月	買建	155,000	2,191,700	2,190,150	0.00%
		アメリカ・ドル売/円 買2018年08月	売建	200,000	22,201,120	22,200,000	0.04%

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

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

為替予約取引の数量は、現地通貨建契約金額です。

## 為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年7月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
為替予約取引	-	アメリカ・ドル売/ 円買2018年08 月	売建	1,251,533,900	138,286,343,176	138,857,686,205	44.31%
		ユーロ売/円買20 18年08月	売建	990,768,900	128,117,291,555	128,730,603,177	41.08%
		イギリス・ポンド 売/円買2018年 08月	売建	149,356,100	21,820,141,247	21,755,209,526	6.94%
		カナダ・ドル売/円 買2018年08月	売建	76,339,100	6,420,517,141	6,499,510,974	2.07%
		オーストラリア・ド ル売/円買2018 年08月	売建	78,454,000	6,405,129,236	6,446,565,180	2.06%
		メキシコ・ペソ売/ 円買2018年08 月	売建	426,524,600	2,385,253,520	2,546,351,862	0.81%
		デンマーク・クロ ネ売/円買2018 年08月	売建	107,163,200	1,860,263,743	1,868,926,208	0.60%
		ポーランド・ズロチ 売/円買2018年 08月	売建	59,685,400	1,762,306,931	1,815,033,014	0.58%
		南アフリカ・ランド 売/円買2018年 08月	売建	209,109,900	1,678,943,387	1,758,614,259	0.56%
		マレーシア・リン ギット売/円買20 18年08月	売建	42,570,000	1,161,509,679	1,163,012,400	0.37%
		シンガポール・ドル 売/円買2018年 08月	売建	12,169,800	986,911,147	992,203,794	0.32%
		スウェーデン・ク ローナ売/円買20 18年08月	売建	77,693,300	962,091,672	985,151,044	0.31%
		ノルウェー・クロ ネ売/円買2018 年08月	売建	51,414,400	698,007,035	701,292,416	0.22%

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

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

為替予約取引の数量は、現地通貨建契約金額です。

## エマージング株式パッシブ・マザーファンド

平成30年7月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
為替予約取引	-	アメリカ・ドル買/円 売2018年08月	買建	2,862,000	317,936,415	317,682,000	0.47%
株価指数先物 取引	ICE-US	MINI MSCI EMG MKT Sep 18	買建	521	3,094,282,194	3,154,965,255	4.66%

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

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

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

## エマージング債券パッシブ・マザーファンド

平成30年7月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
為替予約取引	-	アメリカ・ドル買/円 売2018年08月	買建	1,500,000	166,646,250	166,500,000	0.15%
		アメリカ・ドル売/円 買2018年08月	売建	1,500,000	166,497,000	166,485,000	0.15%

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

(注2) 為替予約取引の時価は、原則としてわが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しています。  
為替予約取引の数量は、現地通貨建契約金額です。

## (3) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

直近日(平成30年7月末)、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 (分配落) (百万円)	純資産総額 (分配付) (百万円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1特定期間末 (平成29年1月11日)	9	9	0.9976	0.9976
第2特定期間末 (平成29年7月11日)	18,746	18,765	0.9965	0.9975
第3特定期間末 (平成30年1月11日)	53,018	53,070	1.0135	1.0145
第4特定期間末 (平成30年7月11日)	98,029	98,127	1.0000	1.0010
平成29年7月末日	21,556	-	1.0024	-
8月末日	26,367	-	1.0093	-
9月末日	32,013	-	1.0046	-
10月末日	36,622	-	1.0127	-
11月末日	42,004	-	1.0154	-
12月末日	51,105	-	1.0168	-
平成30年1月末日	58,866	-	1.0068	-
2月末日	65,415	-	0.9977	-
3月末日	71,786	-	1.0012	-
4月末日	79,986	-	0.9972	-
5月末日	88,977	-	0.9962	-
6月末日	95,769	-	0.9980	-
7月末日	101,437	-	0.9973	-

## 【分配の推移】

	1口当たりの分配金(円)
第1特定期間	0.0000
第2特定期間	0.0020
第3特定期間	0.0030
第4特定期間	0.0030

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1特定期間	0.2
第2特定期間	0.1
第3特定期間	2.0
第4特定期間	1.0

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

なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

## (4) 【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数
第1特定期間	10,000,000	0
第2特定期間	19,719,276,416	916,562,874
第3特定期間	36,029,714,526	2,529,032,169
第4特定期間	48,369,932,289	2,650,700,181

(注1) 本邦外における設定及び解約はございません。

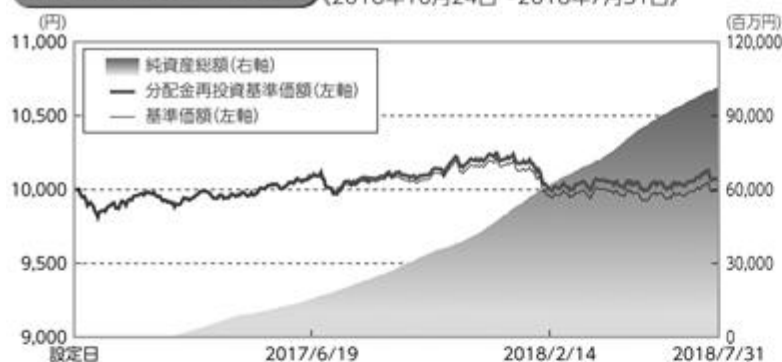
(注2) 第1特定期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

## &lt;&lt; 参考情報 &gt;&gt;

データの基準日:2018年7月31日

## 基準価額・純資産の推移

(2016年10月24日～2018年7月31日)



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。

※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額とは異なります。(設定日:2016年10月24日)

※設定時から10年以上経過した場合は、直近10年分を記載しています。

## 分配の推移(税引前)

第6期 (2017.11.13)	10円
第7期 (2018.01.11)	10円
第8期 (2018.03.12)	10円
第9期 (2018.05.11)	10円
第10期 (2018.07.11)	10円
直近1年間累計	60円
設定来累計	80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です。

順位	銘柄名	比率
1	為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	63.62%
2	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	10.98%
3	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	8.00%
4	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	3.99%
5	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	3.02%
6	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	3.00%
7	J-REITインデックスファンド・マザーファンド	2.51%
8	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	2.48%

## ■国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

## 組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還期限	比率
1	122回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.100000	2019/12/20	1.17%
2	348回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.100000	2027/9/20	0.95%
3	340回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.400000	2025/9/20	0.93%
4	339回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.400000	2025/6/20	0.93%
5	341回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.300000	2025/12/20	0.91%

## ■国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

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

## 組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	業種	比率
1	トヨタ自動車	株式	日本	輸送用機器	3.42%
2	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	日本	銀行業	1.83%
3	ソフトバンクグループ	株式	日本	情報・通信業	1.58%
4	ソニー	株式	日本	電気機器	1.50%
5	日本電信電話	株式	日本	情報・通信業	1.40%

○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。

## ■為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

## 組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還期限	比率
1	US T N/B 0.875 09/15/19	国債証券	アメリカ	0.875000	2019/9/15	0.78%
2	US T N/B 1.375 05/31/20	国債証券	アメリカ	1.375000	2020/5/31	0.74%
3	US T N/B 3.625 02/15/20	国債証券	アメリカ	3.625000	2020/2/15	0.70%
4	US T N/B 1.75 05/31/22	国債証券	アメリカ	1.750000	2022/5/31	0.68%
5	US T N/B 1.625 07/31/20	国債証券	アメリカ	1.625000	2020/7/31	0.67%

## ■外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

## 組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	業種	比率
1	APPLE INC	株式	アメリカ	コンピュータ・周辺機器	2.51%
2	MICROSOFT CORP	株式	アメリカ	ソフトウェア	2.00%
3	AMAZON.COM INC	株式	アメリカ	インターネット販売・通信販売	1.90%
4	FACEBOOK INC	株式	アメリカ	インターネットソフトウェア・サービス	1.06%
5	JPMORGAN CHASE & CO	株式	アメリカ	銀行	1.04%

## ■J-REITインデックスファンド・マザーファンド

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

## 組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	比率
1	日本ビルファンド投資法人	投資証券	日本	6.96%
2	ジャパンリアルエステイト投資法人	投資証券	日本	6.76%
3	野村不動産マスターファンド投資法人	投資証券	日本	5.43%
4	日本リテールファンド投資法人	投資証券	日本	4.45%
5	ユナイテッド・アーバン投資法人	投資証券	日本	4.42%

## ■外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

## 組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	比率
1	SIMON PROPERTY GROUP INC	投資証券	アメリカ	4.66%
2	PROLOGIS INC	投資証券	アメリカ	3.03%
3	PUBLIC STORAGE	投資証券	アメリカ	2.81%
4	UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	投資証券	オランダ	2.61%
5	DIGITAL REALTY TRUST INC	投資証券	アメリカ	2.17%

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

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。



データの基準日:2018年7月31日

## ■エマージング債券パッシブ・マザーファンド

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

## 組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還期限	比率
1	RUSSIAN FEDERATION 5.25 06/23/47	国債証券	ロシア	5.250000	2047/6/23	2.39%
2	RUSSIA FOREIGN BOND 5.0 04/29/20	国債証券	ロシア	5.000000	2020/4/29	1.64%
3	PERU 5.625 11/18/50	国債証券	ペルー	5.625000	2050/11/18	1.59%
4	COLOMBIA 5.0 06/15/45	国債証券	コロンビア	5.000000	2045/6/15	1.54%
5	BRAZIL 4.25 01/07/25	国債証券	ブラジル	4.250000	2025/1/7	1.53%

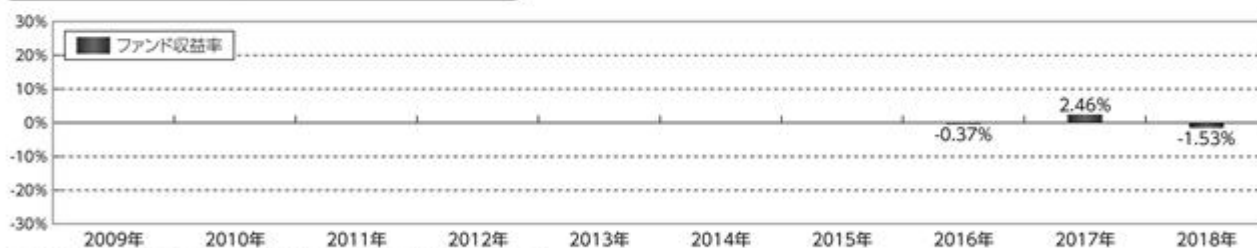
## ■エマージング株式パッシブ・マザーファンド

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

## 組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	業種	比率
1	TENCENT HOLDINGS LTD	株式	ケイマン諸島	インターネットソフトウェア・サービス	4.76%
2	ALIBABA GROUP HOLDING LTD-ADR	株式	ケイマン諸島	インターネットソフトウェア・サービス	3.81%
3	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	株式	韓国	コンピュータ・周辺機器	3.57%
4	TAIWAN SEMICONDUCTOR	株式	台湾	半導体・半導体製造装置	3.52%
5	NASPERS LTD	株式	南アフリカ	メディア	1.97%

## 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。

※2016年は設定日から年末までの収益率、および2018年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

※当ファンドにはベンチマークはありません。

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

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込(販売)手続等】

お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

申込形態について詳しくは販売会社にお問い合わせください。

収益分配金を再投資する場合、取得申込者は販売会社との間で「自動けいぞく投資約款」にしたがって分配金再投資に関する契約を締結します。

なお、販売会社によっては、当該契約または規定について同様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約または規定を使用することがあり、この場合、当該別の名称に読み替えるものとします。

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

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

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

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

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

#### ・お申込価額

お申込日の翌営業日の基準価額とします。

ただし、収益分配金を再投資する場合は、各計算期間終了日の基準価額とします。

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

#### <基準価額の照会方法等>

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

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

#### ・お申込手数料

お申込日の翌営業日の基準価額に、1.08%(税抜1.00%)を上限に各販売会社が定める手数料率を乗じて得た額とします。

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

収益分配金を再投資する場合は、お申込手数料はかかりません。

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

#### ・お申込単位

各販売会社が定める単位とします。

収益分配金を再投資する場合は、1口単位となります。

お申込単位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。

#### ・払込期日

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

## 2【換金(解約)手続等】

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

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

海外休業日には、解約の受付を行いません。

解約の請求を行う受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求にかかるこの信託契約の一部解約を委託会社が行うのと引き換えに、当該一部解約にかかる受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。

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

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

・解約価額

解約価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

当ファンドの解約価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

・解約単位

各販売会社が定める単位とします。

解約単位は販売会社にお問い合わせください。

・解約代金の受渡日

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

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

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

<主な投資対象の時価評価方法の原則>

投資対象	評価方法
マザーファンド 受益証券	計算日の基準価額
公社債等	計算日 における以下のいずれかの価額 <ul style="list-style-type: none"> <li>・日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）</li> <li>・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。）</li> <li>・価格情報会社の提供する価額</li> </ul>
株式	計算日 における金融商品取引所等の最終相場
不動産投資信託証券	計算日 における金融商品取引所等の最終相場
外貨建資産の円換算	計算日の国内における対顧客電信売買相場の仲値
外国為替予約の円換算	計算日の国内における対顧客先物売買相場の仲値

外国で取引されているものについては、計算時に知りうる直近の日

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

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

## (2) 【保管】

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

## (3) 【信託期間】

信託期間は、平成28年10月24日から原則として平成39年7月12日までです。

ただし、下記(5)その他イ.の場合には、信託終了前に信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。また、委託会社は、信託期間満了前に、信託期間の延長が受益者に有利であると認めるときは、受託会社と協議のうえ、信託期間を延長することができます。

## (4) 【計算期間】

a. 計算期間は、原則として毎年1月12日から3月11日まで、3月12日から5月11日まで、5月12日から7月11日まで、7月12日から9月11日まで、9月12日から11月11日まで、11月12日から翌年1月11日までとします。

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

## (5) 【その他】

### イ.償還規定

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

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

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

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

#### ロ. 信託約款の変更等

- a. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、約款を変更することまたはこの信託と他の投資信託との併合(投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。)を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届出ます。なお、約款はa.からg.に定める以外の方法によって変更することができないものとします。
- b. 委託会社は、上記a.の事項(上記a.の変更事項にあつては、その内容が重大なものに該当する場合に限り、上記a.の併合事項にあつては、その併合が受益者の利益におよぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下、「重大な約款の変更等」といいます。)について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、約款にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
- c. 上記b.の書面決議において、受益者(委託会社およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下同じ。)は受益権の

- 口数に応じて、議決権を有し、これを行行使うことができます。なお、知っている受益者が議決権を行行使わないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- d. 上記b.の書面決議は議決権を行行使うことができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- e. 書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。
- f. 上記b.からe.までの規定は、委託会社が重大な約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、約款にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
- g. 上記a.からf.の規定にかかわらず、この信託において併合の書面決議が可決された場合であっても、当該併合にかかる一または複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。
- h. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて約款を変更しようとするときは、上記a.からg.の規定にしたがいます。
- i. この信託は、受益者が一部解約請求を行ったときは、委託会社が信託契約の一部の解約をすることにより当該請求に応じ、当該受益権の公正な価格が当該受益者に一部解約金として支払われることとなる委託者指図型投資信託に該当するため、重大な約款の変更等を行う場合において、投資信託及び投資法人に関する法律第18条第1項に定める反対受益者による受益権買取請求の規定の適用を受けません。

## 八. 関係法人との契約の更改

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

## 二. 公告

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

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

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

## ホ. 運用報告書

- ・ 委託会社は、毎年1月11日、7月11日(休業日の場合は翌営業日とします。)および償還時に交付運用報告書を作成し、販売会社を通じて受益者に対して交付します。
- ・ 運用報告書(全体版)は、委託会社のホームページにおいて開示します。ただし、受益者から運用報告書(全体版)の請求があった場合には、これを交付します。

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

## 4 【受益者の権利等】

### (1) 収益分配金請求権

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

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

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

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

## (2) 償還金請求権

受益者は、持ち分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

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

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドの計算期間は6ヵ月未満であるため、財務諸表は6ヵ月ごとに作成しております。

(3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当特定期間(平成30年1月12日から平成30年7月11日まで)の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

## 1【財務諸表】

## 【リスク抑制世界8資産バランスファンド】

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

	前 期 平成30年1月11日現在	当 期 平成30年7月11日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	3,769,436,580	3,136,499,786
親投資信託受益証券	49,462,214,619	95,044,493,605
派生商品評価勘定	33,680,462	141,851,228
流動資産合計	53,265,331,661	98,322,844,619
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	119,008,010	34,100,658
未払収益分配金	52,313,395	98,032,628
未払解約金	20,612,826	47,791,851
未払受託者報酬	2,383,756	4,923,266
未払委託者報酬	52,442,856	108,312,161
その他未払費用	356,851	402,258
流動負債合計	247,117,694	293,562,822
<b>負債合計</b>		
	247,117,694	293,562,822
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1 52,313,395,899	1 98,032,628,007
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	2 704,818,068	2 3,346,210
(分配準備積立金)	382,054,181	766,544,116
元本等合計	53,018,213,967	98,029,281,797
<b>純資産合計</b>		
	53,018,213,967	98,029,281,797
<b>負債純資産合計</b>		
	53,265,331,661	98,322,844,619

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	前 期 自 平成29年7月12日 至 平成30年1月11日	当 期 自 平成30年1月12日 至 平成30年7月11日
<b>営業収益</b>		
受取利息	823	-
有価証券売買等損益	687,655,928	240,721,014
為替差損益	49,262,167	82,445,259
<b>営業収益合計</b>	<b>638,394,584</b>	<b>158,275,755</b>
<b>営業費用</b>		
支払利息	745,037	1,657,321
受託者報酬	5,539,815	12,140,818
委託者報酬	121,876,913	267,098,856
その他費用	840,998	1,025,398
<b>営業費用合計</b>	<b>129,002,763</b>	<b>281,922,393</b>
営業利益又は営業損失( )	509,391,821	440,198,148
経常利益又は経常損失( )	509,391,821	440,198,148
当期純利益又は当期純損失( )	509,391,821	440,198,148
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( )	10,825,980	6,267,414
期首剰余金又は期首欠損金( )	66,246,543	704,818,068
剰余金増加額又は欠損金減少額	410,596,123	-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	410,596,123	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	19,846,350	24,614,815
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	19,846,350	5,093,475
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	19,521,340
分配金	1 118,251,003	1 249,618,729
期末剰余金又は期末欠損金( )	704,818,068	3,346,210

## (3) 【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引  原則として、わが国における特定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。

## (貸借対照表に関する注記)

項目	前 期 平成30年1月11日現在	当 期 平成30年7月11日現在
1. 1 期首元本額	18,812,713,542円	52,313,395,899円
期中追加設定元本額	36,029,714,526円	48,369,932,289円
期中一部解約元本額	2,529,032,169円	2,650,700,181円
2. 受益権の総数	52,313,395,899口	98,032,628,007口
3. 2 元本の欠損		貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は3,346,210円であります。

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	前 期 自 平成29年7月12日 至 平成30年1月11日	当 期 自 平成30年1月12日 至 平成30年7月11日
1. 1 分配金の計算過程	(自平成29年7月12日 至平成29年9月11日) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(79,191,899円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(54,170,747円)、信託約款に規定される収益調整金(213,962,118円)及び分配準備積立金(101,067,169円)より分配対象収益は448,391,933円(1万口当たり160.50円)であり、うち27,936,843円(1万口当たり10円)を分配金額としております。なお、分配金の計算過程においては、親投資信託の配当等収益及び収益調整金相当額を充当する方法によっております。(以下、各期間において同じ。)	(自平成30年1月12日 至平成30年3月12日) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(125,299,975円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(1,002,695,970円)及び分配準備積立金(377,266,348円)より分配対象収益は1,505,262,293円(1万口当たり221.67円)であり、うち67,905,838円(1万口当たり10円)を分配金額としております。なお、分配金の計算過程においては、親投資信託の配当等収益及び収益調整金相当額を充当する方法によっております。(以下、各期間において同じ。)

<p>(自平成29年9月12日 至平成29年11月13日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(108,220,999円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(52,022,693円)、信託約款に規定される収益調整金(380,104,253円)及び分配準備積立金(201,586,683円)より分配対象収益は741,934,628円(1万口当たり195.24円)であり、うち38,000,765円(1万口当たり10円)を分配金額としております。</p> <p>(自平成29年11月14日 至平成30年1月11日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(118,959,021円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(667,973,730円)及び分配準備積立金(315,408,555円)より分配対象収益は1,102,341,306円(1万口当たり210.72円)であり、うち52,313,395円(1万口当たり10円)を分配金額としております。</p>	<p>(自平成30年3月13日 至平成30年5月11日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(228,676,419円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(1,361,263,445円)及び分配準備積立金(429,928,237円)より分配対象収益は2,019,868,101円(1万口当たり241.38円)であり、うち83,680,263円(1万口当たり10円)を分配金額としております。</p> <p>(自平成30年5月12日 至平成30年7月11日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(296,529,570円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(1,715,139,897円)及び分配準備積立金(568,047,174円)より分配対象収益は2,579,716,641円(1万口当たり263.15円)であり、うち98,032,628円(1万口当たり10円)を分配金額としております。</p>	
--	---	--

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

項目	前 期 自 平成29年7月12日 至 平成30年1月11日	当 期 自 平成30年1月12日 至 平成30年7月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、主要投資対象である親投資信託受益証券が保有する金融商品に係る、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

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

(有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	前期 平成30年1月11日現在	当期 平成30年7月11日現在
	最終計算期間の 損益に含まれた 評価差額（円）	最終計算期間の 損益に含まれた 評価差額（円）
親投資信託受益証券	2,835,388	438,240,103
合計	2,835,388	438,240,103

(デリバティブ取引等に関する注記)

## 通貨関連

種類	前期 平成30年1月11日 現在				当期 平成30年7月11日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
	市場取引以外の取引							
為替予約取引								
売 建	7,711,427,266	-	7,762,627,300	51,200,034	13,213,173,508	-	13,153,658,300	59,515,208
アメリカ・ドル	1,590,092,018	-	1,576,129,100	13,962,918	1,486,497,130	-	1,489,782,000	3,284,870
イギリス・ポンド	2,287,422,220	-	2,305,047,200	17,624,980	3,738,961,140	-	3,709,431,000	29,530,140
オーストラリア・ドル	1,022,385,731	-	1,056,094,200	33,708,469	1,868,614,320	-	1,848,586,500	20,027,820
カナダ・ドル	1,275,965,355	-	1,292,636,800	16,671,445	1,653,765,442	-	1,636,653,600	17,111,842
ユーロ	1,535,561,942	-	1,532,720,000	2,841,942	4,465,335,476	-	4,469,205,200	3,869,724
買 建	3,261,054,514	-	3,226,927,000	34,127,514	4,339,307,738	-	4,387,543,100	48,235,362
アメリカ・ドル	-	-	-	-	984,132,488	-	1,004,248,000	20,115,512
イギリス・ポンド	1,700,726,160	-	1,673,115,200	27,610,960	776,764,500	-	787,116,000	10,351,500
オーストラリア・ドル	100,802,676	-	99,829,800	972,876	391,489,920	-	392,199,000	709,080
カナダ・ドル	673,160,560	-	662,298,800	10,861,760	182,000,070	-	182,692,300	692,230
ユーロ	786,365,118	-	791,683,200	5,318,082	2,004,920,760	-	2,021,287,800	16,367,040
合計	10,972,481,780	-	10,989,554,300	85,327,548	17,552,481,246	-	17,541,201,400	107,750,570



## （注）時価の算定方法

1. 特定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。

特定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。

特定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。

- ・特定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。
- ・特定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. 特定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、特定期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （1口当たり情報に関する注記）

	前 期 平成30年1月11日現在	当 期 平成30年7月11日現在
1口当たり純資産額	1.0135円	1.0000円
（1万口当たり純資産額）	（10,135円）	（10,000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7月11日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	1,115,244,286	2,899,858,192	
	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	5,976,301,988	7,732,139,512	
	J-REITインデックスファンド・マザーファンド	1,303,583,907	2,421,016,032	
	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	698,390,564	2,484,035,558	
	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	3,190,006,461	3,941,571,983	
	為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	46,497,932,113	61,767,853,018	
	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	2,556,846,801	3,016,312,171	
	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	5,911,347,738	10,781,707,139	
親投資信託受益証券 合計		67,249,653,858	95,044,493,605	
合計		67,249,653,858	95,044,493,605	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

(参考)

当ファンドは、「国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド」受益証券、「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「J-REITインデックスファンド・マザーファンド」受益証券、「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「エマージング株式パッシブ・マザーファンド」受益証券及び「エマージング債券パッシブ・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同親投資信託の受益証券であります。

同親投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

「国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位:円)

科 目	注記 番号	平成30年1月11日現在	平成30年7月11日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		9,174,734,961	10,665,436,367
株式	2	312,504,179,760	282,144,702,720
派生商品評価勘定		176,588,080	8,365,980
未収入金		131,159,280	100,920
未収配当金		394,538,223	366,832,129
前払金		-	174,520,000
流動資産合計		322,381,200,304	293,359,958,116
資産合計		322,381,200,304	293,359,958,116
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		706,480	289,828,244
前受金		349,245,000	-
未払解約金		262,677,000	259,340,000
その他未払費用		-	6,516
流動負債合計		612,628,480	549,174,760
負債合計		612,628,480	549,174,760
純資産の部			
元本等			
元本	1	112,835,531,288	112,611,312,358
剰余金			
剰余金又は欠損金( )		208,933,040,536	180,199,470,998
元本等合計		321,768,571,824	292,810,783,356
純資産合計		321,768,571,824	292,810,783,356
負債純資産合計		322,381,200,304	293,359,958,116

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

## （貸借対照表に関する注記）

項目	平成30年1月11日現在	平成30年7月11日現在
1 . 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	122,668,273,869円	112,835,531,288円
同期中追加設定元本額	9,969,103,718円	15,428,145,401円
同期中一部解約元本額	19,801,846,299円	15,652,364,331円
元本の内訳		
ファンド名		
DIAM DC 国内株式インデックスファンド	8,226,196,501円	10,490,531,830円
DIAM国内株式パッシブ・ファンド	1,839,482,555円	1,713,154,194円
MITO ラップ型ファンド（安定型）	4,123,447円	3,224,211円
MITO ラップ型ファンド（中立型）	9,291,815円	7,430,828円
MITO ラップ型ファンド（積極型）	16,267,567円	12,062,772円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	17,474,561円	20,617,488円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	13,210,945円	16,876,583円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	11,886,882円	13,636,876円
たわらノーロード TOPIX	105,629,384円	225,832,229円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	9,120,978円	36,972,701円
たわらノーロード バランス（堅実型）	62,731円	937,272円
たわらノーロード バランス（標準型）	457,256円	6,377,820円

たわらノーロード バランス (積極型)	1,941,760円	19,376,137円
たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(保守型)	14,568円	76,147円
たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(安定型)	18,634円	3,799,772円
たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(安定成長 型)	22,365円	9,844,007円
たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(成長型)	33,208円	8,202,675円
たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(積極型)	44,401円	20,496,624円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(保守型)	- 円	37,020円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定型)	- 円	57,120円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定成長型)	- 円	424,614円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(成長型)	- 円	494,006円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(積極型)	- 円	1,469,719円
D I A M国内株式インデックス ファンド< D C年金>	36,033,477,757円	37,556,666,205円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 1 安定型	755,786,995円	816,478,301円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 2 安定・成長型	2,674,104,581円	2,799,587,690円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 3 成長型	2,772,861,201円	2,935,668,071円
D I A M D C バランス3 0 インデックスファンド	328,683,164円	339,960,129円
D I A M D C バランス5 0 インデックスファンド	1,127,448,779円	1,137,824,023円
D I A M D C バランス7 0 インデックスファンド	1,054,085,428円	1,071,695,738円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型>	47,522,960円	42,726,996円
マネックス資産設計ファンド< 育成型>	1,171,577,546円	1,084,829,283円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	24,024,004円	25,558,900円
D I A M D C 8資産バラ ンスファンド(新興国1 0)	37,610,795円	265,421,853円
D I A M D C 8資産バラ ンスファンド(新興国2 0)	93,210,788円	162,872,234円
D I A M D C 8資産バラ ンスファンド(新興国3 0)	185,672,845円	289,200,624円
投資のソムリエ	2,476,860,905円	2,778,985,406円
クルーズコントロール	2,066,117,052円	748,682,483円
投資のソムリエ< D C年金>	157,129,259円	238,954,842円

D I A M 8 資産バランスファンドN<DC年金>	145,551,548円	180,201,550円
D I A M DC バランス・F(成長型)	190,593,286円	235,254,342円
クルーズコントロール<DC年金>	721,180円	322,728円
D I A Mコア資産設計ファンド(堅実型)	11,905,936円	3,389,986円
D I A Mコア資産設計ファンド(積極型)	27,115,492円	11,950,050円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	41,009,745円	61,660,132円
ダイナミック・ナビゲーションリスク抑制世界8資産バランスファンド	566,776,687円	1,115,244,286円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	507,000円	860,331円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	507,000円	558,617円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	194,381円	298,341円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	467,415円	1,391,944円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	- 円	9,596,986円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	- 円	90,755,943円
D I A Mワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	71,627,508円	71,166,805円
日米資産配分戦略ファンド(インカム重視型)(為替ヘッジあり)(適格機関投資家限定)	- 円	49,226,969円
D I A Mグローバル・バランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	139,026,202円	123,348,352円
D I A Mグローバル・バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	305,156,483円	287,819,155円
D I A M国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	16,481,224円	15,695,993円
D I A M国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	73,774,906円	65,253,990円
D I A M国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	20,065,167円	17,155,486円
D I A M国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	24,943,302円	16,665,826円
D I A M世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	33,391,434円	30,178,653円

D I A M世界バランスファンド 5 0 V A ( 適格機関投資家限 定)	59,453,532円	53,846,130円
D I A Mバランスファンド2 5 V A ( 適格機関投資家限定)	1,110,380,656円	1,046,472,592円
D I A Mバランスファンド3 7 . 5 V A ( 適格機関投資家限 定)	1,056,123,054円	983,224,632円
D I A Mバランスファンド5 0 V A ( 適格機関投資家限定)	2,858,693,114円	2,714,455,678円
D I A Mグローバル・アセッ ト・バランスV A ( 適格機関投 資家限定)	203,597,030円	198,321,837円
D I A Mグローバル・アセッ ト・バランスV A 2 ( 適格機関 投資家限定)	103,572,859円	65,450,833円
D I A M アクサ グローバ ル バランスファンド3 0 V A ( 適格機関投資家限定)	614,329,833円	567,866,288円
D I A M世界アセットバランス ファンドV A ( 適格機関投資家 向け)	1,931,779,617円	825,365,195円
D I A Mグローバル 私募ファ ンド( 適格機関投資家向け)	10,313,671円	10,313,671円
D I A M世界バランスファンド 5 5 V A ( 適格機関投資家限 定)	50,384,094円	10,377,565円
D I A M世界バランスファンド 3 5 V A ( 適格機関投資家限 定)	1,341,418,363円	216,564,142円
D I A M世界アセットバランス ファンド2 V A ( 適格機関投資 家限定)	15,452,034,881円	13,917,581,515円
D I A M世界アセットバランス ファンド4 0 V A ( 適格機関投 資家限定)	551,734,251円	537,147,427円
D I A M世界アセットバランス ファンド2 5 V A ( 適格機関投 資家限定)	1,768,841,652円	1,729,869,171円
D I A M世界アセットバランス ファンド3 V A ( 適格機関投資 家限定)	10,058,436,721円	9,902,704,806円
D I A Mバランス3 0 V A ( 適 格機関投資家限定)	523,029円	3,950,183円
D I A Mバランス5 0 V A ( 適 格機関投資家限定)	9,153,617円	1,486,405円
D I A Mバランス7 0 V A ( 適 格機関投資家限定)	3,719,126円	3,718,648円
D I A M世界アセットバランス ファンド4 V A ( 適格機関投資 家限定)	8,946,206,418円	8,852,811,603円
D I A M世界バランス2 5 V A ( 適格機関投資家限定)	72,553,517円	70,212,939円

	D I A M国内バランス30VA (適格機関投資家限定)	27,930,610円	27,957,494円
	D I A Mバランス20VA(適 格機関投資家限定)	23,981,894円	25,126,872円
	D I A Mバランス40VA(適 格機関投資家限定)	5,401,067円	98,256円
	D I A Mバランス60VA(適 格機関投資家限定)	109,957円	111,158円
	D I A M世界アセットバランス ファンド7VA(1212) (適格機関投資家限定)	477,777,807円	426,902,115円
	D I A M世界アセットバランス ファンド7VA(1303) (適格機関投資家限定)	1,323,021,834円	1,311,785,878円
	D I A M世界アセットバランス ファンド7VA(1306) (適格機関投資家限定)	1,764,382,103円	1,737,262,933円
	D I A M世界アセットバランス ファンド7VA(1309) (適格機関投資家限定)	76,281,237円	73,956,736円
	計	112,835,531,288円	112,611,312,358円
2 .	受益権の総数	112,835,531,288口	112,611,312,358口
3 .	2 差入代用有価証券	株式 3,814,500,000円	株式 3,566,000,000円



## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成29年7月12日 至 平成30年1月11日	自 平成30年1月12日 至 平成30年7月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価の変動によるリスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成30年1月11日現在	平成30年7月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	平成30年1月11日現在	平成30年7月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
株式	60,868,980,291	7,873,464,113
合計	60,868,980,291	7,873,464,113

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成29年2月8日から平成30年1月11日まで及び平成30年2月8日から平成30年7月11日まで）に対応する金額であります。

## （デリバティブ取引等に関する注記）

## 株式関連

種類	平成30年1月11日 現在				平成30年7月11日 現在			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引								
先物取引								
買建	6,418,005,000	-	6,594,000,000	175,995,000	11,943,240,000	-	11,662,000,000	281,240,000
合計	6,418,005,000	-	6,594,000,000	175,995,000	11,943,240,000	-	11,662,000,000	281,240,000

## （注）1．時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （1口当たり情報に関する注記）

	平成30年1月11日現在	平成30年7月11日現在
1口当たり純資産額	2.8517円	2.6002円
（1万口当たり純資産額）	(28,517円)	(26,002円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

平成30年7月11日現在

銘柄	株式数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
極洋	5,200	3,380.00	17,576,000	
日本水産	146,700	516.00	75,697,200	
マルハニチロ	24,700	3,980.00	98,306,000	
ハウスイ	900	1,065.00	958,500	
カネコ種苗	4,400	1,611.00	7,088,400	
サカタのタネ	19,200	4,095.00	78,624,000	
ホクト	13,400	1,940.00	25,996,000	
ホクリヨウ	1,900	846.00	1,607,400	
ヒノキヤグループ	3,300	2,900.00	9,570,000	
ショーボンドホールディングス	12,200	7,730.00	94,306,000	
ミライト・ホールディングス	40,100	1,605.00	64,360,500	
タマホーム	9,900	972.00	9,622,800	
サンヨーホームズ	2,300	1,061.00	2,440,300	
ファーストコーポレーション	4,400	1,066.00	4,690,400	
ベステラ	1,800	1,591.00	2,863,800	
TATERU	11,500	1,550.00	17,825,000	
住石ホールディングス	33,700	146.00	4,920,200	
日鉄鉱業	3,700	5,180.00	19,166,000	
三井松島産業	6,700	1,626.00	10,894,200	
国際石油開発帝石	632,600	1,183.00	748,365,800	
石油資源開発	20,600	2,829.00	58,277,400	
K&Oエナジーグループ	7,600	1,857.00	14,113,200	
ダイセキ環境ソリューション	3,100	1,012.00	3,137,200	
第一カッター興業	1,300	2,400.00	3,120,000	
安藤・間	101,300	1,032.00	104,541,600	
東急建設	50,100	1,104.00	55,310,400	
コムシスホールディングス	45,800	2,771.00	126,911,800	
ミサワホーム	11,000	910.00	10,010,000	
ピーアールホールディングス	13,100	491.00	6,432,100	
高松コンストラクショングループ	8,200	3,180.00	26,076,000	
東建コーポレーション	4,900	8,360.00	40,964,000	
ソネック	1,600	868.00	1,388,800	
ヤマウラ	6,200	877.00	5,437,400	
大成建設	129,500	6,170.00	799,015,000	
大林組	389,800	1,145.00	446,321,000	
清水建設	397,700	1,182.00	470,081,400	
飛鳥建設	119,800	211.00	25,277,800	
長谷工コーポレーション	151,700	1,458.00	221,178,600	
松井建設	14,600	921.00	13,446,600	
銭高組	1,800	5,370.00	9,666,000	
鹿島建設	572,000	857.00	490,204,000	
不動テトラ	99,600	211.00	21,015,600	
大末建設	4,300	1,296.00	5,572,800	

鉄建建設	8,000	2,985.00	23,880,000
西松建設	30,000	3,160.00	94,800,000
三井住友建設	93,700	800.00	74,960,000
大豊建設	48,000	661.00	31,728,000
前田建設工業	92,700	1,280.00	118,656,000
佐田建設	8,700	480.00	4,176,000
ナカノフドー建設	10,100	682.00	6,888,200
奥村組	21,400	3,545.00	75,863,000
東鉄工業	15,700	3,375.00	52,987,500
イチケン	2,400	2,550.00	6,120,000
浅沼組	47,000	401.00	18,847,000
戸田建設	151,000	949.00	143,299,000
熊谷組	20,500	3,930.00	80,565,000
青木あすなろ建設	8,100	992.00	8,035,200
北野建設	27,000	420.00	11,340,000
植木組	1,600	2,625.00	4,200,000
三井ホーム	16,000	672.00	10,752,000
矢作建設工業	18,000	886.00	15,948,000
ピーエス三菱	15,600	635.00	9,906,000
日本ハウスホールディングス	25,100	569.00	14,281,900
大東建託	46,400	18,015.00	835,896,000
新日本建設	15,600	1,226.00	19,125,600
N I P P O	29,900	2,019.00	60,368,100
東亜道路工業	2,700	3,775.00	10,192,500
前田道路	40,500	2,087.00	84,523,500
日本道路	3,500	5,830.00	20,405,000
東亜建設工業	10,700	2,634.00	28,183,800
若築建設	7,100	1,685.00	11,963,500
東洋建設	41,300	476.00	19,658,800
五洋建設	154,700	700.00	108,290,000
世紀東急工業	17,700	709.00	12,549,300
福田組	4,200	6,380.00	26,796,000
日本ドライケミカル	1,500	2,331.00	3,496,500
住友林業	82,700	1,675.00	138,522,500
日本基礎技術	14,700	397.00	5,835,900
日成ビルド工業	19,500	1,150.00	22,425,000
ヤマダ・エスバイエルホーム	60,000	73.00	4,380,000
巴コーポレーション	16,400	468.00	7,675,200
大和ハウス工業	384,100	3,862.00	1,483,394,200
ライト工業	25,300	1,230.00	31,119,000
積水ハウス	422,800	1,901.00	803,742,800
日特建設	11,300	689.00	7,785,700
北陸電気工事	7,300	1,076.00	7,854,800
ユアテック	18,300	867.00	15,866,100
西部電気工業	2,100	3,675.00	7,717,500
四電工	1,900	2,644.00	5,023,600
中電工	16,500	2,800.00	46,200,000
関電工	51,400	1,204.00	61,885,600
きんでん	86,100	1,789.00	154,032,900
東京エネシス	15,000	1,211.00	18,165,000

トーエネック	3,600	3,425.00	12,330,000
住友電設	10,300	1,935.00	19,930,500
日本電設工業	19,800	2,368.00	46,886,400
協和エクシオ	46,700	2,887.00	134,822,900
新日本空調	10,200	1,623.00	16,554,600
日本工営	7,500	2,905.00	21,787,500
N D S	2,000	5,670.00	11,340,000
九電工	25,700	5,130.00	131,841,000
三機工業	27,500	1,082.00	29,755,000
日揮	112,100	2,056.00	230,477,600
中外炉工業	4,000	2,692.00	10,768,000
ヤマト	10,800	692.00	7,473,600
太平電業	8,900	2,778.00	24,724,200
高砂熱学工業	35,500	1,939.00	68,834,500
三晃金属工業	1,500	3,325.00	4,987,500
N E C ネットズエスアイ	12,500	2,389.00	29,862,500
朝日工業社	2,600	3,500.00	9,100,000
明星工業	23,700	800.00	18,960,000
大気社	16,300	3,205.00	52,241,500
ダイダン	8,700	2,322.00	20,201,400
日比谷総合設備	14,700	2,056.00	30,223,200
東芝プラントシステム	28,000	2,550.00	71,400,000
日本製粉	38,300	1,864.00	71,391,200
日清製粉グループ本社	142,600	2,152.00	306,875,200
日東富士製粉	800	4,930.00	3,944,000
昭和産業	10,500	2,738.00	28,749,000
鳥越製粉	10,600	923.00	9,783,800
中部飼料	14,400	1,666.00	23,990,400
フィード・ワン	79,300	217.00	17,208,100
東洋精糖	2,000	1,213.00	2,426,000
日本甜菜製糖	6,700	2,350.00	15,745,000
三井製糖	9,200	3,340.00	30,728,000
塩水港精糖	14,500	254.00	3,683,000
日新製糖	5,600	2,024.00	11,334,400
L I F U L L	39,000	666.00	25,974,000
ジェイエイシーリクルートメント	9,000	2,223.00	20,007,000
日本M&Aセンター	77,000	3,270.00	251,790,000
メンバーズ	2,800	1,442.00	4,037,600
中広	1,200	822.00	986,400
タケエイ	11,600	1,230.00	14,268,000
トラスト・テック	5,100	4,010.00	20,451,000
コシダカホールディングス	30,000	1,485.00	44,550,000
パソナグループ	10,600	1,641.00	17,394,600
C D S	3,000	1,270.00	3,810,000
リンクアンドモチベーション	20,600	1,234.00	25,420,400
G C A	12,800	831.00	10,636,800
エス・エム・エス	44,000	1,915.00	84,260,000
パーソルホールディングス	102,600	2,348.00	240,904,800
リニカル	7,200	2,215.00	15,948,000
クックパッド	35,200	484.00	17,036,800

エスクリ	4,000	785.00	3,140,000
アイ・ケイ・ケイ	6,600	762.00	5,029,200
森永製菓	27,400	4,905.00	134,397,000
中村屋	2,900	4,715.00	13,673,500
江崎グリコ	32,600	4,975.00	162,185,000
名糖産業	5,800	1,692.00	9,813,600
井村屋グループ	4,700	3,360.00	15,792,000
不二家	7,500	2,354.00	17,655,000
山崎製パン	95,300	2,740.00	261,122,000
第一屋製パン	2,000	1,115.00	2,230,000
モロゾフ	1,900	6,560.00	12,464,000
亀田製菓	7,300	5,600.00	40,880,000
寿スピリッツ	11,300	5,150.00	58,195,000
カルビー	53,100	3,980.00	211,338,000
森永乳業	23,400	3,670.00	85,878,000
六甲バター	7,800	2,329.00	18,166,200
ヤクルト本社	67,900	7,140.00	484,806,000
明治ホールディングス	77,100	8,770.00	676,167,000
雪印メグミルク	28,100	2,701.00	75,898,100
プリマハム	82,000	552.00	45,264,000
日本ハム	50,400	4,135.00	208,404,000
林兼産業	4,100	728.00	2,984,800
丸大食品	63,000	475.00	29,925,000
S Foods	8,200	3,930.00	32,226,000
伊藤ハム米久ホールディングス	74,600	883.00	65,871,800
学情	5,100	1,555.00	7,930,500
スタジオアリス	5,600	2,494.00	13,966,400
シミックホールディングス	6,200	2,166.00	13,429,200
システナ	36,800	1,078.00	39,670,400
N J S	2,700	1,735.00	4,684,500
デジタルアーツ	5,700	6,200.00	35,340,000
新日鉄住金ソリューションズ	17,100	2,803.00	47,931,300
総合警備保障	44,200	4,715.00	208,403,000
キューブシステム	6,700	872.00	5,842,400
いちご	164,000	504.00	82,656,000
エイジア	1,700	1,452.00	2,468,400
日本駐車場開発	139,800	182.00	25,443,600
コア	4,900	1,319.00	6,463,100
カカクコム	83,800	2,470.00	206,986,000
アイロムグループ	3,800	1,943.00	7,383,400
セントケア・ホールディング	4,800	682.00	3,273,600
サイネックス	1,600	812.00	1,299,200
ルネサンス	5,500	2,380.00	13,090,000
ディップ	15,800	2,662.00	42,059,600
S B Sホールディングス	11,600	1,200.00	13,920,000
オプトホールディング	7,800	2,474.00	19,297,200
新日本科学	13,700	478.00	6,548,600
ツクイ	26,400	953.00	25,159,200
キャリアデザインセンター	2,600	1,834.00	4,768,400
エムスリー	117,000	4,385.00	513,045,000

ツカダ・グローバルホールディング	9,000	621.00	5,589,000
プラス	600	906.00	543,600
アウトソーシング	33,400	1,932.00	64,528,800
ウェルネット	11,300	1,010.00	11,413,000
ワールドホールディングス	3,700	3,345.00	12,376,500
ディー・エヌ・エー	60,000	2,065.00	123,900,000
博報堂DYホールディングス	154,100	1,678.00	258,579,800
ぐるなび	17,700	823.00	14,567,100
エスアールジータカミヤ	13,300	733.00	9,748,900
ジャパンベストレスキューシステム	8,800	814.00	7,163,200
ファンコミュニケーションズ	31,200	710.00	22,152,000
ライク	4,400	1,635.00	7,194,000
ビジネス・ブレークスルー	5,200	429.00	2,230,800
WDBホールディングス	5,100	3,405.00	17,365,500
ティア	5,900	1,004.00	5,923,600
CDG	1,000	1,601.00	1,601,000
バリューコマース	10,100	1,852.00	18,705,200
インフォマート	56,500	1,469.00	82,998,500
サッポロホールディングス	42,600	2,643.00	112,591,800
アサヒグループホールディングス	244,100	5,464.00	1,333,762,400
麒麟ホールディングス	560,100	2,872.50	1,608,887,250
宝ホールディングス	87,300	1,335.00	116,545,500
オエノンホールディングス	33,500	432.00	14,472,000
養命酒製造	3,500	2,324.00	8,134,000
コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールディングス	81,800	4,245.00	347,241,000
サントリー食品インターナショナル	89,100	4,660.00	415,206,000
ダイドーグループホールディングス	6,000	6,340.00	38,040,000
伊藤園	38,600	4,995.00	192,807,000
キーコーヒー	11,600	2,077.00	24,093,200
ユニカフェ	3,500	1,108.00	3,878,000
ジャパンフーズ	1,800	1,504.00	2,707,200
日清オイリオグループ	13,800	3,105.00	42,849,000
不二製油グループ本社	31,600	3,670.00	115,972,000
かどや製油	1,200	5,810.00	6,972,000
J-オイルミルズ	6,000	3,740.00	22,440,000
ローソン	28,900	6,570.00	189,873,000
サンエー	8,600	5,030.00	43,258,000
カワチ薬品	9,000	2,185.00	19,665,000
エービーシー・マート	20,800	6,150.00	127,920,000
ハードオフコーポレーション	5,100	971.00	4,952,100
高千穂交易	4,500	1,092.00	4,914,000
アスクル	10,000	3,005.00	30,050,000
ゲオホールディングス	21,100	1,388.00	29,286,800
アダストリア	17,700	1,299.00	22,992,300
ジーフット	7,100	761.00	5,403,100
シー・ヴィ・エス・バイエリア	1,500	794.00	1,191,000
伊藤忠食品	2,800	5,600.00	15,680,000
くらコーポレーション	6,700	6,700.00	44,890,000
キャンドウ	5,500	1,672.00	9,196,000



エレマテック	5,300	2,633.00	13,954,900
パルグループホールディングス	5,900	2,650.00	15,635,000
JALUX	3,300	2,786.00	9,193,800
エディオン	44,400	1,112.00	49,372,800
あらた	5,700	5,430.00	30,951,000
サーラコーポレーション	19,900	676.00	13,452,400
ワッツ	4,600	1,033.00	4,751,800
トーメンデバイス	1,700	2,737.00	4,652,900
ハローズ	4,200	2,445.00	10,269,000
J Pホールディングス	35,200	352.00	12,390,400
あみやき亭	2,500	4,505.00	11,262,500
東京エレクトロン デバイス	4,200	1,973.00	8,286,600
ひらまつ	16,000	474.00	7,584,000
フィールズ	8,900	1,156.00	10,288,400
双日	676,500	401.00	271,276,500
アルフレッサ ホールディングス	127,000	2,568.00	326,136,000
大黒天物産	2,700	4,935.00	13,324,500
ハニーズホールディングス	11,200	1,049.00	11,748,800
ファーマライズホールディングス	2,600	644.00	1,674,400
キッコーマン	83,900	5,110.00	428,729,000
味の素	268,100	2,042.00	547,460,200
キュービー	64,900	2,849.00	184,900,100
ハウス食品グループ本社	44,400	3,615.00	160,506,000
カゴメ	46,700	3,460.00	161,582,000
焼津水産化学工業	5,800	1,188.00	6,890,400
アリアケジャパン	10,700	8,850.00	94,695,000
ピエトロ	1,500	1,646.00	2,469,000
エバラ食品工業	2,500	2,225.00	5,562,500
ニチレイ	55,500	2,549.00	141,469,500
横浜冷凍	28,900	980.00	28,322,000
東洋水産	63,900	3,810.00	243,459,000
イトアアンド	3,200	2,002.00	6,406,400
大冷	1,300	1,970.00	2,561,000
ヨシムラ・フード・ホールディングス	1,800	1,027.00	1,848,600
日清食品ホールディングス	45,700	7,390.00	337,723,000
永谷園ホールディングス	12,000	1,429.00	17,148,000
一正蒲鉾	4,400	1,213.00	5,337,200
フジッコ	12,700	2,686.00	34,112,200
ロック・フィールド	12,700	1,774.00	22,529,800
日本たばこ産業	720,900	2,978.50	2,147,200,650
ケンコーマヨネーズ	7,800	3,790.00	29,562,000
わらべや日洋ホールディングス	7,700	2,191.00	16,870,700
なとり	6,600	1,806.00	11,919,600
イフジ産業	2,000	761.00	1,522,000
ピククルスコーポレーション	1,800	2,067.00	3,720,600
北の達人コーポレーション	33,900	806.00	27,323,400
ユーグレナ	45,500	771.00	35,080,500
片倉工業	14,100	1,266.00	17,850,600
グンゼ	9,100	6,570.00	59,787,000
ヒューリック	238,900	1,153.00	275,451,700

神栄	1,500	1,377.00	2,065,500
ラサ商事	5,000	948.00	4,740,000
アルペン	8,700	2,284.00	19,870,800
ハブ	2,200	1,077.00	2,369,400
ラクーン	6,800	532.00	3,617,600
クオール	12,700	1,887.00	23,964,900
アルコニックス	12,300	1,652.00	20,319,600
神戸物産	7,400	5,680.00	42,032,000
ソリトンシステムズ	3,800	994.00	3,777,200
ジーンズ	7,800	6,320.00	49,296,000
ビックカメラ	61,000	1,790.00	109,190,000
DCMホールディングス	61,000	994.00	60,634,000
ペッパーフードサービス	8,300	4,045.00	33,573,500
Monotaro	40,700	5,110.00	207,977,000
東京一番フーズ	2,400	654.00	1,569,600
DDホールディングス	2,600	2,649.00	6,887,400
あいホールディングス	18,400	2,340.00	43,056,000
ディービーエクス	4,100	1,335.00	5,473,500
きちり	3,100	791.00	2,452,100
アークランドサービスホールディングス	9,700	2,000.00	19,400,000
J.フロントリテイリング	136,500	1,597.00	217,990,500
ドトール・日レスホールディングス	20,000	2,026.00	40,520,000
マツモトキヨシホールディングス	47,300	4,745.00	224,438,500
ブロンコビリー	6,000	4,060.00	24,360,000
スタートトゥデイ	112,400	4,600.00	517,040,000
トレジャー・ファクトリー	3,300	660.00	2,178,000
物語コーポレーション	3,300	9,260.00	30,558,000
ココカラファイン	11,900	6,850.00	81,515,000
三越伊勢丹ホールディングス	213,800	1,338.00	286,064,400
東洋紡	44,800	1,765.00	79,072,000
ユニチカ	35,800	607.00	21,730,600
富士紡ホールディングス	6,800	3,515.00	23,902,000
日清紡ホールディングス	70,800	1,162.00	82,269,600
倉敷紡績	122,000	347.00	42,334,000
ダイワボウホールディングス	9,700	5,620.00	54,514,000
シキボウ	6,200	1,282.00	7,948,400
日東紡績	17,400	2,661.00	46,301,400
トヨタ紡織	33,700	2,017.00	67,972,900
マクニカ・富士エレホールディングス	21,900	1,789.00	39,179,100
Hamee	2,900	1,531.00	4,439,900
ラクト・ジャパン	1,600	5,370.00	8,592,000
ウエルシアホールディングス	30,200	5,640.00	170,328,000
クリエイトSDホールディングス	16,800	2,765.00	46,452,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	21,200	1,128.00	23,913,600
八洲電機	9,000	917.00	8,253,000
メディアスホールディングス	6,400	918.00	5,875,200
UKCホールディングス	7,400	2,263.00	16,746,200
ジューテックホールディングス	2,700	1,064.00	2,872,800

丸善CHIホールディングス	13,000	391.00	5,083,000
大光	2,900	721.00	2,090,900
OCHIホールディングス	3,400	1,336.00	4,542,400
TOKAIホールディングス	60,500	1,018.00	61,589,000
ミサワ	1,800	498.00	896,400
ティーライフ	1,600	1,314.00	2,102,400
Cominix	1,700	873.00	1,484,100
エー・ピーカンパニー	2,200	618.00	1,359,600
三洋貿易	6,100	1,984.00	12,102,400
チムニー	3,600	2,793.00	10,054,800
シュッピン	7,000	1,794.00	12,558,000
ビューティガレージ	1,500	2,087.00	3,130,500
ウイン・パートナーズ	8,400	1,507.00	12,658,800
ネクステージ	12,200	1,044.00	12,736,800
ジョイフル本田	33,400	1,576.00	52,638,400
鳥貴族	4,000	2,244.00	8,976,000
キリン堂ホールディングス	4,100	3,110.00	12,751,000
ホットランド	6,700	1,266.00	8,482,200
すかいらーくホールディングス	71,000	1,562.00	110,902,000
綿半ホールディングス	4,300	3,005.00	12,921,500
日本毛織	33,900	995.00	33,730,500
ダイトウボウ	18,800	94.00	1,767,200
トーア紡コーポレーション	5,100	549.00	2,799,900
ダイドーリミテッド	14,100	420.00	5,922,000
ヨシックス	1,900	3,000.00	5,700,000
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	38,000	1,288.00	48,944,000
三栄建築設計	4,600	1,831.00	8,422,600
スター・マイカ	5,600	2,245.00	12,572,000
野村不動産ホールディングス	76,200	2,366.00	180,289,200
三重交通グループホールディングス	23,500	545.00	12,807,500
サムティ	9,800	1,881.00	18,433,800
ディア・ライフ	11,700	481.00	5,627,700
コーセーアールイー	1,900	904.00	1,717,600
エー・ディー・ワークス	153,500	39.00	5,986,500
日本商業開発	6,500	1,822.00	11,843,000
プレサンスコーポレーション	15,900	1,640.00	26,076,000
ユニゾホールディングス	15,700	2,068.00	32,467,600
THEグローバル社	5,300	755.00	4,001,500
日本管理センター	7,600	1,277.00	9,705,200
サンセイランディック	3,400	1,051.00	3,573,400
エストラスト	1,600	890.00	1,424,000
フージャースホールディングス	28,100	794.00	22,311,400
オープンハウス	18,700	5,880.00	109,956,000
東急不動産ホールディングス	276,900	730.00	202,137,000
飯田グループホールディングス	95,400	2,172.00	207,208,800
イーランド	1,400	1,162.00	1,626,800
ムゲンエステート	7,100	1,030.00	7,313,000
帝国繊維	12,800	2,166.00	27,724,800
ブックオフコーポレーション	6,800	770.00	5,236,000

日本コークス工業	99,200	115.00	11,408,000
ゴルフダイジェスト・オンライン	4,700	946.00	4,446,200
ミタチ産業	2,700	820.00	2,214,000
B E E N O S	1,800	1,667.00	3,000,600
あさひ	8,600	1,357.00	11,670,200
日本調剤	4,100	2,812.00	11,529,200
コスモス薬品	5,800	21,620.00	125,396,000
シップヘルスケアホールディングス	23,700	4,305.00	102,028,500
トーエル	5,600	885.00	4,956,000
一六堂	2,500	387.00	967,500
ソフトクリエイイトホールディングス	5,500	1,696.00	9,328,000
オンリー	1,700	890.00	1,513,000
セブン&アイ・ホールディングス	479,200	4,495.00	2,154,004,000
薬王堂	5,000	3,330.00	16,650,000
クリエイイト・レストランツ・ホールディングス	30,900	1,467.00	45,330,300
明治電機工業	4,000	1,810.00	7,240,000
ツルハホールディングス	24,800	13,460.00	333,808,000
デリカフーズホールディングス	2,300	1,505.00	3,461,500
スターティアホールディングス	2,500	689.00	1,722,500
サンマルクホールディングス	8,300	2,549.00	21,156,700
フェリシモ	2,900	1,301.00	3,772,900
トリドールホールディングス	14,200	2,339.00	33,213,800
帝人	99,600	2,007.00	199,897,200
東レ	882,100	856.70	755,695,070
クラレ	204,400	1,494.00	305,373,600
旭化成	758,300	1,406.00	1,066,169,800
サカイオーベックス	3,200	2,295.00	7,344,000
T O K Y O B A S E	7,700	880.00	6,776,000
稲葉製作所	6,600	1,421.00	9,378,600
宮地エンジニアリンググループ	3,300	2,001.00	6,603,300
トーカロ	32,100	1,127.00	36,176,700
アルファ	4,100	1,506.00	6,174,600
S U M C O	105,700	2,272.00	240,150,400
川田テクノロジーズ	2,400	7,020.00	16,848,000
R S T e c h n o l o g i e s	1,800	6,090.00	10,962,000
ピーロット	1,800	1,367.00	2,460,600
ファーストブラザーズ	3,200	1,398.00	4,473,600
ハウズドゥ	3,800	2,283.00	8,675,400
シーアールイー	1,900	2,049.00	3,893,100
ケイアイスター不動産	4,200	2,636.00	11,071,200
住江織物	3,100	2,384.00	7,390,400
日本フェルト	6,400	506.00	3,238,400
イチカワ	8,000	338.00	2,704,000
エコナックホールディングス	21,700	124.00	2,690,800
日東製網	1,400	1,762.00	2,466,800
芦森工業	2,400	2,207.00	5,296,800
アツギ	8,200	1,171.00	9,602,200
ウイルプラスホールディングス	1,100	1,095.00	1,204,500
コメダホールディングス	21,400	2,099.00	44,918,600

サツドラホールディングス	1,900	2,048.00	3,891,200	
ダイユー・リックホールディングス	5,400	1,177.00	6,355,800	
パロックジャパンリミテッド	9,300	971.00	9,030,300	
クスリのアオキホールディングス	9,100	8,770.00	79,807,000	
ダイニック	4,600	993.00	4,567,800	
共和レザー	7,200	956.00	6,883,200	
力の源ホールディングス	2,500	1,408.00	3,520,000	
スシローグローバルホールディングス	12,600	6,670.00	84,042,000	
LIXILピバ	14,600	1,702.00	24,849,200	
セーレン	27,900	1,634.00	45,588,600	
ソトー	4,400	1,002.00	4,408,800	
東海染工	1,700	1,426.00	2,424,200	
小松精練	18,900	925.00	17,482,500	
ワコールホールディングス	33,300	3,055.00	101,731,500	
ホギメディカル	15,300	4,710.00	72,063,000	
レナウン	33,200	138.00	4,581,600	
クラウドシアホールディングス	2,900	581.00	1,684,900	
T S Iホールディングス	42,000	799.00	33,558,000	
マツオカコーポレーション	2,200	3,015.00	6,633,000	
T I S	38,000	5,250.00	199,500,000	
ネオス	3,400	438.00	1,489,200	
電算システム	4,100	2,018.00	8,273,800	
グリー	61,700	592.00	36,526,400	
コーエーテックモホールディングス	19,200	2,084.00	40,012,800	
三菱総合研究所	4,500	5,000.00	22,500,000	
ボルテージ	2,300	767.00	1,764,100	
電算	1,300	2,238.00	2,909,400	
A G S	6,500	843.00	5,479,500	
ファインデックス	9,500	786.00	7,467,000	
ヒト・コミュニケーションズ	2,600	1,881.00	4,890,600	
ブレインパッド	2,500	4,110.00	10,275,000	
K L a b	21,800	1,233.00	26,879,400	
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	8,300	2,369.00	19,662,700	
イーブクイニシアティブジャパン	1,800	1,214.00	2,185,200	
ネクソン	256,100	1,696.00	434,345,600	
アイスタイル	29,200	1,260.00	36,792,000	
エムアップ	3,800	2,149.00	8,166,200	
エイチーム	7,500	2,273.00	17,047,500	
テクノスジャパン	10,400	941.00	9,786,400	
e n i s h	3,900	782.00	3,049,800	
コロブラ	32,800	748.00	24,534,400	
オルトプラス	5,600	645.00	3,612,000	
ブロードリーフ	57,100	624.00	35,630,400	
デジタルハーツホールディングス	6,100	1,491.00	9,095,100	
メディアドゥホールディングス	3,700	2,350.00	8,695,000	
ブイキューブ	7,100	542.00	3,848,200	
サイバーリンクス	1,800	1,007.00	1,812,600	
ディー・エル・イー	7,400	478.00	3,537,200	
フィックスターズ	9,800	1,422.00	13,935,600	

VOYAGE GROUP	5,700	1,165.00	6,640,500
オブティム	2,000	2,837.00	5,674,000
セレス	3,500	1,573.00	5,505,500
特種東海製紙	6,600	4,150.00	27,390,000
ベリサーブ	1,500	3,700.00	5,550,000
ティーガイア	11,400	2,651.00	30,221,400
セック	1,100	2,978.00	3,275,800
日本アジアグループ	12,100	448.00	5,420,800
豆蔵ホールディングス	8,500	1,010.00	8,585,000
テクマトリックス	6,300	1,877.00	11,825,100
プロシップ	1,700	2,474.00	4,205,800
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	309,500	262.00	81,089,000
GMOペイメントゲートウェイ	9,400	13,480.00	126,712,000
ザッパラス	5,500	372.00	2,046,000
システムリサーチ	1,200	3,045.00	3,654,000
インターネットイニシアティブ	18,700	2,103.00	39,326,100
さくらインターネット	13,700	758.00	10,384,600
ヴィンクス	2,400	1,090.00	2,616,000
GMOクラウド	2,600	3,140.00	8,164,000
SRAホールディングス	6,100	3,050.00	18,605,000
MINORIソリューションズ	2,200	1,478.00	3,251,600
システムインテグレータ	1,600	1,000.00	1,600,000
朝日ネット	10,600	501.00	5,310,600
eBASE	2,300	1,701.00	3,912,300
アドソル日進	4,400	1,575.00	6,930,000
フリービット	7,700	1,034.00	7,961,800
コムチュア	5,900	2,714.00	16,012,600
サイバーコム	2,000	1,854.00	3,708,000
インフォテリア	5,700	1,010.00	5,757,000
王子ホールディングス	512,000	662.00	338,944,000
日本製紙	54,100	1,745.00	94,404,500
三菱製紙	17,600	604.00	10,630,400
北越コーポレーション	68,200	596.00	40,647,200
中越パルプ工業	4,900	1,622.00	7,947,800
巴川製紙所	18,000	244.00	4,392,000
大王製紙	48,300	1,516.00	73,222,800
阿波製紙	2,900	628.00	1,821,200
メディカル・データ・ビジョン	8,800	1,542.00	13,569,600
gumi	13,200	685.00	9,042,000
ショーケース・ティービー	2,200	1,173.00	2,580,600
モバイルファクトリー	2,100	1,457.00	3,059,700
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	3,800	1,035.00	3,933,000
PCIホールディングス	1,900	2,965.00	5,633,500
パイブドHD	1,800	1,020.00	1,836,000
アイビーシー	1,200	2,567.00	3,080,400
ネオジャパン	2,000	1,430.00	2,860,000
ランドコンピュータ	1,100	1,162.00	1,278,200
オーブンドア	4,600	2,316.00	10,653,600

マイネット	2,300	1,392.00	3,201,600
アカツキ	3,000	4,020.00	12,060,000
Ubicomホールディングス	1,200	896.00	1,075,200
LINE	34,600	4,965.00	171,789,000
レンゴー	117,400	993.00	116,578,200
トーモク	7,100	1,991.00	14,136,100
ザ・パック	8,700	3,265.00	28,405,500
シンクロ・フード	2,900	875.00	2,537,500
オークネット	3,700	1,797.00	6,648,900
AOI TYO HOLDINGS	9,400	1,554.00	14,607,600
マクロミル	14,400	2,687.00	38,692,800
ビーグリー	2,600	1,432.00	3,723,200
昭和電工	81,000	4,995.00	404,595,000
住友化学	895,000	618.00	553,110,000
住友精化	5,100	5,050.00	25,755,000
日産化学	70,300	5,040.00	354,312,000
ラサ工業	4,400	2,692.00	11,844,800
クレハ	10,500	7,580.00	79,590,000
多木化学	1,600	4,465.00	7,144,000
テイカ	9,400	2,241.00	21,065,400
石原産業	22,100	1,238.00	27,359,800
片倉コープアグリ	3,000	1,149.00	3,447,000
日東エフシー	7,300	760.00	5,548,000
日本曹達	84,000	605.00	50,820,000
東ソー	175,700	1,689.00	296,757,300
トクヤマ	35,300	3,370.00	118,961,000
セントラル硝子	24,800	2,899.00	71,895,200
東亜合成	71,000	1,234.00	87,614,000
大阪ソーダ	11,300	3,340.00	37,742,000
関東電化工業	29,300	905.00	26,516,500
デンカ	44,600	3,550.00	158,330,000
イビデン	71,100	1,721.00	122,363,100
信越化学工業	200,400	10,295.00	2,063,118,000
日本カーバイド工業	3,900	1,930.00	7,527,000
堺化学工業	8,400	2,999.00	25,191,600
エア・ウォーター	100,000	1,979.00	197,900,000
大陽日酸	93,500	1,824.00	170,544,000
日本化学工業	4,600	4,880.00	22,448,000
東邦アセチレン	1,700	1,500.00	2,550,000
日本パーカライジング	62,000	1,588.00	98,456,000
高圧ガス工業	18,100	960.00	17,376,000
チタン工業	1,300	2,445.00	3,178,500
四国化成工業	17,400	1,526.00	26,552,400
戸田工業	2,400	2,781.00	6,674,400
ステラ ケミファ	6,300	3,590.00	22,617,000
保土谷化学工業	4,000	3,150.00	12,600,000
日本触媒	19,100	8,110.00	154,901,000
大日精化工業	9,400	3,395.00	31,913,000
カネカ	164,000	956.00	156,784,000
協和発酵キリン	145,500	2,131.00	310,060,500

三菱瓦斯化学	100,200	2,451.00	245,590,200
三井化学	110,500	2,871.00	317,245,500
J S R	122,300	1,934.00	236,528,200
東京応化工業	21,100	4,045.00	85,349,500
大阪有機化学工業	10,600	1,403.00	14,871,800
三菱ケミカルホールディングス	814,000	936.70	762,473,800
K Hネオケム	18,700	3,320.00	62,084,000
ダイセル	163,800	1,179.00	193,120,200
住友ベークライト	98,000	1,076.00	105,448,000
積水化学工業	248,500	1,896.00	471,156,000
日本ゼオン	102,600	1,384.00	141,998,400
アイカ工業	34,000	3,860.00	131,240,000
宇部興産	61,200	2,882.00	176,378,400
積水樹脂	18,700	2,136.00	39,943,200
タキロンシーアイ	24,900	564.00	14,043,600
旭有機材	7,200	2,140.00	15,408,000
日立化成	60,000	2,156.00	129,360,000
ニチバン	6,100	2,952.00	18,007,200
リケンテクノス	26,600	526.00	13,991,600
大倉工業	5,800	2,313.00	13,415,400
積水化成品工業	15,400	1,086.00	16,724,400
群栄化学工業	2,800	3,315.00	9,282,000
タイガースポリマー	6,100	754.00	4,599,400
ミライアル	4,100	1,120.00	4,592,000
ダイキアクシス	4,100	1,165.00	4,776,500
ダイキョーニシカワ	24,000	1,541.00	36,984,000
竹本容器	1,400	2,754.00	3,855,600
森六ホールディングス	6,200	2,842.00	17,620,400
日本化薬	78,700	1,177.00	92,629,900
カーリットホールディングス	11,400	988.00	11,263,200
E P Sホールディングス	16,900	2,122.00	35,861,800
ソルクシーズ	4,400	1,115.00	4,906,000
レグス	2,800	1,019.00	2,853,200
プレステージ・インターナショナル	23,300	1,379.00	32,130,700
フェイス	3,900	1,368.00	5,335,200
ハイマックス	1,500	1,807.00	2,710,500
アミューズ	7,500	2,826.00	21,195,000
野村総合研究所	72,500	5,430.00	393,675,000
ドリームインキュベータ	3,700	2,057.00	7,610,900
サイバネットシステム	9,400	790.00	7,426,000
クイック	7,000	1,745.00	12,215,000
T A C	6,700	315.00	2,110,500
C Eホールディングス	3,200	758.00	2,425,600
ケネディクス	147,300	631.00	92,946,300
日本システム技術	1,400	1,572.00	2,200,800
電通	135,200	5,000.00	676,000,000
インテージホールディングス	13,500	1,161.00	15,673,500
テイクアンドギヴ・ニーズ	5,200	1,733.00	9,011,600
東邦システムサイエンス	3,800	869.00	3,302,200
ぴあ	3,700	5,580.00	20,646,000



イオンファンタジー	3,600	5,450.00	19,620,000
ソースネクスト	16,200	831.00	13,462,200
シーティーエス	11,100	1,024.00	11,366,400
ネクシィーズグループ	3,700	1,577.00	5,834,900
メディカルシステムネットワーク	13,300	431.00	5,732,300
日本精化	10,200	1,232.00	12,566,400
扶桑化学工業	11,600	2,622.00	30,415,200
トリケミカル研究所	2,800	3,965.00	11,102,000
F I G	9,300	329.00	3,059,700
A D E K A	52,100	1,752.00	91,279,200
日油	46,900	3,600.00	168,840,000
ミヨシ油脂	4,600	1,311.00	6,030,600
新日本理化	19,400	224.00	4,345,600
ハリマ化成グループ	9,600	794.00	7,622,400
花王	285,500	8,071.00	2,304,270,500
第一工業製薬	23,000	706.00	16,238,000
石原ケミカル	2,900	2,085.00	6,046,500
日華化学	3,900	1,112.00	4,336,800
ニイタカ	1,700	1,688.00	2,869,600
三洋化成工業	7,600	5,060.00	38,456,000
武田薬品工業	427,800	4,586.00	1,961,890,800
アステラス製薬	1,141,800	1,748.50	1,996,437,300
大日本住友製薬	86,100	2,360.00	203,196,000
塩野義製薬	163,600	5,516.00	902,417,600
田辺三菱製薬	141,500	1,861.00	263,331,500
わかもと製薬	14,000	281.00	3,934,000
あすか製薬	13,400	1,170.00	15,678,000
日本新薬	30,400	6,030.00	183,312,000
バイオフェルミン製薬	1,900	2,783.00	5,287,700
中外製薬	121,100	5,640.00	683,004,000
科研製薬	20,900	5,500.00	114,950,000
エーザイ	139,000	9,962.00	1,384,718,000
理研ピタミン	4,400	4,085.00	17,974,000
ロート製薬	63,800	3,430.00	218,834,000
小野薬品工業	274,300	2,534.50	695,213,350
久光製薬	34,300	8,270.00	283,661,000
有機合成薬品工業	8,000	256.00	2,048,000
持田製薬	8,000	7,780.00	62,240,000
参天製薬	220,100	1,877.00	413,127,700
扶桑薬品工業	4,000	2,720.00	10,880,000
日本ケミファ	1,500	4,410.00	6,615,000
ツムラ	41,500	3,475.00	144,212,500
日医工	30,600	1,595.00	48,807,000
テルモ	178,000	6,080.00	1,082,240,000
みらかホールディングス	33,200	3,035.00	100,762,000
キッセイ薬品工業	20,400	2,982.00	60,832,800
生化学工業	22,800	1,410.00	32,148,000
栄研化学	18,900	2,318.00	43,810,200
日水製薬	5,000	1,375.00	6,875,000
鳥居薬品	7,300	2,592.00	18,921,600

JCRファーマ	8,200	6,080.00	49,856,000
東和薬品	5,600	5,970.00	33,432,000
富士製薬工業	8,000	1,773.00	14,184,000
沢井製薬	23,400	5,130.00	120,042,000
ゼリア新薬工業	24,900	2,303.00	57,344,700
第一三共	332,300	4,308.00	1,431,548,400
キョーリン製薬ホールディングス	32,300	2,161.00	69,800,300
大幸薬品	6,200	2,042.00	12,660,400
ダイト	6,800	3,025.00	20,570,000
大塚ホールディングス	241,300	4,875.00	1,176,337,500
大正製薬ホールディングス	26,000	12,700.00	330,200,000
ペプチドリーム	53,200	4,270.00	227,164,000
大日本塗料	14,100	1,348.00	19,006,800
日本ペイントホールディングス	93,900	4,500.00	422,550,000
関西ペイント	127,700	2,296.00	293,199,200
神東塗料	9,000	220.00	1,980,000
中国塗料	35,200	1,131.00	39,811,200
日本特殊塗料	7,800	2,187.00	17,058,600
藤倉化成	15,600	624.00	9,734,400
太陽ホールディングス	9,300	4,495.00	41,803,500
DIC	47,900	3,405.00	163,099,500
サカティンクス	24,900	1,479.00	36,827,100
東洋インキSCホールディングス	23,800	2,873.00	68,377,400
T&K TOKA	8,300	1,193.00	9,901,900
アルプス技研	9,800	2,290.00	22,442,000
サニックス	17,800	273.00	4,859,400
ダイオーズ	2,300	1,308.00	3,008,400
日本空調サービス	11,800	798.00	9,416,400
オリエンタルランド	131,100	11,435.00	1,499,128,500
フォーカスシステムズ	6,500	816.00	5,304,000
ダスキン	29,900	2,597.00	77,650,300
パーク24	66,800	3,045.00	203,406,000
明光ネットワークジャパン	14,200	1,256.00	17,835,200
ファルコホールディングス	5,800	1,807.00	10,480,600
クレスコ	2,600	3,150.00	8,190,000
フジ・メディア・ホールディングス	118,200	1,852.00	218,906,400
秀英予備校	2,400	487.00	1,168,800
田谷	2,000	675.00	1,350,000
ラウンドワン	34,500	1,811.00	62,479,500
リゾートトラスト	46,900	1,849.00	86,718,100
オービック	36,000	9,000.00	324,000,000
ジャストシステム	18,700	2,264.00	42,336,800
TDCソフト	5,100	1,584.00	8,078,400
ヤフー	824,900	375.00	309,337,500
ビー・エム・エル	14,400	2,679.00	38,577,600
ワタベウェディング	1,800	555.00	999,000
トレンドマイクロ	55,700	6,160.00	343,112,000
りらいあコミュニケーションズ	17,700	1,525.00	26,992,500
インフォメーション・ディベロプメン ト	3,600	1,269.00	4,568,400

リソー教育	19,000	787.00	14,953,000
日本オラクル	18,500	9,320.00	172,420,000
早稲田アカデミー	1,600	2,271.00	3,633,600
アルファシステムズ	3,700	2,172.00	8,036,400
フューチャー	15,600	1,309.00	20,420,400
CAC Holdings	8,700	1,046.00	9,100,200
ソフトバンク・テクノロジー	4,800	1,523.00	7,310,400
トーセ	3,100	1,031.00	3,196,100
ユー・エス・エス	135,500	2,024.00	274,252,000
オービックビジネスコンサルタント	5,800	7,810.00	45,298,000
伊藤忠テクノソリューションズ	52,100	1,966.00	102,428,600
アイティフォー	13,900	1,251.00	17,388,900
東京個別指導学院	4,000	1,147.00	4,588,000
東計電算	2,000	2,892.00	5,784,000
サイバーエージェント	68,500	6,330.00	433,605,000
楽天	569,700	792.40	451,430,280
エクスネット	1,800	883.00	1,589,400
クリーク・アンド・リバー社	5,800	1,070.00	6,206,000
テー・オー・ダブリュー	10,700	765.00	8,185,500
大塚商会	68,600	4,180.00	286,748,000
総合メディカル	10,100	2,161.00	21,826,100
サイボウズ	15,400	510.00	7,854,000
ソフトブレーン	8,900	543.00	4,832,700
セントラルスポーツ	4,200	4,010.00	16,842,000
パラカ	3,300	2,501.00	8,253,300
電通国際情報サービス	7,100	3,205.00	22,755,500
デジタルガレージ	20,600	4,225.00	87,035,000
イーエムシステムズ	8,000	1,197.00	9,576,000
ウェザーニューズ	3,900	3,270.00	12,753,000
C I J	9,000	637.00	5,733,000
東洋ビジネスエンジニアリング	1,100	1,939.00	2,132,900
日本エンタープライズ	11,700	209.00	2,445,300
WOWOW	5,500	3,390.00	18,645,000
スカラ	9,200	1,224.00	11,260,800
フルキャストホールディングス	9,800	2,598.00	25,460,400
富士フイルムホールディングス	241,100	4,290.00	1,034,319,000
コニカミノルタ	271,200	969.00	262,792,800
資生堂	216,300	8,423.00	1,821,894,900
ライオン	161,800	1,950.00	315,510,000
高砂香料工業	7,200	3,480.00	25,056,000
マンダム	22,600	3,500.00	79,100,000
ミルボン	15,600	4,740.00	73,944,000
ファンケル	28,200	5,840.00	164,688,000
コーセー	19,700	23,020.00	453,494,000
コタ	5,500	1,414.00	7,777,000
シーズ・ホールディングス	14,100	5,010.00	70,641,000
シーボン	1,400	2,830.00	3,962,000
ポーラ・オルビスホールディングス	49,600	4,755.00	235,848,000
ノエビアホールディングス	7,400	7,650.00	56,610,000
アジュバンコスメジャパン	2,700	999.00	2,697,300

エステー	8,400	2,912.00	24,460,800
アグロ カネショウ	4,800	2,633.00	12,638,400
コニシ	19,000	1,718.00	32,642,000
長谷川香料	13,900	2,212.00	30,746,800
星光PMC	6,700	1,026.00	6,874,200
小林製薬	32,500	9,620.00	312,650,000
荒川化学工業	10,600	1,714.00	18,168,400
メック	8,000	2,170.00	17,360,000
日本高純度化学	3,100	2,347.00	7,275,700
タカラバイオ	30,500	2,259.00	68,899,500
JCU	14,200	2,717.00	38,581,400
新田ゼラチン	8,100	775.00	6,277,500
OATアグリオ	1,800	3,495.00	6,291,000
デクセリアルズ	30,100	1,101.00	33,140,100
アース製薬	8,700	5,750.00	50,025,000
北興化学工業	12,100	576.00	6,969,600
大成ラミック	3,500	3,080.00	10,780,000
クミアイ化学工業	52,900	863.00	45,652,700
日本農薬	28,400	681.00	19,340,400
昭和シェル石油	108,500	1,815.00	196,927,500
富士興産	4,500	622.00	2,799,000
ニチレキ	15,000	1,166.00	17,490,000
ユシロ化学工業	6,600	1,601.00	10,566,600
ビービー・カストロール	5,000	1,519.00	7,595,000
富士石油	28,500	401.00	11,428,500
MORESCO	4,300	1,629.00	7,004,700
出光興産	97,500	4,675.00	455,812,500
JXTGホールディングス	1,852,000	794.10	1,470,673,200
コスモエネルギーホールディングス	33,700	4,020.00	135,474,000
横浜ゴム	67,000	2,216.00	148,472,000
東洋ゴム工業	68,800	1,583.00	108,910,400
ブリヂストン	384,200	4,060.00	1,559,852,000
住友ゴム工業	119,300	1,713.00	204,360,900
藤倉ゴム工業	10,300	587.00	6,046,100
オカモト	40,000	1,199.00	47,960,000
アキレス	8,900	2,195.00	19,535,500
フコク	5,200	916.00	4,763,200
ニッタ	11,900	4,050.00	48,195,000
クリエートメディック	3,800	1,322.00	5,023,600
住友理工	22,100	1,094.00	24,177,400
三ツ星ベルト	28,000	1,346.00	37,688,000
バンドー化学	22,000	1,136.00	24,992,000
AGC	117,000	4,300.00	503,100,000
日本板硝子	59,000	1,071.00	63,189,000
石塚硝子	1,600	2,165.00	3,464,000
有沢製作所	19,700	1,133.00	22,320,100
日本山村硝子	49,000	184.00	9,016,000
日本電気硝子	50,200	3,165.00	158,883,000
オハラ	4,600	2,750.00	12,650,000
住友大阪セメント	226,000	542.00	122,492,000

太平洋セメント	73,300	3,565.00	261,314,500
リソルホールディングス	1,200	4,100.00	4,920,000
日本ヒューム	11,800	877.00	10,348,600
日本コンクリート工業	25,300	320.00	8,096,000
三谷セキサン	6,100	2,529.00	15,426,900
アジアパイルホールディングス	15,100	782.00	11,808,200
東海カーボン	105,700	1,946.00	205,692,200
日本カーボン	6,000	5,930.00	35,580,000
東洋炭素	7,600	2,999.00	22,792,400
ノリタケカンパニーリミテド	6,400	5,780.00	36,992,000
TOTO	89,400	5,140.00	459,516,000
日本碍子	141,600	1,898.00	268,756,800
日本特殊陶業	99,600	3,005.00	299,298,000
ダントーホールディングス	9,000	129.00	1,161,000
MARUWA	4,000	9,080.00	36,320,000
品川リフラクトリーズ	3,100	3,760.00	11,656,000
黒崎播磨	2,300	7,200.00	16,560,000
ヨータイ	7,000	684.00	4,788,000
イソライト工業	6,000	621.00	3,726,000
東京窯業	14,900	378.00	5,632,200
ニッカトー	3,900	1,465.00	5,713,500
フジインコーポレーテッド	10,400	2,557.00	26,592,800
クニミネ工業	3,200	1,053.00	3,369,600
エーアンドエーマテリアル	2,600	1,118.00	2,906,800
ニチアス	64,000	1,293.00	82,752,000
新日鐵住金	513,600	2,102.50	1,079,844,000
神戸製鋼所	210,100	1,009.00	211,990,900
中山製鋼所	16,100	623.00	10,030,300
合同製鐵	6,200	2,214.00	13,726,800
ジェイ エフ イー ホールディングス	309,900	2,082.50	645,366,750
日新製鋼	31,700	1,482.00	46,979,400
東京製鐵	61,500	979.00	60,208,500
共英製鋼	13,000	1,927.00	25,051,000
大和工業	24,300	3,290.00	79,947,000
東京鐵鋼	4,800	1,535.00	7,368,000
大阪製鐵	7,400	1,986.00	14,696,400
淀川製鋼所	16,500	2,785.00	45,952,500
丸一鋼管	40,600	3,595.00	145,957,000
モリ工業	3,800	2,892.00	10,989,600
大同特殊鋼	20,300	4,920.00	99,876,000
日本高周波鋼業	4,200	754.00	3,166,800
日本冶金工業	96,000	300.00	28,800,000
山陽特殊製鋼	13,300	2,800.00	37,240,000
愛知製鋼	6,400	4,060.00	25,984,000
日立金属	123,600	1,117.00	138,061,200
日本金属	2,900	1,944.00	5,637,600
大平洋金属	7,100	3,430.00	24,353,000
新日本電工	69,500	310.00	21,545,000
栗本鐵工所	5,900	2,034.00	12,000,600

虹 技	1,700	1,812.00	3,080,400
日本鑄鉄管	12,000	164.00	1,968,000
日本製鋼所	37,500	2,721.00	102,037,500
三菱製鋼	8,600	2,177.00	18,722,200
日亜鋼業	17,200	330.00	5,676,000
日本精線	1,900	4,095.00	7,780,500
大紀アルミニウム工業所	19,100	665.00	12,701,500
日本軽金属ホールディングス	334,700	240.00	80,328,000
三井金属鉱業	31,000	4,225.00	130,975,000
東邦亜鉛	6,400	3,830.00	24,512,000
三菱マテリアル	75,700	2,880.00	218,016,000
住友金属鉱山	146,800	4,108.00	603,054,400
D O W Aホールディングス	29,000	3,335.00	96,715,000
古河機械金属	19,100	1,625.00	31,037,500
エス・サイエンス	55,000	69.00	3,795,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	12,100	1,542.00	18,658,200
東邦チタニウム	20,800	1,006.00	20,924,800
U A C J	17,400	2,307.00	40,141,800
C Kサンエツ	2,200	3,220.00	7,084,000
古河電気工業	38,200	3,725.00	142,295,000
住友電気工業	428,900	1,640.50	703,610,450
フジクラ	138,700	675.00	93,622,500
昭和電線ホールディングス	14,600	667.00	9,738,200
東京特殊電線	1,500	2,672.00	4,008,000
タツタ電線	23,000	556.00	12,788,000
カナレ電気	1,900	2,092.00	3,974,800
平河ヒューテック	5,800	1,317.00	7,638,600
リョービ	14,100	3,455.00	48,715,500
アーレスティ	14,200	932.00	13,234,400
アサヒホールディングス	19,900	2,049.00	40,775,100
東洋製罐グループホールディングス	78,300	1,947.00	152,450,100
ホッカンホールディングス	28,000	353.00	9,884,000
コロナ	6,500	1,219.00	7,923,500
横河ブリッジホールディングス	21,400	2,528.00	54,099,200
O S J Bホールディングス	58,100	276.00	16,035,600
駒井ハルテック	2,500	2,323.00	5,807,500
高田機工	1,100	3,180.00	3,498,000
三和ホールディングス	110,000	1,183.00	130,130,000
文化シャッター	34,000	891.00	30,294,000
三協立山	16,000	1,354.00	21,664,000
アルインコ	8,500	1,026.00	8,721,000
東洋シャッター	2,900	630.00	1,827,000
L I X I Lグループ	169,200	2,296.00	388,483,200
日本フィルコン	9,000	574.00	5,166,000
ノーリツ	25,600	1,757.00	44,979,200
長府製作所	12,800	2,398.00	30,694,400
リンナイ	20,400	9,540.00	194,616,000
ユニプレス	22,400	2,108.00	47,219,200
ダイニチ工業	6,400	792.00	5,068,800
日東精工	16,100	667.00	10,738,700

三洋工業	1,400	2,186.00	3,060,400
岡部	23,500	948.00	22,278,000
ジーテクト	12,700	1,843.00	23,406,100
中国工業	1,700	655.00	1,113,500
東ブレ	21,400	2,728.00	58,379,200
高周波熱錬	22,400	957.00	21,436,800
東京製網	8,300	1,662.00	13,794,600
サンコール	6,600	661.00	4,362,600
モリテックスチール	6,800	530.00	3,604,000
パイオラックス	17,000	2,524.00	42,908,000
エイチワン	11,400	1,179.00	13,440,600
日本発条	113,900	1,046.00	119,139,400
中央発條	1,300	3,675.00	4,777,500
アドバネクス	1,800	1,833.00	3,299,400
三浦工業	49,600	2,616.00	129,753,600
タクマ	38,900	1,313.00	51,075,700
テクノプロ・ホールディングス	21,000	6,570.00	137,970,000
アトラ	1,900	704.00	1,337,600
インターワークス	2,500	998.00	2,495,000
Keeper 技研	3,600	1,156.00	4,161,600
ファーストロジック	1,700	637.00	1,082,900
三機サービス	1,300	2,076.00	2,698,800
Gunosy	5,000	1,520.00	7,600,000
デザインワン・ジャパン	2,200	1,105.00	2,431,000
イー・ガーディアン	5,400	2,729.00	14,736,600
リブセンス	7,100	490.00	3,479,000
ジャパンマテリアル	30,300	1,544.00	46,783,200
ベクトル	13,500	2,116.00	28,566,000
ウチヤマホールディングス	5,600	511.00	2,861,600
ライクキッズネクスト	2,300	1,381.00	3,176,300
キャリアリンク	3,700	512.00	1,894,400
I B J	9,000	622.00	5,598,000
アサンテ	4,100	2,032.00	8,331,200
N・フィールド	6,300	1,607.00	10,124,100
パリュールHR	2,500	1,998.00	4,995,000
M&Aキャピタルパートナーズ	2,800	9,530.00	26,684,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	4,600	1,985.00	9,131,000
ERIホールディングス	3,200	1,081.00	3,459,200
アピスト	1,600	4,560.00	7,296,000
シグマクシス	4,500	1,349.00	6,070,500
ウィルグループ	4,800	1,077.00	5,169,600
エスクロー・エージェント・ジャパン	15,400	400.00	6,160,000
日本ビューホテル	3,600	1,376.00	4,953,600
リクルートホールディングス	856,100	2,950.50	2,525,923,050
エラン	2,700	2,692.00	7,268,400
ツガミ	31,000	983.00	30,473,000
オークマ	13,400	5,830.00	78,122,000
東芝機械	65,000	529.00	34,385,000
アマダホールディングス	176,300	1,058.00	186,525,400

アイダエンジニアリング	29,100	1,031.00	30,002,100
滝澤鉄工所	3,600	1,708.00	6,148,800
F U J I	34,400	1,936.00	66,598,400
牧野フライス製作所	58,000	827.00	47,966,000
オーエスジー	52,700	2,405.00	126,743,500
ダイジェット工業	1,400	1,686.00	2,360,400
旭ダイヤモンド工業	34,500	778.00	26,841,000
D M G 森精機	63,400	1,574.00	99,791,600
ソディック	25,300	948.00	23,984,400
ディスコ	15,500	19,290.00	298,995,000
日東工器	7,100	2,566.00	18,218,600
日進工具	3,100	2,822.00	8,748,200
パンチ工業	9,700	984.00	9,544,800
富士ダイス	4,300	856.00	3,680,800
土木管理総合試験所	3,600	668.00	2,404,800
日本郵政	629,000	1,207.00	759,203,000
ベルシステム24ホールディングス	18,800	1,786.00	33,576,800
鎌倉新書	1,500	3,825.00	5,737,500
一蔵	1,400	805.00	1,127,000
L I T A L I C O	1,900	1,728.00	3,283,200
グローバルグループ	1,200	1,707.00	2,048,400
エポラブルアジア	2,300	2,623.00	6,032,900
ストライク	2,200	3,850.00	8,470,000
ソラスト	20,400	1,095.00	22,338,000
セラク	1,900	831.00	1,578,900
インソース	2,800	2,570.00	7,196,000
豊田自動織機	93,900	5,900.00	554,010,000
豊和工業	6,400	904.00	5,785,600
O K K	4,500	1,096.00	4,932,000
石川製作所	3,000	1,782.00	5,346,000
東洋機械金属	9,100	685.00	6,233,500
津田駒工業	2,700	1,773.00	4,787,100
エンシュウ	30,000	137.00	4,110,000
島精機製作所	14,500	5,600.00	81,200,000
オプトラン	11,200	4,140.00	46,368,000
N C ホールディングス	3,600	724.00	2,606,400
フリー	8,300	923.00	7,660,900
ヤマシンフィルタ	17,700	1,029.00	18,213,300
日阪製作所	16,700	1,017.00	16,983,900
やまびこ	22,300	1,315.00	29,324,500
平田機工	4,300	7,170.00	30,831,000
ペガサスミシン製造	10,900	955.00	10,409,500
ナプテスコ	63,100	3,415.00	215,486,500
三井海洋開発	12,200	2,950.00	35,990,000
レオン自動機	10,300	1,804.00	18,581,200
S M C	36,400	37,710.00	1,372,644,000
新川	9,500	857.00	8,141,500
ホソカワミクロン	4,100	6,470.00	26,527,000
ユニオンツール	5,300	3,555.00	18,841,500
オイレス工業	14,800	2,080.00	30,784,000



日精エー・エス・ビー機械	3,400	5,560.00	18,904,000
サトーホールディングス	15,200	3,165.00	48,108,000
技研製作所	8,000	2,206.00	17,648,000
日本エアーテック	3,900	801.00	3,123,900
カワタ	2,400	1,637.00	3,928,800
日精樹脂工業	9,700	1,220.00	11,834,000
オカダアイヨン	3,900	1,549.00	6,041,100
ワイエイシイホールディングス	3,800	867.00	3,294,600
小松製作所	560,500	3,098.00	1,736,429,000
住友重機械工業	66,300	3,735.00	247,630,500
日立建機	54,200	3,435.00	186,177,000
日工	3,200	2,463.00	7,881,600
巴工業	5,000	2,298.00	11,490,000
井関農機	11,700	1,930.00	22,581,000
TOWA	9,100	1,048.00	9,536,800
丸山製作所	2,500	1,733.00	4,332,500
北川鉄工所	5,600	2,501.00	14,005,600
シンニッタン	18,100	416.00	7,529,600
ローツェ	5,800	2,103.00	12,197,400
タカキタ	4,100	624.00	2,558,400
クボタ	622,500	1,791.00	1,114,897,500
荏原実業	3,400	2,214.00	7,527,600
東洋エンジニアリング	15,500	698.00	10,819,000
三菱化工機	4,100	2,013.00	8,253,300
月島機械	23,000	1,474.00	33,902,000
帝国電機製作所	8,200	1,333.00	10,930,600
東京機械製作所	4,500	412.00	1,854,000
新東工業	27,500	978.00	26,895,000
澁谷工業	10,200	3,440.00	35,088,000
アイチコーポレーション	20,200	650.00	13,130,000
小森コーポレーション	28,900	1,305.00	37,714,500
鶴見製作所	9,700	1,883.00	18,265,100
住友精密工業	19,000	352.00	6,688,000
酒井重工業	2,200	3,470.00	7,634,000
荏原製作所	47,700	3,435.00	163,849,500
石井鐵工所	1,800	1,871.00	3,367,800
西島製作所	12,000	968.00	11,616,000
北越工業	13,200	1,038.00	13,701,600
千代田化工建設	84,800	925.00	78,440,000
ダイキン工業	158,500	12,710.00	2,014,535,000
オルガノ	4,200	2,955.00	12,411,000
トーヨーカネツ	4,700	3,940.00	18,518,000
栗田工業	62,700	3,060.00	191,862,000
椿本チエイン	68,000	912.00	62,016,000
大同工業	4,500	1,189.00	5,350,500
日機装	40,200	1,024.00	41,164,800
木村化工機	9,600	417.00	4,003,200
新興プランテック	25,300	1,055.00	26,691,500
アネスト岩田	19,700	1,120.00	22,064,000
ダイフク	59,100	4,740.00	280,134,000

サムコ	3,200	1,257.00	4,022,400
加藤製作所	5,600	2,829.00	15,842,400
油研工業	2,300	2,395.00	5,508,500
タダノ	56,100	1,348.00	75,622,800
フジテック	35,700	1,422.00	50,765,400
C K D	32,400	1,725.00	55,890,000
キトー	8,900	2,050.00	18,245,000
平和	35,900	2,608.00	93,627,200
理想科学工業	11,500	2,229.00	25,633,500
SANKYO	29,000	4,240.00	122,960,000
日本金銭機械	10,800	1,177.00	12,711,600
マースエンジニアリング	7,400	2,428.00	17,967,200
福島工業	7,200	4,920.00	35,424,000
オーイズミ	4,800	528.00	2,534,400
ダイコク電機	5,400	1,721.00	9,293,400
竹内製作所	19,500	2,572.00	50,154,000
アマノ	35,900	2,523.00	90,575,700
JUKI	17,400	1,057.00	18,391,800
サンデンホールディングス	14,300	1,299.00	18,575,700
蛇の目ミシン工業	10,700	665.00	7,115,500
ブラザー工業	141,600	2,147.00	304,015,200
マックス	17,600	1,334.00	23,478,400
モリタホールディングス	18,500	2,107.00	38,979,500
グローリー	34,600	3,010.00	104,146,000
新晃工業	11,900	1,834.00	21,824,600
大和冷機工業	18,800	1,200.00	22,560,000
セガサミーホールディングス	115,100	1,831.00	210,748,100
日本ピストンリング	4,300	2,157.00	9,275,100
リケン	5,400	5,370.00	28,998,000
T P R	13,000	2,577.00	33,501,000
ツバキ・ナカシマ	11,700	2,605.00	30,478,500
ホシザキ	36,600	10,700.00	391,620,000
大豊工業	9,600	1,178.00	11,308,800
日本精工	238,500	1,129.00	269,266,500
NTN	268,200	450.00	120,690,000
ジェイテクト	123,400	1,468.00	181,151,200
不二越	10,800	5,030.00	54,324,000
ミネベアミツミ	215,600	1,848.00	398,428,800
日本トムソン	37,500	881.00	33,037,500
THK	72,500	3,180.00	230,550,000
ユーシン精機	10,400	1,193.00	12,407,200
前澤給装工業	4,600	2,018.00	9,282,800
イーグル工業	14,400	1,729.00	24,897,600
前澤工業	8,600	438.00	3,766,800
日本ピラー工業	11,900	1,409.00	16,767,100
キッツ	47,200	876.00	41,347,200
日立製作所	2,787,000	779.90	2,173,581,300
三菱電機	1,160,900	1,460.00	1,694,914,000
富士電機	350,000	831.00	290,850,000
東洋電機製造	4,600	1,762.00	8,105,200

安川電機	134,600	4,035.00	543,111,000
シンフォニアテクノロジー	76,000	388.00	29,488,000
明電舎	99,000	388.00	38,412,000
オリジン電気	3,400	2,146.00	7,296,400
山洋電気	5,600	7,480.00	41,888,000
デンヨー	10,800	1,651.00	17,830,800
キャリアインデックス	1,100	3,095.00	3,404,500
MS - Japan	800	7,230.00	5,784,000
船場	1,700	1,137.00	1,932,900
グリーンズ	2,400	1,545.00	3,708,000
日総工産	1,800	6,220.00	11,196,000
キュービーネットホールディングス	5,600	2,036.00	11,401,600
三櫻工業	14,900	682.00	10,161,800
マキタ	151,300	4,930.00	745,909,000
東芝テック	83,000	654.00	54,282,000
芝浦メカトロニクス	17,000	357.00	6,069,000
マブチモーター	32,300	5,190.00	167,637,000
日本電産	139,700	16,655.00	2,326,703,500
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	4,300	2,575.00	11,072,500
トレックス・セミコンダクター	3,300	1,450.00	4,785,000
東光高岳	5,900	1,885.00	11,121,500
ダブル・スコープ	17,000	1,432.00	24,344,000
宮越ホールディングス	4,300	1,205.00	5,181,500
ダイヘン	64,000	663.00	42,432,000
田淵電機	16,300	154.00	2,510,200
ヤーマン	16,900	1,730.00	29,237,000
JVCケンウッド	86,100	299.00	25,743,900
ミマキエンジニアリング	10,500	837.00	8,788,500
第一精工	5,500	1,731.00	9,520,500
日新電機	27,100	979.00	26,530,900
大崎電気工業	25,100	834.00	20,933,400
オムロン	123,400	5,070.00	625,638,000
日東工業	18,800	2,044.00	38,427,200
I D E C	14,500	2,480.00	35,960,000
不二電機工業	1,300	1,408.00	1,830,400
ジーエス・ユアサコーポレーション	209,000	491.00	102,619,000
サクサホールディングス	3,000	2,305.00	6,915,000
メルコホールディングス	5,600	4,075.00	22,820,000
テクノメディカ	2,700	1,972.00	5,324,400
日本電気	149,800	2,973.00	445,355,400
富士通	1,194,000	725.00	865,650,000
沖電気工業	47,000	1,239.00	58,233,000
岩崎通信機	5,200	818.00	4,253,600
電気興業	6,700	3,175.00	21,272,500
サンケン電気	68,000	607.00	41,276,000
ナカヨ	2,200	1,685.00	3,707,000
アイホン	6,700	1,695.00	11,356,500
ルネサスエレクトロニクス	60,100	1,031.00	61,963,100
セイコーエプソン	172,800	1,914.00	330,739,200
ワコム	90,300	561.00	50,658,300

アルバック	26,700	4,250.00	113,475,000
アクセル	4,900	843.00	4,130,700
E I Z O	10,700	4,900.00	52,430,000
ジャパンディスプレイ	240,000	137.00	32,880,000
日本信号	32,200	1,059.00	34,099,800
京三製作所	27,500	713.00	19,607,500
能美防災	15,400	2,230.00	34,342,000
ホーチキ	8,500	2,081.00	17,688,500
エレコム	10,100	2,559.00	25,845,900
パナソニック	1,326,200	1,398.50	1,854,690,700
シャープ	107,800	2,540.00	273,812,000
アンリツ	84,700	1,445.00	122,391,500
富士通ゼネラル	35,500	1,733.00	61,521,500
ソニー	777,100	5,742.00	4,462,108,200
T D K	60,700	11,670.00	708,369,000
帝国通信工業	5,200	1,237.00	6,432,400
タムラ製作所	45,300	699.00	31,664,700
アルプス電気	100,100	3,035.00	303,803,500
池上通信機	37,000	145.00	5,365,000
パイオニア	195,600	146.00	28,557,600
日本電波工業	10,600	509.00	5,395,400
鈴木	5,000	883.00	4,415,000
日本トリム	2,500	4,930.00	12,325,000
ローランド ディー . ジー .	6,000	2,377.00	14,262,000
フォスター電機	13,700	1,531.00	20,974,700
クラリオン	62,000	302.00	18,724,000
S M K	30,000	358.00	10,740,000
ヨコオ	7,600	1,823.00	13,854,800
ティアック	84,000	41.00	3,444,000
ホシデン	29,400	901.00	26,489,400
ヒロセ電機	19,600	13,470.00	264,012,000
日本航空電子工業	30,000	1,770.00	53,100,000
T O A	12,600	1,170.00	14,742,000
マクセルホールディングス	23,200	1,774.00	41,156,800
古野電気	14,000	784.00	10,976,000
ユニデンホールディングス	32,000	317.00	10,144,000
アルパイン	27,600	2,320.00	64,032,000
スミダコーポレーション	12,000	1,252.00	15,024,000
アイコム	6,500	2,585.00	16,802,500
リオン	4,900	2,265.00	11,098,500
本多通信工業	9,100	897.00	8,162,700
船井電機	11,900	661.00	7,865,900
横河電機	116,200	1,947.00	226,241,400
新電元工業	4,100	5,150.00	21,115,000
アズビル	34,700	4,750.00	164,825,000
東亜ディーケーケー	5,800	1,083.00	6,281,400
日本光電工業	48,000	3,135.00	150,480,000
チノー	4,100	1,558.00	6,387,800
共和電業	13,500	405.00	5,467,500
日本電子材料	4,700	722.00	3,393,400

堀場製作所	23,000	7,580.00	174,340,000
アドバンテスト	64,700	2,346.00	151,786,200
小野測器	5,100	760.00	3,876,000
エスベック	10,400	2,194.00	22,817,600
キーエンス	57,000	59,680.00	3,401,760,000
日置電機	6,100	4,710.00	28,731,000
シスメックス	90,400	10,260.00	927,504,000
日本マイクロニクス	19,000	970.00	18,430,000
メガチップス	9,200	2,779.00	25,566,800
OBARA GROUP	6,700	5,940.00	39,798,000
イマジカ・ロボットホールディングス	9,700	869.00	8,429,300
澤藤電機	1,200	2,140.00	2,568,000
デンソー	257,600	5,280.00	1,360,128,000
コーセル	16,300	1,353.00	22,053,900
イリソ電子工業	9,700	6,350.00	61,595,000
新日本無線	7,100	753.00	5,346,300
オプテックスグループ	19,000	3,065.00	58,235,000
千代田インテグレ	5,500	2,350.00	12,925,000
アイ・オー・データ機器	4,900	1,189.00	5,826,100
レーザーテック	23,800	2,994.00	71,257,200
スタンレー電気	88,700	3,615.00	320,650,500
岩崎電気	4,600	1,557.00	7,162,200
ウシオ電機	70,000	1,392.00	97,440,000
岡谷電機産業	6,300	481.00	3,030,300
ヘリオス テクノホールディング	10,000	694.00	6,940,000
日本セラミック	11,900	2,894.00	34,438,600
遠藤照明	6,000	816.00	4,896,000
古河電池	8,400	875.00	7,350,000
双信電機	5,000	498.00	2,490,000
山一電機	8,500	1,417.00	12,044,500
図研	7,700	1,607.00	12,373,900
日本電子	42,000	1,076.00	45,192,000
カシオ計算機	93,400	1,802.00	168,306,800
ファナック	110,300	21,455.00	2,366,486,500
日本シイエムケイ	20,700	699.00	14,469,300
エンプラス	5,300	3,140.00	16,642,000
大真空	4,300	1,218.00	5,237,400
ローム	52,100	9,510.00	495,471,000
浜松ホトニクス	83,300	4,825.00	401,922,500
三井ハイテック	15,400	1,426.00	21,960,400
新光電気工業	43,600	1,003.00	43,730,800
京セラ	190,600	6,149.00	1,171,999,400
協栄産業	1,400	1,981.00	2,773,400
太陽誘電	52,200	3,425.00	178,785,000
村田製作所	121,800	19,500.00	2,375,100,000
ユーシン	17,700	717.00	12,690,900
双葉電子工業	18,900	1,974.00	37,308,600
日東電工	87,700	7,872.00	690,374,400
北陸電気工業	4,700	1,205.00	5,663,500

東海理化電機製作所	30,300	1,988.00	60,236,400	
ニチコン	36,500	1,384.00	50,516,000	
日本ケミコン	9,500	4,630.00	43,985,000	
K O A	16,200	2,841.00	46,024,200	
三井E & Sホールディングス	42,000	1,453.00	61,026,000	
日立造船	91,900	518.00	47,604,200	
三菱重工業	194,400	4,038.00	784,987,200	
川崎重工業	90,300	3,190.00	288,057,000	
I H I	89,200	3,805.00	339,406,000	
名村造船所	35,200	475.00	16,720,000	
サノヤスホールディングス	14,300	222.00	3,174,600	
日本車輛製造	43,000	265.00	11,395,000	
三菱ロジスネクスト	13,800	1,174.00	16,201,200	
近畿車輛	1,800	2,280.00	4,104,000	
F P G	37,000	1,288.00	47,656,000	
島根銀行	2,400	1,230.00	2,952,000	
じもとホールディングス	78,600	151.00	11,868,600	
全国保証	32,300	5,050.00	163,115,000	
めぶきフィナンシャルグループ	594,700	366.00	217,660,200	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	15,600	2,267.00	35,365,200	
九州フィナンシャルグループ	187,800	514.00	96,529,200	
かんぽ生命保険	43,000	2,273.00	97,739,000	
ゆうちょ銀行	323,500	1,272.00	411,492,000	
富山第一銀行	29,600	456.00	13,497,600	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	683,700	551.00	376,718,700	
西日本フィナンシャルホールディングス	73,000	1,233.00	90,009,000	
マーキュリアインベストメント	2,400	1,014.00	2,433,600	
イントラスト	1,800	753.00	1,355,400	
アルヒ	13,100	2,269.00	29,723,900	
日産自動車	1,368,400	1,020.00	1,395,768,000	
いすゞ自動車	336,300	1,411.00	474,519,300	
トヨタ自動車	1,411,200	7,132.00	10,064,678,400	*
日野自動車	165,600	1,168.00	193,420,800	
三菱自動車工業	430,000	868.00	373,240,000	
エフテック	7,500	1,294.00	9,705,000	
レシップホールディングス	4,300	806.00	3,465,800	
G M B	1,900	1,324.00	2,515,600	
ファルテック	2,100	1,127.00	2,366,700	
武蔵精密工業	12,400	3,600.00	44,640,000	
日産車体	45,200	973.00	43,979,600	
新明和工業	50,500	1,260.00	63,630,000	
極東開発工業	21,500	1,800.00	38,700,000	
日信工業	23,700	1,894.00	44,887,800	
トピー工業	9,600	2,858.00	27,436,800	
ティラド	4,300	3,215.00	13,824,500	
曙ブレーキ工業	54,500	251.00	13,679,500	
タチエス	19,700	1,793.00	35,322,100	
N O K	62,000	2,095.00	129,890,000	

フタバ産業	35,800	700.00	25,060,000
K Y B	12,100	4,960.00	60,016,000
市光工業	17,500	1,303.00	22,802,500
大同メタル工業	14,800	1,062.00	15,717,600
プレス工業	62,100	646.00	40,116,600
ミクニ	14,900	566.00	8,433,400
太平洋工業	24,500	1,537.00	37,656,500
ケーヒン	26,600	2,137.00	56,844,200
河西工業	14,400	1,322.00	19,036,800
アイシン精機	95,600	4,925.00	470,830,000
マツダ	364,300	1,317.00	479,783,100
今仙電機製作所	10,900	1,131.00	12,327,900
本田技研工業	1,044,500	3,238.00	3,382,091,000
スズキ	230,100	6,177.00	1,421,327,700
S U B A R U	360,400	3,117.00	1,123,366,800
安永	5,700	1,663.00	9,479,100
ヤマハ発動機	163,900	2,769.00	453,839,100
ショーワ	30,300	1,847.00	55,964,100
小糸製作所	69,600	7,000.00	487,200,000
T B K	14,100	474.00	6,683,400
エクセディ	13,900	3,340.00	46,426,000
ミツバ	21,600	859.00	18,554,400
豊田合成	42,100	2,614.00	110,049,400
愛三工業	20,600	919.00	18,931,400
盟和産業	1,700	1,249.00	2,123,300
日本プラスト	4,800	948.00	4,550,400
ヨロズ	11,900	1,648.00	19,611,200
エフ・シー・シー	19,000	3,185.00	60,515,000
新家工業	2,700	1,964.00	5,302,800
シマノ	46,800	15,910.00	744,588,000
テイ・エス テック	26,900	4,425.00	119,032,500
関西みらいフィナンシャルグループ	49,400	828.00	40,903,200
三十三フィナンシャルグループ	9,700	1,916.00	18,585,200
ジャムコ	5,900	2,371.00	13,988,900
小野建	10,100	1,879.00	18,977,900
はるやまホールディングス	5,500	995.00	5,472,500
ノジマ	20,200	2,243.00	45,308,600
佐島電機	8,500	928.00	7,888,000
カッパ・クリエイト	14,400	1,347.00	19,396,800
エコトレーディング	2,500	682.00	1,705,000
伯東	7,000	1,560.00	10,920,000
コンドーテック	9,200	999.00	9,190,800
中山福	6,400	700.00	4,480,000
ライトオン	9,800	1,050.00	10,290,000
ナガイレーベン	16,500	2,697.00	44,500,500
ジーンズメイト	3,400	610.00	2,074,000
三菱食品	12,200	2,790.00	34,038,000
良品計画	15,200	34,200.00	519,840,000
三城ホールディングス	14,500	461.00	6,684,500
松田産業	8,400	1,600.00	13,440,000

第一興商	16,900	5,240.00	88,556,000
メディバルホールディングス	114,400	2,182.00	249,620,800
アドヴァン	11,800	941.00	11,103,800
S P K	2,400	2,650.00	6,360,000
萩原電気ホールディングス	4,100	2,910.00	11,931,000
アルビス	3,700	3,105.00	11,488,500
アズワン	8,900	7,620.00	67,818,000
スズデン	4,000	1,502.00	6,008,000
尾家産業	3,300	1,354.00	4,468,200
シモジマ	7,100	1,082.00	7,682,200
ドウシシャ	12,200	2,420.00	29,524,000
小津産業	2,500	2,002.00	5,005,000
コナカ	14,900	501.00	7,464,900
高速	6,900	1,253.00	8,645,700
ハウス オブ ローゼ	1,500	1,690.00	2,535,000
G - 7ホールディングス	3,400	2,754.00	9,363,600
たけびし	4,100	1,584.00	6,494,400
イオン北海道	10,600	785.00	8,321,000
コジマ	18,100	565.00	10,226,500
ヒマラヤ	3,200	994.00	3,180,800
コーナン商事	16,300	2,235.00	36,430,500
ネットワンシステムズ	46,600	1,910.00	89,006,000
エコス	4,700	1,815.00	8,530,500
ワタミ	13,700	1,290.00	17,673,000
マルシェ	3,200	807.00	2,582,400
リックス	2,600	1,803.00	4,687,800
システムソフト	27,300	134.00	3,658,200
ドンキホーテホールディングス	74,200	5,290.00	392,518,000
丸文	10,200	802.00	8,180,400
西松屋チェーン	25,300	1,212.00	30,663,600
ゼンショーホールディングス	59,300	2,522.00	149,554,600
ハビネット	7,900	1,418.00	11,202,200
幸楽苑ホールディングス	7,300	1,528.00	11,154,400
ハークスレイ	2,700	1,026.00	2,770,200
橋本総業ホールディングス	2,300	1,680.00	3,864,000
日本ライフライン	32,700	2,812.00	91,952,400
サイゼリヤ	18,900	2,081.00	39,330,900
エクセル	4,600	2,468.00	11,352,800
V Tホールディングス	39,200	526.00	20,619,200
マルカキカイ	3,800	1,799.00	6,836,200
アルゴグラフィックス	5,300	3,400.00	18,020,000
魚力	3,300	1,483.00	4,893,900
I D O M	34,900	587.00	20,486,300
日本エム・ディ・エム	7,700	1,059.00	8,154,300
ポブラ	3,000	791.00	2,373,000
フジ・コーポレーション	2,000	2,629.00	5,258,000
ユナイテッドアローズ	14,200	4,155.00	59,001,000
進和	6,900	2,231.00	15,393,900
エスケイジャパン	2,800	417.00	1,167,600
ダイトロン	5,300	2,055.00	10,891,500



ハイデイ日高	15,100	2,309.00	34,865,900
シークス	14,500	2,387.00	34,611,500
京都きもの友禅	7,300	551.00	4,022,300
コロワイド	38,100	2,746.00	104,622,600
ピーシーデポコーポレーション	17,300	534.00	9,238,200
田中商事	3,700	687.00	2,541,900
オーハシテクニカ	6,600	1,753.00	11,569,800
壱番屋	8,000	4,575.00	36,600,000
白銅	4,200	2,123.00	8,916,600
トップカルチャー	4,100	352.00	1,443,200
P L A N T	2,600	1,281.00	3,330,600
スギホールディングス	25,100	5,940.00	149,094,000
島津製作所	138,700	3,275.00	454,242,500
J M S	10,500	673.00	7,066,500
クボテック	2,500	439.00	1,097,500
長野計器	9,200	1,194.00	10,984,800
ブイ・テクノロジー	2,700	19,810.00	53,487,000
スター精密	18,600	1,753.00	32,605,800
東京計器	7,500	1,104.00	8,280,000
愛知時計電機	1,500	4,200.00	6,300,000
インターアクション	4,700	1,304.00	6,128,800
オーバル	11,200	293.00	3,281,600
東京精密	20,900	3,535.00	73,881,500
マニー	14,100	4,760.00	67,116,000
ニコン	201,900	1,783.00	359,987,700
トプコン	62,300	1,794.00	111,766,200
オリンパス	172,900	4,210.00	727,909,000
理研計器	11,200	2,255.00	25,256,000
S C R E E Nホールディングス	22,000	7,890.00	173,580,000
キヤノン電子	10,500	2,189.00	22,984,500
タムロン	9,500	1,963.00	18,648,500
H O Y A	233,700	6,174.00	1,442,863,800
シード	5,100	2,067.00	10,541,700
ノーリツ鋼機	11,900	1,946.00	23,157,400
エー・アンド・デイ	10,700	932.00	9,972,400
キヤノン	624,600	3,526.00	2,202,339,600
リコー	348,900	996.00	347,504,400
シチズン時計	138,300	687.00	95,012,100
リズム時計工業	4,300	1,986.00	8,539,800
大研医器	10,600	769.00	8,151,400
メニコン	16,000	2,861.00	45,776,000
シンシア	900	643.00	578,700
中本パックス	2,200	1,809.00	3,979,800
スノーピーク	3,600	1,521.00	5,475,600
パラマウントベッドホールディングス	12,200	4,705.00	57,401,000
トランザクション	5,300	908.00	4,812,400
S H O B I	3,900	416.00	1,622,400
ニホンフラッシュ	5,500	2,441.00	13,425,500
前田工織	11,800	1,933.00	22,809,400
永大産業	15,600	507.00	7,909,200

アートネイチャー	12,600	682.00	8,593,200
バンダイナムコホールディングス	120,000	4,390.00	526,800,000
アイフィスジャパン	2,400	705.00	1,692,000
共立印刷	19,800	357.00	7,068,600
S H O E I	5,300	3,790.00	20,087,000
フランスベッドホールディングス	14,000	932.00	13,048,000
マーベラス	19,500	888.00	17,316,000
パイロットコーポレーション	20,200	6,010.00	121,402,000
萩原工業	6,500	1,865.00	12,122,500
エイベックス	21,200	1,460.00	30,952,000
トッパン・フォームズ	24,900	1,107.00	27,564,300
フジシールインターナショナル	26,000	3,910.00	101,660,000
タカラトミー	48,800	868.00	42,358,400
廣済堂	10,900	514.00	5,602,600
A s - m e エステール	3,400	786.00	2,672,400
アーク	59,800	113.00	6,757,400
レック	6,900	4,840.00	33,396,000
タカノ	5,200	993.00	5,163,600
プロネクサス	10,000	1,242.00	12,420,000
ホクシン	8,200	168.00	1,377,600
ウッドワン	3,800	1,310.00	4,978,000
大建工業	9,200	2,317.00	21,316,400
きもと	20,000	276.00	5,520,000
凸版印刷	327,000	820.00	268,140,000
大日本印刷	151,600	2,344.00	355,350,400
図書印刷	7,900	909.00	7,181,100
共同印刷	3,600	2,783.00	10,018,800
N I S S H A	24,000	2,194.00	52,656,000
光村印刷	1,000	2,221.00	2,221,000
藤森工業	9,700	3,600.00	34,920,000
ヴィア・ホールディングス	10,400	726.00	7,550,400
宝印刷	6,200	1,882.00	11,668,400
前澤化成工業	8,100	1,181.00	9,566,100
アシックス	115,400	1,793.00	206,912,200
ツツミ	3,700	1,832.00	6,778,400
ウェーブロックホールディングス	3,000	1,016.00	3,048,000
J S P	6,800	3,055.00	20,774,000
ニチハ	17,500	3,845.00	67,287,500
エフピコ	9,600	6,130.00	58,848,000
小松ウオール工業	4,000	2,050.00	8,200,000
ヤマハ	78,200	5,310.00	415,242,000
河合楽器製作所	3,900	4,805.00	18,739,500
クリナップ	11,000	802.00	8,822,000
ピジョン	70,200	5,660.00	397,332,000
天馬	9,100	1,951.00	17,754,100
兼松サステック	900	1,928.00	1,735,200
キングジム	9,800	970.00	9,506,000
象印マホービン	21,700	1,366.00	29,642,200
リンテック	27,400	3,125.00	85,625,000
信越ポリマー	23,900	1,000.00	23,900,000

東リ	29,400	336.00	9,878,400
イトーキ	24,700	612.00	15,116,400
任天堂	71,500	35,520.00	2,539,680,000
三菱鉛筆	19,100	2,219.00	42,382,900
松風	5,800	1,331.00	7,719,800
タカラスタANDARD	23,600	1,839.00	43,400,400
コクヨ	55,600	1,879.00	104,472,400
ナカバヤシ	11,600	636.00	7,377,600
ニフコ	42,500	3,435.00	145,987,500
立川ブラインド工業	5,100	1,401.00	7,145,100
グロープライド	5,300	3,470.00	18,391,000
オカムラ	40,400	1,553.00	62,741,200
日本バルカー工業	9,500	2,973.00	28,243,500
MUTOHホールディングス	1,600	2,301.00	3,681,600
伊藤忠商事	839,200	1,955.50	1,641,055,600
丸紅	939,400	842.30	791,256,620
スクロール	17,800	542.00	9,647,600
高島	1,900	2,060.00	3,914,000
ヨンドシーホールディングス	11,700	2,409.00	28,185,300
三陽商会	6,400	2,059.00	13,177,600
長瀬産業	68,200	1,734.00	118,258,800
ナイガイ	4,400	518.00	2,279,200
蝶理	7,200	1,876.00	13,507,200
豊田通商	127,600	3,640.00	464,464,000
オンワードホールディングス	70,500	711.00	50,125,500
三共生興	19,800	458.00	9,068,400
兼松	48,700	1,542.00	75,095,400
美津濃	11,500	3,720.00	42,780,000
ツカモトコーポレーション	2,100	1,197.00	2,513,700
ユニー・ファミリーマートホールディングス	36,600	11,030.00	403,698,000
ルックホールディングス	4,200	1,356.00	5,695,200
三井物産	942,000	1,871.00	1,762,482,000
日本紙パルプ商事	6,000	4,620.00	27,720,000
東京エレクトロン	77,400	18,705.00	1,447,767,000
日立ハイテクノロジーズ	39,700	4,415.00	175,275,500
カメイ	14,800	1,424.00	21,075,200
東都水産	1,700	1,885.00	3,204,500
OUGホールディングス	1,800	2,716.00	4,888,800
スターゼン	4,500	5,490.00	24,705,000
セイコーホールディングス	17,900	2,290.00	40,991,000
山善	44,400	1,067.00	47,374,800
椿本興業	2,600	3,450.00	8,970,000
住友商事	721,000	1,837.50	1,324,837,500
日本ユニシス	31,900	2,742.00	87,469,800
内田洋行	5,300	3,505.00	18,576,500
三菱商事	802,300	3,139.00	2,518,419,700
第一実業	5,300	3,305.00	17,516,500
キヤノンマーケティングジャパン	32,700	2,218.00	72,528,600
西華産業	7,100	2,291.00	16,266,100

佐藤商事	10,400	1,194.00	12,417,600
菱洋エレクトロ	10,600	1,760.00	18,656,000
東京産業	11,600	597.00	6,925,200
ユアサ商事	10,900	3,400.00	37,060,000
神鋼商事	2,600	2,803.00	7,287,800
小林産業	7,600	293.00	2,226,800
阪和興業	21,400	4,155.00	88,917,000
正栄食品工業	6,300	3,620.00	22,806,000
カナデン	11,100	1,317.00	14,618,700
菱電商事	8,300	1,747.00	14,500,100
ニプロ	80,300	1,293.00	103,827,900
フルサト工業	6,400	1,720.00	11,008,000
岩谷産業	25,300	3,765.00	95,254,500
すてきナイスグループ	4,800	1,283.00	6,158,400
昭光通商	4,100	877.00	3,595,700
ニチモウ	1,700	1,645.00	2,796,500
極東貿易	17,000	430.00	7,310,000
イワキ	16,300	390.00	6,357,000
兼松エレクトロニクス	7,200	3,620.00	26,064,000
三愛石油	30,600	1,310.00	40,086,000
稲畑産業	27,400	1,579.00	43,264,600
G S Iクレオス	3,100	1,511.00	4,684,100
明和産業	10,700	467.00	4,996,900
キムラタン	55,500	37.00	2,053,500
ゴールドウイン	6,900	8,200.00	56,580,000
ユニ・チャーム	246,200	3,414.00	840,526,800
デサント	27,700	1,832.00	50,746,400
キング	6,200	494.00	3,062,800
ワキタ	24,500	1,247.00	30,551,500
ヤマトインターナショナル	8,100	567.00	4,592,700
東邦ホールディングス	33,700	2,651.00	89,338,700
サンゲツ	37,700	2,166.00	81,658,200
ミツウロコグループホールディングス	16,500	822.00	13,563,000
シナネンホールディングス	4,800	2,736.00	13,132,800
伊藤忠エネクス	24,900	1,058.00	26,344,200
サンリオ	32,000	2,079.00	66,528,000
サンワテクノス	6,800	1,574.00	10,703,200
リョーサン	14,200	3,960.00	56,232,000
新光商事	12,700	1,690.00	21,463,000
トーヨー	5,300	2,450.00	12,985,000
三信電気	10,600	1,885.00	19,981,000
東陽テクニカ	13,400	878.00	11,765,200
モスフードサービス	14,900	3,075.00	45,817,500
加賀電子	10,300	2,602.00	26,800,600
三益半導体工業	8,900	1,828.00	16,269,200
ソーダニッカ	12,000	658.00	7,896,000
立花エレテック	7,800	1,880.00	14,664,000
木曽路	14,100	2,678.00	37,759,800
S R Sホールディングス	13,700	980.00	13,426,000
千趣会	21,000	552.00	11,592,000

タカキュー	9,000	207.00	1,863,000
ケーヨー	21,400	526.00	11,256,400
上新電機	13,500	3,190.00	43,065,000
日本瓦斯	21,100	5,960.00	125,756,000
ロイヤルホールディングス	20,300	2,780.00	56,434,000
東天紅	800	1,753.00	1,402,400
いなげや	12,600	1,753.00	22,087,800
島忠	25,900	3,400.00	88,060,000
チヨダ	13,400	2,170.00	29,078,000
ライフコーポレーション	8,500	2,545.00	21,632,500
リンガーハット	14,300	2,391.00	34,191,300
MrMaxHD	14,500	627.00	9,091,500
テンアライド	10,900	459.00	5,003,100
AOKIホールディングス	22,500	1,532.00	34,470,000
オークワ	16,000	1,026.00	16,416,000
コメリ	17,500	2,679.00	46,882,500
青山商事	21,800	3,530.00	76,954,000
しまむら	13,300	10,030.00	133,399,000
はせがわ	5,900	487.00	2,873,300
高島屋	179,000	917.00	164,143,000
松屋	23,300	1,656.00	38,584,800
エイチ・ツー・オー リテイリング	54,200	1,676.00	90,839,200
近鉄百貨店	4,200	3,805.00	15,981,000
パルコ	10,700	1,181.00	12,636,700
丸井グループ	104,800	2,137.00	223,957,600
クレディセゾン	87,000	1,643.00	142,941,000
アクシアル リテイリング	9,500	4,050.00	38,475,000
井筒屋	6,300	341.00	2,148,300
イオン	439,800	2,182.00	959,643,600
イズミ	20,700	6,330.00	131,031,000
東武ストア	1,300	2,996.00	3,894,800
フォーバル	5,100	866.00	4,416,600
平和堂	23,200	2,672.00	61,990,400
フジ	13,700	1,992.00	27,290,400
ヤオコー	13,000	5,750.00	74,750,000
ゼビオホールディングス	15,500	1,631.00	25,280,500
ケーズホールディングス	100,400	1,227.00	123,190,800
PALTAC	16,000	6,040.00	96,640,000
三谷産業	12,700	328.00	4,165,600
Olympicグループ	6,600	880.00	5,808,000
日産東京販売ホールディングス	17,100	335.00	5,728,500
新生銀行	93,400	1,685.00	157,379,000
あおぞら銀行	68,200	4,170.00	284,394,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	8,017,300	632.90	5,074,149,170
りそなホールディングス	1,257,000	592.90	745,275,300
三井住友トラスト・ホールディングス	225,200	4,368.00	983,673,600
三井住友フィナンシャルグループ	866,800	4,264.00	3,696,035,200
第四銀行	13,900	4,230.00	58,797,000
北越銀行	11,600	2,112.00	24,499,200
千葉銀行	405,700	747.00	303,057,900

群馬銀行	232,000	563.00	130,616,000
武蔵野銀行	18,200	3,075.00	55,965,000
千葉興業銀行	31,800	458.00	14,564,400
筑波銀行	48,200	244.00	11,760,800
七十七銀行	35,800	2,389.00	85,526,200
青森銀行	9,000	3,145.00	28,305,000
秋田銀行	7,400	2,928.00	21,667,200
山形銀行	12,900	2,275.00	29,347,500
岩手銀行	8,000	4,185.00	33,480,000
東邦銀行	101,800	400.00	40,720,000
東北銀行	6,000	1,347.00	8,082,000
みちのく銀行	7,500	1,747.00	13,102,500
ふくおかフィナンシャルグループ	465,000	547.00	254,355,000
静岡銀行	288,200	968.00	278,977,600
十六銀行	15,300	2,700.00	41,310,000
スルガ銀行	117,600	981.00	115,365,600
八十二銀行	207,300	454.00	94,114,200
山梨中央銀行	71,000	395.00	28,045,000
大垣共立銀行	18,100	2,721.00	49,250,100
福井銀行	9,900	2,285.00	22,621,500
北國銀行	12,900	4,245.00	54,760,500
清水銀行	3,800	2,014.00	7,653,200
富山銀行	2,200	3,980.00	8,756,000
滋賀銀行	107,000	566.00	60,562,000
南都銀行	13,400	2,711.00	36,327,400
百五銀行	109,300	426.00	46,561,800
京都銀行	43,800	4,920.00	215,496,000
紀陽銀行	42,900	1,804.00	77,391,600
ほくほくフィナンシャルグループ	75,900	1,450.00	110,055,000
広島銀行	168,600	698.00	117,682,800
山陰合同銀行	67,500	955.00	64,462,500
中国銀行	78,800	1,102.00	86,837,600
鳥取銀行	3,600	1,630.00	5,868,000
伊予銀行	163,100	710.00	115,801,000
百十四銀行	121,000	333.00	40,293,000
四国銀行	17,800	1,254.00	22,321,200
阿波銀行	91,000	660.00	60,060,000
大分銀行	6,700	3,820.00	25,594,000
宮崎銀行	7,700	3,150.00	24,255,000
佐賀銀行	7,100	2,365.00	16,791,500
十八銀行	71,000	274.00	19,454,000
沖縄銀行	11,100	3,905.00	43,345,500
琉球銀行	22,500	1,623.00	36,517,500
セブン銀行	430,100	340.00	146,234,000
みずほフィナンシャルグループ	15,556,900	188.00	2,924,697,200
高知銀行	4,100	1,108.00	4,542,800
山口フィナンシャルグループ	143,000	1,224.00	175,032,000
アクリーティブ	6,300	248.00	1,562,400
芙蓉総合リース	13,100	7,040.00	92,224,000
興銀リース	21,500	2,685.00	57,727,500

東京センチュリー	23,100	5,830.00	134,673,000
SBIホールディングス	129,700	2,674.00	346,817,800
日本証券金融	47,400	575.00	27,255,000
アイフル	194,200	349.00	67,775,800
日本アジア投資	10,400	333.00	3,463,200
長野銀行	3,900	1,782.00	6,949,800
名古屋銀行	9,300	3,915.00	36,409,500
北洋銀行	172,500	373.00	64,342,500
愛知銀行	3,900	4,730.00	18,447,000
中京銀行	4,800	2,313.00	11,102,400
大光銀行	3,800	2,045.00	7,771,000
愛媛銀行	16,200	1,240.00	20,088,000
トマト銀行	4,300	1,411.00	6,067,300
京葉銀行	100,000	461.00	46,100,000
栃木銀行	60,000	368.00	22,080,000
北日本銀行	3,600	2,515.00	9,054,000
東和銀行	20,300	1,049.00	21,294,700
福島銀行	11,000	618.00	6,798,000
大東銀行	5,600	1,133.00	6,344,800
リコーリース	9,000	3,430.00	30,870,000
イオンフィナンシャルサービス	81,300	2,214.00	179,998,200
アコム	231,300	411.00	95,064,300
ジャックス	14,000	2,254.00	31,556,000
オリエントコーポレーション	247,600	145.00	35,902,000
日立キャピタル	31,500	2,817.00	88,735,500
アプラスフィナンシャル	55,800	102.00	5,691,600
オリックス	763,900	1,791.00	1,368,144,900
三菱UFJリース	290,600	653.00	189,761,800
ジャフコ	16,500	4,225.00	69,712,500
九州リースサービス	5,000	743.00	3,715,000
トモニホールディングス	94,600	452.00	42,759,200
大和証券グループ本社	979,000	647.70	634,098,300
野村ホールディングス	1,968,900	535.20	1,053,755,280
岡三証券グループ	98,000	522.00	51,156,000
丸三証券	36,800	995.00	36,616,000
東洋証券	41,000	252.00	10,332,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	126,400	694.00	87,721,600
光世証券	2,800	1,208.00	3,382,400
水戸証券	34,700	389.00	13,498,300
いちよし証券	24,300	1,141.00	27,726,300
松井証券	55,800	1,044.00	58,255,200
SOMPOホールディングス	224,600	4,371.00	981,726,600
だいこう証券ビジネス	5,700	567.00	3,231,900
日本取引所グループ	328,900	1,960.00	644,644,000
マネックスグループ	117,300	602.00	70,614,600
カブドットコム証券	73,400	366.00	26,864,400
極東証券	15,500	1,429.00	22,149,500
岩井コスモホールディングス	11,800	1,431.00	16,885,800
藍澤証券	21,700	772.00	16,752,400

フィデアホールディングス	112,700	163.00	18,370,100
池田泉州ホールディングス	121,900	374.00	45,590,600
アニコムホールディングス	7,900	4,025.00	31,797,500
MS & ADインシュアランスグループ ホールディングス	299,300	3,394.00	1,015,824,200
ソニーフィナンシャルホールディング ス	94,100	2,076.00	195,351,600
マネーパートナーズグループ	14,800	373.00	5,520,400
小林洋行	3,300	284.00	937,200
第一生命ホールディングス	647,900	1,963.00	1,271,827,700
東京海上ホールディングス	431,400	5,223.00	2,253,202,200
アドバンテッジリスクマネジメント	2,800	1,131.00	3,166,800
イー・ギャランティ	6,100	2,030.00	12,383,000
アサックス	4,800	604.00	2,899,200
NECキャピタルソリューション	4,700	1,822.00	8,563,400
T & Dホールディングス	354,100	1,592.00	563,727,200
アドバンスクリエイト	2,700	2,127.00	5,742,900
三井不動産	572,100	2,660.50	1,522,072,050
三菱地所	852,700	1,894.00	1,615,013,800
平和不動産	20,400	1,970.00	40,188,000
東京建物	125,200	1,443.00	180,663,600
ダイビル	29,500	1,080.00	31,860,000
京阪神ビルディング	19,200	862.00	16,550,400
住友不動産	275,000	4,034.00	1,109,350,000
太平洋興発	4,900	926.00	4,537,400
大京	18,100	2,350.00	42,535,000
テーオーシー	39,500	754.00	29,783,000
東京楽天地	1,800	5,300.00	9,540,000
レオパレス21	136,800	593.00	81,122,400
スターツコーポレーション	15,500	2,555.00	39,602,500
フジ住宅	14,800	903.00	13,364,400
空港施設	11,700	603.00	7,055,100
明和地所	6,400	678.00	4,339,200
ゴールドクレスト	9,100	1,747.00	15,897,700
リログループ	60,800	2,841.00	172,732,800
日本エスリード	4,500	1,801.00	8,104,500
日神不動産	15,400	653.00	10,056,200
日本エスコン	20,900	719.00	15,027,100
タカラレーベン	54,200	408.00	22,113,600
サンヨーハウジング名古屋	6,000	1,128.00	6,768,000
イオンモール	73,700	1,939.00	142,904,300
ファースト住建	4,400	1,325.00	5,830,000
ランド	254,500	13.00	3,308,500
カチタス	15,700	4,180.00	65,626,000
東祥	6,900	4,135.00	28,531,500
トーセイ	14,100	1,036.00	14,607,600
穴吹興産	1,200	3,015.00	3,618,000
エヌ・ティ・ティ都市開発	71,100	1,110.00	78,921,000
サンフロンティア不動産	14,000	1,226.00	17,164,000
エフ・ジェー・ネクスト	8,900	986.00	8,775,400



インテリックス	3,300	904.00	2,983,200
ランドビジネス	6,900	317.00	2,187,300
グランディハウス	10,200	487.00	4,967,400
東武鉄道	122,300	3,180.00	388,914,000
相鉄ホールディングス	36,800	3,320.00	122,176,000
東京急行電鉄	315,100	1,802.00	567,810,200
京浜急行電鉄	159,200	1,685.00	268,252,000
小田急電鉄	172,500	2,228.00	384,330,000
京王電鉄	64,800	5,130.00	332,424,000
京成電鉄	80,800	3,570.00	288,456,000
富士急行	15,900	3,145.00	50,005,500
新京成電鉄	3,100	2,100.00	6,510,000
東日本旅客鉄道	208,500	10,035.00	2,092,297,500
西日本旅客鉄道	104,800	7,738.00	810,942,400
東海旅客鉄道	104,000	21,840.00	2,271,360,000
西武ホールディングス	148,000	1,795.00	265,660,000
鴻池運輸	16,300	1,646.00	26,829,800
西日本鉄道	32,000	2,803.00	89,696,000
ハマキョウレックス	8,300	3,045.00	25,273,500
サカイ引越センター	6,100	5,310.00	32,391,000
近鉄グループホールディングス	109,600	4,260.00	466,896,000
阪急阪神ホールディングス	146,500	4,220.00	618,230,000
南海電気鉄道	52,000	2,912.00	151,424,000
京阪ホールディングス	48,800	3,870.00	188,856,000
神戸電鉄	2,600	3,920.00	10,192,000
名古屋鉄道	87,500	2,712.00	237,300,000
山陽電気鉄道	8,600	2,598.00	22,342,800
トランコム	3,100	7,230.00	22,413,000
日本通運	43,100	7,140.00	307,734,000
ヤマトホールディングス	192,800	2,985.50	575,604,400
山九	28,200	5,590.00	157,638,000
日新	9,500	2,370.00	22,515,000
丸運	6,000	339.00	2,034,000
丸全昭和運輸	39,000	495.00	19,305,000
センコーグループホールディングス	66,100	823.00	54,400,300
トナミホールディングス	2,700	5,930.00	16,011,000
ニッコンホールディングス	41,500	2,788.00	115,702,000
日本石油輸送	1,300	3,035.00	3,945,500
福山通運	16,100	5,530.00	89,033,000
セイノーホールディングス	82,400	1,885.00	155,324,000
エスライン	3,000	1,056.00	3,168,000
神奈川中央交通	2,800	3,710.00	10,388,000
日立物流	24,100	2,692.00	64,877,200
丸和運輸機関	5,800	3,680.00	21,344,000
C & F ロジホールディングス	12,200	1,274.00	15,542,800
日本郵船	91,900	2,095.00	192,530,500
商船三井	69,500	2,616.00	181,812,000
川崎汽船	50,800	1,867.00	94,843,600
NSユナイテッド海運	5,200	2,091.00	10,873,200
明治海運	12,000	380.00	4,560,000

飯野海運	56,600	491.00	27,790,600
共栄タンカー	800	1,725.00	1,380,000
九州旅客鉄道	92,200	3,255.00	300,111,000
S Gホールディングス	104,000	2,261.00	235,144,000
日本航空	201,300	3,893.00	783,660,900
A N Aホールディングス	213,600	3,957.00	845,215,200
パスコ	11,000	281.00	3,091,000
西本W i s m e t t a cホールディングス	3,100	5,190.00	16,089,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	900	1,600.00	1,440,000
Genky Drug Stores	4,500	4,220.00	18,990,000
三菱倉庫	38,000	2,360.00	89,680,000
三井倉庫ホールディングス	64,000	332.00	21,248,000
住友倉庫	75,000	675.00	50,625,000
澁澤倉庫	6,200	1,584.00	9,820,800
ヤマタネ	5,800	2,137.00	12,394,600
東陽倉庫	20,200	330.00	6,666,000
乾汽船	8,600	1,032.00	8,875,200
日本トランスシティ	27,000	481.00	12,987,000
ケイヒン	2,100	1,566.00	3,288,600
中央倉庫	6,900	1,157.00	7,983,300
川西倉庫	2,200	1,663.00	3,658,600
安田倉庫	10,000	866.00	8,660,000
東洋埠頭	3,200	1,667.00	5,334,400
宇徳	9,400	471.00	4,427,400
上組	67,600	2,223.00	150,274,800
サンリツ	2,800	747.00	2,091,600
キムラユニティー	3,100	1,102.00	3,416,200
キューソー流通システム	3,300	2,967.00	9,791,100
近鉄エクスプレス	20,800	2,100.00	43,680,000
東海運	6,100	338.00	2,061,800
エーアイテイー	8,000	1,035.00	8,280,000
内外トランスライン	3,900	1,372.00	5,350,800
日本コンセプト	2,200	1,331.00	2,928,200
東京放送ホールディングス	62,900	2,331.00	146,619,900
日本テレビホールディングス	104,300	1,805.00	188,261,500
朝日放送グループホールディングス	11,500	788.00	9,062,000
テレビ朝日ホールディングス	31,300	2,246.00	70,299,800
スカパーJ S A Tホールディングス	86,200	537.00	46,289,400
テレビ東京ホールディングス	9,400	3,205.00	30,127,000
日本B S放送	3,900	1,287.00	5,019,300
ビジョン	3,000	4,185.00	12,555,000
U S E N - N E X T H O L D I N G S	2,900	1,379.00	3,999,100
ワイヤレスゲート	5,400	1,213.00	6,550,200
コネクシオ	8,100	1,856.00	15,033,600
日本通信	103,800	159.00	16,504,200
クロップス	2,400	825.00	1,980,000
日本電信電話	817,500	5,049.00	4,127,557,500
K D D I	1,003,900	3,096.00	3,108,074,400

光通信	13,800	19,300.00	266,340,000
NTTドコモ	817,600	2,816.00	2,302,361,600
エムティーアイ	14,300	588.00	8,408,400
GMOインターネット	41,700	2,461.00	102,623,700
アイドママーケティングコミュニケーション	1,800	913.00	1,643,400
カドカワ	33,500	1,176.00	39,396,000
学研ホールディングス	3,900	4,445.00	17,335,500
ゼンリン	20,800	2,643.00	54,974,400
昭文社	5,400	728.00	3,931,200
インプレスホールディングス	9,500	160.00	1,520,000
東京電力ホールディングス	927,200	518.00	480,289,600
中部電力	355,200	1,675.50	595,137,600
関西電力	473,700	1,550.00	734,235,000
中国電力	159,600	1,425.00	227,430,000
北陸電力	114,000	1,086.00	123,804,000
東北電力	271,800	1,323.00	359,591,400
四国電力	104,500	1,456.00	152,152,000
九州電力	256,300	1,245.00	319,093,500
北海道電力	116,700	693.00	80,873,100
沖縄電力	23,500	2,365.00	55,577,500
電源開発	92,300	2,916.00	269,146,800
エフオン	7,000	1,243.00	8,701,000
イーレックス	18,500	1,101.00	20,368,500
レノバ	6,000	1,542.00	9,252,000
東京瓦斯	247,700	2,873.50	711,765,950
大阪瓦斯	225,100	2,232.00	502,423,200
東邦瓦斯	57,500	3,940.00	226,550,000
北海道瓦斯	32,000	307.00	9,824,000
広島ガス	24,400	372.00	9,076,800
西部瓦斯	13,900	2,742.00	38,113,800
静岡ガス	33,000	1,052.00	34,716,000
メタウォーター	6,600	3,210.00	21,186,000
アイネット	6,500	1,916.00	12,454,000
松竹	7,500	14,680.00	110,100,000
東宝	74,800	3,410.00	255,068,000
エイチ・アイ・エス	17,300	3,000.00	51,900,000
東映	4,200	10,590.00	44,478,000
ラックランド	2,200	2,726.00	5,997,200
エヌ・ティ・ティ・データ	354,700	1,243.00	440,892,100
共立メンテナンス	19,800	5,670.00	112,266,000
イチネンホールディングス	12,600	1,330.00	16,758,000
建設技術研究所	7,800	1,466.00	11,434,800
スペース	7,300	1,309.00	9,555,700
長大	3,300	887.00	2,927,100
アインホールディングス	15,300	8,010.00	122,553,000
燦ホールディングス	2,600	2,414.00	6,276,400
ピー・シー・エー	1,700	1,645.00	2,796,500
スバル興業	800	6,290.00	5,032,000
東京テアトル	4,700	1,400.00	6,580,000

タナベ経営	2,100	2,133.00	4,479,300	
ビジネスブレイン太田昭和	2,000	2,085.00	4,170,000	
ナガワ	2,200	4,460.00	9,812,000	
よみうりランド	2,400	4,455.00	10,692,000	
東京都競馬	8,300	4,365.00	36,229,500	
常磐興産	4,500	1,806.00	8,127,000	
カナモト	16,900	3,515.00	59,403,500	
東京ドーム	44,600	923.00	41,165,800	
D T S	11,900	4,080.00	48,552,000	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	53,000	5,130.00	271,890,000	
シーイーシー	6,900	3,960.00	27,324,000	
カブコン	48,900	2,496.00	122,054,400	
西尾レントオール	11,300	3,635.00	41,075,500	
アイ・エス・ピー	2,200	1,749.00	3,847,800	
アゴーラ・ホスピタリティー・グループ	62,000	32.00	1,984,000	
日本空港ビルデング	33,500	4,865.00	162,977,500	
トランス・コスモス	12,500	2,524.00	31,550,000	
乃村工藝社	26,100	2,267.00	59,168,700	
ジャステック	6,700	1,002.00	6,713,400	
S C S K	26,400	4,955.00	130,812,000	
藤田観光	4,500	3,040.00	13,680,000	
K N T - C Tホールディングス	7,000	1,465.00	10,255,000	
日本管財	11,900	2,072.00	24,656,800	
トーカイ	10,800	2,342.00	25,293,600	
白洋舎	1,200	3,155.00	3,786,000	
セコム	117,800	8,325.00	980,685,000	
日本システムウエア	3,800	2,072.00	7,873,600	
セントラル警備保障	5,400	4,345.00	23,463,000	
アイネス	14,600	1,042.00	15,213,200	
丹青社	22,900	1,366.00	31,281,400	
メイテック	13,000	5,210.00	67,730,000	
T K C	9,700	3,880.00	37,636,000	
富士ソフト	15,900	4,495.00	71,470,500	
応用地質	12,200	1,398.00	17,055,600	
船井総研ホールディングス	23,200	2,307.00	53,522,400	
N S D	18,900	2,440.00	46,116,000	
進学会ホールディングス	5,000	569.00	2,845,000	
丸紅建材リース	11,000	243.00	2,673,000	
オオバ	8,800	625.00	5,500,000	
コナミホールディングス	46,600	5,310.00	247,446,000	
いであ	2,200	1,063.00	2,338,600	
学究社	3,100	1,734.00	5,375,400	
ベネッセホールディングス	40,500	3,920.00	158,760,000	
イオンディライト	13,700	3,930.00	53,841,000	
ナック	7,600	937.00	7,121,200	
福井コンピュータホールディングス	3,400	1,740.00	5,916,000	
ニチイ学館	21,200	1,185.00	25,122,000	
ダイセキ	18,600	3,000.00	55,800,000	

ステップ	4,100	1,566.00	6,420,600
日鉄住金物産	8,800	5,550.00	48,840,000
泉州電業	3,800	3,010.00	11,438,000
元気寿司	2,900	3,380.00	9,802,000
トラスコ中山	23,900	2,617.00	62,546,300
ヤマダ電機	382,700	553.00	211,633,100
オートバックスセブン	45,200	1,886.00	85,247,200
モリト	9,300	950.00	8,835,000
アークランドサカモト	19,400	1,554.00	30,147,600
ニトリホールディングス	45,400	16,675.00	757,045,000
グルメ杵屋	8,000	1,269.00	10,152,000
愛眼	9,100	373.00	3,394,300
ケーユーホールディングス	6,100	905.00	5,520,500
吉野家ホールディングス	37,700	1,803.00	67,973,100
加藤産業	17,800	3,605.00	64,169,000
イノテック	10,000	1,391.00	13,910,000
イエローハット	10,800	3,155.00	34,074,000
松屋フーズ	5,600	3,475.00	19,460,000
J B C Cホールディングス	9,100	1,099.00	10,000,900
J Kホールディングス	11,700	857.00	10,026,900
サガミチェーン	15,500	1,383.00	21,436,500
日伝	9,300	1,981.00	18,423,300
関西スーパーマーケット	8,800	1,133.00	9,970,400
ミロク情報サービス	10,100	2,702.00	27,290,200
北沢産業	9,500	249.00	2,365,500
杉本商事	6,300	1,852.00	11,667,600
因幡電機産業	15,000	4,355.00	65,325,000
王将フードサービス	8,300	6,040.00	50,132,000
プレナス	12,900	1,584.00	20,433,600
ミニストップ	8,600	2,058.00	17,698,800
アークス	21,300	2,845.00	60,598,500
バローホールディングス	26,600	2,325.00	61,845,000
パイテックホールディングス	5,200	2,071.00	10,769,200
東テク	3,800	2,549.00	9,686,200
ミスミグループ本社	132,900	3,235.00	429,931,500
藤久	900	1,415.00	1,273,500
アルテック	9,900	344.00	3,405,600
ベルク	5,100	5,090.00	25,959,000
大 庄	6,200	1,705.00	10,571,000
タキヒヨー	3,700	2,295.00	8,491,500
ファーストリテイリング	15,300	47,420.00	725,526,000
ソフトバンクグループ	515,800	8,812.00	4,545,229,600
蔵王産業	1,800	1,575.00	2,835,000
スズケン	52,100	4,610.00	240,181,000
サンドラッグ	48,400	4,350.00	210,540,000
サックスパー ホールディングス	10,900	927.00	10,104,300
ジェコス	8,000	1,113.00	8,904,000
ヤマザワ	2,300	1,750.00	4,025,000
やまや	2,400	3,015.00	7,236,000
ルネサスイーストン	10,700	540.00	5,778,000

ペルーナ	28,100	1,360.00	38,216,000	
合計	140,933,800		282,144,702,720	

\*担保として以下の有価証券が差し入れられております。

銘柄	株式数
トヨタ自動車	500,000

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表  
「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

## 「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

(単位:円)

科 目	注記 番号	平成30年1月11日現在	平成30年7月11日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		1,225,455,365	966,723,779
国債証券		303,128,208,700	287,019,186,400
地方債証券		22,902,738,657	22,636,622,741
特殊債券		15,780,383,842	16,939,931,173
社債券		16,879,127,400	15,597,661,260
未収入金		1,447,832,100	-
未収利息		770,154,466	677,408,888
前払費用		8,463,736	37,503,723
流動資産合計		362,142,364,266	343,875,037,964
資産合計		362,142,364,266	343,875,037,964
負債の部			
流動負債			
未払解約金		315,300,000	594,780,000
その他未払費用		-	18,879
流動負債合計		315,300,000	594,798,879
負債合計		315,300,000	594,798,879
純資産の部			
元本等			
元本	1	282,148,441,520	265,317,226,510
剰余金			
剰余金又は欠損金( )		79,678,622,746	77,963,012,575
元本等合計		361,827,064,266	343,280,239,085
純資産合計		361,827,064,266	343,280,239,085
負債純資産合計		362,142,364,266	343,875,037,964



## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

## （貸借対照表に関する注記）

項目	平成30年1月11日現在	平成30年7月11日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	296,867,950,534円	282,148,441,520円
同期中追加設定元本額	27,482,923,625円	41,959,884,341円
同期中一部解約元本額	42,202,432,639円	58,791,099,351円
元本の内訳		
ファンド名		
D I A M国内債券パッシブ・ファンド	14,044,050,293円	16,224,206,425円
M I T O ラップ型ファンド（安定型）	137,430,777円	119,440,378円
M I T O ラップ型ファンド（中立型）	112,114,796円	99,280,528円
M I T O ラップ型ファンド（積極型）	34,436,660円	28,462,744円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	583,451,400円	763,832,586円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	159,609,573円	225,487,668円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	25,188,228円	32,175,332円
たわらノーロード 国内債券	2,792,034,873円	4,001,571,429円
たわらノーロード 国内債券<ラップ向け>	754,493円	- 円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	19,455,389円	71,690,226円
たわらノーロード バランス（堅実型）	1,243,754円	16,608,904円
たわらノーロード バランス（標準型）	2,399,845円	30,151,049円
たわらノーロード バランス（積極型）	826,692円	7,497,259円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（保守型）	440,066円	2,091,676円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（安定型）	234,451円	47,434,738円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（安定成長型）	164,351円	51,623,317円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（成長型）	90,351円	17,549,563円

たわらノーロード スマートグローバルバランス(積極型)	19,472円	6,990,884円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	- 円	1,095,674円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	- 円	499,774円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	- 円	1,901,101円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	- 円	583,204円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	- 円	17,517円
D I A M国内債券インデックスファンド<DC年金>	12,427,315,535円	12,684,931,274円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 1 安定型	5,528,653,854円	5,690,893,884円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型	7,985,672,600円	8,205,370,620円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 3 成長型	3,263,681,041円	3,314,885,808円
D I A M DC バランス30インデックスファンド	1,826,494,969円	1,809,651,883円
D I A M DC バランス50インデックスファンド	2,010,449,233円	1,998,122,354円
D I A M DC バランス70インデックスファンド	309,647,783円	306,027,282円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	89,820,576円	91,445,749円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	2,234,726,830円	2,325,174,416円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	2,224,336円	1,190,857円
D I A M DC 8資産バランスファンド(新興国10)	470,102,235円	3,055,951,673円
D I A M DC 8資産バランスファンド(新興国20)	421,003,073円	678,388,474円
D I A M DC 8資産バランスファンド(新興国30)	99,634,072円	144,557,730円
投資のソムリエ	5,412,751,268円	3,987,876,892円
クルーズコントロール	4,127,957,852円	1,525,094,843円
投資のソムリエ<DC年金>	343,120,269円	342,717,792円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	1,785,743,778円	2,082,220,286円
D I A M DC バランス・F(成長型)	228,300,610円	261,874,420円
クルーズコントロール<DC年金>	1,441,246円	657,425円
D I A Mコア資産設計ファンド(堅実型)	9,543,074円	2,750,846円
D I A Mコア資産設計ファンド(積極型)	21,666,572円	9,712,567円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	296,996,808円	330,393,586円
ダイナミック・ナビゲーション	559,152円	499,073円

リスク抑制世界8資産バランスファンド	4,119,995,045円	5,976,301,988円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	721,386円	790,930円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	721,391円	511,048円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	1,382,114円	1,593,754円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	708,794円	1,215,365円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	-円	49,940,747円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	-円	688,041,623円
DIAM高金利通貨ファンド	9,608,918円	9,608,918円
DIAMエマージング債券ファンド	9,450,010円	9,450,010円
DIAM国内債券パッシブファンド(適格機関投資家向け)	22,732,301,633円	22,720,102,763円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	502,918,166円	478,855,501円
DIAMグローバル・バランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	356,392,042円	302,954,413円
DIAMグローバル・バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	260,572,513円	235,425,892円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	82,170,787円	75,007,625円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	236,417,399円	200,309,903円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	107,172,904円	87,815,729円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	71,047,134円	45,459,172円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	107,073,029円	92,633,774円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	190,740,120円	165,279,639円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	6,327,385,858円	5,712,289,546円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	3,384,413,398円	3,018,178,605円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	6,106,252,901円	5,554,071,577円
DIAMグローバル・アセット・バランスVA(適格機関投資家限定)	652,541,797円	608,905,631円
DIAMグローバル・アセット・バランスVA2(適格機関投資家限定)	553,747,291円	335,834,392円
DIAM アクサ グローバル バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	3,945,456,574円	3,493,068,225円
DIAM世界アセットバランスファンドVA(適格機関投資家向け)	4,127,295,962円	1,688,402,829円
DIAMグローバル 私募ファンド(適格機関投資家向け)	194,752,933円	194,752,933円

D I A M世界バランスファンド5 5 V A (適格機関投資家限定)	322,047,228円	63,734,156円
D I A M世界バランスファンド3 5 V A (適格機関投資家限定)	2,383,950,442円	349,979,409円
D I A M世界アセットバランスファンド2 V A (適格機関投資家限定)	88,035,522,422円	75,947,212,793円
D I A M世界アセットバランスファンド4 0 V A (適格機関投資家限定)	1,178,525,546円	1,099,071,813円
D I A M世界アセットバランスファンド2 5 V A (適格機関投資家限定)	7,559,824,166円	7,081,932,609円
D I A M世界アセットバランスファンド3 V A (適格機関投資家限定)	28,649,485,500円	27,020,064,564円
D I A Mバランス3 0 V A (適格機関投資家限定)	8,960,230円	65,311,006円
D I A Mバランス5 0 V A (適格機関投資家限定)	48,915,437円	7,670,416円
D I A Mバランス7 0 V A (適格機関投資家限定)	7,941,011円	7,651,356円
D I A M世界アセットバランスファンド4 V A (適格機関投資家限定)	31,857,319,666円	30,198,164,977円
D I A M世界バランス2 5 V A (適格機関投資家限定)	509,422,227円	472,394,738円
D I A M国内バランス3 0 V A (適格機関投資家限定)	139,681,767円	133,504,178円
D I A Mバランス2 0 V A (適格機関投資家限定)	513,354,007円	522,054,954円
D I A Mバランス4 0 V A (適格機関投資家限定)	40,409,042円	711,766円
D I A Mバランス6 0 V A (適格機関投資家限定)	390,500円	383,533円
計	282,148,441,520円	265,317,226,510円
2 . 受益権の総数	282,148,441,520口	265,317,226,510口

## （金融商品に関する注記）

## 1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成29年7月12日 至 平成30年1月11日	自 平成30年1月12日 至 平成30年7月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成30年1月11日現在	平成30年7月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
国債証券	117,176,300	992,060,600
地方債証券	147,619,176	49,418,314
特殊債券	114,681,960	28,164,310
社債券	133,148,070	48,662,990
合計	512,625,506	865,814,986

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成29年2月15日から平成30年1月11日まで及び平成30年2月15日から平成30年7月11日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	平成30年1月11日現在	平成30年7月11日現在
1口当たり純資産額	1.2824円	1.2938円
（1万口当たり純資産額）	(12,824円)	(12,938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7月11日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
国債証券	381回 利付国庫債券(2年)	1,000,000,000	1,002,960,000	
	384回 利付国庫債券(2年)	1,000,000,000	1,003,560,000	
	386回 利付国庫債券(2年)	1,000,000,000	1,003,940,000	
	387回 利付国庫債券(2年)	1,000,000,000	1,004,140,000	
	388回 利付国庫債券(2年)	800,000,000	803,464,000	
	120回 利付国庫債券(5年)	1,500,000,000	1,505,895,000	
	121回 利付国庫債券(5年)	2,000,000,000	2,005,480,000	
	122回 利付国庫債券(5年)	4,000,000,000	4,013,280,000	
	123回 利付国庫債券(5年)	3,000,000,000	3,011,400,000	
	124回 利付国庫債券(5年)	2,200,000,000	2,209,834,000	
	125回 利付国庫債券(5年)	3,000,000,000	3,014,820,000	
	126回 利付国庫債券(5年)	2,500,000,000	2,513,750,000	
	127回 利付国庫債券(5年)	3,000,000,000	3,017,790,000	
	128回 利付国庫債券(5年)	3,000,000,000	3,019,470,000	
	129回 利付国庫債券(5年)	2,070,000,000	2,084,241,600	
	130回 利付国庫債券(5年)	3,000,000,000	3,022,260,000	
	131回 利付国庫債券(5年)	2,020,000,000	2,036,079,200	
	132回 利付国庫債券(5年)	2,000,000,000	2,017,000,000	
	133回 利付国庫債券(5年)	2,860,000,000	2,885,883,000	
	134回 利付国庫債券(5年)	1,790,000,000	1,807,166,100	
	135回 利付国庫債券(5年)	2,100,000,000	2,121,273,000	
	2回 利付国庫債券(40年)	460,000,000	649,897,200	
	3回 利付国庫債券(40年)	460,000,000	652,487,000	
	4回 利付国庫債券(40年)	770,000,000	1,097,673,500	
	5回 利付国庫債券(40年)	700,000,000	962,486,000	
	6回 利付国庫債券(40年)	700,000,000	944,993,000	
	7回 利付国庫債券(40年)	800,000,000	1,032,856,000	
	8回 利付国庫債券(40年)	840,000,000	1,007,227,200	
	9回 利付国庫債券(40年)	1,210,000,000	1,057,588,400	
	10回 利付国庫債券(40年)	1,120,000,000	1,158,214,400	
	11回 利付国庫債券(40年)	150,000,000	149,548,500	
	303回 利付国庫債券(10年)	1,300,000,000	1,323,738,000	
	305回 利付国庫債券(10年)	2,500,000,000	2,551,600,000	
	306回 利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,538,685,000	
	308回 利付国庫債券(10年)	800,000,000	822,160,000	
	309回 利付国庫債券(10年)	1,000,000,000	1,023,810,000	
	310回 利付国庫債券(10年)	2,300,000,000	2,356,856,000	
	311回 利付国庫債券(10年)	2,020,000,000	2,061,046,400	
	312回 利付国庫債券(10年)	2,200,000,000	2,271,368,000	
	313回 利付国庫債券(10年)	1,790,000,000	1,858,521,200	



314回	利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,549,335,000
315回	利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,558,410,000
316回	利付国庫債券(10年)	500,000,000	517,995,000
317回	利付国庫債券(10年)	1,000,000,000	1,038,920,000
318回	利付国庫債券(10年)	1,600,000,000	1,657,136,000
319回	利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,562,955,000
320回	利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,557,780,000
321回	利付国庫債券(10年)	1,100,000,000	1,145,419,000
324回	利付国庫債券(10年)	2,000,000,000	2,072,420,000
325回	利付国庫債券(10年)	2,900,000,000	3,011,766,000
326回	利付国庫債券(10年)	500,000,000	518,190,000
327回	利付国庫債券(10年)	1,450,000,000	1,509,218,000
328回	利付国庫債券(10年)	1,890,000,000	1,953,220,500
329回	利付国庫債券(10年)	2,270,000,000	2,371,991,100
330回	利付国庫債券(10年)	1,200,000,000	1,256,352,000
332回	利付国庫債券(10年)	2,210,000,000	2,294,002,100
333回	利付国庫債券(10年)	2,500,000,000	2,598,600,000
334回	利付国庫債券(10年)	3,100,000,000	3,226,759,000
335回	利付国庫債券(10年)	2,900,000,000	3,004,661,000
336回	利付国庫債券(10年)	800,000,000	829,768,000
337回	利付国庫債券(10年)	1,700,000,000	1,741,259,000
338回	利付国庫債券(10年)	2,650,000,000	2,733,660,500
339回	利付国庫債券(10年)	3,100,000,000	3,200,471,000
340回	利付国庫債券(10年)	3,100,000,000	3,202,982,000
341回	利付国庫債券(10年)	3,060,000,000	3,141,151,200
342回	利付国庫債券(10年)	3,000,000,000	3,034,710,000
343回	利付国庫債券(10年)	3,000,000,000	3,034,650,000
344回	利付国庫債券(10年)	2,800,000,000	2,831,052,000
345回	利付国庫債券(10年)	2,700,000,000	2,728,539,000
346回	利付国庫債券(10年)	3,000,000,000	3,030,000,000
347回	利付国庫債券(10年)	2,900,000,000	2,927,231,000
348回	利付国庫債券(10年)	3,250,000,000	3,278,340,000
349回	利付国庫債券(10年)	1,910,000,000	1,924,382,300
350回	利付国庫債券(10年)	2,700,000,000	2,718,252,000
1回	利付国庫債券(30年)	100,000,000	130,171,000
2回	利付国庫債券(30年)	100,000,000	126,398,000
3回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	251,254,000
4回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	267,384,000
5回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	251,706,000
6回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	258,426,000
7回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	385,449,000
8回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	244,170,000
11回	利付国庫債券(30年)	400,000,000	484,224,000
12回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	381,507,000
13回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	377,490,000
14回	利付国庫債券(30年)	500,000,000	661,275,000
15回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	268,156,000
16回	利付国庫債券(30年)	400,000,000	537,960,000
17回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	266,432,000
18回	利付国庫債券(30年)	420,000,000	553,929,600

19回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	264,268,000	
20回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	406,902,000	
21回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	397,467,000	
22回	利付国庫債券(30年)	470,000,000	639,909,700	
23回	利付国庫債券(30年)	600,000,000	818,436,000	
24回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	409,611,000	
25回	利付国庫債券(30年)	400,000,000	532,808,000	
26回	利付国庫債券(30年)	700,000,000	946,722,000	
27回	利付国庫債券(30年)	700,000,000	962,003,000	
28回	利付国庫債券(30年)	900,000,000	1,240,398,000	
29回	利付国庫債券(30年)	900,000,000	1,228,257,000	
30回	利付国庫債券(30年)	860,000,000	1,161,103,200	
31回	利付国庫債券(30年)	900,000,000	1,201,221,000	
32回	利付国庫債券(30年)	1,180,000,000	1,605,000,600	
33回	利付国庫債券(30年)	1,300,000,000	1,692,899,000	
34回	利付国庫債券(30年)	990,000,000	1,334,282,400	
35回	利付国庫債券(30年)	1,300,000,000	1,701,700,000	
36回	利付国庫債券(30年)	1,300,000,000	1,705,769,000	
37回	利付国庫債券(30年)	1,200,000,000	1,552,512,000	
38回	利付国庫債券(30年)	900,000,000	1,147,023,000	
39回	利付国庫債券(30年)	800,000,000	1,039,136,000	
40回	利付国庫債券(30年)	580,000,000	741,234,200	
41回	利付国庫債券(30年)	630,000,000	790,807,500	
42回	利付国庫債券(30年)	800,000,000	1,004,808,000	
43回	利付国庫債券(30年)	800,000,000	1,005,424,000	
44回	利付国庫債券(30年)	800,000,000	1,007,160,000	
45回	利付国庫債券(30年)	870,000,000	1,053,491,700	
46回	利付国庫債券(30年)	900,000,000	1,090,089,000	
47回	利付国庫債券(30年)	1,000,000,000	1,237,650,000	
48回	利付国庫債券(30年)	1,040,000,000	1,235,946,400	
49回	利付国庫債券(30年)	990,000,000	1,176,605,100	
50回	利付国庫債券(30年)	1,000,000,000	1,035,190,000	
51回	利付国庫債券(30年)	930,000,000	844,049,400	
52回	利付国庫債券(30年)	860,000,000	823,372,600	
53回	利付国庫債券(30年)	900,000,000	883,890,000	
54回	利付国庫債券(30年)	900,000,000	930,384,000	
55回	利付国庫債券(30年)	980,000,000	1,012,104,800	
56回	利付国庫債券(30年)	900,000,000	928,566,000	
57回	利付国庫債券(30年)	930,000,000	959,722,800	
58回	利付国庫債券(30年)	1,130,000,000	1,164,928,300	
43回	利付国庫債券(20年)	860,000,000	891,097,600	
45回	利付国庫債券(20年)	900,000,000	938,511,000	
46回	利付国庫債券(20年)	500,000,000	522,715,000	
47回	利付国庫債券(20年)	950,000,000	998,602,000	
48回	利付国庫債券(20年)	500,000,000	532,170,000	
50回	利付国庫債券(20年)	780,000,000	822,564,600	
51回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	637,560,000	
52回	利付国庫債券(20年)	550,000,000	589,055,500	
54回	利付国庫債券(20年)	700,000,000	755,979,000	
55回	利付国庫債券(20年)	810,000,000	873,487,800	

58回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	650,922,000	
60回	利付国庫債券(20年)	590,000,000	629,895,800	
61回	利付国庫債券(20年)	800,000,000	841,840,000	
64回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	662,622,000	
65回	利付国庫債券(20年)	550,000,000	610,010,500	
67回	利付国庫債券(20年)	520,000,000	578,988,800	
70回	利付国庫債券(20年)	750,000,000	861,262,500	
72回	利付国庫債券(20年)	350,000,000	397,477,500	
73回	利付国庫債券(20年)	790,000,000	896,097,000	
75回	利付国庫債券(20年)	440,000,000	504,152,000	
78回	利付国庫債券(20年)	640,000,000	727,411,200	
81回	利付国庫債券(20年)	240,000,000	275,709,600	
83回	利付国庫債券(20年)	780,000,000	905,252,400	
85回	利付国庫債券(20年)	440,000,000	513,004,800	
88回	利付国庫債券(20年)	1,200,000,000	1,423,656,000	
90回	利付国庫債券(20年)	1,200,000,000	1,419,744,000	
92回	利付国庫債券(20年)	1,300,000,000	1,533,025,000	
93回	利付国庫債券(20年)	700,000,000	822,339,000	
94回	利付国庫債券(20年)	800,000,000	946,768,000	
95回	利付国庫債券(20年)	1,200,000,000	1,446,732,000	
97回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,682,324,000	
99回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,675,184,000	
100回	利付国庫債券(20年)	1,300,000,000	1,573,247,000	
102回	利付国庫債券(20年)	1,060,000,000	1,308,305,000	
105回	利付国庫債券(20年)	1,300,000,000	1,571,024,000	
107回	利付国庫債券(20年)	1,150,000,000	1,394,145,000	
108回	利付国庫債券(20年)	400,000,000	476,612,000	
109回	利付国庫債券(20年)	1,120,000,000	1,338,131,200	
110回	利付国庫債券(20年)	400,000,000	486,396,000	
111回	利付国庫債券(20年)	770,000,000	947,538,900	
112回	利付国庫債券(20年)	400,000,000	487,888,000	
113回	利付国庫債券(20年)	1,500,000,000	1,834,065,000	
114回	利付国庫債券(20年)	1,100,000,000	1,348,853,000	
116回	利付国庫債券(20年)	1,040,000,000	1,290,816,800	
117回	利付国庫債券(20年)	550,000,000	676,296,500	
118回	利付国庫債券(20年)	1,000,000,000	1,222,010,000	
119回	利付国庫債券(20年)	900,000,000	1,077,975,000	
120回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	704,526,000	
121回	利付国庫債券(20年)	1,250,000,000	1,516,437,500	
122回	利付国庫債券(20年)	500,000,000	600,570,000	
123回	利付国庫債券(20年)	1,330,000,000	1,649,758,600	
124回	利付国庫債券(20年)	500,000,000	614,095,000	
125回	利付国庫債券(20年)	970,000,000	1,218,339,400	
126回	利付国庫債券(20年)	450,000,000	553,995,000	
128回	利付国庫債券(20年)	700,000,000	854,406,000	
129回	利付国庫債券(20年)	700,000,000	845,530,000	
130回	利付国庫債券(20年)	900,000,000	1,089,270,000	
131回	利付国庫債券(20年)	450,000,000	538,830,000	
132回	利付国庫債券(20年)	660,000,000	791,650,200	
133回	利付国庫債券(20年)	510,000,000	618,828,900	

134回	利付国庫債券(20年)	900,000,000	1,094,031,000		
135回	利付国庫債券(20年)	800,000,000	961,152,000		
136回	利付国庫債券(20年)	350,000,000	415,835,000		
137回	利付国庫債券(20年)	690,000,000	830,359,800		
138回	利付国庫債券(20年)	340,000,000	399,942,000		
139回	利付国庫債券(20年)	350,000,000	416,451,000		
140回	利付国庫債券(20年)	1,600,000,000	1,928,528,000		
141回	利付国庫債券(20年)	1,100,000,000	1,327,854,000		
142回	利付国庫債券(20年)	450,000,000	549,513,000		
143回	利付国庫債券(20年)	970,000,000	1,158,800,800		
144回	利付国庫債券(20年)	460,000,000	542,611,400		
145回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,693,566,000		
146回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,697,108,000		
147回	利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	2,038,164,000		
148回	利付国庫債券(20年)	1,300,000,000	1,540,643,000		
149回	利付国庫債券(20年)	1,520,000,000	1,802,948,000		
150回	利付国庫債券(20年)	1,500,000,000	1,757,490,000		
151回	利付国庫債券(20年)	1,560,000,000	1,778,587,200		
152回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,596,434,000		
153回	利付国庫債券(20年)	1,360,000,000	1,572,894,400		
154回	利付国庫債券(20年)	1,500,000,000	1,709,520,000		
155回	利付国庫債券(20年)	1,600,000,000	1,769,488,000		
156回	利付国庫債券(20年)	1,100,000,000	1,102,728,000		
157回	利付国庫債券(20年)	1,500,000,000	1,448,565,000		
158回	利付国庫債券(20年)	1,330,000,000	1,351,399,700		
159回	利付国庫債券(20年)	1,420,000,000	1,464,999,800		
160回	利付国庫債券(20年)	1,300,000,000	1,361,880,000		
161回	利付国庫債券(20年)	1,200,000,000	1,233,564,000		
162回	利付国庫債券(20年)	1,200,000,000	1,230,708,000		
163回	利付国庫債券(20年)	1,210,000,000	1,239,112,600		
164回	利付国庫債券(20年)	1,060,000,000	1,063,805,400		
国債証券 合計		261,430,000,000	287,019,186,400		
地方債証券	680回	東京都公募公債	200,000,000	204,590,000	
	685回	東京都公募公債	500,000,000	510,710,000	
	688回	東京都公募公債	200,000,000	204,002,000	
	697回	東京都公募公債	500,000,000	515,845,000	
	701回	東京都公募公債	700,000,000	721,385,000	
	708回	東京都公募公債	500,000,000	516,930,000	
	720回	東京都公募公債	300,000,000	312,420,000	
	726回	東京都公募公債	400,000,000	415,216,000	
	5回	東京都公募公債 20年	100,000,000	113,655,000	
	9回	東京都公募公債 20年	200,000,000	237,238,000	
	10回	東京都公募公債 20年	300,000,000	354,627,000	
	21年度6回	北海道公募公債	200,000,000	203,560,000	
	22年度12回	北海道公募公債	200,000,000	206,438,000	
	166回	神奈川県公募公債	300,000,000	304,779,000	
	194回	神奈川県公募公債	300,000,000	310,131,000	
	208回	神奈川県公募公債	300,000,000	308,904,000	
	336回	大阪府公募公債	200,000,000	204,914,000	
	345回	大阪府公募公債	300,000,000	309,096,000	

356回	大阪府公募公債	200,000,000	207,126,000	
364回	大阪府公募公債	300,000,000	309,528,000	
374回	大阪府公募公債	300,000,000	313,557,000	
26年度11回	京都府公募公債	350,000,000	359,226,000	
26年度17回	兵庫県公募公債	200,000,000	205,012,000	
1回	兵庫県公募公債(12年)	300,000,000	318,525,000	
21年度5回	静岡県公募公債	197,000,000	200,315,510	
22年度8回	静岡県公募公債	200,000,000	204,388,000	
23年度9回	静岡県公募公債	200,000,000	206,844,000	
1回	静岡県公募公債 20年	100,000,000	115,016,000	
22年度6回	愛知県公募公債	200,000,000	204,728,000	
23年度20回	愛知県公募公債	500,000,000	519,515,000	
25年度4回	愛知県公募公債	300,000,000	312,075,000	
22年度1回	広島県公募公債	200,000,000	205,042,000	
23年度2回	埼玉県公募公債	200,000,000	206,654,000	
26年度5回	埼玉県公募公債	400,000,000	413,408,000	
21年度3回	福岡県公募公債	200,000,000	203,438,000	
25年度11回	福岡県公募公債	200,000,000	207,288,000	
21年度6回	千葉県公募公債	200,000,000	203,344,000	
24年度7回	千葉県公募公債	300,000,000	309,462,000	
25年度5回	千葉県公募公債	200,000,000	208,230,000	
80回	共同発行市場公募地方債	200,000,000	204,166,000	
94回	共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,081,000	
99回	共同発行市場公募地方債	700,000,000	723,569,000	
106回	共同発行市場公募地方債	300,000,000	309,978,000	
109回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	519,300,000	
111回	共同発行市場公募地方債	700,000,000	723,772,000	
119回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	517,780,000	
121回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	512,900,000	
126回	共同発行市場公募地方債	793,900,000	825,886,231	
127回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	517,030,000	
128回	共同発行市場公募地方債	300,000,000	309,969,000	
137回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	515,575,000	
139回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	515,000,000	
142回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	508,950,000	
144回	共同発行市場公募地方債	400,000,000	410,676,000	
146回	共同発行市場公募地方債	400,000,000	413,060,000	
148回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	516,550,000	
166回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	502,340,000	
488回	名古屋市公募公債 10年	450,000,000	464,940,000	
4回	京都市公募公債 20年	100,000,000	119,526,000	
22年度3回	横浜市公募公債	200,000,000	205,000,000	
22年度5回	横浜市公募公債	200,000,000	205,994,000	
23年度4回	横浜市公募公債	450,000,000	465,237,000	
25年度2回	横浜市公募公債	400,000,000	417,148,000	
25年度4回	札幌市公募公債	200,000,000	207,590,000	
2回	川崎市公募公債 15年	100,000,000	103,124,000	
21年度2回	北九州市公募公債	200,000,000	203,882,000	
23年度1回	千葉市公募公債	200,000,000	207,438,000	
地方債証券 合計		21,840,900,000	22,636,622,741	

特殊債券	78回 日本政策投資銀行債券	200,000,000	200,966,000	
	19回 高速道路機構債	150,000,000	221,901,000	
	26回 高速道路機構債	200,000,000	274,330,000	
	96回 高速道路機構債	700,000,000	721,854,000	
	116回 高速道路機構債	100,000,000	103,347,000	
	9回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	105,242,000	
	18回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	321,054,000	
	89回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	304,911,000	
	121回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	592,720,000	
	149回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	400,000,000	414,044,000	
	180回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1,000,000,000	1,034,160,000	
	189回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	513,580,000	
	193回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	522,540,000	
	195回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	330,000,000	345,533,100	
	241回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	514,430,000	
	260回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	231,610,000	
	309回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	800,000,000	804,264,000	
	319回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	203,806,000	
	28回 日本道路・機構承継債	400,000,000	540,632,000	
	3回 政保地方公共団体金融機構債券	101,000,000	102,706,900	
	5回 地方公共団体金融機構債券	500,000,000	508,955,000	
	8回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	306,141,000	
	10回 政保地方公共団体金融機構債券	500,000,000	511,170,000	
	15回 政保地方公共団体金融機構債券	200,000,000	204,356,000	
	20回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	309,402,000	
	24回 地方公共団体金融機構債券	300,000,000	310,257,000	
	19回 政保地方公共団体金融機構債券	200,000,000	238,300,000	
	36回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	310,785,000	
	44回 政保地方公共団体金融機構債券	400,000,000	415,672,000	
	50回 政保地方公共団体金融機構債券	500,000,000	523,315,000	
	56回 政保地方公共団体金融機構債券	542,000,000	564,682,700	
	64回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	309,885,000	
	37回 住宅金融支援機構債券	300,000,000	304,962,000	
	39回 住宅金融支援機構債券	200,000,000	240,864,000	
	75回 住宅金融支援機構債券	350,000,000	425,047,000	
	6回 貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	45,984,000	48,537,491	
	8回 貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	32,338,000	34,171,564	
	9回 貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	48,411,000	51,141,864	

2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	51,141,000	54,359,814	
13回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	19,342,000	19,971,195	
14回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	97,540,000	100,196,989	
4回貸付債権担保住宅金融公庫債券	30,258,000	30,364,205	
43回貸付債権担保住宅金融公庫債券	17,220,000	18,271,453	
44回貸付債権担保住宅金融公庫債券	65,308,000	69,117,415	
51回貸付債権担保住宅金融公庫債券	48,936,000	51,663,203	
1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	82,680,000	86,793,330	
29回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	170,510,000	183,085,112	
36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	298,280,000	317,205,866	
131回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	297,462,000	298,520,964	
132回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	298,008,000	299,054,008	
い第779号 利付商工債	200,000,000	200,510,000	
い第783号 利付商工債	300,000,000	300,924,000	
302回 利附信金中金債	300,000,000	300,780,000	
325回 利附信金中金債	400,000,000	399,308,000	
55回 鉄道建設運輸施設債	500,000,000	518,530,000	
特殊債券 合計	15,976,418,000	16,939,931,173	
社債券			
337回 東京交通債	200,000,000	211,702,000	
27回 ラボバンク・ネダーランド円貨社債	200,000,000	200,900,000	
22回 中日本高速道路債券	300,000,000	306,567,000	
7回 キリンホールディングス社債	100,000,000	101,999,000	
9回 日本たばこ産業社債	200,000,000	200,508,000	
41回 住友化学社債	100,000,000	101,920,000	
19回 三菱ケミカルホールディングス社債	100,000,000	101,349,000	
6回 JXホールディングス社債	100,000,000	104,331,000	
8回 プリヂストン社債	200,000,000	200,426,000	
23回 ジェイ エフ イー ホールディングス社債	100,000,000	99,742,000	
30回 豊田自動織機社債	200,000,000	199,752,000	
12回 パナソニック社債	200,000,000	200,940,000	
13回 パナソニック社債	100,000,000	101,505,000	
56回 日産自動車社債	100,000,000	100,718,000	
14回 トヨタ自動車社債	200,000,000	207,862,000	
16回 トヨタ自動車社債	200,000,000	205,640,000	
94回 丸紅社債	100,000,000	103,975,000	
45回 住友商事社債	100,000,000	103,235,000	
47回 住友商事社債	100,000,000	103,085,000	
48回 クレディセゾン社債	100,000,000	103,613,000	
57回 東京三菱銀行社債	200,000,000	218,042,000	
7回 東京三菱銀行劣後社債	200,000,000	205,810,000	
25回 三菱東京UFJ銀行劣後社債	200,000,000	205,432,000	
28回 三菱東京UFJ銀行劣後社債	200,000,000	207,120,000	

32回	三菱東京UFJ銀行劣後社債	300,000,000	312,786,000	
6回	りそな銀行劣後社債	100,000,000	103,257,000	
7回	三菱UFJ信託銀行劣後債	200,000,000	205,668,000	
9回	三菱UFJ信託銀行劣後債	100,000,000	104,255,000	
12回	住友信託銀行劣後債	100,000,000	102,841,000	
10回	三井住友信託銀行社債	200,000,000	204,650,000	
10回	セブン銀行社債	100,000,000	103,179,000	
22回	三井住友銀行劣後社債	200,000,000	205,642,000	
23回	三井住友銀行劣後社債	400,000,000	414,144,000	
14回	みずほ銀行劣後特約付社債	200,000,000	204,940,000	
15回	トヨタファイナンス社債	200,000,000	207,034,000	
47回	日立キャピタル社債	200,000,000	205,534,000	
164回	オリックス社債	100,000,000	101,065,000	
14回	大和証券グループ本社社債	100,000,000	101,971,000	
26回	野村ホールディングス社債	100,000,000	103,121,000	
42回	野村ホールディングス社債	200,000,000	204,202,000	
46回	野村ホールディングス社債	200,000,000	200,708,000	
38回	三井不動産社債	200,000,000	204,542,000	
72回	三菱地所社債	100,000,000	112,583,000	
87回	住友不動産社債	100,000,000	101,125,000	
15回	東日本旅客鉄道社債	300,000,000	316,677,000	
19回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	108,285,000	
21回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	108,132,000	
39回	東日本旅客鉄道社債	300,000,000	339,396,000	
42回	東日本旅客鉄道社債	200,000,000	227,972,000	
9回	西日本旅客鉄道社債	200,000,000	216,330,000	
10回	西日本旅客鉄道社債	300,000,000	330,075,000	
5回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	103,996,000	
6回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	108,331,000	
11回	東海旅客鉄道社債	300,000,000	314,142,000	
13回	東海旅客鉄道社債	200,000,000	220,676,000	
14回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	111,813,000	
4回	東京地下鉄社債	120,000,000	140,941,200	
60回	日本電信電話社債	300,000,000	308,529,000	
496回	中部電力社債	500,000,000	512,070,000	
518回	中部電力社債	200,000,000	200,090,000	
377回	中国電力社債	400,000,000	418,676,000	
379回	中国電力社債	300,000,000	304,164,000	
260回	北陸電力社債	100,000,000	104,221,000	
301回	北陸電力社債	100,000,000	104,534,000	
307回	北陸電力社債	100,000,000	105,866,000	
471回	東北電力社債	400,000,000	419,880,000	
473回	東北電力社債	300,000,000	304,011,000	
253回	四国電力社債	200,000,000	207,986,000	
423回	九州電力社債	200,000,000	202,206,000	
424回	九州電力社債	200,000,000	210,588,000	
426回	九州電力社債	400,000,000	417,816,000	
320回	北海道電力社債	200,000,000	202,920,000	
321回	北海道電力社債	161,000,000	166,870,060	
340回	北海道電力社債	300,000,000	302,061,000	



	13回 電源開発社債	200,000,000	223,958,000	
	38回 電源開発社債	300,000,000	311,964,000	
	23回 東京瓦斯社債	300,000,000	313,485,000	
	18回 大阪ガス社債	100,000,000	106,084,000	
	27回 NTTデータ社債	100,000,000	103,496,000	
社債券 合計		14,981,000,000	15,597,661,260	
合計		314,228,318,000	342,193,401,574	

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 「J-REITインデックスファンド・マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

(単位:円)

科 目	注記 番号	平成30年1月11日現在	平成30年7月11日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		957,714,377	916,946,623
投資証券		33,647,153,300	36,133,137,650
派生商品評価勘定		14,948,352	14,914,692
未収配当金		323,661,804	274,456,379
差入委託証拠金		6,500,352	13,300,092
流動資産合計		34,949,978,185	37,352,755,436
資産合計		34,949,978,185	37,352,755,436
負債の部			
流動負債			
前受金		13,412,352	14,388,192
未払金		673,826,209	434,571,807
未払解約金		28,461,800	14,400
その他未払費用		-	922
流動負債合計		715,700,361	448,975,321
負債合計		715,700,361	448,975,321
純資産の部			
元本等			
元本	1	19,626,564,592	19,870,219,702
剰余金			
剰余金又は欠損金( )		14,607,713,232	17,033,560,413
元本等合計		34,234,277,824	36,903,780,115
純資産合計		34,234,277,824	36,903,780,115
負債純資産合計		34,949,978,185	37,352,755,436

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

## （貸借対照表に関する注記）

項目	平成30年1月11日現在	平成30年7月11日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	17,361,587,502円	19,626,564,592円
同期中追加設定元本額	9,013,900,625円	8,047,686,881円
同期中一部解約元本額	6,748,923,535円	7,804,031,771円
元本の内訳 ファンド名		
MITO ラップ型ファンド （安定型）	361,083円	291,165円
MITO ラップ型ファンド （中立型）	912,903円	1,177,517円
MITO ラップ型ファンド （積極型）	2,407,898円	2,133,850円
グローバル8資産ラップファン ド（安定型）	1,532,660円	1,861,536円
グローバル8資産ラップファン ド（中立型）	1,298,870円	2,675,656円
グローバル8資産ラップファン ド（積極型）	1,761,249円	2,412,687円
たわらノーロード 国内リート	1,064,897,610円	1,326,980,470円
たわらノーロード 国内リート <ラップ向け>	292,610,032円	543,464,524円
たわらノーロード バランス （8資産均等型）	14,983,358円	51,810,705円
たわらノーロード バランス （堅実型）	51,544円	648,759円
たわらノーロード バランス （標準型）	1,073,973円	12,675,912円
たわらノーロード バランス （積極型）	3,189,831円	27,046,487円

たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(安定型)	35,677円	6,509,363円
たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(安定成長 型)	53,803円	17,569,696円
たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(成長型)	64,927円	13,840,858円
たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(積極型)	77,218円	27,313,897円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定型)	- 円	122,931円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定成長型)	- 円	909,269円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(成長型)	- 円	813,819円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(積極型)	- 円	2,221,234円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型>	13,914,114円	14,493,488円
マネックス資産設計ファンド< 育成型>	343,011,189円	368,359,319円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	3,270,978円	3,505,986円
DIAM DC 8資産 balan スファンド(新興国10)	18,476,325円	112,321,672円
DIAM DC 8資産 balan スファンド(新興国20)	60,982,941円	91,483,915円
DIAM DC 8資産 balan スファンド(新興国30)	134,732,676円	181,623,980円
投資のソムリエ	1,515,538,797円	2,503,597,271円
投資のソムリエ<DC年金>	96,091,039円	215,305,365円
DIAM 8資産バランスマ ンダN<DC年金>	70,215,123円	76,468,506円
投資のソムリエ<DC年金>リ スク抑制型	55,236,473円	72,005,293円
ダイナミック・ナビゲーシ ョン	207,978円	515,717円
リスク抑制世界8資産 balan ス ファンド	764,041,600円	1,303,583,907円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2045)	237,910円	551,661円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2055)	237,910円	355,076円
リスク抑制世界8資産 balan ス ファンド(DC)	256,978円	347,948円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2035)	234,001円	852,031円
リスクコントロール世界資産分 散ファンド	- 円	149,965,158円
Jリートインデックスファンド (DC)	6,728,716円	7,942,356円
DIAM J-REITイン デックス私募ファンド2012 12(適格機関投資家限定)	94,383,939円	92,393,600円

DIAM J-REITイン デックス私募ファンド2014 01(適格機関投資家限定)	1,819,511,382円	829,830,093円
DIAM J-REITイン デックスファンド(適格機関投 資家向け)	9,605,103,606円	9,215,244,946円
日米資産配分戦略ファンド(イ ンカム重視型)(為替ヘッジあ り)(適格機関投資家限定)	- 円	65,219,763円
DIAMグローバル 私募ファ ンド(適格機関投資家向け)	14,402,370円	14,402,370円
DIAMグローバル・リスク ファクター・パリティ戦略ファ ンド(適格機関投資家限定)	1,779,304,967円	1,410,548,883円
DIAMグローバル・リスク ファクター・パリティ戦略ファ ンドII(適格機関投資家限 定)	1,845,130,944円	1,096,821,063円
計	19,626,564,592円	19,870,219,702円
2. 受益権の総数	19,626,564,592口	19,870,219,702口

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成29年7月12日 至 平成30年1月11日	自 平成30年1月12日 至 平成30年7月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、不動産投信指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、不動産投資信託証券の価格の変動によるリスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

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

(有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	平成30年1月11日現在	平成30年7月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
投資証券	472,451,364	613,305,097
合計	472,451,364	613,305,097

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成29年6月7日から平成30年1月11日まで及び平成30年6月7日から平成30年7月11日まで）に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

## 不動産投信関連

種類	平成30年1月11日 現在				平成30年7月11日 現在			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引								
不動産投信指数先物 取引								
買 建	414,592,000	-	429,568,000	14,976,000	600,525,900	-	615,478,500	14,952,600
合計	414,592,000	-	429,568,000	14,976,000	600,525,900	-	615,478,500	14,952,600

(注) 1. 時価の算定方法

不動産投信指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成30年1月11日現在	平成30年7月11日現在
1口当たり純資産額	1.7443円	1.8572円
(1万口当たり純資産額)	(17,443円)	(18,572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7月11日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
投資証券	CRE ロジスティクスファンド投資法人	435	48,328,500	
	GLP 投資法人	9,026	1,043,405,600	
	MCUBS MidCity 投資法人	4,851	390,990,600	
	One リート投資法人	475	123,167,500	
	いちごオフィスリート投資法人	3,367	299,999,700	
	いちごホテルリート投資法人	680	97,648,000	
	さくら総合リート投資法人	1,045	96,662,500	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	1,967	991,368,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人	4,025	1,162,822,500	
	イオンリート投資法人	4,129	525,621,700	
	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	25,618	400,665,520	
	インヴィンシブル投資法人	11,924	604,546,800	
	オリックス不動産投資法人	8,627	1,524,390,900	
	グローバル・ワン不動産投資法人	2,761	313,925,700	
	ケネディクス・オフィス投資法人	1,341	921,267,000	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	2,212	377,588,400	
	ケネディクス商業リート投資法人	1,581	392,404,200	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	1,648	432,600,000	
	サムティ・レジデンシャル投資法人	755	73,990,000	
	ザイマックス・リート投資法人	401	46,195,200	
	ジャパン・ホテル・リート投資法人	12,549	1,035,292,500	
	ジャパンエクセレント投資法人	3,893	570,713,800	
	ジャパンリアルエステイト投資法人	4,326	2,548,014,000	
	スターアジア不動産投資法人	1,020	111,690,000	
	スターツプロシード投資法人	685	113,641,500	
	トーセイ・リート投資法人	699	79,546,200	
	ヒューリックリート投資法人	2,953	505,258,300	
	フロンティア不動産投資法人	1,479	667,029,000	
	プレミア投資法人	3,927	433,933,500	
	ヘルスケア&メディカル投資法人	536	59,710,400	
	マリモ地方創生リート投資法人	348	40,646,400	
	ユナイテッド・アーバン投資法人	9,589	1,668,486,000	
	ラサールロジポート投資法人	3,280	362,112,000	
	阪急リート投資法人	1,898	260,026,000	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	822	279,480,000		
三菱地所物流リート投資法人	403	109,374,200		
産業ファンド投資法人	5,050	617,615,000		
森トラスト・ホテルリート投資法人	942	141,676,800		
森トラスト総合リート投資法人	3,107	500,537,700		

森ヒルズリート投資法人	4,671	665,617,500	
星野リゾート・リート投資法人	687	400,521,000	
積水ハウス・リート投資法人	10,893	790,835,430	
大江戸温泉リート投資法人	730	64,313,000	
大和ハウスリート投資法人	5,059	1,350,247,100	
大和証券オフィス投資法人	926	599,122,000	
投資法人みらい	635	122,555,000	
東急リアル・エステート投資法人	2,915	441,622,500	
日本アコモデーションファンド投資法人	1,445	736,950,000	
日本ビルファンド投資法人	4,210	2,652,300,000	
日本プライムリアルティ投資法人	2,745	1,110,352,500	
日本プロロジスリート投資法人	5,795	1,315,465,000	
日本ヘルスケア投資法人	211	36,460,800	
日本リート投資法人	1,333	443,222,500	
日本リテールファンド投資法人	8,210	1,642,000,000	
日本ロジスティクスファンド投資法人	2,896	654,496,000	
日本賃貸住宅投資法人	4,890	437,166,000	
福岡リート投資法人	2,249	398,297,900	
平和不動産リート投資法人	2,708	290,839,200	
野村不動産マスターファンド投資法人	12,866	2,008,382,600	
投資証券 合計	220,448	36,133,137,650	
合計	220,448	36,133,137,650	

投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

## 「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成30年1月11日現在	平成30年7月11日現在
資産の部			
流動資産			
預金		5,822,987,447	5,489,104,287
コール・ローン		726,764,720	171,476,639
株式		292,877,407,767	300,454,985,072
投資信託受益証券		801,364,202	739,626,667
投資証券		6,273,413,009	6,712,692,366
派生商品評価勘定		175,170,660	100,811,148
未収入金		2,663,502	36,167,920
未収配当金		323,899,180	345,526,103
差入委託証拠金		2,025,207,755	2,635,621,046
流動資産合計		309,028,878,242	316,686,011,248
資産合計		309,028,878,242	316,686,011,248
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		3,689,542	1,589,537
未払解約金		331,777,000	213,332,000
その他未払費用		-	1,578
流動負債合計		335,466,542	214,923,115
負債合計		335,466,542	214,923,115
純資産の部			
元本等			
元本	1	87,104,816,912	88,975,107,871
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		221,588,594,788	227,495,980,262
元本等合計		308,693,411,700	316,471,088,133
純資産合計		308,693,411,700	316,471,088,133
負債純資産合計		309,028,878,242	316,686,011,248

## 注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

## (貸借対照表に関する注記)

項目	平成30年1月11日現在	平成30年7月11日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額 同期中追加設定元本額 同期中一部解約元本額 元本の内訳 ファンド名	87,299,647,391円 11,818,303,770円 12,013,134,249円	87,104,816,912円 14,038,234,344円 12,167,943,385円

D I A M外国株式パッシブ・ ファンド	1,822,423,973円	1,906,729,848円
M I T O ラップ型ファンド (安定型)	3,191,830円	2,423,710円
M I T O ラップ型ファンド (中立型)	7,279,030円	7,682,928円
M I T O ラップ型ファンド (積極型)	18,898,552円	14,007,544円
グローバル8資産ラップファン ド(安定型)	13,544,215円	15,500,550円
グローバル8資産ラップファン ド(中立型)	10,359,460円	17,451,481円
グローバル8資産ラップファン ド(積極型)	13,818,783円	15,792,642円
たわらノーロード 先進国株式	5,502,154,955円	6,928,447,314円
たわらノーロード 先進国株式 <ラップ向け>	424,744円	424,449円
たわらノーロード 先進国株式 <為替ヘッジあり>	463,445,507円	799,442,282円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	7,231,042円	27,581,489円
たわらノーロード バランス (堅実型)	150,198円	2,000,495円
たわらノーロード バランス (標準型)	1,404,580円	17,911,257円
たわらノーロード バランス (積極型)	4,751,015円	43,580,554円
たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(保守型)	14,227円	71,283円
たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(安定型)	57,189円	9,209,178円
たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(安定成長 型)	80,559円	21,668,159円
たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(成長型)	103,944円	17,376,355円
たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(積極型)	127,326円	41,908,829円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(保守型)	- 円	14,099円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定型)	- 円	51,366円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定成長型)	- 円	449,195円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(成長型)	- 円	526,371円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(積極型)	- 円	1,728,931円
D I A M外国株式インデックス ファンド<DC年金>	36,937,428,806円	38,861,551,807円
D I A Mバランス・ファンド< DC年金>1安定型	157,435,724円	164,512,028円

DIAMバランス・ファンド< DC年金> 2安定・成長型	857,026,223円	860,798,975円
DIAMバランス・ファンド< DC年金> 3成長型	1,043,554,352円	1,073,184,906円
DIAM DC バランス30 インデックスファンド	130,707,011円	130,817,408円
DIAM DC バランス50 インデックスファンド	385,930,973円	375,234,201円
DIAM DC バランス70 インデックスファンド	330,441,705円	332,100,058円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型>	33,185,995円	31,471,673円
マネックス資産設計ファンド< 育成型>	817,871,261円	799,032,499円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	187,072,304円	206,676,091円
DIAM DC 8資産バラン スファンド(新興国10)	29,811,822円	200,171,509円
DIAM DC 8資産バラン スファンド(新興国20)	73,885,125円	123,404,993円
DIAM DC 8資産バラン スファンド(新興国30)	145,725,386円	218,118,529円
投資のソムリエ	970,425,131円	750,874,606円
クルーズコントロール	790,811,166円	297,563,297円
投資のソムリエ< DC年金>	61,679,304円	64,456,556円
DIAM 8資産バラン スファンドN< DC年金>	114,876,755円	138,048,807円
DIAM DC バランス・F (成長型)	70,873,790円	85,069,990円
クルーズコントロール< DC年 金>	275,806円	128,297円
DIAMコア資産設計ファンド (堅実型)	3,642,956円	1,072,569円
DIAMコア資産設計ファンド (積極型)	8,318,622円	3,761,847円
投資のソムリエ< DC年金>リ スク抑制型	27,153,058円	38,658,184円
ダイナミック・ナビゲーション	1,144,316円	1,495,747円
リスク抑制世界8資産バラン スファンド	373,981,024円	698,390,564円
ワールドアセットバランス(基 本コース)	588,185,085円	696,288,960円
ワールドアセットバランス(リ スク抑制コース)	2,227,897,121円	2,732,686,672円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2045)	517,823円	822,489円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2055)	517,846円	534,290円
リスク抑制世界8資産バラン スファンド(DC)	126,045円	184,512円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2035)	365,458円	1,088,499円

4資産分散投資・スタンダード <DC年金>	- 円	3,568,737円
リスクコントロール世界資産分 散ファンド	- 円	80,898,377円
D I A M外国株式インデックス ファンドV A (適格機関投資家 専用)	95,685,592円	91,764,770円
D I A M外国株式パッシブ私募 ファンド(適格機関投資家向 け)	2,953,403,840円	2,879,034,337円
D I A M先進国株式パッシブ ファンド(適格機関投資家限 定)	161,207,978円	158,419,668円
外国株式パッシブ・ファンド2 (適格機関投資家限定)	208,789,234円	208,685,890円
D I A Mワールドバランス2 5 V A (適格機関投資家限定)	23,987,145円	23,469,497円
D I A Mグローバル・バランス ファンド2 5 V A (適格機関投 資家限定)	108,709,025円	94,957,427円
D I A Mグローバル・バランス ファンド5 0 V A (適格機関投 資家限定)	238,629,259円	221,387,243円
D I A M国際分散バランスファ ンド3 0 V A (適格機関投資家 限定)	12,888,459円	12,087,592円
D I A M国際分散バランスファ ンド5 0 V A (適格機関投資家 限定)	86,550,378円	75,185,426円
D I A M国内重視バランスファ ンド3 0 V A (適格機関投資家 限定)	7,842,084円	6,601,997円
D I A M国内重視バランスファ ンド5 0 V A (適格機関投資家 限定)	13,001,598円	8,545,004円
D I A M世界バランスファンド 4 0 V A (適格機関投資家限 定)	26,103,100円	23,213,482円
D I A M世界バランスファンド 5 0 V A (適格機関投資家限 定)	69,758,648円	62,137,695円
D I A Mバランスファンド2 5 V A (適格機関投資家限定)	578,673,845円	536,449,917円
D I A Mバランスファンド3 7 . 5 V A (適格機関投資家限 定)	722,585,419円	661,713,592円
D I A Mバランスファンド5 0 V A (適格機関投資家限定)	2,235,486,581円	2,087,932,927円
D I A Mグローバル・アセッ ト・バランスV A (適格機関投 資家限定)	794,469,102円	759,101,003円

D I A Mグローバル・アセ ト・バランスV A 2 ( 適格機関 投資家限定)	242,322,969円	149,974,052円
D I A M アクサ グローバ ル バランスファンド3 0 V A ( 適格機関投資家限定)	962,367,378円	874,971,079円
D I A M世界アセットバラン スファンドV A ( 適格機関投資家 向け)	499,820,780円	211,701,890円
D I A Mグローバル 私募ファ ンド( 適格機関投資家向け)	2,754,975円	2,754,975円
D I A M世界バランスファンド 5 5 V A ( 適格機関投資家限 定)	176,485,295円	35,747,427円
D I A M世界バランスファンド 3 5 V A ( 適格機関投資家限 定)	424,964,949円	64,609,302円
D I A M世界アセットバラン スファンド2 V A ( 適格機関投資 家限定)	8,054,309,887円	7,135,559,831円
D I A M世界アセットバラン スファンド4 0 V A ( 適格機関投 資家限定)	431,455,488円	413,163,240円
D I A M世界アセットバラン スファンド2 5 V A ( 適格機関投 資家限定)	1,383,217,436円	1,330,611,491円
D I A M世界アセットバラン スファンド3 V A ( 適格機関投資 家限定)	5,242,924,377円	5,080,681,959円
D I A Mバランス3 0 V A ( 適 格機関投資家限定)	2,048,915円	15,441,869円
D I A Mバランス5 0 V A ( 適 格機関投資家限定)	28,490,332円	4,637,511円
D I A Mバランス7 0 V A ( 適 格機関投資家限定)	10,665,941円	10,592,510円
D I A M世界アセットバラン スファンド4 V A ( 適格機関投資 家限定)	6,995,839,213円	6,809,630,311円
D I A Mバランス2 0 V A ( 適 格機関投資家限定)	56,125,154円	59,204,056円
D I A Mバランス4 0 V A ( 適 格機関投資家限定)	12,665,761円	230,745円
D I A Mバランス6 0 V A ( 適 格機関投資家限定)	257,653円	260,170円
計	87,104,816,912円	88,975,107,871円
2 . 受益権の総数	87,104,816,912口	88,975,107,871口



## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成29年7月12日 至 平成30年1月11日	自 平成30年1月12日 至 平成30年7月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。</p> <p>また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。</p>	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成30年1月11日現在	平成30年7月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	平成30年1月11日現在	平成30年7月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
株式	38,008,423,503	10,362,297,432
投資信託受益証券	21,791,655	67,211,387
投資証券	100,610,106	540,370,360
合計	38,130,825,264	10,969,879,179

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成29年2月16日から平成30年1月11日まで及び平成30年2月16日から平成30年7月11日まで）に対応する金額であります。

## （デリバティブ取引等に関する注記）

## 通貨関連

種類	平成30年1月11日 現在				平成30年7月11日 現在			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	1,026,890,881	-	1,026,860,650	30,231	66,848,488	-	66,773,840	74,648
アメリカ・ドル	723,398,115	-	723,375,400	22,715	66,848,488	-	66,773,840	74,648
イギリス・ポンド	74,535,466	-	74,532,150	3,316	-	-	-	-
オーストラリア・ドル	29,758,776	-	29,757,420	1,356	-	-	-	-
カナダ・ドル	44,107,048	-	44,104,320	2,728	-	-	-	-
ユーロ	155,091,476	-	155,091,360	116	-	-	-	-
買 建	368,878,305	-	365,713,490	3,164,815	466,776,268	-	466,760,440	15,828
アメリカ・ドル	250,403,880	-	248,221,420	2,182,460	316,797,801	-	316,787,520	10,281
イギリス・ポンド	28,149,045	-	27,855,450	293,595	32,339,714	-	32,337,800	1,914
オーストラリア・ドル	11,862,585	-	11,850,300	12,285	15,634,416	-	15,633,200	1,216
カナダ・ドル	17,942,835	-	17,695,080	247,755	14,089,456	-	14,088,120	1,336
ユーロ	60,519,960	-	60,091,240	428,720	87,914,881	-	87,913,800	1,081
合計	1,395,769,186	-	1,392,574,140	3,134,584	533,624,756	-	533,534,280	58,820

## （注）時価の算定方法

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

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

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

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

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

株式関連

種類	平成30年1月11日 現在				平成30年7月11日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
先物取引								
買 建	7,434,733,565	-	7,609,349,267	174,615,702	8,823,316,081	-	8,922,478,872	99,162,791
合計	7,434,733,565	-	7,609,349,267	174,615,702	8,823,316,081	-	8,922,478,872	99,162,791

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成30年1月11日現在	平成30年7月11日現在
1口当たり純資産額	3.5439円	3.5568円
(1万口当たり純資産額)	(35,439円)	(35,568円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

平成30年7月11日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	AMAZON.COM INC	30,466	1,743.070	53,104,370.620	
	ABBOTT LABORATORIES	129,962	62.810	8,162,913.220	
	AES CORP	45,579	12.840	585,234.360	
	ABIOMED INC	3,100	405.150	1,255,965.000	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	68,075	144.710	9,851,133.250	
	ADVANCED MICRO DEVICES	68,629	16.550	1,135,809.950	
	ADOBE SYSTEMS INC	36,476	248.630	9,069,027.880	
	CHUBB LTD	34,634	133.510	4,623,985.340	
	AGCO CORP	5,610	62.660	351,522.600	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	16,380	159.660	2,615,230.800	
	ALLEGHANY CORP	1,054	596.220	628,415.880	
	RALPH LAUREN CORP	3,497	129.170	451,707.490	
	ALLSTATE CORP	25,754	93.360	2,404,393.440	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	55,523	148.040	8,219,624.920	
	AMGEN INC	50,200	195.690	9,823,638.000	
	HESS CORP	20,421	69.600	1,421,301.600	
	AMERICAN EXPRESS CO	53,581	99.910	5,353,277.710	
	AMERICAN ELECTRIC POWER	36,659	69.780	2,558,065.020	
	AFLAC INC	56,436	43.220	2,439,163.920	
	AMERICAN INTL GROUP	66,725	55.460	3,700,568.500	
	AMERCO	551	372.390	205,186.890	
	ANALOG DEVICES	27,711	98.540	2,730,641.940	
	ANADARKO PETROLEUM CORP	39,893	75.470	3,010,724.710	
	ALEXION PHARMACEUTICALS INC	16,015	131.910	2,112,538.650	
	JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	69,855	34.870	2,435,843.850	
	JONES LANG LASALLE INC	2,818	169.670	478,130.060	
	VALERO ENERGY CORP	32,105	108.620	3,487,245.100	
	APACHE CORP	30,595	48.610	1,487,222.950	
	ANSYS INC	6,519	176.460	1,150,342.740	
	APPLE INC	376,469	190.350	71,660,874.150	
	APPLIED MATERIALS INC	77,970	46.740	3,644,317.800	
	ALBEMARLE CORP	7,904	95.810	757,282.240	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	42,401	47.940	2,032,703.940		
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	7,831	79.910	625,775.210		
AMEREN CORP	17,312	60.500	1,047,376.000		

ARROW ELECTRONICS INC	5,756	78.560	452,191.360	
AUTOLIV INC	6,197	105.760	655,394.720	
AUTODESK INC	16,259	134.370	2,184,721.830	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	33,092	135.970	4,499,519.240	
AUTOZONE INC	2,015	692.680	1,395,750.200	
AVERY DENNISON CORP	6,262	102.710	643,170.020	
AVNET INC	10,288	44.700	459,873.600	
BALL CORP	24,324	37.650	915,798.600	
BERKSHIRE HATHAWAY INC- CL B	94,579	189.900	17,960,552.100	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	73,749	54.030	3,984,658.470	
BAXTER INTERNATIONAL INC	37,776	74.630	2,819,222.880	
BECTON DICKINSON & CO	19,749	244.550	4,829,617.950	
AMETEK INC	16,775	73.370	1,230,781.750	
VERIZON COMM INC	306,879	51.340	15,755,167.860	
WR BERKLEY CORP	8,134	73.820	600,451.880	
BEST BUY CO INC	19,210	75.710	1,454,389.100	
YUM! BRANDS INC	23,738	79.310	1,882,660.780	
FIRSTENERGY CORP	35,496	35.390	1,256,203.440	
H&R BLOCK INC	16,114	23.760	382,868.640	
BOEING CO	41,469	347.160	14,396,378.040	
ROBERT HALF INTL INC	8,158	66.340	541,201.720	
BORGWARNER INC	14,648	46.270	677,762.960	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	101,641	33.560	3,411,071.960	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	9,894	85.880	849,696.720	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	8,731	121.150	1,057,760.650	
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	1,838	593.370	1,090,614.060	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	121,395	56.180	6,819,971.100	
AFFILIATED MANAGERS GROUP INC	3,788	152.430	577,404.840	
INGREDION INC	5,305	113.200	600,526.000	
ONEOK INC	30,787	71.220	2,192,650.140	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	5,900	109.480	645,932.000	
UNITED RENTALS INC	6,332	154.290	976,964.280	
SEMPRA ENERGY	18,112	117.300	2,124,537.600	
FEDEX CORP	18,964	235.660	4,469,056.240	
VERISIGN INC	6,321	143.500	907,063.500	
AMPHENOL CORP	23,100	89.270	2,062,137.000	
BROWN-FORMAN CORP	19,683	50.750	998,912.250	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	127,092	7.020	892,185.840	
CSX CORP	62,392	66.050	4,120,991.600	
CABOT OIL & GAS CORP	32,261	23.650	762,972.650	
CAMPBELL SOUP CO	14,050	41.490	582,934.500	

SEAGATE TECHNOLOGY	20,613	58.890	1,213,899.570	
CONSTELLATION BRANDS INC	12,969	217.980	2,826,982.620	
CARDINAL HEALTH INC	22,125	50.170	1,110,011.250	
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	31,716	58.820	1,865,535.120	
CATERPILLAR INC	44,558	141.250	6,293,817.500	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	9,832	104.390	1,026,362.480	
CELGENE CORP	56,186	84.560	4,751,088.160	
CITRIX SYSTEMS INC	10,896	106.870	1,164,455.520	
CENTURYLINK INC	73,540	20.110	1,478,889.400	
CERNER CORP	22,947	60.760	1,394,259.720	
JPMORGAN CHASE & CO	254,725	106.620	27,158,779.500	
CHURCH & DWIGHT CO INC	18,822	54.470	1,025,234.340	
CIGNA CORP	18,009	173.450	3,123,661.050	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	10,982	69.880	767,422.160	
CINTAS CORP	6,282	193.290	1,214,247.780	
CISCO SYSTEMS INC	357,260	42.860	15,312,163.600	
CLOROX COMPANY	9,331	132.480	1,236,170.880	
COCA-COLA CO/THE	298,559	44.970	13,426,198.230	
COPART INC	15,900	58.710	933,489.000	
COGNEX CORP	11,508	48.300	555,836.400	
COLGATE-PALMOLIVE CO	62,296	65.730	4,094,716.080	
MARRIOTT INTERNATIONAL- CL A	22,744	130.730	2,973,323.120	
COMERICA INC	12,068	92.480	1,116,048.640	
COMCAST CORP-CL A	345,846	33.340	11,530,505.640	
CA INC	22,732	37.150	844,493.800	
CONAGRA BRANDS INC	28,323	36.620	1,037,188.260	
CONSOLIDATED EDISON INC	23,350	77.860	1,818,031.000	
CMS ENERGY CORP	19,291	47.210	910,728.110	
COOPER COS INC	3,794	245.290	930,630.260	
MOLSON COORS BREWING CO	13,855	68.390	947,543.450	
CORNING INC	65,641	28.950	1,900,306.950	
SEALED AIR CORP	13,870	42.890	594,884.300	
CUMMINS INC	11,239	137.190	1,541,878.410	
DR HORTON INC	24,498	41.530	1,017,401.940	
DANAHER CORP	47,175	100.160	4,725,048.000	
MOODY'S CORP	12,963	176.690	2,290,432.470	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	43,966	81.750	3,594,220.500	
TARGET CORP	37,486	78.300	2,935,153.800	
DEERE & CO	22,801	144.550	3,295,884.550	
MORGAN STANLEY	99,843	48.100	4,802,448.300	
REPUBLIC SERVICES INC	17,375	69.330	1,204,608.750	
COSTAR GROUP INC	2,786	419.500	1,168,727.000	
THE WALT DISNEY CO	112,062	106.030	11,881,933.860	
DOLLAR TREE INC	17,493	85.830	1,501,424.190	

DOVER CORP	10,736	74.660	801,549.760	
OMNICOM GROUP	16,993	77.840	1,322,735.120	
DTE ENERGY CO	13,122	104.000	1,364,688.000	
DUKE ENERGY CORP	52,625	79.520	4,184,740.000	
FLOWSERVE CORP	8,406	42.070	353,640.420	
DARDEN RESTAURANTS INC	9,436	109.800	1,036,072.800	
EBAY INC	71,564	37.040	2,650,730.560	
BANK OF AMERICA CORP	722,337	28.830	20,824,975.710	
CITIGROUP INC	190,608	68.230	13,005,183.840	
EASTMAN CHEMICAL CO	10,193	101.860	1,038,258.980	
E*TRADE FINANCIAL CORP	18,740	60.960	1,142,390.400	
EATON CORP PLC	32,234	78.310	2,524,244.540	
EATON VANCE CORP	9,184	53.990	495,844.160	
CADENCE DESIGN SYS INC	20,877	44.780	934,872.060	
DISH NETWORK CORP	16,150	34.930	564,119.500	
ECOLAB INC	19,009	142.910	2,716,576.190	
ELECTRONIC ARTS INC	23,050	144.190	3,323,579.500	
SALESFORCE.COM INC	50,827	142.450	7,240,306.150	
EMERSON ELECTRIC CO	47,931	70.990	3,402,621.690	
ATMOS ENERGY CORP	8,221	90.670	745,398.070	
ENERGY CORP	13,599	80.930	1,100,567.070	
EOG RESOURCES INC	43,300	126.970	5,497,801.000	
EQUIFAX INC	8,495	128.630	1,092,711.850	
EQT CORP	20,049	56.400	1,130,763.600	
ESTEE LAUDER COS INC/THE	16,134	144.600	2,332,976.400	
EXPEDITORS INTERNATIONAL	12,550	72.980	915,899.000	
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	41,833	80.560	3,370,066.480	
EXXON MOBIL CORP	315,280	83.660	26,376,324.800	
FMC CORP	8,970	91.010	816,359.700	
NEXTERA ENERGY INC	35,113	167.440	5,879,320.720	
ASSURANT INC	4,089	107.280	438,667.920	
FASTENAL CO	21,654	49.530	1,072,522.620	
FIFTH THIRD BANCORP	52,173	29.700	1,549,538.100	
M&T BANK CORP	10,399	171.900	1,787,588.100	
FISERV INC	30,704	75.960	2,332,275.840	
FLIR SYSTEMS INC	11,623	52.960	615,554.080	
MACY'S INC	24,741	36.720	908,489.520	
FORD MOTOR CO	278,818	11.250	3,136,702.500	
FRANKLIN RESOURCES INC	22,314	32.490	724,981.860	
FREEMPORT-MCMORAN INC	96,812	18.110	1,753,265.320	
FLEX LTD	35,913	14.670	526,843.710	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	12,176	68.040	828,455.040	
GAP INC/THE	18,295	31.010	567,327.950	
DENTSPLY SIRONA INC	17,477	45.540	795,902.580	
GENERAL DYNAMICS CORP	19,047	192.800	3,672,261.600	
GENERAL MILLS INC	44,775	44.690	2,000,994.750	
GENUINE PARTS CO	11,759	93.420	1,098,525.780	
GILEAD SCIENCES INC	97,302	76.750	7,467,928.500	



GARTNER INC	7,153	140.000	1,001,420.000	
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	18,097	23.840	431,432.480	
MCKESSON CORP	15,054	138.520	2,085,280.080	
NVIDIA CORP	42,765	253.250	10,830,236.250	
GENERAL ELECTRIC CO	641,549	14.170	9,090,749.330	
WW GRAINGER INC	3,832	305.280	1,169,832.960	
HALLIBURTON CO	66,065	46.260	3,056,166.900	
MONSTER BEVERAGE CORP	32,522	59.570	1,937,335.540	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	26,624	226.850	6,039,654.400	
HARLEY-DAVIDSON INC	12,901	43.690	563,644.690	
HARRIS CORP	8,954	146.440	1,311,223.760	
HASBRO INC	9,136	96.590	882,446.240	
HENRY SCHEIN INC	11,426	75.860	866,776.360	
HELMERICH & PAYNE INC	7,213	67.220	484,857.860	
HERSHEY FOODS CORP	10,132	93.810	950,482.920	
HP INC	122,725	23.870	2,929,445.750	
F5 NETWORKS INC	4,874	178.620	870,593.880	
CROWN HOLDINGS INC NPR	10,472	46.620	488,204.640	
UNITED THERAPEUTICS CORP	3,447	121.450	418,638.150	
JUNIPER NETWORKS INC	27,740	28.300	785,042.000	
HOLLYFRONTIER CORP	12,551	68.950	865,391.450	
HOLOGIC INC	19,133	41.360	791,340.880	
UNUM GROUP	16,000	38.820	621,120.000	
HOME DEPOT INC	86,514	197.610	17,096,031.540	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	12,887	99.370	1,280,581.190	
HORMEL FOODS CORP	19,345	37.330	722,148.850	
CENTERPOINT ENERGY INC	31,952	27.110	866,218.720	
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,337	212.800	497,313.600	
HUMANA INC	10,468	312.430	3,270,517.240	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	5,927	124.210	736,192.670	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	82,761	14.980	1,239,759.780	
RED HAT INC	13,147	142.060	1,867,662.820	
NEKTAR THERAPEUTICS	12,000	47.120	565,440.000	
BIOGEN INC	15,971	344.820	5,507,120.220	
IDEX CORP	5,924	138.760	822,014.240	
ILLINOIS TOOL WORKS	22,895	144.060	3,298,253.700	
INTUIT INC	18,126	208.460	3,778,545.960	
IDEXX LABORATORIES INC	6,255	234.100	1,464,295.500	
INGERSOLL-RAND PLC	18,874	91.450	1,726,027.300	
INTEL CORP	348,219	52.160	18,163,103.040	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	5,578	128.940	719,227.320	
INTERNATIONAL PAPER CO	28,375	53.470	1,517,211.250	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	29,157	23.510	685,481.070	

JACOBS ENGINEERING GROUP INC	9,631	66.510	640,557.810	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	5,919	134.250	794,625.750	
INCYTE CORP	12,360	70.180	867,424.800	
JOHNSON & JOHNSON	198,834	127.380	25,327,474.920	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	25,530	53.240	1,359,217.200	
KLA-TENCOR CORP	11,724	106.060	1,243,447.440	
DEVON ENERGY CORP	39,484	45.610	1,800,865.240	
KELLOGG CO	18,922	70.640	1,336,650.080	
EAST WEST BANCORP INC	11,000	66.330	729,630.000	
KEYCORP	79,276	20.120	1,595,033.120	
KIMBERLY-CLARK CORP	26,156	104.760	2,740,102.560	
BLACKROCK INC/NEW YORK	8,949	504.930	4,518,618.570	
KOHL'S CORP	11,357	71.220	808,845.540	
KROGER CO	67,450	28.770	1,940,536.500	
LAM RESEARCH CORP	12,122	176.400	2,138,320.800	
PACKAGING CORP OF AMERICA	7,057	114.340	806,897.380	
AKAMAI TECHNOLOGIES	12,622	75.830	957,126.260	
LEGGETT & PLATT INC	9,588	45.680	437,979.840	
LENNAR CORP	21,933	54.350	1,192,058.550	
JEFFERIES FINANCIAL GROUP INC	21,462	23.120	496,201.440	
ELI LILLY & CO	73,039	88.050	6,431,083.950	
L BRANDS INC	16,262	37.810	614,866.220	
LINCOLN NATIONAL CORP	16,362	64.710	1,058,785.020	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	51,308	108.510	5,567,431.080	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	25,175	63.670	1,602,892.250	
LOCKHEED MARTIN CORP	19,173	308.830	5,921,197.590	
LOEWS CORP	21,346	49.910	1,065,378.860	
LOWE'S COS INC	62,509	99.010	6,189,016.090	
DOMINION ENERGY INC	48,002	69.080	3,315,978.160	
SCANA CORP	10,902	39.620	431,937.240	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	40,298	29.930	1,206,119.140	
MCCORMICK & CO INC	9,307	117.920	1,097,481.440	
MCDONALD'S CORPORATION	59,447	160.620	9,548,377.140	
S&P GLOBAL INC	18,409	209.760	3,861,471.840	
EVEREST RE GROUP LTD	2,855	234.220	668,698.100	
MANPOWERGROUP INC	4,257	86.420	367,889.940	
MARKEL CORPORATION	989	1,120.580	1,108,253.620	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	16,081	147.050	2,364,711.050	
MARSH & MCLENNAN COS	37,853	85.180	3,224,318.540	
MASCO CORP	23,043	38.580	888,998.940	

MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	4,387	226.000	991,462.000	
MATTEL INC	24,003	17.380	417,172.140	
METLIFE INC	64,937	44.910	2,916,320.670	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	20,342	61.320	1,247,371.440	
MEDTRONIC PLC	100,647	87.390	8,795,541.330	
ACTIVISION BLIZZARD INC	54,568	76.190	4,157,535.920	
CVS HEALTH CORP	75,876	68.240	5,177,778.240	
MERCK & CO. INC.	201,289	62.300	12,540,304.700	
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	31,900	23.880	761,772.000	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	7,176	184.500	1,323,972.000	
MICROSOFT CORP	542,300	102.120	55,379,676.000	
MICRON TECH INC	86,870	55.740	4,842,133.800	
MIDDLEBY CORP	4,100	103.740	425,334.000	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	17,529	94.600	1,658,243.400	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	33,363	22.660	756,005.580	
3M CO	44,134	201.480	8,892,118.320	
MOHAWK INDUSTRIES INC	4,873	219.070	1,067,528.110	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	12,062	118.640	1,431,035.680	
KANSAS CITY SOUTHERN	7,247	108.500	786,299.500	
MYLAN NV	38,244	36.670	1,402,407.480	
ILLUMINA INC	11,065	291.440	3,224,783.600	
XCEL ENERGY INC	37,554	45.690	1,715,842.260	
NATIONAL OILWELL VARCO INC	26,938	45.330	1,221,099.540	
NETAPP INC	20,587	79.240	1,631,313.880	
NEWFIELD EXPLORATION CO	13,740	30.770	422,779.800	
NEWELL BRANDS INC	36,206	27.640	1,000,733.840	
NEWMONT MINING CORP	38,093	37.910	1,444,105.630	
NVR INC	236	3,103.560	732,440.160	
NIKE INC-CL B	96,817	77.570	7,510,094.690	
NOBLE ENERGY INC	36,582	37.230	1,361,947.860	
NORDSTROM INC	9,487	52.090	494,177.830	
NORFOLK SOUTHERN CORP	21,159	158.710	3,358,144.890	
EVERSOURCE ENERGY	23,085	58.720	1,355,551.200	
NISOURCE INC	22,198	26.240	582,475.520	
TAPESTRY INC	22,269	46.500	1,035,508.500	
NORTHERN TRUST CORP	16,090	105.010	1,689,610.900	
NORTHROP GRUMMAN CORP	12,188	315.120	3,840,682.560	
WELLS FARGO & CO	348,201	56.620	19,715,140.620	
NUCOR CORP	23,780	64.730	1,539,279.400	
CHENIERE ENERGY INC	15,927	64.230	1,022,991.210	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	36,024	96.010	3,458,664.240	

OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	56,876	85.700	4,874,273.200	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	4,917	148.020	727,814.340	
OGE ENERGY CORP	16,028	34.770	557,293.560	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	6,375	288.110	1,836,701.250	
ORACLE CORP	230,824	46.990	10,846,419.760	
PACCAR INC	26,537	62.580	1,660,685.460	
EXELON CORP	69,910	42.170	2,948,104.700	
PARKER HANNIFIN CORP	9,885	160.030	1,581,896.550	
PAYCHEX INC	23,141	69.690	1,612,696.290	
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	6,526	57.730	376,745.980	
ALIGN TECHNOLOGY INC	5,854	351.450	2,057,388.300	
PPL CORPORATION	52,183	28.310	1,477,300.730	
PEPSICO INC	104,692	112.890	11,818,679.880	
PENTAIR PLC	11,775	43.520	512,448.000	
PFIZER INC	440,510	37.430	16,488,289.300	
CONOCOPHILLIPS	87,473	71.740	6,275,313.020	
PVH CORP	5,387	151.310	815,106.970	
PG&E CORP	38,695	43.720	1,691,745.400	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	12,758	189.820	2,421,723.560	
ALTRIA GROUP INC	141,336	58.760	8,304,903.360	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	35,408	137.750	4,877,452.000	
POLARIS INDUSTRIES INC	3,845	123.700	475,626.500	
GARMIN LTD	7,795	63.300	493,423.500	
AETNA INC	23,744	188.260	4,470,045.440	
FLUOR CORP (NEW)	9,821	49.760	488,692.960	
PPG INDUSTRIES INC	19,079	104.800	1,999,479.200	
IPG PHOTONICS CORP	2,441	233.760	570,608.160	
PRAXAIR INC	21,319	166.470	3,548,973.930	
COSTCO WHOLESALE CORP	32,871	211.700	6,958,790.700	
T ROWE PRICE GROUP INC	18,363	118.740	2,180,422.620	
QUEST DIAGNOSTICS	10,378	112.990	1,172,610.220	
PROCTER & GAMBLE CO	186,535	79.820	14,889,223.700	
PROGRESSIVE CORP	43,996	59.650	2,624,361.400	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	37,115	52.040	1,931,464.600	
PULTE GROUP INC	21,209	29.500	625,665.500	
NEW YORK COMMUNITY BANCORP INC	30,388	11.550	350,981.400	
GLOBAL PAYMENTS INC	11,769	113.600	1,336,958.400	
QUALCOMM INC	109,843	58.370	6,411,535.910	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	10,187	92.290	940,158.230	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	2,550	124.750	318,112.500	

REGENERON PHARMACEUTICALS	5,659	366.270	2,072,721.930	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA INC	4,642	138.340	642,174.280	
RESMED INC	10,594	108.000	1,144,152.000	
US BANCORP	116,678	51.350	5,991,415.300	
SEATTLE GENETICS INC /WA	7,317	69.290	506,994.930	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	31,422	28.240	887,357.280	
ROSS STORES INC	28,189	85.920	2,421,998.880	
ROLLINS INC	8,252	55.000	453,860.000	
ROPER TECHNOLOGIES INC	7,723	280.990	2,170,085.770	
ROCKWELL AUTOMATION INC	9,567	171.400	1,639,783.800	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	12,293	109.130	1,341,535.090	
RAYTHEON COMPANY	21,317	195.910	4,176,213.470	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	3,848	243.360	936,449.280	
ACCENTURE PLC-CL A	45,610	166.460	7,592,240.600	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	111,556	42.080	4,694,276.480	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	9,849	157.920	1,555,354.080	
ROCKWELL COLLINS INC	12,086	136.690	1,652,035.340	
THE TRAVELERS COMPANIES INC	19,755	125.870	2,486,561.850	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	24,562	107.640	2,643,853.680	
BOOKING HOLDINGS INC	3,645	2,064.040	7,523,425.800	
SCHLUMBERGER LTD	103,099	69.490	7,164,349.510	
SCHWAB (CHARLES) CORP	90,105	51.110	4,605,266.550	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	15,475	114.800	1,776,530.000	
BUNGE LTD	10,334	70.200	725,446.800	
SEI INVESTMENTS CO	9,315	64.140	597,464.100	
ANTHEM INC	19,325	249.520	4,821,974.000	
AMERISOURCEBERGEN CORP	12,257	88.140	1,080,331.980	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	21,442	54.770	1,174,378.340	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	6,319	418.880	2,646,902.720	
CENTENE CORP	15,113	130.610	1,973,908.930	
SVB FINANCIAL GROUP	4,107	301.920	1,239,985.440	
IAC INTERACTIVE CORP	5,050	152.550	770,377.500	
SMITH (A.O.) CORP	9,565	61.390	587,195.350	
ACUITY BRANDS INC	3,087	130.650	403,316.550	
SNAP-ON INC	3,932	166.320	653,970.240	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	31,808	97.010	3,085,694.080	
ADVANCE AUTO PARTS	5,273	140.650	741,647.450	
EDISON INTERNATIONAL	24,600	64.990	1,598,754.000	
SOUTHERN CO	75,642	47.340	3,580,892.280	
BB&T CORP	59,388	52.320	3,107,180.160	

SOUTHWEST AIRLINES	11,352	53.000	601,656.000	
AT&T INC	540,606	32.500	17,569,695.000	
CHEVRON CORP	141,261	127.590	18,023,490.990	
STANLEY BLACK & DECKER INC	11,629	137.030	1,593,521.870	
STATE STREET CORP	27,099	93.770	2,541,073.230	
STARBUCKS CORP	104,312	50.420	5,259,411.040	
STEEL DYNAMICS INC	19,030	47.410	902,212.300	
STRYKER CORP	25,320	174.380	4,415,301.600	
NETFLIX INC	32,015	415.630	13,306,394.450	
STERICYCLE INC	6,853	66.810	457,848.930	
SUNTRUST BANKS INC	34,756	69.180	2,404,420.080	
SYMANTEC CORP	47,004	21.410	1,006,355.640	
KNIGHT SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	9,793	38.750	379,478.750	
SYNOPSIS INC	10,656	88.990	948,277.440	
SYSCO CORP	35,926	69.650	2,502,245.900	
INTUITIVE SURGICAL INC	8,408	502.110	4,221,740.880	
TELEFLEX INC	3,203	278.290	891,362.870	
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	71,553	24.140	1,727,289.420	
ANDEAVOR	11,500	135.770	1,561,355.000	
TEXAS INSTRUMENTS INC	73,391	113.730	8,346,758.430	
TEXTRON INC	19,076	66.870	1,275,612.120	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	30,141	214.160	6,454,996.560	
TIFFANY & CO	8,733	133.110	1,162,449.630	
TOLL BROTHERS INC	9,526	37.210	354,462.460	
TORCHMARK CORP	7,699	84.770	652,644.230	
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	11,279	87.330	984,995.070	
DAVITA INC	10,878	70.600	767,986.800	
TRACTOR SUPPLY CO	9,276	77.720	720,930.720	
TRIMBLE INC	20,073	34.060	683,686.380	
TYSON FOODS INC	21,621	66.670	1,441,472.070	
UGI CORP	12,068	53.110	640,931.480	
MARATHON OIL CORP	64,347	21.980	1,414,347.060	
UNION PACIFIC CORP	58,589	144.110	8,443,260.790	
UNITED TECHNOLOGIES CORP	56,111	127.060	7,129,463.660	
UNITEDHEALTH GROUP INC	71,700	255.540	18,322,218.000	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	6,351	115.240	731,889.240	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	6,848	118.100	808,748.800	
VF CORP	24,309	83.100	2,020,077.900	
CBS CORP	27,376	58.740	1,608,066.240	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	19,280	175.110	3,376,120.800	

VULCAN MATERIALS CO	10,136	127.350	1,290,819.600	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	63,286	63.200	3,999,675.200	
WALMART INC	109,762	87.210	9,572,344.020	
WASTE MANAGEMENT INC	32,216	83.410	2,687,136.560	
WATERS CORP	5,963	199.920	1,192,122.960	
ALLERGAN PLC	25,196	175.950	4,433,236.200	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	8,855	109.140	966,434.700	
VAIL RESORTS INC	3,098	282.660	875,680.680	
WESTERN DIGITAL CORP	22,254	80.080	1,782,100.320	
WABTEC CORP	5,497	101.870	559,979.390	
WHIRLPOOL CORP	5,553	154.050	855,439.650	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	13,529	101.640	1,375,087.560	
WYNN RESORTS LTD	7,179	165.380	1,187,263.020	
NASDAQ INC	9,132	90.760	828,820.320	
CME GROUP INC	25,415	164.170	4,172,380.550	
WILLIAMS COS INC	61,081	27.510	1,680,338.310	
LKQ CORP	22,948	33.190	761,644.120	
ALLIANT ENERGY CORP	16,383	42.550	697,096.650	
WEC ENERGY GROUP INC	23,117	64.530	1,491,740.010	
TD AMERITRADE HOLDING CORP	21,581	55.730	1,202,709.130	
CARMAX INC	13,513	76.540	1,034,285.020	
XEROX CORP	17,455	25.270	441,087.850	
XILINX INC	19,197	69.190	1,328,240.430	
CIMAREX ENERGY CO	7,003	102.100	715,006.300	
TJX COMPANIES INC	47,171	95.030	4,482,660.130	
ZIONS BANCORP	16,584	53.420	885,917.280	
DAIRY FARM INTERNATIONAL HLDNGS	27,400	9.230	252,902.000	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	76,400	7.300	557,720.000	
JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	15,700	64.510	1,012,807.000	
JARDINE STRATEGIC HOLDINGS LTD	17,100	36.920	631,332.000	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	6,051	104.730	633,721.230	
SIGNATURE BANK	4,171	129.470	540,019.370	
CBRE GROUP INC	24,276	49.350	1,198,020.600	
LIBERTY GLOBAL PLC	12,435	29.290	364,221.150	
REGIONS FINANCIAL CORP	84,486	17.880	1,510,609.680	
DOMINO'S PIZZA INC	3,256	272.390	886,901.840	
WESTLAKE CHEMICAL CORP	3,000	111.600	334,800.000	
T-MOBILE US INC	25,388	61.180	1,553,237.840	
LAS VEGAS SANDS CORP	30,271	73.630	2,228,853.730	
MOSAIC CO/THE	26,525	28.930	767,368.250	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX NEWS	32,515	49.340	1,604,290.100	

TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC	78,440	49.770	3,903,958.800	
CELANESE CORP	9,491	114.100	1,082,923.100	
DISCOVERY INC-A	10,423	28.400	296,013.200	
EXPEDIA GROUP INC	8,709	127.260	1,108,307.340	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	18,475	43.640	806,249.000	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	10,578	144.830	1,532,011.740	
LIBERTY GLOBAL PLC- SERIES C	41,818	28.410	1,188,049.380	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	43,585	74.440	3,244,467.400	
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	14,696	22.570	331,688.720	
VIACOM INC-CLASS B	24,612	30.500	750,666.000	
LIVE NATION	8,864	49.960	442,845.440	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,807	454.210	820,757.470	
UNITED CONTINENTAL HOLIDINGS INC	6,191	71.300	441,418.300	
TRANSDIGM GROUP INC	3,812	352.370	1,343,234.440	
MASTERCARD INC	69,052	201.520	13,915,359.040	
QURATE RETAIL INC	35,733	21.990	785,768.670	
HANESBRANDS INC	27,619	22.230	613,970.370	
WESTERN UNION CO	35,222	20.440	719,937.680	
OWENS CORNING	7,333	64.220	470,925.260	
LEIDOS HOLDINGS INC	9,322	61.270	571,158.940	
AERCAP HOLDINGS NV	11,586	55.050	637,809.300	
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLDINGS INC	9,175	85.820	787,398.500	
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT-ADR	18,099	25.630	463,877.370	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	8,330	117.300	977,109.000	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	22,746	18.450	419,663.700	
DELTA AIR LINES INC	13,898	50.600	703,238.800	
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	6,354	63.980	406,528.920	
DISCOVER FINANCIAL	27,177	71.580	1,945,329.660	
TE CONNECTIVITY LTD	26,204	93.540	2,451,122.160	
CONCHO RESOURCES INC/MIDLAND TX	10,552	145.390	1,534,155.280	
WABCO HOLDING INC	4,076	120.570	491,443.320	
LULULEMON ATHLETICA INC	7,883	127.380	1,004,136.540	
VMWARE INC	5,491	155.500	853,850.500	
MERCADOLIBRE INC	3,215	308.150	990,702.250	
ULTA BEAUTY INC	4,332	254.610	1,102,970.520	
INVESCO LTD	29,824	27.230	812,107.520	
MSCI INC	6,462	168.730	1,090,333.260	



PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	114,627	82.670	9,476,214.090	
VISA INC	134,179	136.690	18,340,927.510	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	13,492	86.240	1,163,550.080	
DISCOVERY INC-C	23,054	26.220	604,475.880	
MARATHON PETROLEUM CORP	35,273	71.870	2,535,070.510	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	11,624	55.190	641,528.560	
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	155,757	18.220	2,837,892.540	
XYLEM INC	12,873	68.190	877,809.870	
ALKERMES PLC	12,053	43.280	521,653.840	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	24,984	110.190	2,752,986.960	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,479	223.500	777,556.500	
SPLUNK INC	10,674	100.200	1,069,534.800	
HCA HEALTHCARE INC	21,696	105.800	2,295,436.800	
VERISK ANALYTICS INC	11,859	111.550	1,322,871.450	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	3,987	180.570	719,932.590	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	6,544	219.430	1,435,949.920	
FIRST REPUBLIC BANK/SAN FRANCISCO CA	11,868	99.290	1,178,373.720	
CIT GROUP INC	9,287	52.140	484,224.180	
NXP SEMICONDUCTOR NV	22,652	110.355	2,499,761.460	
TARGA RESOURCES CORP	16,445	50.900	837,050.500	
LEAR CORP	5,132	192.470	987,756.040	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	8,640	102.900	889,056.000	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	17,000	53.770	914,090.000	
DOLLAR GENERAL CORP	21,402	100.010	2,140,414.020	
FORTINET INC	11,399	65.410	745,608.590	
AON PLC	18,487	142.820	2,640,313.340	
TESLA INC	9,463	322.470	3,051,533.610	
GENERAL MOTORS CO	95,770	40.090	3,839,419.300	
WORLDPAY INC	21,000	85.180	1,788,780.000	
XPO LOGISTICS INC	9,000	103.500	931,500.000	
TRIPADVISOR INC	9,263	57.590	533,456.170	
ALLY FINANCIAL INC	31,409	27.520	864,375.680	
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	12,138	67.310	817,008.780	
VOYA FINANCIAL INC	13,525	48.370	654,204.250	
APTIV PLC	19,069	96.340	1,837,107.460	
PHILLIPS 66	32,776	113.190	3,709,915.440	
FACEBOOK INC	177,316	203.540	36,090,898.640	
IQVIA HOLDINGS INC	11,751	103.920	1,221,163.920	
DIAMONDBACK ENERGY INC	7,054	133.960	944,953.840	

SERVICENOW INC	12,906	185.600	2,395,353.600	
PALO ALTO NETWORKS INC	7,006	210.700	1,476,164.200	
WORKDAY INC	10,417	129.140	1,345,251.380	
ABBVIE INC	112,000	98.840	11,070,080.000	
ZOETIS INC	36,976	86.220	3,188,070.720	
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDINGS LTD	16,470	47.600	783,972.000	
COTY INC	38,541	14.440	556,532.040	
NEWS CORP/NEW-CL A	30,263	15.770	477,247.510	
HD SUPPLY HOLDINGS INC	12,891	44.010	567,332.910	
CDW CORP	10,824	84.310	912,571.440	
SPRINT CORP	63,882	5.630	359,655.660	
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	10,199	39.120	398,984.880	
ARCONIC INC	27,513	17.740	488,080.620	
LIBERTY MEDIA CORP- LIBERTY-C	13,175	39.080	514,879.000	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	5,006	47.030	235,432.180	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-C	13,368	47.300	632,306.400	
XL GROUP LTD	19,366	56.340	1,091,080.440	
DELL TECHNOLOGIES INC	15,074	94.370	1,422,533.380	
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	15,410	21.150	325,921.500	
BAKER HUGHES A GE CO	31,904	34.270	1,093,350.080	
TECHNIPFMC LTD	32,556	31.850	1,036,908.600	
BROADCOM INC	30,394	250.560	7,615,520.640	
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	6,291	42.130	265,039.830	
ANTERO RESOURCES CORP	13,163	22.360	294,324.680	
VEEVA SYSTEMS INC	9,087	79.450	721,962.150	
TWITTER INC	51,498	43.750	2,253,037.500	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING PLC	11,392	50.800	578,713.600	
EVERGY INC	21,000	55.000	1,155,000.000	
PLAINS GP HOLDINGS LP	7,837	23.940	187,617.780	
COMMSCOPE HOLDING CO INC	12,920	29.900	386,308.000	
ALLEGION PLC	7,325	78.350	573,913.750	
PERRIGO CO PLC	10,553	77.810	821,128.930	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	20,000	81.280	1,625,600.000	
ARAMARK	17,307	38.630	668,569.410	
SABRE CORP	17,624	25.850	455,580.400	
PARSLEY ENERGY INC	17,454	32.870	573,712.980	
ARISTA NETWORKS INC	3,748	268.550	1,006,525.400	
IHS MARKIT LTD	30,253	52.450	1,586,769.850	
FNF GROUP	20,660	38.340	792,104.400	
SYNCHRONY FINANCIAL	53,885	34.850	1,877,892.250	
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	34,845	40.040	1,395,193.800	
CDK GLOBAL INC	8,309	66.700	554,210.300	

KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	14,300	60.420	864,006.000	
QORVO INC	8,784	83.290	731,619.360	
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	16,089	39.120	629,401.680	
LIBERTY BROADBAND CORP-C W/I	7,818	79.480	621,374.640	
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	14,710	30.460	448,066.600	
GODADDY INC	11,400	74.790	852,606.000	
NIELSEN HOLDINGS PLC	26,840	31.550	846,802.000	
TRANSUNION	13,841	74.070	1,025,202.870	
SQUARE INC	20,423	64.760	1,322,593.480	
DOWDUPONT INC	173,668	67.810	11,776,427.080	
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS PLC	17,100	41.720	713,412.000	
WESTROCK CO	17,744	58.110	1,031,103.840	
KRAFT HEINZ CO	43,818	64.000	2,804,352.000	
FORTIVE CORP	23,630	77.060	1,820,927.800	
WASTE CONNECTIONS INC	18,879	76.740	1,448,774.460	
ALPHABET INC-CL A	22,200	1,167.140	25,910,508.000	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	113,242	15.500	1,755,251.000	
PAYPAL HOLDINGS INC	85,540	86.170	7,370,981.800	
FIRST DATA CORP	35,404	22.170	784,906.680	
DXC TECHNOLOGY CO	21,351	84.990	1,814,621.490	
ZILLOW GROUP INC-C	8,134	60.940	495,685.960	
ALPHABET INC-CL C	23,300	1,152.840	26,861,172.000	
L3 TECHNOLOGIES INC	5,892	197.300	1,162,491.600	
CHEMOURS CO	12,723	45.960	584,749.080	
ATHENE HOLDING LTD	11,784	45.450	535,582.800	
CHARTER COMMUNICATIONS INC	12,506	305.710	3,823,209.260	
VISTRA ENERGY CORP	30,000	23.010	690,300.000	
アメリカ・ドル 小計	22,744,763		1,805,781,708.560 (200,315,364,929)	
イギリス・ポンド				
ANTOFAGASTA PLC	25,905	9.694	251,123.070	
ASHTED GROUP	35,233	23.370	823,395.210	
SEVERN TRENT PLC	14,897	19.300	287,512.100	
BHP BILLITON PLC	153,323	17.076	2,618,143.540	
BARCLAYS PLC	1,292,957	1.864	2,410,071.840	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	64,682	4.830	312,414.060	
BT GROUP PLC	638,910	2.273	1,452,242.430	
SKY PLC	72,210	15.015	1,084,233.150	
BUNZL PLC	26,515	22.920	607,723.800	
EASYJET PLC	13,628	16.110	219,547.080	
AVIVA PLC	303,368	4.980	1,510,772.640	
CRODA INTERNATIONAL	10,645	48.930	520,859.850	
DIAGEO PLC	183,390	27.675	5,075,318.250	
SCHRODERS PLC	10,932	32.440	354,634.080	

DCC PLC	5,936	69.050	409,880.800	
NATIONAL GRID PLC	253,078	8.518	2,155,718.400	
KINGFISHER PLC	165,680	3.015	499,525.200	
BAE SYSTEMS PLC	225,176	6.482	1,459,590.830	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	169,676	39.315	6,670,811.940	
NEXT PLC	9,731	59.800	581,913.800	
IMPERIAL BRANDS PLC	72,328	29.050	2,101,128.400	
JOHNSON MATTHEY PLC	15,017	35.730	536,557.410	
ANGLO AMERICAN PLC	79,906	17.230	1,376,780.380	
COMPASS GROUP PLC	115,111	15.990	1,840,624.890	
HSBC HOLDINGS PLC	1,488,734	7.070	10,525,349.380	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	423,649	2.665	1,129,024.580	
CENTRICA PLC	392,766	1.630	640,208.580	
UNILEVER PLC	91,931	41.970	3,858,344.070	
MEGGITT PLC	62,181	5.580	346,969.980	
MORRISON <WM.> SUPERMARKETS	155,682	2.560	398,545.920	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	54,487	7.354	400,697.390	
RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	80,864	6.522	527,395.000	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	25,308	25.100	635,230.800	
PEARSON PLC	65,009	9.082	590,411.730	
PERSIMMON PLC	23,150	24.960	577,824.000	
PRUDENTIAL PLC	193,029	17.675	3,411,787.570	
RIO TINTO PLC	90,035	41.460	3,732,851.100	
VODAFONE GROUP PLC	1,993,578	1.890	3,767,862.420	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	50,208	63.580	3,192,224.640	
RELX PLC	82,464	16.510	1,361,480.640	
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	116,966	9.942	1,162,875.970	
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	330,000	2.446	807,180.000	
ST JAMES'S PLACE PLC	40,884	11.815	483,044.460	
TRAVIS PERKINS PLC	20,357	13.870	282,351.590	
SSE PLC	73,043	13.745	1,003,976.030	
BP PLC	1,481,204	5.895	8,731,697.580	
SHIRE PLC	67,647	43.010	2,909,497.470	
SAGE GROUP PLC(THE)	85,271	6.258	533,625.910	
SMITHS GROUP PLC	31,720	17.455	553,672.600	
STANDARD CHARTERED PLC	210,236	6.914	1,453,571.700	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	5,397,548	0.625	3,373,467.500	
TAYLOR WIMPLEY PLC	253,022	1.738	439,752.230	
TESCO PLC	740,567	2.547	1,886,224.140	
3I GROUP PLC	66,784	9.172	612,542.840	
SMITH & NEPHEW PLC	66,155	13.380	885,153.900	

GLAXOSMITHKLINE PLC	369,384	15.636	5,775,688.220	
WEIR GROUP	18,336	20.200	370,387.200	
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	21,888	45.000	984,960.000	
BABCOCK INT'L GROUP	21,302	7.784	165,814.760	
WPP PLC	90,628	12.280	1,112,911.840	
FERGUSON PLC	17,278	61.630	1,064,843.140	
ASTRAZENECA PLC	94,694	52.810	5,000,790.140	
WHITBREAD PLC	12,159	40.100	487,575.900	
CARNIVAL PLC	13,153	43.200	568,209.600	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	120,290	3.109	373,981.610	
JOHN WOOD GROUP PLC	48,988	6.468	316,854.380	
INTERTEK GROUP PLC	11,273	56.580	637,826.340	
BURBERRY GROUP PLC	29,893	21.010	628,051.930	
INVESTEC PLC	50,655	5.580	282,654.900	
INTERCONTINENTAL HOTELS	12,362	47.640	588,925.680	
ITV PLC	247,210	1.800	444,978.000	
SAINSBURY (J) PLC	137,215	3.294	451,986.210	
RANDGOLD RESOURCES LTD NPR	6,998	56.960	398,606.080	
G4S PLC	122,250	2.764	337,899.000	
ADMIRAL GROUP PLC	15,893	18.985	301,728.600	
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	10,726	35.730	383,239.980	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	341,563	26.945	9,203,415.030	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	275,246	27.805	7,653,215.030	
TUI AG-DI	30,153	16.955	511,244.110	
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	184,183	3.167	583,307.560	
EXPERIAN PLC	71,068	19.220	1,365,926.960	
MONDI PLC	28,318	20.630	584,200.340	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	21,290	20.700	440,703.000	
FRESNILLO PLC NPR	15,639	11.345	177,424.450	
INFORMA PLC	80,000	8.486	678,880.000	
GLENCORE PLC	861,237	3.269	2,815,383.750	
GVC HOLDINGS PLC	36,000	10.910	392,760.000	
NMC HEALTH PLC	8,149	36.000	293,364.000	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP PLC	112,694	3.353	377,862.980	
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	30,616	5.314	162,693.420	
COCA-COLA HBC AG	13,406	26.780	359,012.680	
CONVATEC GROUP PLC	118,400	1.960	232,064.000	
ROYAL MAIL PLC	55,060	4.876	268,472.560	
MERLIN ENTERTAINMENTS PLC	50,037	4.105	205,401.880	

	MICRO FOCUS INTERNATIONAL PLC	32,342	13.035	421,577.970	
	AUTO TRADER GROUP PLC	76,348	4.245	324,097.260	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	335,000	2.139	716,565.000	
イギリス・ボンド	小計	22,462,037		143,820,850.360 (21,141,665,003)	
イスラエル・シュケル	BANK HAPOALIM BM	78,428	25.780	2,021,873.840	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	103,061	22.610	2,330,209.210	
	BEZEQ ISRAELI TELECOMMUNICATION CORP LTD	188,230	3.840	722,803.200	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,760	435.900	767,184.000	
	FRUTAROM INDUSTRIES LTD	2,600	360.500	937,300.000	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	49,411	16.840	832,081.240	
	NICE LTD	4,035	383.800	1,548,633.000	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	10,444	67.920	709,356.480	
	AZRIELI GROUP	4,428	178.000	788,184.000	
イスラエル・シュケル	小計	442,397		10,657,624.970 (325,377,290)	
オーストラリア・ドル	RAMSAY HEALTH CARE LTD	11,115	53.920	599,320.800	
	AUST AND NZ BANKING GROUP LT	218,921	28.800	6,304,924.800	
	AMCOR LTD	80,741	14.070	1,136,025.870	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	253,113	29.490	7,464,302.370	
	BANK OF QUEENSLAND LTD	30,569	10.520	321,585.880	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	114,125	4.410	503,291.250	
	TELSTRA CORP LTD	272,919	2.770	755,985.630	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD	39,014	11.290	440,468.060	
	AMP LTD	200,498	3.650	731,817.700	
	ASX LTD	15,573	64.370	1,002,434.010	
	BHP BILLITON LTD	239,570	34.230	8,200,481.100	
	CALTEX AUSTRALIA LTD	20,946	31.130	652,048.980	
	HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	22,182	3.470	76,971.540	
	COMPUTERSHARE LT	38,040	17.930	682,057.200	
	CSL LIMITED	34,057	195.860	6,670,404.020	
	REA GROUP LTD	4,119	89.100	367,002.900	
	TRANSURBAN GROUP	167,883	11.860	1,991,092.380	
	COCA-COLA AMATIL LTD	48,601	9.590	466,083.590	
	COCHLEAR LTD	3,992	196.740	785,386.080	
	ORIGIN ENERGY LTD	121,721	10.090	1,228,164.890	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	129,233	74.430	9,618,812.190		
BORAL LIMITED	86,101	6.550	563,961.550		
RIO TINTO LIMITED	30,902	81.620	2,522,221.240		

	APA GROUP	77,562	9.960	772,517.520	
	ARISTOCRAT LEISU	43,933	30.790	1,352,697.070	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	171,471	8.120	1,392,344.520	
	TPG TELECOM LTD	28,719	5.520	158,528.880	
	FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	3,275	62.250	203,868.750	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	28,489	21.880	623,339.320	
	ORICA LTD	25,308	17.830	451,241.640	
	CIMIC GROUP LTD	8,709	43.170	375,967.530	
	BLUESCOPE STEEL LTD	36,941	17.820	658,288.620	
	SYDNEY AIRPORT	85,130	7.290	620,597.700	
	MACQUARIE GROUP LTD	24,250	122.520	2,971,110.000	
	SUNCORP GROUP LTD	93,181	14.910	1,389,328.710	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	202,508	27.860	5,641,872.880	
	NEWCREST MINING LTD	59,818	21.850	1,307,023.300	
	OIL SEARCH LTD	93,715	9.050	848,120.750	
	INCITEC PIVOT LTD	136,426	3.780	515,690.280	
	QBE INSURANCE GROUP LIMITED	95,390	9.770	931,960.300	
	CHALLENGER FINANCIAL SERVICES	45,707	12.190	557,168.330	
	SANTOS LTD	133,862	6.330	847,346.460	
	SONIC HEALTHCARE	26,192	25.230	660,824.160	
	TABCORP HOLDINGS LTD	126,348	4.650	587,518.200	
	WESFARMERS LTD	84,335	49.360	4,162,775.600	
	ALUMINA LIMITED	184,613	2.860	527,993.180	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	68,074	36.320	2,472,447.680	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	99,142	30.840	3,057,539.280	
	SEEK LTD	25,899	21.270	550,871.730	
	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES LTD	4,581	47.780	218,880.180	
	AUSNET SERVICES	165,066	1.635	269,882.910	
	AGL ENERGY LTD	46,315	22.750	1,053,666.250	
	BRAMBLES LTD	115,255	9.210	1,061,498.550	
	CROWN RESORTS LTD	32,861	13.490	443,294.890	
	AURIZON HOLDINGS LTD	139,184	4.410	613,801.440	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	50,789	17.560	891,854.840	
	HEALTHSCOPE LTD	149,047	2.210	329,393.870	
	MEDIBANK PVT LTD	177,176	3.080	545,702.080	
	SOUTH32 LTD(AUD)	367,057	3.690	1,354,440.330	
オーストラリア・ドル	小計	5,440,263		93,506,241.760 (7,694,628,634)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	16,141	60.700	979,758.700	
	ALIMENTATION COUCHE TARD INC	30,728	60.800	1,868,262.400	

BARRICK GOLD CORP	83,648	17.580	1,470,531.840	
ATCO LTD	7,193	40.190	289,086.670	
BANK OF MONTREAL	47,406	102.850	4,875,707.100	
BANK OF NOVA SCOTIA	87,876	75.180	6,606,517.680	
NATIONAL BANK OF CANADA	23,756	63.830	1,516,345.480	
BCE INC	11,568	55.000	636,240.000	
BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT	63,537	54.800	3,481,827.600	
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERN	25,819	31.180	805,036.420	
BOMBARDIER INC 'B'	151,615	5.400	818,721.000	
SAPUTO INC	18,601	44.280	823,652.280	
BLACKBERRY LTD	39,652	13.230	524,595.960	
CGI GROUP INC	19,367	85.060	1,647,357.020	
CCL INDUSTRIES INC	11,340	63.950	725,193.000	
CAE INC	23,000	27.660	636,180.000	
CAMECO CORP	32,627	14.600	476,354.200	
ROGERS COMM-CL B	25,967	64.260	1,668,639.420	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	32,680	115.880	3,786,958.400	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	91,420	48.970	4,476,837.400	
CANADIAN TIRE CORP-CL A	4,862	174.000	845,988.000	
CANADIAN UTILITIES LTD	9,119	32.860	299,650.340	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	54,813	111.480	6,110,553.240	
FIRST CAPITAL REALTY INC	11,417	20.210	230,737.570	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	13,930	36.920	514,295.600	
OPEN TEXT CORP	19,756	48.770	963,500.120	
EMPIRE CO LTD	15,093	26.360	397,851.480	
KINROSS GOLD CORP	99,741	5.110	509,676.510	
FINNING INTERNATIONAL INC	9,892	33.540	331,777.680	
FORTIS INC	33,302	42.140	1,403,346.280	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	55,296	19.790	1,094,307.840	
TELUS CORP	15,945	47.460	756,749.700	
GREAT WEST LIFECO INC	19,248	32.180	619,400.640	
IMPERIAL OIL LTD	21,542	44.140	950,863.880	
ENBRIDGE INC	125,330	46.950	5,884,243.500	
IGM FINANCIAL INC	8,426	38.930	328,024.180	
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	87,995	3.850	338,780.750	
MANULIFE FINANCIAL CORP	145,162	23.860	3,463,565.320	
LINAMAR CORP	3,827	56.760	217,220.520	
LOBLAW CO LTD	15,354	67.310	1,033,477.740	
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANCE AND FINANCIAL SERVICES INC	6,524	50.720	330,897.280	
MAGNA INTERNATIONAL INC	25,339	80.210	2,032,441.190	



SUN LIFE FINANCIAL INC	45,976	53.340	2,452,359.840	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,985	718.990	1,427,195.150	
METRO INC	19,226	43.450	835,369.700	
HUSKY ENERGY INC	28,749	21.170	608,616.330	
CRESCENT POINT ENERGY CORP	39,992	10.230	409,118.160	
EMERA INC	6,509	42.450	276,307.050	
METHANEX CORP	5,281	95.000	501,695.000	
ONEX CORP	6,646	97.540	648,250.840	
GOLDCORP INC	66,602	18.210	1,212,822.420	
POWER CORP OF CANADA	25,052	29.360	735,526.720	
POWER FINANCIAL CORP	17,484	30.660	536,059.440	
ROYAL BANK OF CANADA	106,200	101.310	10,759,122.000	
SNC-LAVALIN GROUP INC	13,134	56.780	745,748.520	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	10,607	246.160	2,611,019.120	
SHAW COMM INC-B	35,748	27.360	978,065.280	
SUNCOR ENERGY INC	122,908	54.680	6,720,609.440	
LUNDIN MINING CORP	35,268	7.730	272,621.640	
ENCANA CORP	69,257	17.280	1,196,760.960	
TECK RESOURCES LTD-CL B	41,016	33.240	1,363,371.840	
THOMSON REUTERS CORP	20,469	54.110	1,107,577.590	
TORONTO DOMINION BANK (THE) C\$	136,076	76.200	10,368,991.200	
TRANSCANADA CORP	62,895	56.760	3,569,920.200	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	5,696	93.770	534,113.920	
WESTON (GEORGE) LTD	3,105	105.950	328,974.750	
INTACT FINANCIAL CORP	10,785	94.530	1,019,506.050	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	33,943	29.470	1,000,300.210	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,494	1,077.490	1,609,770.060	
FRANCO-NEVADA CORP NPR	14,687	96.430	1,416,267.410	
CI FINANCIAL CORP	20,695	24.270	502,267.650	
TOURMALINE OIL CORP	15,779	24.390	384,849.810	
KEYERA CORP	13,728	36.850	505,876.800	
ALTAGAS LTD	12,538	28.190	353,446.220	
PEMBINA PIPELINE CORP	38,497	46.630	1,795,115.110	
DOLLARAMA INC	22,512	49.490	1,114,118.880	
CENOVUS ENERGY INC W/I	80,545	14.640	1,179,178.800	
VERMILION ENERGY INC	8,291	48.710	403,854.610	
ARC RESOURCES LTD	22,997	14.260	327,937.220	
INTER PIPELINE LTD	24,083	25.310	609,540.730	
NUTRIEN LTD	45,351	71.270	3,232,165.770	
WSP GLOBAL INC	8,400	68.780	577,752.000	
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	14,961	25.130	375,969.930	

	SEVEN GENERATIONS ENERGY LTD	17,231	14.560	250,883.360	
	RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	17,753	81.110	1,439,945.830	
	SHOPIFY INC	6,500	208.750	1,356,875.000	
	HYDRO ONE LTD	27,340	20.100	549,534.000	
カナダ・ドル 小計		3,029,845		136,976,524.490 (11,556,709,372)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE TECH ENG	125,000	3.320	415,000.000	
	SEMBICORP INDUSTRIES	81,400	2.670	217,338.000	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	123,700	2.770	342,649.000	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	692,140	0.290	200,720.600	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	134,800	26.300	3,545,240.000	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	29,000	9.680	280,720.000	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	5,944	32.370	192,407.280	
	SINGAPORE AIRPORT TERMINAL SERVICES LTD	42,300	5.180	219,114.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	68,900	7.340	505,726.000	
	CAPITALAND LTD	192,415	3.070	590,714.050	
	GENTING SINGAPORE LTD	416,400	1.210	503,844.000	
	KEPPEL CORP LTD	98,400	6.770	666,168.000	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	177,900	2.370	421,623.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	225,453	11.560	2,606,236.680	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	591,922	3.280	1,941,504.160	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	47,500	10.410	494,475.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	94,500	26.990	2,550,555.000	
	UOL GROUP LIMITED	40,500	6.720	272,160.000	
VENTURE CORP LTD	21,000	17.370	364,770.000		
WILMAR INTERNATIONAL LTD	142,300	3.070	436,861.000		
YANGZIJANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	188,800	0.910	171,808.000		
シンガポール・ドル 小計		3,540,274		16,939,633.770 (1,382,104,719)	
スイス・フラン	CREDIT SUISSE GROUP AG	187,381	15.095	2,828,516.190	
	NESTLE SA-REGISTERED	231,295	79.460	18,378,700.700	
	CIE FINANC RICHEMONT	39,186	85.140	3,336,296.040	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	52,431	225.100	11,802,218.100	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2,835	221.400	627,669.000	
	SIKA INHABER	9,060	137.500	1,245,750.000	
	SGS SA-REG	405	2,683.000	1,086,615.000	
	NOVARTIS AG-REG SHS	164,138	76.820	12,609,081.160	
	BALOISE HOLDING AG -R	4,127	146.400	604,192.800	

BARRY CALLEBAUT AG	144	1,791.000	257,904.000	
CLARIANT AG-REG	19,496	23.990	467,709.040	
SWISSCOM AG-REG	1,795	457.300	820,853.500	
ABB LTD	139,628	21.690	3,028,531.320	
ADECCO GROUP AG-REG	12,341	58.640	723,676.240	
GEBERIT AG	2,801	433.000	1,212,833.000	
LONZA GROUP AG-REG	5,389	282.800	1,524,009.200	
LINDT & SPRUENGLI PART	75	6,655.000	499,125.000	
LINDT & SPRUENGLI NAMEN	9	77,700.000	699,300.000	
GIVAUDAN-REG	692	2,365.000	1,636,580.000	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	11,199	297.800	3,335,062.200	
LAFARGEHOLCIM LTD	35,730	48.040	1,716,469.200	
TEMENOS GROUP	4,521	155.100	701,207.100	
SONOVA HOLDING AG	4,142	180.650	748,252.300	
KUEHNE & NAGEL INTL AG	3,687	153.350	565,401.450	
STRAUMANN HOLDING AG	782	749.000	585,718.000	
THE SWATCH GROUP AG-B	2,311	465.900	1,076,694.900	
THE SWATCH GROUP AG-REG	4,592	85.450	392,386.400	
SCHINDLER NAMEN	1,663	215.400	358,210.200	
SWISS LIFE HOLDING AG	2,225	346.800	771,630.000	
VIFOR PHARMA AG	3,050	174.000	530,700.000	
EMS-CHEMIE HOLDING	553	615.000	340,095.000	
SWISS PRIME SITE AG	5,990	90.150	539,998.500	
PARGESA HOLDING PORTEUR	3,000	84.950	254,850.000	
DUFREY GROUP	2,390	130.050	310,819.500	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,272	758.000	964,176.000	
JULIUS BAER GROUP LTD	15,227	59.780	910,270.060	
SWISS RE LTD	24,162	87.700	2,119,007.400	
UBS GROUP AG	285,455	15.160	4,327,497.800	
スイス・フラン 小計	1,285,179		83,938,006.300 (9,378,393,444)	
スウェーデン・ク ローナ				
ATLAS COPCO AB-A SHS	48,377	245.100	11,857,202.700	
ATLAS COPCO AB-B SHS	30,899	221.750	6,851,853.250	
ERICSSON LM-B SHS	221,748	68.500	15,189,738.000	
LUNDBERGS B	7,382	279.800	2,065,483.600	
SKF AB-B SHS	24,866	167.050	4,153,865.300	
SANDVIK AB	85,032	153.500	13,052,412.000	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	128,935	86.120	11,103,882.200	
SKANSKA AB-B SHS	21,179	161.500	3,420,408.500	
SWEDBANK AB	66,507	196.250	13,051,998.750	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	108,388	99.940	10,832,296.720	
VOLVO AB-B SHS	113,672	145.150	16,499,490.800	
SWEDISH MATCH AB	11,481	451.100	5,179,079.100	
TELE2 AB-B SHS	26,976	105.200	2,837,875.200	

	NORDEA AB	218,620	86.520	18,915,002.400	
	INDUSTRIVARDEN C	11,403	178.350	2,033,725.050	
	ELECTROLUX AB-SER B	19,191	194.200	3,726,892.200	
	SECURITAS AB-B SHS	24,098	143.600	3,460,472.800	
	INVESTOR AB-B SHS	33,412	363.200	12,135,238.400	
	HENNES&MAURITZ AB-B SHS	66,448	141.640	9,411,694.720	
	ASSA ABLOY AB-B	77,223	178.900	13,815,194.700	
	TELIA CO AB	184,927	41.670	7,705,908.090	
	LUNDIN PETROLEUM AB	16,790	298.100	5,005,099.000	
	BOLIDEN AB	21,855	289.800	6,333,579.000	
	ALFA LAVAL AB	23,343	209.500	4,890,358.500	
	KINNEVIK AB-B	18,310	312.200	5,716,382.000	
	MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR SA	5,332	539.000	2,873,948.000	
	ICA GRUPPEN AB	5,920	282.600	1,672,992.000	
	HUSQVARNA AB-B SHS	33,692	83.240	2,804,522.080	
	HEXAGON AB	18,360	492.700	9,045,972.000	
	EPIROC AB-A	48,377	97.200	4,702,244.400	
	EPIROC AB-B	30,899	84.460	2,609,729.540	
	ESSITY AB-B	46,071	220.200	10,144,834.200	
スウェーデン・クローナ 小計		1,799,713		243,099,375.200 (3,075,207,097)	
デンマーク・ク ローネ	CARLSBERG AS-B	7,330	781.200	5,726,196.000	
	A P MOLLER A/S	481	7,796.000	3,749,876.000	
	AP MOLLER MAERSK A	273	7,495.000	2,046,135.000	
	DANSKE BANK A/S	59,087	193.800	11,451,060.600	
	GENMAB A/S	4,613	1,063.500	4,905,925.500	
	NOVOZYMES-B SHS	15,904	330.900	5,262,633.600	
	NOVO NORDISK A/S-B	131,029	314.700	41,234,826.300	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	15,808	397.800	6,288,422.400	
	COLOPLAST-B	8,286	656.000	5,435,616.000	
	DSV A/S	14,452	512.800	7,410,985.600	
	WILLIAM DEMANT	6,537	278.000	1,817,286.000	
	H LUNDBECK A/S	4,840	442.900	2,143,636.000	
	TRYG A/S	11,107	153.500	1,704,924.500	
	PANDORA A/S	8,251	414.900	3,423,339.900	
	CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S	7,708	650.800	5,016,366.400	
	ISS A/S	11,125	225.600	2,509,800.000	
	ORSTED A/S	15,020	407.900	6,126,658.000	
デンマーク・クローネ 小計		321,851		116,253,687.800 (2,028,626,852)	
ニュージーラン ド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	71,110	6.850	487,103.500	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	29,894	12.240	365,902.560	
	A2 MILK CO LTD	55,091	11.660	642,361.060	
	FISHER & PAYKEL	42,678	14.910	636,328.980	
	FLETCHER BUILDING LTD	64,104	6.950	445,522.800	

	SPARK NEW ZEALAND LTD	159,623	3.810	608,163.630	
	MERIDIAN ENERGY LTD	90,173	3.160	284,946.680	
ニュージーランド・ドル 小計		512,673		3,470,329.210 (262,148,668)	
ノルウェー・クローネ	MARINE HARVEST	33,000	167.100	5,514,300.000	
	DNB ASA	70,426	162.100	11,416,054.600	
	NORSK HYDRO ASA	91,879	48.050	4,414,785.950	
	TELENOR ASA	53,178	172.350	9,165,228.300	
	ORKLA ASA	61,421	73.000	4,483,733.000	
	EQUINOR ASA	87,000	225.400	19,609,800.000	
	YARA INTERNATIONAL ASA	16,000	326.000	5,216,000.000	
	AKER BP ASA	8,552	317.600	2,716,115.200	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	16,683	139.000	2,318,937.000	
	SCHIBSTED ASA	7,445	238.000	1,771,910.000	
ノルウェー・クローネ 小計		445,584		66,626,864.050 (919,450,724)	
ユーロ	CRH PLC	65,287	30.580	1,996,476.460	
	PADDY POWER BETFAIR PLC	6,246	94.700	591,496.200	
	KERRY GROUP PLC-A	11,576	91.050	1,053,994.800	
	UMICORE	15,320	49.990	765,846.800	
	AIR LIQUIDE	32,310	110.550	3,571,870.500	
	AIRBUS SE	43,659	103.340	4,511,721.060	
	AXA	146,116	21.105	3,083,778.180	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	39,913	19.005	758,546.560	
	ADIDAS AG	14,139	185.000	2,615,715.000	
	ASSICURAZIONI GENERALI	88,233	14.480	1,277,613.840	
	DASSAULT AVIATION SA	157	1,669.000	262,033.000	
	DANONE	43,686	64.440	2,815,125.840	
	SAFRAN SA	25,571	104.000	2,659,384.000	
	INTESA SANPAOLO	1,015,652	2.525	2,564,521.300	
	INTESA SANPAOLO-RNC	51,178	2.646	135,416.980	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	24,725	80.010	1,978,247.250	
	ACCOR SA	16,000	43.740	699,840.000	
	BOUYGUES	16,412	38.210	627,102.520	
	BNP PARIBAS	82,934	53.410	4,429,504.940	
	RELX NV	70,826	18.595	1,317,009.470	
	THALES SA	8,128	111.800	908,710.400	
	CAPGEMINI SA	11,481	114.800	1,318,018.800	
	CASINO GUICHARD PERRACHON	4,264	35.570	151,670.480	
	INGENICO GROUP	4,334	79.320	343,772.880	
	UNICREDIT SPA	150,691	14.590	2,198,581.690	
	NATIXIS	70,166	6.092	427,451.270	
	KONINKLIJKE DSM NV	13,216	88.580	1,170,673.280	
	COMMERZBANK AG	83,118	8.461	703,261.390	
	EIFFAGE	5,949	95.560	568,486.440	

FRESENIUS SE & CO KGAA	30,924	68.500	2,118,294.000	
UNITED INTERNET	9,882	49.040	484,613.280	
FUCHS PETROLUB SE PEF	5,546	43.340	240,363.640	
PUBLICIS GROUPE	15,068	60.860	917,038.480	
MAN SE	3,396	96.400	327,374.400	
FAURECIA	6,117	61.440	375,828.480	
IBERDROLA SA	416,818	6.720	2,801,016.960	
ENI SPA	190,886	16.530	3,155,345.580	
IMERYSA	2,256	68.050	153,520.800	
JERONIMO MARTINS	19,517	12.695	247,768.310	
KBC GROUPE	18,378	66.100	1,214,785.800	
HANNOVER RUECK SE	4,868	110.000	535,480.000	
WARTSILA OYJ	34,935	16.735	584,637.220	
L'OREAL	18,584	207.900	3,863,613.600	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	20,764	293.200	6,088,004.800	
GEA GROUP AG	11,838	27.920	330,516.960	
BOLLORE	71,347	3.920	279,680.240	
MEDIOBANCA SPA	42,404	8.044	341,097.770	
MICHELIN(CGDE)-B	12,118	103.100	1,249,365.800	
CONTINENTAL AG	8,317	200.900	1,670,885.300	
DEUTSCHE POST AG-REG	73,325	28.290	2,074,364.250	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	14,426	11.440	165,033.440	
NOKIAN RENKAAT OYJ	9,399	34.510	324,359.490	
AXEL SPRINGER SE	3,067	64.400	197,514.800	
OMV AG	9,766	49.060	479,119.960	
PERNOD-RICARD	15,401	138.100	2,126,878.100	
PEUGEOT SA	42,232	21.220	896,163.040	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG- PFD	10,591	55.620	589,071.420	
RENAULT SA	14,378	75.130	1,080,219.140	
REPSOL SA	93,766	17.285	1,620,745.310	
REMY COINTREAU	1,860	113.800	211,668.000	
MERCK KGAA	9,551	86.180	823,105.180	
COMPAGNIE DE SAINT- GOBAIN	35,706	38.000	1,356,828.000	
RWE AG	39,183	21.740	851,838.420	
SEB SA	1,405	146.200	205,411.000	
LUXOTTICA GROUP SPA	11,602	56.000	649,712.000	
SOCIETE GENERALE-A	58,110	36.590	2,126,244.900	
VINCI S.A.	37,228	85.800	3,194,162.400	
SODEXO	6,286	90.120	566,494.320	
SOLVAY SA	5,036	108.050	544,139.800	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	39,729	70.820	2,813,607.780	
VIVENDI SA	79,680	20.800	1,657,344.000	
SAP SE	73,011	102.180	7,460,263.980	
TELEFONICA S.A	358,674	7.669	2,750,670.900	
TOTAL SA	178,965	54.620	9,775,068.300	

VALEO	17,731	49.110	870,769.410	
E.ON SE	164,012	9.715	1,593,376.580	
VOEST-ALPINE AG	9,875	41.760	412,380.000	
HENKEL AG & CO KGAA	7,858	96.000	754,368.000	
SIEMENS AG-REG	56,716	117.400	6,658,458.400	
UPM-KYMMENE OYJ	41,197	30.660	1,263,100.020	
ING GROEP NV-CVA	290,820	12.572	3,656,189.040	
PUMA AG	600	487.000	292,200.000	
BAYER AG	66,876	94.630	6,328,475.880	
STORA ENSO OYJ-R SHS	42,303	17.095	723,169.780	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	13,222	108.800	1,438,553.600	
DAIMLER AG	67,488	58.350	3,937,924.800	
BASF SE	68,209	82.870	5,652,479.830	
BEIERSDORF AG	6,780	97.380	660,236.400	
HOCHTIEF AG	1,707	157.200	268,340.400	
HEIDELBERGCEMENT AG	11,009	72.180	794,629.620	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	15,048	83.360	1,254,401.280	
ORANGE	141,819	14.765	2,093,957.530	
SAMPO OYJ-A SHS	32,949	42.680	1,406,263.320	
RANDSTAD NV	7,794	50.220	391,414.680	
ALLIANZ SE	32,994	181.800	5,998,309.200	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	189,631	3.490	661,812.190	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	93,187	21.170	1,972,768.790	
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	17,602	22.270	391,996.540	
HERMES INTL	2,285	539.000	1,231,615.000	
ENDESA S.A.	21,037	20.020	421,160.740	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	15,963	20.330	324,527.790	
ERSTE GROUP BANK AG	20,754	35.210	730,748.340	
MUENCHENER RUECKVER AG- REG	11,602	186.050	2,158,552.100	
ARCELOR MITTAL (NL)	47,245	25.670	1,212,779.150	
SOCIETE BIC SA	2,478	81.750	202,576.500	
DASSAULT SYSTEMES SA	8,961	124.600	1,116,540.600	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	18,558	36.560	678,480.480	
HEINEKEN NV	20,425	87.740	1,792,089.500	
AKZO NOBEL	18,209	74.500	1,356,570.500	
ASML HOLDING NV	30,496	170.500	5,199,568.000	
AEGON NV	120,404	5.194	625,378.370	
BANKINTER S.A.	57,960	8.634	500,426.640	
VOLKSWAGEN AG	2,329	144.300	336,074.700	
VOLKSWAGEN AG PFD	13,901	145.980	2,029,267.980	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	504,414	6.212	3,133,419.760	
KERING	5,479	493.800	2,705,530.200	
CNP ASSURANCES	13,987	19.590	274,005.330	

FORTUM OYJ	29,739	22.210	660,503.190	
AGEAS	12,993	42.900	557,399.700	
UCB SA	8,747	68.360	597,944.920	
THYSSENKRUPP AG	29,903	21.550	644,409.650	
UNILEVER NV-CVA	114,914	47.875	5,501,507.750	
CARREFOUR SA	39,144	14.285	559,172.040	
GAS NATURAL SDG SA	29,010	23.500	681,735.000	
ATOS SE	7,050	121.950	859,747.500	
NOKIA OYJ	417,248	5.054	2,108,771.390	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	73,000	37.400	2,730,200.000	
WOLTERS KLUWER-CVA	20,558	49.420	1,015,976.360	
SANOFI	84,037	71.630	6,019,570.310	
STMICROELECTRONICS NV	50,879	19.555	994,938.840	
ELISA OYJ	9,517	41.460	394,574.820	
BANCO SANTANDER SA	1,201,199	4.750	5,705,695.250	
METSO OYJ	8,585	28.810	247,333.850	
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	34,596	18.245	631,204.020	
QIAGEN N.V.	17,387	31.980	556,036.260	
1&1 DRILLISCH AG	3,149	50.550	159,181.950	
DEUTSCHE BANK AG-REG	149,244	9.740	1,453,636.560	
BMW VORZUG	4,116	68.950	283,798.200	
K & S	14,982	21.110	316,270.020	
ENEL SPA	607,499	4.846	2,943,940.150	
COLRUYT NV	4,673	51.520	240,752.960	
VOPAK (KON.)	5,364	40.070	214,935.480	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	246,287	13.890	3,420,926.430	
SARTORIUS AG	2,712	138.500	375,612.000	
LEONARDO SPA	26,269	8.580	225,388.020	
UBISOFT ENTERTAINMENT	5,911	96.460	570,175.060	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	81,774	22.060	1,803,934.440	
KONINKLIJKE KPN NV	228,967	2.475	566,693.320	
EUROFINS SCIENTIFIC	794	458.600	364,128.400	
TELEPERFORMANCE	4,436	154.100	683,587.600	
DEUTSCHE BOERSE AG	13,844	118.450	1,639,821.800	
EURAZEO	4,725	68.000	321,300.000	
BANCO SABADELL	367,753	1.473	541,700.160	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	5,814	91.820	533,841.480	
FRAPORT AG	3,149	83.020	261,429.980	
HEINEKEN HOLDING NV-A	8,014	84.850	679,987.900	
INDITEX	82,035	30.000	2,461,050.000	
JC DECAUX SA	6,058	29.240	177,135.920	
ANDRITZ AG	6,265	45.660	286,059.900	
MAPFRE SA	84,474	2.678	226,221.370	
ESSILOR INTL	14,632	122.450	1,791,688.400	
SNAM SPA	158,419	3.598	569,991.560	
CREDIT AGRICOLE SA	85,585	11.560	989,362.600	
ENAGAS	18,095	24.590	444,956.050	



WENDEL	2,220	122.600	272,172.000	
WIRECARD AG	8,803	149.100	1,312,527.300	
TENARIS SA	36,959	16.495	609,638.700	
TELECOM ITALIA SPA	792,163	0.636	503,815.660	
TELECOM ITALIA-RNC	497,596	0.555	276,165.780	
ATLANTIA SPA	34,969	25.170	880,169.730	
ILIAD SA	2,102	144.450	303,633.900	
PROXIMUS	14,283	20.890	298,371.870	
SES FDR	24,585	16.155	397,170.670	
TERNA SPA	112,686	4.664	525,567.500	
BIOMERIEUX	3,248	75.800	246,198.400	
GRIFOLS SA	18,800	25.440	478,272.000	
FERROVIAL SA	37,657	17.935	675,378.290	
LANXESS AG	6,856	68.460	469,361.760	
NESTE OYJ	8,839	67.480	596,455.720	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	9,641	26.740	257,800.340	
RECORDATI SPA	6,859	31.000	212,629.000	
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	35,583	7.265	258,510.490	
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	3,960	164.200	650,232.000	
KONE OYJ	23,717	44.560	1,056,829.520	
ENGIE	139,590	13.500	1,884,465.000	
ALSTOM	12,046	39.370	474,251.020	
TELENET GROUP HOLDING NV	3,634	42.340	153,863.560	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	12,542	18.680	234,284.560	
ELECTRICITE DE FRANCE	43,198	12.335	532,847.330	
IPSEN SA	2,487	137.400	341,713.800	
DEUTSCHE WOHNEN	26,714	41.300	1,103,288.200	
ARKEMA SA	5,230	104.150	544,704.500	
LEGRAND SA	19,920	63.780	1,270,497.600	
ADP	2,313	199.800	462,137.400	
ORION OYJ	8,051	23.520	189,359.520	
RTL GROUP SA	3,446	62.650	215,891.900	
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	37,921	17.265	654,706.060	
SYMRISE AG	9,628	78.300	753,872.400	
SCOR SE	13,875	31.790	441,086.250	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	17,397	35.640	620,029.080	
REXEL SA	23,245	12.740	296,141.300	
PRYSMIAN SPA	14,925	21.720	324,171.000	
CAIXABANK	262,372	3.846	1,009,082.710	
BUREAU VERITAS SA	21,480	23.370	501,987.600	
GETLINK	37,646	11.950	449,869.700	
SUEZ SA	25,406	11.210	284,801.260	
AMADEUS IT GROUP SA	32,520	69.100	2,247,132.000	
BRENTAG AG	12,353	49.100	606,532.300	

INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GROUP SA	44,747	7.666	343,030.500	
EVONIK INDUSTRIES AG	11,575	29.870	345,745.250	
EDENRED	18,306	28.290	517,876.740	
BANKIA SA	100,675	3.274	329,609.950	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	61,541	3.611	222,224.550	
HUGO BOSS AG -ORD	5,218	77.460	404,186.280	
OSRAM LICHT AG	7,017	34.400	241,384.800	
KION GROUP AG	4,686	64.200	300,841.200	
VONOVIA SE	35,308	41.250	1,456,455.000	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	73,287	6.640	486,625.680	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	10,000	38.050	380,500.000	
FERRARI NV	9,503	117.450	1,116,127.350	
METRO AG	10,774	10.535	113,504.090	
CNH INDUSTRIAL NV	78,645	9.150	719,601.750	
AIB GROUP PLC	52,322	4.816	251,982.750	
LINDE AG-TENDER	13,854	214.000	2,964,756.000	
REPSOL SA-RTS	93,766	0.497	46,601.700	
ACS ACTIVIDADES DE CONSTRUCCION-RTS	18,558	0.938	17,407.400	
IBERDROLA SA-RTS	416,818	0.191	79,612.230	
INNOGY SE-TEMPORARY	9,769	36.400	355,591.600	
PRYSMIAN SPA-RTS	14,925	0.842	12,566.850	
MONCLER SPA	14,353	38.440	551,729.320	
NN GROUP NV	21,965	36.030	791,398.950	
ZALANDO SE	6,674	49.870	332,832.380	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	76,719	17.186	1,318,492.730	
AENA SME SA	5,256	158.750	834,390.000	
ABN AMRO GROUP NV	29,129	21.990	640,546.710	
EXOR NV	7,726	58.520	452,125.520	
COVESTRO AG	14,459	76.840	1,111,029.560	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	57,180	88.500	5,060,430.000	
POSTE ITALIANE SPA	40,015	7.560	302,513.400	
AMUNDI SA	3,894	59.880	233,172.720	
SCHAEFFLER AG	12,644	11.555	146,101.420	
PIRELLI & C SPA	34,086	7.158	243,987.580	
UNIPER SE	13,897	26.660	370,494.020	
DELIVERY HERO AG	7,238	48.000	347,424.000	
ユーロ 小計	15,001,080		296,864,762.870 (38,607,262,411)	
香港・ドル				
ASM PACIFIC TECH	16,600	97.750	1,622,650.000	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	164,000	16.100	2,640,400.000	
BANK OF EAST ASIA	76,260	32.050	2,444,133.000	
CLP HOLDINGS LTD	119,500	87.500	10,456,250.000	

PCCW LTD	331,000	4.560	1,509,360.000	
LI & FUNG LTD	532,400	2.590	1,378,916.000	
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	49,000	61.400	3,008,600.000	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	89,040	234.000	20,835,360.000	
MTR CORP	118,500	43.200	5,119,200.000	
HANG LUNG GROUP LTD	63,000	21.450	1,351,350.000	
HANG SENG BANK LTD	56,000	199.200	11,155,200.000	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	92,228	42.050	3,878,187.400	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	96,500	57.800	5,577,700.000	
(THE) WHARF HOLDINGS LTD	95,750	26.100	2,499,075.000	
HONG KONG & CHINA GAS	671,050	15.300	10,267,065.000	
HYSAN DEVELOPMENT CO	50,000	42.850	2,142,500.000	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	186,000	61.350	11,411,100.000	
KERRY PROPERTIES LTD	33,000	37.050	1,222,650.000	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	262,000	36.950	9,680,900.000	
NWS HOLDINGS LTD	135,000	13.900	1,876,500.000	
YUE YUEN INDUSTRIAL HOLDINGS	50,500	22.850	1,153,925.000	
NEW WORLD DEVELOPMENT	441,266	11.120	4,906,877.920	
SHANGRI-LA ASIA LTD	104,000	14.300	1,487,200.000	
SINO LAND CO	255,400	12.740	3,253,796.000	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	114,000	120.000	13,680,000.000	
SWIRE PACIFIC LTD A	30,000	86.150	2,584,500.000	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	113,500	43.800	4,971,300.000	
WHEELLOCK & CO LTD	56,000	54.850	3,071,600.000	
MINTH GROUP LTD	44,000	32.300	1,421,200.000	
SJM HOLDINGS LTD	156,000	9.370	1,461,720.000	
WYNN MACAU LTD	124,400	24.350	3,029,140.000	
MGM CHINA HOLDINGS LTD	64,800	16.600	1,075,680.000	
AIA GROUP LTD	904,027	67.950	61,428,634.650	
HKT TRUST / HKT LTD	282,000	10.340	2,915,880.000	
SANDS CHINA LTD	169,200	41.450	7,013,340.000	
SWIRE PROPERTIES LTD	104,200	29.200	3,042,640.000	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT CO LTD	95,750	56.450	5,405,087.500	
HK ELECTRIC INVESTMENTS & HK ELECTRIC INVESTMENTS LTD	230,000	7.840	1,803,200.000	
WH GROUP LTD	701,500	6.220	4,363,330.000	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	199,332	85.300	17,003,019.600	
CK ASSET HOLDINGS LTD	184,332	62.500	11,520,750.000	
香港・ドル 小計	7,661,035		266,669,917.070	

			(3,768,045,929)	
合計	84,686,694		300,454,985,072 (300,454,985,072)	

## (2) 株式以外の有価証券

平成30年7月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考	
投資信託受益証券	オーストラリア・ドル	DEXUS	80,596.000	794,676.560		
		GOODMAN GROUP	121,619.000	1,167,542.400		
		GPT GROUP	144,955.000	737,820.950		
		LENDLEASE GROUP	37,363.000	760,710.680		
		MIRVAC GROUP	295,783.000	653,680.430		
		SCENTRE GROUP	383,688.000	1,707,411.600		
		STOCKLAND	194,018.000	799,354.160		
		VICINITY CENTRES	270,443.000	708,560.660		
	オーストラリア・ドル	小計		1,528,465.000	7,329,757.440 (603,165,739)	
	シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	200,806.000	544,184.260		
		CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	206,300.000	358,962.000		
		CAPITALAND MALL TRUST	199,000.000	415,910.000		
		SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	192,100.000	353,464.000		
	シンガポール・ドル	小計		798,206.000	1,672,520.260 (136,460,928)	
	投資信託受益証券	合計		2,326,671	739,626,667 (739,626,667)	
	投資証券	アメリカ・ドル	AGNC INVESTMENT CORP	32,741.000	624,043.460	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT			7,304.000	930,383.520		
AMERICAN TOWER CORP			32,749.000	4,700,791.460		
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT			77,528.000	812,493.440		
AVALONBAY COMMUNITIES INC			10,542.000	1,829,247.840		
BOSTON PROPERTIES INC			11,168.000	1,405,492.800		
CAMDEN PROPERTY TRUST			6,285.000	573,254.850		
CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP			30,388.000	3,360,912.800		
DIGITAL REALTY TRUST INC			15,118.000	1,751,117.940		
DUKE REALTY TRUST			24,470.000	707,917.100		
EQUINIX INC			5,887.000	2,624,895.560		
EQUITY RESIDENTIAL			27,070.000	1,756,030.900		
ESSEX PROPERTY TRUST INC			5,024.000	1,208,874.880		
EXTRA SPACE STORAGE INC			9,741.000	966,599.430		
FEDERAL REALTY INVS TRUST			6,000.000	757,680.000		
GGP INC			50,863.000	1,067,105.740		
HCP INC	34,130.000	887,721.300				

	HOST HOTELS & RESORTS INC	51,147.000	1,093,011.390	
	INVITATION HOMES INC	22,567.000	522,200.380	
	IRON MOUNTAIN INC	19,265.000	702,401.900	
	KIMCO REALTY	32,980.000	551,425.600	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	11,649.000	517,798.050	
	MID AMERICA	8,123.000	810,756.630	
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	10,544.000	470,578.720	
	PROLOGIS INC	38,966.000	2,565,131.780	
	PUBLIC STORAGE	11,851.000	2,734,144.210	
	REALTY INCOME CORP	22,285.000	1,236,148.950	
	REGENCY CENTERS CORP	11,294.000	696,726.860	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	8,169.000	1,351,887.810	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	23,209.000	4,011,211.470	
	SL GREEN	7,097.000	723,964.970	
	THE MACERICH COMPANY	9,014.000	524,164.100	
	UDR INC	21,658.000	810,658.940	
	VENTAS INC	25,041.000	1,469,155.470	
	VEREIT INC	72,429.000	555,530.430	
	VORNADO REALTY TRUST	12,211.000	903,247.670	
	WELLTOWER INC	26,516.000	1,677,137.000	
	WEYERHAEUSER CO	56,867.000	2,104,079.000	
アメリカ・ドル 小計		889,890.000	51,995,924.350 (5,767,907,888)	
イギリス・ボンド	BRITISH LAND CO PLC	71,871.000	474,348.600	
	HAMMERSON PLC	58,616.000	317,581.480	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	59,062.000	564,101.160	
	SEGRO PLC	82,914.000	562,986.060	
イギリス・ボンド 小計		272,463.000	1,919,017.300 (282,095,543)	
カナダ・ドル	H & R REAL ESTATE INVESTMENT	10,748.000	219,151.720	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	9,675.000	237,521.250	
	SMARTCENTRES REIT	2,582.000	78,647.720	
カナダ・ドル 小計		23,005.000	535,320.690 (45,165,006)	
ユーロ	COVIVIO	2,343.000	207,589.800	
	GECINA SA	3,670.000	525,911.000	
	ICADE	2,234.000	187,767.700	
	KLEPIERRE	17,042.000	551,990.380	
	UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	10,338.000	1,956,983.400	
ユーロ 小計		35,627.000	3,430,242.280 (446,103,008)	
香港・ドル	LINK REIT	163,500.000	12,131,700.000	
香港・ドル 小計		163,500.000	12,131,700.000 (171,420,921)	

投資証券 合計	1,384,485	6,712,692,366 (6,712,692,366)	
合計		7,452,319,033 (7,452,319,033)	

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

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入 投資信託受益 証券 時価比率	組入 投資証券 時価比率	有価証券の 合計金額 に対する 比率
アメリカ・ドル	株式 598銘柄	63.30%	-%	-%	66.93%
	投資証券 38銘柄	-%	-%	1.82%	
イギリス・ポンド	株式 97銘柄	6.68%	-%	-%	6.96%
	投資証券 4銘柄	-%	-%	0.09%	
イスラエル・シケル	株式 9銘柄	0.10%	-%	-%	0.11%
オーストラリア・ドル	株式 59銘柄	2.43%	-%	-%	2.69%
	投資信託 受益証券 8銘柄	-%	0.19%	-%	
カナダ・ドル	株式 87銘柄	3.65%	-%	-%	3.77%
	投資証券 3銘柄	-%	-%	0.01%	
シンガポール・ドル	株式 21銘柄	0.44%	-%	-%	0.49%
	投資信託 受益証券 4銘柄	-%	0.04%	-%	
スイス・フラン	株式 38銘柄	2.96%	-%	-%	3.05%
スウェーデン・クローナ	株式 32銘柄	0.97%	-%	-%	1.00%
デンマーク・クローネ	株式 17銘柄	0.64%	-%	-%	0.66%
ニュージーランド・ドル	株式 7銘柄	0.08%	-%	-%	0.09%
ノルウェー・クローネ	株式 10銘柄	0.29%	-%	-%	0.30%
ユーロ	株式 244銘柄	12.20%	-%	-%	12.68%
	投資証券 5銘柄	-%	-%	0.14%	
香港・ドル	株式 41銘柄	1.19%	-%	-%	1.28%
	投資証券 1銘柄	-%	-%	0.05%	

(注) 「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

## 「外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

(単位:円)

科 目	注記 番号	平成30年1月11日現在	平成30年7月11日現在
資産の部			
流動資産			
預金		409,027,141	124,946,716
コール・ローン		81,777,811	92,805,011
投資信託受益証券		6,493,687,842	5,393,315,131
投資証券		48,340,326,547	48,157,425,564
派生商品評価勘定		-	33,672
未収入金		28,955	84,591
未収配当金		276,841,525	226,329,480
流動資産合計		55,601,689,821	53,994,940,165
資産合計		55,601,689,821	53,994,940,165
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		167,021	-
未払金		392,565,351	-
未払解約金		6,842,000	82,839,000
その他未払費用		-	510
流動負債合計		399,574,372	82,839,510
負債合計		399,574,372	82,839,510
純資産の部			
元本等			
元本	1	46,402,765,697	43,633,295,638
剰余金			
剰余金又は欠損金( )		8,799,349,752	10,278,805,017
元本等合計		55,202,115,449	53,912,100,655
純資産合計		55,202,115,449	53,912,100,655
負債純資産合計		55,601,689,821	53,994,940,165



## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

## （貸借対照表に関する注記）

項目	平成30年1月11日現在	平成30年7月11日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	39,739,190,368円	46,402,765,697円
同期中追加設定元本額	14,619,980,786円	21,142,191,108円
同期中一部解約元本額	7,956,405,457円	23,911,661,167円
元本の内訳		
ファンド名		
DIAM先進国REITインデックスファンド<為替ヘッジなし>（ファンドラップ）	274,804,177円	249,613,727円
DIAM先進国REITインデックスファンド<為替ヘッジあり>（ファンドラップ）	67,370,416円	88,143,324円
MITO ラップ型ファンド（安定型）	5,909,943円	4,670,633円
MITO ラップ型ファンド（中立型）	15,182,713円	18,688,067円
MITO ラップ型ファンド（積極型）	39,369,153円	34,131,064円

グローバル8資産ラップファンド(安定型)	25,105,584円	29,869,389円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	21,627,261円	42,445,575円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	28,808,725円	38,483,563円
たわらノーロード 先進国リート	1,721,168,125円	2,624,670,911円
たわらノーロード 先進国リート<ラップ向け>	400,970,948円	423,148,632円
たわらノーロード 先進国リート<為替ヘッジあり>	125,946,635円	132,514,847円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	21,115,226円	78,215,071円
たわらノーロード バランス(堅実型)	35,727円	492,806円
たわらノーロード バランス(標準型)	758,305円	9,618,471円
たわらノーロード バランス(積極型)	4,154,380円	37,694,667円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定型)	- 円	3,317,352円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定成長型)	50,006円	18,801,373円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(成長型)	90,164円	19,531,977円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(積極型)	122,951円	47,722,952円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	- 円	83,168円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	- 円	927,094円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	- 円	1,078,234円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	- 円	3,584,707円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	22,174,404円	23,851,883円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	539,811,573円	605,308,573円
マネックス資産設計ファンドエボリューション	78,019,353円	64,548,816円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	25,595,252円	172,886,995円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	84,478,084円	140,494,274円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	189,120,828円	279,034,664円
投資のソムリエ	6,351,242,412円	7,653,588,468円
投資のソムリエ<DC年金>	402,574,454円	658,457,526円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	96,943,349円	119,024,804円

投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	186,280,072円	176,208,238円
ダイナミック・ナビゲーション	286,863円	800,409円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	2,578,280,510円	3,190,006,461円
ワールドアセットバランス(基本コース)	1,100,032,739円	1,316,609,921円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	4,194,614,874円	5,166,081,673円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	840,948円	1,679,621円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	840,948円	1,086,889円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	865,578円	832,318円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	820,132円	2,592,506円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	-円	365,824,903円
DIAMパッシブ資産分散ファンド	1,113,784,191円	1,151,911,524円
DIAM外国リートインデックスファンド<DC年金>	20,739,627円	26,553,198円
DIAM世界アセットバランスファンドVA(適格機関投資家向け)	2,834,824,826円	1,201,030,785円
DIAMグローバル 私募ファンド(適格機関投資家向け)	11,580,328円	11,580,328円
DIAM世界アセットバランスファンド2VA(適格機関投資家限定)	11,354,337,336円	10,118,289,327円
DIAMグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンド(適格機関投資家限定)	4,236,813,769円	1,956,002,974円
DIAMグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンドII(適格機関投資家限定)	4,407,569,364円	1,521,041,521円
P-Oneマルチアセット戦略ファンド(適格機関投資家限定)	3,257,586,698円	3,241,156,712円
DIAM海外リートインデックスファンド(適格機関投資家限定)	560,116,746円	559,362,723円
計	46,402,765,697円	43,633,295,638円
2. 受益権の総数	46,402,765,697口	43,633,295,638口

## （金融商品に関する注記）

## 1．金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成29年7月12日 至 平成30年1月11日	自 平成30年1月12日 至 平成30年7月11日
1． 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2． 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
3． 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

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

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	平成30年1月11日現在	平成30年7月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
投資信託受益証券	175,410,396	26,724,506
投資証券	1,673,572,217	921,229,514
合計	1,498,161,821	947,954,020

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成29年6月23日から平成30年1月11日まで及び平成30年6月23日から平成30年7月11日まで）に対応する金額であります。

## （デリバティブ取引等に関する注記）

## 通貨関連

種類	平成30年1月11日 現在				平成30年7月11日 現在			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	-	-	-	-	22,829,922	-	22,796,250	33,672
ユーロ	-	-	-	-	5,852,322	-	5,852,250	72
香港・ドル	-	-	-	-	16,977,600	-	16,944,000	33,600
買 建	114,761,091	-	114,594,070	167,021	-	-	-	-
アメリカ・ドル	49,601,257	-	49,599,700	1,557	-	-	-	-
オーストラリア・ドル	32,503,570	-	32,478,600	24,970	-	-	-	-
カナダ・ドル	1,778,510	-	1,778,400	110	-	-	-	-
シンガポール・ドル	11,768,880	-	11,706,800	62,080	-	-	-	-
ニュージーランド・ドル	2,813,335	-	2,809,450	3,885	-	-	-	-
ユーロ	6,395,524	-	6,395,520	4	-	-	-	-
香港・ドル	9,900,015	-	9,825,600	74,415	-	-	-	-
合計	114,761,091	-	114,594,070	167,021	22,829,922	-	22,796,250	33,672

## （注）時価の算定方法

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

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

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

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

( 関連当事者との取引に関する注記 )

該当事項はありません。

( 1口当たり情報に関する注記 )

	平成30年1月11日現在	平成30年7月11日現在
1口当たり純資産額	1.1896円	1.2356円
(1万口当たり純資産額)	(11,896円)	(12,356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7月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	オーストラリア・ドル	ABACUS PROPERTY GROUP	128,515.000	489,642.150	
		ARENA REIT	108,676.000	233,653.400	
		BWP TRUST	194,137.000	638,710.730	
		CHARTER HALL GROUP	190,299.000	1,261,682.370	
		CHARTER HALL LONG WALE REIT	72,501.000	319,729.410	
		CHARTER HALL RETAIL REIT	131,911.000	554,026.200	
		CROMWELL PROPERTY GROUP	671,902.000	759,249.260	
		DEXUS	418,605.000	4,127,445.300	
		FOLKESTONE EDUCATION TRUST	88,555.000	245,297.350	
		GDI PROPERTY GROUP	208,566.000	264,878.820	
		GOODMAN GROUP	665,772.000	6,391,411.200	
		GPT GROUP	744,219.000	3,788,074.710	
		GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA	97,040.000	354,196.000	
		HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD	62,650.000	195,468.000	
		INDUSTRIA REIT	42,579.000	112,408.560	
		INGENIA COMMUNITIES GROUP	85,235.000	270,194.950	
		INVESTA OFFICE FUND	204,004.000	1,060,820.800	
		MIRVAC GROUP	1,535,600.000	3,393,676.000	
		NATIONAL STORAGE REIT	223,901.000	387,348.730	
		PROPERTYLINK GROUP	151,222.000	161,051.430	
		RURAL FUNDS GROUP	104,894.000	217,130.580	
		SCENTRE GROUP	2,250,973.000	10,016,829.850	
		SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	307,102.000	761,612.960	
STOCKLAND	1,009,700.000	4,159,964.000			
VICINITY CENTRES	1,347,462.000	3,530,350.440			
VIVA ENERGY REIT	183,737.000	404,221.400			
	オーストラリア・ドル 小計		11,229,757.000	44,099,074.600 (3,628,912,849)	
	カナダ・ドル	KILLAM APARTMENT REIT	15,367.000	237,573.820	
	カナダ・ドル 小計		15,367.000	237,573.820 (20,044,103)	
	シンガポール・ドル	AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL REIT	265,795.000	372,113.000	



	ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	317,200.000	253,760.000	
	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	993,760.000	2,693,089.600	
	ASCOTT RESIDENCE TRUST	553,415.000	603,222.350	
	CACHE LOGISTICS TRUST	435,780.000	335,550.600	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	1,112,279.000	1,935,365.460	
	CAPITALAND MALL TRUST	1,114,960.000	2,330,266.400	
	CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST	234,580.000	351,870.000	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	302,100.000	483,360.000	
	ESR REIT	539,430.000	275,109.300	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	359,600.000	224,750.000	
	FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	254,100.000	332,871.000	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	229,100.000	506,311.000	
	FRASERS COMMERCIAL TRUST	267,080.000	371,241.200	
	FRASERS LOGISTICS & INDUSTRIAL TRUST	626,850.000	670,729.500	
	KEPPEL DC REIT	402,200.000	555,036.000	
	KEPPEL REIT	775,100.000	868,112.000	
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST	732,100.000	230,611.500	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	791,100.000	1,281,582.000	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	525,920.000	1,041,321.600	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	891,720.000	1,150,318.800	
	MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL TRUST	887,000.000	1,020,050.000	
	QUE HOSPITALITY TRUST	488,620.000	381,123.600	
	PARKWAY LIFE REIT	169,500.000	462,735.000	
	SABANA SHARIAH COMP IND REIT	357,200.000	157,168.000	
	SOILBUILD BUSINESS SPACE REIT	276,100.000	180,845.500	
	SPH REIT	265,400.000	265,400.000	
	STARHILL GLOBAL REIT	531,700.000	348,263.500	
	SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	922,490.000	1,697,381.600	
	シンガポール・ドル 小計	15,622,179.000	21,379,558.510 (1,744,358,179)	
	投資信託受益証券 合計	26,867,303	5,393,315,131 (5,393,315,131)	
投資証券	アメリカ・ドル	ACADIA REALTY TRUST	33,538.000	915,587.400

AGREE REALTY CORP	12,555.000	674,580.150	
ALEXANDER & BALDWIN INC	26,791.000	673,257.830	
ALEXANDER'S INC.	1,525.000	586,377.750	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	42,789.000	5,450,462.820	
AMERICAN ASSETS TRUST INC	16,454.000	626,732.860	
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	56,638.000	2,430,336.580	
AMERICAN HOMES 4 RENT	110,194.000	2,466,141.720	
AMERICOLD REALTY TRUST	19,990.000	432,183.800	
APARTMENT INVT & MGMT CO-A	65,239.000	2,756,347.750	
APPLE HOSPITALITY REIT INC	91,138.000	1,659,622.980	
ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC	17,472.000	270,117.120	
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	35,470.000	297,238.600	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	57,483.000	9,974,450.160	
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH REIT INC	8,916.000	79,976.520	
BOSTON PROPERTIES INC	64,184.000	8,077,556.400	
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	12,100.000	144,232.000	
BRANDYWINE REALTY TRUST	73,637.000	1,248,147.150	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	128,877.000	2,219,261.940	
CAMDEN PROPERTY TRUST	38,501.000	3,511,676.210	
CARETRUST REIT INC	32,366.000	555,400.560	
CBL & ASSOCIATES	69,060.000	393,642.000	
CEDAR REALTY TRUST INC	29,878.000	151,780.240	
CHATHAM LODGING TRUST	17,959.000	386,298.090	
CHESAPEAKE LODGING TRUST	23,991.000	774,189.570	
CITY OFFICE REIT INC	14,463.000	186,861.960	
CLIPPER REALTY INC	5,169.000	51,586.620	
COLONY CAPITAL INC	208,616.000	1,333,056.240	
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	49,730.000	1,153,736.000	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	6,974.000	206,569.880	
CORECIVIC INC	48,861.000	1,171,686.780	
CORESITE REALTY CORP	14,650.000	1,669,367.500	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	42,123.000	1,258,214.010	
COUSINS PROPERTIES INC	173,762.000	1,682,016.160	
CUBESMART	75,533.000	2,441,981.890	
CYRUSONE INC	42,038.000	2,602,992.960	

DCT INDUSTRIAL TRUST INC	39,933.000	2,668,722.390	
DDR CORP	62,984.000	911,378.480	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	85,642.000	1,060,247.960	
DIGITAL REALTY TRUST INC	87,034.000	10,081,148.220	
DOUGLAS EMMETT INC	67,714.000	2,735,645.600	
DUKE REALTY TRUST	148,262.000	4,289,219.660	
EAST GROUP	14,427.000	1,389,608.640	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	23,345.000	466,433.100	
EDUCATION REALTY TRUST INC	32,288.000	1,353,512.960	
EMPIRE STATE REALTY TRUST INC	55,942.000	965,558.920	
EPR PROPERTIES	26,742.000	1,755,879.720	
EQUITY COMMONWEALTH	50,200.000	1,596,360.000	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	36,822.000	3,386,519.340	
EQUITY RESIDENTIAL	153,142.000	9,934,321.540	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	27,452.000	6,605,500.240	
EXTRA SPACE STORAGE INC	52,393.000	5,198,957.390	
FARMLAND PARTNERS INC	14,523.000	125,623.950	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	30,395.000	3,838,280.600	
FIRST INDUSTRIAL RT	51,844.000	1,731,589.600	
FOREST CITY REALTY TRUST INC	110,742.000	2,547,066.000	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST INC	26,006.000	645,468.920	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	42,731.000	379,023.970	
GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	85,047.000	3,054,037.770	
GEO GROUP INC	50,780.000	1,340,592.000	
GETTY REALTY CORP	13,178.000	378,999.280	
GGP INC	262,816.000	5,513,879.680	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	11,089.000	219,673.090	
GLADSTONE LAND CORP	4,237.000	52,496.430	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	8,278.000	73,260.300	
GLOBAL NET LEASE INC	28,621.000	599,896.160	
GOVERNMENT PROPERTIES INCOME TRUST	40,071.000	662,774.340	
GRAMERCY PROPERTY TRSUT	67,027.000	1,833,188.450	
HCP INC	195,168.000	5,076,319.680	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	51,726.000	1,505,226.600	

HEALTHCARE TRUST OF AMERICA INC	87,053.000	2,326,056.160	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	14,668.000	327,243.080	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	42,832.000	2,196,424.960	
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	68,022.000	1,971,277.560	
HOST HOTELS & RESORTS INC	308,136.000	6,584,866.320	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	66,473.000	2,353,144.200	
INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	35,997.000	370,049.160	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES TRUST	8,484.000	192,671.640	
INFREIT INC	16,132.000	354,258.720	
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	47,370.000	261,482.400	
INVITATION HOMES INC	121,711.000	2,816,392.540	
IRON MOUNTAIN INC	116,859.000	4,260,679.140	
ISTAR INC	26,858.000	293,020.780	
JBG SMITH PROPERTIES	38,789.000	1,431,701.990	
KILROY REALTY CORP	41,000.000	3,122,150.000	
KIMCO REALTY	176,216.000	2,946,331.520	
KITE REALTY GROUP TRUST	33,773.000	569,750.510	
LASALLE HOTEL PROPERTIES	45,620.000	1,589,400.800	
LEXINGTON REALTY TRUST	85,800.000	765,336.000	
LIBERTY PROPERTY TRUST	61,271.000	2,723,495.950	
LIFE STORAGE INC	19,249.000	1,895,834.010	
LTC PROPERTIES INC	15,715.000	670,559.050	
MACK CALI	35,789.000	732,242.940	
MANULIFE US REIT	511,500.000	439,890.000	
MEDEQUITIES REALTY TRUST INC	13,143.000	154,955.970	
MEDICAL PROPERTIES TRUST	154,807.000	2,226,124.660	
MID AMERICA	47,264.000	4,717,419.840	
MONMOUTH RE INVEST CP -CL A	31,881.000	538,788.900	
NATIONAL HEALTH INVS INC	17,135.000	1,282,897.450	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	63,793.000	2,847,081.590	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUST	21,369.000	668,208.630	
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP INC	34,578.000	263,484.360	

NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	7,762.000	222,536.540	
NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP	21,513.000	306,990.510	
OMEGA HEALTHCARE INVS INC	82,323.000	2,596,467.420	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	6,251.000	170,402.260	
PARAMOUNT GROUP INC	84,713.000	1,324,064.190	
PARK HOTELS & RESORTS INC	85,547.000	2,659,656.230	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	29,450.000	1,152,084.000	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	27,906.000	317,291.220	
PHYSICIANS REALTY TRUST	77,594.000	1,237,624.300	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC	54,702.000	1,106,074.440	
PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES INC	15,140.000	265,707.000	
PROLOGIS INC	221,865.000	14,605,372.950	
PS BUSINESS PARKS	8,212.000	1,067,642.120	
PUBLIC STORAGE	62,342.000	14,382,922.820	
QTS REALTY TRUST INC	21,476.000	901,992.000	
QUALITY CARE PROPERTIES INC	39,836.000	819,824.880	
RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES	32,060.000	420,627.200	
REALTY INCOME CORP	118,203.000	6,556,720.410	
REGENCY CENTERS CORP	61,180.000	3,774,194.200	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	48,206.000	928,447.560	
RETAIL PROPERTIES OF AMERICA INC	93,590.000	1,201,695.600	
RETAIL VALUE INC	6,244.000	233,275.840	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	34,603.000	1,081,689.780	
RLJ LODGING TRUST	74,494.000	1,669,410.540	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	21,211.000	1,765,391.530	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	75,800.000	1,705,500.000	
SAUL CENTERS INC	4,786.000	262,942.840	
SELECT INCOME REIT	25,477.000	578,073.130	
SENIOR HOUSING PPTYS TRUST	98,295.000	1,828,287.000	
SERITAGE GROWTH PROPERTIES	11,004.000	474,602.520	
SIMON PROPERTY GROUP INC	128,890.000	22,276,058.700	
SL GREEN	36,703.000	3,744,073.030	

	SPIRIT MTA REIT	17,097.000	186,699.240	
	SPIRIT REALTY CAPITAL INC	182,370.000	1,489,962.900	
	STAG INDUSTRIAL INC	41,484.000	1,135,002.240	
	STORE CAPITAL CORP	72,549.000	1,995,097.500	
	SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	41,428.000	596,977.480	
	SUN COMMUNITIES INC	33,228.000	3,260,995.920	
	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	93,231.000	1,573,739.280	
	TANGER FACTORY OUTLET	38,798.000	932,703.920	
	TAUBMAN CENTERS INC	25,196.000	1,507,224.720	
	TERRENO REALTY CORP	23,950.000	894,772.000	
	THE MACERICH COMPANY	44,998.000	2,616,633.700	
	TIER REIT INC	20,328.000	481,773.600	
	UDR INC	111,113.000	4,158,959.590	
	UMH PROPERTIES INC	12,898.000	204,304.320	
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	5,022.000	334,063.440	
	URBAN EDGE PROPERTIES	44,936.000	1,028,135.680	
	URSTADT BIDDLE PROPERTIES	11,757.000	264,532.500	
	VENTAS INC	148,168.000	8,693,016.560	
	VEREIT INC	410,291.000	3,146,931.970	
	VORNADO REALTY TRUST	71,901.000	5,318,516.970	
	WASHINGTON PRIME GROUP INC	78,952.000	641,879.760	
	WASHINGTON REIT	32,352.000	993,206.400	
	WEINGARTEN REALTY INVST	49,239.000	1,511,637.300	
	WELLTOWER INC	154,709.000	9,785,344.250	
	WHEELER REIT INC	2,961.000	12,998.790	
	WHITESTONE REIT	15,682.000	200,415.960	
	WP CAREY INC	44,458.000	2,981,353.480	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	44,193.000	1,086,263.940	
	アメリカ・ドル 小計	9,827,219.000	347,054,086.180 (38,498,709,781)	
イギリス・債券	AEW UK LONG LEASE REIT PLC	37,060.000	31,908.660	
	ASSURA PLC	1,013,326.000	580,635.790	
	BIG YELLOW GROUP PLC	63,606.000	593,443.980	
	BRITISH LAND CO PLC	412,493.000	2,722,453.800	
	CAPITAL & REGIONAL PLC	198,657.000	99,328.500	
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	81,480.000	85,554.000	
	DERWENT LONDON PLC	46,692.000	1,436,245.920	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	228,600.000	209,854.800	

	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	116,012.000	816,144.420	
	HAMMERSON PLC	328,601.000	1,780,360.210	
	HANSTEEN HOLDINGS PLC	167,573.000	177,794.950	
	INTU PROPERTIES PLC	359,012.000	675,301.570	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	311,901.000	2,978,966.450	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	281,561.000	520,606.280	
	LXI REIT PLC	73,400.000	80,006.000	
	NEWRIVER REIT PLC	131,034.000	353,136.630	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC	295,123.000	345,884.150	
	RDI REIT PLC	528,881.000	188,281.630	
	REGIONAL REIT LTD	118,301.000	110,966.330	
	SAFESTORE HOLDINGS LTD	82,837.000	450,633.280	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT TRUST LTD	221,364.000	138,352.500	
	SEGRE PLC	418,960.000	2,844,738.400	
	SHAFTESBURY PLC	104,740.000	972,510.900	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	629,771.000	974,255.730	
	UNITE GROUP PLC	112,096.000	927,033.920	
	WORKSPACE GROUP PLC	56,353.000	602,977.100	
イギリス・ポンド 小計		6,419,434.000	20,697,375.900 (3,042,514,257)	
イスラエル・シュケル	REIT 1 LTD	70,287.000	971,366.340	
イスラエル・シュケル 小計		70,287.000	971,366.340 (29,655,815)	
カナダ・ドル	AGELLAN COMMERCIAL REIT	7,030.000	96,029.800	
	ALLIED PROPERTIES REIT	20,229.000	845,976.780	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	33,111.000	434,416.320	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	9,181.000	425,539.350	
	CANADIAN APT PPTYS REIT	30,099.000	1,314,423.330	
	CHOICE PROPERTIES REIT	58,346.000	722,323.480	
	COMINAR REAL ESTATE INVT TR	38,863.000	497,446.400	
	CROMBIE REAL ESTATE INV	18,049.000	235,178.470	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	12,724.000	158,922.760	
	DREAM GLOBAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	37,235.000	541,396.900	
	DREAM INDUSTRIAL REIT	13,888.000	143,879.680	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV TRUST	12,287.000	293,044.950	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	9,149.000	508,043.970	
	H & R REAL ESTATE INVESTMENT	60,486.000	1,233,309.540	

	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	20,114.000	220,851.720	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT	7,446.000	113,328.120	
	MORGUARD REAL ESTATE INVT TR	8,313.000	109,149.690	
	NORTHVIEW APARTMENT REIT	11,298.000	300,526.800	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	21,137.000	240,327.690	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	64,066.000	1,572,820.300	
	SLATE OFFICE REIT	12,079.000	91,860.790	
	SLATE RETAIL REIT	7,739.000	101,226.120	
	SMARTCENTRES REIT	27,854.000	848,432.840	
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	17,406.000	154,739.340	
カナダ・ドル 小計		558,129.000	11,203,195.140 (945,213,574)	
ニュージーランド・ドル	ARGOSY PROPERTY LTD	356,878.000	390,781.410	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	447,011.000	663,811.330	
	INVESTORE PROPERTY LTD	88,877.000	135,093.040	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	590,734.000	803,398.240	
	PRECINCT PROPERTIES	391,222.000	532,061.920	
	STRIDE STAPLED GROUP	149,101.000	280,309.880	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	129,943.000	272,880.300	
ニュージーランド・ドル 小計		2,153,766.000	3,078,336.120 (232,537,511)	
ユーロ	AEDIFICA	7,429.000	589,862.600	
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	62,153.000	801,773.700	
	ALTAREA	1,450.000	287,100.000	
	BEFIMMO	9,385.000	489,897.000	
	BENI STABILI SPA	430,612.000	327,695.730	
	COFINIMMO SA	8,892.000	960,336.000	
	COVIVIO	22,867.000	2,026,016.200	
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	21,208.000	783,847.680	
	GECINA SA	19,975.000	2,862,417.500	
	GREEN REIT PLC	293,629.000	443,379.790	
	HAMBORNER REIT AG	31,714.000	292,720.220	
	HIBERNIA REIT PLC	288,491.000	422,350.820	
	HISPANIA ACTIVOS INMOBILIARIOS SOCIMI SA	45,388.000	827,423.240	
	ICADE	18,922.000	1,590,394.100	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE	20,030.000	144,716.750	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA	133,071.000	1,288,792.630	



	INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	6,873.000	150,175.050	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES REIT PLC	138,876.000	194,148.640	
	KLEPIERRE	86,243.000	2,793,410.770	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA	37,079.000	355,216.820	
	MERCIALYS	22,547.000	344,518.160	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	141,612.000	1,794,932.100	
	NSI NV	7,625.000	264,587.500	
	RETAIL ESTATES	2,948.000	229,059.600	
	UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	56,114.000	10,622,380.200	
	VASTNED RETAIL	6,129.000	243,627.750	
	WAREHOUSES DE PAUW	7,125.000	790,875.000	
	WERELDHAVE NV	16,697.000	543,821.290	
	ユーロ 小計	1,945,084.000	32,465,476.840 (4,222,135,263)	
	香港・ドル			
	CHAMPION REIT	833,070.000	4,406,940.300	
	FORTUNE REAL ESTATE (HK)	571,000.000	5,298,880.000	
	LINK REIT	894,020.000	66,336,284.000	
	PROSPERITY REIT	535,000.000	1,722,700.000	
	SPRING REIT	351,000.000	1,158,300.000	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	439,000.000	2,392,550.000	
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	503,000.000	2,665,900.000	
	香港・ドル 小計	4,126,090.000	83,981,554.300 (1,186,659,363)	
投資証券 合計		25,100,009	48,157,425,564 (48,157,425,564)	
合計			53,550,740,695 (53,550,740,695)	

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

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

通貨	銘柄数	組入 投資信託受益証券 時価比率	組入 投資証券 時価比率	有価証券の合計 金額 に対する比率
アメリカ・ドル	投資証券 162銘柄	-%	71.41%	71.89%
イギリス・ポンド	投資証券 26銘柄	-%	5.64%	5.68%
イスラエル・シェケル	投資証券 1銘柄	-%	0.06%	0.06%
オーストラリア・ドル	投資信託受益証券 26銘柄	6.73%	-%	6.78%
カナダ・ドル	投資信託受益証券 1銘柄 投資証券 24銘柄	0.04% -%	-% 1.75%	1.80%
シンガポール・ドル	投資信託受益証券 29銘柄	3.24%	-%	3.26%

ニュージーランド・ドル	投資証券	7銘柄	-%	0.43%	0.43%
ユーロ	投資証券	28銘柄	-%	7.83%	7.88%
香港・ドル	投資証券	7銘柄	-%	2.20%	2.22%

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

## 「為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

(単位:円)

科 目	注記 番号	平成30年1月11日現在	平成30年7月11日現在
資産の部			
流動資産			
預金		194,211,625	4,832,764,348
コール・ローン		16,369,828,774	2,346,343,460
国債証券		257,363,274,468	302,592,963,040
派生商品評価勘定		3,169,354,253	-
未収入金		424,832,472	-
未収利息		1,710,167,438	2,010,671,990
前払費用		253,433,853	367,569,842
流動資産合計		279,485,102,883	312,150,312,680
資産合計		279,485,102,883	312,150,312,680
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		108,103,162	1,423,012,601
未払金		14,393,773,859	-
未払解約金		37,599,000	166,160,000
その他未払費用		-	2,930
流動負債合計		14,539,476,021	1,589,175,531
負債合計		14,539,476,021	1,589,175,531
純資産の部			
元本等			
元本	1	199,035,898,706	233,784,571,212
剰余金			
剰余金又は欠損金( )		65,909,728,156	76,776,565,937
元本等合計		264,945,626,862	310,561,137,149
純資産合計		264,945,626,862	310,561,137,149
負債純資産合計		279,485,102,883	312,150,312,680

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

## （貸借対照表に関する注記）

項目	平成30年1月11日現在	平成30年7月11日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	132,887,156,620円	199,035,898,706円
同期中追加設定元本額	72,380,607,622円	71,123,799,735円
同期中一部解約元本額	6,231,865,536円	36,375,127,229円
元本の内訳		
ファンド名		
たわらノーロード 先進国債券 <為替ヘッジあり>	1,371,990,619円	1,951,292,910円
たわらノーロード バランス (堅実型)	1,111,328円	15,023,523円
たわらノーロード バランス (標準型)	3,216,299円	40,895,808円
たわらノーロード バランス (積極型)	4,148,746円	37,937,237円
たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(保守型)	217,449円	1,179,989円
たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(安定型)	228,647円	45,435,539円
たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(安定成長 型)	176,521円	56,403,150円
たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(成長型)	121,387円	22,291,535円
たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(積極型)	53,621円	19,061,784円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(保守型)	- 円	556,330円

たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	- 円	610,403円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	- 円	2,751,370円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	- 円	1,363,628円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	- 円	1,447,001円
投資のソムリエ	32,526,151,669円	38,001,490,729円
投資のソムリエ<DC年金>	2,062,045,129円	3,268,492,485円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	1,712,840,756円	2,571,287,376円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	23,751,087,877円	46,497,932,113円
ワールドアセットバランス(基本コース)	5,065,279,117円	6,012,658,968円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	19,501,495,101円	23,598,277,974円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	1,851,588円	4,439,623円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	1,851,588円	2,874,519円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	7,956,474円	12,392,013円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	2,261,149円	7,199,866円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	- 円	4,680,029,837円
外国債券パッシブファンド2(為替フルヘッジ)(適格機関投資家限定)	8,840,073,265円	8,825,007,351円
DIAM世界アセットバランスファンド2VA(適格機関投資家限定)	21,132,977,228円	18,486,537,224円
DIAM世界アセットバランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	1,132,048,640円	1,070,526,995円
DIAM世界アセットバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	7,261,638,027円	6,897,996,198円
DIAM世界アセットバランスファンド3VA(適格機関投資家限定)	34,401,391,575円	32,900,648,850円
DIAMバランス30VA(適格機関投資家限定)	3,226,003円	23,814,210円
DIAM世界アセットバランスファンド4VA(適格機関投資家限定)	30,601,099,769円	29,413,872,974円
DIAMバランス20VA(適格機関投資家限定)	147,846,567円	152,335,238円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA(1212)(適格機関投資家限定)	2,852,126,136円	2,619,820,816円

D I A M世界アセットバランス ファンド7VA(1303) (適格機関投資家限定)	2,672,709,186円	2,627,419,330円
D I A M世界アセットバランス ファンド7VA(1306) (適格機関投資家限定)	3,520,962,596円	3,475,672,740円
D I A M世界アセットバランス ファンド7VA(1309) (適格機関投資家限定)	455,714,649円	437,593,576円
計	199,035,898,706円	233,784,571,212円
2 . 受益権の総数	199,035,898,706口	233,784,571,212口

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成29年7月12日 至 平成30年1月11日	自 平成30年1月12日 至 平成30年7月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

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



(有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	平成30年1月11日現在	平成30年7月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
国債証券	4,254,220,070	691,319,581
合計	4,254,220,070	691,319,581

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成29年6月23日から平成30年1月11日まで及び平成30年6月23日から平成30年7月11日まで）に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

## 通貨関連

種類	平成30年1月11日 現在				平成30年7月11日 現在			
	契約額等 （円）	うち 1年 超	時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）	うち 1年 超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	263,900,648,588	-	260,741,033,698	3,159,614,890	308,594,842,100	-	310,017,854,701	1,423,012,601
アメリカ カ・ドル	113,413,762,270	-	112,270,583,744	1,143,178,526	136,540,597,174	-	136,840,056,489	299,459,315
イギリ ス・ボン ド	18,852,459,581	-	18,631,057,200	221,402,381	21,820,141,247	-	21,941,904,651	121,763,404
オースト ラリア・ ドル	5,826,599,654	-	5,806,146,360	20,453,294	6,405,129,236	-	6,444,996,100	39,866,864
カナダ・ ドル	5,768,253,269	-	5,705,127,120	63,126,149	6,035,786,760	-	6,050,550,506	14,763,746
シンガ ポール・ ドル	994,570,780	-	987,193,380	7,377,400	986,911,147	-	991,473,606	4,562,459
スウェー デン・ク ローナ	1,237,389,129	-	1,225,022,490	12,366,639	962,091,672	-	982,820,245	20,728,573
デンマー ク・ク ローネ ノル	1,519,660,746	-	1,496,299,921	23,360,825	1,603,011,679	-	1,611,210,850	8,199,171
ウェー・ クロネ ポーラン ド・ズロ チ	754,064,899	-	755,011,800	946,901	698,007,035	-	709,004,576	10,997,541
	1,707,996,495	-	1,684,745,511	23,250,984	1,762,306,931	-	1,793,546,270	31,239,339

マレーシ ア・リン ギット	1,197,215,604	-	1,182,594,600	14,621,004	1,161,509,679	-	1,167,695,100	6,185,421
メキシ コ・ペソ	1,942,105,705	-	1,947,386,266	5,280,561	2,385,253,520	-	2,469,577,434	84,323,914
ユーロ 南アフリ カ・ラン ド	109,120,772,255	-	107,506,252,356	1,614,519,899	126,555,152,633	-	127,287,771,100	732,618,467
1,565,798,201	-	1,543,612,950	22,185,251	1,678,943,387	-	1,727,247,774	48,304,387	
買 建	13,964,225,786	-	13,865,861,987	98,363,799	-	-	-	-
アメリ カ・ドル	5,734,111,661	-	5,692,741,478	41,370,183	-	-	-	-
イギリ ス・ボン ド	953,199,492	-	944,480,439	8,719,053	-	-	-	-
オースト ラリア・ ドル	345,712,212	-	345,554,748	157,464	-	-	-	-
カナダ・ ドル	355,300,340	-	350,647,128	4,653,212	-	-	-	-
シンガ ポール・ ドル	102,073,120	-	101,514,680	558,440	-	-	-	-
スウェー デン・ク ローナ	175,819,312	-	175,381,182	438,130	-	-	-	-
デンマー ク・ク ローネ	59,854,434	-	59,455,626	398,808	-	-	-	-
ノル ウェー・ クローネ	161,606,280	-	160,848,660	757,620	-	-	-	-
ポーラン ド・ズロ チ	157,898,291	-	157,405,321	492,970	-	-	-	-
マレーシ ア・リン ギット	166,158,392	-	165,362,160	796,232	-	-	-	-
メキシ コ・ペソ	234,358,782	-	231,351,612	3,007,170	-	-	-	-
ユーロ 南アフリ カ・ラン ド	5,428,869,124	-	5,393,248,748	35,620,376	-	-	-	-
89,264,346	-	87,870,205	1,394,141	-	-	-	-	
合計	277,864,874,374	-	274,606,895,685	3,061,251,091	308,594,842,100	-	310,017,854,701	1,423,012,601

(注) 時価の算定方法

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

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

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

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

( 関連当事者との取引に関する注記 )

該当事項はありません。

( 1口当たり情報に関する注記 )

	平成30年1月11日現在	平成30年7月11日現在
1口当たり純資産額	1.3311円	1.3284円
( 1万口当たり純資産額 )	(13,311円)	(13,284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7月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	US T N/B 0.75 08/15/19	7,000,000.000	6,875,820.000	
		US T N/B 0.875 07/31/19	10,000,000.000	9,842,500.000	
		US T N/B 0.875 09/15/19	22,500,000.000	22,089,375.000	
		US T N/B 1.0 09/30/19	10,700,000.000	10,513,499.000	
		US T N/B 1.0 11/15/19	16,000,000.000	15,683,040.000	
		US T N/B 1.0 11/30/19	17,000,000.000	16,651,330.000	
		US T N/B 1.125 03/31/20	11,000,000.000	10,734,020.000	
		US T N/B 1.125 06/30/21	10,000,000.000	9,556,200.000	
		US T N/B 1.125 07/31/21	13,900,000.000	13,264,631.000	
		US T N/B 1.125 08/31/21	11,000,000.000	10,480,910.000	
		US T N/B 1.125 12/31/19	14,500,000.000	14,205,940.000	
		US T N/B 1.25 02/29/20	4,200,000.000	4,112,052.000	
		US T N/B 1.25 07/31/23	8,400,000.000	7,795,536.000	
		US T N/B 1.25 10/31/19	12,300,000.000	12,103,446.000	
		US T N/B 1.25 10/31/21	10,500,000.000	10,018,470.000	
		US T N/B 1.375 01/31/21	17,000,000.000	16,460,760.000	
		US T N/B 1.375 03/31/20	7,620,000.000	7,468,133.400	
		US T N/B 1.375 04/30/20	11,510,000.000	11,266,218.200	
		US T N/B 1.375 04/30/21	10,000,000.000	9,650,000.000	
		US T N/B 1.375 05/31/20	21,400,000.000	20,919,998.000	
		US T N/B 1.375 05/31/21	12,350,000.000	11,903,177.000	
		US T N/B 1.375 06/30/23	550,000.000	514,288.500	
		US T N/B 1.375 08/31/23	9,500,000.000	8,859,415.000	
		US T N/B 1.375 09/30/23	9,000,000.000	8,381,880.000	
		US T N/B 1.375 10/31/20	10,000,000.000	9,717,900.000	
		US T N/B 1.5 06/15/20	13,000,000.000	12,736,360.000	
		US T N/B 1.5 08/15/26	9,800,000.000	8,836,758.000	
		US T N/B 1.5 10/31/19	4,840,000.000	4,778,144.800	
		US T N/B 1.625 02/15/26	12,200,000.000	11,177,274.000	
		US T N/B 1.625 04/30/23	9,800,000.000	9,296,182.000	
		US T N/B 1.625 05/15/26	9,000,000.000	8,223,030.000	
		US T N/B 1.625 08/15/22	15,900,000.000	15,208,032.000	
		US T N/B 1.625 08/31/19	11,800,000.000	11,692,974.000	
		US T N/B 1.625 11/15/22	16,080,000.000	15,335,656.800	
		US T N/B 1.625 11/30/20	10,000,000.000	9,764,000.000	
		US T N/B 1.75 02/28/22	10,500,000.000	10,145,625.000	
US T N/B 1.75 05/15/22	15,770,000.000	15,201,333.800			
US T N/B 1.75 05/15/23	5,000,000.000	4,767,950.000			
US T N/B 1.75 05/31/22	20,000,000.000	19,284,200.000			
US T N/B 1.75 06/30/22	15,000,000.000	14,438,550.000			

US T N/B 1.75 09/30/22	15,600,000.000	14,977,092.000	
US T N/B 1.875 03/31/22	13,300,000.000	12,895,680.000	
US T N/B 2.0 02/15/22	10,000,000.000	9,752,300.000	
US T N/B 2.0 02/15/23	14,000,000.000	13,539,400.000	
US T N/B 2.0 02/15/25	8,600,000.000	8,167,248.000	
US T N/B 2.0 05/31/21	11,560,000.000	11,342,325.200	
US T N/B 2.0 06/30/24	10,800,000.000	10,313,136.000	
US T N/B 2.0 07/31/20	12,600,000.000	12,447,414.000	
US T N/B 2.0 08/15/25	11,600,000.000	10,971,860.000	
US T N/B 2.0 08/31/21	12,900,000.000	12,628,842.000	
US T N/B 2.0 09/30/20	12,660,000.000	12,487,824.000	
US T N/B 2.0 10/31/22	4,280,000.000	4,148,218.800	
US T N/B 2.0 11/15/21	7,900,000.000	7,720,670.000	
US T N/B 2.0 11/15/26	8,900,000.000	8,327,730.000	
US T N/B 2.0 11/30/22	12,020,000.000	11,646,178.000	
US T N/B 2.125 03/31/24	10,500,000.000	10,119,375.000	
US T N/B 2.125 05/15/25	8,400,000.000	8,026,536.000	
US T N/B 2.125 08/15/21	9,590,000.000	9,426,202.800	
US T N/B 2.125 08/31/20	17,180,000.000	17,004,076.800	
US T N/B 2.125 09/30/21	9,800,000.000	9,624,580.000	
US T N/B 2.125 09/30/24	13,000,000.000	12,477,920.000	
US T N/B 2.125 12/31/21	7,000,000.000	6,862,170.000	
US T N/B 2.125 12/31/22	13,500,000.000	13,138,200.000	
US T N/B 2.25 01/31/24	13,400,000.000	13,015,688.000	
US T N/B 2.25 02/15/27	10,300,000.000	9,830,011.000	
US T N/B 2.25 03/31/21	11,920,000.000	11,787,688.000	
US T N/B 2.25 08/15/27	10,030,000.000	9,528,500.000	
US T N/B 2.25 08/15/46	6,000,000.000	5,177,760.000	
US T N/B 2.25 11/15/24	12,600,000.000	12,172,734.000	
US T N/B 2.25 11/15/25	10,800,000.000	10,371,348.000	
US T N/B 2.25 11/15/27	12,100,000.000	11,479,875.000	
US T N/B 2.25 12/31/24	15,000,000.000	14,483,100.000	
US T N/B 2.375 01/31/23	2,760,000.000	2,714,046.000	
US T N/B 2.375 05/15/27	9,600,000.000	9,230,208.000	
US T N/B 2.375 08/15/24	12,610,000.000	12,289,706.000	
US T N/B 2.375 12/31/20	16,950,000.000	16,838,638.500	
US T N/B 2.5 01/31/25	2,980,000.000	2,920,847.000	
US T N/B 2.5 02/15/45	6,900,000.000	6,300,528.000	
US T N/B 2.5 02/15/46	5,600,000.000	5,102,552.000	
US T N/B 2.5 03/31/23	6,720,000.000	6,640,704.000	
US T N/B 2.5 05/15/24	10,790,000.000	10,603,656.700	
US T N/B 2.5 05/15/46	9,550,000.000	8,694,893.000	
US T N/B 2.5 08/15/23	6,700,000.000	6,610,488.000	
US T N/B 2.625 02/28/23	1,190,000.000	1,183,026.600	
US T N/B 2.625 03/31/25	2,400,000.000	2,368,872.000	
US T N/B 2.625 08/15/20	13,350,000.000	13,349,466.000	
US T N/B 2.625 11/15/20	11,860,000.000	11,853,951.400	
US T N/B 2.75 02/15/24	11,930,000.000	11,893,613.500	
US T N/B 2.75 02/15/28	10,540,000.000	10,427,959.800	

US T N/B 2.75 02/28/25	6,290,000.000	6,258,046.800	
US T N/B 2.75 04/30/23	10,670,000.000	10,659,970.200	
US T N/B 2.75 05/31/23	3,880,000.000	3,876,934.800	
US T N/B 2.75 08/15/42	3,220,000.000	3,103,758.000	
US T N/B 2.75 08/15/47	5,850,000.000	5,611,378.500	
US T N/B 2.75 11/15/23	7,000,000.000	6,984,110.000	
US T N/B 2.75 11/15/42	4,500,000.000	4,334,040.000	
US T N/B 2.75 11/15/47	6,950,000.000	6,646,424.000	
US T N/B 2.875 04/30/25	8,010,000.000	8,029,384.200	
US T N/B 2.875 05/15/28	8,420,000.000	8,421,263.000	
US T N/B 2.875 05/15/43	8,680,000.000	8,536,172.400	
US T N/B 2.875 05/31/25	4,550,000.000	4,561,011.000	
US T N/B 2.875 08/15/45	6,620,000.000	6,498,456.800	
US T N/B 2.875 11/15/46	6,200,000.000	6,079,348.000	
US T N/B 3.0 02/15/47	6,000,000.000	6,036,540.000	
US T N/B 3.0 02/15/48	6,450,000.000	6,486,765.000	
US T N/B 3.0 05/15/42	2,310,000.000	2,326,955.400	
US T N/B 3.0 05/15/45	6,200,000.000	6,236,766.000	
US T N/B 3.0 05/15/47	5,920,000.000	5,967,123.200	
US T N/B 3.0 11/15/44	6,500,000.000	6,537,050.000	
US T N/B 3.0 11/15/45	6,100,000.000	6,133,306.000	
US T N/B 3.125 02/15/42	2,760,000.000	2,838,908.400	
US T N/B 3.125 02/15/43	4,700,000.000	4,830,707.000	
US T N/B 3.125 05/15/21	100,000.000	101,214.000	
US T N/B 3.125 05/15/48	5,860,000.000	6,035,800.000	
US T N/B 3.125 08/15/44	6,260,000.000	6,433,089.000	
US T N/B 3.125 11/15/41	2,350,000.000	2,415,353.500	
US T N/B 3.375 05/15/44	6,300,000.000	6,761,160.000	
US T N/B 3.375 11/15/19	2,250,000.000	2,275,132.500	
US T N/B 3.5 02/15/39	2,150,000.000	2,341,479.000	
US T N/B 3.625 02/15/20	19,500,000.000	19,825,065.000	
US T N/B 3.625 02/15/21	2,010,000.000	2,057,737.500	
US T N/B 3.625 02/15/44	7,610,000.000	8,504,175.000	
US T N/B 3.625 08/15/19	6,200,000.000	6,280,848.000	
US T N/B 3.625 08/15/43	6,080,000.000	6,785,340.800	
US T N/B 3.75 08/15/41	3,990,000.000	4,518,675.000	
US T N/B 3.75 11/15/43	7,100,000.000	8,080,652.000	
US T N/B 3.875 08/15/40	2,450,000.000	2,821,518.000	
US T N/B 4.25 05/15/39	1,790,000.000	2,160,709.000	
US T N/B 4.25 11/15/40	3,100,000.000	3,761,168.000	
US T N/B 4.375 02/15/38	1,210,000.000	1,474,965.800	
US T N/B 4.375 05/15/40	3,240,000.000	3,988,731.600	
US T N/B 4.375 05/15/41	2,100,000.000	2,594,466.000	
US T N/B 4.375 11/15/39	2,000,000.000	2,457,800.000	
US T N/B 4.5 02/15/36	2,100,000.000	2,565,591.000	
US T N/B 4.5 05/15/38	1,700,000.000	2,107,320.000	
US T N/B 4.5 08/15/39	2,000,000.000	2,494,520.000	
US T N/B 4.625 02/15/40	3,370,000.000	4,279,630.400	
US T N/B 4.75 02/15/41	2,600,000.000	3,372,070.000	

	US T N/B 5.0 05/15/37	890,000.000	1,161,654.700	
	US T N/B 5.25 02/15/29	830,000.000	1,008,474.900	
	US T N/B 5.25 11/15/28	1,700,000.000	2,058,122.000	
	US T N/B 5.375 02/15/31	2,300,000.000	2,900,507.000	
	US T N/B 5.5 08/15/28	930,000.000	1,142,365.500	
	US T N/B 6.0 02/15/26	800,000.000	972,216.000	
	US T N/B 6.125 11/15/27	950,000.000	1,202,187.000	
	US T N/B 6.25 05/15/30	1,200,000.000	1,602,936.000	
	US T N/B 6.25 08/15/23	1,200,000.000	1,397,520.000	
	US T N/B 6.5 11/15/26	500,000.000	635,155.000	
	US T N/B 8.0 11/15/21	2,100,000.000	2,454,375.000	
	US T N/B 8.125 08/15/19	3,900,000.000	4,140,981.000	
アメリカ・ドル 小計		1,227,390,000.000 (136,154,372,700)	1,209,034,572.500 (134,118,205,127)	
イギリス・ポンド	UK TREASURY 0.5 07/22/22	4,850,000.000	4,768,568.500	
	UK TREASURY 0.75 07/22/23	4,080,000.000	4,019,208.000	
	UK TREASURY 1.25 07/22/27	3,950,000.000	3,916,306.500	
	UK TREASURY 1.5 01/22/21	4,310,000.000	4,387,192.100	
	UK TREASURY 1.5 07/22/26	2,850,000.000	2,904,435.000	
	UK TREASURY 1.5 07/22/47	3,310,000.000	3,133,577.000	
	UK TREASURY 1.625 10/22/28	1,770,000.000	1,798,443.900	
	UK TREASURY 1.625 10/22/71	980,000.000	996,865.800	
	UK TREASURY 1.75 07/22/57	2,730,000.000	2,825,004.000	
	UK TREASURY 1.75 09/07/22	3,420,000.000	3,533,338.800	
	UK TREASURY 1.75 09/07/37	2,060,000.000	2,070,300.000	
	UK TREASURY 2.0 07/22/20	4,920,000.000	5,043,688.800	
	UK TREASURY 2.0 09/07/25	3,250,000.000	3,437,265.000	
	UK TREASURY 2.25 09/07/23	3,000,000.000	3,181,560.000	
	UK TREASURY 2.5 07/22/65	2,800,000.000	3,646,244.000	
	UK TREASURY 2.75 09/07/24	2,500,000.000	2,742,375.000	
	UK TREASURY 3.25 01/22/44	3,740,000.000	4,881,448.000	
	UK TREASURY 3.5 01/22/45	4,030,000.000	5,513,443.000	

	UK TREASURY 3.5 07/22/68	2,980,000.000	4,943,820.000	
	UK TREASURY 3.75 07/22/52	2,540,000.000	3,903,980.000	
	UK TREASURY 3.75 09/07/19	3,900,000.000	4,037,631.000	
	UK TREASURY 3.75 09/07/20	3,050,000.000	3,248,128.000	
	UK TREASURY 3.75 09/07/21	2,200,000.000	2,400,266.000	
	UK TREASURY 4.0 01/22/60	2,570,000.000	4,432,736.000	
	UK TREASURY 4.0 03/07/22	2,350,000.000	2,617,030.500	
	UK TREASURY 4.25 03/07/36	3,300,000.000	4,603,500.000	
	UK TREASURY 4.25 06/07/32	2,440,000.000	3,256,424.000	
	UK TREASURY 4.25 09/07/39	2,250,000.000	3,256,650.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/27	2,050,000.000	2,584,004.500	
	UK TREASURY 4.25 12/07/40	2,820,000.000	4,135,812.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/46	2,530,000.000	3,943,511.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/49	2,130,000.000	3,439,737.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/55	2,800,000.000	4,842,880.000	
	UK TREASURY 4.5 09/07/34	3,150,000.000	4,430,160.000	
	UK TREASURY 4.5 12/07/42	3,110,000.000	4,810,859.000	
	UK TREASURY 4.75 03/07/20	2,600,000.000	2,773,420.000	
	UK TREASURY 4.75 12/07/30	2,320,000.000	3,170,280.000	
	UK TREASURY 4.75 12/07/38	2,570,000.000	3,921,049.000	
	UK TREASURY 5.0 03/07/25	2,200,000.000	2,744,962.000	
	UK TREASURY 6.0 12/07/28	1,450,000.000	2,098,150.000	
	UK TREASURY 8.0 06/07/21	1,520,000.000	1,835,749.600	
	イギリス・ボンド 小計	117,380,000.000 (17,254,860,000)	144,230,003.000 (21,201,810,441)	
	オーストラリア・ドル AUSTRALIAN 4.5 04/15/20	3,740,000.000	3,900,259.000	



	AUSTRALIAN 5.75 05/15/21	4,700,000.000	5,174,418.000	
	AUSTRALIAN 1.75 11/21/20	4,500,000.000	4,469,040.000	
	AUSTRALIAN 2.0 12/21/21	2,700,000.000	2,687,742.000	
	AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	4,120,000.000	3,976,212.000	
	AUSTRALIAN 2.25 11/21/22	2,190,000.000	2,190,657.000	
	AUSTRALIAN 2.75 04/21/24	4,000,000.000	4,077,480.000	
	AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	1,100,000.000	1,076,801.000	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	4,290,000.000	4,328,953.200	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/28	3,590,000.000	3,626,007.700	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/29	2,630,000.000	2,650,172.100	
	AUSTRALIAN 3.0 03/21/47	2,040,000.000	1,995,874.800	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	4,650,000.000	4,873,851.000	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	4,350,000.000	4,596,688.500	
	AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	1,330,000.000	1,378,146.000	
	AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	1,900,000.000	2,118,291.000	
	AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	5,190,000.000	5,811,502.500	
	AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	2,220,000.000	2,672,680.200	
	AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	4,750,000.000	5,550,422.500	
	AUSTRALIAN 5.5 04/21/23	4,150,000.000	4,752,372.500	
	AUSTRALIAN 5.75 07/15/22	3,890,000.000	4,420,518.200	
	オーストラリア・ドル 小計	72,030,000.000 (5,927,348,700)	76,328,089.200 (6,281,038,460)	
カナダ・ドル	CANADA 8.0 06/01/27	900,000.000	1,324,710.000	
	CANADA 0.5 03/01/22	2,280,000.000	2,158,248.000	
	CANADA 0.75 03/01/21	4,660,000.000	4,511,718.800	
	CANADA 0.75 09/01/20	4,600,000.000	4,483,528.000	
	CANADA 0.75 09/01/21	1,870,000.000	1,798,304.200	
	CANADA 1.0 06/01/27	2,480,000.000	2,251,815.200	
	CANADA 1.0 09/01/22	2,300,000.000	2,204,573.000	
	CANADA 1.25 02/01/20	2,360,000.000	2,335,998.800	
	CANADA 1.25 11/01/19	3,200,000.000	3,174,688.000	
	CANADA 1.5 03/01/20	4,250,000.000	4,221,270.000	
	CANADA 1.5 06/01/23	2,200,000.000	2,140,138.000	
	CANADA 1.5 06/01/26	2,060,000.000	1,965,919.800	

	CANADA 1.75 03/01/23	2,500,000.000	2,464,750.000	
	CANADA 1.75 05/01/20	1,100,000.000	1,096,337.000	
	CANADA 1.75 09/01/19	2,000,000.000	1,998,160.000	
	CANADA 2.0 06/01/28	2,220,000.000	2,190,185.400	
	CANADA 2.0 09/01/23	1,450,000.000	1,442,996.500	
	CANADA 2.0 12/01/51	540,000.000	514,755.000	
	CANADA 2.25 06/01/25	2,000,000.000	2,015,180.000	
	CANADA 2.5 06/01/24	2,250,000.000	2,297,790.000	
	CANADA 2.75 06/01/22	1,850,000.000	1,898,729.000	
	CANADA 2.75 12/01/48	2,390,000.000	2,677,278.000	
	CANADA 2.75 12/01/64	770,000.000	899,991.400	
	CANADA 3.25 06/01/21	2,400,000.000	2,482,944.000	
	CANADA 3.5 06/01/20	2,000,000.000	2,057,220.000	
	CANADA 3.5 12/01/45	2,640,000.000	3,333,950.400	
	CANADA 4.0 06/01/41	2,480,000.000	3,266,755.200	
	CANADA 5.0 06/01/37	2,020,000.000	2,888,014.200	
	CANADA 5.75 06/01/29	1,700,000.000	2,287,792.000	
	CANADA 5.75 06/01/33	2,070,000.000	3,001,044.600	
カナダ・ドル 小計		67,540,000.000 (5,698,349,800)	71,384,784.500 (6,022,734,268)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE 1.25 10/01/21	800,000.000	782,400.000	
	SINGAPORE 1.75 02/01/23	270,000.000	266,427.900	
	SINGAPORE 1.75 04/01/22	300,000.000	297,300.000	
	SINGAPORE 2.125 06/01/26	400,000.000	393,200.000	
	SINGAPORE 2.25 06/01/21	800,000.000	806,400.000	
	SINGAPORE 2.25 08/01/36	300,000.000	281,400.000	
	SINGAPORE 2.375 06/01/25	500,000.000	502,000.000	
	SINGAPORE 2.75 03/01/46	750,000.000	748,905.000	
	SINGAPORE 2.75 04/01/42	760,000.000	761,748.000	
	SINGAPORE 2.75 07/01/23	700,000.000	719,285.000	
	SINGAPORE 2.875 07/01/29	200,000.000	207,460.000	
	SINGAPORE 2.875 09/01/30	610,000.000	630,435.000	
	SINGAPORE 3.0 09/01/24	1,240,000.000	1,292,700.000	
	SINGAPORE 3.125 09/01/22	1,200,000.000	1,252,800.000	
	SINGAPORE 3.25 09/01/20	980,000.000	1,008,126.000	
	SINGAPORE 3.375 09/01/33	680,000.000	740,703.600	
SINGAPORE 3.5 03/01/27	1,260,000.000	1,368,990.000		
シンガポール・ドル 小計		11,750,000.000 (958,682,500)	12,060,280.500 (983,998,286)	
スウェーデン・クローナ	SWEDEN 0.75 05/12/28	9,270,000.000	9,499,061.700	
	SWEDEN 1.0 11/12/26	9,290,000.000	9,794,354.100	
	SWEDEN 1.5 11/13/23	12,920,000.000	13,996,494.400	
	SWEDEN 2.5 05/12/25	9,890,000.000	11,483,971.300	

	SWEDEN 3.5 03/30/39	7,320,000.000	10,427,413.200	
	SWEDEN 3.5 06/01/22	17,760,000.000	20,380,310.400	
スウェーデン・クローナ	小計	66,450,000.000 (840,592,500)	75,581,605.100 (956,107,305)	
デンマーク・クローネ	DENMARK 0.25 11/15/20	5,000,000.000	5,097,650.000	
	DENMARK 0.5 11/15/27	9,470,000.000	9,614,606.900	
	DENMARK 1.5 11/15/23	8,570,000.000	9,336,586.500	
	DENMARK 1.75 11/15/25	12,750,000.000	14,310,727.500	
	DENMARK 3.0 11/15/21	13,540,000.000	15,092,361.000	
	DENMARK 4.5 11/15/39	21,440,000.000	37,047,891.200	
デンマーク・クローネ	小計	70,770,000.000 (1,234,936,500)	90,499,823.100 (1,579,221,913)	
ノルウェー・クローネ	NORWAY 1.5 02/19/26	5,610,000.000	5,579,369.400	
	NORWAY 1.75 02/17/27	7,030,000.000	7,086,450.900	
	NORWAY 1.75 03/13/25	5,990,000.000	6,080,508.900	
	NORWAY 2.0 05/24/23	9,380,000.000	9,669,373.000	
	NORWAY 3.0 03/14/24	9,430,000.000	10,237,585.200	
	NORWAY 3.75 05/25/21	10,410,000.000	11,184,504.000	
ノルウェー・クローネ	小計	47,850,000.000 (660,330,000)	49,837,791.400 (687,761,521)	
ポーランド・ズロチ	POLAND 07/25/20	1,500,000.000	1,452,150.000	
	POLAND 1.5 04/25/20	4,100,000.000	4,099,590.000	
	POLAND 1.75 07/25/21	4,500,000.000	4,474,350.000	
	POLAND 2.0 04/25/21	4,000,000.000	4,016,800.000	
	POLAND 2.25 04/25/22	5,500,000.000	5,512,650.000	
	POLAND 2.5 01/25/23	2,640,000.000	2,654,520.000	
	POLAND 2.5 07/25/26	5,520,000.000	5,289,540.000	
	POLAND 2.5 07/25/27	4,890,000.000	4,635,720.000	
	POLAND 2.75 04/25/28	1,000,000.000	963,950.000	
	POLAND 3.25 07/25/25	5,200,000.000	5,292,300.000	
	POLAND 4.0 10/25/23	4,070,000.000	4,363,243.500	
	POLAND 5.25 10/25/20	2,880,000.000	3,108,096.000	
	POLAND 5.5 10/25/19	3,210,000.000	3,375,636.000	
	POLAND 5.75 04/25/29	1,800,000.000	2,230,200.000	
	POLAND 5.75 09/23/22	3,380,000.000	3,844,851.400	
POLAND 5.75 10/25/21	2,690,000.000	3,008,630.500		
ポーランド・ズロチ	小計	56,880,000.000 (1,712,088,000)	58,322,227.400 (1,755,499,045)	
マレーシア・リングギット	MALAYSIA 3.418 08/15/22	5,000,000.000	4,933,600.000	
	MALAYSIA 3.48 03/15/23	3,910,000.000	3,853,383.200	
	MALAYSIA 3.502 05/31/27	4,580,000.000	4,330,664.800	
	MALAYSIA 3.844 04/15/33	1,340,000.000	1,227,520.400	
	MALAYSIA 3.9 11/30/26	1,500,000.000	1,474,905.000	
	MALAYSIA 4.127 04/15/32	1,180,000.000	1,119,442.400	
	MALAYSIA 4.16 07/15/21	6,460,000.000	6,568,398.800	
	MALAYSIA 4.181 07/15/24	2,190,000.000	2,222,236.800	
	MALAYSIA 4.232 06/30/31	2,000,000.000	1,935,320.000	
	MALAYSIA 4.378 11/29/19	5,160,000.000	5,224,448.400	
	MALAYSIA 4.392 04/15/26	1,480,000.000	1,496,605.600	

	MALAYSIA 4.498 04/15/30	2,820,000.000	2,826,965.400	
	MALAYSIA 4.935 09/30/43	3,470,000.000	3,527,255.000	
	MALAYSIA 5.248 09/15/28	1,480,000.000	1,589,579.200	
マレーシア・リングgit	小計	42,570,000.000 (1,170,675,000)	42,330,325.000 (1,164,083,938)	
メキシコ・ペソ	MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	13,880,000.000	16,740,529.200	
	MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	45,604,000.000	51,012,634.400	
	MEXICAN BONDS 5.75 03/05/26	21,500,000.000	19,103,395.000	
	MEXICAN BONDS 6.5 06/09/22	42,000,000.000	40,313,280.000	
	MEXICAN BONDS 6.5 06/10/21	47,647,000.000	46,214,254.710	
	MEXICAN BONDS 7.25 12/09/21	9,886,000.000	9,749,573.200	
	MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	34,386,000.000	33,967,866.240	
	MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	21,054,000.000	20,986,206.120	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	30,877,000.000	30,370,308.430	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	16,399,000.000	16,251,736.980	
	MEXICAN BONDS 8.0 06/11/20	46,000,000.000	46,328,900.000	
	MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47	11,366,000.000	11,489,775.740	
	MEXICAN BONDS 8.0 12/07/23	22,730,000.000	23,049,356.500	
	MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	16,000,000.000	16,920,000.000	
	MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	17,526,000.000	18,607,704.720	
メキシコ・ペソ	小計	396,855,000.000 (2,313,664,650)	401,105,521.240 (2,338,445,189)	
ユーロ	AUSTRIA 0.25 10/18/19	1,280,000.000	1,293,030.400	
	AUSTRIA 0.5 04/20/27	2,300,000.000	2,309,798.000	
	AUSTRIA 0.75 02/20/28	570,000.000	580,328.400	
	AUSTRIA 0.75 10/20/26	1,700,000.000	1,752,377.000	
	AUSTRIA 07/15/23	900,000.000	904,545.000	
	AUSTRIA 09/20/22	800,000.000	809,368.000	
	AUSTRIA 1.2 10/20/25	1,580,000.000	1,689,557.200	
	AUSTRIA 1.5 02/20/47	760,000.000	787,717.200	
	AUSTRIA 1.5 11/02/86	540,000.000	507,654.000	
	AUSTRIA 1.65 10/21/24	1,580,000.000	1,738,047.400	
	AUSTRIA 1.75 10/20/23	1,820,000.000	1,997,996.000	
	AUSTRIA 2.1 09/20/17	520,000.000	602,035.200	
	AUSTRIA 2.4 05/23/34	1,190,000.000	1,442,565.600	

AUSTRIA 3.15 06/20/44	1,090,000.000	1,551,767.600	
AUSTRIA 3.4 11/22/22	3,320,000.000	3,855,648.800	
AUSTRIA 3.5 09/15/21	3,110,000.000	3,501,860.000	
AUSTRIA 3.65 04/20/22	1,270,000.000	1,461,960.500	
AUSTRIA 3.8 01/26/62	580,000.000	1,014,072.000	
AUSTRIA 3.9 07/15/20	4,170,000.000	4,540,921.500	
AUSTRIA 4.15 03/15/37	2,310,000.000	3,525,060.000	
AUSTRIA 4.85 03/15/26	1,400,000.000	1,895,194.000	
AUSTRIA 6.25 07/15/27	1,160,000.000	1,759,070.400	
BELGIUM 0.2 10/22/23	1,060,000.000	1,072,296.000	
BELGIUM 0.5 10/22/24	1,500,000.000	1,533,285.000	
BELGIUM 0.8 06/22/25	6,000,000.000	6,232,620.000	
BELGIUM 0.8 06/22/27	2,050,000.000	2,092,558.000	
BELGIUM 0.8 06/22/28	1,370,000.000	1,383,768.500	
BELGIUM 1.0 06/22/26	2,050,000.000	2,147,375.000	
BELGIUM 1.0 06/22/31	1,500,000.000	1,506,945.000	
BELGIUM 1.25 04/22/33	700,000.000	714,686.000	
BELGIUM 1.45 06/22/37	600,000.000	608,610.000	
BELGIUM 1.6 06/22/47	1,570,000.000	1,560,658.500	
BELGIUM 1.9 06/22/38	1,220,000.000	1,328,323.800	
BELGIUM 2.15 06/22/66	640,000.000	686,720.000	
BELGIUM 2.25 06/22/23	1,850,000.000	2,069,965.000	
BELGIUM 2.25 06/22/57	410,000.000	457,888.000	
BELGIUM 2.6 06/22/24	2,820,000.000	3,244,297.200	
BELGIUM 3.0 06/22/34	1,200,000.000	1,521,108.000	
BELGIUM 3.0 09/28/19	2,530,000.000	2,639,397.200	
BELGIUM 3.75 06/22/45	1,480,000.000	2,191,554.400	
BELGIUM 3.75 09/28/20	2,500,000.000	2,738,400.000	
BELGIUM 4.0 03/28/22	2,130,000.000	2,479,128.300	
BELGIUM 4.0 03/28/32	1,550,000.000	2,154,205.500	
BELGIUM 4.25 03/28/41	2,670,000.000	4,112,494.200	
BELGIUM 4.25 09/28/21	2,400,000.000	2,765,400.000	
BELGIUM 4.25 09/28/22	2,300,000.000	2,744,245.000	
BELGIUM 4.5 03/28/26	1,500,000.000	1,978,605.000	
BELGIUM 5.0 03/28/35	3,260,000.000	5,138,738.000	
BELGIUM 5.5 03/28/28	3,370,000.000	4,940,285.200	
BUNDESOBL 0.25 10/11/19	3,400,000.000	3,439,678.000	
BUNDESOBL 0.25 10/16/20	3,000,000.000	3,060,390.000	
BUNDESOBL 04/08/22	2,500,000.000	2,542,050.000	
BUNDESOBL 04/09/21	2,850,000.000	2,895,115.500	
BUNDESOBL 04/14/23	2,960,000.000	2,999,279.200	
BUNDESOBL 04/17/20	2,950,000.000	2,985,164.000	
BUNDESOBL 10/07/22	3,000,000.000	3,047,550.000	
BUNDESOBL 10/08/21	3,400,000.000	3,456,542.000	
BUNDESSCHAT 09/13/19	2,330,000.000	2,348,896.300	
BUNDESSCHAT 12/13/19	4,000,000.000	4,038,520.000	
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27	3,800,000.000	3,817,746.000	

DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25	3,440,000.000	3,563,736.800	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26	4,000,000.000	4,129,880.000	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28	3,330,000.000	3,386,610.000	
DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27	3,480,000.000	3,556,072.800	
DEUTSCHLAND 08/15/26	3,770,000.000	3,728,153.000	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/24	3,100,000.000	3,310,459.000	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25	4,440,000.000	4,753,286.400	
DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48	1,160,000.000	1,225,168.800	
DEUTSCHLAND 1.5 02/15/23	3,100,000.000	3,364,275.000	
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/23	3,070,000.000	3,339,361.800	
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/24	2,600,000.000	2,851,212.000	
DEUTSCHLAND 1.5 09/04/22	3,300,000.000	3,562,614.000	
DEUTSCHLAND 1.75 02/15/24	3,300,000.000	3,658,743.000	
DEUTSCHLAND 1.75 07/04/22	3,350,000.000	3,643,058.000	
DEUTSCHLAND 2.0 01/04/22	2,700,000.000	2,935,197.000	
DEUTSCHLAND 2.0 08/15/23	2,900,000.000	3,235,965.000	
DEUTSCHLAND 2.25 09/04/20	3,000,000.000	3,188,880.000	
DEUTSCHLAND 2.25 09/04/21	2,700,000.000	2,937,654.000	
DEUTSCHLAND 2.5 01/04/21	2,200,000.000	2,371,974.000	
DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	5,080,000.000	6,881,977.600	
DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	4,170,000.000	5,715,068.400	
DEUTSCHLAND 3.0 07/04/20	3,200,000.000	3,433,408.000	
DEUTSCHLAND 3.25 01/04/20	2,300,000.000	2,436,137.000	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/21	2,490,000.000	2,774,532.300	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	2,330,000.000	3,517,298.100	

DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	4,680,000.000	7,303,233.600	
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	2,100,000.000	3,489,003.000	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	1,800,000.000	2,586,708.000	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	3,400,000.000	5,512,318.000	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	2,400,000.000	4,291,968.000	
DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	2,600,000.000	4,186,676.000	
DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	2,900,000.000	4,360,817.000	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/24	1,180,000.000	1,599,442.800	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	1,400,000.000	2,321,438.000	
DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	1,670,000.000	2,609,107.800	
FINLAND 0.375 09/15/20	1,150,000.000	1,174,081.000	
FINLAND 0.5 04/15/26	730,000.000	741,395.300	
FINLAND 0.5 09/15/27	600,000.000	601,656.000	
FINLAND 0.75 04/15/31	750,000.000	748,072.500	
FINLAND 0.875 09/15/25	1,250,000.000	1,309,400.000	
FINLAND 04/15/22	770,000.000	779,147.600	
FINLAND 09/15/23	750,000.000	753,270.000	
FINLAND 1.125 04/15/34	450,000.000	462,820.500	
FINLAND 1.5 04/15/23	830,000.000	896,649.000	
FINLAND 1.625 09/15/22	960,000.000	1,037,097.600	
FINLAND 2.0 04/15/24	700,000.000	781,326.000	
FINLAND 2.625 07/04/42	780,000.000	1,038,437.400	
FINLAND 2.75 07/04/28	700,000.000	850,801.000	
FINLAND 3.375 04/15/20	2,320,000.000	2,483,838.400	
FINLAND 3.5 04/15/21	1,210,000.000	1,344,443.100	
FINLAND 4.0 07/04/25	930,000.000	1,176,794.100	
FRANCE BTAN 8.5 04/25/23	1,480,000.000	2,099,690.800	
FRANCE OAT 0.25 11/25/20	4,300,000.000	4,381,700.000	
FRANCE OAT 0.25 11/25/26	4,400,000.000	4,351,644.000	
FRANCE OAT 0.5 05/25/25	5,500,000.000	5,629,635.000	
FRANCE OAT 0.5 05/25/26	5,000,000.000	5,076,500.000	
FRANCE OAT 0.5 11/25/19	5,000,000.000	5,072,650.000	
FRANCE OAT 0.75 05/25/28	6,030,000.000	6,120,691.200	
FRANCE OAT 02/25/20	4,200,000.000	4,238,976.000	
FRANCE OAT 02/25/21	2,400,000.000	2,428,440.000	
FRANCE OAT 03/25/23	2,800,000.000	2,821,140.000	

FRANCE OAT 05/25/20	5,400,000.000	5,458,752.000	
FRANCE OAT 05/25/21	7,200,000.000	7,293,960.000	
FRANCE OAT 05/25/22	5,500,000.000	5,566,550.000	
FRANCE OAT 1.0 05/25/27	5,000,000.000	5,234,250.000	
FRANCE OAT 1.0 11/25/25	5,200,000.000	5,494,476.000	
FRANCE OAT 1.25 05/25/34	500,000.000	514,955.000	
FRANCE OAT 1.25 05/25/36	3,600,000.000	3,650,760.000	
FRANCE OAT 1.5 05/25/31	10,640,000.000	11,474,814.400	
FRANCE OAT 1.75 05/25/23	6,650,000.000	7,271,376.000	
FRANCE OAT 1.75 05/25/66	1,450,000.000	1,472,098.000	
FRANCE OAT 1.75 06/25/39	1,500,000.000	1,625,325.000	
FRANCE OAT 1.75 11/25/24	5,600,000.000	6,197,184.000	
FRANCE OAT 2.0 05/25/48	3,150,000.000	3,490,798.500	
FRANCE OAT 2.25 05/25/24	5,400,000.000	6,115,122.000	
FRANCE OAT 2.25 10/25/22	4,900,000.000	5,432,238.000	
FRANCE OAT 2.5 05/25/30	4,850,000.000	5,802,734.000	
FRANCE OAT 2.5 10/25/20	4,300,000.000	4,601,301.000	
FRANCE OAT 2.75 10/25/27	6,850,000.000	8,264,388.000	
FRANCE OAT 3.0 04/25/22	6,220,000.000	7,014,356.200	
FRANCE OAT 3.25 05/25/45	3,850,000.000	5,403,359.500	
FRANCE OAT 3.25 10/25/21	6,000,000.000	6,730,440.000	
FRANCE OAT 3.5 04/25/20	3,010,000.000	3,230,000.900	
FRANCE OAT 3.5 04/25/26	6,660,000.000	8,343,648.000	
FRANCE OAT 3.75 04/25/21	5,510,000.000	6,164,863.500	
FRANCE OAT 3.75 10/25/19	5,060,000.000	5,342,651.600	
FRANCE OAT 4.0 04/25/55	2,250,000.000	3,734,550.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/60	2,330,000.000	3,981,154.500	
FRANCE OAT 4.0 10/25/38	4,050,000.000	6,101,568.000	
FRANCE OAT 4.25 10/25/23	12,850,000.000	15,832,999.000	
FRANCE OAT 4.5 04/25/41	5,460,000.000	8,903,403.600	
FRANCE OAT 4.75 04/25/35	4,920,000.000	7,747,819.200	
FRANCE OAT 5.5 04/25/29	5,620,000.000	8,477,657.600	
FRANCE OAT 5.75 10/25/32	5,000,000.000	8,275,250.000	
FRANCE OAT 6.0 10/25/25	2,220,000.000	3,161,235.600	



FRANCE OAT 8.5 10/25/19	1,480,000.000	1,654,136.800	
IRISH 0.8 03/15/22	1,280,000.000	1,328,716.800	
IRISH 0.9 05/15/28	800,000.000	806,048.000	
IRISH 1.0 05/15/26	1,730,000.000	1,794,061.900	
IRISH 1.3 05/15/33	740,000.000	739,874.200	
IRISH 1.7 05/15/37	930,000.000	968,967.000	
IRISH 10/18/22	890,000.000	894,628.000	
IRISH 2.0 02/18/45	1,350,000.000	1,459,984.500	
IRISH 2.4 05/15/30	1,490,000.000	1,719,474.900	
IRISH 3.4 03/18/24	1,120,000.000	1,328,566.400	
IRISH 3.9 03/20/23	950,000.000	1,128,068.000	
IRISH 4.5 04/18/20	1,570,000.000	1,710,515.000	
IRISH 5.0 10/18/20	1,420,000.000	1,598,636.000	
IRISH 5.4 03/13/25	2,030,000.000	2,710,253.000	
IRISH 5.9 10/18/19	1,190,000.000	1,286,021.100	
ITALY BTPS 0.05 10/15/19	3,100,000.000	3,083,849.000	
ITALY BTPS 0.2 10/15/20	2,500,000.000	2,460,750.000	
ITALY BTPS 0.35 06/15/20	3,600,000.000	3,571,920.000	
ITALY BTPS 0.35 11/01/21	3,800,000.000	3,690,332.000	
ITALY BTPS 0.45 06/01/21	3,750,000.000	3,680,250.000	
ITALY BTPS 0.65 10/15/23	3,000,000.000	2,814,270.000	
ITALY BTPS 0.65 11/01/20	2,000,000.000	1,988,800.000	
ITALY BTPS 0.7 05/01/20	3,800,000.000	3,795,668.000	
ITALY BTPS 0.9 08/01/22	3,000,000.000	2,916,870.000	
ITALY BTPS 0.95 03/01/23	2,000,000.000	1,926,020.000	
ITALY BTPS 0.95 03/15/23	2,700,000.000	2,601,450.000	
ITALY BTPS 1.05 12/01/19	3,300,000.000	3,320,361.000	
ITALY BTPS 1.2 04/01/22	2,700,000.000	2,671,920.000	
ITALY BTPS 1.25 12/01/26	3,500,000.000	3,192,140.000	
ITALY BTPS 1.35 04/15/22	3,000,000.000	2,982,270.000	
ITALY BTPS 1.45 05/15/25	1,360,000.000	1,286,138.400	
ITALY BTPS 1.45 09/15/22	3,820,000.000	3,790,738.800	
ITALY BTPS 1.45 11/15/24	2,800,000.000	2,672,740.000	
ITALY BTPS 1.5 06/01/25	3,700,000.000	3,509,450.000	
ITALY BTPS 1.6 06/01/26	3,300,000.000	3,112,560.000	

ITALY BTPS 1.65 03/01/32	3,300,000.000	2,854,401.000	
ITALY BTPS 1.85 05/15/24	2,800,000.000	2,756,600.000	
ITALY BTPS 2.0 02/01/28	1,950,000.000	1,842,145.500	
ITALY BTPS 2.0 12/01/25	2,900,000.000	2,828,080.000	
ITALY BTPS 2.05 08/01/27	4,600,000.000	4,388,170.000	
ITALY BTPS 2.15 12/15/21	2,000,000.000	2,054,600.000	
ITALY BTPS 2.2 06/01/27	2,500,000.000	2,426,750.000	
ITALY BTPS 2.25 09/01/36	2,400,000.000	2,148,960.000	
ITALY BTPS 2.45 09/01/33	1,800,000.000	1,679,760.000	
ITALY BTPS 2.5 12/01/24	3,800,000.000	3,867,336.000	
ITALY BTPS 2.7 03/01/47	2,650,000.000	2,378,375.000	
ITALY BTPS 2.8 03/01/67	1,100,000.000	947,100.000	
ITALY BTPS 2.95 09/01/38	1,450,000.000	1,395,219.000	
ITALY BTPS 3.25 09/01/46	2,200,000.000	2,178,506.000	
ITALY BTPS 3.45 03/01/48	5,080,000.000	5,122,519.600	
ITALY BTPS 3.5 03/01/30	3,980,000.000	4,206,820.200	
ITALY BTPS 3.75 03/01/21	2,950,000.000	3,153,668.000	
ITALY BTPS 3.75 05/01/21	3,000,000.000	3,212,400.000	
ITALY BTPS 3.75 08/01/21	3,500,000.000	3,761,450.000	
ITALY BTPS 3.75 09/01/24	2,500,000.000	2,718,250.000	
ITALY BTPS 4.0 02/01/37	4,570,000.000	5,147,648.000	
ITALY BTPS 4.0 09/01/20	5,240,000.000	5,585,316.000	
ITALY BTPS 4.25 03/01/20	2,100,000.000	2,220,057.000	
ITALY BTPS 4.25 09/01/19	4,860,000.000	5,066,258.400	
ITALY BTPS 4.5 02/01/20	2,420,000.000	2,560,311.600	
ITALY BTPS 4.5 03/01/24	3,500,000.000	3,943,170.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/26	2,850,000.000	3,264,390.000	
ITALY BTPS 4.5 05/01/23	2,600,000.000	2,917,304.000	
ITALY BTPS 4.75 08/01/23	4,010,000.000	4,558,969.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/21	5,140,000.000	5,685,354.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/28	3,100,000.000	3,638,811.000	

ITALY BTPS 4.75 09/01/44	2,600,000.000	3,191,370.000	
ITALY BTPS 5.0 03/01/22	2,500,000.000	2,806,750.000	
ITALY BTPS 5.0 03/01/25	3,860,000.000	4,508,518.600	
ITALY BTPS 5.0 08/01/34	3,670,000.000	4,568,783.000	
ITALY BTPS 5.0 08/01/39	4,010,000.000	5,028,540.000	
ITALY BTPS 5.0 09/01/40	3,450,000.000	4,310,775.000	
ITALY BTPS 5.25 11/01/29	4,680,000.000	5,754,060.000	
ITALY BTPS 5.5 09/01/22	2,960,000.000	3,409,712.800	
ITALY BTPS 5.5 11/01/22	3,200,000.000	3,692,896.000	
ITALY BTPS 5.75 02/01/33	3,350,000.000	4,410,945.000	
ITALY BTPS 6.0 05/01/31	4,300,000.000	5,673,420.000	
ITALY BTPS 6.5 11/01/27	3,400,000.000	4,466,580.000	
ITALY BTPS 7.25 11/01/26	2,150,000.000	2,909,810.000	
ITALY BTPS 9.0 11/01/23	1,700,000.000	2,299,250.000	
NETHERLANDS 0.25 01/15/20	2,150,000.000	2,180,293.500	
NETHERLANDS 0.25 07/15/25	2,400,000.000	2,423,736.000	
NETHERLANDS 0.5 07/15/26	2,690,000.000	2,745,683.000	
NETHERLANDS 0.75 07/15/27	2,390,000.000	2,471,451.200	
NETHERLANDS 0.75 07/15/28	900,000.000	924,210.000	
NETHERLANDS 01/15/22	2,800,000.000	2,839,200.000	
NETHERLANDS 01/15/24	1,640,000.000	1,646,937.200	
NETHERLANDS 1.75 07/15/23	2,700,000.000	2,965,869.000	
NETHERLANDS 2.0 07/15/24	2,200,000.000	2,469,456.000	
NETHERLANDS 2.25 07/15/22	2,280,000.000	2,522,044.800	
NETHERLANDS 2.5 01/15/33	2,110,000.000	2,629,271.000	
NETHERLANDS 2.75 01/15/47	2,100,000.000	2,997,183.000	
NETHERLANDS 3.25 07/15/21	2,760,000.000	3,076,075.200	
NETHERLANDS 3.5 07/15/20	4,510,000.000	4,889,065.500	
NETHERLANDS 3.75 01/15/23	2,000,000.000	2,366,400.000	
NETHERLANDS 3.75 01/15/42	2,930,000.000	4,686,388.500	
NETHERLANDS 4.0 01/15/37	2,310,000.000	3,575,418.000	

	NETHERLANDS 5.5 01/15/28	2,070,000.000	3,063,600.000	
	NETHERLANDS 7.5 01/15/23	590,000.000	799,096.000	
	SPAIN 0.05 01/31/21	2,500,000.000	2,510,825.000	
	SPAIN 0.4 04/30/22	3,300,000.000	3,341,778.000	
	SPAIN 0.45 10/31/22	2,600,000.000	2,632,162.000	
	SPAIN 0.75 07/30/21	4,700,000.000	4,821,824.000	
	SPAIN 1.15 07/30/20	4,500,000.000	4,631,355.000	
	SPAIN 1.3 10/31/26	3,500,000.000	3,571,085.000	
	SPAIN 1.4 01/31/20	3,600,000.000	3,696,552.000	
	SPAIN 1.4 04/30/28	5,960,000.000	6,026,394.400	
	SPAIN 1.45 10/31/27	3,300,000.000	3,369,795.000	
	SPAIN 1.5 04/30/27	2,700,000.000	2,776,950.000	
	SPAIN 1.6 04/30/25	3,100,000.000	3,283,551.000	
	SPAIN 1.95 04/30/26	3,000,000.000	3,223,470.000	
	SPAIN 1.95 07/30/30	3,050,000.000	3,185,298.000	
	SPAIN 2.15 10/31/25	3,600,000.000	3,930,444.000	
	SPAIN 2.35 07/30/33	1,860,000.000	1,988,340.000	
	SPAIN 2.7 10/31/48	1,080,000.000	1,139,238.000	
	SPAIN 2.75 10/31/24	3,800,000.000	4,300,688.000	
	SPAIN 2.9 10/31/46	2,500,000.000	2,767,775.000	
	SPAIN 3.45 07/30/66	1,700,000.000	2,035,988.000	
	SPAIN 3.8 04/30/24	2,980,000.000	3,533,237.000	
	SPAIN 4.0 04/30/20	2,870,000.000	3,090,559.500	
	SPAIN 4.2 01/31/37	3,000,000.000	4,053,390.000	
	SPAIN 4.3 10/31/19	2,820,000.000	2,993,740.200	
	SPAIN 4.4 10/31/23	4,000,000.000	4,835,320.000	
	SPAIN 4.65 07/30/25	3,380,000.000	4,281,446.000	
	SPAIN 4.7 07/30/41	3,060,000.000	4,456,492.200	
	SPAIN 4.8 01/31/24	3,000,000.000	3,709,140.000	
	SPAIN 4.85 10/31/20	2,630,000.000	2,935,711.200	
	SPAIN 4.9 07/30/40	3,230,000.000	4,798,165.000	
	SPAIN 5.15 10/31/28	3,600,000.000	4,904,280.000	
	SPAIN 5.15 10/31/44	2,000,000.000	3,123,060.000	
	SPAIN 5.4 01/31/23	3,000,000.000	3,705,540.000	
	SPAIN 5.5 04/30/21	3,000,000.000	3,473,040.000	
	SPAIN 5.75 07/30/32	3,720,000.000	5,640,859.200	
	SPAIN 5.85 01/31/22	4,160,000.000	5,026,944.000	
	SPAIN 5.9 07/30/26	4,680,000.000	6,452,830.800	
	SPAIN 6.0 01/31/29	3,500,000.000	5,100,235.000	
	ユーロ 小計	832,590,000.000 (108,278,329,500)	952,118,270.700 (123,822,981,105)	
南アフリカ・ランド	SOUTH AFRICA 10.5 12/21/26	39,540,000.000	43,828,113.000	
	SOUTH AFRICA 6.25 03/31/36	17,630,000.000	12,914,680.200	
	SOUTH AFRICA 6.5 02/28/41	13,680,000.000	9,864,374.400	

	SOUTH AFRICA 7.0 02/28/31	17,190,000.000	14,441,319.000	
	SOUTH AFRICA 7.75 02/28/23	11,500,000.000	11,346,935.000	
	SOUTH AFRICA 8.0 01/31/30	15,820,000.000	14,655,015.200	
	SOUTH AFRICA 8.25 03/31/32	13,000,000.000	12,025,650.000	
	SOUTH AFRICA 8.5 01/31/37	16,500,000.000	15,177,690.000	
	SOUTH AFRICA 8.75 01/31/44	15,000,000.000	13,873,050.000	
	SOUTH AFRICA 8.75 02/28/48	39,170,000.000	36,023,473.900	
	SOUTH AFRICA 8.875 02/28/35	10,000,000.000	9,576,400.000	
	SOUTH AFRICA 9.0 01/31/40	9,000,000.000	8,568,900.000	
	南アフリカ・ランド 小計	218,030,000.000 (1,811,829,300)	202,295,600.700 (1,681,076,442)	
国債証券 合計		284,016,059,150 (284,016,059,150)	302,592,963,040 (302,592,963,040)	
合計		284,016,059,150 (284,016,059,150)	302,592,963,040 (302,592,963,040)	

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	有価証券の合計金額 に対する比率
アメリカ・ドル	国債証券 150銘柄	43.19%	44.32%
イギリス・ポンド	国債証券 41銘柄	6.83%	7.01%
オーストラリア・ドル	国債証券 21銘柄	2.02%	2.08%
カナダ・ドル	国債証券 30銘柄	1.94%	1.99%
シンガポール・ドル	国債証券 17銘柄	0.32%	0.33%
スウェーデン・クローナ	国債証券 6銘柄	0.31%	0.32%
デンマーク・クローネ	国債証券 6銘柄	0.51%	0.52%
ノルウェー・クローネ	国債証券 6銘柄	0.22%	0.23%
ポーランド・ズロチ	国債証券 16銘柄	0.57%	0.58%
マレーシア・リンギット	国債証券 14銘柄	0.37%	0.38%
メキシコ・ペソ	国債証券 15銘柄	0.75%	0.77%
ユーロ	国債証券 291銘柄	39.87%	40.92%
南アフリカ・ランド	国債証券 12銘柄	0.54%	0.56%

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

## 「エマージング株式パッシブ・マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成30年1月11日現在	平成30年7月11日現在
資産の部			
流動資産			
預金		3,319,230,119	3,892,823,539
コール・ローン		107,218,956	70,784,507
株式		56,566,691,714	60,051,084,522
投資信託受益証券		291,974,467	333,504,522
投資証券		112,860,012	110,826,746
派生商品評価勘定		256,498,285	57,714,352
未収入金		704,406	10,620,636
未収配当金		80,996,576	383,537,405
差入委託証拠金		1,115,971,723	887,654,636
流動資産合計		61,852,146,258	65,798,550,865
資産合計		61,852,146,258	65,798,550,865
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		692,746	92,849,183
未払金		4,986	31,886
未払解約金		34,717,000	98,701,000
その他未払費用		-	2,527
流動負債合計		35,414,732	191,584,596
負債合計		35,414,732	191,584,596
純資産の部			
元本等			
元本	1	47,332,729,770	55,614,868,236
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		14,484,001,756	9,992,098,033
元本等合計		61,816,731,526	65,606,966,269
純資産合計		61,816,731,526	65,606,966,269
負債純資産合計		61,852,146,258	65,798,550,865

## 注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

## (貸借対照表に関する注記)

項目	平成30年1月11日現在	平成30年7月11日現在
<p>1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額</p> <p>同期中追加設定元本額</p> <p>同期中一部解約元本額</p> <p>元本の内訳</p> <p>ファンド名</p>	<p>44,737,444,562円</p> <p>14,002,287,139円</p> <p>11,407,001,931円</p>	<p>47,332,729,770円</p> <p>24,152,026,162円</p> <p>15,869,887,696円</p>

D I A M新興国株式インデック スファンド< D C 年金 >	2,967,430,561円	3,814,828,710円
D I A M新興国株式インデック スファンド< 為替ヘッジなし > (ファンドラップ)	249,749,689円	529,402,030円
M I T O ラップ型ファンド (安定型)	6,258,056円	4,288,618円
M I T O ラップ型ファンド (中立型)	16,063,826円	12,271,117円
M I T O ラップ型ファンド (積極型)	18,157,927円	14,095,680円
グローバル8資産ラップファン ド(安定型)	26,539,962円	27,418,980円
グローバル8資産ラップファン ド(中立型)	22,849,313円	27,881,386円
グローバル8資産ラップファン ド(積極型)	13,271,449円	15,897,153円
たわらノーロード 新興国株式	3,190,937,167円	3,816,064,629円
たわらノーロード 新興国株式 <ラップ向け>	968,725,817円	1,286,861,968円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	19,503,319円	83,666,789円
たわらノーロード バランス (堅実型)	33,387円	524,251円
たわらノーロード バランス (標準型)	138,526円	2,047,579円
たわらノーロード バランス (積極型)	635,967円	6,720,786円
たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(保守型)	7,956円	44,009円
たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(安定型)	15,911円	3,528,590円
たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(安定成長 型)	23,867円	8,565,767円
たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(成長型)	39,778円	6,922,321円
たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(積極型)	47,733円	15,855,916円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定型)	- 円	21,957円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定成長型)	- 円	245,719円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(成長型)	- 円	264,312円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(積極型)	- 円	601,308円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	462,876,236円	429,132,057円
D I A M D C 8資産 balan スファンド(新興国10)	40,575,086円	303,871,969円
D I A M D C 8資産 balan スファンド(新興国20)	133,439,313円	247,921,075円



DIAM DC 8資産バ ランスファンド(新興国30)	298,885,378円	491,090,199円
投資のソムリエ	1,371,356,428円	5,354,318,675円
クルーズコントロール	2,170,535,683円	801,287,245円
投資のソムリエ<DC年金>	87,148,003円	460,011,200円
DIAM 8資産バ ランスファ ンドN<DC年金>	157,925,647円	206,973,919円
クルーズコントロール<DC年 金>	757,609円	345,566円
DIAMコア資産設計ファンド (堅実型)	24,975,794円	7,218,206円
DIAMコア資産設計ファンド (積極型)	57,019,939円	25,339,484円
投資のソムリエ<DC年金>リ スク抑制型	89,462,427円	141,819,914円
ダイナミック・ナビゲーション	1,743,533円	552,053円
リスク抑制世界8資産バ ランス ファンド	1,214,158,639円	2,556,846,801円
ワールドアセットバランス(基 本コース)	1,627,105,199円	1,964,816,977円
ワールドアセットバランス(リ スク抑制コース)	6,091,354,580円	7,712,821,183円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2045)	230,203円	1,586,206円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2055)	230,203円	1,026,335円
リスク抑制世界8資産バ ランス ファンド(DC)	415,873円	670,375円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2035)	240,421円	2,441,711円
リスクコントロール世界資産分 散ファンド	-円	218,814,040円
エマージング株式パッシブファ ンドVA(適格機関投資家専 用)	5,065,986,468円	4,462,150,674円
エマージング株式パッシブファ ンド(適格機関投資家限定)	2,638,488,353円	2,127,490,579円
DIAM世界アセットバ ランス ファンド2VA(適格機関投資 家限定)	11,082,972,525円	10,762,265,811円
DIAM世界アセットバ ランス ファンド3VA(適格機関投資 家限定)	7,214,416,019円	7,656,036,407円
計	47,332,729,770円	55,614,868,236円
2. 受益権の総数	47,332,729,770口	55,614,868,236口

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成29年7月12日 至 平成30年1月11日	自 平成30年1月12日 至 平成30年7月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成30年1月11日現在	平成30年7月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	平成30年1月11日現在	平成30年7月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
株式	9,392,239,360	2,396,193,416
投資信託受益証券	281,450	5,241,250
投資証券	3,539,125	13,195,730
合計	9,388,981,685	2,404,147,896

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(平成29年4月19日から平成30年1月11日まで及び平成30年4月19日から平成30年7月11日まで)に対応する金額であります。

## (デリバティブ取引等に関する注記)

## 通貨関連

種類	平成30年1月11日 現在				平成30年7月11日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	1,161,449,670	-	1,161,413,200	36,470	64,294,476	-	64,222,680	71,796
アメリカ・ドル	1,161,449,670	-	1,161,413,200	36,470	64,294,476	-	64,222,680	71,796
買 建	39,578,880	-	39,233,920	344,960	809,964,127	-	809,937,840	26,287
アメリカ・ドル	39,578,880	-	39,233,920	344,960	809,964,127	-	809,937,840	26,287
合計	1,201,028,550	-	1,200,647,120	308,490	874,258,603	-	874,160,520	45,509

## (注) 時価の算定方法

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

#### 株式関連

種類	平成30年1月11日 現在				平成30年7月11日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
先物取引								
買 建	3,403,250,998	-	3,659,365,027	256,114,029	5,874,056,322	-	5,838,875,982	35,180,340
合計	3,403,250,998	-	3,659,365,027	256,114,029	5,874,056,322	-	5,838,875,982	35,180,340

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成30年1月11日現在	平成30年7月11日現在
1口当たり純資産額	1.3060円	1.1797円
(1万口当たり純資産額)	(13,060円)	(11,797円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

平成30年7月11日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	CTRI.P.COM INTERNATIONAL LTD ADR	40,900	45.190	1,848,271.000	
	CIA DE MINAS BUENAVENTURA SA ADR	18,800	13.260	249,288.000	
	SURGUTNEFTEGAZ SP ADR PREF	85,900	5.365	460,853.500	
	CREDICORP LTD	7,049	229.780	1,619,719.220	
	SINA CORP	6,800	84.680	575,824.000	
	MOBILE TELESYSTEMS PJSC ADR	59,625	9.010	537,221.250	
	NETEASE INC-ADR	8,200	265.240	2,174,968.000	
	SOUTHERN COPPER CORP	8,780	46.310	406,601.800	
	LUKOIL SPON ADR	45,656	70.060	3,198,659.360	
	GAZPROM PAO ADR	575,700	4.667	2,686,791.900	
	COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK SP GDR	118,173	4.775	564,276.070	
	INNER MONGOLIA YITAI COAL CO	101,500	1.358	137,837.000	
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRADE	96,280	1.385	133,347.800	
	SURGUTNEFTEGAZ ADR	74,017	4.612	341,366.400	
	51JOB INC ADR	2,300	92.590	212,957.000	
	X5 RETAIL GROUP NV GDR	13,015	28.340	368,845.100	
	NOVATEK PJSC GDR	10,172	156.600	1,592,935.200	
	BAIDU INC -SPON ADR	28,500	261.250	7,445,625.000	
	NOVOLIPETSK STEEL GDR	14,520	25.890	375,922.800	
	MMC NORILSK NICKEL ADR	71,744	18.660	1,338,743.040	
	ROSNEFT OIL CO GDR	122,010	6.630	808,926.300	
	NEW ORIENTAL EDUCATION & TECH	14,900	95.230	1,418,927.000	
	SEVERSTAL GDR	27,217	15.430	419,958.310	
	TATNEFT ADR	27,870	67.100	1,870,077.000	
	VTB BANK OJSC GDR	222,000	1.588	352,536.000	
	DP WORLD LTD	18,320	23.000	421,360.000	
	MAGNIT PJSC GDR	38,979	17.550	684,081.450	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD ADR	43,400	10.690	463,946.000	
	FANG HOLDINGS LTD ADR	19,300	3.520	67,936.000	
	RUSHYDRO PJSC ADR	193,960	1.062	205,985.520	
TAL EDUCATION GROUP-ADR	34,700	37.830	1,312,701.000		
NOAH HOLDINGS LTD ADR	2,700	48.040	129,708.000		
SBERBANK ADR	285,840	15.505	4,431,949.200		
PHOSAGRO PJSC GDR	17,458	13.500	235,683.000		

	HUAZHU GROUP LTD ADR	12,700	41.320	524,764.000	
	YY INC-ADR	4,900	97.150	476,035.000	
	GDS HOLDINGS LTD ADR	5,600	42.970	240,632.000	
	58.COM INC ADR	9,700	65.260	633,022.000	
	AUTOHOME INC ADR	6,200	103.240	640,088.000	
	WEIBO CORP ADR	4,900	90.280	442,372.000	
	JD.COM INC ADR	75,000	38.590	2,894,250.000	
	ALIBABA GROUP HOLDING LTD-ADR	119,580	192.550	23,025,129.000	
	MOMO INC SPON ADR	11,500	45.200	519,800.000	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	38,200	36.740	1,403,468.000	
アメリカ・ドル 小計		2,744,565		69,893,388.220 (7,753,273,554)	
アラブ首長国連邦・ディルハム	DUBAI ISLAMIC BANK PJSC	168,000	4.960	833,280.000	
	EMIRATES TELECOMMUNICATIONS GROUP CO PJSC	171,437	17.100	2,931,572.700	
	DUBAI INVESTMENTS PJSC	169,895	1.960	332,994.200	
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK PJSC	198,000	7.150	1,415,700.000	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	152,879	12.400	1,895,699.600	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	384,127	5.090	1,955,206.430	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	480,391	2.100	1,008,821.100	
	EMAAR DEVELOPMENT PJSC	77,463	5.100	395,061.300	
	EMAAR MALLS PJSC	178,166	2.110	375,930.260	
	DAMAC PROPERTIES DUBAI CO PJSC	190,235	2.190	416,614.650	
アラブ首長国連邦・ディルハム 小計		2,170,593		11,560,880.240 (349,716,627)	
インド・ルピー	RELIANCE INDUSTRIES LTD	294,501	1,025.700	302,069,675.700	
	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	80,630	375.250	30,256,407.500	
	ASIAN PAINTS LTD	27,773	1,370.450	38,061,507.850	
	EICHER MOTORS LTD	1,433	28,289.000	40,538,137.000	
	GRASIM INDUSTRIES LTD	35,755	990.650	35,420,690.750	
	MAHINDRA & MAHINDRA LTD	78,468	930.550	73,018,397.400	
	SHREE CEMENT LTD	830	16,804.800	13,947,984.000	
	ICICI BANK LTD	246,240	273.400	67,322,016.000	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP LTD	65,734	268.300	17,636,432.200	
	STATE BANK OF INDIA LTD	165,539	263.750	43,660,911.250	
	CONTAINER CORP OF INDIA LTD	15,148	674.000	10,209,752.000	
	LIC HOUSING FINANCE LTD	34,315	496.150	17,025,387.250	
	TATA STEEL LTD	30,298	568.650	17,228,957.700	
	TATA MOTORS LTD	165,005	275.450	45,450,627.250	
JSW STEEL LTD	86,000	317.450	27,300,700.000		

TATA POWER CO LTD	114,770	73.050	8,383,948.500	
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	3,339	6,389.700	21,335,208.300	
NESTLE INDIA LTD	2,343	10,005.250	23,442,300.750	
BHARAT HEAVY ELECTRICALS LTD	116,708	71.550	8,350,457.400	
GAIL INDIA LTD	85,632	363.950	31,165,766.400	
VEDANTA LTD	139,732	226.050	31,586,418.600	
AXIS BANK LTD	186,927	532.550	99,547,973.850	
TITAN COMPANY LTD	29,870	832.850	24,877,229.500	
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	121,518	157.950	19,193,768.100	
LUPIN LTD	22,500	902.850	20,314,125.000	
BAJAJ FINANCE LTD	17,067	2,366.350	40,386,495.450	
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP	163,458	1,942.550	317,525,337.900	
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISES LTD	53,623	538.400	28,870,623.200	
INFOSYS LTD	181,118	1,301.400	235,706,965.200	
WIPRO LTD	121,545	270.600	32,890,077.000	
INDIAN OIL CORP LTD	153,017	155.250	23,755,889.250	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	67,410	1,687.000	113,720,670.000	
HCL TECHNOLOGIES LTD	58,794	979.550	57,591,662.700	
DABUR INDIA LTD	50,863	376.250	19,137,203.750	
HERO MOTOCORP LTD	4,626	3,583.500	16,577,271.000	
DR REDDYS LABORATORIES LTD	10,779	2,321.850	25,027,221.150	
BHARTI AIRTEL LTD	146,285	367.800	53,803,623.000	
UNITED SPIRITS LTD	31,830	638.300	20,317,089.000	
SUN PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD	86,644	563.950	48,862,883.800	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	11,036	9,531.000	105,184,116.000	
GLENMARK PHARMACEUTICALS LTD	17,084	583.000	9,959,972.000	
AUROBINDO PHARMA LTD	30,426	617.250	18,780,448.500	
HAVELLS INDIA LTD	24,800	573.950	14,233,960.000	
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	64,460	306.650	19,766,659.000	
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE CO LTD	15,042	1,206.100	18,142,156.200	
PETRONET LNG LTD	70,238	222.800	15,649,026.400	
CIPLA LTD/INDIA	40,120	632.050	25,357,846.000	
LARSEN & TOUBRO LTD	49,742	1,284.600	63,898,573.200	
ULTRATECH CEMENT LTD	9,234	3,959.800	36,564,793.200	
ASHOK LEYLAND LTD	110,886	133.950	14,853,179.700	
BOSCH LTD	774	17,842.050	13,809,746.700	
TATA CONSULTANCY SERVICES LTD	95,006	1,875.100	178,145,750.600	
NTPC LTD	207,553	153.900	31,942,406.700	
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	7,771	2,466.300	19,165,617.300	



YES BANK LTD	179,419	371.400	66,636,216.600	
AMBUJA CEMENTS LTD	74,525	204.350	15,229,183.750	
BHARAT FORGE LTD	23,740	644.050	15,289,747.000	
HINDALCO INDUSTRIES LTD	121,198	229.050	27,760,401.900	
ITC LTD	356,053	277.050	98,644,483.650	
PIDILITE INDUSTRIES LTD	11,666	1,074.400	12,533,950.400	
UNITED PHOSPHORUS LTD	32,991	637.100	21,018,566.100	
SIEMENS INDIA LTD	9,457	1,015.750	9,605,947.750	
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	23,311	1,255.500	29,266,960.500	
TECH MAHINDRA LTD	50,717	650.750	33,004,087.750	
IDEA CELLULAR LTD	196,527	55.800	10,966,206.600	
MARICO LTD	45,380	350.300	15,896,614.000	
POWER GRID CORP OF INDIA LTD	152,012	184.050	27,977,808.600	
ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	48,081	370.450	17,811,606.450	
RURAL ELECTRIFICATION CORP LTD	85,677	103.650	8,880,421.050	
BAJAJ FINSERV LTD	3,706	6,199.800	22,976,458.800	
BAJAJ AUTO LTD	8,402	3,093.950	25,995,367.900	
COAL INDIA LTD	75,901	278.450	21,134,633.450	
VAKRANGEE LTD	35,954	57.100	2,052,973.400	
MAHINDRA & MAHINDRA FINANCIAL SERVICES LTD	32,995	481.950	15,901,940.250	
BHARTI INFRATEL LTD	39,421	305.300	12,035,231.300	
INDIABULLS HOUSING FINANCE LTD	26,629	1,143.650	30,454,255.850	
TATA STEEL LTD-PARTLY PAID	2,333	132.100	308,189.300	
CADILA HEALTHCARE LTD	26,908	381.150	10,255,984.200	
AVENUE SUPERMARTS LTD	11,937	1,598.100	19,076,519.700	
INTERGLOBE AVIATION LTD	8,300	1,090.600	9,051,980.000	
インド・ルピー 小計	5,735,479		3,266,737,780.400 (5,292,115,204)	
インドネシア・ルピア				
AKR CORPORINDO TBK PT	150,400	4,520.000	679,808,000.000	
UNITED TRACTORS TBK PT	168,201	33,400.000	5,617,913,400.000	
INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK PT	479,200	6,650.000	3,186,680,000.000	
UNILEVER INDONESIA TBK PT	146,400	47,125.000	6,899,100,000.000	
PT ASTRA INTERNATIONAL TBK	2,132,200	6,350.000	13,539,470,000.000	
TELEKOMUNIKASI INDONESIA PERSERO TBK	5,270,200	4,030.000	21,238,906,000.000	
CHAROEN POKPHAND INDONESIA TBK PT	845,600	3,710.000	3,137,176,000.000	
GUDANG GARAM TBK PT	48,600	70,975.000	3,449,385,000.000	

	HANJAYA MANDALA SAMPOERNA TBK	924,800	3,810.000	3,523,488,000.000	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA TBK PT	185,600	13,950.000	2,589,120,000.000	
	INDAH KIAT PULP AND PAPER CORP TBK PT	264,100	18,775.000	4,958,477,500.000	
	BANK DANAMON INDONESIA TBK PT	261,316	6,500.000	1,698,554,000.000	
	BANK MANDIRI	1,974,500	6,450.000	12,735,525,000.000	
	MATAHARI DEPARTMENT STORE TBK	276,500	8,500.000	2,350,250,000.000	
	BANK RAKYAT INDONESIA	5,829,300	3,050.000	17,779,365,000.000	
	PERUSAHAAN GAS NEGARA PT	1,064,100	1,585.000	1,686,598,500.000	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSERO TBK PT	709,000	7,300.000	5,175,700,000.000	
	KALBE FARMA TBK PT	2,522,200	1,310.000	3,304,082,000.000	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK PT	330,300	7,575.000	2,502,022,500.000	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	1,031,400	21,900.000	22,587,660,000.000	
	JASA MARGA PERSERO TBK PT	200,125	4,880.000	976,610,000.000	
	BUMI SERPONG DAMAI PT	851,700	1,550.000	1,320,135,000.000	
	ADARO ENERGY PT	1,434,500	1,865.000	2,675,342,500.000	
	PAKUWON JATI TBK	1,912,800	580.000	1,109,424,000.000	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR TBK PT	239,000	8,900.000	2,127,100,000.000	
	TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE TBK PT	180,800	5,025.000	908,520,000.000	
	BANK TABUNGAN NEGARA TBK PT	480,300	2,300.000	1,104,690,000.000	
	WASKITA KARYA PERSERO TBK PT	392,000	1,850.000	725,200,000.000	
	PT SURYA CITRA MEDIA TBK	511,300	2,220.000	1,135,086,000.000	
	インドネシア・ルピア 小計	30,816,442		150,721,388,400.000 (1,175,626,830)	
オフショア・人民 元	WULIANGYE YIBIN CO LTD	4,500	73.370	330,165.000	
	SUNING.COM CO LTD	29,500	13.050	384,975.000	
	MIDEA GROUP CO LTD	8,000	48.500	388,000.000	
	HANGZHOU HIKVISION DIGITAL TECHNOLOGY CO LTD	12,000	35.690	428,280.000	
	CHINA VANKE CO LTD	13,700	24.150	330,855.000	
	GF SECURITIES CO LTD	39,700	13.310	528,407.000	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL CORP	51,300	6.510	333,963.000	
	CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	21,200	26.800	568,160.000	
	PING AN INSURANCE GROUP CO OF CHINA LTD	14,000	58.180	814,520.000	

	INDUSTRIAL BANK CO LTD	27,400	14.370	393,738.000	
	SHANGHAI PUDONG DEVELOPMENT BANK CO LTD	36,700	9.570	351,219.000	
	CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	73,320	5.810	425,989.200	
	SAIC MOTOR CORP LTD	10,900	34.640	377,576.000	
	KWEICHOW MOUTAI CO LTD	1,100	725.760	798,336.000	
	BANK OF COMMUNICATIONS CO LTD	79,200	5.990	474,408.000	
	CITIC SECURITIES CO LTD	33,200	16.520	548,464.000	
	CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	10,900	32.590	355,231.000	
	CHINA YANGTZE POWER CO LTD	26,500	16.290	431,685.000	
	CHINA STATE CONSTRUCTION ENGINEERING CORP LTD	61,600	5.150	317,240.000	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	14,300	33.750	482,625.000	
	CHINA MERCHANTS SECURITIES CO LTD	22,800	13.210	301,188.000	
	CRRC CORP LTD	64,800	7.550	489,240.000	
	JIANGSU HENGRUI MEDICINE CO LTD	4,900	72.840	356,916.000	
	CHINA RAILWAY CONSTRUCTION CORP LTD	45,500	8.350	379,925.000	
	HUATAI SECURITIES CO LTD	30,600	14.690	449,514.000	
	SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	11,000	41.040	451,440.000	
	KANGMEI PHARMACEUTICAL CO LTD	14,300	22.780	325,754.000	
	FOSHAN HAITIAN FLAVOURING & FOOD CO LTD	6,200	76.480	474,176.000	
	GUOTAI JUNAN SECURITIES CO LTD	33,800	14.520	490,776.000	
	CHINA NATIONAL NUCLEAR POWER CO LTD	92,600	5.640	522,264.000	
	オフショア・人民元 小計	895,520		13,305,029.200 (220,730,434)	
カタール・リアル	QATAR INSURANCE CO SAQ	17,487	34.550	604,175.850	
	QATAR NATIONAL BANK	47,014	159.900	7,517,538.600	
	COMMERCIAL BANK OF QATAR QSC	21,711	39.980	868,005.780	
	OOREDOO QSC	8,410	73.950	621,919.500	
	DOHA BANK QSC	18,035	27.130	489,289.550	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	4,628	189.000	874,692.000	
	INDUSTRIES QATAR QSC	19,237	114.900	2,210,331.300	
	QATAR ISLAMIC BANK SAQ	11,054	122.500	1,354,115.000	
	MASRAF AL RAYAN	38,923	35.900	1,397,335.700	

	BARWA REAL ESTATE CO	9,376	36.010	337,629.760	
	EZDAN HOLDING GROUP QSC	84,431	8.200	692,334.200	
カタール・リアル	小計	280,306		16,967,367.240 (518,013,722)	
コロンビア・ペソ	INTERCONEXION ELECTRICA SA ESP	45,324	14,220.000	644,507,280.000	
	ECOPETROL SA	436,668	3,020.000	1,318,737,360.000	
	GRUPO DE INVERSIONES SURAMERICANA SA-PREF	10,138	36,040.000	365,373,520.000	
	GRUPO AVAL ACCIONES Y VALORES SA-PREF	545,351	1,190.000	648,967,690.000	
	CEMENTOS ARGOS SA	42,840	9,800.000	419,832,000.000	
	GRUPO ARGOS SA	28,217	19,060.000	537,816,020.000	
	BANCOLOMBIA SA	26,499	35,000.000	927,465,000.000	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	47,149	35,680.000	1,682,276,320.000	
	GRUPO DE INVERSIONES SURAMERICANA SA	25,428	36,880.000	937,784,640.000	
コロンビア・ペソ	小計	1,207,614		7,482,759,830.000 (288,834,530)	
タイ・パーツ	BANGKOK BANK PCL	27,700	201.000	5,567,700.000	
	BERLI JUCKER PCL NVDR	135,500	53.000	7,181,500.000	
	KRUNG THAI BANK PCL NVDR	348,000	17.600	6,124,800.000	
	ROBINSON PCL-NVDR	64,300	58.750	3,777,625.000	
	SIAM COMMERCIAL BANK PCL NVDR	191,900	123.500	23,699,650.000	
	TRUE CORP PCL NVDR	1,030,755	5.800	5,978,379.000	
	KASIKORNBANK PCL NVDR	71,200	195.500	13,919,600.000	
	TMB BANK PCL -NVDR	1,010,000	2.420	2,444,200.000	
	IRPC PCL NVDR	1,065,500	6.000	6,393,000.000	
	BANPU PCL PUBLIC CO LTD NVDR	255,900	20.500	5,245,950.000	
	ELECTRICITY GENERATING PCL NVDR	13,100	233.000	3,052,300.000	
	CHAROEN POKPHAND FOODS PCL	319,400	25.500	8,144,700.000	
	ADVANCED INFO SERVICE PCL	110,700	197.000	21,807,900.000	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	352,320	14.300	5,038,176.000	
	DELTA ELECTRONICS THAI PCL NVDR	44,200	61.000	2,696,200.000	
	PTT PCL	1,089,100	48.750	53,093,625.000	
	THAI UNION GROUP PCL-NVDR	158,500	15.400	2,440,900.000	
	LAND AND HOUSES PCL NVDR	263,900	11.600	3,061,240.000	
	SIAM CEMENT PCL NVDR	36,950	426.000	15,740,700.000	
	AIRPORTS OF THAILAND PCL-NVDR	450,100	65.500	29,481,550.000	
KASIKORNBANK PCL - FOREIGN	120,900	198.500	23,998,650.000		

	CENTRAL PATTANA PCL NVDR	129,100	73.250	9,456,575.000	
	BANGKOK DUSIT MEDICAL SERVICES NVDR	411,400	26.000	10,696,400.000	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR	38,900	174.000	6,768,600.000	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	236,810	33.500	7,933,135.000	
	THAI OIL PCL NVDR	118,900	76.500	9,095,850.000	
	GLOW ENERGY PCL NVDR	54,000	93.250	5,035,500.000	
	CP ALL PCL NVDR	526,900	79.000	41,625,100.000	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL	544,800	9.100	4,957,680.000	
	PTT EXPLORATION & PRODUCTION PCL NVDR	142,945	138.500	19,797,882.500	
	INDORAMA VENTURES PCL NVDR	174,022	56.000	9,745,232.000	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	241,608	78.000	18,845,424.000	
	ENERGY ABSOLUTE PCL NVDR	118,000	31.500	3,717,000.000	
	BANGKOK EXPRESSWAY & METRO PCL NVDR	740,700	7.850	5,814,495.000	
タイ・パーツ 小計		10,638,010		402,377,218.500 (1,343,939,910)	
チェコ・コルナ	KOMERCNI BANKA AS	7,067	934.500	6,604,111.500	
	O2 CZECH REPUBLIC AS	5,677	262.000	1,487,374.000	
	CEZ	15,347	577.500	8,862,892.500	
	MONETA MONEY BANK AS	57,258	78.700	4,506,204.600	
チェコ・コルナ 小計		85,349		21,460,582.600 (107,946,730)	
チリ・ペソ	BANCO SANTANDER CHILE	6,313,803	51.440	324,782,026.320	
	BANCO DE CREDITO E INVERSIONES	4,534	43,353.000	196,562,502.000	
	BANCO DE CHILE	2,748,849	101.250	278,320,961.250	
	EMPRESAS CMPC SA	119,530	2,446.200	292,394,286.000	
	EMPRESAS COPEC SA	41,123	10,083.000	414,643,209.000	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	15,170	8,249.000	125,137,330.000	
	ENTEL CHILE SA	16,500	6,018.700	99,308,550.000	
	ENEL AMERICAS SA	3,087,120	112.680	347,856,681.600	
	COLBUN SA	915,483	146.440	134,063,330.520	
	AGUAS ANDINAS SA	325,357	366.070	119,103,436.990	
	EMBOTELLADORA ANDINA SA	27,270	2,491.900	67,954,113.000	
	LATAM AIRLINES GROUP SA	32,604	6,606.500	215,398,326.000	
	SOCIEDAD QUIMICA Y MINERA DE CHILE SA	12,539	31,507.000	395,066,273.000	
	SACI FALABELLA	70,314	5,919.100	416,195,597.400	
	ITAU CORPBANCA	19,467,464	6.498	126,499,581.070	
	CENCOSUD SA	148,398	1,572.600	233,370,694.800	
ENEL CHILE SA	2,713,745	68.210	185,104,546.450		
チリ・ペソ 小計		36,059,803		3,971,761,445.400 (680,759,911)	

トルコ・リラ	AKBANK TAS	186,283	7.250	1,350,551.750	
	ANADOLU EFES BIRACILIK VE MALT SANAYII AS	21,520	22.340	480,756.800	
	ARCELIK	30,429	14.430	439,090.470	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	17,677	27.480	485,763.960	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIKALARI TAS	152,776	10.940	1,671,369.440	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	8,914	61.000	543,754.000	
	KOC HOLDING AS	84,507	13.690	1,156,900.830	
	PETKIM PETROKIMYA HOLDING	88,174	4.450	392,374.300	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI AS	79,624	4.360	347,160.640	
	TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKASI AS	17,797	22.460	399,720.620	
	TURK HAVA YOLLARI	57,827	14.300	826,926.100	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	116,438	12.110	1,410,064.180	
	TURKIYE GARANTI BANKASI AS	238,831	7.870	1,879,599.970	
	TURKIYE IS BANKASI	162,502	5.490	892,135.980	
	TUPRAS TURKIYE PETROL RAFINE	13,779	108.000	1,488,132.000	
	ULKER BISKUVI SANAYI AS	13,121	17.940	235,390.740	
	YAPI VE KREDI BANKASI AS	143,015	2.320	331,794.800	
	HACI OMER SABANCI HOLDING AS	98,354	8.440	830,107.760	
	COCA-COLA ICECEK AS	6,451	33.400	215,463.400	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	21,817	67.250	1,467,193.250	
TURKIYE VAKIFLAR BANKASI TAO	90,731	4.690	425,528.390		
TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	13,735	23.300	320,025.500		
TURKIYE HALK BANKASI AS	61,970	7.360	456,099.200		
トルコ・リラ 小計		1,726,272		18,045,904.080 (424,981,042)	
ハンガリー・フォロント	RICHTER GEDEON NYRT	14,830	4,850.000	71,925,500.000	
	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NYRT	38,598	2,700.000	104,214,600.000	
	OTP BANK NYRT	23,398	10,020.000	234,447,960.000	
ハンガリー・フォロント 小計		76,826		410,588,060.000 (164,851,107)	
パキスタン・ルピー	LUCKY CEMENT LTD	9,900	473.410	4,686,759.000	
	MCB BANK LTD	39,000	189.900	7,406,100.000	
	OIL & GAS DEVELOPMENT CO LTD	74,500	149.800	11,160,100.000	

	UNITED BANK LTD	51,400	155.270	7,980,878.000	
	HABIB BANK LTD	54,400	161.320	8,775,808.000	
パキスタン・ルビー 小計		229,200		40,009,645.000 (36,808,873)	
フィリピン・ペソ	AYALA LAND INC	787,600	36.550	28,786,780.000	
	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	180,120	52.750	9,501,330.000	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAND	82,640	91.000	7,520,240.000	
	AYALA CORP	27,123	924.000	25,061,652.000	
	ALLIANCE GLOBAL GROUP INC	542,900	11.640	6,319,356.000	
	DMCI HOLDINGS INC	351,850	10.900	3,835,165.000	
	GLOBE TELECOM INC	2,785	1,650.000	4,595,250.000	
	INTERNATIONAL CONTAINER TERM SERVICES INC	40,680	79.000	3,213,720.000	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	290,050	50.400	14,618,520.000	
	JOLLIBEE FOODS CORP	44,130	246.000	10,855,980.000	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	82,037	68.800	5,644,145.600	
	BDO UNIBANK INC	214,803	131.000	28,139,193.000	
	MEGAWORLD CORP	962,000	4.410	4,242,420.000	
	PLDT INC	9,520	1,323.000	12,594,960.000	
	ROBINSONS LAND CORP	218,722	19.720	4,313,197.840	
	SECURITY BANK CORP	23,420	202.000	4,730,840.000	
	SM PRIME HOLDINGS INC	1,068,075	36.800	39,305,160.000	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	90,210	121.000	10,915,410.000	
	SM INVESTMENTS CORP	23,058	880.000	20,291,040.000	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CORP	1,810,900	4.640	8,402,576.000	
ABOITIZ POWER CORP	128,200	36.000	4,615,200.000		
MANILA ELECTRIC COMPANY	24,000	354.000	8,496,000.000		
GT CAPITAL HOLDINGS INC	9,387	920.000	8,636,040.000		
フィリピン・ペソ 小計		7,014,210		274,634,175.440 (568,492,744)	
ブラジル・リアル	BRF SA	49,492	23.070	1,141,780.440	
	VALE SA	328,721	49.530	16,281,551.130	
	RAIA DROGASIL SA	24,800	67.950	1,685,160.000	
	TIM PARTICIPACOES SA	94,500	13.130	1,240,785.000	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	19,450	16.560	322,092.000	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	29,400	14.130	415,422.000	
	BANCO DO BRASIL SA	82,400	29.210	2,406,904.000	
	INVESTIMENTOS ITAU SA	464,360	9.740	4,522,866.400	
	LOJAS AMERICANAS SA	79,674	16.950	1,350,474.300	
	GERDAU SA	112,430	15.250	1,714,557.500	

CIA BRASILEIRA DE DISTRIBUICAO GRUPO PAO DE ACUCAR	17,006	75.900	1,290,755.400	
PETROLEO BRASILEIRO SA	292,910	20.190	5,913,852.900	
PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	32,800	19.350	634,680.000	
PETROLEO BRASILEIRO SA	418,612	17.750	7,430,363.000	
KROTON EDUCACIONAL SA	148,268	11.190	1,659,118.920	
CCR SA	114,420	10.220	1,169,372.400	
WEG SA	90,172	17.000	1,532,924.000	
BANCO BRADESCO SA PREF	353,825	27.800	9,836,335.000	
BANCO BRADESCO SA	94,718	24.790	2,348,059.220	
NATURA COSMETICOS SA	19,400	30.330	588,402.000	
CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	61,606	7.970	490,999.820	
SUZANO PAPEL E CELULOSE SA	47,000	43.310	2,035,570.000	
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	332,598	42.190	14,032,309.620	
PORTO SEGURO SA	12,600	39.180	493,668.000	
FIBRIA CELULOSE SA	24,390	71.400	1,741,446.000	
BRASKEM SA	17,030	52.630	896,288.900	
ENGIE BRASIL SA	17,370	34.400	597,528.000	
LOCALIZA RENT A CAR	54,680	23.400	1,279,512.000	
TELEFONICA BRASIL S.A.	47,228	44.880	2,119,592.640	
LOJAS RENNER SA	77,270	30.500	2,356,735.000	
EDP - ENERGIAS DO BRASIL SA	31,864	13.920	443,546.880	
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	38,352	45.590	1,748,467.680	
COSAN SA	16,500	37.040	611,160.000	
EQUATORIAL ENERGIA SA	16,500	59.020	973,830.000	
EMBRAER SA	71,660	22.560	1,616,649.600	
M DIAS BRANCO SA	10,400	38.470	400,088.000	
ODONTOPREV SA	32,200	13.760	443,072.000	
BR MALLS PARTICIPACOES SA	85,565	10.170	870,196.050	
JBS SA	89,900	9.840	884,616.000	
CIA ENERGETICA DE MINAS GERAIS	96,249	7.800	750,742.200	
CIA DE SANEAMENTO BASICO DO ESTADO DE SAO PAULO	34,698	23.730	823,383.540	
MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS IMOBILIARIOS SA	10,380	55.500	576,090.000	
SUL AMERICA SA	17,869	19.500	348,445.500	
HYPERA SA	33,300	28.000	932,400.000	
B3 SA-BRASIL BOLSA BAICAO	217,316	22.370	4,861,358.920	
MAGAZINE LUIZA SA	7,300	118.050	861,765.000	



	BANCO SANTANDER BRASIL SA	45,600	29.670	1,352,952.000	
	CIELO SA	117,607	16.810	1,976,973.670	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	74,000	24.800	1,835,200.000	
	ATACADAO DISTRIBUICAO COMERCIO E INDUSTRIA LTDA	44,500	14.660	652,370.000	
	AMBEV SA	491,095	18.190	8,933,018.050	
	KLABIN SA	77,400	19.430	1,503,882.000	
	RUMO SA	106,000	14.000	1,484,000.000	
	IRB BRASIL RESSEGUROS S/A	10,500	49.390	518,595.000	
ブラジル・リアル	小計	5,335,885		124,931,907.680 (3,631,770,556)	
ポーランド・ズロチ	BANK MILLENNIUM SA	75,133	7.850	589,794.050	
	MBANK	1,595	400.000	638,000.000	
	BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA	2,596	73.100	189,767.600	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	14,190	91.600	1,299,804.000	
	BANK PEKAO SA	16,055	106.400	1,708,252.000	
	ORANGE POLSKA SA	58,600	4.550	266,630.000	
	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	32,064	84.320	2,703,636.480	
	LPP SA	130	9,030.000	1,173,900.000	
	BANK ZACHODNI WBK SA	3,171	344.000	1,090,824.000	
	CD PROJEKT RED SA	7,517	178.000	1,338,026.000	
	POWSZECHNA KASA OSZCZEDNOSCI BANK POLSKI SA	93,521	38.800	3,628,614.800	
	CCC SA	3,309	205.200	679,006.800	
	GRUPA LOTOS SA	9,480	57.000	540,360.000	
	POLSKIE GORNICtwo NAFTOWE I GAZOWNICTWO SA	167,192	5.980	999,808.160	
	CYFROWY POLSAT SA	22,810	23.440	534,666.400	
	GRUPA AZOTY SA	3,853	45.760	176,313.280	
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	94,532	9.670	914,124.440	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZEN SA	58,270	38.900	2,266,703.000	
	JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA SA	6,170	77.940	480,889.800	
	ALIOR BANK SA	9,405	68.600	645,183.000	
	DINO POLSKA SA	6,068	99.500	603,766.000	
	PLAY COMMUNICATIONS SA	15,228	21.980	334,711.440	
ポーランド・ズロチ	小計	700,889		22,802,781.250 (686,363,716)	
マレーシア・リンギット	AMMB HOLDINGS BHD	190,200	3.830	728,466.000	

GENTING PLANTATIONS BHD	19,900	9.100	181,090.000	
CIMB GROUP HOLDINGS BHD	488,300	5.350	2,612,405.000	
DIGI.COM BHD	298,000	4.230	1,260,540.000	
MALAYSIA AIRPORTS HOLDINGS BHD	87,820	8.780	771,059.600	
RHB BANK BHD	108,980	5.330	580,863.400	
HAP SENG CONSOLIDATED BHD	70,000	9.800	686,000.000	
TOP GLOVE CORP BHD	66,900	9.900	662,310.000	
GAMUDA BHD	194,600	3.320	646,072.000	
GENTING BHD	202,000	8.500	1,717,000.000	
YTL CORP BHD	283,710	1.180	334,777.800	
HONG LEONG FINANCIAL GROUP BHD	20,256	17.840	361,367.040	
HONG LEONG BANK BHD	63,808	18.280	1,166,410.240	
IJM CORP BHD	349,760	1.760	615,577.600	
IOI CORP BHD	187,213	4.550	851,819.150	
KUALA LUMPUR KEPONG BHD	43,200	24.180	1,044,576.000	
FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	12,800	38.000	486,400.000	
MALAYAN BANKING BHD	373,575	9.140	3,414,475.500	
ALLIANCE BANK MALAYSIA BHD	88,400	4.030	356,252.000	
MISC BHD	140,080	6.060	848,884.800	
NESTLE MALAYSIA BHD	5,800	148.100	858,980.000	
PPB GROUP BHD	47,800	19.720	942,616.000	
PETRONAS DAGANGAN BHD	19,600	24.940	488,824.000	
PETRONAS GAS BHD	73,200	17.660	1,292,712.000	
GENTING MALAYSIA BHD	282,100	4.920	1,387,932.000	
BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD	14,700	34.360	505,092.000	
TELEKOM MALAYSIA BHD	132,500	3.450	457,125.000	
SP SETIA BHD	178,500	3.070	547,995.000	
TENAGA NASIONAL BHD	327,550	14.420	4,723,271.000	
UMW HOLDINGS BHD	39,000	6.070	236,730.000	
DIALOG GROUP BHD	418,844	3.110	1,302,604.840	
PUBLIC BANK BHD(LLOCAL)	305,230	22.540	6,879,884.200	
AIRASIA GROUP BHD	147,900	3.050	451,095.000	
MY EG SERVICES BHD	335,800	0.835	280,393.000	
SIME DARBY BERHAD	232,700	2.400	558,480.000	
HARTALEGA HOLDINGS BHD	145,400	5.770	838,958.000	
AXIATA GROUP BERHAD	256,400	4.170	1,069,188.000	
MAXIS BHD	254,400	5.400	1,373,760.000	
PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	239,200	8.540	2,042,768.000	
ASTRO MALAYSIA HOLDINGS BHD	140,500	1.730	243,065.000	
IHH HEALTHCARE BHD	279,400	5.900	1,648,460.000	
FGV HOLDINGS BHD	126,400	1.520	192,128.000	

	WESTPORTS HOLDINGS BHD	130,000	3.410	443,300.000	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDINGS BHD	153,100	4.100	627,710.000	
	SIME DARBY PROPERTY BHD	232,700	1.190	276,913.000	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	262,800	5.350	1,405,980.000	
	IOI PROPERTIES GROUP SDN BHD	174,548	1.650	288,004.200	
マレーシア・リンギット 小計		8,245,574		50,690,314.370 (1,393,983,646)	
メキシコ・ペソ	ALFA SAB DE CV	323,200	23.500	7,595,200.000	
	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	53,800	117.410	6,316,658.000	
	EL PUERTO DE LIVERPOOL SAB DE CV	19,100	133.940	2,558,254.000	
	GRUPO TELEVISIA SAB	255,700	76.890	19,660,773.000	
	GRUPO BIMBO SAB DE CV	148,700	40.300	5,992,610.000	
	GRUMA SAB DE CV	24,570	254.040	6,241,762.800	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INFRAESTRUCTURA	26,125	187.290	4,892,951.250	
	GRUPO CARSO SAB DE CV	54,300	70.080	3,805,344.000	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE SAB DE CV	257,800	118.770	30,618,906.000	
	MEXICHEM SAB DE CV	108,225	59.550	6,444,798.750	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	13,960	342.450	4,780,602.000	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO SAB DE CV	156,700	34.920	5,471,964.000	
	ALSEA SAB DE CV	45,100	68.250	3,078,075.000	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL SURESTE SAB DE CV	22,325	311.000	6,943,075.000	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV	379,752	56.570	21,482,570.640	
	AMERICA MOVIL SAB DE CV	3,464,878	16.980	58,833,628.440	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA SA	244,700	29.400	7,194,180.000	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	43,400	125.640	5,452,776.000	
	WAL-MART DE MEXICO SAB DE CV	509,200	55.140	28,077,288.000	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL PACIFICO SAB DE CV	39,700	189.200	7,511,240.000	
INFRAESTRUCTURA ENERGETICA NOVA SAB DE CV	53,200	91.300	4,857,160.000		
BANCO SANTANDER MEXICO SA-B	195,390	29.060	5,678,033.400		
メキシコ・ペソ 小計		6,439,825		253,487,850.280 (1,477,834,167)	
ユーロ	PIRAEUS BANK S.A	25,000	2.770	69,250.000	
	ALPHA BANK A.E.	154,071	1.896	292,118.610	

	NATIONAL BANK OF GREECE	345,432	0.259	89,466.880	
	TITAN CEMENT CO. S.A.	5,217	21.100	110,078.700	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	25,490	10.660	271,723.400	
	FF GROUP	3,130	4.800	15,024.000	
	EUROBANK ERGASIAS	194,100	0.855	165,955.500	
	OPAP SA	27,511	9.850	270,983.350	
	JUMBO SA	10,420	13.560	141,295.200	
ユーロ 小計		790,371		1,425,895.640 (185,437,729)	
韓国・ウォン	CHEIL WORLDWIDE INC	7,097	20,350.000	144,423,950.000	
	HANMI SCIENCE CO LTD	1,164	70,000.000	81,480,000.000	
	HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	3,401	86,000.000	292,486,000.000	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANC	3,260	269,000.000	876,940,000.000	
	DB INSURANCE CO LTD	5,060	62,100.000	314,226,000.000	
	COWAY CO LTD	5,320	90,200.000	479,864,000.000	
	KT&G CORP	12,441	108,000.000	1,343,628,000.000	
	S-1 CORPORATION	2,126	99,200.000	210,899,200.000	
	KOREA GAS CORP	2,997	59,100.000	177,122,700.000	
	CJ CORP	1,547	143,500.000	221,994,500.000	
	KAKAO CORP	4,877	117,000.000	570,609,000.000	
	SK TELECOM CO LTD	1,935	233,000.000	450,855,000.000	
	DAELIM INDUSTRIAL CO	2,987	75,000.000	224,025,000.000	
	MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD	40,612	8,310.000	337,485,720.000	
	NCSOFT CORPORATION	1,703	386,500.000	658,209,500.000	
	DOOSAN HEAVY INDUSTRIES AND CONSTRUCTION CO LTD	7,766	14,800.000	114,936,800.000	
	DAEWOO ENGINEERING & CONSTRUCT	13,540	5,510.000	74,605,400.000	
	POSCO DAEWOO CORP	3,600	21,150.000	76,140,000.000	
	LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD	976	1,287,000.000	1,256,112,000.000	
	LG CHEM LTD	4,673	325,500.000	1,521,061,500.000	
	LG CHEM LTD	1,006	194,500.000	195,667,000.000	
	LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD	259	690,000.000	178,710,000.000	
	SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD	44,389	44,550.000	1,977,529,950.000	
	S-OIL CORP	4,763	107,500.000	512,022,500.000	
	HANWHA CHEMICAL CORPORATION	7,771	21,100.000	163,968,100.000	
	SAMSUNG SECURITIES CO LTD	5,914	33,650.000	199,006,100.000	
	LOTTE CHEMICAL CORPORATION	1,831	341,500.000	625,286,500.000	
	HOTEL SHILLA CO LTD	3,006	101,000.000	303,606,000.000	

HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	3,906	101,500.000	396,459,000.000	
HYUNDAI MOBIS	7,069	205,000.000	1,449,145,000.000	
SK HYNIX INC	60,297	87,300.000	5,263,928,100.000	
HYUNDAI ENGINEERING & CONSTRUCTION CO LTD	7,926	52,100.000	412,944,600.000	
HYUNDAI MOTOR CO	2,642	79,100.000	208,982,200.000	
HYUNDAI MOTOR CO	16,162	123,500.000	1,996,007,000.000	
HYUNDAI STEEL CO	7,647	48,400.000	370,114,800.000	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	27,169	15,900.000	431,987,100.000	
KCC CORP	670	320,500.000	214,735,000.000	
KIA MOTORS CORP	27,458	31,100.000	853,943,800.000	
KOREA ZINC CO LTD	773	387,500.000	299,537,500.000	
KOREA ELECTRIC POWER CORP	27,021	31,000.000	837,651,000.000	
HANWHA CORP	3,785	31,600.000	119,606,000.000	
KOREAN AIR CO LTD	5,301	28,550.000	151,343,550.000	
OCI COMPANY LTD	1,829	95,800.000	175,218,200.000	
CJ LOGISTICS	860	173,000.000	148,780,000.000	
KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	1,930	114,000.000	220,020,000.000	
KT CORP	2,048	27,750.000	56,832,000.000	
HLB INC	2,994	90,700.000	271,555,800.000	
LG ELECTRONICS INC	11,207	78,200.000	876,387,400.000	
LOTTE CORP	3,366	52,800.000	177,724,800.000	
HANSSEM CO LTD	1,100	105,000.000	115,500,000.000	
LG CORP	10,160	72,300.000	734,568,000.000	
NH INVESTMENT & SECURITIES CO LTD	13,362	14,050.000	187,736,100.000	
GS ENGINEERING & CONSTRUCTION	5,490	45,850.000	251,716,500.000	
NAVER CORP	2,918	760,000.000	2,217,680,000.000	
HYUNDAI DEPARTMENT STORE CO LTD	1,249	104,000.000	129,896,000.000	
DONGSUH CO INC	3,149	25,450.000	80,142,050.000	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO LTD	4,061	79,900.000	324,473,900.000	
OTTOGI CORP	112	832,000.000	93,184,000.000	
AMOREPACIFIC GROUP	2,818	108,500.000	305,753,000.000	
KANGWON LAND INC	13,108	25,950.000	340,152,600.000	
POSCO	8,177	309,000.000	2,526,693,000.000	
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	14,738	15,500.000	228,439,000.000	
SAMSUNG SDI CO LTD	5,764	228,500.000	1,317,074,000.000	
SAMSUNG ELECTRO- MECHANICS CO LTD	5,938	154,500.000	917,421,000.000	
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	498,001	46,300.000	23,057,446,300.000	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES CO LTD	42,202	6,810.000	287,395,620.000	

SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	88,502	37,350.000	3,305,549,700.000	
SHINSEGAE CO LTD	827	341,000.000	282,007,000.000	
HYOSUNG CORP	2,165	134,000.000	290,110,000.000	
YUHAN CORP	809	221,000.000	178,789,000.000	
HANON SYSTEMS	19,093	10,200.000	194,748,600.000	
HYUNDAI MARINE & FIRE INSURANCE CO LTD	6,480	35,550.000	230,364,000.000	
GS HOLDINGS CORP	5,269	51,400.000	270,826,600.000	
LG DISPLAY CO LTD	22,366	19,600.000	438,373,600.000	
CELLTRION INC	8,478	281,000.000	2,382,318,000.000	
VIROMED CO LTD	1,302	231,000.000	300,762,000.000	
HANA FINANCIAL GROUP	30,923	42,950.000	1,328,142,850.000	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	2,057	113,500.000	233,469,500.000	
CELLTRION PHARM INC	1,457	85,100.000	123,990,700.000	
LOTTE SHOPPING CO	1,227	214,500.000	263,191,500.000	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LTD	6,769	97,900.000	662,685,100.000	
AMOREPACIFIC CORP	3,333	294,000.000	979,902,000.000	
AMOREPACIFIC CORP-PREF	1,093	142,000.000	155,206,000.000	
SAMSUNG CARD CO	2,877	36,800.000	105,873,600.000	
SK INNOVATION CO LTD	6,757	192,000.000	1,297,344,000.000	
CJ CHEILJEDANG CORP	870	336,500.000	292,755,000.000	
STX PAN OCEAN CO LTD	18,395	4,850.000	89,215,750.000	
KEPCO PLANT SERVICE & ENGINEERING CO LTD	2,976	33,900.000	100,886,400.000	
LG INNOTEK CO LTD	1,440	157,500.000	226,800,000.000	
SK HOLDINGS CO LTD	3,352	262,500.000	879,900,000.000	
KB FINANCIAL GROUP INC	41,419	54,500.000	2,257,335,500.000	
MEDY-TOX INC	464	830,300.000	385,259,200.000	
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES LTD	6,872	43,000.000	295,496,000.000	
BNK FINANCIAL GROUP INC	24,007	9,440.000	226,626,080.000	
HANMI PHARM CO LTD	690	448,500.000	309,465,000.000	
HANWHA LIFE INSURANCE CO LTD	26,430	5,210.000	137,700,300.000	
CJ E&M CORP	1,950	98,900.000	192,855,000.000	
E-MART CO LTD	2,012	245,000.000	492,940,000.000	
DGB FINANCIAL GROUP INC	18,575	10,150.000	188,536,250.000	
GS RETAIL CO LTD	2,482	40,100.000	99,528,200.000	
HANKOOK TIRE CO LTD NEW	8,081	41,600.000	336,169,600.000	
HDC HYUNDAI DEVELOPMENT CO-ENGINEERING & CONSTRUCTION	3,444	56,700.000	195,274,800.000	
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOLDINGS CO LTD	942	340,000.000	320,280,000.000	
BGF RETAIL CO LTD	854	179,000.000	152,866,000.000	
ORION CORP REPUBLIC OF KOREA	2,381	146,500.000	348,816,500.000	

	ING LIFE INSURANCE KOREA LTD	3,735	41,550.000	155,189,250.000	
	NETMARBLE CORP	2,766	163,000.000	450,858,000.000	
	SAMSUNG SDS CO LTD	3,664	204,000.000	747,456,000.000	
	WOORI BANK	50,159	16,600.000	832,639,400.000	
	SAMSUNG C&T CORP	8,001	118,000.000	944,118,000.000	
	SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	1,767	417,000.000	736,839,000.000	
	PEARL ABYSS CORP	534	221,500.000	118,281,000.000	
	DOOSAN BOBCAT INC	4,679	30,850.000	144,347,150.000	
	SILLAJEN INC	4,950	73,200.000	362,340,000.000	
	CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	3,490	100,300.000	350,047,000.000	
韓国・ウォン 小計		1,513,593		87,025,548,470.000 (8,624,231,853)	
香港・ドル	JIANGXI COPPER CO LTD	138,000	9.350	1,290,300.000	
	JIANGSU EXPRESS	124,000	9.210	1,142,040.000	
	CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD	216,000	5.950	1,285,200.000	
	ANGANG STEEL CO LTD-H	104,000	7.070	735,280.000	
	CHINA MOBILE LIMITED	631,500	70.850	44,741,775.000	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	123,500	44.750	5,526,625.000	
	DATANG INTERNATIONAL POWER GEN	288,000	2.200	633,600.000	
	BEIJING ENTERPRISES	52,500	38.500	2,021,250.000	
	HUANENG POWER INTERNATIONAL IN	424,000	5.480	2,323,520.000	
	ALIBABA HEALTH INFORMATION TECHNOLOGY	372,000	7.250	2,697,000.000	
	YANZHOU COAL MINING CO LTD	188,000	10.200	1,917,600.000	
	HENGAN INTERNATIONAL GROUP	77,000	74.050	5,701,850.000	
	HUADIAN POWER INTL CORP-H	144,000	3.260	469,440.000	
	CHONGQING CHANGAN AUTOMOBILE	63,600	7.100	451,560.000	
	CHINA EASTERN AIRLINES CORP LT	124,000	5.090	631,160.000	
	CNOOC LTD	1,841,000	13.040	24,006,640.000	
	BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	322,000	13.880	4,469,360.000	
	CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LTD	496,000	22.200	11,011,200.000	
	CHINA OVERSEAS LAND & INVESTME	401,120	25.550	10,248,616.000	
	CHINA RESOURCES LAND LTD	290,888	26.350	7,664,898.800	
CITIC LTD	608,000	10.660	6,481,280.000		
CHINA TRAVEL INTERNATIONAL INV	198,000	3.080	609,840.000		

BEIJING CAPITAL INTERNATIONAL	188,000	8.050	1,513,400.000	
LENOVO GROUP LTD	798,000	3.990	3,184,020.000	
PETRO CHINA CO LTD	2,162,000	5.860	12,669,320.000	
SKYWORTH DIGITAL HOLDINGS LTD	162,000	3.300	534,600.000	
CHINA UNICOM HONG KONG LTD	644,742	9.600	6,189,523.200	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS CO LTD	174,590	25.600	4,469,504.000	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL COR	2,603,200	7.090	18,456,688.000	
TONG REN TANG TECHNOLOGIES CO	52,000	11.800	613,600.000	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	102,000	23.000	2,346,000.000	
KINGDEE INTERNATIONAL SOFTWARE GROUP CO LTD	190,000	8.180	1,554,200.000	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	80,000	80.150	6,412,000.000	
KUNLUN ENERGY COMPANY LTD	366,000	6.940	2,540,040.000	
TOWNGAS CHINA CO LTD	91,000	7.600	691,600.000	
COSCO SHIPPING PORTS LTD	162,000	6.710	1,087,020.000	
YUEXIU PROPERTY CO LTD	654,000	1.470	961,380.000	
CHINA MERCHANTS PORT HOLDINGS CO LTD	132,000	16.040	2,117,280.000	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	374,000	3.270	1,222,980.000	
SHENZHEN INTERNATIONAL HOLDING	117,500	15.100	1,774,250.000	
CHINA EVERBRIGHT LTD	112,000	14.240	1,594,880.000	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	183,600	31.850	5,847,660.000	
KINGBOARD CHEMICALS HOLDINGS	66,000	27.500	1,815,000.000	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LTD	517,000	20.250	10,469,250.000	
SHENZHEN INVESTMENT LTD	520,000	2.830	1,471,600.000	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LTD	86,000	33.600	2,889,600.000	
BYD CO LTD	68,000	47.400	3,223,200.000	
CHINA TELECOM CORP LTD	1,464,000	3.650	5,343,600.000	
CHINA OILFIELD SERVICES LTD	202,000	7.230	1,460,460.000	
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	1,680,000	0.940	1,579,200.000	
SINOTRANS LTD	190,000	3.850	731,500.000	
CHINA EVERBRIGHT INTERNATIONAL	277,000	9.830	2,722,910.000	
MMG LTD	220,000	5.280	1,161,600.000	



LEE & MAN PAPER MANUFACTURING LTD	170,000	7.530	1,280,100.000	
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	721,788	8.660	6,250,684.080	
AVICHINA INDUSTRY & TECHNOLOGY	225,000	4.630	1,041,750.000	
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS	195,200	14.540	2,838,208.000	
GREAT WALL MOTOR COMPANY LTD	351,500	5.310	1,866,465.000	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	774,000	19.880	15,387,120.000	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD	691,000	2.940	2,031,540.000	
SHANDONG WEIGAO GROUP MEDICAL-H	176,000	5.310	934,560.000	
SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	317,200	9.300	2,949,960.000	
WEICHAJ POWER CO LTD	215,440	9.410	2,027,290.400	
CHINA SHIPPING DEVELOPMENT CO	100,000	3.600	360,000.000	
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEMICAL	353,000	4.690	1,655,570.000	
SHANGHAI INDUSTRIAL	46,000	18.120	833,520.000	
TINGYI HOLDING CORP	188,000	17.620	3,312,560.000	
TSINGTAO BREWERY CO LTD	40,000	41.800	1,672,000.000	
GUANGDONG INVESTMENTS LTD	320,000	12.760	4,083,200.000	
CHINA TRADITIONAL CHINESE MEDICINE HOLDINGS CO LTD	216,000	6.770	1,462,320.000	
CHINA RESOURCES BEER HOLDINGS	159,333	35.550	5,664,288.150	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO LTD	146,000	6.380	931,480.000	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	711,500	11.940	8,495,310.000	
CHINA SHIPPING CONTAINER LINES	627,000	1.220	764,940.000	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	293,000	25.700	7,530,100.000	
TENCENT HOLDINGS LTD	589,800	386.800	228,134,640.000	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	534,500	71.100	38,002,950.000	
BEIJING ENTERPRISES WATER GROUP LTD	528,000	4.320	2,280,960.000	
GOME RETAIL HOLDINGS LTD	970,240	0.830	805,299.200	
CHINA POWER INTERNATIONAL	643,000	1.760	1,131,680.000	
AIR CHINA / HONG KONG	198,000	7.480	1,481,040.000	
ZTE CORP	71,288	11.800	841,198.400	

SHANGHAI ELECTRIC GROUP CO LTD	250,000	2.640	660,000.000	
CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD	355,500	18.060	6,420,330.000	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO LTD	248,500	3.350	832,475.000	
BANK OF COMMUNICATIONS	808,205	5.610	4,534,030.050	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT HOLDINGS LTD	206,250	8.070	1,664,437.500	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	77,000	105.900	8,154,300.000	
CHINA CONSTRUCTION BANK	9,950,530	6.990	69,554,204.700	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP HOLDINGS LTD	80,000	95.400	7,632,000.000	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	294,000	7.870	2,313,780.000	
AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	160,000	11.600	1,856,000.000	
SSY GROUP LTD	144,000	7.900	1,137,600.000	
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS LTD	168,000	9.620	1,616,160.000	
CHINA NATIONAL BLDG MATERIAL	374,000	7.670	2,868,580.000	
BANK OF CHINA LTD	8,221,200	3.710	30,500,652.000	
SHUI ON LAND LTD	335,500	1.840	617,320.000	
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	120,000	21.500	2,580,000.000	
GREENTOWN CHINA HOLDINGS LTD	82,000	10.200	836,400.000	
GUANGZHOU R&F PROPERTIES CO LTD	100,400	15.240	1,530,096.000	
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	400,970	28.250	11,327,402.500	
IND & COMM BK OF CHINA - H	7,208,235	5.650	40,726,527.750	
ZHAOJIN MINING INDUSTRY CO LTD	108,000	6.120	660,960.000	
KINGBOARD LAMINATES HOLDING	104,000	9.500	988,000.000	
CHINA COMMUNICATIONS SERVICES	275,600	4.550	1,253,980.000	
CHINA COMMUNICATIONS CONSTRUCTION CO LTD	486,000	7.330	3,562,380.000	
CHINA COAL ENERGY CO	178,000	3.040	541,120.000	
HAITIAN INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	64,000	17.200	1,100,800.000	
ZHUZHOU CRRG TIMES ELECTRIC CO LTD	60,700	39.200	2,379,440.000	
HAIER ELECTRONICS GROUP CO LTD	122,000	24.350	2,970,700.000	

CHINA AGRI-INDUSTRIES HOLDINGS LTD	191,000	2.920	557,720.000	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD	800,142	13.260	10,609,882.920	
CHINA MOLYBDENUM CO LTD	369,000	3.660	1,350,540.000	
CHINA CITIC BANK-H	938,800	4.870	4,571,956.000	
KWG PROPERTY HOLDING LTD	121,000	8.860	1,072,060.000	
SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	75,100	142.000	10,664,200.000	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	115,000	40.200	4,623,000.000	
FOSUN INTERNATIONAL	281,028	14.540	4,086,147.120	
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP LTD	568,000	3.870	2,198,160.000	
SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD	308,500	4.470	1,378,995.000	
SOHO CHINA LTD	178,000	3.590	639,020.000	
KINGSOFT CORP LTD	81,000	21.150	1,713,150.000	
GCL POLY ENERGY HOLDINGS LTD	1,362,000	0.690	939,780.000	
SINOTRUK HONG KONG LTD	64,500	11.340	731,430.000	
CHINA RAILWAY GROUP LTD	365,000	5.830	2,127,950.000	
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS LTD	122,000	9.070	1,106,540.000	
BYD ELECTRONIC INTERNATIONAL CO LTD	79,000	10.140	801,060.000	
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION CORP	155,000	7.770	1,204,350.000	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	481,000	7.000	3,367,000.000	
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	268,800	29.900	8,037,120.000	
CHINA EVERGRANDE GROUP	278,000	21.250	5,907,500.000	
CRRC CORP LTD - H	404,450	6.040	2,442,878.000	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDINGS LTD	153,000	14.900	2,279,700.000	
CHONG SING HOLDINGS FINTECH GROUP LTD	1,656,000	0.860	1,424,160.000	
SUN ART RETAIL GROUP LTD	240,000	10.340	2,481,600.000	
BBMG CORP	222,000	2.780	617,160.000	
CHINA ZHONGWANG HOLDINGS LTD	145,200	4.020	583,704.000	
SINOPHARM GROUP CO	128,400	31.250	4,012,500.000	
CHINA RESOURCES CEMENT	190,000	8.090	1,537,100.000	
METALLURGICAL CORP OF CHINA LTD	276,000	2.190	604,440.000	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD	268,527	7.290	1,957,561.830	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL BANK	285,000	4.520	1,288,200.000	

CHINA LONGYUAN POWER GROUP CORP	317,000	6.530	2,070,010.000	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD	90,000	21.250	1,912,500.000	
HUANENG RENEWABLES CORP LTD	472,000	2.690	1,269,680.000	
SIHUAN PHARMACEUTICAL HOLDINGS GROUP LTD	325,000	1.640	533,000.000	
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	256,000	27.200	6,963,200.000	
YUZHOU PROPERTIES CO LTD	166,000	4.520	750,320.000	
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	161,500	21.300	3,439,950.000	
NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	93,800	32.650	3,062,570.000	
CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	556,656	5.690	3,167,372.640	
KAISA GROUP HOLDINGS LTD	203,000	3.080	625,240.000	
XINJIANG GOLDWIND SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	60,000	9.650	579,000.000	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD	257,000	3.370	866,090.000	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA	3,042,000	3.680	11,194,560.000	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS LTD	55,000	21.350	1,174,250.000	
FAR EAST HORIZON LTD	257,000	7.320	1,881,240.000	
CITIC SECURITIES CO LTD	227,000	15.360	3,486,720.000	
FUTURE LAND DEVELOPMENT HOLDINGS LTD	172,000	6.690	1,150,680.000	
HAITONG SECURITIES CO LTD	380,000	7.680	2,918,400.000	
CHINA INTERNATIONAL MARINE CONTAINERS GROUP CO LTD	39,400	9.200	362,480.000	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROUP OF CHINA LTD	703,000	3.470	2,439,410.000	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	38,500	40.250	1,549,625.000	
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	382,000	4.850	1,852,700.000	
SINOPEC ENGINEERING GROUP CO LTD	121,500	8.010	973,215.000	
CHINA GALAXY SECURITIES CO LTD	345,500	3.960	1,368,180.000	
HANERGY THIN FILM POWER GROUP	986,000	0.000	0.000	
NEXTEER AUTOMOTIVE GROUP LTD	100,000	11.060	1,106,000.000	

CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS CO LTD	323,000	0.000	0.000	
JIAYUAN INTERNATIONAL GROUP LTD	94,000	14.180	1,332,920.000	
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO LTD	42,400	15.700	665,680.000	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA CO LTD	267,000	5.080	1,356,360.000	
GENSCRIPT BIOTECH CORP	74,000	20.150	1,491,100.000	
CHINA FIRST CAPITAL GROUP LTD	308,000	4.430	1,364,440.000	
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	276,000	2.250	621,000.000	
CHINA CINDA ASSET MANAGEMENT CO LTD	1,025,000	2.180	2,234,500.000	
LOGAN PROPERTY HOLDINGS CO LTD	134,000	10.260	1,374,840.000	
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS LTD	178,500	28.350	5,060,475.000	
CHINA VANKE CO LTD-H	125,461	26.550	3,330,989.550	
LUYE PHARMA GROUP LTD	108,000	8.260	892,080.000	
CAR INC	68,000	7.330	498,440.000	
CGN POWER CO LTD	1,232,000	2.050	2,525,600.000	
FULLSHARE HOLDINGS LTD	702,500	3.590	2,521,975.000	
BAIC MOTOR CORP LTD	163,500	7.130	1,165,755.000	
GF SECURITIES CO LTD	148,400	11.260	1,670,984.000	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD	51,200	28.000	1,433,600.000	
HUATAI SECURITIES CO LTD	154,200	12.140	1,871,988.000	
3SBIO INC	113,000	17.600	1,988,800.000	
LEGEND HOLDINGS CORP	31,500	23.450	738,675.000	
CHINA RESOURCES PHARMACEUTICAL GROUP LTD	152,000	10.840	1,647,680.000	
CHINA HUARONG ASSET MANAGEMENT CO LTD	960,000	2.050	1,968,000.000	
CHINA LITERATURE LTD	17,200	75.250	1,294,300.000	
DALI FOODS GROUP CO LTD	193,500	6.160	1,191,960.000	
CHINA RAILWAY SIGNAL & COMMUNICATION CORP LTD	141,000	5.420	764,220.000	
CHINA REINSURANCE GROUP CORP	525,000	1.590	834,750.000	
MEITU INC	152,500	6.310	962,275.000	
BOC AVIATION LTD	19,800	48.250	955,350.000	
ZHONGAN ONLINE P&C INSURANCE CO LTD	15,500	48.200	747,100.000	
CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CORP LTD	101,600	13.540	1,375,664.000	
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	52,500	76.050	3,992,625.000	

	HENGTEN NETWORKS GROUP LTD	2,096,000	0.250	524,000.000	
香港・ドル 小計		94,443,683		995,589,391.790 (14,067,678,106)	
台湾・ドル	ACER INC	314,532	24.500	7,706,034.000	
	ASUSTEK COMPUTER INC	74,554	262.500	19,570,425.000	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	46,616	116.500	5,430,764.000	
	ASIA CEMENT CORP	195,928	36.100	7,073,000.800	
	WALSIN TECHNOLOGY CORP	30,000	414.500	12,435,000.000	
	TAIWAN BUSINESS BANK	437,171	9.490	4,148,752.790	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMICONDUCTOR CORP	99,000	68.300	6,761,700.000	
	MICRO-STAR INTERNATIONAL CO LTD	73,000	97.600	7,124,800.000	
	CHICONY ELECTRONICS CO LTD	49,543	66.600	3,299,563.800	
	QUANTA COMPUTER INC	283,858	52.600	14,930,930.800	
	HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	90,070	44.850	4,039,639.500	
	EVA AIRWAYS CORP	268,161	14.750	3,955,374.750	
	CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	67,760	343.000	23,241,680.000	
	CHANG HWA COMMERCIAL BANK	539,755	17.550	9,472,700.250	
	CHINA AIRLINES	232,156	9.410	2,184,587.960	
	CHENG SHIN RUBBER INDUSTRY CO	201,169	45.150	9,082,780.350	
	CHINA STEEL CORP	1,306,058	23.650	30,888,271.700	
	CHINA LIFE INSURANCE CO LTD/TAIWAN	264,146	32.050	8,465,879.300	
	ADVANTECH CO LTD	36,889	193.000	7,119,577.000	
	COMPAL ELECTRONICS INC	450,304	19.250	8,668,352.000	
	DELTA ELECTRONICS INC	215,663	102.500	22,105,457.500	
	NANYA TECHNOLOGY CORP	110,000	83.900	9,229,000.000	
	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	371,327	112.500	41,774,287.500	
	AU OPTRONICS CORP	880,194	13.400	11,794,599.600	
	TAIWAN MOBILE CO LTD	171,800	106.000	18,210,800.000	
	EVERGREEN MARINE CORP	178,658	13.000	2,322,554.000	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	341,824	32.050	10,955,459.200	
	FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	29,825	150.500	4,488,662.500	
	ECLAT TEXTILE CO LTD	18,322	347.000	6,357,734.000	
	NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	61,285	140.000	8,579,900.000	
FORMOSA PLASTICS CORP	461,633	112.000	51,702,896.000		
FORMOSA TAFFETA CO LTD	126,000	33.450	4,214,700.000		
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE CO	364,594	114.500	41,746,013.000		

GIANT MANUFACTURING	30,151	129.500	3,904,554.500	
MEDIATEK INC	154,507	280.000	43,261,960.000	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD	683,936	50.500	34,538,768.000	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	709,313	17.700	12,554,840.100	
HOTAI MOTOR CO LTD	29,000	263.500	7,641,500.000	
FAR EASTONE TELECOMMUNICATIONS CO LTD	177,000	79.300	14,036,100.000	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,111,141	13.250	14,722,618.250	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	842,920	51.800	43,663,256.000	
CHINA DEPT FINANCIAL HOLDING	1,477,403	11.400	16,842,394.200	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO LTD	998,028	21.150	21,108,292.200	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	1,698,532	80.500	136,731,826.000	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,126,495	26.700	30,077,416.500	
LARGAN PRECISION CO LTD	10,220	4,840.000	49,464,800.000	
TAISHIN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	1,052,977	14.450	15,215,517.650	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING CO	856,724	11.600	9,937,998.400	
INVENTEC CO LTD	268,005	24.400	6,539,322.000	
HTC CORPORATION	79,832	51.200	4,087,398.400	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	218,845	36.800	8,053,496.000	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	1,095,533	11.150	12,215,192.950	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,823,048	20.400	37,190,179.200	
MACRONIX INTERNATIONAL	193,000	43.550	8,405,150.000	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO LTD	989,327	20.500	20,281,203.500	
POWERTECH TECHNOLOGY INC	85,560	85.400	7,306,824.000	
NAN YA PLASTICS CORP	512,828	82.700	42,410,875.600	
WISTRON CORP	259,301	22.000	5,704,622.000	
POU CHEN CORP	236,990	33.900	8,033,961.000	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CORP	510,297	79.700	40,670,670.900	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	59,392	350.000	20,787,200.000	
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	116,480	118.000	13,744,640.000	
PHISON ELECTRONICS CORP	16,658	230.500	3,839,669.000	
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	90,656	34.700	3,145,763.200	

	RUENTEX INDUSTRIES LTD	68,715	61.100	4,198,486.500	
	FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	94,588	73.600	6,961,676.800	
	STANDARD FOODS CORP	30,639	61.600	1,887,362.400	
	SYNNEX TECHNOLOGY INTERNATIONAL CORP	144,899	43.950	6,368,311.050	
	TAIWAN CEMENT CORP	389,874	43.250	16,862,050.500	
	TECO ELECTRIC AND MACHINERY CO LTD	153,000	21.750	3,327,750.000	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR	2,539,083	222.000	563,676,426.000	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	1,260,525	17.000	21,428,925.000	
	WINBOND ELECTRONICS CORP	324,000	19.200	6,220,800.000	
	YAGEO CORP	25,160	1,045.000	26,292,200.000	
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	227,000	24.450	5,550,150.000	
	INNOLUX CORPORATION	964,345	11.750	11,331,053.750	
	WPG HOLDINGS CO LTD	198,526	43.200	8,576,323.200	
	HIWIN TECHNOLOGIES CORP	23,560	324.000	7,633,440.000	
	TAI MED BIOLOGICS INC	18,000	281.000	5,058,000.000	
	PEGATRON CORP	209,554	63.800	13,369,545.200	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	13,000	374.000	4,862,000.000	
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	38,000	207.500	7,885,000.000	
	CHAILEASE HOLDING CO LTD	108,076	99.900	10,796,792.400	
	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING LTD	48,385	67.400	3,261,149.000	
	TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL HOLDING	852,828	17.700	15,095,055.600	
	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	362,903	69.600	25,258,048.800	
	GLOBALWAFERS CO LTD	21,000	521.000	10,941,000.000	
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	15,000	254.500	3,817,500.000	
	GENERAL INTERFACE SOLUTION HOLDING LTD	18,000	176.000	3,168,000.000	
	台湾・ドル 小計	34,054,554		1,919,026,933.050 (7,004,448,305)	
南アフリカ・ランド	BIDVEST GROUP LTD	35,898	192.430	6,907,852.140	
	CLICKS GROUP LTD	28,022	194.910	5,461,768.020	
	TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	44,326	76.170	3,376,311.420	
	DISCOVERY LTD	37,569	154.590	5,807,791.710	
	REDEFINE PROPERTIES LTD	586,888	10.790	6,332,521.520	
	GOLD FIELDS LTD	97,228	48.690	4,734,031.320	
	REMGRO LTD	54,435	210.890	11,479,797.150	
	THE FOSCHINI GROUP LTD	23,822	172.650	4,112,868.300	
	MMI HOLDINGS LTD	111,471	17.970	2,003,133.870	



GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	317,680	27.000	8,577,360.000	
EXXARO RESOURCES LTD	25,340	132.460	3,356,536.400	
CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	4,593	906.070	4,161,579.510	
LIBERTY HOLDINGS LTD	15,137	120.800	1,828,549.600	
MTN GROUP LTD	174,789	109.320	19,107,933.480	
ANGLOGOLD ASHANTI LTD	39,800	117.910	4,692,818.000	
TELKOM SA SOC LTD	31,588	50.490	1,594,878.120	
FIRSTRAND LTD	345,104	65.630	22,649,175.520	
PSG GROUP LTD	15,546	219.600	3,413,901.600	
NASPERS LTD	45,339	3,496.000	158,505,144.000	
CORONATION FUND MANAGERS LTD	26,700	61.130	1,632,171.000	
NEDBANK GROUP LTD	21,384	264.670	5,659,703.280	
NETCARE LTD	106,707	28.450	3,035,814.150	
PICK'N PAY STORES LTD	43,375	77.500	3,361,562.500	
RMB HOLDINGS LTD	73,140	77.960	5,701,994.400	
ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	6,200	370.260	2,295,612.000	
SAPPI LTD	56,231	91.840	5,164,255.040	
SASOL LTD	57,428	519.650	29,842,460.200	
SHOPRITE HOLDINGS LTD	42,892	227.070	9,739,486.440	
MR PRICE GROUP LTD	25,911	222.190	5,757,165.090	
STANDARD BANK GROUP LTD	132,740	194.910	25,872,353.400	
SPAR GROUP LTD/THE	20,754	192.800	4,001,371.200	
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	104,346	54.650	5,702,508.900	
IMPERIAL HOLDINGS LTD	16,774	207.440	3,479,598.560	
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LTD	40,805	265.500	10,833,727.500	
BARCLAYS AFRICA GROUP LTD	74,147	165.300	12,256,499.100	
TIGER BRANDS LTD	15,366	335.720	5,158,673.520	
SANLAM LTD	178,927	70.290	12,576,778.830	
INVESTEC LTD	29,312	98.610	2,890,456.320	
KUMBA IRON ORE LTD	5,327	321.760	1,714,015.520	
PIONEER FOODS LTD	15,500	114.200	1,770,100.000	
MONDI LTD	11,126	366.120	4,073,451.120	
LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDINGS LTD	135,845	25.250	3,430,086.250	
RMI HOLDINGS	73,926	38.280	2,829,887.280	
VODACOM GROUP PTY LTD	57,401	130.450	7,487,960.450	
NEPI ROCKCASTLE PLC	35,885	124.450	4,465,888.250	
OLD MUTUAL LTD	500,000	28.490	14,245,000.000	
REINET INVESTMENTS SCA	13,612	248.320	3,380,131.840	
FORTRESS REIT LTD-A	102,950	15.390	1,584,400.500	
BID CORP LTD	35,164	276.080	9,708,077.120	
南アフリカ・ランド 小計	4,094,450		487,755,141.440 (4,053,245,226)	

合計	255,299,013		60,051,084,522 (60,051,084,522)	
----	-------------	--	------------------------------------	--

## (2) 株式以外の有価証券

平成30年7月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	メキシコ・ペソ	CEMEX SAB DE CV	1,525,375.000	20,302,741.250	
		FOMENTO ECONOMICO MEXICANO SAB DE CV	206,700.000	36,902,151.000	
	メキシコ・ペソ	小計	1,732,075.000	57,204,892.250 (333,504,522)	
投資信託受益証券 合計			1,732,075	333,504,522 (333,504,522)	
投資証券	トルコ・リラ	EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATIRIM	231,071.000	427,481.350	
		トルコ・リラ 小計	231,071.000	427,481.350 (10,067,185)	
	メキシコ・ペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	310,600.000	8,662,634.000	
	メキシコ・ペソ	小計	310,600.000	8,662,634.000 (50,503,156)	
	南アフリカ・ランド	FORTRESS REIT LTD-B	95,302.000	1,439,060.200	
		HYPROP INVESTMENTS LTD	29,707.000	3,055,662.020	
		RESILIENT REIT LTD	28,600.000	1,552,980.000	
	南アフリカ・ランド	小計	153,609.000	6,047,702.220 (50,256,405)	
投資証券 合計			695,280	110,826,746 (110,826,746)	
合計				444,331,268 (444,331,268)	

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

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入 投資信託受益 証券 時価比率	組入 投資証券 時価比率	有価証券の 合計金額 に対する 比率
アメリカ・ドル	株式 44銘柄	11.82%	-%	-%	12.82%
アラブ首長国連邦・ディ ルハム	株式 10銘柄	0.53%	-%	-%	0.58%
インド・ルピー	株式 80銘柄	8.07%	-%	-%	8.75%
インドネシア・ルピア	株式 29銘柄	1.79%	-%	-%	1.94%
オフショア・人民元	株式 30銘柄	0.34%	-%	-%	0.36%
カタール・リアル	株式 11銘柄	0.79%	-%	-%	0.86%
コロンビア・ペソ	株式 9銘柄	0.44%	-%	-%	0.48%
タイ・バーツ	株式 34銘柄	2.05%	-%	-%	2.22%
チェコ・コルナ	株式 4銘柄	0.16%	-%	-%	0.18%
チリ・ペソ	株式 17銘柄	1.04%	-%	-%	1.13%
トルコ・リラ	株式 23銘柄 投資証券 1銘柄	0.65% -%	-% -%	-% 0.02%	0.72%
ハンガリー・フォリント	株式 3銘柄	0.25%	-%	-%	0.27%
パキスタン・ルピー	株式 5銘柄	0.06%	-%	-%	0.06%
フィリピン・ペソ	株式 23銘柄	0.87%	-%	-%	0.94%
ブラジル・レアル	株式 54銘柄	5.54%	-%	-%	6.00%
ポーランド・ズロチ	株式 22銘柄	1.05%	-%	-%	1.13%
マレーシア・リンギット	株式 47銘柄	2.12%	-%	-%	2.30%
メキシコ・ペソ	株式 22銘柄 投資信託 受益証券 2銘柄 投資証券 1銘柄	2.25% -% -%	-% 0.51% -%	-% -% 0.08%	3.08%
ユーロ	株式 9銘柄	0.28%	-%	-%	0.31%
韓国・ウォン	株式 115銘柄	13.15%	-%	-%	14.26%
香港・ドル	株式 201銘柄	21.44%	-%	-%	23.25%
台湾・ドル	株式 89銘柄	10.68%	-%	-%	11.58%
南アフリカ・ランド	株式 49銘柄 投資証券 3銘柄	6.18% -%	-% -%	-% 0.08%	6.78%

(注) 「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

## 「エマージング債券パッシブ・マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

(単位:円)

科 目	注記 番号	平成30年1月11日現在	平成30年7月11日現在
資産の部			
流動資産			
預金		2,451,465,696	2,537,511,472
コール・ローン		395,982,514	56,693,775
国債証券		98,971,707,355	104,890,888,928
派生商品評価勘定		-	62,000
未収入金		418,714,761	-
未収利息		1,507,428,223	1,581,148,764
前払費用		95,331,659	187,533,628
流動資産合計		103,840,630,208	109,253,838,567
資産合計		103,840,630,208	109,253,838,567
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		2,556,800	30,600
未払金		602,479,744	-
未払解約金		68,895,000	79,080,000
その他未払費用		-	1,745
流動負債合計		673,931,544	79,112,345
負債合計		673,931,544	79,112,345
純資産の部			
元本等			
元本	1	54,256,447,518	59,857,001,615
剰余金			
剰余金又は欠損金( )		48,910,251,146	49,317,724,607
元本等合計		103,166,698,664	109,174,726,222
純資産合計		103,166,698,664	109,174,726,222
負債純資産合計		103,840,630,208	109,253,838,567

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

## （貸借対照表に関する注記）

項目	平成30年1月11日現在	平成30年7月11日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	51,535,631,842円	54,256,447,518円
同期中追加設定元本額	11,524,225,338円	30,954,967,707円
同期中一部解約元本額	8,803,409,662円	25,354,413,610円
元本の内訳		
ファンド名		
D I A M新興国債券インデックスファンド<為替ヘッジなし>（ファンドラップ）	231,736,287円	275,866,960円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	13,439,320円	53,295,171円
たわらノーロード バランス（堅実型）	185,533円	2,676,351円
たわらノーロード バランス（標準型）	578,044円	7,841,375円
たわらノーロード バランス（積極型）	658,928円	6,421,074円
たわらノーロード 最適化バランス（保守型）	- 円	82,384円
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	- 円	113,223円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	- 円	549,653円
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	- 円	281,104円
たわらノーロード 最適化バランス（積極型）	- 円	383,324円

マネックス資産設計ファンド エボリューション	75,944,530円	59,295,344円
DIAM DC 8資産バラン スファンド(新興国10)	27,320,395円	194,638,292円
DIAM DC 8資産バラン スファンド(新興国20)	90,077,700円	158,127,730円
DIAM DC 8資産バラン スファンド(新興国30)	200,732,596円	314,777,396円
投資のソムリエ	5,386,829,880円	8,638,821,397円
クルーズコントロール	1,391,418,497円	554,599,758円
投資のソムリエ<DC年金>	341,339,293円	742,176,852円
DIAM 8資産バランスファ ンドN<DC年金>	103,835,053円	132,733,848円
クルーズコントロール<DC年 金>	485,809円	239,129円
DIAMコア資産設計ファンド (堅実型)	6,404,568円	1,969,496円
DIAMコア資産設計ファンド (積極型)	14,622,181円	7,037,090円
投資のソムリエ<DC年金>リ スク抑制型	137,701,694円	326,852,267円
ダイナミック・ナビゲーション	188,968円	177,753円
リスク抑制世界8資産バラン スファンド	1,912,437,568円	5,911,347,738円
ワールドアセットバランス(基 本コース)	704,245,670円	891,800,567円
ワールドアセットバランス(リ スク抑制コース)	2,707,059,809円	3,500,161,418円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤ-2045)	802,092円	1,706,431円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤ-2055)	802,092円	1,105,582円
リスク抑制世界8資産バラン スファンド(DC)	641,925円	1,567,300円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤ-2035)	680,332円	2,621,503円
リスクコントロール世界資産分 散ファンド	-円	510,274,666円
エマージング債券リスク抑制型 (適格機関投資家限定)	12,745,371,625円	11,559,148,690円
エマージング債券パッシブファ ンドVA(適格機関投資家専 用)	3,284,400,424円	2,828,965,750円
DIAM世界アセットバランス ファンド2VA(適格機関投資 家限定)	7,316,952,369円	6,835,889,417円
DIAM世界アセットバランス ファンド3VA(適格機関投資 家限定)	4,762,929,633円	4,870,008,669円
DIAMグローバル・リスク ファクター・パリティ戦略ファ ンド(適格機関投資家限定)	4,695,478,120円	3,682,541,666円

	D I A Mグローバル・リスク ファクター・パリティ戦略ファ ンドI I (適格機関投資家限 定)	4,875,707,169円	2,853,159,768円
	P - O n eマルチアセット戦略 ファンド(適格機関投資家限 定)	3,225,439,414円	4,927,745,479円
計		54,256,447,518円	59,857,001,615円
2 .	受益権の総数	54,256,447,518口	59,857,001,615口



## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成29年7月12日 至 平成30年1月11日	自 平成30年1月12日 至 平成30年7月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成30年1月11日現在	平成30年7月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	平成30年1月11日現在	平成30年7月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
国債証券	248,212,144	2,220,709,627
合計	248,212,144	2,220,709,627

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成29年4月19日から平成30年1月11日まで及び平成30年4月19日から平成30年7月11日まで）に対応する金額であります。

## （デリバティブ取引等に関する注記）

## 通貨関連

種類	平成30年1月11日 現在				平成30年7月11日 現在			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	980,663,200	-	980,672,000	8,800	55,522,000	-	55,460,000	62,000
アメリカ・ドル	980,663,200	-	980,672,000	8,800	55,522,000	-	55,460,000	62,000
買 建	292,344,000	-	289,796,000	2,548,000	499,125,600	-	499,095,000	30,600
アメリカ・ドル	292,344,000	-	289,796,000	2,548,000	499,125,600	-	499,095,000	30,600
合計	1,273,007,200	-	1,270,468,000	2,556,800	554,647,600	-	554,555,000	31,400

## （注）時価の算定方法

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

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成30年1月11日現在	平成30年7月11日現在
1口当たり純資産額	1.9015円	1.8239円
(1万口当たり純資産額)	(19,015円)	(18,239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7月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	BRAZIL 2.625 01/05/23	8,200,000.000	7,556,300.000	
		BRAZIL 4.25 01/07/25	15,900,000.000	15,283,875.000	
		BRAZIL 4.625 01/13/28	11,000,000.000	10,205,250.000	
		BRAZIL 4.875 01/22/21	9,600,000.000	9,796,896.000	
		BRAZIL 5.0 01/27/45	12,000,000.000	9,930,000.000	
		BRAZIL 5.625 01/07/41	8,700,000.000	7,882,200.000	
		BRAZIL 5.625 02/21/47	10,400,000.000	9,308,000.000	
		BRAZIL 6.0 04/07/26	8,200,000.000	8,614,182.000	
		BRAZIL 7.125 01/20/37	7,500,000.000	8,175,000.000	
		BRAZIL 8.25 01/20/34	6,400,000.000	7,572,480.000	
		BRAZIL 8.75 02/04/25	3,000,000.000	3,600,150.000	
		BRAZIL 8.875 10/14/19	5,200,000.000	5,499,988.000	
		COLOMBIA 2.625 03/15/23	3,900,000.000	3,743,493.000	
		COLOMBIA 3.875 04/25/27	9,200,000.000	9,054,640.000	
		COLOMBIA 4.0 02/26/24	7,900,000.000	7,988,875.000	
		COLOMBIA 4.375 07/12/21	10,000,000.000	10,287,500.000	
		COLOMBIA 4.5 01/28/26	5,600,000.000	5,792,472.000	
		COLOMBIA 5.0 06/15/45	14,800,000.000	15,133,000.000	
		COLOMBIA 5.625 02/26/44	9,000,000.000	9,891,000.000	
		COLOMBIA 6.125 01/18/41	9,200,000.000	10,626,000.000	
		COLOMBIA 7.375 09/18/37	7,200,000.000	9,270,000.000	
		COLOMBIA 8.125 05/21/24	4,300,000.000	5,231,380.000	
		CROATIA 5.5 04/04/23	5,800,000.000	6,174,390.000	
		CROATIA 6.0 01/26/24	4,000,000.000	4,366,080.000	
		CROATIA 6.375 03/24/21	3,700,000.000	3,940,500.000	
		CROATIA 6.625 07/14/20	5,800,000.000	6,136,516.000	
		CROATIA 6.75 11/05/19	7,800,000.000	8,148,192.000	
		HUNGARY 5.375 02/21/23	5,700,000.000	6,063,660.000	
		HUNGARY 5.375 03/25/24	4,800,000.000	5,139,600.000	
		HUNGARY 5.75 11/22/23	8,200,000.000	8,898,394.000	
		HUNGARY 6.25 01/29/20	8,500,000.000	8,918,625.000	
		HUNGARY 6.375 03/29/21	8,600,000.000	9,223,070.000	
		HUNGARY 7.625 03/29/41	3,800,000.000	5,284,774.000	
		INDONESIA 3.375 04/15/23	4,500,000.000	4,368,735.000	
		INDONESIA 3.75 04/25/22	7,000,000.000	6,966,750.000	
		INDONESIA 3.85 07/18/27	3,000,000.000	2,886,390.000	
INDONESIA 4.125 01/15/25	10,200,000.000	10,124,112.000			
INDONESIA 4.35 01/08/27	4,200,000.000	4,197,438.000			

INDONESIA 4.625 04/15/43	4,600,000.000	4,393,966.000	
INDONESIA 4.75 01/08/26	7,000,000.000	7,208,530.000	
INDONESIA 4.875 05/05/21	8,700,000.000	8,977,182.000	
INDONESIA 5.125 01/15/45	5,800,000.000	5,881,026.000	
INDONESIA 5.25 01/08/47	3,600,000.000	3,709,980.000	
INDONESIA 5.25 01/17/42	6,900,000.000	7,148,538.000	
INDONESIA 5.875 01/15/24	7,800,000.000	8,432,034.000	
INDONESIA 5.95 01/08/46	4,000,000.000	4,492,120.000	
INDONESIA 6.75 01/15/44	5,700,000.000	7,004,445.000	
INDONESIA 7.75 01/17/38	6,300,000.000	8,242,353.000	
PANAMA 3.75 03/16/25	6,600,000.000	6,616,500.000	
PANAMA 3.875 03/17/28	6,200,000.000	6,200,000.000	
PANAMA 4.5 05/15/47	4,800,000.000	4,826,976.000	
PANAMA 5.2 01/30/20	6,400,000.000	6,624,000.000	
PANAMA 6.7 01/26/36	9,400,000.000	11,681,380.000	
PANAMA 7.125 01/29/26	4,600,000.000	5,553,350.000	
PANAMA 9.375 04/01/29	4,900,000.000	6,982,500.000	
PERU 4.125 08/25/27	7,000,000.000	7,262,500.000	
PERU 5.625 11/18/50	12,800,000.000	15,249,280.000	
PERU 6.55 03/14/37	5,800,000.000	7,333,520.000	
PERU 7.35 07/21/25	10,400,000.000	12,743,120.000	
PHILIPPINES 3.7 02/02/42	5,000,000.000	4,681,050.000	
PHILIPPINES 3.7 03/01/41	6,200,000.000	5,813,306.000	
PHILIPPINES 3.95 01/20/40	6,200,000.000	6,021,626.000	
PHILIPPINES 4.0 01/15/21	5,200,000.000	5,260,008.000	
PHILIPPINES 4.2 01/21/24	4,000,000.000	4,097,160.000	
PHILIPPINES 5.0 01/13/37	4,000,000.000	4,332,480.000	
PHILIPPINES 5.5 03/30/26	3,800,000.000	4,214,200.000	
PHILIPPINES 6.375 01/15/32	3,000,000.000	3,635,610.000	
PHILIPPINES 6.375 10/23/34	6,200,000.000	7,642,058.000	
PHILIPPINES 6.5 01/20/20	3,800,000.000	3,995,700.000	
PHILIPPINES 7.75 01/14/31	5,900,000.000	7,818,326.000	
PHILIPPINES 9.5 02/02/30	6,600,000.000	9,678,504.000	
ROMANIA 4.375 08/22/23	6,600,000.000	6,721,242.000	

ROMANIA 4.875 01/22/24	2,400,000.000	2,495,064.000	
ROMANIA 6.125 01/22/44	3,200,000.000	3,654,880.000	
ROMANIA 6.75 02/07/22	8,300,000.000	9,098,875.000	
RUSSIA FOREIGN BOND 5.0 04/29/20	16,200,000.000	16,665,264.000	
RUSSIAN FEDERATION 03/31/30	11,525,500.000	12,780,626.950	
RUSSIAN FEDERATION 4.25 06/23/27	9,800,000.000	9,627,814.000	
RUSSIAN FEDERATION 4.5 04/04/22	9,000,000.000	9,250,830.000	
RUSSIAN FEDERATION 4.75 05/27/26	10,800,000.000	11,010,708.000	
RUSSIAN FEDERATION 4.875 09/16/23	10,000,000.000	10,513,000.000	
RUSSIAN FEDERATION 5.25 06/23/47	24,000,000.000	23,941,680.000	
RUSSIAN FEDERATION 5.625 04/04/42	9,200,000.000	9,924,684.000	
RUSSIAN FEDERATION 5.875 09/16/43	5,400,000.000	5,993,730.000	
SOUTH AFRICA 4.3 10/12/28	6,800,000.000	6,209,828.000	
SOUTH AFRICA 4.665 01/17/24	4,700,000.000	4,698,073.000	
SOUTH AFRICA 4.875 04/14/26	4,800,000.000	4,717,680.000	
SOUTH AFRICA 5.0 10/12/46	2,400,000.000	2,088,144.000	
SOUTH AFRICA 5.375 07/24/44	3,200,000.000	2,930,880.000	
SOUTH AFRICA 5.5 03/09/20	6,600,000.000	6,806,316.000	
SOUTH AFRICA 5.875 05/30/22	3,200,000.000	3,381,984.000	
SOUTH AFRICA 5.875 09/16/25	6,200,000.000	6,486,316.000	
TURKEY 11.875 01/15/30	5,100,000.000	7,084,410.000	
TURKEY 3.25 03/23/23	5,100,000.000	4,494,732.000	
TURKEY 4.25 04/14/26	5,000,000.000	4,245,550.000	
TURKEY 4.875 04/16/43	9,100,000.000	6,598,228.000	
TURKEY 4.875 10/09/26	9,800,000.000	8,574,510.000	
TURKEY 5.125 03/25/22	4,300,000.000	4,148,253.000	
TURKEY 5.625 03/30/21	7,700,000.000	7,656,495.000	
TURKEY 5.75 03/22/24	9,300,000.000	8,905,029.000	
TURKEY 5.75 05/11/47	9,800,000.000	7,718,872.000	
TURKEY 6.0 01/14/41	10,700,000.000	8,969,703.000	
TURKEY 6.0 03/25/27	11,400,000.000	10,604,052.000	
TURKEY 6.25 09/26/22	8,500,000.000	8,487,675.000	
TURKEY 6.625 02/17/45	9,700,000.000	8,517,764.000	

	TURKEY 6.75 05/30/40	5,900,000.000	5,342,568.000	
	TURKEY 7.0 06/05/20	7,700,000.000	7,892,962.000	
	TURKEY 7.375 02/05/25	10,300,000.000	10,567,285.000	
	TURKEY 7.5 11/07/19	6,400,000.000	6,583,744.000	
	UNITED MEXICAN STATES 3.5 01/21/21	5,200,000.000	5,205,200.000	
	UNITED MEXICAN STATES 3.6 01/30/25	9,200,000.000	8,979,200.000	
	UNITED MEXICAN STATES 3.625 03/15/22	9,100,000.000	9,145,955.000	
	UNITED MEXICAN STATES 4.0 10/02/23	11,700,000.000	11,803,779.000	
	UNITED MEXICAN STATES 4.125 01/21/26	9,400,000.000	9,411,750.000	
	UNITED MEXICAN STATES 4.15 03/28/27	11,600,000.000	11,546,292.000	
	UNITED MEXICAN STATES 4.35 01/15/47	6,600,000.000	6,055,500.000	
	UNITED MEXICAN STATES 4.6 01/23/46	10,200,000.000	9,669,600.000	
	UNITED MEXICAN STATES 4.6 02/10/48	8,200,000.000	7,757,200.000	
	UNITED MEXICAN STATES 4.75 03/08/44	15,600,000.000	15,022,800.000	
	UNITED MEXICAN STATES 5.55 01/21/45	10,000,000.000	10,762,500.000	
	UNITED MEXICAN STATES 5.75 10/12/2110	9,200,000.000	9,365,600.000	
	UNITED MEXICAN STATES 6.05 01/11/40	11,900,000.000	13,375,600.000	
	UNITED MEXICAN STATES 6.75 09/27/34	6,000,000.000	7,035,600.000	
	アメリカ・ドル 小計	916,025,500.000 (101,614,708,715)	945,559,261.950 (104,890,888,928)	
国債証券	合計	101,614,708,715 (101,614,708,715)	104,890,888,928 (104,890,888,928)	
合計		101,614,708,715 (101,614,708,715)	104,890,888,928 (104,890,888,928)	

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

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

3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	有価証券の合計金額 に対する比率
アメリカ・ドル	国債証券 123銘柄	96.08%	100%

(注) 「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表



「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

## 2【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

平成30年7月31日現在

資産総額	101,557,600,276円
負債総額	119,712,725円
純資産総額( - )	101,437,887,551円
発行済数量	101,710,274,300口
1口当たり純資産額( / )	0.9973円

(参考)

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

平成30年7月31日現在

資産総額	302,950,054,118円
負債総額	1,544,278,436円
純資産総額( - )	301,405,775,682円
発行済数量	112,517,950,310口
1口当たり純資産額( / )	2.6787円

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年7月31日現在

資産総額	343,546,052,606円
負債総額	273,460,000円
純資産総額( - )	343,272,592,606円
発行済数量	266,079,340,450口
1口当たり純資産額( / )	1.2901円

J-REITインデックスファンド・マザーファンド

平成30年7月31日現在

資産総額	38,320,354,307円
負債総額	827,408,272円
純資産総額( - )	37,492,946,035円
発行済数量	20,136,506,421口
1口当たり純資産額( / )	1.8619円

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年7月31日現在

資産総額	317,347,270,628円
負債総額	693,536,551円
純資産総額( - )	316,653,734,077円
発行済数量	88,591,962,950口
1口当たり純資産額( / )	3.5743円

## 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年7月31日現在

資産総額	53,403,835,698円
負債総額	151,309,031円
純資産総額( - )	53,252,526,667円
発行済数量	43,781,008,664口
1口当たり純資産額( / )	1.2163円

## 為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年7月31日現在

資産総額	320,028,387,145円
負債総額	6,641,910,084円
純資産総額( - )	313,386,477,061円
発行済数量	237,202,128,405口
1口当たり純資産額( / )	1.3212円

## エマージング株式パッシブ・マザーファンド

平成30年7月31日現在

資産総額	67,677,861,222円
負債総額	4,256,215円
純資産総額( - )	67,673,605,007円
発行済数量	56,495,202,249口
1口当たり純資産額( / )	1.1979円

## エマージング債券パッシブ・マザーファンド

平成30年7月31日現在

資産総額	114,877,537,198円
負債総額	2,546,757,810円
純資産総額( - )	112,330,779,388円
発行済数量	61,352,365,759口
1口当たり純資産額( / )	1.8309円

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

### (1) 受益証券の名義書換

該当事項はありません。

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

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

### (2) 受益者等名簿

該当事項はありません。

### (3) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

### (4) 受益権の譲渡制限

譲渡制限はありません。

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

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

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

### (5) 受益権の譲渡の対抗要件

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

### (6) 受益権の再分割

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

### (7) 質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

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

## 第三部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

##### (1) 資本金の額（平成30年7月31日現在）

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

直近5カ年の資本金の増減：該当事項はありません。

##### (2) 会社の機構（平成30年7月31日現在）

###### 会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。

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

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

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

また、取締役会の決議によって、取締役社長を定めることができます。

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

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

###### 投資運用の意思決定機構

###### 1. 投資環境見直しおよび運用方針の策定

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

## 2.運用計画、売買計画の決定

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

## 2【事業の内容及び営業の概況】

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

平成30年7月31日現在、委託会社の運用する投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除く）

基本的性格	本数	純資産総額（単位：円）
追加型公社債投資信託	38	1,264,102,345,784
追加型株式投資信託	850	12,950,854,953,959
単位型公社債投資信託	49	193,796,833,775
単位型株式投資信託	145	955,223,205,407
合計	1,082	15,363,977,338,925

### 3【委託会社等の経理状況】

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



## (1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

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

（単位：千円）

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

## (2) 【損益計算書】

(単位：千円)

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

（単位：千円）

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

## （３）【株主資本等変動計算書】

第32期（自平成28年4月1日至平成29年3月31日）

（単位：千円）

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

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

第33期（自平成29年4月1日至平成30年3月31日）

（単位：千円）

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

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

## 重要な会計方針

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

## 会計上の見積りの変更

第33期(自平成29年4月1日至平成30年3月31日)

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

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

## 追加情報

第33期(自平成29年4月1日至平成30年3月31日)

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

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

## 注記事項

(貸借対照表関係)

## 1.有形固定資産の減価償却累計額

(千円)

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

(損益計算書関係)

## 1.関係会社に対する事項

(千円)

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

## 2.固定資産売却益の内訳

(千円)

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



## 3. 固定資産除却損の内訳

(千円)

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

## 4. 固定資産売却損の内訳

(千円)

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

## 5. 本社移転費用の内訳

(千円)

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

## (株主資本等変動計算書関係)

第32期(自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

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

## 2. 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

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

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

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

## 第33期(自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2. 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

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

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

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

## (金融商品関係)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

## (1) 金融商品に対する取組方針

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

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

## (2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

営業債務である未払手数料は、1年以内の支払期日であります。

## (3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

## (4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

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

第32期（平成29年3月31日現在）

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

## 第33期(平成30年3月31日現在)

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

## (注1) 金融商品の時価の算定方法

## 資 産

## (1) 現金・預金

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

## (2) 金銭の信託

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

## (3) 未収委託者報酬及び(4) 未収運用受託報酬

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

## (5) 有価証券及び投資有価証券

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

## 負 債

## (1) 未払手数料

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

## (注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(千円)

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

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

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

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第32期(平成29年3月31日現在)

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

第33期(平成30年3月31日現在)

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

(有価証券関係)

## 1. 子会社株式及び関連会社株式

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

## 2. その他有価証券

第32期(平成29年3月31日現在)

(千円)

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

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

## 第33期(平成30年3月31日現在)

(千円)

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

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

## 3. 当該事業年度中に売却したその他有価証券

## 第32期(自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)

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

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

## 第33期(自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)

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

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

## 4. 減損処理を行った有価証券

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

第33期において、該当事項はありません。

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

## (退職給付関係)

## 1. 採用している退職給付制度の概要

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

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

## 2. 確定給付制度

## (1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(千円)

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

## (2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

(千円)

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

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

(千円)

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

## (4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(千円)

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

(注) 特別損失に計上しております。

## (5) 年金資産に関する事項

年金資産の主な内訳

年金資産合計に対する主な分類ごとの比率は、次のとおりであります。

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

長期期待運用収益率の設定方法

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

## (6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎

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

## 3. 簡便法を適用した確定給付制度

(1) 簡便法を適用した制度の、退職給付引当金の期首残高と期末残高の調整表

(千円)

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



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

(千円)

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

## (3) 退職給付費用

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

## 4. 確定拠出制度

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

## (税効果会計関係)

## 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

繰延税金資産の純額

1,571,992

1,699,533

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

(企業結合等関係)

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

1. 結合当事企業

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

2. 企業結合日

平成28年10月1日

3. 企業結合の方法

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

4. 結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

5. 企業結合の主な目的

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

6. 合併比率

「3. 企業結合の方法」の吸収合併における合併比率は以下の通りであります。

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

(\*) 普通株式と種類株式を合算して算定しております。

7. 交付した株式数

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

## 8. 経済的持分比率(議決権比率)

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

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

## 9. 取得企業を決定するに至った主な根拠

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

## 10. 会計処理

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

## 11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

## (1) 財務諸表に含まれる被取得企業の業績の期間

平成29年4月1日から平成30年3月31日まで

## (2) 被取得企業の取得原価及びその内訳

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

## (3) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

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

## (4) 企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

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

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

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

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

## 12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

## (1) 貸借対照表項目

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

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

## (2) 損益計算書項目

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

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

## (資産除去債務関係)

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

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

## (セグメント情報等)

## 1. セグメント情報

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

## 2. 関連情報

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

## (1) サービスごとの情報

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

## (2) 地域ごとの情報

## 営業収益

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

## 有形固定資産

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

## (3) 主要な顧客ごとの情報

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

## ( 関連当事者情報 )

## 1. 関連当事者との取引

## (1) 親会社及び法人主要株主等

第32期(自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)

該当はありません。

第33期(自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)

該当はありません。

## (2) 子会社及び関連会社等

第32期(自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)

該当はありません。

第33期(自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)

該当はありません。

## (3) 兄弟会社等

第32期(自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は 出資金	事業の 内容又は 職業	議決権 等の所有 (被所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員 の兼任等	事業上 の関係				
親会社の子会社	株式会社みずほ銀行	東京都千代田区	14,040 億円	銀行業	-	-	当社設定投資信託の販売	投資信託の 販売代行手 数料	4,530,351	未払 手数料	767,732
	資産管理サービス信託銀行株式会社	東京都中央区	500 億円	資産管理 等	-	-	当社信託財産の運用	信託元本の 払戻(純 額) 信託報酬の 支払	100,000  7,080	金銭の 信託	12,366,219
	みずほ証券株式会社	東京都千代田区	1,251 億円	証券業	-	-	当社設定投資信託の販売	投資信託の 販売代行手 数料	5,061,766	未払 手数料	1,166,212
	みずほ信託銀行株式会社	東京都中央区	2,473 億円	信託銀行 業	-	-	投資一任契約の締結	運用受託報 酬の受取	2,520,431	未収運 用受託 報酬	2,722,066

第33期(自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は 出資金	事業の 内容又は 職業	議決権 等の所有 (被所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員 の兼任等	事業上 の関係				
親会社の子会社	株式会社みずほ銀行	東京都千代田区	14,040 億円	銀行業	-	-	当社設定投資信託の販売	投資信託の 販売代行手 数料	6,470,802	未払 手数料	894,336
	みずほ証券株式会社	東京都千代田区	1,251 億円	証券業	-	-	当社設定投資信託の販売	投資信託の 販売代行手 数料	9,079,083	未払 手数料	1,549,208

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

- (注1) 投資信託の販売代行手数料は、一般的取引条件を勘案した個別契約により決定しております。
- (注2) 信託報酬は、一般的取引条件を勘案した料率が適用されております。
- (注3) 運用受託報酬は、一般的取引条件を勘案した個別契約により決定しております。
- (注4) 上記の取引金額には消費税等が含まれておりません。期末残高には、消費税等が含まれております。

## 2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

## (1) 親会社情報

株式会社みずほフィナンシャルグループ

(東京証券取引所及びニューヨーク証券取引所に上場)

## (2) 重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません。

## (1株当たり情報)

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

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

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

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

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

#### 4【利害関係人との取引制限】

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

- (1) 自己またはその取締役もしくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。
- (2) 運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。
- (3) 通常の実取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下（4）（5）において同じ。）または子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引または店頭デリバティブ取引を行うこと。
- (4) 委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。
- (5) 上記（3）（4）に掲げるもののほか、委託会社の親法人等または子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

#### 5【その他】

- (1) 定款の変更、事業譲渡又は事業譲受、出資の状況その他の重要事項  
平成30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。
- (2) 訴訟事件その他の重要事項  
委託会社およびファンドに重要な影響を与えた事実、または与えると予想される事実はありません。

## 第2【その他の関係法人の概況】

## 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

## (1)受託会社

## a.名称

みずほ信託銀行株式会社

## b.資本金の額

平成30年3月末日現在 247,369百万円

## c.事業の内容

日本において銀行業務および信託業務を営んでいます。

## (2)販売会社

販売会社の名称、資本金の額および事業内容は以下の「販売会社一覧表」の通りです。

名 称	資本金の額 (単位:百万円)	事 業 の 内 容
株式会社東邦銀行	23,519	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社足利銀行	135,000	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社常陽銀行	85,113	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社横浜銀行	215,628	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社北陸銀行	140,409	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社北洋銀行	121,101	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社大光銀行	10,000	日本において銀行業務を営んでおります。
信金中央金庫	( 1 ) 690,998	日本において全国の信用金庫の中央金融機関として、信用金庫の余裕資金の効率運用と信用金庫間の資金の受給調整、信用金庫業界の信用力の維持向上および業務機能の補完を図っています。
株式会社ゆうちょ銀行	3,500,000	日本において銀行業務を営んでおります。
上光証券株式会社	500	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
とうほう証券株式会社	3,000	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。

(注) 資本金の額は平成30年3月末日現在

( 1 ) 出資の総額

## 2【関係業務の概要】

「受託会社」は、以下の業務を行います。

- (1) 委託会社の指図に基づく信託財産の管理、保管、処分
- (2) 信託財産の計算
- (3) 信託財産に関する報告書の作成
- (4) その他上記に付帯する業務

「販売会社」は、以下の業務を行います。



- (1)募集の取扱い
- (2)追加設定の申込事務
- (3)信託契約の一部解約事務
- (4)受益者に対する収益分配金、一部解約金および償還金の支払い
- (5)受益者に対する収益分配金の再投資
- (6)受益者に対する投資信託説明書（目論見書）および運用報告書の交付
- (7)その他上記に付帯する業務

### 3【資本関係】

該当事項はありません。

持株比率5%以上を記載します。

### 第3【その他】

- (1)目論見書の表紙等にロゴ・マークや図案を使用し、ファンドの基本的性格を記載することがあります。また目論見書には「目論見書の使用開始日」、「委託会社の金融商品取引業者登録番号」、「金融商品取引法の規定に基づく目論見書である旨」、「投資信託の取引はクーリングオフ適用外である旨」、「請求目論見書の内容やその照会先と請求方法」、「信託財産の管理方法」、「投資信託運用による損益は全て投資家に帰属する旨」、「投資信託の元本は保証されていない旨」等を記載することがあります。
- (2)目論見書には有価証券届出書の第一部「証券情報」、第二部「ファンド情報」の主要内容を要約し記載することがあります。第二部「ファンド情報」第1 ファンドの状況 5 運用状況 には、参考情報として 基準価額・純資産の推移 分配の推移 主要な資産の状況 年間収益率の推移等（ベンチマークを含む）を記載することがあります。（表示されるデータは適宜更新されます。）
- (3)請求目論見書の巻末に用語説明を掲載する場合があります。  
なお、請求目論見書の巻末に信託約款を掲載し参照することで、有価証券届出書の内容の記載とすることがあります。
- (4)ファンドの特色やリスク等について投資者に開示すべき情報のあるファンドは、交付目論見書に「追加的記載事項」と明記して当該情報の内容等を有価証券届出書の記載に従い記載することがあります。
- (5)交付目論見書の「お申込みメモ」に以下の内容を記載することがあります。  
基準価額は、販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。  
もしくは、計算日の翌日付の日本経済新聞朝刊の「オープン基準価格」の欄をご参照ください。

## 独立監査人の監査報告書

平成30年5月30日

アセットマネジメントOne株式会社  
取締役会 御中

## 新日本有限責任監査法人

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

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

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

## 監査人の責任

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

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

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

## 監査意見

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

## 利害関係

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

以上

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

(注2) XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。

## 独立監査人の監査報告書

平成30年8月31日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 湯原 尚 印  
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているリスク抑制世界8資産バランスファンドの平成30年1月12日から平成30年7月11日までの特定期間の財務諸表、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、リスク抑制世界8資産バランスファンドの平成30年7月11日現在の信託財産の状況及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## その他の事項

ファンドの平成30年1月11日をもって終了した前特定期間の財務諸表は、前任監査人によって監査されている。前任監査人は、当該財務諸表に対して平成30年2月28日付けで無限定適正意見を表明している。

## 利害関係

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

以上

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

(注2) XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。

