

【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3月9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 西 惠正
【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】	ワールドアセットバランス（基本コース） ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】	ワールドアセットバランス（基本コース） 2,000億円を上限とします。 ワールドアセットバランス（リスク抑制コース） 2,000億円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

ワールドアセットバランス（基本コース）

ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）

（以下、総称して「ワールドアセットバランス」、「ワールドアセットバランス（基本コース）／（リスク抑制コース）」または「ファンド」という場合、あるいは個別に「各ファンド」という場合があります。また、「ワールドアセットバランス（基本コース）」は「（基本コース）」、「ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）」は「（リスク抑制コース）」という場合があります。

各ファンドを総称した愛称として「ワールドOne」という名称を用いる場合があります。

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

契約型の追加型証券投資信託の受益権（以下「受益権」といいます。）

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

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

（３）【発行（売出）価額の総額】

各ファンドにつき、2,000億円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

お申込日の翌営業日の基準価額 とします。

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

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

< 基準価額の照会方法等 >

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

各ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・ 販売会社へのお問い合わせ
- ・ 委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

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

(5) 【申込手数料】

お申込日の翌営業日の基準価額に、2.16%(税抜2.00%)を上限に各販売会社が定める手数料率を乗じて得た額とします。

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

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

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

(6) 【申込単位】

各販売会社が定める単位とします。

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

取扱コースおよびお申込単位は、販売会社にお問い合わせください。

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

当初元本は1口当たり1円です。

(7) 【申込期間】

継続申込期間:平成30年3月10日から平成30年9月11日まで

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

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

(8) 【申込取扱場所】

ファンドのお申込みにかかる取扱い等は販売会社が行います。

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。

(10)【払込取扱場所】

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

・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

(11)【振替機関に関する事項】

振替機関は下記の通りです。

・株式会社証券保管振替機構

(12)【その他】

お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

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

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

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

ただし、海外休業日には取得またはスイッチングのお申込みの受付は行いません。

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

受益権の取得申込者は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。

<スイッチング>

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

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

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

振替受益権について

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

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

(参考)

投資信託振替制度

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

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

各ファンドは、信託財産の成長を図ることを目的として、運用を行います。

各ファンドの信託金限度額は、各々2,000億円とします。ただし、委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

<ファンドの特色>



1 日本を除く先進国の株式、債券、不動産投資信託証券(リート)および新興国の株式、債券に分散投資することにより、信託財産の成長を図ることを目的として、運用を行います。

■ 上記資産に関しては、主としてマザーファンド(*)を通じて実質的に投資します。また、指数に連動する投資成果をめざす上場投資信託証券(ETF)、有価証券指数等先物取引等へ直接投資する場合があります。

■ DIAMマネーマザーファンドや短期金融資産等へ投資する場合があります。

(*)外国株式/パッシブ・ファンドマザーファンド、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、外国リート/パッシブ・ファンドマザーファンド、エマージング株式パッシブ・マザーファンド、エマージング債券パッシブ・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。



2 実質的な組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行い、為替リスクの低減をめざします。

※一部の新興国通貨については代替通貨等により対円での為替取引を行う場合があります。



3 基本コース、リスク抑制コースの2コースからお選びいただけます。

■ 各資産への基本投資比率は、統計的手法により、原則として年1回見直します。

※経済環境、運用環境の大きな変化などにより委託会社が必要と判断した場合には、適宜、基本投資比率の見直しを行うことがあります。

■ 基本コースは、基本投資比率をもとに分散投資を行います。

■ リスク抑制コースは、基本投資比率をもとに分散投資を行いつつ、基準価額の下落を一定水準(下値目安値(**))までに抑えることを目標に、基準価額の水準や市場環境等に応じて投資対象資産の合計資産比率(**)を機動的に変更します。

下値目安値は、過去12ヵ月間の基準価額の最高値から-15%の水準となるよう毎営業日決定します。ただし、当該水準は委託会社の判断により今後変更する場合があります。

(*) 基準価額が下値目安値を下回らないことを委託会社が保証等するものではありません(相場急落の場合などには、基準価額が下値目安値を下回る場合があります。)

(**) 合計資産比率とは、「DIAMマネーマザーファンド」を除く5つのマザーファンドとETFおよび有価証券指数等先物取引等への投資比率の合計をいいます。なお、合計資産比率の変更の際も、基本投資比率をもとに運用を行います。

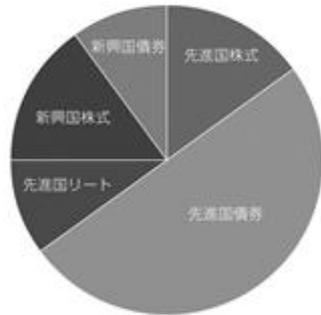
■ 各コース間でスイッチングが可能です。

※販売会社によっては、スイッチングの取扱いを行わない場合があります。

スイッチング時には、税金、購入時手数料がかかる場合があります。くわしくは、販売会社にお問い合わせください。

基本投資比率のイメージ

基本コース リスク抑制コース



※基本投資比率は、原則として年1回見直しします。
 ※上記はイメージ図であり、実際にはこれと異なる場合があります。

基本コース

投資対象資産の合計資産比率の変更は行いません。



※この図においては、左記の5つの資産への投資比率の合計を「合計資産比率」として表示しています。以下同じ。
 ※合計資産比率には、ETFおよび有価証券指数等先物取引等を含みます。

リスク抑制コース

基本投資比率をもとに投資対象資産の合計資産比率を、現金等*を用いて機動的に変更し、基準価額の下落の抑制をめざします。



※合計資産比率は、10%～100%程度とします。それにあわせて現金等の比率は変動します。

リスク抑制コースでは、基準価額下落時や各資産の値動きが大きい時等は機動的に合計資産比率を減少（現金等比率を増加）させることで基準価額の下落を一定水準（下値目安値）までに抑えることをめざします。その後、市場環境回復局面では合計資産比率を増加（現金等比率を減少）させます。
 ※下値目安値は、基準価額がこれを下回らないように目標とされる水準であり、基準価額が下値目安値を下回らないことを委託会社が保証するものではありません。

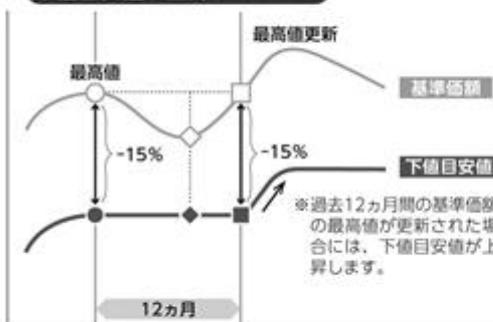
※現金等とは、短期国債、コール・ローンなどの短期金融資産等をいい、当該資産へは、「DIAMマネーマザーファンド」を通じてまたは直接投資を行います。
 ※円グラフの現金等・合計資産比率の割合はイメージです。

(リスク抑制コース)の下値目安値について

下値目安値は、過去12ヵ月間の基準価額の最高値から-15%の水準となるよう毎営業日決定します。

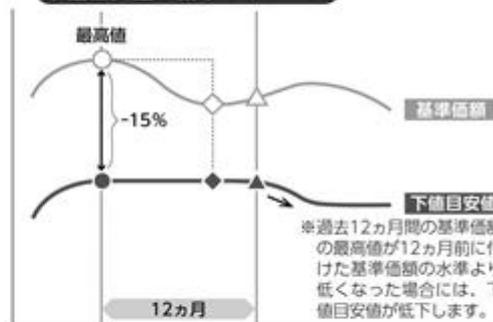
※（基本コース）は、下値目安値を定めておりません。
 ※設定後12ヵ月に満たない場合は、設定来の最高値をもとに下値目安値を決定します。

下値目安値が上昇するケース



※過去12ヵ月間の基準価額の最高値が更新された場合には、下値目安値が上昇します。

下値目安値が低下するケース



※過去12ヵ月間の基準価額の最高値が12ヵ月前に付けた基準価額の水準より低くなった場合には、下値目安値が低下します。

※下値目安値は、必ずしも上昇または低下するものではありません。基準価額の上昇局面でも基準価額が過去12ヵ月間の最高値を更新できない場合には、下値目安値は上昇せず同じ水準が継続します。基準価額の下落局面でも過去12ヵ月間の基準価額の最高値が維持されている場合には、下値目安値は低下せず同じ水準が継続します。
 ※下値目安値は、基準価額がこれを下回らないように目標とされる水準であり、基準価額が下値目安値を下回らないことを委託会社が保証するものではありません。
 ※上記はイメージ図であり、実際にはこれと異なる場合があります。また、将来の運用成果等を示唆・保証するものではありません。

4

各資産への投資比率の決定にあたっては、
 みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社の
 投資助言を活用します。

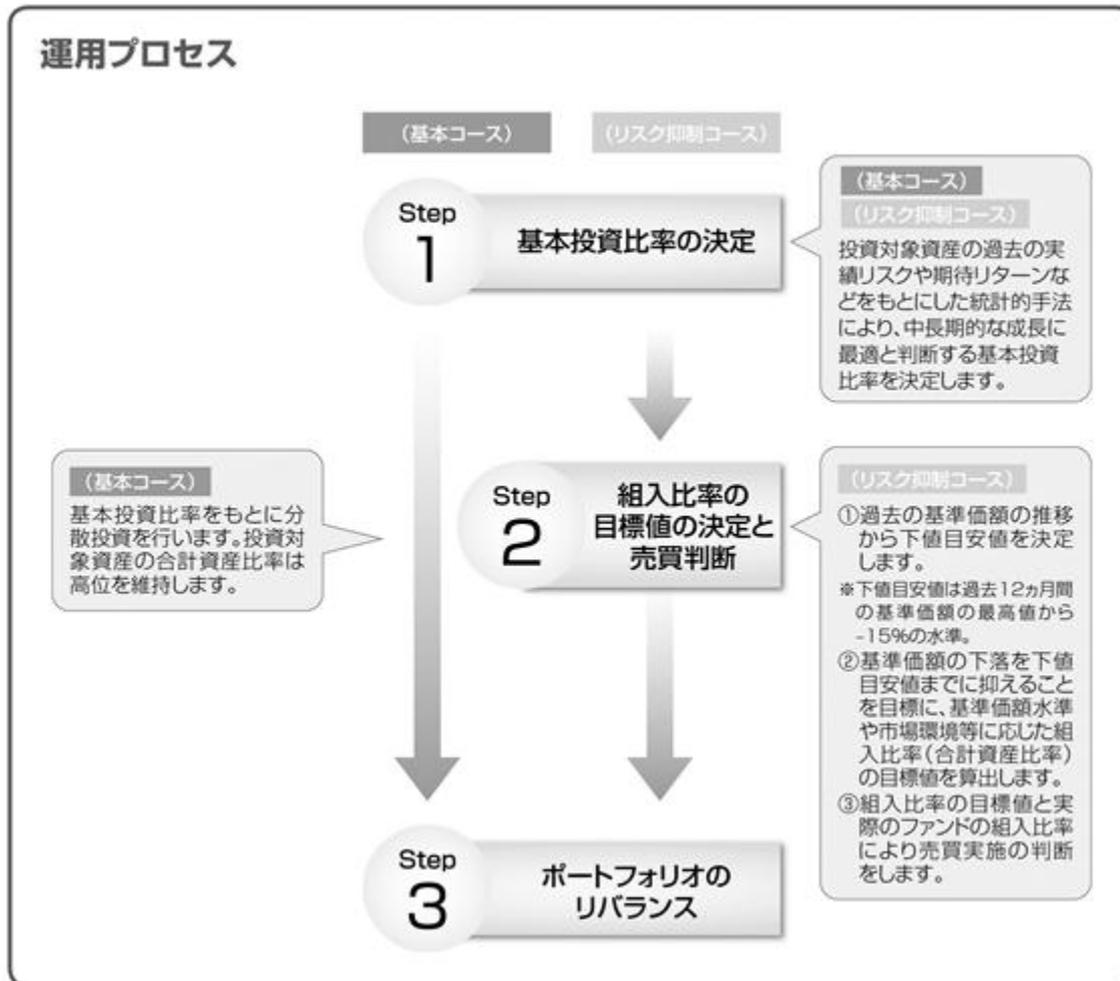
5

年2回決算を行います。

■ 毎年6月、12月の各11日（休業日の場合は翌営業日）の決算時に、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には、分配を行わないことがあります。

※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。



分配方針

年2回の決算時(毎年6月、12月の各11日(休業日の場合は翌営業日))に、経費控除後の配当等収益および売買益(評価益を含みます。)等の全額を対象として、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して、分配金額を決定します。

※将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

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

商品分類表

各ファンド

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

(注) 各ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

商品分類定義

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

属性区分表

各ファンド

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

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

(注) 各ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

属性区分定義

資産複合（投資信託証券（債券、株式、不動産投信）、先物、ETF、短期金融資産） 資産配分変更型	目論見書または投資信託約款において、複数資産（投資信託証券、先物、ETF、短期金融資産）を投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行う旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないものをいいます。
年2回	目論見書または投資信託約款において、年2回決算する旨の記載があるものをいいます。
グローバル（日本除く）	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除く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（フルヘッジ）	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。

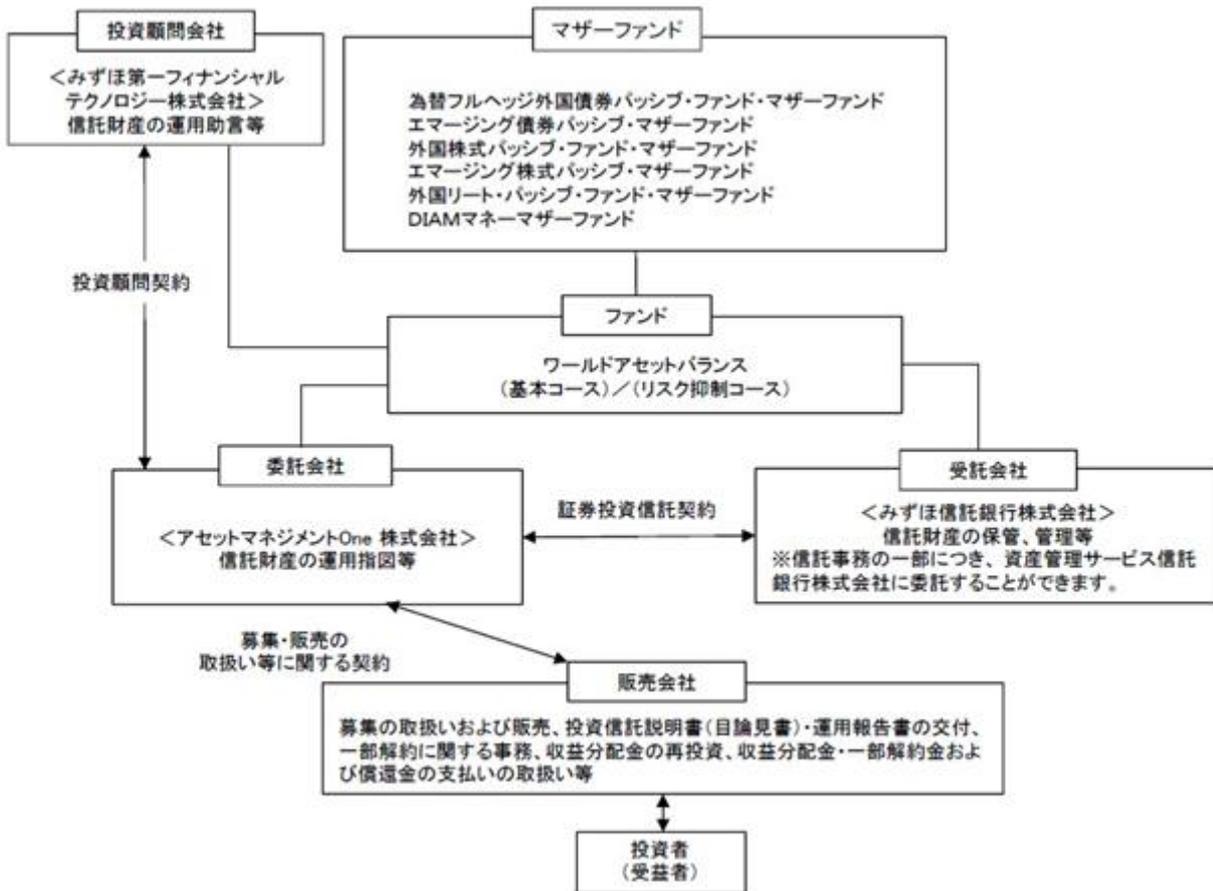
上記の分類は、一般社団法人投資信託協会の商品分類に関する指針に基づき記載しております。

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/>）をご覧ください。

（２）【ファンドの沿革】

平成29年1月18日 信託契約締結、ファンドの設定、ファンドの運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】



- ・ 「証券投資信託契約」の概要

委託会社と受託会社との間においては、各ファンドにかかる証券投資信託契約を締結しております。

当該契約の内容は、各ファンドの運用の基本方針、投資対象、投資制限、受益者の権利等を規定したものです。

- ・ 「募集・販売の取扱い等に関する契約」の概要

委託会社と販売会社との間においては、募集・販売の取扱い等に関する契約を締結しております。

当該契約の内容は、証券投資信託の募集・販売の取扱い、一部解約に関する事務、収益分配金の再投資、収益分配金・一部解約金および償還金の受益者への支払い等に関する包括的な規則を定めたものです。

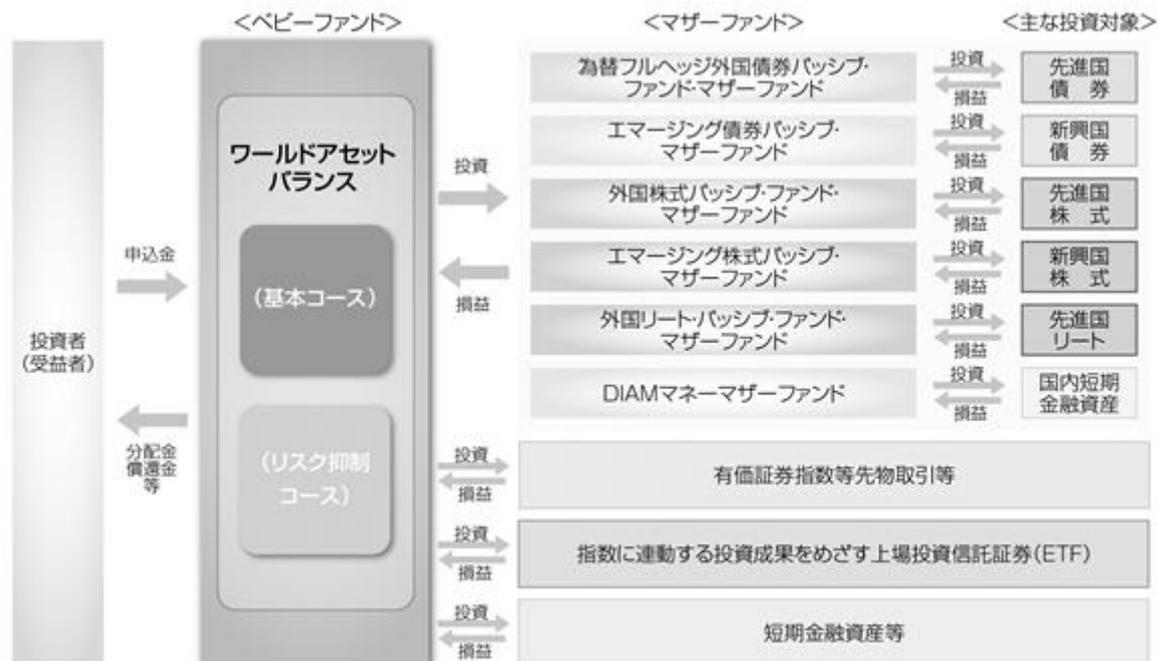
- ・ 「投資顧問契約」の概要

委託会社と投資顧問会社（みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社）との間においては、各ファンドの運用にかかる助言契約が締結されております。当該契約の内容は、投資顧問サービスの内容、助言の基本方針、運用の責任等について規定したものです。

「ファミリーファンド方式」とは

各ファンドは「ファミリーファンド方式」により運用を行います。

「ファミリーファンド方式」とは、複数のファンドを合同運用する仕組みで、投資者からの資金をまとめてベビーファンド（各ファンド）とし、その資金の全部または一部をマザーファンド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。



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29年12月29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29年12月29日現在）

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

1：A種種類株式（15,510株）を含みます。

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

ワールドアセットバランス（基本コース）

<基本方針>

この投資信託は、信託財産の成長を図ることを目的として、運用を行います。

<投資対象>

「外国株式パッシブ・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、「外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「エマージング株式パッシブ・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、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投資信託証券（ETF）を主要投資対象とします。なお、「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。

<投資態度>

以下のマザーファンド受益証券、指数に連動する投資成果をめざす上場投資信託証券（ETF）、有価証券指数等先物取引等への投資を通じて、海外の株式、債券、不動産投資信託証券に実質的に分散投資を行います。

- ・外国株式パッシブ・ファンド・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
 - ・外国リート・パッシブ・ファンド・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
 - ・エマージング債券パッシブ・マザーファンド
 - ・上記のほか、DIAMマネーマザーファンドや短期金融資産等に投資する場合があります。
- 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。

実質的な組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行い、為替変動リスクの低減をめざします。

一部の新興国通貨については代替通貨等により対円での為替取引を行う場合があります。

各資産への基本投資比率は、統計的手法により決定し、原則として年1回見直します。

経済環境、運用環境の大きな変化などにより委託会社が必要と判断した場合には、適宜、基本投資比率の見直しを行うことがあります。

「DIAMマネーマザーファンド」を除く5つのマザーファンドとETFおよび有価証券指数等先物取引等への投資比率は、原則として高位を保ちます。

各資産への投資比率の決定にあたっては、みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社の投資助言を活用します。

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。

ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)

<基本方針>

この投資信託は、信託財産の成長を図ることを目的として、運用を行います。

<投資対象>

「外国株式パッシブ・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、「外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「エマージング株式パッシブ・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、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投資信託証券(ETF)を主要投資対象とします。なお、「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。

<投資態度>

以下のマザーファンド受益証券、指数に連動する投資成果をめざす上場投資信託証券(ETF)、有価証券指数等先物取引等への投資を通じて、海外の株式、債券、不動産投資信託証券に実質的に分散投資を行います。

- ・外国株式パッシブ・ファンド・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
 - ・外国リート・パッシブ・ファンド・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
 - ・エマージング債券パッシブ・マザーファンド
 - ・上記のほか、DIAMマネーマザーファンドや短期金融資産等に投資する場合があります。
- 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。

実質的な組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行い、為替変動リスクの低減をめざします。

一部の新興国通貨については代替通貨等により対円での為替取引を行う場合があります。

各資産への基本投資比率は、統計的手法により決定し、原則として年1回見直します。

経済環境、運用環境の大きな変化などにより委託会社が必要と判断した場合には、適宜、基本投資比率の見直しを行うことがあります。

基準価額の下落を一定水準(下値目安値^(*))までに抑えることを目標に、基準価額の水準や市場環境等に応じて投資対象資産の合計資産比率^(**)を機動的に変更します。下値目安値は、毎営業日、委託会社の判断により過去12ヵ月間の基準価額の最高値から一定の水準に設定します。ただし、当該水準は委託会社の判断により今後変更する場合があります。

(*) 基準価額が下値目安値を下回らないことを委託会社が保証等するものではありません(相場急落の場合などには、基準価額が下値目安値を下回る場合があります。)

(**) 合計資産比率とは、「DIAMマネーマザーファンド」を除く5つのマザーファンドとETFおよび有価証券指数等先物取引等への投資比率の合計をいいます。

各資産への投資比率の決定にあたっては、みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社の投資助言を活用します。

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。

a. 次に掲げる特定資産(「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項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す。)

ハ. 金銭債権

ニ. 約束手形

b. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

運用の指図範囲等(約款第17条第1項)

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

1. 株券または新株引受権証券

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、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

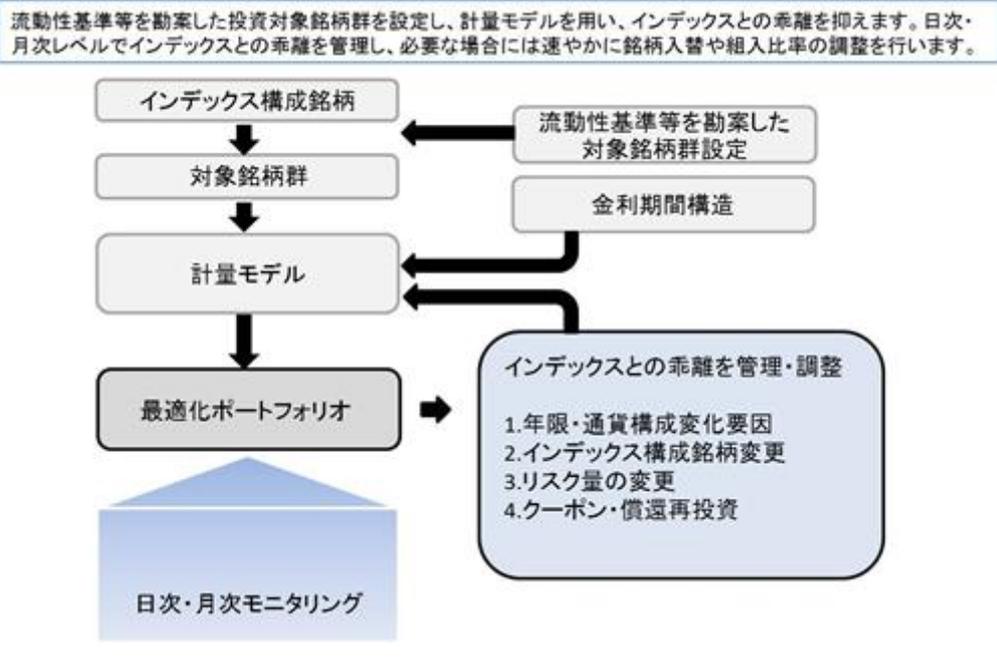
なお、1.の証券または証書、13.および18.の証券または証書のうち1.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、2.から7.までの証券ならびに13.および18.の証券または証書のうち2.から7.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、14.の証券および15.の証券を以下「投資信託証券」といいます。

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）各ファンドが投資対象とするマザーファンドの概要

ファンド名	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	<p>1.主に日本を除く世界主要国の公社債に投資し、「FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジあり）」に連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>2.外国債券への投資は原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</p> <p>3.外貨建資産の為替リスクは原則フルヘッジとします。</p>
	<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>
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] --> B[対象銘柄群] B --> C[計量モデル] C --> D[最適化ポートフォリオ] D --> E[日次・月次モニタリング] F[流動性基準等を勘案した対象銘柄群設定] --> B G[金利期間構造] --> C D --> H[インデックスとの乖離を管理・調整] H --> C subgraph H [インデックスとの乖離を管理・調整] H1[1.年限・通貨構成変化要因] H2[2.インデックス構成銘柄変更] H3[3.リスク量の変更] H4[4.クーポン・償還再投資] end </pre>

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

ファンド名	エマージング債券パッシブ・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、主として新興国の債券に投資し、JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス(円換算ベース・為替ヘッジなし)の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。
主な投資対象	新興国の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	<ol style="list-style-type: none"> 1. 主として新興国の債券に投資し、JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス(円換算ベース・為替ヘッジなし)の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。 2. 原則として、新興国の債券の組入比率は高位を維持します。 3. 組入債券は、当初組入時において、S&PもしくはMoody'sの外貨建て長期格付がBB-格もしくはBa3格以上を取得している債券とします。ただし、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満となった場合は、当該債券を速やかに売却するものとします。 4. 外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。 <div style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin-top: 10px;"> <p>JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラスに関する著作権等の知的財産その他一切の権利はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。</p> </div>

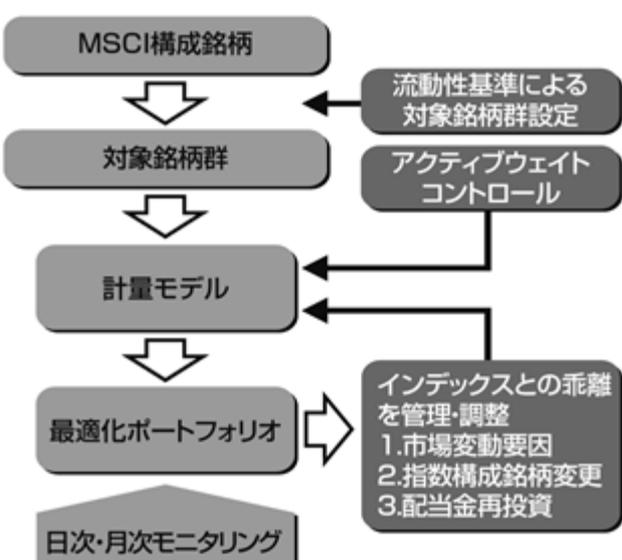
運用プロセス	<p>信用格付基準等を勘案した投資対象銘柄群を設定し、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。</p>
主な投資制限	<ol style="list-style-type: none"> 1. 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 2. 外貨建資産への投資には、制限を設けません。 3. 投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 4. デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金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

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

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

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

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

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

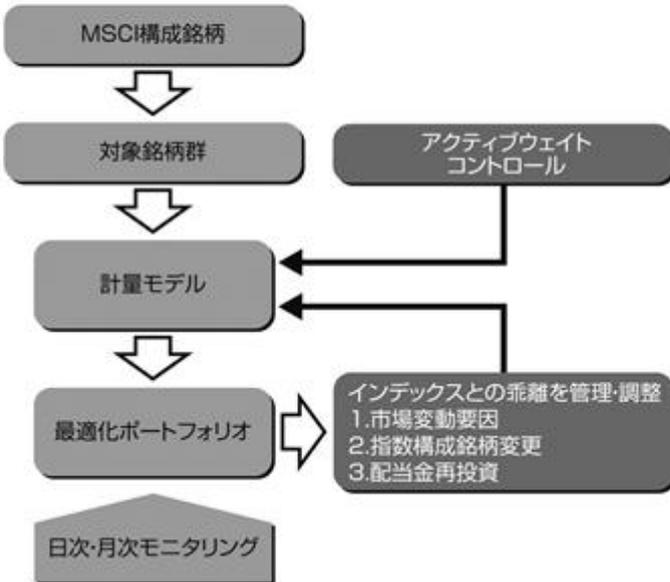
主な投資制限	<ol style="list-style-type: none"> 1. 株式への投資割合には、制限を設けません。 2. 新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において、原則として信託財産の純資産総額の20%以下とします。 3. 同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、原則として信託財産の純資産総額の10%以下とします。 4. 外貨建資産への投資には、制限を設けません。 5. デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます。)は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有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

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

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

本ファンドは、MSCI Inc. (以下、「MSCI」といいます。)、MSCI の関連会社、情報提供者その他MSCI指数の編集、計算または作成に関与または関係した第三者(以下、総称して「MSCI関係者」といいます。)によって保証、推奨、販売、または宣伝されるものではありません。MSCI指数は、MSCIの独占的財産です。MSCIおよびMSCI指数の名称は、MSCIまたはその関連会社のサービスマークであり、委託会社による特定の目的のために使用が許諾されています。MSCI関係者は、本ファンドの発行者もしくは所有者、またはその他の者もしくは団体に対して、ファンド全般もしくは本ファンド自体への投資に関する適否あるいは一般的な株式市場のパフォーマンスをトラックするMSCI 指数の能力に関して、明示的であると黙示的であるとを問わず、一切の表明または保証を行いません。MSCIまたはその関連会社は、特定のトレードマーク、サービスマークおよびトレードネーム、ならびに、本ファンドまたは本ファンドの発行会社、所有者、その他の者もしくは団体に関りなく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

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

ファンド名	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド
-------	-------------------------

基本方針	この投資信託は、S & P 先進国 REIT インデックス(除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)に連動する投資成果をめざして運用を行います。
主な投資対象	日本を除く世界各国の不動産投資信託証券(*)を主要投資対象とします。 (*) 海外の証券取引所に上場(これに準ずるものを含みます。)されている不動産投資信託証券とします。

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

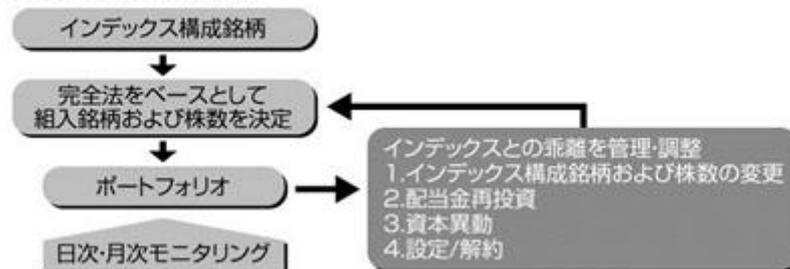
S & P 先進国 R E I T インデックスは、S&P Globalの一部門である S&P ダウ・ジョーンズ・インデックス LLC またはその関連会社 (「SPDJ」) の商品であり、これを利用するライセンスが委託会社に付与されています。Standard & Poor's および S&P は、S&P Global の一部門であるスタンダード & プアーズ・ファイナンシャル・サービシーズ LLC (「S&P」) の登録商標で、Dow Jones は、ダウ・ジョーンズ・トレードマーク・ホールディングズ LLC (「Dow Jones」) の登録商標です。指数に直接投資することはできません。本商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

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

は責任も負わないものとしします。S&P DOW JONES INDICESは、明示的または黙示的を問わず、いかなる保証もせず、商品性、特定の目的または使用への適合性、もしくはS & P 先進国 R E I Tインデックスを使用することによって、またはそれに関連するデータに関して、委託会社、本商品の所有者、またはその他の人物や組織が得られる結果について、一切の保証を明示的に否認します。上記を制限することなく、いかなる場合においても、S&P DOW JONES INDICESは、利益の逸失、営業損失、時間または信用の喪失を含むがこれらに限定されない、間接的、特別、懲罰的、または派生的損害に対して、たとえその可能性について知らされていたとしても、契約の記述、不法行為、または厳格責任の有無を問わず、一切の責任を負わないものとしします。S&P DOW JONES INDICESのライセンサーを除き、S&P DOW JONES INDICESと委託会社との間の契約または取り決めの第三者受益者は存在しません。

運用プロセス

ポートフォリオの構築にあたっては、原則としてインデックスである「S&P先進国REITインデックス(除く日本)」を構成する全ての銘柄を、その時価構成比で組み入れることをめざします。インデックスに対する運動性を随時確認し、必要に応じてポートフォリオのリバランスを実施します。



主な投資制限	<ol style="list-style-type: none"> 1.投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 2.外貨建資産への投資割合には制限を設けません。 3.株式への直接投資は行いません。 4.同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として信託財産の純資産総額の30%以内とします。ただし、S & P 先進国 REITインデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）における時価の構成割合が30%を超える不動産投資信託証券がある場合には、指数との連動性を維持するために当該不動産投資信託証券をS & P 先進国 REITインデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）の構成割合の範囲で組入れることができるものとします。 5.デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 6.外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。 7.一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
--------	--

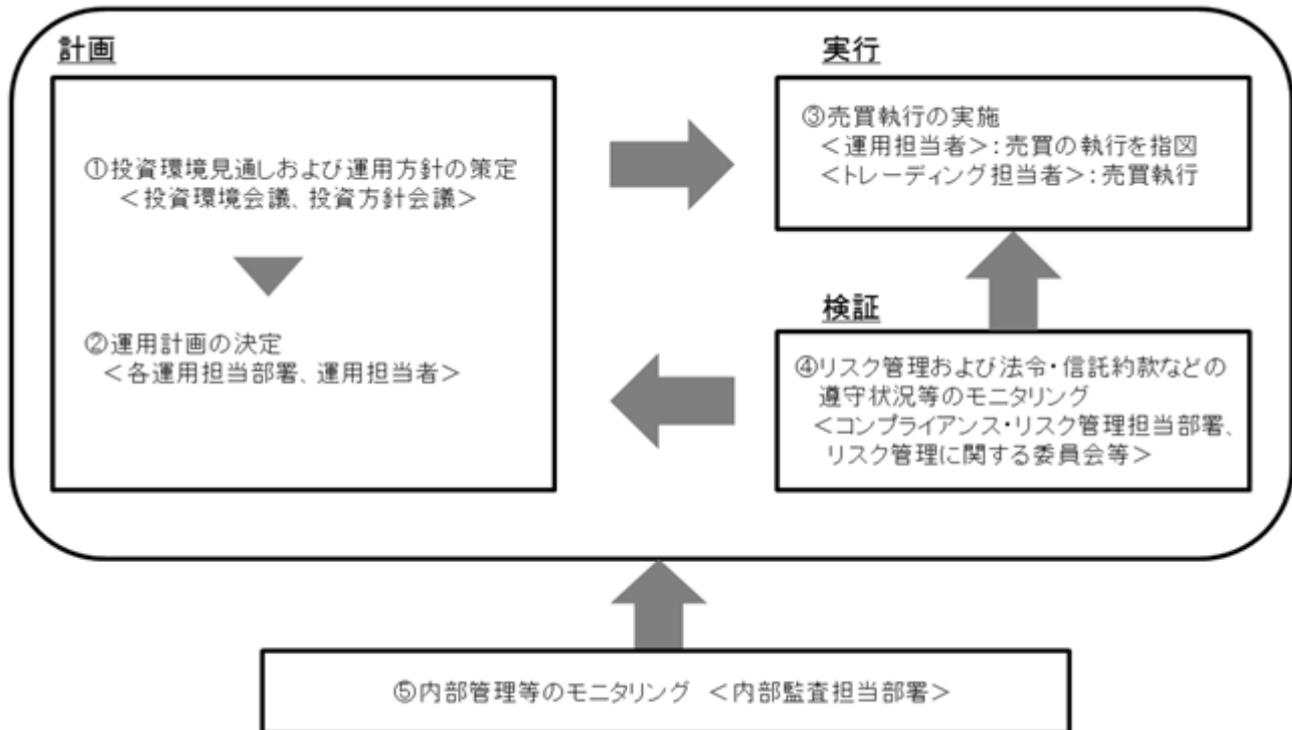
ファンド名	DIAMマネーマザーファンド
基本方針	この投資信託は、安定した収益の確保をめざします。
主な投資対象	国内発行体の公社債、転換社債、ユーロ円債、資産担保証券ならびにCD、CP、コールローン等の国内短期金融資産を主要投資対象とします。
投資態度	<ol style="list-style-type: none"> 1.国内の国債、政府保証債、政府機関債、地方債等のほか、取得時において主要格付機関^(*)の長期発行体格付（複数の格付機関が付与している場合は高い方の格付）がAA-格相当以上の社債、転換社債、ユーロ円債、資産担保証券、さらに、国内格付機関の短期格付がa-1格相当以上のCD、CPを主要投資対象とします。 (*)主要格付機関とは、R&I、JCR、Moody's、S&Pとします。 2.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。 3.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。
運用プロセス	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張等を予測し、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）。

主な投資制限	<ol style="list-style-type: none">1. 株式への投資割合は、純資産総額の10%以下とします。2. 同一銘柄の株式への投資は、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。3. 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。4. 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。5. 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。6. 外貨建て資産への投資は行いません。7. 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。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。
--------	--

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29年12月29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6月、12月の各11日。休業日の場合は翌営業日。）に、原則として次のとおり収益分配を行う方針です。

(1) 分配対象額の範囲

経費控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。

(2) 分配対象額についての分配方針

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

(3) 留保益の運用方針

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

収益の分配方式

(1) 信託財産から生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)に、原則として決算日から起算して5営業日までにお支払いを開始します。

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

(5) 【投資制限】

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

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)

同一銘柄の上場投資信託証券への実質投資割合は、当該上場投資信託証券が一般社団法人投資信託協会規則に定めるエクスポージャーがルックスルーできる場合に該当しないときは、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。(約款「運用の基本方針」2.運用方法(3)投資制限)

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

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

投資する株式等の範囲(約款第20条)

- 1) 委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所に準ずる市場におい

て取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。

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

信用取引の指図範囲(約款第21条)

- 1)委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引き渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
- 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 運用の指図範囲等の1.~4.に掲げる金融商品で運用している額(以下「金融商品運用額」といいます。)とマザーファンドが限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに金融商品運用額のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占めるマザーファンドが限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに金融商品運用額の割合を乗じて得た額をいいます。)の合計額の範囲内とします。

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

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

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

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

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

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

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

るヘッジ対象金利商品の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。)の合計額の範囲内とします。

2. 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに上記(2)投資対象運用の指図範囲等の1.~4.に掲げる金融商品で運用している額(以下2.において「金融商品運用額等」といいます。)とマザーファンドが限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに金融商品運用額のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占めるマザーファンドが限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに金融商品運用額の割合を乗じて得た額をいいます。)との合計額の範囲内とします。ただし、ヘッジ対象金利商品が外貨建て、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ます。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 3) スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。以下3)において同じ。)が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、当該純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の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ます。
- 4) 上記3)においてマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

- 5)スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- 6)委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供または受入れが必要と認めるときは、担保の提供または受入れの指図を行うものとします。

金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図(約款第24条)

- 1)委託会社は、信託財産に属する資産の価格変動リスクや為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。
- 2)金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 3)金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(「金利先渡取引の想定元本の合計額」といいます。以下3)において同じ。)が、信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額とマザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(「ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額」といいます。以下3)において同じ。)を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額が減少して、金利先渡取引の想定元本の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28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29条)

1) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、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35条)

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

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

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

3【投資リスク】

< 基準価額の主な変動要因 >

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

また、投資信託は預貯金と異なります。

・資産配分リスク

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。

リスク抑制コースでは、現金等の保有比率を増加させることにより、基準価額の下落リスクの低減をめざして運用を行います。当手法が効果的に機能しない場合等により、基準価額の下落リスクを低減できない場合や、市場全体の上昇に追従できない場合があります。

・株価変動リスク

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。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。

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

・為替リスク

ファンドは、実質組入外貨建資産については原則として対円で為替ヘッジを行い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、実質組入資産の直接ヘッジのほか、一部の新興国通貨については代替通貨を用いた為替ヘッジを行う場合があります。代替通貨を用いた為替ヘッジの場合、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、代替通貨と一部の新興国通貨間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および代替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

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

・流動性リスク

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

・カントリーリスク

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

基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

<その他の留意点>

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

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。

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

（基本コース）（リスク抑制コース）の2つのファンド間でスイッチングを行うことができます。ただし、販売会社によっては、スイッチングの取扱いを行わない場合があります。くわしくは販売会社にお問い合わせください。

リスク抑制コースでは、過去12ヵ月間の基準価額の最高値をもとに下値目安値を毎営業日決定し、合計資産比率を調整します。そのため、基準価額は、長期的に15%以上下落する場合があります。また、相場急変時等においては、基準価額が下値目安値を下回る場合もあります。したがって、損失が常に一定範囲に限定されるわけではないことにご留意ください。

基準価額の水準が下値目安値に近づいた場合等では、下値目安値を意識した資産配分(組入比率)をめざすため、投資対象資産の合計資産比率の引上げについては機動的に行えない場合があります。

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

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

各ファンドは、信託契約を解約することが受益者のために有利であると認める場合、各ファンドにおいて受益権口数が10億口を下回ることとなった場合、その他やむを得ない事情が発生した場合は、当初定められていた信託期間の途中でも信託を終了(繰上償還)する場合があります。

注意事項

イ. ファンドは、実質的に債券、株式、不動産投資信託証券(リート)などの値動きのある有価証券(外貨建資産には為替リスクもあります。)に投資しますので、基準価額は変動します。

ロ. 投資信託は、預金等や保険契約ではありません。また、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。加えて、証券会社を通して購入していない場合には投資者保護基金の対象にもなりません。

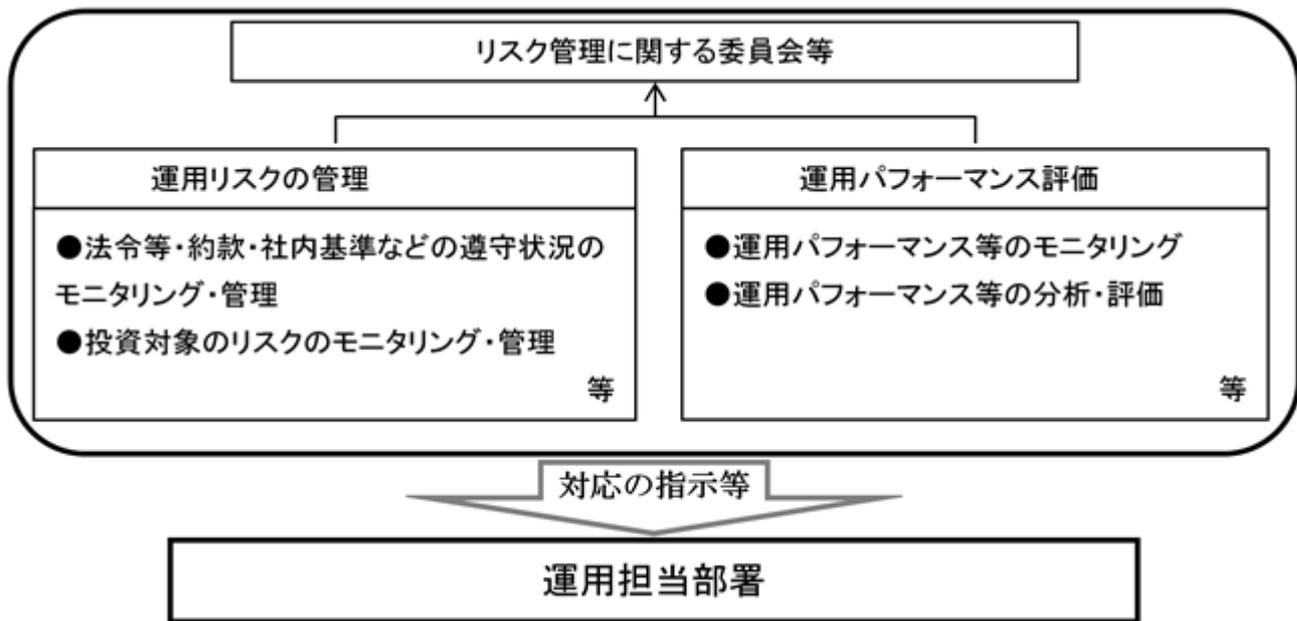
ハ. 投資信託は、購入金額について元本保証および利回り保証のいずれもありません。

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

< リスク管理体制 >

委託会社における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29年12月29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

(基本コース)



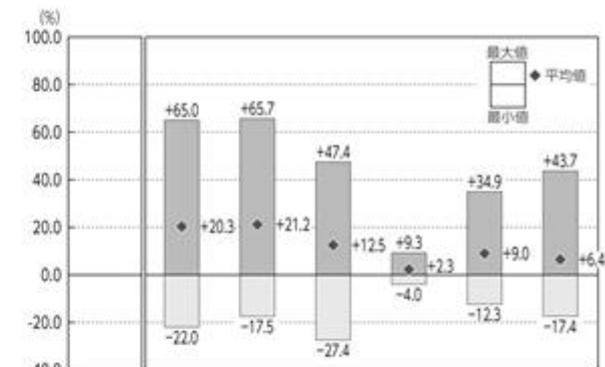
(リスク抑制コース)



*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。

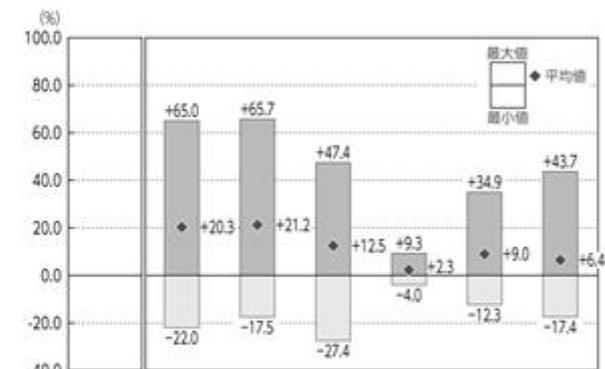
*ファンドは2017年12月末現在、設定後1年を経過していないため、年間騰落率はありません。

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12月末現在、設定後1年を経過していないため、データはありません。

代表的な資産クラス:2013年1月～2017年12月



ファンド:2017年12月末現在、設定後1年を経過していないため、データはありません。

代表的な資産クラス:2013年1月～2017年12月

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

*全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

*各資産クラスの指数

日本株… 東証株価指数(TOPIX) (配当込み)
先進国株… MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)
新興国株… MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)
(注)海外の指数は為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

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

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

●「MSCIコクサイ・インデックス」は、MSCI Inc.が開発した株債指数で、日本を除く世界の主要先進国の株債指数を、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.が開発した株債指数で、新興国の株債指数を、各国の株式時価総額をベースに合成したものです。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

●「NOMURA-BPI国債」は、野村證券株式会社が国内で発行された公募利付国債の市場全体の動向を表すために開発した投資収益指数です。同指数の知的財産権その他一切の権利は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。

●「FTSE世界国債インデックス(除く日本)」は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。

●「JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースィファイド」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2.16%（税抜2.00%）を上限に各販売会社が定める手数料率を乗じて得た額とします。

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

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

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

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

(2)【換金（解約）手数料】

ありません。

(3)【信託報酬等】

各ファンドの日々の純資産総額に対して年率1.2204%（税抜1.13%）

支払先	内訳（税抜）	主な役務
委託会社	年率0.55%	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0.55%	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。

委託会社の信託報酬には、各ファンドの投資顧問会社（みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社）に対する投資顧問報酬が含まれます。

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

(4)【その他の手数料等】

1. 信託財産留保額

ありません。

2. その他の費用

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

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

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

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

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

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

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

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

(5) 【課税上の取扱い】

各ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

個人の受益者に対する課税

収益分配時

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

詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

解約時および償還時

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

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

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

損益通算について

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

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

NISAおよびジュニアNISAは、上場株式や公募株式投資信託などにかかる非課税制度です。毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が一定期間非課税となります。ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。なお、同非課税口座内で少額上場株式等にかかる譲渡損失が生じた場合には、課税上譲渡損失はないものとみなされ、他の口座の上場株式等の譲渡益および上場株式等の配当所得等の金額との損益通算を行うことはできませんので、ご注意ください。

法人の受益者に対する課税

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

なお、益金不算入制度の適用はありません。

上記は、平成29年12月末現在のものです。税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。

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

個別元本方式について

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

< 個別元本について >

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

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

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

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

< 収益分配金の課税について >

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

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

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

税法が改正された場合等は、上記内容が変更になることがあります。

5【運用状況】

(1)【投資状況】

ワールドアセットバランス（基本コース）

平成29年12月29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	36,114,687	0.25
内 アメリカ	36,114,687	0.25
親投資信託受益証券	13,648,853,619	95.40
内 日本	13,648,853,619	95.40
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	622,558,220	4.35
純資産総額	14,307,526,526	100.00

その他資産の投資状況

平成29年12月29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）	6,800,926,300	47.53
-	6,800,926,300	47.53

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

（注3）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。

ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）

平成29年12月29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	55,665,495	0.11
内 アメリカ	55,665,495	0.11
親投資信託受益証券	49,523,051,118	95.55
内 日本	49,523,051,118	95.55
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	2,251,650,189	4.34
純資産総額	51,830,366,802	100.00

その他資産の投資状況

平成29年12月29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）	24,576,054,600	47.42
-	24,576,054,600	47.42

（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)

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成29年12月29日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	290,127,261,677	94.70
内 アメリカ	179,381,636,697	58.55
内 イギリス	20,193,565,072	6.59
内 ドイツ	11,930,223,539	3.89
内 カナダ	11,673,633,560	3.81
内 フランス	11,619,070,768	3.79
内 スイス	10,659,221,949	3.48
内 オーストラリア	7,566,828,673	2.47
内 オランダ	5,839,880,301	1.91
内 アイルランド	4,159,554,097	1.36
内 スペイン	3,880,586,963	1.27
内 スウェーデン	3,235,912,598	1.06
内 香港	2,858,937,559	0.93
内 シンガポール	2,365,859,314	0.77
内 イタリア	2,345,967,047	0.77
内 デンマーク	2,209,054,912	0.72
内 ジャージー	1,662,196,965	0.54
内 バミューダ	1,339,389,878	0.44
内 ベルギー	1,337,505,484	0.44
内 フィンランド	1,132,798,244	0.37
内 ケイマン諸島	899,368,890	0.29
内 ノルウェー	768,209,999	0.25
内 オランダ領キュラソー	765,316,700	0.25
内 イスラエル	574,722,481	0.19
内 ルクセンブルグ	425,613,280	0.14
内 オーストリア	331,636,133	0.11
内 ニュージーランド	201,330,165	0.07
内 ポルトガル	196,353,711	0.06
内 パナマ	187,174,971	0.06
内 リベリア	167,915,495	0.05
内 イギリス領バージン諸島	85,620,851	0.03
内 パプアニューギニア	64,450,242	0.02
内 マン島	46,087,943	0.02
内 モーリシャス	21,637,196	0.01
投資信託受益証券	820,441,135	0.27
内 オーストラリア	703,756,120	0.23
内 シンガポール	116,685,015	0.04
投資証券	6,614,774,059	2.16
内 アメリカ	5,737,061,798	1.87
内 フランス	420,845,111	0.14
内 イギリス	235,238,688	0.08
内 香港	172,350,909	0.06
内 カナダ	49,277,553	0.02
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	8,808,167,080	2.88

純資産総額	306,370,643,951	100.00
-------	-----------------	--------

その他資産の投資状況

平成29年12月29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)	96,393,230	0.03
-	96,393,230	0.03
株価指数先物取引(買建)	8,697,538,732	2.84
内 アメリカ	5,902,875,637	1.93
内 ドイツ	1,604,722,672	0.52
内 イギリス	632,309,535	0.21
内 カナダ	344,400,560	0.11
内 オーストラリア	213,230,328	0.07

(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29年12月29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	6,326,851,902	11.41
内 オーストラリア	4,458,808,363	8.04
内 シンガポール	1,847,729,771	3.33
内 カナダ	20,313,768	0.04
投資証券	48,632,377,745	87.73
内 アメリカ	38,775,734,927	69.95
内 イギリス	3,043,275,056	5.49
内 フランス	2,603,025,295	4.70
内 香港	1,142,172,909	2.06
内 カナダ	1,021,619,409	1.84
内 スペイン	569,450,912	1.03
内 ベルギー	397,913,321	0.72
内 オランダ	262,637,485	0.47
内 ニュージーランド	243,775,078	0.44
内 アイルランド	146,781,507	0.26
内 ドイツ	135,026,516	0.24
内 シンガポール	121,794,178	0.22
内 イタリア	64,041,187	0.12
内 ガーンジー	39,892,426	0.07
内 イスラエル	33,791,706	0.06
内 マン島	31,445,833	0.06
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	471,876,764	0.85
純資産総額	55,431,106,411	100.00

その他資産の投資状況

平成29年12月29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）	101,361,200	0.18
-	101,361,200	0.18

（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29年12月29日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	247,456,100,639	98.03
内 アメリカ	106,491,263,575	42.19
内 フランス	25,692,467,798	10.18
内 イタリア	24,924,965,012	9.87
内 ドイツ	18,332,032,379	7.26
内 イギリス	17,685,642,003	7.01
内 スペイン	14,467,928,598	5.73
内 ベルギー	6,436,189,719	2.55
内 オランダ	5,555,965,385	2.20
内 オーストラリア	5,391,099,906	2.14
内 カナダ	5,350,379,161	2.12
内 オーストリア	3,950,575,555	1.57
内 アイルランド	1,921,823,150	0.76
内 メキシコ	1,811,200,621	0.72
内 ポーランド	1,527,401,256	0.61
内 フィンランド	1,503,017,673	0.60
内 デンマーク	1,452,759,228	0.58
内 南アフリカ	1,434,932,190	0.57
内 スウェーデン	1,036,849,556	0.41
内 マレーシア	1,020,388,115	0.40
内 シンガポール	888,848,661	0.35
内 ノルウェー	580,371,098	0.23
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	4,962,078,992	1.97
純資産総額	252,418,179,631	100.00

その他資産の投資状況

平成29年12月29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）	249,879,065,814	98.99
-	249,879,065,814	98.99

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

（注3）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29年12月29日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	55,242,257,415	90.11
内 ケイマン諸島	8,902,372,823	14.52
内 韓国	8,619,666,611	14.06
内 台湾	6,134,022,783	10.01
内 中国	5,339,029,886	8.71
内 インド	4,868,385,209	7.94
内 ブラジル	3,793,842,239	6.19
内 南アフリカ	3,760,015,612	6.13
内 ロシア	1,895,724,242	3.09
内 香港	1,828,024,003	2.98
内 マレーシア	1,293,316,017	2.11
内 メキシコ	1,279,055,268	2.09
内 タイ	1,260,094,308	2.06
内 インドネシア	1,259,542,545	2.05
内 ポーランド	730,313,788	1.19
内 チリ	696,953,289	1.14
内 フィリピン	626,891,980	1.02
内 パミュダ	583,142,588	0.95
内 トルコ	579,919,577	0.95
内 アラブ首長国連邦	360,440,681	0.59
内 カタール	311,993,076	0.51
内 コロンビア	222,855,653	0.36
内 アメリカ	199,006,831	0.32
内 ハンガリー	183,541,504	0.30
内 ギリシャ	182,164,902	0.30
内 チェコ	94,844,442	0.15
内 マン島	70,727,853	0.12
内 エジプト	58,365,454	0.10
内 パキスタン	40,143,132	0.07
内 ペルー	33,340,650	0.05
内 マルタ	13,730,867	0.02
内 オランダ	11,396,010	0.02
内 ルクセンブルグ	9,393,592	0.02
投資信託受益証券	288,284,073	0.47
内 メキシコ	288,284,073	0.47
投資証券	119,232,484	0.19
内 南アフリカ	64,668,145	0.11
内 メキシコ	40,745,619	0.07
内 トルコ	13,818,720	0.02
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	5,657,211,608	9.23
純資産総額	61,306,985,580	100.00

その他資産の投資状況

平成29年12月29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）	37,273,500	0.06
-	37,273,500	0.06
株価指数先物取引（買建）	5,667,446,070	9.24
内 アメリカ	5,667,446,070	9.24

（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。

（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29年12月29日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	97,958,566,939	94.70
内 トルコ	14,630,737,828	14.14
内 メキシコ	13,346,732,275	12.90
内 インドネシア	10,803,479,695	10.44
内 ブラジル	9,673,244,090	9.35
内 コロンビア	9,607,491,198	9.29
内 ロシア	9,078,043,587	8.78
内 フィリピン	7,237,274,388	7.00
内 ハンガリー	4,780,904,570	4.62
内 パナマ	4,587,188,670	4.43
内 南アフリカ	4,572,476,861	4.42
内 ベルギー	4,364,421,600	4.22
内 クロアチア	2,942,871,543	2.85
内 ルーマニア	2,333,700,634	2.26
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	5,479,885,308	5.30
純資産総額	103,438,452,247	100.00

その他資産の投資状況

平成29年12月29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）	271,080,000	0.26
-	271,080,000	0.26

（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】

ワールドアセットバランス（基本コース）

平成29年12月29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	5,065,279,117	1.3453 6,814,792,511	1.3384 6,779,369,570	- -	47.38%
2	エマージング株式パッシブ・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	1,627,105,199	1.2342 2,008,199,540	1.2759 2,076,023,523	- -	14.51%
3	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	588,185,085	3.4777 2,045,589,989	3.5129 2,066,235,385	- -	14.44%
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	1,100,032,739	1.2382 1,362,110,242	1.2451 1,369,650,763	- -	9.57%
5	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	704,245,670	1.9341 1,362,135,267	1.9277 1,357,574,378	- -	9.49%
6	XTRACKERS MSCI EMERGING MARKETS HEDGED EQUITY ETF アメリカ	投資信託受益証券	13,300	2,674.71 35,573,643	2,715.39 36,114,687	- -	0.25%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成29年12月29日現在

種類	投資比率
投資信託受益証券	0.25%
親投資信託受益証券	95.40%
合計	95.65%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)

平成29年12月29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	18,375,568,620	1.3450 24,715,336,732	1.3384 24,593,861,041	- -	47.45%
2	エマージング株式パッシ ブ・マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	5,945,662,237	1.2349 7,342,613,844	1.2759 7,586,070,448	- -	14.64%
3	外国株式パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	2,127,633,416	3.4783 7,400,632,787	3.5129 7,474,163,427	- -	14.42%
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	3,981,636,776	1.2377 4,928,394,624	1.2451 4,957,535,949	- -	9.56%
5	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	2,547,813,588	1.9341 4,927,943,270	1.9277 4,911,420,253	- -	9.48%
6	XTRACKERS MSCI EMERGING MARKETS HEDGED EQUITY ETF アメリカ	投資信託受 益証券	20,500	2,674.71 54,831,555	2,715.39 55,665,495	- -	0.11%

(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29年12月29日現在

種類	投資比率
投資信託受益証券	0.11%
親投資信託受益証券	95.55%
合計	95.66%

(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)

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成29年12月29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	368,126	15,332.43 5,644,268,972	19,332.03 7,116,626,557	- -	2.32%
2	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフトウェア	521,379	7,329.58 3,821,489,583	9,686.35 5,050,264,690	- -	1.65%
3	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 インターネット販売・通信販売	29,076	95,164.80 2,767,011,857	134,029.29 3,897,035,926	- -	1.27%
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	168,961	15,303.50 2,585,695,955	20,104.95 3,396,954,146	- -	1.11%
5	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	250,678	10,128.84 2,539,078,774	12,180.26 3,053,325,723	- -	1.00%
6	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	191,449	13,201.60 2,527,434,159	15,883.27 3,040,838,072	- -	0.99%
7	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 石油・ガス・消耗燃料	300,424	9,326.59 2,801,931,888	9,494.25 2,852,303,566	- -	0.93%
8	ALPHABET INC-CL C アメリカ	株式 インターネットソフトウェア・サービス	22,444	93,175.09 2,091,221,942	118,439.81 2,658,263,320	- -	0.87%
9	ALPHABET INC-CL A アメリカ	株式 インターネットソフトウェア・サービス	21,134	95,423.57 2,016,681,744	119,322.34 2,521,758,544	- -	0.82%
10	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 銀行	719,642	2,719.63 1,957,161,221	3,367.39 2,423,322,470	- -	0.79%
11	WELLS FARGO & CO アメリカ	株式 銀行	334,953	6,530.95 2,187,563,955	6,926.89 2,320,185,935	- -	0.76%
12	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	221,279	8,466.81 1,873,529,110	9,687.09 2,143,550,473	- -	0.70%
13	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 各種金融サービス	90,365	18,922.79 1,709,958,006	22,550.27 2,037,756,052	- -	0.67%
14	AT&T INC アメリカ	株式 各種電気通信サービス	435,922	4,592.61 2,002,020,879	4,427.33 1,929,974,907	- -	0.63%
15	CHEVRON CORP アメリカ	株式 石油・ガス・消耗燃料	134,596	12,697.24 1,708,998,553	14,190.53 1,909,989,921	- -	0.62%

16	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品	181,559	9,942.08 1,805,074,434	10,403.90 1,888,923,495	- -	0.62%
17	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 専門小売り	83,442	16,007.19 1,335,672,136	21,445.13 1,789,425,371	- -	0.58%
18	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	69,757	18,586.65 1,296,549,288	25,173.00 1,755,993,658	- -	0.57%
19	VERIZON COMM INC アメリカ	株式 各種電気通信 サービス	290,013	5,454.93 1,582,001,586	6,037.58 1,750,979,588	- -	0.57%
20	INTEL CORP アメリカ	株式 半導体・半導 体製造装置	334,110	4,061.79 1,357,086,113	5,222.85 1,745,009,754	- -	0.57%
21	PFIZER INC アメリカ	株式 医薬品	423,943	3,704.66 1,570,564,815	4,109.80 1,742,325,180	- -	0.57%
22	VISA INC アメリカ	株式 情報技術サー ビス	130,002	9,851.93 1,280,771,813	12,921.54 1,679,827,343	- -	0.55%
23	HSBC HOLDINGS PLC イギリス	株式 銀行	1,445,842	1,063.81 1,538,101,928	1,158.46 1,674,959,953	- -	0.55%
24	CITIGROUP INC アメリカ	株式 銀行	193,450	6,786.57 1,312,863,791	8,484.04 1,641,237,538	- -	0.54%
25	CISCO SYSTEMS INC アメリカ	株式 通信機器	354,512	3,648.23 1,293,342,659	4,360.66 1,545,909,843	- -	0.50%
26	NOVARTIS AG-REG SHS スイス	株式 医薬品	160,610	8,694.05 1,396,352,885	9,548.54 1,533,591,330	- -	0.50%
27	COMCAST CORP-CL A アメリカ	株式 メディア	333,255	4,308.83 1,435,940,447	4,552.76 1,517,233,366	- -	0.50%
28	COCA-COLA CO/THE アメリカ	株式 飲料	289,171	4,591.79 1,327,813,078	5,166.35 1,493,961,487	- -	0.49%
29	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN スイス	株式 医薬品	50,677	27,452.15 1,391,192,771	28,564.80 1,447,578,572	- -	0.47%
30	PEPSICO INC アメリカ	株式 飲料	101,450	12,120.23 1,229,597,961	13,486.54 1,368,210,497	- -	0.45%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成29年12月29日現在

種類	投資比率
株式	94.70%
投資信託受益証券	0.27%
投資証券	2.16%
合計	97.12%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

平成29年12月29日現在

業種	国内/外国	投資比率
銀行	外国	9.49%
石油・ガス・消耗燃料		6.11%
医薬品		5.18%
保険		4.00%
ソフトウェア		3.88%
インターネットソフトウェア・サービス		3.16%
資本市場		3.00%
情報技術サービス		2.93%
半導体・半導体製造装置		2.82%
コンピュータ・周辺機器		2.66%
化学		2.64%
メディア		2.24%
各種電気通信サービス		2.14%
バイオテクノロジー		2.12%
航空宇宙・防衛		2.12%
ヘルスケア機器・用品		2.06%
飲料		2.01%
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス		1.91%
食品		1.88%
ホテル・レストラン・レジャー		1.82%
インターネット販売・通信販売		1.81%
電力		1.73%
機械		1.69%
食品・生活必需品小売り		1.67%
コングロマリット		1.63%
金属・鉱業		1.58%
専門小売り		1.57%
タバコ		1.30%
家庭用品		1.29%
繊維・アパレル・贅沢品		1.21%
自動車		1.03%
総合公益事業		1.02%
各種金融サービス		0.99%
陸運・鉄道		0.95%
通信機器		0.85%
電気設備		0.75%
パーソナル用品		0.70%
専門サービス		0.62%

航空貨物・物流サービス	0.60%
不動産管理・開発	0.56%
ライフサイエンス・ツール/サービス	0.56%
エネルギー設備・サービス	0.52%
消費者金融	0.52%
自動車部品	0.49%
家庭用耐久財	0.48%
電子装置・機器・部品	0.47%
建設関連製品	0.41%
複合小売り	0.39%
商業サービス・用品	0.37%
無線通信サービス	0.37%
建設・土木	0.34%
建設資材	0.34%
商社・流通業	0.33%
容器・包装	0.29%
運送インフラ	0.27%
旅客航空輸送業	0.15%
ガス	0.13%
紙製品・林産品	0.10%
販売	0.08%
海運業	0.07%
水道	0.07%
ヘルスケア・テクノロジー	0.07%
レジャー用品	0.06%
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.04%
各種消費者サービス	0.02%
貯蓄・抵当・不動産金融	0.01%
合計	94.70%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成29年12月29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	129,098	18,010.67 2,325,142,180	19,339.94 2,496,748,865	- -	4.50%
2	PROLOGIS INC アメリカ	投資証券	221,042	6,711.61 1,483,548,721	7,317.87 1,617,558,830	- -	2.92%
3	PUBLIC STORAGE アメリカ	投資証券	62,183	23,927.83 1,487,904,850	23,644.11 1,470,262,313	- -	2.65%
4	UNIBAIL-RODAMCO SE フランス	投資証券	41,273	30,574.34 1,261,895,097	28,573.54 1,179,315,922	- -	2.13%
5	AVALONBAY COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	57,379	21,663.14 1,243,009,736	20,179.53 1,157,881,825	- -	2.09%
6	EQUITY RESIDENTIAL アメリカ	投資証券	152,711	7,634.25 1,165,834,515	7,260.24 1,108,720,037	- -	2.00%
7	WELLTOWER INC アメリカ	投資証券	153,905	8,519.26 1,311,157,246	7,200.35 1,108,171,405	- -	2.00%
8	DIGITAL REALTY TRUST INC アメリカ	投資証券	85,376	13,341.46 1,139,040,962	12,885.38 1,100,103,056	- -	1.98%
9	VENTAS INC アメリカ	投資証券	148,015	7,842.66 1,160,832,038	6,828.58 1,010,733,748	- -	1.82%
10	LINK REIT 香港	投資証券	914,020	899.08 821,785,724	1,054.13 963,499,558	- -	1.74%
11	BOSTON PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	64,140	14,080.79 903,142,028	14,558.91 933,809,128	- -	1.68%
12	SCENTRE GROUP オーストラリア	投資信託受益 証券	2,213,604	365.52 809,119,667	372.07 823,632,020	- -	1.49%
13	REALTY INCOME CORP アメリカ	投資証券	117,155	6,304.19 738,567,928	6,454.55 756,183,976	- -	1.36%
14	ESSEX PROPERTY TRUST INC アメリカ	投資証券	27,456	29,777.70 817,576,802	27,222.82 747,430,020	- -	1.35%
15	HOST HOTELS & RESORTS INC アメリカ	投資証券	307,713	2,105.88 648,007,882	2,273.55 699,603,968	- -	1.26%
16	GGP INC アメリカ	投資証券	259,610	2,609.80 677,530,412	2,646.45 687,047,480	- -	1.24%
17	WESTFIELD CORP オーストラリア	投資信託受益 証券	795,054	733.99 583,564,632	837.61 665,949,156	- -	1.20%
18	VORNADO REALTY TRUST アメリカ	投資証券	71,703	8,504.23 609,779,250	8,821.90 632,557,412	- -	1.14%
19	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT アメリカ	投資証券	39,812	13,574.26 540,418,713	14,765.70 587,852,446	- -	1.06%
20	HCP INC アメリカ	投資証券	195,125	3,596.90 701,846,827	2,941.38 573,938,723	- -	1.04%
21	MID AMERICA アメリカ	投資証券	47,270	12,289.26 580,913,714	11,363.27 537,142,245	- -	0.97%
22	EXTRA SPACE STORAGE INC アメリカ	投資証券	52,385	8,894.49 465,938,311	9,916.87 519,495,758	- -	0.94%

23	IRON MOUNTAIN INC アメリカ	投資証券	117,098	4,024.00 471,203,101	4,291.73 502,554,170	- -	0.91%
24	GOODMAN GROUP オーストラリア	投資信託受益 証券	662,318	734.12 486,222,404	754.73 499,874,708	- -	0.90%
25	UDR INC アメリカ	投資証券	111,338	4,487.26 499,602,792	4,364.05 485,885,712	- -	0.88%
26	REGENCY CENTERS CORP アメリカ	投資証券	61,571	6,918.79 425,997,116	7,844.45 482,991,246	- -	0.87%
27	LAND SECURITIES GROUP PLC イギリス	投資証券	312,633	1,556.75 486,691,504	1,530.13 478,371,164	- -	0.86%
28	SL GREEN アメリカ	投資証券	40,892	11,888.14 486,129,873	11,405.08 466,376,940	- -	0.84%
29	FEDERAL REALTY INVS TRUST アメリカ	投資証券	30,192	14,090.48 425,419,815	15,097.92 455,836,702	- -	0.82%
30	DUKE REALTY TRUST アメリカ	投資証券	147,516	3,223.13 475,464,140	3,084.89 455,072,108	- -	0.82%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成29年12月29日現在

種類	投資比率
投資信託受益証券	11.41%
投資証券	87.73%
合計	99.15%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

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29年12月29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 1.625 08/15/22 アメリカ	国債証券	1,796,700,000	98.89 1,776,814,377	97.57 1,753,183,926	1.625000 2022/8/15	0.69%
2	US T N/B 1.75 05/15/22 アメリカ	国債証券	1,782,010,000	99.36 1,770,620,557	98.31 1,751,929,671	1.750000 2022/5/15	0.69%
3	US T N/B 1.75 09/30/22 アメリカ	国債証券	1,762,800,000	99.18 1,748,496,460	97.90 1,725,886,968	1.750000 2022/9/30	0.68%
4	US T N/B 3.625 02/15/20 アメリカ	国債証券	1,638,500,000	104.84 1,717,806,204	103.57 1,697,059,990	3.625000 2020/2/15	0.67%
5	US T N/B 1.375 10/31/20 アメリカ	国債証券	1,695,000,000	98.43 1,668,469,876	98.33 1,666,778,250	1.375000 2020/10/31	0.66%
6	US T N/B 2.625 08/15/20 アメリカ	国債証券	1,508,550,000	103.17 1,556,502,047	101.72 1,534,527,231	2.625000 2020/8/15	0.61%
7	US T N/B 2.25 01/31/24 アメリカ	国債証券	1,514,200,000	101.82 1,541,758,440	99.64 1,508,748,880	2.250000 2024/1/31	0.60%
8	US T N/B 1.125 12/31/19 アメリカ	国債証券	1,525,500,000	99.07 1,511,400,312	98.48 1,502,312,400	1.125000 2019/12/31	0.60%
9	US T N/B 0.875 09/15/19 アメリカ	国債証券	1,525,500,000	98.93 1,509,318,965	98.29 1,499,444,460	0.875000 2019/9/15	0.59%
10	US T N/B 1.375 05/31/20 アメリカ	国債証券	1,514,200,000	99.53 1,507,184,639	98.67 1,494,076,282	1.375000 2020/5/31	0.59%
11	US T N/B 1.875 03/31/22 アメリカ	国債証券	1,502,900,000	100.17 1,505,562,845	98.77 1,484,459,417	1.875000 2022/3/31	0.59%
12	US T N/B 1.5 06/15/20 アメリカ	国債証券	1,469,000,000	99.94 1,468,208,587	98.96 1,453,781,160	1.500000 2020/6/15	0.58%
13	US T N/B 2.125 08/31/20 アメリカ	国債証券	1,432,840,000	101.70 1,457,295,226	100.42 1,438,872,256	2.125000 2020/8/31	0.57%
14	US T N/B 2.0 09/30/20 アメリカ	国債証券	1,430,580,000	101.15 1,447,145,444	100.10 1,432,139,332	2.000000 2020/9/30	0.57%
15	US T N/B 1.75 05/15/23 アメリカ	国債証券	1,469,000,000	98.74 1,450,589,155	97.43 1,431,349,530	1.750000 2023/5/15	0.57%
16	US T N/B 2.0 07/31/20 アメリカ	国債証券	1,423,800,000	101.35 1,443,024,473	100.10 1,425,351,942	2.000000 2020/7/31	0.56%
17	US T N/B 2.75 02/15/24 アメリカ	国債証券	1,348,090,000	104.22 1,405,104,051	102.46 1,381,360,861	2.750000 2024/2/15	0.55%
18	US T N/B 2.375 12/31/20 アメリカ	国債証券	1,350,350,000	102.65 1,386,215,296	101.07 1,364,906,773	2.375000 2020/12/31	0.54%
19	US T N/B 2.625 11/15/20 アメリカ	国債証券	1,340,180,000	103.41 1,385,973,950	101.75 1,363,726,962	2.625000 2020/11/15	0.54%
20	US T N/B 2.125 12/31/21 アメリカ	国債証券	1,356,000,000	101.70 1,379,092,680	99.96 1,355,566,080	2.125000 2021/12/31	0.54%
21	US T N/B 2.25 03/31/21 アメリカ	国債証券	1,346,960,000	101.39 1,365,773,853	100.60 1,355,162,986	2.250000 2021/3/31	0.54%
22	US T N/B 1.375 01/31/21 アメリカ	国債証券	1,356,000,000	99.14 1,344,338,400	98.02 1,329,191,880	1.375000 2021/1/31	0.53%
23	US T N/B 1.25 01/31/19 アメリカ	国債証券	1,322,100,000	99.88 1,320,581,845	99.36 1,313,731,107	1.250000 2019/1/31	0.52%

24	US T N/B 2.75 11/15/23 アメリカ	国債証券	1,254,300,000	104.94 1,316,325,135	102.61 1,287,125,031	2.750000 2023/11/15	0.51%
25	US T N/B 1.25 11/30/18 アメリカ	国債証券	1,243,000,000	99.87 1,241,483,540	99.51 1,236,921,730	1.250000 2018/11/30	0.49%
26	US T N/B 2.5 05/15/24 アメリカ	国債証券	1,219,270,000	103.07 1,256,746,608	100.99 1,231,365,158	2.500000 2024/5/15	0.49%
27	US T N/B 0.75 07/15/19 アメリカ	国債証券	1,243,000,000	98.73 1,227,213,900	98.28 1,221,682,550	0.750000 2019/7/15	0.48%
28	US T N/B 1.125 03/31/20 アメリカ	国債証券	1,243,000,000	99.04 1,231,087,576	98.25 1,221,334,510	1.125000 2020/3/31	0.48%
29	US T N/B 1.125 08/31/21 アメリカ	国債証券	1,243,000,000	97.39 1,210,614,231	96.52 1,199,780,890	1.125000 2021/8/31	0.48%
30	US T N/B 2.0 06/30/24 アメリカ	国債証券	1,220,400,000	99.24 1,211,239,293	97.93 1,195,223,148	2.000000 2024/6/30	0.47%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成29年12月29日現在

種類	投資比率
国債証券	98.03%
合計	98.03%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資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29年12月29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	516,900	3,543.71 1,831,747,374	5,902.57 3,051,039,466	- -	4.98%
2	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD 韓国	株式 コンピュータ・周辺機器	8,837	227,689.82 2,012,095,023	270,597.59 2,391,270,991	- -	3.90%
3	ALIBABA GROUP HOLDING LTD- ADR ケイマン諸島	株式 インターネット ソフトウェア・サービス	104,580	13,598.19 1,422,099,185	19,469.90 2,036,162,142	- -	3.32%
4	TAIWAN SEMICONDUCTOR 台湾	株式 半導体・半導 体製造装置	2,239,083	728.15 1,630,388,932	856.53 1,917,864,152	- -	3.13%
5	NASPERS LTD 南アフリカ	株式 メディア	39,745	23,143.94 919,856,283	31,357.53 1,246,305,069	- -	2.03%
6	CHINA CONSTRUCTION BANK 中国	株式 銀行	7,625,530	91.44 697,335,861	103.67 790,601,224	- -	1.29%
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	24,900	20,551.16 511,724,086	26,525.62 660,487,938	- -	1.08%
8	CHINA MOBILE LIMITED 香港	株式 無線通信サー ビス	557,000	1,215.01 676,764,405	1,130.77 629,840,004	- -	1.03%
9	IND & COMM BK OF CHINA - H 中国	株式 銀行	6,680,235	74.46 497,415,409	91.38 610,487,971	- -	1.00%
10	PING AN INSURANCE GROUP CO-H 中国	株式 保険	471,000	647.59 305,015,690	1,179.93 555,749,856	- -	0.91%
11	HON HAI PRECISION INDUSTRY 台湾	株式 電子装置・機 器・部品	1,414,532	374.02 529,067,337	357.39 505,549,493	- -	0.82%
12	SBERBANK ADR ロシア	株式 銀行	250,760	1,263.87 316,928,850	1,909.70 478,876,372	- -	0.78%
13	SK HYNIX INC 韓国	株式 半導体・半導 体製造装置	52,740	5,662.95 298,664,160	8,124.30 428,475,582	- -	0.70%
14	ITAU UNIBANCO HOLDING SA ブラジル	株式 銀行	293,598	1,335.77 392,180,490	1,450.70 425,922,794	- -	0.69%
15	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP インド	株式 貯蓄・抵当・ 不動産金融	136,505	2,699.43 368,486,592	3,019.14 412,128,661	- -	0.67%

16	BANK OF CHINA LTD 中国	株式 銀行	7,173,200	54.23 389,032,683	55.09 395,190,238	- -	0.64%
17	VALE SA ブラジル	株式 金属・鉱業	286,321	983.56 281,616,652	1,371.65 392,734,547	- -	0.64%
18	RELIANCE INDUSTRIES LTD インド	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	235,083	1,264.93 297,365,099	1,645.07 386,729,401	- -	0.63%
19	SAMSUNG ELECTRONICS-PFD 韓国	株式 コンピュー タ・周辺機器	1,583	175,925.77 278,490,495	221,958.00 351,359,514	- -	0.57%
20	BANCO BRADESCO SA PREF ブラジル	株式 銀行	277,596	1,017.78 282,531,710	1,153.26 320,143,000	- -	0.52%
21	AMBEV SA ブラジル	株式 飲料	425,095	628.10 267,005,102	725.00 308,197,955	- -	0.50%
22	INFOSYS LTD インド	株式 情報技術サー ビス	164,519	1,650.56 271,549,482	1,839.18 302,580,877	- -	0.49%
23	AMERICA MOVIL SAB DE CV メキシコ	株式 無線通信サー ビス	3,043,478	79.75 242,729,766	97.46 296,633,191	- -	0.48%
24	NETEASE INC-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	7,200	30,334.74 218,410,132	39,544.35 284,719,320	- -	0.46%
25	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	59,000	3,827.61 225,829,139	4,704.19 277,547,210	- -	0.45%
26	LUKOIL SPON ADR ロシア	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	40,294	5,813.17 234,236,153	6,494.10 261,673,668	- -	0.43%
27	CNOOC LTD 香港	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	1,594,000	136.25 217,192,110	163.39 260,456,412	- -	0.42%
28	GAZPROM PAO ADR ロシア	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	504,750	489.02 246,833,281	504.99 254,897,235	- -	0.42%
29	KB FINANCIAL GROUP INC 韓国	株式 銀行	35,627	5,452.66 194,261,919	6,733.07 239,879,441	- -	0.39%
30	CHINA LIFE INSURANCE CO LTD 中国	株式 保険	668,000	335.61 224,193,163	354.27 236,652,360	- -	0.39%

(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29年12月29日現在

種類	投資比率
株式	90.11%
投資信託受益証券	0.47%
投資証券	0.19%
合計	90.77%

（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。

投資株式の業種別投資比率

平成29年12月29日現在

業種	国内/外国	投資比率
銀行	外国	14.63%
インターネットソフトウェア・サービス		10.79%
石油・ガス・消耗燃料		6.09%
コンピュータ・周辺機器		5.36%
半導体・半導体製造装置		5.01%
保険		3.37%
金属・鉱業		3.07%
無線通信サービス		3.03%
メディア		2.40%
電子装置・機器・部品		2.35%
自動車		2.28%
不動産管理・開発		2.16%
化学		2.15%
食品・生活必需品小売り		1.57%
コングロマリット		1.51%
食品		1.50%
情報技術サービス		1.44%
医薬品		1.37%
各種電気通信サービス		1.31%
各種金融サービス		1.15%
資本市場		1.05%
電力		0.95%
運送インフラ		0.90%
飲料		0.90%
貯蓄・抵当・不動産金融		0.83%
インターネット販売・通信販売		0.82%
建設資材		0.82%
パーソナル用品		0.75%
自動車部品		0.68%
ホテル・レストラン・レジャー		0.62%
機械		0.60%
建設・土木		0.60%
タバコ		0.58%
複合小売り		0.55%
繊維・アパレル・贅沢品		0.51%
各種消費者サービス		0.48%
ガス		0.46%
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス		0.46%

独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.45%
バイオテクノロジー	0.44%
家庭用耐久財	0.42%
専門小売り	0.39%
家庭用品	0.38%
紙製品・林産品	0.38%
旅客航空輸送業	0.25%
ソフトウェア	0.25%
水道	0.23%
エクイティ不動産投資信託(REITs)	0.23%
消費者金融	0.21%
陸運・鉄道	0.20%
航空宇宙・防衛	0.19%
電気設備	0.17%
商業サービス・用品	0.10%
ライフサイエンス・ツール/サービス	0.10%
海運業	0.08%
通信機器	0.07%
エネルギー設備・サービス	0.06%
容器・包装	0.05%
総合公益事業	0.05%
販売	0.05%
ヘルスケア機器・用品	0.05%
商社・流通業	0.04%
航空貨物・物流サービス	0.04%
レジャー用品	0.03%
建設関連製品	0.03%
ヘルスケア・テクノロジー	0.03%
合計	90.11%

(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29年12月29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 03/31/30 ロシア	国債証券	2,538,827,500	120.36 3,055,913,556	114.75 2,913,329,943	7.500000 2030/3/31	2.82%
2	BRAZIL 4.25 01/07/25 ブラジル	国債証券	1,593,300,000	100.04 1,593,961,050	102.00 1,625,166,000	4.250000 2025/1/7	1.57%
3	UNITED MEXICAN STATES 4.75 03/08/44 メキシコ	国債証券	1,559,400,000	99.85 1,557,117,400	101.35 1,580,451,900	4.750000 2044/3/8	1.53%
4	PERU 5.625 11/18/50 ペルー	国債証券	1,220,400,000	121.11 1,478,041,130	128.59 1,569,312,360	5.625000 2050/11/18	1.52%
5	COLOMBIA 5.0 06/15/45 コロンビア	国債証券	1,423,800,000	102.51 1,459,609,700	106.00 1,509,228,000	5.000000 2045/6/15	1.46%
6	UNITED MEXICAN STATES 6.05 01/11/40 メキシコ	国債証券	1,118,700,000	116.88 1,307,633,175	118.17 1,322,023,725	6.050000 2040/1/11	1.28%
7	PERU 7.35 07/21/25 ペルー	国債証券	1,017,000,000	130.07 1,322,884,220	129.20 1,313,964,000	7.350000 2025/7/21	1.27%
8	RUSSIAN FEDERATION 4.875 09/16/23 ロシア	国債証券	1,152,600,000	108.01 1,245,016,598	108.38 1,249,210,932	4.875000 2023/9/16	1.21%
9	RUSSIA FOREIGN BOND 5.0 04/29/20 ロシア	国債証券	1,175,200,000	106.67 1,253,650,250	105.16 1,235,875,576	5.000000 2020/4/29	1.19%
10	PANAMA 6.7 01/26/36 パナマ	国債証券	926,600,000	127.92 1,185,358,700	132.92 1,231,636,720	6.700000 2036/1/26	1.19%
11	UNITED MEXICAN STATES 4.0 10/02/23 メキシコ	国債証券	1,163,900,000	104.52 1,216,535,400	104.90 1,220,931,100	4.000000 2023/10/2	1.18%
12	RUSSIAN FEDERATION 5.625 04/04/42 ロシア	国債証券	1,084,800,000	110.54 1,199,194,420	112.15 1,216,657,440	5.625000 2042/4/4	1.18%
13	TURKEY 7.375 02/05/25 トルコ	国債証券	1,050,900,000	114.97 1,208,275,100	115.10 1,209,585,900	7.375000 2025/2/5	1.17%
14	RUSSIAN FEDERATION 4.75 05/27/26 ロシア	国債証券	1,130,000,000	105.17 1,188,490,608	106.18 1,199,935,700	4.750000 2026/5/27	1.16%
15	BRAZIL 5.0 01/27/45 ブラジル	国債証券	1,243,000,000	90.97 1,130,768,400	93.40 1,160,962,000	5.000000 2045/1/27	1.12%
16	UNITED MEXICAN STATES 5.55 01/21/45 メキシコ	国債証券	1,017,000,000	111.04 1,129,288,100	112.87 1,147,938,750	5.550000 2045/1/21	1.11%
17	TURKEY 6.0 03/25/27 トルコ	国債証券	1,062,200,000	107.85 1,145,650,500	106.27 1,128,799,940	6.000000 2027/3/25	1.09%
18	BRAZIL 4.875 01/22/21 ブラジル	国債証券	1,062,200,000	106.36 1,129,841,800	106.25 1,128,587,500	4.875000 2021/1/22	1.09%

19	COLOMBIA 6.125 01/18/41 コロンビア	国債証券	904,000,000	116.33 1,051,623,200	121.00 1,093,840,000	6.125000 2041/1/18	1.06%
20	UNITED MEXICAN STATES 4.15 03/28/27 メキシコ	国債証券	1,039,600,000	105.64 1,098,280,900	103.82 1,079,364,700	4.150000 2027/3/28	1.04%
21	TURKEY 4.875 10/09/26 トルコ	国債証券	1,084,800,000	98.13 1,064,555,598	98.77 1,071,456,960	4.875000 2026/10/9	1.04%
22	COLOMBIA 5.625 02/26/44 コロンビア	国債証券	926,600,000	111.30 1,031,328,400	114.75 1,063,273,500	5.625000 2044/2/26	1.03%
23	HUNGARY 5.75 11/22/23 ハンガリー	国債証券	926,600,000	114.40 1,060,063,396	114.59 1,061,809,472	5.750000 2023/11/22	1.03%
24	UNITED MEXICAN STATES 4.125 01/21/26 メキシコ	国債証券	1,017,000,000	104.20 1,059,736,600	104.37 1,061,493,750	4.125000 2026/1/21	1.03%
25	UNITED MEXICAN STATES 3.625 03/15/22 メキシコ	国債証券	1,005,700,000	103.66 1,042,543,650	103.95 1,045,425,150	3.625000 2022/3/15	1.01%
26	PHILIPPINES 9.5 02/02/30 フィリピン	国債証券	655,400,000	159.37 1,044,556,406	157.99 1,035,505,784	9.500000 2030/2/2	1.00%
27	HUNGARY 6.375 03/29/21 ハンガリー	国債証券	904,000,000	113.24 1,023,712,200	111.20 1,005,257,040	6.375000 2021/3/29	0.97%
28	TURKEY 5.75 05/11/47 トルコ	国債証券	1,017,000,000	95.45 970,801,080	97.28 989,398,620	5.750000 2047/5/11	0.96%
29	UNITED MEXICAN STATES 4.6 01/23/46 メキシコ	国債証券	994,400,000	97.53 969,935,500	98.85 982,964,400	4.600000 2046/1/23	0.95%
30	TURKEY 6.0 01/14/41 トルコ	国債証券	960,500,000	101.16 971,699,995	101.13 971,353,650	6.000000 2041/1/14	0.94%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成29年12月29日現在

種類	投資比率
国債証券	94.70%
合計	94.70%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資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】

ワールドアセットバランス（基本コース）

平成29年12月29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01月	売建	45,040,000	5,106,165,280	5,084,565,600	35.54%
		香港・ドル売/円買2018年01月	売建	34,430,000	500,206,956	497,169,200	3.47%
		ユーロ売/円買2018年01月	売建	2,780,000	371,670,500	375,077,600	2.62%
		イギリス・ポンド売/円買2018年01月	売建	1,430,000	217,200,030	217,202,700	1.52%
		オーストラリア・ドル売/円買2018年01月	売建	1,900,000	161,978,250	167,371,000	1.17%
		南アフリカ・ランド売/円買2018年01月	売建	15,380,000	127,192,600	139,650,400	0.98%
		カナダ・ドル売/円買2018年01月	売建	1,170,000	103,181,244	105,171,300	0.74%
		スイス・フラン売/円買2018年01月	売建	570,000	65,311,000	65,823,600	0.46%
		メキシコ・ペソ売/円買2018年01月	売建	9,420,000	56,049,000	53,788,200	0.38%
		シンガポール・ドル売/円買2018年01月	売建	600,000	50,292,000	50,652,000	0.35%
		スウェーデン・クローナ売/円買2018年01月	売建	1,660,000	22,347,706	22,742,000	0.16%
		デンマーク・クローネ売/円買2018年01月	売建	530,000	9,534,700	9,603,600	0.07%
		ニュージーランド・ドル売/円買2018年01月	売建	80,000	6,212,800	6,408,800	0.04%
		ノルウェー・クローネ売/円買2018年01月	売建	250,000	3,417,500	3,422,500	0.02%
イスラエル・シケル売/円買2018年01月	売建	70,000	2,254,700	2,277,800	0.02%		

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

(注2) 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。

ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）

平成29年12月29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01月	売建	162,750,000	18,449,328,698	18,372,847,500	35.45%
		香港・ドル売/円買2018年01月	売建	125,700,000	1,825,865,255	1,815,108,000	3.50%
		ユーロ売/円買2018年01月	売建	10,040,000	1,342,656,900	1,354,596,800	2.61%
		イギリス・ポンド売/円買2018年01月	売建	5,160,000	783,721,580	783,752,400	1.51%
		オーストラリア・ドル売/円買2018年01月	売建	6,610,000	563,470,680	582,274,900	1.12%
		南アフリカ・ランド売/円買2018年01月	売建	56,700,000	468,753,780	514,836,000	0.99%
		カナダ・ドル売/円買2018年01月	売建	4,070,000	358,907,784	365,852,300	0.71%
		スイス・フラン売/円買2018年01月	売建	1,970,000	225,721,580	227,495,600	0.44%
		メキシコ・ペソ売/円買2018年01月	売建	36,120,000	214,587,390	206,245,200	0.40%
		シンガポール・ドル売/円買2018年01月	売建	2,370,000	198,741,015	200,075,400	0.39%
		スウェーデン・クローナ売/円買2018年01月	売建	5,790,000	77,950,827	79,323,000	0.15%
		デンマーク・クローネ売/円買2018年01月	売建	1,790,000	32,202,100	32,434,800	0.06%
		ニュージーランド・ドル売/円買2018年01月	売建	270,000	20,968,200	21,629,700	0.04%
		ノルウェー・クローネ売/円買2018年01月	売建	860,000	11,756,200	11,773,400	0.02%
		イスラエル・シケル売/円買2018年01月	売建	240,000	7,730,400	7,809,600	0.02%

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

(注2) 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)

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成29年12月29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01月	買建	622,000	70,230,020	70,254,900	0.02%
		ユーロ買/円売201 8年01月	買建	146,000	19,705,474	19,699,780	0.01%
		イギリス・ポンド買/ 円売2018年01月	買建	36,000	5,470,056	5,469,120	0.00%
		オーストラリア・ドル 買/円売2018年0 1月	買建	11,000	969,606	969,430	0.00%
株価指数先物 取引	シカゴ商品 取引所	S&P500 EMI NI FUT Mar 18	買建	389	5,861,977,830	5,902,875,637	1.93%
	EUREX 取引所	DJ EURO ST OXX 50 Mar 18	買建	339	1,635,398,583	1,604,722,672	0.52%
	ICE-E EU	FTSE 100 I NDEX FUTUR E Mar18	買建	55	620,375,382	632,309,535	0.21%
	モントリ オール取引 所	S&P/TSE 6 0 IX FUT M ar18	買建	20	343,786,741	344,400,560	0.11%
	シドニー先 物取引所	SPI 200 FU TURES Mar1 8	買建	16	210,660,172	213,230,328	0.07%

(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29年12月29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01月	売建	760,000	85,806,280	85,834,400	0.15%
		オーストラリア・ドル 売/円買2018年0 1月	売建	90,000	7,929,450	7,930,800	0.01%
		イギリス・ポンド売/ 円買2018年01月	売建	50,000	7,594,050	7,596,000	0.01%

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

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

為替予約取引の数量は、現地通貨建契約金額です。

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29年12月29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01月	売建	947,601,800	105,839,057,818	106,993,719,238	42.39%
		ユーロ売/円買2018年01月	売建	774,807,700	103,429,560,441	104,537,054,884	41.41%
		イギリス・ポンド売/円買2018年01月	売建	115,719,900	17,518,923,250	17,577,852,810	6.96%
		オーストラリア・ドル売/円買2018年01月	売建	62,331,100	5,287,026,440	5,491,369,910	2.18%
		カナダ・ドル売/円買2018年01月	売建	60,022,900	5,209,392,114	5,396,058,710	2.14%
		メキシコ・ペソ売/円買2018年01月	売建	336,052,800	2,003,326,472	1,918,861,488	0.76%
		ポーランド・ズロチ売/円買2018年01月	売建	47,725,200	1,513,825,412	1,539,614,952	0.61%
		デンマーク・クローネ売/円買2018年01月	売建	80,669,700	1,446,945,221	1,461,734,964	0.58%
		南アフリカ・ランド売/円買2018年01月	売建	154,924,400	1,271,341,697	1,406,713,552	0.56%
		スウェーデン・クローナ売/円買2018年01月	売建	77,307,200	1,038,954,822	1,059,108,640	0.42%
		マレーシア・リングgit売/円買2018年01月	売建	36,570,000	1,006,363,779	1,016,280,300	0.40%
		シンガポール・ドル売/円買2018年01月	売建	10,527,400	874,467,631	888,828,382	0.35%
		ノルウェー・クローネ売/円買2018年01月	売建	43,233,600	583,052,653	591,867,984	0.23%

(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) 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29年12月29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01月	買建	330,000	37,260,300	37,273,500	0.06%
株価指数先物 取引	ICE-US	MINI MSCI EMG MKT Ma r18	買建	866	5,432,109,445	5,667,446,070	9.24%

(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) 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29年12月29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01月	買建	2,400,000	271,881,600	271,080,000	0.26%

(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29年12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。
ワールドアセットバランス(基本コース)

	純資産総額 (分配落) (百万円)	純資産総額 (分配付) (百万円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (平成29年6月12日)	6,004	6,004	1.0341	1.0341
第2計算期間末 (平成29年12月11日)	13,684	13,684	1.0542	1.0542
平成29年1月末日	2,494	-	0.9970	-
2月末日	3,387	-	1.0148	-
3月末日	4,335	-	1.0154	-
4月末日	4,757	-	1.0235	-
5月末日	5,763	-	1.0303	-
6月末日	6,622	-	1.0287	-
7月末日	8,121	-	1.0374	-
8月末日	9,940	-	1.0447	-
9月末日	11,646	-	1.0391	-
10月末日	12,563	-	1.0484	-
11月末日	13,516	-	1.0551	-
12月末日	14,307	-	1.0581	-

ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)

	純資産総額 (分配落) (百万円)	純資産総額 (分配付) (百万円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (平成29年6月12日)	10,386	10,386	1.0337	1.0337
第2計算期間末 (平成29年12月11日)	47,243	47,243	1.0544	1.0544
平成29年1月末日	2,823	-	0.9969	-
2月末日	4,466	-	1.0146	-
3月末日	7,263	-	1.0150	-
4月末日	8,165	-	1.0232	-
5月末日	9,521	-	1.0299	-
6月末日	12,722	-	1.0285	-
7月末日	17,720	-	1.0372	-
8月末日	24,686	-	1.0449	-
9月末日	35,734	-	1.0392	-
10月末日	41,213	-	1.0484	-
11月末日	45,449	-	1.0552	-
12月末日	51,830	-	1.0583	-

【分配の推移】

ワールドアセットバランス(基本コース)

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

ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)

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

【収益率の推移】

ワールドアセットバランス(基本コース)

	収益率(%)
第1計算期間	3.4
第2計算期間	1.9

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

なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)

	収益率(%)
第1計算期間	3.4
第2計算期間	2.0

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

なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

(4) 【設定及び解約の実績】

ワールドアセットバランス(基本コース)

	設定口数	解約口数
第1計算期間	5,868,621,462	62,212,876
第2計算期間	7,912,713,431	738,193,959

(注1) 本邦外における設定及び解約はございません。

(注2) 設定口数には、当初募集期間中の設定口数を含みます。

ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)

	設定口数	解約口数
第1計算期間	10,404,764,520	356,726,722
第2計算期間	37,154,151,069	2,394,963,569

(注1) 本邦外における設定及び解約はございません。

(注2) 設定口数には、当初募集期間中の設定口数を含みます。

<< 参考情報 >>

データの基準日:2017年12月29日

基準価額・純資産の推移 (2017年1月18日~2017年12月29日)**(基本コース)****(リスク抑制コース)**

※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:2017年1月18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)**■ワールドアセットバランス****(基本コース)**

第1期	(2017.06.12)	0円
第2期	(2017.12.11)	0円
設定来累計		0円

※分配金は1万口当たりです。

(リスク抑制コース)

第1期	(2017.06.12)	0円
第2期	(2017.12.11)	0円
設定来累計		0円

※分配金は1万口当たりです。

主要な資産の状況**■ワールドアセットバランス**

※比率(%)は、各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。

(基本コース)**組入銘柄**

順位	銘柄名	種類	国/地域	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	親投資信託受益証券	日本	47.38%
2	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	14.51%
3	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	14.44%
4	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	9.57%
5	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	9.49%
6	XTRACKERS MSCI EMERGING MARKETS HEDGED EQUITY ETF	投資信託受益証券	アメリカ	0.25%

(リスク抑制コース)**組入銘柄**

順位	銘柄名	種類	国/地域	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	親投資信託受益証券	日本	47.45%
2	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	14.64%
3	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	14.42%
4	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	9.56%
5	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	9.48%
6	XTRACKERS MSCI EMERGING MARKETS HEDGED EQUITY ETF	投資信託受益証券	アメリカ	0.11%

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

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

■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 1.625 08/15/22	国債証券	アメリカ	1.625000	2022/8/15	0.69%
2	US T N/B 1.75 05/15/22	国債証券	アメリカ	1.750000	2022/5/15	0.69%
3	US T N/B 1.75 09/30/22	国債証券	アメリカ	1.750000	2022/9/30	0.68%
4	US T N/B 3.625 02/15/20	国債証券	アメリカ	3.625000	2020/2/15	0.67%
5	US T N/B 1.375 10/31/20	国債証券	アメリカ	1.375000	2020/10/31	0.66%

■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 03/31/30	国債証券	ロシア	7.500000	2030/3/31	2.82%
2	BRAZIL 4.25 01/07/25	国債証券	ブラジル	4.250000	2025/1/7	1.57%
3	UNITED MEXICAN STATES 4.75 03/08/44	国債証券	メキシコ	4.750000	2044/3/8	1.53%
4	PERU 5.625 11/18/50	国債証券	ペルー	5.625000	2050/11/18	1.52%
5	COLOMBIA 5.0 06/15/45	国債証券	コロンビア	5.000000	2045/6/15	1.46%

■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	2.32%
2	MICROSOFT CORP	株式	アメリカ	ソフトウェア	1.65%
3	AMAZON.COM INC	株式	アメリカ	インターネット販売・通信販売	1.27%
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	1.11%
5	JPMORGAN CHASE & CO	株式	アメリカ	銀行	1.00%

○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:2017年12月29日

■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	4.98%
2	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	株式	韓国	コンピュータ・周辺機器	3.90%
3	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	3.32%
4	TAIWAN SEMICONDUCTOR	株式	台湾	半導体・半導体製造装置	3.13%
5	NASPERS LTD	株式	南アフリカ	メディア	2.03%

■外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

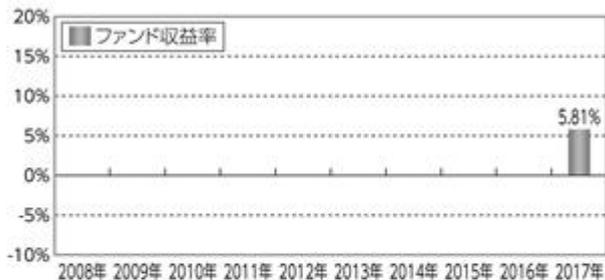
※比率(%)は、当該マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

組入上位5銘柄

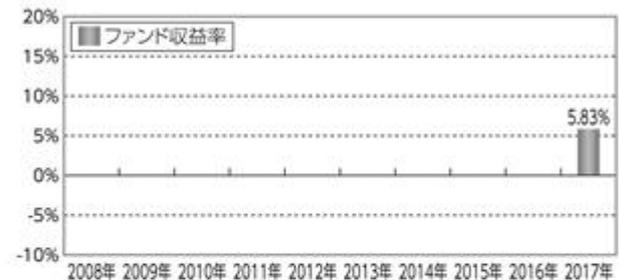
順位	銘柄名	国/地域	比率
1	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	4.50%
2	PROLOGIS INC	アメリカ	2.92%
3	PUBLIC STORAGE	アメリカ	2.65%
4	UNIBAIL-RODAMCO SE	フランス	2.13%
5	AVALONBAY COMMUNITIES INC	アメリカ	2.09%

年間収益率の推移(暦年ベース)

(基本コース)



(リスク抑制コース)



※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。

※2017年は設定日から年末までの収益率を表示しています。

※各ファンドにはベンチマークはありません。

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

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

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

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

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

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

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

受益権の取得申込者は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。委託会社は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権にかかる信託を設定した旨の通知を行います。

・お申込価額

お申込日の翌営業日の基準価額とします。

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

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

< 基準価額の照会方法等 >

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

各ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

・お申込手数料

お申込日の翌営業日の基準価額に、2.16%（税抜2.00%）を上限に各販売会社が定める手数料率を乗じて得た額とします。

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

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

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

・お申込単位

各販売会社が定める単位とします。

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

取扱コースおよびお申込単位は、販売会社にお問い合わせください。

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

当初元本は1口当たり1円です。

・払込期日

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

2【換金（解約）手続等】

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

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

海外休業日には、解約の受付を行いません。

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

なお、受益者が解約の請求をするときは、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。

各ファンドの解約価額は、以下の方法でご確認ください。

・販売会社へのお問い合わせ

・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

・解約単位

各販売会社が定める単位とします。

解約単位は販売会社にお問い合わせください。

・解約代金の受渡日

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

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

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

<主な投資対象の時価評価方法の原則>

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

公社債等	計算日 における以下のいずれかの価額 ・日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値） ・金融商品取引業者、銀行などの提示する価額（売り気配相場を除きます。） ・価格情報会社の提供する価額
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
上場先物取引等	計算日 における主たる金融商品取引所等が発表する清算値段または最終相場
上場投資信託証券	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。

各ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

（２）【保管】

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

（３）【信託期間】

信託期間は、平成29年1月18日（設定日）から原則として平成39年6月11日までです。

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6月12日から12月11日まで、および12月12日から翌年6月11日までとします。

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

（５）【その他】

- イ.償還規定

- a. 委託会社は、信託期間中において、信託契約を解約することが受益者のために有利であると認める場合、各ファンドにつき受益権口数が10億口を下回ることとなった場合、またはやむを得ない事情が発生した場合は、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
- b. 委託会社は、上記a.の事項について、書面による決議(以下「書面決議」といいます。)を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日および信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託契約にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発送します。
- c. 上記b.の書面決議において、受益者(委託会社およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。イ.償還規定c.において同じ。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができま。なお、知れている受益者が議決権を行行使しないときは、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行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- e. 上記b.からd.までの規定は、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、信託契約にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって上記b.からd.までの手続きを行うことが困難な場合にも適用しません。
- f. 委託会社は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し信託を終了させます。
- g. 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が、信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、下記「ロ. 信託約款の変更等 b.」の書面決議が否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
- h. 受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を申立てることができます。受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は下記「ロ. 信託約款の変更等」の規定にしたがい、新受託会社を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託会社を解任することはできないものとします。委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は信託契約を解約し、信託を終了させます。
- i. この信託は、受益者が一部解約請求を行ったときは、委託会社が信託契約の一部の解約をすることにより当該請求に応じ、当該受益権の公正な価格が当該受益者に一部解約金として支払われることとなる委託者指図型投資信託に該当するため、信託契約の解約を行う場合において、投資信託及び投資法人に関する法律第18条第1項に定める反対受益者による受益権買取請求の規定の適用を受けません。

ロ. 信託約款の変更等

- a. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、約款を変更することまたはこの信託と他の投資信託との併合(投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。)を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届出ます。なお、約款はa.からg.に定める以外の方法によって変更することができないものとします。
- b. 委託会社は、上記a.の事項(上記a.の変更事項にあつては、その内容が重大なものに該当する場合に限り、上記a.の併合事項にあつては、その併合が受益者の利益におよぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下、「重大な約款の変更等」といいます。)について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、約款にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
- c. 上記b.の書面決議において、受益者(委託会社およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下同じ。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- d. 上記b.の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- e. 書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。
- f. 上記b.からe.までの規定は、委託会社が重大な約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、約款にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
- g. 上記a.からf.の規定にかかわらず、この信託において併合の書面決議が可決された場合にあつても、当該併合にかかる一または複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。
- h. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて約款を変更しようとするときは、上記a.からg.の規定にしたがいます。
- i. この信託は、受益者が一部解約請求を行ったときは、委託会社が信託契約の一部の解約をすることにより当該請求に応じ、当該受益権の公正な価格が当該受益者に一部解約金として支払われることとなる委託者指図型投資信託に該当するため、重大な約款の変更等を行う場合において、投資信託及び投資法人に関する法律第18条第1項に定める反対受益者による受益権買取請求の規定の適用を受けません。

八. 関係法人との契約の更改

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

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

二．公告

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

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

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

ホ．運用報告書

・委託会社は、毎年6月11日、12月11日(休業日の場合は翌営業日とします。)および償還時に交付運用報告書を作成し、販売会社を通じて受益者に対して交付します。

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

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

4【受益者の権利等】

収益分配金請求権

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

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

収益分配金は、決算日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者(当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため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。

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

償還金請求権

受益者は、持ち分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

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

一部解約請求権

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

帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

ワールドアセットバランス(基本コース)

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドの計算期間は6ヵ月であるため、財務諸表は6ヵ月ごとに作成しております。
- (3) 当ファンドの第1期計算期間は信託約款の規定に基づき、平成29年1月18日から平成29年6月12日までとなっております。
- (4) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第2期計算期間(平成29年6月13日から平成29年12月11日まで)の財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人による監査を受けております。

1【財務諸表】

【ワールドアセットバランス(基本コース)】

(1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第1期 平成29年6月12日現在	第2期 平成29年12月11日現在
資産の部		
流動資産		
預金	605,994	669,862
コール・ローン	296,545,173	652,491,324
投資信託受益証券	31,681,535	35,778,270
親投資信託受益証券	5,680,879,342	13,125,627,549
派生商品評価勘定	16,425,408	768,417
流動資産合計	6,026,137,452	13,815,335,422
資産合計	6,026,137,452	13,815,335,422
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	1,669,655	57,056,532
未払解約金	3,954	11,101,019
未払受託者報酬	532,285	1,644,632
未払委託者報酬	19,518,470	60,305,156
その他未払費用	79,781	246,609
流動負債合計	21,804,145	130,353,948
負債合計	21,804,145	130,353,948
純資産の部		
元本等		
元本	15,806,408,586	112,980,928,058
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	197,924,721	704,053,416
(分配準備積立金)	145,231,496	332,977,883
元本等合計	6,004,333,307	13,684,981,474
純資産合計	6,004,333,307	13,684,981,474
負債純資産合計	6,026,137,452	13,815,335,422

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第1期		第2期	
	自	平成29年1月18日 平成29年6月12日	自	平成29年6月13日 平成29年12月11日
営業収益				
受取配当金		-		43,478
受取利息		486		1,640
有価証券売買等損益		118,290,370		447,961,990
為替差損益		48,423,650		179,390,735
営業収益合計		166,714,506		268,616,373
営業費用				
支払利息		55,046		113,336
受託者報酬		532,285		1,644,632
委託者報酬		19,518,470		60,305,156
その他費用		214,682		580,584
営業費用合計		20,320,483		62,643,708
営業利益又は営業損失()		146,394,023		205,972,665
経常利益又は経常損失()		146,394,023		205,972,665
当期純利益又は当期純損失()		146,394,023		205,972,665
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額()		1,162,527		7,205,550
期首剰余金又は期首欠損金()		-		197,924,721
剰余金増加額又は欠損金減少額		53,097,091		334,086,600
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		53,097,091		334,086,600
剰余金減少額又は欠損金増加額		403,866		26,725,020
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		403,866		26,725,020
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金()		197,924,721		704,053,416

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 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> <p>計算期間末日の取扱い 当ファンドは、原則として毎年6月11日及び12月11日を計算期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、前計算期間末日を平成29年6月12日としております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	第1期 平成29年6月12日現在	第2期 平成29年12月11日現在
1. 1 期首元本額	2,088,903,041円	5,806,408,586円
期中追加設定元本額	3,779,718,421円	7,912,713,431円
期中一部解約元本額	62,212,876円	738,193,959円
2. 受益権の総数	5,806,408,586口	12,980,928,058口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第1期 自 平成29年1月18日 至 平成29年6月12日	第2期 自 平成29年6月13日 至 平成29年12月11日
1 . 1 分配金の計算過程	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(40,857,743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(104,373,753円)、信託約款に規定される収益調整金(52,693,225円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象収益は197,924,721円(1万口当たり340.87円)ですが、分配を行っておりません。なお、分配金の計算過程においては、親投資信託の配当等収益及び収益調整金相当額を充当する方法によっております。</p>	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(99,545,268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(99,221,847円)、信託約款に規定される収益調整金(371,075,533円)及び分配準備積立金(134,210,768円)より分配対象収益は704,053,416円(1万口当たり542.38円)ですが、分配を行っておりません。なお、分配金の計算過程においては、親投資信託の配当等収益及び収益調整金相当額を充当する方法によっております。</p>

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	第1期 自 平成29年1月18日 至 平成29年6月12日	第2期 自 平成29年6月13日 至 平成29年12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投資信託受益証券及び親投資信託受益証券が保有する金融商品に係る、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第1期 平成29年6月12日現在	第2期 平成29年12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	第1期 平成29年6月12日現在	第2期 平成29年12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	2,084,028	3,113,783
親投資信託受益証券	116,206,342	443,406,771
合計	118,290,370	446,520,554

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	第1期 平成29年6月12日 現在				第2期 平成29年12月11日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	2,579,748,553	-	2,564,992,800	14,755,753	5,902,896,085	-	5,959,184,200	56,288,115
アメリカ・ドル	1,972,008,600	-	1,959,602,000	12,406,600	4,470,207,360	-	4,517,856,000	47,648,640
イギリス・ポンド	74,244,040	-	73,054,800	1,189,240	165,978,878	-	165,865,300	113,578
イスラエル・シケル	939,900	-	936,600	3,300	2,251,970	-	2,254,700	2,730
オーストラリア・ドル	61,646,250	-	62,160,000	513,750	140,127,900	-	140,580,000	452,100
カナダ・ドル	31,210,920	-	31,118,200	92,720	74,921,480	-	75,903,600	982,120
シンガポール・ドル	20,814,820	-	20,688,200	126,620	49,960,680	-	50,292,000	331,320
スイス・フラン	20,631,240	-	20,491,200	140,040	42,371,956	-	42,405,700	33,744
スウェーデン・クローナ	6,632,808	-	6,583,200	49,608	14,518,872	-	14,526,000	7,128
デンマーク・クローネ	4,023,360	-	3,986,400	36,960	9,543,975	-	9,534,700	9,275
ニュージーランド・ドル	3,136,360	-	3,169,600	33,240	6,134,400	-	6,212,800	78,400
ノルウェー・クローネ	1,444,740	-	1,426,700	18,040	3,381,850	-	3,417,500	35,650
メキシコ・ペソ	27,620,715	-	28,160,100	539,385	56,330,658	-	56,049,000	281,658
ユーロ	119,685,120	-	118,579,200	1,105,920	277,412,706	-	277,048,800	363,906
香港・ドル	182,402,960	-	181,146,600	1,256,360	464,960,080	-	470,045,500	5,085,420
南アフリカ・ランド	53,306,720	-	53,890,000	583,280	124,793,320	-	127,192,600	2,399,280
合計	2,579,748,553	-	2,564,992,800	14,755,753	5,902,896,085	-	5,959,184,200	56,288,115

(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)

	第1期 平成29年6月12日現在	第2期 平成29年12月11日現在
1口当たり純資産額	1.0341円	1.0542円
(1万口当たり純資産額)	(10,341円)	(10,542円)

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

平成29年12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	アメリカ・ドル	XTRACKERS MSCI EMERGING MARKETS HEDGED EQUITY ETF	13,300.000	314,811.000	
	アメリカ・ドル 小計		13,300.000	314,811.000 (35,778,270)	
投資信託受益証券 合計			13,300	35,778,270 (35,778,270)	
親投資信託受益証券	日本円	外国株式パッシブ・ファン ド・マザーファンド	383,609,621	1,332,889,989	
		外国リート・パッシブ・ ファンド・マザーファンド	1,084,970,314	1,343,410,242	
		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	5,367,468,791	7,221,392,511	
		エマージング株式パッシ ブ・マザーファンド	1,551,324,265	1,914,799,540	
		エマージング債券パッシ ブ・マザーファンド	678,833,368	1,313,135,267	
	日本円 小計		9,066,206,359	13,125,627,549	
親投資信託受益証券 合計			9,066,206,359	13,125,627,549	
合計				13,161,405,819 (35,778,270)	

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

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

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

3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入 投資信託 受益証券 時価比率	有価証券の合計金額 に対する比率
アメリカ・ドル	投資信託受 益証券 1銘柄	0.26%	0.27%

(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。

ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドの計算期間は6ヵ月であるため、財務諸表は6ヵ月ごとに作成しております。
- (3) 当ファンドの第1期計算期間は信託約款の規定に基づき、平成29年1月18日から平成29年6月12日までとなっております。
- (4) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第2期計算期間(平成29年6月13日から平成29年12月11日まで)の財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人による監査を受けております。

【ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)】

(1) 【貸借対照表】

(単位:円)

	第1期 平成29年6月12日現在	第2期 平成29年12月11日現在
資産の部		
流動資産		
預金	613,017	700,905
コール・ローン	384,696,636	681,762,957
投資信託受益証券	48,832,441	55,146,958
親投資信託受益証券	9,994,959,951	46,899,621,258
派生商品評価勘定	27,149,054	2,659,686
流動資産合計	10,456,251,099	47,639,891,764
資産合計	10,456,251,099	47,639,891,764
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	3,864,845	196,957,663
未払解約金	34,448,198	24,455,982
未払受託者報酬	821,725	4,628,738
未払委託者報酬	30,131,316	169,721,898
その他未払費用	123,196	694,236
流動負債合計	69,389,280	396,458,517
負債合計	69,389,280	396,458,517
純資産の部		
元本等		
元本	1 10,048,037,798	1 44,807,225,298
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	338,824,021	2,436,207,949
(分配準備積立金)	225,690,756	785,159,838
元本等合計	10,386,861,819	47,243,433,247
純資産合計	10,386,861,819	47,243,433,247
負債純資産合計	10,456,251,099	47,639,891,764

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第1期		第2期	
	自	平成29年1月18日 平成29年6月12日	自	平成29年6月13日 平成29年12月11日
営業収益				
受取配当金		-		67,015
受取利息		494		1,979
有価証券売買等損益		191,435,322		1,306,260,747
為替差損益		72,094,314		529,495,994
営業収益合計		263,530,130		776,833,747
営業費用				
支払利息		85,332		305,997
受託者報酬		821,725		4,628,738
委託者報酬		30,131,316		169,721,898
その他費用		258,097		1,028,211
営業費用合計		31,296,470		175,684,844
営業利益又は営業損失()		232,233,660		601,148,903
経常利益又は経常損失()		232,233,660		601,148,903
当期純利益又は当期純損失()		232,233,660		601,148,903
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額()		6,542,904		21,862,312
期首剰余金又は期首欠損金()		-		338,824,021
剰余金増加額又は欠損金減少額		116,174,713		1,608,770,611
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		116,174,713		1,608,770,611
剰余金減少額又は欠損金増加額		3,041,448		90,673,274
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		3,041,448		90,673,274
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金()		338,824,021		2,436,207,949

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 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> <p>計算期間末日の取扱い 当ファンドは、原則として毎年6月11日及び12月11日を計算期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、前計算期間末日を平成29年6月12日としております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	第1期 平成29年6月12日現在	第2期 平成29年12月11日現在
1. 1 期首元本額	2,157,741,288円	10,048,037,798円
期中追加設定元本額	8,247,023,232円	37,154,151,069円
期中一部解約元本額	356,726,722円	2,394,963,569円
2. 受益権の総数	10,048,037,798口	44,807,225,298口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第1期 自 平成29年1月18日 至 平成29年6月12日	第2期 自 平成29年6月13日 至 平成29年12月11日
1. 1 分配金の計算過程	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(64,597,295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(161,093,461円)、信託約款に規定される収益調整金(113,133,265円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象収益は338,824,021円(1万口当たり337.20円)ですが、分配を行っておりません。なお、分配金の計算過程においては、親投資信託の配当等収益及び収益調整金相当額を充当する方法によっております。</p>	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(284,749,006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(294,537,585円)、信託約款に規定される収益調整金(1,651,048,111円)及び分配準備積立金(205,873,247円)より分配対象収益は2,436,207,949円(1万口当たり543.71円)ですが、分配を行っておりません。なお、分配金の計算過程においては、親投資信託の配当等収益及び収益調整金相当額を充当する方法によっております。</p>

（金融商品に関する注記）

1．金融商品の状況に関する事項

項目	第1期 自 平成29年1月18日 至 平成29年6月12日	第2期 自 平成29年6月13日 至 平成29年12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投資信託受益証券及び親投資信託受益証券が保有する金融商品に係る、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
3． 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第1期 平成29年6月12日現在	第2期 平成29年12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	第1期 平成29年6月12日現在	第2期 平成29年12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	3,148,371	4,799,440
親投資信託受益証券	188,286,951	1,300,794,914
合計	191,435,322	1,305,594,354

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	第1期 平成29年6月12日 現在				第2期 平成29年12月11日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	4,444,001,409	-	4,420,717,200	23,284,209	20,980,051,623	-	21,174,349,600	194,297,977
アメリカ・ドル	3,412,419,540	-	3,392,973,800	19,445,740	15,932,885,000	-	16,097,130,000	164,245,000
イギリス・ポンド	131,269,220	-	129,250,800	2,018,420	589,328,133	-	588,897,900	430,233
イスラエル・シケル	1,566,500	-	1,561,000	5,500	7,721,040	-	7,730,400	9,360
オーストラリア・ドル	109,301,650	-	110,230,400	928,750	496,793,075	-	498,420,000	1,626,925
カナダ・ドル	51,744,420	-	51,590,700	153,720	253,513,380	-	256,836,600	3,323,220
シンガポール・ドル	33,623,940	-	33,419,400	204,540	169,866,312	-	170,992,800	1,126,488
スイス・フラン	33,239,220	-	33,013,600	225,620	143,148,500	-	143,262,500	114,000
スウェーデン・クローナ	10,969,644	-	10,887,600	82,044	49,471,712	-	49,496,000	24,288
デンマーク・クローネ	6,537,960	-	6,477,900	60,060	32,233,425	-	32,202,100	31,325
ニュージーランド・ドル	4,704,540	-	4,754,400	49,860	20,703,600	-	20,968,200	264,600
ノルウェー・クローネ	2,364,120	-	2,334,600	29,520	11,633,564	-	11,756,200	122,636
メキシコ・ペソ	45,719,085	-	46,611,900	892,815	193,150,770	-	192,185,000	965,770
ユーロ	210,565,770	-	208,748,800	1,816,970	984,786,800	-	983,724,000	1,062,800
香港・ドル	301,775,880	-	299,697,300	2,078,580	1,667,046,232	-	1,684,753,500	17,707,268
南アフリカ・ランド	88,199,920	-	89,165,000	965,080	427,770,080	-	435,994,400	8,224,320
合計	4,444,001,409	-	4,420,717,200	23,284,209	20,980,051,623	-	21,174,349,600	194,297,977

(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)

	第1期 平成29年6月12日現在	第2期 平成29年12月11日現在
1口当たり純資産額	1.0337円	1.0544円
(1万口当たり純資産額)	(10,337円)	(10,544円)

（４）【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

（１）株式

該当事項はありません。

（２）株式以外の有価証券

平成29年12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	アメリカ・ドル	XTRACKERS MSCI EMERGING MARKETS HEDGED EQUITY ETF	20,500.000	485,235.000	
	アメリカ・ドル 小計		20,500.000	485,235.000 (55,146,958)	
投資信託受益証券 合計			20,500	55,146,958 (55,146,958)	
親投資信託受益証券	日本円	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	1,369,548,376	4,758,632,787	
		外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	3,831,363,774	4,743,994,624	
		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	19,163,175,809	25,782,136,733	
		エマージング株式パッシブ・マザーファンド	5,567,620,388	6,872,113,844	
		エマージング債券パッシブ・マザーファンド	2,451,790,359	4,742,743,270	
	日本円 小計		32,383,498,706	46,899,621,258	
親投資信託受益証券 合計			32,383,498,706	46,899,621,258	
合計				46,954,768,216 (55,146,958)	

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

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

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

３．外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入 投資信託 受益証券 時価比率	有価証券の合計金額 に対する比率
アメリカ・ドル	投資信託受 益証券 1銘柄	0.12%	0.12%

（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。

(参考)

「ワールドアセットバランス(基本コース)」、「ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)」は、「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。

「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成29年6月12日現在	平成29年12月11日現在
資産の部			
流動資産			
預金		3,757,534,985	2,638,514,373
コール・ローン		236,099,433	666,266,222
株式		261,922,388,422	287,108,328,050
投資信託受益証券		780,845,176	793,144,760
投資証券		6,202,054,039	6,644,534,459
派生商品評価勘定		58,066,101	101,588,426
未収入金		23,369,050	-
未収配当金		544,751,662	536,970,677
差入委託証拠金		1,434,738,404	1,905,742,870
流動資産合計		274,959,847,272	300,395,089,837
資産合計		274,959,847,272	300,395,089,837
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		3,985,127	8,403,319
未払解約金		259,840,000	450,839,000
流動負債合計		263,825,127	459,242,319
負債合計		263,825,127	459,242,319
純資産の部			
元本等			
元本	1	88,552,177,603	86,323,479,779
剰余金			
剰余金又は欠損金()		186,143,844,542	213,612,367,739
元本等合計		274,696,022,145	299,935,847,518
純資産合計		274,696,022,145	299,935,847,518
負債純資産合計		274,959,847,272	300,395,089,837

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29年6月12日現在	平成29年12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>	92,335,327,550円	88,552,177,603円
<p>同期中追加設定元本額</p>	7,216,242,320円	10,504,300,528円
<p>同期中一部解約元本額</p>	10,999,392,267円	12,732,998,352円
<p>元本の内訳 ファンド名</p>		

D I A M外国株式パッシブ・ ファンド	1,688,460,733円	1,772,792,525円
M I T O ラップ型ファンド (安定型)	4,185,275円	2,807,540円
M I T O ラップ型ファンド (中立型)	9,628,667円	6,389,168円
M I T O ラップ型ファンド (積極型)	27,957,802円	16,873,130円
グローバル8資産ラップファン ド(安定型)	6,160,298円	10,586,823円
グローバル8資産ラップファン ド(中立型)	8,871,853円	8,562,036円
グローバル8資産ラップファン ド(積極型)	15,884,033円	12,073,566円
たわらノーロード 先進国株式	3,174,894,890円	5,133,698,391円
たわらノーロード 先進国株式 <ラップ向け>	425,349円	425,029円
たわらノーロード 先進国株式 <為替ヘッジあり>	195,572,745円	414,866,588円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	- 円	5,889,843円
たわらノーロード バランス (堅実型)	- 円	34,963円
たわらノーロード バランス (標準型)	- 円	79,253円
たわらノーロード バランス (積極型)	- 円	117,424円
たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(保守型)	- 円	14,793円
たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(安定型)	- 円	59,169円
たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(安定成長 型)	- 円	82,545円
たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(成長型)	- 円	106,212円
たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(積極型)	- 円	129,879円
D I A M外国株式インデックス ファンド<DC年金>	35,746,590,470円	36,677,928,546円
D I A Mバランス・ファンド< DC年金>1安定型	164,078,105円	157,435,724円
D I A Mバランス・ファンド< DC年金>2安定・成長型	867,715,289円	857,026,223円
D I A Mバランス・ファンド< DC年金>3成長型	1,044,655,683円	1,043,554,352円
D I A M DC バランス30 インデックスファンド	142,948,772円	132,035,140円
D I A M DC バランス50 インデックスファンド	408,653,663円	389,058,681円
D I A M DC バランス70 インデックスファンド	329,391,295円	330,441,705円

マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	37,347,623円	34,206,990円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	847,024,117円	820,555,501円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	201,414,979円	187,072,304円
DIAM DC 8資産バランス ファンド(新興国10)	28,370,185円	30,215,012円
DIAM DC 8資産バランス ファンド(新興国20)	60,530,898円	74,275,172円
DIAM DC 8資産バランス ファンド(新興国30)	115,927,900円	141,824,089円
投資のソムリエ	1,085,019,602円	841,804,538円
クルーズコントロール	828,472,858円	641,917,915円
投資のソムリエ<DC年金>	50,718,738円	52,158,941円
DIAM 8資産バランス ファンドN<DC年金>	96,005,250円	115,562,877円
DIAM DC バランス・F (成長型)	51,407,710円	67,016,525円
クルーズコントロール<DC年金>	272,914円	214,777円
DIAMコア資産設計ファンド (堅実型)	4,112,941円	3,100,738円
DIAMコア資産設計ファンド (積極型)	10,816,397円	8,318,622円
投資のソムリエ<DC年金>リ スク抑制型	19,462,765円	34,402,820円
ダイナミック・ナビゲーション リスク抑制世界8資産バランス ファンド	1,631,703円	1,167,998円
ワールドアセットバランス(基 本コース)	185,831,655円	383,609,621円
ワールドアセットバランス(リ スク抑制コース)	324,501,695円	1,369,548,376円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2045)	- 円	481,515円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2055)	- 円	481,538円
リスク抑制世界8資産バランス ファンド(DC)	- 円	150,283円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2035)	- 円	192,297円
DIAM外国株式インデックス ファンドVA(適格機関投資家 専用)	143,196,331円	98,646,996円
DIAM外国株式パッシブ私募 ファンド(適格機関投資家向 け)	3,123,590,428円	2,954,694,223円
DIAMアクティブアロケー ション私募ファンド(適格機関 投資家限定)	189,862,329円	- 円

D I A M先進国株式パッシブ ファンド(適格機関投資家限 定)	161,410,146円	161,232,273円
外国株式パッシブ・ファンド2 (適格機関投資家限定)	87,164,719円	208,806,341円
D I A Mワールドバランス25 V A(適格機関投資家限定)	27,394,127円	24,536,408円
D I A Mグローバル・バランス ファンド25V A(適格機関投 資家限定)	141,691,145円	114,472,228円
D I A Mグローバル・バランス ファンド50V A(適格機関投 資家限定)	273,930,804円	248,276,491円
D I A M国際分散バランスファ ンド30V A(適格機関投資家 限定)	19,200,702円	14,813,470円
D I A M国際分散バランスファ ンド50V A(適格機関投資家 限定)	120,555,988円	91,103,095円
D I A M国内重視バランスファ ンド30V A(適格機関投資家 限定)	10,786,442円	8,130,540円
D I A M国内重視バランスファ ンド50V A(適格機関投資家 限定)	14,920,537円	13,240,019円
D I A M世界バランスファンド 40V A(適格機関投資家限 定)	44,480,411円	28,978,536円
D I A M世界バランスファンド 50V A(適格機関投資家限 定)	117,580,114円	72,808,292円
D I A Mバランスファンド25 V A(適格機関投資家限定)	683,941,290円	597,723,519円
D I A Mバランスファンド3 7.5V A(適格機関投資家限 定)	824,912,632円	743,608,210円
D I A Mバランスファンド50 V A(適格機関投資家限定)	2,569,380,302円	2,305,862,897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)	990,758,874円	823,945,543円
D I A Mグローバル・アセッ ト・バランスV A2(適格機関 投資家限定)	630,292,099円	268,122,404円
D I A M アクサ グローバ ル バランスファンド30V A (適格機関投資家限定)	1,139,197,857円	1,001,326,679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)	744,686,488円	591,917,029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)	8,099,193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)	2,302,217,730円	382,122,074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)	1,368,462,961円	507,935,036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)	9,095,141,163円	8,279,676,493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)	490,577,206円	442,270,030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)	1,547,127,988円	1,415,798,109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)	5,806,791,288円	5,390,220,352円
D I A Mバランス 3 0 V A (適 格機関投資家限定)	23,707,946円	12,602,647円
D I A Mバランス 5 0 V A (適 格機関投資家限定)	1,320,182円	15,140,977円
D I A Mバランス 7 0 V A (適 格機関投資家限定)	12,957,336円	11,295,771円
D I A M世界アセットバランス ファンド 4 V A (適格機関投資 家限定)	7,785,150,269円	7,196,095,458円
D I A Mバランス 2 0 V A (適 格機関投資家限定)	78,789,955円	65,306,688円
D I A Mバランス 4 0 V A (適 格機関投資家限定)	165,376円	157,803円
D I A Mバランス 6 0 V A (適 格機関投資家限定)	270,704円	261,895円
計	88,552,177,603円	86,323,479,779円
2 . 受益権の総数	88,552,177,603口	86,323,479,779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1月18日 至 平成29年6月12日	自 平成29年6月13日 至 平成29年12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29年6月12日現在	平成29年12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29年6月12日現在	平成29年12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	11,182,788,635	28,709,291,226
投資信託受益証券	9,456,969	31,518,618
投資証券	205,156,583	359,941,704
合計	11,397,402,187	29,100,751,548

(注) 「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成29年2月16日から平成29年6月12日まで及び平成29年2月16日から平成29年12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29年6月12日 現在				平成29年12月11日 現在			
	契約額等	うち 1年超	時価	評価損益	契約額等	うち 1年超	時価	評価損益
	(円)		(円)	(円)	(円)		(円)	(円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	177,702,630	-	177,838,500	135,870	-	-	-	-
アメリカ・ドル	140,940,856	-	141,078,000	137,144	-	-	-	-
イギリス・ポンド	11,242,944	-	11,242,400	544	-	-	-	-
オーストラリア・ドル	1,660,020	-	1,660,000	20	-	-	-	-
カナダ・ドル	4,096,890	-	4,096,500	390	-	-	-	-
ユーロ	19,761,920	-	19,761,600	320	-	-	-	-
買 建	52,193,472	-	52,368,300	174,828	549,062,495	-	549,589,840	527,345
アメリカ・ドル	-	-	-	-	372,869,533	-	373,286,660	417,127
イギリス・ポンド	7,007,460	-	7,026,500	19,040	42,668,086	-	42,638,400	29,686
オーストラリア・ドル	14,094,020	-	14,110,000	15,980	16,482,701	-	16,480,270	2,431
カナダ・ドル	11,396,952	-	11,470,200	73,248	7,335,208	-	7,334,710	498
ユーロ	19,695,040	-	19,761,600	66,560	109,706,967	-	109,849,800	142,833
合計	229,896,102	-	230,206,800	38,958	549,062,495	-	549,589,840	527,345

(注) 時価の算定方法

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

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

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

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

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

株式関連

種類	平成29年6月12日 現在				平成29年12月11日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								
先物取引								
買 建	5,512,483,866	-	5,566,525,882	54,042,016	5,569,183,282	-	5,661,841,044	92,657,762
合計	5,512,483,866	-	5,566,525,882	54,042,016	5,569,183,282	-	5,661,841,044	92,657,762

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成29年6月12日現在	平成29年12月11日現在
1口当たり純資産額	3.1021円	3.4746円
(1万口当たり純資産額)	(31,021円)	(34,746円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

平成29年12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	29,076	1,162.000	33,786,312.000	
	ABBOTT LABORATORIES	124,816	54.640	6,819,946.240	
	AES CORP	45,579	10.760	490,430.040	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	62,373	154.810	9,655,964.130	
	ADVANCED MICRO DEVICES	59,529	9.940	591,718.260	
	ADOBE SYSTEMS INC	35,138	173.570	6,098,902.660	
	CHUBB LTD	33,654	150.050	5,049,782.700	
	AGCO CORP	5,610	72.460	406,500.600	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	15,019	160.920	2,416,857.480	
	ALLEGHANY CORP	1,054	585.720	617,348.880	
	RALPH LAUREN CORP	4,703	102.340	481,305.020	
	ALLSTATE CORP	25,754	102.500	2,639,785.000	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	52,300	153.660	8,036,418.000	
	AMGEN INC	51,512	175.410	9,035,719.920	
	HESS CORP	20,421	45.490	928,951.290	
	AMERICAN EXPRESS CO	54,985	98.550	5,418,771.750	
	AMERICAN ELECTRIC POWER	34,859	76.930	2,681,702.870	
	AFLAC INC	28,218	88.160	2,487,698.880	
	AMERICAN INTL GROUP	65,596	59.510	3,903,617.960	
	AMERCO	551	381.120	209,997.120	
	ANALOG DEVICES	27,391	85.520	2,342,478.320	
	ANADARKO PETROLEUM CORP	41,003	47.920	1,964,863.760	
	ALEXION PHARMACEUTICALS INC	16,015	114.460	1,833,076.900	
	JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	64,578	37.410	2,415,862.980	
	TIME WARNER	56,495	90.710	5,124,661.450	
	JONES LANG LASALLE INC	2,818	150.090	422,953.620	
	VALERO ENERGY CORP	32,105	87.600	2,812,398.000	
	APACHE CORP	28,309	40.700	1,152,176.300	
	ANSYS INC	5,619	146.130	821,104.470	
	APPLE INC	368,126	169.370	62,349,500.620	
APPLIED MATERIALS INC	78,309	51.430	4,027,431.870		
ALBEMARLE CORP	7,904	130.600	1,032,262.400		
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	41,382	41.510	1,717,766.820		
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	7,831	90.750	710,663.250		
AMEREN CORP	17,312	63.190	1,093,945.280		

ARROW ELECTRONICS INC	5,756	77.880	448,277.280	
AUTOLIV INC	6,197	128.650	797,244.050	
AUTODESK INC	14,259	107.160	1,527,994.440	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	31,205	116.020	3,620,404.100	
AUTOZONE INC	2,015	721.890	1,454,608.350	
AVERY DENNISON CORP	6,262	113.730	712,177.260	
AVNET INC	10,288	39.140	402,672.320	
BALL CORP	24,324	39.600	963,230.400	
BERKSHIRE HATHAWAY INC- CL B	90,365	196.440	17,751,300.600	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	73,749	54.670	4,031,857.830	
CR BARD INC	5,309	332.800	1,766,835.200	
BAXTER INTERNATIONAL INC	34,876	64.050	2,233,807.800	
BECTON DICKINSON & CO	15,891	219.680	3,490,934.880	
AMETEK INC	16,775	71.740	1,203,438.500	
VERIZON COMM INC	290,013	51.090	14,816,764.170	
WR BERKLEY CORP	8,134	70.400	572,633.600	
BEST BUY CO INC	21,033	63.790	1,341,695.070	
YUM! BRANDS INC	23,738	83.320	1,977,850.160	
FIRSTENERGY CORP	30,796	32.830	1,011,032.680	
H&R BLOCK INC	16,114	27.220	438,623.080	
BOEING CO	39,919	285.900	11,412,842.100	
ROBERT HALF INTL INC	8,158	54.680	446,079.440	
BORGWARNER INC	14,648	53.760	787,476.480	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	102,476	25.770	2,640,806.520	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	9,894	88.380	874,431.720	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	7,233	106.810	772,556.730	
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	1,838	623.190	1,145,423.220	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	116,634	62.420	7,280,294.280	
AFFILIATED MANAGERS GROUP INC	3,788	200.430	759,228.840	
INGREDION INC	5,305	139.890	742,116.450	
ONEOK INC	28,473	53.010	1,509,353.730	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	4,418	104.790	462,962.220	
UNITED RENTALS INC	6,332	164.000	1,038,448.000	
SEMPRA ENERGY	16,912	116.690	1,973,461.280	
FEDEX CORP	18,719	240.730	4,506,224.870	
VERISIGN INC	6,321	112.980	714,146.580	
AMPHENOL CORP	21,490	89.340	1,919,916.600	
BROWN-FORMAN CORP	13,612	66.480	904,925.760	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	127,092	5.640	716,798.880	
CSX CORP	66,444	56.460	3,751,428.240	
CABOT OIL & GAS CORP	32,261	27.750	895,242.750	

CAMPBELL SOUP CO	14,050	48.950	687,747.500	
SEAGATE TECHNOLOGY	23,239	40.490	940,947.110	
CONSTELLATION BRANDS INC	12,240	217.980	2,668,075.200	
CARDINAL HEALTH INC	22,125	58.890	1,302,941.250	
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	24,916	66.910	1,667,129.560	
CATERPILLAR INC	42,278	143.860	6,082,113.080	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	9,832	104.780	1,030,196.960	
CELGENE CORP	54,731	106.090	5,806,411.790	
CITRIX SYSTEMS INC	10,896	87.590	954,380.640	
CENTURYLINK INC	71,294	14.670	1,045,882.980	
CERNER CORP	20,809	70.420	1,465,369.780	
JPMORGAN CHASE & CO	250,678	105.930	26,554,320.540	
CHURCH & DWIGHT CO INC	18,822	48.400	910,984.800	
CIGNA CORP	17,595	209.970	3,694,422.150	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	10,982	74.400	817,060.800	
CINTAS CORP	6,282	159.180	999,968.760	
CISCO SYSTEMS INC	354,512	37.610	13,333,196.320	
CLOROX COMPANY	9,331	145.230	1,355,141.130	
COCA-COLA CO/THE	289,171	45.310	13,102,338.010	
COGNEX CORP	11,508	64.380	740,885.040	
COLGATE-PALMOLIVE CO	59,819	73.320	4,385,929.080	
MARRIOTT INTERNATIONAL- CL A	23,366	129.320	3,021,691.120	
COMERICA INC	12,068	85.400	1,030,607.200	
COMCAST CORP-CL A	333,255	37.950	12,647,027.250	
CA INC	22,732	33.480	761,067.360	
CONAGRA BRANDS INC	31,942	37.250	1,189,839.500	
CONSOLIDATED EDISON INC	21,750	88.920	1,934,010.000	
CMS ENERGY CORP	22,372	49.870	1,115,691.640	
COOPER COS INC	3,794	226.560	859,568.640	
MOLSON COORS BREWING CO	13,855	80.140	1,110,339.700	
CORNING INC	65,641	32.350	2,123,486.350	
WR GRACE & CO	3,314	70.260	232,841.640	
SEALED AIR CORP	13,870	47.790	662,847.300	
CUMMINS INC	11,239	170.880	1,920,520.320	
DR HORTON INC	24,498	50.780	1,244,008.440	
DANAHER CORP	44,524	93.180	4,148,746.320	
MOODY'S CORP	11,822	152.390	1,801,554.580	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	43,287	71.820	3,108,872.340	
TARGET CORP	37,486	61.370	2,300,515.820	
DEERE & CO	19,364	151.580	2,935,195.120	
MORGAN STANLEY	96,261	52.890	5,091,244.290	
REPUBLIC SERVICES INC	17,375	65.140	1,131,807.500	
COSTAR GROUP INC	2,278	292.340	665,950.520	
THE WALT DISNEY CO	108,774	104.230	11,337,514.020	

DOLLAR TREE INC	17,493	108.670	1,900,964.310	
DOVER CORP	10,736	98.600	1,058,569.600	
OMNICOM GROUP	16,993	73.480	1,248,645.640	
DTE ENERGY CO	13,122	115.490	1,515,459.780	
DUKE ENERGY CORP	49,292	88.050	4,340,160.600	
FLOWSERVE CORP	8,406	42.130	354,144.780	
DARDEN RESTAURANTS INC	9,436	86.410	815,364.760	
EBAY INC	73,800	37.650	2,778,570.000	
BANK OF AMERICA CORP	719,642	29.050	20,905,600.100	
CITIGROUP INC	193,450	75.710	14,646,099.500	
EASTMAN CHEMICAL CO	10,193	92.180	939,590.740	
E*TRADE FINANCIAL CORP	18,740	50.380	944,121.200	
EATON CORP PLC	32,234	77.290	2,491,365.860	
EATON VANCE CORP	9,184	56.840	522,018.560	
CADENCE DESIGN SYS INC	20,877	43.560	909,402.120	
DISH NETWORK CORP	16,150	48.590	784,728.500	
ECOLAB INC	19,009	135.330	2,572,487.970	
ELECTRONIC ARTS INC	23,241	105.270	2,446,580.070	
SALESFORCE.COM INC	48,240	103.440	4,989,945.600	
EMERSON ELECTRIC CO	45,625	66.550	3,036,343.750	
ATMOS ENERGY CORP	8,221	91.800	754,687.800	
ENTERGY CORP	13,984	84.040	1,175,215.360	
EOG RESOURCES INC	39,963	100.390	4,011,885.570	
EQUIFAX INC	8,495	117.400	997,313.000	
EQT CORP	19,875	56.380	1,120,552.500	
ESTEE LAUDER COS INC/THE	16,134	125.630	2,026,914.420	
EXPEDITORS INTERNATIONAL	14,641	64.460	943,758.860	
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	38,911	68.150	2,651,784.650	
EXXON MOBIL CORP	300,424	82.660	24,833,047.840	
FMC CORP	8,970	88.810	796,625.700	
NEXTERA ENERGY INC	33,513	159.030	5,329,572.390	
ASSURANT INC	4,089	99.130	405,342.570	
FASTENAL CO	21,654	53.780	1,164,552.120	
FIFTH THIRD BANCORP	52,173	30.370	1,584,494.010	
M&T BANK CORP	9,799	171.720	1,682,684.280	
FISERV INC	14,095	131.720	1,856,593.400	
FLIR SYSTEMS INC	11,623	46.390	539,190.970	
MACY'S INC	24,512	25.800	632,409.600	
FORD MOTOR CO	261,895	12.610	3,302,495.950	
FRANKLIN RESOURCES INC	22,314	44.670	996,766.380	
FREEMPORT-MCMORAN INC	96,812	14.970	1,449,275.640	
FLEX LTD	35,913	17.840	640,687.920	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	12,176	65.690	799,841.440	
GAP INC/THE	18,295	33.490	612,699.550	
DENTSPLY SIRONA INC	17,477	64.900	1,134,257.300	
GENERAL DYNAMICS CORP	18,563	201.070	3,732,462.410	
GENERAL MILLS INC	38,727	55.840	2,162,515.680	
GENUINE PARTS CO	11,094	94.850	1,052,265.900	

GILEAD SCIENCES INC	94,012	74.220	6,977,570.640	
GARTNER INC	7,153	120.710	863,438.630	
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	18,097	31.750	574,579.750	
MCKESSON CORP	15,054	152.570	2,296,788.780	
NVIDIA CORP	42,645	191.490	8,166,091.050	
GENERAL ELECTRIC CO	608,018	17.710	10,767,998.780	
WW GRAINGER INC	3,832	223.910	858,023.120	
HALLIBURTON CO	61,528	43.990	2,706,616.720	
MONSTER BEVERAGE CORP	29,522	63.220	1,866,380.840	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	25,381	250.350	6,354,133.350	
HARLEY-DAVIDSON INC	12,901	51.190	660,402.190	
HARRIS CORP	8,954	143.250	1,282,660.500	
HASBRO INC	7,736	91.360	706,760.960	
HENRY SCHEIN INC	11,426	67.900	775,825.400	
HELMERICH & PAYNE INC	7,213	58.010	418,426.130	
HERSHEY FOODS CORP	10,132	113.200	1,146,942.400	
HP INC	122,725	21.070	2,585,815.750	
F5 NETWORKS INC	4,874	132.740	646,974.760	
CROWN HOLDINGS INC NPR	7,781	58.800	457,522.800	
UNITED THERAPEUTICS CORP	3,447	136.210	469,515.870	
JUNIPER NETWORKS INC	27,740	28.380	787,261.200	
HOLLYFRONTIER CORP	13,888	45.690	634,542.720	
HOLOGIC INC	22,344	42.690	953,865.360	
UNUM GROUP	16,000	57.490	919,840.000	
HOME DEPOT INC	83,442	183.410	15,304,097.220	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	12,887	81.990	1,056,605.130	
HORMEL FOODS CORP	19,345	37.240	720,407.800	
CENTERPOINT ENERGY INC	31,952	28.910	923,732.320	
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,337	206.660	482,964.420	
HUMANA INC	10,468	256.490	2,684,937.320	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	5,927	112.510	666,846.770	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	75,161	14.850	1,116,140.850	
RED HAT INC	12,098	125.290	1,515,758.420	
BIOGEN INC	15,267	325.770	4,973,530.590	
IDEX CORP	4,699	132.640	623,275.360	
ILLINOIS TOOL WORKS	22,032	166.490	3,668,107.680	
INTUIT INC	17,739	155.230	2,753,624.970	
IDEXX LABORATORIES INC	6,255	160.570	1,004,365.350	
INGERSOLL-RAND PLC	16,730	87.610	1,465,715.300	
INTEL CORP	334,110	43.350	14,483,668.500	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	5,578	153.040	853,657.120	
INTERNATIONAL PAPER CO	28,375	56.910	1,614,821.250	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	29,157	20.220	589,554.540	

JACOBS ENGINEERING GROUP INC	7,931	68.510	543,352.810	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	4,173	117.290	489,451.170	
INCYTE CORP	12,360	96.580	1,193,728.800	
JOHNSON & JOHNSON	191,449	140.590	26,915,814.910	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	25,530	55.170	1,408,490.100	
KLA-TENCOR CORP	11,724	103.980	1,219,061.520	
DEVON ENERGY CORP	34,184	38.050	1,300,701.200	
WESTAR ENERGY INC	9,911	56.760	562,548.360	
KELLOGG CO	18,922	66.530	1,258,880.660	
EAST WEST BANCORP INC	8,509	60.350	513,518.150	
KEYCORP	71,550	19.890	1,423,129.500	
KIMBERLY-CLARK CORP	25,358	120.110	3,045,749.380	
BLACKROCK INC/NEW YORK	8,616	515.490	4,441,461.840	
KOHL'S CORP	11,357	49.780	565,351.460	
KROGER CO	66,588	26.680	1,776,567.840	
LAM RESEARCH CORP	11,522	186.460	2,148,392.120	
PACKAGING CORP OF AMERICA	6,157	118.340	728,619.380	
AKAMA I TECHNOLOGIES	12,622	56.500	713,143.000	
LEGGETT & PLATT INC	9,588	46.300	443,924.400	
LENNAR CORP	14,850	62.180	923,373.000	
LEUCADIA NATIONAL CORP	21,462	26.100	560,158.200	
ELI LILLY & CO	70,283	86.450	6,075,965.350	
L BRANDS INC	16,262	57.280	931,487.360	
LINCOLN NATIONAL CORP	14,163	78.540	1,112,362.020	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	47,982	119.560	5,736,727.920	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	24,266	67.380	1,635,043.080	
LOCKHEED MARTIN CORP	18,240	315.850	5,761,104.000	
LOEWS CORP	21,346	49.840	1,063,884.640	
RANGE RESOURCES CORP	13,697	16.080	220,247.760	
LOWE'S COS INC	58,178	85.600	4,980,036.800	
DOMINION ENERGY INC	45,131	83.880	3,785,588.280	
SCANA CORP	10,902	45.780	499,093.560	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	32,198	33.180	1,068,329.640	
MCCORMICK & CO INC	7,476	101.160	756,272.160	
MCDONALD'S CORPORATION	57,515	173.150	9,958,722.250	
S&P GLOBAL INC	18,409	171.210	3,151,804.890	
EVEREST RE GROUP LTD	3,382	212.280	717,930.960	
MANPOWERGROUP INC	4,257	127.960	544,725.720	
MARKEL CORPORATION	989	1,110.940	1,098,719.660	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	15,776	118.030	1,862,041.280	
MARSH & MCLENNAN COS	35,821	84.130	3,013,620.730	
MASCO CORP	23,043	42.720	984,396.960	

MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	4,387	214.100	939,256.700	
MATTEL INC	24,003	15.040	361,005.120	
METLIFE INC	64,937	53.760	3,491,013.120	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	20,342	51.890	1,055,546.380	
MEDTRONIC PLC	95,177	81.070	7,715,999.390	
ACTIVISION BLIZZARD INC	50,052	62.430	3,124,746.360	
CVS HEALTH CORP	73,660	73.090	5,383,809.400	
MERCK & CO. INC.	193,111	55.570	10,731,178.270	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	7,176	156.260	1,121,321.760	
MICROSOFT CORP	521,379	84.160	43,879,256.640	
MICRON TECH INC	76,146	43.210	3,290,268.660	
MIDDLEBY CORP	4,100	125.610	515,001.000	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	15,331	87.410	1,340,082.710	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	26,463	22.040	583,244.520	
3M CO	42,407	238.130	10,098,378.910	
MOHAWK INDUSTRIES INC	4,042	280.570	1,134,063.940	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	10,582	92.520	979,046.640	
KANSAS CITY SOUTHERN	7,247	111.740	809,779.780	
MYLAN NV	31,344	38.670	1,212,072.480	
ILLUMINA INC	10,453	217.650	2,275,095.450	
XCEL ENERGY INC	37,554	51.200	1,922,764.800	
NATIONAL OILWELL VARCO INC	26,938	32.620	878,717.560	
NETAPP INC	20,641	58.260	1,202,544.660	
NEWFIELD EXPLORATION CO	13,740	29.390	403,818.600	
NEWELL BRANDS INC	36,206	30.960	1,120,937.760	
NEWMONT MINING CORP	38,093	35.400	1,348,492.200	
NVR INC	236	3,392.680	800,672.480	
NIKE INC-CL B	94,901	61.300	5,817,431.300	
NOBLE ENERGY INC	31,005	26.940	835,274.700	
NORDSTROM INC	9,487	45.780	434,314.860	
NORFOLK SOUTHERN CORP	19,973	140.820	2,812,597.860	
EVERSOURCE ENERGY	23,085	65.220	1,505,603.700	
NISOURCE INC	22,198	27.140	602,453.720	
TAPESTRY INC	19,175	42.260	810,335.500	
NORTHERN TRUST CORP	16,090	97.730	1,572,475.700	
NORTHROP GRUMMAN CORP	11,954	305.670	3,653,979.180	
WELLS FARGO & CO	334,953	59.310	19,866,062.430	
NUCOR CORP	23,780	60.170	1,430,842.600	
MONSANTO CO	30,856	117.300	3,619,408.800	
CHENIERE ENERGY INC	15,927	47.400	754,939.800	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	33,007	95.790	3,161,740.530	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	54,121	68.870	3,727,313.270	

OLD DOMINION FREIGHT LINE	3,814	130.500	497,727.000	
OGE ENERGY CORP	16,028	34.460	552,324.880	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	6,375	251.070	1,600,571.250	
ORACLE CORP	222,369	49.600	11,029,502.400	
PACCAR INC	24,457	71.970	1,760,170.290	
EXELON CORP	69,910	41.050	2,869,805.500	
PARKER HANNIFIN CORP	8,808	192.980	1,699,767.840	
PAYCHEX INC	23,141	69.010	1,596,960.410	
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	6,526	50.250	327,931.500	
ALIGN TECHNOLOGY INC	5,255	238.430	1,252,949.650	
PPL CORPORATION	49,957	34.500	1,723,516.500	
PEPSICO INC	101,450	116.570	11,826,026.500	
PENTAIR PLC	11,775	69.950	823,661.250	
PFIZER INC	423,943	35.740	15,151,722.820	
CONOCOPHILLIPS	88,450	51.570	4,561,366.500	
PVH CORP	5,387	135.400	729,399.800	
PG&E CORP	37,651	53.460	2,012,822.460	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	12,158	155.900	1,895,432.200	
ALTRIA GROUP INC	135,928	71.540	9,724,289.120	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	34,538	143.800	4,966,564.400	
POLARIS INDUSTRIES INC	5,010	133.700	669,837.000	
GARMIN LTD	7,795	62.270	485,394.650	
AETNA INC	23,744	182.730	4,338,741.120	
FLUOR CORP (NEW)	9,821	50.380	494,781.980	
PPG INDUSTRIES INC	17,674	115.920	2,048,770.080	
IPG PHOTONICS CORP	2,441	205.260	501,039.660	
PRAXAIR INC	20,519	151.410	3,106,781.790	
COSTCO WHOLESALE CORP	31,578	188.070	5,938,874.460	
T ROWE PRICE GROUP INC	16,303	102.750	1,675,133.250	
QUEST DIAGNOSTICS	10,378	97.090	1,007,600.020	
PROCTER & GAMBLE CO	181,559	90.370	16,407,486.830	
PROGRESSIVE CORP	41,336	54.990	2,273,066.640	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	37,115	51.930	1,927,381.950	
PULTE GROUP INC	21,209	34.100	723,226.900	
NEW YORK COMMUNITY BANCORP INC	30,388	13.350	405,679.800	
GLOBAL PAYMENTS INC	10,769	99.370	1,070,115.530	
QUALCOMM INC	104,228	64.240	6,695,606.720	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	10,187	89.490	911,634.630	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	3,535	126.720	447,955.200	
REGENERON PHARMACEUTICALS	5,659	380.780	2,154,834.020	

REINSURANCE GROUP OF AMERICA INC	4,642	161.860	751,354.120	
AUTONATION INC	5,772	55.590	320,865.480	
RESMED INC	9,394	86.370	811,359.780	
US BANCORP	122,040	55.360	6,756,134.400	
SEATTLE GENETICS INC /WA	7,317	59.260	433,605.420	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	8,674	92.010	798,094.740	
ROSS STORES INC	28,189	76.890	2,167,452.210	
ROLLINS INC	5,357	46.000	246,422.000	
ROPER TECHNOLOGIES INC	6,983	260.580	1,819,630.140	
ROCKWELL AUTOMATION INC	8,867	192.860	1,710,089.620	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	12,293	125.230	1,539,452.390	
RAYTHEON COMPANY	21,099	188.070	3,968,088.930	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	3,848	233.050	896,776.400	
ACCENTURE PLC-CL A	44,729	150.530	6,733,056.370	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	109,427	42.650	4,667,061.550	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	8,849	155.460	1,375,665.540	
ROCKWELL COLLINS INC	12,086	134.610	1,626,896.460	
THE TRAVELERS COMPANIES INC	19,755	133.750	2,642,231.250	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	22,718	95.850	2,177,520.300	
PRICELINE GROUP INC	3,542	1,719.840	6,091,673.280	
SCHLUMBERGER LTD	100,396	63.540	6,379,161.840	
SCHWAB (CHARLES) CORP	83,988	51.390	4,316,143.320	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	14,175	113.380	1,607,161.500	
BUNGE LTD	10,334	69.790	721,209.860	
SEI INVESTMENTS CO	11,107	71.220	791,040.540	
ANTHEM INC	18,448	224.850	4,148,032.800	
AMERISOURCEBERGEN CORP	12,257	86.700	1,062,681.900	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	21,442	71.760	1,538,677.920	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	5,958	408.850	2,435,928.300	
CENTENE CORP	12,713	101.340	1,288,335.420	
SVB FINANCIAL GROUP	3,468	232.270	805,512.360	
IAC INTERACTIVE CORP	5,050	123.910	625,745.500	
SMITH (A.O.) CORP	9,565	62.220	595,134.300	
ACUITY BRANDS INC	3,087	171.650	529,883.550	
SNAP-ON INC	3,932	172.190	677,051.080	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	30,203	117.150	3,538,281.450	
ADVANCE AUTO PARTS	5,273	100.310	528,934.630	
EDISON INTERNATIONAL	24,139	71.800	1,733,180.200	
SOUTHERN CO	70,353	51.060	3,592,224.180	
BB&T CORP	55,828	49.810	2,780,792.680	
SOUTHWEST AIRLINES	11,352	63.330	718,922.160	

AT&T INC	435,922	36.730	16,011,415.060	
CHEVRON CORP	134,596	119.920	16,140,752.320	
STANLEY BLACK & DECKER INC	10,528	167.660	1,765,124.480	
STATE STREET CORP	27,099	97.670	2,646,759.330	
STARBUCKS CORP	103,854	58.610	6,086,882.940	
STEEL DYNAMICS INC	15,309	40.700	623,076.300	
STRYKER CORP	24,985	151.930	3,795,971.050	
NETFLIX INC	30,587	188.540	5,766,872.980	
STERICYCLE INC	6,853	66.580	456,272.740	
SUNTRUST BANKS INC	34,756	65.200	2,266,091.200	
SYMANTEC CORP	46,581	27.980	1,303,336.380	
KNIGHT SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	9,793	43.110	422,176.230	
SYNOPSIS INC	10,656	90.510	964,474.560	
SYSCO CORP	35,926	62.640	2,250,404.640	
INTUITIVE SURGICAL INC	7,788	379.610	2,956,402.680	
TELEFLEX INC	3,203	252.760	809,590.280	
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	63,853	16.060	1,025,479.180	
ANDEAVOR	11,500	111.040	1,276,960.000	
TEXAS INSTRUMENTS INC	70,900	98.020	6,949,618.000	
TEXTRON INC	19,076	54.840	1,046,127.840	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	28,065	187.960	5,275,097.400	
TIFFANY & CO	8,733	95.750	836,184.750	
TOLL BROTHERS INC	9,526	47.870	456,009.620	
TORCHMARK CORP	7,699	89.950	692,525.050	
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	11,279	76.580	863,745.820	
DAVITA INC	12,618	67.710	854,364.780	
TRACTOR SUPPLY CO	9,276	67.660	627,614.160	
TRIMBLE INC	20,073	41.210	827,208.330	
TYSON FOODS INC	21,621	83.620	1,807,948.020	
UGI CORP	12,068	49.600	598,572.800	
MARATHON OIL CORP	66,702	15.150	1,010,535.300	
UNION PACIFIC CORP	56,617	129.110	7,309,820.870	
UNITED TECHNOLOGIES CORP	54,787	122.810	6,728,391.470	
UNITEDHEALTH GROUP INC	69,757	223.910	15,619,289.870	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	6,351	111.560	708,517.560	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	6,848	111.980	766,839.040	
VF CORP	24,309	73.350	1,783,065.150	
CBS CORP	26,212	57.470	1,506,403.640	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	17,742	143.610	2,547,928.620	
VULCAN MATERIALS CO	9,977	125.880	1,255,904.760	

WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	63,286	71.550	4,528,113.300	
WAL-MART STORES INC	106,126	96.550	10,246,465.300	
WASTE MANAGEMENT INC	32,216	84.570	2,724,507.120	
WATERS CORP	5,963	199.290	1,188,366.270	
ALLERGAN PLC	23,313	167.800	3,911,921.400	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	8,755	118.610	1,038,430.550	
VAIL RESORTS INC	2,598	225.490	585,823.020	
WESTERN DIGITAL CORP	20,516	81.470	1,671,438.520	
WABTEC CORP	5,497	76.230	419,036.310	
WHIRLPOOL CORP	5,553	169.700	942,344.100	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	13,529	96.280	1,302,572.120	
WYNN RESORTS LTD	6,279	159.540	1,001,751.660	
NASDAQ INC	9,132	78.780	719,418.960	
CME GROUP INC	25,327	152.820	3,870,472.140	
WILLIAMS COS INC	61,081	28.550	1,743,862.550	
LKQ CORP	22,948	40.220	922,968.560	
ALLIANT ENERGY CORP	16,383	44.940	736,252.020	
WEC ENERGY GROUP INC	23,117	68.960	1,594,148.320	
TD AMERITRADE HOLDING CORP	18,631	52.750	982,785.250	
CARMAX INC	13,513	67.480	911,857.240	
XEROX CORP	17,455	29.590	516,493.450	
XILINX INC	18,777	68.540	1,286,975.580	
CIMAREX ENERGY CO	7,003	111.900	783,635.700	
TJX COMPANIES INC	43,999	73.880	3,250,646.120	
ZIONS BANCORP	16,584	50.930	844,623.120	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	94,700	7.210	682,787.000	
JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	15,700	62.100	974,970.000	
JARDINE STRATEGIC HOLDINGS LTD	17,100	40.200	687,420.000	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	6,051	130.890	792,015.390	
SIGNATURE BANK	4,171	137.570	573,804.470	
CBRE GROUP INC	20,976	43.620	914,973.120	
LIBERTY GLOBAL PLC	16,073	30.770	494,566.210	
REGIONS FINANCIAL CORP	84,486	17.080	1,443,020.880	
DOMINO'S PIZZA INC	3,256	183.910	598,810.960	
T-MOBILE US INC	21,188	62.540	1,325,097.520	
LAS VEGAS SANDS CORP	28,387	70.360	1,997,309.320	
MOSAIC CO/THE	26,525	23.620	626,520.500	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX NEWS	27,332	32.970	901,136.040	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC	75,340	33.300	2,508,822.000	
MACQUARIE INFRASTRUCTURE CORP	5,473	65.370	357,770.010	

CELANESE CORP	10,766	106.540	1,147,009.640	
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	10,423	19.660	204,916.180	
EXPEDIA INC	8,709	117.540	1,023,655.860	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	18,475	39.260	725,328.500	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	10,578	169.860	1,796,779.080	
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	41,818	29.870	1,249,103.660	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	42,085	70.930	2,985,089.050	
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	14,696	13.630	200,306.480	
VIACOM INC-CLASS B	24,612	29.290	720,885.480	
LIVE NATION	8,864	43.350	384,254.400	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,807	315.900	570,831.300	
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	6,191	63.550	393,438.050	
TRANSDIGM GROUP INC	3,812	274.620	1,046,851.440	
MASTERCARD INC	67,015	149.890	10,044,878.350	
LIBERTY INTERACTIVE CORP QVC GROUP	29,531	24.790	732,073.490	
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	7,436	113.050	840,639.800	
HANESBRANDS INC	27,619	20.750	573,094.250	
WESTERN UNION CO	35,222	19.390	682,954.580	
OWENS CORNING	7,333	88.590	649,630.470	
LEIDOS HOLDINGS INC	9,322	64.130	597,819.860	
AERCAP HOLDINGS NV	11,586	52.360	606,642.960	
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLDINGS INC	7,576	84.950	643,581.200	
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT-ADR	18,099	25.850	467,859.150	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	8,330	89.530	745,784.900	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	30,910	18.840	582,344.400	
DELTA AIR LINES INC	9,473	53.460	506,426.580	
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	6,354	47.930	304,547.220	
DISCOVER FINANCIAL	27,177	73.800	2,005,662.600	
TE CONNECTIVITY LTD	24,311	94.820	2,305,169.020	
CONCHO RESOURCES INC/MIDLAND TX	10,552	140.210	1,479,495.920	
WABCO HOLDING INC	3,176	144.020	457,407.520	
LULULEMON ATHLETICA INC	6,683	73.770	493,004.910	
VMWARE INC	5,491	119.570	656,558.870	
MERCADOLIBRE INC	2,861	276.450	790,923.450	
ULTA BEAUTY INC	4,332	224.540	972,707.280	
INVESCO LTD	29,824	37.670	1,123,470.080	

MSCI INC	6,462	127.710	825,262.020	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	110,262	106.590	11,752,826.580	
VISA INC	130,002	112.600	14,638,225.200	
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	12,572	94.150	1,183,653.800	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	11,992	91.520	1,097,507.840	
SCRIPPS NETWORKS INTERACTIVE	6,585	81.850	538,982.250	
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	16,085	18.400	295,964.000	
MARATHON PETROLEUM CORP	36,673	64.750	2,374,576.750	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	11,624	68.220	792,989.280	
SPECTRUM BRANDS HOLDINGS INC	1,826	114.470	209,022.220	
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	133,961	17.790	2,383,166.190	
XYLEM INC	14,682	68.190	1,001,165.580	
ALKERMES PLC	12,053	52.880	637,362.640	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	23,062	107.140	2,470,862.680	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,479	237.010	824,557.790	
SPLUNK INC	10,674	80.420	858,403.080	
HCA HEALTHCARE INC	21,493	84.840	1,823,466.120	
VERISK ANALYTICS INC	10,053	96.160	966,696.480	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	3,987	138.970	554,073.390	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	6,544	186.430	1,219,997.920	
FIRST REPUBLIC BANK/SAN FRANCISCO CA	10,668	92.790	989,883.720	
CIT GROUP INC	9,287	49.840	462,864.080	
NXP SEMICONDUCTOR NV	22,652	115.290	2,611,549.080	
TARGA RESOURCES CORP	16,445	45.360	745,945.200	
HUTCHISON PORT HOLDINGS TRUST	405,600	0.405	164,268.000	
LEAR CORP	5,132	177.070	908,723.240	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	8,174	125.270	1,023,956.980	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	10,633	40.630	432,018.790	
DOLLAR GENERAL CORP	19,355	93.380	1,807,369.900	
FORTINET INC	11,399	41.950	478,188.050	
AON PLC	19,411	138.490	2,688,229.390	
TESLA INC	9,357	315.130	2,948,671.410	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING NV	11,392	48.050	547,385.600	
GENERAL MOTORS CO	91,138	42.020	3,829,618.760	
VANTIV INC	12,141	74.760	907,661.160	

TRIPADVISOR INC	9,263	34.500	319,573.500	
ALLY FINANCIAL INC	31,409	28.650	899,867.850	
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	11,923	61.810	736,960.630	
VOYA FINANCIAL INC	13,525	46.150	624,178.750	
APTIV PLC	19,069	85.220	1,625,060.180	
PHILLIPS 66	30,976	99.550	3,083,660.800	
FACEBOOK INC	168,961	179.000	30,244,019.000	
IQVIA HOLDINGS INC	10,051	101.350	1,018,668.850	
DIAMONDBACK ENERGY INC	7,054	110.770	781,371.580	
SERVICENOW INC	13,054	121.810	1,590,107.740	
PALO ALTO NETWORKS INC	7,048	143.890	1,014,136.720	
TESARO INC	2,646	84.390	223,295.940	
WORKDAY INC	10,290	104.850	1,078,906.500	
ABBVIE INC	113,442	95.950	10,884,759.900	
ZOETIS INC	34,425	71.880	2,474,469.000	
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDINGS LTD	12,224	55.030	672,686.720	
COTY INC	38,871	17.780	691,126.380	
NEWS CORP/NEW-CL A	30,263	16.550	500,852.650	
HD SUPPLY HOLDINGS INC	12,891	39.320	506,874.120	
CDW CORP	12,723	69.760	887,556.480	
SPRINT CORP	63,882	5.440	347,518.080	
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	10,199	51.020	520,352.980	
ARCONIC INC	27,513	24.470	673,243.110	
DELPHI TECHNOLOGIES PLC	6,356	51.000	324,156.000	
ENVISION HEALTHCARE CORP	8,692	32.070	278,752.440	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	13,175	34.630	456,250.250	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	5,006	42.340	211,954.040	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-C	13,368	42.150	563,461.200	
XL GROUP LTD	20,259	36.870	746,949.330	
BROADCOM LTD	29,284	259.910	7,611,204.440	
DELL TECHNOLOGIES INC	15,074	77.250	1,164,466.500	
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	15,410	12.190	187,847.900	
BAKER HUGHES A GE CO	28,404	30.260	859,505.040	
TECHNIPFMC LTD	32,556	27.350	890,406.600	
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	6,291	60.200	378,718.200	
MICRO FOCUS INTERNATIONAL PLC ADR	16,697	32.360	540,314.920	
ANTERO RESOURCES CORP	13,163	18.230	239,961.490	
VEEVA SYSTEMS INC	6,980	56.060	391,298.800	
TWITTER INC	43,692	21.100	921,901.200	
PLAINS GP HOLDINGS LP	7,837	20.630	161,677.310	
COMMScope HOLDING CO INC	12,920	37.910	489,797.200	
ALLEGION PLC	5,402	82.460	445,448.920	
PERRIGO CO PLC	8,553	85.600	732,136.800	

HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	14,796	78.380	1,159,710.480	
ARAMARK	17,307	42.690	738,835.830	
SABRE CORP	17,624	19.300	340,143.200	
PARSLEY ENERGY INC	17,454	26.100	455,549.400	
ARISTA NETWORKS INC	3,158	222.790	703,570.820	
IHS MARKIT LTD	27,511	45.590	1,254,226.490	
FNF GROUP	17,760	40.080	711,820.800	
SYNCHRONY FINANCIAL	57,485	37.500	2,155,687.500	
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	34,845	41.740	1,454,430.300	
CDK GLOBAL INC	8,309	70.730	587,695.570	
QORVO INC	8,784	67.880	596,257.920	
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	11,389	34.420	392,009.380	
LIBERTY BROADBAND CORP-C W/I	7,818	84.670	661,950.060	
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	14,710	32.410	476,751.100	
NIELSEN HOLDINGS PLC	26,840	37.950	1,018,578.000	
TRANSUNION	10,341	55.610	575,063.010	
SQUARE INC	17,376	38.090	661,851.840	
DOWDUPONT INC	168,213	70.730	11,897,705.490	
WESTROCK CO	17,744	64.420	1,143,068.480	
KRAFT HEINZ CO	43,818	78.480	3,438,836.640	
FORTIVE CORP	21,682	73.690	1,597,746.580	
WASTE CONNECTIONS INC	18,879	68.660	1,296,232.140	
ALPHABET INC-CL A	21,134	1,049.380	22,177,596.920	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	121,590	14.340	1,743,600.600	
PAYPAL HOLDINGS INC	81,079	72.910	5,911,469.890	
FIRST DATA CORP	22,035	16.520	364,018.200	
DXC TECHNOLOGY CO	21,001	95.930	2,014,625.930	
ZILLOW GROUP INC-C	8,134	40.180	326,824.120	
ALPHABET INC-CL C	22,444	1,037.050	23,275,550.200	
L3 TECHNOLOGIES INC	5,892	193.850	1,142,164.200	
CHEMOURS CO	12,723	47.640	606,123.720	
ATHENE HOLDING LTD	8,984	51.500	462,676.000	
CHARTER COMMUNICATIONS INC	13,583	324.500	4,407,683.500	
VISTRA ENERGY CORP	15,825	17.750	280,893.750	
アメリカ・ドル 小計	22,266,265		1,652,553,302.990 (187,812,682,885)	
イギリス・ポンド				
ANTOFAGASTA PLC	25,905	8.935	231,461.170	
ASHTED GROUP	35,233	20.190	711,354.270	
SEVERN TRENT PLC	14,897	20.830	310,304.510	
BHP BILLITON PLC	153,323	13.415	2,056,828.040	
BARCLAYS PLC	1,164,260	1.964	2,286,606.640	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	64,682	6.300	407,496.600	
BT GROUP PLC	631,894	2.680	1,693,475.920	

SKY PLC	72,210	9.930	717,045.300	
BUNZL PLC	22,241	20.850	463,724.850	
EASYJET PLC	13,628	14.560	198,423.680	
CAPITA PLC	54,894	4.861	266,839.730	
AVIVA PLC	277,861	5.100	1,417,091.100	
CRODA INTERNATIONAL	8,407	42.530	357,549.710	
DIAGEO PLC	179,703	26.355	4,736,072.560	
SCHRODERS PLC	6,697	34.250	229,372.250	
DCC PLC	5,936	69.500	412,552.000	
NATIONAL GRID PLC	229,884	8.778	2,017,921.750	
GKN PLC	134,180	2.987	400,795.660	
KINGFISHER PLC	165,680	3.362	557,016.160	
BAE SYSTEMS PLC	225,176	5.570	1,254,230.320	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	162,930	49.390	8,047,112.700	
COBHAM PLC	142,739	1.220	174,141.580	
NEXT PLC	9,731	44.830	436,240.730	
IMPERIAL BRANDS PLC	65,739	30.835	2,027,062.060	
IMI PLC	21,218	12.480	264,800.640	
JOHNSON MATTHEY PLC	12,527	30.120	377,313.240	
ANGLO AMERICAN PLC	93,573	13.640	1,276,335.720	
COMPASS GROUP PLC	115,111	14.910	1,716,305.010	
HSBC HOLDINGS PLC	1,445,842	7.332	10,600,913.540	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	423,649	2.638	1,117,586.060	
CENTRICA PLC	392,766	1.441	565,975.800	
UNILEVER PLC	89,305	41.815	3,734,288.570	
MEGGITT PLC	62,181	4.916	305,681.790	
MORRISON <WM.> SUPERMARKETS	155,682	2.219	345,458.350	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	34,714	8.170	283,613.380	
RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	80,864	6.005	485,588.320	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	25,308	28.830	729,629.640	
PEARSON PLC	65,009	7.405	481,391.640	
PERSIMMON PLC	23,150	26.710	618,336.500	
PRUDENTIAL PLC	182,973	18.350	3,357,554.550	
RIO TINTO PLC	85,976	34.685	2,982,077.560	
VODAFONE GROUP PLC	1,906,594	2.294	4,373,726.630	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	47,231	67.160	3,172,033.960	
RELX PLC	80,689	17.120	1,381,395.680	
OLD MUTUAL PLC	339,296	1.987	674,181.150	
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	116,966	8.385	980,759.910	
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	279,442	2.810	785,232.020	
ST JAMES'S PLACE PLC	40,884	11.570	473,027.880	

TRAVIS PERKINS PLC	20,357	15.990	325,508.430	
SSE PLC	73,043	13.240	967,089.320	
BP PLC	1,412,206	4.927	6,957,938.960	
SHIRE PLC	65,457	36.480	2,387,871.360	
SAGE GROUP PLC(THE)	85,271	7.680	654,881.280	
SMITHS GROUP PLC	31,720	14.740	467,552.800	
STANDARD CHARTERED PLC	237,533	7.597	1,804,538.200	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	5,055,136	0.668	3,376,830.840	
TAYLOR WIMPLEY PLC	253,022	2.029	513,381.630	
TESCO PLC	562,988	2.045	1,151,310.460	
3I GROUP PLC	66,784	8.685	580,019.040	
SMITH & NEPHEW PLC	66,155	13.240	875,892.200	
GLAXOSMITHKLINE PLC	345,537	12.875	4,448,788.870	
WEIR GROUP	18,336	20.300	372,220.800	
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	21,888	37.900	829,555.200	
BABCOCK INT'L GROUP	21,302	6.615	140,912.730	
WPP PLC	90,628	13.410	1,215,321.480	
FERGUSON PLC	18,238	53.450	974,821.100	
ASTRAZENECA PLC	90,878	47.840	4,347,603.520	
WHITBREAD PLC	12,159	39.940	485,630.460	
CARNIVAL PLC	13,153	49.280	648,179.840	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	120,290	3.190	383,725.100	
JOHN WOOD GROUP PLC	48,988	6.820	334,098.160	
INTERTEK GROUP PLC	13,339	50.500	673,619.500	
BURBERRY GROUP PLC	29,893	17.360	518,942.480	
INVESTEC PLC	50,655	4.614	233,722.170	
INTERCONTINENTAL HOTELS	12,362	44.460	549,614.520	
ITV PLC	247,210	1.637	404,682.770	
SAINSBURY (J) PLC	109,410	2.447	267,726.270	
RANDGOLD RESOURCES LTD NPR	6,998	68.700	480,762.600	
G4S PLC	122,250	2.517	307,703.250	
ADMIRAL GROUP PLC	15,893	18.490	293,861.570	
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	10,726	41.130	441,160.380	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	319,445	23.575	7,530,915.870	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	266,594	23.850	6,358,266.900	
TUI AG-DI	30,153	13.950	420,634.350	
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	184,183	4.184	770,621.670	
EXPERIAN PLC	62,214	15.730	978,626.220	
MONDI PLC	24,061	16.940	407,593.340	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	21,290	16.000	340,640.000	
FRESNILLO PLC NPR	15,639	13.060	204,245.340	
GLENCORE PLC	900,291	3.455	3,110,505.400	

	DIRECT LINE INSURANCE GROUP PLC	112,694	3.591	404,684.150	
	MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	30,616	5.950	182,165.200	
	COCA-COLA HBC AG	13,406	23.190	310,885.140	
	CONVATEC GROUP PLC	118,400	2.102	248,876.800	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC-C	5,380,436	0.001	5,380.430	
	ROYAL MAIL PLC	55,060	4.384	241,383.040	
	MERLIN ENTERTAINMENTS PLC	50,037	3.591	179,682.860	
	MICRO FOCUS INTERNATIONAL PLC	15,645	24.250	379,391.250	
	AUTO TRADER GROUP PLC	76,348	3.426	261,568.240	
	WORLDPAY GROUP PLC	160,354	4.247	681,023.430	
イギリス・ボンド 小計		27,175,451		133,926,483.750 (20,395,664,210)	
イスラエル・シュケル	BANK HAPOALIM BM	78,428	24.560	1,926,191.680	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	124,270	19.810	2,461,788.700	
	BEZEQ ISRAELI TELECOMMUNICATION CORP LTD	188,230	5.296	996,866.080	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,760	461.200	811,712.000	
	FRUTAROM INDUSTRIES LTD	2,600	300.800	782,080.000	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	49,411	14.130	698,177.430	
	NICE LTD	4,035	306.800	1,237,938.000	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	10,444	62.170	649,303.480	
イスラエル・シュケル 小計		459,178		9,564,057.370 (308,536,491)	
オーストラリア・ドル	RAMSAY HEALTH CARE LTD	11,115	70.410	782,607.150	
	AUST AND NZ BANKING GROUP LT	203,883	28.510	5,812,704.330	
	AMCOR LTD	80,741	15.720	1,269,248.520	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	239,994	31.570	7,576,610.580	
	BANK OF QUEENSLAND LTD	30,569	12.680	387,614.920	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	114,125	4.560	520,410.000	
	TELSTRA CORP LTD	272,919	3.690	1,007,071.110	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD	39,014	11.490	448,270.860	
	AMP LTD	200,498	5.230	1,048,604.540	
	ASX LTD	10,290	56.250	578,812.500	
	BHP BILLITON LTD	232,053	27.170	6,304,880.010	
	CALTEX AUSTRALIA LTD	20,946	34.040	713,001.840	
	HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	60,838	4.200	255,519.600	
	COMPUTERSHARE LT	38,040	16.370	622,714.800	

CSL LIMITED	32,212	142.030	4,575,070.360	
REA GROUP LTD	4,119	77.200	317,986.800	
TRANSURBAN GROUP	149,591	12.350	1,847,448.850	
COCA-COLA AMATIL LTD	48,601	8.450	410,678.450	
COCHLEAR LTD	3,992	180.910	722,192.720	
ORIGIN ENERGY LTD	121,721	9.130	1,111,312.730	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	121,208	79.620	9,650,580.960	
BORAL LIMITED	86,101	7.850	675,892.850	
RIO TINTO LIMITED	26,822	69.200	1,856,082.400	
APA GROUP	73,253	8.860	649,021.580	
ARISTOCRAT LEISU	44,406	23.020	1,022,226.120	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	171,471	7.160	1,227,732.360	
TPG TELECOM LTD	28,719	6.360	182,652.840	
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	6,557	45.590	298,933.630	
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	35,790	21.940	785,232.600	
ORICA LTD	25,308	18.780	475,284.240	
CIMIC GROUP LTD	8,709	51.130	445,291.170	
BLUESCOPE STEEL LTD	36,941	14.060	519,390.460	
SYDNEY AIRPORT	85,130	7.330	624,002.900	
MACQUARIE GROUP LTD	21,627	98.650	2,133,503.550	
SUNCORP GROUP LTD	93,181	14.350	1,337,147.350	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	192,882	29.840	5,755,598.880	
NEWCREST MINING LTD	51,533	22.760	1,172,891.080	
OIL SEARCH LTD	93,715	7.260	680,370.900	
INCITEC PIVOT LTD	136,426	3.830	522,511.580	
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	95,390	10.700	1,020,673.000	
CHALLENGER FINANCIAL SERVICES	45,707	14.030	641,269.210	
SANTOS LTD	133,862	5.000	669,310.000	
SONIC HEALTHCARE	26,192	22.850	598,487.200	
TABCORP HOLDINGS LTD	70,776	5.120	362,373.120	
WESFARMERS LTD	81,021	43.980	3,563,303.580	
ALUMINA LIMITED	184,613	2.230	411,686.990	
WOODSIDE PETROLEUM LTD	60,249	31.560	1,901,458.440	
WOOLWORTHS GROUP LTD	97,477	26.910	2,623,106.070	
SEEK LTD	25,899	18.650	483,016.350	
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES LTD	4,581	46.850	214,619.850	
TATTS GROUP LTD	109,937	4.520	496,915.240	
AUSNET SERVICES	165,066	1.925	317,752.050	
AGL ENERGY LTD	46,315	25.820	1,195,853.300	
BRAMBLES LTD	115,255	10.200	1,175,601.000	
CROWN RESORTS LTD	32,861	12.390	407,147.790	

	AURIZON HOLDINGS LTD	139,184	5.340	743,242.560	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	50,789	16.220	823,797.580	
	HEALTHSCOPE LTD	149,047	2.050	305,546.350	
	MEDIBANK PVT LTD	177,176	3.270	579,365.520	
	SOUTH32 LTD(AUD)	367,057	3.220	1,181,923.540	
オーストラリア・ドル 小計		5,433,494		86,043,556.860 (7,348,980,191)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	16,141	55.080	889,046.280	
	ALIMENTATION COUCHE TARD INC	30,728	66.490	2,043,104.720	
	BARRICK GOLD CORP	83,648	17.570	1,469,695.360	
	ATCO LTD	7,193	45.730	328,935.890	
	BANK OF MONTREAL	45,451	100.910	4,586,460.410	
	BANK OF NOVA SCOTIA	86,583	83.600	7,238,338.800	
	NATIONAL BANK OF CANADA	23,756	64.140	1,523,709.840	
	BCE INC	11,568	62.280	720,455.040	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT	57,500	55.770	3,206,775.000	
	VALEANT PHARMACEUTICALS INTERN	25,819	25.360	654,769.840	
	BOMBARDIER INC 'B'	151,615	3.190	483,651.850	
	SAPUTO INC	14,101	44.210	623,405.210	
	BLACKBERRY LTD	39,652	13.180	522,613.360	
	CGI GROUP INC	15,228	68.590	1,044,488.520	
	CCL INDUSTRIES INC	11,340	59.150	670,761.000	
	CAE INC	23,000	22.430	515,890.000	
	CAMECO CORP	32,627	13.330	434,917.910	
	ROGERS COMM-CL B	25,967	64.870	1,684,479.290	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	29,471	119.650	3,526,205.150	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	79,420	44.850	3,561,987.000	
	CANADIAN TIRE CORP-CL A	4,862	164.180	798,243.160	
	CANADIAN UTILITIES LTD	9,119	38.830	354,090.770	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	54,387	103.080	5,606,211.960	
	FIRST CAPITAL REALTY INC	11,417	20.900	238,615.300	
	AGRIUM INC	9,382	136.490	1,280,549.180	
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	13,930	41.320	575,587.600	
	OPEN TEXT CORP	19,756	41.790	825,603.240	
	EMPIRE CO LTD	15,093	25.850	390,154.050	
	KINROSS GOLD CORP	99,741	5.000	498,705.000	
	FINNING INTERNATIONAL INC	9,892	30.390	300,617.880	
	FORTIS INC	29,002	47.440	1,375,854.880	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	55,296	15.100	834,969.600	
TELUS CORP	15,945	48.130	767,432.850		
GREAT WEST LIFECO INC	19,248	35.140	676,374.720		

IMPERIAL OIL LTD	21,542	39.450	849,831.900	
ENBRIDGE INC	112,614	49.340	5,556,374.760	
IGM FINANCIAL INC	8,426	44.270	373,019.020	
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	87,995	3.870	340,540.650	
MANULIFE FINANCIAL CORP	136,517	26.860	3,666,846.620	
LINAMAR CORP	3,827	67.780	259,394.060	
LOBLAW CO LTD	15,354	68.190	1,046,989.260	
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANCE AND FINANCIAL SERVICES INC	6,524	60.000	391,440.000	
MAGNA INTERNATIONAL INC	25,339	72.240	1,830,489.360	
SUN LIFE FINANCIAL INC	40,842	52.430	2,141,346.060	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,245	673.050	1,510,997.250	
METRO INC	12,389	40.830	505,842.870	
HUSKY ENERGY INC	28,749	15.930	457,971.570	
CRESCENT POINT ENERGY CORP	39,992	9.080	363,127.360	
METHANEX CORP	7,381	68.250	503,753.250	
ONEX CORP	6,646	95.540	634,958.840	
GOLDCORP INC	51,066	15.390	785,905.740	
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	61,076	24.330	1,485,979.080	
POWER CORP OF CANADA	25,052	32.410	811,935.320	
POWER FINANCIAL CORP	17,484	35.280	616,835.520	
ROYAL BANK OF CANADA	106,285	102.470	10,891,023.950	
SNC-LAVALIN GROUP INC	13,134	56.380	740,494.920	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	10,607	231.730	2,457,960.110	
SHAW COMM INC-B	27,548	29.390	809,635.720	
SUNCOR ENERGY INC	120,732	44.250	5,342,391.000	
LUNDIN MINING CORP	35,268	7.060	248,992.080	
ENCANA CORP	69,257	15.170	1,050,628.690	
TECK RESOURCES LTD-CL B	41,016	29.590	1,213,663.440	
THOMSON REUTERS CORP	20,469	56.980	1,166,323.620	
TORONTO DOMINION BANK (THE) C\$	133,609	72.850	9,733,415.650	
TRANSCANADA CORP	62,895	62.990	3,961,756.050	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	5,696	76.570	436,142.720	
WESTON (GEORGE) LTD	3,105	110.770	343,940.850	
INTACT FINANCIAL CORP	10,785	106.570	1,149,357.450	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	33,943	27.010	916,800.430	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,494	785.000	1,172,790.000	
FRANCO-NEVADA CORP NPR	14,627	100.010	1,462,846.270	
CI FINANCIAL CORP	20,695	29.230	604,914.850	

	TOURMALINE OIL CORP	15,779	21.880	345,244.520	
	KEYERA CORP	13,728	34.640	475,537.920	
	ALTAGAS LTD	12,538	28.840	361,595.920	
	PEMBINA PIPELINE CORP	30,850	45.280	1,396,888.000	
	DOLLARAMA INC	7,504	158.680	1,190,734.720	
	CENOVUS ENERGY INC W/I	80,545	12.150	978,621.750	
	VERMILION ENERGY INC	8,291	42.100	349,051.100	
	ARC RESOURCES LTD	22,997	14.500	333,456.500	
	ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP	30,631	9.440	289,156.640	
	INTER PIPELINE LTD	24,083	27.620	665,172.460	
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	14,961	32.140	480,846.540	
	SEVEN GENERATIONS ENERGY LTD	17,231	17.210	296,545.510	
	RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	15,353	78.100	1,199,069.300	
	SHOPIFY INC	5,021	129.500	650,219.500	
	HYDRO ONE LTD	13,354	22.730	303,536.420	
カナダ・ドル 小計		2,932,969		127,405,033.750 (11,260,056,882)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE TECH ENG	125,000	3.210	401,250.000	
	SEMBICORP INDUSTRIES	81,400	3.020	245,828.000	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	123,700	2.650	327,805.000	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	692,140	0.370	256,091.800	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	124,200	24.840	3,085,128.000	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	29,000	12.310	356,990.000	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	5,944	40.810	242,574.640	
	SINGAPORE AIRPORT TERMINAL SERVICES LTD	42,300	5.260	222,498.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	68,900	7.580	522,262.000	
	CAPITALAND LTD	192,415	3.460	665,755.900	
	GENTING SINGAPORE PLC	416,400	1.320	549,648.000	
	KEPPEL CORP LTD	119,300	7.650	912,645.000	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	177,900	1.910	339,789.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	225,453	12.390	2,793,362.670	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	591,922	3.780	2,237,465.160	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	47,500	10.560	501,600.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	94,500	25.880	2,445,660.000	
	UOL GROUP LIMITED	40,500	8.650	350,325.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	92,000	3.100	285,200.000	
YANGZIJIANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	188,800	1.550	292,640.000		
GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES LTD	172,100	3.350	576,535.000		

シンガポール・ドル 小計		3,651,374		17,611,053.170 (1,478,800,135)	
スイス・フラン	CREDIT SUISSE GROUP AG	167,395	17.190	2,877,520.050	
	NESTLE SA-REGISTERED	221,279	85.350	18,886,162.650	
	CIE FINANC RICHEMONT	37,438	87.100	3,260,849.800	
	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN	50,677	240.500	12,187,818.500	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2,835	222.600	631,071.000	
	SIKA INHABER	151	7,530.000	1,137,030.000	
	SGS SA-REG	405	2,476.000	1,002,780.000	
	NOVARTIS AG-REG SHS	160,610	83.100	13,346,691.000	
	BALOISE HOLDING AG -R	4,127	151.600	625,653.200	
	BARRY CALLEBAUT AG	144	1,943.000	279,792.000	
	CLARIANT AG-REG	12,888	27.150	349,909.200	
	SWISSCOM AG-REG	1,795	524.000	940,580.000	
	ABB LTD	126,278	25.920	3,273,125.760	
	ADECCO GROUP AG-REG	12,341	74.100	914,468.100	
	GEBERIT AG	2,801	427.500	1,197,427.500	
	LONZA GROUP AG-REG	5,901	257.100	1,517,147.100	
	LINDT & SPRUENGLI PART	75	5,830.000	437,250.000	
	LINDT & SPRUENGLI NAMEN	9	69,370.000	624,330.000	
	GIVAUDAN-REG	692	2,255.000	1,560,460.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	11,250	297.600	3,348,000.000	
	LAFARGEHOLCIM LTD	32,676	52.950	1,730,194.200	
	SONOVA HOLDING AG	3,168	157.300	498,326.400	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG	3,687	173.200	638,588.400	
	STRAUMANN HOLDING AG	600	719.000	431,400.000	
	THE SWATCH GROUP AG-B	1,955	373.300	729,801.500	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	4,592	71.550	328,557.600	
	SCHINDLER NAMEN	1,663	216.700	360,372.100	
	SWISS LIFE HOLDING AG	2,225	329.900	734,027.500	
	VIFOR PHARMA AG	3,050	122.200	372,710.000	
	EMS-CHEMIE HOLDING	553	652.500	360,832.500	
SWISS PRIME SITE AG	5,990	86.700	519,333.000		
DUFREY GROUP	2,390	139.000	332,210.000		
PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,272	669.500	851,604.000		
JULIUS BAER GROUP LTD	15,227	57.300	872,507.100		
SWISS RE LTD	20,638	90.650	1,870,834.700		
UBS GROUP AG	268,881	17.350	4,665,085.350		
スイス・フラン 小計		1,187,658		83,694,450.210 (9,584,688,439)	
スウェーデン・ク ローナ	ATLAS COPCO AB-A SHS	48,377	356.200	17,231,887.400	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	29,157	316.300	9,222,359.100	
	ERICSSON LM-B SHS	221,748	52.900	11,730,469.200	
	GETINGE AB-B SHS	13,153	146.400	1,925,599.200	

	LUNDBERGS B	3,691	613.000	2,262,583.000	
	SKF AB-B SHS	24,866	184.300	4,582,803.800	
	SANDVIK AB	76,781	140.100	10,757,018.100	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	95,918	99.400	9,534,249.200	
	SKANSKA AB-B SHS	21,179	182.700	3,869,403.300	
	SWEDBANK AB	66,507	201.900	13,427,763.300	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	108,388	113.500	12,302,038.000	
	VOLVO AB-B SHS	113,672	157.000	17,846,504.000	
	SWEDISH MATCH AB	11,481	333.700	3,831,209.700	
	TELE2 AB-B SHS	26,976	106.000	2,859,456.000	
	NORDEA AB	218,620	100.000	21,862,000.000	
	INDUSTRIVARDEN C	11,403	200.100	2,281,740.300	
	ELECTROLUX AB-SER B	19,191	269.800	5,177,731.800	
	SECURITAS AB-B SHS	24,098	145.800	3,513,488.400	
	INVESTOR AB-B SHS	33,412	387.800	12,957,173.600	
	HENNES&MAURITZ AB-B SHS	66,448	198.300	13,176,638.400	
	ASSA ABLOY AB-B	68,613	171.000	11,732,823.000	
	TELIA CO AB	184,927	37.420	6,919,968.340	
	LUNDIN PETROLEUM AB	16,790	188.900	3,171,631.000	
	BOLIDEN AB	21,855	261.400	5,712,897.000	
	ALFA LAVAL AB	17,411	192.500	3,351,617.500	
	KINNEVIK AB-B	18,310	270.600	4,954,686.000	
	MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR SA	5,332	558.500	2,977,922.000	
	ICA GRUPPEN AB	5,920	304.100	1,800,272.000	
	HUSQVARNA AB-B SHS	33,692	78.850	2,656,614.200	
	HEXAGON AB	20,529	412.200	8,462,053.800	
	ESSITY AB-B	39,797	246.700	9,817,919.900	
	スウェーデン・クローナ 小計	1,668,242		241,910,520.540 (3,251,277,396)	
デンマーク・ク ローネ	CARLSBERG AS-B	7,330	732.000	5,365,560.000	
	A P MOLLER A/S	481	10,630.000	5,113,030.000	
	AP MOLLER MAERSK A	273	10,140.000	2,768,220.000	
	DANSKE BANK A/S	50,188	237.600	11,924,668.800	
	GENMAB A/S	4,633	1,194.000	5,531,802.000	
	NOVOZYMES-B SHS	15,904	341.300	5,428,035.200	
	NOVO NORDISK A/S-B	134,315	329.000	44,189,635.000	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	15,808	400.600	6,332,684.800	
	TDC A/S	68,939	38.300	2,640,363.700	
	COLOPLAST-B	8,286	486.300	4,029,481.800	
	DSV A/S	13,040	486.600	6,345,264.000	
	WILLIAM DEMANT	6,537	176.200	1,151,819.400	
	H LUNDBECK A/S	4,840	303.900	1,470,876.000	
	TRYG A/S	11,107	155.100	1,722,695.700	
	PANDORA A/S	8,251	636.500	5,251,761.500	

	CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S	7,708	556.500	4,289,502.000	
	ISS A/S	11,125	233.000	2,592,125.000	
	ORSTED A/S	11,600	350.900	4,070,440.000	
デンマーク・クローネ 小計		380,365		120,217,964.900 (2,161,519,009)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	97,992	6.525	639,397.800	
	FISHER & PAYKEL	37,249	13.400	499,136.600	
	FLETCHER BUILDING LTD	75,281	7.160	539,011.960	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	210,161	3.690	775,494.090	
ニュージーランド・ドル 小計		420,683		2,453,040.450 (191,018,260)	
ノルウェー・クローネ	MARINE HARVEST	24,816	137.700	3,417,163.200	
	DNB ASA	70,426	152.300	10,725,879.800	
	NORSK HYDRO ASA	91,879	53.700	4,933,902.300	
	TELENOR ASA	53,178	181.700	9,662,442.600	
	ORKLA ASA	61,421	83.400	5,122,511.400	
	STATOIL ASA	81,414	166.800	13,579,855.200	
	YARA INTERNATIONAL ASA	11,279	366.100	4,129,241.900	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	16,683	149.800	2,499,113.400	
ノルウェー・クローネ 小計		411,096		54,070,109.800 (739,679,103)	
ユーロ	ALLIED IRISH BANKS PLC	52,322	5.407	282,905.050	
	CRH PLC	58,956	29.920	1,763,963.520	
	PADDY POWER BETFAIR PLC	6,246	98.360	614,356.560	
	KERRY GROUP PLC-A	11,576	92.520	1,071,011.520	
	UMICORE	15,320	39.380	603,301.600	
	AIR LIQUIDE	29,845	107.850	3,218,783.250	
	AIRBUS SE	42,646	87.770	3,743,039.420	
	AXA	139,550	25.270	3,526,428.500	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	34,622	21.330	738,487.260	
	ADIDAS AG	13,503	180.600	2,438,641.800	
	ASSICURAZIONI GENERALI	85,995	15.280	1,314,003.600	
	ABERTIS INFRASTRUCTURAS SA	38,521	18.900	728,046.900	
	DASSAULT AVIATION SA	157	1,358.000	213,206.000	
	DANONE	43,686	70.940	3,099,084.840	
	SAFRAN SA	22,050	89.070	1,963,993.500	
	INTESA SANPAOLO	934,915	2.880	2,692,555.200	
	INTESA SANPAOLO-RNC	51,178	2.746	140,534.780	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	22,705	85.480	1,940,823.400	
	ACCOR SA	10,552	43.080	454,580.160	
	BOSKALIS WESTMINSTER CT	7,563	30.880	233,545.440	
BOUYGUES	13,996	44.420	621,702.320		
BNP PARIBAS	80,451	65.040	5,232,533.040		

RELX NV	70,826	19.215	1,360,921.590	
THALES SA	8,128	85.650	696,163.200	
CAPGEMINI SA	11,481	97.960	1,124,678.760	
CASINO GUICHARD PERRACHON	4,264	51.000	217,464.000	
INGENICO GROUP	4,334	85.000	368,390.000	
UNICREDIT SPA	142,664	17.960	2,562,245.440	
NATIXIS	70,166	6.728	472,076.840	
KONINKLIJKE DSM NV	14,525	80.000	1,162,000.000	
COMMERZBANK AG	72,573	12.610	915,145.530	
EIFFAGE	4,777	92.750	443,066.750	
FRESENIUS SE & CO KGAA	30,156	66.220	1,996,930.320	
UNITED INTERNET	9,882	57.920	572,365.440	
FUCHS PETROLUB SE PREF	5,546	43.865	243,275.290	
PUBLICIS GROUPE	15,068	56.910	857,519.880	
MAN SE	3,396	94.650	321,431.400	
FAURECIA	3,831	64.060	245,413.860	
IBERDROLA SA	407,950	6.717	2,740,200.150	
ENI SPA	177,297	13.900	2,464,428.300	
IMERYS SA	2,256	77.630	175,133.280	
JERONIMO MARTINS	19,517	16.315	318,419.850	
KBC GROUPE	18,378	72.000	1,323,216.000	
HANNOVER RUECK SE	3,642	107.750	392,425.500	
WARTSILA OYJ	11,645	52.700	613,691.500	
L'OREAL	18,067	188.400	3,403,822.800	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	19,742	247.400	4,884,170.800	
LAGARDERE S.C.A.	9,600	27.860	267,456.000	
GEA GROUP AG	14,635	39.895	583,863.320	
BOLLORE	71,347	4.446	317,208.760	
MEDIOBANCA SPA	42,404	9.625	408,138.500	
MICHELIN(CGDE)-B	12,118	124.650	1,510,508.700	
CONTINENTAL AG	7,776	224.400	1,744,934.400	
DEUTSCHE POST AG-REG	69,944	40.410	2,826,437.040	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	14,426	10.955	158,036.830	
NOKIAN RENKAAT OYJ	9,399	36.620	344,191.380	
AXEL SPRINGER SE	3,067	68.060	208,740.020	
OMV AG	9,766	52.490	512,617.340	
PERNOD-RICARD	16,249	132.000	2,144,868.000	
PEUGEOT SA	42,232	16.910	714,143.120	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG- PFD	12,066	71.280	860,064.480	
RENAULT SA	12,442	84.410	1,050,229.220	
REPSOL SA	80,598	15.475	1,247,254.050	
REMY COINTREAU	1,860	116.350	216,411.000	
MERCK KGAA	9,551	88.860	848,701.860	
COMPAGNIE DE SAINT- GOBAIN	35,706	47.720	1,703,890.320	

RWE AG	39,183	20.395	799,137.280	
SEB SA	1,405	151.800	213,279.000	
LUXOTTICA GROUP SPA	11,602	51.450	596,922.900	
SOCIETE GENERALE-A	56,596	43.915	2,485,413.340	
VINCI S.A.	35,362	87.760	3,103,369.120	
SODEXO	6,286	112.400	706,546.400	
SOLVAY SA	5,036	116.550	586,945.800	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	38,899	71.170	2,768,441.830	
VIVENDI SA	77,297	22.195	1,715,606.910	
SAP SE	69,054	95.540	6,597,419.160	
TELEFONICA S.A	322,715	8.626	2,783,739.590	
TOTAL SA	168,622	47.025	7,929,449.550	
VALEO	17,731	59.710	1,058,718.010	
E.ON SE	164,012	9.790	1,605,677.480	
VOEST-ALPINE AG	9,875	48.130	475,283.750	
ZODIAC AEROSPACE	15,282	24.835	379,528.470	
HENKEL AG & CO KGAA	7,525	103.250	776,956.250	
SIEMENS AG-REG	53,706	115.200	6,186,931.200	
UPM-KYMMENE OYJ	36,917	25.330	935,107.610	
ING GROEP NV-CVA	272,880	15.650	4,270,572.000	
BAYER AG	58,437	104.700	6,118,353.900	
STORA ENSO OYJ-R SHS	42,303	12.960	548,246.880	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	13,173	113.400	1,493,818.200	
DAIMLER AG	68,086	70.300	4,786,445.800	
BASF SE	65,128	94.080	6,127,242.240	
BEIERSDORF AG	6,780	101.050	685,119.000	
HOCHTIEF AG	1,707	145.100	247,685.700	
HEIDELBERGCEMENT AG	11,009	90.260	993,672.340	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	15,048	87.300	1,313,690.400	
ORANGE	141,819	14.640	2,076,230.160	
SAMPO OYJ-A SHS	28,897	44.900	1,297,475.300	
RANDSTAD HOLDINGS	7,794	51.940	404,820.360	
ALLIANZ SE	32,540	199.150	6,480,341.000	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	191,094	2.908	555,701.350	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	91,426	18.565	1,697,323.690	
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	17,602	28.705	505,265.410	
HERMES INTL	2,285	440.000	1,005,400.000	
ENDESA S.A.	21,037	19.100	401,806.700	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	19,748	30.130	595,007.240	
ERSTE GROUP BANK AG	23,324	35.800	834,999.200	
MUENCHENER RUECKVER AG- REG	11,346	184.800	2,096,740.800	
ARCELOR MITTAL (NL)	51,058	26.455	1,350,739.390	
SOCIETE BIC SA	2,478	93.000	230,454.000	
DASSAULT SYSTEMES SA	8,961	89.550	802,457.550	

ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	15,049	32.415	487,813.330	
HEINEKEN NV	17,373	85.580	1,486,781.340	
AKZO NOBEL	18,209	74.240	1,351,836.160	
ASML HOLDING NV	27,421	146.850	4,026,773.850	
AEGON NV	120,404	5.247	631,759.780	
BANKINTER S.A.	57,960	7.992	463,216.320	
VOLKSWAGEN AG	2,794	170.100	475,259.400	
VOLKSWAGEN AG PFD	13,134	172.150	2,261,018.100	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	464,350	7.210	3,347,963.500	
KERING	5,479	385.750	2,113,524.250	
CNP ASSURANCES	13,987	18.680	261,277.160	
FORTUM OYJ	29,739	17.210	511,808.190	
AGEAS	12,993	42.010	545,835.930	
UCB SA	8,747	64.080	560,507.760	
THYSSENKRUPP AG	29,903	22.900	684,778.700	
UNILEVER NV-CVA	115,530	48.815	5,639,596.950	
CARREFOUR SA	39,144	17.710	693,240.240	
GAS NATURAL SDG SA	29,010	19.510	565,985.100	
ATOS SE	7,050	125.200	882,660.000	
NOKIA OYJ	417,248	3.934	1,641,453.630	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	70,960	32.595	2,312,941.200	
WOLTERS KLUWER-CVA	20,558	43.740	899,206.920	
SANOFI	81,462	73.180	5,961,389.160	
STMICROELECTRONICS NV	45,866	18.300	839,347.800	
ELISA OYJ	9,517	34.590	329,193.030	
BANCO SANTANDER SA	1,164,128	5.630	6,554,040.640	
METSO OYJ	8,585	29.130	250,081.050	
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	34,596	19.145	662,340.420	
QIAGEN N.V.	13,642	26.575	362,536.150	
DRILLISCH AG	3,149	67.970	214,037.530	
DEUTSCHE BANK AG-REG	149,244	16.490	2,461,033.560	
BMW VORZUG	4,116	73.360	301,949.760	
K & S	14,982	19.620	293,946.840	
ENEL SPA	600,898	5.580	3,353,010.840	
COLRUYT NV	4,673	45.085	210,682.200	
VOPAK (KON.)	5,364	35.875	192,433.500	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	232,897	15.520	3,614,561.440	
LEONARDO SPA	26,269	9.990	262,427.310	
UBISOFT ENTERTAINMENT	3,930	66.490	261,305.700	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	81,774	22.795	1,864,038.330	
KONINKLIJKE KPN NV	228,967	2.924	669,499.500	
EUROFINS SCIENTIFIC	794	508.700	403,907.800	
UNIPOLSAI SPA	91,992	1.929	177,452.560	
TELEPERFORMANCE	3,607	119.100	429,593.700	
DEUTSCHE BOERSE AG	13,844	99.020	1,370,832.880	
EURAZEO	2,427	75.390	182,971.530	

BANCO SABADELL	367,753	1.703	626,283.350	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	5,814	90.810	527,969.340	
FRAPORT AG	3,149	87.460	275,411.540	
HEINEKEN HOLDING NV-A	8,014	80.610	646,008.540	
INDITEX	79,821	31.075	2,480,437.570	
JC DECAUX SA	6,058	34.160	206,941.280	
ANDRITZ AG	6,265	48.005	300,751.320	
MAPFRE SA	84,474	2.719	229,684.800	
ESSILOR INTL	14,632	114.350	1,673,169.200	
SNAM SPA	158,419	4.310	682,785.890	
CREDIT AGRICOLE SA	85,585	14.670	1,255,531.950	
ENAGAS	18,095	25.085	453,913.070	
WENDEL	2,220	141.900	315,018.000	
WIRECARD AG	7,990	89.310	713,586.900	
TENARIS SA	38,237	12.670	484,462.790	
TELECOM ITALIA SPA	792,163	0.754	597,290.900	
TELECOM ITALIA-RNC	497,596	0.627	311,992.690	
ATLANTIA SPA	34,969	27.750	970,389.750	
ILIAD SA	2,102	205.750	432,486.500	
PROXIMUS	8,922	28.695	256,016.790	
SES FDR	24,585	14.785	363,489.220	
TERNA SPA	81,915	5.280	432,511.200	
GRIFOLS SA	18,800	24.080	452,704.000	
FERROVIAL SA	36,997	18.635	689,439.090	
LANXESS AG	6,856	63.000	431,928.000	
NESTE OYJ	10,692	51.000	545,292.000	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	9,641	29.500	284,409.500	
RECORDATI SPA	6,859	38.680	265,306.120	
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	35,583	6.610	235,203.630	
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	3,134	148.450	465,242.300	
KONE OYJ	23,717	44.150	1,047,105.550	
ENGIE	129,539	14.815	1,919,120.280	
ALSTOM	12,046	34.260	412,695.960	
TELENET GROUP HOLDING NV	3,634	57.600	209,318.400	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	12,542	19.130	239,928.460	
ELECTRICITE DE FRANCE	34,756	11.300	392,742.800	
IPSEN SA	2,487	99.740	248,053.380	
DEUTSCHE WOHNEN	26,714	37.205	993,894.370	
ARKEMA SA	3,796	101.450	385,104.200	
LEGRAND SA	19,920	63.070	1,256,354.400	
ADP	2,313	164.500	380,488.500	
ORION OYJ	8,051	30.300	243,945.300	
RTL GROUP SA	3,446	68.040	234,465.840	
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	37,921	15.560	590,050.760	

SYMRISE AG	7,926	71.250	564,727.500		
SCOR SE	13,875	33.750	468,281.250		
REXEL SA	23,245	15.260	354,718.700		
PRYSMIAN SPA	14,925	27.400	408,945.000		
CAIXABANK	262,372	4.039	1,059,720.500		
BUREAU VERITAS SA	21,480	22.730	488,240.400		
GROUPE EUROTUNNEL SE	37,646	10.980	413,353.080		
SUEZ SA	25,406	15.825	402,049.950		
AMADEUS IT GROUP SA	30,169	60.790	1,833,973.510		
BRENNTAG AG	9,600	53.320	511,872.000		
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GROUP SA	44,747	7.251	324,460.490		
EVONIK INDUSTRIES AG	11,575	31.995	370,342.120		
EDENRED	13,195	24.105	318,065.470		
BANKIA SA	63,197	4.150	262,267.550		
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	61,541	4.200	258,472.200		
HUGO BOSS AG -ORD	5,218	71.900	375,174.200		
OSRAM LICHT AG	7,017	71.030	498,417.510		
KION GROUP AG	6,125	67.310	412,273.750		
VONOVIA SE	35,308	41.220	1,455,395.760		
BANK OF IRELAND GROUP PLC	73,287	6.930	507,878.910		
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS PLC	14,000	33.020	462,280.000		
FERRARI NV	8,338	90.200	752,087.600		
METRO AG	10,774	17.615	189,784.010		
INNOGY SE	9,769	39.535	386,217.410		
CNH INDUSTRIAL NV	78,645	11.100	872,959.500		
LINDE AG-TENDER	13,375	195.350	2,612,806.250		
NN GROUP NV	21,965	37.200	817,098.000		
ZALANDO SE	6,674	45.415	303,099.710		
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	82,323	14.890	1,225,789.470		
AENA SME SA	5,256	168.700	886,687.200		
ABN AMRO GROUP NV	29,129	26.550	773,374.950		
EXOR NV	9,441	51.250	483,851.250		
ALTICE NV-A	43,403	7.327	318,013.780		
COVESTRO AG	8,603	83.800	720,931.400		
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	54,880	94.430	5,182,318.400		
POSTE ITALIANE SPA	40,015	6.125	245,091.870		
AMUNDI SA	3,894	72.250	281,341.500		
SCHAEFFLER AG	12,644	14.195	179,481.580		
UNIPER SE	13,897	25.060	348,258.820		
ユーロ 小計	14,061,583		290,358,779.760 (38,850,004,733)		
香港・ドル	ASM PACIFIC TECH	16,600	106.200	1,762,920.000	

HANG LUNG PROPERTIES LTD	164,000	18.280	2,997,920.000	
BANK OF EAST ASIA	76,260	32.800	2,501,328.000	
CLP HOLDINGS LTD	119,500	78.350	9,362,825.000	
PCCW LTD	331,000	4.490	1,486,190.000	
LI & FUNG LTD	532,400	3.850	2,049,740.000	
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	49,000	67.300	3,297,700.000	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	79,040	227.400	17,973,696.000	
MTR CORP	118,500	45.400	5,379,900.000	
HANG LUNG GROUP LTD	63,000	27.900	1,757,700.000	
HANG SENG BANK LTD	56,000	185.900	10,410,400.000	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	83,844	48.250	4,045,473.000	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	96,500	66.200	6,388,300.000	
(THE) WHARF HOLDINGS LTD	95,750	26.500	2,537,375.000	
HONG KONG & CHINA GAS	610,046	15.400	9,394,708.400	
HYSAN DEVELOPMENT CO	50,000	42.200	2,110,000.000	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	164,000	57.500	9,430,000.000	
KERRY PROPERTIES LTD	33,000	33.150	1,093,950.000	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	289,000	38.350	11,083,150.000	
YUE YUEN INDUSTRIAL HOLDINGS	50,500	28.850	1,456,925.000	
NEW WORLD DEVELOPMENT	441,266	11.060	4,880,401.960	
SINO LAND CO	255,400	13.460	3,437,684.000	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	103,000	121.500	12,514,500.000	
SWIRE PACIFIC LTD A	30,000	73.100	2,193,000.000	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	113,500	45.900	5,209,650.000	
WHEELLOCK & CO LTD	56,000	53.700	3,007,200.000	
KINGSTON FINANCIAL GROUP LTD	258,000	8.360	2,156,880.000	
MINTH GROUP LTD	44,000	46.250	2,035,000.000	
SJM HOLDINGS LTD	299,000	6.230	1,862,770.000	
WYNN MACAU LTD	124,400	23.000	2,861,200.000	
MGM CHINA HOLDINGS LTD	64,800	21.950	1,422,360.000	
AIA GROUP LTD	849,627	61.800	52,506,948.600	
HKT TRUST / HKT LTD	282,000	9.700	2,735,400.000	
SANDS CHINA LTD	169,200	38.450	6,505,740.000	
SWIRE PROPERTIES LTD	104,200	25.650	2,672,730.000	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT CO LTD	95,750	49.500	4,739,625.000	
HK ELECTRIC INVESTMENTS & HK ELECTRIC INVESTMENTS LTD	230,000	7.140	1,642,200.000	
WH GROUP LTD	530,500	8.680	4,604,740.000	

	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	199,332	96.700	19,275,404.400	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	198,832	65.800	13,083,145.600	
香港・ドル	小計	7,526,747		255,866,779.960 (3,725,420,316)	
合計		87,575,105		287,108,328.050 (287,108,328,050)	

(2) 株式以外の有価証券

平成29年12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	63,819.000	661,164.840	
		GOODMAN GROUP	121,619.000	1,045,923.400	
		GPT GROUP	144,955.000	778,408.350	
		LENDLEASE GROUP	37,363.000	601,544.300	
		MIRVAC GROUP	295,783.000	730,584.010	
		SCENTRE GROUP	383,688.000	1,619,163.360	
		STOCKLAND	126,459.000	586,769.760	
		VICINITY CENTRES	270,443.000	754,535.970	
	WESTFIELD CORP	140,035.000	1,188,897.150		
	オーストラリア・ドル	小計	1,584,164.000	7,966,991.140 (680,460,713)	
	シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	200,806.000	536,152.020	
		CAPITALAND MALL TRUST	199,000.000	413,920.000	
		SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	192,100.000	391,884.000	
	シンガポール・ドル	小計	591,906.000	1,341,956.020 (112,684,047)	
投資信託受益証券	合計		2,176,070	793,144,760 (793,144,760)	
投資証券	アメリカ・ドル	AGNC INVESTMENT CORP	25,741.000	524,344.170	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	7,304.000	949,520.000	
		AMERICAN TOWER CORP	30,693.000	4,372,831.710	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	77,528.000	923,358.480	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	10,463.000	1,906,567.860	
		BOSTON PROPERTIES INC	11,168.000	1,392,202.880	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	21,975.000	394,011.750	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	6,285.000	579,225.600	
		COLONY NORTHSTAR INC	39,311.000	478,807.980	
		CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	28,166.000	3,084,177.000	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	15,118.000	1,735,697.580	
		DUKE REALTY TRUST	24,470.000	682,957.700	
		EQUINIX INC	5,753.000	2,602,599.670	
EQUITY RESIDENTIAL	27,070.000	1,781,476.700			

	ESSEX PROPERTY TRUST INC	4,524.000	1,105,258.440	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	8,141.000	702,405.480	
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	4,144.000	539,921.760	
	GGP INC	43,463.000	1,018,338.090	
	HCP INC	34,130.000	914,001.400	
	HOST HOTELS & RESORTS INC	51,147.000	1,014,756.480	
	INVITATION HOMES INC	22,567.000	533,709.550	
	IRON MOUNTAIN INC	19,265.000	772,911.800	
	KIMCO REALTY	32,980.000	603,204.200	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	11,649.000	521,642.220	
	MID AMERICA	8,123.000	837,724.990	
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	10,544.000	443,691.520	
	PROLOGIS INC	38,966.000	2,577,990.560	
	PUBLIC STORAGE	11,151.000	2,351,076.840	
	REALTY INCOME CORP	21,640.000	1,202,751.200	
	REGENCY CENTERS CORP	11,294.000	763,248.520	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	8,169.000	1,349,437.110	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	22,664.000	3,677,234.000	
	SL GREEN	5,382.000	552,193.200	
	THE MACERICH COMPANY	9,014.000	592,670.500	
	UDR INC	17,458.000	681,385.740	
	VENTAS INC	25,041.000	1,585,345.710	
	VEREIT INC	72,429.000	574,361.970	
	VORNADO REALTY TRUST	12,211.000	940,124.890	
	WELLTOWER INC	26,516.000	1,758,541.120	
	WEYERHAEUSER CO	51,939.000	1,840,198.770	
アメリカ・ドル 小計		915,596.000	50,861,905.140 (5,780,455,519)	
イギリス・ポンド	BRITISH LAND CO PLC	71,871.000	470,755.050	
	HAMMERSON PLC	58,616.000	308,613.240	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	37,974.000	363,980.790	
	SEGRO PLC	61,113.000	342,843.930	
イギリス・ポンド 小計		229,574.000	1,486,193.010 (226,332,333)	
カナダ・ドル	H & R REAL ESTATE INVESTMENT	10,748.000	227,857.600	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	9,675.000	240,423.750	
	SMARTCENTRES REIT	2,582.000	75,988.260	
カナダ・ドル 小計		23,005.000	544,269.610 (48,102,548)	
ユーロ	FONCIERE DES REGIONS	2,343.000	217,664.700	
	GECINA SA	3,670.000	537,104.500	
	ICADE	2,234.000	182,450.780	
	KLEPIERRE	17,042.000	606,695.200	

	UNIBAIL-RODAMCO SE	7,221.000	1,621,114.500	
ユーロ 小計		32,510.000	3,165,029.680 (423,480,971)	
香港・ドル	LINK REIT	163,500.000	11,412,300.000	
香港・ドル 小計		163,500.000	11,412,300.000 (166,163,088)	
投資証券 合計		1,364,185	6,644,534,459 (6,644,534,459)	
合計			7,437,679,219 (7,437,679,219)	

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

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入 投資信託 受益証券 時価比率	組入 投資証券 時価比率	有価証券の 合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	株式 604銘柄 投資証券 40銘柄	62.62% -	-% -	-% 1.93%	65.73%
イギリス・ポンド	株式 100銘柄 投資証券 4銘柄	6.80% -	-% -	-% 0.08%	7.00%
イスラエル・シケル	株式 8銘柄	0.10%	-%	-%	0.10%
オーストラリア・ドル	株式 60銘柄 投資信託 受益証券 9銘柄	2.45% -	-% 0.23%	-% -	2.73%
カナダ・ドル	株式 87銘柄 投資証券 3銘柄	3.75% -	-% -	-% 0.02%	3.84%
シンガポール・ドル	株式 21銘柄 投資信託 受益証券 3銘柄	0.49% -	-% 0.04%	-% -	0.54%
スイス・フラン	株式 36銘柄	3.20%	-%	-%	3.25%
スウェーデン・クローナ	株式 31銘柄	1.08%	-%	-%	1.10%
デンマーク・クローネ	株式 18銘柄	0.72%	-%	-%	0.73%
ニュージーランド・ドル	株式 4銘柄	0.06%	-%	-%	0.06%
ノルウェー・クローネ	株式 8銘柄	0.25%	-%	-%	0.25%
ユーロ	株式 239銘柄 投資証券 5銘柄	12.95% -	-% -	-% 0.14%	13.33%
香港・ドル	株式 40銘柄 投資証券 1銘柄	1.24% -	-% -	-% 0.06%	1.32%

(注) 「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

「外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位:円)

科 目	注記 番号	平成29年6月12日現在	平成29年12月11日現在
資産の部			
流動資産			
預金		245,394,615	359,312,848
コール・ローン		50,970,512	124,592,247
投資信託受益証券		4,720,517,725	6,078,593,099
投資証券		37,519,537,477	48,197,526,646
派生商品評価勘定		-	60,814
未収入金		366,282	355,207
未収配当金		36,346,476	85,289,208
流動資産合計		42,573,133,087	54,845,730,069
資産合計		42,573,133,087	54,845,730,069
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		104	3,350
未払金		165,282,234	332,839,444
未払解約金		18,228,000	71,609,000
流動負債合計		183,510,338	404,451,794
負債合計		183,510,338	404,451,794
純資産の部			
元本等			
元本	1	36,587,045,283	43,966,878,704
剰余金			
剰余金又は欠損金()		5,802,577,466	10,474,399,571
元本等合計		42,389,622,749	54,441,278,275
純資産合計		42,389,622,749	54,441,278,275
負債純資産合計		42,573,133,087	54,845,730,069

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	平成29年6月12日現在	平成29年12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	30,812,691,404円	36,587,045,283円
同期中追加設定元本額	12,792,115,580円	16,080,609,497円
同期中一部解約元本額	7,017,761,701円	8,700,776,076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）	148,099,096円	259,436,746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）	49,262,456円	67,592,212円
MITO ラップ型ファンド（安定型）	7,190,802円	5,952,717円
MITO ラップ型ファンド（中立型）	18,673,980円	15,294,678円
MITO ラップ型ファンド（積極型）	54,028,832円	40,205,489円

グローバル8資産ラップファンド(安定型)	10,567,281円	22,195,990円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	17,208,529円	20,297,177円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	30,710,019円	28,756,420円
たわらノーロード 先進国リート	1,271,367,700円	1,629,383,910円
たわらノーロード 先進国リート<ラップ向け>	172,054,982円	361,919,156円
たわらノーロード 先進国リート<為替ヘッジあり>	66,428,715円	123,705,209円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	- 円	16,530,116円
たわらノーロード バランス(堅実型)	- 円	8,087円
たわらノーロード バランス(標準型)	- 円	41,257円
たわらノーロード バランス(積極型)	- 円	98,684円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定成長型)	- 円	49,181円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(成長型)	- 円	90,164円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(積極型)	- 円	122,951円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	24,915,671円	22,842,669円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	559,206,654円	541,590,645円
マネックス資産設計ファンドエボリューション	56,673,619円	78,019,353円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	22,955,315円	25,533,392円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	65,018,641円	82,501,849円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	140,608,841円	178,946,185円
投資のソムリエ	3,410,793,616円	5,945,400,383円
投資のソムリエ<DC年金>	159,006,554円	369,898,842円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	77,772,113円	96,488,767円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	84,977,131円	164,457,206円
ダイナミック・ナビゲーション	272,679円	286,863円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	822,655,504円	2,152,464,782円
ワールドアセットバランス(基本コース)	487,108,825円	1,084,970,314円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	876,797,151円	3,831,363,774円

投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2045)	- 円	750,278円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2055)	- 円	750,278円
リスク抑制世界8資産バランス ファンド(DC)	- 円	719,560円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2035)	- 円	737,705円
DIAMパッシブ資産分散ファ ンド	1,345,356,407円	1,154,217,638円
DIAM外国リートインデック スファンド<DC年金>	13,263,134円	20,809,211円
為替フルヘッジ型外国リート・ パッシブ・ファンド(適格機関 投資家限定)	210,882,076円	- 円
DIAMアクティブアローケー ション私募ファンド(適格機関 投資家限定)	169,827,949円	- 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)	4,033,069,656円	3,320,847,770円
DIAMグローバル 私募ファ ンド(適格機関投資家向け)	34,702,295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)	12,274,255,185円	11,576,729,030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)	2,576,737,128円	3,378,690,199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)	3,246,647,485円	3,516,755,372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)	3,486,991,305円	3,257,586,698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)	560,957,957円	560,259,469円
計	36,587,045,283円	43,966,878,704円
2. 受益権の総数	36,587,045,283口	43,966,878,704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1月18日 至 平成29年6月12日	自 平成29年6月13日 至 平成29年12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29年6月12日現在	平成29年12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29年6月12日現在	平成29年12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	12,865,062	216,877,113
投資証券	85,423,834	81,576,304
合計	72,558,772	298,453,417

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(平成28年6月23日から平成29年6月12日まで及び平成29年6月23日から平成29年12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29年6月12日 現在				平成29年12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								
買 建	6,422,624	-	6,422,520	104	87,859,366	-	87,916,830	57,464
アメリカ・ドル	-	-	-	-	56,822,250	-	56,820,000	2,250
イギリス・ポンド	-	-	-	-	4,568,634	-	4,568,400	234
オーストラリア・ドル	-	-	-	-	14,477,090	-	14,517,500	40,410
カナダ・ドル	-	-	-	-	2,209,450	-	2,209,250	200
シンガポール・ドル	-	-	-	-	3,600,906	-	3,610,280	9,374
ユーロ	6,422,624	-	6,422,520	104	2,408,436	-	2,408,400	36
香港・ドル	-	-	-	-	3,772,600	-	3,783,000	10,400
合計	6,422,624	-	6,422,520	104	87,859,366	-	87,916,830	57,464

(注) 時価の算定方法

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

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

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

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

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

(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29年6月12日現在	平成29年12月11日現在
1口当たり純資産額	1.1586円	1.2382円
(1万口当たり純資産額)	(11,586円)	(12,382円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

平成29年12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	136,265.000	572,313.000	
		ARENA REIT	112,770.000	270,648.000	
		BWP TRUST	193,740.000	623,842.800	
		CHARTER HALL GROUP	190,502.000	1,196,352.560	
		CHARTER HALL LONG WALE REIT	61,240.000	266,394.000	
		CHARTER HALL RETAIL REIT	139,186.000	599,891.660	
		CROMWELL PROPERTY GROUP	512,470.000	527,844.100	
		DEXUS	412,877.000	4,277,405.720	
		FOLKESTONE EDUCATION TRUST	90,510.000	257,953.500	
		GDI PROPERTY GROUP	201,160.000	260,502.200	
		GOODMAN GROUP	656,481.000	5,645,736.600	
		GPT GROUP	734,124.000	3,942,245.880	
		GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA	108,140.000	386,059.800	
		HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD	56,730.000	188,910.900	
		INDUSTRIA REIT	41,950.000	108,650.500	
		INGENIA COMMUNITIES GROUP	88,080.000	251,028.000	
		INVESTA OFFICE FUND	201,350.000	972,520.500	
		MIRVAC GROUP	1,515,044.000	3,742,158.680	
		NATIONAL STORAGE REIT	217,320.000	343,365.600	
		PROPERTYLINK GROUP	170,770.000	175,893.100	
		RURAL FUNDS GROUP	108,070.000	257,206.600	
		SCENTRE GROUP	2,193,063.000	9,254,725.860	
		SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	303,304.000	733,995.680	
		STOCKLAND	984,149.000	4,566,451.360	
		VICINITY CENTRES	1,336,051.000	3,727,582.290	
		VIVA ENERGY REIT	184,125.000	403,233.750	
WESTFIELD CORP	787,791.000	6,688,345.590			
	オーストラリア・ドル 小計		11,737,262.000	50,241,258.230 (4,291,105,865)	
	カナダ・ドル	KILLAM APARTMENT REIT	15,960.000	230,143.200	
	カナダ・ドル 小計		15,960.000	230,143.200 (20,340,056)	

シンガポール・ドル	AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL REIT	240,195.000	326,665.200	
	ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	320,000.000	272,000.000	
	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	991,760.000	2,647,999.200	
	ASCOTT RESIDENCE TRUST	511,915.000	609,178.850	
	CACHE LOGISTICS TRUST	420,080.000	354,967.600	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	1,058,079.000	1,989,188.520	
	CAPITALAND MALL TRUST	1,114,260.000	2,317,660.800	
	CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST	222,080.000	353,107.200	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	317,500.000	530,225.000	
	ESR REIT	477,000.000	269,505.000	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	326,000.000	231,460.000	
	FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	242,800.000	337,492.000	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	230,300.000	508,963.000	
	FRASERS COMMERCIAL TRUST	240,080.000	348,116.000	
	FRASERS LOGISTICS & INDUSTRIAL TRUST	470,600.000	517,660.000	
	KEPPEL DC REIT	300,400.000	426,568.000	
	KEPPEL REIT	716,200.000	895,250.000	
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST	820,300.000	340,424.500	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	773,300.000	1,221,814.000	
	MAPLETREE GREATER CHINA COMMERCIAL TRUST	716,900.000	845,942.000	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	489,720.000	974,542.800	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	831,820.000	1,056,411.400	
	QUE HOSPITALITY TRUST	442,320.000	360,490.800	
	PARKWAY LIFE REIT	157,000.000	450,590.000	
	SABANA SHARIAH COMP IND REIT	335,900.000	137,719.000	
	SOILBUILD BUSINESS SPACE REIT	281,000.000	182,650.000	
	SPH REIT	266,300.000	276,952.000	
STARHILL GLOBAL REIT	537,000.000	408,120.000		
SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	908,490.000	1,853,319.600		
シンガポール・ドル 小計	14,759,299.000	21,044,982.470 (1,767,147,178)		
投資信託受益証券 合計	26,512,521	6,078,593,099		

				(6,078,593,099)	
投資証券	アメリカ・ドル	ACADIA REALTY TRUST	34,264.000	940,546.800	
		AGREE REALTY CORP	11,820.000	587,335.800	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	19,385.000	562,746.550	
		ALEXANDER'S INC.	1,549.000	608,757.000	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	38,591.000	5,016,830.000	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	16,840.000	648,171.600	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	56,333.000	2,438,092.240	
		AMERICAN HOMES 4 RENT	103,233.000	2,247,382.410	
		APARTMENT INVT & MGMT CO-A	64,807.000	2,859,932.910	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	85,945.000	1,696,554.300	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC	19,135.000	296,783.850	
		ASHFORD HOSPITALITY PRIME INC	13,350.000	123,354.000	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	36,770.000	246,359.000	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	56,858.000	10,360,664.760	
		BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH REIT INC	9,570.000	105,174.300	
		BOSTON PROPERTIES INC	63,559.000	7,923,264.940	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	71,868.000	1,281,406.440	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	125,019.000	2,241,590.670	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	38,123.000	3,513,415.680	
		CARETRUST REIT INC	31,310.000	554,187.000	
		CBL & ASSOCIATES	70,590.000	396,715.800	
		CEDAR REALTY TRUST INC	34,500.000	209,760.000	
		CHATHAM LODGING TRUST	18,222.000	408,719.460	
		CHESAPEAKE LODGING TRUST	24,596.000	688,933.960	
		CITY OFFICE REIT INC	12,140.000	157,577.200	
		CLIPPER REALTY INC	5,515.000	55,370.600	
		COLONY NORTHSTAR INC	227,581.000	2,771,936.580	
		COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	49,668.000	1,095,676.080	
		COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	7,520.000	202,212.800	
		CORECIVIC INC	48,416.000	1,091,780.800	
		CORESITRE REALTY CORP	14,014.000	1,618,056.440	
		CORPORATE OFFICE PROPERTIES	40,757.000	1,231,676.540	
		COUSINS PROPERTIES INC	172,152.000	1,607,899.680	
		CUBESMART	73,873.000	2,116,461.450	

CYRUSONE INC	37,431.000	2,262,703.950	
DCT INDUSTRIAL TRUST INC	38,165.000	2,278,450.500	
DDR CORP	125,035.000	955,267.400	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	82,057.000	923,961.820	
DIGITAL REALTY TRUST INC	84,260.000	9,673,890.600	
DOUGLAS EMMETT INC	63,209.000	2,568,181.670	
DUKE REALTY TRUST	146,688.000	4,094,062.080	
EAST GROUP	14,058.000	1,283,917.140	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	18,048.000	389,836.800	
EDUCATION REALTY TRUST INC	29,985.000	1,079,460.000	
EMPIRE STATE REALTY TRUST INC	52,306.000	1,065,473.220	
EPR PROPERTIES	26,272.000	1,759,698.560	
EQUITY COMMONWEALTH	50,861.000	1,534,476.370	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	35,897.000	3,275,960.220	
EQUITY RESIDENTIAL	151,251.000	9,953,828.310	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	27,186.000	6,641,811.660	
EXTRA SPACE STORAGE INC	51,909.000	4,478,708.520	
FARMLAND PARTNERS INC	14,870.000	131,896.900	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	29,797.000	3,882,251.130	
FIRST INDUSTRIAL RT	49,123.000	1,590,111.510	
FOREST CITY REALTY TRUST INC	110,111.000	2,654,776.210	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST INC	25,240.000	640,086.400	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	45,106.000	481,732.080	
GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	82,460.000	2,985,876.600	
GEO GROUP INC	50,826.000	1,244,220.480	
GETTY REALTY CORP	13,824.000	387,348.480	
GGP INC	257,250.000	6,027,367.500	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	11,770.000	253,878.900	
GLADSTONE LAND CORP	4,860.000	65,561.400	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	6,945.000	60,768.750	
GLOBAL NET LEASE INC	27,575.000	583,762.750	
GOVERNMENT PROPERTIES INCOME TRUST	39,375.000	720,168.750	
GRAMERCY PROPERTY TRSUT	65,868.000	1,826,519.640	
HCP INC	193,280.000	5,176,038.400	

HEALTHCARE REALTY TRUST INC	50,745.000	1,655,809.350	
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA INC	82,840.000	2,529,933.600	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	16,280.000	283,597.600	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	42,329.000	2,179,520.210	
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	67,349.000	2,027,878.390	
HOST HOTELS & RESORTS INC	304,928.000	6,049,771.520	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	63,679.000	2,212,208.460	
INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	34,585.000	349,308.500	
INFREIT INC	16,110.000	323,972.100	
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	51,302.000	300,629.720	
INVITATION HOMES INC	117,698.000	2,783,557.700	
IRON MOUNTAIN INC	109,002.000	4,373,160.240	
ISTAR INC	28,179.000	318,986.280	
JBG SMITH PROPERTIES	38,264.000	1,302,889.200	
KILROY REALTY CORP	40,591.000	3,055,284.570	
KIMCO REALTY	175,632.000	3,212,309.280	
KITE REALTY GROUP TRUST	33,940.000	642,484.200	
LASALLE HOTEL PROPERTIES	46,395.000	1,301,379.750	
LEXINGTON REALTY TRUST	88,715.000	909,328.750	
LIBERTY PROPERTY TRUST	60,809.000	2,723,027.020	
LIFE STORAGE INC	19,088.000	1,721,355.840	
LTC PROPERTIES INC	16,195.000	734,119.350	
MACK CALI	36,809.000	795,442.490	
MANULIFE US REIT	407,100.000	368,425.500	
MEDEQUITIES REALTY TRUST INC	14,060.000	153,394.600	
MEDICAL PROPERTIES TRUST	149,275.000	2,027,154.500	
MID AMERICA	46,829.000	4,829,474.770	
MONMOUTH RE INVEST CP -CL A	30,690.000	553,340.700	
NATIONAL HEALTH INVS INC	16,794.000	1,313,962.560	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	61,610.000	2,592,548.800	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUST	18,280.000	476,559.600	
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP INC	33,990.000	264,782.100	

NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	7,970.000	221,486.300	
NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP	22,880.000	325,582.400	
OMEGA HEALTHCARE INVS INC	80,873.000	2,231,286.070	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	6,990.000	183,138.000	
PARAMOUNT GROUP INC	83,171.000	1,309,111.540	
PARK HOTELS & RESORTS INC	66,573.000	1,891,338.930	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	28,247.000	1,062,087.200	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	28,220.000	305,622.600	
PHYSICIANS REALTY TRUST	72,884.000	1,313,369.680	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC	59,611.000	1,189,835.560	
PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES INC	14,602.000	306,349.960	
PROLOGIS INC	218,946.000	14,485,467.360	
PS BUSINESS PARKS	8,138.000	1,056,719.300	
PUBLIC STORAGE	61,605.000	12,988,798.200	
QTS REALTY TRUST INC	19,940.000	1,089,322.200	
QUALITY CARE PROPERTIES INC	38,700.000	568,116.000	
RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES	32,790.000	475,127.100	
REALTY INCOME CORP	112,923.000	6,276,260.340	
REGENCY CENTERS CORP	61,012.000	4,123,190.960	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	44,953.000	875,684.440	
RETAIL PROPERTIES OF AMERICA INC	94,632.000	1,217,913.840	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	31,907.000	987,202.580	
RLJ LODGING TRUST	71,636.000	1,536,592.200	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	20,980.000	1,431,885.000	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	72,066.000	1,378,622.580	
SAUL CENTERS INC	4,960.000	306,428.800	
SELECT INCOME REIT	26,550.000	670,387.500	
SENIOR HOUSING PPTYS TRUST	97,385.000	1,856,158.100	
SERITAGE GROWTH PROPERTIES	10,380.000	420,390.000	
SIMON PROPERTY GROUP INC	127,931.000	20,756,804.750	
SL GREEN	40,806.000	4,186,695.600	

SPIRIT REALTY CAPITAL INC	187,895.000	1,587,712.750	
STAG INDUSTRIAL INC	37,782.000	1,057,896.000	
STORE CAPITAL CORP	67,761.000	1,748,911.410	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	42,330.000	633,256.800	
SUN COMMUNITIES INC	32,609.000	3,117,420.400	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	92,362.000	1,543,369.020	
TANGER FACTORY OUTLET	38,893.000	975,436.440	
TAUBMAN CENTERS INC	24,881.000	1,477,931.400	
TERRENO REALTY CORP	21,437.000	788,881.600	
THE MACERICH COMPANY	44,939.000	2,954,739.250	
TIER REIT INC	19,780.000	392,633.000	
UDR INC	110,319.000	4,305,750.570	
UMH PROPERTIES INC	12,480.000	187,574.400	
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	5,170.000	378,961.000	
URBAN EDGE PROPERTIES	43,365.000	1,084,125.000	
URSTADT BIDDLE PROPERTIES	12,820.000	288,193.600	
VENTAS INC	146,665.000	9,285,361.150	
VEREIT INC	401,965.000	3,187,582.450	
VORNADO REALTY TRUST	71,064.000	5,471,217.360	
WASHINGTON PRIME GROUP INC	76,620.000	537,106.200	
WASHINGTON REIT	31,510.000	1,002,333.100	
WEINGARTEN REALTY INVST	48,954.000	1,594,921.320	
WELLTOWER INC	151,894.000	10,073,610.080	
WHEELER REIT INC	3,490.000	40,588.700	
WHITESTONE REIT	16,000.000	232,000.000	
WP CAREY INC	44,122.000	3,128,691.020	
XENIA HOTELS & RESORTS INC	43,710.000	938,016.600	
アメリカ・ドル 小計	9,581,941.000	340,244,175.300 (38,668,750,523)	
イギリス・ポンド			
AEW UK LONG LEASE REIT PLC	37,060.000	37,541.780	
ASSURA PLC	762,815.000	457,689.000	
BIG YELLOW GROUP PLC	61,708.000	525,443.620	
BRITISH LAND CO PLC	427,011.000	2,796,922.050	
CAPITAL & REGIONAL PLC	209,340.000	108,228.780	
CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	72,808.000	81,326.530	
DERWENT LONDON PLC	45,868.000	1,327,419.920	
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	232,350.000	193,315.200	
GREAT PORTLAND ESTATES PLC	133,312.000	880,525.760	

	HAMMERSON PLC	327,856.000	1,726,161.840	
	HANSTEEN HOLDINGS PLC	168,820.000	224,868.240	
	INTU PROPERTIES PLC	356,282.000	840,825.520	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	309,849.000	2,969,902.660	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	287,762.000	510,777.550	
	LXI REIT PLC	89,980.000	93,129.300	
	NEWRIVER REIT PLC	124,158.000	392,587.590	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC	252,225.000	284,257.570	
	RDI REIT PLC	489,304.000	168,809.880	
	REGIONAL REIT LTD	120,720.000	123,134.400	
	SAFESTORE HOLDINGS LTD	84,864.000	404,292.090	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT TRUST LTD	229,020.000	133,976.700	
	SEGRO PLC	407,126.000	2,283,976.860	
	SHAFTESBURY PLC	91,787.000	917,870.000	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	556,061.000	800,727.840	
	UNITE GROUP PLC	98,138.000	742,413.970	
	WORKSPACE GROUP PLC	49,611.000	477,009.760	
	イギリス・ポンド 小計	6,025,835.000	19,503,134.410 (2,970,132,339)	
イスラエル・シケル	REIT 1 LTD	68,706.000	1,038,147.660	
	イスラエル・シケル 小計	68,706.000	1,038,147.660 (33,490,643)	
カナダ・ドル	AGELLAN COMMERCIAL REIT	7,030.000	83,938.200	
	ALLIED PROPERTIES REIT	18,430.000	772,217.000	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	30,129.000	426,024.060	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	9,440.000	396,574.400	
	CANADIAN APT PPTYS REIT	27,177.000	1,005,549.000	
	CANADIAN REAL ESTATE INV TRUST	14,541.000	672,375.840	
	CHOICE PROPERTIES REIT	18,220.000	241,779.400	
	COMINAR REAL ESTATE INV TR	36,423.000	515,021.220	
	CROMBIE REAL ESTATE INV	18,634.000	259,198.940	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	13,492.000	197,522.880	
	DREAM GLOBAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	34,860.000	421,108.800	
	DREAM INDUSTRIAL REIT	15,704.000	138,980.400	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV TRUST	16,081.000	358,445.490	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	9,540.000	474,615.000	

	H & R REAL ESTATE INVESTMENT	58,874.000	1,248,128.800	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	16,990.000	154,269.200	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT	6,120.000	89,841.600	
	MORGUARD REAL ESTATE INVT TR	9,085.000	125,373.000	
	NORTHVIEW APARTMENT REIT	10,535.000	267,167.600	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	21,789.000	245,997.810	
	PURE INDUSTRIAL REAL ESTATE TRUST	60,900.000	400,113.000	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	66,147.000	1,643,752.950	
	SLATE OFFICE REIT	11,022.000	89,057.760	
	SLATE RETAIL REIT	7,890.000	103,043.400	
	SMARTCENTRES REIT	25,982.000	764,650.260	
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	10,440.000	75,376.800	
	カナダ・ドル 小計	575,475.000	11,170,122.810 (987,215,454)	
	ニュージーランド・ドル ARGOSY PROPERTY LTD	347,267.000	364,630.350	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	411,397.000	565,670.870	
	INVESTORE PROPERTY LTD	82,700.000	119,915.000	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	587,914.000	790,744.330	
	PRECINCT PROPERTIES	390,875.000	519,863.750	
	STRIDE STAPLED GROUP	160,040.000	283,270.800	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	128,860.000	282,203.400	
	ニュージーランド・ドル 小計	2,109,053.000	2,926,298.500 (227,870,864)	
	ユーロ AEDIFICA	7,298.000	589,678.400	
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	50,516.000	657,718.320	
	ALTAREA	1,520.000	293,436.000	
	AXIARE PATRIMONIO SOCIMI SA	27,403.000	501,200.870	
	BEFIMMO	9,450.000	525,325.500	
	BENI STABILI SPA	410,731.000	315,030.670	
	COFINIMMO SA	7,999.000	887,489.050	
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	20,361.000	732,181.560	
	FONCIERE DES REGIONS	21,805.000	2,025,684.500	
	GECINA SA	19,038.000	2,786,211.300	
	GREEN REIT PLC	277,987.000	425,876.080	
	HAMBORNER REIT AG	33,640.000	330,983.960	
	HIBERNIA REIT PLC	287,622.000	428,556.780	

	HISPANIA ACTIVOS INMOBILIARIOS SOCIMI SA	45,868.000	707,972.580	
	ICADE	18,491.000	1,510,159.970	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE	149,220.000	165,634.200	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA	130,829.000	1,086,404.010	
	INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	6,733.000	149,102.280	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES REIT PLC	147,360.000	220,303.200	
	KLEPIERRE	85,562.000	3,046,007.200	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA	39,080.000	346,522.360	
	MERCIALYS	22,588.000	408,165.160	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	135,968.000	1,527,600.480	
	NSI NV	7,570.000	268,735.000	
	RETAIL ESTATES	2,658.000	197,648.880	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	40,891.000	9,180,029.500	
	VASTNED RETAIL	6,282.000	259,446.600	
	WAREHOUSES DE PAUW	6,746.000	622,588.340	
	WERELDHAVE NV	16,690.000	656,584.600	
	ユーロ 小計	2,037,906.000	30,852,277.350 (4,128,034,710)	
	香港・ドル			
	CHAMPION REIT	839,070.000	4,774,308.300	
	FORTUNE REAL ESTATE (HK)	555,000.000	5,255,850.000	
	LINK REIT	911,020.000	63,589,196.000	
	PROSPERITY REIT	521,000.000	1,708,880.000	
	SPRING REIT	357,000.000	1,231,650.000	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	429,000.000	2,247,960.000	
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	464,000.000	2,375,680.000	
	香港・ドル 小計	4,076,090.000	81,183,524.300 (1,182,032,113)	
	投資証券 合計	24,475,006	48,197,526.646 (48,197,526,646)	
	合計		54,276,119.745 (54,276,119,745)	

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

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

通貨	銘柄数	組入 投資信託受益証券 時価比率	組入 投資証券 時価比率	有価証券の 合計金額 に対する比率
アメリカ・ドル	投資証券 158銘柄	-%	71.03%	71.24%

イギリス・ポンド	投資証券	26銘柄	-%	5.46%	5.47%
イスラエル・シケル	投資証券	1銘柄	-%	0.06%	0.06%
オーストラリア・ドル	投資信託受益証券	27銘柄	7.88%	-%	7.91%
カナダ・ドル	投資信託受益証券	1銘柄	0.04%	-%	1.86%
	投資証券	26銘柄	-%	1.81%	
シンガポール・ドル	投資信託受益証券	29銘柄	3.25%	-%	3.26%
ニュージーランド・ドル	投資証券	7銘柄	-%	0.42%	0.42%
ユーロ	投資証券	29銘柄	-%	7.58%	7.61%
香港・ドル	投資証券	7銘柄	-%	2.17%	2.18%

(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29年6月12日現在	平成29年12月11日現在
資産の部			
流動資産			
預金		129,219,270	83,158,955
コール・ローン		2,576,910,130	5,572,852,881
国債証券		170,285,159,138	243,504,965,311
派生商品評価勘定		917,333,061	7,776,191
未収利息		1,143,703,324	1,481,757,558
前払費用		132,100,139	248,563,343
流動資産合計		175,184,425,062	250,899,074,239
資産合計		175,184,425,062	250,899,074,239
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		97,483,187	2,136,282,931
未払解約金		50,330,000	165,693,000
流動負債合計		147,813,187	2,301,975,931
負債合計		147,813,187	2,301,975,931
純資産の部			
元本等			
元本	1	130,406,252,857	184,770,487,694
剰余金			
剰余金又は欠損金()		44,630,359,018	63,826,610,614
元本等合計		175,036,611,875	248,597,098,308
純資産合計		175,036,611,875	248,597,098,308
負債純資産合計		175,184,425,062	250,899,074,239

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	平成29年6月12日現在	平成29年12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	122,549,694,187円	130,406,252,857円
同期中追加設定元本額	26,449,784,070円	61,904,502,601円
同期中一部解約元本額	18,593,225,400円	7,540,267,764円
元本の内訳		
ファンド名		
たわらノーロード 先進国債券	457,598,863円	1,233,223,388円
<為替ヘッジあり>		
たわらノーロード バランス	- 円	245,390円
（堅実型）		
たわらノーロード バランス	- 円	171,030円
（標準型）		
たわらノーロード バランス	- 円	96,669円
（積極型）		
たわらノーロード スマートグ	- 円	215,951円
ローバルバランス（保守型）		
たわらノーロード スマートグ	- 円	223,398円
ローバルバランス（安定型）		
たわらノーロード スマートグ	- 円	171,272円
ローバルバランス（安定成長		
型）		
たわらノーロード スマートグ	- 円	119,146円
ローバルバランス（成長型）		
たわらノーロード スマートグ	- 円	52,126円
ローバルバランス（積極型）		
投資のソムリエ	13,592,051,274円	25,360,362,901円
投資のソムリエ<DC年金>	646,581,709円	1,578,476,730円

投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	338,762,081円	1,377,723,715円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	3,210,379,019円	17,989,365,550円
ワールドアセットバランス(基本コース)	2,327,881,799円	5,367,468,791円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	4,148,586,734円	19,163,175,809円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	-円	1,986,329円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	-円	1,986,329円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	-円	5,979,665円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	-円	2,755,232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)	2,676,088,257円	8,840,073,265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)	21,041,008,876円	21,053,132,877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)	1,134,897,772円	1,124,594,525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)	7,159,780,935円	7,202,876,378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)	33,594,645,752円	34,275,084,041円
DIAMバランス30VA(適格機関投資家限定)	32,902,978円	19,169,705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)	30,025,369,008円	30,504,529,482円
DIAMバランス20VA(適格機関投資家限定)	180,055,740円	165,715,433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)	2,967,999,339円	2,852,126,136円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA(1303)(適格機関投資家限定)	2,771,576,680円	2,672,709,186円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA(1306)(適格機関投資家限定)	3,637,678,831円	3,520,962,596円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA(1309)(適格機関投資家限定)	462,407,210円	455,714,649円
計	130,406,252,857円	184,770,487,694円
2. 受益権の総数	130,406,252,857口	184,770,487,694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1月18日 至 平成29年6月12日	自 平成29年6月13日 至 平成29年12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29年6月12日現在	平成29年12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29年6月12日現在	平成29年12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	3,675,049,811	1,405,413,869
合計	3,675,049,811	1,405,413,869

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(平成28年6月23日から平成29年6月12日まで及び平成29年6月23日から平成29年12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29年6月12日 現在				平成29年12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	172,210,508,242	-	171,390,658,368	819,849,874	242,266,853,548	-	244,395,360,288	2,128,506,740
アメリカ・ドル	75,855,706,363	-	75,647,563,050	208,143,313	104,052,235,345	-	105,671,173,784	1,618,938,439
イギリス・ポンド	12,559,052,181	-	12,366,547,956	192,504,225	16,831,523,877	-	16,916,967,155	85,443,278
オーストラリア・ドル	3,633,693,599	-	3,666,581,127	32,887,528	5,164,021,780	-	5,191,010,242	26,988,462
カナダ・ドル	3,502,183,966	-	3,506,316,886	4,132,920	5,130,482,791	-	5,219,193,318	88,710,527
シンガポール・ドル	640,064,542	-	637,737,636	2,326,906	764,081,068	-	772,434,828	8,353,760
スウェーデン・クローナ	768,741,874	-	763,149,864	5,592,010	1,038,954,822	-	1,039,008,768	53,946
デンマーク・クローネ	1,014,152,511	-	1,007,359,958	6,792,553	1,446,945,221	-	1,450,441,206	3,495,985
ノルウェー・クローネ	437,603,821	-	432,719,407	4,884,414	583,052,653	-	591,003,312	7,950,659
ポーランド・ズロチ	1,123,430,392	-	1,115,700,282	7,730,110	1,438,339,357	-	1,444,380,208	6,040,851
マレーシア・リンギット	659,498,224	-	655,814,500	3,683,724	1,006,363,779	-	1,013,354,700	6,990,921
メキシコ・ペソ	1,509,954,384	-	1,550,873,790	40,919,406	2,003,326,472	-	1,999,514,160	3,812,312
ユーロ	69,597,351,518	-	69,111,675,712	485,675,806	101,668,069,088	-	101,929,023,198	260,954,110
南アフリカ・ランド	909,074,867	-	928,618,200	19,543,333	1,139,457,295	-	1,157,855,409	18,398,114
合計	172,210,508,242	-	171,390,658,368	819,849,874	242,266,853,548	-	244,395,360,288	2,128,506,740

(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29年6月12日現在	平成29年12月11日現在
1口当たり純資産額	1.3422円	1.3454円
(1万口当たり純資産額)	(13,422円)	(13,454円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

平成29年12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 07/15/19	11,000,000.000	10,821,580.000	
		US T N/B 0.75 08/15/19	7,000,000.000	6,881,000.000	
		US T N/B 0.875 04/15/19	3,300,000.000	3,260,928.000	
		US T N/B 0.875 05/15/19	6,200,000.000	6,122,686.000	
		US T N/B 0.875 06/15/19	9,500,000.000	9,374,125.000	
		US T N/B 0.875 07/31/19	10,000,000.000	9,855,800.000	
		US T N/B 0.875 09/15/19	13,500,000.000	13,283,190.000	
		US T N/B 1.0 03/15/19	5,000,000.000	4,953,300.000	
		US T N/B 1.0 09/30/19	10,700,000.000	10,549,451.000	
		US T N/B 1.0 11/15/19	10,000,000.000	9,848,800.000	
		US T N/B 1.0 11/30/19	9,400,000.000	9,253,454.000	
		US T N/B 1.125 03/31/20	11,000,000.000	10,823,780.000	
		US T N/B 1.125 06/30/21	10,000,000.000	9,696,000.000	
		US T N/B 1.125 07/31/21	7,900,000.000	7,649,412.000	
		US T N/B 1.125 08/31/21	7,000,000.000	6,771,380.000	
		US T N/B 1.125 12/31/19	13,500,000.000	13,313,835.000	
		US T N/B 1.25 01/31/19	11,700,000.000	11,637,288.000	
		US T N/B 1.25 07/31/23	8,400,000.000	7,974,708.000	
		US T N/B 1.25 10/31/19	9,000,000.000	8,909,280.000	
		US T N/B 1.25 10/31/21	10,500,000.000	10,185,735.000	
		US T N/B 1.25 11/30/18	11,000,000.000	10,953,580.000	
		US T N/B 1.375 01/31/21	12,000,000.000	11,788,080.000	
		US T N/B 1.375 04/30/21	10,000,000.000	9,800,000.000	
		US T N/B 1.375 05/31/20	13,400,000.000	13,241,880.000	
		US T N/B 1.375 08/31/23	6,000,000.000	5,730,000.000	
		US T N/B 1.375 10/31/20	15,000,000.000	14,772,600.000	
		US T N/B 1.5 02/28/19	8,500,000.000	8,475,350.000	
		US T N/B 1.5 03/31/19	5,900,000.000	5,880,589.000	
		US T N/B 1.5 06/15/20	13,000,000.000	12,883,650.000	
		US T N/B 1.5 08/15/26	9,800,000.000	9,136,148.000	
		US T N/B 1.5 12/31/18	7,100,000.000	7,083,883.000	
		US T N/B 1.625 02/15/26	7,700,000.000	7,283,661.000	
		US T N/B 1.625 04/30/23	9,800,000.000	9,518,936.000	
		US T N/B 1.625 05/15/26	8,000,000.000	7,550,560.000	
		US T N/B 1.625 08/15/22	15,900,000.000	15,560,217.000	
		US T N/B 1.625 11/15/22	6,380,000.000	6,227,964.600	
US T N/B 1.75 02/28/22	10,500,000.000	10,363,815.000			
US T N/B 1.75 05/15/22	15,770,000.000	15,545,750.600			
US T N/B 1.75 05/15/23	13,000,000.000	12,709,450.000			
US T N/B 1.75 05/31/22	10,000,000.000	9,848,400.000			

US T N/B 1.75 09/30/22	15,600,000.000	15,324,504.000	
US T N/B 1.875 03/31/22	13,300,000.000	13,175,246.000	
US T N/B 2.0 02/15/22	10,000,000.000	9,976,500.000	
US T N/B 2.0 02/15/23	9,000,000.000	8,927,550.000	
US T N/B 2.0 02/15/25	8,600,000.000	8,425,936.000	
US T N/B 2.0 05/31/21	8,060,000.000	8,060,000.000	
US T N/B 2.0 06/30/24	7,000,000.000	6,880,720.000	
US T N/B 2.0 07/31/20	12,600,000.000	12,639,312.000	
US T N/B 2.0 08/15/25	8,600,000.000	8,399,706.000	
US T N/B 2.0 08/31/21	10,200,000.000	10,185,618.000	
US T N/B 2.0 09/30/20	12,660,000.000	12,696,587.400	
US T N/B 2.0 11/15/21	8,900,000.000	8,887,451.000	
US T N/B 2.0 11/15/26	6,900,000.000	6,692,448.000	
US T N/B 2.125 03/31/24	10,500,000.000	10,412,955.000	
US T N/B 2.125 05/15/25	8,400,000.000	8,293,656.000	
US T N/B 2.125 08/31/20	12,680,000.000	12,757,221.200	
US T N/B 2.125 09/30/21	9,800,000.000	9,829,008.000	
US T N/B 2.125 12/31/21	12,000,000.000	12,026,160.000	
US T N/B 2.125 12/31/22	6,000,000.000	5,990,580.000	
US T N/B 2.25 01/31/24	13,400,000.000	13,398,928.000	
US T N/B 2.25 02/15/27	8,300,000.000	8,211,771.000	
US T N/B 2.25 03/31/21	5,920,000.000	5,970,852.800	
US T N/B 2.25 08/15/27	9,500,000.000	9,383,435.000	
US T N/B 2.25 08/15/46	4,900,000.000	4,390,841.000	
US T N/B 2.25 11/15/24	8,600,000.000	8,574,458.000	
US T N/B 2.25 11/15/25	9,300,000.000	9,236,760.000	
US T N/B 2.375 05/15/27	9,600,000.000	9,589,440.000	
US T N/B 2.375 08/15/24	8,410,000.000	8,455,918.600	
US T N/B 2.375 12/31/20	11,950,000.000	12,106,784.000	
US T N/B 2.5 02/15/45	5,200,000.000	4,930,640.000	
US T N/B 2.5 02/15/46	5,200,000.000	4,918,056.000	
US T N/B 2.5 05/15/24	10,790,000.000	10,935,772.900	
US T N/B 2.5 05/15/46	5,050,000.000	4,776,189.000	
US T N/B 2.5 08/15/23	6,700,000.000	6,804,654.000	
US T N/B 2.625 08/15/20	13,350,000.000	13,604,985.000	
US T N/B 2.625 11/15/20	11,860,000.000	12,096,725.600	
US T N/B 2.75 02/15/19	3,700,000.000	3,744,067.000	
US T N/B 2.75 02/15/24	11,930,000.000	12,271,078.700	
US T N/B 2.75 08/15/42	3,220,000.000	3,226,279.000	
US T N/B 2.75 08/15/47	5,850,000.000	5,822,563.500	
US T N/B 2.75 11/15/23	11,100,000.000	11,432,112.000	
US T N/B 2.75 11/15/42	4,000,000.000	4,003,720.000	
US T N/B 2.75 11/15/47	700,000.000	696,549.000	
US T N/B 2.875 05/15/43	4,400,000.000	4,500,716.000	
US T N/B 2.875 08/15/45	5,320,000.000	5,429,698.400	
US T N/B 2.875 11/15/46	4,900,000.000	4,998,735.000	
US T N/B 3.0 02/15/47	5,000,000.000	5,222,250.000	
US T N/B 3.0 05/15/42	1,810,000.000	1,896,536.100	
US T N/B 3.0 05/15/45	4,850,000.000	5,067,474.000	

US T N/B 3.0 05/15/47	5,550,000.000	5,804,079.000	
US T N/B 3.0 11/15/44	5,300,000.000	5,540,938.000	
US T N/B 3.0 11/15/45	6,100,000.000	6,371,145.000	
US T N/B 3.125 02/15/42	1,760,000.000	1,884,291.200	
US T N/B 3.125 02/15/43	4,200,000.000	4,489,716.000	
US T N/B 3.125 05/15/19	4,500,000.000	4,587,345.000	
US T N/B 3.125 05/15/21	100,000.000	103,726.000	
US T N/B 3.125 08/15/44	5,460,000.000	5,839,633.800	
US T N/B 3.125 11/15/41	1,850,000.000	1,980,943.000	
US T N/B 3.375 05/15/44	5,100,000.000	5,695,221.000	
US T N/B 3.5 02/15/39	1,200,000.000	1,367,340.000	
US T N/B 3.625 02/15/20	14,500,000.000	15,059,555.000	
US T N/B 3.625 02/15/44	5,370,000.000	6,247,619.100	
US T N/B 3.625 08/15/19	6,200,000.000	6,391,518.000	
US T N/B 3.625 08/15/43	5,000,000.000	5,807,800.000	
US T N/B 3.75 08/15/41	2,040,000.000	2,409,750.000	
US T N/B 3.75 11/15/43	5,100,000.000	6,049,467.000	
US T N/B 3.875 08/15/40	2,450,000.000	2,943,062.500	
US T N/B 4.25 05/15/39	1,790,000.000	2,258,335.600	
US T N/B 4.25 11/15/40	2,400,000.000	3,039,168.000	
US T N/B 4.375 02/15/38	1,210,000.000	1,546,718.800	
US T N/B 4.375 05/15/40	2,560,000.000	3,291,187.200	
US T N/B 4.375 05/15/41	2,100,000.000	2,709,819.000	
US T N/B 4.375 11/15/39	2,000,000.000	2,565,780.000	
US T N/B 4.5 02/15/36	1,750,000.000	2,257,360.000	
US T N/B 4.5 05/15/38	1,000,000.000	1,299,450.000	
US T N/B 4.5 08/15/39	1,700,000.000	2,215,695.000	
US T N/B 4.625 02/15/40	2,120,000.000	2,812,625.200	
US T N/B 4.75 02/15/41	2,600,000.000	3,521,570.000	
US T N/B 5.0 05/15/37	890,000.000	1,221,658.500	
US T N/B 5.25 02/15/29	830,000.000	1,059,378.800	
US T N/B 5.25 11/15/28	1,700,000.000	2,163,641.000	
US T N/B 5.375 02/15/31	2,300,000.000	3,058,448.000	
US T N/B 5.5 08/15/28	930,000.000	1,201,290.300	
US T N/B 6.0 02/15/26	800,000.000	1,019,184.000	
US T N/B 6.125 11/15/27	950,000.000	1,265,124.500	
US T N/B 6.25 05/15/30	900,000.000	1,266,957.000	
US T N/B 6.25 08/15/23	1,200,000.000	1,460,436.000	
US T N/B 6.5 11/15/26	500,000.000	667,500.000	
US T N/B 8.0 11/15/21	2,100,000.000	2,574,621.000	
US T N/B 8.125 08/15/19	3,900,000.000	4,306,263.000	
アメリカ・ドル 小計	918,970,000.000 (104,440,940,500)	928,154,754.900 (105,484,787,894)	
イギリス・債券	UK TREASURY 0.5 07/22/22	2,600,000.000	2,568,358.000
	UK TREASURY 0.75 07/22/23	1,700,000.000	1,684,683.000
	UK TREASURY 1.25 07/22/27	2,700,000.000	2,685,825.000

UK TREASURY 1.5 01/22/21	3,150,000.000	3,237,255.000	
UK TREASURY 1.5 07/22/26	2,500,000.000	2,565,925.000	
UK TREASURY 1.5 07/22/47	2,260,000.000	2,082,816.000	
UK TREASURY 1.75 07/22/19	3,800,000.000	3,876,532.000	
UK TREASURY 1.75 07/22/57	1,460,000.000	1,476,352.000	
UK TREASURY 1.75 09/07/22	2,720,000.000	2,844,494.400	
UK TREASURY 1.75 09/07/37	1,100,000.000	1,085,920.000	
UK TREASURY 2.0 07/22/20	3,100,000.000	3,217,335.000	
UK TREASURY 2.0 09/07/25	3,250,000.000	3,471,325.000	
UK TREASURY 2.25 09/07/23	1,850,000.000	1,991,340.000	
UK TREASURY 2.5 07/22/65	2,180,000.000	2,780,917.000	
UK TREASURY 2.75 09/07/24	1,800,000.000	2,006,856.000	
UK TREASURY 3.25 01/22/44	2,970,000.000	3,805,461.000	
UK TREASURY 3.5 01/22/45	2,750,000.000	3,694,350.000	
UK TREASURY 3.5 07/22/68	2,020,000.000	3,294,014.000	
UK TREASURY 3.75 07/22/52	2,050,000.000	3,097,345.000	
UK TREASURY 3.75 09/07/19	2,070,000.000	2,187,762.300	
UK TREASURY 3.75 09/07/20	3,050,000.000	3,317,058.000	
UK TREASURY 3.75 09/07/21	2,150,000.000	2,398,110.000	
UK TREASURY 4.0 01/22/60	1,830,000.000	3,103,131.000	
UK TREASURY 4.0 03/07/22	2,350,000.000	2,676,932.000	
UK TREASURY 4.25 03/07/36	2,800,000.000	3,890,880.000	
UK TREASURY 4.25 06/07/32	2,060,000.000	2,764,314.000	
UK TREASURY 4.25 09/07/39	1,900,000.000	2,721,940.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/27	1,600,000.000	2,044,800.000	

	UK TREASURY 4.25 12/07/40	2,100,000.000	3,044,370.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/46	2,080,000.000	3,187,600.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/49	1,680,000.000	2,671,704.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/55	2,050,000.000	3,488,485.000	
	UK TREASURY 4.5 03/07/19	1,200,000.000	1,259,772.000	
	UK TREASURY 4.5 09/07/34	2,600,000.000	3,657,680.000	
	UK TREASURY 4.5 12/07/42	2,340,000.000	3,571,776.000	
	UK TREASURY 4.75 03/07/20	1,800,000.000	1,971,234.000	
	UK TREASURY 4.75 12/07/30	1,700,000.000	2,349,570.000	
	UK TREASURY 4.75 12/07/38	1,900,000.000	2,875,650.000	
	UK TREASURY 5.0 03/07/25	1,700,000.000	2,172,022.000	
	UK TREASURY 6.0 12/07/28	1,150,000.000	1,697,745.000	
	UK TREASURY 8.0 06/07/21	1,520,000.000	1,907,691.200	
	イギリス・ポンド 小計	89,590,000.000 (13,643,661,100)	110,427,329.900 (16,816,978,070)	
オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN 4.5 04/15/20	3,100,000.000	3,286,217.000	
	AUSTRALIAN 5.25 03/15/19	2,500,000.000	2,608,325.000	
	AUSTRALIAN 5.75 05/15/21	3,700,000.000	4,158,430.000	
	AUSTRALIAN 1.75 11/21/20	3,200,000.000	3,181,664.000	
	AUSTRALIAN 2.0 12/21/21	1,800,000.000	1,794,744.000	
	AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	3,000,000.000	2,912,400.000	
	AUSTRALIAN 2.25 11/21/22	1,000,000.000	1,003,260.000	
	AUSTRALIAN 2.75 04/21/24	3,310,000.000	3,395,331.800	
	AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	850,000.000	827,084.000	
	AUSTRALIAN 2.75 10/21/19	3,000,000.000	3,051,780.000	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	3,200,000.000	3,256,192.000	

	AUSTRALIAN 2.75 11/21/28	2,500,000.000	2,537,125.000	
	AUSTRALIAN 3.0 03/21/47	1,300,000.000	1,235,338.000	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	3,400,000.000	3,595,874.000	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	2,650,000.000	2,813,160.500	
	AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	900,000.000	921,492.000	
	AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	1,500,000.000	1,662,810.000	
	AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	4,100,000.000	4,653,500.000	
	AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	1,670,000.000	2,021,334.600	
	AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	3,800,000.000	4,512,386.000	
	AUSTRALIAN 5.5 04/21/23	3,050,000.000	3,555,049.500	
	AUSTRALIAN 5.75 07/15/22	2,950,000.000	3,415,421.500	
	オーストラリア・ドル 小計	56,480,000.000 (4,823,956,800)	60,398,918.900 (5,158,671,663)	
カナダ・ドル	CANADA 8.0 06/01/27	750,000.000	1,147,875.000	
	CANADA 0.5 02/01/19	1,900,000.000	1,881,228.000	
	CANADA 0.5 03/01/22	1,500,000.000	1,430,550.000	
	CANADA 0.75 03/01/21	2,200,000.000	2,142,338.000	
	CANADA 0.75 05/01/19	2,700,000.000	2,674,809.000	
	CANADA 0.75 08/01/19	3,300,000.000	3,261,126.000	
	CANADA 0.75 09/01/20	3,800,000.000	3,719,934.000	
	CANADA 0.75 09/01/21	2,400,000.000	2,326,104.000	
	CANADA 1.0 06/01/27	1,400,000.000	1,294,790.000	
	CANADA 1.0 09/01/22	1,800,000.000	1,745,640.000	
	CANADA 1.25 11/01/19	1,500,000.000	1,492,995.000	
	CANADA 1.5 03/01/20	3,250,000.000	3,248,180.000	
	CANADA 1.5 06/01/23	3,150,000.000	3,116,610.000	
	CANADA 1.5 06/01/26	1,870,000.000	1,821,735.300	
	CANADA 1.75 03/01/19	400,000.000	401,772.000	
	CANADA 1.75 09/01/19	2,000,000.000	2,009,200.000	
	CANADA 2.0 06/01/28	950,000.000	958,274.500	
	CANADA 2.25 06/01/25	1,650,000.000	1,702,833.000	
	CANADA 2.5 06/01/24	1,850,000.000	1,934,452.500	
	CANADA 2.75 06/01/22	1,850,000.000	1,937,986.000	
	CANADA 2.75 12/01/48	1,680,000.000	1,896,888.000	
	CANADA 2.75 12/01/64	770,000.000	907,044.600	
	CANADA 3.25 06/01/21	1,400,000.000	1,477,616.000	
	CANADA 3.5 06/01/20	1,430,000.000	1,497,867.800	
	CANADA 3.5 12/01/45	1,990,000.000	2,530,484.000	
	CANADA 3.75 06/01/19	1,350,000.000	1,395,009.000	
	CANADA 4.0 06/01/41	1,900,000.000	2,530,686.000	
	CANADA 5.0 06/01/37	1,750,000.000	2,548,542.500	

	CANADA 5.75 06/01/29	1,290,000.000	1,792,003.500	
	CANADA 5.75 06/01/33	1,500,000.000	2,233,425.000	
カナダ・ドル 小計		55,280,000.000 (4,885,646,400)	59,057,998.700 (5,219,545,925)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE 1.25 10/01/21	800,000.000	788,720.000	
	SINGAPORE 1.625 10/01/19	500,000.000	501,100.000	
	SINGAPORE 2.125 06/01/26	400,000.000	404,800.000	
	SINGAPORE 2.25 06/01/21	800,000.000	816,000.000	
	SINGAPORE 2.25 08/01/36	200,000.000	195,880.000	
	SINGAPORE 2.375 06/01/25	300,000.000	308,400.000	
	SINGAPORE 2.75 03/01/46	430,000.000	453,009.300	
	SINGAPORE 2.75 04/01/42	420,000.000	440,790.000	
	SINGAPORE 2.75 07/01/23	500,000.000	525,000.000	
	SINGAPORE 2.875 07/01/29	200,000.000	214,000.000	
	SINGAPORE 2.875 09/01/30	370,000.000	394,790.000	
	SINGAPORE 3.0 09/01/24	1,240,000.000	1,324,320.000	
	SINGAPORE 3.125 09/01/22	600,000.000	638,880.000	
	SINGAPORE 3.25 09/01/20	980,000.000	1,024,296.000	
SINGAPORE 3.375 09/01/33	270,000.000	305,340.300		
SINGAPORE 3.5 03/01/27	740,000.000	829,887.800		
シンガポール・ドル 小計		8,750,000.000 (734,737,500)	9,165,213.400 (769,602,969)	
スウェーデン・クローナ	SWEDEN 0.75 05/12/28	5,000,000.000	5,038,900.000	
	SWEDEN 1.0 11/12/26	6,600,000.000	6,915,942.000	
	SWEDEN 1.5 11/13/23	9,900,000.000	10,764,171.000	
	SWEDEN 2.5 05/12/25	7,000,000.000	8,171,100.000	
	SWEDEN 3.5 03/30/39	5,210,000.000	7,211,317.300	
	SWEDEN 3.5 06/01/22	12,080,000.000	14,115,359.200	
	SWEDEN 4.25 03/12/19	9,580,000.000	10,194,078.000	
SWEDEN 5.0 12/01/20	11,740,000.000	13,680,739.400		
スウェーデン・クローナ 小計		67,110,000.000 (901,958,400)	76,091,606.900 (1,022,671,197)	
デンマーク・クローネ	DENMARK 0.25 11/15/20	3,000,000.000	3,068,370.000	
	DENMARK 0.5 11/15/27	5,500,000.000	5,566,990.000	
	DENMARK 1.5 11/15/23	6,570,000.000	7,205,319.000	
	DENMARK 1.75 11/15/25	11,100,000.000	12,558,873.000	
	DENMARK 3.0 11/15/21	11,830,000.000	13,413,445.500	
	DENMARK 4.0 11/15/19	10,500,000.000	11,443,740.000	
	DENMARK 4.5 11/15/39	16,100,000.000	27,623,253.000	
デンマーク・クローネ 小計		64,600,000.000 (1,161,508,000)	80,879,990.500 (1,454,222,229)	
ノルウェー・クローネ	NORWAY 1.5 02/19/26	4,000,000.000	4,038,480.000	

	NORWAY 1.75 02/17/27	3,000,000.000	3,071,070.000	
	NORWAY 1.75 03/13/25	4,600,000.000	4,741,910.000	
	NORWAY 2.0 05/24/23	6,600,000.000	6,913,302.000	
	NORWAY 3.0 03/14/24	4,400,000.000	4,878,896.000	
	NORWAY 3.75 05/25/21	10,260,000.000	11,273,175.000	
	NORWAY 4.5 05/22/19	7,200,000.000	7,614,000.000	
ノルウェー・クローネ	小計	40,060,000.000 (548,020,800)	42,530,833.000 (581,821,795)	
ポーランド・ズロチ	POLAND 1.5 04/25/20	3,000,000.000	2,978,100.000	
	POLAND 1.75 07/25/21	3,700,000.000	3,634,510.000	
	POLAND 2.0 04/25/21	2,500,000.000	2,485,000.000	
	POLAND 2.25 04/25/22	3,000,000.000	2,972,100.000	
	POLAND 2.5 07/25/26	4,100,000.000	3,901,765.000	
	POLAND 2.5 07/25/27	3,500,000.000	3,288,775.000	
	POLAND 3.25 07/25/19	5,000,000.000	5,138,000.000	
	POLAND 3.25 07/25/25	3,600,000.000	3,645,900.000	
	POLAND 4.0 10/25/23	4,070,000.000	4,340,044.500	
	POLAND 5.25 10/25/20	2,880,000.000	3,142,944.000	
	POLAND 5.5 10/25/19	2,110,000.000	2,257,278.000	
	POLAND 5.75 04/25/29	1,100,000.000	1,382,975.000	
	POLAND 5.75 09/23/22	3,380,000.000	3,865,030.000	
	POLAND 5.75 10/25/21	1,780,000.000	2,007,484.000	
ポーランド・ズロチ	小計	43,720,000.000 (1,393,793,600)	45,039,905.500 (1,435,872,187)	
マレーシア・リングgit	MALAYSIA 3.418 08/15/22	5,000,000.000	4,921,050.000	
	MALAYSIA 3.48 03/15/23	3,910,000.000	3,846,658.000	
	MALAYSIA 3.502 05/31/27	1,580,000.000	1,479,670.000	
	MALAYSIA 3.844 04/15/33	1,340,000.000	1,253,891.600	
	MALAYSIA 4.127 04/15/32	1,180,000.000	1,134,900.400	
	MALAYSIA 4.16 07/15/21	6,460,000.000	6,608,580.000	
	MALAYSIA 4.181 07/15/24	690,000.000	700,350.000	
	MALAYSIA 4.232 06/30/31	2,000,000.000	1,950,180.000	
	MALAYSIA 4.378 11/29/19	5,760,000.000	5,892,480.000	
	MALAYSIA 4.392 04/15/26	1,480,000.000	1,497,153.200	
	MALAYSIA 4.498 04/15/30	2,820,000.000	2,817,180.000	
	MALAYSIA 4.935 09/30/43	2,870,000.000	2,884,350.000	
	MALAYSIA 5.248 09/15/28	1,480,000.000	1,583,141.200	
マレーシア・リングgit	小計	36,570,000.000 (1,017,011,700)	36,569,584.400 (1,017,000,142)	
メキシコ・ペソ	MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	11,880,000.000	14,819,349.600	
	MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	30,720,000.000	35,426,611.200	
	MEXICAN BONDS 5.0 12/11/19	23,000,000.000	22,093,570.000	
	MEXICAN BONDS 5.75 03/05/26	19,500,000.000	17,702,685.000	
	MEXICAN BONDS 6.5 06/09/22	25,000,000.000	24,360,500.000	

	MEXICAN BONDS 6.5 06/10/21	35,860,000.000	35,138,138.200	
	MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	20,000,000.000	20,286,400.000	
	MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	15,040,000.000	15,480,822.400	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	23,380,000.000	23,806,685.000	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	10,000,000.000	10,275,900.000	
	MEXICAN BONDS 8.0 06/11/20	35,000,000.000	35,692,300.000	
	MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47	6,500,000.000	6,791,850.000	
	MEXICAN BONDS 8.0 12/07/23	12,500,000.000	12,992,750.000	
	MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	13,000,000.000	14,172,470.000	
	MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	11,820,000.000	12,969,967.800	
	MEXICAN BONDS 8.5 12/13/18	20,000,000.000	20,242,200.000	
	メキシコ・ペソ 小計	313,200,000.000 (1,879,200,000)	322,252,199.200 (1,933,513,195)	
ユーロ	AUSTRIA 0.25 10/18/19	730,000.000	742,446.500	
	AUSTRIA 0.5 04/20/27	1,060,000.000	1,066,508.400	
	AUSTRIA 0.75 10/20/26	1,590,000.000	1,647,112.800	
	AUSTRIA 07/15/23	750,000.000	756,075.000	
	AUSTRIA 09/20/22	250,000.000	253,997.500	
	AUSTRIA 1.2 10/20/25	1,380,000.000	1,491,366.000	
	AUSTRIA 1.5 02/20/47	590,000.000	605,664.500	
	AUSTRIA 1.5 11/02/86	640,000.000	579,545.600	
	AUSTRIA 1.65 10/21/24	1,380,000.000	1,535,677.800	
	AUSTRIA 1.75 10/20/23	1,420,000.000	1,582,306.000	
	AUSTRIA 1.95 06/18/19	1,270,000.000	1,320,787.300	
	AUSTRIA 2.1 09/20/17	100,000.000	110,757.000	
	AUSTRIA 2.4 05/23/34	950,000.000	1,160,966.500	
	AUSTRIA 3.15 06/20/44	830,000.000	1,179,122.900	
	AUSTRIA 3.4 11/22/22	980,000.000	1,162,358.400	
	AUSTRIA 3.5 09/15/21	2,040,000.000	2,350,080.000	
	AUSTRIA 3.65 04/20/22	1,770,000.000	2,084,086.500	
	AUSTRIA 3.8 01/26/62	580,000.000	1,000,917.600	
	AUSTRIA 3.9 07/15/20	1,820,000.000	2,033,395.000	
	AUSTRIA 4.15 03/15/37	1,570,000.000	2,424,080.000	
	AUSTRIA 4.35 03/15/19	900,000.000	957,366.000	
	AUSTRIA 4.85 03/15/26	950,000.000	1,318,182.000	
	AUSTRIA 6.25 07/15/27	1,000,000.000	1,562,070.000	
	BELGIUM 0.2 10/22/23	1,060,000.000	1,079,080.000	
	BELGIUM 0.5 10/22/24	1,300,000.000	1,336,907.000	

BELGIUM 0.8 06/22/25	2,000,000.000	2,093,260.000	
BELGIUM 0.8 06/22/27	1,850,000.000	1,900,135.000	
BELGIUM 1.0 06/22/26	2,050,000.000	2,165,374.000	
BELGIUM 1.0 06/22/31	1,200,000.000	1,220,904.000	
BELGIUM 1.45 06/22/37	350,000.000	364,448.000	
BELGIUM 1.6 06/22/47	1,060,000.000	1,074,500.800	
BELGIUM 1.9 06/22/38	820,000.000	919,703.800	
BELGIUM 2.15 06/22/66	440,000.000	485,012.000	
BELGIUM 2.25 06/22/23	1,700,000.000	1,931,778.000	
BELGIUM 2.25 06/22/57	310,000.000	354,931.400	
BELGIUM 2.6 06/22/24	1,500,000.000	1,756,290.000	
BELGIUM 3.0 06/22/34	980,000.000	1,274,529.200	
BELGIUM 3.0 09/28/19	1,930,000.000	2,056,916.800	
BELGIUM 3.75 06/22/45	1,310,000.000	2,002,387.400	
BELGIUM 3.75 09/28/20	2,400,000.000	2,694,072.000	
BELGIUM 4.0 03/28/19	830,000.000	880,306.300	
BELGIUM 4.0 03/28/22	1,830,000.000	2,180,408.400	
BELGIUM 4.0 03/28/32	1,060,000.000	1,511,803.800	
BELGIUM 4.25 03/28/41	2,180,000.000	3,487,891.000	
BELGIUM 4.25 09/28/21	2,400,000.000	2,834,976.000	
BELGIUM 4.25 09/28/22	2,000,000.000	2,442,440.000	
BELGIUM 4.5 03/28/26	1,050,000.000	1,421,700.000	
BELGIUM 5.0 03/28/35	2,500,000.000	4,090,325.000	
BELGIUM 5.5 03/28/28	2,500,000.000	3,772,100.000	
BUNDESABL 0.25 10/11/19	2,800,000.000	2,853,648.000	
BUNDESABL 0.25 10/16/20	2,300,000.000	2,360,605.000	
BUNDESABL 0.5 04/12/19	2,950,000.000	3,002,274.000	
BUNDESABL 04/08/22	2,500,000.000	2,550,250.000	
BUNDESABL 04/09/21	2,850,000.000	2,907,741.000	
BUNDESABL 04/17/20	2,950,000.000	3,000,091.000	
BUNDESABL 1.0 02/22/19	1,200,000.000	1,226,256.000	
BUNDESABL 10/07/22	2,000,000.000	2,036,640.000	
BUNDESABL 10/08/21	3,400,000.000	3,470,448.000	
BUNDESSCHAT 06/14/19	3,200,000.000	3,238,912.000	
BUNDESSCHAT 12/14/18	2,000,000.000	2,015,960.000	
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27	3,300,000.000	3,305,280.000	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25	2,670,000.000	2,774,397.000	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26	3,100,000.000	3,204,470.000	
DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27	2,700,000.000	2,751,435.000	
DEUTSCHLAND 08/15/26	3,420,000.000	3,376,600.200	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/24	2,600,000.000	2,795,390.000	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25	3,150,000.000	3,388,833.000	

DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48	560,000.000	576,128.000	
DEUTSCHLAND 1.5 02/15/23	2,600,000.000	2,849,184.000	
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/23	2,370,000.000	2,602,165.200	
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/24	2,600,000.000	2,877,602.000	
DEUTSCHLAND 1.5 09/04/22	2,300,000.000	2,511,186.000	
DEUTSCHLAND 1.75 02/15/24	1,850,000.000	2,073,128.500	
DEUTSCHLAND 1.75 07/04/22	3,350,000.000	3,689,958.000	
DEUTSCHLAND 2.0 01/04/22	2,700,000.000	2,978,289.000	
DEUTSCHLAND 2.0 08/15/23	1,800,000.000	2,031,696.000	
DEUTSCHLAND 2.25 09/04/20	3,000,000.000	3,242,820.000	
DEUTSCHLAND 2.25 09/04/21	2,000,000.000	2,212,180.000	
DEUTSCHLAND 2.5 01/04/21	2,300,000.000	2,524,296.000	
DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	2,830,000.000	3,764,749.000	
DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	3,020,000.000	4,078,419.400	
DEUTSCHLAND 3.0 07/04/20	2,600,000.000	2,848,950.000	
DEUTSCHLAND 3.25 01/04/20	2,300,000.000	2,492,579.000	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/21	2,300,000.000	2,618,343.000	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	1,900,000.000	2,825,870.000	
DEUTSCHLAND 3.5 07/04/19	3,160,000.000	3,374,816.800	
DEUTSCHLAND 3.75 01/04/19	2,400,000.000	2,517,960.000	
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	3,030,000.000	4,725,315.300	
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	1,780,000.000	2,943,586.000	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	1,700,000.000	2,469,080.000	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	2,460,000.000	4,002,420.000	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	2,050,000.000	3,643,055.000	

DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	2,090,000.000	3,395,414.000	
DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	1,700,000.000	2,595,560.000	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/24	1,180,000.000	1,643,527.600	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	1,160,000.000	1,947,408.000	
DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	1,670,000.000	2,655,634.000	
FINLAND 0.375 09/15/20	650,000.000	667,660.500	
FINLAND 0.5 04/15/26	580,000.000	592,209.000	
FINLAND 0.5 09/15/27	500,000.000	502,525.000	
FINLAND 0.75 04/15/31	550,000.000	552,189.000	
FINLAND 0.875 09/15/25	520,000.000	548,454.400	
FINLAND 04/15/22	450,000.000	456,786.000	
FINLAND 09/15/23	490,000.000	492,753.800	
FINLAND 1.5 04/15/23	600,000.000	654,000.000	
FINLAND 1.625 09/15/22	700,000.000	765,163.000	
FINLAND 2.0 04/15/24	600,000.000	676,758.000	
FINLAND 2.625 07/04/42	510,000.000	686,607.900	
FINLAND 2.75 07/04/28	700,000.000	864,542.000	
FINLAND 3.375 04/15/20	730,000.000	799,131.000	
FINLAND 3.5 04/15/21	660,000.000	749,482.800	
FINLAND 4.0 07/04/25	800,000.000	1,033,064.000	
FINLAND 4.375 07/04/19	650,000.000	702,195.000	
FRANCE BTAN 8.5 04/25/23	1,480,000.000	2,177,612.800	
FRANCE OAT 0.25 11/25/20	4,000,000.000	4,092,400.000	
FRANCE OAT 0.25 11/25/26	4,400,000.000	4,352,744.000	
FRANCE OAT 0.5 05/25/25	4,500,000.000	4,625,370.000	
FRANCE OAT 0.5 05/25/26	3,800,000.000	3,867,298.000	
FRANCE OAT 0.5 11/25/19	3,700,000.000	3,784,508.000	
FRANCE OAT 0.75 05/25/28	1,300,000.000	1,316,991.000	
FRANCE OAT 02/25/19	3,150,000.000	3,176,460.000	
FRANCE OAT 02/25/20	4,200,000.000	4,257,876.000	
FRANCE OAT 03/25/23	700,000.000	705,950.000	
FRANCE OAT 05/25/20	4,400,000.000	4,465,648.000	
FRANCE OAT 05/25/21	5,300,000.000	5,383,210.000	
FRANCE OAT 05/25/22	4,500,000.000	4,561,290.000	
FRANCE OAT 1.0 05/25/19	3,570,000.000	3,658,714.500	
FRANCE OAT 1.0 05/25/27	4,500,000.000	4,721,535.000	
FRANCE OAT 1.0 11/25/25	4,000,000.000	4,252,840.000	
FRANCE OAT 1.25 05/25/36	2,800,000.000	2,822,400.000	
FRANCE OAT 1.5 05/25/31	4,600,000.000	4,961,514.000	

FRANCE OAT 1.75 05/25/23	4,550,000.000	5,031,708.500	
FRANCE OAT 1.75 05/25/66	1,340,000.000	1,341,420.400	
FRANCE OAT 1.75 06/25/39	1,510,000.000	1,636,220.900	
FRANCE OAT 1.75 11/25/24	4,800,000.000	5,366,256.000	
FRANCE OAT 2.0 05/25/48	1,700,000.000	1,860,378.000	
FRANCE OAT 2.25 05/25/24	4,200,000.000	4,822,734.000	
FRANCE OAT 2.25 10/25/22	4,300,000.000	4,830,147.000	
FRANCE OAT 2.5 05/25/30	4,100,000.000	4,926,929.000	
FRANCE OAT 2.5 10/25/20	3,900,000.000	4,246,281.000	
FRANCE OAT 2.75 10/25/27	4,450,000.000	5,418,053.000	
FRANCE OAT 3.0 04/25/22	4,300,000.000	4,936,658.000	
FRANCE OAT 3.25 05/25/45	3,050,000.000	4,259,081.000	
FRANCE OAT 3.25 10/25/21	4,900,000.000	5,605,404.000	
FRANCE OAT 3.5 04/25/20	3,000,000.000	3,295,440.000	
FRANCE OAT 3.5 04/25/26	4,270,000.000	5,433,575.000	
FRANCE OAT 3.75 04/25/21	3,550,000.000	4,064,217.500	
FRANCE OAT 3.75 10/25/19	3,960,000.000	4,293,907.200	
FRANCE OAT 4.0 04/25/55	1,680,000.000	2,762,592.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/60	1,750,000.000	2,965,270.000	
FRANCE OAT 4.0 10/25/38	3,400,000.000	5,148,722.000	
FRANCE OAT 4.25 04/25/19	1,990,000.000	2,125,797.600	
FRANCE OAT 4.25 10/25/23	5,560,000.000	7,006,044.800	
FRANCE OAT 4.5 04/25/41	4,100,000.000	6,735,849.000	
FRANCE OAT 4.75 04/25/35	3,600,000.000	5,723,388.000	
FRANCE OAT 5.5 04/25/29	3,500,000.000	5,372,325.000	
FRANCE OAT 5.75 10/25/32	4,100,000.000	6,870,329.000	
FRANCE OAT 6.0 10/25/25	3,150,000.000	4,610,623.500	
FRANCE OAT 8.5 10/25/19	1,480,000.000	1,737,327.600	
IRISH 0.8 03/15/22	940,000.000	984,076.600	
IRISH 1.0 05/15/26	1,300,000.000	1,354,964.000	
IRISH 1.7 05/15/37	560,000.000	591,500.000	
IRISH 10/18/22	600,000.000	604,386.000	
IRISH 2.0 02/18/45	980,000.000	1,062,457.200	
IRISH 2.4 05/15/30	1,160,000.000	1,358,313.600	
IRISH 3.4 03/18/24	970,000.000	1,171,701.800	

IRISH 3.9 03/20/23	800,000.000	968,680.000	
IRISH 4.4 06/18/19	400,000.000	430,568.000	
IRISH 4.5 04/18/20	1,570,000.000	1,761,304.500	
IRISH 5.0 10/18/20	980,000.000	1,137,642.800	
IRISH 5.4 03/13/25	1,400,000.000	1,915,424.000	
IRISH 5.9 10/18/19	740,000.000	830,265.200	
ITALY BTPS 0.1 04/15/19	5,100,000.000	5,133,405.000	
ITALY BTPS 0.35 06/15/20	3,600,000.000	3,650,040.000	
ITALY BTPS 0.35 11/01/21	3,800,000.000	3,836,062.000	
ITALY BTPS 0.45 06/01/21	3,750,000.000	3,811,125.000	
ITALY BTPS 0.65 10/15/23	2,300,000.000	2,287,442.000	
ITALY BTPS 0.65 11/01/20	2,400,000.000	2,453,280.000	
ITALY BTPS 0.7 05/01/20	3,800,000.000	3,886,260.000	
ITALY BTPS 0.9 08/01/22	3,800,000.000	3,886,716.000	
ITALY BTPS 0.95 03/15/23	2,700,000.000	2,752,920.000	
ITALY BTPS 1.05 12/01/19	4,800,000.000	4,932,576.000	
ITALY BTPS 1.2 04/01/22	2,700,000.000	2,802,600.000	
ITALY BTPS 1.25 12/01/26	2,500,000.000	2,452,675.000	
ITALY BTPS 1.35 04/15/22	3,800,000.000	3,969,860.000	
ITALY BTPS 1.45 09/15/22	2,350,000.000	2,464,421.500	
ITALY BTPS 1.45 11/15/24	2,000,000.000	2,050,440.000	
ITALY BTPS 1.5 06/01/25	3,200,000.000	3,268,320.000	
ITALY BTPS 1.5 08/01/19	3,900,000.000	4,020,666.000	
ITALY BTPS 1.6 06/01/26	3,300,000.000	3,345,540.000	
ITALY BTPS 1.65 03/01/32	2,600,000.000	2,460,718.000	
ITALY BTPS 1.85 05/15/24	2,800,000.000	2,959,600.000	
ITALY BTPS 2.0 12/01/25	2,100,000.000	2,208,423.000	
ITALY BTPS 2.05 08/01/27	2,000,000.000	2,075,000.000	
ITALY BTPS 2.2 06/01/27	2,500,000.000	2,634,000.000	
ITALY BTPS 2.25 09/01/36	1,900,000.000	1,860,480.000	
ITALY BTPS 2.45 09/01/33	1,500,000.000	1,541,715.000	
ITALY BTPS 2.5 05/01/19	2,700,000.000	2,808,567.000	
ITALY BTPS 2.5 12/01/24	2,800,000.000	3,067,316.000	
ITALY BTPS 2.7 03/01/47	2,000,000.000	1,964,200.000	

ITALY BTPS 2.8 03/01/67	1,250,000.000	1,172,250.000	
ITALY BTPS 3.25 09/01/46	1,900,000.000	2,080,576.000	
ITALY BTPS 3.45 03/01/48	600,000.000	669,060.000	
ITALY BTPS 3.5 03/01/30	3,180,000.000	3,712,904.400	
ITALY BTPS 3.75 03/01/21	2,950,000.000	3,310,962.000	
ITALY BTPS 3.75 05/01/21	2,500,000.000	2,816,500.000	
ITALY BTPS 3.75 08/01/21	2,000,000.000	2,265,800.000	
ITALY BTPS 3.75 09/01/24	1,900,000.000	2,237,155.000	
ITALY BTPS 4.0 02/01/37	3,300,000.000	4,095,630.000	
ITALY BTPS 4.0 09/01/20	1,560,000.000	1,737,372.000	
ITALY BTPS 4.25 02/01/19	2,100,000.000	2,212,056.000	
ITALY BTPS 4.25 03/01/20	2,100,000.000	2,313,570.000	
ITALY BTPS 4.5 02/01/20	1,820,000.000	2,008,370.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/19	2,700,000.000	2,861,460.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/24	2,000,000.000	2,439,340.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/26	2,350,000.000	2,926,220.000	
ITALY BTPS 4.5 05/01/23	2,600,000.000	3,138,668.000	
ITALY BTPS 4.75 08/01/23	3,200,000.000	3,925,760.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/21	2,200,000.000	2,579,720.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/28	2,700,000.000	3,488,778.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/44	2,100,000.000	2,879,205.000	
ITALY BTPS 5.0 03/01/22	2,500,000.000	2,998,000.000	
ITALY BTPS 5.0 03/01/25	2,800,000.000	3,553,340.000	
ITALY BTPS 5.0 08/01/34	3,170,000.000	4,362,237.000	
ITALY BTPS 5.0 08/01/39	2,750,000.000	3,859,075.000	
ITALY BTPS 5.0 09/01/40	2,800,000.000	3,896,200.000	
ITALY BTPS 5.25 11/01/29	3,600,000.000	4,898,160.000	
ITALY BTPS 5.5 09/01/22	2,360,000.000	2,925,031.200	
ITALY BTPS 5.5 11/01/22	1,700,000.000	2,115,242.000	
ITALY BTPS 5.75 02/01/33	2,550,000.000	3,716,625.000	
ITALY BTPS 6.0 05/01/31	3,800,000.000	5,568,520.000	
ITALY BTPS 6.5 11/01/27	3,100,000.000	4,486,320.000	
ITALY BTPS 7.25 11/01/26	900,000.000	1,337,580.000	
ITALY BTPS 9.0 11/01/23	1,700,000.000	2,505,290.000	

NETHERLANDS 0.25 01/15/20	2,750,000.000	2,805,935.000	
NETHERLANDS 0.25 07/15/25	1,800,000.000	1,820,736.000	
NETHERLANDS 0.5 07/15/26	1,800,000.000	1,840,320.000	
NETHERLANDS 0.75 07/15/27	1,950,000.000	2,016,319.500	
NETHERLANDS 01/15/22	2,030,000.000	2,065,545.300	
NETHERLANDS 01/15/24	400,000.000	402,340.000	
NETHERLANDS 1.25 01/15/19	1,500,000.000	1,533,795.000	
NETHERLANDS 1.75 07/15/23	2,700,000.000	2,997,621.000	
NETHERLANDS 2.0 07/15/24	2,450,000.000	2,784,890.500	
NETHERLANDS 2.25 07/15/22	1,960,000.000	2,199,414.000	
NETHERLANDS 2.5 01/15/33	1,800,000.000	2,250,756.000	
NETHERLANDS 2.75 01/15/47	1,640,000.000	2,293,490.800	
NETHERLANDS 3.25 07/15/21	2,050,000.000	2,334,130.000	
NETHERLANDS 3.5 07/15/20	1,940,000.000	2,151,654.000	
NETHERLANDS 3.75 01/15/23	1,090,000.000	1,316,611.000	
NETHERLANDS 3.75 01/15/42	1,940,000.000	3,081,748.200	
NETHERLANDS 4.0 01/15/37	1,950,000.000	3,026,985.000	
NETHERLANDS 4.0 07/15/19	1,370,000.000	1,474,805.000	
NETHERLANDS 5.5 01/15/28	1,600,000.000	2,412,160.000	
SPAIN 0.05 01/31/21	2,400,000.000	2,408,688.000	
SPAIN 0.25 01/31/19	1,800,000.000	1,812,924.000	
SPAIN 0.4 04/30/22	3,300,000.000	3,337,290.000	
SPAIN 0.45 10/31/22	500,000.000	503,995.000	
SPAIN 0.75 07/30/21	4,000,000.000	4,113,080.000	
SPAIN 1.15 07/30/20	3,700,000.000	3,832,016.000	
SPAIN 1.3 10/31/26	2,990,000.000	3,023,697.300	
SPAIN 1.4 01/31/20	3,600,000.000	3,727,728.000	
SPAIN 1.45 10/31/27	2,000,000.000	2,012,460.000	
SPAIN 1.5 04/30/27	2,450,000.000	2,496,060.000	
SPAIN 1.6 04/30/25	3,100,000.000	3,268,392.000	
SPAIN 1.95 04/30/26	3,000,000.000	3,202,530.000	
SPAIN 1.95 07/30/30	2,640,000.000	2,700,904.800	
SPAIN 2.15 10/31/25	2,760,000.000	3,000,644.400	

	SPAIN 2.35 07/30/33	900,000.000	934,200.000	
	SPAIN 2.75 04/30/19	3,200,000.000	3,338,944.000	
	SPAIN 2.75 10/31/24	3,300,000.000	3,746,523.000	
	SPAIN 2.9 10/31/46	1,700,000.000	1,788,400.000	
	SPAIN 3.45 07/30/66	1,000,000.000	1,120,350.000	
	SPAIN 3.8 04/30/24	2,500,000.000	2,995,975.000	
	SPAIN 4.0 04/30/20	2,070,000.000	2,280,436.200	
	SPAIN 4.2 01/31/37	2,600,000.000	3,418,766.000	
	SPAIN 4.3 10/31/19	2,120,000.000	2,306,899.200	
	SPAIN 4.4 10/31/23	2,070,000.000	2,536,971.300	
	SPAIN 4.6 07/30/19	2,710,000.000	2,930,052.000	
	SPAIN 4.65 07/30/25	2,350,000.000	3,002,007.500	
	SPAIN 4.7 07/30/41	2,220,000.000	3,140,056.800	
	SPAIN 4.8 01/31/24	2,580,000.000	3,239,061.000	
	SPAIN 4.85 10/31/20	1,400,000.000	1,602,286.000	
	SPAIN 4.9 07/30/40	2,150,000.000	3,093,850.000	
	SPAIN 5.15 10/31/28	2,200,000.000	2,980,780.000	
	SPAIN 5.15 10/31/44	1,730,000.000	2,595,882.300	
	SPAIN 5.4 01/31/23	3,100,000.000	3,898,932.000	
	SPAIN 5.5 04/30/21	2,000,000.000	2,375,340.000	
	SPAIN 5.75 07/30/32	2,700,000.000	4,043,682.000	
	SPAIN 5.85 01/31/22	1,950,000.000	2,417,142.000	
	SPAIN 5.9 07/30/26	1,740,000.000	2,423,506.800	
	SPAIN 6.0 01/31/29	3,100,000.000	4,516,979.000	
	ユーロ 小計	651,980,000.000 (87,234,924,000)	758,407,476.600 (101,474,920,369)	
南アフリカ・ランド	SOUTH AFRICA 10.5 12/21/26	24,940,000.000	26,820,974.800	
	SOUTH AFRICA 6.25 03/31/36	12,410,000.000	8,578,040.200	
	SOUTH AFRICA 6.5 02/28/41	7,780,000.000	5,269,471.800	
	SOUTH AFRICA 6.75 03/31/21	16,150,000.000	15,412,752.500	
	SOUTH AFRICA 7.0 02/28/31	8,690,000.000	6,914,633.000	
	SOUTH AFRICA 7.75 02/28/23	11,500,000.000	11,077,375.000	
	SOUTH AFRICA 8.0 01/31/30	6,020,000.000	5,298,683.600	
	SOUTH AFRICA 8.25 03/31/32	6,000,000.000	5,267,460.000	
	SOUTH AFRICA 8.5 01/31/37	10,100,000.000	8,751,650.000	
	SOUTH AFRICA 8.75 01/31/44	13,000,000.000	11,250,980.000	
	SOUTH AFRICA 8.75 02/28/48	16,960,000.000	14,688,208.000	
	SOUTH AFRICA 8.875 02/28/35	10,000,000.000	9,073,600.000	

	SOUTH AFRICA 9.0 01/31/40	9,000,000.000	8,057,430.000	
	南アフリカ・ランド 小計	152,550,000.000 (1,269,216,000)	136,461,258.900 (1,135,357,674)	
国債証券 合計		223,934,574,800 (223,934,574,800)	243,504,965,311 (243,504,965,311)	
合計		223,934,574,800 (223,934,574,800)	243,504,965,311 (243,504,965,311)	

- (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 130銘柄	42.43%	43.32%
イギリス・ポンド	国債証券 41銘柄	6.76%	6.91%
オーストラリア・ドル	国債証券 22銘柄	2.08%	2.12%
カナダ・ドル	国債証券 30銘柄	2.10%	2.14%
シンガポール・ドル	国債証券 16銘柄	0.31%	0.32%
スウェーデン・クローナ	国債証券 8銘柄	0.41%	0.42%
デンマーク・クローネ	国債証券 7銘柄	0.58%	0.60%
ノルウェー・クローネ	国債証券 7銘柄	0.23%	0.24%
ポーランド・ズロチ	国債証券 14銘柄	0.58%	0.59%
マレーシア・リンギット	国債証券 13銘柄	0.41%	0.42%
メキシコ・ペソ	国債証券 16銘柄	0.78%	0.79%
ユーロ	国債証券 291銘柄	40.82%	41.67%
南アフリカ・ランド	国債証券 13銘柄	0.46%	0.47%

(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29年6月12日現在	平成29年12月11日現在
資産の部			
流動資産			
預金		2,991,700,894	2,294,531,363
コール・ローン		66,586,781	651,561,965
株式		42,699,588,530	53,518,112,088
投資信託受益証券		291,275,124	292,832,167
投資証券		102,048,943	110,410,043
派生商品評価勘定		128,490,151	60,745,308
未収入金		1,806,993	18,075,628
未収配当金		67,698,132	21,081,260
差入委託証拠金		519,000,399	948,674,284
流動資産合計		46,868,195,947	57,916,024,106
資産合計		46,868,195,947	57,916,024,106
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		654,215	591,065
未払解約金		38,268,000	317,772,000
流動負債合計		38,922,215	318,363,065
負債合計		38,922,215	318,363,065
純資産の部			
元本等			
元本	1	43,308,447,537	46,664,168,016
剰余金			
剰余金又は欠損金()		3,520,826,195	10,933,493,025
元本等合計		46,829,273,732	57,597,661,041
純資産合計		46,829,273,732	57,597,661,041
負債純資産合計		46,868,195,947	57,916,024,106

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29年6月12日現在	平成29年12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>	41,562,622,591円	43,308,447,537円
<p>同期中追加設定元本額</p>	9,052,320,659円	14,085,925,400円
<p>同期中一部解約元本額</p>	7,306,495,713円	10,730,204,921円
<p>元本の内訳 ファンド名</p>		

D I A M新興国株式インデック スファンド< D C 年金 >	2,074,768,247円	2,708,173,034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)	156,330,882円	236,771,587円
M I T O ラップ型ファンド (安定型)	8,886,002円	6,549,182円
M I T O ラップ型ファンド (中立型)	22,658,297円	16,759,591円
M I T O ラップ型ファンド (積極型)	28,468,171円	19,236,832円
グローバル8資産ラップファン ド(安定型)	12,654,635円	24,635,594円
グローバル8資産ラップファン ド(中立型)	20,934,286円	22,399,505円
グローバル8資産ラップファン ド(積極型)	15,698,905円	13,756,584円
たわらノーロード 新興国株式	1,507,700,322円	3,031,517,097円
たわらノーロード 新興国株式 <ラップ向け>	462,665,596円	904,732,303円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	- 円	16,622,037円
たわらノーロード バランス (堅実型)	- 円	7,913円
たわらノーロード バランス (標準型)	- 円	7,913円
たわらノーロード バランス (積極型)	- 円	15,826円
たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(保守型)	- 円	7,956円
たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(安定型)	- 円	15,911円
たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(安定成長 型)	- 円	23,867円
たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(成長型)	- 円	39,778円
たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(積極型)	- 円	47,733円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	475,842,627円	462,876,236円
D I A M D C 8資産バラン スファンド(新興国10)	40,721,535円	42,480,341円
D I A M D C 8資産バラン スファンド(新興国20)	116,034,334円	136,844,294円
D I A M D C 8資産バラン スファンド(新興国30)	249,750,952円	296,829,450円
投資のソムリエ	3,112,365,436円	1,985,021,311円
クルーズコントロール	2,416,961,015円	1,759,004,205円
投資のソムリエ< D C 年金 >	146,209,361円	123,423,279円
D I A M 8資産バランスファ ンドN< D C 年金 >	137,601,301円	156,909,893円

クルーズコントロール<DC年金>	696,689円	587,979円
DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)	23,987,502円	21,318,063円
DIAMコア資産設計ファンド(積極型)	63,003,087円	57,019,939円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	69,991,169円	81,537,797円
ダイナミック・ナビゲーション	1,767,449円	1,714,235円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	673,346,539円	1,069,866,746円
ワールドアセットバランス(基本コース)	781,824,653円	1,551,324,265円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	1,293,297,893円	5,567,620,388円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	-円	207,552円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	-円	207,552円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	-円	349,786円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	-円	278,441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)	5,932,765,214円	5,069,248,671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)	2,133,378,511円	2,638,960,295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)	13,020,542,312円	11,289,522,421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)	8,307,594,615円	7,349,694,634円
計	43,308,447,537円	46,664,168,016円
2. 受益権の総数	43,308,447,537口	46,664,168,016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1月18日 至 平成29年6月12日	自 平成29年6月13日 至 平成29年12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29年6月12日現在	平成29年12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29年6月12日現在	平成29年12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	2,127,048,027	6,183,274,067
投資信託受益証券	6,126,540	9,963,352
投資証券	3,905,523	3,682,133
合計	2,137,080,090	6,169,628,582

(注) 「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成29年4月19日から平成29年6月12日まで及び平成29年4月19日から平成29年12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29年6月12日 現在				平成29年12月11日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	-	-	-	-	56,511,000	-	56,838,600	327,600
タイ・パーツ	-	-	-	-	56,511,000	-	56,838,600	327,600
買 建	-	-	-	-	695,660,348	-	697,116,359	1,456,011
アメリカ・ドル	-	-	-	-	695,660,348	-	697,116,359	1,456,011
合計	-	-	-	-	752,171,348	-	753,954,959	1,128,411

(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29年6月12日 現在				平成29年12月11日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								
先物取引								
買 建	3,584,132,859	-	3,711,968,795	127,835,936	3,921,120,478	-	3,980,146,310	59,025,832
合計	3,584,132,859	-	3,711,968,795	127,835,936	3,921,120,478	-	3,980,146,310	59,025,832

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成29年6月12日現在	平成29年12月11日現在
1口当たり純資産額	1.0813円	1.2343円
(1万口当たり純資産額)	(10,813円)	(12,343円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

平成29年12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	35,100	42.980	1,508,598.000	
	CIA DE MINAS BUENAVENTURA SA ADR	21,000	13.160	276,360.000	
	SURGUTNEFTEGAZ SP ADR PREF	81,000	4.855	393,255.000	
	CREDICORP LTD	5,949	209.070	1,243,757.430	
	SINA CORP	5,600	97.020	543,312.000	
	MOBILE TELESYSTEMS PJSC ADR	49,625	8.730	433,226.250	
	NETEASE INC-ADR	7,200	321.510	2,314,872.000	
	SOUTHERN COPPER CORP	7,680	41.990	322,483.200	
	LUKOIL SPON ADR	40,294	57.200	2,304,816.800	
	GAZPROM PAO ADR	504,750	4.450	2,246,137.500	
	COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK SP GDR	106,998	4.100	438,691.800	
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRADE	96,280	1.443	138,932.040	
	EFG-HERMES HOLDINGS GDR	26,843	2.610	70,060.230	
	SURGUTNEFTEGAZ ADR	76,317	4.607	351,592.410	
	NOVATEK PJSC GDR	9,006	115.000	1,035,690.000	
	BAIDU INC -SPON ADR	24,900	234.590	5,841,291.000	
	NOVOLIPETSK STEEL GDR	14,700	23.550	346,185.000	
	MMC NORILSK NICKEL ADR	62,046	17.195	1,066,880.970	
	ROSNEFT OIL CO GDR	125,900	4.958	624,212.200	
	NEW ORIENTAL EDUCATION & TECH	12,000	90.010	1,080,120.000	
	SEVERSTAL GDR	25,347	14.820	375,642.540	
	TATNEFT ADR	25,100	50.600	1,270,060.000	
	VTB BANK OJSC GDR	272,000	1.814	493,408.000	
	DP WORLD LTD	15,640	24.130	377,393.200	
	MAGNIT PJSC GDR	34,000	26.690	907,460.000	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD ADR	37,700	8.460	318,942.000	
	RUSHYDRO PJSC ADR	128,960	1.300	167,648.000	
	TAL EDUCATION GROUP-ADR	27,200	29.040	789,888.000	
	SBERBANK ADR	250,760	16.130	4,044,758.800	
	PHOSAGRO PJSC GDR	16,500	15.050	248,325.000	
	YY INC-ADR	4,000	105.850	423,400.000	
58.COM INC ADR	8,000	69.480	555,840.000		
AUTOHOME INC ADR	5,100	56.600	288,660.000		
WEIBO CORP ADR	4,600	100.240	461,104.000		
JD.COM INC ADR	59,000	38.010	2,242,590.000		

	ALIBABA GROUP HOLDING LTD-ADR	104,580	177.620	18,575,499.600	
	MOMO INC SPON ADR	9,800	24.440	239,512.000	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	34,300	40.810	1,399,783.000	
アメリカ・ドル 小計		2,375,775		55,760,387.970 (6,337,168,094)	
アラブ首長国連邦・ディルハム	DUBAI ISLAMIC BANK PJSC	126,000	6.010	757,260.000	
	EMIRATES TELECOMMUNICATIONS GROUP CO PJSC	150,000	16.600	2,490,000.000	
	DUBAI INVESTMENTS PJSC	72,000	2.300	165,600.000	
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK PJSC	197,247	6.840	1,349,169.480	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	129,990	10.100	1,312,899.000	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	303,000	7.690	2,330,070.000	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	330,000	2.200	726,000.000	
	EMAAR MALLS PJSC	178,166	2.140	381,275.240	
	DXB ENTERTAINMENTS PJSC	272,783	0.649	177,036.160	
	DAMAC PROPERTIES DUBAI CO PJSC	190,235	3.400	646,799.000	
アラブ首長国連邦・ディルハム 小計		1,949,421		10,336,108.880 (320,316,014)	
インド・ルピー	RELIANCE INDUSTRIES LTD	235,083	921.000	216,511,443.000	
	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	65,542	514.450	33,718,081.900	
	ASIAN PAINTS LTD	26,800	1,135.500	30,431,400.000	
	EICHER MOTORS LTD	1,161	28,999.950	33,668,941.950	
	GRASIM INDUSTRIES LTD	32,060	1,134.050	36,357,643.000	
	MAHINDRA & MAHINDRA LTD	32,294	1,388.150	44,828,916.100	
	SHREE CEMENT LTD	830	17,238.200	14,307,706.000	
	ICICI BANK LTD	210,349	310.750	65,365,951.750	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP LTD	56,690	428.450	24,288,830.500	
	STATE BANK OF INDIA LTD	151,072	313.100	47,300,643.200	
	CONTAINER CORP OF INDIA LTD	3,657	1,299.450	4,752,088.650	
	LIC HOUSING FINANCE LTD	28,660	566.400	16,233,024.000	
	TATA STEEL LTD	29,170	697.800	20,354,826.000	
	TATA MOTORS LTD	141,957	411.150	58,365,620.550	
	JSW STEEL LTD	78,900	252.450	19,918,305.000	
	TATA POWER CO LTD	114,770	91.600	10,512,932.000	
	BRITANNIA INDUSTRIES LTD	2,210	4,855.850	10,731,428.500	
	NESTLE INDIA LTD	2,310	7,921.050	18,297,625.500	
	BHARAT HEAVY ELECTRICALS LTD	73,648	92.100	6,782,980.800	
	GAIL INDIA LTD	49,700	482.500	23,980,250.000	
VEDANTA LTD	127,673	291.200	37,178,377.600		
AXIS BANK LTD	149,946	542.500	81,345,705.000		

TITAN COMPANY LTD	29,500	810.950	23,923,025.000	
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	123,780	180.250	22,311,345.000	
LUPIN LTD	21,100	822.850	17,362,135.000	
ACC LTD	2,211	1,746.950	3,862,506.450	
BAJAJ FINANCE LTD	15,400	1,702.250	26,214,650.000	
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP	136,505	1,682.950	229,731,089.750	
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISES LTD	44,098	563.000	24,827,174.000	
INFOSYS LTD	165,519	1,001.850	165,825,210.150	
WIPRO LTD	113,500	282.900	32,109,150.000	
INDIAN OIL CORP LTD	56,340	404.850	22,809,249.000	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	57,892	1,326.650	76,802,421.800	
HCL TECHNOLOGIES LTD	48,972	870.450	42,627,677.400	
DABUR INDIA LTD	52,800	351.150	18,540,720.000	
HERO MOTOCORP LTD	4,790	3,519.550	16,858,644.500	
DR REDDYS LABORATORIES LTD	10,700	2,185.450	23,384,315.000	
BHARTI AIRTEL LTD	106,556	525.150	55,957,883.400	
UNITED SPIRITS LTD	5,444	3,420.900	18,623,379.600	
SUN PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD	83,734	521.850	43,696,587.900	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	9,431	9,042.250	85,277,459.750	
GLENMARK PHARMACEUTICALS LTD	11,618	536.200	6,229,571.600	
AUROBINDO PHARMA LTD	25,500	672.500	17,148,750.000	
HAVELLS INDIA LTD	24,800	537.100	13,320,080.000	
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	62,550	372.300	23,287,365.000	
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE CO LTD	14,810	1,375.450	20,370,414.500	
PETRONET LNG LTD	36,378	251.300	9,141,791.400	
CIPLA LTD/INDIA	33,400	603.100	20,143,540.000	
LARSEN & TOUBRO LTD	41,040	1,220.350	50,083,164.000	
ULTRATECH CEMENT LTD	7,286	4,165.550	30,350,197.300	
ASHOK LEYLAND LTD	113,820	118.550	13,493,361.000	
BOSCH LTD	730	19,550.250	14,271,682.500	
TATA CONSULTANCY SERVICES LTD	41,405	2,601.500	107,715,107.500	
NTPC LTD	155,200	180.400	27,998,080.000	
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	7,680	2,879.950	22,118,016.000	
YES BANK LTD	149,825	312.700	46,850,277.500	
AMBUJA CEMENTS LTD	59,360	268.100	15,914,416.000	
BHARAT FORGE LTD	17,572	706.900	12,421,646.800	
HINDALCO INDUSTRIES LTD	109,900	239.700	26,343,030.000	
ITC LTD	304,671	262.200	79,884,736.200	
UNITED PHOSPHORUS LTD	33,000	728.050	24,025,650.000	
SIEMENS INDIA LTD	6,219	1,175.300	7,309,190.700	

	GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	22,600	1,007.650	22,772,890.000	
	TECH MAHINDRA LTD	43,655	496.100	21,657,245.500	
	IDEA CELLULAR LTD	133,167	96.200	12,810,665.400	
	MARICO LTD	45,380	311.950	14,156,291.000	
	POWER FINANCE CORP LTD	65,910	120.950	7,971,814.500	
	ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	68,449	393.400	26,927,836.600	
	RURAL ELECTRIFICATION CORP LTD	59,932	153.000	9,169,596.000	
	BAJAJ FINSERV LTD	3,720	5,125.100	19,065,372.000	
	BAJAJ AUTO LTD	8,000	3,212.650	25,701,200.000	
	COAL INDIA LTD	64,200	264.850	17,003,370.000	
	TATA MOTORS LTD	31,568	233.500	7,371,128.000	
	VAKRANGEE LTD	17,977	759.000	13,644,543.000	
	MAHINDRA & MAHINDRA FINANCIAL SERVICES LTD	23,715	452.400	10,728,666.000	
	BHARTI INFRATEL LTD	54,580	373.700	20,396,546.000	
	INDIABULLS HOUSING FINANCE LTD	31,030	1,205.550	37,408,216.500	
	CADILA HEALTHCARE LTD	18,146	416.950	7,565,974.700	
	IDFC BANK LTD	114,421	53.550	6,127,244.550	
	インド・ルピー 小計	4,765,968		2,674,876,012.450 (4,761,279,302)	
インドネシア・ルピア	AKR CORPORINDO TBK PT	150,400	6,225.000	936,240,000.000	
	UNITED TRACTORS TBK PT	157,801	32,900.000	5,191,652,900.000	
	INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK PT	432,000	7,375.000	3,186,000,000.000	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	142,600	50,900.000	7,258,340,000.000	
	PT ASTRA INTERNATIONAL TBK	1,769,600	8,250.000	14,599,200,000.000	
	TELEKOMUNIKASI INDONESIA PERSERO TBK	4,489,600	4,140.000	18,586,944,000.000	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA TBK PT	753,200	3,000.000	2,259,600,000.000	
	GUDANG GARAM TBK PT	48,100	80,575.000	3,875,657,500.000	
	HANJAYA MANDALA SAMPOERNA TBK	926,100	4,340.000	4,019,274,000.000	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA TBK PT	185,100	19,400.000	3,590,940,000.000	
	BANK DANAMON INDONESIA TBK PT	290,416	5,500.000	1,597,288,000.000	
	BANK MANDIRI	1,618,800	7,475.000	12,100,530,000.000	
	MATAHARI DEPARTMENT STORE TBK	251,900	10,000.000	2,519,000,000.000	
	BANK RAKYAT INDONESIA	4,851,200	3,370.000	16,348,544,000.000	
	PERUSAHAAN GAS NEGARA PT	1,064,100	1,675.000	1,782,367,500.000	

	BANK NEGARA INDONESIA PERSERO TBK PT	702,200	8,850.000	6,214,470,000.000	
	KALBE FARMA TBK PT	2,086,600	1,675.000	3,495,055,000.000	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK PT	286,500	9,150.000	2,621,475,000.000	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	872,700	21,125.000	18,435,787,500.000	
	XL AXIATA TBK PT	290,700	2,940.000	854,658,000.000	
	JASA MARGA PERSERO TBK PT	200,125	6,425.000	1,285,803,125.000	
	BUMI SERPONG DAMAI PT	851,700	1,630.000	1,388,271,000.000	
	ADARO ENERGY PT	1,434,500	1,725.000	2,474,512,500.000	
	PAKUWON JATI TBK	1,912,800	640.000	1,224,192,000.000	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR TBK PT	239,000	8,775.000	2,097,225,000.000	
	TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE TBK PT	180,800	6,175.000	1,116,440,000.000	
	BANK TABUNGAN NEGARA TBK PT	289,200	3,540.000	1,023,768,000.000	
	WASKITA KARYA PERSERO TBK PT	392,000	1,950.000	764,400,000.000	
	PT SURYA CITRA MEDIA TBK	511,300	2,450.000	1,252,685,000.000	
インドネシア・ルピア 小計		27,381,042		142,100,320,025.000 (1,193,642,688)	
カタール・リアル	QATAR INSURANCE CO SAQ	13,800	44.460	613,548.000	
	QATAR NATIONAL BANK	21,430	120.000	2,571,600.000	
	COMMERCIAL BANK OF QATAR QSC	16,651	26.310	438,087.810	
	OOREDOO QSC	8,410	81.010	681,294.100	
	DOHA BANK QSC	11,963	26.400	315,823.200	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	2,406	166.010	399,420.060	
	INDUSTRIES QATAR QSC	12,500	89.290	1,116,125.000	
	QATAR ISLAMIC BANK SAQ	5,054	92.500	467,495.000	
	QATAR GAS TRANSPORT CO LTD	12,000	13.850	166,200.000	
	MASRAF AL RAYAN	37,100	34.210	1,269,191.000	
	BARWA REAL ESTATE CO	7,916	28.760	227,664.160	
	EZDAN HOLDING GROUP QSC	81,350	9.510	773,638.500	
カタール・リアル 小計		230,580		9,040,086.830 (282,683,515)	
コロンビア・ペソ	INTERCONEXION ELECTRICA SA ESP	31,123	13,680.000	425,762,640.000	
	ECOPETROL SA	413,049	1,780.000	735,227,220.000	
	GRUPO DE INVERSIONES SURAMERICANA SA-PREF	10,138	37,500.000	380,175,000.000	
	GRUPO AVAL ACCIONES Y VALORES SA-PREF	247,861	1,255.000	311,065,555.000	
	CEMENTOS ARGOS SA	31,255	10,680.000	333,803,400.000	
	GRUPO ARGOS SA	27,199	20,400.000	554,859,600.000	

	BANCOLOMBIA SA	17,700	29,140.000	515,778,000.000	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	45,900	29,380.000	1,348,542,000.000	
	GRUPO DE INVERSIONES SURAMERICANA SA	24,660	38,780.000	956,314,800.000	
コロンビア・ペソ	小計	848,885		5,561,528,215.000 (209,669,613)	
タイ・パーツ	BANGKOK BANK PCL	19,700	219.000	4,314,300.000	
	BERLI JUCKER PCL NVDR	121,000	58.500	7,078,500.000	
	KRUNG THAI BANK PCL NVDR	348,000	19.400	6,751,200.000	
	ROBINSON PCL-NVDR	39,400	72.750	2,866,350.000	
	SIAM COMMERCIAL BANK PCL NVDR	172,000	151.000	25,972,000.000	
	TRUE CORP PCL NVDR	1,023,055	5.750	5,882,566.250	
	KASIKORNBANK PCL NVDR	57,000	228.000	12,996,000.000	
	TMB BANK PCL -NVDR	1,010,000	2.940	2,969,400.000	
	IRPC PCL NVDR	863,400	6.450	5,568,930.000	
	BANPU PCL PUBLIC CO LTD NVDR	169,100	17.000	2,874,700.000	
	ELECTRICITY GENERATING PCL NVDR	7,800	219.000	1,708,200.000	
	CHAROEN POKPHAND FOODS PCL	293,200	23.900	7,007,480.000	
	ADVANCED INFO SERVICE PCL	97,500	177.500	17,306,250.000	
	HOME PRODUCT CENTER PCL- NVDR	280,320	12.300	3,447,936.000	
	DELTA ELECTRONICS THAI PCL NVDR	44,200	82.000	3,624,400.000	
	PTT PCL	93,300	422.000	39,372,600.000	
	THAI UNION GROUP PCL- NVDR	164,100	19.500	3,199,950.000	
	SIAM CEMENT PCL NVDR	11,650	478.000	5,568,700.000	
	KCE ELECTRONICS PCL-NVDR	24,900	86.000	2,141,400.000	
	AIRPORTS OF THAILAND PCL-NVDR	418,000	62.500	26,125,000.000	
	SIAM CEMENT PCL FOREIGN	26,500	480.000	12,720,000.000	
	KASIKORNBANK PCL - FOREIGN	105,700	232.000	24,522,400.000	
	CENTRAL PATTANA PCL NVDR	131,400	79.750	10,479,150.000	
	BANGKOK DUSIT MEDICAL SERVICES NVDR	397,000	21.300	8,456,100.000	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL- NVDR	37,000	202.000	7,474,000.000	
	MINOR INTERNATIONAL PCL- NVDR	168,210	42.250	7,106,872.500	
	THAI OIL PCL NVDR	81,000	99.250	8,039,250.000	
	GLOW ENERGY PCL NVDR	54,000	85.750	4,630,500.000	
	CP ALL PCL NVDR	440,100	74.500	32,787,450.000	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL	544,800	8.300	4,521,840.000	

	PTT EXPLORATION & PRODUCTION PCL NVDR	136,045	93.500	12,720,207.500	
	INDORAMA VENTURES PCL NVDR	142,022	52.500	7,456,155.000	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	203,308	82.250	16,722,083.000	
	ENERGY ABSOLUTE PCL NVDR	93,000	49.000	4,557,000.000	
	BANGKOK EXPRESSWAY & METRO PCL NVDR	740,700	7.700	5,703,390.000	
タイ・パーツ 小計		8,558,410		354,672,260.250 (1,234,259,465)	
チェコ・コルナ	KOMERCNI BANKA AS	7,100	898.900	6,382,190.000	
	O2 CZECH REPUBLIC AS	5,677	276.900	1,571,961.300	
	CEZ	15,000	490.400	7,356,000.000	
	MONETA MONEY BANK AS	35,965	78.000	2,805,270.000	
チェコ・コルナ 小計		63,742		18,115,421.300 (94,743,653)	
チリ・ペソ	BANCO SANTANDER CHILE	6,514,000	43.630	284,205,820.000	
	BANCO DE CREDITO E INVERSIONES	3,640	35,463.000	129,085,320.000	
	BANCO DE CHILE	2,348,850	87.820	206,276,007.000	
	EMPRESAS CMPC SA	116,370	1,796.300	209,035,431.000	
	EMPRESAS COPEC SA	43,910	8,205.400	360,299,114.000	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	15,170	8,264.000	125,364,880.000	
	ENTEL CHILE SA	15,970	6,159.500	98,367,215.000	
	ENEL GENERACION CHILE SA	322,190	531.210	171,150,549.900	
	ENEL AMERICAS SA	2,717,380	124.990	339,645,326.200	
	COLBUN SA	405,312	128.010	51,883,989.120	
	AGUAS ANDINAS SA	224,116	366.660	82,174,372.560	
	EMBOTELLADORA ANDINA SA	27,270	2,731.000	74,474,370.000	
	LATAM AIRLINES GROUP SA	27,396	7,924.000	217,085,904.000	
	SOCIEDAD QUIMICA Y MINERA DE CHILE SA	9,000	34,308.000	308,772,000.000	
	SACI FALABELLA	60,913	5,457.500	332,432,697.500	
	ITAU CORPBANCA	4,838,793	4.965	24,024,607.240	
	CENCOSUD SA	132,780	1,568.600	208,278,708.000	
AES GENER SA	257,135	177.760	45,708,317.600		
ENEL CHILE SA	1,934,010	67.300	130,158,873.000		
チリ・ペソ 小計		20,014,205		3,398,423,502.120 (588,946,793)	
トルコ・リラ	AKBANK TAS	213,480	9.140	1,951,207.200	
	ANADOLU EFES BIRACILIK VE MALT SANAYII AS	21,520	23.500	505,720.000	
	ARCELIK	20,062	20.500	411,271.000	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	17,677	33.520	592,533.040	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIKALARI TAS	128,570	8.940	1,149,415.800	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	5,584	60.500	337,832.000	

	KOC HOLDING AS	70,650	17.580	1,242,027.000	
	PETKIM PETROKIMYA HOLDING	80,700	6.900	556,830.000	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI AS	46,897	4.340	203,532.980	
	TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKASI AS	10,370	32.500	337,025.000	
	TURK HAVA YOLLARI	44,695	13.590	607,405.050	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	93,210	15.020	1,400,014.200	
	TURKIYE GARANTI BANKASI AS	198,350	10.050	1,993,417.500	
	TURKIYE IS BANKASI	120,899	6.710	811,232.290	
	TUPRAS TURKIYE PETROL RAFINE	12,180	118.000	1,437,240.000	
	ULKER BISKUVI SANAYI AS	13,121	18.300	240,114.300	
	YAPI VE KREDI BANKASI AS	73,599	4.220	310,587.780	
	HACI OMER SABANCI HOLDING AS	93,430	10.560	986,620.800	
	COCA-COLA ICECEK AS	6,451	34.320	221,398.320	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	20,710	73.700	1,526,327.000	
	TURKIYE VAKIFLAR BANKASI TAO	63,608	6.050	384,828.400	
	TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	13,735	21.100	289,808.500	
	TURKIYE HALK BANKASI AS	61,970	9.920	614,742.400	
	TURK TELEKOMUNIKASYON AS	56,200	6.120	343,944.000	
	トルコ・リラ 小計	1,487,668		18,455,074.560 (547,008,410)	
ハンガリー・フォロント	RICHTER GEDEON NYRT	13,930	6,489.000	90,391,770.000	
	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NYRT	27,417	3,051.000	83,649,267.000	
	OTP BANK NYRT	23,000	10,075.000	231,725,000.000	
	ハンガリー・フォロント 小計	64,347		405,766,037.000 (172,937,485)	
パキスタン・ルビー	LUCKY CEMENT LTD	9,900	493.180	4,882,482.000	
	MCB BANK LTD	39,000	199.230	7,769,970.000	
	OIL & GAS DEVELOPMENT CO LTD	42,300	155.600	6,581,880.000	
	UNITED BANK LTD	51,400	168.180	8,644,452.000	
	HABIB BANK LTD	54,400	155.920	8,482,048.000	
	パキスタン・ルビー 小計	197,000		36,360,832.000 (39,269,698)	
フィリピン・ペソ	AYALA LAND INC	694,400	43.000	29,859,200.000	
	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	149,280	70.900	10,583,952.000	

	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAND	77,686	103.500	8,040,501.000	
	AYALA CORP	20,368	1,030.000	20,979,040.000	
	ALLIANCE GLOBAL GROUP INC	340,600	15.720	5,354,232.000	
	DMCI HOLDINGS INC	351,850	14.320	5,038,492.000	
	GLOBE TELECOM INC	2,785	1,760.000	4,901,600.000	
	INTERNATIONAL CONTAINER TERM SERVICES INC	40,680	104.500	4,251,060.000	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	271,380	69.000	18,725,220.000	
	JOLLIBEE FOODS CORP	44,130	248.800	10,979,544.000	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	65,551	96.150	6,302,728.650	
	BDO UNIBANK INC	165,113	148.000	24,436,724.000	
	MEGAWORLD CORP	962,000	5.200	5,002,400.000	
	PLDT INC	7,900	1,515.000	11,968,500.000	
	ROBINSONS LAND CORP	172,400	22.200	3,827,280.000	
	SECURITY BANK CORP	23,420	250.000	5,855,000.000	
	SM PRIME HOLDINGS INC	819,075	36.500	29,896,237.500	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	88,660	144.000	12,767,040.000	
	SM INVESTMENTS CORP	23,688	980.500	23,226,084.000	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CORP	979,300	6.400	6,267,520.000	
	ABOITIZ POWER CORP	122,900	38.600	4,743,940.000	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	16,600	323.400	5,368,440.000	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	8,940	1,175.000	10,504,500.000	
フィリピン・ペソ	小計	5,448,706		268,879,235.150 (604,978,279)	
ブラジル・リアル	BRF SA	38,492	36.710	1,413,041.320	
	VALE SA	286,321	35.480	10,158,669.080	
	RAIA DROGASIL SA	21,600	88.000	1,900,800.000	
	TIM PARTICIPACOES SA	81,700	11.990	979,583.000	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	19,450	21.470	417,591.500	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	24,500	18.580	455,210.000	
	BANCO DO BRASIL SA	77,100	30.950	2,386,245.000	
	INVESTIMENTOS ITAU SA	354,286	10.520	3,727,088.720	
	LOJAS AMERICANAS SA	68,974	15.350	1,058,750.900	
	GERDAU SA	84,430	11.700	987,831.000	
	CIA BRASILEIRA DE DISTRIBUICAO GRUPO PAO DE ACUCAR	14,906	74.910	1,116,608.460	
	PETROLEO BRASILEIRO SA	261,410	15.890	4,153,804.900	
	PETROLEO BRASILEIRO SA	356,912	15.350	5,478,599.200	
	KROTON EDUCACIONAL SA	123,168	16.990	2,092,624.320	
	CCR SA	103,920	15.970	1,659,602.400	
	WEG SA	53,540	23.150	1,239,451.000	
	BANCO BRADESCO SA PREF	277,596	32.960	9,149,564.160	

BANCO BRADESCO SA	81,835	30.500	2,495,967.500	
NATURA COSMETICOS SA	14,800	30.700	454,360.000	
CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	61,606	7.370	454,036.220	
SUZANO PAPEL E CELULOSE SA	37,900	18.780	711,762.000	
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	293,598	42.250	12,404,515.500	
PORTO SEGURO SA	9,400	35.450	333,230.000	
FIBRIA CELULOSE SA	24,390	47.090	1,148,525.100	
BRASKEM SA	17,030	43.150	734,844.500	
ENGIE BRASIL SA	11,270	34.850	392,759.500	
LOCALIZA RENT A CAR	47,880	21.150	1,012,662.000	
TELEFONICA BRASIL S.A.	39,728	50.050	1,988,386.400	
LOJAS RENNER SA	62,370	34.500	2,151,765.000	
EDP - ENERGIAS DO BRASIL SA	31,864	13.600	433,350.400	
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	31,352	70.490	2,210,002.480	
COSAN SA INDUSTRIA E COMERCIO	16,500	34.750	573,375.000	
EQUATORIAL ENERGIA SA	18,800	64.820	1,218,616.000	
EMBRAER SA	62,560	16.420	1,027,235.200	
M DIAS BRANCO SA	10,400	49.550	515,320.000	
TRANSMISSORA ALIANCA DE ENERGIA ELETRICA SA	16,300	20.790	338,877.000	
ODONTOPREV SA	22,300	15.160	338,068.000	
BR MALLS PARTICIPACOES SA	78,065	12.450	971,909.250	
JBS SA	81,500	8.780	715,570.000	
CIA ENERGETICA DE MINAS GERAIS	75,749	6.710	508,275.790	
CIA DE SANEAMENTO BASICO DO ESTADO DE SAO PAULO	33,798	32.980	1,114,658.040	
MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS IMOBILIARIOS SA	6,080	69.320	421,465.600	
SUL AMERICA SA	17,869	18.060	322,714.140	
HYPERMARCAS SA	34,900	34.110	1,190,439.000	
B3 SA-BRASIL BOLSA BAICAO	185,316	21.730	4,026,916.680	
QUALICORP SA	22,000	29.760	654,720.000	
BANCO SANTANDER BRASIL SA	40,500	32.000	1,296,000.000	
CIELO SA	108,507	23.330	2,531,468.310	
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	68,400	27.810	1,902,204.000	
ATACADAO DISTRIBUICAO COMERCIO E INDUSTRIA LTDA	32,300	15.510	500,973.000	
AMBEV SA	425,095	21.020	8,935,496.900	

	KLABIN SA	55,200	17.480	964,896.000	
	RUMO SA	106,000	12.480	1,322,880.000	
ブラジル・リアル	小計	4,531,467		106,693,309.470 (3,680,919,177)	
ポーランド・ズロチ	BANK MILLENNIUM SA	52,647	8.400	442,234.800	
	MBANK	1,530	463.000	708,390.000	
	BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA	2,596	74.000	192,104.000	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	11,456	102.400	1,173,094.400	
	BANK PEKAO SA	14,880	126.550	1,883,064.000	
	ORANGE POLSKA SA	58,600	5.450	319,370.000	
	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	26,869	111.050	2,983,802.450	
	LPP SA	130	8,345.900	1,084,967.000	
	BANK ZACHODNI WBK SA	3,200	366.900	1,174,080.000	
	CD PROJEKT RED SA	5,817	94.000	546,798.000	
	POWSZECHNA KASA OSZCZEDNOSCI BANK POLSKI SA	84,184	41.970	3,533,202.480	
	CCC SA	2,638	260.000	685,880.000	
	SYNTHOS SA	46,508	4.790	222,773.320	
	GRUPA LOTOS SA	9,480	60.350	572,118.000	
	POLSKIE GORNICtwo NAFTOWE I GAZOWNICTWO SA	132,742	5.930	787,160.060	
	CYFROWY POLSAT SA	22,810	24.000	547,440.000	
	GRUPA AZOTY SA	3,853	69.600	268,168.800	
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	81,100	12.660	1,026,726.000	
	TAURON POLSKA ENERGIA SA	89,318	3.280	292,963.040	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZEN SA	53,943	43.400	2,341,126.200	
	JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA SA	4,403	90.020	396,358.060	
ALIOR BANK SA	9,250	74.000	684,500.000		
DINO POLSKA SA	3,757	73.000	274,261.000		
PLAY COMMUNICATIONS SA	8,612	34.000	292,808.000		
ポーランド・ズロチ	小計	730,323		22,433,389.610 (715,176,461)	
マレーシア・リンギット	AMMB HOLDINGS BHD	138,900	4.130	573,657.000	
	GENTING PLANTATIONS BHD	22,600	10.300	232,780.000	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	438,000	5.960	2,610,480.000	
	DIGI.COM BHD	289,900	4.670	1,353,833.000	
	MALAYSIA AIRPORTS HOLDINGS BHD	84,220	8.300	699,026.000	
	RHB BANK BHD	68,080	4.850	330,188.000	
	HAP SENG CONSOLIDATED BHD	54,700	9.500	519,650.000	
	GAMUDA BHD	109,600	4.750	520,600.000	

GENTING BHD	220,900	8.790	1,941,711.000	
YTL CORP BHD	377,410	1.180	445,343.800	
HONG LEONG FINANCIAL GROUP BHD	12,756	16.760	213,790.560	
HONG LEONG BANK BHD	63,008	16.000	1,008,128.000	
IJM CORP BHD	184,560	2.860	527,841.600	
IOI CORP BHD	229,013	4.490	1,028,268.370	
KUALA LUMPUR KEPONG BHD	46,000	24.460	1,125,160.000	
MALAYAN BANKING BHD	384,875	9.270	3,567,791.250	
ALLIANCE BANK MALAYSIA BHD	86,100	3.900	335,790.000	
MISC BHD	131,080	7.120	933,289.600	
NESTLE MALAYSIA BHD	3,500	99.460	348,110.000	
PPB GROUP BHD	47,800	16.800	803,040.000	
PETRONAS DAGANGAN BHD	17,500	24.500	428,750.000	
PETRONAS GAS BHD	68,000	16.000	1,088,000.000	
GENTING MALAYSIA BHD	249,500	5.250	1,309,875.000	
BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD	14,700	38.080	559,776.000	
TELEKOM MALAYSIA BHD	95,000	6.040	573,800.000	
SP SETIA BHD	77,900	3.410	265,639.000	
TENAGA NASIONAL BHD	311,050	15.520	4,827,496.000	
UMW HOLDINGS BHD	39,000	5.020	195,780.000	
DIALOG GROUP BHD	243,444	2.400	584,265.600	
PUBLIC BANK BHD(LLOCAL)	272,030	20.020	5,446,040.600	
YTL POWER INTERNATIONAL BHD	148,780	1.210	180,023.800	
AIRASIA BHD	147,900	3.220	476,238.000	
SIME DARBY BERHAD	232,700	2.180	507,286.000	
HARTALEGA HOLDINGS BHD	57,600	9.190	529,344.000	
AXIATA GROUP BERHAD	256,000	5.360	1,372,160.000	
MAXIS BHD	188,600	5.940	1,120,284.000	
PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	224,000	7.420	1,662,080.000	
SAPURA ENERGY BHD	319,200	0.830	264,936.000	
ASTRO MALAYSIA HOLDINGS BHD	95,500	2.720	259,760.000	
IHH HEALTHCARE BHD	207,300	5.620	1,165,026.000	
FELDA GLOBAL VENTURES HOLDINGS BHD	126,400	1.710	216,144.000	
WESTPORTS HOLDINGS BHD	83,500	3.550	296,425.000	
PRESS METAL ALUMINIUM HOLDINGS BHD	107,800	5.070	546,546.000	
SIME DARBY PROPERTY BHD	232,700	1.280	297,856.000	
SIME DARBY PLANTATION BHD	232,700	5.290	1,230,983.000	
IOI PROPERTIES GROUP SDN BHD	174,548	1.950	340,368.600	
マレーシア・リンギット 小計	7,216,354		44,863,360.780	

				(1,247,650,063)	
メキシコ・ペソ	ALFA SAB DE CV	287,100	20.760	5,960,196.000	
	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	47,600	129.100	6,145,160.000	
	EL PUERTO DE LIVERPOOL SAB DE CV	19,100	118.410	2,261,631.000	
	GRUPO FINANCIERO SANTANDER MEXICO	178,000	29.450	5,242,100.000	
	GRUPO TELEVISIA SAB	215,100	70.870	15,244,137.000	
	GRUPO BIMBO SAB DE CV	156,500	42.650	6,674,725.000	
	GRUMA SAB DE CV	20,805	243.940	5,075,171.700	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INFRAESTRUCTURA	22,030	193.800	4,269,414.000	
	GRUPO CARSO SAB DE CV	37,900	61.140	2,317,206.000	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE SAB DE CV	222,200	105.840	23,517,648.000	
	MEXICHEM SAB DE CV	79,825	48.190	3,846,766.750	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	14,700	381.540	5,608,638.000	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO SAB DE CV	153,700	33.810	5,196,597.000	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL SURESTE SAB DE CV	19,575	336.330	6,583,659.750	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV	339,352	58.940	20,001,406.880	
	AMERICA MOVIL SAB DE CV	3,043,478	16.310	49,639,126.180	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA SA	214,700	32.420	6,960,574.000	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	43,800	133.100	5,829,780.000	
	WAL-MART DE MEXICO SAB DE CV	467,900	45.460	21,270,734.000	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL PACIFICO SAB DE CV	33,500	194.850	6,527,475.000	
GENEREA SAB DE CV	103,000	16.640	1,713,920.000		
INFRAESTRUCTURA ENERGETICA NOVA SAB DE CV	53,200	99.420	5,289,144.000		
GRUPO LALA SAB DE CV	50,400	28.380	1,430,352.000		
メキシコ・ペソ 小計	5,823,465		216,605,562.260 (1,299,633,374)		
ユーロ	PIRAEUS BANK S.A	25,000	2.420	60,500.000	
	ALPHA BANK A.E.	121,000	1.630	197,230.000	
	NATIONAL BANK OF GREECE	552,000	0.272	150,144.000	
	TITAN CEMENT CO. S.A.	3,518	20.440	71,907.920	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	22,000	10.500	231,000.000	
	FF GROUP	3,130	17.180	53,773.400	
	EUROBANK ERGASIAS	151,630	0.720	109,173.600	
	OPAP SA	20,000	10.100	202,000.000	
JUMBO SA	10,420	13.380	139,419.600		

ユーロ 小計		908,698		1,215,148.520 (162,586,872)	
韓国・ウォン	CHEIL WORLDWIDE INC	7,097	20,400.000	144,778,800.000	
	HANMI SCIENCE CO LTD	1,142	105,000.000	119,910,000.000	
	HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	3,710	105,000.000	389,550,000.000	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANC	2,685	263,000.000	706,155,000.000	
	DB INSURANCE CO LTD	4,750	68,700.000	326,325,000.000	
	COWAY CO LTD	4,980	103,000.000	512,940,000.000	
	KT&G CORP	10,362	116,000.000	1,201,992,000.000	
	S-1 CORPORATION	1,579	100,000.000	157,900,000.000	
	KOREA GAS CORP	2,997	41,850.000	125,424,450.000	
	CJ CORP	1,108	190,000.000	210,520,000.000	
	KAKAO CORP	3,370	138,500.000	466,745,000.000	
	SK TELECOM CO LTD	1,900	271,500.000	515,850,000.000	
	DAELIM INDUSTRIAL CO	2,890	81,800.000	236,402,000.000	
	MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD	35,200	10,550.000	371,360,000.000	
	NCSOFT CORPORATION	1,557	465,500.000	724,783,500.000	
	DOOSAN HEAVY INDUSTRIES AND CONSTRUCTION CO LTD	4,050	15,800.000	63,990,000.000	
	DAEWOO ENGINEERING & CONSTRUCT	13,540	5,530.000	74,876,200.000	
	POSCO DAEWOO CORP	3,600	17,600.000	63,360,000.000	
	LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD	835	1,188,000.000	991,980,000.000	
	LG CHEM LTD	4,137	398,500.000	1,648,594,500.000	
	LG CHEM LTD	641	243,500.000	156,083,500.000	
	LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD	177	681,000.000	120,537,000.000	
	SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD	38,041	48,200.000	1,833,576,200.000	
	HYUNDAI DEVELOPMENT CO	5,910	39,350.000	232,558,500.000	
	S-OIL CORP	4,230	119,000.000	503,370,000.000	
	HANWHA CHEMICAL CORPORATION	7,771	29,900.000	232,352,900.000	
	SAMSUNG SECURITIES CO LTD	6,600	36,050.000	237,930,000.000	
	LOTTE CHEMICAL CORPORATION	1,450	357,000.000	517,650,000.000	
	HOTEL SHILLA CO LTD	2,955	86,100.000	254,425,500.000	
	HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	3,080	126,500.000	389,620,000.000	
	HYUNDAI MOBIS	6,104	262,000.000	1,599,248,000.000	
SK HYNIX INC	52,740	78,700.000	4,150,638,000.000		
HYUNDAI ENGINEERING & CONSTRUCTION CO LTD	7,478	34,650.000	259,112,700.000		
HYUNDAI MOTOR CO	2,370	95,700.000	226,809,000.000		
HYUNDAI MOTOR CO	13,601	158,500.000	2,155,758,500.000		

HYUNDAI STEEL CO	7,580	58,900.000	446,462,000.000	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	23,903	15,550.000	371,691,650.000	
KCC CORP	399	382,000.000	152,418,000.000	
KIA MOTORS CORP	22,905	33,000.000	755,865,000.000	
KOREA ZINC CO LTD	810	464,000.000	375,840,000.000	
KOREA ELECTRIC POWER CORP	22,642	38,000.000	860,396,000.000	
HANWHA CORP	3,785	39,750.000	150,453,750.000	
KOREAN AIR CO LTD	4,930	31,550.000	155,541,500.000	
OCI COMPANY LTD	1,500	120,500.000	180,750,000.000	
CJ LOGISTICS	860	151,000.000	129,860,000.000	
KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	1,930	86,200.000	166,366,000.000	
KT CORP	2,048	30,250.000	61,952,000.000	
LG ELECTRONICS INC	9,433	94,500.000	891,418,500.000	
LOTTE CORP	2,351	58,900.000	138,473,900.000	
HANSSEM CO LTD	1,100	173,000.000	190,300,000.000	
LG CORP	8,224	87,500.000	719,600,000.000	
NH INVESTMENT & SECURITIES CO LTD	10,100	13,700.000	138,370,000.000	
GS ENGINEERING & CONSTRUCTION	5,290	26,900.000	142,301,000.000	
NAVER CORP	2,512	830,000.000	2,084,960,000.000	
HYUNDAI DEPARTMENT STORE CO LTD	1,187	101,500.000	120,480,500.000	
DONGSUH CO INC	2,798	28,550.000	79,882,900.000	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO LTD	4,030	68,800.000	277,264,000.000	
OTTOGI CORP	112	778,000.000	87,136,000.000	
AMOREPACIFIC GROUP	2,750	150,000.000	412,500,000.000	
KANGWON LAND INC	11,170	36,650.000	409,380,500.000	
POSCO	6,635	330,500.000	2,192,867,500.000	
SAMSUNG SDI CO LTD	4,894	209,500.000	1,025,293,000.000	
SAMSUNG ELECTRO- MECHANICS CO LTD	5,260	99,600.000	523,896,000.000	
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	8,837	2,600,000.000	22,976,200,000.000	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES CO LTD	23,331	7,640.000	178,248,840.000	
HANWHA TECHWIN CO LTD	3,141	33,550.000	105,380,550.000	
SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	1,583	2,075,000.000	3,284,725,000.000	
SHINSEGAE CO LTD	669	281,500.000	188,323,500.000	
HYOSUNG CORP	2,120	134,000.000	284,080,000.000	
YUHAN CORP	733	210,000.000	153,930,000.000	
HANON SYSTEMS	18,967	13,250.000	251,312,750.000	
HYUNDAI MARINE & FIRE INSURANCE CO LTD	6,280	44,850.000	281,658,000.000	
GS HOLDINGS CORP	4,910	60,200.000	295,582,000.000	
LG DISPLAY CO LTD	20,395	29,650.000	604,711,750.000	

SK NETWORKS CO LTD	14,810	6,420.000	95,080,200.000	
CELLTRION INC	7,148	196,100.000	1,401,722,800.000	
HANA FINANCIAL GROUP	26,350	46,950.000	1,237,132,500.000	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	1,753	143,000.000	250,679,000.000	
LOTTE SHOPPING CO	944	204,500.000	193,048,000.000	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LTD	6,195	124,000.000	768,180,000.000	
AMOREPACIFIC CORP	2,852	319,000.000	909,788,000.000	
AMOREPACIFIC CORP-PREF	752	174,000.000	130,848,000.000	
SAMSUNG CARD CO	2,877	39,100.000	112,490,700.000	
SK INNOVATION CO LTD	5,739	203,000.000	1,165,017,000.000	
CJ CHEILJEDANG CORP	770	390,000.000	300,300,000.000	
STX PAN OCEAN CO LTD	18,395	5,690.000	104,667,550.000	
KEPCO PLANT SERVICE & ENGINEERING CO LTD	1,825	39,650.000	72,361,250.000	
LG INNOTEK CO LTD	1,440	154,000.000	221,760,000.000	
SK HOLDINGS CO LTD	2,773	295,500.000	819,421,500.000	
KB FINANCIAL GROUP INC	35,627	59,500.000	2,119,806,500.000	
MEDY-TOX INC	430	446,000.000	191,780,000.000	
HYUNDAI WIA CORP	1,454	65,100.000	94,655,400.000	
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES LTD	6,800	46,150.000	313,820,000.000	
BNK FINANCIAL GROUP INC	26,470	9,280.000	245,641,600.000	
HANMI PHARM CO LTD	556	535,000.000	297,460,000.000	
HANWHA LIFE INSURANCE CO LTD	26,430	7,130.000	188,445,900.000	
O MEDIA HOLDINGS CO LTD	1,950	89,100.000	173,745,000.000	
E-MART CO LTD	1,970	257,500.000	507,275,000.000	
DGB FINANCIAL GROUP INC	17,915	10,300.000	184,524,500.000	
GS RETAIL CO LTD	2,482	42,300.000	104,988,600.000	
HANKOOK TIRE CO LTD NEW	7,070	53,200.000	376,124,000.000	
HYUNDAI ROBOTICS CO LTD	930	382,500.000	355,725,000.000	
BGF RETAIL CO LTD	854	194,000.000	165,676,000.000	
ORION CORP REPUBLIC OF KOREA	1,748	114,000.000	199,272,000.000	
ING LIFE INSURANCE KOREA LTD	2,625	53,900.000	141,487,500.000	
NETMARBLE GAMES CORP	1,710	185,500.000	317,205,000.000	
BGF CO LTD	1,595	28,550.000	45,537,250.000	
SAMSUNG SDS CO LTD	3,260	200,500.000	653,630,000.000	
WOORI BANK	32,025	15,700.000	502,792,500.000	
SAMSUNG C&T CORP	6,690	132,000.000	883,080,000.000	
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	1,550	337,000.000	522,350,000.000	
DOOSAN BOBCAT INC	2,980	34,150.000	101,767,000.000	
SILLAJEN INC	4,737	91,200.000	432,014,400.000	
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	2,915	77,900.000	227,078,500.000	
韓国・ウォン 小計	814,137		80,897,356,490.000 (8,429,504,547)	

香港・ドル	JIANGXI COPPER CO LTD	122,000	11.240	1,371,280.000	
	JIANGSU EXPRESS	124,000	11.500	1,426,000.000	
	CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD	162,000	7.210	1,168,020.000	
	CHINA MOBILE LIMITED	557,000	76.000	42,332,000.000	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	106,500	36.400	3,876,600.000	
	BEIJING ENTERPRISES	48,500	44.800	2,172,800.000	
	HUANENG POWER INTERNATIONAL IN	424,000	4.860	2,060,640.000	
	ALIBABA HEALTH INFORMATION TECHNOLOGY	276,000	3.710	1,023,960.000	
	YANZHOU COAL MINING CO LTD	186,000	7.250	1,348,500.000	
	HENGAN INTERNATIONAL GROUP	63,000	79.800	5,027,400.000	
	CNOOC LTD	1,594,000	10.480	16,705,120.000	
	BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	268,000	19.480	5,220,640.000	
	CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LTD	416,000	15.420	6,414,720.000	
	CHINA OVERSEAS LAND & INVESTME	337,120	24.200	8,158,304.000	
	CHINA RESOURCES LAND LTD	234,888	21.900	5,144,047.200	
	CITIC LTD	497,000	11.020	5,476,940.000	
	BEIJING CAPITAL INTERNATIONAL	150,000	11.700	1,755,000.000	
	LENOVO GROUP LTD	682,000	4.300	2,932,600.000	
	PETRO CHINA CO LTD	1,840,000	5.130	9,439,200.000	
	CHINA UNICOM HONG KONG LTD	526,742	10.620	5,594,000.040	
	CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS CO LTD	151,990	28.550	4,339,314.500	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL COR	2,267,200	5.450	12,356,240.000	
	TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	92,000	21.650	1,991,800.000	
	ENN ENERGY HOLDINGS LTD	74,000	56.100	4,151,400.000	
	KUNLUN ENERGY COMPANY LTD	306,000	7.210	2,206,260.000	
	COSCO SHIPPING PORTS LTD	162,000	7.910	1,281,420.000	
	CHINA MERCHANTS PORT HOLDINGS CO LTD	96,000	19.780	1,898,880.000	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	374,000	4.900	1,832,600.000	
	CHINA EVERBRIGHT LTD	56,000	17.080	956,480.000	
	CHINA GAS HOLDINGS LTD	164,000	24.000	3,936,000.000	
	KINGBOARD CHEMICALS HOLDINGS	55,000	40.800	2,244,000.000	

GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LTD	442,000	25.700	11,359,400.000	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LTD	88,000	29.000	2,552,000.000	
BYD CO LTD	63,000	64.700	4,076,100.000	
CHINA TELECOM CORP LTD	1,208,000	3.750	4,530,000.000	
CHINA OILFIELD SERVICES LTD	120,000	7.050	846,000.000	
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	1,170,000	0.910	1,064,700.000	
CHINA EVERBRIGHT INTERNATIONAL	235,000	10.500	2,467,500.000	
LEE & MAN PAPER MANUFACTURING LTD	124,000	9.330	1,156,920.000	
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	407,192	14.940	6,083,448.480	
AVICHINA INDUSTRY & TECHNOLOGY	225,000	3.980	895,500.000	
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS	159,200	14.020	2,231,984.000	
GREAT WALL MOTOR COMPANY LTD	290,000	8.800	2,552,000.000	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	668,000	24.650	16,466,200.000	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD	583,000	2.530	1,474,990.000	
SHANDONG WEIGAO GROUP MEDICAL-H	160,000	5.270	843,200.000	
SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	275,700	10.720	2,955,504.000	
WEICHAJ POWER CO LTD	194,440	7.990	1,553,575.600	
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEMICAL	353,000	4.500	1,588,500.000	
SHANGHAI INDUSTRIAL	43,000	21.650	930,950.000	
TINGYI HOLDING CORP	186,000	12.860	2,391,960.000	
TSINGTAO BREWERY CO LTD	24,000	33.550	805,200.000	
GUANGDONG INVESTMENTS LTD	278,000	10.680	2,969,040.000	
CHINA RESOURCES BEER HOLDINGS	153,333	23.900	3,664,658.700	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO LTD	146,000	8.850	1,292,100.000	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	418,000	11.200	4,681,600.000	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	239,000	20.350	4,863,650.000	
TENCENT HOLDINGS LTD	516,900	394.000	203,658,600.000	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	471,000	78.400	36,926,400.000	
BEIJING ENTERPRISES WATER GROUP LTD	456,000	5.980	2,726,880.000	
GOME RETAIL HOLDINGS LTD	970,240	0.860	834,406.400	

AIR CHINA / HONG KONG	162,000	8.100	1,312,200.000	
ZTE CORP	71,288	27.350	1,949,726.800	
SHANGHAI ELECTRIC GROUP CO LTD	250,000	3.070	767,500.000	
CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD	302,500	19.020	5,753,550.000	
BANK OF COMMUNICATIONS	851,205	5.680	4,834,844.400	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT HOLDINGS LTD	210,250	10.180	2,140,345.000	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	66,000	148.900	9,827,400.000	
CHINA CONSTRUCTION BANK	7,625,530	6.650	50,709,774.500	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP HOLDINGS LTD	66,000	73.300	4,837,800.000	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	256,000	9.320	2,385,920.000	
AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	124,000	11.480	1,423,520.000	
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS LTD	167,000	12.600	2,104,200.000	
CHINA NATIONAL BLDG MATERIAL	290,000	6.530	1,893,700.000	
BANK OF CHINA LTD	7,173,200	3.760	26,971,232.000	
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	118,500	15.640	1,853,340.000	
GUANGZHOU R&F PROPERTIES CO LTD	96,800	16.580	1,604,944.000	
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	349,970	30.450	10,656,586.500	
IND & COMM BK OF CHINA - H	6,680,235	5.900	39,413,386.500	
CHINA COMMUNICATIONS SERVICES	199,600	4.940	986,024.000	
CHINA COMMUNICATIONS CONSTRUCTION CO LTD	366,000	8.550	3,129,300.000	
HAITIAN INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	64,000	22.500	1,440,000.000	
ZHUZHOU CRRG TIMES ELECTRIC CO LTD	52,500	43.650	2,291,625.000	
HAIER ELECTRONICS GROUP CO LTD	118,000	21.200	2,501,600.000	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD	475,142	12.980	6,167,343.160	
CHINA MOLYBDENUM CO LTD	306,000	4.530	1,386,180.000	
CHINA CITIC BANK-H	750,800	4.890	3,671,412.000	
SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	64,000	116.000	7,424,000.000	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	99,000	33.250	3,291,750.000	
FOSUN INTERNATIONAL	241,528	16.480	3,980,381.440	

CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP LTD	376,000	3.390	1,274,640.000	
SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD	302,000	5.070	1,531,140.000	
SOHO CHINA LTD	178,000	4.370	777,860.000	
KINGSOFT CORP LTD	80,000	22.100	1,768,000.000	
GCL POLY ENERGY HOLDINGS LTD	1,314,000	1.260	1,655,640.000	
CHINA RAILWAY GROUP LTD	376,000	5.700	2,143,200.000	
BYD ELECTRONIC INTERNATIONAL CO LTD	53,000	18.420	976,260.000	
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION CORP	187,500	8.980	1,683,750.000	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	475,000	6.090	2,892,750.000	
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	233,200	38.200	8,908,240.000	
CHINA EVERGRANDE GROUP	295,000	25.700	7,581,500.000	
CRRC CORP LTD - H	387,450	7.190	2,785,765.500	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDINGS LTD	127,000	16.840	2,138,680.000	
SUN ART RETAIL GROUP LTD	235,500	8.250	1,942,875.000	
SINOPHARM GROUP CO	98,400	30.100	2,961,840.000	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD	205,805	18.380	3,782,695.900	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL BANK	212,000	5.400	1,144,800.000	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP CORP	317,000	5.250	1,664,250.000	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD	71,800	19.360	1,390,048.000	
HUANENG RENEWABLES CORP LTD	472,000	2.400	1,132,800.000	
SIHUAN PHARMACEUTICAL HOLDINGS GROUP LTD	325,000	2.640	858,000.000	
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	184,000	33.800	6,219,200.000	
LONGFOR PROPERTIES CO LTD	139,000	18.440	2,563,160.000	
NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	72,700	52.300	3,802,210.000	
CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	477,380	7.680	3,666,278.400	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD	257,000	3.570	917,490.000	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA	2,359,000	3.590	8,468,810.000	
FAR EAST HORIZON LTD	202,000	6.780	1,369,560.000	
CITIC SECURITIES CO LTD	215,500	16.280	3,508,340.000	
HAITONG SECURITIES CO LTD	306,400	11.260	3,450,064.000	

	PEOPLE'S INSURANCE CO GROUP OF CHINA LTD	670,000	3.840	2,572,800.000	
	SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	49,000	40.500	1,984,500.000	
	CHINA GALAXY SECURITIES CO LTD	335,000	5.840	1,956,400.000	
	HANERGY THIN FILM POWER GROUP	986,000	3.910	3,855,260.000	
	NEXTEER AUTOMOTIVE GROUP LTD	71,000	17.660	1,253,860.000	
	CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS CO LTD	323,000	0.420	135,660.000	
	CHINA CINDA ASSET MANAGEMENT CO LTD	842,000	2.760	2,323,920.000	
	CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS LTD	157,000	17.980	2,822,860.000	
	CHINA VANKE CO LTD-H	110,961	28.300	3,140,196.300	
	CGN POWER CO LTD	780,000	2.060	1,606,800.000	
	FULLSHARE HOLDINGS LTD	677,500	3.130	2,120,575.000	
	GF SECURITIES CO LTD	133,200	15.580	2,075,256.000	
	FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD	51,200	30.500	1,561,600.000	
	HUATAI SECURITIES CO LTD	155,600	15.460	2,405,576.000	
	3SBIO INC	90,000	14.480	1,303,200.000	
	CHINA RESOURCES PHARMACEUTICAL GROUP LTD	147,500	9.610	1,417,475.000	
	CHINA HUARONG ASSET MANAGEMENT CO LTD	850,000	3.480	2,958,000.000	
	MEITU INC	105,000	10.760	1,129,800.000	
香港・ドル	小計	67,745,589		824,578,303.320 (12,005,860,096)	
台湾・ドル	ACER INC	304,532	20.000	6,090,640.000	
	ASUSTEK COMPUTER INC	61,554	270.000	16,619,580.000	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	46,616	104.500	4,871,372.000	
	ADVANCED SEMICONDUCTOR ENGINEERING INC	595,806	38.000	22,640,628.000	
	ASIA CEMENT CORP	167,928	26.450	4,441,695.600	
	TAIWAN BUSINESS BANK	336,171	8.290	2,786,857.590	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMICONDUCTOR CORP	78,000	63.000	4,914,000.000	
	MICRO-STAR INTERNATIONAL CO LTD	57,000	72.200	4,115,400.000	
	CHICONY ELECTRONICS CO LTD	46,543	75.500	3,513,996.500	
	QUANTA COMPUTER INC	235,858	59.800	14,104,308.400	
	HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	90,070	39.600	3,566,772.000	
	EVA AIRWAYS CORP	158,161	15.250	2,411,955.250	

CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	58,760	313.000	18,391,880.000	
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	431,755	16.400	7,080,782.000	
CHINA AIRLINES	232,156	11.800	2,739,440.800	
CHENG SHIN RUBBER INDUSTRY CO	186,169	51.100	9,513,235.900	
CHINA STEEL CORP	1,111,058	24.400	27,109,815.200	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD/TAIWAN	254,146	29.550	7,510,014.300	
ADVANTECH CO LTD	33,889	199.500	6,760,855.500	
COMPAL ELECTRONICS INC	405,304	20.950	8,491,118.800	
DELTA ELECTRONICS INC	170,663	137.000	23,380,831.000	
NANYA TECHNOLOGY CORP	68,000	77.300	5,256,400.000	
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	350,327	104.500	36,609,171.500	
AU OPTRONICS CORP	814,194	12.500	10,177,425.000	
TAIWAN MOBILE CO LTD	159,800	106.500	17,018,700.000	
EVERGREEN MARINE CORP	178,658	16.300	2,912,125.400	
FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	234,824	24.950	5,858,858.800	
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	29,825	131.000	3,907,075.000	
ECLAT TEXTILE CO LTD	18,322	292.000	5,350,024.000	
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	43,285	113.000	4,891,205.000	
FORMOSA PLASTICS CORP	370,633	93.000	34,468,869.000	
FORMOSA TAFFETA CO LTD	65,000	30.200	1,963,000.000	
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE CO	260,594	94.400	24,600,073.600	
GIANT MANUFACTURING	30,151	150.500	4,537,725.500	
MEDIATEK INC	135,507	296.000	40,110,072.000	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD	595,936	50.200	29,915,987.200	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	700,313	16.500	11,555,164.500	
HOTAI MOTOR CO LTD	25,000	341.500	8,537,500.000	
FAR EASTONE TELECOMMUNICATIONS CO LTD	150,000	70.900	10,635,000.000	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	850,141	13.850	11,774,452.850	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	734,920	53.500	39,318,220.000	
CHINA DEPT FINANCIAL HOLDING	1,278,403	9.490	12,132,044.470	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO LTD	854,028	18.700	15,970,323.600	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	1,414,532	93.600	132,400,195.200	

MEGA FINANCIAL HOLDING CO LTD	967,495	23.350	22,591,008.250	
LARGAN PRECISION CO LTD	9,220	4,370.000	40,291,400.000	
TAISHIN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	769,977	13.550	10,433,188.350	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING CO	813,724	10.100	8,218,612.400	
INVENTEC CO LTD	254,005	22.150	5,626,210.750	
HTC CORPORATION	56,832	65.000	3,694,080.000	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	210,845	37.250	7,853,976.250	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	810,533	9.360	7,586,588.880	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,566,048	20.200	31,634,169.600	
MACRONIX INTERNATIONAL	158,000	39.850	6,296,300.000	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO LTD	882,327	19.150	16,896,562.050	
POWERTECH TECHNOLOGY INC	68,560	87.900	6,026,424.000	
NAN YA PLASTICS CORP	425,828	74.500	31,724,186.000	
WISTRON CORP	259,301	22.100	5,730,552.100	
POU CHEN CORP	210,990	37.150	7,838,278.500	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CORP	427,297	65.100	27,817,034.700	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	56,392	275.500	15,535,996.000	
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	119,480	108.000	12,903,840.000	
PHISON ELECTRONICS CORP	12,658	310.000	3,923,980.000	
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	90,656	29.950	2,715,147.200	
RUENTEX INDUSTRIES LTD	47,715	47.050	2,244,990.750	
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	88,588	85.400	7,565,415.200	
SILICONWARE PRECISION INDS	191,743	50.100	9,606,324.300	
STANDARD FOODS CORP	35,639	73.000	2,601,647.000	
SYNNEX TECHNOLOGY INTERNATIONAL CORP	144,899	40.300	5,839,429.700	
TAIWAN CEMENT CORP	327,874	33.800	11,082,141.200	
TECO ELECTRIC AND MACHINERY CO LTD	118,000	28.700	3,386,600.000	
TAIWAN SEMICONDUCTOR	2,239,083	227.000	508,271,841.000	
UNITED MICROELECTRONICS CORP	1,122,525	14.650	16,444,991.250	
WINBOND ELECTRONICS CORP	254,000	24.750	6,286,500.000	
YAGEO CORP	17,000	310.000	5,270,000.000	
TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	142,000	23.250	3,301,500.000	
INNOLUX CORPORATION	821,345	12.300	10,102,543.500	
WPG HOLDINGS CO LTD	156,526	39.950	6,253,213.700	

	HIWIN TECHNOLOGIES CORP	20,560	315.000	6,476,400.000	
	TAIMED BIOLOGICS INC	18,000	172.500	3,105,000.000	
	PEGATRON CORP	189,554	68.600	13,003,404.400	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	10,000	493.000	4,930,000.000	
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	29,000	286.000	8,294,000.000	
	CHAILEASE HOLDING CO LTD	112,076	82.600	9,257,477.600	
	ASIA PACIFIC TELECOM CO LTD	188,000	9.640	1,812,320.000	
	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING LTD	48,385	68.900	3,333,726.500	
	TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL HOLDING	732,828	16.450	12,055,020.600	
	GLOBALWAFERS CO LTD	21,000	396.500	8,326,500.000	
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	15,000	283.000	4,245,000.000	
	GENERAL INTERFACE SOLUTION HOLDING LTD	18,000	212.500	3,825,000.000	
台湾・ドル 小計		29,704,040		1,623,213,313.190 (6,151,978,457)	
南アフリカ・ランド	BIDVEST GROUP LTD	31,400	197.370	6,197,418.000	
	TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	43,580	83.900	3,656,362.000	
	DISCOVERY LTD	34,030	155.510	5,292,005.300	
	REDEFINE PROPERTIES LTD	487,300	10.070	4,907,111.000	
	GOLD FIELDS LTD	85,000	51.160	4,348,600.000	
	REMGRO LTD	44,220	212.070	9,377,735.400	
	THE FOSCHINI GROUP LTD	21,500	158.860	3,415,490.000	
	MMI HOLDINGS LTD	82,706	19.490	1,611,939.940	
	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	207,700	25.500	5,296,350.000	
	EXXARO RESOURCES LTD	19,985	149.710	2,991,954.350	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	3,850	933.030	3,592,165.500	
	LIBERTY HOLDINGS LTD	14,449	113.450	1,639,239.050	
	MTN GROUP LTD	151,513	128.380	19,451,238.940	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	34,938	124.350	4,344,540.300	
	TELKOM SA SOC LTD	20,227	48.500	981,009.500	
	FIRSTRAND LTD	299,334	55.650	16,657,937.100	
	PSG GROUP LTD	8,084	249.000	2,012,916.000	
	NASPERS LTD	39,745	3,619.200	143,845,104.000	
	CORONATION FUND MANAGERS LTD	19,000	68.820	1,307,580.000	
	NEDBANK GROUP LTD	21,600	227.130	4,906,008.000	
NETCARE LTD	105,400	22.530	2,374,662.000		
PICK'N PAY STORES LTD	30,212	66.250	2,001,545.000		
RMB HOLDINGS LTD	53,867	65.420	3,523,979.140		
ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	6,200	349.430	2,166,466.000		

SAPPI LTD	53,960	98.280	5,303,188.800	
SASOL LTD	49,590	418.520	20,754,406.800	
SHOPRITE HOLDINGS LTD	39,325	216.340	8,507,570.500	
MR PRICE GROUP LTD	23,720	211.500	5,016,780.000	
BRAIT SE	37,060	39.100	1,449,046.000	
STANDARD BANK GROUP LTD	115,586	176.420	20,391,682.120	
SPAR GROUP LTD/THE	13,937	191.860	2,673,952.820	
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	93,400	57.800	5,398,520.000	
IMPERIAL HOLDINGS LTD	13,278	230.000	3,053,940.000	
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LTD	34,131	287.620	9,816,758.220	
BARCLAYS AFRICA GROUP LTD	59,024	156.990	9,266,177.760	
TIGER BRANDS LTD	15,100	425.830	6,430,033.000	
SANLAM LTD	121,400	78.080	9,478,912.000	
INVESTEC LTD	30,200	85.000	2,567,000.000	
KUMBA IRON ORE LTD	5,327	350.000	1,864,450.000	
PIONEER FOODS LTD	10,707	126.910	1,358,825.370	
MONDI LTD	11,520	307.540	3,542,860.800	
LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDINGS LTD	130,000	26.570	3,454,100.000	
RMI HOLDINGS	63,840	41.500	2,649,360.000	
VODACOM GROUP PTY LTD	58,000	140.590	8,154,220.000	
SIBANYE GOLD LTD	172,000	16.800	2,889,600.000	
NEPI ROCKCASTLE PLC	36,000	210.940	7,593,840.000	
FORTRESS REIT LTD-A	102,950	17.380	1,789,271.000	
FORTRESS REIT LTD-B	57,876	40.400	2,338,190.400	
STEINHOFF INTERNATIONAL HOLDINGS NV	267,866	6.000	1,607,196.000	
BID CORP LTD	32,520	306.270	9,959,900.400	
南アフリカ・ランド 小計	3,514,157		413,209,138.510 (3,437,900,032)	
合計	194,373,979		53,518,112,088 (53,518,112,088)	

(2) 株式以外の有価証券

平成29年12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	1,291,375.000	18,324,611.250	
		FOMENTO ECONOMICO MEXICANO SAB DE CV	172,500.000	30,480,750.000	
	メキシコ・ペソ	小計	1,463,875.000	48,805,361.250 (292,832,167)	
投資信託受益証券	合計		1,463,875	292,832,167 (292,832,167)	
投資証券	トルコ・リラ	EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATIRIM	162,734.000	424,735.740	
	トルコ・リラ	小計	162,734.000	424,735.740 (12,589,167)	
	メキシコ・ペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	245,200.000	7,083,828.000	
	メキシコ・ペソ	小計	245,200.000	7,083,828.000 (42,502,968)	
	南アフリカ・ランド	HYPROP INVESTMENTS LTD	25,100.000	2,644,787.000	
		RESILIENT REIT LTD	28,600.000	4,004,000.000	
	南アフリカ・ランド	小計	53,700.000	6,648,787.000 (55,317,908)	
投資証券	合計		461,634	110,410,043 (110,410,043)	
合計				403,242,210 (403,242,210)	

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 38銘柄	11.00%	-%	-%	11.75%
アラブ首長国連邦・ディ ルハム	株式 10銘柄	0.56%	-%	-%	0.59%
インド・ルピー	株式 79銘柄	8.27%	-%	-%	8.83%
インドネシア・ルピア	株式 29銘柄	2.07%	-%	-%	2.21%
カタール・リアル	株式 12銘柄	0.49%	-%	-%	0.52%
コロンビア・ペソ	株式 9銘柄	0.36%	-%	-%	0.39%
タイ・バーツ	株式 35銘柄	2.14%	-%	-%	2.29%
チェコ・コルナ	株式 4銘柄	0.16%	-%	-%	0.18%
チリ・ペソ	株式 19銘柄	1.02%	-%	-%	1.09%
トルコ・リラ	株式 24銘柄 投資証券 1銘柄	0.95% -%	-% -%	-% 0.02%	1.04%
ハンガリー・フォリント	株式 3銘柄	0.30%	-%	-%	0.32%
パキスタン・ルピー	株式 5銘柄	0.07%	-%	-%	0.07%
フィリピン・ペソ	株式 23銘柄	1.05%	-%	-%	1.12%
ブラジル・レアル	株式 53銘柄	6.39%	-%	-%	6.83%
ポーランド・ズロチ	株式 24銘柄	1.24%	-%	-%	1.33%
マレーシア・リンギット	株式 46銘柄	2.17%	-%	-%	2.31%
メキシコ・ペソ	株式 23銘柄 投資信託 受益証券 2銘柄 投資証券 1銘柄	2.26% -% -%	-% 0.51% -%	-% -% 0.07%	3.03%
ユーロ	株式 9銘柄	0.28%	-%	-%	0.30%
韓国・ウォン	株式 114銘柄	14.64%	-%	-%	15.63%
香港・ドル	株式 138銘柄	20.84%	-%	-%	22.27%
台湾・ドル	株式 90銘柄	10.68%	-%	-%	11.41%
南アフリカ・ランド	株式 50銘柄 投資証券 2銘柄	5.97% -%	-% -%	-% 0.10%	6.48%

(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29年6月12日現在	平成29年12月11日現在
資産の部			
流動資産			
預金		3,289,639,610	2,269,619,084
コール・ローン		48,007,461	621,545,041
国債証券		88,511,415,568	98,674,949,073
派生商品評価勘定		-	912,500
未収利息		1,085,711,853	1,286,225,032
前払費用		198,637,112	90,365,806
流動資産合計		93,133,411,604	102,943,616,536
資産合計		93,133,411,604	102,943,616,536
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		-	36,000
未払金		776,195,568	510,728,894
未払解約金		10,205,000	310,721,000
流動負債合計		786,400,568	821,485,894
負債合計		786,400,568	821,485,894
純資産の部			
元本等			
元本	1	50,181,058,353	52,793,954,392
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		42,165,952,683	49,328,176,250
元本等合計		92,347,011,036	102,122,130,642
純資産合計		92,347,011,036	102,122,130,642
負債純資産合計		93,133,411,604	102,943,616,536

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	平成29年6月12日現在	平成29年12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	33,803,931,113円 22,059,331,731円 5,682,204,491円	50,181,058,353円 12,567,031,436円 9,954,135,397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）	135,013,697円	218,918,087円
たわらノーロード バランス （8資産均等型）	- 円	10,516,615円
たわらノーロード バランス （堅実型）	- 円	42,121円
たわらノーロード バランス （標準型）	- 円	31,722円
たわらノーロード バランス （積極型）	- 円	15,598円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	78,581,078円	75,944,530円
D I A M D C 8資産バランス ファンド（新興国10）	23,892,314円	27,143,199円
D I A M D C 8資産バランス ファンド（新興国20）	68,142,189円	88,034,415円
D I A M D C 8資産バランス ファンド（新興国30）	146,662,184円	190,593,307円
投資のソムリエ	3,649,860,484円	5,101,391,750円
クルーズコントロール	1,367,148,340円	1,130,388,722円

投資のソムリエ<DC年金>	171,577,811円	316,404,470円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	80,865,102円	102,815,703円
クルーズコントロール<DC年金>	450,343円	377,694円
DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)	6,785,171円	5,474,325円
DIAMコア資産設計ファンド(積極型)	17,836,279円	14,622,181円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	82,546,928円	123,204,932円
ダイナミック・ナビゲーション	172,264円	188,968円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	790,091,323円	1,608,344,955円
ワールドアセットバランス(基本コース)	309,828,145円	678,833,368円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	546,535,858円	2,451,790,359円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	-円	802,092円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	-円	802,092円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	-円	537,469円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	-円	685,510円
エマージング債券リスク抑制型(適格機関投資家限定)	16,072,392,000円	12,745,371,625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)	3,415,454,556円	3,267,576,998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)	7,657,116,920円	7,407,522,362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)	4,888,777,380円	4,822,410,724円
DIAMグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンド(適格機関投資家限定)	3,488,959,894円	4,498,750,018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)	4,438,908,008円	4,678,979,067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)	2,743,460,085円	3,225,439,414円
計	50,181,058,353円	52,793,954,392円
2. 受益権の総数	50,181,058,353口	52,793,954,392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1月18日 至 平成29年6月12日	自 平成29年6月13日 至 平成29年12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29年6月12日現在	平成29年12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 該当事項はありませぬ。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成29年6月12日現在	平成29年12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	882,107,212	446,975,085
合計	882,107,212	446,975,085

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成29年4月19日から平成29年6月12日まで及び平成29年4月19日から平成29年12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29年6月12日 現在				平成29年12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								
買 建	-	-	-	-	624,113,500	-	624,990,000	876,500
アメリカ・ドル	-	-	-	-	624,113,500	-	624,990,000	876,500
合計	-	-	-	-	624,113,500	-	624,990,000	876,500

(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29年6月12日現在	平成29年12月11日現在
1口当たり純資産額	1.8403円	1.9344円
(1万口当たり純資産額)	(18,403円)	(19,344円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

平成29年12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	7,400,000.000	7,137,300.000	
		BRAZIL 4.25 01/07/25	14,100,000.000	14,385,525.000	
		BRAZIL 4.875 01/22/21	8,800,000.000	9,345,600.000	
		BRAZIL 5.0 01/27/45	11,000,000.000	10,356,500.000	
		BRAZIL 5.625 01/07/41	8,300,000.000	8,536,550.000	
		BRAZIL 5.625 02/21/47	4,000,000.000	4,118,000.000	
		BRAZIL 6.0 04/07/26	7,000,000.000	7,840,000.000	
		BRAZIL 7.125 01/20/37	6,700,000.000	8,140,500.000	
		BRAZIL 8.25 01/20/34	5,400,000.000	7,113,960.000	
		BRAZIL 8.75 02/04/25	2,600,000.000	3,363,360.000	
		BRAZIL 8.875 10/14/19	3,800,000.000	4,259,800.000	
		COLOMBIA 2.625 03/15/23	3,300,000.000	3,227,796.000	
		COLOMBIA 3.875 04/25/27	8,000,000.000	8,133,200.000	
		COLOMBIA 4.0 02/26/24	6,900,000.000	7,174,275.000	
		COLOMBIA 4.375 07/12/21	7,000,000.000	7,402,500.000	
		COLOMBIA 4.5 01/28/26	5,000,000.000	5,354,350.000	
		COLOMBIA 5.0 06/15/45	12,600,000.000	13,308,750.000	
		COLOMBIA 5.625 02/26/44	7,600,000.000	8,702,000.000	
		COLOMBIA 6.125 01/18/41	8,000,000.000	9,656,000.000	
		COLOMBIA 7.375 03/18/19	7,900,000.000	8,409,550.000	
		COLOMBIA 7.375 09/18/37	6,000,000.000	8,094,000.000	
		COLOMBIA 8.125 05/21/24	3,100,000.000	3,937,465.000	
		CROATIA 5.5 04/04/23	4,400,000.000	4,860,680.000	
		CROATIA 6.0 01/26/24	4,200,000.000	4,796,022.000	
		CROATIA 6.375 03/24/21	3,300,000.000	3,636,270.000	
		CROATIA 6.625 07/14/20	5,200,000.000	5,678,660.000	
		CROATIA 6.75 11/05/19	6,600,000.000	7,110,312.000	
		HUNGARY 4.0 03/25/19	3,800,000.000	3,896,216.000	
		HUNGARY 5.375 02/21/23	4,900,000.000	5,478,151.000	
		HUNGARY 5.375 03/25/24	3,600,000.000	4,087,116.000	
		HUNGARY 5.75 11/22/23	8,200,000.000	9,418,110.000	
		HUNGARY 6.25 01/29/20	4,900,000.000	5,287,982.000	
		HUNGARY 6.375 03/29/21	8,000,000.000	8,934,880.000	
		HUNGARY 7.625 03/29/41	3,400,000.000	5,321,034.000	
INDONESIA 11.625 03/04/19		7,400,000.000	8,253,072.000		
INDONESIA 3.375 04/15/23		4,500,000.000	4,557,375.000		
INDONESIA 3.75 04/25/22		6,600,000.000	6,811,728.000		
INDONESIA 4.125 01/15/25		8,200,000.000	8,536,200.000		
INDONESIA 4.35 01/08/27		4,000,000.000	4,229,120.000		

INDONESIA 4.625 04/15/43	4,000,000.000	4,139,560.000	
INDONESIA 4.75 01/08/26	6,600,000.000	7,172,748.000	
INDONESIA 4.875 05/05/21	6,500,000.000	6,949,670.000	
INDONESIA 5.125 01/15/45	5,200,000.000	5,720,624.000	
INDONESIA 5.25 01/08/47	4,000,000.000	4,493,520.000	
INDONESIA 5.25 01/17/42	5,900,000.000	6,605,758.000	
INDONESIA 5.375 10/17/23	1,500,000.000	1,675,395.000	
INDONESIA 5.875 01/15/24	7,000,000.000	7,980,560.000	
INDONESIA 5.95 01/08/46	3,200,000.000	3,923,712.000	
INDONESIA 6.75 01/15/44	5,300,000.000	7,016,670.000	
INDONESIA 7.75 01/17/38	5,300,000.000	7,556,687.000	
PANAMA 3.75 03/16/25	5,000,000.000	5,225,000.000	
PANAMA 3.875 03/17/28	4,200,000.000	4,404,750.000	
PANAMA 5.2 01/30/20	6,400,000.000	6,792,000.000	
PANAMA 6.7 01/26/36	8,200,000.000	10,923,220.000	
PANAMA 7.125 01/29/26	4,800,000.000	6,192,000.000	
PANAMA 9.375 04/01/29	4,700,000.000	7,138,125.000	
PERU 4.125 08/25/27	5,600,000.000	6,137,600.000	
PERU 5.625 11/18/50	10,800,000.000	13,814,280.000	
PERU 6.55 03/14/37	5,200,000.000	7,036,640.000	
PERU 7.35 07/21/25	9,000,000.000	11,715,300.000	
PHILIPPINES 3.7 03/01/41	5,200,000.000	5,187,260.000	
PHILIPPINES 3.95 01/20/40	5,200,000.000	5,371,288.000	
PHILIPPINES 4.0 01/15/21	5,600,000.000	5,877,200.000	
PHILIPPINES 4.2 01/21/24	4,200,000.000	4,569,138.000	
PHILIPPINES 5.0 01/13/37	3,800,000.000	4,498,288.000	
PHILIPPINES 5.5 03/30/26	3,000,000.000	3,554,550.000	
PHILIPPINES 6.375 01/15/32	3,000,000.000	3,920,400.000	
PHILIPPINES 6.375 10/23/34	5,800,000.000	7,757,558.000	
PHILIPPINES 6.5 01/20/20	1,800,000.000	1,967,166.000	
PHILIPPINES 7.75 01/14/31	5,300,000.000	7,560,927.000	
PHILIPPINES 8.375 06/17/19	4,300,000.000	4,719,250.000	
PHILIPPINES 9.5 02/02/30	5,800,000.000	9,180,704.000	
ROMANIA 4.375 08/22/23	5,600,000.000	6,019,216.000	
ROMANIA 4.875 01/22/24	2,400,000.000	2,652,000.000	
ROMANIA 6.125 01/22/44	2,800,000.000	3,628,184.000	
ROMANIA 6.75 02/07/22	7,300,000.000	8,407,556.000	
RUSSIA FOREIGN BOND 5.0 04/29/20	10,400,000.000	10,959,624.000	
RUSSIAN FEDERATION 03/31/30	22,467,500.000	25,961,645.600	
RUSSIAN FEDERATION 3.5 01/16/19	8,000,000.000	8,081,040.000	

RUSSIAN FEDERATION 4.5 04/04/22	6,600,000.000	7,009,464.000	
RUSSIAN FEDERATION 4.75 05/27/26	10,000,000.000	10,612,500.000	
RUSSIAN FEDERATION 4.875 09/16/23	9,200,000.000	9,999,020.000	
RUSSIAN FEDERATION 5.625 04/04/42	9,600,000.000	10,674,816.000	
RUSSIAN FEDERATION 5.875 09/16/43	3,600,000.000	4,150,692.000	
SOUTH AFRICA 4.3 10/12/28	6,200,000.000	5,851,374.000	
SOUTH AFRICA 4.665 01/17/24	4,500,000.000	4,567,950.000	
SOUTH AFRICA 4.875 04/14/26	3,600,000.000	3,617,460.000	
SOUTH AFRICA 5.0 10/12/46	2,400,000.000	2,178,000.000	
SOUTH AFRICA 5.375 07/24/44	2,600,000.000	2,496,832.000	
SOUTH AFRICA 5.5 03/09/20	5,000,000.000	5,253,550.000	
SOUTH AFRICA 5.875 05/30/22	2,600,000.000	2,835,664.000	
SOUTH AFRICA 5.875 09/16/25	6,000,000.000	6,471,540.000	
SOUTH AFRICA 6.875 05/27/19	6,300,000.000	6,661,305.000	
TURKEY 11.875 01/15/30	4,300,000.000	6,711,870.000	
TURKEY 3.25 03/23/23	4,100,000.000	3,870,769.000	
TURKEY 4.25 04/14/26	4,400,000.000	4,176,040.000	
TURKEY 4.875 04/16/43	8,500,000.000	7,379,275.000	
TURKEY 4.875 10/09/26	9,600,000.000	9,439,392.000	
TURKEY 5.125 03/25/22	4,700,000.000	4,854,865.000	
TURKEY 5.625 03/30/21	6,300,000.000	6,628,608.000	
TURKEY 5.75 03/22/24	8,100,000.000	8,540,721.000	
TURKEY 5.75 05/11/47	8,400,000.000	8,097,348.000	
TURKEY 6.0 01/14/41	8,500,000.000	8,499,490.000	
TURKEY 6.0 03/25/27	9,400,000.000	9,940,500.000	
TURKEY 6.25 09/26/22	5,500,000.000	5,953,255.000	
TURKEY 6.625 02/17/45	7,900,000.000	8,440,518.000	
TURKEY 6.75 05/30/40	6,100,000.000	6,661,566.000	
TURKEY 7.0 03/11/19	6,100,000.000	6,384,260.000	
TURKEY 7.0 06/05/20	5,700,000.000	6,153,150.000	
TURKEY 7.375 02/05/25	8,500,000.000	9,702,750.000	
TURKEY 7.5 11/07/19	5,400,000.000	5,807,592.000	
UNITED MEXICAN STATES 3.5 01/21/21	4,600,000.000	4,816,200.000	
UNITED MEXICAN STATES 3.6 01/30/25	7,400,000.000	7,570,200.000	

	UNITED MEXICAN STATES 3.625 03/15/22	8,900,000.000	9,304,950.000	
	UNITED MEXICAN STATES 4.0 10/02/23	10,300,000.000	10,856,200.000	
	UNITED MEXICAN STATES 4.125 01/21/26	9,000,000.000	9,438,750.000	
	UNITED MEXICAN STATES 4.15 03/28/27	9,200,000.000	9,597,900.000	
	UNITED MEXICAN STATES 4.35 01/15/47	5,800,000.000	5,591,200.000	
	UNITED MEXICAN STATES 4.6 01/23/46	8,800,000.000	8,747,200.000	
	UNITED MEXICAN STATES 4.75 03/08/44	13,800,000.000	14,013,900.000	
	UNITED MEXICAN STATES 5.55 01/21/45	9,000,000.000	10,217,250.000	
	UNITED MEXICAN STATES 5.75 10/12/2110	7,200,000.000	7,693,200.000	
	UNITED MEXICAN STATES 6.05 01/11/40	9,900,000.000	11,773,575.000	
	UNITED MEXICAN STATES 6.75 09/27/34	5,800,000.000	7,615,980.000	
	アメリカ・ドル 小計	785,467,500.000 (89,268,381,375)	868,235,363.600 (98,674,949,073)	
国債証券 合計		89,268,381,375 (89,268,381,375)	98,674,949,073 (98,674,949,073)	
合計		89,268,381,375 (89,268,381,375)	98,674,949,073 (98,674,949,073)	

(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 124銘柄	96.62%	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】

ワールドアセットバランス（基本コース）

平成29年12月29日現在

資産総額	14,414,521,156円
負債総額	106,994,630円
純資産総額（ - ）	14,307,526,526円
発行済数量	13,522,512,348口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0581円

ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）

平成29年12月29日現在

資産総額	52,080,240,439円
負債総額	249,873,637円
純資産総額（ - ）	51,830,366,802円
発行済数量	48,974,293,493口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0583円

（参考）

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成29年12月29日現在

資産総額	307,467,017,512円
負債総額	1,096,373,561円
純資産総額（ - ）	306,370,643,951円
発行済数量	87,213,678,848口
1口当たり純資産額（ / ）	3.5129円

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成29年12月29日現在

資産総額	55,845,297,826円
負債総額	414,191,415円
純資産総額（ - ）	55,431,106,411円
発行済数量	44,518,629,224口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2451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29年12月29日現在

資産総額	255,390,788,042円
負債総額	2,972,608,411円
純資産総額（ - ）	252,418,179,631円
発行済数量	188,600,999,244口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3384円

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

平成29年12月29日現在

資産総額	61,325,797,077円
負債総額	18,811,497円
純資産総額(-)	61,306,985,580円
発行済数量	48,050,079,813口
1口当たり純資産額(/)	1.2759円

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

平成29年12月29日現在

資産総額	103,522,395,147円
負債総額	83,942,900円
純資産総額(-)	103,438,452,247円
発行済数量	53,659,071,707口
1口当たり純資産額(/)	1.9277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29年12月29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29年12月29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29年12月29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	1,293,117,020,606
追加型株式投資信託	855	12,654,793,140,365
単位型公社債投資信託	56	279,714,647,698
単位型株式投資信託	136	918,568,212,117
合計	1,085	15,146,193,020,786

3【委託会社等の経理状況】

- 1．委託会社であるアセットマネジメントOne株式会社（以下「委託会社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。
また、中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）、ならびに同規則第38条及び第57条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。
- 2．財務諸表及び中間財務諸表の金額は、千円未満の端数を切り捨てて記載しております。
- 3．委託会社は、第32期事業年度（自平成28年4月1日至平成29年3月31日）の財務諸表について、新日本有限責任監査法人の監査を受け、第33期中間会計期間（自平成29年4月1日至平成29年9月30日）の中間財務諸表について、新日本有限責任監査法人の中間監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

	第31期 (平成28年3月31日現在)	第32期 (平成29年3月31日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金	12,951,736	27,972,477
金銭の信託	13,094,914	12,366,219
有価証券	-	297,560
未収委託者報酬	4,460,404	10,164,041
未収運用受託報酬	1,859,778	7,250,239
未収投資助言報酬	277,603	316,414
未収収益	205,097	52,278
前払費用	44,951	533,411
繰延税金資産	341,078	678,104
その他	40,689	445,717
流動資産計	33,276,255	60,076,462
固定資産		
有形固定資産	658,607	1,900,343
建物	1 29,219	1 1,243,812
車両運搬具	1 549	1 -
器具備品	1 184,683	1 656,235
建設仮勘定	444,155	295
無形固定資産	1,706,201	1,614,084
商標権	7	5
ソフトウェア	1,645,861	1,511,558
ソフトウェア仮勘定	53,036	98,483
電話加入権	7,148	3,934
電信電話専用施設利用権	146	103
投資その他の資産	6,497,772	10,055,336
投資有価証券	458,701	3,265,786
関係会社株式	3,229,196	3,306,296
長期差入保証金	2,040,945	1,800,827
前払年金費用	-	686,322
繰延税金資産	679,092	893,887
その他	89,835	102,215
固定資産計	8,862,580	13,569,764
資産合計	42,138,836	73,646,227

（単位：千円）

	第31期 （平成28年3月31日現在）	第32期 （平成29年3月31日現在）
（負債の部）		
流動負債		
預り金	966,681	1,169,128
未払金	2,055,332	4,745,195
未払収益分配金	-	1,027
未払償還金	49,873	57,332
未払手数料	1,744,274	4,062,695
その他未払金	261,185	624,140
未払費用	3,076,566	7,030,589
未払法人税等	1,223,957	1,915,556
未払消費税等	352,820	891,476
賞与引当金	728,769	1,432,264
役員賞与引当金	-	27,495
流動負債計	8,404,128	17,211,706
固定負債		
退職給付引当金	997,396	1,305,273
役員退職慰労引当金	154,535	-
時効後支払損引当金	-	216,466
本社移転費用引当金	-	942,315
固定負債計	1,151,932	2,464,055
負債合計	9,556,060	19,675,761
（純資産の部）		
株主資本		
資本金	2,000,000	2,000,000
資本剰余金	2,428,478	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
利益剰余金	28,000,340	31,899,643
利益準備金	123,293	123,293
その他利益剰余金	27,877,047	31,776,350
別途積立金	22,030,000	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	5,347,047	6,696,350
株主資本計	32,428,818	53,452,601
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	153,956	517,864
評価・換算差額等計	153,956	517,864
純資産合計	32,582,775	53,970,465
負債・純資産合計	42,138,836	73,646,227

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	第31期 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)		第32期 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	
	営業収益			
委託者報酬	30,188,445		56,355,754	
運用受託報酬	7,595,678		12,834,241	
投資助言報酬	993,027		1,002,482	
その他営業収益	724,211		378,715	
営業収益計		39,501,363		70,571,194
営業費用				
支払手数料	12,946,176		24,957,038	
広告宣伝費	468,931		838,356	
公告費	258		991	
調査費	7,616,390		15,105,578	
調査費	4,969,812		7,780,474	
委託調査費	2,646,578		7,325,104	
委託計算費	412,257		891,379	
営業雑経費	548,183		1,102,921	
通信費	34,855		51,523	
印刷費	436,756		926,453	
協会費	23,698		37,471	
諸会費	40		74	
支払販売手数料	52,833		87,399	
営業費用計		21,992,198		42,896,265
一般管理費				
給料	5,382,757		8,517,089	
役員報酬	242,446		220,145	
給料・手当	4,431,015		7,485,027	
賞与	709,295		811,916	
交際費	43,975		66,813	
寄付金	2,628		13,467	
旅費交通費	254,276		297,237	
租税公課	180,892		430,779	
不動産賃借料	1,128,367		1,961,686	
退職給付費用	226,460		358,960	
固定資産減価償却費	902,248		825,593	
福利厚生費	36,173		39,792	
修繕費	31,617		27,435	
賞与引当金繰入額	728,769		1,432,264	
役員賞与引当金繰入額	-		27,495	
役員退職慰労引当金繰入額	49,320		-	
役員退職慰労金	5,250		63,072	
機器リース料	140		210	
事務委託費	251,913		1,530,113	
事務用消耗品費	70,839		127,265	
器具備品費	14,182		271,658	
諸経費	214,532		129,981	
一般管理費計		9,524,346		16,120,918
営業利益		7,984,819		11,554,010

(単位:千円)

	第31期 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)		第32期 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	
営業外収益				
受取利息		2,079		537
受取配当金		25,274		51,036
時効成立分配金・償還金		-		103
為替差益		3,996		7,025
投資信託解約益		-		2
雑収入	1	6,693	1	18,213
営業外収益計		38,044		76,918
営業外費用				
投資信託解約損		-		31,945
投資信託償還損		-		47,201
金銭の信託運用損		305,368		552,635
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		305,368		841,031
経常利益		7,717,494		10,789,897
特別利益				
固定資産売却益	2	-	2	2,348
投資有価証券売却益		3,377		-
貸倒引当金戻入益		-		8,883
訴訟損失引当金戻入益		-		21,677
その他特別利益		-		746
特別利益計		3,377		33,655
特別損失				
固定資産除却損	3	624	3	23,600
固定資産売却損	4	2,653	4	10,323
投資有価証券評価損		-		12,085
ゴルフ会員権評価損		6,307		4,832
訴訟和解金		-		30,000
本社移転費用	5	-	5	1,511,622
特別損失計		9,584		1,592,463
税引前当期純利益		7,711,286		9,231,089
法人税、住民税及び事業税		2,557,305		2,965,061
法人税等調整額		27,424		177,275
法人税等合計		2,584,730		2,787,786
当期純利益		5,126,556		6,443,302

(3) 【株主資本等変動計算書】

第31期（自平成27年4月1日至平成28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	19,480,000	300,000	200,000	5,314,491
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									5,126,556
株主資本以外 の項目の当期 変動額(純額)									
当期変動額合計	-	-	-	-	-	2,550,000	-	-	32,556
当期末残高	2,000,000	2,428,478	-	2,428,478	123,293	22,030,000	300,000	200,000	5,347,047

	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	25,417,784	29,846,262	252,905	252,905	30,099,168
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	5,126,556	5,126,556			5,126,556
株主資本以外 の項目の当期 変動額(純額)			98,949	98,949	98,949
当期変動額合計	2,582,556	2,582,556	98,949	98,949	2,483,607
当期末残高	28,000,340	32,428,818	153,956	153,956	32,582,775

第32期(自平成28年4月1日至平成29年3月31日)

(単位:千円)

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

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

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 定率法によっております。 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 定額法によっております。 なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。</p>
4. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、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、退職一時金制度及び確定給付型企业年金制度（キャッシュバランス型）について、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき計上しております。 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。 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 過去勤務費用については、その発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年または10年）による定額法により按分した額を費用処理しております。 数理計算上の差異については、各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年または10年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌事業年度から費用処理しております。 なお、一部の確定給付企業年金制度については、退職給付引当金及び退職給付費用の計算に、退職給付に係る期末自己都合要支給額を退職給付債務とする方法を用いた簡便法を適用しております。</p> <p>(4) 役員退職慰労引当金は、役員の退職慰労金の支払に備えるため、内規に基づく期末要支給額を計上しております。</p> <p>(5) 時効後支払損引当金は、時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。</p> <p>(6) 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。 なお、本社移転費用引当金繰入額は、本社移転費用に含めて表示しております。</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。

会計方針の変更

第32期（自平成28年4月1日 至平成29年3月31日）

法人税法の改正に伴い、「平成28年度税制改正に係る減価償却方法の変更に関する実務上の取扱い」（実務対応報告第32号 平成28年6月17日）を当事業年度に適用し、平成28年4月1日以後に取得した建物附属設備に係る減価償却方法を定率法から定額法に変更しております。

この結果、当事業年度の営業利益、経常利益及び税引前当期純利益はそれぞれ42,532千円増加しております。

追加情報

第32期（自平成28年4月1日 至平成29年3月31日）

1. 「繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第26号 平成28年3月28日）を当事業年度から適用しております。

2. 当社は、平成28年9月7日開催の臨時株主総会において、退任となる取締役及び監査役に対して、在任中の労に報いるため、当社所定の基準による相当額の範囲内で役員退職慰労金を支給することを決議しました。

これに伴い、当事業年度末日までに217,608千円を支給し、役員退職慰労引当金全額を取り崩しております。

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31期 （平成28年3月31日現在）	第32期 （平成29年3月31日現在）
建物	767,802	53,098
車両運搬具	4,374	-
器具備品	562,853	734,064

（損益計算書関係）

1. 関係会社項目

各科目に含まれている関係会社に対する営業外収益は、次のとおりであります。

（千円）

	第31期 （自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）	第32期 （自平成28年4月1日 至平成29年3月31日）
雑収入	4,715	8,183

2. 固定資産売却益の内訳

（千円）

	第31期 （自平成27年4月1日 至平成28年3月31日）	第32期 （自平成28年4月1日 至平成29年3月31日）
建物	-	546
車両運搬具	-	696
器具備品	-	1,104

3. 固定資産除却損の内訳

(千円)

	第31期 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)	第32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)
器具備品	182	4,727
ソフトウェア	442	2,821
電話加入権	-	16,052

4. 固定資産売却損の内訳

(千円)

	第31期 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)	第32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)
建物	-	543
器具備品	2,653	9,779

5. 本社移転費用の内訳

(千円)

	第31期 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)	第32期 (自平成28年4月1日 至平成29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31期(自平成27年4月1日 至平成28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	-	-	24,000
合計	24,000	-	-	24,000

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27年6月29日 定時株主総会	普通株式	2,544,000	106,000	平成27年3月31日	平成27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
平成28年6月29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28年6月29日 定時株主総会	普通 株式	利益剰 余金	2,544,000	106,000	平成28年3月31日	平成28年6月30日

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
平成29年6月21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					

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

有価証券及び投資有価証券は、主に其他有価証券（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31期（平成28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	12,951,736	12,951,736	-
(2) 金銭の信託	13,094,914	13,094,914	-
(3) 未収委託者報酬	4,460,404	4,460,404	-
(4) 未収運用受託報酬	1,859,778	1,859,778	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	381,005	381,005	-
資産計	32,747,840	32,747,840	-
(1) 未払手数料	1,744,274	1,744,274	-
負債計	1,744,274	1,744,274	-

第32期（平成29年3月31日現在）

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

(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31期 (平成28年3月31日現在)	第32期 (平成29年3月31日現在)
非上場株式	77,696	337,468
関係会社株式	3,229,196	3,306,296

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

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

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第31期(平成28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	12,951,736	-	-	-
(2) 金銭の信託	13,094,914	-	-	-
(3) 未収委託者報酬	4,460,404	-	-	-
(4) 未収運用受託報酬	1,859,778	-	-	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券(投資信託)	-	-	-	-

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

(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31期の貸借対照表計上額3,229,196千円、第32期の貸借対照表計上額3,306,296千円)は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載していません。

2. その他有価証券

第31期(平成28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	365,683	146,101	219,581
投資信託	15,322	13,000	2,322
小計	381,005	159,101	221,903
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	-	-	-
小計	-	-	-
合計	381,005	159,101	221,903

(注) 非上場株式(貸借対照表計上額77,696千円)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「其他有価証券」には含めておりません。

3. 当該事業年度中に売却した其他有価証券

第31期(自平成27年4月1日 至平成28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	5,927	3,377	-

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(其他有価証券)減損処理を行っております。

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確定給付企業年金制度(積立型制度であります)及び退職一時金制度(非積立型制度であります)を採用しております。また、確定拠出型の制度として確定拠出年金制度を採用しております。

なお、当社が有する確定給付企業年金制度の一部は、簡便法により退職給付引当金及び退職給付費用を計算しております。

2. 確定給付制度(複数事業主制度を含む)

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(千円)

	第31期	第32期
	(自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)	(自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)
退職給付債務の期首残高	973,035	1,086,550
勤務費用	134,944	189,127
利息費用	8,660	10,905
数理計算上の差異の発生額	21,441	89,303
退職給付の支払額	51,531	144,062
過去勤務費用の発生額	-	-
合併による増加	-	1,486,547
退職給付債務の期末残高	1,086,550	2,718,372

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

(千円)

	第31期	第32期
	(自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)	(自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)
年金資産の期首残高	-	-
期待運用収益	-	16,033
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
退職給付の支払額	-	28,876
合併による増加	-	1,336,984
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31期	第32期
	(平成28年3月31日現在)	(平成29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	1,086,550	1,443,026
未積立退職給付債務	1,086,550	1,354,935
未認識数理計算上の差異	79,449	430,203
未認識過去勤務費用	9,704	4,852
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	997,396	919,879
退職給付引当金	997,396	1,245,019
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	997,396	919,879

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(千円)

	第31期 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)	第32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)
勤務費用	134,944	189,127
利息費用	8,660	10,905
期待運用収益	-	16,033
数理計算上の差異の費用処理額	31,542	78,229
過去勤務費用の費用処理額	4,852	4,852
その他	2,268	7,498
確定給付制度に係る退職給付費用	182,267	274,580

(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。

(千円)

	第31期 (平成28年3月31日現在)	第32期 (平成29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31期 (平成28年3月31日現在)	第32期 (平成29年3月31日現在)
割引率	0.89%	0.02% ~ 1.09%
長期期待運用収益率	-	2.50%
予想昇給率	1.00% ~ 8.73%	1.00% ~ 8.73%

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31期 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)	第32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)
退職給付引当金の期首残高	-	-
退職給付費用	-	22,562
退職給付の支払額	-	-
制度への拠出額	-	36,177
合併による増加	-	287,313
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31期 (平成28年3月31日現在)	第32期 (平成29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 - 千円 当事業年度22,562千円

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44,193千円、当事業年度61,817千円であります。

(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31期	第32期
	(平成28年3月31日現在)	(平成29年3月31日現在)
	(千円)	(千円)
繰延税金資産		
未払事業税	79,702	124,081
未払事業所税	5,581	11,054
賞与引当金	224,898	441,996
未払法定福利費	28,395	80,909
資産除去債務	13,244	86,421
減価償却超過額(一括償却資産)	3,389	10,666
減価償却超過額	136,503	116,920
繰延資産償却超過額(税法上)	1,339	32,949
退職給付引当金	305,591	399,808
役員退職慰労引当金	47,318	-
時効後支払損引当金	-	66,282
ゴルフ会員権評価損	3,768	14,295
関係会社株式評価損	166,740	191,166
未払給与	-	12,344
本社移転費用引当金	-	289,865
その他有価証券評価差額金	1,196	-
その他	2,500	17,552
繰延税金資産小計	1,020,171	1,896,316
評価性引当額	-	-
繰延税金資産合計	1,020,171	1,896,316
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	-	114,171
繰延税金負債合計	-	324,323
繰延税金資産の純額	1,020,171	1,571,992

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28年10月1日から平成29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	123,277,747千円
資産合計	123,277,747千円
流動負債	- 千円
固定負債	14,647,470千円
負債合計	14,647,470千円
純資産	108,630,277千円

(注) 固定資産及び資産合計には、のれん金額74,319,216千円及び顧客関連資産の金額50,434,199千円が含まれております。

(2) 損益計算書項目

営業収益	- 千円
営業利益	4,483,082千円
経常利益	4,483,082千円
税引前当期純利益	4,483,082千円
当期純利益	3,693,863千円
1株当たり当期純利益	115,512円36銭

(注) 営業利益には、のれんの償却額1,905,620千円及び顧客関連資産の償却額2,595,800千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31期(自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)及び第32期(自平成28年4月1日 至平成29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31期(自平成27年4月1日 至平成28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				
その他の関係会社	第一生命保険株式会社	東京都千代田区	3,431億円	生命保険業	(被所有)直接50%	兼務2名, 出向3名, 転籍2名	資産運用の助言	資産運用の助言の顧問料の受入	795,405	未収投資助言報酬	207,235

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。

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 資産運用の助言の顧問料は、一般的取引条件を定めた規定に基づく個別契約により決定しております。

(注2) 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) 子会社及び関連会社等

第31期(自平成27年4月1日 至平成28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				
子会社	DIAM International Ltd	London United Kingdom	9,000千GBP	資産の運用	(所有)直接100%	兼務2名	当社預り資産の運用	当社預り資産の運用の顧問料の支払 増資の引受	800,617	未払費用	308,974
	DIAM U.S.A., Inc.	New York U.S.A.	4,000千USD	資産の運用	(所有)直接100%	兼務2名	当社預り資産の運用	当社預り資産の運用の顧問料の支払	912,600	-	-
									473,948	未払費用	157,130

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。

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 当社預り資産の運用の顧問料は、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) 上記の取引金額及び期末残高には免税取引のため、消費税等は含まれておりません。

(注3) 増資の引受は、子会社が行った増資を引き受けたものであります。

(3) 兄弟会社等

第31期（自平成27年4月1日 至平成28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				
その他の 関係会社 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	-	兼務 1名	当社設定投 資信託の販 売	投資信託の 販売代行手 数料	3,023,040	未払手 数料	372,837
	みずほ第 一ファイ ナンシャル テクノロ ジー株式 会社	東京都 千代田 区	2億円	金融 技術 研究等	-	兼務 1名	当社預り資 産の助言 金融技術の 開発業務委 託	当社預り資 産の助言の 顧問料の支 払 業務委託料 の支払	557,013 8,540	未払費 用 未払金	292,861 7,581
	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	700,000 8,336	金銭の 信託	13,094,914

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

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) 当社預り資産の助言の顧問料は、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3) 業務委託料は、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4) 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5) 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6) 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せん。

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

当事業年度において、重要な関連会社は株式会社みずほ証券リサーチ&コンサルティングであり、その要約財務諸表は以下のとおりであります。

(単位：千円)

株式会社みずほ証券リサーチ&コンサルティング		
	前事業年度	当事業年度
流動資産合計	-	7,449,532
固定資産合計	-	124,292
流動負債合計	-	1,665,547
固定負債合計	-	114,110
純資産合計	-	5,794,167
営業収益	-	1,093,658
税引前当期純利益	-	5,546,153
当期純利益	-	3,891,816

(1株当たり情報)

	第31期 (自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日)	第32期 (自 平成28年4月 1日 至 平成29年3月31日)
1株当たり純資産額	1,357,615円66銭	1,349,261円64銭
1株当たり当期純利益金額	213,606円51銭	201,491円22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31期 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)	第32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)
当期純利益金額	5,126,556千円	6,443,302千円
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	5,126,556千円	6,443,302千円
普通株式及び普通株式と同等の 株式の期中平均株式数	24,000株	31,978株
(うち普通株式)	(24,000株)	(24,244株)
(うちA種種類株式)	(-)	(7,734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。

(重要な後発事象)

当社は、株式会社みずほ証券リサーチ&コンサルティング(以下、同社といいます。)の株式のうち当社が保有している全株式について、同社が実施する自己株式取得に伴い、平成29年4月1日付で同社へ譲渡いたしました。

これにより、関係会社株式売却益として1,492百万円の特別利益を計上する予定であります。

(1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

		第33期中間会計期間末 (平成29年9月30日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金		38,311,736
金銭の信託		12,187,115
有価証券		10,007
未収委託者報酬		10,291,857
未収運用受託報酬		4,862,664
未収投資助言報酬		324,278
未収収益		55,950
前払費用		764,943
繰延税金資産		727,622
その他		498,289
	流動資産計	68,034,465
固定資産		
有形固定資産		
建物	1	1,200,157
器具備品	1	573,952
建設仮勘定		7,907
無形固定資産		
ソフトウェア		1,050,789
ソフトウェア仮勘定		502,759
電話加入権		3,934
電信電話専用施設利用権		81
投資その他の資産		
投資有価証券		1,939,084
関係会社株式		3,229,196
長期差入保証金		1,566,055
繰延税金資産		906,695
その他		101,155
	固定資産計	11,081,771
資産合計		79,116,236

(単位:千円)

	第33期中間会計期間末 (平成29年9月30日現在)
(負債の部)	
流動負債	
預り金	970,622
未払金	4,511,170
未払収益分配金	1,016
未払償還金	57,332
未払手数料	4,075,374
その他未払金	377,447
未払費用	7,061,067
未払法人税等	3,136,528
未払消費税等	1,025,584
前受収益	66,578
賞与引当金	1,376,046
役員賞与引当金	24,993
本社移転費用引当金	347,010
流動負債計	18,519,601
固定負債	
退職給付引当金	1,423,210
時効後支払損引当金	199,012
固定負債計	1,622,222
負債合計	20,141,823
(純資産の部)	
株主資本	
資本金	2,000,000
資本剰余金	19,552,957
資本準備金	2,428,478
その他資本剰余金	17,124,479
利益剰余金	36,673,439
利益準備金	123,293
その他利益剰余金	36,550,146
別途積立金	24,580,000
研究開発積立金	300,000
運用責任準備積立金	200,000
繰越利益剰余金	11,470,146
株主資本計	58,226,396
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	748,016
評価・換算差額等計	748,016
純資産合計	58,974,413
負債・純資産合計	79,116,236

(2) 中間損益計算書

(単位：千円)

	第33期中間会計期間 (自平成29年4月1日至平成29年9月30日)	
営業収益		
委託者報酬	42,132,996	
運用受託報酬	9,310,831	
投資助言報酬	593,439	
その他営業収益	57,716	
	営業収益計	52,094,984
営業費用		
支払手数料	18,688,374	
広告宣伝費	177,047	
公告費	860	
調査費	11,809,998	
調査費	5,371,951	
委託調査費	6,438,046	
委託計算費	550,197	
営業雑経費	555,637	
通信費	24,831	
印刷費	438,120	
協会費	27,130	
諸会費	29	
支払販売手数料	65,526	
	営業費用計	31,782,116
一般管理費		
給料	5,014,947	
役員報酬	93,260	
給料・手当	4,921,687	
交際費	22,147	
寄付金	4,057	
旅費交通費	181,947	
租税公課	331,327	
不動産賃借料	773,059	
退職給付費用	260,989	
固定資産減価償却費	1 720,970	
福利厚生費	22,315	
修繕費	1,799	
賞与引当金繰入額	1,376,046	
役員賞与引当金繰入額	24,993	
機器リース料	104	
事務委託費	1,549,368	
事務用消耗品費	75,575	
器具備品費	3,469	
諸経費	90,183	
	一般管理費計	10,453,305
営業利益		9,859,563

（単位：千円）

	第33期中間会計期間 （自平成29年4月1日至平成29年9月30日）	
営業外収益		
受取利息	593	
受取配当金	46,072	
時効成立分配金・償還金	85	
投資信託解約益	217,088	
投資信託償還益	93,060	
時効後支払損引当金戻入額	17,443	
雑収入	3,498	
	営業外収益計	377,842
営業外費用		
為替差損	8,306	
投資信託解約損	1,365	
投資信託償還損	17,053	
金銭の信託運用損	31,660	
	営業外費用計	58,386
経常利益		10,179,019
特別利益		
投資有価証券売却益	132,762	
関係会社株式売却益	1,492,680	
本社移転費用引当金戻入額	122,238	
その他特別利益	0	
	特別利益計	1,747,681
特別損失		
固定資産除却損	18,065	
固定資産売却損	134	
退職給付制度終了損	690,899	
その他特別損失	50	
	特別損失計	709,149
税引前中間純利益		11,217,551
法人税、住民税及び事業税		3,407,636
法人税等調整額		163,880
法人税等合計		3,243,755
中間純利益		7,973,795

(3) 中間株主資本等変動計算書

第33期中間会計期間（自平成29年4月1日至平成29年9月30日）

（単位：千円）

	株主資本								
	資本金	資本剰余金			利益剰余金				
		資本準備金	その他 資本剰余金	資本剰余金 合計	利益 準備金	その他利益剰余金			
						別途 積立金	研究開発 積立金	運用責 任準備 積立金	繰越利益 剰余金
当期首残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	24,580,000	300,000	200,000	6,696,350
当中間期変動額									
剰余金の配当									3,200,000
中間純利益									7,973,795
株主資本以外 の項目の当中 間期変動額(純 額)									
当中間期変動額 合計	-	-	-	-	-	-	-	-	4,773,795
当中間期末残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	24,580,000	300,000	200,000	11,470,146

	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
当中間期変動額					
剰余金の配当	3,200,000	3,200,000			3,200,000
中間純利益	7,973,795	7,973,795			7,973,795
株主資本以外 の項目の当中 間期変動額(純 額)			230,151	230,151	230,151
当中間期変動額 合計	4,773,795	4,773,795	230,151	230,151	5,003,947
当中間期末残高	36,673,439	58,226,396	748,016	748,016	58,974,413

重要な会計方針

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 子会社株式及び関連会社株式 ：移動平均法による原価法</p> <p>(2) その他有価証券 時価のあるもの：中間決算日の市場価格等に基づく時価法 （評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定） 時価のないもの：移動平均法による原価法</p>						
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法						
3. 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産 定率法によっております。 ただし、平成28年4月1日以降に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。 なお、主な耐用年数は次のとおりであります。</p> <table data-bbox="566 696 922 768"> <tr> <td>建物</td> <td>...</td> <td>6～18年</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td>...</td> <td>2～20年</td> </tr> </table> <p>(2) 無形固定資産 定額法によっております。 なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。</p>	建物	...	6～18年	器具備品	...	2～20年
建物	...	6～18年					
器具備品	...	2～20年					
4. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、中間決算日の直物等為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。						

5 . 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金は、従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当中間会計期間に見合う分を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金は、役員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当中間会計期間に見合う分を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金は、従業員の退職給付に備えるため、退職一時金制度及び確定給付型企业年金制度（キャッシュバランス型）について、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。</p> <p>退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。</p> <p>数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 過去勤務費用については、その発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年または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、それぞれ発生の翌事業年度から費用処理しております。</p> <p>なお、一部の確定給付企業年金制度については、退職給付引当金及び退職給付費用の計算に、退職給付に係る中間期末自己都合要支給額を退職給付債務とする方法を用いた簡便法を適用しております。</p> <p>(4) 時効後支払損引当金は、時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。</p> <p>(5) 本社移転費用引当金は、本社移転に関連して発生する損失に備えるため、発生すると見込まれる額を計上しております。</p>
6 . 消費税等の会計処理	消費税及び地方消費税の会計処理は税抜き方式によっております。

会計上の見積りの変更

<p>第33期中間会計期間 (自平成29年4月1日 至平成29年9月30日)</p>
<p>当社は、当中間会計期間においてシステム統合計画を決定したことに伴い、利用不能となる固定資産について耐用年数を短縮し、将来にわたり変更しております。</p> <p>これにより、従来の方法と比べて、当中間会計期間の減価償却費が286,788千円増加し、営業利益、経常利益及び税引前中間純利益はそれぞれ同額減少しております。</p>

追加情報

<p>第33期中間会計期間 (自平成29年4月1日 至平成29年9月30日)</p>
--

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

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

(中間貸借対照表関係)

項目	第33期中間会計期間末 (平成29年9月30日現在)
1.有形固定資産の減価償却累計額	建物 ... 97,109千円 器具備品 ... 774,035千円

(中間損益計算書関係)

項目	第33期中間会計期間 (自平成29年4月1日 至平成29年9月30日)	
	1. 減価償却実施額	有形固定資産 ...
	無形固定資産 ...	578,697千円

(中間株主資本等変動計算書関係)

第33期中間会計期間(自平成29年4月1日 至平成29年9月30日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の 種類	配当金の 総額 (千円)	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成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) 基準日が当中間会計期間に属する配当のうち、配当の効力発生日が当中間会計期間後となるもの

該当事項はありません。

（金融商品関係）

第33期中間会計期間末（平成29年9月30日現在）

金融商品の時価等に関する事項

平成29年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

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

	中間貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1) 現金・預金	38,311,736	38,311,736	-
(2) 金銭の信託	12,187,115	12,187,115	-
(3) 未収委託者報酬	10,291,857	10,291,857	-
(4) 未収運用受託報酬	4,862,664	4,862,664	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	1,641,123	1,641,123	-
資産計	67,294,496	67,294,496	-
(1) 未払手数料	4,075,374	4,075,374	-
負債計	4,075,374	4,075,374	-

（注1）金融商品の時価の算定方法

資 産

（1）現金・預金

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

（2）金銭の信託

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

（3）未収委託者報酬及び（4）未収運用受託報酬

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

（5）有価証券及び投資有価証券

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

負 債

（1）未払手数料

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

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

区分	中間貸借対照表計上額 (千円)
非上場株式	307,968
関係会社株式	3,229,196

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

(有価証券関係)

第33期中間会計期間末 (平成29年9月30日現在)			
1. 子会社株式 関係会社株式(中間貸借対照表計上額3,229,196千円)は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。			
2. その他有価証券			
区分	中間貸借対照表 計上額(千円)	取得原価 (千円)	差額 (千円)
中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの			
株式	1,189,247	146,101	1,043,145
投資信託	423,152	385,910	37,242
小計	1,612,400	532,011	1,080,388
中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
株式	-	-	-
投資信託	28,723	30,967	2,244
小計	28,723	30,967	2,244
合計	1,641,123	562,979	1,078,144
(注) 非上場株式(中間貸借対照表計上額307,968千円)については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。			

(企業結合等関係)

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

1. 結合当事企業

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

2. 企業結合日

平成28年10月1日

3. 企業結合の方法

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

4. 結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

5. 企業結合の主な目的

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

6. 合併比率

「3. 企業結合の方法」の吸収合併における合併比率は以下の通りであります。

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

(*) 普通株式と種類株式を合算して算定しております。

7. 交付した株式数

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

8. 経済的持分比率（議決権比率）

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

MHFGが企業結合日に追加取得した当社に対する経済的持分比率 20.00%

MHFGの追加取得後の当社に対する経済的持分比率 70.00%

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

9. 取得企業を決定するに至った主な根拠

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

10. 会計処理

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

11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

(1) 中間財務諸表に含まれる被取得企業の業績の期間

平成29年4月1日から平成29年9月30日まで

(2) 被取得企業の取得原価及びその内訳

取得の対価 MHAMの普通株式 144,212,500千円

取得原価 144,212,500千円

(3) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

a. 発生したのれんのご金額 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	118,742,638千円
資産合計	118,742,638千円
流動負債	- 千円
固定負債	13,822,169千円
負債合計	13,822,169千円
純資産	104,920,468千円

(注) 固定資産及び資産合計には、のれんのご金額72,413,595千円及び顧客関連資産の金額47,817,519千円が含まれております。

(2) 損益計算書項目

営業収益	- 千円
営業利益	4,506,064千円
経常利益	4,506,064千円
税引前中間純利益	4,506,064千円
中間純利益	3,709,808千円
1株当たり中間純利益	92,745円22銭

(注) 営業利益には、のれんのご償却額1,905,620千円及び顧客関連資産の償却額2,616,680千円が含まれております。

(資産除去債務関係)

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

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

(セグメント情報等)

第33期中間会計期間(自平成29年4月1日 至平成29年9月30日)

1. セグメント情報

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

(1) サービスごとの情報

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

(2) 地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

(1株当たり情報)

第33期中間会計期間 (自平成29年4月1日 至平成29年9月30日)	
1株当たり純資産額	1,474,360円32銭
1株当たり中間純利益金額	199,344円89銭

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

1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第33期中間会計期間 (自平成29年4月1日 至平成29年9月30日)
中間純利益金額	7,973,795千円
普通株主及び普通株主と同等の株主に帰属しない金額	-
普通株式及び普通株式と同等の株式に係る中間純利益金額	7,973,795千円
普通株式及び普通株式と同等の株式の期中平均株式数	40,000株
(うち普通株式)	(24,490株)
(うちA種種類株式)	(15,510株)

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

4【利害関係人との取引制限】

委託会社は、「金融商品取引法」の定めるところにより、利害関係人との取引について、次に掲げる行為が禁止されています。

- (1) 自己またはその取締役もしくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。
- (2) 運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。
- (3) 通常取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下（4）（5）において同じ。）または子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引または店頭デリバティブ取引を行うこと。
- (4) 委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。
- (5) 上記（3）（4）に掲げるもののほか、委託会社の親法人等または子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

5【その他】

- (1) 定款の変更、事業譲渡又は事業譲受、出資の状況その他の重要事項
該当事項はありません。
- (2) 訴訟事件その他の重要事項
委託会社およびファンドに重要な影響を与えた事実、または与えると予想される事実はありません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

a. 名称

みずほ信託銀行株式会社

b. 資本金の額

平成29年3月末日現在 247,369百万円

c. 事業の内容

日本において銀行業務および信託業務を営んでいます。

(2) 販売会社

販売会社の名称、資本金の額および事業内容は以下の「販売会社一覧表」の通りです。

名 称	資本金の額 (単位:百万円)	事 業 の 内 容
株式会社みずほ銀行	1,404,065	日本において銀行業務を営んでおります。
みずほ信託銀行株式会社	247,369	日本において銀行業務および信託業務を営んでいます。

(注) 資本金の額は平成29年3月末日現在

(3) 投資顧問会社

a. 名称

みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社

b. 資本金の額

平成29年3月末日現在 200百万円

c. 事業の内容

日本において投資顧問業務を営んでいます。

2【関係業務の概要】

「受託会社」は、以下の業務を行います。

- (1) 委託会社の指図に基づく信託財産の管理、保管、処分
- (2) 信託財産の計算
- (3) 信託財産に関する報告書の作成
- (4) その他上記に付帯する業務

「販売会社」は、以下の業務を行います。

- (1) 募集の取扱い
- (2) 追加設定の申込事務
- (3) 信託契約の一部解約事務
- (4) 受益者に対する収益分配金、一部解約金および償還金の支払い
- (5) 受益者に対する収益分配金の再投資
- (6) 受益者に対する投資信託説明書(目論見書)および運用報告書の交付
- (7) その他上記に付帯する業務

「投資顧問会社」は、以下の業務を行います。

みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社は委託会社との投資顧問契約に基づき、各ファンドの信託財産の運用指図等について助言を行います。

3【資本関係】

該当事項はありません。

持株比率5%以上を記載します。

第3【その他】

- (1)目論見書の表紙等にロゴ・マークや図案を使用し、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29年6月7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28年4月1日から平成29年3月31日までの第32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29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1月31日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

PwCあらた有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 佐々木 貴 司 印
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 鶴 田 光 夫 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているワールドアセットバランス(基本コース)の平成29年6月13日から平成29年12月11日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ワールドアセットバランス(基本コース)の平成29年12月11日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

独立監査人の監査報告書

平成30年1月31日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

PwCあらた有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 佐々木 貴 司 印
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 鶴 田 光 夫 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているワールドアセットバランス(リスク抑制コース)の平成29年6月13日から平成29年12月11日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)の平成29年12月11日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

独立監査人の中間監査報告書

平成29年11月24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期事業年度の中間会計期間（平成29年4月1日から平成29年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、アセットマネジメントOne株式会社の平成29年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成29年4月1日から平成29年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

（注2）XBRLデータは中間監査の対象には含まれておりません。