

【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9月11日
【発行者名】	アセットマネジメントOne株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 菅野 暁
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目8番2号
【事務連絡者氏名】	三木谷 正直
【電話番号】	03-6774-5100
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	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9月12日から平成31年3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經由して受託会社の指定するファンド口座(受託会社が信託事務の一部について委託を行っている場合は当該委託先の口座)に払込まれます。

(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。

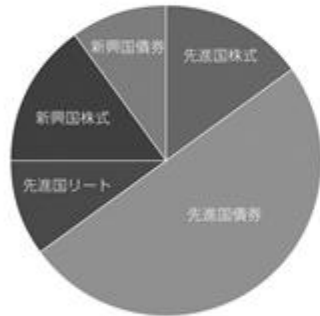
■ 各コース間でスイッチングが可能です。

※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。

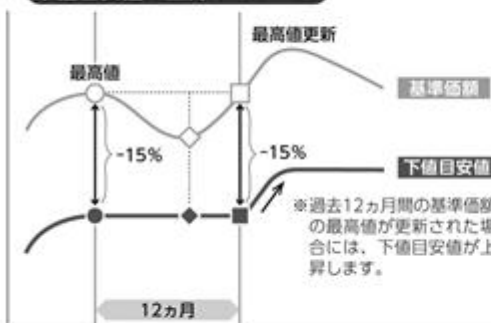
※現金等とは、短期国債、コール・ローンなどの短期金融資産等をいい、当該資産へは、「DIAMマネーマザーファンド」を通じてまたは直接投資を行います。
 ※円グラフの現金等・合計資産比率の割合はイメージです。

(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。

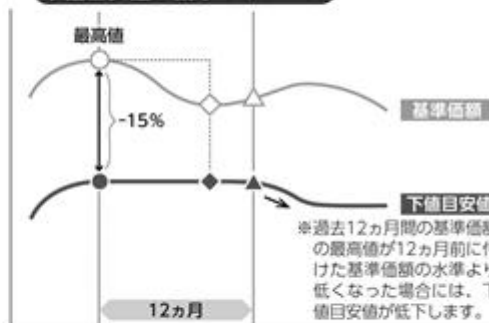
※（基本コース）は、下値目安値を定めておりません。
 ※設定後12ヵ月に満たない場合は、設定来の最高値をもとに下値目安値を決定します。

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。

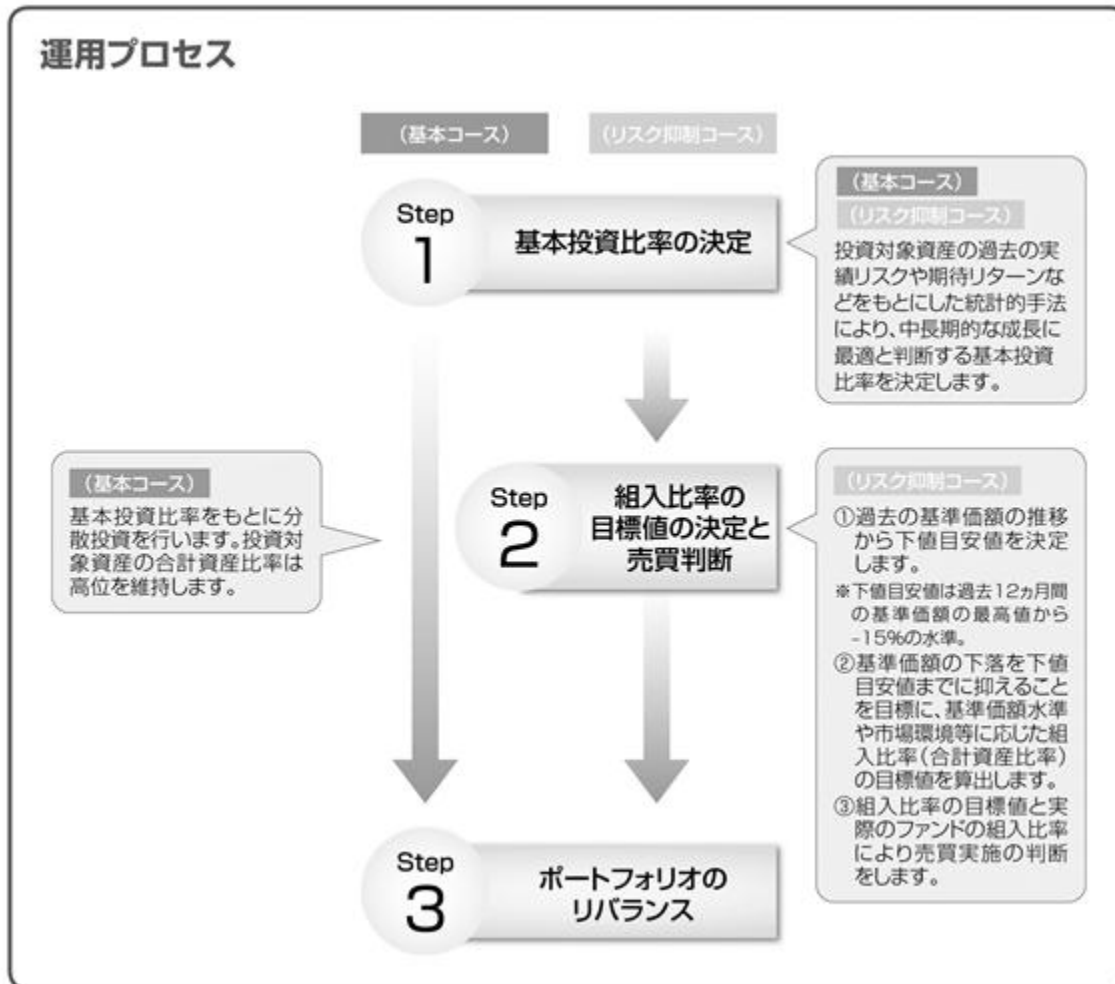
5

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。

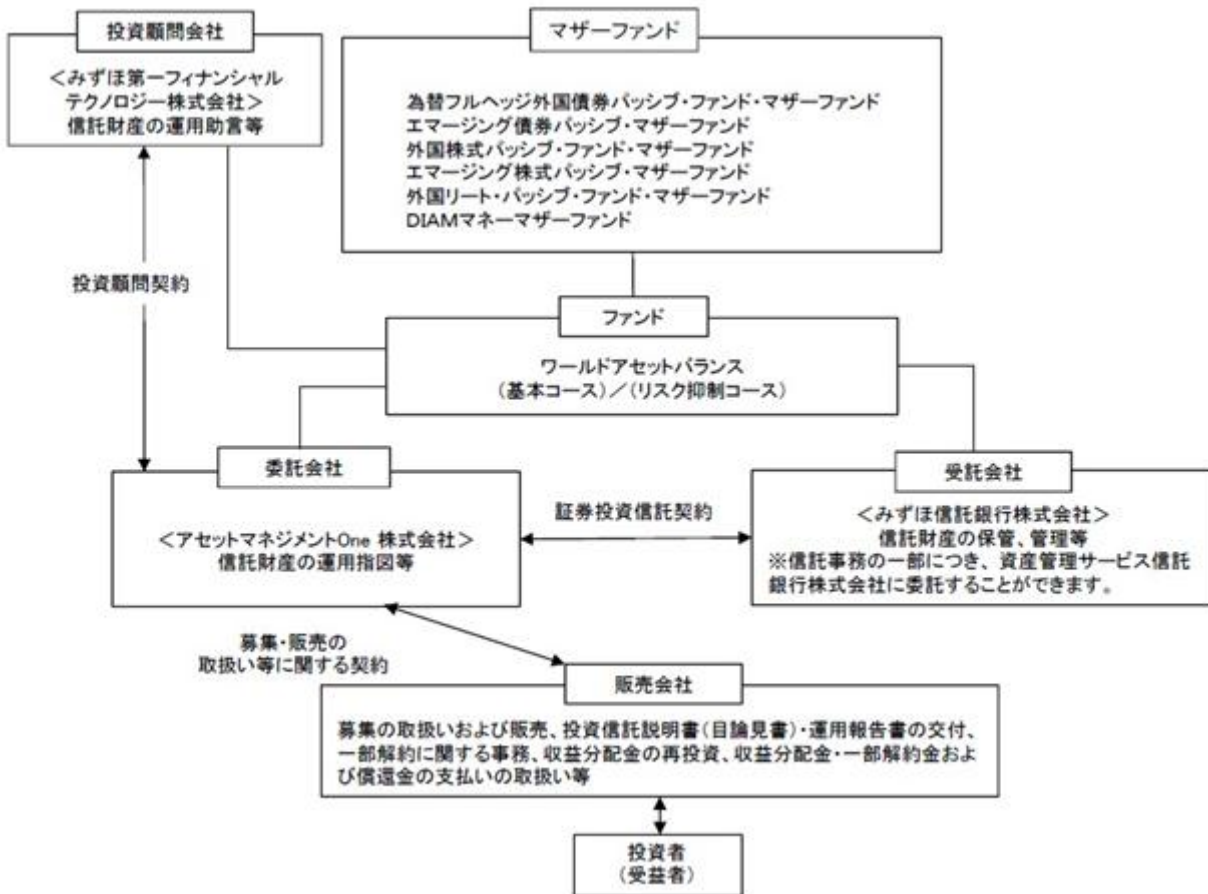
上記の分類は、一般社団法人投資信託協会の商品分類に関する指針に基づき記載しております。

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。

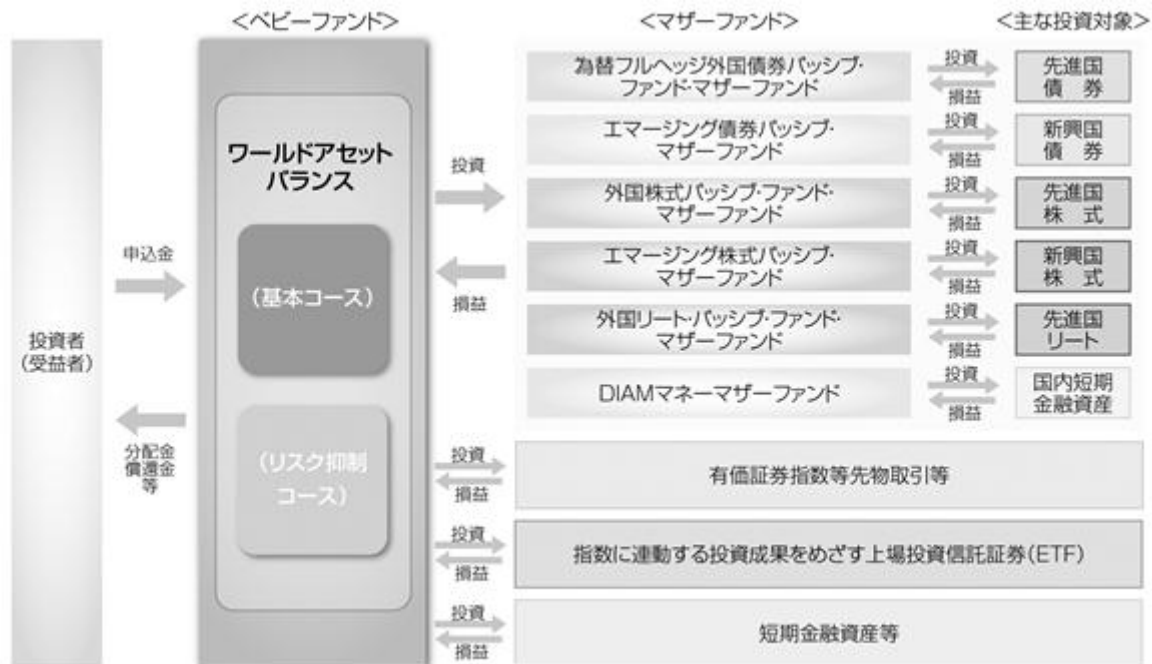
- ・ 「投資顧問契約」の概要

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30年6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「D I A Mアセットマネジメント株式会社」に商号変更
平成28年10月 1日	D I A Mアセットマネジメント株式会社、みずほ投信投資顧問株式会社、新光投信株式会社、みずほ信託銀行株式会社（資産運用部門）が統合し、商号をアセットマネジメントOne株式会社に変更

大株主の状況

（平成30年6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。

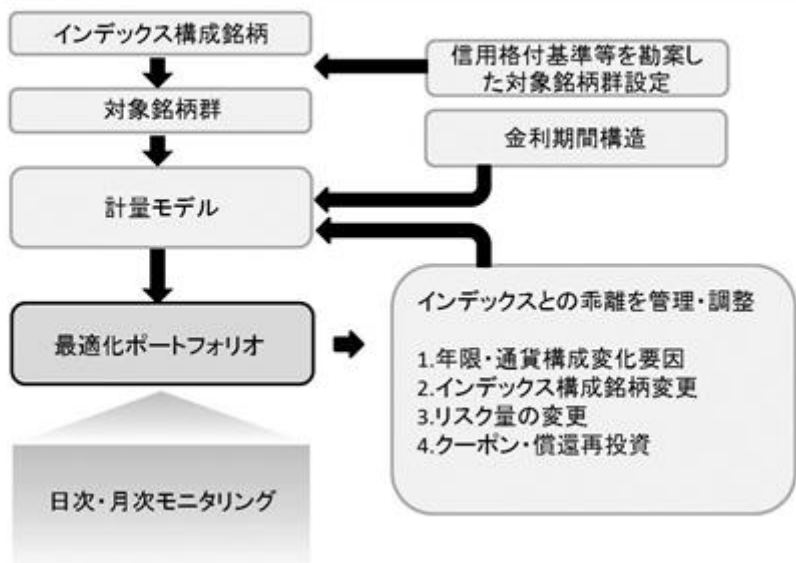
1. 預金
2. 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
6. 外国の者に対する権利で5.の権利の性質を有するもの

（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>

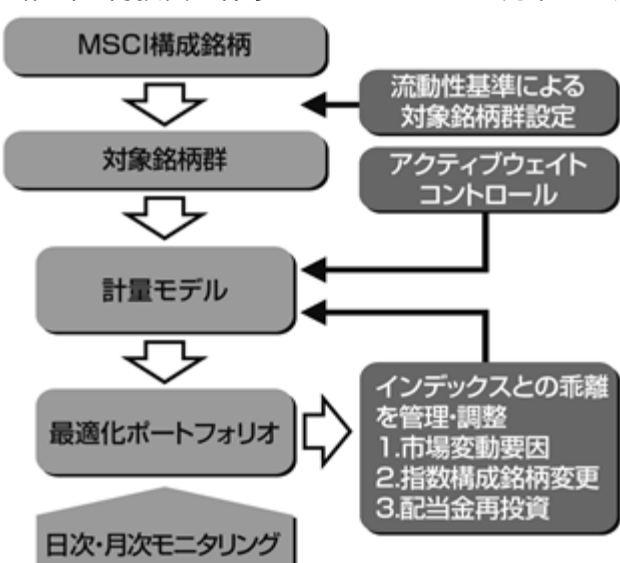
運用プロセス	<p>信用格付基準等を勘案した投資対象銘柄群を設定し、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。</p>  <pre> graph TD A[インデックス構成銘柄] --> B[対象銘柄群] B --> C[計量モデル] C --> D[最適化ポートフォリオ] D --> E[日次・月次モニタリング] F[信用格付基準等を勘案した対象銘柄群設定] --> B G[金利期間構造] --> C D --> H[インデックスとの乖離を管理・調整] subgraph H [イ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] --> D I[1.市場変動要因] --> H J[2.指数構成銘柄変更] --> H K[3.配当金再投資] --> H </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[日次・月次モニタリング] G[インデックスとの乖離を管理・調整 1.市場変動要因 2.指数構成銘柄変更 3.配当金再投資] --> E </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。
------	--

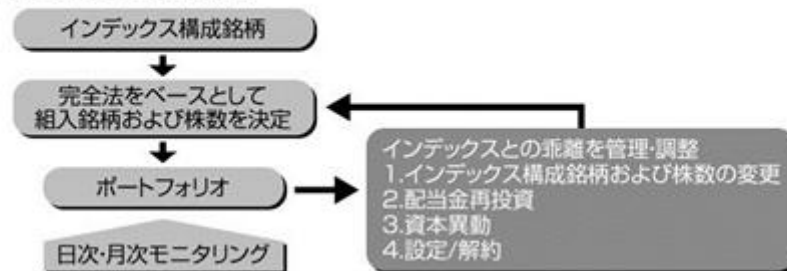
S & P 先進国 R E I T インデックスは、S&P Globalの一部門である S&P ダウ・ジョーンズ・インデックス LLC またはその関連会社 (「SPDJI」) の商品であり、これを利用するライセンスが委託会社に付与されています。Standard & Poor's および S&P は、S&P Global の一部門であるスタンダード & プアーズ・ファイナンシャル・サービシーズ LLC (「S&P」) の登録商標で、Dow Jones は、ダウ・ジョーンズ・トレードマーク・ホールディングズ LLC (「Dow Jones」) の登録商標です。指数に直接投資することはできません。本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

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

は責任も負わないものとしします。S&P Dow Jones Indicesは、明示的または黙示的を問わず、いかなる保証もせず、商品性、特定の目的または使用への適合性、もしくはS & P 先進国 REITインデックスを使用することによって、またはそれに関連するデータに関して、委託会社、本商品の所有者、またはその他の人物や組織が得られる結果について、一切の保証を明示的に否認します。上記を制限することなく、いかなる場合においても、S&P Dow Jones Indicesは、利益の逸失、営業損失、時間または信用の喪失を含むがこれらに限定されない、間接的、特別、懲罰的、または派生的損害に対して、たとえその可能性について知らされていたとしても、契約の記述、不法行為、または厳格責任の有無を問わず、一切の責任を負わないものとしします。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30年6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で、信託財産の外貨建資産組入可能額(約款上の組入可能額から保有外貨建資産の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。)を加えた額を差引いた額をいいます。以下同じ。)に信託財産が限月までに受取る外貨建組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに外貨建組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額が当該金融商品運用額等の額より少ない場合には外貨建資産組入可能額に信託財産が限月までに受取る外貨建組入有価証券にかかる利払金および償還金等を加えた額を限度とします。
3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点のヘッジ対象金利商品の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつで規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

スワップ取引の運用指図(約款第23条)

- 1) 委託会社は、信託財産に属する資産の価格変動リスクや為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利、または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行うことの指図をすることができます。
- 2) スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。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が、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。

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

収益分配金に関する留意点として、以下の事項にご留意ください。

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

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

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

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%以上下落する場合はあ

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。

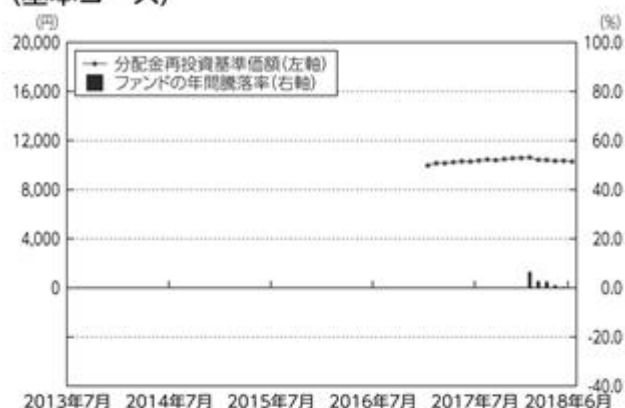


上記体制は平成30年6月29日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

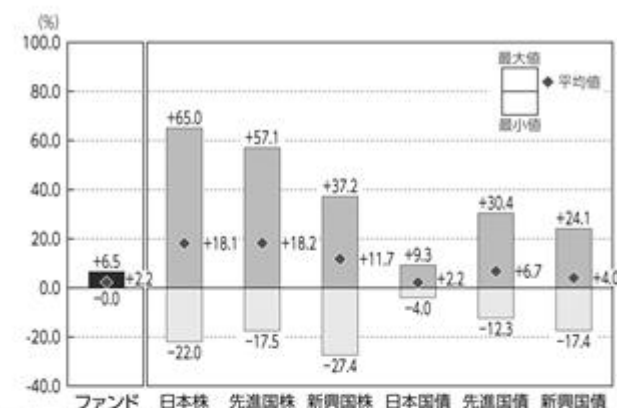
<参考情報>

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)

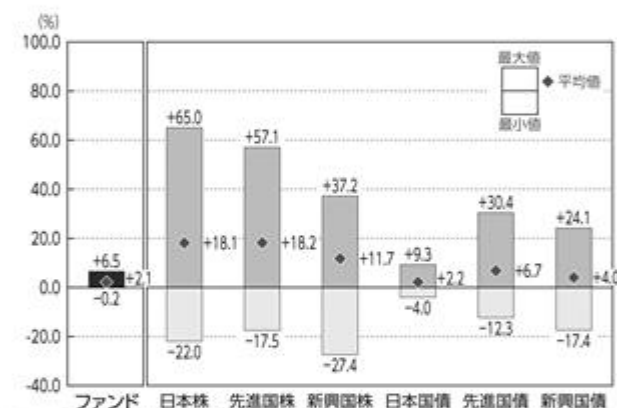
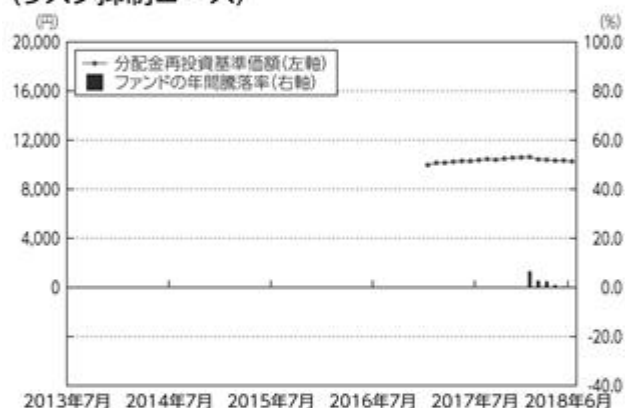


ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



ファンド:2018年1月~2018年6月
代表的な資産クラス:2013年7月~2018年6月

(リスク抑制コース)



ファンド:2018年1月~2018年6月
代表的な資産クラス:2013年7月~2018年6月

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

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

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

*全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

*各資産クラスの指数

日本株… 東証株価指数(TOPIX)(配当込み)
先進国株… MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)
新興国株… MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)
(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… J.P.モルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイド(円ベース)

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

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

●「MSCIエマージング・マーケット・インデックス」は、MSCI Inc.が開発した株価指数で、新興国の株価指数を、各国の株式時価総額をベースに合成したものです。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

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

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

●「J.P.モルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイド」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30年6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30年6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	33,520,149	0.21
内 アメリカ	33,520,149	0.21
親投資信託受益証券	16,024,152,479	99.15
内 日本	16,024,152,479	99.15
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	104,178,953	0.64
純資産総額	16,161,851,581	100.00

その他資産の投資状況

平成30年6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）	8,093,348,500	50.08
-	8,093,348,500	50.08

（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30年6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	51,666,396	0.08
内 アメリカ	51,666,396	0.08
親投資信託受益証券	63,289,711,487	99.73
内 日本	63,289,711,487	99.73
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	121,376,803	0.19
純資産総額	63,462,754,686	100.00

その他資産の投資状況

平成30年6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）	32,158,781,500	50.67
-	32,158,781,500	50.67

（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30年6月29日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	290,569,562,648	94.67
内 アメリカ	184,882,834,231	60.24
内 イギリス	19,723,117,667	6.43
内 フランス	11,345,958,401	3.70
内 カナダ	11,319,648,314	3.69
内 ドイツ	10,961,877,933	3.57
内 スイス	9,822,957,233	3.20
内 オーストラリア	7,425,362,434	2.42
内 オランダ	5,714,131,089	1.86
内 アイルランド	4,319,689,025	1.41
内 スペイン	3,558,095,541	1.16
内 スウェーデン	2,904,636,596	0.95
内 香港	2,851,736,877	0.93
内 イタリア	2,268,361,646	0.74
内 デンマーク	1,915,229,253	0.62
内 ジャージー	1,611,421,749	0.53
内 シンガポール	1,402,708,982	0.46
内 バミューダ	1,381,727,759	0.45
内 ベルギー	1,240,326,363	0.40
内 フィンランド	1,186,533,261	0.39
内 ノルウェー	876,886,887	0.29
内 ケイマン諸島	789,311,463	0.26
内 オランダ領キュラソー	763,683,717	0.25
内 イスラエル	619,333,673	0.20
内 ルクセンブルグ	387,178,471	0.13
内 オーストリア	274,164,952	0.09
内 ニューゼaland	257,940,440	0.08
内 パナマ	200,396,480	0.07
内 ポルトガル	193,895,872	0.06
内 リベリア	141,716,366	0.05
内 イギリス領バージン諸島	89,842,543	0.03
内 パプアニューギニア	67,388,357	0.02
内 マン島	54,134,496	0.02
内 モーリシャス	17,334,577	0.01
投資信託受益証券	716,652,729	0.23
内 オーストラリア	586,699,443	0.19
内 シンガポール	129,953,286	0.04
投資証券	6,568,565,303	2.14
内 アメリカ	5,651,508,076	1.84
内 イギリス	275,271,879	0.09
内 オランダ	247,408,612	0.08
内 フランス	186,532,729	0.06
内 香港	163,563,765	0.05
内 カナダ	44,280,242	0.01

コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	9,077,493,842	2.96
純資産総額	306,932,274,522	100.00

その他資産の投資状況

平成30年6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)	79,129,930	0.03
-	79,129,930	0.03
株価指数先物取引(買建)	8,971,950,580	2.92
内 アメリカ	6,192,638,718	2.02
内 ドイツ	1,573,058,924	0.51
内 イギリス	633,243,472	0.21
内 カナダ	335,072,694	0.11
内 オーストラリア	237,936,772	0.08

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

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

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

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

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年6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	5,329,430,792	9.90
内 オーストラリア	3,600,716,527	6.69
内 シンガポール	1,709,441,195	3.17
内 カナダ	19,273,070	0.04
投資証券	48,090,740,916	89.29
内 アメリカ	38,504,282,918	71.49
内 イギリス	2,966,539,888	5.51
内 オランダ	1,606,568,426	2.98
内 フランス	1,268,749,579	2.36
内 香港	1,085,940,648	2.02
内 カナダ	925,149,562	1.72
内 スペイン	544,715,360	1.01
内 ベルギー	407,701,466	0.76
内 ニュージーランド	230,059,414	0.43
内 ドイツ	139,326,533	0.26
内 アイルランド	137,147,931	0.25
内 シンガポール	122,077,616	0.23
内 イタリア	59,216,010	0.11
内 ガーンジー	36,094,236	0.07
内 イスラエル	30,788,868	0.06
内 マン島	26,382,461	0.05
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	438,041,439	0.81
純資産総額	53,858,213,147	100.00

その他資産の投資状況

平成30年6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)	19,869,420	0.04
-	19,869,420	0.04

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

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

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

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年6月29日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	286,041,746,384	97.50
内 アメリカ	128,445,766,358	43.78
内 フランス	29,545,446,650	10.07
内 イタリア	26,344,728,721	8.98
内 イギリス	20,051,090,802	6.83
内 ドイツ	19,965,974,664	6.81
内 スペイン	16,574,711,588	5.65
内 ベルギー	7,363,719,568	2.51
内 カナダ	6,027,806,568	2.05
内 オランダ	6,020,566,874	2.05
内 オーストラリア	5,980,705,071	2.04
内 オーストリア	4,649,685,893	1.58
内 アイルランド	2,456,725,653	0.84
内 メキシコ	2,125,253,329	0.72
内 フィンランド	1,934,793,064	0.66
内 ポーランド	1,709,523,954	0.58
内 南アフリカ	1,593,652,374	0.54
内 デンマーク	1,537,729,918	0.52
内 マレーシア	1,149,042,209	0.39
内 シンガポール	966,603,060	0.33
内 スウェーデン	926,600,309	0.32
内 ノルウェー	671,619,757	0.23
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	7,334,381,941	2.50
純資産総額	293,376,128,325	100.00

その他資産の投資状況

平成30年6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）	291,842,186,732	99.48
-	291,842,186,732	99.48

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

平成30年6月29日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	58,288,165,781	93.01
内 ケイマン諸島	10,457,534,970	16.69
内 韓国	8,652,518,599	13.81
内 台湾	6,721,149,340	10.73
内 中国	6,013,145,727	9.60
内 インド	5,099,588,504	8.14
内 南アフリカ	3,633,972,818	5.80
内 ブラジル	3,434,284,046	5.48
内 香港	2,163,015,094	3.45
内 ロシア	2,006,988,359	3.20
内 マレーシア	1,373,808,025	2.19
内 メキシコ	1,363,809,510	2.18
内 タイ	1,295,335,147	2.07
内 インドネシア	1,098,936,583	1.75
内 チリ	663,590,659	1.06
内 ポーランド	634,685,090	1.01
内 バミューダ	625,857,804	1.00
内 フィリピン	553,055,101	0.88
内 カタール	494,961,921	0.79
内 トルコ	437,243,335	0.70
内 アラブ首長国連邦	383,799,795	0.61
内 コロンビア	278,793,196	0.44
内 アメリカ	207,963,544	0.33
内 ギリシャ	181,629,796	0.29
内 ハンガリー	158,734,928	0.25
内 チェコ	99,710,438	0.16
内 エジプト	63,681,361	0.10
内 オランダ	38,700,440	0.06
内 パキスタン	38,331,043	0.06
内 ルクセンブルグ	37,550,336	0.06
内 マン島	34,032,078	0.05
内 ペルー	28,325,211	0.05
内 シンガポール	13,432,983	0.02
投資信託受益証券	309,878,905	0.49
内 メキシコ	309,878,905	0.49
投資証券	107,509,830	0.17
内 メキシコ	48,475,963	0.08
内 南アフリカ	47,641,490	0.08
内 トルコ	11,392,377	0.02
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	3,961,229,847	6.32
純資産総額	62,666,784,363	100.00

その他資産の投資状況

平成30年6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）	181,726,500	0.29
-	181,726,500	0.29
為替予約取引（売建）	117,279,500	0.19
-	117,279,500	0.19
株価指数先物取引（買建）	3,955,607,576	6.31
内 アメリカ	3,955,607,576	6.31

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

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

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

平成30年6月29日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	102,292,113,320	96.01
内 メキシコ	14,349,495,083	13.47
内 トルコ	14,039,476,913	13.18
内 ロシア	11,843,162,710	11.12
内 ブラジル	10,971,807,208	10.30
内 インドネシア	10,224,752,459	9.60
内 コロンビア	9,216,609,645	8.65
内 フィリピン	7,367,759,496	6.92
内 パナマ	5,279,760,709	4.96
内 ハンガリー	4,783,041,036	4.49
内 ペルー	4,631,637,053	4.35
内 南アフリカ	4,043,071,906	3.79
内 クロアチア	3,158,395,747	2.96
内 ルーマニア	2,383,143,355	2.24
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	4,254,541,963	3.99
純資産総額	106,546,655,283	100.00

その他資産の投資状況

平成30年6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）	232,071,000	0.22
-	232,071,000	0.22
為替予約取引（売建）	209,950,000	0.20
-	209,950,000	0.20

（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30年6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	6,071,699,281	1.3156 7,988,534,744	1.3272 8,058,359,285	- -	49.86%
2	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	708,384,105	3.4936 2,474,881,547	3.4381 2,435,495,391	- -	15.07%
3	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	1,964,816,977	1.2235 2,404,150,053	1.1411 2,242,052,652	- -	13.87%
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	1,383,436,091	1.1885 1,644,352,137	1.2118 1,676,447,855	- -	10.37%
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	900,646,679	1.7612 1,586,308,995	1.7896 1,611,797,296	- -	9.97%
6	XTRACKERS MSCI EMERGING MARKETS HEDGED EQUITY ETF アメリカ	投資信託受益証券	13,300	2,678.38 35,622,509	2,520.31 33,520,149	- -	0.21%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成30年6月29日現在

種類	投資比率
投資信託受益証券	0.21%
親投資信託受益証券	99.15%
合計	99.36%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

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30年6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	23,768,329,118	1.3157 31,271,990,621	1.3272 31,545,326,405	- -	49.71%
2	外国株式パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資信託 受益証券	2,833,633,500	3.4936 9,899,865,358	3.4381 9,742,315,336	- -	15.35%
3	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	7,712,821,183	1.2235 9,437,407,999	1.1411 8,801,100,251	- -	13.87%
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	5,622,314,658	1.1885 6,682,683,202	1.2118 6,813,120,902	- -	10.74%
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	3,569,428,137	1.7612 6,286,833,777	1.7896 6,387,848,593	- -	10.07%
6	XTRACKERS MSCI EMERGING MARKETS HEDGED EQUITY ETF アメリカ	投資信託受 益証券	20,500	2,678.38 54,906,876	2,520.31 51,666,396	- -	0.08%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成30年6月29日現在

種類	投資比率
投資信託受益証券	0.08%
親投資信託受益証券	99.73%
合計	99.81%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

(参考)

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年6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	376,469	18,552.32 6,984,377,066	20,505.16 7,719,560,844	- -	2.52%
2	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフトウェア	542,300	10,055.84 5,453,285,558	10,902.56 5,912,458,396	- -	1.93%
3	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 インターネット販売・通信販売	30,466	160,745.21 4,897,263,595	188,078.28 5,729,992,969	- -	1.87%
4	FACEBOOK INC アメリカ	株式 インターネットソフトウェア・サービス	177,316	19,851.98 3,520,075,147	21,691.26 3,846,208,202	- -	1.25%
5	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	254,725	12,719.54 3,239,985,731	11,598.96 2,954,545,646	- -	0.96%
6	ALPHABET INC-CL C アメリカ	株式 インターネットソフトウェア・サービス	23,300	118,460.88 2,760,138,551	123,165.87 2,869,764,976	- -	0.93%
7	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 石油・ガス・消耗燃料	315,280	8,455.72 2,665,920,931	9,060.96 2,856,740,666	- -	0.93%
8	ALPHABET INC-CL A アメリカ	株式 インターネットソフトウェア・サービス	22,200	118,788.87 2,637,113,058	124,554.26 2,765,104,598	- -	0.90%
9	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	198,834	14,341.29 2,851,538,026	13,485.87 2,681,451,463	- -	0.87%
10	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 銀行	722,337	3,537.88 2,555,542,501	3,169.18 2,289,217,273	- -	0.75%
11	WELLS FARGO & CO アメリカ	株式 銀行	348,201	6,578.75 2,290,728,193	5,928.26 2,064,226,129	- -	0.67%
12	VISA INC アメリカ	株式 情報技術サービス	134,179	13,365.30 1,793,343,342	14,673.07 1,968,819,147	- -	0.64%
13	CHEVRON CORP アメリカ	株式 石油・ガス・消耗燃料	141,261	12,557.89 1,773,940,480	13,890.45 1,962,179,761	- -	0.64%
14	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	231,295	8,561.76 1,980,294,123	8,460.14 1,956,789,006	- -	0.64%
15	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 各種金融サービス	94,579	22,200.50 2,099,701,104	20,680.92 1,955,981,546	- -	0.64%

16	UNITEDHEALTH GROUP INC アメリカ	株式 ヘルスケア・ プロバイ ダー/ヘルス ケア・サービ ス	71,700	25,308.54 1,814,622,559	27,071.24 1,941,008,338	- -	0.63%
17	AT&T INC アメリカ	株式 各種電気通信 サービス	540,606	3,887.85 2,101,796,019	3,558.28 1,923,628,923	- -	0.63%
18	INTEL CORP アメリカ	株式 半導体・半導 体製造装置	348,219	5,039.53 1,754,863,248	5,444.09 1,895,737,316	- -	0.62%
19	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 専門小売り	86,514	20,416.79 1,766,339,029	21,578.51 1,866,843,508	- -	0.61%
20	PFIZER INC アメリカ	株式 医薬品	440,510	3,899.27 1,717,671,357	4,019.23 1,770,512,945	- -	0.58%
21	VERIZON COMM INC アメリカ	株式 各種電気通信 サービス	306,879	5,463.07 1,676,502,501	5,622.06 1,725,293,501	- -	0.56%
22	CISCO SYSTEMS INC アメリカ	株式 通信機器	357,260	4,661.88 1,665,504,835	4,746.58 1,695,765,885	- -	0.55%
23	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品	186,535	8,917.83 1,663,488,396	8,627.64 1,609,358,133	- -	0.52%
24	BOEING CO アメリカ	株式 航空宇宙・防 衛	41,469	38,236.23 1,585,618,263	36,992.21 1,534,029,997	- -	0.50%
25	HSBC HOLDINGS PLC イギリス	株式 銀行	1,488,734	1,082.39 1,611,399,553	1,026.29 1,527,887,435	- -	0.50%
26	MASTERCARD INC アメリカ	株式 情報技術サー ビス	69,052	19,084.66 1,317,834,044	21,787.43 1,504,465,892	- -	0.49%
27	COCA-COLA CO/THE アメリカ	株式 飲料	298,559	4,872.63 1,454,769,178	4,805.17 1,434,627,884	- -	0.47%
28	CITIGROUP INC アメリカ	株式 銀行	190,608	8,473.98 1,615,210,020	7,392.91 1,409,148,780	- -	0.46%
29	NETFLIX INC アメリカ	株式 インターネッ ト販売・通信 販売	32,015	29,525.03 945,244,085	43,709.72 1,399,366,903	- -	0.46%
30	MERCK & CO. INC. アメリカ	株式 医薬品	201,289	6,067.84 1,221,390,944	6,665.56 1,341,704,309	- -	0.44%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成30年6月29日現在

種類	投資比率
株式	94.67%
投資信託受益証券	0.23%
投資証券	2.14%
合計	97.04%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

平成30年6月29日現在

業種	国内/外国	投資比率
銀行	外国	8.65%
石油・ガス・消耗燃料		6.53%
医薬品		4.99%
ソフトウェア		4.51%
保険		3.67%
インターネットソフトウェア・サービス		3.52%
情報技術サービス		3.32%
半導体・半導体製造装置		3.00%
資本市場		2.93%
コンピュータ・周辺機器		2.85%
インターネット販売・通信販売		2.68%
化学		2.44%
ヘルスケア機器・用品		2.35%
航空宇宙・防衛		2.23%
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス		2.16%
バイオテクノロジー		2.01%
各種電気通信サービス		2.01%
メディア		1.95%
飲料		1.93%
電力		1.76%
ホテル・レストラン・レジャー		1.75%
食品		1.74%
専門小売り		1.62%
金属・鉱業		1.53%
機械		1.49%
コングロマリット		1.47%
食品・生活必需品小売り		1.47%
繊維・アパレル・贅沢品		1.34%
家庭用品		1.13%
タバコ		1.05%
陸運・鉄道		0.98%
総合公益事業		0.97%
自動車		0.93%
各種金融サービス		0.91%
通信機器		0.90%
パーソナル用品		0.71%
電気設備		0.71%
専門サービス		0.67%

ライフサイエンス・ツール/サービス	0.60%
航空貨物・物流サービス	0.56%
エネルギー設備・サービス	0.53%
不動産管理・開発	0.53%
電子装置・機器・部品	0.48%
消費者金融	0.47%
自動車部品	0.43%
複合小売り	0.42%
家庭用耐久財	0.41%
商業サービス・用品	0.40%
建設関連製品	0.37%
建設・土木	0.34%
商社・流通業	0.33%
無線通信サービス	0.31%
建設資材	0.31%
容器・包装	0.29%
運送インフラ	0.20%
ガス	0.14%
旅客航空輸送業	0.13%
紙製品・林産品	0.12%
水道	0.08%
ヘルスケア・テクノロジー	0.07%
販売	0.07%
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.07%
レジャー用品	0.06%
海運業	0.05%
各種消費者サービス	0.01%
貯蓄・抵当・不動産金融	0.01%
合計	94.67%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年6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	131,184	18,738.68 2,458,216,091	18,925.55 2,482,729,797	- -	4.61%
2	PROLOGIS INC アメリカ	投資証券	225,945	7,069.16 1,597,241,539	7,201.68 1,627,183,813	- -	3.02%
3	PUBLIC STORAGE アメリカ	投資証券	63,490	24,533.33 1,557,621,389	25,305.92 1,606,673,000	- -	2.98%
4	UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD オランダ	投資証券	57,161	24,148.48 1,380,351,656	23,931.96 1,367,974,822	- -	2.54%
5	AVALONBAY COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	58,584	18,783.78 1,100,429,499	18,947.66 1,110,029,795	- -	2.06%
6	EQUITY RESIDENTIAL アメリカ	投資証券	156,081	6,948.79 1,084,574,332	6,997.18 1,092,127,163	- -	2.03%
7	WELLTOWER INC アメリカ	投資証券	157,690	6,500.64 1,025,086,553	6,893.27 1,087,000,440	- -	2.02%
8	DIGITAL REALTY TRUST INC アメリカ	投資証券	87,306	11,859.24 1,035,382,942	12,202.51 1,065,352,390	- -	1.98%
9	VENTAS INC アメリカ	投資証券	151,067	6,086.24 919,431,194	6,349.41 959,187,468	- -	1.78%
10	LINK REIT 香港	投資証券	911,520	978.95 892,335,031	1,000.38 911,875,492	- -	1.69%
11	BOSTON PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	65,450	13,529.91 885,532,853	13,810.86 903,921,284	- -	1.68%
12	SCENTRE GROUP オーストラリア	投資信託受益 証券	2,257,894	353.83 798,930,023	356.29 804,470,472	- -	1.49%
13	ESSEX PROPERTY TRUST INC アメリカ	投資証券	28,013	25,933.85 726,485,182	26,042.11 729,517,868	- -	1.35%
14	HOST HOTELS & RESORTS INC アメリカ	投資証券	314,435	2,389.98 751,495,372	2,305.86 725,044,472	- -	1.35%
15	REALTY INCOME CORP アメリカ	投資証券	120,624	5,917.34 713,773,950	6,002.32 724,024,088	- -	1.34%
16	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT アメリカ	投資証券	43,696	13,972.14 610,526,901	13,965.62 610,241,888	- -	1.13%
17	GGP INC アメリカ	投資証券	268,389	2,293.30 615,498,915	2,264.96 607,891,584	- -	1.13%
18	VORNADO REALTY TRUST アメリカ	投資証券	73,430	8,084.20 593,622,995	8,144.58 598,057,038	- -	1.11%
19	EXTRA SPACE STORAGE INC アメリカ	投資証券	53,512	11,021.75 589,795,893	11,065.05 592,113,169	- -	1.10%
20	HCP INC アメリカ	投資証券	199,382	2,722.30 542,778,076	2,840.87 566,419,937	- -	1.05%
21	MID AMERICA アメリカ	投資証券	48,297	10,926.66 527,725,335	11,192.17 540,548,475	- -	1.00%
22	GOODMAN GROUP オーストラリア	投資信託受益 証券	680,263	804.23 547,088,170	782.38 532,225,798	- -	0.99%

23	DUKE REALTY TRUST アメリカ	投資証券	151,575	3,176.18 481,430,993	3,203.44 485,562,812	- -	0.90%
24	UDR INC アメリカ	投資証券	113,617	4,073.02 462,765,438	4,150.77 471,598,830	- -	0.88%
25	IRON MOUNTAIN INC アメリカ	投資証券	119,498	3,835.54 458,340,168	3,830.21 457,702,554	- -	0.85%
26	LAND SECURITIES GROUP PLC イギリス	投資証券	319,030	1,364.07 435,181,888	1,386.61 442,372,772	- -	0.82%
27	FEDERAL REALTY INVS TRUST アメリカ	投資証券	31,096	13,674.93 425,235,905	13,946.83 433,690,681	- -	0.81%
28	REGENCY CENTERS CORP アメリカ	投資証券	62,592	6,776.90 424,180,139	6,904.32 432,155,723	- -	0.80%
29	SL GREEN アメリカ	投資証券	37,556	11,076.07 415,972,998	11,142.43 418,465,176	- -	0.78%
30	SEGRO PLC イギリス	投資証券	428,700	954.36 409,138,236	960.36 411,709,238	- -	0.76%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成30年6月29日現在

種類	投資比率
投資信託受益証券	9.90%
投資証券	89.29%
合計	99.19%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年6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 0.875 09/15/19 アメリカ	国債証券	2,487,150,000	98.11 2,440,217,479	98.18 2,441,958,484	0.875000 2019/9/15	0.83%
2	US T N/B 1.375 05/31/20 アメリカ	国債証券	2,365,556,000	97.78 2,313,253,556	97.84 2,314,530,957	1.375000 2020/5/31	0.79%
3	US T N/B 3.625 02/15/20 アメリカ	国債証券	2,155,530,000	101.75 2,193,316,440	101.80 2,194,415,761	3.625000 2020/2/15	0.75%
4	US T N/B 1.75 05/31/22 アメリカ	国債証券	2,210,800,000	96.33 2,129,774,180	96.56 2,134,792,696	1.750000 2022/5/31	0.73%
5	US T N/B 2.125 08/31/20 アメリカ	国債証券	1,899,077,200	99.03 1,880,827,068	99.10 1,882,156,422	2.125000 2020/8/31	0.64%
6	US T N/B 2.375 12/31/20 アメリカ	国債証券	1,873,653,000	99.42 1,862,954,441	99.52 1,864,715,675	2.375000 2020/12/31	0.64%
7	US T N/B 1.0 11/30/19 アメリカ	国債証券	1,879,180,000	97.91 1,840,036,680	97.98 1,841,220,564	1.000000 2019/11/30	0.63%
8	US T N/B 1.375 01/31/21 アメリカ	国債証券	1,879,180,000	96.86 1,820,305,290	96.96 1,822,203,262	1.375000 2021/1/31	0.62%
9	US T N/B 1.0 11/15/19 アメリカ	国債証券	1,768,640,000	97.98 1,732,913,472	98.05 1,734,151,520	1.000000 2019/11/15	0.59%
10	US T N/B 1.625 11/15/22 アメリカ	国債証券	1,777,483,200	95.35 1,694,848,006	95.54 1,698,314,098	1.625000 2022/11/15	0.58%
11	US T N/B 1.625 08/15/22 アメリカ	国債証券	1,757,586,000	95.62 1,680,744,340	95.80 1,683,837,691	1.625000 2022/8/15	0.57%
12	US T N/B 1.75 05/15/22 アメリカ	国債証券	1,743,215,800	96.40 1,680,494,895	96.56 1,683,284,040	1.750000 2022/5/15	0.57%
13	US T N/B 1.75 09/30/22 アメリカ	国債証券	1,724,424,000	96.00 1,655,447,040	96.19 1,658,809,666	1.750000 2022/9/30	0.57%
14	US T N/B 2.25 12/31/24 アメリカ	国債証券	1,658,100,000	96.43 1,599,021,897	96.78 1,604,725,761	2.250000 2024/12/31	0.55%
15	US T N/B 1.75 06/30/22 アメリカ	国債証券	1,658,100,000	96.26 1,596,169,965	96.43 1,599,021,897	1.750000 2022/6/30	0.55%
16	US T N/B 1.125 12/31/19 アメリカ	国債証券	1,602,830,000	97.96 1,570,132,268	98.03 1,571,270,277	1.125000 2019/12/31	0.54%
17	US T N/B 2.0 02/15/23 アメリカ	国債証券	1,547,560,000	96.70 1,496,536,946	96.90 1,499,678,493	2.000000 2023/2/15	0.51%
18	US T N/B 2.625 08/15/20 アメリカ	国債証券	1,475,709,000	100.09 1,477,140,437	100.13 1,477,656,935	2.625000 2020/8/15	0.50%
19	US T N/B 1.125 07/31/21 アメリカ	国債証券	1,536,506,000	95.43 1,466,395,231	95.58 1,468,669,260	1.125000 2021/7/31	0.50%
20	US T N/B 2.125 12/31/22 アメリカ	国債証券	1,492,290,000	97.32 1,452,416,011	97.50 1,455,087,210	2.125000 2022/12/31	0.50%
21	US T N/B 2.25 01/31/24 アメリカ	国債証券	1,481,236,000	97.10 1,438,413,467	97.31 1,441,538,875	2.250000 2024/1/31	0.49%
22	US T N/B 1.875 03/31/22 アメリカ	国債証券	1,470,182,000	96.97 1,425,723,696	97.17 1,428,590,551	1.875000 2022/3/31	0.49%
23	US T N/B 1.5 06/15/20 アメリカ	国債証券	1,437,020,000	97.98 1,408,107,157	98.04 1,408,883,148	1.500000 2020/6/15	0.48%

24	US T N/B 2.0 08/31/21 アメリカ	国債証券	1,425,966,000	97.93 1,396,491,282	98.08 1,398,658,751	2.000000 2021/8/31	0.48%
25	US T N/B 2.0 09/30/20 アメリカ	国債証券	1,399,436,400	98.70 1,381,383,670	98.79 1,382,587,185	2.000000 2020/9/30	0.47%
26	US T N/B 2.125 09/30/24 アメリカ	国債証券	1,437,020,000	95.92 1,378,403,954	96.16 1,381,895,912	2.125000 2024/9/30	0.47%
27	US T N/B 2.0 07/31/20 アメリカ	国債証券	1,392,804,000	98.84 1,376,689,257	98.89 1,377,455,299	2.000000 2020/7/31	0.47%
28	US T N/B 2.375 08/15/24 アメリカ	国債証券	1,393,909,400	97.41 1,357,862,902	97.64 1,361,124,650	2.375000 2024/8/15	0.46%
29	US T N/B 2.25 11/15/24 アメリカ	国債証券	1,392,804,000	96.53 1,344,599,053	96.78 1,347,969,639	2.250000 2024/11/15	0.46%
30	US T N/B 1.25 10/31/19 アメリカ	国債証券	1,359,642,000	98.38 1,337,697,378	98.44 1,338,499,566	1.250000 2019/10/31	0.46%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成30年6月29日現在

種類	投資比率
国債証券	97.50%
合計	97.50%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

平成30年6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	589,800	5,624.07 3,317,079,267	5,340.11 3,149,596,878	- -	5.03%
2	ALIBABA GROUP HOLDING LTD- ADR ケイマン諸島	株式 インターネット ソフトウェア・サービス	119,580	19,907.76 2,380,570,756	20,823.52 2,490,077,143	- -	3.97%
3	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD 韓国	株式 コンピュータ・周辺機器	498,001	4,947.62 2,463,920,722	4,623.83 2,302,676,943	- -	3.67%
4	TAIWAN SEMICONDUCTOR 台湾	株式 半導体・半導 体製造装置	2,539,083	856.43 2,174,554,934	765.31 1,943,211,001	- -	3.10%
5	NASPERS LTD 南アフリカ	株式 メディア	45,339	24,334.14 1,103,285,665	26,239.99 1,189,695,196	- -	1.90%
6	CHINA CONSTRUCTION BANK 中国	株式 銀行	9,950,530	111.59 1,110,399,669	99.75 992,637,011	- -	1.58%
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	28,500	26,209.43 746,968,893	26,773.89 763,055,961	- -	1.22%
8	CHINA MOBILE LIMITED 香港	株式 無線通信サー ビス	631,500	1,023.74 646,494,659	974.32 615,285,290	- -	0.98%
9	IND & COMM BK OF CHINA - H 中国	株式 銀行	7,208,235	93.05 670,776,721	80.87 582,977,538	- -	0.93%
10	PING AN INSURANCE GROUP CO-H 中国	株式 保険	534,500	1,141.16 609,951,051	1,003.91 536,591,231	- -	0.86%
11	SK HYNIX INC 韓国	株式 半導体・半導 体製造装置	60,297	8,232.81 496,414,271	8,249.79 497,438,190	- -	0.79%
12	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP インド	株式 貯蓄・抵当・ 不動産金融	163,458	3,055.24 499,404,545	3,042.35 497,298,080	- -	0.79%
13	HON HAI PRECISION INDUSTRY 台湾	株式 電子装置・機 器・部品	1,698,532	312.78 531,271,844	290.60 493,601,891	- -	0.79%
14	VALE SA ブラジル	株式 金属・鉱業	328,721	1,328.90 436,838,805	1,403.89 461,489,012	- -	0.74%
15	RELIANCE INDUSTRIES LTD インド	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	294,501	1,531.67 451,080,582	1,530.81 450,827,726	- -	0.72%

16	BANK OF CHINA LTD 中国	株式 銀行	8,221,200	58.18 478,344,406	53.96 443,654,591	- -	0.71%
17	SBERBANK ADR ロシア	株式 銀行	285,840	1,571.38 449,165,637	1,509.97 431,611,654	- -	0.69%
18	INFOSYS LTD インド	株式 情報技術サー ビス	181,118	1,836.75 332,670,040	2,089.15 378,383,031	- -	0.60%
19	ITAU UNIBANCO HOLDING SA ブラジル	株式 銀行	332,598	1,432.52 476,454,420	1,134.38 377,294,681	- -	0.60%
20	CNOOC LTD 香港	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	1,841,000	176.71 325,333,475	189.93 349,667,021	- -	0.56%
21	LUKOIL SPON ADR ロシア	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	45,656	7,061.78 322,412,687	7,417.23 338,641,235	- -	0.54%
22	SAMSUNG ELECTRONICS-PFD 韓国	株式 コンピュー タ・周辺機器	88,502	4,009.81 354,876,974	3,675.35 325,276,710	- -	0.52%
23	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	75,000	4,391.96 329,397,282	4,303.32 322,749,165	- -	0.52%
24	AMERICA MOVIL SAB DE CV メキシコ	株式 無線通信サー ビス	3,464,878	99.09 343,354,701	92.17 319,378,594	- -	0.51%
25	TATA CONSULTANCY SERVICES LTD インド	株式 情報技術サー ビス	95,006	2,586.82 245,763,523	2,985.17 283,609,441	- -	0.45%
26	GAZPROM PAO ADR ロシア	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	575,700	503.86 290,075,405	478.63 275,552,011	- -	0.44%
27	BANCO BRADESCO SA PREF ブラジル	株式 銀行	353,825	954.24 337,634,508	755.59 267,346,667	- -	0.43%
28	POSCO 韓国	株式 金属・鉱業	8,177	33,206.65 271,530,805	31,813.59 260,139,807	- -	0.42%
29	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL COR 中国	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	2,603,200	104.01 270,778,741	98.34 256,020,034	- -	0.41%
30	AMBEV SA ブラジル	株式 飲料	491,095	655.00 321,669,461	515.26 253,044,605	- -	0.40%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成30年6月29日現在

種類	投資比率
株式	93.01%
投資信託受益証券	0.49%
投資証券	0.17%
合計	93.68%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

平成30年6月29日現在

業種	国内/外国	投資比率
銀行	外国	14.72%
インターネットソフトウェア・サービス		11.60%
石油・ガス・消耗燃料		6.67%
コンピュータ・周辺機器		5.09%
半導体・半導体製造装置		4.96%
保険		3.35%
金属・鉱業		3.03%
無線通信サービス		2.81%
電子装置・機器・部品		2.57%
不動産管理・開発		2.38%
化学		2.36%
メディア		2.30%
自動車		1.99%
食品・生活必需品小売り		1.73%
情報技術サービス		1.68%
食品		1.58%
医薬品		1.50%
コングロマリット		1.40%
各種電気通信サービス		1.22%
資本市場		1.09%
各種金融サービス		1.08%
インターネット販売・通信販売		0.94%
貯蓄・抵当・不動産金融		0.91%
電力		0.90%
飲料		0.86%
建設資材		0.85%
運送インフラ		0.83%
パーソナル用品		0.82%
機械		0.75%
ホテル・レストラン・レジャー		0.71%
建設・土木		0.70%
バイオテクノロジー		0.63%
繊維・アパレル・贅沢品		0.59%
ガス		0.59%
自動車部品		0.58%
複合小売り		0.57%
タバコ		0.55%
各種消費者サービス		0.54%

独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.51%
紙製品・林産品	0.49%
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	0.45%
専門小売り	0.41%
家庭用品	0.41%
家庭用耐久財	0.37%
ソフトウェア	0.31%
旅客航空輸送業	0.26%
ライフサイエンス・ツール/サービス	0.25%
消費者金融	0.24%
陸運・鉄道	0.21%
水道	0.21%
エクイティ不動産投資信託(REITs)	0.20%
電気設備	0.17%
航空宇宙・防衛	0.16%
商業サービス・用品	0.11%
海運業	0.11%
ヘルスケア機器・用品	0.09%
エネルギー設備・サービス	0.09%
容器・包装	0.07%
レジャー用品	0.07%
ヘルスケア・テクノロジー	0.06%
総合公益事業	0.06%
航空貨物・物流サービス	0.05%
商社・流通業	0.04%
販売	0.04%
専門サービス	0.04%
通信機器	0.04%
建設関連製品	0.03%
合計	93.01%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

平成30年6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 5.25 06/23/47 ロシア	国債証券	2,652,960,000	96.09 2,549,407,233	95.36 2,529,995,304	5.250000 2047/6/23	2.37%
2	RUSSIA FOREIGN BOND 5.0 04/29/20 ロシア	国債証券	1,790,748,000	102.18 1,829,934,651	102.42 1,834,137,824	5.000000 2020/4/29	1.72%
3	BRAZIL 4.25 01/07/25 ブラジル	国債証券	1,757,586,000	99.53 1,749,348,006	94.62 1,663,115,752	4.250000 2025/1/7	1.56%
4	PERU 5.625 11/18/50 ペルー	国債証券	1,414,912,000	120.58 1,706,159,475	116.29 1,645,471,910	5.625000 2050/11/18	1.54%
5	COLOMBIA 5.0 06/15/45 コロンビア	国債証券	1,591,776,000	101.70 1,618,946,732	98.00 1,559,940,480	5.000000 2045/6/15	1.46%
6	UNITED MEXICAN STATES 4.75 03/08/44 メキシコ	国債証券	1,613,884,000	97.73 1,577,405,800	93.75 1,513,016,250	4.750000 2044/3/8	1.42%
7	UNITED MEXICAN STATES 6.05 01/11/40 メキシコ	国債証券	1,315,426,000	113.92 1,498,599,070	110.50 1,453,545,730	6.050000 2040/1/11	1.36%
8	RUSSIAN FEDERATION 03/31/30 ロシア	国債証券	1,274,028,770	112.00 1,426,994,418	109.73 1,398,119,172	7.500000 2030/3/31	1.31%
9	PERU 7.35 07/21/25 ペルー	国債証券	1,149,616,000	124.27 1,428,729,500	121.56 1,397,588,171	7.350000 2025/7/21	1.31%
10	PANAMA 6.7 01/26/36 パナマ	国債証券	1,039,076,000	125.73 1,306,461,206	121.65 1,264,035,954	6.700000 2036/1/26	1.19%
11	RUSSIAN FEDERATION 4.75 05/27/26 ロシア	国債証券	1,193,832,000	100.65 1,201,639,661	99.73 1,190,632,530	4.750000 2026/5/27	1.12%
12	UNITED MEXICAN STATES 4.0 10/02/23 メキシコ	国債証券	1,182,778,000	102.53 1,212,785,077	100.48 1,188,538,128	4.000000 2023/10/2	1.12%
13	TURKEY 6.0 03/25/27 トルコ	国債証券	1,260,156,000	100.38 1,264,983,945	93.50 1,178,296,266	6.000000 2027/3/25	1.11%
14	UNITED MEXICAN STATES 4.15 03/28/27 メキシコ	国債証券	1,193,832,000	100.88 1,204,443,840	98.60 1,177,118,352	4.150000 2027/3/28	1.10%
15	TURKEY 7.375 02/05/25 トルコ	国債証券	1,138,562,000	109.41 1,245,769,219	103.19 1,174,939,055	7.375000 2025/2/5	1.10%
16	UNITED MEXICAN STATES 5.55 01/21/45 メキシコ	国債証券	1,105,400,000	109.77 1,213,497,287	104.87 1,159,288,250	5.550000 2045/1/21	1.09%
17	RUSSIAN FEDERATION 4.875 09/16/23 ロシア	国債証券	1,105,400,000	102.98 1,138,450,133	103.68 1,146,178,206	4.875000 2023/9/16	1.08%
18	COLOMBIA 4.375 07/12/21 コロンビア	国債証券	1,105,400,000	103.42 1,143,259,950	102.02 1,127,784,350	4.375000 2021/7/12	1.06%

19	INDONESIA 4.125 01/15/25 インドネシア	国債証券	1,127,508,000	101.07 1,139,685,086	98.28 1,108,216,338	4.125000 2025/1/15	1.04%
20	BRAZIL 4.625 01/13/28 ブラジル	国債証券	1,215,940,000	94.63 1,150,666,130	90.67 1,102,553,595	4.625000 2028/1/13	1.03%
21	COLOMBIA 6.125 01/18/41 コロンビア	国債証券	972,752,000	115.11 1,119,770,200	111.75 1,087,050,360	6.125000 2041/1/18	1.02%
22	PHILIPPINES 9.5 02/02/30 フィリピン	国債証券	729,564,000	149.81 1,092,996,306	146.09 1,065,834,638	9.500000 2030/2/2	1.00%
23	RUSSIAN FEDERATION 5.625 04/04/42 ロシア	国債証券	1,016,968,000	104.48 1,062,568,845	103.93 1,057,026,369	5.625000 2042/4/4	0.99%
24	COLOMBIA 5.625 02/26/44 コロンビア	国債証券	994,860,000	109.44 1,088,807,946	105.75 1,052,064,450	5.625000 2044/2/26	0.99%
25	BRAZIL 5.0 01/27/45 ブラジル	国債証券	1,326,480,000	88.20 1,170,067,447	79.00 1,047,919,200	5.000000 2045/1/27	0.98%
26	UNITED MEXICAN STATES 4.6 01/23/46 メキシコ	国債証券	1,127,508,000	95.84 1,080,627,986	92.05 1,037,871,114	4.600000 2046/1/23	0.97%
27	RUSSIAN FEDERATION 4.25 06/23/27 ロシア	国債証券	1,083,292,000	96.37 1,044,038,803	95.73 1,037,143,760	4.250000 2027/6/23	0.97%
28	UNITED MEXICAN STATES 4.125 01/21/26 メキシコ	国債証券	1,039,076,000	101.42 1,053,899,414	99.32 1,032,062,237	4.125000 2026/1/21	0.97%
29	HUNGARY 6.375 03/29/21 ハンガリー	国債証券	950,644,000	108.67 1,033,093,354	106.99 1,017,179,573	6.375000 2021/3/29	0.95%
30	RUSSIAN FEDERATION 4.5 04/04/22 ロシア	国債証券	994,860,000	101.21 1,006,897,806	101.75 1,012,279,998	4.500000 2022/4/4	0.95%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成30年6月29日現在

種類	投資比率
国債証券	96.01%
合計	96.01%

(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30年6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07月	売建	55,320,000	6,040,944,000	6,111,753,600	37.82%
		香港・ドル売/円買2018年07月	売建	41,550,000	578,376,000	585,024,000	3.62%
		ユーロ売/円買2018年07月	売建	3,430,000	442,675,800	438,697,000	2.71%
		イギリス・ポンド売/円買2018年07月	売建	1,860,000	272,750,400	268,881,600	1.66%
		オーストラリア・ドル売/円買2018年07月	売建	2,170,000	180,283,600	176,008,700	1.09%
		南アフリカ・ランド売/円買2018年07月	売建	16,470,000	137,195,100	131,760,000	0.82%
		カナダ・ドル売/円買2018年07月	売建	1,450,000	122,264,000	120,857,500	0.75%
		スイス・フラン売/円買2018年07月	売建	650,000	72,228,000	72,072,000	0.45%
		シンガポール・ドル売/円買2018年07月	売建	830,000	67,977,000	67,030,800	0.41%
		メキシコ・ペソ売/円買2018年07月	売建	10,930,000	58,475,500	61,098,700	0.38%
		スウェーデン・クローナ売/円買2018年07月	売建	2,020,000	25,391,400	24,724,800	0.15%
		デンマーク・クローネ売/円買2018年07月	売建	930,000	16,107,600	15,958,800	0.10%
		ニュージーランド・ドル売/円買2018年07月	売建	120,000	9,225,600	8,943,600	0.06%
		ノルウェー・クローネ売/円買2018年07月	売建	490,000	6,644,400	6,610,100	0.04%
イスラエル・シケル売/円買2018年07月	売建	130,000	3,985,800	3,927,300	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30年6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07月	売建	219,530,000	23,972,676,000	24,253,674,400	38.22%
		香港・ドル売/円買2018年07月	売建	163,640,000	2,277,868,800	2,304,051,200	3.63%
		ユーロ売/円買2018年07月	売建	13,770,000	1,777,156,200	1,761,183,000	2.78%
		イギリス・ポンド売/円買2018年07月	売建	7,490,000	1,098,333,600	1,082,754,400	1.71%
		オーストラリア・ドル売/円買2018年07月	売建	8,750,000	726,950,000	709,712,500	1.12%
		南アフリカ・ランド売/円買2018年07月	売建	64,660,000	538,617,800	517,280,000	0.82%
		カナダ・ドル売/円買2018年07月	売建	5,840,000	492,428,800	486,764,000	0.77%
		スイス・フラン売/円買2018年07月	売建	2,620,000	291,134,400	290,505,600	0.46%
		シンガポール・ドル売/円買2018年07月	売建	3,380,000	276,822,000	272,968,800	0.43%
		メキシコ・ペソ売/円買2018年07月	売建	42,900,000	229,515,000	239,811,000	0.38%
		スウェーデン・クローナ売/円買2018年07月	売建	8,090,000	101,691,300	99,021,600	0.16%
		デンマーク・クローネ売/円買2018年07月	売建	3,740,000	64,776,800	64,178,400	0.10%
		ニュージーランド・ドル売/円買2018年07月	売建	470,000	36,133,600	35,029,100	0.06%
		ノルウェー・クローネ売/円買2018年07月	売建	1,960,000	26,577,600	26,440,400	0.04%
		イスラエル・シェケル売/円買2018年07月	売建	510,000	15,636,600	15,407,100	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30年6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07月	買建	652,000	72,054,476	72,046,000	0.02%
		イギリス・ポンド買/ 円売2018年07月	買建	49,000	7,084,567	7,083,930	0.00%
株価指数先物 取引	シカゴ商品 取引所	S&P500 EMI NI FUT Sep 18	買建	412	6,306,628,947	6,192,638,718	2.02%
	EUREX 取引所	DJ EURO ST OXX 50 Sep 18	買建	367	1,609,987,820	1,573,058,924	0.51%
	ICE-E EU	FTSE 100 I NDEX FUTUR E Sep18	買建	58	639,250,463	633,243,472	0.21%
	モン トリ オール 取引 所	S&P/TSE 6 0 IX FUT S ep18	買建	21	335,121,060	335,072,694	0.11%
	シド ニー 先 物 取引 所	SPI 200 FU TURES Sep1 8	買建	19	232,612,676	237,936,772	0.08%

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

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

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

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年6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	-	シンガポール・ドル 買/円売2018年0 7月	買建	246,000	19,829,568	19,869,420	0.04%

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

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

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年6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07月	売建	1,176,825,900	129,380,239,446	130,027,493,691	44.32%
		ユーロ売/円買2018年07月	売建	921,432,000	117,703,723,680	117,851,152,800	40.17%
		イギリス・ポンド売/円買2018年07月	売建	141,636,300	20,659,070,718	20,474,943,528	6.98%
		オーストラリア・ドル売/円買2018年07月	売建	75,736,700	6,152,849,508	6,143,761,104	2.09%
		カナダ・ドル売/円買2018年07月	売建	73,130,600	6,044,975,396	6,096,166,816	2.08%
		メキシコ・ペソ売/円買2018年07月	売建	433,272,500	2,339,671,500	2,421,993,275	0.83%
		ポーランド・ズロチ売/円買2018年07月	売建	59,518,800	1,755,209,412	1,743,900,840	0.59%
		南アフリカ・ランド売/円買2018年07月	売建	213,408,600	1,722,207,402	1,709,402,886	0.58%
		デンマーク・クローネ売/円買2018年07月	売建	92,474,800	1,585,018,072	1,586,867,568	0.54%
		マレーシア・リンギット売/円買2018年07月	売建	42,570,000	1,167,269,400	1,162,586,700	0.40%
		シンガポール・ドル売/円買2018年07月	売建	12,090,500	979,330,500	976,428,780	0.33%
		スウェーデン・クローナ売/円買2018年07月	売建	77,933,700	964,819,206	953,908,488	0.33%
		ノルウェー・クローネ売/円買2018年07月	売建	51,414,400	696,150,976	693,580,256	0.24%

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

為替予約取引の数量は、現地通貨建契約金額です。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

平成30年6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	-	南アフリカ・ランド 買/円売2018年0 7月	買建	14,700,000	116,791,321	117,747,000	0.19%
		アメリカ・ドル買/円 売2018年07月	買建	579,000	63,987,027	63,979,500	0.10%
		アメリカ・ドル売/円 買2018年07月	売建	1,061,256	116,791,321	117,279,500	0.19%
株価指数先物 取引	ICE-US	MINI MSCI EMG MKT Sep 18	買建	685	4,204,894,620	3,955,607,576	6.31%

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

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

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

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

平成30年6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07月	買建	2,100,000	231,048,300	232,071,000	0.22%
		アメリカ・ドル売/円 買2018年07月	売建	1,900,000	209,974,700	209,950,000	0.20%

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

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

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

直近日(平成30年6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
第3計算期間末 (平成30年6月11日)	16,409	16,409	1.0376	1.0376
平成29年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	-
平成30年1月末日	14,929	-	1.0620	-
2月末日	15,071	-	1.0427	-
3月末日	15,824	-	1.0408	-
4月末日	15,766	-	1.0338	-
5月末日	16,239	-	1.0350	-
6月末日	16,161	-	1.0284	-

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
第3計算期間末 (平成30年6月11日)	64,853	64,853	1.0356	1.0356
平成29年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	-
平成30年1月末日	55,253	-	1.0620	-
2月末日	58,214	-	1.0422	-
3月末日	62,334	-	1.0396	-
4月末日	64,184	-	1.0325	-
5月末日	64,740	-	1.0330	-
6月末日	63,462	-	1.0266	-

【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
第3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
第3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
第3計算期間	1.6

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

なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

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
第3計算期間	1.8

(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
第3計算期間	4,414,882,467	1,581,611,324

(注1) 本邦外における設定及び解約はございません。

(注2) 第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)

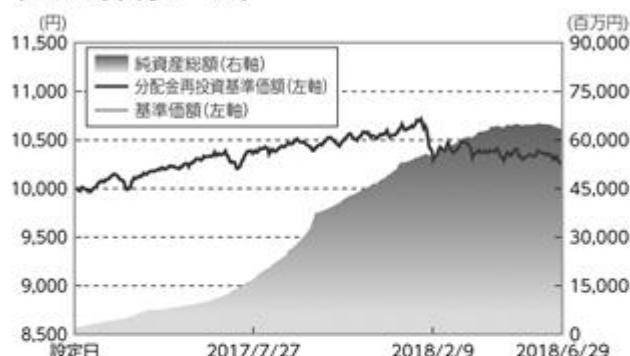
	設定口数	解約口数
第1計算期間	10,404,764,520	356,726,722
第2計算期間	37,154,151,069	2,394,963,569
第3計算期間	23,144,363,900	5,324,740,324

(注1) 本邦外における設定及び解約はございません。

(注2) 第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

<< 参考情報 >>

データの基準日:2018年6月29日

基準価額・純資産の推移 (2017年1月18日～2018年6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
第3期	(2018.06.11)	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
第3期	(2018.06.11)	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	49.86%
2	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	15.07%
3	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	13.87%
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	10.37%
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	9.97%
6	XTRACKERS MSCI EMERGING MARKETS HEDGED EQUITY ETF	投資信託受益証券	アメリカ	0.21%

(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	49.71%
2	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	15.35%
3	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	13.87%
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	10.74%
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	10.07%
6	XTRACKERS MSCI EMERGING MARKETS HEDGED EQUITY ETF	投資信託受益証券	アメリカ	0.08%

○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 0.875 09/15/19	国債証券	アメリカ	0.875000	2019/9/15	0.83%
2	US T N/B 1.375 05/31/20	国債証券	アメリカ	1.375000	2020/5/31	0.79%
3	US T N/B 3.625 02/15/20	国債証券	アメリカ	3.625000	2020/2/15	0.75%
4	US T N/B 1.75 05/31/22	国債証券	アメリカ	1.750000	2022/5/31	0.73%
5	US T N/B 2.125 08/31/20	国債証券	アメリカ	2.125000	2020/8/31	0.64%

■エマージング債券パッシブ・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還期限	比率
1	RUSSIAN FEDERATION 5.25 06/23/47	国債証券	ロシア	5.250000	2047/6/23	2.37%
2	RUSSIA FOREIGN BOND 5.0 04/29/20	国債証券	ロシア	5.000000	2020/4/29	1.72%
3	BRAZIL 4.25 01/07/25	国債証券	ブラジル	4.250000	2025/1/7	1.56%
4	PERU 5.625 11/18/50	国債証券	ペルー	5.625000	2050/11/18	1.54%
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	2.52%
2	MICROSOFT CORP	株式	アメリカ	ソフトウェア	1.93%
3	AMAZON.COM INC	株式	アメリカ	インターネット販売・通信販売	1.87%
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	1.25%
5	JPMORGAN CHASE & CO	株式	アメリカ	銀行	0.96%

○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。

■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	5.03%
2	ALIBABA GROUP HOLDING LTD-ADR	株式	ケイマン諸島	インターネットソフトウェア・サービス	3.97%
3	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	株式	韓国	コンピュータ・周辺機器	3.67%
4	TAIWAN SEMICONDUCTOR	株式	台湾	半導体・半導体製造装置	3.10%
5	NASPERS LTD	株式	南アフリカ	メディア	1.90%

■外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

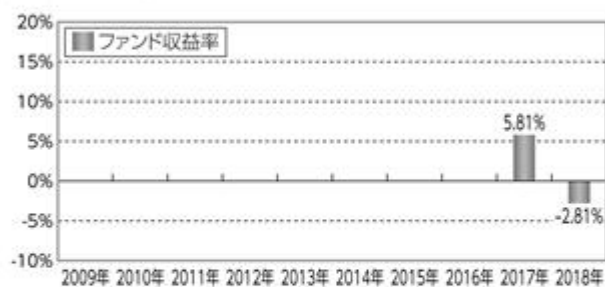
※比率(%)は、当該マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

組入上位5銘柄

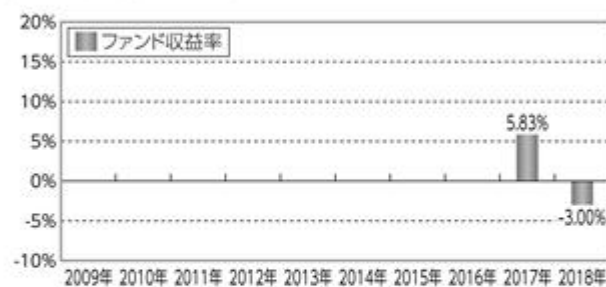
順位	銘柄名	種類	国/地域	比率
1	SIMON PROPERTY GROUP INC	投資証券	アメリカ	4.61%
2	PROLOGIS INC	投資証券	アメリカ	3.02%
3	PUBLIC STORAGE	投資証券	アメリカ	2.98%
4	UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	投資証券	オランダ	2.54%
5	AVALONBAY COMMUNITIES INC	投資証券	アメリカ	2.06%

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、および2018年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

※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1万口当たりには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發します。
- c. 上記b.の書面決議において、受益者(委託会社およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。イ.償還規定c.において同じ。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行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であっても、当該併合にかかる一または複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。
- h. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて約款を変更しようとするときは、上記a.からg.の規定にしたがいます。
- i. この信託は、受益者が一部解約請求を行ったときは、委託会社が信託契約の一部の解約をすることにより当該請求に応じ、当該受益権の公正な価格が当該受益者に一部解約金として支払われることとなる委託者指図型投資信託に該当するため、重大な約款の変更等を行う場合において、投資信託及び投資法人に関する法律第18条第1項に定める反対受益者による受益権買取請求の規定の適用を受けません。

八．関係法人との契約の更改

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

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) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第3期計算期間(平成29年12月12日から平成30年6月11日まで)の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

1【財務諸表】

【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2期 平成29年12月11日現在	第3期 平成30年6月11日現在
資産の部		
流動資産		
預金	669,862	1,082,483
コール・ローン	652,491,324	415,732,600
投資信託受益証券	35,778,270	35,258,357
親投資信託受益証券	13,125,627,549	16,098,227,476
派生商品評価勘定	768,417	3,981,690
流動資産合計	13,815,335,422	16,554,282,606
資産合計	13,815,335,422	16,554,282,606
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	57,056,532	44,815,362
未払解約金	11,101,019	6,951,101
未払受託者報酬	1,644,632	2,466,352
未払委託者報酬	60,305,156	90,434,855
その他未払費用	246,609	329,045
流動負債合計	130,353,948	144,996,715
負債合計	130,353,948	144,996,715
純資産の部		
元本等		
元本	1 12,980,928,058	1 15,814,199,201
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	704,053,416	595,086,690
（分配準備積立金）	332,977,883	405,405,842
元本等合計	13,684,981,474	16,409,285,891
純資産合計	13,684,981,474	16,409,285,891
負債純資産合計	13,815,335,422	16,554,282,606

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第2期 自 平成29年6月13日 至 平成29年12月11日	第3期 自 平成29年12月12日 至 平成30年6月11日
営業収益		
受取配当金	43,478	434,118
受取利息	1,640	3,493
有価証券売買等損益	447,961,990	319,685,187
為替差損益	179,390,735	165,147,191
営業収益合計	268,616,373	154,100,385
営業費用		
支払利息	113,336	211,898
受託者報酬	1,644,632	2,466,352
委託者報酬	60,305,156	90,434,855
その他費用	580,584	666,670
営業費用合計	62,643,708	93,779,775
営業利益又は営業損失()	205,972,665	247,880,160
経常利益又は経常損失()	205,972,665	247,880,160
当期純利益又は当期純損失()	205,972,665	247,880,160
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()	7,205,550	16,889,839
期首剰余金又は期首欠損金()	197,924,721	704,053,416
剰余金増加額又は欠損金減少額	334,086,600	207,192,123
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	334,086,600	207,192,123
剰余金減少額又は欠損金増加額	26,725,020	85,168,528
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	26,725,020	85,168,528
分配金	1 -	1 -
期末剰余金又は期末欠損金()	704,053,416	595,086,690

(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</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	第2期 平成29年12月11日現在	第3期 平成30年6月11日現在
1. 1 期首元本額	5,806,408,586円	12,980,928,058円
期中追加設定元本額	7,912,713,431円	4,414,882,467円
期中一部解約元本額	738,193,959円	1,581,611,324円
2. 受益権の総数	12,980,928,058口	15,814,199,201口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第2期 自 平成29年6月13日 至 平成29年12月11日	第3期 自 平成29年12月12日 至 平成30年6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（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）であります。なお、分配を行っておりません。なお、分配金の計算過程においては、親投資信託の配当等収益及び収益調整金相当額を充当する方法によっております。</p>	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（106,650,325円）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（369,860,701円）及び分配準備積立金（298,755,517円）より分配対象収益は775,266,543円（1万口当たり490.23円）であります。なお、分配を行っておりません。なお、分配金の計算過程においては、親投資信託の配当等収益及び収益調整金相当額を充当する方法によっております。</p>

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	第2期 自 平成29年6月13日 至 平成29年12月11日	第3期 自 平成29年12月12日 至 平成30年6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2期 平成29年12月11日現在	第3期 平成30年6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2期 平成29年12月11日現在	第3期 平成30年6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	3,113,783	814,886
親投資信託受益証券	443,406,771	319,260,086
合計	446,520,554	318,445,200

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	第2期 平成29年12月11日 現在				第3期 平成30年6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	5,902,896,085	-	5,959,184,200	56,288,115	7,993,690,528	-	8,034,524,200	40,833,672
アメリカ・ドル	4,470,207,360	-	4,517,856,000	47,648,640	6,011,679,720	-	6,040,944,000	29,264,280
イギリス・ポンド	165,978,878	-	165,865,300	113,578	269,136,420	-	272,750,400	3,613,980
イスラエル・シケル	2,251,970	-	2,254,700	2,730	3,975,270	-	3,985,800	10,530
オーストラリア・ドル	140,127,900	-	140,580,000	452,100	178,441,270	-	180,283,600	1,842,330
カナダ・ドル	74,921,480	-	75,903,600	982,120	121,875,400	-	122,264,000	388,600
シンガポール・ドル	49,960,680	-	50,292,000	331,320	67,449,950	-	67,977,000	527,050
スイス・フラン	42,371,956	-	42,405,700	33,744	71,881,550	-	72,228,000	346,450
スウェーデン・クローナ	14,518,872	-	14,526,000	7,128	24,931,446	-	25,391,400	459,954
デンマーク・クローネ	9,543,975	-	9,534,700	9,275	15,916,392	-	16,107,600	191,208
ニュージーランド・ドル	6,134,400	-	6,212,800	78,400	9,151,080	-	9,225,600	74,520
ノルウェー・クローネ	3,381,850	-	3,417,500	35,650	6,518,960	-	6,644,400	125,440
メキシコ・ペソ	56,330,658	-	56,049,000	281,658	59,360,830	-	58,475,500	885,330
ユーロ	277,412,706	-	277,048,800	363,906	436,865,380	-	442,675,800	5,810,420
香港・ドル	464,960,080	-	470,045,500	5,085,420	576,215,400	-	578,376,000	2,160,600
南アフリカ・ランド	124,793,320	-	127,192,600	2,399,280	140,291,460	-	137,195,100	3,096,360
合計	5,902,896,085	-	5,959,184,200	56,288,115	7,993,690,528	-	8,034,524,200	40,833,672

(注) 時価の算定方法

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

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

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

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	第2期 平成29年12月11日現在	第3期 平成30年6月11日現在
1口当たり純資産額	1.0542円	1.0376円
(1万口当たり純資産額)	(10,542円)	(10,376円)

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

平成30年6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	322,259.000	
	アメリカ・ドル	小計	13,300.000	322,259.000 (35,258,357)	
投資信託受益証券 合計			13,300	35,258,357 (35,258,357)	
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	708,384,105	2,474,881,547	
		外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	1,383,436,091	1,644,352,137	
		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	6,071,699,281	7,988,534,744	
		エマージング株式パッシブ・マザーファンド	1,964,816,977	2,404,150,053	
		エマージング債券パッシブ・マザーファンド	900,646,679	1,586,308,995	
	日本円	小計	11,028,983,133	16,098,227,476	
親投資信託受益証券 合計			11,028,983,133	16,098,227,476	
合計				16,133,485,833 (35,258,357)	

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	0.21%	0.22%

(注) 「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

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

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) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第3期計算期間(平成29年12月12日から平成30年6月11日まで)の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

【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2期 平成29年12月11日現在	第3期 平成30年6月11日現在
資産の部		
流動資産		
預金	700,905	1,348,440
コール・ローン	681,762,957	1,239,666,781
投資信託受益証券	55,146,958	54,345,588
親投資信託受益証券	46,899,621,258	64,209,961,157
派生商品評価勘定	2,659,686	15,630,980
流動資産合計	47,639,891,764	65,520,952,946
資産合計	47,639,891,764	65,520,952,946
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	196,957,663	178,502,707
未払解約金	24,455,982	130,126,163
未払受託者報酬	4,628,738	9,501,332
未払委託者報酬	169,721,898	348,383,792
その他未払費用	694,236	849,707
流動負債合計	396,458,517	667,363,701
負債合計	396,458,517	667,363,701
純資産の部		
元本等		
元本	1 44,807,225,298	1 62,626,848,874
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	2,436,207,949	2,226,740,371
(分配準備積立金)	785,159,838	1,108,577,842
元本等合計	47,243,433,247	64,853,589,245
純資産合計	47,243,433,247	64,853,589,245
負債純資産合計	47,639,891,764	65,520,952,946

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第2期 自 平成29年6月13日 至 平成29年12月11日	第3期 自 平成29年12月12日 至 平成30年6月11日
営業収益		
受取配当金	67,015	669,131
受取利息	1,979	4,553
有価証券売買等損益	1,306,260,747	1,331,204,074
為替差損益	529,495,994	614,155,766
営業収益合計	776,833,747	716,374,624
営業費用		
支払利息	305,997	1,270,549
受託者報酬	4,628,738	9,501,332
委託者報酬	169,721,898	348,383,792
その他費用	1,028,211	1,187,332
営業費用合計	175,684,844	360,343,005
営業利益又は営業損失()	601,148,903	1,076,717,629
経常利益又は経常損失()	601,148,903	1,076,717,629
当期純利益又は当期純損失()	601,148,903	1,076,717,629
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()	21,862,312	35,997,310
期首剰余金又は期首欠損金()	338,824,021	2,436,207,949
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,608,770,611	1,117,789,481
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,608,770,611	1,117,789,481
剰余金減少額又は欠損金増加額	90,673,274	286,536,740
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	90,673,274	286,536,740
分配金	1 -	1 -
期末剰余金又は期末欠損金()	2,436,207,949	2,226,740,371

(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</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	第2期 平成29年12月11日現在	第3期 平成30年6月11日現在
1. 1 期首元本額	10,048,037,798円	44,807,225,298円
期中追加設定元本額	37,154,151,069円	23,144,363,900円
期中一部解約元本額	2,394,963,569円	5,324,740,324円
2. 受益権の総数	44,807,225,298口	62,626,848,874口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第2期 自 平成29年6月13日 至 平成29年12月11日	第3期 自 平成29年12月12日 至 平成30年6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（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）であります。なお、分配を行っておりません。なお、分配金の計算過程においては、親投資信託の配当等収益及び収益調整金相当額を充当する方法によっております。</p>	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（394,870,678円）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（1,659,263,499円）及び分配準備積立金（713,707,164円）より分配対象収益は2,767,841,341円（1万口当たり441.96円）であります。なお、分配を行っておりません。なお、分配金の計算過程においては、親投資信託の配当等収益及び収益調整金相当額を充当する方法によっております。</p>

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	第2期 自 平成29年6月13日 至 平成29年12月11日	第3期 自 平成29年12月12日 至 平成30年6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2期 平成29年12月11日現在	第3期 平成30年6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2期 平成29年12月11日現在	第3期 平成30年6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	4,799,440	1,256,027
親投資信託受益証券	1,300,794,914	838,196,168
合計	1,305,594,354	836,940,141

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	第2期 平成29年12月11日 現在				第3期 平成30年6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	20,980,051,623	-	21,174,349,600	194,297,977	31,763,446,773	-	31,926,318,500	162,871,727
アメリカ・ドル	15,932,885,000	-	16,097,130,000	164,245,000	23,856,544,630	-	23,972,676,000	116,131,370
イギリス・ポンド	589,328,133	-	588,897,900	430,233	1,083,780,530	-	1,098,333,600	14,553,070
イスラエル・シケル	7,721,040	-	7,730,400	9,360	15,595,290	-	15,636,600	41,310
オーストラリア・ドル	496,793,075	-	498,420,000	1,626,925	719,521,250	-	726,950,000	7,428,750
カナダ・ドル	253,513,380	-	256,836,600	3,323,220	490,863,680	-	492,428,800	1,565,120
シンガポール・ドル	169,866,312	-	170,992,800	1,126,488	274,675,700	-	276,822,000	2,146,300
スイス・フラン	143,148,500	-	143,262,500	114,000	289,737,940	-	291,134,400	1,396,460
スウェーデン・クローナ	49,471,712	-	49,496,000	24,288	99,849,207	-	101,691,300	1,842,093
デンマーク・クローネ	32,233,425	-	32,202,100	31,325	64,007,856	-	64,776,800	768,944
ニュージーランド・ドル	20,703,600	-	20,968,200	264,600	35,841,730	-	36,133,600	291,870
ノルウェー・クローネ	11,633,564	-	11,756,200	122,636	26,075,840	-	26,577,600	501,760
メキシコ・ペソ	193,150,770	-	192,185,000	965,770	232,989,900	-	229,515,000	3,474,900
ユーロ	984,786,800	-	983,724,000	1,062,800	1,753,829,820	-	1,777,156,200	23,326,380
香港・ドル	1,667,046,232	-	1,684,753,500	17,707,268	2,269,359,520	-	2,277,868,800	8,509,280
南アフリカ・ランド	427,770,080	-	435,994,400	8,224,320	550,773,880	-	538,617,800	12,156,080
合計	20,980,051,623	-	21,174,349,600	194,297,977	31,763,446,773	-	31,926,318,500	162,871,727

(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2期 平成29年12月11日現在	第3期 平成30年6月11日現在
1口当たり純資産額	1.0544円	1.0356円
(1万口当たり純資産額)	(10,544円)	(10,356円)

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

平成30年6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	496,715.000	
	アメリカ・ドル 小計		20,500.000	496,715.000 (54,345,588)	
投資信託受益証券 合計			20,500	54,345,588 (54,345,588)	
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	2,833,633,500	9,899,865,358	
		外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	5,622,314,658	6,682,683,202	
		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	24,248,058,692	31,903,170,821	
		エマージング株式パッシブ・マザーファンド	7,712,821,183	9,437,407,999	
		エマージング債券パッシブ・マザーファンド	3,569,428,137	6,286,833,777	
日本円 小計			43,986,256,170	64,209,961,157	
親投資信託受益証券 合計			43,986,256,170	64,209,961,157	
合計				64,264,306,745 (54,345,588)	

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	0.08%	0.08%

(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12月11日現在	平成30年6月11日現在
資産の部			
流動資産			
預金		2,638,514,373	6,169,818,668
コール・ローン		666,266,222	196,389,443
株式		287,108,328,050	296,035,690,571
投資信託受益証券		793,144,760	727,971,227
投資証券		6,644,534,459	6,419,206,855
派生商品評価勘定		101,588,426	208,862,507
未収入金		-	116,881,508
未収配当金		536,970,677	604,680,287
差入委託証拠金		1,905,742,870	2,422,054,094
流動資産合計		300,395,089,837	312,901,555,160
資産合計		300,395,089,837	312,901,555,160
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		8,403,319	11,434,570
未払金		-	114,201,019
未払解約金		450,839,000	171,113,000
その他未払費用		-	1,578
流動負債合計		459,242,319	296,750,167
負債合計		459,242,319	296,750,167
純資産の部			
元本等			
元本	1	86,323,479,779	89,477,974,583
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		213,612,367,739	223,126,830,410
元本等合計		299,935,847,518	312,604,804,993
純資産合計		299,935,847,518	312,604,804,993
負債純資産合計		300,395,089,837	312,901,555,160

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	平成29年12月11日現在	平成30年6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	88,552,177,603円	86,323,479,779円
同期中追加設定元本額	10,504,300,528円	14,982,972,124円
同期中一部解約元本額	12,732,998,352円	11,828,477,320円
元本の内訳 ファンド名		

D I A M外国株式パッシブ・ ファンド	1,772,792,525円	2,280,760,656円
M I T O ラップ型ファンド (安定型)	2,807,540円	2,576,013円
M I T O ラップ型ファンド (中立型)	6,389,168円	8,253,521円
M I T O ラップ型ファンド (積極型)	16,873,130円	15,610,811円
グローバル8資産ラップファン ド(安定型)	10,586,823円	15,954,912円
グローバル8資産ラップファン ド(中立型)	8,562,036円	18,115,492円
グローバル8資産ラップファン ド(積極型)	12,073,566円	16,388,372円
たわらノーロード 先進国株式	5,133,698,391円	6,672,745,238円
たわらノーロード 先進国株式 <ラップ向け>	425,029円	424,449円
たわらノーロード 先進国株式 <為替ヘッジあり>	414,866,588円	729,379,436円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	5,889,843円	22,601,268円
たわらノーロード バランス (堅実型)	34,963円	1,592,267円
たわらノーロード バランス (標準型)	79,253円	14,263,359円
たわらノーロード バランス (積極型)	117,424円	36,954,341円
たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(保守型)	14,793円	62,340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)	59,169円	7,309,428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)	82,545円	15,696,871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)	106,212円	10,864,941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)	129,879円	28,180,986円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(保守型)	- 円	6,504円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定型)	- 円	48,484円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定成長型)	- 円	414,146円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(成長型)	- 円	465,915円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(積極型)	- 円	1,524,904円
D I A M外国株式インデックス ファンド<D C年金>	36,677,928,546円	38,546,896,698円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 1 安定型	157,435,724円	163,871,815円

DIAMバランス・ファンド< DC年金> 2安定・成長型	857,026,223円	864,953,397円
DIAMバランス・ファンド< DC年金> 3成長型	1,043,554,352円	1,076,354,900円
DIAM DC バランス30 インデックスファンド	132,035,140円	130,336,604円
DIAM DC バランス50 インデックスファンド	389,058,681円	377,556,547円
DIAM DC バランス70 インデックスファンド	330,441,705円	335,232,104円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型>	34,206,990円	31,471,673円
マネックス資産設計ファンド< 育成型>	820,555,501円	799,032,499円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	187,072,304円	206,676,091円
DIAM DC 8資産バラン スファンド(新興国10)	30,215,012円	36,157,363円
DIAM DC 8資産バラン スファンド(新興国20)	74,275,172円	88,984,722円
DIAM DC 8資産バラン スファンド(新興国30)	141,824,089円	170,918,446円
投資のソムリエ	841,804,538円	868,741,001円
クルーズコントロール	641,917,915円	392,509,961円
投資のソムリエ< DC年金>	52,158,941円	64,336,511円
DIAM 8資産バラン スファンドN< DC年金>	115,562,877円	132,520,267円
DIAM DC バランス・F (成長型)	67,016,525円	83,800,402円
クルーズコントロール< DC年 金>	214,777円	164,617円
DIAMコア資産設計ファンド (堅実型)	3,100,738円	1,941,319円
DIAMコア資産設計ファンド (積極型)	8,318,622円	7,304,345円
投資のソムリエ< DC年金>リ スク抑制型	34,402,820円	28,781,499円
ダイナミック・ナビゲーション	1,167,998円	1,416,047円
リスク抑制世界8資産バラン スファンド	448,248,581円	521,323,309円
ワールドアセットバランス(基 本コース)	383,609,621円	708,384,105円
ワールドアセットバランス(リ スク抑制コース)	1,369,548,376円	2,833,633,500円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2045)	481,515円	663,072円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2055)	481,538円	432,935円
リスク抑制世界8資産バラン スファンド(DC)	150,283円	135,236円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2035)	192,297円	801,220円

4資産分散投資・スタンダード <DC年金>	- 円	2,686,847円
リスクコントロール世界資産分 散ファンド	- 円	45,042,961円
D I A M外国株式インデックス ファンドV A (適格機関投資家 専用)	98,646,996円	91,807,579円
D I A M外国株式パッシブ私募 ファンド(適格機関投資家向 け)	2,954,694,223円	2,883,713,605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)	161,232,273円	158,447,647円
外国株式パッシブ・ファンド2 (適格機関投資家限定)	208,806,341円	208,700,625円
D I A Mワールドバランス2 5 V A (適格機関投資家限定)	24,536,408円	23,795,507円
D I A Mグローバル・バランス ファンド2 5 V A (適格機関投 資家限定)	114,472,228円	97,372,860円
D I A Mグローバル・バランス ファンド5 0 V A (適格機関投 資家限定)	248,276,491円	225,166,060円
D I A M国際分散バランスファ ンド3 0 V A (適格機関投資家 限定)	14,813,470円	12,123,685円
D I A M国際分散バランスファ ンド5 0 V A (適格機関投資家 限定)	91,103,095円	82,899,784円
D I A M国内重視バランスファ ンド3 0 V A (適格機関投資家 限定)	8,130,540円	6,640,729円
D I A M国内重視バランスファ ンド5 0 V A (適格機関投資家 限定)	13,240,019円	10,221,886円
D I A M世界バランスファンド 4 0 V A (適格機関投資家限 定)	28,978,536円	22,908,257円
D I A M世界バランスファンド 5 0 V A (適格機関投資家限 定)	72,808,292円	64,248,826円
D I A Mバランスファンド2 5 V A (適格機関投資家限定)	597,723,519円	543,374,227円
D I A Mバランスファンド3 7 . 5 V A (適格機関投資家限 定)	743,608,210円	674,979,721円
D I A Mバランスファンド5 0 V A (適格機関投資家限定)	2,305,862,897円	2,120,387,129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)	823,945,543円	771,905,259円

D I A Mグローバル・アセ ト・バランスV A 2 (適格機 関投資家限定)	268,122,404円	170,657,828円
D I A M アクサ グローバ ル バランスファンド3 0 V A (適格機関投資家限定)	1,001,326,679円	892,771,100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)	591,917,029円	252,734,011円
D I A Mグローバル 私募ファ ンド(適格機関投資家向け)	2,754,975円	2,754,975円
D I A M世界バランスファンド 5 5 V A (適格機関投資家限 定)	382,122,074円	43,052,940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)	507,935,036円	92,033,794円
D I A M世界アセットバラン スファンド2 V A (適格機関投資 家限定)	8,279,676,493円	7,736,276,798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)	442,270,030円	421,949,131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)	1,415,798,109円	1,348,932,090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)	5,390,220,352円	5,131,324,155円
D I A Mバランス3 0 V A (適 格機関投資家限定)	12,602,647円	16,699,050円
D I A Mバランス5 0 V A (適 格機関投資家限定)	15,140,977円	4,645,302円
D I A Mバランス7 0 V A (適 格機関投資家限定)	11,295,771円	10,747,430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)	7,196,095,458円	6,870,614,649円
D I A Mバランス2 0 V A (適 格機関投資家限定)	65,306,688円	60,336,899円
D I A Mバランス4 0 V A (適 格機関投資家限定)	157,803円	232,188円
D I A Mバランス6 0 V A (適 格機関投資家限定)	261,895円	262,190円
計	86,323,479,779円	89,477,974,583円
2 . 受益権の総数	86,323,479,779口	89,477,974,583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6月13日 至 平成29年12月11日	自 平成29年12月12日 至 平成30年6月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。</p> <p>また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。</p>	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成29年12月11日現在	平成30年6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12月11日現在	平成30年6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	28,709,291,226	8,601,287,361
投資信託受益証券	31,518,618	48,612,735
投資証券	359,941,704	342,782,219
合計	29,100,751,548	8,992,682,315

(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12月11日まで及び平成30年2月16日から平成30年6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12月11日 現在				平成30年6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	-	-	-	-	60,376,079	-	60,375,430	649
アメリカ・ドル	-	-	-	-	22,425,770	-	22,424,950	820
イギリス・ボンド	-	-	-	-	29,639,258	-	29,639,460	202
オーストラリア・ドル	-	-	-	-	1,081,964	-	1,081,860	104
カナダ・ドル	-	-	-	-	4,389,767	-	4,389,840	73
ユーロ	-	-	-	-	2,839,320	-	2,839,320	-
買 建	549,062,495	-	549,589,840	527,345	2,427,938	-	2,413,670	14,268
アメリカ・ドル	372,869,533	-	373,286,660	417,127	-	-	-	-
イギリス・ボンド	42,668,086	-	42,638,400	29,686	-	-	-	-
オーストラリア・ドル	16,482,701	-	16,480,270	2,431	2,427,938	-	2,413,670	14,268
カナダ・ドル	7,335,208	-	7,334,710	498	-	-	-	-
ユーロ	109,706,967	-	109,849,800	142,833	-	-	-	-
合計	549,062,495	-	549,589,840	527,345	62,804,017	-	62,789,100	13,619

(注) 時価の算定方法

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

株式関連

種類	平成29年12月11日 現在				平成30年6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	5,569,183,282	-	5,661,841,044	92,657,762	8,598,448,600	-	8,795,890,157	197,441,557
合計	5,569,183,282	-	5,661,841,044	92,657,762	8,598,448,600	-	8,795,890,157	197,441,557

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成29年12月11日現在	平成30年6月11日現在
1口当たり純資産額	3.4746円	3.4937円
(1万口当たり純資産額)	(34,746円)	(34,937円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

平成30年6月11日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	AMAZON.COM INC	30,466	1,683.990	51,304,439.340	
	ABBOTT LABORATORIES	129,962	63.270	8,222,695.740	
	AES CORP	45,579	12.770	582,043.830	
	ABIOMED INC	3,100	409.770	1,270,287.000	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	68,075	146.140	9,948,480.500	
	ADVANCED MICRO DEVICES	68,629	15.250	1,046,592.250	
	ADOBE SYSTEMS INC	36,476	251.210	9,163,135.960	
	CHUBB LTD	34,634	133.520	4,624,331.680	
	AGCO CORP	5,610	63.680	357,244.800	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	16,380	168.510	2,760,193.800	
	ALLEGHANY CORP	1,054	591.690	623,641.260	
	RALPH LAUREN CORP	3,497	142.230	497,378.310	
	ALLSTATE CORP	25,754	93.710	2,413,407.340	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	55,523	151.860	8,431,722.780	
	AMGEN INC	50,200	184.300	9,251,860.000	
	HESS CORP	20,421	61.840	1,262,834.640	
	AMERICAN EXPRESS CO	53,581	101.000	5,411,681.000	
	AMERICAN ELECTRIC POWER	36,659	64.110	2,350,208.490	
	AFLAC INC	56,436	45.890	2,589,848.040	
	AMERICAN INTL GROUP	66,725	55.120	3,677,882.000	
	AMERCO	551	346.680	191,020.680	
	ANALOG DEVICES	27,711	101.060	2,800,473.660	
	ANADARKO PETROLEUM CORP	39,893	71.400	2,848,360.200	
	ALEXION PHARMACEUTICALS INC	16,015	118.330	1,895,054.950	
	JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	69,855	35.140	2,454,704.700	
	TIME WARNER	58,404	95.340	5,568,237.360	
	JONES LANG LASALLE INC	2,818	170.770	481,229.860	
	VALERO ENERGY CORP	32,105	119.720	3,843,610.600	
	APACHE CORP	30,595	42.240	1,292,332.800	
	ANSYS INC	5,619	172.230	967,760.370	
	APPLE INC	376,469	191.700	72,169,107.300	
	APPLIED MATERIALS INC	77,970	51.150	3,988,165.500	
ALBEMARLE CORP	7,904	95.370	753,804.480		
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	42,401	44.850	1,901,684.850		
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	7,831	74.400	582,626.400		

AMEREN CORP	17,312	56.690	981,417.280	
ARROW ELECTRONICS INC	5,756	77.740	447,471.440	
AUTOLIV INC	6,197	158.850	984,393.450	
AUTODESK INC	16,259	135.130	2,197,078.670	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	33,092	135.350	4,479,002.200	
AUTOZONE INC	2,015	674.390	1,358,895.850	
AVERY DENNISON CORP	6,262	108.030	676,483.860	
AVNET INC	10,288	39.580	407,199.040	
BALL CORP	24,324	37.600	914,582.400	
BERKSHIRE HATHAWAY INC- CL B	94,579	196.010	18,538,429.790	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	73,749	57.560	4,244,992.440	
BAXTER INTERNATIONAL INC	37,776	74.780	2,824,889.280	
BECTON DICKINSON & CO	19,749	231.840	4,578,608.160	
AMETEK INC	16,775	75.750	1,270,706.250	
VERIZON COMM INC	306,879	49.180	15,092,309.220	
WR BERKLEY CORP	8,134	78.310	636,973.540	
BEST BUY CO INC	19,210	72.310	1,389,075.100	
YUM! BRANDS INC	23,738	83.180	1,974,526.840	
FIRSTENERGY CORP	35,496	33.320	1,182,726.720	
H&R BLOCK INC	16,114	29.150	469,723.100	
BOEING CO	41,469	369.500	15,322,795.500	
ROBERT HALF INTL INC	8,158	68.910	562,167.780	
BORGWARNER INC	14,648	50.020	732,692.960	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	101,641	31.950	3,247,429.950	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	9,894	88.320	873,838.080	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	8,731	113.420	990,270.020	
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	1,838	594.860	1,093,352.680	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	121,395	53.160	6,453,358.200	
AFFILIATED MANAGERS GROUP INC	3,788	165.050	625,209.400	
INGREDION INC	5,305	111.960	593,947.800	
ONEOK INC	30,787	68.450	2,107,370.150	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	5,900	111.630	658,617.000	
UNITED RENTALS INC	6,332	166.800	1,056,177.600	
SEMPRA ENERGY	18,112	101.430	1,837,100.160	
FEDEX CORP	18,964	260.150	4,933,484.600	
VERISIGN INC	6,321	137.870	871,476.270	
AMPHENOL CORP	23,100	90.910	2,100,021.000	
BROWN-FORMAN CORP	19,683	52.970	1,042,608.510	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	127,092	7.240	920,146.080	
CSX CORP	62,392	67.070	4,184,631.440	
CABOT OIL & GAS CORP	32,261	23.540	759,423.940	

CAMPBELL SOUP CO	14,050	34.050	478,402.500	
SEAGATE TECHNOLOGY	20,613	55.980	1,153,915.740	
CONSTELLATION BRANDS INC	12,969	227.280	2,947,594.320	
CARDINAL HEALTH INC	22,125	53.350	1,180,368.750	
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	31,716	60.940	1,932,773.040	
CATERPILLAR INC	44,558	155.320	6,920,748.560	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	9,832	99.100	974,351.200	
CELGENE CORP	56,186	79.060	4,442,065.160	
CITRIX SYSTEMS INC	10,896	107.940	1,176,114.240	
CENTURYLINK INC	73,540	17.650	1,297,981.000	
CERNER CORP	22,947	60.690	1,392,653.430	
JPMORGAN CHASE & CO	254,725	111.110	28,302,494.750	
CHURCH & DWIGHT CO INC	18,822	48.190	907,032.180	
CIGNA CORP	18,009	177.810	3,202,180.290	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	10,982	71.280	782,796.960	
CINTAS CORP	6,282	191.480	1,202,877.360	
CISCO SYSTEMS INC	357,260	43.480	15,533,664.800	
CLOROX COMPANY	9,331	126.750	1,182,704.250	
COCA-COLA CO/THE	298,559	43.950	13,121,668.050	
COPART INC	15,900	57.630	916,317.000	
COGNEX CORP	11,508	47.520	546,860.160	
COLGATE-PALMOLIVE CO	62,296	63.340	3,945,828.640	
MARRIOTT INTERNATIONAL- CL A	22,744	138.380	3,147,314.720	
COMERICA INC	12,068	96.470	1,164,199.960	
COMCAST CORP-CL A	345,846	32.080	11,094,739.680	
CA INC	22,732	36.280	824,716.960	
CONAGRA BRANDS INC	28,323	37.740	1,068,910.020	
CONSOLIDATED EDISON INC	23,350	72.750	1,698,712.500	
CMS ENERGY CORP	19,291	43.350	836,264.850	
COOPER COS INC	3,794	232.210	881,004.740	
MOLSON COORS BREWING CO	13,855	63.560	880,623.800	
CORNING INC	65,641	28.750	1,887,178.750	
SEALED AIR CORP	13,870	43.800	607,506.000	
CUMMINS INC	11,239	143.680	1,614,819.520	
DR HORTON INC	24,498	44.190	1,082,566.620	
DANAHER CORP	47,175	103.000	4,859,025.000	
MOODY'S CORP	12,963	179.210	2,323,099.230	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	43,966	77.110	3,390,218.260	
TARGET CORP	37,486	78.020	2,924,657.720	
DEERE & CO	22,801	157.120	3,582,493.120	
MORGAN STANLEY	99,843	51.910	5,182,850.130	
REPUBLIC SERVICES INC	17,375	68.240	1,185,670.000	
COSTAR GROUP INC	2,786	401.850	1,119,554.100	
THE WALT DISNEY CO	112,062	103.980	11,652,206.760	

DOLLAR TREE INC	17,493	82.630	1,445,446.590	
DOVER CORP	10,736	78.920	847,285.120	
OMNICOM GROUP	16,993	73.900	1,255,782.700	
DTE ENERGY CO	13,122	96.970	1,272,440.340	
DUKE ENERGY CORP	52,625	73.120	3,847,940.000	
FLOWSERVE CORP	8,406	42.170	354,481.020	
DARDEN RESTAURANTS INC	9,436	91.450	862,922.200	
EBAY INC	71,564	40.290	2,883,313.560	
BANK OF AMERICA CORP	722,337	30.010	21,677,333.370	
CITIGROUP INC	190,608	68.470	13,050,929.760	
EASTMAN CHEMICAL CO	10,193	109.070	1,111,750.510	
E*TRADE FINANCIAL CORP	18,740	65.410	1,225,783.400	
EATON CORP PLC	32,234	80.350	2,590,001.900	
EATON VANCE CORP	9,184	56.450	518,436.800	
CADENCE DESIGN SYS INC	20,877	44.070	920,049.390	
DISH NETWORK CORP	16,150	32.080	518,092.000	
ECOLAB INC	19,009	146.190	2,778,925.710	
ELECTRONIC ARTS INC	23,050	137.870	3,177,903.500	
SALESFORCE.COM INC	50,827	133.530	6,786,929.310	
EMERSON ELECTRIC CO	47,931	73.150	3,506,152.650	
ATMOS ENERGY CORP	8,221	85.310	701,333.510	
ENTERGY CORP	13,599	76.890	1,045,627.110	
EOG RESOURCES INC	43,300	117.670	5,095,111.000	
EQUIFAX INC	8,495	127.820	1,085,830.900	
EQT CORP	20,049	53.120	1,065,002.880	
ESTEE LAUDER COS INC/THE	16,134	153.050	2,469,308.700	
EXPEDITORS INTERNATIONAL	12,550	76.520	960,326.000	
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	41,833	78.390	3,279,288.870	
EXXON MOBIL CORP	315,280	83.600	26,357,408.000	
FMC CORP	8,970	88.640	795,100.800	
NEXTERA ENERGY INC	35,113	156.800	5,505,718.400	
ASSURANT INC	4,089	98.290	401,907.810	
FASTENAL CO	21,654	52.820	1,143,764.280	
FIFTH THIRD BANCORP	52,173	31.810	1,659,623.130	
M&T BANK CORP	10,399	177.110	1,841,766.890	
FISERV INC	30,704	75.470	2,317,230.880	
FLIR SYSTEMS INC	11,623	55.060	639,962.380	
MACY'S INC	24,741	39.880	986,671.080	
FORD MOTOR CO	278,818	12.100	3,373,697.800	
FRANKLIN RESOURCES INC	22,314	34.410	767,824.740	
FREEMPORT-MCMORAN INC	96,812	18.030	1,745,520.360	
FLEX LTD	35,913	14.070	505,295.910	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	12,176	67.780	825,289.280	
GAP INC/THE	18,295	31.740	580,683.300	
DENTSPLY SIRONA INC	17,477	42.960	750,811.920	
GENERAL DYNAMICS CORP	19,047	202.580	3,858,541.260	
GENERAL MILLS INC	44,775	42.910	1,921,295.250	
GENUINE PARTS CO	11,759	94.620	1,112,636.580	

GILEAD SCIENCES INC	97,302	71.910	6,996,986.820	
GARTNER INC	7,153	137.730	985,182.690	
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	18,097	25.310	458,035.070	
MCKESSON CORP	15,054	145.370	2,188,399.980	
NVIDIA CORP	42,765	262.280	11,216,404.200	
GENERAL ELECTRIC CO	641,549	13.930	8,936,777.570	
WW GRAINGER INC	3,832	314.590	1,205,508.880	
HALLIBURTON CO	66,065	48.100	3,177,726.500	
MONSTER BEVERAGE CORP	29,522	55.480	1,637,880.560	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	26,624	233.390	6,213,775.360	
HARLEY-DAVIDSON INC	12,901	42.650	550,227.650	
HARRIS CORP	8,954	154.650	1,384,736.100	
HASBRO INC	9,136	90.330	825,254.880	
HENRY SCHEIN INC	11,426	72.120	824,043.120	
HELMERICH & PAYNE INC	7,213	65.380	471,585.940	
HERSHEY FOODS CORP	10,132	91.770	929,813.640	
HP INC	122,725	23.710	2,909,809.750	
F5 NETWORKS INC	4,874	176.800	861,723.200	
CROWN HOLDINGS INC NPR	10,472	44.580	466,841.760	
UNITED THERAPEUTICS CORP	3,447	111.890	385,684.830	
JUNIPER NETWORKS INC	27,740	27.920	774,500.800	
HOLLYFRONTIER CORP	12,551	77.190	968,811.690	
HOLOGIC INC	19,133	38.340	733,559.220	
UNUM GROUP	16,000	39.350	629,600.000	
HOME DEPOT INC	86,514	198.330	17,158,321.620	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	12,887	90.640	1,168,077.680	
HORMEL FOODS CORP	19,345	36.210	700,482.450	
CENTERPOINT ENERGY INC	31,952	25.350	809,983.200	
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,337	213.760	499,557.120	
HUMANA INC	10,468	297.890	3,118,312.520	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	5,927	128.680	762,686.360	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	82,761	15.690	1,298,520.090	
RED HAT INC	13,147	171.060	2,248,925.820	
NEKTAR THERAPEUTICS	12,000	54.140	649,680.000	
BIOGEN INC	15,971	303.290	4,843,844.590	
IDEX CORP	5,924	144.130	853,826.120	
ILLINOIS TOOL WORKS	22,895	147.760	3,382,965.200	
INTUIT INC	18,126	206.260	3,738,668.760	
IDEXX LABORATORIES INC	6,255	219.720	1,374,348.600	
INGERSOLL-RAND PLC	18,874	90.690	1,711,683.060	
INTEL CORP	348,219	55.050	19,169,455.950	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	5,578	126.410	705,114.980	
INTERNATIONAL PAPER CO	28,375	58.810	1,668,733.750	

INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	29,157	23.120	674,109.840	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	9,631	66.600	641,424.600	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	5,919	129.650	767,398.350	
INCYTE CORP	12,360	70.010	865,323.600	
JOHNSON & JOHNSON	198,834	124.060	24,667,346.040	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	25,530	53.260	1,359,727.800	
KLA-TENCOR CORP	11,724	114.200	1,338,880.800	
DEVON ENERGY CORP	39,484	42.160	1,664,645.440	
KELLOGG CO	18,922	63.710	1,205,520.620	
EAST WEST BANCORP INC	11,000	72.660	799,260.000	
KEYCORP	79,276	20.540	1,628,329.040	
KIMBERLY-CLARK CORP	26,156	103.270	2,701,130.120	
BLACKROCK INC/NEW YORK	8,949	549.410	4,916,670.090	
KOHL'S CORP	11,357	77.760	883,120.320	
KROGER CO	67,450	25.360	1,710,532.000	
LAM RESEARCH CORP	12,122	188.030	2,279,299.660	
PACKAGING CORP OF AMERICA	7,057	122.640	865,470.480	
AKAMAI TECHNOLOGIES	12,622	78.480	990,574.560	
LEGGETT & PLATT INC	9,588	43.640	418,420.320	
LENNAR CORP	21,933	54.000	1,184,382.000	
JEFFERIES FINANCIAL GROUP INC	21,462	23.070	495,128.340	
ELI LILLY & CO	73,039	86.080	6,287,197.120	
L BRANDS INC	16,262	36.990	601,531.380	
LINCOLN NATIONAL CORP	16,362	69.250	1,133,068.500	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	51,308	116.600	5,982,512.800	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	25,175	65.730	1,654,752.750	
LOCKHEED MARTIN CORP	19,173	322.310	6,179,649.630	
LOEWS CORP	21,346	50.420	1,076,265.320	
LOWE'S COS INC	62,509	100.220	6,264,651.980	
DOMINION ENERGY INC	48,002	62.600	3,004,925.200	
SCANA CORP	10,902	36.150	394,107.300	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	40,298	30.780	1,240,372.440	
MCCORMICK & CO INC	9,307	103.480	963,088.360	
MCDONALD'S CORPORATION	59,447	168.910	10,041,192.770	
S&P GLOBAL INC	18,409	206.470	3,800,906.230	
EVEREST RE GROUP LTD	2,855	230.320	657,563.600	
MANPOWERGROUP INC	4,257	92.300	392,921.100	
MARKEL CORPORATION	989	1,117.590	1,105,296.510	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	16,081	142.820	2,296,688.420	
MARSH & MCLENNAN COS	37,853	82.900	3,138,013.700	

MASCO CORP	23,043	38.860	895,450.980	
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	4,387	229.560	1,007,079.720	
MATTEL INC	24,003	17.030	408,771.090	
METLIFE INC	64,937	47.410	3,078,663.170	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	20,342	60.750	1,235,776.500	
MEDTRONIC PLC	100,647	87.180	8,774,405.460	
ACTIVISION BLIZZARD INC	54,568	74.290	4,053,856.720	
CVS HEALTH CORP	75,876	66.030	5,010,092.280	
MERCK & CO. INC.	201,289	62.580	12,596,665.620	
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	31,900	25.200	803,880.000	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	7,176	186.960	1,341,624.960	
MICROSOFT CORP	542,300	101.630	55,113,949.000	
MICRON TECH INC	86,870	61.390	5,332,949.300	
MIDDLEBY CORP	4,100	104.190	427,179.000	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	17,529	102.150	1,790,587.350	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	33,363	21.750	725,645.250	
3M CO	44,134	206.590	9,117,643.060	
MOHAWK INDUSTRIES INC	4,873	210.440	1,025,474.120	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	12,062	112.300	1,354,562.600	
KANSAS CITY SOUTHERN	7,247	109.250	791,734.750	
MYLAN NV	38,244	41.360	1,581,771.840	
ILLUMINA INC	11,065	282.030	3,120,661.950	
XCEL ENERGY INC	37,554	42.690	1,603,180.260	
NATIONAL OILWELL VARCO INC	26,938	42.580	1,147,020.040	
NETAPP INC	18,387	74.350	1,367,073.450	
NEWFIELD EXPLORATION CO	13,740	29.150	400,521.000	
NEWELL BRANDS INC	36,206	24.680	893,564.080	
NEWMONT MINING CORP	38,093	38.380	1,462,009.340	
NVR INC	236	3,196.450	754,362.200	
NIKE INC-CL B	96,817	74.900	7,251,593.300	
NOBLE ENERGY INC	36,582	34.060	1,245,982.920	
NORDSTROM INC	9,487	52.470	497,782.890	
NORFOLK SOUTHERN CORP	21,159	154.230	3,263,352.570	
EVERSOURCE ENERGY	23,085	53.560	1,236,432.600	
NISOURCE INC	22,198	23.520	522,096.960	
TAPESTRY INC	22,269	46.240	1,029,718.560	
NORTHERN TRUST CORP	16,090	106.920	1,720,342.800	
NORTHROP GRUMMAN CORP	12,188	338.630	4,127,222.440	
WELLS FARGO & CO	348,201	55.680	19,387,831.680	
NUCOR CORP	23,780	66.850	1,589,693.000	
CHENIERE ENERGY INC	15,927	65.390	1,041,466.530	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	36,024	96.970	3,493,247.280	

OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	56,876	85.470	4,861,191.720	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	4,917	160.640	789,866.880	
OGE ENERGY CORP	16,028	33.750	540,945.000	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	6,375	283.130	1,804,953.750	
ORACLE CORP	230,824	48.180	11,121,100.320	
PACCAR INC	26,537	65.260	1,731,804.620	
EXELON CORP	69,910	40.000	2,796,400.000	
PARKER HANNIFIN CORP	9,885	174.710	1,727,008.350	
PAYCHEX INC	23,141	68.170	1,577,521.970	
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	6,526	57.940	378,116.440	
ALIGN TECHNOLOGY INC	5,854	346.670	2,029,406.180	
PPL CORPORATION	52,183	25.790	1,345,799.570	
PEPSICO INC	104,692	102.490	10,729,883.080	
PENTAIR PLC	11,775	45.000	529,875.000	
PFIZER INC	440,510	36.670	16,153,501.700	
CONOCOPHILLIPS	87,473	69.430	6,073,250.390	
PVH CORP	5,387	168.160	905,877.920	
PG&E CORP	38,695	41.450	1,603,907.750	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	12,758	193.240	2,465,355.920	
ALTRIA GROUP INC	141,336	57.710	8,156,500.560	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	35,408	148.850	5,270,480.800	
POLARIS INDUSTRIES INC	3,845	126.010	484,508.450	
GARMIN LTD	7,795	61.850	482,120.750	
AETNA INC	23,744	180.810	4,293,152.640	
FLUOR CORP (NEW)	9,821	50.340	494,389.140	
PPG INDUSTRIES INC	19,079	104.150	1,987,077.850	
IPG PHOTONICS CORP	2,441	248.950	607,686.950	
PRAXAIR INC	21,319	159.830	3,407,415.770	
COSTCO WHOLESALE CORP	32,871	203.760	6,697,794.960	
T ROWE PRICE GROUP INC	18,363	125.980	2,313,370.740	
QUEST DIAGNOSTICS	10,378	109.720	1,138,674.160	
PROCTER & GAMBLE CO	186,535	77.180	14,396,771.300	
PROGRESSIVE CORP	43,996	62.840	2,764,708.640	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	37,115	50.890	1,888,782.350	
PULTE GROUP INC	21,209	32.560	690,565.040	
NEW YORK COMMUNITY BANCORP INC	30,388	11.990	364,352.120	
GLOBAL PAYMENTS INC	11,769	117.080	1,377,914.520	
QUALCOMM INC	109,843	60.260	6,619,139.180	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	10,187	100.600	1,024,812.200	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	2,550	127.640	325,482.000	

REGENERON PHARMACEUTICALS	5,659	308.100	1,743,537.900	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA INC	4,642	151.680	704,098.560	
RESMED INC	10,594	106.790	1,131,333.260	
US BANCORP	116,678	52.050	6,073,089.900	
SEATTLE GENETICS INC /WA	7,317	65.010	475,678.170	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	10,474	84.290	882,853.460	
ROSS STORES INC	28,189	85.840	2,419,743.760	
ROLLINS INC	8,252	52.810	435,788.120	
ROPER TECHNOLOGIES INC	7,723	285.580	2,205,534.340	
ROCKWELL AUTOMATION INC	9,567	178.010	1,703,021.670	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	12,293	103.480	1,272,079.640	
RAYTHEON COMPANY	21,317	214.560	4,573,775.520	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	3,848	222.380	855,718.240	
ACCENTURE PLC-CL A	45,610	162.170	7,396,573.700	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	111,556	39.780	4,437,697.680	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	9,849	158.130	1,557,422.370	
ROCKWELL COLLINS INC	12,086	139.180	1,682,129.480	
THE TRAVELERS COMPANIES INC	19,755	131.320	2,594,226.600	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	24,562	106.140	2,607,010.680	
BOOKING HOLDINGS INC	3,645	2,136.540	7,787,688.300	
SCHLUMBERGER LTD	103,099	69.430	7,158,163.570	
SCHWAB (CHARLES) CORP	90,105	57.730	5,201,761.650	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	14,175	114.500	1,623,037.500	
BUNGE LTD	10,334	69.170	714,802.780	
SEI INVESTMENTS CO	9,315	66.750	621,776.250	
ANTHEM INC	19,325	228.300	4,411,897.500	
AMERISOURCEBERGEN CORP	12,257	86.090	1,055,205.130	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	21,442	56.800	1,217,905.600	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	6,319	398.050	2,515,277.950	
CENTENE CORP	15,113	119.810	1,810,688.530	
SVB FINANCIAL GROUP	4,107	325.720	1,337,732.040	
IAC INTERACTIVE CORP	5,050	157.170	793,708.500	
SMITH (A.O.) CORP	9,565	64.840	620,194.600	
ACUITY BRANDS INC	3,087	121.840	376,120.080	
SNAP-ON INC	3,932	156.940	617,088.080	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	31,808	100.550	3,198,294.400	
ADVANCE AUTO PARTS	5,273	131.710	694,506.830	
EDISON INTERNATIONAL	24,600	59.610	1,466,406.000	
SOUTHERN CO	75,642	43.280	3,273,785.760	
BB&T CORP	59,388	54.600	3,242,584.800	

SOUTHWEST AIRLINES	11,352	50.480	573,048.960	
AT&T INC	456,680	33.830	15,449,484.400	
CHEVRON CORP	141,261	126.440	17,861,040.840	
STANLEY BLACK & DECKER INC	11,629	145.370	1,690,507.730	
STATE STREET CORP	27,099	100.460	2,722,365.540	
STARBUCKS CORP	104,312	56.600	5,904,059.200	
STEEL DYNAMICS INC	19,030	50.740	965,582.200	
STRYKER CORP	25,320	178.950	4,531,014.000	
NETFLIX INC	32,015	360.570	11,543,648.550	
STERICYCLE INC	6,853	64.600	442,703.800	
SUNTRUST BANKS INC	34,756	70.530	2,451,340.680	
SYMANTEC CORP	47,004	21.320	1,002,125.280	
KNIGHT SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	9,793	40.510	396,714.430	
SYNOPSIS INC	10,656	90.510	964,474.560	
SYSCO CORP	35,926	66.150	2,376,504.900	
INTUITIVE SURGICAL INC	8,408	484.600	4,074,516.800	
TELEFLEX INC	3,203	283.280	907,345.840	
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	71,553	23.110	1,653,589.830	
ANDEAVOR	11,500	144.680	1,663,820.000	
TEXAS INSTRUMENTS INC	73,391	115.740	8,494,274.340	
TEXTRON INC	19,076	69.320	1,322,348.320	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	30,141	217.020	6,541,199.820	
TIFFANY & CO	8,733	132.190	1,154,415.270	
TOLL BROTHERS INC	9,526	40.520	385,993.520	
TORCHMARK CORP	7,699	86.240	663,961.760	
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	11,279	87.140	982,852.060	
DAVITA INC	10,878	71.050	772,881.900	
TRACTOR SUPPLY CO	9,276	76.580	710,356.080	
TRIMBLE INC	20,073	34.520	692,919.960	
TYSON FOODS INC	21,621	70.750	1,529,685.750	
UGI CORP	12,068	48.810	589,039.080	
MARATHON OIL CORP	64,347	20.990	1,350,643.530	
UNION PACIFIC CORP	58,589	144.520	8,467,282.280	
UNITED TECHNOLOGIES CORP	56,111	127.610	7,160,324.710	
UNITEDHEALTH GROUP INC	71,700	250.680	17,973,756.000	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	6,351	115.300	732,270.300	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	6,848	121.670	833,196.160	
VF CORP	24,309	83.670	2,033,934.030	
CBS CORP	27,376	51.130	1,399,734.880	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	19,280	150.550	2,902,604.000	

VULCAN MATERIALS CO	10,136	130.040	1,318,085.440	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	63,286	63.400	4,012,332.400	
WALMART INC	109,762	84.360	9,259,522.320	
WASTE MANAGEMENT INC	32,216	83.590	2,692,935.440	
WATERS CORP	5,963	205.320	1,224,323.160	
ALLERGAN PLC	25,196	170.350	4,292,138.600	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	8,855	102.520	907,814.600	
VAIL RESORTS INC	3,098	275.250	852,724.500	
WESTERN DIGITAL CORP	22,254	82.620	1,838,625.480	
WABTEC CORP	5,497	102.690	564,486.930	
WHIRLPOOL CORP	5,553	148.860	826,619.580	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	13,529	99.810	1,350,329.490	
WYNN RESORTS LTD	7,179	178.120	1,278,723.480	
NASDAQ INC	9,132	95.130	868,727.160	
CME GROUP INC	25,415	170.970	4,345,202.550	
WILLIAMS COS INC	61,081	26.120	1,595,435.720	
LKQ CORP	22,948	32.590	747,875.320	
ALLIANT ENERGY CORP	16,383	39.230	642,705.090	
WEC ENERGY GROUP INC	23,117	59.460	1,374,536.820	
TD AMERITRADE HOLDING CORP	21,581	62.310	1,344,712.110	
CARMAX INC	13,513	73.790	997,124.270	
XEROX CORP	17,455	27.910	487,169.050	
XILINX INC	19,197	69.540	1,334,959.380	
CIMAREX ENERGY CO	7,003	85.590	599,386.770	
TJX COMPANIES INC	47,171	94.940	4,478,414.740	
ZIONS BANCORP	16,584	57.190	948,438.960	
DAIRY FARM INTERNATIONAL HLDNGS	27,400	8.900	243,860.000	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	76,400	7.320	559,248.000	
JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	15,700	62.410	979,837.000	
JARDINE STRATEGIC HOLDINGS LTD	17,100	36.710	627,741.000	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	6,051	100.240	606,552.240	
SIGNATURE BANK	4,171	130.640	544,899.440	
CBRE GROUP INC	24,276	48.590	1,179,570.840	
LIBERTY GLOBAL PLC	12,435	29.370	365,215.950	
REGIONS FINANCIAL CORP	84,486	19.110	1,614,527.460	
DOMINO'S PIZZA INC	3,256	270.040	879,250.240	
WESTLAKE CHEMICAL CORP	3,000	117.670	353,010.000	
T-MOBILE US INC	25,388	57.800	1,467,426.400	
LAS VEGAS SANDS CORP	30,271	78.000	2,361,138.000	
MOSAIC CO/THE	26,525	29.460	781,426.500	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX NEWS	32,515	39.550	1,285,968.250	

TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC	78,440	39.990	3,136,815.600	
CELANESE CORP	9,491	117.110	1,111,491.010	
DISCOVERY INC-A	10,423	23.020	239,937.460	
EXPEDIA GROUP INC	8,709	120.890	1,052,831.010	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	18,475	43.180	797,750.500	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	10,578	142.630	1,508,740.140	
LIBERTY GLOBAL PLC- SERIES C	41,818	28.350	1,185,540.300	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	43,585	75.660	3,297,641.100	
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	14,696	24.310	357,259.760	
VIACOM INC-CLASS B	24,612	27.910	686,920.920	
LIVE NATION	8,864	45.860	406,503.040	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,807	453.380	819,257.660	
UNITED CONTINENTAL HOLIDINGS INC	6,191	69.990	433,308.090	
TRANSDIGM GROUP INC	3,812	346.000	1,318,952.000	
MASTERCARD INC	69,052	200.040	13,813,162.080	
QURATE RETAIL INC	35,733	21.460	766,830.180	
HANESBRANDS INC	27,619	20.090	554,865.710	
WESTERN UNION CO	35,222	20.810	732,969.820	
OWENS CORNING	7,333	65.550	480,678.150	
LEIDOS HOLDINGS INC	9,322	61.290	571,345.380	
AERCAP HOLDINGS NV	11,586	54.830	635,260.380	
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLDINGS INC	9,175	89.490	821,070.750	
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT-ADR	18,099	29.650	536,635.350	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	8,330	119.400	994,602.000	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	22,746	19.190	436,495.740	
DELTA AIR LINES INC	13,898	54.090	751,742.820	
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	6,354	65.840	418,347.360	
DISCOVER FINANCIAL	27,177	75.380	2,048,602.260	
TE CONNECTIVITY LTD	26,204	97.250	2,548,339.000	
CONCHO RESOURCES INC/MIDLAND TX	10,552	128.280	1,353,610.560	
WABCO HOLDING INC	4,076	124.280	506,565.280	
LULULEMON ATHLETICA INC	6,683	122.020	815,459.660	
VMWARE INC	5,491	149.640	821,673.240	
MERCADOLIBRE INC	3,215	288.800	928,492.000	
ULTA BEAUTY INC	4,332	253.060	1,096,255.920	
INVESCO LTD	29,824	27.930	832,984.320	
MSCI INC	6,462	166.290	1,074,565.980	

PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	114,627	79.420	9,103,676.340	
VISA INC	134,179	134.740	18,079,278.460	
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	13,600	120.520	1,639,072.000	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	13,492	79.280	1,069,645.760	
DISCOVERY INC-C	23,054	21.800	502,577.200	
MARATHON PETROLEUM CORP	35,273	78.990	2,786,214.270	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	11,624	58.520	680,236.480	
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	155,757	16.850	2,624,505.450	
XYLEM INC	12,873	73.270	943,204.710	
ALKERMES PLC	12,053	48.610	585,896.330	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	24,984	118.090	2,950,360.560	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,479	226.350	787,471.650	
SPLUNK INC	10,674	116.750	1,246,189.500	
HCA HEALTHCARE INC	21,696	105.390	2,286,541.440	
VERISK ANALYTICS INC	11,859	109.060	1,293,342.540	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	3,987	176.790	704,861.730	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	6,544	202.500	1,325,160.000	
FIRST REPUBLIC BANK/SAN FRANCISCO CA	11,868	103.380	1,226,913.840	
CIT GROUP INC	9,287	52.080	483,666.960	
NXP SEMICONDUCTOR NV	22,652	120.170	2,722,090.840	
TARGA RESOURCES CORP	16,445	49.310	810,902.950	
LEAR CORP	5,132	205.340	1,053,804.880	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	8,640	103.950	898,128.000	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	17,000	51.680	878,560.000	
DOLLAR GENERAL CORP	21,402	94.900	2,031,049.800	
FORTINET INC	11,399	62.530	712,779.470	
AON PLC	18,487	142.970	2,643,086.390	
TESLA INC	9,463	317.660	3,006,016.580	
GENERAL MOTORS CO	95,770	44.250	4,237,822.500	
WORLDPAY INC	21,000	82.070	1,723,470.000	
XPO LOGISTICS INC	9,000	111.280	1,001,520.000	
TRIPADVISOR INC	9,263	55.840	517,245.920	
ALLY FINANCIAL INC	31,409	26.630	836,421.670	
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	12,138	64.650	784,721.700	
VOYA FINANCIAL INC	13,525	53.590	724,804.750	
APTIV PLC	19,069	100.810	1,922,345.890	
PHILLIPS 66	32,776	116.840	3,829,547.840	
FACEBOOK INC	177,316	189.100	33,530,455.600	

IQVIA HOLDINGS INC	11,751	104.600	1,229,154.600	
DIAMONDBACK ENERGY INC	7,054	113.960	803,873.840	
SERVICENOW INC	12,906	178.190	2,299,720.140	
PALO ALTO NETWORKS INC	7,006	199.330	1,396,505.980	
WORKDAY INC	10,417	123.900	1,290,666.300	
ABBVIE INC	112,000	100.430	11,248,160.000	
ZOETIS INC	36,976	86.780	3,208,777.280	
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDINGS LTD	16,470	51.750	852,322.500	
COTY INC	38,541	13.890	535,334.490	
NEWS CORP/NEW-CL A	30,263	15.820	478,760.660	
HD SUPPLY HOLDINGS INC	12,891	42.890	552,894.990	
CDW CORP	10,824	84.710	916,901.040	
SPRINT CORP	63,882	5.170	330,269.940	
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	10,199	43.110	439,678.890	
ARCONIC INC	27,513	17.940	493,583.220	
LIBERTY MEDIA CORP- LIBERTY-C	13,175	32.010	421,731.750	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	5,006	46.030	230,426.180	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-C	13,368	46.170	617,200.560	
XL GROUP LTD	19,366	56.300	1,090,305.800	
DELL TECHNOLOGIES INC	15,074	88.330	1,331,486.420	
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	15,410	22.400	345,184.000	
BAKER HUGHES A GE CO	31,904	34.700	1,107,068.800	
TECHNIPFMC LTD	32,556	32.600	1,061,325.600	
BROADCOM INC	30,394	257.970	7,840,740.180	
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	6,291	46.700	293,789.700	
ANTERO RESOURCES CORP	13,163	19.620	258,258.060	
VEEVA SYSTEMS INC	9,087	79.530	722,689.110	
TWITTER INC	47,998	41.210	1,977,997.580	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING PLC	11,392	53.850	613,459.200	
EVERGY INC	10,000	51.320	513,200.000	
PLAINS GP HOLDINGS LP	7,837	24.760	194,044.120	
COMMSCOPE HOLDING CO INC	12,920	29.800	385,016.000	
ALLEGION PLC	7,325	81.120	594,204.000	
PERRIGO CO PLC	8,553	73.260	626,592.780	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	20,000	84.140	1,682,800.000	
ARAMARK	17,307	39.030	675,492.210	
SABRE CORP	17,624	25.530	449,940.720	
PARSLEY ENERGY INC	17,454	27.200	474,748.800	
ARISTA NETWORKS INC	3,748	273.750	1,026,015.000	
IHS MARKIT LTD	30,253	51.140	1,547,138.420	
FNF GROUP	20,660	37.870	782,394.200	
SYNCHRONY FINANCIAL	53,885	35.450	1,910,223.250	

	CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	34,845	41.980	1,462,793.100	
	CDK GLOBAL INC	8,309	64.990	540,001.910	
	KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	14,300	60.990	872,157.000	
	QORVO INC	8,784	80.160	704,125.440	
	ZAYO GROUP HOLDINGS INC	16,089	36.290	583,869.810	
	LIBERTY BROADBAND CORP-C W/I	7,818	72.900	569,932.200	
	AXALTA COATING SYSTEMS LTD	14,710	31.850	468,513.500	
	GODADDY INC	11,400	72.640	828,096.000	
	NIELSEN HOLDINGS PLC	26,840	31.240	838,481.600	
	TRANSUNION	13,841	70.930	981,742.130	
	SQUARE INC	20,423	61.780	1,261,732.940	
	DOWDUPONT INC	173,668	69.490	12,068,189.320	
	COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS PLC	17,100	38.420	656,982.000	
	WESTROCK CO	17,744	60.960	1,081,674.240	
	KRAFT HEINZ CO	43,818	58.470	2,562,038.460	
	FORTIVE CORP	23,630	78.200	1,847,866.000	
	WASTE CONNECTIONS INC	18,879	76.730	1,448,585.670	
	ALPHABET INC-CL A	22,200	1,132.710	25,146,162.000	
	HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	113,242	16.010	1,813,004.420	
	PAYPAL HOLDINGS INC	85,540	84.340	7,214,443.600	
	FIRST DATA CORP	35,404	20.050	709,850.200	
	DXC TECHNOLOGY CO	21,351	85.540	1,826,364.540	
	ZILLOW GROUP INC-C	8,134	62.430	507,805.620	
	ALPHABET INC-CL C	23,300	1,120.870	26,116,271.000	
	L3 TECHNOLOGIES INC	5,892	204.220	1,203,264.240	
	CHEMOURS CO	12,723	51.280	652,435.440	
	ATHENE HOLDING LTD	11,784	45.810	539,825.040	
	CHARTER COMMUNICATIONS INC	12,506	277.260	3,467,413.560	
	VISTRA ENERGY CORP	30,000	24.560	736,800.000	
	アメリカ・ドル 小計	22,686,793		1,800,587,843.090 (197,002,315,912)	
イギリス・ポンド	ANTOFAGASTA PLC	25,905	10.985	284,566.420	
	ASHTED GROUP	35,233	23.750	836,783.750	
	SEVERN TRENT PLC	14,897	19.370	288,554.890	
	BHP BILLITON PLC	153,323	17.636	2,704,004.420	
	BARCLAYS PLC	1,292,957	1.990	2,572,984.430	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	64,682	5.860	379,036.520	
	BT GROUP PLC	638,910	2.049	1,309,126.590	
	SKY PLC	72,210	13.400	967,614.000	
	BUNZL PLC	26,515	22.720	602,420.800	
	EASYJET PLC	13,628	17.135	233,515.780	
	AVIVA PLC	303,368	5.066	1,536,862.280	

CRODA INTERNATIONAL	10,645	48.300	514,153.500	
DIAGEO PLC	183,390	27.240	4,995,543.600	
SCHRODERS PLC	10,932	32.530	355,617.960	
DCC PLC	5,936	72.050	427,688.800	
NATIONAL GRID PLC	253,078	8.285	2,096,751.230	
KINGFISHER PLC	165,680	3.014	499,359.520	
BAE SYSTEMS PLC	225,176	6.482	1,459,590.830	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	169,676	36.560	6,203,354.560	
NEXT PLC	9,731	60.540	589,114.740	
IMPERIAL BRANDS PLC	72,328	25.845	1,869,317.160	
JOHNSON MATTHEY PLC	15,017	37.880	568,843.960	
ANGLO AMERICAN PLC	79,906	18.494	1,477,781.560	
COMPASS GROUP PLC	115,111	15.790	1,817,602.690	
HSBC HOLDINGS PLC	1,488,734	7.299	10,866,269.460	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	423,649	2.702	1,144,699.590	
CENTRICA PLC	392,766	1.455	571,474.530	
UNILEVER PLC	91,931	41.155	3,783,420.300	
MEGGITT PLC	62,181	4.983	309,847.920	
MORRISON <WM.> SUPERMARKETS	155,682	2.462	383,289.080	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	54,487	7.792	424,562.700	
RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	80,864	6.434	520,278.970	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	25,308	27.400	693,439.200	
PEARSON PLC	65,009	8.828	573,899.450	
PERSIMMON PLC	23,150	28.800	666,720.000	
PRUDENTIAL PLC	193,029	18.360	3,544,012.440	
RIO TINTO PLC	90,035	44.200	3,979,547.000	
VODAFONE GROUP PLC	1,993,578	1.874	3,735,965.170	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	50,208	58.740	2,949,217.920	
RELX PLC	82,464	16.735	1,380,035.040	
OLD MUTUAL PLC	339,296	2.224	754,594.300	
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	116,966	8.354	977,133.960	
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	330,000	2.676	883,080.000	
ST JAMES'S PLACE PLC	40,884	11.930	487,746.120	
TRAVIS PERKINS PLC	20,357	14.145	287,949.760	
SSE PLC	73,043	13.425	980,602.270	
BP PLC	1,481,204	5.838	8,647,268.950	
SHIRE PLC	67,647	39.980	2,704,527.060	
SAGE GROUP PLC(THE)	85,271	6.710	572,168.410	
SMITHS GROUP PLC	31,720	17.845	566,043.400	
STANDARD CHARTERED PLC	210,236	7.266	1,527,574.770	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	5,397,548	0.629	3,395,057.690	

TAYLOR WIMPLEY PLC	253,022	1.910	483,272.020	
TESCO PLC	740,567	2.479	1,835,865.590	
3I GROUP PLC	66,784	9.674	646,068.410	
SMITH & NEPHEW PLC	66,155	13.600	899,708.000	
GLAXOSMITHKLINE PLC	369,384	15.280	5,644,187.520	
WEIR GROUP	18,336	22.000	403,392.000	
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	21,888	45.040	985,835.520	
BABCOCK INT'L GROUP	21,302	8.542	181,961.680	
WPP PLC	90,628	12.160	1,102,036.480	
FERGUSON PLC	18,238	58.940	1,074,947.720	
ASTRAZENECA PLC	94,694	53.530	5,068,969.820	
WHITBREAD PLC	12,159	41.450	503,990.550	
CARNIVAL PLC	13,153	45.200	594,515.600	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	120,290	2.900	348,841.000	
JOHN WOOD GROUP PLC	48,988	6.442	315,580.690	
INTERTEK GROUP PLC	11,273	57.140	644,139.220	
BURBERRY GROUP PLC	29,893	21.140	631,938.020	
INVESTEC PLC	50,655	5.522	279,716.910	
INTERCONTINENTAL HOTELS	12,362	49.150	607,592.300	
ITV PLC	247,210	1.691	418,032.110	
SAINSBURY (J) PLC	137,215	3.048	418,231.320	
RANDGOLD RESOURCES LTD NPR	6,998	58.300	407,983.400	
G4S PLC	122,250	2.757	337,043.250	
ADMIRAL GROUP PLC	15,893	19.025	302,364.320	
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	10,726	43.210	463,470.460	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	341,563	26.065	8,902,839.590	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	275,246	27.000	7,431,642.000	
TUI AG-DI	30,153	17.340	522,853.020	
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	184,183	3.510	646,482.330	
EXPERIAN PLC	71,068	18.830	1,338,210.440	
MONDI PLC	28,318	20.970	593,828.460	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	21,290	19.620	417,709.800	
FRESNILLO PLC NPR	15,639	12.160	190,170.240	
GLENCORE PLC	861,237	3.838	3,305,427.600	
GVC HOLDINGS PLC	36,000	10.550	379,800.000	
NMC HEALTH PLC	8,149	34.340	279,836.660	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP PLC	112,694	3.478	391,949.730	
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	30,616	5.508	168,632.920	
COCA-COLA HBC AG	13,406	26.000	348,556.000	
CONVATEC GROUP PLC	118,400	2.263	267,939.200	

	ROYAL MAIL PLC	55,060	4.823	265,554.380	
	MERLIN ENTERTAINMENTS PLC	50,037	3.829	191,591.670	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC-C	8,304,586	0.001	8,304.580	
	MICRO FOCUS INTERNATIONAL PLC	32,342	13.360	432,089.120	
	AUTO TRADER GROUP PLC	76,348	4.170	318,371.160	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	335,000	2.370	793,950.000	
イギリス・ポンド	小計	31,026,879		143,696,038.260 (21,085,956,655)	
イスラエル・シュケル	BANK HAPOALIM BM	78,428	24.610	1,930,113.080	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	103,061	22.020	2,269,403.220	
	BEZEQ ISRAELI TELECOMMUNICATION CORP LTD	188,230	4.285	806,565.550	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,760	452.000	795,520.000	
	FRUTAROM INDUSTRIES LTD	2,600	352.600	916,760.000	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	49,411	16.780	829,116.580	
	NICE LTD	4,035	380.000	1,533,300.000	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	10,444	69.550	726,380.200	
	AZRIELI GROUP	4,428	185.400	820,951.200	
イスラエル・シュケル	小計	442,397		10,628,109.830 (325,964,129)	
オーストラリア・ドル	RAMSAY HEALTH CARE LTD	11,115	56.660	629,775.900	
	AUST AND NZ BANKING GROUP LT	218,921	26.660	5,836,433.860	
	AMCOR LTD	80,741	13.910	1,123,107.310	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	253,113	27.610	6,988,449.930	
	BANK OF QUEENSLAND LTD	30,569	10.090	308,441.210	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	114,125	4.710	537,528.750	
	TELSTRA CORP LTD	272,919	2.770	755,985.630	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD	39,014	10.300	401,844.200	
	AMP LTD	200,498	3.630	727,807.740	
	ASX LTD	15,573	61.890	963,812.970	
	BHP BILLITON LTD	239,570	34.070	8,162,149.900	
	CALTEX AUSTRALIA LTD	20,946	29.350	614,765.100	
	HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	22,182	3.490	77,415.180	
	COMPUTERSHARE LT	38,040	17.660	671,786.400	
	CSL LIMITED	34,057	189.190	6,443,243.830	
	REA GROUP LTD	4,119	88.740	365,520.060	
	TRANSURBAN GROUP	167,883	11.670	1,959,194.610	
	COCA-COLA AMATIL LTD	48,601	9.160	445,185.160	
	COCHLEAR LTD	3,992	198.630	792,930.960	

ORIGIN ENERGY LTD	121,721	9.940	1,209,906.740	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	129,233	69.370	8,964,893.210	
BORAL LIMITED	86,101	6.380	549,324.380	
RIO TINTO LIMITED	30,902	86.600	2,676,113.200	
APA GROUP	77,562	8.360	648,418.320	
ARISTOCRAT LEISU	43,933	30.010	1,318,429.330	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	171,471	8.010	1,373,482.710	
TPG TELECOM LTD	28,719	5.420	155,656.980	
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	3,275	61.530	201,510.750	
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	28,489	22.770	648,694.530	
ORICA LTD	25,308	17.530	443,649.240	
CIMIC GROUP LTD	8,709	41.510	361,510.590	
BLUESCOPE STEEL LTD	36,941	18.450	681,561.450	
SYDNEY AIRPORT	85,130	7.130	606,976.900	
MACQUARIE GROUP LTD	24,250	113.070	2,741,947.500	
SUNCORP GROUP LTD	93,181	14.030	1,307,329.430	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	202,508	26.380	5,342,161.040	
NEWCREST MINING LTD	59,818	20.840	1,246,607.120	
OIL SEARCH LTD	93,715	8.380	785,331.700	
INCITEC PIVOT LTD	136,426	3.540	482,948.040	
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	95,390	9.330	889,988.700	
CHALLENGER FINANCIAL SERVICES	45,707	12.600	575,908.200	
SANTOS LTD	133,862	5.890	788,447.180	
SONIC HEALTHCARE	26,192	24.250	635,156.000	
TABCORP HOLDINGS LTD	126,348	4.580	578,673.840	
WESFARMERS LTD	84,335	46.360	3,909,770.600	
ALUMINA LIMITED	184,613	2.730	503,993.490	
WOODSIDE PETROLEUM LTD	68,074	33.480	2,279,117.520	
WOOLWORTHS GROUP LTD	99,142	28.870	2,862,229.540	
SEEK LTD	25,899	20.890	541,030.110	
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES LTD	4,581	52.910	242,380.710	
AUSNET SERVICES	165,066	1.540	254,201.640	
AGL ENERGY LTD	46,315	21.190	981,414.850	
BRAMBLES LTD	115,255	9.060	1,044,210.300	
CROWN RESORTS LTD	32,861	13.360	439,022.960	
AURIZON HOLDINGS LTD	139,184	4.140	576,221.760	
TREASURY WINE ESTATES LTD	50,789	16.990	862,905.110	
HEALTHSCOPE LTD	149,047	2.280	339,827.160	
MEDIBANK PVT LTD	177,176	2.870	508,495.120	
SOUTH32 LTD(AUD)	367,057	3.850	1,413,169.450	

オーストラリア・ドル 小計		5,440,263		89,777,996.100 (7,473,120,396)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	16,141	57.540	928,753.140	
	ALIMENTATION COUCHE TARD INC	30,728	53.890	1,655,931.920	
	BARRICK GOLD CORP	83,648	16.870	1,411,141.760	
	ATCO LTD	7,193	39.010	280,598.930	
	BANK OF MONTREAL	47,406	102.170	4,843,471.020	
	BANK OF NOVA SCOTIA	87,876	76.360	6,710,211.360	
	NATIONAL BANK OF CANADA	23,756	63.080	1,498,528.480	
	BCE INC	11,568	54.780	633,695.040	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT	63,537	53.400	3,392,875.800	
	VALEANT PHARMACEUTICALS INTERN	25,819	33.380	861,838.220	
	BOMBARDIER INC 'B'	151,615	4.880	739,881.200	
	SAPUTO INC	18,601	41.800	777,521.800	
	BLACKBERRY LTD	39,652	15.660	620,950.320	
	CGI GROUP INC	19,367	80.600	1,560,980.200	
	CCL INDUSTRIES INC	11,340	64.460	730,976.400	
	CAE INC	23,000	27.610	635,030.000	
	CAMECO CORP	32,627	15.130	493,646.510	
	ROGERS COMM-CL B	25,967	61.510	1,597,230.170	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	32,680	115.250	3,766,370.000	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	91,420	43.660	3,991,397.200	
	CANADIAN TIRE CORP-CL A	4,862	166.280	808,453.360	
	CANADIAN UTILITIES LTD	9,119	31.320	285,607.080	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	54,813	107.880	5,913,226.440	
	FIRST CAPITAL REALTY INC	11,417	21.120	241,127.040	
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	13,930	37.430	521,399.900	
	OPEN TEXT CORP	19,756	46.160	911,936.960	
	EMPIRE CO LTD	15,093	24.180	364,948.740	
	KINROSS GOLD CORP	99,741	4.640	462,798.240	
	FINNING INTERNATIONAL INC	9,892	34.250	338,801.000	
	FORTIS INC	33,302	40.760	1,357,389.520	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	55,296	21.830	1,207,111.680	
	TELUS CORP	15,945	45.750	729,483.750	
	GREAT WEST LIFECO INC	19,248	33.450	643,845.600	
IMPERIAL OIL LTD	21,542	42.470	914,888.740		
ENBRIDGE INC	125,330	40.550	5,082,131.500		
IGM FINANCIAL INC	8,426	39.480	332,658.480		
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	87,995	3.660	322,061.700		
MANULIFE FINANCIAL CORP	145,162	24.740	3,591,307.880		
LINAMAR CORP	3,827	65.090	249,099.430		

LOBLAW CO LTD	15,354	65.370	1,003,690.980	
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANCE AND FINANCIAL SERVICES INC	6,524	53.310	347,794.440	
MAGNA INTERNATIONAL INC	25,339	85.470	2,165,724.330	
SUN LIFE FINANCIAL INC	45,976	55.030	2,530,059.280	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,985	742.140	1,473,147.900	
METRO INC	19,226	42.710	821,142.460	
HUSKY ENERGY INC	28,749	19.420	558,305.580	
CRESCENT POINT ENERGY CORP	39,992	9.960	398,320.320	
EMERA INC	6,509	40.150	261,336.350	
METHANEX CORP	5,281	91.880	485,218.280	
ONEX CORP	6,646	94.190	625,986.740	
GOLDCORP INC	66,602	18.330	1,220,814.660	
POWER CORP OF CANADA	25,052	30.480	763,584.960	
POWER FINANCIAL CORP	17,484	32.610	570,153.240	
ROYAL BANK OF CANADA	106,200	99.890	10,608,318.000	
SNC-LAVALIN GROUP INC	13,134	58.500	768,339.000	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	10,607	248.830	2,639,339.810	
SHAW COMM INC-B	35,748	26.980	964,481.040	
SUNCOR ENERGY INC	122,908	52.730	6,480,938.840	
LUNDIN MINING CORP	35,268	8.750	308,595.000	
ENCANA CORP	69,257	16.070	1,112,959.990	
TECK RESOURCES LTD-CL B	41,016	38.200	1,566,811.200	
THOMSON REUTERS CORP	20,469	52.740	1,079,535.060	
TORONTO DOMINION BANK (THE) C\$	136,076	75.200	10,232,915.200	
TRANSCANADA CORP	62,895	54.110	3,403,248.450	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	5,696	96.000	546,816.000	
WESTON (GEORGE) LTD	3,105	103.510	321,398.550	
INTACT FINANCIAL CORP	10,785	95.410	1,028,996.850	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	33,943	28.690	973,824.670	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,494	1,034.330	1,545,289.020	
FRANCO-NEVADA CORP NPR	14,687	91.470	1,343,419.890	
CI FINANCIAL CORP	20,695	25.110	519,651.450	
TOURMALINE OIL CORP	15,779	24.450	385,796.550	
KEYERA CORP	13,728	36.460	500,522.880	
ALTAGAS LTD	12,538	25.010	313,575.380	
PEMBINA PIPELINE CORP	38,497	44.810	1,725,050.570	
DOLLARAMA INC	7,504	151.190	1,134,529.760	
CENOVUS ENERGY INC W/I	80,545	13.000	1,047,085.000	
VERMILION ENERGY INC	8,291	45.700	378,898.700	
ARC RESOURCES LTD	22,997	12.800	294,361.600	

	INTER PIPELINE LTD	24,083	24.810	597,499.230	
	NUTRIEN LTD	45,351	68.090	3,087,949.590	
	WSP GLOBAL INC	8,400	73.280	615,552.000	
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	14,961	26.510	396,616.110	
	SEVEN GENERATIONS ENERGY LTD	17,231	15.000	258,465.000	
	RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	17,753	76.550	1,358,992.150	
	SHOPIFY INC	6,500	210.680	1,369,420.000	
	HYDRO ONE LTD	27,340	19.570	535,043.800	
カナダ・ドル 小計		3,014,837		134,078,822.370 (11,320,274,972)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE TECH ENG	125,000	3.490	436,250.000	
	SEBACORP INDUSTRIES	81,400	2.940	239,316.000	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	123,700	2.700	333,990.000	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	692,140	0.305	211,102.700	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	134,800	28.500	3,841,800.000	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	29,000	11.840	343,360.000	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	5,944	34.520	205,186.880	
	SINGAPORE AIRPORT TERMINAL SERVICES LTD	42,300	5.130	216,999.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	68,900	7.250	499,525.000	
	CAPITALAND LTD	192,415	3.500	673,452.500	
	GENTING SINGAPORE LTD	416,400	1.250	520,500.000	
	KEPPEL CORP LTD	98,400	7.580	745,872.000	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	177,900	2.400	426,960.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	225,453	12.580	2,836,198.740	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	591,922	3.230	1,911,908.060	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	47,500	11.430	542,925.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	94,500	28.020	2,647,890.000	
	UOL GROUP LIMITED	40,500	8.130	329,265.000	
	VENTURE CORP LTD	21,000	21.130	443,730.000	
WILMAR INTERNATIONAL LTD	142,300	3.240	461,052.000		
YANGZIJANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	188,800	1.010	190,688.000		
シンガポール・ドル 小計		3,540,274		18,057,970.880 (1,481,295,351)	
スイス・フラン	CREDIT SUISSE GROUP AG	187,381	15.185	2,845,380.480	
	NESTLE SA-REGISTERED	231,295	73.460	16,990,930.700	
	CIE FINANC RICHEMONT	39,186	92.260	3,615,300.360	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	52,431	207.700	10,889,918.700	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2,835	220.000	623,700.000	

	SIKA INHABER	151	8,240.000	1,244,240.000	
	SGS SA-REG	405	2,611.000	1,057,455.000	
	NOVARTIS AG-REG SHS	164,138	73.860	12,123,232.680	
	BALOISE HOLDING AG -R	4,127	147.000	606,669.000	
	BARRY CALLEBAUT AG	144	1,764.000	254,016.000	
	CLARIANT AG-REG	19,496	24.700	481,551.200	
	SWISSCOM AG-REG	1,795	442.300	793,928.500	
	ABB LTD	139,628	22.660	3,163,970.480	
	ADECCO GROUP AG-REG	12,341	59.740	737,251.340	
	GEBERIT AG	2,801	439.000	1,229,639.000	
	LONZA GROUP AG-REG	5,389	268.000	1,444,252.000	
	LINDT & SPRUENGLI PART	75	6,270.000	470,250.000	
	LINDT & SPRUENGLI NAMEN	9	75,400.000	678,600.000	
	GIVAUDAN-REG	692	2,203.000	1,524,476.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	11,199	294.700	3,300,345.300	
	LAFARGEHOLCIM LTD	35,730	51.860	1,852,957.800	
	TEMENOS GROUP	4,521	146.000	660,066.000	
	SONOVA HOLDING AG	4,142	173.550	718,844.100	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG	3,687	152.350	561,714.450	
	STRAUMANN HOLDING AG	782	691.500	540,753.000	
	THE SWATCH GROUP AG-B	2,311	492.500	1,138,167.500	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	4,592	89.400	410,524.800	
	SCHINDLER NAMEN	1,663	214.000	355,882.000	
	SWISS LIFE HOLDING AG	2,225	342.300	761,617.500	
	VIFOR PHARMA AG	3,050	157.500	480,375.000	
	EMS-CHEMIE HOLDING	553	644.500	356,408.500	
	SWISS PRIME SITE AG	5,990	91.650	548,983.500	
	PARGESA HOLDING PORTEUR	3,000	88.600	265,800.000	
	DUFREY GROUP	2,390	136.850	327,071.500	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,272	730.500	929,196.000	
	JULIUS BAER GROUP LTD	15,227	59.180	901,133.860	
	SWISS RE LTD	24,162	87.060	2,103,543.720	
	UBS GROUP AG	285,455	15.195	4,337,488.720	
	スイス・フラン 小計	1,276,270		81,325,634.690 (9,034,464,758)	
スウェーデン・ク ローナ	ATLAS COPCO AB-A SHS	48,377	353.600	17,106,107.200	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	30,899	319.450	9,870,685.550	
	ERICSSON LM-B SHS	221,748	63.420	14,063,258.160	
	LUNDBERGS B	7,382	285.200	2,105,346.400	
	SKF AB-B SHS	24,866	171.200	4,257,059.200	
	SANDVIK AB	85,032	154.850	13,167,205.200	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	128,935	80.260	10,348,323.100	
	SKANSKA AB-B SHS	21,179	159.550	3,379,109.450	
	SWEDBANK AB	66,507	186.950	12,433,483.650	

	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	108,388	97.300	10,546,152.400	
	VOLVO AB-B SHS	113,672	148.900	16,925,760.800	
	SWEDISH MATCH AB	11,481	425.300	4,882,869.300	
	TELE2 AB-B SHS	26,976	110.800	2,988,940.800	
	NORDEA AB	218,620	84.540	18,482,134.800	
	INDUSTRIVARDEN C	11,403	184.150	2,099,862.450	
	ELECTROLUX AB-SER B	19,191	215.800	4,141,417.800	
	SECURITAS AB-B SHS	24,098	142.650	3,437,579.700	
	INVESTOR AB-B SHS	33,412	366.100	12,232,133.200	
	HENNES&MAURITZ AB-B SHS	66,448	134.600	8,943,900.800	
	ASSA ABLOY AB-B	77,223	189.000	14,595,147.000	
	TELIA CO AB	184,927	42.330	7,827,959.910	
	LUNDIN PETROLEUM AB	16,790	278.800	4,681,052.000	
	BOLIDEN AB	21,855	314.050	6,863,562.750	
	ALFA LAVAL AB	23,343	224.100	5,231,166.300	
	KINNEVIK AB-B	18,310	304.600	5,577,226.000	
	MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR SA	5,332	554.000	2,953,928.000	
	ICA GRUPPEN AB	5,920	270.700	1,602,544.000	
	HUSQVARNA AB-B SHS	33,692	88.020	2,965,569.840	
	HEXAGON AB	18,360	525.600	9,650,016.000	
	ESSITY AB-B	46,071	217.000	9,997,407.000	
スウェーデン・クローナ 小計		1,720,437		243,356,908.760 (3,058,996,343)	
デンマーク・クローネ	CARLSBERG AS-B	7,330	720.200	5,279,066.000	
	A P MOLLER A/S	481	9,588.000	4,611,828.000	
	AP MOLLER MAERSK A	273	8,990.000	2,454,270.000	
	DANSKE BANK A/S	59,087	213.400	12,609,165.800	
	GENMAB A/S	4,613	952.000	4,391,576.000	
	NOVOZYMES-B SHS	15,904	326.000	5,184,704.000	
	NOVO NORDISK A/S-B	131,029	285.550	37,415,330.950	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	15,808	407.600	6,443,340.800	
	COLOPLAST-B	8,286	630.000	5,220,180.000	
	DSV A/S	14,452	531.000	7,674,012.000	
	WILLIAM DEMANT	6,537	241.800	1,580,646.600	
	H LUNDBECK A/S	4,840	450.900	2,182,356.000	
	TRYG A/S	11,107	148.400	1,648,278.800	
	PANDORA A/S	8,251	502.400	4,145,302.400	
	CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S	7,708	640.000	4,933,120.000	
	ISS A/S	11,125	222.400	2,474,200.000	
ORSTED A/S	15,020	371.900	5,585,938.000		
デンマーク・クローネ 小計		321,851		113,833,315.350 (1,971,593,021)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	71,110	6.850	487,103.500	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	29,894	12.230	365,603.620	

	A2 MILK CO LTD	55,091	11.500	633,546.500	
	FISHER & PAYKEL	42,678	14.480	617,977.440	
	FLETCHER BUILDING LTD	64,104	6.880	441,035.520	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	159,623	3.700	590,605.100	
	MERIDIAN ENERGY LTD	90,173	3.140	283,143.220	
ニュージーランド・ドル 小計		512,673		3,419,014.900 (263,400,908)	
ノルウェー・ク ローネ	MARINE HARVEST	33,000	168.650	5,565,450.000	
	DNB ASA	70,426	154.300	10,866,731.800	
	NORSK HYDRO ASA	91,879	53.720	4,935,739.880	
	TELENOR ASA	53,178	171.600	9,125,344.800	
	ORKLA ASA	61,421	74.300	4,563,580.300	
	EQUINOR ASA	87,000	216.700	18,852,900.000	
	YARA INTERNATIONAL ASA	16,000	358.000	5,728,000.000	
	AKER BP ASA	8,552	296.600	2,536,523.200	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	16,683	127.200	2,122,077.600	
	SCHIBSTED ASA	7,445	240.500	1,790,522.500	
ノルウェー・クローネ 小計		445,584		66,086,870.080 (896,798,827)	
ユーロ	CRH PLC	65,287	32.110	2,096,365.570	
	PADDY POWER BETFAIR PLC	6,246	98.350	614,294.100	
	KERRY GROUP PLC-A	11,576	90.250	1,044,734.000	
	UMICORE	15,320	49.650	760,638.000	
	AIR LIQUIDE	32,310	109.500	3,537,945.000	
	AIRBUS SE	43,659	100.900	4,405,193.100	
	AXA	146,116	21.800	3,185,328.800	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	39,913	19.090	761,939.170	
	ADIDAS AG	14,139	199.350	2,818,609.650	
	ASSICURAZIONI GENERALI	88,233	14.170	1,250,261.610	
	DASSAULT AVIATION SA	157	1,687.000	264,859.000	
	DANONE	43,686	64.310	2,809,446.660	
	SAFRAN SA	25,571	102.550	2,622,306.050	
	INTESA SANPAOLO	1,015,652	2.425	2,462,956.100	
	INTESA SANPAOLO-RNC	51,178	2.512	128,559.130	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	24,725	85.640	2,117,449.000	
	ACCOR SA	16,000	43.400	694,400.000	
	BOUYGUES	16,412	39.180	643,022.160	
	BNP PARIBAS	82,934	53.700	4,453,555.800	
	RELX NV	70,826	18.870	1,336,486.620	
	THALES SA	8,128	110.350	896,924.800	
	CAPGEMINI SA	11,481	113.200	1,299,649.200	
	CASINO GUICHARD PERRACHON	4,264	32.820	139,944.480	
	INGENICO GROUP	4,334	70.980	307,627.320	
	UNICREDIT SPA	150,691	13.600	2,049,397.600	
NATIXIS	70,166	6.280	440,642.480		

KONINKLIJKE DSM NV	13,216	88.600	1,170,937.600	
COMMERZBANK AG	83,118	9.324	774,992.230	
EIFFAGE	5,949	96.160	572,055.840	
FRESENIUS SE & CO KGAA	30,924	67.760	2,095,410.240	
UNITED INTERNET	9,882	55.060	544,102.920	
FUCHS PETROLUB SE PREF	5,546	45.160	250,457.360	
PUBLICIS GROUPE	15,068	56.740	854,958.320	
MAN SE	3,396	94.250	320,073.000	
FAURECIA	6,117	72.620	444,216.540	
IBERDROLA SA	416,818	6.354	2,648,461.570	
ENI SPA	190,886	15.224	2,906,048.460	
IMERYS SA	2,256	72.350	163,221.600	
JERONIMO MARTINS	19,517	13.335	260,259.190	
KBC GROUPE	18,378	66.480	1,221,769.440	
HANNOVER RUECK SE	4,868	109.400	532,559.200	
WARTSILA OYJ	34,935	18.195	635,642.320	
L'OREAL	18,584	206.100	3,830,162.400	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	20,764	300.350	6,236,467.400	
GEA GROUP AG	11,838	32.040	379,289.520	
BOLLORE	71,347	4.152	296,232.740	
MEDIOBANCA SPA	42,404	7.828	331,938.510	
MICHELIN(CGDE)-B	12,118	116.450	1,411,141.100	
CONTINENTAL AG	8,317	221.900	1,845,542.300	
DEUTSCHE POST AG-REG	73,325	31.170	2,285,540.250	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	14,426	12.970	187,105.220	
NOKIAN RENKAAT OYJ	9,399	35.150	330,374.850	
AXEL SPRINGER SE	3,067	61.000	187,087.000	
OMV AG	9,766	50.760	495,722.160	
PERNOD-RICARD	15,401	141.100	2,173,081.100	
PEUGEOT SA	42,232	20.600	869,979.200	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG- PFD	10,591	61.880	655,371.080	
RENAULT SA	14,378	83.500	1,200,563.000	
REPSOL SA	93,766	17.035	1,597,303.810	
REMY COINTREAU	1,860	122.900	228,594.000	
MERCK KGAA	9,551	84.520	807,250.520	
COMPAGNIE DE SAINT- GOBAIN	35,706	42.500	1,517,505.000	
RWE AG	39,183	18.900	740,558.700	
SEB SA	1,405	155.700	218,758.500	
LUXOTTICA GROUP SPA	11,602	53.500	620,707.000	
SOCIETE GENERALE-A	58,110	37.230	2,163,435.300	
VINCI S.A.	37,228	84.320	3,139,064.960	
SODEXO	6,286	81.320	511,177.520	
SOLVAY SA	5,036	114.100	574,607.600	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	39,729	73.600	2,924,054.400	
VIVENDI SA	79,680	21.480	1,711,526.400	

SAP SE	73,011	100.440	7,333,224.840	
TELEFONICA S.A	358,674	7.582	2,719,466.260	
TOTAL SA	178,965	53.100	9,503,041.500	
VALEO	17,731	54.020	957,828.620	
E.ON SE	164,012	8.868	1,454,458.410	
VOEST-ALPINE AG	9,875	45.810	452,373.750	
HENKEL AG & CO KGAA	7,858	96.400	757,511.200	
SIEMENS AG-REG	56,716	113.800	6,454,280.800	
UPM-KYMMENE OYJ	41,197	32.080	1,321,599.760	
ING GROEP NV-CVA	290,820	12.662	3,682,362.840	
PUMA AG	456	494.500	225,492.000	
BAYER AG	61,526	98.440	6,056,619.440	
STORA ENSO OYJ-R SHS	42,303	18.075	764,626.720	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	13,222	107.300	1,418,720.600	
DAIMLER AG	67,488	61.960	4,181,556.480	
BASF SE	68,209	85.880	5,857,788.920	
BEIERSDORF AG	6,780	98.000	664,440.000	
HOCHTIEF AG	1,707	156.800	267,657.600	
HEIDELBERGCEMENT AG	11,009	78.520	864,426.680	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	15,048	86.680	1,304,360.640	
ORANGE	141,819	14.675	2,081,193.820	
SAMPO OYJ-A SHS	32,949	41.880	1,379,904.120	
RANDSTAD NV	7,794	52.160	406,535.040	
ALLIANZ SE	32,994	178.580	5,892,068.520	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	189,631	3.376	640,194.250	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	93,187	19.922	1,856,471.410	
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	17,602	24.850	437,409.700	
HERMES INTL	2,285	563.200	1,286,912.000	
ENDESA S.A.	21,037	19.015	400,018.550	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	15,963	22.990	366,989.370	
ERSTE GROUP BANK AG	20,754	36.100	749,219.400	
MUENCHENER RUECKVER AG- REG	11,602	178.850	2,075,017.700	
ARCELOR MITTAL (NL)	47,245	28.045	1,324,986.020	
SOCIETE BIC SA	2,478	80.500	199,479.000	
DASSAULT SYSTEMES SA	8,961	119.250	1,068,599.250	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	18,558	36.700	681,078.600	
HEINEKEN NV	20,425	85.420	1,744,703.500	
AKZO NOBEL	18,209	75.980	1,383,519.820	
ASML HOLDING NV	30,496	175.650	5,356,622.400	
AEGON NV	120,404	5.372	646,810.280	
BANKINTER S.A.	57,960	8.434	488,834.640	
VOLKSWAGEN AG	2,329	160.800	374,503.200	
VOLKSWAGEN AG PFD	13,901	159.400	2,215,819.400	

BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	504,414	6.078	3,065,828.290	
KERING	5,479	505.400	2,769,086.600	
CNP ASSURANCES	13,987	19.610	274,285.070	
FORTUM OYJ	29,739	20.200	600,727.800	
AGEAS	12,993	43.630	566,884.590	
UCB SA	8,747	66.160	578,701.520	
THYSSENKRUPP AG	29,903	23.360	698,534.080	
UNILEVER NV-CVA	121,914	47.420	5,781,161.880	
CARREFOUR SA	39,144	14.965	585,789.960	
GAS NATURAL SDG SA	29,010	21.010	609,500.100	
ATOS SE	7,050	118.100	832,605.000	
NOKIA OYJ	417,248	4.931	2,057,449.880	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	73,000	36.005	2,628,365.000	
WOLTERS KLUWER-CVA	20,558	47.940	985,550.520	
SANOFI	84,037	66.430	5,582,577.910	
STMICROELECTRONICS NV	50,879	21.040	1,070,494.160	
ELISA OYJ	9,517	38.970	370,877.490	
BANCO SANTANDER SA	1,201,199	4.696	5,640,830.500	
METSO OYJ	8,585	30.220	259,438.700	
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	34,596	17.510	605,775.960	
QIAGEN N.V.	17,387	31.020	539,344.740	
1&1 DRILLISCH AG	3,149	60.050	189,097.450	
DEUTSCHE BANK AG-REG	149,244	9.554	1,425,877.170	
BMW VORZUG	4,116	74.600	307,053.600	
K & S	14,982	22.710	340,241.220	
ENEL SPA	607,499	4.594	2,790,850.400	
COLRUYT NV	4,673	45.480	212,528.040	
VOPAK (KON.)	5,364	42.060	225,609.840	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	246,287	13.335	3,284,237.140	
SARTORIUS AG	2,712	122.200	331,406.400	
LEONARDO SPA	26,269	8.638	226,911.620	
UBISOFT ENTERTAINMENT	5,911	95.620	565,209.820	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	81,774	24.730	2,022,271.020	
KONINKLIJKE KPN NV	228,967	2.389	547,002.160	
EUROFINS SCIENTIFIC	794	422.600	335,544.400	
TELEPERFORMANCE	4,436	137.300	609,062.800	
DEUTSCHE BOERSE AG	13,844	117.450	1,625,977.800	
EURAZEO	4,725	65.450	309,251.250	
BANCO SABADELL	367,753	1.460	536,919.380	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	5,814	91.360	531,167.040	
FRAPORT AG	3,149	79.560	250,534.440	
HEINEKEN HOLDING NV-A	8,014	83.000	665,162.000	
INDITEX	82,035	28.290	2,320,770.150	
JC DECAUX SA	6,058	26.660	161,506.280	
ANDRITZ AG	6,265	42.520	266,387.800	
MAPFRE SA	84,474	2.603	219,885.820	

ESSILOR INTL	14,632	117.250	1,715,602.000	
SNAM SPA	158,419	3.456	547,496.060	
CREDIT AGRICOLE SA	85,585	11.890	1,017,605.650	
ENAGAS	18,095	23.850	431,565.750	
WENDEL	2,220	116.200	257,964.000	
WIRECARD AG	8,803	142.000	1,250,026.000	
TENARIS SA	36,959	15.560	575,082.040	
TELECOM ITALIA SPA	792,163	0.672	532,333.530	
TELECOM ITALIA-RNC	497,596	0.593	295,074.420	
ATLANTIA SPA	34,969	23.580	824,569.020	
ILIAD SA	2,102	147.700	310,465.400	
PROXIMUS	14,283	22.470	320,939.010	
SES FDR	24,585	15.600	383,526.000	
TERNA SPA	112,686	4.442	500,551.210	
BIOMERIEUX	3,248	76.800	249,446.400	
GRIFOLS SA	18,800	26.910	505,908.000	
FERROVIAL SA	36,997	18.305	677,230.080	
LANXESS AG	6,856	69.180	474,298.080	
NESTE OYJ	8,839	70.880	626,508.320	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	9,641	27.430	264,452.630	
RECORDATI SPA	6,859	32.550	223,260.450	
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	35,583	6.445	229,332.430	
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	3,960	161.700	640,332.000	
KONE OYJ	23,717	44.240	1,049,240.080	
ENGIE	139,590	13.500	1,884,465.000	
ALSTOM	12,046	41.000	493,886.000	
TELENET GROUP HOLDING NV	3,634	41.820	151,973.880	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	12,542	17.335	217,415.570	
ELECTRICITE DE FRANCE	43,198	11.120	480,361.760	
IPSEN SA	2,487	133.450	331,890.150	
DEUTSCHE WOHNEN	26,714	40.500	1,081,917.000	
ARKEMA SA	5,230	103.300	540,259.000	
LEGRAND SA	19,920	63.840	1,271,692.800	
ADP	2,313	176.000	407,088.000	
ORION OYJ	8,051	26.350	212,143.850	
RTL GROUP SA	3,446	64.750	223,128.500	
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	37,921	16.085	609,959.280	
SYMRISE AG	9,628	70.700	680,699.600	
SCOR SE	13,875	31.790	441,086.250	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	17,397	33.700	586,278.900	
REXEL SA	23,245	12.680	294,746.600	
PRYSMIAN SPA	14,925	24.160	360,588.000	
CAIXABANK	262,372	3.845	1,008,820.340	
BUREAU VERITAS SA	21,480	21.670	465,471.600	
GETLINK	37,646	11.710	440,834.660	

SUEZ SA	25,406	11.435	290,517.610	
AMADEUS IT GROUP SA	32,520	70.320	2,286,806.400	
BRENNTAG AG	12,353	50.120	619,132.360	
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GROUP SA	44,747	7.870	352,158.890	
EVONIK INDUSTRIES AG	11,575	30.420	352,111.500	
EDENRED	18,306	25.890	473,942.340	
BANKIA SA	100,675	3.353	337,563.270	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	61,541	3.627	223,209.200	
HUGO BOSS AG -ORD	5,218	78.360	408,882.480	
OSRAM LICHT AG	7,017	51.700	362,778.900	
KION GROUP AG	4,686	70.540	330,550.440	
VONOVIA SE	35,308	40.650	1,435,270.200	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	73,287	7.220	529,132.140	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	10,000	35.200	352,000.000	
FERRARI NV	9,503	115.300	1,095,695.900	
METRO AG	10,774	11.320	121,961.680	
INNOGY SE	9,769	36.400	355,591.600	
CNH INDUSTRIAL NV	78,645	9.710	763,642.950	
AIB GROUP PLC	52,322	4.890	255,854.580	
LINDE AG-TENDER	13,854	196.850	2,727,159.900	
FERROVIAL SA-RTS	36,997	0.312	11,543.060	
MONCLER SPA	14,353	39.750	570,531.750	
NN GROUP NV	21,965	36.510	801,942.150	
ZALANDO SE	6,674	46.030	307,204.220	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	76,719	17.960	1,377,873.240	
AENA SME SA	5,256	159.000	835,704.000	
ABN AMRO GROUP NV	29,129	23.040	671,132.160	
EXOR NV	7,726	58.900	455,061.400	
COVESTRO AG	14,459	78.120	1,129,537.080	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	57,180	80.100	4,580,118.000	
POSTE ITALIANE SPA	40,015	7.084	283,466.260	
AMUNDI SA	3,894	64.220	250,072.680	
SCHAEFFLER AG	12,644	13.250	167,533.000	
BAYER AG-RTS	61,526	1.498	92,165.940	
PIRELLI & C SPA	34,086	7.276	248,009.730	
UNIPER SE	13,897	25.600	355,763.200	
DELIVERY HERO AG	7,238	41.120	297,626.560	
ユーロ 小計	14,556,382		295,907,606.680 (38,189,835,719)	
香港・ドル				
ASM PACIFIC TECH	16,600	106.500	1,767,900.000	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	164,000	17.980	2,948,720.000	
BANK OF EAST ASIA	76,260	32.650	2,489,889.000	
CLP HOLDINGS LTD	119,500	81.950	9,793,025.000	

PCCW LTD	331,000	4.560	1,509,360.000	
LI & FUNG LTD	532,400	3.090	1,645,116.000	
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	49,000	59.400	2,910,600.000	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	89,040	260.000	23,150,400.000	
MTR CORP	118,500	44.500	5,273,250.000	
HANG LUNG GROUP LTD	63,000	24.400	1,537,200.000	
HANG SENG BANK LTD	56,000	200.200	11,211,200.000	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	92,228	45.950	4,237,876.600	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	96,500	55.450	5,350,925.000	
(THE) WHARF HOLDINGS LTD	95,750	25.800	2,470,350.000	
HONG KONG & CHINA GAS	671,050	15.480	10,387,854.000	
HYSAN DEVELOPMENT CO	50,000	45.800	2,290,000.000	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	186,000	64.400	11,978,400.000	
KERRY PROPERTIES LTD	33,000	41.350	1,364,550.000	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	262,000	39.950	10,466,900.000	
NWS HOLDINGS LTD	135,000	14.700	1,984,500.000	
YUE YUEN INDUSTRIAL HOLDINGS	50,500	23.000	1,161,500.000	
NEW WORLD DEVELOPMENT	441,266	12.100	5,339,318.600	
SHANGRI-LA ASIA LTD	104,000	16.620	1,728,480.000	
SINO LAND CO	255,400	14.140	3,611,356.000	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	114,000	126.900	14,466,600.000	
SWIRE PACIFIC LTD A	30,000	83.250	2,497,500.000	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	113,500	46.200	5,243,700.000	
WHEELLOCK & CO LTD	56,000	59.200	3,315,200.000	
MINTH GROUP LTD	44,000	38.000	1,672,000.000	
SJM HOLDINGS LTD	156,000	10.240	1,597,440.000	
WYNN MACAU LTD	124,400	27.450	3,414,780.000	
MGM CHINA HOLDINGS LTD	64,800	20.800	1,347,840.000	
AIA GROUP LTD	904,027	71.950	65,044,742.650	
HKT TRUST / HKT LTD	282,000	10.020	2,825,640.000	
SANDS CHINA LTD	169,200	44.750	7,571,700.000	
SWIRE PROPERTIES LTD	104,200	30.950	3,224,990.000	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT CO LTD	95,750	60.400	5,783,300.000	
HK ELECTRIC INVESTMENTS & HK ELECTRIC INVESTMENTS LTD	230,000	7.520	1,729,600.000	
WH GROUP LTD	701,500	7.880	5,527,820.000	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	199,332	90.050	17,949,846.600	
CK ASSET HOLDINGS LTD	184,332	66.300	12,221,211.600	
香港・ドル 小計	7,661,035		282,042,581.050	

			(3,931,673,580)	
合計	92,645,675		296,035,690,571 (296,035,690,571)	

(2) 株式以外の有価証券

平成30年6月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	オーストラリア・ドル	DEXUS	80,596.000	788,228.880	
		GOODMAN GROUP	121,619.000	1,145,650.980	
		GPT GROUP	144,955.000	727,674.100	
		LENLEASE GROUP	37,363.000	713,259.670	
		MIRVAC GROUP	295,783.000	647,764.770	
		SCENTRE GROUP	383,688.000	1,599,978.960	
		STOCKLAND	194,018.000	803,234.520	
		VICINITY CENTRES	270,443.000	708,560.660	
	オーストラリア・ドル	小計	1,528,465.000	7,134,352.540 (593,863,505)	
	シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	200,806.000	532,135.900	
		CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	206,300.000	350,710.000	
		CAPITALAND MALL TRUST	199,000.000	413,920.000	
		SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	192,100.000	338,096.000	
	シンガポール・ドル	小計	798,206.000	1,634,861.900 (134,107,722)	
	投資信託受益証券	合計		2,326,671	727,971,227 (727,971,227)
投資証券	アメリカ・ドル	AGNC INVESTMENT CORP	32,741.000	621,424.180	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	7,304.000	928,995.760	
		AMERICAN TOWER CORP	32,749.000	4,538,356.420	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	77,528.000	817,145.120	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	10,542.000	1,769,158.440	
		BOSTON PROPERTIES INC	11,168.000	1,369,755.200	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	6,285.000	572,752.050	
		CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	30,388.000	3,131,179.520	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	15,118.000	1,656,479.260	
		DUKE REALTY TRUST	24,470.000	702,778.400	
		EQUINIX INC	5,887.000	2,374,521.450	
		EQUITY RESIDENTIAL	27,070.000	1,748,722.000	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	5,024.000	1,210,733.760	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	9,741.000	954,812.820	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	6,000.000	725,160.000	
		GGP INC	50,863.000	1,051,338.210	
HCP INC	34,130.000	830,724.200			

	HOST HOTELS & RESORTS INC	51,147.000	1,129,837.230	
	INVITATION HOMES INC	22,567.000	500,084.720	
	IRON MOUNTAIN INC	19,265.000	666,761.650	
	KIMCO REALTY	32,980.000	540,212.400	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	11,649.000	523,622.550	
	MID AMERICA	8,123.000	782,163.670	
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	10,544.000	442,426.240	
	PROLOGIS INC	38,966.000	2,569,807.700	
	PUBLIC STORAGE	11,151.000	2,414,749.050	
	REALTY INCOME CORP	22,285.000	1,187,121.950	
	REGENCY CENTERS CORP	11,294.000	671,654.180	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	8,169.000	1,285,147.080	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	23,209.000	3,838,304.420	
	SL GREEN	7,097.000	699,409.350	
	THE MACERICH COMPANY	9,014.000	513,798.000	
	UDR INC	21,658.000	811,525.260	
	VENTAS INC	25,041.000	1,373,248.440	
	VEREIT INC	72,429.000	520,040.220	
	VORNADO REALTY TRUST	12,211.000	874,307.600	
	WELLTOWER INC	26,516.000	1,537,662.840	
	WEYERHAEUSER CO	56,867.000	2,167,201.370	
アメリカ・ドル 小計		889,190.000	50,053,122.710 (5,476,312,155)	
イギリス・ボンド	BRITISH LAND CO PLC	71,871.000	491,597.640	
	HAMMERSON PLC	58,616.000	312,657.740	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	59,062.000	554,769.360	
	SEGRO PLC	82,914.000	557,016.250	
イギリス・ボンド 小計		272,463.000	1,916,040.990 (281,159,855)	
カナダ・ドル	H & R REAL ESTATE INVESTMENT	10,748.000	218,399.360	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	9,675.000	233,554.500	
	SMARTCENTRES REIT	2,582.000	78,079.680	
カナダ・ドル 小計		23,005.000	530,033.540 (44,750,731)	
ユーロ	COVIVIO	2,343.000	207,355.500	
	GECINA SA	3,670.000	545,729.000	
	ICADE	2,234.000	179,613.600	
	KLEPIERRE	17,042.000	567,498.600	
	UNIBAIL-RODAMCO SE & WFD UNIBAIL-RODAMCO NV	10,338.000	1,985,929.800	
ユーロ 小計		35,627.000	3,486,126.500 (449,919,486)	
香港・ドル	LINK REIT	163,500.000	11,984,550.000	
香港・ドル 小計		163,500.000	11,984,550.000 (167,064,628)	

投資証券 合計	1,383,785	6,419,206,855 (6,419,206,855)	
合計		7,147,178,082 (7,147,178,082)	

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 600銘柄	63.02%	-%	-%	66.78%
	投資証券 38銘柄	-%	-%	1.75%	
イギリス・ポンド	株式 98銘柄	6.75%	-%	-%	7.05%
	投資証券 4銘柄	-%	-%	0.09%	
イスラエル・シケル	株式 9銘柄	0.10%	-%	-%	0.11%
オーストラリア・ドル	株式 59銘柄	2.39%	-%	-%	2.66%
	投資信託 受益証券 8銘柄	-%	0.19%	-%	
カナダ・ドル	株式 87銘柄	3.62%	-%	-%	3.75%
	投資証券 3銘柄	-%	-%	0.01%	
シンガポール・ドル	株式 21銘柄	0.47%	-%	-%	0.53%
	投資信託 受益証券 4銘柄	-%	0.04%	-%	
スイス・フラン	株式 38銘柄	2.89%	-%	-%	2.98%
スウェーデン・クローナ	株式 30銘柄	0.98%	-%	-%	1.01%
デンマーク・クローネ	株式 17銘柄	0.63%	-%	-%	0.65%
ニュージーランド・ドル	株式 7銘柄	0.08%	-%	-%	0.09%
ノルウェー・クローネ	株式 10銘柄	0.29%	-%	-%	0.30%
ユーロ	株式 242銘柄	12.22%	-%	-%	12.74%
	投資証券 5銘柄	-%	-%	0.14%	
香港・ドル	株式 41銘柄	1.26%	-%	-%	1.35%
	投資証券 1銘柄	-%	-%	0.05%	

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

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

「外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成29年12月11日現在	平成30年6月11日現在
資産の部			
流動資産			
預金		359,312,848	198,226,266
コール・ローン		124,592,247	50,687,140
投資信託受益証券		6,078,593,099	5,408,502,119
投資証券		48,197,526,646	47,114,890,486
派生商品評価勘定		60,814	133,720
未収入金		355,207	48,847,206
未収配当金		85,289,208	39,722,312
流動資産合計		54,845,730,069	52,861,009,249
資産合計		54,845,730,069	52,861,009,249
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		3,350	120
未払金		332,839,444	86,340,758
未払解約金		71,609,000	58,196,000
その他未払費用		-	510
流動負債合計		404,451,794	144,537,388
負債合計		404,451,794	144,537,388
純資産の部			
元本等			
元本	1	43,966,878,704	44,350,594,689
剰余金			
剰余金又は欠損金()		10,474,399,571	8,365,877,172
元本等合計		54,441,278,275	52,716,471,861
純資産合計		54,441,278,275	52,716,471,861
負債純資産合計		54,845,730,069	52,861,009,249

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	平成29年12月11日現在	平成30年6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	36,587,045,283円	43,966,878,704円
同期中追加設定元本額	16,080,609,497円	21,283,053,504円
同期中一部解約元本額	8,700,776,076円	20,899,337,519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）	259,436,746円	244,897,013円
DIAM先進国REITインデックスファンド<為替ヘッジあり>（ファンドラップ）	67,592,212円	90,625,991円
MITO ラップ型ファンド（安定型）	5,952,717円	5,197,248円
MITO ラップ型ファンド（中立型）	15,294,678円	21,023,866円
MITO ラップ型ファンド（積極型）	40,205,489円	39,466,459円

グローバル8資産ラップファンド(安定型)	22,195,990円	32,207,993円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	20,297,177円	46,051,893円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	28,756,420円	41,790,488円
たわらノーロード 先進国リート	1,629,383,910円	2,175,537,668円
たわらノーロード 先進国リート<ラップ向け>	361,919,156円	522,210,280円
たわらノーロード 先進国リート<為替ヘッジあり>	123,705,209円	138,439,636円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	16,530,116円	66,419,832円
たわらノーロード バランス(堅実型)	8,087円	400,391円
たわらノーロード バランス(標準型)	41,257円	7,905,227円
たわらノーロード バランス(積極型)	98,684円	32,636,289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	2,719,624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)	49,181円	14,541,627円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(成長型)	90,164円	12,446,581円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(積極型)	122,951円	33,563,394円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	- 円	80,728円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	- 円	881,429円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	- 円	1,042,643円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	- 円	3,534,345円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	22,842,669円	23,851,883円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	541,590,645円	605,308,573円
マネックス資産設計ファンドエボリューション	78,019,353円	64,548,816円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	25,533,392円	31,772,724円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	82,501,849円	104,551,468円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	178,946,185円	226,501,981円
投資のソムリエ	5,945,400,383円	6,010,068,047円
投資のソムリエ<DC年金>	369,898,842円	445,654,770円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	96,488,767円	119,939,477円

投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	164,457,206円	208,844,575円
ダイナミック・ナビゲーション	286,863円	282,304円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	2,152,464,782円	3,795,337,659円
ワールドアセットバランス(基本コース)	1,084,970,314円	1,383,436,091円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	3,831,363,774円	5,622,314,658円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	750,278円	1,637,534円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	750,278円	1,069,966円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	719,560円	986,988円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	737,705円	2,386,033円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	-円	112,763,676円
DIAMパッシブ資産分散ファンド	1,154,217,638円	1,192,999,535円
DIAM外国リートインデックスファンド<DC年金>	20,809,211円	27,214,851円
DIAM世界アセットバランスファンドVA(適格機関投資家向け)	3,320,847,770円	1,478,631,738円
DIAMグローバル 私募ファンド(適格機関投資家向け)	11,580,328円	11,580,328円
DIAM世界アセットバランスファンド2VA(適格機関投資家限定)	11,576,729,030円	11,315,005,751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)	3,378,690,199円	2,154,006,440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)	3,516,755,372円	1,669,544,120円
P-Oneマルチアセット戦略ファンド(適格機関投資家限定)	3,257,586,698円	3,647,231,593円
DIAM海外リートインデックスファンド(適格機関投資家限定)	560,259,469円	559,502,465円
計	43,966,878,704円	44,350,594,689円
2. 受益権の総数	43,966,878,704口	44,350,594,689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6月13日 至 平成29年12月11日	自 平成29年12月12日 至 平成30年6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12月11日現在	平成30年6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12月11日現在	平成30年6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	216,877,113	39,317,700
投資証券	81,576,304	101,727,959
合計	298,453,417	141,045,659

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成29年6月23日から平成29年12月11日まで及び平成29年6月23日から平成30年6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12月11日 現在				平成30年6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	-	-	-	-	68,063,600	-	67,930,000	133,600
アメリカ・ドル	-	-	-	-	50,456,120	-	50,322,400	133,720
イギリス・ボンド	-	-	-	-	17,607,480	-	17,607,600	120
買 建	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・ボンド	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	2,408,436	-	2,408,400	36	-	-	-	-
香港・ドル	3,772,600	-	3,783,000	10,400	-	-	-	-
合計	87,859,366	-	87,916,830	57,464	68,063,600	-	67,930,000	133,600

(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12月11日現在	平成30年6月11日現在
1口当たり純資産額	1,2382円	1,1886円
(1万口当たり純資産額)	(12,382円)	(11,886円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

平成30年6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	137,440.000	520,897.600	
		ARENA REIT	108,676.000	242,347.480	
		BWP TRUST	205,883.000	660,884.430	
		CHARTER HALL GROUP	196,697.000	1,250,992.920	
		CHARTER HALL LONG WALE REIT	72,501.000	308,854.260	
		CHARTER HALL RETAIL REIT	140,441.000	591,256.610	
		CROMWELL PROPERTY GROUP	674,830.000	742,313.000	
		DEXUS	428,072.000	4,186,544.160	
		FOLKESTONE EDUCATION TRUST	88,555.000	239,098.500	
		GDI PROPERTY GROUP	208,566.000	269,050.140	
		GOODMAN GROUP	676,390.000	6,371,593.800	
		GPT GROUP	761,372.000	3,822,087.440	
		GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA	104,165.000	372,910.700	
		HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD	62,650.000	201,733.000	
		INDUSTRIA REIT	42,579.000	108,576.450	
		INGENIA COMMUNITIES GROUP	85,235.000	224,168.050	
		INVESTA OFFICE FUND	211,438.000	1,069,876.280	
		MIRVAC GROUP	1,571,815.000	3,442,274.850	
		NATIONAL STORAGE REIT	223,901.000	354,883.080	
		PROPERTYLINK GROUP	151,222.000	158,783.100	
		RURAL FUNDS GROUP	104,894.000	223,424.220	
		SCENTRE GROUP	2,250,637.000	9,385,156.290	
		SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	307,102.000	749,328.880	
STOCKLAND	1,028,074.000	4,256,226.360			
VICINITY CENTRES	1,363,217.000	3,571,628.540			
VIVA ENERGY REIT	183,737.000	378,498.220			
	オーストラリア・ドル 小計		11,390,089.000	43,703,388.360 (3,637,870,048)	
	カナダ・ドル	KILLAM APARTMENT REIT	15,367.000	228,968.300	
	カナダ・ドル 小計		15,367.000	228,968.300 (19,331,794)	
	シンガポール・ドル	AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL REIT	235,095.000	329,133.000	

	ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	317,200.000	239,486.000	
	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	1,014,360.000	2,688,054.000	
	ASCOTT RESIDENCE TRUST	548,015.000	602,816.500	
	CACHE LOGISTICS TRUST	435,780.000	344,266.200	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	1,106,779.000	1,881,524.300	
	CAPITALAND MALL TRUST	1,136,760.000	2,364,460.800	
	CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST	234,580.000	370,636.400	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	314,300.000	521,738.000	
	ESR REIT	539,430.000	267,017.850	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	359,600.000	235,538.000	
	FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	236,600.000	321,776.000	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	247,600.000	544,720.000	
	FRASERS COMMERCIAL TRUST	270,880.000	376,523.200	
	FRASERS LOGISTICS & INDUSTRIAL TRUST	590,900.000	614,536.000	
	KEPPEL DC REIT	402,200.000	559,058.000	
	KEPPEL REIT	769,700.000	892,852.000	
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST	798,300.000	251,464.500	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	811,800.000	1,290,762.000	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	524,220.000	1,027,471.200	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	876,220.000	1,086,512.800	
	MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL TRUST	912,600.000	1,067,742.000	
	QUE HOSPITALITY TRUST	488,620.000	390,896.000	
	PARKWAY LIFE REIT	167,700.000	452,790.000	
	SABANA SHARIAH COMP IND REIT	296,000.000	128,760.000	
	SOILBUILD BUSINESS SPACE REIT	276,100.000	182,226.000	
	SPH REIT	265,400.000	262,746.000	
	STARHILL GLOBAL REIT	550,500.000	377,092.500	
	SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	952,790.000	1,676,910.400	
	シンガポール・ドル 小計	15,680,029.000	21,349,509.650 (1,751,300,277)	
投資信託受益証券	合計	27,085,485	5,408,502,119 (5,408,502,119)	
投資証券	アメリカ・ドル	ACADIA REALTY TRUST	35,553.000	966,686.070

AGREE REALTY CORP	13,167.000	702,064.440	
ALEXANDER & BALDWIN INC	28,742.000	625,713.340	
ALEXANDER'S INC.	1,606.000	613,251.100	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	42,771.000	5,440,043.490	
AMERICAN ASSETS TRUST INC	17,616.000	655,843.680	
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	57,893.000	2,452,926.410	
AMERICAN HOMES 4 RENT	106,793.000	2,237,313.350	
AMERICOLD REALTY TRUST	19,990.000	433,783.000	
APARTMENT INVT & MGMT CO-A	66,724.000	2,782,390.800	
APPLE HOSPITALITY REIT INC	88,952.000	1,670,518.560	
ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC	19,187.000	279,938.330	
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	35,805.000	259,586.250	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	58,394.000	9,799,681.080	
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH REIT INC	8,916.000	80,600.640	
BOSTON PROPERTIES INC	65,252.000	8,003,157.800	
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	13,902.000	145,136.880	
BRANDYWINE REALTY TRUST	74,331.000	1,221,258.330	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	129,251.000	2,171,416.800	
CAMDEN PROPERTY TRUST	39,066.000	3,560,084.580	
CARETRUST REIT INC	32,366.000	539,864.880	
CBL & ASSOCIATES	72,069.000	412,234.680	
CEDAR REALTY TRUST INC	33,531.000	151,895.430	
CHATHAM LODGING TRUST	19,517.000	398,341.970	
CHESAPEAKE LODGING TRUST	25,520.000	821,233.600	
CITY OFFICE REIT INC	14,463.000	179,341.200	
CLIPPER REALTY INC	5,169.000	48,691.980	
COLONY NORTHSTAR INC	217,832.000	1,267,782.240	
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	50,891.000	1,155,225.700	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	6,974.000	192,761.360	
CORECIVIC INC	50,174.000	1,075,730.560	
CORESITE REALTY CORP	14,529.000	1,559,978.730	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	42,988.000	1,193,346.880	
COUSINS PROPERTIES INC	178,182.000	1,742,619.960	
CUBESMART	77,311.000	2,423,699.850	
CYRUSONE INC	40,772.000	2,390,462.360	

DCT INDUSTRIAL TRUST INC	39,742.000	2,652,381.080	
DDR CORP	64,983.000	1,103,411.340	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	85,121.000	1,062,310.080	
DIGITAL REALTY TRUST INC	86,876.000	9,519,003.320	
DOUGLAS EMMETT INC	67,600.000	2,604,628.000	
DUKE REALTY TRUST	150,592.000	4,325,002.240	
EAST GROUP	14,741.000	1,400,837.230	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	18,694.000	372,197.540	
EDUCATION REALTY TRUST INC	32,161.000	1,282,580.680	
EMPIRE STATE REALTY TRUST INC	54,549.000	941,515.740	
EPR PROPERTIES	27,430.000	1,716,569.400	
EQUITY COMMONWEALTH	52,790.000	1,640,713.200	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	37,342.000	3,442,185.560	
EQUITY RESIDENTIAL	155,700.000	10,058,220.000	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	27,911.000	6,726,271.890	
EXTRA SPACE STORAGE INC	53,193.000	5,213,977.860	
FARMLAND PARTNERS INC	14,523.000	126,350.100	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	30,863.000	3,730,102.180	
FIRST INDUSTRIAL RT	50,981.000	1,708,883.120	
FOREST CITY REALTY TRUST INC	113,135.000	2,298,903.200	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST INC	26,006.000	594,237.100	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	44,756.000	352,229.720	
GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	84,705.000	2,979,921.900	
GEO GROUP INC	52,635.000	1,314,295.950	
GETTY REALTY CORP	13,326.000	354,604.860	
GGP INC	266,850.000	5,515,789.500	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	11,218.000	209,215.700	
GLADSTONE LAND CORP	5,526.000	70,290.720	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	8,278.000	72,846.400	
GLOBAL NET LEASE INC	28,621.000	556,106.030	
GOVERNMENT PROPERTIES INCOME TRUST	42,132.000	597,853.080	
GRAMERCY PROPERTY TRSUT	68,158.000	1,880,479.220	
HCP INC	198,084.000	4,821,364.560	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	52,993.000	1,439,819.810	

HEALTHCARE TRUST OF AMERICA INC	86,903.000	2,168,229.850	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	15,638.000	333,245.780	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	43,810.000	2,144,937.600	
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	69,715.000	1,998,729.050	
HOST HOTELS & RESORTS INC	310,286.000	6,854,217.740	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	65,870.000	2,344,972.000	
INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	34,580.000	342,687.800	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES TRUST	8,484.000	181,557.600	
INFREIT INC	16,132.000	341,353.120	
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	50,011.000	289,563.690	
INVITATION HOMES INC	120,949.000	2,680,229.840	
IRON MOUNTAIN INC	118,707.000	4,108,449.270	
ISTAR INC	28,395.000	313,480.800	
JBG SMITH PROPERTIES	39,622.000	1,506,824.660	
KILROY REALTY CORP	41,605.000	3,201,504.750	
KIMCO REALTY	179,680.000	2,943,158.400	
KITE REALTY GROUP TRUST	35,532.000	582,369.480	
LASALLE HOTEL PROPERTIES	48,034.000	1,690,316.460	
LEXINGTON REALTY TRUST	91,973.000	797,405.910	
LIBERTY PROPERTY TRUST	62,537.000	2,811,038.150	
LIFE STORAGE INC	19,733.000	1,857,269.960	
LTC PROPERTIES INC	16,835.000	699,999.300	
MACK CALI	38,286.000	772,994.340	
MANULIFE US REIT	511,500.000	455,235.000	
MEDEQUITIES REALTY TRUST INC	13,143.000	134,584.320	
MEDICAL PROPERTIES TRUST	154,694.000	2,159,528.240	
MID AMERICA	47,941.000	4,616,238.890	
MONMOUTH RE INVEST CP -CL A	33,032.000	512,656.640	
NATIONAL HEALTH INVS INC	17,625.000	1,299,667.500	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	65,269.000	2,738,687.240	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUST	21,369.000	629,744.430	
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP INC	34,578.000	255,185.640	

NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	7,762.000	215,550.740	
NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP	21,513.000	305,914.860	
OMEGA HEALTHCARE INVS INC	84,226.000	2,579,000.120	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	6,553.000	169,263.990	
PARAMOUNT GROUP INC	86,597.000	1,318,872.310	
PARK HOTELS & RESORTS INC	85,299.000	2,695,448.400	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	29,264.000	1,183,436.160	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	29,416.000	350,344.560	
PHYSICIANS REALTY TRUST	76,067.000	1,130,355.620	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC	54,405.000	1,059,265.350	
PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES INC	16,134.000	244,107.420	
PROLOGIS INC	225,518.000	14,872,912.100	
PS BUSINESS PARKS	8,446.000	1,041,391.800	
PUBLIC STORAGE	63,381.000	13,725,155.550	
QTS REALTY TRUST INC	21,476.000	888,247.360	
QUALITY CARE PROPERTIES INC	39,836.000	844,523.200	
RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES	33,773.000	426,890.720	
REALTY INCOME CORP	120,113.000	6,398,419.510	
REGENCY CENTERS CORP	62,654.000	3,726,033.380	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	47,738.000	881,720.860	
RETAIL PROPERTIES OF AMERICA INC	96,389.000	1,242,454.210	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	33,318.000	1,034,190.720	
RLJ LODGING TRUST	74,135.000	1,703,622.300	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	21,716.000	1,825,446.960	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	75,620.000	1,584,995.200	
SAUL CENTERS INC	5,042.000	255,629.400	
SELECT INCOME REIT	27,352.000	582,597.600	
SENIOR HOUSING PPTYS TRUST	100,809.000	1,773,230.310	
SERITAGE GROWTH PROPERTIES	11,004.000	484,286.040	
SIMON PROPERTY GROUP INC	131,556.000	21,756,731.280	
SL GREEN	38,089.000	3,753,670.950	
SPIRIT MTA REIT	17,097.000	158,660.160	

	SPIRIT REALTY CAPITAL INC	183,583.000	1,437,454.890	
	STAG INDUSTRIAL INC	39,936.000	1,077,073.920	
	STORE CAPITAL CORP	70,122.000	1,884,879.360	
	SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	44,281.000	642,517.310	
	SUN COMMUNITIES INC	33,439.000	3,239,904.710	
	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	95,603.000	1,622,382.910	
	TANGER FACTORY OUTLET	40,143.000	899,604.630	
	TAUBMAN CENTERS INC	25,845.000	1,462,051.650	
	TERRENO REALTY CORP	23,552.000	894,504.960	
	THE MACERICH COMPANY	45,998.000	2,621,886.000	
	TIER REIT INC	20,328.000	451,688.160	
	UDR INC	113,114.000	4,238,381.580	
	UMH PROPERTIES INC	13,007.000	190,812.690	
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	5,259.000	331,527.360	
	URBAN EDGE PROPERTIES	44,936.000	1,004,319.600	
	URSTADT BIDDLE PROPERTIES	12,432.000	271,639.200	
	VENTAS INC	150,594.000	8,258,574.960	
	VEREIT INC	413,134.000	2,966,302.120	
	VORNADO REALTY TRUST	73,134.000	5,236,394.400	
	WASHINGTON PRIME GROUP INC	78,952.000	613,457.040	
	WASHINGTON REIT	33,313.000	977,070.290	
	WEINGARTEN REALTY INVST	50,686.000	1,509,935.940	
	WELLTOWER INC	156,604.000	9,081,465.960	
	WHEELER REIT INC	2,961.000	11,340.630	
	WHITESTONE REIT	15,579.000	190,998.540	
	WP CAREY INC	45,338.000	3,035,832.480	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	45,298.000	1,138,338.740	
	アメリカ・ドル 小計	9,960,351.000	341,608,477.240 (37,375,383,495)	
	イギリス・ポンド			
	AEW UK LONG LEASE REIT PLC	37,060.000	33,946.960	
	ASSURA PLC	1,013,326.000	589,755.730	
	BIG YELLOW GROUP PLC	63,285.000	599,308.950	
	BRITISH LAND CO PLC	419,592.000	2,870,009.280	
	CAPITAL & REGIONAL PLC	229,731.000	119,460.120	
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	81,480.000	83,517.000	
	DERWENT LONDON PLC	47,088.000	1,433,829.600	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	228,600.000	199,796.400	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	119,899.000	838,813.400	

	HAMMERSON PLC	336,849.000	1,796,752.560	
	HANSTEEN HOLDINGS PLC	163,211.000	180,184.940	
	INTU PROPERTIES PLC	372,244.000	736,298.630	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	317,138.000	2,978,877.230	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	295,326.000	560,824.070	
	LXI REIT PLC	73,400.000	82,942.000	
	NEWRIVER REIT PLC	131,034.000	379,343.430	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC	312,940.000	354,873.960	
	RDI REIT PLC	528,881.000	188,281.630	
	REGIONAL REIT LTD	118,301.000	112,385.950	
	SAFESTORE HOLDINGS LTD	89,348.000	501,242.280	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT TRUST LTD	221,364.000	135,696.130	
	SEGRO PLC	419,252.000	2,816,534.930	
	SHAFTESBURY PLC	104,587.000	1,004,035.200	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	626,950.000	954,844.850	
	UNITE GROUP PLC	111,920.000	963,071.600	
	WORKSPACE GROUP PLC	50,811.000	579,245.400	
	イギリス・ポンド 小計	6,513,617.000	21,093,872.230 (3,095,314,811)	
イスラエル・シュケル	REIT 1 LTD	70,287.000	1,047,979.170	
	イスラエル・シュケル 小計	70,287.000	1,047,979.170 (32,141,521)	
カナダ・ドル	AGELLAN COMMERCIAL REIT	7,030.000	94,623.800	
	ALLIED PROPERTIES REIT	19,518.000	836,151.120	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	30,141.000	401,478.120	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	9,781.000	462,347.870	
	CANADIAN APT PPTYS REIT	28,900.000	1,176,808.000	
	CHOICE PROPERTIES REIT	58,346.000	698,985.080	
	COMINAR REAL ESTATE INVT TR	38,546.000	469,490.280	
	CROMBIE REAL ESTATE INV	18,049.000	232,110.140	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	12,724.000	165,920.960	
	DREAM GLOBAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	37,235.000	540,279.850	
	DREAM INDUSTRIAL REIT	13,888.000	149,018.240	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV TRUST	12,463.000	303,349.420	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	9,917.000	533,336.260	
	H & R REAL ESTATE INVESTMENT	60,656.000	1,232,529.920	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	20,114.000	221,656.280	

	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT	7,446.000	115,040.700	
	MORGUARD REAL ESTATE INVT TR	10,016.000	132,712.000	
	NORTHVIEW APARTMENT REIT	10,096.000	263,505.600	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	21,137.000	237,791.250	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	66,632.000	1,608,496.480	
	SLATE OFFICE REIT	12,079.000	91,196.450	
	SLATE RETAIL REIT	7,739.000	99,600.930	
	SMARTCENTRES REIT	27,854.000	842,304.960	
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	13,569.000	117,778.920	
カナダ・ドル 小計		553,876.000	11,026,512.630 (930,968,461)	
ニュージーランド・ドル	ARGOSY PROPERTY LTD	356,878.000	394,350.190	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	441,448.000	640,099.600	
	INVESTORE PROPERTY LTD	88,877.000	134,204.270	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	606,953.000	828,490.840	
	PRECINCT PROPERTIES	423,696.000	557,160.240	
	STRIDE STAPLED GROUP	149,101.000	277,327.860	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	129,943.000	265,733.430	
ニュージーランド・ドル 小計		2,196,896.000	3,097,366.430 (238,621,110)	
ユーロ	AEDIFICA	7,647.000	611,760.000	
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	59,160.000	748,965.600	
	ALTAREA	1,576.000	317,564.000	
	BEFIMMO	9,800.000	516,460.000	
	BENI STABILI SPA	437,760.000	333,135.360	
	COFINIMMO SA	8,342.000	893,428.200	
	COVIVIO	22,872.000	2,024,172.000	
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	21,124.000	755,394.240	
	GECINA SA	20,314.000	3,020,691.800	
	GREEN REIT PLC	293,629.000	445,728.820	
	HAMBORNER REIT AG	33,143.000	305,909.890	
	HIBERNIA REIT PLC	299,530.000	453,488.420	
	HISPANIA ACTIVOS INMOBILIARIOS SOCIMI SA	46,179.000	816,444.720	
	ICADE	19,139.000	1,538,775.600	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE	20,030.000	143,635.130	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA	136,980.000	1,271,174.400	
	INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	6,873.000	148,113.150	

	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES REIT PLC	138,876.000	187,760.350	
	KLEPIERRE	87,462.000	2,912,484.600	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA	39,724.000	343,612.600	
	MERCIALYS	22,547.000	349,027.560	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	141,716.000	1,714,055.020	
	NSI NV	7,625.000	275,643.750	
	RETAIL ESTATES	3,100.000	236,530.000	
	UNIBAIL-RODAMCO SE & WFD UNIBAIL-RODAMCO NV	57,184.000	10,985,046.400	
	VASTNED RETAIL	6,794.000	279,912.800	
	WAREHOUSES DE PAUW	6,864.000	735,820.800	
	WERELDHAVE NV	17,195.000	568,810.600	
	ユーロ 小計	1,973,185.000	32,933,545.810 (4,250,403,422)	
香港・ドル	CHAMPION REIT	871,070.000	4,808,306.400	
	FORTUNE REAL ESTATE (HK)	588,000.000	5,515,440.000	
	LINK REIT	920,020.000	67,437,466.000	
	PROSPERITY REIT	522,000.000	1,691,280.000	
	SPRING REIT	351,000.000	1,165,320.000	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	403,000.000	2,204,410.000	
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	492,000.000	2,691,240.000	
	香港・ドル 小計	4,147,090.000	85,513,462.400 (1,192,057,666)	
投資証券 合計		25,415,302	47,114,890,486 (47,114,890,486)	
合計			52,523,392,605 (52,523,392,605)	

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

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

通貨	銘柄数	組入 投資信託受益証券 時価比率	組入 投資証券 時価比率	有価証券の 合計金額 に対する比率
アメリカ・ドル	投資証券 161銘柄	-%	70.90%	71.16%
イギリス・ポンド	投資証券 26銘柄	-%	5.87%	5.89%
イスラエル・シェケル	投資証券 1銘柄	-%	0.06%	0.06%
オーストラリア・ドル	投資信託受益証券 26銘柄	6.90%	-%	6.93%
カナダ・ドル	投資信託受益証券 1銘柄 投資証券 24銘柄	0.04% -%	-% 1.77%	1.81%
シンガポール・ドル	投資信託受益証券 29銘柄	3.32%	-%	3.33%
ニュージーランド・ドル	投資証券 7銘柄	-%	0.45%	0.45%
ユーロ	投資証券 28銘柄	-%	8.06%	8.09%

香港・ドル	投資証券	7銘柄	-%	2.26%	2.27%
-------	------	-----	----	-------	-------

(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。

「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12月11日現在	平成30年6月11日現在
資産の部			
流動資産			
預金		83,158,955	2,910,245,030
コール・ローン		5,572,852,881	3,108,345,413
国債証券		243,504,965,311	281,954,244,331
派生商品評価勘定		7,776,191	59,538,999
未収利息		1,481,757,558	1,752,077,848
前払費用		248,563,343	319,510,797
流動資産合計		250,899,074,239	290,103,962,418
資産合計		250,899,074,239	290,103,962,418
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		2,136,282,931	3,490,532,576
未払解約金		165,693,000	88,402,000
その他未払費用		-	2,930
流動負債合計		2,301,975,931	3,578,937,506
負債合計		2,301,975,931	3,578,937,506
純資産の部			
元本等			
元本	1	184,770,487,694	217,773,827,773
剰余金			
剰余金又は欠損金()		63,826,610,614	68,751,197,139
元本等合計		248,597,098,308	286,525,024,912
純資産合計		248,597,098,308	286,525,024,912
負債純資産合計		250,899,074,239	290,103,962,418

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12月11日現在	平成30年6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	130,406,252,857円	184,770,487,694円
同期中追加設定元本額	61,904,502,601円	69,265,063,782円
同期中一部解約元本額	7,540,267,764円	36,261,723,703円
元本の内訳		
ファンド名		
たわらノーロード 先進国債券	1,233,223,388円	1,825,689,957円
＜為替ヘッジあり＞		
たわらノーロード バランス	245,390円	11,905,634円
（堅実型）		
たわらノーロード バランス	171,030円	32,979,567円
（標準型）		
たわらノーロード バランス	96,669円	32,197,500円
（積極型）		
たわらノーロード スマートグ	215,951円	996,308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	223,398円	35,946,593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	171,272円	42,097,855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	119,146円	13,708,427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	52,126円	12,937,105円
ローバルバランス（積極型）		
たわらノーロード 最適化バラ	- 円	501,860円
ンス（保守型）		

たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	- 円	554,630円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	- 円	2,623,214円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	- 円	1,343,331円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	- 円	1,802,746円
投資のソムリエ	25,360,362,901円	31,790,569,769円
投資のソムリエ<DC年金>	1,578,476,730円	2,358,441,751円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	1,377,723,715円	2,060,956,067円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	17,989,365,550円	37,389,577,479円
ワールドアセットバランス(基本コース)	5,367,468,791円	6,071,699,281円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	19,163,175,809円	24,248,058,692円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	1,986,329円	3,905,024円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	1,986,329円	2,558,403円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	5,979,665円	9,712,584円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	2,755,232円	7,009,842円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	- 円	3,098,874,074円
外国債券パッシブファンド2(為替フルヘッジ)(適格機関投資家限定)	8,840,073,265円	8,825,007,351円
DIAM世界アセットバランスファンド2VA(適格機関投資家限定)	21,053,132,877円	19,933,515,218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)	1,124,594,525円	1,087,234,352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)	7,202,876,378円	6,954,082,433円
DIAM世界アセットバランスファンド3VA(適格機関投資家限定)	34,275,084,041円	33,063,469,353円
DIAMバランス30VA(適格機関投資家限定)	19,169,705円	25,667,266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)	30,504,529,482円	29,512,697,660円
DIAMバランス20VA(適格機関投資家限定)	165,715,433円	154,999,985円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA(1212)(適格機関投資家限定)	2,852,126,136円	2,619,820,816円

D I A M世界アセットバランス ファンド7VA(1303) (適格機関投資家限定)	2,672,709,186円	2,627,419,330円
D I A M世界アセットバランス ファンド7VA(1306) (適格機関投資家限定)	3,520,962,596円	3,475,672,740円
D I A M世界アセットバランス ファンド7VA(1309) (適格機関投資家限定)	455,714,649円	437,593,576円
計	184,770,487,694円	217,773,827,773円
2 . 受益権の総数	184,770,487,694口	217,773,827,773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6月13日 至 平成29年12月11日	自 平成29年12月12日 至 平成30年6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12月11日現在	平成30年6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12月11日現在	平成30年6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	1,405,413,869	8,008,384,999
合計	1,405,413,869	8,008,384,999

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(平成29年6月23日から平成29年12月11日まで及び平成29年6月23日から平成30年6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12月11日 現在				平成30年6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	242,266,853,548	-	244,395,360,288	2,128,506,740	285,306,695,589	-	288,737,689,166	3,430,993,577
アメリカ・ドル	104,052,235,345	-	105,671,173,784	1,618,938,439	127,106,641,019	-	128,052,678,402	946,037,383
イギリス・ポンド	16,831,523,877	-	16,916,967,155	85,443,278	20,463,088,569	-	20,770,963,395	307,874,826
オーストラリア・ドル	5,164,021,780	-	5,191,010,242	26,988,462	6,213,211,657	-	6,292,205,036	78,993,379
カナダ・ドル	5,130,482,791	-	5,219,193,318	88,710,527	6,116,943,219	-	6,166,372,192	49,428,973
シンガポール・ドル	764,081,068	-	772,434,828	8,353,760	980,489,978	-	990,332,855	9,842,877
スウェーデン・クローナ	1,038,954,822	-	1,039,008,768	53,946	958,958,591	-	979,626,609	20,668,018
デンマーク・クローネ	1,446,945,221	-	1,450,441,206	3,495,985	1,575,955,541	-	1,601,663,536	25,707,995
ノルウェー・クローネ	583,052,653	-	591,003,312	7,950,659	682,032,581	-	697,179,264	15,146,683
ポーランド・ズロチ	1,438,339,357	-	1,444,380,208	6,040,851	1,744,906,707	-	1,793,301,444	48,394,737
マレーシア・リンギット	1,006,363,779	-	1,013,354,700	6,990,921	1,169,108,424	-	1,165,992,300	3,116,124
メキシコ・ペソ	2,003,326,472	-	1,999,514,160	3,812,312	2,333,605,685	-	2,318,007,875	15,597,810
ユーロ	101,668,069,088	-	101,929,023,198	260,954,110	114,143,234,915	-	116,131,672,620	1,988,437,705
南アフリカ・ランド	1,139,457,295	-	1,157,855,409	18,398,114	1,818,518,703	-	1,777,693,638	40,825,065
合計	242,266,853,548	-	244,395,360,288	2,128,506,740	285,306,695,589	-	288,737,689,166	3,430,993,577

(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12月11日現在	平成30年6月11日現在
1口当たり純資産額	1.3454円	1.3157円
(1万口当たり純資産額)	(13,454円)	(13,157円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

平成30年6月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	US T N/B 0.75 08/15/19	7,000,000.000	6,868,470.000	
		US T N/B 0.875 07/31/19	10,000,000.000	9,832,800.000	
		US T N/B 0.875 09/15/19	22,500,000.000	22,071,825.000	
		US T N/B 1.0 09/30/19	10,700,000.000	10,507,721.000	
		US T N/B 1.0 11/15/19	16,000,000.000	15,681,760.000	
		US T N/B 1.0 11/30/19	17,000,000.000	16,648,610.000	
		US T N/B 1.125 03/31/20	11,000,000.000	10,739,080.000	
		US T N/B 1.125 06/30/21	10,000,000.000	9,555,400.000	
		US T N/B 1.125 07/31/21	13,900,000.000	13,262,546.000	
		US T N/B 1.125 08/31/21	11,000,000.000	10,478,270.000	
		US T N/B 1.125 12/31/19	14,500,000.000	14,217,250.000	
		US T N/B 1.25 02/29/20	4,200,000.000	4,113,522.000	
		US T N/B 1.25 07/31/23	8,400,000.000	7,781,088.000	
		US T N/B 1.25 10/31/19	12,300,000.000	12,104,430.000	
		US T N/B 1.25 10/31/21	10,500,000.000	10,015,950.000	
		US T N/B 1.375 01/31/21	17,000,000.000	16,471,300.000	
		US T N/B 1.375 03/31/20	7,620,000.000	7,471,714.800	
		US T N/B 1.375 04/30/20	11,510,000.000	11,274,390.300	
		US T N/B 1.375 04/30/21	10,000,000.000	9,653,900.000	
		US T N/B 1.375 05/31/20	21,400,000.000	20,935,192.000	
		US T N/B 1.375 08/31/23	9,500,000.000	8,844,595.000	
		US T N/B 1.375 09/30/23	9,000,000.000	8,367,840.000	
		US T N/B 1.375 10/31/20	10,000,000.000	9,725,000.000	
		US T N/B 1.5 06/15/20	13,000,000.000	12,746,500.000	
		US T N/B 1.5 08/15/26	9,800,000.000	8,789,326.000	
		US T N/B 1.5 10/31/19	4,840,000.000	4,778,919.200	
		US T N/B 1.625 02/15/26	12,200,000.000	11,119,080.000	
		US T N/B 1.625 04/30/23	9,800,000.000	9,284,716.000	
		US T N/B 1.625 05/15/26	9,000,000.000	8,180,820.000	
		US T N/B 1.625 08/15/22	15,900,000.000	15,199,923.000	
		US T N/B 1.625 08/31/19	11,800,000.000	11,690,732.000	
		US T N/B 1.625 11/15/22	16,080,000.000	15,326,169.600	
		US T N/B 1.625 11/30/20	10,000,000.000	9,772,600.000	
		US T N/B 1.75 02/28/22	10,500,000.000	10,142,265.000	
		US T N/B 1.75 05/15/22	15,770,000.000	15,195,183.500	
		US T N/B 1.75 05/15/23	5,000,000.000	4,763,650.000	
US T N/B 1.75 05/31/22	20,000,000.000	19,256,200.000			
US T N/B 1.75 06/30/22	15,000,000.000	14,435,100.000			
US T N/B 1.75 09/30/22	15,600,000.000	14,968,668.000			
US T N/B 1.875 03/31/22	13,300,000.000	12,894,749.000			

US T N/B 2.0 02/15/22	10,000,000.000	9,753,500.000	
US T N/B 2.0 02/15/23	14,000,000.000	13,531,840.000	
US T N/B 2.0 02/15/25	8,600,000.000	8,140,416.000	
US T N/B 2.0 05/31/21	11,560,000.000	11,350,879.600	
US T N/B 2.0 06/30/24	10,800,000.000	10,289,484.000	
US T N/B 2.0 07/31/20	12,600,000.000	12,461,148.000	
US T N/B 2.0 08/15/25	11,600,000.000	10,929,288.000	
US T N/B 2.0 08/31/21	12,900,000.000	12,633,873.000	
US T N/B 2.0 09/30/20	12,660,000.000	12,502,636.200	
US T N/B 2.0 10/31/22	4,280,000.000	4,147,234.400	
US T N/B 2.0 11/15/21	7,900,000.000	7,723,119.000	
US T N/B 2.0 11/15/26	8,900,000.000	8,284,565.000	
US T N/B 2.0 11/30/22	12,020,000.000	11,641,490.200	
US T N/B 2.125 03/31/24	10,500,000.000	10,099,635.000	
US T N/B 2.125 05/15/25	8,400,000.000	7,997,640.000	
US T N/B 2.125 08/15/21	9,590,000.000	9,432,244.500	
US T N/B 2.125 08/31/20	17,180,000.000	17,024,177.400	
US T N/B 2.125 09/30/21	9,800,000.000	9,629,186.000	
US T N/B 2.125 09/30/24	13,000,000.000	12,447,500.000	
US T N/B 2.125 12/31/21	7,000,000.000	6,863,780.000	
US T N/B 2.125 12/31/22	13,500,000.000	13,132,935.000	
US T N/B 2.25 01/31/24	13,400,000.000	12,998,000.000	
US T N/B 2.25 02/15/27	10,300,000.000	9,752,761.000	
US T N/B 2.25 03/31/21	11,920,000.000	11,803,541.600	
US T N/B 2.25 08/15/27	9,500,000.000	8,976,740.000	
US T N/B 2.25 08/15/46	6,000,000.000	5,063,880.000	
US T N/B 2.25 11/15/24	12,600,000.000	12,142,242.000	
US T N/B 2.25 11/15/25	10,800,000.000	10,329,120.000	
US T N/B 2.25 11/15/27	12,100,000.000	11,415,503.000	
US T N/B 2.25 12/31/24	15,000,000.000	14,430,450.000	
US T N/B 2.375 01/31/23	2,760,000.000	2,711,700.000	
US T N/B 2.375 05/15/27	9,600,000.000	9,182,976.000	
US T N/B 2.375 08/15/24	12,610,000.000	12,266,125.300	
US T N/B 2.375 12/31/20	16,950,000.000	16,862,538.000	
US T N/B 2.5 01/31/25	2,980,000.000	2,913,397.000	
US T N/B 2.5 02/15/45	6,900,000.000	6,175,983.000	
US T N/B 2.5 02/15/46	5,600,000.000	4,997,104.000	
US T N/B 2.5 03/31/23	6,720,000.000	6,638,083.200	
US T N/B 2.5 05/15/24	10,790,000.000	10,591,895.600	
US T N/B 2.5 05/15/46	9,550,000.000	8,514,398.000	
US T N/B 2.5 08/15/23	6,700,000.000	6,607,339.000	
US T N/B 2.625 02/28/23	1,190,000.000	1,182,836.200	
US T N/B 2.625 03/31/25	2,400,000.000	2,361,744.000	
US T N/B 2.625 08/15/20	13,350,000.000	13,376,566.500	
US T N/B 2.625 11/15/20	11,860,000.000	11,873,401.800	
US T N/B 2.75 02/15/24	11,930,000.000	11,886,097.600	
US T N/B 2.75 02/15/28	10,540,000.000	10,371,992.400	
US T N/B 2.75 02/28/25	6,290,000.000	6,241,818.600	
US T N/B 2.75 08/15/42	3,220,000.000	3,048,663.800	

US T N/B 2.75 08/15/47	5,850,000.000	5,466,064.500	
US T N/B 2.75 11/15/23	7,000,000.000	6,980,820.000	
US T N/B 2.75 11/15/42	4,500,000.000	4,257,045.000	
US T N/B 2.75 11/15/47	6,950,000.000	6,503,671.000	
US T N/B 2.875 05/15/43	5,230,000.000	5,053,487.500	
US T N/B 2.875 08/15/45	6,620,000.000	6,374,331.800	
US T N/B 2.875 11/15/46	6,200,000.000	5,959,254.000	
US T N/B 3.0 02/15/47	6,000,000.000	5,910,000.000	
US T N/B 3.0 02/15/48	6,450,000.000	6,349,186.500	
US T N/B 3.0 05/15/42	2,310,000.000	2,287,800.900	
US T N/B 3.0 05/15/45	6,200,000.000	6,114,750.000	
US T N/B 3.0 05/15/47	5,920,000.000	5,817,288.000	
US T N/B 3.0 11/15/44	6,500,000.000	6,411,080.000	
US T N/B 3.0 11/15/45	6,100,000.000	6,014,173.000	
US T N/B 3.125 02/15/42	2,760,000.000	2,792,126.400	
US T N/B 3.125 02/15/43	4,700,000.000	4,747,705.000	
US T N/B 3.125 05/15/21	100,000.000	101,394.000	
US T N/B 3.125 08/15/44	6,260,000.000	6,320,596.800	
US T N/B 3.125 11/15/41	2,350,000.000	2,377,706.500	
US T N/B 3.375 05/15/44	6,300,000.000	6,637,617.000	
US T N/B 3.375 11/15/19	2,250,000.000	2,279,610.000	
US T N/B 3.5 02/15/39	2,150,000.000	2,311,572.500	
US T N/B 3.625 02/15/20	19,500,000.000	19,870,890.000	
US T N/B 3.625 02/15/21	2,010,000.000	2,063,606.700	
US T N/B 3.625 02/15/44	7,610,000.000	8,353,116.500	
US T N/B 3.625 08/15/19	6,200,000.000	6,288,350.000	
US T N/B 3.625 08/15/43	5,000,000.000	5,484,750.000	
US T N/B 3.75 08/15/41	3,990,000.000	4,451,962.200	
US T N/B 3.75 11/15/43	7,100,000.000	7,948,663.000	
US T N/B 3.875 08/15/40	2,450,000.000	2,779,770.000	
US T N/B 4.25 05/15/39	1,790,000.000	2,132,194.300	
US T N/B 4.25 11/15/40	3,100,000.000	3,707,631.000	
US T N/B 4.375 02/15/38	1,210,000.000	1,457,009.400	
US T N/B 4.375 05/15/40	2,560,000.000	3,108,992.000	
US T N/B 4.375 05/15/41	2,100,000.000	2,558,703.000	
US T N/B 4.375 11/15/39	2,000,000.000	2,425,140.000	
US T N/B 4.5 02/15/36	2,100,000.000	2,539,194.000	
US T N/B 4.5 05/15/38	1,700,000.000	2,081,956.000	
US T N/B 4.5 08/15/39	2,000,000.000	2,462,500.000	
US T N/B 4.625 02/15/40	3,370,000.000	4,222,744.800	
US T N/B 4.75 02/15/41	2,600,000.000	3,323,528.000	
US T N/B 5.0 05/15/37	890,000.000	1,148,927.700	
US T N/B 5.25 02/15/29	830,000.000	1,004,424.500	
US T N/B 5.25 11/15/28	1,700,000.000	2,050,880.000	
US T N/B 5.375 02/15/31	2,300,000.000	2,886,316.000	
US T N/B 5.5 08/15/28	930,000.000	1,138,589.700	
US T N/B 6.0 02/15/26	800,000.000	971,248.000	
US T N/B 6.125 11/15/27	950,000.000	1,198,928.500	
US T N/B 6.25 05/15/30	1,200,000.000	1,596,180.000	

	US T N/B 6.25 08/15/23	1,200,000.000	1,400,808.000	
	US T N/B 6.5 11/15/26	500,000.000	634,175.000	
	US T N/B 8.0 11/15/21	2,100,000.000	2,465,358.000	
	US T N/B 8.125 08/15/19	3,900,000.000	4,158,804.000	
アメリカ・ドル 小計		1,167,360,000.000 (127,720,857,600)	1,144,883,345.000 (125,261,686,776)	
イギリス・ボンド	UK TREASURY 0.5 07/22/22	4,850,000.000	4,758,092.500	
	UK TREASURY 0.75 07/22/23	2,980,000.000	2,929,071.800	
	UK TREASURY 1.25 07/22/27	3,950,000.000	3,884,548.500	
	UK TREASURY 1.5 01/22/21	3,800,000.000	3,869,084.000	
	UK TREASURY 1.5 07/22/26	2,850,000.000	2,885,682.000	
	UK TREASURY 1.5 07/22/47	3,310,000.000	3,046,524.000	
	UK TREASURY 1.625 10/22/28	920,000.000	927,498.000	
	UK TREASURY 1.75 07/22/57	2,730,000.000	2,740,647.000	
	UK TREASURY 1.75 09/07/22	3,420,000.000	3,530,260.800	
	UK TREASURY 1.75 09/07/37	1,700,000.000	1,673,140.000	
	UK TREASURY 2.0 07/22/20	3,600,000.000	3,694,752.000	
	UK TREASURY 2.0 09/07/25	3,250,000.000	3,424,167.500	
	UK TREASURY 2.25 09/07/23	3,000,000.000	3,177,720.000	
	UK TREASURY 2.5 07/22/65	2,800,000.000	3,541,020.000	
	UK TREASURY 2.75 09/07/24	2,500,000.000	2,737,725.000	
	UK TREASURY 3.25 01/22/44	3,740,000.000	4,778,972.000	
	UK TREASURY 3.5 01/22/45	4,030,000.000	5,396,976.000	
	UK TREASURY 3.5 07/22/68	2,980,000.000	4,803,164.000	
	UK TREASURY 3.75 07/22/52	2,540,000.000	3,805,682.000	
	UK TREASURY 3.75 09/07/19	3,900,000.000	4,049,994.000	
	UK TREASURY 3.75 09/07/20	3,050,000.000	3,255,173.500	
UK TREASURY 3.75 09/07/21	2,200,000.000	2,404,974.000		

	UK TREASURY 4.0 01/22/60	2,240,000.000	3,760,064.000	
	UK TREASURY 4.0 03/07/22	2,350,000.000	2,620,226.500	
	UK TREASURY 4.25 03/07/36	3,300,000.000	4,529,580.000	
	UK TREASURY 4.25 06/07/32	2,350,000.000	3,099,180.000	
	UK TREASURY 4.25 09/07/39	2,250,000.000	3,199,725.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/27	2,050,000.000	2,569,347.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/40	2,820,000.000	4,063,056.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/46	2,530,000.000	3,860,780.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/49	2,130,000.000	3,361,566.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/55	2,800,000.000	4,715,200.000	
	UK TREASURY 4.5 09/07/34	3,150,000.000	4,364,325.000	
	UK TREASURY 4.5 12/07/42	3,000,000.000	4,550,700.000	
	UK TREASURY 4.75 03/07/20	2,600,000.000	2,783,508.000	
	UK TREASURY 4.75 12/07/30	2,320,000.000	3,142,904.000	
	UK TREASURY 4.75 12/07/38	2,570,000.000	3,856,028.000	
	UK TREASURY 5.0 03/07/25	2,200,000.000	2,741,046.000	
	UK TREASURY 6.0 12/07/28	1,450,000.000	2,085,535.000	
	UK TREASURY 8.0 06/07/21	1,520,000.000	1,843,851.200	
	イギリス・ボンド 小計	111,730,000.000 (16,395,260,200)	136,461,490.300 (20,024,359,087)	
	オーストラリア・ドル			
	AUSTRALIAN 4.5 04/15/20	3,740,000.000	3,904,260.800	
	AUSTRALIAN 5.75 05/15/21	4,700,000.000	5,172,820.000	
	AUSTRALIAN 1.75 11/21/20	4,500,000.000	4,459,815.000	
	AUSTRALIAN 2.0 12/21/21	2,700,000.000	2,676,510.000	
	AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	4,120,000.000	3,927,184.000	
	AUSTRALIAN 2.25 11/21/22	1,500,000.000	1,492,485.000	

	AUSTRALIAN 2.75 04/21/24	4,000,000.000	4,048,960.000	
	AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	1,100,000.000	1,051,578.000	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	4,290,000.000	4,271,510.100	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/28	3,590,000.000	3,577,542.700	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/29	1,130,000.000	1,122,078.700	
	AUSTRALIAN 3.0 03/21/47	1,860,000.000	1,756,026.000	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	4,650,000.000	4,833,954.000	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	4,350,000.000	4,534,744.500	
	AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	970,000.000	978,797.900	
	AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	1,900,000.000	2,068,340.000	
	AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	5,190,000.000	5,763,027.900	
	AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	2,220,000.000	2,628,901.800	
	AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	4,750,000.000	5,498,695.000	
	AUSTRALIAN 5.5 04/21/23	4,150,000.000	4,735,440.500	
	AUSTRALIAN 5.75 07/15/22	3,890,000.000	4,411,182.200	
	オーストラリア・ドル 小計	69,300,000.000 (5,768,532,000)	72,913,854.100 (6,069,349,215)	
カナダ・ドル	CANADA 8.0 06/01/27	900,000.000	1,313,775.000	
	CANADA 0.5 03/01/22	2,280,000.000	2,151,111.600	
	CANADA 0.75 03/01/21	4,660,000.000	4,506,499.600	
	CANADA 0.75 08/01/19	3,300,000.000	3,262,347.000	
	CANADA 0.75 09/01/20	4,600,000.000	4,480,722.000	
	CANADA 0.75 09/01/21	1,870,000.000	1,794,227.600	
	CANADA 1.0 06/01/27	2,480,000.000	2,219,996.800	
	CANADA 1.0 09/01/22	2,300,000.000	2,196,707.000	
	CANADA 1.25 02/01/20	2,360,000.000	2,335,857.200	
	CANADA 1.25 11/01/19	3,200,000.000	3,174,080.000	
	CANADA 1.5 03/01/20	4,250,000.000	4,221,695.000	
	CANADA 1.5 06/01/23	2,200,000.000	2,132,064.000	
	CANADA 1.5 06/01/26	2,060,000.000	1,943,939.600	
	CANADA 1.75 03/01/23	2,500,000.000	2,455,375.000	
	CANADA 1.75 05/01/20	1,100,000.000	1,096,645.000	
	CANADA 1.75 09/01/19	2,000,000.000	1,999,000.000	
	CANADA 2.0 06/01/28	1,350,000.000	1,311,687.000	
	CANADA 2.0 09/01/23	410,000.000	406,379.700	
	CANADA 2.25 06/01/25	2,000,000.000	1,999,980.000	
	CANADA 2.5 06/01/24	2,250,000.000	2,286,742.500	
	CANADA 2.75 06/01/22	1,850,000.000	1,895,787.500	

	CANADA 2.75 12/01/48	2,390,000.000	2,595,779.000	
	CANADA 2.75 12/01/64	770,000.000	864,771.600	
	CANADA 3.25 06/01/21	2,400,000.000	2,484,192.000	
	CANADA 3.5 06/01/20	2,000,000.000	2,060,420.000	
	CANADA 3.5 12/01/45	2,590,000.000	3,180,779.000	
	CANADA 4.0 06/01/41	2,480,000.000	3,192,206.400	
	CANADA 5.0 06/01/37	2,020,000.000	2,832,767.200	
	CANADA 5.75 06/01/29	1,700,000.000	2,261,017.000	
	CANADA 5.75 06/01/33	2,070,000.000	2,954,738.700	
カナダ・ドル 小計		68,340,000.000 (5,769,946,200)	71,611,290.000 (6,046,141,215)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE 1.25 10/01/21	800,000.000	778,400.000	
	SINGAPORE 1.75 02/01/23	270,000.000	264,945.600	
	SINGAPORE 1.75 04/01/22	300,000.000	295,590.000	
	SINGAPORE 2.125 06/01/26	400,000.000	390,200.000	
	SINGAPORE 2.25 06/01/21	800,000.000	803,840.000	
	SINGAPORE 2.25 08/01/36	300,000.000	272,400.000	
	SINGAPORE 2.375 06/01/25	500,000.000	498,250.000	
	SINGAPORE 2.75 03/01/46	750,000.000	718,980.000	
	SINGAPORE 2.75 04/01/42	760,000.000	731,120.000	
	SINGAPORE 2.75 07/01/23	700,000.000	715,365.000	
	SINGAPORE 2.875 07/01/29	200,000.000	204,800.000	
	SINGAPORE 2.875 09/01/30	610,000.000	620,370.000	
	SINGAPORE 3.0 09/01/24	1,240,000.000	1,284,020.000	
	SINGAPORE 3.125 09/01/22	1,200,000.000	1,248,000.000	
	SINGAPORE 3.25 09/01/20	980,000.000	1,007,146.000	
	SINGAPORE 3.375 09/01/33	680,000.000	723,608.400	
SINGAPORE 3.5 03/01/27	1,260,000.000	1,355,760.000		
シンガポール・ドル 小計		11,750,000.000 (963,852,500)	11,912,795.000 (977,206,574)	
スウェーデン・クローナ	SWEDEN 0.75 05/12/28	9,270,000.000	9,396,350.100	
	SWEDEN 1.0 11/12/26	9,290,000.000	9,721,892.100	
	SWEDEN 1.5 11/13/23	12,920,000.000	13,971,171.200	
	SWEDEN 2.5 05/12/25	9,890,000.000	11,443,323.400	
	SWEDEN 3.5 03/30/39	7,320,000.000	10,285,405.200	
	SWEDEN 3.5 06/01/22	17,760,000.000	20,418,672.000	
スウェーデン・クローナ 小計		66,450,000.000 (835,276,500)	75,236,814.000 (945,726,752)	
デンマーク・クローネ	DENMARK 0.25 11/15/20	5,000,000.000	5,098,200.000	
	DENMARK 0.5 11/15/27	9,470,000.000	9,522,747.900	
	DENMARK 1.5 11/15/23	8,570,000.000	9,303,163.500	
	DENMARK 1.75 11/15/25	12,750,000.000	14,226,067.500	
	DENMARK 3.0 11/15/21	13,540,000.000	15,101,162.000	

	DENMARK 4.5 11/15/39	20,910,000.000	35,560,382.400	
デンマーク・クローネ	小計	70,240,000.000 (1,216,556,800)	88,811,723.300 (1,538,219,048)	
ノルウェー・クローネ	NORWAY 1.5 02/19/26	5,610,000.000	5,544,643.500	
	NORWAY 1.75 02/17/27	7,030,000.000	7,032,812.000	
	NORWAY 1.75 03/13/25	5,990,000.000	6,051,397.500	
	NORWAY 2.0 05/24/23	9,380,000.000	9,663,745.000	
	NORWAY 3.0 03/14/24	9,430,000.000	10,212,029.900	
ノルウェー・クローネ	小計	37,440,000.000 (508,060,800)	38,504,627.900 (522,507,801)	
ポーランド・ズロチ	POLAND 07/25/20	1,500,000.000	1,449,750.000	
	POLAND 1.5 04/25/20	4,100,000.000	4,098,770.000	
	POLAND 1.75 07/25/21	4,500,000.000	4,473,450.000	
	POLAND 2.0 04/25/21	4,000,000.000	4,016,000.000	
	POLAND 2.25 04/25/22	5,500,000.000	5,502,200.000	
	POLAND 2.5 01/25/23	2,640,000.000	2,643,960.000	
	POLAND 2.5 07/25/26	5,520,000.000	5,261,388.000	
	POLAND 2.5 07/25/27	4,890,000.000	4,602,419.100	
	POLAND 2.75 04/25/28	1,000,000.000	955,150.000	
	POLAND 3.25 07/25/25	5,200,000.000	5,262,868.000	
	POLAND 4.0 10/25/23	4,070,000.000	4,349,812.500	
	POLAND 5.25 10/25/20	2,880,000.000	3,120,192.000	
	POLAND 5.5 10/25/19	3,210,000.000	3,385,587.000	
	POLAND 5.75 04/25/29	1,800,000.000	2,213,208.000	
	POLAND 5.75 09/23/22	3,380,000.000	3,845,426.000	
POLAND 5.75 10/25/21	2,690,000.000	3,015,086.500		
ポーランド・ズロチ	小計	56,880,000.000 (1,716,638,400)	58,195,267.100 (1,756,333,161)	
マレーシア・リングgit	MALAYSIA 3.418 08/15/22	5,000,000.000	4,900,000.000	
	MALAYSIA 3.48 03/15/23	3,910,000.000	3,829,766.800	
	MALAYSIA 3.502 05/31/27	4,580,000.000	4,275,979.600	
	MALAYSIA 3.844 04/15/33	1,340,000.000	1,211,360.000	
	MALAYSIA 3.9 11/30/26	1,500,000.000	1,454,250.000	
	MALAYSIA 4.127 04/15/32	1,180,000.000	1,108,326.800	
	MALAYSIA 4.16 07/15/21	6,460,000.000	6,530,414.000	
	MALAYSIA 4.181 07/15/24	2,190,000.000	2,187,087.300	
	MALAYSIA 4.232 06/30/31	2,000,000.000	1,911,000.000	
	MALAYSIA 4.378 11/29/19	5,160,000.000	5,224,500.000	
	MALAYSIA 4.392 04/15/26	1,480,000.000	1,485,905.200	
	MALAYSIA 4.498 04/15/30	2,820,000.000	2,770,706.400	
	MALAYSIA 4.935 09/30/43	3,470,000.000	3,515,595.800	
	MALAYSIA 5.248 09/15/28	1,480,000.000	1,572,440.800	
マレーシア・リングgit	小計	42,570,000.000 (1,169,397,900)	41,977,332.700 (1,153,117,329)	
メキシコ・ペソ	MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	13,880,000.000	16,668,075.600	
	MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	45,604,000.000	50,692,950.360	

	MEXICAN BONDS 5.75 03/05/26	21,500,000.000	18,924,945.000	
	MEXICAN BONDS 6.5 06/09/22	42,000,000.000	40,094,460.000	
	MEXICAN BONDS 6.5 06/10/21	47,647,000.000	46,027,478.470	
	MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	34,386,000.000	33,635,009.760	
	MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	21,054,000.000	20,838,617.580	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	30,877,000.000	30,223,025.140	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	13,000,000.000	12,821,380.000	
	MEXICAN BONDS 8.0 06/11/20	46,000,000.000	46,249,320.000	
	MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47	11,366,000.000	11,427,603.720	
	MEXICAN BONDS 8.0 12/07/23	12,500,000.000	12,592,625.000	
	MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	16,000,000.000	16,760,000.000	
	MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	17,526,000.000	18,518,146.860	
	メキシコ・ペソ 小計	373,340,000.000 (2,012,302,600)	375,473,637.490 (2,023,802,906)	
ユーロ	AUSTRIA 0.25 10/18/19	1,280,000.000	1,293,555.200	
	AUSTRIA 0.5 04/20/27	2,300,000.000	2,273,780.000	
	AUSTRIA 0.75 02/20/28	570,000.000	569,566.800	
	AUSTRIA 0.75 10/20/26	1,700,000.000	1,725,908.000	
	AUSTRIA 07/15/23	900,000.000	898,695.000	
	AUSTRIA 09/20/22	800,000.000	805,320.000	
	AUSTRIA 1.2 10/20/25	1,580,000.000	1,670,486.600	
	AUSTRIA 1.5 02/20/47	760,000.000	760,562.400	
	AUSTRIA 1.5 11/02/86	540,000.000	477,576.000	
	AUSTRIA 1.65 10/21/24	1,580,000.000	1,722,547.600	
	AUSTRIA 1.75 10/20/23	1,820,000.000	1,987,076.000	
	AUSTRIA 2.1 09/20/17	480,000.000	521,107.200	
	AUSTRIA 2.4 05/23/34	1,190,000.000	1,413,815.200	
	AUSTRIA 3.15 06/20/44	1,090,000.000	1,507,993.200	
	AUSTRIA 3.4 11/22/22	1,450,000.000	1,679,172.500	
	AUSTRIA 3.5 09/15/21	2,390,000.000	2,692,335.000	
	AUSTRIA 3.65 04/20/22	1,270,000.000	1,460,055.500	
	AUSTRIA 3.8 01/26/62	580,000.000	975,855.800	
	AUSTRIA 3.9 07/15/20	4,170,000.000	4,556,142.000	
	AUSTRIA 4.15 03/15/37	2,310,000.000	3,451,140.000	
	AUSTRIA 4.85 03/15/26	1,400,000.000	1,879,276.000	
	AUSTRIA 6.25 07/15/27	1,160,000.000	1,741,960.400	
	BELGIUM 0.2 10/22/23	1,060,000.000	1,064,876.000	
	BELGIUM 0.5 10/22/24	1,500,000.000	1,514,715.000	

BELGIUM 0.8 06/22/25	2,300,000.000	2,356,856.000	
BELGIUM 0.8 06/22/27	2,050,000.000	2,055,658.000	
BELGIUM 0.8 06/22/28	1,100,000.000	1,089,979.000	
BELGIUM 1.0 06/22/26	2,050,000.000	2,112,443.000	
BELGIUM 1.0 06/22/31	1,500,000.000	1,473,900.000	
BELGIUM 1.25 04/22/33	700,000.000	697,305.000	
BELGIUM 1.45 06/22/37	600,000.000	594,810.000	
BELGIUM 1.6 06/22/47	1,570,000.000	1,511,423.300	
BELGIUM 1.9 06/22/38	970,000.000	1,028,568.600	
BELGIUM 2.15 06/22/66	640,000.000	661,440.000	
BELGIUM 2.25 06/22/23	1,850,000.000	2,060,363.500	
BELGIUM 2.25 06/22/57	410,000.000	441,959.500	
BELGIUM 2.6 06/22/24	2,820,000.000	3,218,184.000	
BELGIUM 3.0 06/22/34	1,200,000.000	1,488,324.000	
BELGIUM 3.0 09/28/19	2,530,000.000	2,646,607.700	
BELGIUM 3.75 06/22/45	1,480,000.000	2,134,914.800	
BELGIUM 3.75 09/28/20	2,500,000.000	2,745,950.000	
BELGIUM 4.0 03/28/22	2,130,000.000	2,476,955.700	
BELGIUM 4.0 03/28/32	1,550,000.000	2,115,378.000	
BELGIUM 4.25 03/28/41	2,670,000.000	4,039,763.400	
BELGIUM 4.25 09/28/21	2,400,000.000	2,767,176.000	
BELGIUM 4.25 09/28/22	2,300,000.000	2,740,427.000	
BELGIUM 4.5 03/28/26	1,500,000.000	1,957,365.000	
BELGIUM 5.0 03/28/35	3,260,000.000	5,051,728.600	
BELGIUM 5.5 03/28/28	3,370,000.000	4,881,579.800	
BUNDESABL 0.25 10/11/19	3,400,000.000	3,443,384.000	
BUNDESABL 0.25 10/16/20	3,000,000.000	3,061,620.000	
BUNDESABL 04/08/22	2,500,000.000	2,539,250.000	
BUNDESABL 04/09/21	2,850,000.000	2,896,170.000	
BUNDESABL 04/14/23	2,960,000.000	2,988,090.400	
BUNDESABL 04/17/20	2,950,000.000	2,987,258.500	
BUNDESABL 10/07/22	3,000,000.000	3,038,550.000	
BUNDESABL 10/08/21	3,400,000.000	3,455,760.000	
BUNDESSCHAT 09/13/19	2,330,000.000	2,350,830.200	
BUNDESSCHAT 12/13/19	4,000,000.000	4,041,480.000	
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27	3,800,000.000	3,779,100.000	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25	3,440,000.000	3,541,789.600	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26	4,000,000.000	4,094,680.000	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28	2,690,000.000	2,703,073.400	
DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27	3,480,000.000	3,516,679.200	
DEUTSCHLAND 08/15/26	3,770,000.000	3,690,641.500	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/24	3,100,000.000	3,291,890.000	

DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25	4,440,000.000	4,719,986.400	
DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48	1,160,000.000	1,195,356.800	
DEUTSCHLAND 1.5 02/15/23	3,100,000.000	3,355,967.000	
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/23	3,070,000.000	3,329,292.200	
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/24	2,600,000.000	2,837,822.000	
DEUTSCHLAND 1.5 09/04/22	3,300,000.000	3,557,334.000	
DEUTSCHLAND 1.75 02/15/24	3,300,000.000	3,642,738.000	
DEUTSCHLAND 1.75 07/04/22	3,350,000.000	3,640,478.500	
DEUTSCHLAND 2.0 01/04/22	2,700,000.000	2,937,870.000	
DEUTSCHLAND 2.0 08/15/23	2,900,000.000	3,225,931.000	
DEUTSCHLAND 2.25 09/04/20	3,000,000.000	3,195,330.000	
DEUTSCHLAND 2.25 09/04/21	2,700,000.000	2,942,190.000	
DEUTSCHLAND 2.5 01/04/21	2,200,000.000	2,377,540.000	
DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	3,690,000.000	4,903,862.400	
DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	4,170,000.000	5,602,978.800	
DEUTSCHLAND 3.0 07/04/20	3,200,000.000	3,441,920.000	
DEUTSCHLAND 3.25 01/04/20	2,300,000.000	2,444,164.000	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/21	2,490,000.000	2,781,828.000	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	2,330,000.000	3,452,710.500	
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	3,510,000.000	5,393,536.200	
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	2,100,000.000	3,433,080.000	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	1,800,000.000	2,565,792.000	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	2,640,000.000	4,222,336.800	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	2,400,000.000	4,219,992.000	
DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	2,600,000.000	4,143,464.000	

DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	2,900,000.000	4,329,729.000	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/24	1,180,000.000	1,600,080.000	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	1,400,000.000	2,301,558.000	
DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	1,670,000.000	2,592,608.200	
FINLAND 0.375 09/15/20	1,150,000.000	1,172,781.500	
FINLAND 0.5 04/15/26	730,000.000	731,700.900	
FINLAND 0.5 09/15/27	600,000.000	591,576.000	
FINLAND 0.75 04/15/31	750,000.000	734,527.500	
FINLAND 0.875 09/15/25	520,000.000	538,517.200	
FINLAND 04/15/22	770,000.000	776,152.300	
FINLAND 09/15/23	750,000.000	748,080.000	
FINLAND 1.125 04/15/34	450,000.000	453,514.500	
FINLAND 1.5 04/15/23	830,000.000	891,959.500	
FINLAND 1.625 09/15/22	700,000.000	753,529.000	
FINLAND 2.0 04/15/24	700,000.000	775,432.000	
FINLAND 2.625 07/04/42	780,000.000	1,016,441.400	
FINLAND 2.75 07/04/28	700,000.000	839,181.000	
FINLAND 3.375 04/15/20	2,320,000.000	2,488,803.200	
FINLAND 3.5 04/15/21	1,210,000.000	1,345,278.000	
FINLAND 4.0 07/04/25	930,000.000	1,168,024.200	
FRANCE BTAN 8.5 04/25/23	1,480,000.000	2,096,790.000	
FRANCE OAT 0.25 11/25/20	4,300,000.000	4,374,433.000	
FRANCE OAT 0.25 11/25/26	4,400,000.000	4,275,788.000	
FRANCE OAT 0.5 05/25/25	5,500,000.000	5,557,090.000	
FRANCE OAT 0.5 05/25/26	5,000,000.000	4,995,500.000	
FRANCE OAT 0.5 11/25/19	5,000,000.000	5,076,800.000	
FRANCE OAT 0.75 05/25/28	6,030,000.000	5,994,543.600	
FRANCE OAT 02/25/20	4,200,000.000	4,238,220.000	
FRANCE OAT 02/25/21	2,400,000.000	2,424,696.000	
FRANCE OAT 03/25/23	2,800,000.000	2,801,036.000	
FRANCE OAT 05/25/20	5,400,000.000	5,454,432.000	
FRANCE OAT 05/25/21	7,200,000.000	7,277,760.000	
FRANCE OAT 05/25/22	5,500,000.000	5,540,865.000	
FRANCE OAT 1.0 05/25/27	5,000,000.000	5,138,250.000	
FRANCE OAT 1.0 11/25/25	5,200,000.000	5,418,400.000	
FRANCE OAT 1.25 05/25/34	500,000.000	501,245.000	
FRANCE OAT 1.25 05/25/36	3,600,000.000	3,544,920.000	
FRANCE OAT 1.5 05/25/31	5,350,000.000	5,632,052.000	

FRANCE OAT 1.75 05/25/23	6,650,000.000	7,227,685.500	
FRANCE OAT 1.75 05/25/66	1,450,000.000	1,396,103.500	
FRANCE OAT 1.75 06/25/39	1,500,000.000	1,579,455.000	
FRANCE OAT 1.75 11/25/24	5,600,000.000	6,130,936.000	
FRANCE OAT 2.0 05/25/48	3,150,000.000	3,362,215.500	
FRANCE OAT 2.25 05/25/24	5,400,000.000	6,061,986.000	
FRANCE OAT 2.25 10/25/22	4,900,000.000	5,409,796.000	
FRANCE OAT 2.5 05/25/30	4,850,000.000	5,682,308.500	
FRANCE OAT 2.5 10/25/20	4,300,000.000	4,603,666.000	
FRANCE OAT 2.75 10/25/27	6,850,000.000	8,122,387.500	
FRANCE OAT 3.0 04/25/22	6,220,000.000	7,001,605.200	
FRANCE OAT 3.25 05/25/45	3,850,000.000	5,231,765.000	
FRANCE OAT 3.25 10/25/21	6,000,000.000	6,724,740.000	
FRANCE OAT 3.5 04/25/20	3,010,000.000	3,236,653.000	
FRANCE OAT 3.5 04/25/26	4,870,000.000	6,024,190.000	
FRANCE OAT 3.75 04/25/21	5,510,000.000	6,169,491.900	
FRANCE OAT 3.75 10/25/19	5,060,000.000	5,359,349.600	
FRANCE OAT 4.0 04/25/55	2,250,000.000	3,601,125.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/60	2,330,000.000	3,823,227.100	
FRANCE OAT 4.0 10/25/38	4,050,000.000	5,945,764.500	
FRANCE OAT 4.25 10/25/23	6,290,000.000	7,709,715.900	
FRANCE OAT 4.5 04/25/41	5,460,000.000	8,680,526.400	
FRANCE OAT 4.75 04/25/35	4,920,000.000	7,578,423.600	
FRANCE OAT 5.5 04/25/29	4,500,000.000	6,678,000.000	
FRANCE OAT 5.75 10/25/32	5,000,000.000	8,110,500.000	
FRANCE OAT 6.0 10/25/25	2,220,000.000	3,135,639.000	
FRANCE OAT 8.5 10/25/19	1,480,000.000	1,664,926.000	
IRISH 0.8 03/15/22	1,280,000.000	1,323,571.200	
IRISH 0.9 05/15/28	800,000.000	787,656.000	
IRISH 1.0 05/15/26	1,550,000.000	1,579,000.500	
IRISH 1.3 05/15/33	740,000.000	720,582.400	
IRISH 1.7 05/15/37	860,000.000	868,686.000	
IRISH 10/18/22	890,000.000	889,181.200	
IRISH 2.0 02/18/45	1,350,000.000	1,396,669.500	
IRISH 2.4 05/15/30	1,490,000.000	1,680,705.100	
IRISH 3.4 03/18/24	1,120,000.000	1,319,248.000	

IRISH 3.9 03/20/23	950,000.000	1,122,073.500	
IRISH 4.5 04/18/20	1,570,000.000	1,716,920.600	
IRISH 5.0 10/18/20	1,420,000.000	1,603,961.000	
IRISH 5.4 03/13/25	2,030,000.000	2,682,705.900	
IRISH 5.9 10/18/19	1,190,000.000	1,292,708.900	
ITALY BTPS 0.05 10/15/19	3,100,000.000	3,051,485.000	
ITALY BTPS 0.2 10/15/20	2,500,000.000	2,409,625.000	
ITALY BTPS 0.35 06/15/20	3,600,000.000	3,510,324.000	
ITALY BTPS 0.35 11/01/21	3,800,000.000	3,595,940.000	
ITALY BTPS 0.45 06/01/21	3,750,000.000	3,593,250.000	
ITALY BTPS 0.65 10/15/23	3,000,000.000	2,725,290.000	
ITALY BTPS 0.65 11/01/20	2,000,000.000	1,948,600.000	
ITALY BTPS 0.7 05/01/20	3,800,000.000	3,738,250.000	
ITALY BTPS 0.9 08/01/22	3,000,000.000	2,828,160.000	
ITALY BTPS 0.95 03/01/23	2,000,000.000	1,869,560.000	
ITALY BTPS 0.95 03/15/23	2,700,000.000	2,527,470.000	
ITALY BTPS 1.05 12/01/19	3,300,000.000	3,285,546.000	
ITALY BTPS 1.2 04/01/22	2,700,000.000	2,605,770.000	
ITALY BTPS 1.25 12/01/26	3,500,000.000	3,077,095.000	
ITALY BTPS 1.35 04/15/22	3,000,000.000	2,900,160.000	
ITALY BTPS 1.45 05/15/25	1,360,000.000	1,243,040.000	
ITALY BTPS 1.45 09/15/22	3,820,000.000	3,682,900.200	
ITALY BTPS 1.45 11/15/24	2,800,000.000	2,587,732.000	
ITALY BTPS 1.5 06/01/25	3,700,000.000	3,394,861.000	
ITALY BTPS 1.6 06/01/26	3,300,000.000	3,001,350.000	
ITALY BTPS 1.65 03/01/32	3,300,000.000	2,740,749.000	
ITALY BTPS 1.85 05/15/24	2,800,000.000	2,678,760.000	
ITALY BTPS 2.0 02/01/28	1,950,000.000	1,775,806.500	
ITALY BTPS 2.0 12/01/25	2,900,000.000	2,734,149.000	
ITALY BTPS 2.05 08/01/27	4,600,000.000	4,232,460.000	
ITALY BTPS 2.15 12/15/21	2,000,000.000	2,008,400.000	
ITALY BTPS 2.2 06/01/27	2,500,000.000	2,347,250.000	

ITALY BTPS 2.25 09/01/36	2,400,000.000	2,065,680.000	
ITALY BTPS 2.45 09/01/33	1,800,000.000	1,620,828.000	
ITALY BTPS 2.5 12/01/24	3,800,000.000	3,752,310.000	
ITALY BTPS 2.7 03/01/47	2,650,000.000	2,309,740.000	
ITALY BTPS 2.8 03/01/67	1,100,000.000	934,230.000	
ITALY BTPS 2.95 09/01/38	1,450,000.000	1,341,308.000	
ITALY BTPS 3.25 09/01/46	2,200,000.000	2,115,674.000	
ITALY BTPS 3.45 03/01/48	1,650,000.000	1,614,145.500	
ITALY BTPS 3.5 03/01/30	3,980,000.000	4,055,102.600	
ITALY BTPS 3.75 03/01/21	2,950,000.000	3,088,473.000	
ITALY BTPS 3.75 05/01/21	3,000,000.000	3,144,000.000	
ITALY BTPS 3.75 08/01/21	3,500,000.000	3,672,550.000	
ITALY BTPS 3.75 09/01/24	2,500,000.000	2,640,800.000	
ITALY BTPS 4.0 02/01/37	3,550,000.000	3,860,625.000	
ITALY BTPS 4.0 09/01/20	5,240,000.000	5,487,852.000	
ITALY BTPS 4.25 03/01/20	2,100,000.000	2,190,615.000	
ITALY BTPS 4.5 02/01/20	2,420,000.000	2,531,126.400	
ITALY BTPS 4.5 03/01/24	3,500,000.000	3,834,215.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/26	2,850,000.000	3,165,780.000	
ITALY BTPS 4.5 05/01/23	2,600,000.000	2,837,510.000	
ITALY BTPS 4.75 08/01/23	4,010,000.000	4,435,060.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/21	5,140,000.000	5,570,218.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/28	3,100,000.000	3,504,302.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/44	2,600,000.000	3,090,594.000	
ITALY BTPS 5.0 03/01/22	2,500,000.000	2,746,250.000	
ITALY BTPS 5.0 03/01/25	3,860,000.000	4,378,706.800	
ITALY BTPS 5.0 08/01/34	3,670,000.000	4,419,781.000	
ITALY BTPS 5.0 08/01/39	3,300,000.000	3,994,980.000	
ITALY BTPS 5.0 09/01/40	3,450,000.000	4,175,535.000	
ITALY BTPS 5.25 11/01/29	4,680,000.000	5,544,396.000	
ITALY BTPS 5.5 09/01/22	2,960,000.000	3,321,179.200	
ITALY BTPS 5.5 11/01/22	3,200,000.000	3,601,632.000	
ITALY BTPS 5.75 02/01/33	3,350,000.000	4,251,485.000	
ITALY BTPS 6.0 05/01/31	4,300,000.000	5,479,060.000	

ITALY BTPS 6.5 11/01/27	3,400,000.000	4,332,960.000	
ITALY BTPS 7.25 11/01/26	2,150,000.000	2,826,820.000	
ITALY BTPS 9.0 11/01/23	1,700,000.000	2,246,550.000	
NETHERLANDS 0.25 01/15/20	2,150,000.000	2,181,282.500	
NETHERLANDS 0.25 07/15/25	2,400,000.000	2,397,384.000	
NETHERLANDS 0.5 07/15/26	2,690,000.000	2,713,134.000	
NETHERLANDS 0.75 07/15/27	2,390,000.000	2,437,154.700	
NETHERLANDS 0.75 07/15/28	900,000.000	909,891.000	
NETHERLANDS 01/15/22	2,800,000.000	2,834,216.000	
NETHERLANDS 01/15/24	870,000.000	867,477.000	
NETHERLANDS 1.75 07/15/23	2,700,000.000	2,952,774.000	
NETHERLANDS 2.0 07/15/24	2,200,000.000	2,452,560.000	
NETHERLANDS 2.25 07/15/22	2,280,000.000	2,517,735.600	
NETHERLANDS 2.5 01/15/33	2,110,000.000	2,579,960.300	
NETHERLANDS 2.75 01/15/47	2,100,000.000	2,922,906.000	
NETHERLANDS 3.25 07/15/21	2,760,000.000	3,081,402.000	
NETHERLANDS 3.5 07/15/20	1,940,000.000	2,108,198.000	
NETHERLANDS 3.75 01/15/23	2,000,000.000	2,362,000.000	
NETHERLANDS 3.75 01/15/42	2,310,000.000	3,619,238.700	
NETHERLANDS 4.0 01/15/37	2,310,000.000	3,508,659.000	
NETHERLANDS 5.5 01/15/28	2,070,000.000	3,040,416.000	
NETHERLANDS 7.5 01/15/23	590,000.000	799,037.000	
SPAIN 0.05 01/31/21	2,500,000.000	2,502,525.000	
SPAIN 0.4 04/30/22	3,300,000.000	3,320,262.000	
SPAIN 0.45 10/31/22	2,600,000.000	2,613,442.000	
SPAIN 0.75 07/30/21	4,700,000.000	4,805,562.000	
SPAIN 1.15 07/30/20	4,500,000.000	4,622,670.000	
SPAIN 1.3 10/31/26	3,500,000.000	3,527,965.000	
SPAIN 1.4 01/31/20	3,600,000.000	3,695,868.000	
SPAIN 1.4 04/30/28	2,300,000.000	2,288,638.000	
SPAIN 1.45 10/31/27	3,300,000.000	3,319,338.000	
SPAIN 1.5 04/30/27	2,700,000.000	2,739,960.000	

	SPAIN 1.6 04/30/25	3,100,000.000	3,250,164.000	
	SPAIN 1.95 04/30/26	3,000,000.000	3,183,630.000	
	SPAIN 1.95 07/30/30	3,050,000.000	3,136,589.500	
	SPAIN 2.15 10/31/25	3,600,000.000	3,886,920.000	
	SPAIN 2.35 07/30/33	1,860,000.000	1,950,210.000	
	SPAIN 2.7 10/31/48	1,080,000.000	1,111,687.200	
	SPAIN 2.75 10/31/24	3,800,000.000	4,270,554.000	
	SPAIN 2.9 10/31/46	2,500,000.000	2,698,500.000	
	SPAIN 3.45 07/30/66	1,700,000.000	1,975,570.000	
	SPAIN 3.8 04/30/24	2,980,000.000	3,513,777.600	
	SPAIN 4.0 04/30/20	2,870,000.000	3,095,553.300	
	SPAIN 4.2 01/31/37	3,000,000.000	3,980,820.000	
	SPAIN 4.3 10/31/19	2,820,000.000	3,002,369.400	
	SPAIN 4.4 10/31/23	1,970,000.000	2,370,225.200	
	SPAIN 4.65 07/30/25	3,380,000.000	4,246,665.800	
	SPAIN 4.7 07/30/41	3,060,000.000	4,364,722.800	
	SPAIN 4.8 01/31/24	3,000,000.000	3,693,990.000	
	SPAIN 4.85 10/31/20	2,630,000.000	2,937,710.000	
	SPAIN 4.9 07/30/40	3,230,000.000	4,696,420.000	
	SPAIN 5.15 10/31/28	3,600,000.000	4,857,480.000	
	SPAIN 5.15 10/31/44	2,000,000.000	3,052,800.000	
	SPAIN 5.4 01/31/23	3,000,000.000	3,688,590.000	
	SPAIN 5.5 04/30/21	3,000,000.000	3,472,080.000	
	SPAIN 5.75 07/30/32	3,720,000.000	5,561,437.200	
	SPAIN 5.85 01/31/22	4,160,000.000	5,016,710.400	
	SPAIN 5.9 07/30/26	2,700,000.000	3,690,333.000	
	SPAIN 6.0 01/31/29	3,500,000.000	5,033,210.000	
	ユーロ 小計	784,130,000.000 (101,199,817,800)	883,140,901.600 (113,978,164,760)	
南アフリカ・ランド	SOUTH AFRICA 10.5 12/21/26	39,540,000.000	43,142,094.000	
	SOUTH AFRICA 6.25 03/31/36	17,630,000.000	12,586,938.500	
	SOUTH AFRICA 6.5 02/28/41	13,680,000.000	9,588,312.000	
	SOUTH AFRICA 7.0 02/28/31	17,190,000.000	14,075,172.000	
	SOUTH AFRICA 7.75 02/28/23	11,500,000.000	11,268,160.000	
	SOUTH AFRICA 8.0 01/31/30	15,820,000.000	14,311,563.000	
	SOUTH AFRICA 8.25 03/31/32	13,000,000.000	11,740,560.000	
	SOUTH AFRICA 8.5 01/31/37	16,500,000.000	14,786,475.000	
	SOUTH AFRICA 8.75 01/31/44	15,000,000.000	13,490,250.000	
	SOUTH AFRICA 8.75 02/28/48	39,170,000.000	35,113,946.500	

	SOUTH AFRICA 8.875 02/28/35	10,000,000.000	9,345,800.000	
	SOUTH AFRICA 9.0 01/31/40	9,000,000.000	8,358,570.000	
	南アフリカ・ランド 小計	218,030,000.000 (1,827,091,400)	197,807,841.000 (1,657,629,708)	
国債証券 合計		267,103,590,700 (267,103,590,700)	281,954,244,331 (281,954,244,331)	
合計		267,103,590,700 (267,103,590,700)	281,954,244,331 (281,954,244,331)	

(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 142銘柄	43.72%	44.43%
イギリス・ポンド	国債証券 40銘柄	6.99%	7.10%
オーストラリア・ドル	国債証券 21銘柄	2.12%	2.15%
カナダ・ドル	国債証券 30銘柄	2.11%	2.14%
シンガポール・ドル	国債証券 17銘柄	0.34%	0.35%
スウェーデン・クローナ	国債証券 6銘柄	0.33%	0.34%
デンマーク・クローネ	国債証券 6銘柄	0.54%	0.55%
ノルウェー・クローネ	国債証券 5銘柄	0.18%	0.19%
ポーランド・ズロチ	国債証券 16銘柄	0.61%	0.62%
マレーシア・リングギット	国債証券 14銘柄	0.40%	0.41%
メキシコ・ペソ	国債証券 14銘柄	0.71%	0.72%
ユーロ	国債証券 290銘柄	39.78%	40.42%
南アフリカ・ランド	国債証券 12銘柄	0.58%	0.59%

(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12月11日現在	平成30年6月11日現在
資産の部			
流動資産			
預金		2,294,531,363	5,601,548,359
コール・ローン		651,561,965	66,370,171
株式		53,518,112,088	62,622,552,042
投資信託受益証券		292,832,167	292,228,492
投資証券		110,410,043	110,906,923
派生商品評価勘定		60,745,308	11,391,900
未収入金		18,075,628	1,040,178
未収配当金		21,081,260	131,142,379
差入委託証拠金		948,674,284	960,057,177
流動資産合計		57,916,024,106	69,797,237,621
資産合計		57,916,024,106	69,797,237,621
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		591,065	25,466,490
未払金		-	3,476,050,285
未払解約金		317,772,000	32,651,000
その他未払費用		-	2,527
流動負債合計		318,363,065	3,534,170,302
負債合計		318,363,065	3,534,170,302
純資産の部			
元本等			
元本	1	46,664,168,016	54,153,814,826
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		10,933,493,025	12,109,252,493
元本等合計		57,597,661,041	66,263,067,319
純資産合計		57,597,661,041	66,263,067,319
負債純資産合計		57,916,024,106	69,797,237,621

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	平成29年12月11日現在	平成30年6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	43,308,447,537円	46,664,168,016円
同期中追加設定元本額	14,085,925,400円	22,786,309,118円
同期中一部解約元本額	10,730,204,921円	15,296,662,308円
元本の内訳 ファンド名		

D I A M新興国株式インデック スファンド< D C 年金 >	2,708,173,034円	3,639,307,526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)	236,771,587円	519,366,252円
M I T O ラップ型ファンド (安定型)	6,549,182円	5,422,509円
M I T O ラップ型ファンド (中立型)	16,759,591円	15,490,682円
M I T O ラップ型ファンド (積極型)	19,236,832円	18,210,990円
グローバル8資産ラップファン ド(安定型)	24,635,594円	33,062,033円
グローバル8資産ラップファン ド(中立型)	22,399,505円	34,304,113円
グローバル8資産ラップファン ド(積極型)	13,756,584円	19,559,630円
たわらノーロード 新興国株式	3,031,517,097円	3,827,705,672円
たわらノーロード 新興国株式 <ラップ向け>	904,732,303円	1,202,738,458円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	16,622,037円	63,989,384円
たわらノーロード バランス (堅実型)	7,913円	389,510円
たわらノーロード バランス (標準型)	7,913円	1,536,758円
たわらノーロード バランス (積極型)	15,826円	5,240,617円
たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(保守型)	7,956円	35,530円
たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(安定型)	15,911円	2,671,553円
たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(安定成長 型)	23,867円	6,122,301円
たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(成長型)	39,778円	4,075,066円
たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(積極型)	47,733円	10,303,217円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定型)	- 円	19,364円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定成長型)	- 円	107,474円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(成長型)	- 円	157,566円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(積極型)	- 円	547,494円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	462,876,236円	429,132,057円
D I A M D C 8資産 balan スファンド(新興国10)	42,480,341円	50,799,988円
D I A M D C 8資産 balan スファンド(新興国20)	136,844,294円	168,040,185円

DIAM DC 8資産バ ランスファンド(新興国30)	296,829,450円	362,177,159円
投資のソムリエ	1,985,021,311円	4,222,449,231円
クルーズコントロール	1,759,004,205円	1,052,340,320円
投資のソムリエ<DC年金>	123,423,279円	313,360,884円
DIAM 8資産バ ランスファ ンドN<DC年金>	156,909,893円	188,411,503円
クルーズコントロール<DC年 金>	587,979円	441,607円
DIAMコア資産設計ファンド (堅実型)	21,318,063円	13,058,591円
DIAMコア資産設計ファンド (積極型)	57,019,939円	49,220,369円
投資のソムリエ<DC年金>リ スク抑制型	81,537,797円	161,263,510円
ダイナミック・ナビゲーション	1,714,235円	534,473円
リスク抑制世界8資産バ ランス ファンド	1,069,866,746円	2,933,470,326円
ワールドアセットバランス(基 本コース)	1,551,324,265円	1,964,816,977円
ワールドアセットバランス(リ スク抑制コース)	5,567,620,388円	7,712,821,183円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2045)	207,552円	1,414,527円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2055)	207,552円	924,199円
リスク抑制世界8資産バ ランス ファンド(DC)	349,786円	765,108円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2035)	278,441円	2,269,983円
リスクコントロール世界資産分 散ファンド	-円	76,172,088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)	5,069,248,671円	4,455,331,749円
エマージング株式パッシブファ ンド(適格機関投資家限定)	2,638,960,295円	2,127,877,664円
DIAM世界アセットバ ランス ファンド2VA(適格機関投資 家限定)	11,289,522,421円	11,096,231,306円
DIAM世界アセットバ ランス ファンド3VA(適格機関投資 家限定)	7,349,694,634円	7,360,126,140円
計	46,664,168,016円	54,153,814,826円
2. 受益権の総数	46,664,168,016口	54,153,814,826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6月13日 至 平成29年12月11日	自 平成29年12月12日 至 平成30年6月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。</p> <p>また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。</p>	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成29年12月11日現在	平成30年6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12月11日現在	平成30年6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	6,183,274,067	173,802,402
投資信託受益証券	9,963,352	11,260,193
投資証券	3,682,133	9,789,244
合計	6,169,628,582	152,752,965

(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12月11日まで及び平成30年4月19日から平成30年6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12月11日 現在				平成30年6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	56,511,000	-	56,838,600	327,600	376,547,389	-	375,027,833	1,519,556
アメリカ・ドル	-	-	-	-	376,547,389	-	375,027,833	1,519,556
タイ・パーツ	56,511,000	-	56,838,600	327,600	-	-	-	-
買 建	695,660,348	-	697,116,359	1,456,011	354,668,589	-	356,587,702	1,919,113
アメリカ・ドル	695,660,348	-	697,116,359	1,456,011	-	-	-	-
コロンビア・ペソ	-	-	-	-	17,160,531	-	17,085,592	74,939
ブラジル・リアル	-	-	-	-	187,511,992	-	191,353,110	3,841,118
南アフリカ・ランド	-	-	-	-	149,996,066	-	148,149,000	1,847,066
合計	752,171,348	-	753,954,959	1,128,411	731,215,978	-	731,615,535	3,438,669

(注) 時価の算定方法

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

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

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

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

株式関連

種類	平成29年12月11日 現在				平成30年6月11日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
先物取引								
買 建	3,921,120,478	-	3,980,146,310	59,025,832	3,245,955,639	-	3,228,442,380	17,513,259
合計	3,921,120,478	-	3,980,146,310	59,025,832	3,245,955,639	-	3,228,442,380	17,513,259

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成29年12月11日現在	平成30年6月11日現在
1口当たり純資産額	1.2343円	1.2236円
(1万口当たり純資産額)	(12,343円)	(12,236円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

平成30年6月11日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	CTRI.P.COM INTERNATIONAL LTD ADR	40,900	48.890	1,999,601.000	
	CIA DE MINAS BUENAVENTURA SA ADR	18,800	15.810	297,228.000	
	SURGUTNEFTEGAZ SP ADR PREF	85,900	4.980	427,782.000	
	CREDICORP LTD	7,049	230.000	1,621,270.000	
	SINA CORP	6,800	94.980	645,864.000	
	MOBILE TELESYSTEMS PJSC ADR	59,625	9.700	578,362.500	
	NETEASE INC-ADR	8,200	243.580	1,997,356.000	
	SOUTHERN COPPER CORP	8,780	51.460	451,818.800	
	LUKOIL SPON ADR	45,656	67.020	3,059,865.120	
	GAZPROM PAO ADR	575,700	4.546	2,617,132.200	
	COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK SP GDR	118,173	4.750	561,321.750	
	INNER MONGOLIA YITAI COAL CO	101,500	1.370	139,055.000	
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRADE	96,280	1.499	144,323.720	
	SURGUTNEFTEGAZ ADR	74,017	4.508	333,668.630	
	51JOB INC ADR	2,300	110.210	253,483.000	
	X5 RETAIL GROUP NV GDR	13,015	27.400	356,611.000	
	NOVATEK PJSC GDR	10,172	141.300	1,437,303.600	
	BAIDU INC -SPON ADR	28,500	263.590	7,512,315.000	
	NOVOLIPETSK STEEL GDR	14,520	27.140	394,072.800	
	MMC NORILSK NICKEL ADR	71,744	18.290	1,312,197.760	
	ROSNEFT OIL CO GDR	122,010	6.066	740,112.660	
	NEW ORIENTAL EDUCATION & TECH	14,900	105.000	1,564,500.000	
	SEVERSTAL GDR	27,217	16.330	444,453.610	
	TATNEFT ADR	27,870	63.300	1,764,171.000	
	VTB BANK OJSC GDR	222,000	1.436	318,792.000	
	DP WORLD LTD	18,320	23.500	430,520.000	
	MAGNIT PJSC GDR	38,979	18.250	711,366.750	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD ADR	43,400	11.980	519,932.000	
	FANG HOLDINGS LTD ADR	19,300	4.750	91,675.000	
	RUSHYDRO PJSC ADR	193,960	1.046	202,882.160	
TAL EDUCATION GROUP-ADR	34,700	46.800	1,623,960.000		
NOAH HOLDINGS LTD ADR	2,700	65.140	175,878.000		
SBERBANK ADR	285,840	13.930	3,981,751.200		
PHOSAGRO PJSC GDR	17,458	13.020	227,303.160		

	CHINA LODGING GROUP LTD	12,700	47.900	608,330.000	
	YY INC-ADR	4,900	109.140	534,786.000	
	GDS HOLDINGS LTD ADR	5,600	39.810	222,936.000	
	58.COM INC ADR	9,700	79.910	775,127.000	
	AUTOHOME INC ADR	6,200	112.040	694,648.000	
	WEIBO CORP ADR	4,900	106.540	522,046.000	
	JD.COM INC ADR	75,000	39.920	2,994,000.000	
	ALIBABA GROUP HOLDING LTD-ADR	119,580	205.070	24,522,270.600	
	MOMO INC SPON ADR	11,500	52.010	598,115.000	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	38,200	41.700	1,592,940.000	
アメリカ・ドル 小計		2,744,565		72,003,128.020 (7,877,862,236)	
アラブ首長国連邦・ディルハム	DUBAI ISLAMIC BANK PJSC	126,000	5.130	646,380.000	
	EMIRATES TELECOMMUNICATIONS GROUP CO PJSC	171,437	17.000	2,914,429.000	
	DUBAI INVESTMENTS PJSC	169,895	2.140	363,575.300	
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK PJSC	198,000	7.480	1,481,040.000	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	152,879	12.400	1,895,699.600	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	384,127	5.570	2,139,587.390	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	480,391	2.090	1,004,017.190	
	EMAAR DEVELOPMENT PJSC	77,463	5.350	414,427.050	
	DUBAI ISLAMIC BANK-RTS	42,000	1.690	70,980.000	
	EMAAR MALLS PJSC	178,166	2.150	383,056.900	
	DAMAC PROPERTIES DUBAI CO PJSC	190,235	2.470	469,880.450	
アラブ首長国連邦・ディルハム 小計		2,170,593		11,783,072.880 (351,606,894)	
インド・ルピー	RELIANCE INDUSTRIES LTD	294,501	984.350	289,892,059.350	
	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	80,630	409.850	33,046,205.500	
	ASIAN PAINTS LTD	27,773	1,278.850	35,517,501.050	
	EICHER MOTORS LTD	1,433	29,513.000	42,292,129.000	
	GRASIM INDUSTRIES LTD	35,755	1,028.600	36,777,593.000	
	MAHINDRA & MAHINDRA LTD	78,468	911.650	71,535,352.200	
	SHREE CEMENT LTD	830	16,224.400	13,466,252.000	
	ICICI BANK LTD	246,240	288.250	70,978,680.000	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP LTD	65,734	311.300	20,462,994.200	
	STATE BANK OF INDIA LTD	165,539	273.000	45,192,147.000	
	CONTAINER CORP OF INDIA LTD	7,574	1,362.700	10,321,089.800	
	LIC HOUSING FINANCE LTD	34,315	496.950	17,052,839.250	
	TATA STEEL LTD	30,298	600.500	18,193,949.000	
	TATA MOTORS LTD	165,005	309.950	51,143,299.750	

JSW STEEL LTD	86,000	343.250	29,519,500.000	
TATA POWER CO LTD	114,770	77.950	8,946,321.500	
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	3,339	5,917.650	19,759,033.350	
NESTLE INDIA LTD	2,343	9,888.850	23,169,575.550	
BHARAT HEAVY ELECTRICALS LTD	116,708	77.550	9,050,705.400	
GAIL INDIA LTD	85,632	342.400	29,320,396.800	
VEDANTA LTD	139,732	246.300	34,415,991.600	
AXIS BANK LTD	186,927	537.400	100,454,569.800	
TITAN COMPANY LTD	29,870	896.000	26,763,520.000	
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	121,518	173.700	21,107,676.600	
LUPIN LTD	22,500	810.050	18,226,125.000	
BAJAJ FINANCE LTD	17,067	2,186.850	37,322,968.950	
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP	163,458	1,840.450	300,836,276.100	
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISES LTD	53,623	557.350	29,886,779.050	
INFOSYS LTD	181,118	1,260.050	228,217,735.900	
WIPRO LTD	121,545	264.000	32,087,880.000	
INDIAN OIL CORP LTD	153,017	175.000	26,777,975.000	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	67,410	1,595.600	107,559,396.000	
HCL TECHNOLOGIES LTD	58,794	928.700	54,601,987.800	
DABUR INDIA LTD	50,863	382.350	19,447,468.050	
HERO MOTOCORP LTD	4,626	3,635.150	16,816,203.900	
DR REDDYS LABORATORIES LTD	10,779	2,062.900	22,235,999.100	
BHARTI AIRTEL LTD	146,285	377.550	55,229,901.750	
UNITED SPIRITS LTD	6,366	3,355.000	21,357,930.000	
SUN PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD	86,644	528.250	45,769,693.000	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	11,036	8,932.450	98,578,518.200	
GLENMARK PHARMACEUTICALS LTD	17,084	556.750	9,511,517.000	
AUROBINDO PHARMA LTD	30,426	572.350	17,414,321.100	
HAVELLS INDIA LTD	24,800	552.900	13,711,920.000	
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	64,460	310.050	19,985,823.000	
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE CO LTD	15,042	1,446.050	21,751,484.100	
PETRONET LNG LTD	70,238	225.800	15,859,740.400	
CIPLA LTD/INDIA	40,120	559.650	22,453,158.000	
LARSEN & TOUBRO LTD	49,742	1,343.950	66,850,760.900	
ULTRATECH CEMENT LTD	9,234	3,715.150	34,305,695.100	
ASHOK LEYLAND LTD	110,886	145.000	16,078,470.000	
BOSCH LTD	774	18,450.250	14,280,493.500	
TATA CONSULTANCY SERVICES LTD	95,006	1,747.100	165,984,982.600	
NTPC LTD	207,553	161.450	33,509,431.850	

	PIRAMAL ENTERPRISES LTD	7,771	2,408.200	18,714,122.200	
	YES BANK LTD	179,419	337.650	60,580,825.350	
	AMBUJA CEMENTS LTD	74,525	206.000	15,352,150.000	
	BHARAT FORGE LTD	23,740	652.450	15,489,163.000	
	HINDALCO INDUSTRIES LTD	121,198	242.150	29,348,095.700	
	ITC LTD	356,053	267.900	95,386,598.700	
	PIDILITE INDUSTRIES LTD	11,666	1,070.350	12,486,703.100	
	UNITED PHOSPHORUS LTD	32,991	712.900	23,519,283.900	
	SIEMENS INDIA LTD	9,457	1,009.700	9,548,732.900	
	GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	23,311	1,168.550	27,240,069.050	
	TECH MAHINDRA LTD	50,717	706.950	35,854,383.150	
	IDEA CELLULAR LTD	196,527	64.150	12,607,207.050	
	MARICO LTD	45,380	343.650	15,594,837.000	
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	152,012	197.900	30,083,174.800	
	ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	48,081	380.500	18,294,820.500	
	RURAL ELECTRIFICATION CORP LTD	85,677	114.900	9,844,287.300	
	BAJAJ FINSERV LTD	3,706	6,025.500	22,330,503.000	
	BAJAJ AUTO LTD	8,402	2,874.050	24,147,768.100	
	COAL INDIA LTD	75,901	289.900	22,003,699.900	
	VAKRANGEE LTD	35,954	35.750	1,285,355.500	
	MAHINDRA & MAHINDRA FINANCIAL SERVICES LTD	32,995	487.600	16,088,362.000	
	BHARTI INFRATEL LTD	39,421	298.400	11,763,226.400	
	INDIABULLS HOUSING FINANCE LTD	26,629	1,203.900	32,058,653.100	
	TATA STEEL LTD-PARTLY PAID	2,333	159.350	371,763.550	
	CADILA HEALTHCARE LTD	26,908	364.350	9,803,929.800	
	AVENUE SUPERMARTS LTD	11,937	1,593.550	19,022,206.350	
	INTERGLOBE AVIATION LTD	8,300	1,186.300	9,846,290.000	
	インド・ルピー 小計	5,702,441		3,223,696,228.450 (5,254,624,853)	
インドネシア・ルピア	AKR CORPORINDO TBK PT	150,400	4,580.000	688,832,000.000	
	UNITED TRACTORS TBK PT	168,201	34,800.000	5,853,394,800.000	
	INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK PT	479,200	6,950.000	3,330,440,000.000	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	146,400	45,400.000	6,646,560,000.000	
	PT ASTRA INTERNATIONAL TBK	2,132,200	6,900.000	14,712,180,000.000	
	TELEKOMUNIKASI INDONESIA PERSERO TBK	5,270,200	3,610.000	19,025,422,000.000	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA TBK PT	845,600	3,460.000	2,925,776,000.000	

	GUDANG GARAM TBK PT	48,600	70,250.000	3,414,150,000.000	
	HANJAYA MANDALA SAMPOERNA TBK	924,800	3,640.000	3,366,272,000.000	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA TBK PT	185,600	16,125.000	2,992,800,000.000	
	INDAH KIAT PULP AND PAPER CORP TBK PT	264,100	19,100.000	5,044,310,000.000	
	BANK DANAMON INDONESIA TBK PT	261,316	5,950.000	1,554,830,200.000	
	BANK MANDIRI	1,974,500	6,950.000	13,722,775,000.000	
	MATAHARI DEPARTMENT STORE TBK	276,500	9,000.000	2,488,500,000.000	
	BANK RAKYAT INDONESIA	5,829,300	3,140.000	18,304,002,000.000	
	PERUSAHAAN GAS NEGARA PT	1,064,100	2,080.000	2,213,328,000.000	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSERO TBK PT	709,000	8,050.000	5,707,450,000.000	
	KALBE FARMA TBK PT	2,522,200	1,360.000	3,430,192,000.000	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK PT	330,300	8,275.000	2,733,232,500.000	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	1,031,400	22,250.000	22,948,650,000.000	
	JASA MARGA PERSERO TBK PT	200,125	4,610.000	922,576,250.000	
	BUMI SERPONG DAMAI PT	851,700	1,720.000	1,464,924,000.000	
	ADARO ENERGY PT	1,434,500	1,935.000	2,775,757,500.000	
	PAKUWON JATI TBK	1,912,800	590.000	1,128,552,000.000	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR TBK PT	239,000	8,850.000	2,115,150,000.000	
	TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE TBK PT	180,800	4,900.000	885,920,000.000	
	BANK TABUNGAN NEGARA TBK PT	480,300	3,030.000	1,455,309,000.000	
	WASKITA KARYA PERSERO TBK PT	392,000	2,350.000	921,200,000.000	
	PT SURYA CITRA MEDIA TBK	511,300	2,300.000	1,175,990,000.000	
	インドネシア・ルピア 小計	30,816,442		153,948,475,250.000 (1,216,192,954)	
オフショア・人民 元	WULIANGYE YIBIN CO LTD	4,500	80.390	361,755.000	
	SUNING.COM CO LTD	29,500	15.200	448,400.000	
	MIDEA GROUP CO LTD	8,000	54.660	437,280.000	
	HANGZHOU HIKVISION DIGITAL TECHNOLOGY CO LTD	12,000	39.050	468,600.000	
	CHINA VANKE CO LTD	13,700	26.710	365,927.000	
	GF SECURITIES CO LTD	39,700	14.120	560,564.000	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL CORP	51,300	6.500	333,450.000	
	CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	21,200	28.200	597,840.000	

	PING AN INSURANCE GROUP CO OF CHINA LTD	14,000	62.390	873,460.000	
	INDUSTRIAL BANK CO LTD	27,400	15.800	432,920.000	
	SHANGHAI PUDONG DEVELOPMENT BANK CO LTD	36,700	10.420	382,414.000	
	CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	61,100	7.510	458,861.000	
	SAIC MOTOR CORP LTD	10,900	36.040	392,836.000	
	KWEICHOW MOUTAI CO LTD	1,100	777.950	855,745.000	
	BANK OF COMMUNICATIONS CO LTD	79,200	5.970	472,824.000	
	CITIC SECURITIES CO LTD	33,200	18.590	617,188.000	
	CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	10,900	33.420	364,278.000	
	CHINA YANGTZE POWER CO LTD	26,500	16.990	450,235.000	
	CHINA STATE CONSTRUCTION ENGINEERING CORP LTD	44,000	8.130	357,720.000	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	14,300	35.370	505,791.000	
	CHINA MERCHANTS SECURITIES CO LTD	22,800	15.330	349,524.000	
	CRRC CORP LTD	64,800	8.780	568,944.000	
	JIANGSU HENGRUI MEDICINE CO LTD	4,900	81.150	397,635.000	
	CHINA RAILWAY CONSTRUCTION CORP LTD	45,500	8.940	406,770.000	
	HUATAI SECURITIES CO LTD	30,600	16.760	512,856.000	
	SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	11,000	44.440	488,840.000	
	KANGMEI PHARMACEUTICAL CO LTD	14,300	24.660	352,638.000	
	FOSHAN HAITIAN FLAVOURING & FOOD CO LTD	6,200	80.380	498,356.000	
	GUOTAI JUNAN SECURITIES CO LTD	33,800	16.410	554,658.000	
	CHINA NATIONAL NUCLEAR POWER CO LTD	92,600	5.790	536,154.000	
	オフショア・人民元 小計	865,700		14,404,463.000 (246,316,318)	
カタール・リアル	QATAR INSURANCE CO SAQ	17,487	39.000	681,993.000	
	QATAR NATIONAL BANK	47,014	162.970	7,661,871.580	
	COMMERCIAL BANK OF QATAR QSC	21,711	36.980	802,872.780	
	OOREDOO QSC	8,410	75.750	637,057.500	
	DOHA BANK QSC	18,035	27.410	494,339.350	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	4,628	189.990	879,273.720	
	INDUSTRIES QATAR QSC	19,237	109.000	2,096,833.000	

	QATAR ISLAMIC BANK SAQ	11,054	123.000	1,359,642.000	
	MASRAF AL RAYAN	38,923	34.690	1,350,238.870	
	BARWA REAL ESTATE CO	9,376	34.870	326,941.120	
	EZDAN HOLDING GROUP QSC	84,431	9.080	766,633.480	
カタール・リアル	小計	280,306		17,057,696.400 (513,266,085)	
コロンビア・ペソ	INTERCONEXION ELECTRICA SA ESP	45,324	14,640.000	663,543,360.000	
	ECOPETROL SA	436,668	3,045.000	1,329,654,060.000	
	GRUPO DE INVERSIONES SURAMERICANA SA-PREF	10,138	35,320.000	358,074,160.000	
	GRUPO AVAL ACCIONES Y VALORES SA-PREF	545,351	1,240.000	676,235,240.000	
	CEMENTOS ARGOS SA	42,840	9,520.000	407,836,800.000	
	GRUPO ARGOS SA	28,217	19,300.000	544,588,100.000	
	BANCOLOMBIA SA	26,499	33,140.000	878,176,860.000	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	47,149	33,120.000	1,561,574,880.000	
GRUPO DE INVERSIONES SURAMERICANA SA	25,428	37,200.000	945,921,600.000		
コロンビア・ペソ	小計	1,207,614		7,365,605,060.000 (282,102,673)	
タイ・パーツ	BANGKOK BANK PCL	27,700	203.000	5,623,100.000	
	BERLI JUCKER PCL NVDR	135,500	55.500	7,520,250.000	
	KRUNG THAI BANK PCL NVDR	348,000	17.900	6,229,200.000	
	ROBINSON PCL-NVDR	64,300	63.250	4,066,975.000	
	SIAM COMMERCIAL BANK PCL NVDR	191,900	136.000	26,098,400.000	
	TRUE CORP PCL NVDR	1,030,755	6.800	7,009,134.000	
	KASIKORNBANK PCL NVDR	71,200	194.500	13,848,400.000	
	TMB BANK PCL -NVDR	1,010,000	2.460	2,484,600.000	
	IRPC PCL NVDR	1,065,500	6.500	6,925,750.000	
	BANPU PCL PUBLIC CO LTD NVDR	255,900	21.500	5,501,850.000	
	ELECTRICITY GENERATING PCL NVDR	13,100	241.000	3,157,100.000	
	CHAROEN POKPHAND FOODS PCL	319,400	25.750	8,224,550.000	
	ADVANCED INFO SERVICE PCL	110,700	193.000	21,365,100.000	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	352,320	14.300	5,038,176.000	
	DELTA ELECTRONICS THAI PCL NVDR	44,200	65.500	2,895,100.000	
	PTT PCL	1,089,100	51.000	55,544,100.000	
	THAI UNION GROUP PCL-NVDR	158,500	17.200	2,726,200.000	
LAND AND HOUSES PCL NVDR	263,900	11.300	2,982,070.000		
SIAM CEMENT PCL NVDR	36,950	446.000	16,479,700.000		
AIRPORTS OF THAILAND PCL-NVDR	450,100	68.500	30,831,850.000		

	KASIKORNBANK PCL - FOREIGN	120,900	202.000	24,421,800.000	
	CENTRAL PATTANA PCL NVDR	129,100	74.250	9,585,675.000	
	BANGKOK DUSIT MEDICAL SERVICES NVDR	411,400	25.000	10,285,000.000	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR	38,900	191.000	7,429,900.000	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	236,810	35.250	8,347,552.500	
	THAI OIL PCL NVDR	118,900	87.500	10,403,750.000	
	GLOW ENERGY PCL NVDR	54,000	85.500	4,617,000.000	
	CP ALL PCL NVDR	526,900	79.250	41,756,825.000	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL	544,800	9.650	5,257,320.000	
	PTT EXPLORATION & PRODUCTION PCL NVDR	142,945	136.000	19,440,520.000	
	INDORAMA VENTURES PCL NVDR	174,022	59.500	10,354,309.000	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	241,608	89.500	21,623,916.000	
	ENERGY ABSOLUTE PCL NVDR	118,000	38.750	4,572,500.000	
	BANGKOK EXPRESSWAY & METRO PCL NVDR	740,700	7.800	5,777,460.000	
	タイ・パーツ 小計	10,638,010		418,425,132.500 (1,426,829,702)	
チェコ・コルナ	KOMERCNI BANKA AS	7,067	909.000	6,423,903.000	
	O2 CZECH REPUBLIC AS	5,677	260.000	1,476,020.000	
	CEZ	15,347	564.000	8,655,708.000	
	MONETA MONEY BANK AS	57,258	77.000	4,408,866.000	
	チェコ・コルナ 小計	85,349		20,964,497.000 (105,032,129)	
チリ・ペソ	BANCO SANTANDER CHILE	6,313,803	50.190	316,889,772.570	
	BANCO DE CREDITO E INVERSIONES	4,534	43,819.000	198,675,346.000	
	BANCO DE CHILE	2,748,849	100.850	277,221,421.650	
	EMPRESAS CMPC SA	119,530	2,450.900	292,956,077.000	
	EMPRESAS COPEC SA	41,123	10,236.000	420,935,028.000	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	15,170	8,024.700	121,734,699.000	
	ENTEL CHILE SA	16,500	6,700.900	110,564,850.000	
	ENEL AMERICAS SA	3,087,120	120.360	371,565,763.200	
	COLBUN SA	915,483	147.230	134,786,562.090	
	AGUAS ANDINAS SA	325,357	383.400	124,741,873.800	
	EMBOTELLADORA ANDINA SA	27,270	2,727.300	74,373,471.000	
	LATAM AIRLINES GROUP SA	32,604	7,398.600	241,223,954.400	
	SOCIEDAD QUIMICA Y MINERA DE CHILE SA	12,539	32,768.000	410,877,952.000	
	SACI FALABELLA	70,314	6,092.500	428,388,045.000	
	ITAU CORPBANCA	19,467,464	6.509	126,713,723.170	
	CENCOSUD SA	148,398	1,727.400	256,342,705.200	
	ENEL CHILE SA	2,713,745	68.410	185,647,295.450	

チリ・ペソ 小計		36,059,803		4,093,638,539.530 (709,836,922)	
トルコ・リラ	AKBANK TAS	186,283	7.430	1,384,082.690	
	ANADOLU EFES BIRACILIK VE MALT SANAYII AS	21,520	24.240	521,644.800	
	ARCELIK	30,429	15.180	461,912.220	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	17,677	21.340	377,227.180	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIKALARI TAS	152,776	10.320	1,576,648.320	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	8,914	63.000	561,582.000	
	KOC HOLDING AS	84,507	14.050	1,187,323.350	
	PETKIM PETROKIMYA HOLDING	80,159	4.450	356,707.550	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI AS	79,624	4.350	346,364.400	
	TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKASI AS	17,797	24.380	433,890.860	
	TURK HAVA YOLLARI	57,827	13.470	778,929.690	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	116,438	11.700	1,362,324.600	
	TURKIYE GARANTI BANKASI AS	238,831	8.400	2,006,180.400	
	TURKIYE IS BANKASI	162,502	5.770	937,636.540	
	TUPRAS TURKIYE PETROL RAFINE	13,779	110.400	1,521,201.600	
	ULKER BISKUVI SANAYI AS	13,121	19.110	250,742.310	
	YAPI VE KREDI BANKASI AS	73,599	2.530	186,205.470	
	HACI OMER SABANCI HOLDING AS	98,354	8.990	884,202.460	
	COCA-COLA ICECEK AS	6,451	35.120	226,559.120	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	21,817	66.600	1,453,012.200	
TURKIYE VAKIFLAR BANKASI TAO	90,731	5.170	469,079.270		
TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	13,735	22.280	306,015.800		
TURKIYE HALK BANKASI AS	61,970	7.240	448,662.800		
YAPI VE KREDI BANKASI AS-RTS	73,599	1.440	105,982.560		
トルコ・リラ 小計		1,722,440		18,144,118.190 (444,349,454)	
ハンガリー・フォ リント	RICHTER GEDEON NYRT	14,830	5,510.000	81,713,300.000	
	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NYRT	38,598	2,716.000	104,832,168.000	
	OTP BANK NYRT	23,398	10,180.000	238,191,640.000	
ハンガリー・フォリント 小計		76,826		424,737,108.000 (171,508,845)	

パキスタン・ルピー	LUCKY CEMENT LTD	9,900	579.150	5,733,585.000	
	MCB BANK LTD	39,000	213.320	8,319,480.000	
	OIL & GAS DEVELOPMENT CO LTD	74,500	162.360	12,095,820.000	
	UNITED BANK LTD	51,400	182.470	9,378,958.000	
	HABIB BANK LTD	54,400	184.880	10,057,472.000	
パキスタン・ルピー 小計		229,200		45,585,315.000 (43,306,049)	
フィリピン・ペソ	AYALA LAND INC	787,600	40.800	32,134,080.000	
	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	180,120	64.000	11,527,680.000	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAND	82,640	99.300	8,206,152.000	
	AYALA CORP	27,123	966.500	26,214,379.500	
	ALLIANCE GLOBAL GROUP INC	542,900	12.980	7,046,842.000	
	DMCI HOLDINGS INC	351,850	11.120	3,912,572.000	
	GLOBE TELECOM INC	2,785	1,660.000	4,623,100.000	
	INTERNATIONAL CONTAINER TERM SERVICES INC	40,680	86.950	3,537,126.000	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	290,050	59.350	17,214,467.500	
	JOLLIBEE FOODS CORP	44,130	284.000	12,532,920.000	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	82,037	80.000	6,562,960.000	
	BDO UNIBANK INC	214,803	137.100	29,449,491.300	
	MEGAWORLD CORP	962,000	4.900	4,713,800.000	
	PLDT INC	9,520	1,319.000	12,556,880.000	
	ROBINSONS LAND CORP	218,722	20.350	4,450,992.700	
	SECURITY BANK CORP	23,420	200.600	4,698,052.000	
	SM PRIME HOLDINGS INC	1,068,075	37.700	40,266,427.500	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	90,210	131.000	11,817,510.000	
	SM INVESTMENTS CORP	23,058	917.500	21,155,715.000	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CORP	1,810,900	5.010	9,072,609.000	
ABOITIZ POWER CORP	128,200	38.200	4,897,240.000		
MANILA ELECTRIC COMPANY	24,000	338.000	8,112,000.000		
GT CAPITAL HOLDINGS INC	9,070	1,000.000	9,070,000.000		
フィリピン・ペソ 小計		7,013,893		293,772,996.500 (608,110,103)	
ブラジル・リアル	BRF SA	49,492	21.500	1,064,078.000	
	VALE SA	328,721	50.890	16,728,611.690	
	RAIA DROGASIL SA	24,800	65.300	1,619,440.000	
	TIM PARTICIPACOES SA	94,500	12.900	1,219,050.000	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	19,450	14.640	284,748.000	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	29,400	12.900	379,260.000	
	BANCO DO BRASIL SA	82,400	26.950	2,220,680.000	

INVESTIMENTOS ITAU SA	464,360	9.420	4,374,271.200	
LOJAS AMERICANAS SA	79,674	16.190	1,289,922.060	
GERDAU SA	112,430	14.320	1,609,997.600	
CIA BRASILEIRA DE DISTRIBUICAO GRUPO PAO DE ACUCAR	17,006	75.840	1,289,735.040	
PETROLEO BRASILEIRO SA	292,910	18.000	5,272,380.000	
PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	32,800	17.380	570,064.000	
PETROLEO BRASILEIRO SA	418,612	15.250	6,383,833.000	
KROTON EDUCACIONAL SA	148,268	10.800	1,601,294.400	
CCR SA	114,420	9.910	1,133,902.200	
WEG SA	90,172	16.500	1,487,838.000	
BANCO BRADESCO SA PREF	353,825	27.500	9,730,187.500	
BANCO BRADESCO SA	94,718	25.050	2,372,685.900	
NATURA COSMETICOS SA	19,400	34.690	672,986.000	
CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	61,606	8.130	500,856.780	
SUZANO PAPEL E CELULOSE SA	47,000	44.730	2,102,310.000	
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	332,598	41.150	13,686,407.700	
PORTO SEGURO SA	12,600	41.660	524,916.000	
FIBRIA CELULOSE SA	24,390	71.530	1,744,616.700	
BRASKEM SA	17,030	42.970	731,779.100	
ENGIE BRASIL SA	17,370	34.740	603,433.800	
LOCALIZA RENT A CAR	54,680	24.000	1,312,320.000	
TELEFONICA BRASIL S.A.	47,228	45.270	2,138,011.560	
LOJAS RENNER SA	77,270	29.250	2,260,147.500	
EDP - ENERGIAS DO BRASIL SA	31,864	12.870	410,089.680	
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	38,352	48.780	1,870,810.560	
COSAN SA INDUSTRIA E COMERCIO	16,500	35.800	590,700.000	
EQUATORIAL ENERGIA SA	16,500	58.450	964,425.000	
EMBRAER SA	71,660	22.630	1,621,665.800	
M DIAS BRANCO SA	10,400	38.850	404,040.000	
ODONTOPREV SA	32,200	13.120	422,464.000	
BR MALLS PARTICIPACOES SA	85,565	10.000	855,650.000	
JBS SA	89,900	8.800	791,120.000	
CIA ENERGETICA DE MINAS GERAIS	96,249	6.810	655,455.690	
CIA DE SANEAMENTO BASICO DO ESTADO DE SAO PAULO	34,698	24.100	836,221.800	
MULTIPLAN EMPREENHIMENTOS IMOBILIARIOS SA	10,380	55.450	575,571.000	
SUL AMERICA SA	17,869	18.650	333,256.850	

	HYPERA SA	33,300	26.260	874,458.000	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BAICAO	217,316	20.840	4,528,865.440	
	MAGAZINE LUIZA SA	7,300	105.490	770,077.000	
	BANCO SANTANDER BRASIL SA	45,600	32.000	1,459,200.000	
	CIELO SA	117,607	16.420	1,931,106.940	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	74,000	25.460	1,884,040.000	
	ATACADAO DISTRIBUICAO COMERCIO E INDUSTRIA LTDA	44,500	15.370	683,965.000	
	AMBEV SA	491,095	18.960	9,311,161.200	
	KLABIN SA	77,400	20.560	1,591,344.000	
	RUMO SA	106,000	13.640	1,445,840.000	
	IRB BRASIL RESSEGUROS S/A	10,500	51.380	539,490.000	
	ブラジル・リアル 小計	5,335,885		122,260,781.690 (3,606,693,060)	
ポーランド・ズロチ	BANK MILLENNIUM SA	75,133	8.360	628,111.880	
	MBANK	1,595	430.800	687,126.000	
	BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA	2,596	79.400	206,122.400	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	14,190	96.280	1,366,213.200	
	BANK PEKAO SA	16,055	120.500	1,934,627.500	
	ORANGE POLSKA SA	58,600	4.970	291,242.000	
	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	32,064	87.360	2,801,111.040	
	LPP SA	130	8,995.000	1,169,350.000	
	BANK ZACHODNI WBK SA	3,171	359.000	1,138,389.000	
	CD PROJEKT RED SA	7,517	150.200	1,129,053.400	
	POWSZECHNA KASA OSZCZEDNOSCI BANK POLSKI SA	93,521	39.500	3,694,079.500	
	CCC SA	3,309	245.000	810,705.000	
	GRUPA LOTOS SA	9,480	58.880	558,182.400	
	POLSKIE GORNICtwo NAFTOWE I GAZOWNICTWO SA	167,192	6.040	1,009,839.680	
	CYFROWY POLSAT SA	22,810	23.820	543,334.200	
	GRUPA AZOTY SA	3,853	47.620	183,479.860	
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	94,532	10.450	987,859.400	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZEN SA	58,270	38.550	2,246,308.500	
	JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA SA	6,170	91.000	561,470.000	
	ALIOR BANK SA	9,405	70.000	658,350.000	
	DINO POLSKA SA	6,068	102.200	620,149.600	
	PLAY COMMUNICATIONS SA	15,228	25.900	394,405.200	

ポーランド・ズロチ 小計		700,889		23,619,509.760 (712,836,804)	
マレーシア・リン ギット	AMMB HOLDINGS BHD	190,200	3.820	726,564.000	
	GENTING PLANTATIONS BHD	19,900	9.540	189,846.000	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	488,300	6.320	3,086,056.000	
	DIGI.COM BHD	298,000	4.570	1,361,860.000	
	MALAYSIA AIRPORTS HOLDINGS BHD	87,820	8.850	777,207.000	
	RHB BANK BHD	108,980	5.730	624,455.400	
	HAP SENG CONSOLIDATED BHD	70,000	9.800	686,000.000	
	TOP GLOVE CORP BHD	66,900	10.900	729,210.000	
	GAMUDA BHD	194,600	3.540	688,884.000	
	GENTING BHD	202,000	8.780	1,773,560.000	
	YTL CORP BHD	283,710	0.990	280,872.900	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP BHD	20,256	19.600	397,017.600	
	HONG LEONG BANK BHD	63,808	19.100	1,218,732.800	
	IJM CORP BHD	349,760	1.780	622,572.800	
	IOI CORP BHD	187,213	4.630	866,796.190	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	43,200	24.920	1,076,544.000	
	FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	12,800	36.720	470,016.000	
	MALAYAN BANKING BHD	373,575	9.800	3,661,035.000	
	ALLIANCE BANK MALAYSIA BHD	88,400	4.430	391,612.000	
	MISC BHD	140,080	6.120	857,289.600	
	NESTLE MALAYSIA BHD	5,800	145.800	845,640.000	
	PPB GROUP BHD	47,800	19.840	948,352.000	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	19,600	25.120	492,352.000	
	PETRONAS GAS BHD	73,200	17.860	1,307,352.000	
	GENTING MALAYSIA BHD	282,100	5.110	1,441,531.000	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD	14,700	36.020	529,494.000	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	132,500	3.880	514,100.000	
	SP SETIA BHD	178,500	3.210	572,985.000	
	TENAGA NASIONAL BHD	327,550	14.620	4,788,781.000	
	UMW HOLDINGS BHD	39,000	6.470	252,330.000	
	DIALOG GROUP BHD	418,844	3.400	1,424,069.600	
	PUBLIC BANK BHD(LOCAL)	305,230	24.600	7,508,658.000	
AIRASIA GROUP BHD	147,900	3.200	473,280.000		
MY EG SERVICES BHD	335,800	0.855	287,109.000		
SIME DARBY BERHAD	232,700	2.490	579,423.000		
HARTALEGA HOLDINGS BHD	145,400	6.190	900,026.000		
AXIATA GROUP BERHAD	256,400	4.630	1,187,132.000		
MAXIS BHD	254,400	5.800	1,475,520.000		
PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	239,200	8.390	2,006,888.000		

	ASTRO MALAYSIA HOLDINGS BHD	140,500	1.690	237,445.000	
	IHH HEALTHCARE BHD	279,400	6.050	1,690,370.000	
	FELDA GLOBAL VENTURES HOLDINGS BHD	126,400	1.550	195,920.000	
	WESTPORTS HOLDINGS BHD	130,000	3.500	455,000.000	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDINGS BHD	153,100	4.470	684,357.000	
	SIME DARBY PROPERTY BHD	232,700	1.350	314,145.000	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	262,800	5.230	1,374,444.000	
	IOI PROPERTIES GROUP SDN BHD	174,548	1.710	298,477.080	
マレーシア・リングgit 小計		8,245,574		53,271,311.970 (1,463,362,939)	
メキシコ・ペソ	ALFA SAB DE CV	323,200	20.810	6,725,792.000	
	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	53,800	119.630	6,436,094.000	
	EL PUERTO DE LIVERPOOL SAB DE CV	19,100	116.190	2,219,229.000	
	GRUPO TELEVISA SAB	255,700	70.280	17,970,596.000	
	GRUPO BIMBO SAB DE CV	148,700	35.730	5,313,051.000	
	GRUMA SAB DE CV	24,570	226.320	5,560,682.400	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INFRAESTRUCTURA	26,125	182.330	4,763,371.250	
	GRUPO CARSO SAB DE CV	54,300	66.470	3,609,321.000	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE SAB DE CV	257,800	107.440	27,698,032.000	
	MEXICHEM SAB DE CV	108,225	55.780	6,036,790.500	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	13,960	346.290	4,834,208.400	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO SAB DE CV	156,700	31.750	4,975,225.000	
	ALSEA SAB DE CV	45,100	64.330	2,901,283.000	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL SURESTE SAB DE CV	22,325	317.000	7,077,025.000	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV	379,752	58.980	22,397,772.960	
	AMERICA MOVIL SAB DE CV	3,464,878	15.570	53,948,150.460	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA SA	244,700	28.790	7,044,913.000	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	43,400	117.410	5,095,594.000	
	WAL-MART DE MEXICO SAB DE CV	509,200	50.230	25,577,116.000	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL PACIFICO SAB DE CV	39,700	174.350	6,921,695.000	
INFRAESTRUCTURA ENERGETICA NOVA SAB DE CV	53,200	83.100	4,420,920.000		

	BANCO SANTANDER MEXICO SA-B	195,390	27.770	5,425,980.300	
メキシコ・ペソ 小計		6,439,825		236,952,842.270 (1,277,175,820)	
ユーロ	PIRAEUS BANK S.A	25,000	2.778	69,450.000	
	ALPHA BANK A.E.	154,071	1.860	286,572.060	
	NATIONAL BANK OF GREECE	345,432	0.265	91,539.480	
	TITAN CEMENT CO. S.A.	5,217	22.700	118,425.900	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	25,490	10.280	262,037.200	
	FF GROUP	3,130	4.800	15,024.000	
	EUROBANK ERGASIAS	194,100	0.940	182,454.000	
	OPAP SA	27,511	9.650	265,481.150	
	JUMBO SA	10,420	14.500	151,090.000	
ユーロ 小計		790,371		1,442,073.790 (186,114,043)	
韓国・ウォン	CHEIL WORLDWIDE INC	7,097	20,350.000	144,423,950.000	
	HANMI SCIENCE CO LTD	1,164	68,100.000	79,268,400.000	
	HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	3,401	97,600.000	331,937,600.000	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANC	3,260	261,500.000	852,490,000.000	
	DB INSURANCE CO LTD	5,060	61,100.000	309,166,000.000	
	COWAY CO LTD	5,320	93,900.000	499,548,000.000	
	KT&G CORP	12,441	98,400.000	1,224,194,400.000	
	S-1 CORPORATION	2,126	92,600.000	196,867,600.000	
	KOREA GAS CORP	2,997	63,900.000	191,508,300.000	
	CJ CORP	1,547	151,000.000	233,597,000.000	
	KAKAO CORP	4,877	113,000.000	551,101,000.000	
	SK TELECOM CO LTD	1,935	230,000.000	445,050,000.000	
	DAELIM INDUSTRIAL CO	2,987	84,700.000	252,998,900.000	
	MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD	40,612	9,460.000	384,189,520.000	
	NCSOFT CORPORATION	1,703	365,000.000	621,595,000.000	
	DOOSAN HEAVY INDUSTRIES AND CONSTRUCTION CO LTD	7,766	18,650.000	144,835,900.000	
	DAEWOO ENGINEERING & CONSTRUCT	13,540	6,380.000	86,385,200.000	
	POSCO DAEWOO CORP	3,600	23,550.000	84,780,000.000	
	LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD	976	1,392,000.000	1,358,592,000.000	
	LG CHEM LTD	4,673	375,500.000	1,754,711,500.000	
	LG CHEM LTD	1,006	228,000.000	229,368,000.000	
	LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD	259	758,000.000	196,322,000.000	
	SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD	44,389	47,450.000	2,106,258,050.000	
	HYUNDAI DEVELOPMENT CO	5,910	46,400.000	274,224,000.000	
S-OIL CORP	4,763	111,500.000	531,074,500.000		

HANWHA CHEMICAL CORPORATION	7,771	25,550.000	198,549,050.000	
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	5,914	37,500.000	221,775,000.000	
LOTTE CHEMICAL CORPORATION	1,831	381,000.000	697,611,000.000	
HOTEL SHILLA CO LTD	3,006	125,000.000	375,750,000.000	
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	3,906	121,500.000	474,579,000.000	
HYUNDAI MOBIS	7,069	230,000.000	1,625,870,000.000	
SK HYNIX INC	60,297	88,400.000	5,330,254,800.000	
HYUNDAI ENGINEERING & CONSTRUCTION CO LTD	7,926	67,200.000	532,627,200.000	
HYUNDAI MOTOR CO	2,642	88,600.000	234,081,200.000	
HYUNDAI MOTOR CO	16,162	141,000.000	2,278,842,000.000	
HYUNDAI STEEL CO	7,647	60,800.000	464,937,600.000	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	27,169	16,150.000	438,779,350.000	
KCC CORP	670	350,500.000	234,835,000.000	
KIA MOTORS CORP	27,458	33,100.000	908,859,800.000	
KOREA ZINC CO LTD	773	428,500.000	331,230,500.000	
KOREA ELECTRIC POWER CORP	27,021	34,050.000	920,065,050.000	
HANWHA CORP	3,785	36,350.000	137,584,750.000	
KOREAN AIR CO LTD	5,301	31,750.000	168,306,750.000	
OCI COMPANY LTD	1,829	117,500.000	214,907,500.000	
CJ LOGISTICS	860	154,000.000	132,440,000.000	
KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	1,930	99,300.000	191,649,000.000	
KT CORP	2,048	27,850.000	57,036,800.000	
HLB INC	2,994	104,600.000	313,172,400.000	
LG ELECTRONICS INC	11,207	89,900.000	1,007,509,300.000	
LOTTE CORP	3,366	58,900.000	198,257,400.000	
HANSEM CO LTD	1,100	116,000.000	127,600,000.000	
LG CORP	10,160	77,100.000	783,336,000.000	
NH INVESTMENT & SECURITIES CO LTD	13,362	16,400.000	219,136,800.000	
GS ENGINEERING & CONSTRUCTION	5,490	46,500.000	255,285,000.000	
NAVER CORP	2,918	701,000.000	2,045,518,000.000	
HYUNDAI DEPARTMENT STORE CO LTD	1,249	117,000.000	146,133,000.000	
DONGSUH CO INC	3,149	26,250.000	82,661,250.000	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO LTD	4,061	94,200.000	382,546,200.000	
OTTOGI CORP	112	888,000.000	99,456,000.000	
AMOREPACIFIC GROUP	2,818	129,500.000	364,931,000.000	
KANGWON LAND INC	13,108	28,100.000	368,334,800.000	
POSCO	8,177	360,000.000	2,943,720,000.000	
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	14,738	16,800.000	247,598,400.000	

SAMSUNG SDI CO LTD	5,764	225,500.000	1,299,782,000.000	
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO LTD	5,938	146,000.000	866,948,000.000	
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	498,001	49,650.000	24,725,749,650.000	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES CO LTD	42,202	7,510.000	316,937,020.000	
SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	88,502	40,350.000	3,571,055,700.000	
SHINSEGAE CO LTD	827	415,500.000	343,618,500.000	
HYOSUNG CORP	2,165	134,000.000	290,110,000.000	
YUHAN CORP	809	229,000.000	185,261,000.000	
HANON SYSTEMS	19,093	11,200.000	213,841,600.000	
HYUNDAI MARINE & FIRE INSURANCE CO LTD	6,480	35,350.000	229,068,000.000	
GS HOLDINGS CORP	5,269	58,600.000	308,763,400.000	
LG DISPLAY CO LTD	22,366	22,350.000	499,880,100.000	
CELLTRION INC	8,478	269,500.000	2,284,821,000.000	
VIROMED CO LTD	1,302	248,300.000	323,286,600.000	
HANA FINANCIAL GROUP	30,923	45,800.000	1,416,273,400.000	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	2,057	134,500.000	276,666,500.000	
CELLTRION PHARM INC	1,457	88,100.000	128,361,700.000	
LOTTE SHOPPING CO	1,227	216,000.000	265,032,000.000	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LTD	6,769	104,500.000	707,360,500.000	
AMOREPACIFIC CORP	3,333	338,000.000	1,126,554,000.000	
AMOREPACIFIC CORP-PREF	1,093	173,500.000	189,635,500.000	
SAMSUNG CARD CO	2,877	39,200.000	112,778,400.000	
SK INNOVATION CO LTD	6,757	210,000.000	1,418,970,000.000	
CJ CHEILJEDANG CORP	870	372,500.000	324,075,000.000	
STX PAN OCEAN CO LTD	18,395	5,320.000	97,861,400.000	
KEPCO PLANT SERVICE & ENGINEERING CO LTD	2,976	40,050.000	119,188,800.000	
LG INNOTEK CO LTD	1,440	150,500.000	216,720,000.000	
SK HOLDINGS CO LTD	3,352	283,000.000	948,616,000.000	
KB FINANCIAL GROUP INC	41,419	56,000.000	2,319,464,000.000	
MEDY-TOX INC	464	742,900.000	344,705,600.000	
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES LTD	6,872	46,400.000	318,860,800.000	
BNK FINANCIAL GROUP INC	24,007	10,000.000	240,070,000.000	
HANMI PHARM CO LTD	690	450,000.000	310,500,000.000	
HANWHA LIFE INSURANCE CO LTD	26,430	5,630.000	148,800,900.000	
O MEDIA HOLDINGS CO LTD	1,950	90,700.000	176,865,000.000	
E-MART CO LTD	2,012	248,500.000	499,982,000.000	
DGB FINANCIAL GROUP INC	18,575	10,800.000	200,610,000.000	
GS RETAIL CO LTD	2,482	41,500.000	103,003,000.000	
HANKOOK TIRE CO LTD NEW	8,081	46,800.000	378,190,800.000	
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOLDINGS CO LTD	942	377,000.000	355,134,000.000	

	BGF RETAIL CO LTD	854	196,000.000	167,384,000.000	
	ORION CORP REPUBLIC OF KOREA	2,381	148,500.000	353,578,500.000	
	ING LIFE INSURANCE KOREA LTD	3,735	41,650.000	155,562,750.000	
	NETMARBLE CORP	2,766	151,000.000	417,666,000.000	
	SAMSUNG SDS CO LTD	3,664	233,500.000	855,544,000.000	
	WOORI BANK	50,159	16,600.000	832,639,400.000	
	SAMSUNG C&T CORP	8,001	124,000.000	992,124,000.000	
	SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	1,767	421,000.000	743,907,000.000	
	PEARL ABYSS CORP	534	213,100.000	113,795,400.000	
	DOOSAN BOBCAT INC	4,679	34,000.000	159,086,000.000	
	SILLAJEN INC	4,950	80,300.000	397,485,000.000	
	CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	3,490	99,100.000	345,859,000.000	
韓国・ウォン 小計		1,516,059		92,578,286,640.000 (9,461,500,895)	
香港・ドル	JIANGXI COPPER CO LTD	138,000	11.860	1,636,680.000	
	JIANGSU EXPRESS	124,000	11.360	1,408,640.000	
	CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD	216,000	8.560	1,848,960.000	
	ANGANG STEEL CO LTD-H	104,000	8.200	852,800.000	
	CHINA MOBILE LIMITED	631,500	71.500	45,152,250.000	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	123,500	48.450	5,983,575.000	
	DATANG INTERNATIONAL POWER GEN	288,000	2.580	743,040.000	
	BEIJING ENTERPRISES	52,500	42.800	2,247,000.000	
	HUANENG POWER INTERNATIONAL IN	424,000	5.600	2,374,400.000	
	ALIBABA HEALTH INFORMATION TECHNOLOGY	372,000	7.240	2,693,280.000	
	YANZHOU COAL MINING CO LTD	188,000	11.560	2,173,280.000	
	HENGAN INTERNATIONAL GROUP	77,000	76.750	5,909,750.000	
	HUADIAN POWER INTL CORP-H	144,000	3.470	499,680.000	
	CHONGQING CHANGAN AUTOMOBILE	63,600	8.800	559,680.000	
	CHINA EASTERN AIRLINES CORP LT	124,000	6.670	827,080.000	
	CNOOC LTD	1,841,000	13.200	24,301,200.000	
	BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	322,000	15.720	5,061,840.000	
	CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LTD	496,000	24.400	12,102,400.000	
CHINA OVERSEAS LAND & INVESTME	401,120	28.800	11,552,256.000		
CHINA RESOURCES LAND LTD	290,888	31.100	9,046,616.800		

CITIC LTD	608,000	11.840	7,198,720.000	
CHINA TRAVEL INTERNATIONAL INV	198,000	3.380	669,240.000	
BEIJING CAPITAL INTERNATIONAL	188,000	11.520	2,165,760.000	
LENOVO GROUP LTD	798,000	4.150	3,311,700.000	
PETRO CHINA CO LTD	2,162,000	6.550	14,161,100.000	
SKYWORTH DIGITAL HOLDINGS LTD	162,000	3.870	626,940.000	
CHINA UNICOM HONG KONG LTD	644,742	10.320	6,653,737.440	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS CO LTD	174,590	28.700	5,010,733.000	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL COR	2,603,200	7.470	19,445,904.000	
TONG REN TANG TECHNOLOGIES CO	52,000	13.500	702,000.000	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	102,000	23.750	2,422,500.000	
KINGDEE INTERNATIONAL SOFTWARE GROUP CO LTD	190,000	8.640	1,641,600.000	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	80,000	78.000	6,240,000.000	
KUNLUN ENERGY COMPANY LTD	366,000	7.310	2,675,460.000	
TOWNGAS CHINA CO LTD	91,000	7.260	660,660.000	
COSCO SHIPPING PORTS LTD	162,000	7.200	1,166,400.000	
YUEXIU PROPERTY CO LTD	654,000	1.700	1,111,800.000	
CHINA MERCHANTS PORT HOLDINGS CO LTD	132,000	17.220	2,273,040.000	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	374,000	4.250	1,589,500.000	
SHENZHEN INTERNATIONAL HOLDING	117,500	16.860	1,981,050.000	
CHINA EVERBRIGHT LTD	112,000	16.840	1,886,080.000	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	183,600	33.650	6,178,140.000	
KINGBOARD CHEMICALS HOLDINGS	66,000	31.100	2,052,600.000	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LTD	517,000	23.600	12,201,200.000	
SHENZHEN INVESTMENT LTD	520,000	3.190	1,658,800.000	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LTD	86,000	30.150	2,592,900.000	
BYD CO LTD	68,000	54.100	3,678,800.000	
CHINA TELECOM CORP LTD	1,464,000	3.700	5,416,800.000	
CHINA OILFIELD SERVICES LTD	202,000	7.980	1,611,960.000	
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	1,680,000	1.000	1,680,000.000	
SINOTRANS LTD	190,000	4.360	828,400.000	

CHINA EVERBRIGHT INTERNATIONAL	277,000	10.860	3,008,220.000	
MMG LTD	220,000	6.450	1,419,000.000	
LEE & MAN PAPER MANUFACTURING LTD	170,000	8.750	1,487,500.000	
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	481,192	14.340	6,900,293.280	
AVICHINA INDUSTRY & TECHNOLOGY	225,000	5.080	1,143,000.000	
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS	195,200	15.720	3,068,544.000	
GREAT WALL MOTOR COMPANY LTD	351,500	7.620	2,678,430.000	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	774,000	22.800	17,647,200.000	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD	691,000	3.510	2,425,410.000	
SHANDONG WEIGAO GROUP MEDICAL-H	176,000	6.380	1,122,880.000	
SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	317,200	10.320	3,273,504.000	
WEICHAJ POWER CO LTD	215,440	10.740	2,313,825.600	
CHINA SHIPPING DEVELOPMENT CO	100,000	4.380	438,000.000	
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEMICAL	353,000	5.610	1,980,330.000	
SHANGHAI INDUSTRIAL	46,000	20.200	929,200.000	
TINGYI HOLDING CORP	188,000	17.920	3,368,960.000	
TSINGTAO BREWERY CO LTD	40,000	47.200	1,888,000.000	
GUANGDONG INVESTMENTS LTD	320,000	13.020	4,166,400.000	
CHINA TRADITIONAL CHINESE MEDICINE HOLDINGS CO LTD	216,000	7.110	1,535,760.000	
CHINA RESOURCES BEER HOLDINGS	159,333	36.200	5,767,854.600	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO LTD	146,000	7.750	1,131,500.000	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	711,500	12.560	8,936,440.000	
CHINA SHIPPING CONTAINER LINES	627,000	1.500	940,500.000	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	293,000	28.700	8,409,100.000	
TENCENT HOLDINGS LTD	589,800	415.000	244,767,000.000	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	534,500	78.500	41,958,250.000	
BEIJING ENTERPRISES WATER GROUP LTD	528,000	4.680	2,471,040.000	
GOME RETAIL HOLDINGS LTD	970,240	0.860	834,406.400	
CHINA POWER INTERNATIONAL	643,000	2.080	1,337,440.000	

AIR CHINA / HONG KONG	198,000	9.670	1,914,660.000	
ZTE CORP	71,288	25.600	1,824,972.800	
SHANGHAI ELECTRIC GROUP CO LTD	250,000	2.910	727,500.000	
CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD	355,500	20.850	7,412,175.000	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO LTD	248,500	4.230	1,051,155.000	
BANK OF COMMUNICATIONS	808,205	6.320	5,107,855.600	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT HOLDINGS LTD	206,250	9.490	1,957,312.500	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	77,000	127.100	9,786,700.000	
CHINA CONSTRUCTION BANK	9,950,530	8.080	80,400,282.400	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP HOLDINGS LTD	80,000	96.450	7,716,000.000	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	294,000	9.150	2,690,100.000	
AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	160,000	16.040	2,566,400.000	
SSY GROUP LTD	144,000	8.800	1,267,200.000	
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS LTD	168,000	12.120	2,036,160.000	
CHINA NATIONAL BLDG MATERIAL	374,000	9.770	3,653,980.000	
BANK OF CHINA LTD	8,221,200	4.180	34,364,616.000	
SHUI ON LAND LTD	335,500	2.180	731,390.000	
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	120,000	25.200	3,024,000.000	
GREENTOWN CHINA HOLDINGS LTD	82,000	12.260	1,005,320.000	
GUANGZHOU R&F PROPERTIES CO LTD	100,400	18.680	1,875,472.000	
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	400,970	32.550	13,051,573.500	
IND & COMM BK OF CHINA - H	7,208,235	6.590	47,502,268.650	
ZHAOJIN MINING INDUSTRY CO LTD	108,000	6.600	712,800.000	
KINGBOARD LAMINATES HOLDING	104,000	10.300	1,071,200.000	
CHINA COMMUNICATIONS SERVICES	275,600	5.240	1,444,144.000	
CHINA COMMUNICATIONS CONSTRUCTION CO LTD	486,000	8.470	4,116,420.000	
CHINA COAL ENERGY CO	178,000	3.480	619,440.000	
HAITIAN INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	64,000	21.050	1,347,200.000	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC CO LTD	60,700	38.600	2,343,020.000	

HAIER ELECTRONICS GROUP CO LTD	122,000	29.250	3,568,500.000	
CHINA AGRI-INDUSTRIES HOLDINGS LTD	191,000	3.260	622,660.000	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD	800,142	17.240	13,794,448.080	
CHINA MOLYBDENUM CO LTD	369,000	4.920	1,815,480.000	
CHINA CITIC BANK-H	938,800	5.330	5,003,804.000	
KWG PROPERTY HOLDING LTD	121,000	12.380	1,497,980.000	
SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	75,100	168.300	12,639,330.000	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	115,000	47.250	5,433,750.000	
FOSUN INTERNATIONAL	281,028	16.980	4,771,855.440	
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP LTD	568,000	4.400	2,499,200.000	
SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD	308,500	5.400	1,665,900.000	
SOHO CHINA LTD	178,000	4.120	733,360.000	
KINGSOFT CORP LTD	81,000	25.600	2,073,600.000	
GCL POLY ENERGY HOLDINGS LTD	1,362,000	0.800	1,089,600.000	
SINOTRUK HONG KONG LTD	64,500	12.620	813,990.000	
CHINA RAILWAY GROUP LTD	365,000	6.460	2,357,900.000	
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS LTD	122,000	8.760	1,068,720.000	
BYD ELECTRONIC INTERNATIONAL CO LTD	79,000	12.880	1,017,520.000	
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION CORP	155,000	8.900	1,379,500.000	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	481,000	7.790	3,746,990.000	
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	268,800	35.300	9,488,640.000	
CHINA EVERGRANDE GROUP	278,000	23.600	6,560,800.000	
CRRC CORP LTD - H	404,450	6.810	2,754,304.500	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDINGS LTD	153,000	17.900	2,738,700.000	
CHONG SING HOLDINGS FINTECH GROUP LTD	1,656,000	0.970	1,606,320.000	
SUN ART RETAIL GROUP LTD	240,000	10.040	2,409,600.000	
BBMG CORP	222,000	3.350	743,700.000	
CHINA ZHONGWANG HOLDINGS LTD	145,200	4.520	656,304.000	
SINOPHARM GROUP CO	128,400	36.050	4,628,820.000	
CHINA RESOURCES CEMENT	190,000	9.780	1,858,200.000	
METALLURGICAL CORP OF CHINA LTD	276,000	2.390	659,640.000	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD	268,527	9.480	2,545,635.960	

CHONGQING RURAL COMMERCIAL BANK	285,000	5.290	1,507,650.000	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP CORP	317,000	6.730	2,133,410.000	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD	90,000	22.850	2,056,500.000	
HUANENG RENEWABLES CORP LTD	472,000	3.100	1,463,200.000	
SIHUA PHARMACEUTICAL HOLDINGS GROUP LTD	325,000	2.080	676,000.000	
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	256,000	31.650	8,102,400.000	
YUZHOU PROPERTIES CO LTD	166,000	5.450	904,700.000	
LONGFOR PROPERTIES CO LTD	161,500	24.600	3,972,900.000	
NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	93,800	37.200	3,489,360.000	
CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	463,880	7.370	3,418,795.600	
KAISA GROUP HOLDINGS LTD	203,000	4.310	874,930.000	
XINJIANG GOLDWIND SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	60,000	11.080	664,800.000	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD	257,000	3.910	1,004,870.000	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA	3,042,000	4.150	12,624,300.000	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS LTD	55,000	27.600	1,518,000.000	
FAR EAST HORIZON LTD	257,000	8.440	2,169,080.000	
CITIC SECURITIES CO LTD	227,000	19.260	4,372,020.000	
FUTURE LAND DEVELOPMENT HOLDINGS LTD	172,000	7.200	1,238,400.000	
HAITONG SECURITIES CO LTD	380,000	9.770	3,712,600.000	
CHINA INTERNATIONAL MARINE CONTAINERS GROUP CO LTD	39,400	12.000	472,800.000	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROUP OF CHINA LTD	703,000	4.000	2,812,000.000	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	38,500	48.350	1,861,475.000	
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	382,000	6.100	2,330,200.000	
SINOPEC ENGINEERING GROUP CO LTD	121,500	7.910	961,065.000	
CHINA GALAXY SECURITIES CO LTD	345,500	4.840	1,672,220.000	
HANERGY THIN FILM POWER GROUP	986,000	0.000	0.000	

NEXTEER AUTOMOTIVE GROUP LTD	100,000	13.300	1,330,000.000	
CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS CO LTD	323,000	0.000	0.000	
JIAYUAN INTERNATIONAL GROUP LTD	94,000	14.180	1,332,920.000	
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO LTD	42,400	18.160	769,984.000	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA CO LTD	267,000	5.410	1,444,470.000	
GENSCRIPT BIOTECH CORP	74,000	25.650	1,898,100.000	
CHINA FIRST CAPITAL GROUP LTD	308,000	4.480	1,379,840.000	
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	276,000	2.620	723,120.000	
CHINA CINDA ASSET MANAGEMENT CO LTD	1,025,000	2.850	2,921,250.000	
LOGAN PROPERTY HOLDINGS CO LTD	134,000	12.500	1,675,000.000	
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS LTD	178,500	29.000	5,176,500.000	
CHINA VANKE CO LTD-H	125,461	30.800	3,864,198.800	
LUYE PHARMA GROUP LTD	108,000	8.180	883,440.000	
CAR INC	68,000	8.500	578,000.000	
CGN POWER CO LTD	1,232,000	2.160	2,661,120.000	
FULLSHARE HOLDINGS LTD	702,500	3.640	2,557,100.000	
BAIC MOTOR CORP LTD	163,500	8.500	1,389,750.000	
GF SECURITIES CO LTD	148,400	13.000	1,929,200.000	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD	51,200	28.950	1,482,240.000	
HUATAI SECURITIES CO LTD	154,200	15.200	2,343,840.000	
3SBIO INC	113,000	20.100	2,271,300.000	
LEGEND HOLDINGS CORP	31,500	25.050	789,075.000	
CHINA RESOURCES PHARMACEUTICAL GROUP LTD	152,000	11.740	1,784,480.000	
CHINA HUARONG ASSET MANAGEMENT CO LTD	960,000	2.610	2,505,600.000	
CHINA LITERATURE LTD	17,200	78.800	1,355,360.000	
DALI FOODS GROUP CO LTD	193,500	6.370	1,232,595.000	
CHINA RAILWAY SIGNAL & COMMUNICATION CORP LTD	141,000	5.800	817,800.000	
CHINA REINSURANCE GROUP CORP	525,000	1.780	934,500.000	
MEITU INC	152,500	8.150	1,242,875.000	
BOC AVIATION LTD	19,800	48.950	969,210.000	
ZHONGAN ONLINE P&C INSURANCE CO LTD	15,500	52.000	806,000.000	
CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CORP LTD	101,600	16.580	1,684,528.000	

	WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	52,500	95.700	5,024,250.000	
	HENG TEN NETWORKS GROUP LTD	2,096,000	0.325	681,200.000	
香港・ドル 小計		94,110,311		1,107,834,510.950 (15,443,213,083)	
台湾・ドル	ACER INC	314,532	26.800	8,429,457.600	
	ASUSTEK COMPUTER INC	74,554	281.500	20,986,951.000	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	46,616	114.000	5,314,224.000	
	ASIA CEMENT CORP	195,928	33.850	6,632,162.800	
	WALSIN TECHNOLOGY CORP	30,000	407.500	12,225,000.000	
	TAIWAN BUSINESS BANK	437,171	9.690	4,236,186.990	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMICONDUCTOR CORP	99,000	66.600	6,593,400.000	
	MICRO-STAR INTERNATIONAL CO LTD	73,000	112.500	8,212,500.000	
	CHICONY ELECTRONICS CO LTD	49,543	73.700	3,651,319.100	
	QUANTA COMPUTER INC	283,858	56.200	15,952,819.600	
	HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	90,070	47.600	4,287,332.000	
	EVA AIRWAYS CORP	268,161	15.250	4,089,455.250	
	CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	67,760	346.000	23,444,960.000	
	CHANG HWA COMMERCIAL BANK	539,755	18.050	9,742,577.750	
	CHINA AIRLINES	232,156	10.150	2,356,383.400	
	CHENG SHIN RUBBER INDUSTRY CO	201,169	46.950	9,444,884.550	
	CHINA STEEL CORP	1,306,058	24.400	31,867,815.200	
	CHINA LIFE INSURANCE CO LTD/TAIWAN	264,146	32.700	8,637,574.200	
	ADVANTECH CO LTD	36,889	209.500	7,728,245.500	
	COMPAL ELECTRONICS INC	450,304	19.950	8,983,564.800	
	DELTA ELECTRONICS INC	215,663	113.500	24,477,750.500	
	NANYA TECHNOLOGY CORP	110,000	99.800	10,978,000.000	
	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	371,327	110.000	40,845,970.000	
	AU OPTRONICS CORP	880,194	13.300	11,706,580.200	
	TAIWAN MOBILE CO LTD	171,800	110.500	18,983,900.000	
	EVERGREEN MARINE CORP	178,658	14.800	2,644,138.400	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	341,824	29.650	10,135,081.600	
	FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	29,825	140.000	4,175,500.000	
	ECLAT TEXTILE CO LTD	18,322	369.000	6,760,818.000	
	NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	61,285	145.500	8,916,967.500	
	FORMOSA PLASTICS CORP	461,633	108.500	50,087,180.500	
	FORMOSA TAFFETA CO LTD	126,000	35.500	4,473,000.000	

FORMOSA CHEMICALS & FIBRE CO	364,594	116.000	42,292,904.000	
GIANT MANUFACTURING	30,151	136.000	4,100,536.000	
MEDIATEK INC	154,507	330.000	50,987,310.000	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD	683,936	53.800	36,795,756.800	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	709,313	18.050	12,803,099.650	
HOTAI MOTOR CO LTD	29,000	280.500	8,134,500.000	
FAR EASTONE TELECOMMUNICATIONS CO LTD	177,000	77.600	13,735,200.000	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,111,141	14.600	16,222,658.600	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	842,920	55.000	46,360,600.000	
CHINA DEPT FINANCIAL HOLDING	1,477,403	11.500	16,990,134.500	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO LTD	998,028	21.850	21,806,911.800	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	1,698,532	88.300	149,980,375.600	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,126,495	27.100	30,528,014.500	
LARGAN PRECISION CO LTD	10,220	4,545.000	46,449,900.000	
TAISHIN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	1,052,977	14.950	15,742,006.150	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING CO	856,724	12.200	10,452,032.800	
INVENTEC CO LTD	268,005	24.600	6,592,923.000	
HTC CORPORATION	79,832	60.200	4,805,886.400	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	218,845	40.000	8,753,800.000	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	1,095,533	11.450	12,543,852.850	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,823,048	22.350	40,745,122.800	
MACRONIX INTERNATIONAL	193,000	48.700	9,399,100.000	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO LTD	989,327	21.050	20,825,333.350	
POWERTECH TECHNOLOGY INC	85,560	92.000	7,871,520.000	
NAN YA PLASTICS CORP	512,828	85.500	43,846,794.000	
WISTRON CORP	259,301	23.400	6,067,643.400	
POU CHEN CORP	236,990	37.650	8,922,673.500	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CORP	510,297	75.000	38,272,275.000	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	59,392	316.000	18,767,872.000	
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	116,480	124.000	14,443,520.000	
PHISON ELECTRONICS CORP	16,658	278.000	4,630,924.000	

	RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	90,656	36.700	3,327,075.200	
	RUENTEX INDUSTRIES LTD	68,715	65.000	4,466,475.000	
	FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	94,588	77.200	7,302,193.600	
	STANDARD FOODS CORP	30,639	62.700	1,921,065.300	
	SYNNEX TECHNOLOGY INTERNATIONAL CORP	144,899	47.350	6,860,967.650	
	TAIWAN CEMENT CORP	389,874	45.000	17,544,330.000	
	TECO ELECTRIC AND MACHINERY CO LTD	153,000	24.200	3,702,600.000	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR	2,539,083	227.000	576,371,841.000	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	1,260,525	16.400	20,672,610.000	
	WINBOND ELECTRONICS CORP	324,000	20.500	6,642,000.000	
	YAGEO CORP	21,000	1,180.000	24,780,000.000	
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	227,000	23.700	5,379,900.000	
	INNOLUX CORPORATION	964,345	12.050	11,620,357.250	
	WPG HOLDINGS CO LTD	198,526	43.550	8,645,807.300	
	HIWIN TECHNOLOGIES CORP	23,560	417.000	9,824,520.000	
	TAIMED BIOLOGICS INC	18,000	307.500	5,535,000.000	
	PEGATRON CORP	209,554	67.900	14,228,716.600	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	13,000	555.000	7,215,000.000	
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	38,000	251.000	9,538,000.000	
	CHAILEASE HOLDING CO LTD	108,076	111.000	11,996,436.000	
	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING LTD	48,385	71.000	3,435,335.000	
	TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL HOLDING	852,828	18.200	15,521,469.600	
	ASE INDUSTRIAL HOLDING CO LTD	362,903	77.500	28,124,982.500	
	GLOBALWAFERS CO LTD	21,000	542.000	11,382,000.000	
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	15,000	280.500	4,207,500.000	
	GENERAL INTERFACE SOLUTION HOLDING LTD	18,000	219.000	3,942,000.000	
	台湾・ドル 小計	34,050,394		1,991,061,063.140 (7,307,194,101)	
南アフリカ・ランド	BIDVEST GROUP LTD	35,898	202.750	7,278,319.500	
	CLICKS GROUP LTD	28,022	203.360	5,698,553.920	
	TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	44,326	83.750	3,712,302.500	
	DISCOVERY LTD	37,569	147.000	5,522,643.000	
	REDEFINE PROPERTIES LTD	586,888	10.690	6,273,832.720	
	GOLD FIELDS LTD	97,228	47.500	4,618,330.000	
	REMGRO LTD	54,435	203.880	11,098,207.800	
	THE FOSCHINI GROUP LTD	23,822	185.030	4,407,784.660	

MMI HOLDINGS LTD	111,471	18.340	2,044,378.140	
GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	317,680	26.800	8,513,824.000	
EXXARO RESOURCES LTD	25,340	132.670	3,361,857.800	
CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	4,593	884.110	4,060,717.230	
LIBERTY HOLDINGS LTD	15,137	123.750	1,873,203.750	
MTN GROUP LTD	174,789	116.230	20,315,725.470	
ANGLOGOLD ASHANTI LTD	39,800	111.320	4,430,536.000	
TELKOM SA SOC LTD	31,588	52.850	1,669,425.800	
FIRSTRAND LTD	345,104	61.500	21,223,896.000	
PSG GROUP LTD	15,546	215.000	3,342,390.000	
NASPERS LTD	45,339	3,339.990	151,431,806.610	
CORONATION FUND MANAGERS LTD	26,700	59.250	1,581,975.000	
NEDBANK GROUP LTD	21,384	270.620	5,786,938.080	
NETCARE LTD	106,707	29.900	3,190,539.300	
PICK'N PAY STORES LTD	43,375	75.740	3,285,222.500	
RMB HOLDINGS LTD	73,140	72.800	5,324,592.000	
ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	6,200	345.440	2,141,728.000	
SAPPI LTD	56,231	91.000	5,117,021.000	
SASOL LTD	57,428	492.490	28,282,715.720	
SHOPRITE HOLDINGS LTD	42,892	232.000	9,950,944.000	
MR PRICE GROUP LTD	25,911	242.500	6,283,417.500	
STANDARD BANK GROUP LTD	132,740	204.620	27,161,258.800	
SPAR GROUP LTD/THE	20,754	192.610	3,997,427.940	
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	104,346	56.620	5,908,070.520	
IMPERIAL HOLDINGS LTD	16,774	200.260	3,359,161.240	
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LTD	40,805	259.010	10,568,903.050	
BARCLAYS AFRICA GROUP LTD	74,147	162.630	12,058,526.610	
TIGER BRANDS LTD	15,366	329.730	5,066,631.180	
SANLAM LTD	178,927	73.380	13,129,663.260	
INVESTEC LTD	29,312	95.470	2,798,416.640	
KUMBA IRON ORE LTD	5,327	315.220	1,679,176.940	
PIONEER FOODS LTD	15,500	108.720	1,685,160.000	
MONDI LTD	11,126	367.000	4,083,242.000	
LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDINGS LTD	135,845	26.990	3,666,456.550	
RMI HOLDINGS	73,926	38.700	2,860,936.200	
VODACOM GROUP PTY LTD	57,401	144.450	8,291,574.450	
NEPI ROCKCASTLE PLC	35,885	130.000	4,665,050.000	
REINET INVESTMENTS SCA	13,612	240.060	3,267,696.720	
FORTRESS REIT LTD-A	102,950	16.400	1,688,380.000	
BID CORP LTD	35,164	263.000	9,248,132.000	
南アフリカ・ランド 小計	3,594,450		467,006,692.100 (3,913,516,080)	

合計	254,396,940		62,622,552,042 (62,622,552,042)	
----	-------------	--	------------------------------------	--

(2) 株式以外の有価証券

平成30年6月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考	
投資信託受益証券	メキシコ・ペソ	CEMEX SAB DE CV	1,525,375.000	18,670,590.000		
		FOMENTO ECONOMICO MEXICANO SAB DE CV	206,700.000	35,546,199.000		
	メキシコ・ペソ	小計	1,732,075.000	54,216,789.000 (292,228,492)		
投資信託受益証券 合計			1,732,075	292,228,492 (292,228,492)		
投資証券	トルコ・リラ	EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATIRIM	231,071.000	459,831.290		
	トルコ・リラ	小計	231,071.000	459,831.290 (11,261,269)		
	メキシコ・ペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	310,600.000	8,678,164.000		
	メキシコ・ペソ	小計	310,600.000	8,678,164.000 (46,775,304)		
	南アフリカ・ランド	南アフリカ・ランド	FORTRESS REIT LTD-B	95,302.000	1,568,670.920	
			HYPROP INVESTMENTS LTD	29,707.000	3,039,026.100	
			RESILIENT REIT LTD	28,600.000	1,701,414.000	
南アフリカ・ランド	小計	153,609.000	6,309,111.020 (52,870,350)			
投資証券 合計			695,280	110,906,923 (110,906,923)		
合計				403,135,415 (403,135,415)		

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

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入 投資信託 受益証券 時価比率	組入 投資証券 時価比率	有価証券の 合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	株式 44銘柄	11.89%	-%	-%	12.50%
アラブ首長国連邦・ディ ルハム	株式 11銘柄	0.53%	-%	-%	0.56%
インド・ルピー	株式 80銘柄	7.93%	-%	-%	8.34%
インドネシア・ルピア	株式 29銘柄	1.84%	-%	-%	1.93%
オフショア・人民元	株式 30銘柄	0.37%	-%	-%	0.39%
カタール・リアル	株式 11銘柄	0.77%	-%	-%	0.81%
コロンビア・ペソ	株式 9銘柄	0.43%	-%	-%	0.45%
タイ・バーツ	株式 34銘柄	2.15%	-%	-%	2.26%
チェコ・コルナ	株式 4銘柄	0.16%	-%	-%	0.17%
チリ・ペソ	株式 17銘柄	1.07%	-%	-%	1.13%
トルコ・リラ	株式 24銘柄 投資証券 1銘柄	0.67% -%	-% -%	-% 0.02%	0.72%
ハンガリー・フォリント	株式 3銘柄	0.26%	-%	-%	0.27%
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	0.92%	-%	-%	0.96%
ブラジル・レアル	株式 54銘柄	5.44%	-%	-%	5.72%
ポーランド・ズロチ	株式 22銘柄	1.08%	-%	-%	1.13%
マレーシア・リンギット	株式 47銘柄	2.21%	-%	-%	2.32%
メキシコ・ペソ	株式 22銘柄 投資信託 受益証券 2銘柄 投資証券 1銘柄	1.93% -% -%	-% 0.44% -%	-% -% 0.07%	2.56%
ユーロ	株式 9銘柄	0.28%	-%	-%	0.30%
韓国・ウォン	株式 115銘柄	14.28%	-%	-%	15.01%
香港・ドル	株式 201銘柄	23.31%	-%	-%	24.50%
台湾・ドル	株式 89銘柄	11.03%	-%	-%	11.59%
南アフリカ・ランド	株式 48銘柄 投資証券 3銘柄	5.91% -%	-% -%	-% 0.08%	6.29%

(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12月11日現在	平成30年6月11日現在
資産の部			
流動資産			
預金		2,269,619,084	2,730,488,338
コール・ローン		621,545,041	35,239,669
国債証券		98,674,949,073	105,587,991,123
派生商品評価勘定		912,500	177,440
未収利息		1,286,225,032	1,381,612,990
前払費用		90,365,806	227,812,174
流動資産合計		102,943,616,536	109,963,321,734
資産合計		102,943,616,536	109,963,321,734
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		36,000	-
未払金		510,728,894	106,018,290
未払解約金		310,721,000	47,887,000
その他未払費用		-	1,745
流動負債合計		821,485,894	153,907,035
負債合計		821,485,894	153,907,035
純資産の部			
元本等			
元本	1	52,793,954,392	62,346,960,857
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		49,328,176,250	47,462,453,842
元本等合計		102,122,130,642	109,809,414,699
純資産合計		102,122,130,642	109,809,414,699
負債純資産合計		102,943,616,536	109,963,321,734

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12月11日現在	平成30年6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	50,181,058,353円	52,793,954,392円
同期中追加設定元本額	12,567,031,436円	30,461,258,820円
同期中一部解約元本額	9,954,135,397円	20,908,252,355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）	218,918,087円	270,169,437円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	10,516,615円	44,780,851円
たわらノーロード バランス（堅実型）	42,121円	2,136,474円
たわらノーロード バランス（標準型）	31,722円	6,369,299円
たわらノーロード バランス（積極型）	15,598円	5,500,910円
たわらノーロード 最適化バランス（保守型）	- 円	77,307円
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	- 円	107,110円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	- 円	508,641円
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	- 円	264,286円
たわらノーロード 最適化バランス（積極型）	- 円	366,427円

マネックス資産設計ファンド エボリューション	75,944,530円	59,295,344円
DIAM DC 8資産バラン スファンド(新興国10)	27,143,199円	34,460,930円
DIAM DC 8資産バラン スファンド(新興国20)	88,034,415円	115,620,550円
DIAM DC 8資産バラン スファンド(新興国30)	190,593,307円	250,267,452円
投資のソムリエ	5,101,391,750円	8,475,207,388円
クルーズコントロール	1,130,388,722円	732,708,202円
投資のソムリエ<DC年金>	316,404,470円	628,888,132円
DIAM 8資産バランスファ ンドN<DC年金>	102,815,703円	128,445,770円
クルーズコントロール<DC年 金>	377,694円	307,329円
DIAMコア資産設計ファンド (堅実型)	5,474,325円	3,609,144円
DIAMコア資産設計ファンド (積極型)	14,622,181円	13,655,883円
投資のソムリエ<DC年金>リ スク抑制型	123,204,932円	279,800,713円
ダイナミック・ナビゲーション	188,968円	177,753円
リスク抑制世界8資産バラン スファンド	1,608,344,955円	5,073,901,777円
ワールドアセットバランス(基 本コース)	678,833,368円	900,646,679円
ワールドアセットバランス(リ スク抑制コース)	2,451,790,359円	3,569,428,137円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤ-2045)	802,092円	1,621,481円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤ-2055)	802,092円	1,060,296円
リスク抑制世界8資産バラン スファンド(DC)	537,469円	1,315,432円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤ-2035)	685,510円	2,619,348円
リスクコントロール世界資産分 散ファンド	-円	450,048,092円
エマージング債券リスク抑制型 (適格機関投資家限定)	12,745,371,625円	14,881,594,912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)	3,267,576,998円	3,003,197,407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)	7,407,522,362円	7,427,564,498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)	4,822,410,724円	4,926,615,765円
DIAMグローバル・リスク ファクター・パリティ戦略ファ ンド(適格機関投資家限定)	4,498,750,018円	3,727,050,401円

	D I A Mグローバル・リスク ファクター・パリティ戦略ファ ンドI I (適格機関投資家限 定)	4,678,979,067円	2,897,668,503円
	P - O n eマルチアセット戦略 ファンド(適格機関投資家限 定)	3,225,439,414円	4,429,902,797円
計		52,793,954,392円	62,346,960,857円
2 .	受益権の総数	52,793,954,392口	62,346,960,857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6月13日 至 平成29年12月11日	自 平成29年12月12日 至 平成30年6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12月11日現在	平成30年6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	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成29年12月11日現在	平成30年6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	446,975,085	4,212,743,594
合計	446,975,085	4,212,743,594

（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12月11日まで及び平成30年4月19日から平成30年6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12月11日 現在				平成30年6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	-	-	-	-	43,937,440	-	43,760,000	177,440
アメリカ・ドル	-	-	-	-	43,937,440	-	43,760,000	177,440
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	43,937,440	-	43,760,000	177,440

（注）時価の算定方法

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

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成29年12月11日現在	平成30年6月11日現在
1口当たり純資産額	1.9344円	1.7613円
(1万口当たり純資産額)	(19,344円)	(17,613円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

平成30年6月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	BRAZIL 2.625 01/05/23	8,200,000.000	7,474,300.000	
		BRAZIL 4.25 01/07/25	16,500,000.000	15,555,375.000	
		BRAZIL 4.625 01/13/28	11,000,000.000	9,919,250.000	
		BRAZIL 4.875 01/22/21	10,400,000.000	10,571,600.000	
		BRAZIL 5.0 01/27/45	13,000,000.000	10,192,000.000	
		BRAZIL 5.625 01/07/41	9,300,000.000	7,974,750.000	
		BRAZIL 5.625 02/21/47	10,400,000.000	8,808,800.000	
		BRAZIL 6.0 04/07/26	8,200,000.000	8,482,900.000	
		BRAZIL 7.125 01/20/37	8,100,000.000	8,525,250.000	
		BRAZIL 8.25 01/20/34	6,400,000.000	7,435,520.000	
		BRAZIL 8.75 02/04/25	3,000,000.000	3,602,850.000	
		BRAZIL 8.875 10/14/19	5,200,000.000	5,587,400.000	
		COLOMBIA 2.625 03/15/23	5,300,000.000	4,999,861.000	
		COLOMBIA 3.875 04/25/27	9,200,000.000	8,785,540.000	
		COLOMBIA 4.0 02/26/24	7,300,000.000	7,250,725.000	
		COLOMBIA 4.375 07/12/21	10,000,000.000	10,217,500.000	
		COLOMBIA 4.5 01/28/26	6,600,000.000	6,661,842.000	
		COLOMBIA 5.0 06/15/45	15,200,000.000	14,516,000.000	
		COLOMBIA 5.625 02/26/44	9,800,000.000	10,216,500.000	
		COLOMBIA 6.125 01/18/41	9,600,000.000	10,584,000.000	
		COLOMBIA 7.375 09/18/37	7,200,000.000	8,928,000.000	
		COLOMBIA 8.125 05/21/24	4,300,000.000	5,159,355.000	
		CROATIA 5.5 04/04/23	5,800,000.000	6,089,478.000	
		CROATIA 6.0 01/26/24	4,000,000.000	4,299,200.000	
		CROATIA 6.375 03/24/21	3,700,000.000	3,912,380.000	
		CROATIA 6.625 07/14/20	5,800,000.000	6,107,052.000	
		CROATIA 6.75 11/05/19	7,800,000.000	8,137,350.000	
		HUNGARY 5.375 02/21/23	7,100,000.000	7,541,123.000	
		HUNGARY 5.375 03/25/24	4,800,000.000	5,124,480.000	
		HUNGARY 5.75 11/22/23	8,200,000.000	8,880,764.000	
		HUNGARY 6.25 01/29/20	8,500,000.000	8,891,000.000	
		HUNGARY 6.375 03/29/21	8,600,000.000	9,206,042.000	
		HUNGARY 7.625 03/29/41	3,800,000.000	5,233,360.000	
		INDONESIA 3.375 04/15/23	4,500,000.000	4,358,835.000	
		INDONESIA 3.75 04/25/22	9,000,000.000	8,917,110.000	
		INDONESIA 3.85 07/18/27	3,000,000.000	2,857,860.000	
INDONESIA 4.125 01/15/25	10,200,000.000	10,079,232.000			
INDONESIA 4.35 01/08/27	4,200,000.000	4,156,824.000			
INDONESIA 4.625 04/15/43	4,600,000.000	4,266,362.000			
INDONESIA 4.75 01/08/26	7,000,000.000	7,133,770.000			

INDONESIA 4.875 05/05/21	8,700,000.000	8,965,176.000	
INDONESIA 5.125 01/15/45	5,800,000.000	5,771,812.000	
INDONESIA 5.25 01/08/47	4,200,000.000	4,213,818.000	
INDONESIA 5.25 01/17/42	6,900,000.000	6,969,207.000	
INDONESIA 5.875 01/15/24	7,800,000.000	8,390,850.000	
INDONESIA 5.95 01/08/46	4,000,000.000	4,432,360.000	
INDONESIA 6.75 01/15/44	6,300,000.000	7,626,528.000	
INDONESIA 7.75 01/17/38	6,300,000.000	8,227,611.000	
PANAMA 3.75 03/16/25	6,600,000.000	6,534,000.000	
PANAMA 3.875 03/17/28	6,200,000.000	6,091,500.000	
PANAMA 4.5 05/15/47	5,400,000.000	5,225,904.000	
PANAMA 5.2 01/30/20	7,400,000.000	7,677,500.000	
PANAMA 6.7 01/26/36	10,000,000.000	12,175,000.000	
PANAMA 7.125 01/29/26	4,600,000.000	5,491,250.000	
PANAMA 9.375 04/01/29	4,900,000.000	6,884,500.000	
PERU 4.125 08/25/27	7,000,000.000	7,122,500.000	
PERU 5.625 11/18/50	13,600,000.000	15,567,240.000	
PERU 6.55 03/14/37	5,800,000.000	7,176,920.000	
PERU 7.35 07/21/25	11,400,000.000	13,824,780.000	
PHILIPPINES 3.7 02/02/42	5,000,000.000	4,606,200.000	
PHILIPPINES 3.7 03/01/41	6,800,000.000	6,297,820.000	
PHILIPPINES 3.95 01/20/40	6,200,000.000	5,964,338.000	
PHILIPPINES 4.0 01/15/21	5,200,000.000	5,273,372.000	
PHILIPPINES 4.2 01/21/24	5,000,000.000	5,119,250.000	
PHILIPPINES 5.0 01/13/37	4,000,000.000	4,320,240.000	
PHILIPPINES 5.5 03/30/26	3,800,000.000	4,193,756.000	
PHILIPPINES 6.375 01/15/32	3,000,000.000	3,626,820.000	
PHILIPPINES 6.375 10/23/34	6,200,000.000	7,610,562.000	
PHILIPPINES 6.5 01/20/20	3,800,000.000	4,010,406.000	
PHILIPPINES 7.75 01/14/31	5,900,000.000	7,823,164.000	
PHILIPPINES 9.5 02/02/30	6,600,000.000	9,694,476.000	
ROMANIA 4.375 08/22/23	6,600,000.000	6,653,592.000	
ROMANIA 4.875 01/22/24	2,400,000.000	2,471,112.000	
ROMANIA 6.125 01/22/44	3,000,000.000	3,409,530.000	
ROMANIA 6.75 02/07/22	8,300,000.000	9,041,937.000	
RUSSIA FOREIGN BOND 5.0 04/29/20	16,200,000.000	16,558,992.000	
RUSSIAN FEDERATION 03/31/30	14,195,500.000	15,787,383.370	
RUSSIAN FEDERATION 4.25 06/23/27	9,800,000.000	9,397,220.000	
RUSSIAN FEDERATION 4.5 04/04/22	9,000,000.000	9,142,020.000	
RUSSIAN FEDERATION 4.75 05/27/26	10,800,000.000	10,800,216.000	

RUSSIAN FEDERATION 4.875 09/16/23	10,000,000.000	10,350,200.000	
RUSSIAN FEDERATION 5.25 06/23/47	24,000,000.000	22,382,880.000	
RUSSIAN FEDERATION 5.625 04/04/42	11,200,000.000	11,380,208.000	
RUSSIAN FEDERATION 5.875 09/16/43	5,400,000.000	5,642,838.000	
SOUTH AFRICA 4.3 10/12/28	6,800,000.000	6,124,692.000	
SOUTH AFRICA 4.665 01/17/24	4,700,000.000	4,633,025.000	
SOUTH AFRICA 4.875 04/14/26	5,400,000.000	5,201,982.000	
SOUTH AFRICA 5.0 10/12/46	2,800,000.000	2,385,208.000	
SOUTH AFRICA 5.375 07/24/44	3,200,000.000	2,864,224.000	
SOUTH AFRICA 5.5 03/09/20	6,600,000.000	6,785,394.000	
SOUTH AFRICA 5.875 05/30/22	4,200,000.000	4,425,834.000	
SOUTH AFRICA 5.875 09/16/25	6,200,000.000	6,403,112.000	
TURKEY 11.875 01/15/30	5,100,000.000	6,942,630.000	
TURKEY 3.25 03/23/23	5,100,000.000	4,546,497.000	
TURKEY 4.25 04/14/26	7,000,000.000	6,038,970.000	
TURKEY 4.875 04/16/43	10,100,000.000	7,552,780.000	
TURKEY 4.875 10/09/26	10,800,000.000	9,585,216.000	
TURKEY 5.125 03/25/22	4,300,000.000	4,171,301.000	
TURKEY 5.625 03/30/21	7,700,000.000	7,698,152.000	
TURKEY 5.75 03/22/24	9,300,000.000	9,055,875.000	
TURKEY 5.75 05/11/47	9,800,000.000	7,958,678.000	
TURKEY 6.0 01/14/41	11,700,000.000	9,937,746.000	
TURKEY 6.0 03/25/27	11,400,000.000	10,769,922.000	
TURKEY 6.25 09/26/22	8,500,000.000	8,564,855.000	
TURKEY 6.625 02/17/45	10,700,000.000	9,637,490.000	
TURKEY 6.75 05/30/40	5,900,000.000	5,437,145.000	
TURKEY 7.0 06/05/20	7,700,000.000	7,929,075.000	
TURKEY 7.375 02/05/25	11,300,000.000	11,740,700.000	
TURKEY 7.5 11/07/19	8,400,000.000	8,671,236.000	
UNITED MEXICAN STATES 3.5 01/21/21	6,200,000.000	6,187,600.000	
UNITED MEXICAN STATES 3.6 01/30/25	10,200,000.000	9,812,400.000	
UNITED MEXICAN STATES 3.625 03/15/22	9,100,000.000	9,034,571.000	
UNITED MEXICAN STATES 4.0 10/02/23	10,700,000.000	10,671,859.000	

	UNITED MEXICAN STATES 4.125 01/21/26	9,400,000.000	9,190,850.000	
	UNITED MEXICAN STATES 4.15 03/28/27	11,800,000.000	11,381,100.000	
	UNITED MEXICAN STATES 4.35 01/15/47	6,600,000.000	5,616,600.000	
	UNITED MEXICAN STATES 4.6 01/23/46	10,200,000.000	8,996,400.000	
	UNITED MEXICAN STATES 4.6 02/10/48	9,200,000.000	8,105,200.000	
	UNITED MEXICAN STATES 4.75 03/08/44	15,600,000.000	14,157,000.000	
	UNITED MEXICAN STATES 5.55 01/21/45	11,000,000.000	11,129,250.000	
	UNITED MEXICAN STATES 5.75 10/12/2110	8,800,000.000	8,294,000.000	
	UNITED MEXICAN STATES 6.05 01/11/40	11,900,000.000	12,661,600.000	
	UNITED MEXICAN STATES 6.75 09/27/34	7,000,000.000	8,198,400.000	
	アメリカ・ドル 小計	952,495,500.000 (104,212,532,655)	965,067,097.370 (105,587,991,123)	
国債証券 合計		104,212,532,655 (104,212,532,655)	105,587,991,123 (105,587,991,123)	
合計		104,212,532,655 (104,212,532,655)	105,587,991,123 (105,587,991,123)	

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

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

3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	有価証券の合計金額 に対する比率
アメリカ・ドル	国債証券 123銘柄	96.16%	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30年6月29日現在

資産総額	16,324,939,334円
負債総額	163,087,753円
純資産総額（ - ）	16,161,851,581円
発行済数量	15,714,789,609口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0284円

ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）

平成30年6月29日現在

資産総額	64,103,863,351円
負債総額	641,108,665円
純資産総額（ - ）	63,462,754,686円
発行済数量	61,820,993,229口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0266円

（参考）

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年6月29日現在

資産総額	307,142,822,840円
負債総額	210,548,318円
純資産総額（ - ）	306,932,274,522円
発行済数量	89,273,982,191口
1口当たり純資産額（ / ）	3.4381円

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年6月29日現在

資産総額	54,046,898,474円
負債総額	188,685,327円
純資産総額（ - ）	53,858,213,147円
発行済数量	44,445,255,917口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2118円

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年6月29日現在

資産総額	297,119,931,657円
負債総額	3,743,803,332円
純資産総額（ - ）	293,376,128,325円
発行済数量	221,057,155,995口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3272円

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

平成30年6月29日現在

資産総額	63,038,412,113円
負債総額	371,627,750円
純資産総額(-)	62,666,784,363円
発行済数量	54,919,931,457口
1口当たり純資産額(/)	1.1411円

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

平成30年6月29日現在

資産総額	106,605,348,028円
負債総額	58,692,745円
純資産総額(-)	106,546,655,283円
発行済数量	59,535,632,834口
1口当たり純資産額(/)	1.7896円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 受益証券の名義書換

該当事項はありません。

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

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

(2) 受益者等名簿

該当事項はありません。

(3) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

(4) 受益権の譲渡制限

譲渡制限はありません。

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

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

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

(5) 受益権の譲渡の対抗要件

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

(6) 受益権の再分割

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

(7) 質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額（平成30年6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30年6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30年6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	1,205,030,866,605
追加型株式投資信託	849	12,875,304,912,545
単位型公社債投資信託	50	194,834,324,314
単位型株式投資信託	144	907,114,136,767
合計	1,081	15,182,284,240,231

3【委託会社等の経理状況】

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

(1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

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

（単位：千円）

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

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

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

（単位：千円）

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

（３）【株主資本等変動計算書】

第32期（自平成28年4月1日至平成29年3月31日）

（単位：千円）

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

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

第33期(自平成29年4月1日至平成30年3月31日)

(単位:千円)

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

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

重要な会計方針

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

会計上の見積りの変更

第33期 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)

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

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

追加情報

第33期 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)

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

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

注記事項

(貸借対照表関係)

1. 有形固定資産の減価償却累計額

(千円)

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

(損益計算書関係)

1. 関係会社に対する事項

(千円)

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

2. 固定資産売却益の内訳

(千円)

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

3. 固定資産除却損の内訳

(千円)

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

4. 固定資産売却損の内訳

(千円)

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

5. 本社移転費用の内訳

(千円)

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

(株主資本等変動計算書関係)

第32期(自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

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

第33期(自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

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

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

営業債務である未払手数料は、1年以内の支払期日であります。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

(4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

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

第32期（平成29年3月31日現在）

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

第33期(平成30年3月31日現在)

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

(注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3) 未収委託者報酬及び(4) 未収運用受託報酬

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

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

負 債

(1) 未払手数料

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

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(千円)

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

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

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

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第32期(平成29年3月31日現在)

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

第33期(平成30年3月31日現在)

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

(有価証券関係)

1. 子会社株式及び関連会社株式

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

2. その他有価証券

第32期(平成29年3月31日現在)

(千円)

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

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

第33期(平成30年3月31日現在)

(千円)

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

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

3. 当該事業年度中に売却したその他有価証券

第32期(自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)

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

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

第33期(自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)

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

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

4. 減損処理を行った有価証券

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

第33期において、該当事項はありません。

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

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

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

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(千円)

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

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

(千円)

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

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

(千円)

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

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(千円)

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

(注) 特別損失に計上しております。

(5) 年金資産に関する事項

年金資産の主な内訳

年金資産合計に対する主な分類ごとの比率は、次のとおりであります。

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

長期期待運用収益率の設定方法

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

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎

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

3. 簡便法を適用した確定給付制度

(1) 簡便法を適用した制度の、退職給付引当金の期首残高と期末残高の調整表

(千円)

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

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

(千円)

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

(3) 退職給付費用

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

4. 確定拠出制度

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

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

繰延税金資産の純額

1,571,992

1,699,533

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

(企業結合等関係)

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

1. 結合当事企業

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

2. 企業結合日

平成28年10月1日

3. 企業結合の方法

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

4. 結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

5. 企業結合の主な目的

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

6. 合併比率

「3. 企業結合の方法」の吸収合併における合併比率は以下の通りであります。

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

(*) 普通株式と種類株式を合算して算定しております。

7. 交付した株式数

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

8. 経済的持分比率(議決権比率)

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

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

9. 取得企業を決定するに至った主な根拠

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

10. 会計処理

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

11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

(1) 財務諸表に含まれる被取得企業の業績の期間

平成29年4月1日から平成30年3月31日まで

(2) 被取得企業の取得原価及びその内訳

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

(3) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

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

(4) 企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

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

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

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

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

12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

(1) 貸借対照表項目

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

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

(2) 損益計算書項目

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

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

(資産除去債務関係)

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

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

(セグメント情報等)

1. セグメント情報

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

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

(1) サービスごとの情報

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

(2) 地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

(1) 親会社及び法人主要株主等

第32期(自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)

該当はありません。

第33期(自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)

該当はありません。

(2) 子会社及び関連会社等

第32期(自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)

該当はありません。

第33期(自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)

該当はありません。

(3) 兄弟会社等

第32期(自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は 出資金	事業の 内容又は 職業	議決権 等の所有 (被所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員 の兼任等	事業上 の関係				
親会社の子会社	株式会社みずほ銀行	東京都千代田区	14,040 億円	銀行業	-	-	当社設定投資信託の販売	投資信託の 販売代行手 数料	4,530,351	未払 手数料	767,732
	資産管理サービス信託銀行株式会社	東京都中央区	500 億円	資産管理 等	-	-	当社信託財産の運用	信託元本の 払戻(純額) 信託報酬の 支払	100,000 7,080	金銭の 信託	12,366,219
	みずほ証券株式会社	東京都千代田区	1,251 億円	証券業	-	-	当社設定投資信託の販売	投資信託の 販売代行手 数料	5,061,766	未払 手数料	1,166,212
	みずほ信託銀行株式会社	東京都中央区	2,473 億円	信託銀行 業	-	-	投資一任契約の締結	運用受託報 酬の受取	2,520,431	未収運 用受託 報酬	2,722,066

第33期(自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は 出資金	事業の 内容又は 職業	議決権 等の所有 (被所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員 の兼任等	事業上 の関係				
親会社の子会社	株式会社みずほ銀行	東京都千代田区	14,040 億円	銀行業	-	-	当社設定投資信託の販売	投資信託の 販売代行手 数料	6,470,802	未払 手数料	894,336
	みずほ証券株式会社	東京都千代田区	1,251 億円	証券業	-	-	当社設定投資信託の販売	投資信託の 販売代行手 数料	9,079,083	未払 手数料	1,549,208

取引条件及び取引条件の決定方針等

- (注1) 投資信託の販売代行手数料は、一般的取引条件を勘案した個別契約により決定しております。
- (注2) 信託報酬は、一般的取引条件を勘案した料率が適用されております。
- (注3) 運用受託報酬は、一般的取引条件を勘案した個別契約により決定しております。
- (注4) 上記の取引金額には消費税等が含まれておりません。期末残高には、消費税等が含まれております。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

株式会社みずほフィナンシャルグループ

(東京証券取引所及びニューヨーク証券取引所に上場)

(2) 重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません。

(1株当たり情報)

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

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

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

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

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

4【利害関係人との取引制限】

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

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

5【その他】

- (1) 定款の変更、事業譲渡又は事業譲受、出資の状況その他の重要事項

平成30年6月20日付で、総則の「目的」に関する事項の定款の変更を行いました。

- (2) 訴訟事件その他の重要事項

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

a. 名称

みずほ信託銀行株式会社

b. 資本金の額

平成30年3月末日現在 247,369百万円

c. 事業の内容

日本において銀行業務および信託業務を営んでいます。

(2) 販売会社

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

名 称	資本金の額 (単位:百万円)	事 業 の 内 容
株式会社みずほ銀行	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30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30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30年5月30日

アセットマネジメントOne株式会社
取締役会 御中

新日本有限責任監査法人

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

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

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

利害関係

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

以上

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

(注2) XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

平成30年8月3日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 湯原 尚 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているワールドアセットバランス（基本コース）の平成29年12月12日から平成30年6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30年6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。

その他の事項

ファンドの平成29年12月11日をもって終了した前計算期間の財務諸表は、前任監査人によって監査されている。前任監査人は、当該財務諸表に対して平成30年1月31日付けで無限定適正意見を表明している。

利害関係

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

以上

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

（注2）XBRLデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

平成30年8月3日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 湯原 尚 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている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12日から平成30年6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30年6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。

その他の事項

ファンドの平成29年12月11日をもって終了した前計算期間の財務諸表は、前任監査人によって監査されている。前任監査人は、当該財務諸表に対して平成30年1月31日付けで無限定適正意見を表明している。

利害関係

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

以上

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

（注2）XBRLデータは監査の対象には含まれておりません。

