

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	2019年3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:2019年3月12日から2019年9月11日まで

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

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

(8) 【申込取扱場所】

ファンドのお申込みにかかる取扱い等は販売会社が行います。

販売会社は、以下の方法でご確認ください。

・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

(9) 【払込期日】

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

(10)【払込取扱場所】

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

・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

(11)【振替機関に関する事項】

ファンドの受益権にかかる振替機関は以下の通りです。

株式会社証券保管振替機構

(12)【その他】

お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

ファンドは、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。

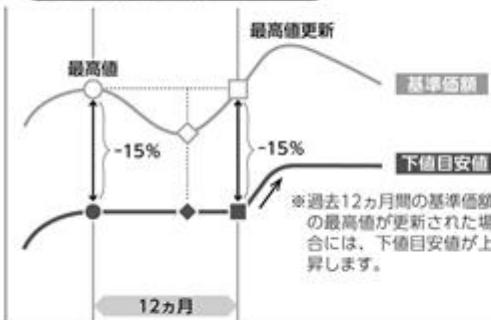
※現金等とは、短期国債、コール・ローンなどの短期金融資産等をいい、当該資産へは、「DIAMマネーマザーファンド」を通じてまたは直接投資を行います。
 ※円グラフの現金等・合計資産比率の割合はイメージです。

(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。

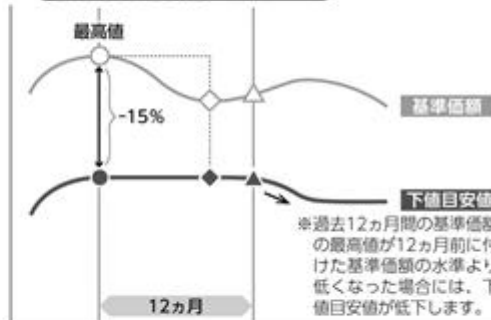
※(基本コース)は、下値目安値を定めておりません。
 ※設定後12ヵ月に満たない場合は、設定来の最高値をもとに下値目安値を決定します。

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。**

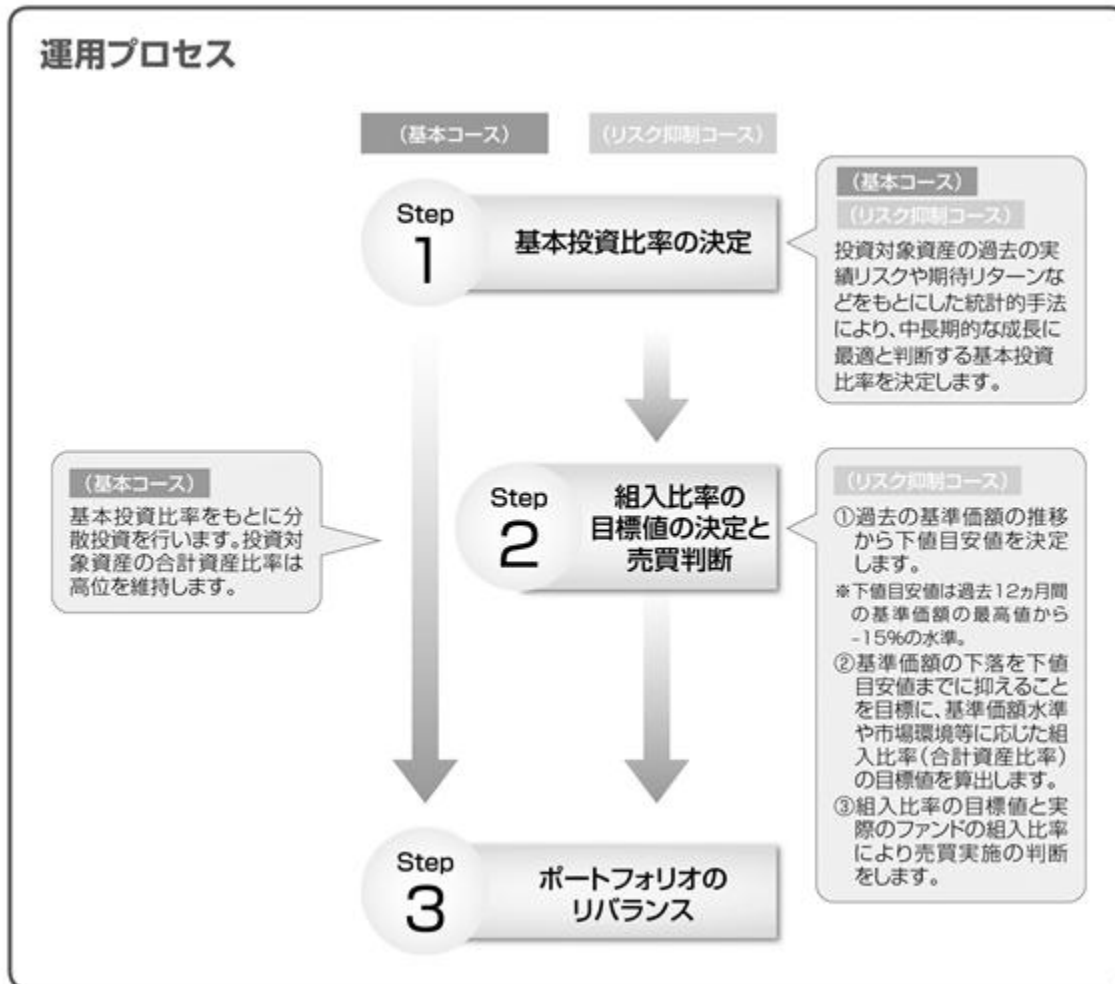
5

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。

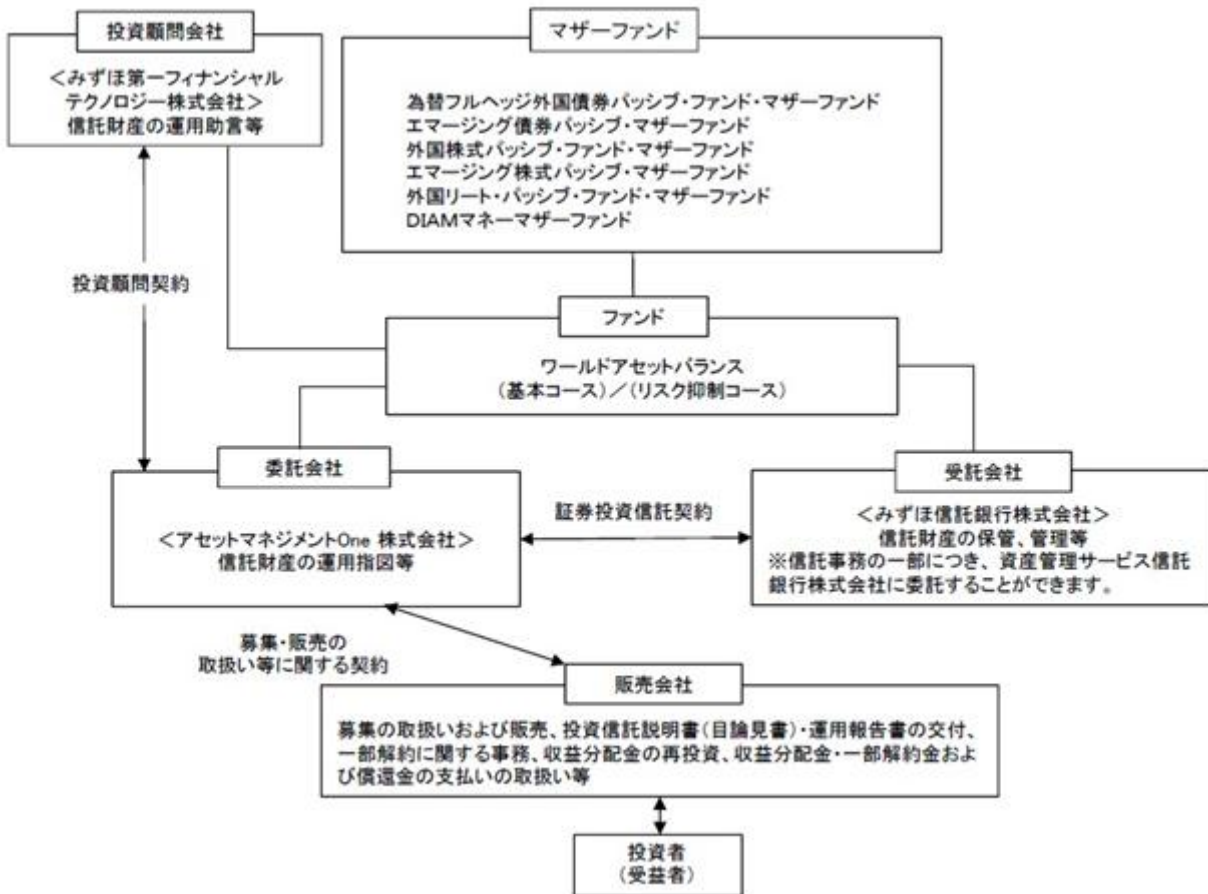
上記の分類は、一般社団法人投資信託協会の商品分類に関する指針に基づき記載しております。

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（<https://www.toushin.or.jp/>）をご覧ください。

（２）【ファンドの沿革】

2017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。

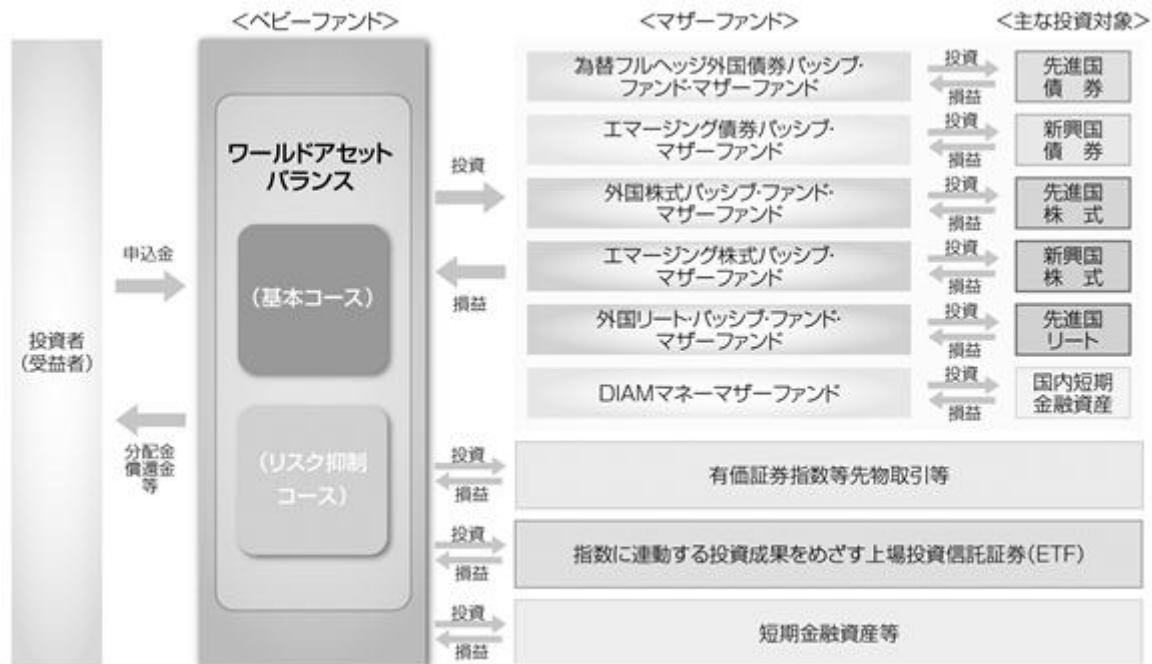
- ・「投資顧問契約」の概要

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（2018年12月28日現在）

委託会社の沿革

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

大株主の状況

（2018年12月28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書

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>

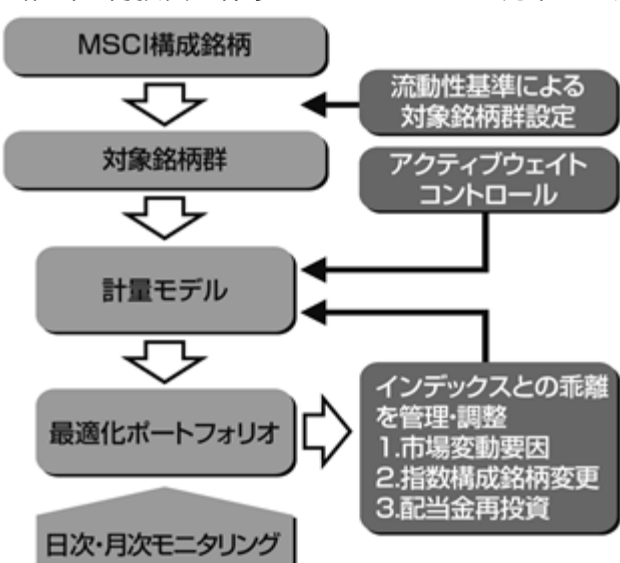
運用プロセス	<p>信用格付基準等を勘案した投資対象銘柄群を設定し、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。</p> <pre> graph TD A[インデックス構成銘柄] --> B[対象銘柄群] B --> C[計量モデル] C --> D[最適化ポートフォリオ] E[信用格付基準等を勘案した対象銘柄群設定] --> B F[金利期間構造] --> C D --> G[インデックスとの乖離を管理・調整] G --> H[日次・月次モニタリング] </pre>
主な投資制限	<ol style="list-style-type: none"> 1. 株式への投資割合は、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 D --> H["インデックスとの乖離を管理・調整 1.市場変動要因 2.指数構成銘柄変更 3.配当金再投資"] </pre>

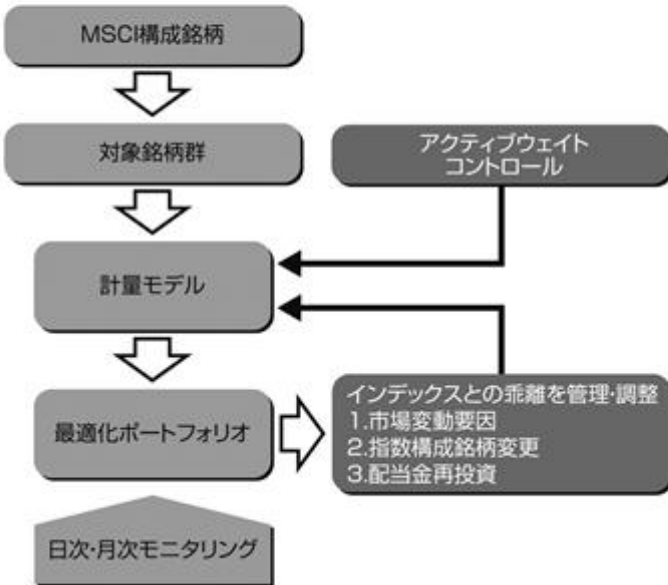
主な投資制限	<ol style="list-style-type: none"> 1. 株式への投資割合には、制限を設けません。 2. 新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において、原則として信託財産の純資産総額の20%以下とします。 3. 同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、原則として信託財産の純資産総額の10%以下とします。 4. 外貨建資産への投資には、制限を設けません。 5. デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます。)は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有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。
------	--

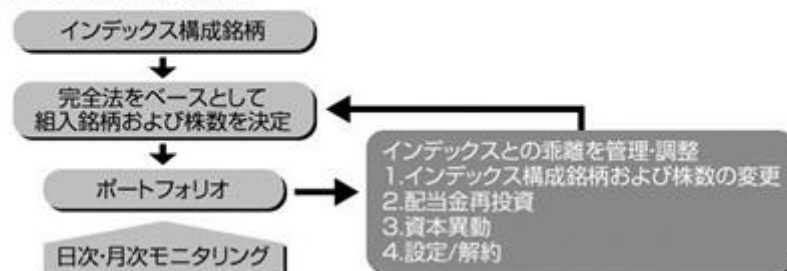
S & P 先進国 R E I T インデックスは、S&P Globalの一部門である S&P ダウ・ジョーンズ・インデックス LLC またはその関連会社 (「SPDJI」) の商品であり、これを利用するライセンスが委託会社に付与されています。Standard & Poor's および S&P は、S&P Global の一部門であるスタンダード & プアーズ・ファイナンシャル・サービシーズ LLC (「S&P」) の登録商標で、Dow Jones は、ダウ・ジョーンズ・トレードマーク・ホールディングズ LLC (「Dow Jones」) の登録商標です。指数に直接投資することはできません。本商品は、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。
--------	---

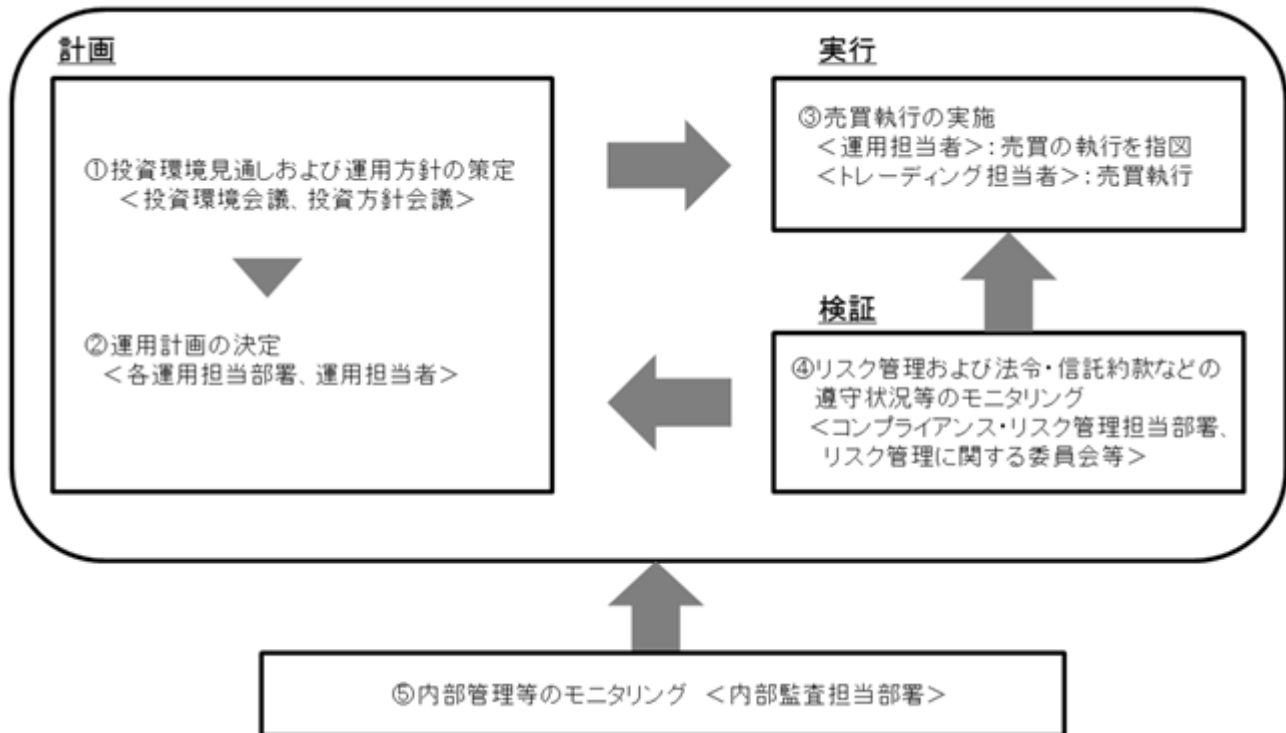
ファンド名	DIAMマネーマザーファンド
基本方針	この投資信託は、安定した収益の確保をめざします。
主な投資対象	国内発行体の公社債、転換社債、ユーロ円債、資産担保証券ならびにCD、CP、コールローン等の国内短期金融資産を主要投資対象とします。
投資態度	<ol style="list-style-type: none"> 1. 国内の国債、政府保証債、政府機関債、地方債等のほか、取得時において主要格付機関^(*)の長期発行体格付（複数の格付機関が付与している場合は高い方の格付）がAA-格相当以上の社債、転換社債、ユーロ円債、資産担保証券、さらに、国内格付機関の短期格付がa-1格相当以上のCD、CP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2018年12月28日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

上記体制は、マザーファンドを通じた実質的な運用体制を記載しております。

（４）【分配方針】

収益分配方針

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

(1) 分配対象額の範囲

経費控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。

(2) 分配対象額についての分配方針

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

(3) 留保益の運用方針

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

収益の分配方式

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

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

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

収益分配金の支払い

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

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

(5) 【投資制限】

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

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

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

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

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

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

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

投資する株式等の範囲(約款第20条)

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

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

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

信用取引の指図範囲(約款第21条)

- 1)委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引き渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
- 2)上記1)の信用取引の指図は、次の1.~6.に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行うことができるものとし、かつ次の1.~6.に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。
- 1.信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
 - 2.株式分割により取得する株券
 - 3.有償増資により取得する株券
 - 4.売出しにより取得する株券
 - 5.信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権(転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限り、)の行使により取得可能な株券
 - 6.信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権(5.に定めるものを除きます。)の行使により取得可能な株券

先物取引等の運用指図(約款第22条)

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

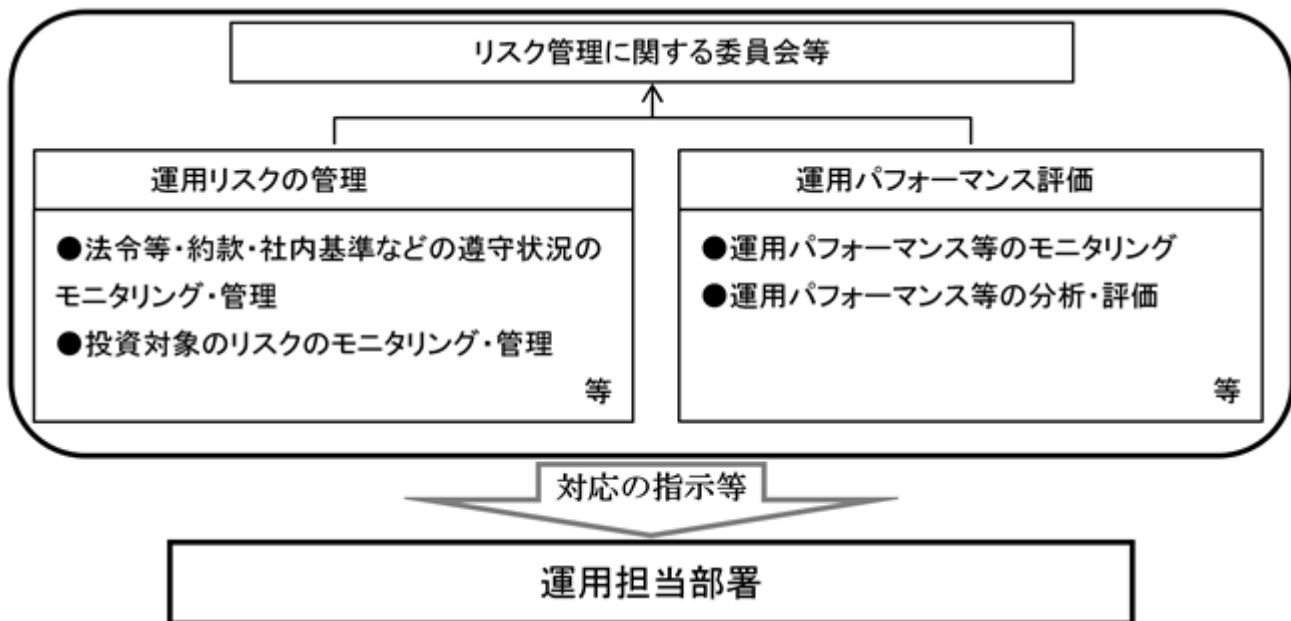
ハ. 投資信託は、購入金額について元本保証および利回り保証のいずれもありません。

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、これによる損失は購入者が負担することとなります。

< リスク管理体制 >

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

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



リスク管理体制は2018年12月28日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

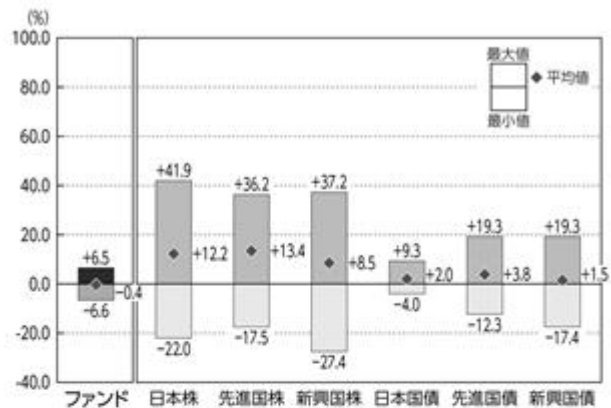
<参考情報>

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)

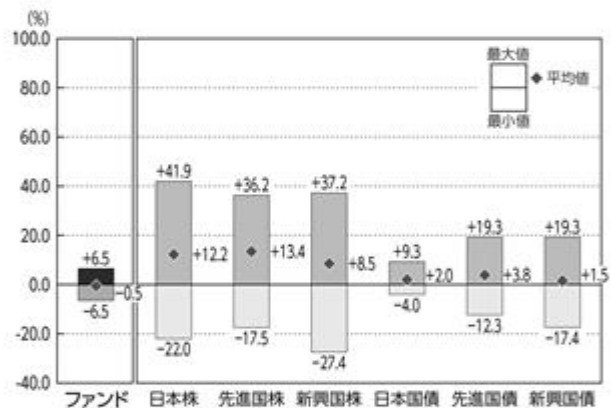


ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



ファンド:2018年1月～2018年12月
代表的な資産クラス:2014年1月～2018年12月

(リスク抑制コース)



ファンド:2018年1月～2018年12月
代表的な資産クラス:2014年1月～2018年12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… JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースィファイド(円ベース)

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

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

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

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

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

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

(2)【換金（解約）手数料】

ありません。

(3)【信託報酬等】

各ファンドの日々の純資産総額に対して年率1.2204%（税抜1.13%）

支払先	内訳（税抜）	主な役務
委託会社	年率0.55%	信託財産の運用、目論見書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価
販売会社	年率0.55%	購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価
受託会社	年率0.03%	運用財産の保管・管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率

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

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

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

(4)【その他の手数料等】

1. 信託財産留保額

ありません。

2. その他の費用

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

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

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

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

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

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

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

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

(5) 【課税上の取扱い】

各ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

個人の受益者に対する課税

収益分配時

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

詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

解約時および償還時

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

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

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

損益通算について

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

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

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

法人の受益者に対する課税

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

なお、益金不算入制度の適用はありません。

上記は、2018年12月末現在のものです。税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。

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

個別元本方式について

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

< 個別元本について >

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

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

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

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

< 収益分配金の課税について >

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

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

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

税法が改正された場合等は、上記内容が変更になることがあります。

5【運用状況】

(1)【投資状況】

ワールドアセットバランス（基本コース）

平成30年12月28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	30,633,225	0.22
内 アメリカ	30,633,225	0.22
親投資信託受益証券	13,510,118,478	97.93
内 日本	13,510,118,478	97.93
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	255,430,460	1.85
純資産総額	13,796,182,163	100.00

その他資産の投資状況

平成30年12月28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）	7,506,792,000	54.41
-	7,506,792,000	54.41

（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12月28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	47,216,625	0.09
内 アメリカ	47,216,625	0.09
親投資信託受益証券	31,475,242,120	59.75
内 日本	31,475,242,120	59.75
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	21,155,609,945	40.16
純資産総額	52,678,068,690	100.00

その他資産の投資状況

平成30年12月28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）	14,892,895,600	28.27
-	14,892,895,600	28.27

（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12月28日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	294,718,269,374	94.25
内 アメリカ	190,362,177,123	60.88
内 イギリス	18,760,053,298	6.00
内 フランス	11,442,947,586	3.66
内 カナダ	11,240,827,029	3.59
内 スイス	10,763,593,465	3.44
内 ドイツ	10,040,767,502	3.21
内 オーストラリア	7,317,101,983	2.34
内 オランダ	5,294,841,196	1.69
内 アイルランド	5,235,230,783	1.67
内 スペイン	3,559,549,309	1.14
内 香港	3,136,419,103	1.00
内 スウェーデン	2,773,153,241	0.89
内 イタリア	2,169,867,832	0.69
内 デンマーク	2,021,128,055	0.65
内 シンガポール	1,463,346,216	0.47
内 フィンランド	1,425,299,232	0.46
内 バミューダ	1,206,121,152	0.39
内 ベルギー	1,090,522,866	0.35
内 ジャージー	1,087,524,451	0.35
内 ノルウェー	805,873,913	0.26
内 ケイマン諸島	789,944,534	0.25
内 イスラエル	619,487,235	0.20
内 オランダ領キュラソー	467,470,534	0.15
内 ルクセンブルグ	397,308,771	0.13
内 オーストリア	272,410,426	0.09
内 ニュージーランド	269,149,639	0.09
内 パナマ	189,378,458	0.06
内 ポルトガル	179,781,402	0.06
内 リベリア	148,529,761	0.05
内 パプアニューギニア	77,048,156	0.02
内 イギリス領バージン諸島	51,022,932	0.02
内 マン島	47,217,307	0.02
内 モーリシャス	13,174,884	0.00
投資信託受益証券	765,829,269	0.24
内 オーストラリア	630,013,133	0.20
内 シンガポール	135,816,136	0.04
投資証券	7,184,639,442	2.30
内 アメリカ	6,340,746,871	2.03
内 イギリス	213,780,235	0.07
内 香港	207,537,771	0.07
内 オランダ	202,803,302	0.06
内 フランス	176,684,323	0.06
内 カナダ	43,086,940	0.01

コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	10,031,919,664	3.21
純資産総額	312,700,657,749	100.00

その他資産の投資状況

平成30年12月28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)	745,131,160	0.24
-	745,131,160	0.24
為替予約取引(売建)	890,389,360	0.28
-	890,389,360	0.28
株価指数先物取引(買建)	9,737,854,696	3.11
内 アメリカ	6,854,388,750	2.19
内 ドイツ	1,651,933,450	0.53
内 イギリス	632,822,163	0.20
内 カナダ	359,936,886	0.12
内 オーストラリア	238,773,447	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12月28日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	4,154,107,756	10.81
内 オーストラリア	2,746,631,684	7.15
内 シンガポール	1,391,775,284	3.62
内 カナダ	15,700,788	0.04
投資証券	32,452,395,832	84.43
内 アメリカ	26,262,226,237	68.32
内 イギリス	1,782,090,661	4.64
内 香港	904,909,061	2.35
内 オランダ	852,777,953	2.22
内 フランス	802,707,998	2.09
内 カナダ	662,754,485	1.72
内 ベルギー	325,322,803	0.85
内 スペイン	262,609,720	0.68
内 ニュージーランド	180,646,679	0.47
内 ドイツ	101,830,147	0.26
内 シンガポール	92,079,346	0.24
内 アイルランド	88,930,859	0.23
内 ガーンジー	54,958,579	0.14
内 イタリア	39,886,953	0.10
内 イスラエル	22,644,610	0.06
内 マン島	16,019,741	0.04
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	1,830,945,637	4.76
純資産総額	38,437,449,225	100.00

その他資産の投資状況

平成30年12月28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）	1,815,701,500	4.72
-	1,815,701,500	4.72

（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12月28日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	299,839,059,429	94.38
内 アメリカ	139,149,126,621	43.80
内 フランス	30,429,162,183	9.58
内 イタリア	27,431,528,177	8.63
内 ドイツ	20,345,184,943	6.40
内 イギリス	19,404,646,403	6.11
内 スペイン	17,328,831,389	5.45
内 ベルギー	7,186,021,487	2.26
内 オランダ	6,199,957,813	1.95
内 オーストラリア	6,117,574,550	1.93
内 カナダ	6,114,426,007	1.92
内 オーストリア	5,074,529,116	1.60
内 フィンランド	2,916,791,075	0.92
内 アイルランド	2,690,742,150	0.85
内 メキシコ	2,077,813,282	0.65
内 ポーランド	1,584,035,954	0.50
内 デンマーク	1,305,548,953	0.41
内 南アフリカ	1,219,493,302	0.38
内 マレーシア	1,112,421,578	0.35
内 シンガポール	941,388,900	0.30
内 スウェーデン	686,196,858	0.22
内 ノルウェー	523,638,688	0.16
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	17,865,802,705	5.62
純資産総額	317,704,862,134	100.00

その他資産の投資状況

平成30年12月28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）	304,760,343,626	95.93
-	304,760,343,626	95.93

（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12月28日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	43,256,226,228	95.42
内 ケイマン諸島	6,620,491,874	14.60
内 韓国	6,023,658,577	13.29
内 台湾	4,884,055,270	10.77
内 中国	4,659,051,672	10.28
内 インド	4,109,988,221	9.07
内 ブラジル	3,202,679,923	7.06
内 南アフリカ	2,597,273,954	5.73
内 香港	1,594,139,105	3.52

内 ロシア	1,553,802,655	3.43
内 タイ	1,072,788,775	2.37
内 マレーシア	1,070,361,707	2.36
内 インドネシア	1,025,714,119	2.26
内 メキシコ	965,312,549	2.13
内 ポーランド	548,983,833	1.21
内 カタール	488,023,080	1.08
内 フィリピン	487,469,788	1.08
内 チリ	467,067,776	1.03
内 バミューダ	460,583,908	1.02
内 アラブ首長国連邦	330,309,382	0.73
内 トルコ	276,279,261	0.61
内 コロンビア	176,320,175	0.39
内 ハンガリー	138,091,036	0.30
内 アメリカ	123,450,559	0.27
内 ギリシャ	98,353,521	0.22
内 チェコ	78,299,895	0.17
内 エジプト	48,169,784	0.11
内 ペルー	30,682,620	0.07
内 オランダ	29,556,769	0.07
内 マン島	26,783,403	0.06
内 ルクセンブルグ	22,237,958	0.05
内 パキスタン	19,269,307	0.04
内 ジョージア	14,241,565	0.03
内 シンガポール	12,734,207	0.03
新株予約権証券	87,067	0.00
内 タイ	87,067	0.00
投資信託受益証券	212,251,451	0.47
内 メキシコ	212,251,451	0.47
投資証券	66,670,040	0.15
内 メキシコ	34,653,682	0.08
内 南アフリカ	32,016,358	0.07
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,799,502,507	3.97
純資産総額	45,334,737,293	100.00

その他資産の投資状況

平成30年12月28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）	565,743,000	1.25
-	565,743,000	1.25
株価指数先物取引（買建）	1,211,723,730	2.67
内 アメリカ	1,211,723,730	2.67

（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。

（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12月28日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	77,690,567,979	91.55
内 メキシコ	11,714,734,872	13.80
内 ロシア	9,809,111,496	11.56
内 インドネシア	9,612,635,409	11.33
内 ブラジル	9,108,935,502	10.73
内 コロンビア	7,652,639,034	9.02
内 フィリピン	6,190,919,328	7.30
内 ハンガリー	4,428,593,973	5.22
内 パナマ	4,362,116,184	5.14
内 南アフリカ	4,282,210,059	5.05
内 ペルー	4,189,161,534	4.94
内 クロアチア	3,329,540,460	3.92
内 ルーマニア	3,009,970,128	3.55
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	7,171,338,613	8.45
純資産総額	84,861,906,592	100.00

その他資産の投資状況

平成30年12月28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）	4,182,061,000	4.93
-	4,182,061,000	4.93

（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12月28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	4,746,536,595	1.3273 6,300,552,676	1.3326 6,325,234,666	- -	45.85%
2	エマージング債券パッシブ・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	1,129,715,395	1.8255 2,062,380,052	1.8043 2,038,345,487	- -	14.77%
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	1,879,064,959	1.0796 2,028,668,987	1.0518 1,976,400,523	- -	14.33%
4	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	610,427,443	3.3433 2,040,887,244	3.1298 1,910,515,811	- -	13.85%
5	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	1,107,749,531	1.2420 1,375,824,918	1.1371 1,259,621,991	- -	9.13%
6	XTRACKERS MSCI EMERGING MARKETS HEDGED EQUITY ETF アメリカ	投資信託受益証券	13,300	2,384.28 31,710,924	2,303.25 30,633,225	- -	0.22%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成30年12月28日現在

種類	投資比率
投資信託受益証券	0.22%
親投資信託受益証券	97.93%
合計	98.15%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)

平成30年12月28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	11,083,568,602	1.3274 14,712,328,963	1.3326 14,769,963,519	- -	28.04%
2	エマージング債券パッシ ブ・マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	2,658,859,660	1.8259 4,854,860,522	1.8043 4,797,380,484	- -	9.11%
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	4,331,722,844	1.0792 4,675,228,465	1.0518 4,556,106,087	- -	8.65%
4	外国株式パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	1,409,243,916	3.3421 4,709,975,016	3.1298 4,410,651,608	- -	8.37%
5	外国リート・パッシブ・ ファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	2,586,527,502	1.2419 3,212,467,157	1.1371 2,941,140,422	- -	5.58%
6	XTRACKERS MSCI EMERGING MARKETS HEDGED EQUITY ETF アメリカ	投資信託受益 証券	20,500	2,384.28 48,877,740	2,303.25 47,216,625	- -	0.09%

(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12月28日現在

種類	投資比率
投資信託受益証券	0.09%
親投資信託受益証券	59.75%
合計	59.84%

(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12月28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	406,937	18,927.06 7,702,121,515	17,332.64 7,053,296,593	- -	2.26%
2	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフトウェア	611,742	10,311.11 6,307,742,403	11,230.97 6,870,462,167	- -	2.20%
3	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 インターネット販売・通信販売	34,968	164,219.13 5,742,414,622	162,242.03 5,673,279,654	- -	1.81%
4	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	224,172	14,484.16 3,246,943,373	14,142.50 3,170,354,751	- -	1.01%
5	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	284,789	12,573.94 3,580,921,115	10,771.43 3,067,587,626	- -	0.98%
6	FACEBOOK INC アメリカ	株式 インタラクティブ・メディアおよびサービス	204,582	19,327.50 3,954,059,966	14,931.71 3,054,761,141	- -	0.98%
7	ALPHABET INC-CL C アメリカ	株式 インタラクティブ・メディアおよびサービス	26,295	118,544.08 3,117,116,650	115,870.67 3,046,819,530	- -	0.97%
8	ALPHABET INC-CL A アメリカ	株式 インタラクティブ・メディアおよびサービス	25,439	118,954.43 3,026,081,792	116,871.89 2,973,104,264	- -	0.95%
9	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 石油・ガス・消耗燃料	358,278	8,457.04 3,029,973,184	7,652.33 2,741,665,070	- -	0.88%
10	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 各種金融サービス	109,040	22,313.09 2,433,020,126	22,213.31 2,422,140,412	- -	0.77%
11	PFIZER INC アメリカ	株式 医薬品	496,599	4,037.39 2,004,966,008	4,756.34 2,361,998,653	- -	0.76%
12	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	258,817	8,776.18 2,271,425,263	8,812.66 2,280,867,517	- -	0.73%
13	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	81,537	25,862.06 2,108,714,869	27,302.66 2,226,177,803	- -	0.71%

14	VISA INC アメリカ	株式 情報技術サービス	150,150	13,632.02 2,046,848,323	14,653.10 2,200,164,466	- -	0.70%
15	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 銀行	804,210	3,457.01 2,780,166,698	2,705.06 2,175,444,344	- -	0.70%
16	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品	210,831	9,112.07 1,921,108,451	10,214.21 2,153,474,216	- -	0.69%
17	VERIZON COMM INC アメリカ	株式 各種電気通信サービス	350,337	5,591.67 1,958,971,675	6,121.64 2,144,640,496	- -	0.69%
18	INTEL CORP アメリカ	株式 半導体・半導体製造装置	390,653	5,066.62 1,979,294,041	5,145.95 2,010,284,711	- -	0.64%
19	CHEVRON CORP アメリカ	株式 石油・ガス・消耗燃料	162,299	12,564.67 2,039,234,881	12,134.51 1,969,420,461	- -	0.63%
20	WELLS FARGO & CO アメリカ	株式 銀行	387,914	6,438.34 2,497,522,663	5,053.82 1,960,451,410	- -	0.63%
21	AT&T INC アメリカ	株式 各種電気通信サービス	615,965	3,812.46 2,348,347,851	3,124.64 1,924,675,037	- -	0.62%
22	CISCO SYSTEMS INC アメリカ	株式 通信機器	399,761	4,715.29 1,884,990,049	4,763.00 1,904,065,640	- -	0.61%
23	MERCK & CO. INC. アメリカ	株式 医薬品	225,279	6,366.55 1,434,250,893	8,367.17 1,884,949,943	- -	0.60%
24	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 専門小売り	95,897	20,316.61 1,948,302,788	18,905.51 1,812,982,651	- -	0.58%
25	COCA-COLA CO/THE アメリカ	株式 飲料	335,109	4,951.83 1,659,403,483	5,275.82 1,767,978,115	- -	0.57%
26	NOVARTIS AG-REG SHS スイス	株式 医薬品	183,825	9,031.12 1,660,146,956	9,208.84 1,692,815,196	- -	0.54%
27	MASTERCARD INC アメリカ	株式 情報技術サービス	78,161	19,515.34 1,525,339,254	20,944.58 1,637,050,098	- -	0.52%
28	BOEING CO アメリカ	株式 航空宇宙・防衛	46,233	38,306.39 1,771,019,546	35,202.53 1,627,519,031	- -	0.52%
29	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN スイス	株式 医薬品	59,448	25,366.36 1,507,979,758	26,528.03 1,577,038,624	- -	0.50%
30	HSBC HOLDINGS PLC イギリス	株式 銀行	1,688,481	1,027.89 1,735,574,627	896.13 1,513,106,583	- -	0.48%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成30年12月28日現在

種類	投資比率
株式	94.25%
投資信託受益証券	0.24%
投資証券	2.30%
合計	96.79%

（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12月28日現在

業種	国内/外国	投資比率
銀行	外国	8.09%
石油・ガス・消耗燃料		5.87%
医薬品		5.83%
ソフトウェア		4.65%
保険		3.72%
情報技術サービス		3.58%
インタラクティブ・メディアおよびサービス		3.05%
半導体・半導体製造装置		2.80%
資本市場		2.68%
コンピュータ・周辺機器		2.52%
ヘルスケア機器・用品		2.51%
化学		2.32%
インターネット販売・通信販売		2.30%
各種電気通信サービス		2.21%
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス		2.17%
航空宇宙・防衛		2.11%
電力		2.02%
飲料		1.99%
バイオテクノロジー		1.99%
食品		1.86%
ホテル・レストラン・レジャー		1.84%
専門小売り		1.62%
食品・生活必需品小売り		1.53%
機械		1.49%
金属・鉱業		1.43%
娯楽		1.38%
コングロマリット		1.38%
繊維・アパレル・贅沢品		1.36%
家庭用品		1.34%
メディア		1.16%
総合公益事業		1.08%
各種金融サービス		1.02%
陸運・鉄道		0.99%
通信機器		0.97%
タバコ		0.91%
自動車		0.86%
パーソナル用品		0.72%
電気設備		0.71%

ライフサイエンス・ツール/サービス	0.70%
専門サービス	0.68%
不動産管理・開発	0.56%
航空貨物・物流サービス	0.52%
複合小売り	0.48%
消費者金融	0.46%
電子装置・機器・部品	0.46%
商業サービス・用品	0.42%
建設関連製品	0.37%
エネルギー設備・サービス	0.36%
家庭用耐久財	0.35%
自動車部品	0.33%
建設・土木	0.32%
無線通信サービス	0.32%
商社・流通業	0.28%
容器・包装	0.26%
建設資材	0.26%
運送インフラ	0.21%
ガス	0.17%
旅客航空輸送業	0.12%
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.11%
紙製品・林産品	0.09%
水道	0.09%
ヘルスケア・テクノロジー	0.08%
販売	0.07%
海運業	0.06%
レジャー用品	0.05%
各種消費者サービス	0.01%
合計	94.25%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年12月28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	96,717	19,511.89 1,887,131,525	18,573.62 1,796,385,772	- -	4.67%
2	PROLOGIS INC アメリカ	投資証券	196,814	7,223.06 1,421,600,568	6,438.00 1,267,088,532	- -	3.30%
3	PUBLIC STORAGE アメリカ	投資証券	46,874	24,011.01 1,125,492,151	22,389.80 1,049,499,953	- -	2.73%
4	WELLTOWER INC アメリカ	投資証券	117,406	6,999.10 821,736,359	7,688.96 902,731,211	- -	2.35%
5	EQUITY RESIDENTIAL アメリカ	投資証券	115,146	7,208.67 830,049,949	7,332.65 844,326,468	- -	2.20%
6	AVALONBAY COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	43,197	19,457.50 840,505,666	19,248.50 831,477,886	- -	2.16%
7	LINK REIT 香港	投資証券	700,020	1,017.28 712,116,754	1,118.80 783,183,776	- -	2.04%
8	DIGITAL REALTY TRUST INC アメリカ	投資証券	64,459	12,226.31 788,096,057	11,633.90 749,910,204	- -	1.95%
9	VENTAS INC アメリカ	投資証券	111,387	6,337.27 705,890,024	6,570.08 731,822,614	- -	1.90%
10	UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD オランダ	投資証券	43,008	22,542.83 969,522,051	16,814.79 723,170,918	- -	1.88%
11	REALTY INCOME CORP アメリカ	投資証券	92,200	6,317.11 582,437,570	7,027.41 647,927,202	- -	1.69%
12	BOSTON PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	48,246	13,727.42 662,293,453	12,507.47 603,435,880	- -	1.57%
13	ESSEX PROPERTY TRUST INC アメリカ	投資証券	20,636	26,835.50 553,777,534	27,273.80 562,822,343	- -	1.46%
14	SCENTRE GROUP オーストラリア	投資信託受益 証券	1,761,490	330.75 582,625,344	310.37 546,721,754	- -	1.42%
15	HCP INC アメリカ	投資証券	149,093	2,896.77 431,888,704	3,086.90 460,236,672	- -	1.20%
16	GOODMAN GROUP オーストラリア	投資信託受益 証券	526,364	792.71 417,255,955	859.19 452,251,001	- -	1.18%
17	HOST HOTELS & RESORTS INC アメリカ	投資証券	231,676	2,291.23 530,824,784	1,869.23 433,058,046	- -	1.13%
18	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT アメリカ	投資証券	33,569	13,921.96 467,346,481	12,708.38 426,607,943	- -	1.11%
19	EXTRA SPACE STORAGE INC アメリカ	投資証券	39,491	10,686.56 422,023,167	10,067.69 397,583,540	- -	1.03%
20	UDR INC アメリカ	投資証券	86,000	4,266.10 366,884,762	4,386.72 377,257,920	- -	0.98%
21	MID AMERICA アメリカ	投資証券	35,530	11,057.37 392,868,438	10,598.27 376,556,888	- -	0.98%
22	VORNADO REALTY TRUST アメリカ	投資証券	54,043	8,018.79 433,359,614	6,865.34 371,024,110	- -	0.97%

23	WP CAREY INC アメリカ	投資証券	50,267	7,403.65 372,159,505	7,369.28 370,432,100	- -	0.96%
24	REGENCY CENTERS CORP アメリカ	投資証券	52,871	6,983.21 369,209,437	6,475.73 342,378,849	- -	0.89%
25	DUKE REALTY TRUST アメリカ	投資証券	111,786	3,168.20 354,161,115	2,853.80 319,016,004	- -	0.83%
26	IRON MOUNTAIN INC アメリカ	投資証券	89,292	3,799.99 339,309,514	3,569.75 318,751,009	- -	0.83%
27	FEDERAL REALTY INVS TRUST アメリカ	投資証券	23,041	13,946.48 321,341,057	13,345.52 307,494,356	- -	0.80%
28	SUN COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	26,935	11,006.34 296,455,978	11,234.30 302,596,139	- -	0.79%
29	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES アメリカ	投資証券	27,993	10,395.88 291,011,948	10,699.28 299,505,224	- -	0.78%
30	DEXUS オーストラリア	投資信託受益 証券	331,045	795.06 263,201,562	864.67 286,244,944	- -	0.74%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成30年12月28日現在

種類	投資比率
投資信託受益証券	10.81%
投資証券	84.43%
合計	95.24%

(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12月28日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	US T N/B 1.375 09/30/20 アメリカ	国債証券	2,388,720,000	97.18 2,321,491,816	97.96 2,339,990,112	1.375000 2020/9/30	0.74%
2	US T N/B 3.625 02/15/20 アメリカ	国債証券	2,164,500,000	101.75 2,202,443,685	101.10 2,188,417,725	3.625000 2020/2/15	0.69%
3	US T N/B 1.625 07/31/20 アメリカ	国債証券	2,136,750,000	97.92 2,092,512,597	98.50 2,104,848,322	1.625000 2020/7/31	0.66%
4	US T N/B 2.75 09/30/20 アメリカ	国債証券	2,093,460,000	99.89 2,091,240,932	100.30 2,099,740,380	2.750000 2020/9/30	0.66%
5	US T N/B 2.875 10/31/20 アメリカ	国債証券	1,867,020,000	100.07 1,868,438,935	100.54 1,877,139,248	2.875000 2020/10/31	0.59%
6	US T N/B 1.75 06/30/22 アメリカ	国債証券	1,665,000,000	96.26 1,602,812,250	97.35 1,620,894,150	1.750000 2022/6/30	0.51%
7	US T N/B 2.0 12/31/21 アメリカ	国債証券	1,633,920,000	97.07 1,586,176,775	98.46 1,608,888,345	2.000000 2021/12/31	0.51%
8	US T N/B 1.875 09/30/22 アメリカ	国債証券	1,639,470,000	95.86 1,571,727,099	97.58 1,599,876,799	1.875000 2022/9/30	0.50%
9	US T N/B 2.0 02/15/23 アメリカ	国債証券	1,554,000,000	96.70 1,502,764,620	97.78 1,519,516,740	2.000000 2023/2/15	0.48%
10	US T N/B 1.125 07/31/21 アメリカ	国債証券	1,542,900,000	95.43 1,472,497,473	96.44 1,488,049,905	1.125000 2021/7/31	0.47%
11	US T N/B 2.625 08/15/20 アメリカ	国債証券	1,481,850,000	100.09 1,483,287,394	100.08 1,483,168,846	2.625000 2020/8/15	0.47%
12	US T N/B 2.125 12/31/22 アメリカ	国債証券	1,498,500,000	97.32 1,458,460,080	98.32 1,473,445,080	2.125000 2022/12/31	0.46%
13	US T N/B 2.875 10/15/21 アメリカ	国債証券	1,454,100,000	100.02 1,454,434,443	100.88 1,466,983,326	2.875000 2021/10/15	0.46%
14	US T N/B 1.875 03/31/22 アメリカ	国債証券	1,476,300,000	96.97 1,431,656,688	97.94 1,445,962,035	1.875000 2022/3/31	0.46%
15	US T N/B 2.625 08/31/20 アメリカ	国債証券	1,419,690,000	99.61 1,414,172,559	100.07 1,420,740,570	2.625000 2020/8/31	0.45%
16	US T N/B 1.5 06/15/20 アメリカ	国債証券	1,443,000,000	97.98 1,413,966,840	98.44 1,420,619,070	1.500000 2020/6/15	0.45%
17	US T N/B 2.0 09/30/20 アメリカ	国債証券	1,405,260,000	98.71 1,387,132,146	99.04 1,391,853,819	2.000000 2020/9/30	0.44%
18	US T N/B 2.0 07/31/20 アメリカ	国債証券	1,398,600,000	98.84 1,382,418,198	99.10 1,386,138,474	2.000000 2020/7/31	0.44%
19	US T N/B 2.375 08/15/24 アメリカ	国債証券	1,399,710,000	97.41 1,363,513,499	98.71 1,381,653,741	2.375000 2024/8/15	0.43%
20	US T N/B 1.75 12/31/20 アメリカ	国債証券	1,397,490,000	97.77 1,366,367,897	98.49 1,376,415,850	1.750000 2020/12/31	0.43%
21	US T N/B 2.25 11/15/27 アメリカ	国債証券	1,428,570,000	93.30 1,332,871,305	96.15 1,373,655,769	2.250000 2027/11/15	0.43%
22	US T N/B 2.25 11/15/24 アメリカ	国債証券	1,398,600,000	96.53 1,350,194,454	97.88 1,368,977,652	2.250000 2024/11/15	0.43%
23	US T N/B 2.75 02/15/24 アメリカ	国債証券	1,324,230,000	99.68 1,320,085,160	100.72 1,333,843,909	2.750000 2024/2/15	0.42%

24	US T N/B 1.375 05/31/21 アメリカ	国債証券	1,370,850,000	96.53 1,323,336,339	97.26 1,333,357,252	1.375000 2021/5/31	0.42%
25	US T N/B 2.625 11/15/20 アメリカ	国債証券	1,316,460,000	100.05 1,317,118,230	100.10 1,317,894,941	2.625000 2020/11/15	0.41%
26	US T N/B 2.25 03/31/21 アメリカ	国債証券	1,323,120,000	98.96 1,309,465,401	99.35 1,314,638,800	2.250000 2021/3/31	0.41%
27	US T N/B 1.375 05/31/20 アメリカ	国債証券	1,333,110,000	97.78 1,303,634,937	98.30 1,310,500,454	1.375000 2020/5/31	0.41%
28	US T N/B 2.0 11/30/22 アメリカ	国債証券	1,334,220,000	96.89 1,292,725,758	97.91 1,306,388,170	2.000000 2022/11/30	0.41%
29	US T N/B 2.125 08/31/20 アメリカ	国債証券	1,294,260,000	99.03 1,281,822,161	99.25 1,284,643,648	2.125000 2020/8/31	0.40%
30	ITALY BTPS 0.35 11/01/21 イタリア	国債証券	1,295,400,000	95.38 1,235,624,362	98.35 1,274,142,486	0.350000 2021/11/1	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12月28日現在

種類	投資比率
国債証券	94.38%
合計	94.38%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

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12月28日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	TENCENT HOLDINGS LTD ケイマン諸島	株式 インタラク ティブ・メ ディアおよび サービス	470,800	5,521.33 2,599,446,200	4,390.12 2,066,872,262	- -	4.56%
2	ALIBABA GROUP HOLDING LTD- ADR ケイマン諸島	株式 インターネッ ト販売・通信 販売	106,580	19,644.56 2,093,717,803	15,367.95 1,637,916,111	- -	3.61%
3	TAIWAN SEMICONDUCTOR 台湾	株式 半導体・半導 体製造装置	2,030,083	849.94 1,725,450,696	802.79 1,629,750,632	- -	3.59%
4	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD 韓国	株式 コンピュー タ・周辺機器	397,189	4,920.80 1,954,488,948	3,802.04 1,510,132,437	- -	3.33%
5	NASPERS LTD 南アフリカ	株式 メディア	36,084	23,207.90 837,434,162	21,958.92 792,365,741	- -	1.75%
6	CHINA CONSTRUCTION BANK 中国	株式 銀行	7,943,530	109.96 873,503,162	89.75 713,006,486	- -	1.57%
7	CHINA MOBILE LIMITED 香港	株式 無線通信サー ビス	502,000	1,027.48 515,795,420	1,055.70 529,961,902	- -	1.17%
8	IND & COMM BK OF CHINA - H 中国	株式 銀行	5,721,235	91.57 523,939,756	77.28 442,142,762	- -	0.98%
9	PING AN INSURANCE GROUP CO-H 中国	株式 保険	428,500	1,136.39 486,943,153	979.83 419,860,583	- -	0.93%
10	RELIANCE INDUSTRIES LTD インド	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	233,815	1,532.23 358,259,877	1,781.11 416,452,105	- -	0.92%
11	BAIDU INC -SPON ADR ケイマン諸島	株式 インタラク ティブ・メ ディアおよび サービス	22,900	26,040.22 596,321,238	17,935.38 410,720,202	- -	0.91%
12	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP インド	株式 貯蓄・抵当・ 不動産金融	131,396	3,002.88 394,567,172	3,098.67 407,153,040	- -	0.90%
13	ITAU UNIBANCO HOLDING SA ブラジル	株式 銀行	399,247	950.44 379,461,772	980.63 391,516,380	- -	0.86%
14	VALE SA ブラジル	株式 金属・鉱業	257,821	1,353.25 348,896,898	1,415.20 364,869,568	- -	0.80%

15	INFOSYS LTD インド	株式 情報技術サー ビス	301,453	921.61 277,824,011	1,044.31 314,810,985	- -	0.69%
16	LUKOIL SPON ADR ロシア	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	40,288	7,344.99 295,914,994	7,758.89 312,590,563	- -	0.69%
17	BANK OF CHINA LTD 中国	株式 銀行	6,554,200	57.39 376,154,879	47.21 309,485,391	- -	0.68%
18	BANCO BRADESCO SA PREF ブラジル	株式 銀行	273,125	954.74 260,764,944	1,072.12 292,824,140	- -	0.65%
19	SK HYNIX INC 韓国	株式 半導体・半導 体製造装置	47,543	8,230.77 391,315,950	6,123.03 291,107,690	- -	0.64%
20	HON HAI PRECISION INDUSTRY 台湾	株式 電子装置・機 器・部品	1,071,225	372.35 398,877,692	254.88 273,033,828	- -	0.60%
21	SBERBANK ADR ロシア	株式 銀行	224,930	1,558.62 350,582,384	1,187.14 267,024,524	- -	0.59%
22	CNOOC LTD 香港	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	1,463,000	178.89 261,729,810	166.75 243,965,198	- -	0.54%
23	SAMSUNG ELECTRONICS-PFD 韓国	株式 コンピュー タ・周辺機器	70,564	3,995.46 281,936,290	3,121.15 220,241,534	- -	0.49%
24	TATA CONSULTANCY SERVICES LTD インド	株式 情報技術サー ビス	72,050	2,602.25 187,492,449	3,035.23 218,688,357	- -	0.48%
25	QATAR NATIONAL BANK カタール	株式 銀行	36,289	4,859.19 176,335,197	5,955.29 216,111,881	- -	0.48%
26	GAZPROM PAO ADR ロシア	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	448,380	504.63 226,267,097	477.96 214,310,395	- -	0.47%
27	AMERICA MOVIL SAB DE CV メキシコ	株式 無線通信サー ビス	2,717,078	98.16 266,712,242	78.00 211,935,344	- -	0.47%
28	PETROLEO BRASILEIRO SA ブラジル	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	326,012	598.36 195,074,201	619.54 201,979,202	- -	0.45%
29	NETEASE INC-ADR ケイマン諸島	株式 娯楽	6,400	30,031.78 192,203,409	27,349.29 175,035,456	- -	0.39%
30	PETROLEO BRASILEIRO SA ブラジル	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	241,810	673.60 162,885,311	698.73 168,962,222	- -	0.37%

(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12月28日現在

種類	投資比率
株式	95.42%
新株予約権証券	0.00%
投資信託受益証券	0.47%
投資証券	0.15%
合計	96.03%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

平成30年12月28日現在

業種	国内/外国	投資比率
銀行	外国	16.57%
石油・ガス・消耗燃料		7.51%
インタラクティブ・メディアおよびサービス		6.32%
半導体・半導体製造装置		5.10%
コンピュータ・周辺機器		4.60%
インターネット販売・通信販売		4.31%
保険		3.54%
金属・鉱業		3.35%
無線通信サービス		2.98%
不動産管理・開発		2.50%
化学		2.35%
電子装置・機器・部品		2.10%
メディア		2.07%
自動車		1.94%
情報技術サービス		1.78%
食品・生活必需品小売り		1.73%
食品		1.72%
コングロマリット		1.51%
各種電気通信サービス		1.50%
医薬品		1.25%
資本市場		1.19%
各種金融サービス		1.15%
電力		1.03%
貯蓄・抵当・不動産金融		1.02%
建設資材		0.96%
運送インフラ		0.93%
飲料		0.81%
建設・土木		0.79%
パーソナル用品		0.74%
機械		0.71%
娯楽		0.71%
繊維・アパレル・贅沢品		0.69%
ホテル・レストラン・レジャー		0.68%
ガス		0.66%
タバコ		0.65%
複合小売り		0.62%
自動車部品		0.58%

バイオテクノロジー	0.58%
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.57%
家庭用品	0.51%
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	0.48%
紙製品・林産品	0.47%
専門小売り	0.44%
各種消費者サービス	0.42%
家庭用耐久財	0.33%
旅客航空輸送業	0.28%
陸運・鉄道	0.27%
消費者金融	0.27%
水道	0.26%
ライフサイエンス・ツール/サービス	0.24%
エクイティ不動産投資信託(REITs)	0.21%
電気設備	0.18%
航空宇宙・防衛	0.18%
商業サービス・用品	0.15%
ヘルスケア機器・用品	0.12%
海運業	0.10%
エネルギー設備・サービス	0.09%
レジャー用品	0.09%
ソフトウェア	0.08%
総合公益事業	0.08%
航空貨物・物流サービス	0.07%
容器・包装	0.06%
ヘルスケア・テクノロジー	0.06%
通信機器	0.05%
商社・流通業	0.04%
建設関連製品	0.04%
専門サービス	0.03%
合計	95.42%

(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12月28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	2,086,800,000	93.39 1,948,960,200	93.72 1,955,748,960	5.250000 2047/6/23	2.30%
2	PERU 5.625 11/18/50 ペルー	国債証券	1,265,400,000	117.24 1,483,637,100	117.07 1,481,416,434	5.625000 2050/11/18	1.75%
3	COLOMBIA 5.0 06/15/45 コロンビア	国債証券	1,443,000,000	97.42 1,405,826,100	95.25 1,374,457,500	5.000000 2045/6/15	1.62%
4	RUSSIA FOREIGN BOND 5.0 04/29/20 ロシア	国債証券	1,309,800,000	101.98 1,335,863,688	101.65 1,331,424,798	5.000000 2020/4/29	1.57%
5	RUSSIAN FEDERATION 03/31/30 ロシア	国債証券	1,183,870,500	109.36 1,294,701,737	109.49 1,296,326,358	7.500000 2030/3/31	1.53%
6	PERU 7.35 07/21/25 ペルー	国債証券	1,043,400,000	123.07 1,284,136,800	121.22 1,264,809,480	7.350000 2025/7/21	1.49%
7	ROMANIA 6.75 02/07/22 ルーマニア	国債証券	1,121,100,000	109.29 1,225,360,635	107.73 1,207,783,452	6.750000 2022/2/7	1.42%
8	UNITED MEXICAN STATES 4.75 03/08/44 メキシコ	国債証券	1,309,800,000	93.51 1,224,807,300	90.87 1,190,280,750	4.750000 2044/3/8	1.40%
9	HUNGARY 6.375 03/29/21 ハンガリー	国債証券	1,110,000,000	106.98 1,187,538,828	105.71 1,173,458,700	6.375000 2021/3/29	1.38%
10	BRAZIL 4.25 01/07/25 ブラジル	国債証券	1,165,500,000	98.28 1,145,533,875	98.17 1,144,241,280	4.250000 2025/1/7	1.35%
11	BRAZIL 4.875 01/22/21 ブラジル	国債証券	1,087,800,000	102.85 1,118,813,400	102.57 1,115,810,850	4.875000 2021/1/22	1.31%
12	UNITED MEXICAN STATES 6.05 01/11/40 メキシコ	国債証券	1,032,300,000	109.56 1,131,020,625	105.90 1,093,205,700	6.050000 2040/1/11	1.29%
13	PANAMA 6.7 01/26/36 パナマ	国債証券	865,800,000	123.64 1,070,528,400	122.37 1,059,479,460	6.700000 2036/1/26	1.25%
14	UNITED MEXICAN STATES 4.0 10/02/23 メキシコ	国債証券	1,054,500,000	100.43 1,059,117,600	99.48 1,049,079,870	4.000000 2023/10/2	1.24%
15	CROATIA 6.625 07/14/20 クロアチア	国債証券	999,000,000	104.56 1,044,598,800	104.05 1,039,459,500	6.625000 2020/7/14	1.22%
16	RUSSIAN FEDERATION 5.625 04/04/42 ロシア	国債証券	999,000,000	102.95 1,028,483,154	102.69 1,025,893,080	5.625000 2042/4/4	1.21%
17	UNITED MEXICAN STATES 4.15 03/28/27 メキシコ	国債証券	1,043,400,000	98.16 1,024,274,700	96.38 1,005,681,090	4.150000 2027/3/28	1.19%
18	BRAZIL 5.0 01/27/45 ブラジル	国債証券	1,154,400,000	85.07 982,106,688	87.06 1,005,043,728	5.000000 2045/1/27	1.18%
19	INDONESIA 4.875 05/05/21 インドネシア	国債証券	965,700,000	102.81 992,838,390	102.24 987,379,965	4.875000 2021/5/5	1.16%

20	INDONESIA 4.125 01/15/25 インドネシア	国債証券	976,800,000	99.67 973,585,440	98.54 962,568,024	4.125000 2025/1/15	1.13%
21	HUNGARY 5.75 11/22/23 ハンガリー	国債証券	888,000,000	107.95 958,662,600	108.34 962,085,840	5.750000 2023/11/22	1.13%
22	RUSSIAN FEDERATION 4.875 09/16/23 ロシア	国債証券	932,400,000	102.41 954,919,458	102.05 951,588,792	4.875000 2023/9/16	1.12%
23	UNITED MEXICAN STATES 5.55 01/21/45 メキシコ	国債証券	932,400,000	104.85 977,653,590	101.37 945,220,500	5.550000 2045/1/21	1.11%
24	COLOMBIA 5.625 02/26/44 コロンビア	国債証券	888,000,000	106.32 944,166,000	103.15 915,972,000	5.625000 2044/2/26	1.08%
25	BRAZIL 4.625 01/13/28 ブラジル	国債証券	932,400,000	94.45 880,718,400	96.27 897,668,100	4.625000 2028/1/13	1.06%
26	RUSSIAN FEDERATION 4.75 05/27/26 ロシア	国債証券	888,000,000	99.53 883,843,938	99.22 881,082,480	4.750000 2026/5/27	1.04%
27	COLOMBIA 4.0 02/26/24 コロンビア	国債証券	876,900,000	100.35 880,049,625	99.12 869,227,125	4.000000 2024/2/26	1.02%
28	HUNGARY 5.375 03/25/24 ハンガリー	国債証券	799,200,000	107.46 858,841,410	107.25 857,181,960	5.375000 2024/3/25	1.01%
29	COLOMBIA 3.875 04/25/27 コロンビア	国債証券	888,000,000	97.15 862,754,160	95.70 849,824,880	3.875000 2027/4/25	1.00%
30	CROATIA 5.5 04/04/23 クロアチア	国債証券	799,200,000	106.29 849,528,954	105.04 839,535,624	5.500000 2023/4/4	0.99%

(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12月28日現在

種類	投資比率
国債証券	91.55%
合計	91.55%

(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12月28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2019年01月	売建	52,910,000	5,967,260,156	5,866,131,700	42.52%
		香港・ドル売/円買2019年01月	売建	36,170,000	522,294,800	512,167,200	3.71%
		ユーロ売/円買2019年01月	売建	2,680,000	344,219,200	340,333,200	2.47%
		イギリス・ポンド売/円買2019年01月	売建	1,420,000	201,469,600	199,353,800	1.44%
		オーストラリア・ドル売/円買2019年01月	売建	1,830,000	148,339,800	142,923,000	1.04%
		南アフリカ・ランド売/円買2019年01月	売建	15,680,000	122,617,600	119,638,400	0.87%
		カナダ・ドル売/円買2019年01月	売建	1,210,000	101,821,500	98,566,600	0.71%
		スイス・フラン売/円買2019年01月	売建	580,000	66,299,800	65,284,800	0.47%
		シンガポール・ドル売/円買2019年01月	売建	730,000	59,933,000	59,071,600	0.43%
		メキシコ・ペソ売/円買2019年01月	売建	9,580,000	52,785,800	53,743,800	0.39%
		スウェーデン・クローナ売/円買2019年01月	売建	1,630,000	20,277,200	20,081,600	0.15%
		デンマーク・クローネ売/円買2019年01月	売建	760,000	13,079,600	12,927,600	0.09%
		ニュージーランド・ドル売/円買2019年01月	売建	110,000	8,526,100	8,186,200	0.06%
		ノルウェー・クローネ売/円買2019年01月	売建	430,000	5,671,700	5,439,500	0.04%
イスラエル・シケル売/円買2019年01月	売建	100,000	3,016,000	2,943,000	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12月28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2019年01月	売建	104,610,000	11,798,701,392	11,598,110,700	22.02%
		香港・ドル売/円買2019年01月	売建	72,200,000	1,042,568,000	1,022,352,000	1.94%
		ユーロ売/円買2019年01月	売建	5,380,000	691,007,200	683,206,200	1.30%
		イギリス・ポンド売/円買2019年01月	売建	2,850,000	404,358,000	400,111,500	0.76%
		オーストラリア・ドル売/円買2019年01月	売建	3,610,000	292,626,600	281,941,000	0.54%
		南アフリカ・ランド売/円買2019年01月	売建	31,470,000	246,095,400	240,116,100	0.46%
		カナダ・ドル売/円買2019年01月	売建	2,400,000	201,960,000	195,504,000	0.37%
		スイス・フラン売/円買2019年01月	売建	1,190,000	136,028,900	133,946,400	0.25%
		シンガポール・ドル売/円買2019年01月	売建	1,350,000	110,835,000	109,242,000	0.21%
		メキシコ・ペソ売/円買2019年01月	売建	19,220,000	105,902,200	107,824,200	0.20%
		スウェーデン・クローナ売/円買2019年01月	売建	3,960,000	49,262,400	48,787,200	0.09%
		デンマーク・クローネ売/円買2019年01月	売建	1,860,000	32,010,600	31,638,600	0.06%
		ニュージーランド・ドル売/円買2019年01月	売建	260,000	20,152,600	19,349,200	0.04%
		ノルウェー・クローネ売/円買2019年01月	売建	1,060,000	13,981,400	13,409,000	0.03%
		イスラエル・シェケル売/円買2019年01月	売建	250,000	7,540,000	7,357,500	0.01%

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

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

為替予約取引の数量は、現地通貨建契約金額です。

(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12月28日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
為替予約取引	-	ユーロ買/円売2019年01月	買建	2,810,000	356,807,477	356,841,900	0.11%
		スイス・フラン買/円売2019年01月	買建	2,200,000	247,644,540	247,610,000	0.08%
		スウェーデン・クローナ買/円売2019年01月	買建	5,300,000	65,324,090	65,296,000	0.02%
		デンマーク・クローネ買/円売2019年01月	買建	3,600,000	61,228,800	61,236,000	0.02%
		カナダ・ドル買/円売2019年01月	買建	95,000	7,740,372	7,740,600	0.00%
		オーストラリア・ドル買/円売2019年01月	買建	82,000	6,405,577	6,406,660	0.00%
		アメリカ・ドル売/円買2019年01月	売建	7,700,000	854,073,990	854,161,000	0.27%
		イギリス・ポンド売/円買2019年01月	売建	258,000	36,221,626	36,228,360	0.01%
株価指数先物取引	シカゴ商品取引所	S&P500 EMINI FUT Mar 19	買建	495	6,916,934,475	6,854,388,750	2.19%
	EUREX取引所	DJ EURO STOXX 50 Mar 19	買建	445	1,713,025,530	1,651,933,450	0.53%
	ICE-EU	FTSE 100 INDEX FUTURE Mar 19	買建	69	649,178,730	632,822,163	0.20%
	モントルオール取引所	S&P/TSE 60 IX FUT Mar 19	買建	26	363,711,262	359,936,886	0.12%
	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTURES Mar 19	買建	22	237,977,965	238,773,447	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12月28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2019年01月	売建	11,800,000	1,308,840,660	1,308,974,000	3.41%
		ユーロ売/円買2019年01月	売建	1,030,000	130,787,082	130,799,700	0.34%
		オーストラリア・ドル売/円買2019年01月	売建	1,650,000	128,892,720	128,914,500	0.34%
		イギリス・ポンド売/円買2019年01月	売建	660,000	92,659,974	92,677,200	0.24%
		シンガポール・ドル売/円買2019年01月	売建	840,000	67,964,988	67,998,000	0.18%
		香港・ドル売/円買2019年01月	売建	3,100,000	43,909,795	43,927,000	0.11%
		カナダ・ドル売/円買2019年01月	売建	420,000	34,220,592	34,221,600	0.09%
		ニュージーランド・ドル売/円買2019年01月	売建	110,000	8,187,168	8,189,500	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。

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12月28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2019年01月	売建	1,270,773,300	143,731,327,586	140,903,343,504	44.35%
		ユーロ売/円買2019年01月	売建	953,486,000	122,547,133,034	121,083,187,140	38.11%
		イギリス・ポンド売/円買2019年01月	売建	142,016,800	20,543,383,397	19,937,738,552	6.28%
		オーストラリア・ドル売/円買2019年01月	売建	80,849,500	6,682,769,037	6,315,154,445	1.99%
		カナダ・ドル売/円買2019年01月	売建	73,863,400	6,293,560,542	6,016,912,564	1.89%
		メキシコ・ペソ売/円買2019年01月	売建	401,442,800	2,219,215,942	2,256,108,536	0.71%
		南アフリカ・ランド売/円買2019年01月	売建	214,538,900	1,741,199,777	1,639,077,196	0.52%
		ポーランド・ズロチ売/円買2019年01月	売建	54,513,400	1,628,386,125	1,610,870,970	0.51%
		デンマーク・クローネ売/円買2019年01月	売建	87,046,100	1,499,577,983	1,480,654,161	0.47%
		マレーシア・リンギット売/円買2019年01月	売建	41,940,000	1,136,718,882	1,116,442,800	0.35%
		シンガポール・ドル売/円買2019年01月	売建	11,980,500	988,372,081	969,462,060	0.31%
		スウェーデン・クローナ売/円買2019年01月	売建	71,710,400	894,709,147	883,472,128	0.28%
		ノルウェー・クローネ売/円買2019年01月	売建	43,313,800	570,451,408	547,919,570	0.17%

(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12月28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2019年01月	売建	5,100,000	565,685,370	565,743,000	1.25%
株価指数先物 取引	ICE-US	MINI MSCI EMG MKT Ma r 19	買建	227	1,227,473,520	1,211,723,730	2.67%

(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) 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12月28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2019年01月	売建	37,700,000	4,180,707,000	4,182,061,000	4.93%

(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12月末)、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。
ワールドアセットバランス(基本コース)

	純資産総額 (分配落) (百万円)	純資産総額 (分配付) (百万円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (平成29年6月12日)	6,004	6,004	1.0341	1.0341
第2計算期間末 (平成29年12月11日)	13,684	13,684	1.0542	1.0542
第3計算期間末 (平成30年6月11日)	16,409	16,409	1.0376	1.0376
第4計算期間末 (平成30年12月11日)	14,083	14,083	1.0007	1.0007
平成29年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	-
7月末日	16,161	-	1.0365	-
8月末日	16,011	-	1.0377	-
9月末日	15,540	-	1.0281	-
10月末日	14,569	-	0.9940	-
11月末日	14,296	-	1.0065	-
12月末日	13,796	-	0.9881	-

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
第4計算期間末 (平成30年12月11日)	53,883	53,883	0.9975	0.9975
平成29年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	-
7月末日	62,931	-	1.0345	-
8月末日	61,948	-	1.0356	-
9月末日	59,701	-	1.0259	-
10月末日	55,927	-	0.9934	-
11月末日	54,894	-	1.0010	-
12月末日	52,678	-	0.9897	-

【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
第4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
第4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
第4計算期間	3.6

(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
第4計算期間	3.7

(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
第4計算期間	527,482,147	2,267,181,143

(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)

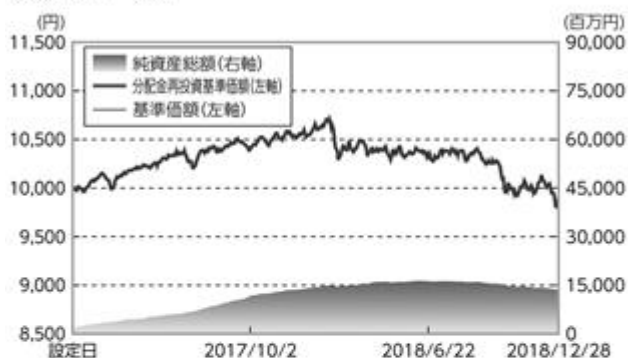
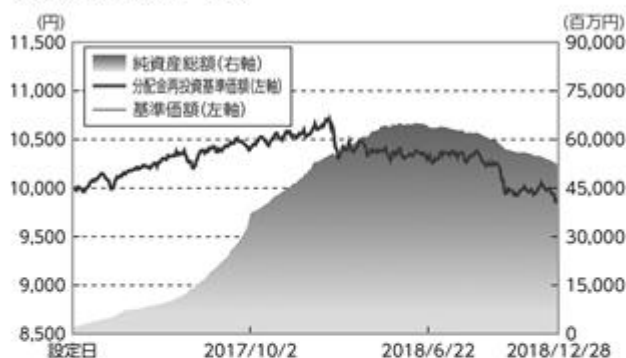
	設定口数	解約口数
第1計算期間	10,404,764,520	356,726,722
第2計算期間	37,154,151,069	2,394,963,569
第3計算期間	23,144,363,900	5,324,740,324
第4計算期間	2,278,919,156	10,886,978,597

(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12月28日

基準価額・純資産の推移 (2017年1月18日～2018年12月28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
第4期	(2018.12.11)	0円
設定来累計		0円

※分配金は1万口当たりです。

(リスク抑制コース)

第1期	(2017.06.12)	0円
第2期	(2017.12.11)	0円
第3期	(2018.06.11)	0円
第4期	(2018.12.11)	0円
設定来累計		0円

※分配金は1万口当たりです。

主要な資産の状況**■ワールドアセットバランス**

※比率(%)は、各ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

(基本コース)**組入銘柄**

順位	銘柄名	種類	国/地域	比率
1	為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	45.85%
2	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	14.77%
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	14.33%
4	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	13.85%
5	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	9.13%
6	XTRACKERS MSCI EMERGING MARKETS HEDGED EQUITY ETF	投資信託受益証券	アメリカ	0.22%

(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	28.04%
2	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	9.11%
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	8.65%
4	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	8.37%
5	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	5.58%
6	XTRACKERS MSCI EMERGING MARKETS HEDGED EQUITY ETF	投資信託受益証券	アメリカ	0.09%

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

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

データの基準日:2018年12月28日

■為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還期限	比率
1	US T N/B 1.375 09/30/20	国債証券	アメリカ	1.375000	2020/9/30	0.74%
2	US T N/B 3.625 02/15/20	国債証券	アメリカ	3.625000	2020/2/15	0.69%
3	US T N/B 1.625 07/31/20	国債証券	アメリカ	1.625000	2020/7/31	0.66%
4	US T N/B 2.75 09/30/20	国債証券	アメリカ	2.750000	2020/9/30	0.66%
5	US T N/B 2.875 10/31/20	国債証券	アメリカ	2.875000	2020/10/31	0.59%

■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	2.30%
2	PERU 5.625 11/18/50	国債証券	ペルー	5.625000	2050/11/18	1.75%
3	COLOMBIA 5.0 06/15/45	国債証券	コロンビア	5.000000	2045/6/15	1.62%
4	RUSSIA FOREIGN BOND 5.0 04/29/20	国債証券	ロシア	5.000000	2020/4/29	1.57%
5	RUSSIAN FEDERATION 03/31/30	国債証券	ロシア	7.500000	2030/3/31	1.53%

■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	2.26%
2	MICROSOFT CORP	株式	アメリカ	ソフトウェア	2.20%
3	AMAZON.COM INC	株式	アメリカ	インターネット販売・通信販売	1.81%
4	JOHNSON & JOHNSON	株式	アメリカ	医薬品	1.01%
5	JPMORGAN CHASE & CO	株式	アメリカ	銀行	0.98%

○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	インタラクティブ・メディアおよびサービス	4.56%
2	ALIBABA GROUP HOLDING LTD-ADR	株式	ケイマン諸島	インターネット販売・通信販売	3.61%
3	TAIWAN SEMICONDUCTOR	株式	台湾	半導体・半導体製造装置	3.59%
4	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	株式	韓国	コンピュータ・周辺機器	3.33%
5	NASPERS LTD	株式	南アフリカ	メディア	1.75%

■外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

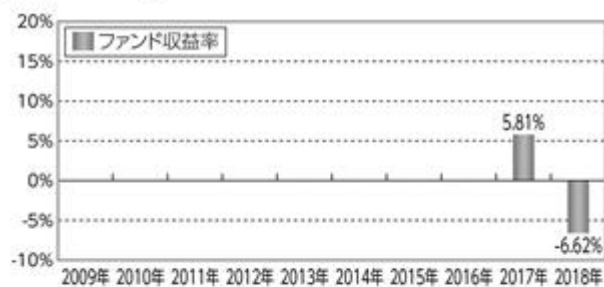
※比率(%)は、当該マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

組入上位5銘柄

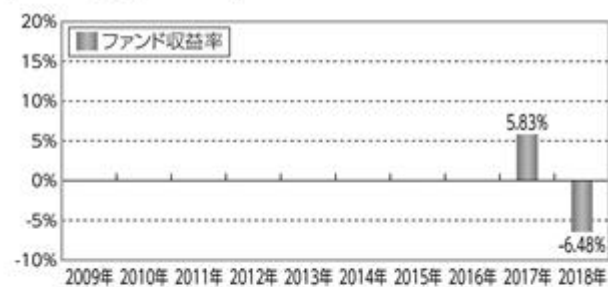
順位	銘柄名	種類	国/地域	比率
1	SIMON PROPERTY GROUP INC	投資証券	アメリカ	4.67%
2	PROLOGIS INC	投資証券	アメリカ	3.30%
3	PUBLIC STORAGE	投資証券	アメリカ	2.73%
4	WELLTOWER INC	投資証券	アメリカ	2.35%
5	EQUITY RESIDENTIAL	投資証券	アメリカ	2.20%

年間収益率の推移(暦年ベース)

(基本コース)



(リスク抑制コース)



※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。

※2017年は設定日から年末までの収益率を表示しています。

※各ファンドにはベンチマークはありません。

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

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

第2【管理及び運営】

1【申込(販売)手続等】

お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

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

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

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

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

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

受益権の取得申込者は委託会社または販売会社に、取得申込みと同時にまたはあらかじめ、自己のために開設されたファンドの受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録が行われます。

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

・お申込価額

お申込日の翌営業日の基準価額とします。

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

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

< 基準価額の照会方法等 >

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

各ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・ 販売会社へのお問い合わせ
- ・ 委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

・ お申込手数料

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

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

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

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

・ お申込単位

各販売会社が定める単位とします。

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

取扱コースおよびお申込単位は、販売会社にお問い合わせください。

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

当初元本は1口当たり1円です。

・ 払込期日

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

2【換金（解約）手続等】

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

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

海外休業日には、解約の受付を行いません。

解約の請求を行う受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求にかかるこの信託契約の一部解約を委託会社が行うのと引き換えに、当該一部解約にかかる受益権

の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。

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

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

・解約価額

解約価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

各ファンドの解約価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

・解約単位

各販売会社が定める単位とします。

解約単位は販売会社にお問い合わせください。

・解約代金の受渡日

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

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

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

< 主な投資対象の時価評価方法の原則 >

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

公社債等	計算日における以下のいずれかの価額 ・日本証券業協会が発表する売買参考統計値(平均値) ・金融商品取引業者、銀行などの提示する価額(売り気配相場を除きます。) ・価格情報会社の提供する価額
不動産投資信託証券	計算日における金融商品取引所等の最終相場
上場先物取引等	計算日における主たる金融商品取引所等が発表する清算値段または最終相場
上場投資信託証券	計算日における金融商品取引所等の最終相場
外貨建資産の円換算	計算日の国内における対顧客電信売買相場の仲値
外国為替予約の円換算	計算日の国内における対顧客先物売買相場の仲値

外国で取引されているものについては、計算時に知りうる直近の日

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

各ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

(2)【保管】

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

信託期間は、2017年1月18日(設定日)から原則として2027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て)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4期計算期間(平成30年6月12日から平成30年12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3期 平成30年6月11日現在	第4期 平成30年12月11日現在
資産の部		
流動資産		
預金	1,082,483	1,125,264
コール・ローン	415,732,600	273,368,522
投資信託受益証券	35,258,357	32,313,717
親投資信託受益証券	16,098,227,476	13,916,113,877
派生商品評価勘定	3,981,690	40,353,187
未収入金	-	194,060
流動資産合計	16,554,282,606	14,263,468,627
資産合計	16,554,282,606	14,263,468,627
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	44,815,362	265,060
未払解約金	6,951,101	84,241,806
未払受託者報酬	2,466,352	2,518,757
未払委託者報酬	90,434,855	92,356,100
その他未払費用	329,045	329,323
流動負債合計	144,996,715	179,711,046
負債合計	144,996,715	179,711,046
純資産の部		
元本等		
元本	1 15,814,199,201	1 14,074,500,205
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	595,086,690	9,257,376
(分配準備積立金)	405,405,842	458,921,709
元本等合計	16,409,285,891	14,083,757,581
純資産合計	16,409,285,891	14,083,757,581
負債純資産合計	16,554,282,606	14,263,468,627

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第3期 自 平成29年12月12日 至 平成30年6月11日	第4期 自 平成30年6月12日 至 平成30年12月11日
営業収益		
受取配当金	434,118	-
受取利息	3,493	6,175
有価証券売買等損益	319,685,187	171,150,597
為替差損益	165,147,191	292,974,258
営業収益合計	154,100,385	464,118,680
営業費用		
支払利息	211,898	105,220
受託者報酬	2,466,352	2,518,757
委託者報酬	90,434,855	92,356,100
その他費用	666,670	664,418
営業費用合計	93,779,775	95,644,495
営業利益又は営業損失()	247,880,160	559,763,175
経常利益又は経常損失()	247,880,160	559,763,175
当期純利益又は当期純損失()	247,880,160	559,763,175
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()	16,889,839	43,038,956
期首剰余金又は期首欠損金()	704,053,416	595,086,690
剰余金増加額又は欠損金減少額	207,192,123	15,923,980
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	207,192,123	15,923,980
剰余金減少額又は欠損金増加額	85,168,528	85,029,075
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	85,168,528	85,029,075
分配金	1 -	1 -
期末剰余金又は期末欠損金()	595,086,690	9,257,376

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

<p>1 . 有価証券の評価基準及び評価方法</p>	<p>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>
<p>2 . デリバティブ等の評価基準及び評価方法</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>
<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>	<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3期 平成30年6月11日現在	第4期 平成30年12月11日現在
<p>1 . 1 期首元本額</p> <p>期中追加設定元本額</p> <p>期中一部解約元本額</p>	<p>12,980,928,058円</p> <p>4,414,882,467円</p> <p>1,581,611,324円</p>	<p>15,814,199,201円</p> <p>527,482,147円</p> <p>2,267,181,143円</p>
<p>2 . 受益権の総数</p>	<p>15,814,199,201口</p>	<p>14,074,500,205口</p>

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第3期	第4期
	自 平成29年12月12日 至 平成30年6月11日	自 平成30年6月12日 至 平成30年12月11日
1 . 1 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益（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。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（110,195,644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（341,923,949円）及び分配準備積立金（348,726,065円）より分配対象収益は800,845,658円（1万口当たり569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。

(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3期 自 平成29年12月12日 至 平成30年6月11日	第4期 自 平成30年6月12日 至 平成30年12月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、主要投資対象である投資信託受益証券及び親投資信託受益証券が保有する金融商品に係る、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第3期 平成30年6月11日現在	第4期 平成30年12月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第3期 平成30年6月11日現在	第4期 平成30年12月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
投資信託受益証券	814,886	4,136,998
親投資信託受益証券	319,260,086	186,534,189
合計	318,445,200	190,671,187

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	第3期 平成30年6月11日 現在				第4期 平成30年12月11日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	7,993,690,528	-	8,034,524,200	40,833,672	7,031,112,327	-	6,991,024,200	40,088,127
アメリカ・ドル	6,011,679,720	-	6,040,944,000	29,264,280	5,341,615,422	-	5,320,672,500	20,942,922
イギリス・ポンド	269,136,420	-	272,750,400	3,613,980	205,669,676	-	201,469,600	4,200,076
イスラエル・シケル	3,975,270	-	3,985,800	10,530	3,056,100	-	3,016,000	40,100
オーストラリア・ドル	178,441,270	-	180,283,600	1,842,330	152,366,349	-	148,339,800	4,026,549
カナダ・ドル	121,875,400	-	122,264,000	388,600	103,434,672	-	101,821,500	1,613,172
シンガポール・ドル	67,449,950	-	67,977,000	527,050	60,355,013	-	59,933,000	422,013
スイス・フラン	71,881,550	-	72,228,000	346,450	66,034,740	-	66,299,800	265,060
スウェーデン・クローナ	24,931,446	-	25,391,400	459,954	20,406,622	-	20,277,200	129,422
デンマーク・クローネ	15,916,392	-	16,107,600	191,208	13,121,704	-	13,079,600	42,104
ニュージーランド・ドル	9,151,080	-	9,225,600	74,520	8,581,210	-	8,526,100	55,110
ノルウェー・クローネ	6,518,960	-	6,644,400	125,440	5,700,983	-	5,671,700	29,283
メキシコ・ペソ	59,360,830	-	58,475,500	885,330	53,393,172	-	52,785,800	607,372
ユーロ	436,865,380	-	442,675,800	5,810,420	345,246,444	-	344,219,200	1,027,244
香港・ドル	576,215,400	-	578,376,000	2,160,600	523,900,748	-	522,294,800	1,605,948
南アフリカ・ランド	140,291,460	-	137,195,100	3,096,360	128,229,472	-	122,617,600	5,611,872
合計	7,993,690,528	-	8,034,524,200	40,833,672	7,031,112,327	-	6,991,024,200	40,088,127

(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3期 平成30年6月11日現在	第4期 平成30年12月11日現在
1口当たり純資産額	1.0376円	1.0007円
(1万口当たり純資産額)	(10,376円)	(10,007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12月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	アメリカ・ドル	XTRACKERS MSCI EMERGING MARKETS HEDGED EQUITY ETF	13,300.000	285,684.000	
	アメリカ・ドル	小計	13,300.000	285,684.000 (32,313,717)	
投資信託受益証券 合計			13,300	32,313,717 (32,313,717)	
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	595,681,660	1,990,887,244	
		外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	1,126,268,050	1,398,824,918	
		為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	5,321,193,820	7,063,352,676	
		エマージング株式パッシブ・マザーファンド	1,853,672,739	2,000,668,987	
		エマージング債券パッシブ・マザーファンド	802,579,470	1,462,380,052	
親投資信託受益証券 合計			9,699,395,739	13,916,113,877	
合計				13,948,427,594 (32,313,717)	

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	0.23%	0.23%

(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4期計算期間(平成30年6月12日から平成30年12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3期 平成30年6月11日現在	第4期 平成30年12月11日現在
資産の部		
流動資産		
預金	1,348,440	1,402,227
コール・ローン	1,239,666,781	18,791,922,894
投資信託受益証券	54,345,588	49,806,857
親投資信託受益証券	64,209,961,157	32,663,660,123
派生商品評価勘定	15,630,980	95,042,782
未収入金	-	2,927,566,404
流動資産合計	65,520,952,946	54,529,401,287
資産合計	65,520,952,946	54,529,401,287
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	178,502,707	648,940
未払解約金	130,126,163	277,105,435
未払受託者報酬	9,501,332	9,757,290
未払委託者報酬	348,383,792	357,768,864
その他未払費用	849,707	850,300
流動負債合計	667,363,701	646,130,829
負債合計	667,363,701	646,130,829
純資産の部		
元本等		
元本	1 62,626,848,874	1 54,018,789,433
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2 2,226,740,371	2 135,518,975
（分配準備積立金）	1,108,577,842	1,267,538,784
元本等合計	64,853,589,245	53,883,270,458
純資産合計	64,853,589,245	53,883,270,458
負債純資産合計	65,520,952,946	54,529,401,287

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第3期		第4期	
	自	平成29年12月12日 平成30年6月11日	自	平成30年6月12日 平成30年12月11日
営業収益				
受取配当金		669,131		-
受取利息		4,553		8,186
有価証券売買等損益		1,331,204,074		792,277,610
為替差損益		614,155,766		1,046,937,597
営業収益合計		716,374,624		1,839,207,021
営業費用				
支払利息		1,270,549		2,957,221
受託者報酬		9,501,332		9,757,290
委託者報酬		348,383,792		357,768,864
その他費用		1,187,332		1,185,395
営業費用合計		360,343,005		371,668,770
営業利益又は営業損失()		1,076,717,629		2,210,875,791
経常利益又は経常損失()		1,076,717,629		2,210,875,791
当期純利益又は当期純損失()		1,076,717,629		2,210,875,791
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()		35,997,310		170,045,344
期首剰余金又は期首欠損金()		2,436,207,949		2,226,740,371
剰余金増加額又は欠損金減少額		1,117,789,481		64,453,178
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		1,117,789,481		64,453,178
剰余金減少額又は欠損金増加額		286,536,740		385,882,077
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		286,536,740		385,882,077
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金()		2,226,740,371		135,518,975

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

<p>1. 有価証券の評価基準及び評価方法</p>	<p>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>
<p>2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法</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>
<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>	<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3期 平成30年6月11日現在	第4期 平成30年12月11日現在
<p>1. 1 期首元本額</p> <p>期中追加設定元本額</p> <p>期中一部解約元本額</p>	<p>44,807,225,298円</p> <p>23,144,363,900円</p> <p>5,324,740,324円</p>	<p>62,626,848,874円</p> <p>2,278,919,156円</p> <p>10,886,978,597円</p>
<p>2. 受益権の総数</p>	<p>62,626,848,874口</p>	<p>54,018,789,433口</p>
<p>3. 2 元本の欠損</p>		<p>貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は135,518,975円であります。</p>

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第3期 自 平成29年12月12日 至 平成30年6月11日	第4期 自 平成30年6月12日 至 平成30年12月11日
1. 1 分配金の計算過程	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(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>	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(346,791,509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(1,469,567,335円)及び分配準備積立金(920,747,275円)より分配対象収益は2,737,106,119円(1万口当たり506.70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3期 自 平成29年12月12日 至 平成30年6月11日	第4期 自 平成30年6月12日 至 平成30年12月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、主要投資対象である投資信託受益証券及び親投資信託受益証券が保有する金融商品に係る、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第3期 平成30年6月11日現在	第4期 平成30年12月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第3期 平成30年6月11日現在	第4期 平成30年12月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
投資信託受益証券	1,256,027	6,376,576
親投資信託受益証券	838,196,168	440,733,988
合計	836,940,141	447,110,564

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	第3期 平成30年6月11日 現在				第4期 平成30年12月11日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	31,763,446,773	-	31,926,318,500	162,871,727	16,388,671,642	-	16,294,277,800	94,393,842
アメリカ・ドル	23,856,544,630	-	23,972,676,000	116,131,370	12,382,269,782	-	12,333,722,500	48,547,282
イギリス・ポンド	1,083,780,530	-	1,098,333,600	14,553,070	485,206,630	-	475,298,000	9,908,630
イスラエル・シケル	15,595,290	-	15,636,600	41,310	7,640,250	-	7,540,000	100,250
オーストラリア・ドル	719,521,250	-	726,950,000	7,428,750	356,354,084	-	346,936,800	9,417,284
カナダ・ドル	490,863,680	-	492,428,800	1,565,120	252,175,440	-	248,242,500	3,932,940
シンガポール・ドル	274,675,700	-	276,822,000	2,146,300	146,340,237	-	145,317,000	1,023,237
スイス・フラン	289,737,940	-	291,134,400	1,396,460	161,671,260	-	162,320,200	648,940
スウェーデン・クローナ	99,849,207	-	101,691,300	1,842,093	49,576,824	-	49,262,400	314,424
デンマーク・クローネ	64,007,856	-	64,776,800	768,944	32,113,644	-	32,010,600	103,044
ニュージーランド・ドル	35,841,730	-	36,133,600	291,870	20,282,860	-	20,152,600	130,260
ノルウェー・クローネ	26,075,840	-	26,577,600	501,760	14,053,586	-	13,981,400	72,186
メキシコ・ペソ	232,989,900	-	229,515,000	3,474,900	131,643,708	-	130,146,200	1,497,508
ユーロ	1,753,829,820	-	1,777,156,200	23,326,380	812,875,023	-	810,456,400	2,418,623
香港・ドル	2,269,359,520	-	2,277,868,800	8,509,280	1,220,310,700	-	1,216,570,000	3,740,700
南アフリカ・ランド	550,773,880	-	538,617,800	12,156,080	316,157,614	-	302,321,200	13,836,414
合計	31,763,446,773	-	31,926,318,500	162,871,727	16,388,671,642	-	16,294,277,800	94,393,842

(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まいります。

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まいります。

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3期 平成30年6月11日現在	第4期 平成30年12月11日現在
1口当たり純資産額	1.0356円	0.9975円
(1万口当たり純資産額)	(10,356円)	(9,975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12月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	アメリカ・ドル	XTRACKERS MSCI EMERGING MARKETS HEDGED EQUITY ETF	20,500.000	440,340.000	
	アメリカ・ドル 小計		20,500.000	440,340.000 (49,806,857)	
投資信託受益証券 合計			20,500	49,806,857 (49,806,857)	
親投資信託受益証券	日本円	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	1,409,243,916	4,709,975,016	
		外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	2,627,590,304	3,263,467,157	
		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	12,589,896,763	16,711,828,963	
		エマージング株式パッシブ・マザーファンド	4,331,722,844	4,675,228,465	
		エマージング債券パッシブ・マザーファンド	1,812,831,635	3,303,160,522	
日本円 小計			22,771,285,462	32,663,660,123	
親投資信託受益証券 合計			22,771,285,462	32,663,660,123	
合計				32,713,466,980 (49,806,857)	

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	0.09%	0.15%

（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30年6月11日現在	平成30年12月11日現在
資産の部			
流動資産			
預金		6,169,818,668	3,878,488,494
コール・ローン		196,389,443	505,501,825
株式		296,035,690,571	296,596,601,963
投資信託受益証券		727,971,227	766,871,198
投資証券		6,419,206,855	7,405,843,364
派生商品評価勘定		208,862,507	312,053
未収入金		116,881,508	217,021,983
未収配当金		604,680,287	579,340,500
差入委託証拠金		2,422,054,094	2,098,634,981
流動資産合計		312,901,555,160	312,048,616,361
資産合計		312,901,555,160	312,048,616,361
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		11,434,570	265,402,889
未払金		114,201,019	-
未払解約金		171,113,000	665,588,000
その他未払費用		1,578	-
流動負債合計		296,750,167	930,990,889
負債合計		296,750,167	930,990,889
純資産の部			
元本等			
元本	1	89,477,974,583	93,087,548,203
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		223,126,830,410	218,030,077,269
元本等合計		312,604,804,993	311,117,625,472
純資産合計		312,604,804,993	311,117,625,472
負債純資産合計		312,901,555,160	312,048,616,361

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	平成30年6月11日現在	平成30年12月11日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	86,323,479,779円	89,477,974,583円
同期中追加設定元本額	14,982,972,124円	19,475,116,292円
同期中一部解約元本額	11,828,477,320円	15,865,542,672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	2,280,760,656円	2,770,152,755円
M I T O ラップ型ファンド (安定型)	2,576,013円	2,795,385円
M I T O ラップ型ファンド (中立型)	8,253,521円	8,567,971円
M I T O ラップ型ファンド (積極型)	15,610,811円	16,971,755円
グローバル8資産ラップファン ド(安定型)	15,954,912円	20,371,951円
グローバル8資産ラップファン ド(中立型)	18,115,492円	23,048,530円
グローバル8資産ラップファン ド(積極型)	16,388,372円	20,870,949円
たわらノーロード 先進国株式	6,672,745,238円	8,290,315,837円
たわらノーロード 先進国株式 <ラップ向け>	424,449円	424,170円
たわらノーロード 先進国株式 <為替ヘッジあり>	729,379,436円	1,014,096,674円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	22,601,268円	61,515,122円
たわらノーロード バランス (堅実型)	1,592,267円	4,624,797円
たわらノーロード バランス (標準型)	14,263,359円	42,826,126円
たわらノーロード バランス (積極型)	36,954,341円	75,315,235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)	62,340円	218,017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)	7,309,428円	18,850,914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)	15,696,871円	55,095,987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)	10,864,941円	38,052,697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)	28,180,986円	97,492,816円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(保守型)	6,504円	17,277円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定型)	48,484円	77,900円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定成長型)	414,146円	855,692円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(成長型)	465,915円	633,840円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(積極型)	1,524,904円	2,319,405円
D I A M外国株式インデックス ファンド<DC年金>	38,546,896,698円	40,276,538,151円
D I A Mバランス・ファンド< DC年金> 1 安定型	163,871,815円	172,217,541円

DIAMバランス・ファンド< DC年金> 2安定・成長型	864,953,397円	872,487,284円
DIAMバランス・ファンド< DC年金> 3成長型	1,076,354,900円	1,081,273,080円
DIAM DC バランス30 インデックスファンド	130,336,604円	127,206,341円
DIAM DC バランス50 インデックスファンド	377,556,547円	360,021,829円
DIAM DC バランス70 インデックスファンド	335,232,104円	323,498,598円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型>	31,471,673円	30,305,396円
マネックス資産設計ファンド< 育成型>	799,032,499円	800,195,148円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	206,676,091円	213,664,955円
DIAM DC 8資産バラン スファンド(新興国10)	36,157,363円	206,255,560円
DIAM DC 8資産バラン スファンド(新興国20)	88,984,722円	137,159,702円
DIAM DC 8資産バラン スファンド(新興国30)	170,918,446円	239,035,345円
投資のソムリエ	868,741,001円	889,297,102円
クルーズコントロール	392,509,961円	181,927,336円
投資のソムリエ< DC年金>	64,336,511円	79,783,863円
DIAM 8資産バラン スファンドN< DC年金>	132,520,267円	149,764,407円
DIAM DC バランス・F (成長型)	83,800,402円	90,320,164円
クルーズコントロール< DC年 金>	164,617円	117,995円
DIAMコア資産設計ファンド (堅実型)	1,941,319円	980,420円
DIAMコア資産設計ファンド (積極型)	7,304,345円	2,394,317円
投資のソムリエ< DC年金>リ スク抑制型	28,781,499円	18,047,243円
ダイナミック・ナビゲーション	1,416,047円	633,910円
リスク抑制世界8資産バラン スファンド	521,323,309円	319,690,616円
ワールドアセットバランス(基 本コース)	708,384,105円	595,681,660円
ワールドアセットバランス(リ スク抑制コース)	2,833,633,500円	1,409,243,916円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2045)	663,072円	1,662,950円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2055)	432,935円	1,259,352円
リスク抑制世界8資産バラン スファンド(DC)	135,236円	109,641円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2035)	801,220円	2,742,280円

4資産分散投資・スタンダード <DC年金>	2,686,847円	5,366,582円
リスクコントロール世界資産分 散ファンド	45,042,961円	97,008,785円
9資産分散投資・スタンダード <DC年金>	-円	13,989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)	91,807,579円	91,028,759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)	2,883,713,605円	2,395,476,664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)	158,447,647円	5,982,237,672円
外国株式パッシブ・ファンド2 (適格機関投資家限定)	208,700,625円	206,201,980円
D I A Mワールドバランス25 V A (適格機関投資家限定)	23,795,507円	20,963,127円
D I A Mグローバル・バランス ファンド25V A (適格機関投 資家限定)	97,372,860円	83,173,640円
D I A Mグローバル・バランス ファンド50V A (適格機関投 資家限定)	225,166,060円	204,796,879円
D I A M国際分散バランスファ ンド30V A (適格機関投資家 限定)	12,123,685円	10,841,774円
D I A M国際分散バランスファ ンド50V A (適格機関投資家 限定)	82,899,784円	70,630,916円
D I A M国内重視バランスファ ンド30V A (適格機関投資家 限定)	6,640,729円	5,975,667円
D I A M国内重視バランスファ ンド50V A (適格機関投資家 限定)	10,221,886円	6,866,745円
D I A M世界バランスファンド 40V A (適格機関投資家限 定)	22,908,257円	21,797,603円
D I A M世界バランスファンド 50V A (適格機関投資家限 定)	64,248,826円	59,983,360円
D I A Mバランスファンド25 V A (適格機関投資家限定)	543,374,227円	497,825,607円
D I A Mバランスファンド3 7.5V A (適格機関投資家限 定)	674,979,721円	615,938,318円
D I A Mバランスファンド50 V A (適格機関投資家限定)	2,120,387,129円	1,961,841,073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)	771,905,259円	694,808,789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)	170,657,828円	113,563,089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)	892,771,100円	809,047,720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)	252,734,011円	95,911,596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)	43,052,940円	24,869,999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)	92,033,794円	15,773,016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)	7,736,276,798円	4,858,890,006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)	421,949,131円	178,441,405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)	1,348,932,090円	1,283,160,890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)	5,131,324,155円	4,890,498,369円
D I A Mバランス3 0 V A (適 格機関投資家限定)	16,699,050円	17,626,648円
D I A Mバランス5 0 V A (適 格機関投資家限定)	4,645,302円	329,724円
D I A Mバランス7 0 V A (適 格機関投資家限定)	10,747,430円	10,422,014円
D I A M世界アセットバラン スファンド4 V A (適格機関投資 家限定)	6,870,614,649円	6,547,665,217円
D I A Mバランス2 0 V A (適 格機関投資家限定)	60,336,899円	56,306,640円
D I A Mバランス4 0 V A (適 格機関投資家限定)	232,188円	226,006円
D I A Mバランス6 0 V A (適 格機関投資家限定)	262,190円	255,056円
計	89,477,974,583円	93,087,548,203円
2 . 受益権の総数	89,477,974,583口	93,087,548,203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12月12日 至 平成30年6月11日	自 平成30年6月12日 至 平成30年12月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。</p> <p>また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。</p>	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成30年6月11日現在	平成30年12月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成30年6月11日現在	平成30年12月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
株式	8,601,287,361	14,165,624,657
投資信託受益証券	48,612,735	43,612,146
投資証券	342,782,219	562,132,134
合計	8,992,682,315	13,559,880,377

(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30年2月16日から平成30年6月11日まで及び平成30年2月16日から平成30年12月11日まで）に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	平成30年6月11日 現在				平成30年12月11日 現在			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	60,376,079	-	60,375,430	649	240,482,267	-	241,099,700	617,433
アメリカ・ドル	22,425,770	-	22,424,950	820	182,967,000	-	183,653,710	686,710
イギリス・ボンド	29,639,258	-	29,639,460	202	11,736,004	-	11,647,280	88,724
オーストラリア・ドル	1,081,964	-	1,081,860	104	3,159,000	-	3,169,530	10,530
カナダ・ドル	4,389,767	-	4,389,840	73	9,379,944	-	9,360,630	19,314
ユーロ	2,839,320	-	2,839,320	-	33,240,319	-	33,268,550	28,231
買 建	2,427,938	-	2,413,670	14,268	16,450,343	-	16,448,950	1,393
イギリス・ボンド	-	-	-	-	1,420,640	-	1,420,300	340
オーストラリア・ドル	2,427,938	-	2,413,670	14,268	-	-	-	-
ユーロ	-	-	-	-	15,029,703	-	15,028,650	1,053
合計	62,804,017	-	62,789,100	13,619	256,932,610	-	257,548,650	618,826

(注) 時価の算定方法

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

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

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

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

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

株式関連

種類	平成30年6月11日 現在				平成30年12月11日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
先物取引								
買 建	8,598,448,600	-	8,795,890,157	197,441,557	6,460,092,136	-	6,195,620,126	264,472,010
合計	8,598,448,600	-	8,795,890,157	197,441,557	6,460,092,136	-	6,195,620,126	264,472,010

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成30年6月11日現在	平成30年12月11日現在
1口当たり純資産額	3.4937円	3.3422円
(1万口当たり純資産額)	(34,937円)	(33,422円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

平成30年12月11日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	AMAZON.COM INC	32,888	1,641.030	53,970,194.640	
	ABBOTT LABORATORIES	138,484	70.920	9,821,285.280	
	AES CORP	55,631	15.770	877,300.870	
	ABIOMED INC	3,560	323.660	1,152,229.600	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	71,198	121.130	8,624,213.740	
	ADVANCED MICRO DEVICES	76,385	19.990	1,526,936.150	
	ADOBE INC	38,657	244.090	9,435,787.130	
	CHUBB LTD	37,075	130.240	4,828,648.000	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	16,064	157.080	2,523,333.120	
	ALLEGHANY CORP	1,325	618.360	819,327.000	
	RALPH LAUREN CORP	4,893	105.140	514,450.020	
	ALLSTATE CORP	25,815	83.280	2,149,873.200	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	57,428	137.950	7,922,192.600	
	AMGEN INC	51,144	194.090	9,926,538.960	
	HESS CORP	23,734	51.490	1,222,063.660	
	AMERICAN EXPRESS CO	56,315	105.790	5,957,563.850	
	AMERICAN ELECTRIC POWER	39,528	79.360	3,136,942.080	
	AFLAC INC	56,211	43.040	2,419,321.440	
	AMERICAN INTL GROUP	68,445	37.510	2,567,371.950	
	AMERCO	551	347.870	191,676.370	
	ANALOG DEVICES	30,662	88.480	2,712,973.760	
	ANADARKO PETROLEUM CORP	42,877	51.060	2,189,299.620	
	ALEXION PHARMACEUTICALS INC	17,964	114.650	2,059,572.600	
	JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	76,484	32.350	2,474,257.400	
	JONES LANG LASALLE INC	4,087	130.100	531,718.700	
	VALERO ENERGY CORP	35,375	73.380	2,595,817.500	
	APACHE CORP	30,595	31.260	956,399.700	
	ANSYS INC	6,519	154.380	1,006,403.220	
	APPLE INC	382,546	169.600	64,879,801.600	
	APPLIED MATERIALS INC	76,914	34.170	2,628,151.380	
	ALBEMARLE CORP	7,904	89.040	703,772.160	
	ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	45,485	44.590	2,028,176.150	
	PINNACLE WEST CAPITAL CORP	9,600	91.070	874,272.000	
AMEREN CORP	18,566	70.710	1,312,801.860		
ARROW ELECTRONICS INC	8,346	71.500	596,739.000		

AUTOLIV INC	6,197	75.530	468,059.410	
AUTODESK INC	18,045	135.020	2,436,435.900	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	35,703	139.730	4,988,780.190	
AUTOZONE INC	2,231	885.870	1,976,375.970	
AVERY DENNISON CORP	6,262	91.170	570,906.540	
BALL CORP	27,803	48.300	1,342,884.900	
BERKSHIRE HATHAWAY INC- CL B	103,466	203.260	21,030,499.160	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	76,073	47.560	3,618,031.880	
BAXTER INTERNATIONAL INC	42,327	65.480	2,771,571.960	
BECTON DICKINSON & CO	21,205	236.430	5,013,498.150	
AMETEK INC	16,124	70.700	1,139,966.800	
VERIZON COMM INC	326,584	58.270	19,030,049.680	
WR BERKLEY CORP	8,134	75.210	611,758.140	
BEST BUY CO INC	19,210	58.660	1,126,858.600	
YUM! BRANDS INC	23,337	90.260	2,106,397.620	
FIRSTENERGY CORP	35,496	39.540	1,403,511.840	
H&R BLOCK INC	16,114	27.880	449,258.320	
BOEING CO	43,248	326.350	14,113,984.800	
ROBERT HALF INTL INC	10,827	59.000	638,793.000	
BORGWARNER INC	14,648	34.880	510,922.240	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	111,108	36.150	4,016,554.200	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	11,755	87.820	1,032,324.100	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	8,731	105.240	918,850.440	
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	2,142	591.660	1,267,335.720	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	128,671	52.580	6,765,521.180	
AFFILIATED MANAGERS GROUP INC	3,788	100.480	380,618.240	
INGREDION INC	5,305	96.460	511,720.300	
ONEOK INC	34,002	59.160	2,011,558.320	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	5,900	93.630	552,417.000	
UNITED RENTALS INC	6,332	101.860	644,977.520	
SEMPRA ENERGY	20,552	116.190	2,387,936.880	
FEDEX CORP	20,262	192.930	3,909,147.660	
VERISIGN INC	9,648	157.000	1,514,736.000	
AMPHENOL CORP	23,100	85.240	1,969,044.000	
BROWN-FORMAN CORP	19,683	46.390	913,094.370	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	127,092	6.200	787,970.400	
CSX CORP	63,380	68.300	4,328,854.000	
CABOT OIL & GAS CORP	38,255	25.290	967,468.950	
CAMPBELL SOUP CO	14,050	37.720	529,966.000	
SEAGATE TECHNOLOGY	20,613	39.810	820,603.530	
CONSTELLATION BRANDS INC	13,698	187.300	2,565,635.400	

CARDINAL HEALTH INC	26,919	53.050	1,428,052.950	
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	35,448	56.350	1,997,494.800	
CATERPILLAR INC	46,522	123.390	5,740,349.580	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	9,832	109.130	1,072,966.160	
CELGENE CORP	55,492	68.680	3,811,190.560	
CITRIX SYSTEMS INC	10,896	108.550	1,182,760.800	
CENTURYLINK INC	80,424	17.050	1,371,229.200	
CERNER CORP	22,947	54.440	1,249,234.680	
JPMORGAN CHASE & CO	265,789	101.360	26,940,373.040	
CHURCH & DWIGHT CO INC	18,822	66.580	1,253,168.760	
CIGNA CORP	19,268	206.080	3,970,749.440	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	14,286	79.390	1,134,165.540	
CINTAS CORP	7,944	171.540	1,362,713.760	
CISCO SYSTEMS INC	370,265	46.860	17,350,617.900	
CLOROX COMPANY	10,885	162.200	1,765,547.000	
COCA-COLA CO/THE	317,279	49.240	15,622,817.960	
COPART INC	15,900	48.340	768,606.000	
COGNEX CORP	15,291	41.340	632,129.940	
COLGATE-PALMOLIVE CO	63,400	63.540	4,028,436.000	
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	24,763	110.810	2,743,988.030	
COMERICA INC	12,253	72.180	884,421.540	
NRG ENERGY, INC.	13,365	40.590	542,485.350	
COMCAST CORP-CL A	360,606	37.350	13,468,634.100	
CONAGRA BRANDS INC	40,573	30.410	1,233,824.930	
CONSOLIDATED EDISON INC	22,464	82.910	1,862,490.240	
CMS ENERGY CORP	23,616	53.140	1,254,954.240	
COOPER COS INC	3,794	253.080	960,185.520	
MOLSON COORS BREWING CO	16,200	62.740	1,016,388.000	
CORNING INC	68,691	31.760	2,181,626.160	
SEALED AIR CORP	13,870	34.050	472,273.500	
CUMMINS INC	13,193	136.290	1,798,073.970	
DR HORTON INC	32,152	35.920	1,154,899.840	
DANAHER CORP	51,071	101.720	5,194,942.120	
MOODY'S CORP	14,293	145.750	2,083,204.750	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	44,297	67.090	2,971,885.730	
TARGET CORP	40,408	68.320	2,760,674.560	
DEERE & CO	24,482	147.030	3,599,588.460	
MORGAN STANLEY	100,509	40.710	4,091,721.390	
REPUBLIC SERVICES INC	17,375	74.260	1,290,267.500	
COSTAR GROUP INC	2,786	363.070	1,011,513.020	
THE WALT DISNEY CO	116,536	111.860	13,035,716.960	
DOLLAR TREE INC	20,078	83.820	1,682,937.960	
DOVER CORP	12,635	78.200	988,057.000	
OMNICOM GROUP	19,325	75.840	1,465,608.000	

DTE ENERGY CO	14,643	119.310	1,747,056.330	
DUKE ENERGY CORP	56,007	90.510	5,069,193.570	
FLOWERVE CORP	8,406	44.570	374,655.420	
DARDEN RESTAURANTS INC	9,436	105.360	994,176.960	
EBAY INC	78,355	28.980	2,270,727.900	
BANK OF AMERICA CORP	750,418	24.760	18,580,349.680	
CITIGROUP INC	198,184	57.070	11,310,360.880	
EASTMAN CHEMICAL CO	9,297	72.720	676,077.840	
E*TRADE FINANCIAL CORP	19,380	45.110	874,231.800	
EATON CORP PLC	31,379	71.330	2,238,264.070	
EATON VANCE CORP	9,184	36.600	336,134.400	
CADENCE DESIGN SYS INC	20,877	43.380	905,644.260	
DISH NETWORK CORP	16,150	31.980	516,477.000	
ECOLAB INC	20,640	154.600	3,190,944.000	
ELECTRONIC ARTS INC	25,240	83.730	2,113,345.200	
SALESFORCE.COM INC	57,341	137.270	7,871,199.070	
EMERSON ELECTRIC CO	51,077	62.550	3,194,866.350	
ATMOS ENERGY CORP	8,221	98.450	809,357.450	
ENERGY CORP	13,599	89.150	1,212,350.850	
EOG RESOURCES INC	43,724	101.710	4,447,168.040	
EQUIFAX INC	10,231	98.440	1,007,139.640	
ESTEE LAUDER COS INC/THE	18,295	137.980	2,524,344.100	
EXPEDITORS INTERNATIONAL	14,792	71.220	1,053,486.240	
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	44,474	96.010	4,269,948.740	
EXXON MOBIL CORP	332,938	76.540	25,483,074.520	
FMC CORP	10,614	79.390	842,645.460	
NEXTERA ENERGY INC	37,752	182.610	6,893,892.720	
ASSURANT INC	4,089	90.650	370,667.850	
FASTENAL CO	21,654	54.620	1,182,741.480	
FIFTH THIRD BANCORP	52,173	24.860	1,297,020.780	
M&T BANK CORP	10,011	155.350	1,555,208.850	
FISERV INC	33,307	76.140	2,535,994.980	
FLIR SYSTEMS INC	11,623	44.050	511,993.150	
MACY'S INC	24,741	31.890	788,990.490	
FORD MOTOR CO	304,939	8.520	2,598,080.280	
FRANKLIN RESOURCES INC	21,050	32.050	674,652.500	
FREEMPORT-MCMORAN INC	117,269	10.690	1,253,605.610	
FLEX LTD	35,913	8.210	294,845.730	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	16,478	74.540	1,228,270.120	
GAP INC/THE	18,295	26.960	493,233.200	
DENTSPLY SIRONA INC	17,477	36.460	637,211.420	
GENERAL DYNAMICS CORP	19,414	172.200	3,343,090.800	
GENERAL MILLS INC	48,902	38.540	1,884,683.080	
GENUINE PARTS CO	11,759	99.320	1,167,903.880	
GILEAD SCIENCES INC	105,995	67.490	7,153,602.550	
GARTNER INC	7,153	143.250	1,024,667.250	
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	18,097	21.590	390,714.230	

MCKESSON CORP	16,848	123.100	2,073,988.800	
NVIDIA CORP	46,836	151.860	7,112,514.960	
GENERAL ELECTRIC CO	707,684	6.930	4,904,250.120	
WW GRAINGER INC	3,832	285.310	1,093,307.920	
HALLIBURTON CO	73,763	29.280	2,159,780.640	
MONSTER BEVERAGE CORP	32,522	56.950	1,852,127.900	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	27,962	178.830	5,000,444.460	
HARLEY-DAVIDSON INC	12,901	36.970	476,949.970	
HARRIS CORP	10,033	143.450	1,439,233.850	
HASBRO INC	9,136	84.000	767,424.000	
HENRY SCHEIN INC	11,426	85.550	977,494.300	
HELMERICH & PAYNE INC	10,055	59.200	595,256.000	
HERSHEY FOODS CORP	10,317	107.130	1,105,260.210	
HP INC	122,933	22.930	2,818,853.690	
F5 NETWORKS INC	4,874	167.190	814,884.060	
CROWN HOLDINGS INC NPR	10,472	47.220	494,487.840	
UNITED THERAPEUTICS CORP	3,447	108.500	373,999.500	
JUNIPER NETWORKS INC	27,740	27.610	765,901.400	
HOLLYFRONTIER CORP	12,551	54.950	689,677.450	
HOLOGIC INC	23,377	42.380	990,717.260	
UNUM GROUP	16,000	31.060	496,960.000	
HOME DEPOT INC	90,098	171.690	15,468,925.620	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	15,079	93.830	1,414,862.570	
HORMEL FOODS CORP	24,161	44.260	1,069,365.860	
CENTERPOINT ENERGY INC	35,202	28.460	1,001,848.920	
LENNOX INTERNATIONAL INC	3,569	207.880	741,923.720	
HUMANA INC	11,262	307.320	3,461,037.840	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	7,359	99.910	735,237.690	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	93,648	13.020	1,219,296.960	
RED HAT INC	14,824	177.000	2,623,848.000	
NEKTAR THERAPEUTICS	12,000	36.660	439,920.000	
BIOGEN INC	15,973	319.440	5,102,415.120	
IDEX CORP	5,924	134.380	796,067.120	
ILLINOIS TOOL WORKS	22,585	130.660	2,950,956.100	
INTUIT INC	19,317	206.790	3,994,562.430	
IDEXX LABORATORIES INC	7,402	196.000	1,450,792.000	
INGERSOLL-RAND PLC	20,370	97.730	1,990,760.100	
INTEL CORP	364,142	47.210	17,191,143.820	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	7,446	137.700	1,025,314.200	
INTERNATIONAL PAPER CO	32,983	44.310	1,461,476.730	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	29,157	22.900	667,695.300	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	9,631	58.860	566,880.660	

JACK HENRY & ASSOCIATES INC	5,919	134.770	797,703.630	
INCYTE CORP	15,601	65.420	1,020,617.420	
JOHNSON & JOHNSON	211,671	145.260	30,747,329.460	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	29,441	41.570	1,223,862.370	
KLA-TENCOR CORP	11,724	92.280	1,081,890.720	
DEVON ENERGY CORP	44,878	26.270	1,178,945.060	
KELLOGG CO	21,564	60.300	1,300,309.200	
EAST WEST BANCORP INC	11,000	47.140	518,540.000	
KEYCORP	88,511	16.000	1,416,176.000	
KIMBERLY-CLARK CORP	28,662	113.690	3,258,582.780	
BLACKROCK INC/NEW YORK	9,584	393.260	3,769,003.840	
KOHL'S CORP	14,910	63.830	951,705.300	
KROGER CO	66,610	28.790	1,917,701.900	
LAM RESEARCH CORP	12,267	137.820	1,690,637.940	
PACKAGING CORP OF AMERICA	7,057	92.500	652,772.500	
AKAMAI TECHNOLOGIES	12,622	67.280	849,208.160	
LEGGETT & PLATT INC	9,588	37.700	361,467.600	
LENNAR CORP	21,933	41.120	901,884.960	
JEFFERIES FINANCIAL GROUP INC	21,462	18.640	400,051.680	
ELI LILLY & CO	76,571	114.090	8,735,985.390	
L BRANDS INC	16,262	32.020	520,709.240	
LINCOLN NATIONAL CORP	18,890	55.470	1,047,828.300	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	55,869	104.400	5,832,723.600	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	25,175	70.590	1,777,103.250	
LOCKHEED MARTIN CORP	19,984	298.400	5,963,225.600	
LOEWS CORP	21,346	45.140	963,558.440	
LOWE'S COS INC	63,929	89.430	5,717,170.470	
DOMINION ENERGY INC	52,247	76.270	3,984,878.690	
SCANA CORP	10,902	47.190	514,465.380	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	40,298	25.820	1,040,494.360	
MCCORMICK & CO INC	9,307	151.250	1,407,683.750	
MCDONALD'S CORPORATION	60,936	184.650	11,251,832.400	
S&P GLOBAL INC	20,081	169.120	3,396,098.720	
EVEREST RE GROUP LTD	2,855	230.170	657,135.350	
MANPOWERGROUP INC	6,265	73.220	458,723.300	
MARKEL CORPORATION	981	1,055.720	1,035,661.320	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	17,378	161.920	2,813,845.760	
MARSH & MCLENNAN COS	41,255	84.570	3,488,935.350	
MASCO CORP	23,043	29.940	689,907.420	
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	5,382	179.980	968,652.360	
MATTEL INC	24,003	12.900	309,638.700	

METLIFE INC	65,288	39.610	2,586,057.680	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	19,364	53.330	1,032,682.120	
MEDTRONIC PLC	105,619	95.480	10,084,502.120	
ACTIVISION BLIZZARD INC	59,081	47.880	2,828,798.280	
CVS HEALTH CORP	105,231	73.340	7,717,641.540	
MERCK & CO. INC.	210,037	77.420	16,261,064.540	
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	31,900	17.590	561,121.000	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	7,285	139.550	1,016,621.750	
MICROSOFT CORP	576,296	107.590	62,003,686.640	
MICRON TECH INC	94,810	34.800	3,299,388.000	
MIDDLEBY CORP	4,100	109.090	447,269.000	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	17,529	71.900	1,260,335.100	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	45,086	15.350	692,070.100	
3M CO	45,909	198.320	9,104,672.880	
MOHAWK INDUSTRIES INC	4,873	119.980	584,662.540	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	13,480	129.600	1,747,008.000	
KANSAS CITY SOUTHERN	8,856	97.800	866,116.800	
MYLAN NV	43,574	30.300	1,320,292.200	
ILLUMINA INC	12,036	323.050	3,888,229.800	
XCEL ENERGY INC	41,218	53.460	2,203,514.280	
NATIONAL OILWELL VARCO INC	33,468	29.160	975,926.880	
NETAPP INC	20,587	65.630	1,351,124.810	
NEWELL BRANDS INC	36,206	22.860	827,669.160	
NEWMONT MINING CORP	40,577	33.530	1,360,546.810	
NVR INC	307	2,391.660	734,239.620	
NIKE INC-CL B	99,677	72.510	7,227,579.270	
NOBLE ENERGY INC	36,582	22.820	834,801.240	
NORDSTROM INC	9,487	49.040	465,242.480	
NORFOLK SOUTHERN CORP	21,505	155.880	3,352,199.400	
EVERSOURCE ENERGY	27,088	69.640	1,886,408.320	
NISOURCE INC	31,548	27.260	859,998.480	
TAPESTRY INC	22,269	35.840	798,120.960	
NORTHERN TRUST CORP	17,867	88.200	1,575,869.400	
NORTHROP GRUMMAN CORP	12,767	270.230	3,450,026.410	
WELLS FARGO & CO	361,721	48.800	17,651,984.800	
NUCOR CORP	23,780	56.980	1,354,984.400	
CHENIERE ENERGY INC	15,927	60.640	965,813.280	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	39,049	82.450	3,219,590.050	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	61,379	64.440	3,955,262.760	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	4,917	129.750	637,980.750	
OGE ENERGY CORP	16,028	40.790	653,782.120	

O'REILLY AUTOMOTIVE INC	6,375	338.060	2,155,132.500	
ORACLE CORP	234,662	46.670	10,951,675.540	
PACCAR INC	26,537	57.570	1,527,735.090	
PTC INC	4,142	85.320	353,395.440	
EXELON CORP	76,576	47.000	3,599,072.000	
PARKER HANNIFIN CORP	11,023	156.300	1,722,894.900	
PAYCHEX INC	26,670	68.120	1,816,760.400	
ALIGN TECHNOLOGY INC	5,854	216.660	1,268,327.640	
PPL CORPORATION	57,297	30.790	1,764,174.630	
PEPSICO INC	110,954	116.190	12,891,745.260	
PENTAIR PLC	11,775	39.680	467,232.000	
PFIZER INC	462,781	44.400	20,547,476.400	
CONOCOPHILLIPS	89,884	65.200	5,860,436.800	
PVH CORP	6,862	100.790	691,620.980	
PG&E CORP	37,276	25.890	965,075.640	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	14,308	140.560	2,011,132.480	
ALTRIA GROUP INC	149,083	53.360	7,955,068.880	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	35,828	124.260	4,451,987.280	
POLARIS INDUSTRIES INC	3,845	83.440	320,826.800	
GARMIN LTD	7,795	64.930	506,129.350	
FLUOR CORP (NEW)	9,821	35.710	350,707.910	
PPG INDUSTRIES INC	18,046	103.460	1,867,039.160	
IPG PHOTONICS CORP	2,441	123.100	300,487.100	
COSTCO WHOLESALE CORP	35,482	222.660	7,900,422.120	
T ROWE PRICE GROUP INC	19,916	92.450	1,841,234.200	
QUEST DIAGNOSTICS	10,378	87.460	907,659.880	
PROCTER & GAMBLE CO	196,465	93.030	18,277,138.950	
PROGRESSIVE CORP	47,422	63.650	3,018,410.300	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	41,013	55.390	2,271,710.070	
PULTE GROUP INC	21,209	25.560	542,102.040	
GLOBAL PAYMENTS INC	13,406	103.790	1,391,408.740	
QUALCOMM INC	114,098	57.240	6,530,969.520	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	10,187	75.580	769,933.460	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	2,550	140.670	358,708.500	
REGENERON PHARMACEUTICALS	6,415	377.590	2,422,239.850	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA INC	4,642	137.710	639,249.820	
RESMED INC	12,271	112.900	1,385,395.900	
US BANCORP	120,539	50.580	6,096,862.620	
SEATTLE GENETICS INC /WA	7,317	60.650	443,776.050	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	31,422	27.570	866,304.540	
ROSS STORES INC	30,914	80.010	2,473,429.140	
ROLLINS INC	8,252	57.370	473,417.240	

ROPER TECHNOLOGIES INC	7,644	285.360	2,181,291.840	
ROCKWELL AUTOMATION INC	10,439	160.160	1,671,910.240	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	14,121	104.860	1,480,728.060	
RAYTHEON COMPANY	22,940	171.210	3,927,557.400	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	3,848	179.010	688,830.480	
ACCENTURE PLC-CL A	49,763	157.720	7,848,620.360	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	113,537	43.930	4,987,680.410	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	11,016	154.610	1,703,183.760	
THE TRAVELERS COMPANIES INC	21,930	123.000	2,697,390.000	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	24,736	105.680	2,614,100.480	
BOOKING HOLDINGS INC	3,768	1,826.010	6,880,405.680	
SCHLUMBERGER LTD	104,496	41.970	4,385,697.120	
SCHWAB (CHARLES) CORP	96,501	41.100	3,966,191.100	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	16,874	111.100	1,874,701.400	
BUNGE LTD	10,334	59.640	616,319.760	
SEI INVESTMENTS CO	12,294	49.180	604,618.920	
ANTHEM INC	20,799	276.660	5,754,251.340	
AMERISOURCEBERGEN CORP	12,257	83.550	1,024,072.350	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	21,442	42.930	920,505.060	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	6,882	393.460	2,707,791.720	
CENTENE CORP	17,128	132.460	2,268,774.880	
SVB FINANCIAL GROUP	4,107	204.200	838,649.400	
IAC INTERACTIVE CORP	5,766	179.240	1,033,497.840	
SMITH (A.O.) CORP	9,536	42.970	409,761.920	
ACUITY BRANDS INC	3,087	116.340	359,141.580	
SNAP-ON INC	4,935	148.710	733,883.850	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	31,824	83.300	2,650,939.200	
ADVANCE AUTO PARTS	6,330	166.170	1,051,856.100	
EDISON INTERNATIONAL	26,721	58.840	1,572,263.640	
SOUTHERN CO	81,919	47.220	3,868,215.180	
BB&T CORP	63,542	46.950	2,983,296.900	
SOUTHWEST AIRLINES	11,352	51.140	580,541.280	
AT&T INC	572,945	29.910	17,136,784.950	
CHEVRON CORP	151,460	114.940	17,408,812.400	
STANLEY BLACK & DECKER INC	13,077	121.860	1,593,563.220	
STATE STREET CORP	30,346	64.030	1,943,054.380	
STARBUCKS CORP	106,081	65.490	6,947,244.690	
STEEL DYNAMICS INC	19,030	31.810	605,344.300	
STRYKER CORP	27,381	171.220	4,688,174.820	
NETFLIX INC	34,532	269.700	9,313,280.400	
SUNTRUST BANKS INC	38,038	55.570	2,113,771.660	

SYMANTEC CORP	47,004	22.080	1,037,848.320	
KNIGHT SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	9,793	28.650	280,569.450	
SYNOPSYS INC	13,239	89.340	1,182,772.260	
SYSCO CORP	39,953	64.900	2,592,949.700	
INTUITIVE SURGICAL INC	9,036	498.110	4,500,921.960	
TELEFLEX INC	3,905	257.170	1,004,248.850	
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	80,553	18.440	1,485,397.320	
TEXAS INSTRUMENTS INC	75,203	93.800	7,054,041.400	
TEXTRON INC	19,076	51.200	976,691.200	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	32,661	237.080	7,743,269.880	
TIFFANY & CO	8,733	85.110	743,265.630	
TORCHMARK CORP	7,699	78.920	607,605.080	
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	14,384	85.380	1,228,105.920	
DAVITA INC	10,878	58.010	631,032.780	
TRACTOR SUPPLY CO	9,276	90.120	835,953.120	
TRIMBLE INC	20,073	35.650	715,602.450	
TYSON FOODS INC	24,607	55.410	1,363,473.870	
UGI CORP	14,725	58.760	865,241.000	
MARATHON OIL CORP	64,347	15.300	984,509.100	
UNION PACIFIC CORP	57,646	148.040	8,533,913.840	
UNITED TECHNOLOGIES CORP	61,400	119.410	7,331,774.000	
UNITEDHEALTH GROUP INC	75,940	266.530	20,240,288.200	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	6,351	127.320	808,609.320	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	6,848	119.500	818,336.000	
VF CORP	27,791	76.330	2,121,287.030	
CBS CORP	27,376	49.760	1,362,229.760	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	20,994	173.780	3,648,337.320	
VULCAN MATERIALS CO	10,136	101.540	1,029,209.440	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	68,404	81.160	5,551,668.640	
WALMART INC	116,752	93.940	10,967,682.880	
WASTE MANAGEMENT INC	32,422	91.270	2,959,155.940	
WATERS CORP	5,963	189.540	1,130,227.020	
ALLERGAN PLC	26,766	152.380	4,078,603.080	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	8,855	99.160	878,061.800	
VAIL RESORTS INC	3,098	234.480	726,419.040	
WESTERN DIGITAL CORP	22,254	41.660	927,101.640	
WABTEC CORP	7,530	82.410	620,547.300	
WHIRLPOOL CORP	5,553	116.640	647,701.920	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	13,529	67.440	912,395.760	
WYNN RESORTS LTD	7,179	106.240	762,696.960	

NASDAQ INC	9,132	87.100	795,397.200	
CME GROUP INC	28,996	190.350	5,519,388.600	
WILLIAMS COS INC	99,653	24.080	2,399,644.240	
LKQ CORP	22,948	25.630	588,157.240	
ALLIANT ENERGY CORP	19,910	45.940	914,665.400	
WEC ENERGY GROUP INC	23,865	74.430	1,776,271.950	
TD AMERITRADE HOLDING CORP	21,581	49.190	1,061,569.390	
CARMAX INC	13,513	62.340	842,400.420	
XEROX CORP	17,455	25.000	436,375.000	
XILINX INC	21,093	87.630	1,848,379.590	
CIMAREX ENERGY CO	7,003	72.370	506,807.110	
TJX COMPANIES INC	102,627	46.210	4,742,393.670	
ZIONS BANCORP NA	16,584	44.230	733,510.320	
DAIRY FARM INTERNATIONAL HLDNGS	27,400	8.970	245,778.000	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	76,400	6.450	492,780.000	
JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	15,700	64.820	1,017,674.000	
JARDINE STRATEGIC HOLDINGS LTD	17,100	37.460	640,566.000	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	6,051	76.690	464,051.190	
SIGNATURE BANK	4,171	114.210	476,369.910	
CBRE GROUP INC	24,276	41.150	998,957.400	
LIBERTY GLOBAL PLC	19,835	23.640	468,899.400	
WELLCARE HEALTH PLANS INC	2,290	236.210	540,920.900	
REGIONS FINANCIAL CORP	92,992	14.390	1,338,154.880	
DOMINO'S PIZZA INC	3,256	255.210	830,963.760	
WESTLAKE CHEMICAL CORP	3,000	66.820	200,460.000	
T-MOBILE US INC	27,739	65.730	1,823,284.470	
LAS VEGAS SANDS CORP	33,332	53.460	1,781,928.720	
MOSAIC CO/THE	31,433	33.200	1,043,575.600	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX NEWS	35,913	49.020	1,760,455.260	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC	81,060	49.350	4,000,311.000	
CELANESE CORP	11,880	89.730	1,065,992.400	
DEXCOM INC	3,630	123.450	448,123.500	
DISCOVERY INC-A	10,423	28.370	295,700.510	
EXPEDIA GROUP INC	10,373	118.780	1,232,104.940	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	18,475	41.330	763,571.750	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	10,552	112.460	1,186,677.920	
LIBERTY GLOBAL PLC- SERIES C	41,818	23.100	965,995.800	

INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	44,098	78.930	3,480,655.140	
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	14,696	22.390	329,043.440	
VIACOM INC-CLASS B	30,282	29.390	889,987.980	
LIVE NATION	13,682	54.340	743,479.880	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,807	475.150	858,596.050	
UNITED CONTINENTAL HOLIDINGS INC	6,191	88.550	548,213.050	
TRANSDIGM GROUP INC	3,812	345.790	1,318,151.480	
MASTERCARD INC	72,698	198.060	14,398,565.880	
QURATE RETAIL INC	35,733	21.480	767,544.840	
HANESBRANDS INC	27,619	14.950	412,904.050	
WESTERN UNION CO	35,222	18.300	644,562.600	
OWENS CORNING	7,333	47.570	348,830.810	
LEIDOS HOLDINGS INC	13,182	59.480	784,065.360	
AERCAP HOLDINGS NV	11,586	48.680	564,006.480	
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLDINGS INC	9,175	74.640	684,822.000	
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT-ADR	18,099	17.030	308,225.970	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	10,519	99.380	1,045,378.220	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	29,653	15.850	470,000.050	
DELTA AIR LINES INC	13,898	56.320	782,735.360	
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	6,354	45.620	289,869.480	
DISCOVER FINANCIAL	29,057	64.740	1,881,150.180	
TE CONNECTIVITY LTD	25,145	74.090	1,862,993.050	
CONCHO RESOURCES INC/MIDLAND TX	16,507	120.450	1,988,268.150	
WABCO HOLDING INC	4,076	106.650	434,705.400	
LULULEMON ATHLETICA INC	7,883	115.010	906,623.830	
VMWARE INC	5,491	163.360	897,009.760	
MERCADOLIBRE INC	3,215	353.520	1,136,566.800	
ULTA BEAUTY INC	4,332	251.100	1,087,765.200	
INVESCO LTD	29,824	17.950	535,340.800	
MSCI INC	7,537	150.160	1,131,755.920	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	122,619	84.220	10,326,972.180	
VISA INC	139,521	137.880	19,237,155.480	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	13,492	97.460	1,314,930.320	
DISCOVERY INC-C	23,054	26.400	608,625.600	
MARATHON PETROLEUM CORP	56,609	60.980	3,452,016.820	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	11,624	42.830	497,855.920	

KINDER MORGAN INC/DELAWARE	149,409	16.040	2,396,520.360	
XYLEM INC	15,111	65.900	995,814.900	
ALKERMES PLC	12,053	34.280	413,176.840	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	27,218	84.430	2,298,015.740	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,479	199.560	694,269.240	
SPLUNK INC	12,240	108.400	1,326,816.000	
HCA HEALTHCARE INC	22,931	134.120	3,075,505.720	
VERISK ANALYTICS INC	11,859	114.380	1,356,432.420	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	5,474	139.650	764,444.100	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	7,443	185.870	1,383,430.410	
FIRST REPUBLIC BANK/SAN FRANCISCO CA	13,676	92.570	1,265,987.320	
CIT GROUP INC	9,287	43.370	402,777.190	
NXP SEMICONDUCTOR NV	28,555	76.000	2,170,180.000	
TARGA RESOURCES CORP	16,445	42.940	706,148.300	
LEAR CORP	5,132	123.970	636,214.040	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	8,640	105.460	911,174.400	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	17,000	46.130	784,210.000	
DOLLAR GENERAL CORP	22,291	105.640	2,354,821.240	
FORTINET INC	11,399	74.700	851,505.300	
AON PLC	19,838	157.730	3,129,047.740	
TESLA INC	10,430	365.150	3,808,514.500	
GENERAL MOTORS CO	103,588	34.420	3,565,498.960	
WORLDPAY INC	24,088	81.720	1,968,471.360	
XPO LOGISTICS INC	9,000	65.870	592,830.000	
TRIPADVISOR INC	9,263	61.090	565,876.670	
ALLY FINANCIAL INC	31,409	24.390	766,065.510	
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	12,138	39.630	481,028.940	
VOYA FINANCIAL INC	13,525	42.160	570,214.000	
APTIV PLC	22,571	65.330	1,474,563.430	
PHILLIPS 66	35,506	88.840	3,154,353.040	
FACEBOOK INC	191,253	141.850	27,129,238.050	
IQVIA HOLDINGS INC	13,426	119.120	1,599,305.120	
DIAMONDBACK ENERGY INC	13,109	100.630	1,319,158.670	
SERVICENOW INC	14,659	184.900	2,710,449.100	
PALO ALTO NETWORKS INC	7,006	179.240	1,255,755.440	
WORKDAY INC	12,376	159.680	1,976,199.680	
ABBVIE INC	120,096	87.610	10,521,610.560	
ZOETIS INC	39,459	88.920	3,508,694.280	
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDINGS LTD	16,470	47.730	786,113.100	
COTY INC	38,541	7.590	292,526.190	
NEWS CORP/NEW-CL A	30,263	12.530	379,195.390	

HD SUPPLY HOLDINGS INC	12,891	38.450	495,658.950	
CDW CORP	13,040	90.620	1,181,684.800	
SPRINT CORP	63,882	5.930	378,820.260	
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	10,199	33.840	345,134.160	
ARCONIC INC	36,761	19.890	731,176.290	
LIBERTY MEDIA CORP- LIBERTY-C	17,852	31.570	563,587.640	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	5,006	39.240	196,435.440	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-C	17,931	39.500	708,274.500	
DELL TECHNOLOGIES INC	16,584	104.110	1,726,560.240	
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	15,410	21.010	323,764.100	
BAKER HUGHES A GE CO	43,404	21.270	923,203.080	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	6,152	73.370	451,372.240	
TECHNIPFMC LTD	32,556	20.970	682,699.320	
BROADCOM INC	33,381	239.250	7,986,404.250	
BURLINGTON STORES INC	2,844	159.720	454,243.680	
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	9,985	33.050	330,004.250	
ANTERO RESOURCES CORP	13,163	12.790	168,354.770	
VEEVA SYSTEMS INC	9,087	90.040	818,193.480	
TWITTER INC	56,256	33.430	1,880,638.080	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING PLC	17,181	44.110	757,853.910	
EVERGY INC	21,000	60.510	1,270,710.000	
PLAINS GP HOLDINGS LP	7,837	21.090	165,282.330	
COMMSCOPE HOLDING CO INC	12,920	17.320	223,774.400	
ALLEGION PLC	7,325	87.230	638,959.750	
WIX.COM LTD	2,000	91.390	182,780.000	
PERRIGO CO PLC	10,553	58.840	620,938.520	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	22,612	72.670	1,643,214.040	
ARAMARK	21,772	35.560	774,212.320	
GRUBHUB INC	1,917	80.810	154,912.770	
SABRE CORP	17,624	25.040	441,304.960	
PARSLEY ENERGY INC	17,454	18.030	314,695.620	
ARISTA NETWORKS INC	4,441	229.770	1,020,408.570	
IHS MARKIT LTD	30,253	50.790	1,536,549.870	
FNF GROUP	20,660	32.230	665,871.800	
SYNCHRONY FINANCIAL	60,568	24.960	1,511,777.280	
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	40,320	32.050	1,292,256.000	
CDK GLOBAL INC	8,309	48.010	398,915.090	
WAYFAIR INC	1,336	108.290	144,675.440	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	14,300	59.610	852,423.000	
QORVO INC	10,887	59.520	647,994.240	
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	16,089	25.080	403,512.120	

	LIBERTY BROADBAND CORP-C W/I	7,818	79.860	624,345.480	
	AXALTA COATING SYSTEMS LTD	14,710	23.250	342,007.500	
	GODADDY INC	14,641	64.720	947,565.520	
	NIELSEN HOLDINGS PLC	26,840	25.990	697,571.600	
	TRANSUNION	13,841	61.770	854,958.570	
	SQUARE INC	23,565	63.380	1,493,549.700	
	DOWDUPONT INC	180,411	53.800	9,706,111.800	
	COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS PLC	17,100	47.330	809,343.000	
	WESTROCK CO	17,987	44.210	795,205.270	
	KRAFT HEINZ CO	50,303	48.270	2,428,125.810	
	FORTIVE CORP	23,630	70.720	1,671,113.600	
	WASTE CONNECTIONS INC	23,491	76.650	1,800,585.150	
	ALPHABET INC-CL A	23,509	1,053.180	24,759,208.620	
	HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	125,608	14.570	1,830,108.560	
	PAYPAL HOLDINGS INC	88,858	84.930	7,546,709.940	
	AXA EQUITABLE HOLDINGS INC	13,000	17.340	225,420.000	
	FIRST DATA CORP	44,487	17.700	787,419.900	
	DXC TECHNOLOGY CO	23,734	58.860	1,396,983.240	
	ZILLOW GROUP INC-C	8,134	36.100	293,637.400	
	ALPHABET INC-CL C	25,128	1,039.550	26,121,812.400	
	BEIGENE LTD ADR	2,000	136.360	272,720.000	
	L3 TECHNOLOGIES INC	6,752	183.650	1,240,004.800	
	CHEMOURS CO	12,723	25.410	323,291.430	
	LINDE PLC	44,570	156.910	6,993,478.700	
	ATHENE HOLDING LTD	11,784	40.560	477,959.040	
	CHARTER COMMUNICATIONS INC	12,771	315.640	4,031,038.440	
	VISTRA ENERGY CORP	30,000	23.650	709,500.000	
	アメリカ・ドル 小計	24,141,705		1,795,778,666.430 (203,120,524,960)	
イギリス・ポンド	ANTOFAGASTA PLC	25,905	7.396	191,593.380	
	ASHTED GROUP	42,154	16.065	677,204.010	
	SEVERN TRENT PLC	25,530	18.035	460,433.550	
	BHP GROUP PLC	173,514	15.296	2,654,070.140	
	BARCLAYS PLC	1,386,487	1.533	2,125,484.570	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	103,764	4.390	455,523.960	
	BT GROUP PLC	696,796	2.486	1,732,234.850	
	BUNZL PLC	26,515	22.850	605,867.750	
	EASYJET PLC	13,628	10.540	143,639.120	
	AVIVA PLC	303,368	3.726	1,130,349.160	
	CRODA INTERNATIONAL	10,645	46.000	489,670.000	
	DIAGEO PLC	191,193	28.005	5,354,359.960	
	SCHRODERS PLC	10,932	23.340	255,152.880	
	DCC PLC	9,753	58.250	568,112.250	

NATIONAL GRID PLC	273,118	8.137	2,222,361.160	
KINGFISHER PLC	165,680	2.304	381,726.720	
BAE SYSTEMS PLC	268,920	4.540	1,220,896.800	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	186,589	27.210	5,077,086.690	
NEXT PLC	12,064	46.170	556,994.880	
IMPERIAL BRANDS PLC	78,173	23.775	1,858,563.070	
JOHNSON MATTHEY PLC	15,017	26.200	393,445.400	
ANGLO AMERICAN PLC	88,044	15.750	1,386,693.000	
COMPASS GROUP PLC	129,886	16.690	2,167,797.340	
HSBC HOLDINGS PLC	1,561,508	6.386	9,971,790.080	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	393,111	2.275	894,327.520	
CENTRICA PLC	471,340	1.332	627,824.880	
UNILEVER PLC	87,011	42.495	3,697,532.440	
MEGGITT PLC	62,181	4.606	286,405.680	
MORRISON <WM.> SUPERMARKETS	155,682	2.235	347,949.270	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	54,487	7.392	402,767.900	
RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	80,864	5.024	406,260.730	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	30,240	21.610	653,486.400	
PEARSON PLC	65,009	9.160	595,482.440	
PERSIMMON PLC	23,150	18.610	430,821.500	
PRUDENTIAL PLC	208,962	14.070	2,940,095.340	
RIO TINTO PLC	89,618	35.270	3,160,826.860	
VODAFONE GROUP PLC	2,120,291	1.593	3,377,623.560	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	53,007	62.850	3,331,489.950	
RELX PLC	147,847	15.950	2,358,159.650	
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	138,993	7.592	1,055,234.850	
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	389,955	2.036	793,948.380	
ST JAMES'S PLACE PLC	40,884	9.292	379,894.120	
SSE PLC	84,479	10.500	887,029.500	
BP PLC	1,563,718	5.091	7,960,888.330	
SHIRE PLC	72,222	45.000	3,249,990.000	
SAGE GROUP PLC(THE)	85,271	5.780	492,866.380	
SMITHS GROUP PLC	31,720	13.400	425,048.000	
STANDARD CHARTERED PLC	234,243	5.805	1,359,780.610	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	5,416,024	0.528	2,859,660.670	
TAYLOR WIMPLEY PLC	253,022	1.293	327,157.440	
TESCO PLC	804,334	1.964	1,579,711.970	
3I GROUP PLC	64,546	7.804	503,716.980	
SMITH & NEPHEW PLC	66,155	14.610	966,524.550	
GLAXOSMITHKLINE PLC	387,158	14.696	5,689,673.960	
WEIR GROUP	18,336	13.390	245,519.040	

LONDON STOCK EXCHANGE PLC	26,266	38.670	1,015,706.220	
BABCOCK INT'L GROUP	21,302	5.148	109,662.690	
WPP PLC	107,494	8.050	865,326.700	
FERGUSON PLC	17,278	48.095	830,985.410	
ASTRAZENECA PLC	99,758	60.070	5,992,463.060	
WHITBREAD PLC	15,639	43.760	684,362.640	
CARNIVAL PLC	13,153	43.050	566,236.650	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	120,290	2.758	331,759.820	
JOHN WOOD GROUP PLC	48,988	6.136	300,590.360	
INTERTEK GROUP PLC	14,335	45.570	653,245.950	
BURBERRY GROUP PLC	29,893	16.960	506,985.280	
INVESTEC PLC	50,655	4.298	217,715.190	
INTERCONTINENTAL HOTELS	15,922	41.260	656,941.720	
ITV PLC	247,210	1.260	311,484.600	
SAINSBURY (J) PLC	137,215	2.945	404,098.170	
RANDGOLD RESOURCES LTD NPR	6,998	70.200	491,259.600	
G4S PLC	122,250	1.758	214,915.500	
ADMIRAL GROUP PLC	15,893	19.955	317,144.810	
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	10,726	32.300	346,449.800	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	359,606	23.170	8,332,071.020	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	296,454	23.270	6,898,484.580	
TUI AG-DI	45,043	10.970	494,121.710	
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	214,715	2.292	492,126.780	
EXPERIAN PLC	71,068	18.470	1,312,625.960	
MONDI PLC	28,318	16.250	460,167.500	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	21,290	18.185	387,158.650	
FRESNILLO PLC NPR	15,639	8.028	125,549.890	
INFORMA PLC	102,475	6.486	664,652.850	
GLENCORE PLC	929,853	2.745	2,552,446.480	
GVC HOLDINGS PLC	49,618	6.295	312,345.310	
NMC HEALTH PLC	8,149	31.380	255,715.620	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP PLC	112,694	3.072	346,195.960	
COCA-COLA HBC AG	13,406	23.800	319,062.800	
CONVATEC GROUP PLC	118,400	1.473	174,403.200	
ROYAL MAIL PLC	55,060	2.968	163,418.080	
MERLIN ENTERTAINMENTS PLC	50,037	3.208	160,518.690	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC-C	5,380,436	0.001	5,380.430	
MICRO FOCUS INTERNATIONAL PLC	32,342	14.610	472,516.620	

	AUTO TRADER GROUP PLC	76,348	4.257	325,013.430	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	417,620	1.463	610,978.060	
イギリス・ポンド	小計	29,012,879		134,051,037.410 (19,041,949,864)	
イスラエル・シュケル	BANK HAPOALIM BM	78,428	24.450	1,917,564.600	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	103,061	23.440	2,415,749.840	
	BEZEQ ISRAELI TELECOMMUNICATION CORP LTD	188,230	3.985	750,096.550	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,760	456.400	803,264.000	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	49,411	21.170	1,046,030.870	
	NICE LTD	4,035	420.700	1,697,524.500	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	10,444	66.510	694,630.440	
	AZRIELI GROUP	4,428	190.800	844,862.400	
イスラエル・シュケル	小計	439,797		10,169,723.200 (307,125,641)	
オーストラリア・ドル	RAMSAY HEALTH CARE LTD	11,115	53.450	594,096.750	
	AUST AND NZ BANKING GROUP LT	239,374	24.640	5,898,175.360	
	AMCOR LTD	110,142	13.250	1,459,381.500	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	270,531	24.860	6,725,400.660	
	BANK OF QUEENSLAND LTD	30,569	9.430	288,265.670	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	114,125	4.070	464,488.750	
	TELSTRA CORP LTD	272,919	3.040	829,673.760	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD	39,014	10.360	404,185.040	
	AMP LTD	200,498	2.280	457,135.440	
	ASX LTD	15,573	58.590	912,422.070	
	BHP BILLITON LTD	255,718	31.290	8,001,416.220	
	CALTEX AUSTRALIA LTD	20,946	26.830	561,981.180	
	HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	22,182	3.150	69,873.300	
	COMPUTERSHARE LT	38,040	16.750	637,170.000	
	CSL LIMITED	35,919	176.640	6,344,732.160	
	REA GROUP LTD	4,119	71.860	295,991.340	
	TRANSURBAN GROUP	223,354	11.770	2,628,876.580	
	COCA-COLA AMATIL LTD	48,601	8.420	409,220.420	
	COCHLEAR LTD	6,524	165.730	1,081,222.520	
	ORIGIN ENERGY LTD	121,721	6.860	835,006.060	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	138,412	68.270	9,449,387.240	
	BORAL LIMITED	86,101	4.890	421,033.890	
	RIO TINTO LIMITED	28,979	71.950	2,085,039.050	
APA GROUP	116,193	8.800	1,022,498.400		
ARISTOCRAT LEISU	43,933	21.910	962,572.030		

INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	167,355	6.890	1,153,075.950		
TPG TELECOM LTD	28,719	7.360	211,371.840		
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	3,275	45.020	147,440.500		
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	28,489	15.330	436,736.370		
ORICA LTD	25,308	16.870	426,945.960		
CIMIC GROUP LTD	8,709	39.780	346,444.020		
BLUESCOPE STEEL LTD	36,941	11.500	424,821.500		
SYDNEY AIRPORT	85,130	7.080	602,720.400		
MACQUARIE GROUP LTD	28,250	109.890	3,104,392.500		
WORLEYPARSONS LTD	13,000	12.390	161,070.000		
SUNCORP GROUP LTD	124,185	12.990	1,613,163.150		
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	217,098	23.390	5,077,922.220		
NEWCREST MINING LTD	59,818	21.300	1,274,123.400		
OIL SEARCH LTD	138,806	7.330	1,017,447.980		
INCITEC PIVOT LTD	136,426	3.550	484,312.300		
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	129,436	10.390	1,344,840.040		
CHALLENGER FINANCIAL SERVICES	45,707	9.350	427,360.450		
SANTOS LTD	133,862	5.690	761,674.780		
SONIC HEALTHCARE	43,041	21.640	931,407.240		
WASHINGTON H SOUL PATTINSON & CO LTD	5,000	26.010	130,050.000		
TABCORP HOLDINGS LTD	126,348	4.260	538,242.480		
WESFARMERS LTD	96,821	31.000	3,001,451.000		
ALUMINA LIMITED	184,613	2.180	402,456.340		
WOODSIDE PETROLEUM LTD	79,115	31.100	2,460,476.500		
WOOLWORTHS GROUP LTD	99,142	28.740	2,849,341.080		
SEEK LTD	25,899	16.390	424,484.610		
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES LTD	4,581	43.330	198,494.730		
AUSNET SERVICES	165,066	1.585	261,629.610		
AGL ENERGY LTD	46,315	19.470	901,753.050		
BRAMBLES LTD	115,255	10.050	1,158,312.750		
CROWN RESORTS LTD	32,861	11.540	379,215.940		
AURIZON HOLDINGS LTD	139,184	4.360	606,842.240		
TREASURY WINE ESTATES LTD	50,789	13.750	698,348.750		
MEDIBANK PVT LTD	177,176	2.350	416,363.600		
SOUTH32 LTD(AUD)	367,057	3.040	1,115,853.280		
COLES GROUP LTD	96,821	12.490	1,209,294.290		
オーストラリア・ドル 小計	5,760,200		89,539,126.240 (7,277,740,180)		
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	20,281	52.640	1,067,591.840	

ALIMENTATION COUCHE TARD INC	36,030	66.880	2,409,686.400	
BARRICK GOLD CORP	96,442	18.550	1,788,999.100	
ATCO LTD	7,193	40.790	293,402.470	
BANK OF MONTREAL	51,533	92.160	4,749,281.280	
BANK OF NOVA SCOTIA	96,922	71.830	6,961,907.260	
NATIONAL BANK OF CANADA	26,741	58.790	1,572,103.390	
BCE INC	11,568	56.710	656,021.280	
BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT	64,375	55.830	3,594,056.250	
BAUSCH HEALTH COS INC	25,819	30.650	791,352.350	
BOMBARDIER INC 'B'	151,615	2.100	318,391.500	
SAPUTO INC	18,601	40.580	754,828.580	
BLACKBERRY LTD	39,652	10.610	420,707.720	
CGI GROUP INC	19,367	84.160	1,629,926.720	
CCL INDUSTRIES INC	11,340	54.350	616,329.000	
CAE INC	23,000	25.790	593,170.000	
CAMECO CORP	32,627	15.680	511,591.360	
ROGERS COMM-CL B	30,822	70.520	2,173,567.440	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	32,855	106.770	3,507,928.350	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	101,994	35.980	3,669,744.120	
CANADIAN TIRE CORP-CL A	4,862	143.510	697,745.620	
CANADIAN UTILITIES LTD	9,119	32.540	296,732.260	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	58,464	105.400	6,162,105.600	
FIRST CAPITAL REALTY INC	11,417	19.890	227,084.130	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	13,543	43.450	588,443.350	
OPEN TEXT CORP	19,756	44.730	883,685.880	
EMPIRE CO LTD	15,093	25.510	385,022.430	
KINROSS GOLD CORP	99,741	3.840	383,005.440	
FINNING INTERNATIONAL INC	9,892	24.540	242,749.680	
FORTIS INC	33,302	46.580	1,551,207.160	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	55,296	11.860	655,810.560	
TELUS CORP	15,945	46.780	745,907.100	
GREAT WEST LIFECO INC	19,248	28.650	551,455.200	
IMPERIAL OIL LTD	21,542	36.500	786,283.000	
ENBRIDGE INC	147,898	42.090	6,225,026.820	
IGM FINANCIAL INC	8,426	33.590	283,029.340	
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	87,995	2.340	205,908.300	
MANULIFE FINANCIAL CORP	163,105	20.040	3,268,624.200	
LOBLAW CO LTD	15,354	62.340	957,168.360	
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANCE AND FINANCIAL SERVICES INC	6,126	44.560	272,974.560	
MAGNA INTERNATIONAL INC	28,590	59.630	1,704,821.700	

SUN LIFE FINANCIAL INC	43,277	45.410	1,965,208.570	
FAIRFAX FINANCIAL HDGS LTD	2,419	610.200	1,476,073.800	
METRO INC	19,226	46.670	897,277.420	
HUSKY ENERGY INC	28,749	15.750	452,796.750	
EMERA INC	6,509	44.780	291,473.020	
METHANEX CORP	5,281	70.840	374,106.040	
ONEX CORP	6,646	77.830	517,258.180	
GOLDCORP INC	66,602	12.880	857,833.760	
POWER CORP OF CANADA	25,052	24.840	622,291.680	
POWER FINANCIAL CORP	17,484	26.700	466,822.800	
ROYAL BANK OF CANADA	110,900	94.090	10,434,581.000	
SNC-LAVALIN GROUP INC	13,134	46.570	611,650.380	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	11,916	255.130	3,040,129.080	
SHAW COMM INC-B	35,748	24.870	889,052.760	
SUNCOR ENERGY INC	130,238	41.750	5,437,436.500	
LUNDIN MINING CORP	35,268	5.710	201,380.280	
ENCANA CORP	87,517	8.350	730,766.950	
TECK RESOURCES LTD-CL B	41,016	28.220	1,157,471.520	
THOMSON REUTERS CORP	15,772	67.420	1,063,348.240	
TORONTO DOMINION BANK (THE) C\$	141,848	69.550	9,865,528.400	
TRANSCANADA CORP	68,648	52.750	3,621,182.000	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	5,696	65.830	374,967.680	
WESTON (GEORGE) LTD	4,252	95.280	405,130.560	
INTACT FINANCIAL CORP	10,785	101.500	1,094,677.500	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	33,943	21.930	744,369.990	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,729	910.710	1,574,617.590	
FRANCO-NEVADA CORP NPR	14,687	95.440	1,401,727.280	
CI FINANCIAL CORP	20,695	18.440	381,615.800	
TOURMALINE OIL CORP	15,779	17.000	268,243.000	
KEYERA CORP	13,728	27.690	380,128.320	
ALTAGAS LTD	23,944	13.740	328,990.560	
PEMBINA PIPELINE CORP	43,784	43.050	1,884,901.200	
DOLLARAMA INC	28,295	31.850	901,195.750	
STARS GROUP INC	8,000	23.250	186,000.000	
CENOVUS ENERGY INC W/I	80,545	10.040	808,671.800	
VERMILION ENERGY INC	12,923	30.490	394,022.270	
ARC RESOURCES LTD	22,997	8.680	199,613.960	
INTER PIPELINE LTD	25,429	20.500	521,294.500	
NUTRIEN LTD	50,076	65.490	3,279,477.240	
WSP GLOBAL INC	8,400	60.980	512,232.000	
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	14,961	16.370	244,911.570	
SEVEN GENERATIONS ENERGY LTD	17,231	9.270	159,731.370	

	RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	20,664	72.060	1,489,047.840	
	AURORA CANNABIS INC	50,000	7.670	383,500.000	
	SHOPIFY INC	6,500	203.230	1,320,995.000	
	CANOPY GROWTH CORP	15,000	41.700	625,500.000	
	HYDRO ONE LTD	27,340	21.180	579,061.200	
カナダ・ドル 小計		3,234,124		130,573,670.210 (11,012,583,344)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE TECH ENG	125,000	3.440	430,000.000	
	SEMBCORP INDUSTRIES	81,400	2.600	211,640.000	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	123,700	2.470	305,539.000	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	692,140	0.255	176,495.700	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	134,800	23.800	3,208,240.000	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	29,000	8.420	244,180.000	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	5,944	34.900	207,445.600	
	SINGAPORE AIRPORT TERMINAL SERVICES LTD	42,300	4.610	195,003.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	68,900	7.030	484,367.000	
	CAPITALAND LTD	192,415	3.150	606,107.250	
	GENTING SINGAPORE LTD	416,400	0.970	403,908.000	
	KEPPEL CORP LTD	168,400	6.090	1,025,556.000	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	177,900	2.110	375,369.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	267,053	11.070	2,956,276.710	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	591,922	3.060	1,811,281.320	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	47,500	9.290	441,275.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	110,800	24.640	2,730,112.000	
	UOL GROUP LIMITED	40,500	6.150	249,075.000	
VENTURE CORP LTD	21,000	14.660	307,860.000		
WILMAR INTERNATIONAL LTD	142,300	3.140	446,822.000		
YANGZIJANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	188,800	1.220	230,336.000		
シンガポール・ドル 小計		3,668,174		17,046,888.580 (1,403,299,868)	
スイス・フラン	CREDIT SUISSE GROUP AG	189,999	10.815	2,054,839.180	
	NESTLE SA-REGISTERED	241,421	83.080	20,057,256.680	
	CIE FINANC RICHEMONT	42,886	62.120	2,664,078.320	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	55,283	247.250	13,668,721.750	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,607	192.000	692,544.000	
	SIKA INHABER	11,291	119.700	1,351,532.700	
	SGS SA-REG	405	2,292.000	928,260.000	
	NOVARTIS AG-REG SHS	170,812	84.920	14,505,355.040	
	BALOISE HOLDING AG -R	4,127	137.500	567,462.500	

BARRY CALLEBAUT AG	144	1,600.000	230,400.000	
CLARIANT AG-REG	19,496	18.430	359,311.280	
SWISSCOM AG-REG	1,712	466.100	797,963.200	
ABB LTD	150,930	18.615	2,809,561.950	
ADECCO GROUP AG-REG	12,341	45.060	556,085.460	
GEBERIT AG	3,243	373.000	1,209,639.000	
LONZA GROUP AG-REG	6,228	299.300	1,864,040.400	
LINDT & SPRUENGLI PART	75	6,590.000	494,250.000	
LINDT & SPRUENGLI NAMEN	9	78,100.000	702,900.000	
GIVAUDAN-REG	771	2,362.000	1,821,102.000	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	12,237	294.500	3,603,796.500	
LAFARGEHOLCIM LTD	40,615	40.780	1,656,279.700	
TEMENOS GROUP	4,521	116.300	525,792.300	
SONOVA HOLDING AG	4,142	158.750	657,542.500	
KUEHNE & NAGEL INTL AG	5,105	132.250	675,136.250	
STRAUMANN HOLDING AG	782	630.000	492,660.000	
THE SWATCH GROUP AG-B	2,311	281.400	650,315.400	
THE SWATCH GROUP AG-REG	4,592	55.050	252,789.600	
SCHINDLER NAMEN	1,663	184.800	307,322.400	
SWISS LIFE HOLDING AG	2,614	374.200	978,158.800	
VIFOR PHARMA AG	3,050	119.600	364,780.000	
EMS-CHEMIE HOLDING	553	496.800	274,730.400	
SWISS PRIME SITE AG	5,990	80.850	484,291.500	
PARGESA HOLDING PORTEUR	3,000	66.800	200,400.000	
DUFREY GROUP	2,390	95.020	227,097.800	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,505	611.500	920,307.500	
JULIUS BAER GROUP LTD	17,849	35.560	634,710.440	
SWISS RE LTD	22,592	87.440	1,975,444.480	
UBS GROUP AG	307,020	12.165	3,734,898.300	
スイス・フラン 小計	1,357,311		85,951,757.330 (9,823,426,345)	
スウェーデン・ク ローナ				
ATLAS COPCO AB-A SHS	57,191	205.650	11,761,329.150	
ATLAS COPCO AB-B SHS	30,899	192.080	5,935,079.920	
ERICSSON LM-B SHS	251,529	78.660	19,785,271.140	
LUNDBERGS B	7,382	256.200	1,891,268.400	
SKF AB-B SHS	24,866	127.500	3,170,415.000	
SANDVIK AB	85,032	123.050	10,463,187.600	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	128,935	89.100	11,488,108.500	
SKANSKA AB-B SHS	32,547	134.850	4,388,962.950	
SWEDBANK AB	74,223	201.400	14,948,512.200	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	108,661	96.020	10,433,629.220	
VOLVO AB-B SHS	129,013	114.700	14,797,791.100	
SWEDISH MATCH AB	16,488	364.700	6,013,173.600	
TELE2 AB-B SHS	44,876	110.500	4,958,798.000	

	INDUSTRI VARDEN C	11,403	177.100	2,019,471.300	
	ELECTROLUX AB-SER B	19,191	191.100	3,667,400.100	
	SECURITAS AB-B SHS	24,098	144.750	3,488,185.500	
	INVESTOR AB-B SHS	37,657	373.100	14,049,826.700	
	HENNES&MAURITZ AB-B SHS	66,448	158.100	10,505,428.800	
	ASSA ABLOY AB-B	77,223	160.700	12,409,736.100	
	TELIA CO AB	216,239	41.530	8,980,405.670	
	LUNDIN PETROLEUM AB	16,790	228.700	3,839,873.000	
	BOLIDEN AB	21,855	189.920	4,150,701.600	
	ALFA LAVAL AB	23,343	190.350	4,443,340.050	
	KINNEVIK AB-B	18,310	216.500	3,964,115.000	
	MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR SA	5,332	532.500	2,839,290.000	
	ICA GRUPPEN AB	5,920	327.500	1,938,800.000	
	HUSQVARNA AB-B SHS	33,692	63.580	2,142,137.360	
	HEXAGON AB	22,037	413.900	9,121,114.300	
	EPIROC AB-A	48,377	74.010	3,580,381.770	
	EPIROC AB-B	30,899	71.390	2,205,879.610	
	ESSITY AB-B	46,071	224.800	10,356,760.800	
	NORDEA BANK ABP	247,034	76.990	19,019,147.660	
スウェーデン・クローナ 小計		1,963,561		242,757,522.100 (3,019,903,575)	
デンマーク・ク ローネ	CARLSBERG AS-B	9,644	711.200	6,858,812.800	
	A P MOLLER A/S	604	8,574.000	5,178,696.000	
	AP MOLLER MAERSK A	273	8,030.000	2,192,190.000	
	DANSKE BANK A/S	61,114	137.350	8,394,007.900	
	GENMAB A/S	4,613	1,025.000	4,728,325.000	
	NOVOZYMES-B SHS	19,111	297.100	5,677,878.100	
	NOVO NORDISK A/S-B	142,581	299.850	42,752,912.850	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	15,808	487.500	7,706,400.000	
	COLOPLAST-B	9,195	633.000	5,820,435.000	
	DSV A/S	14,452	492.700	7,120,500.400	
	WILLIAM DEMANT	6,537	199.500	1,304,131.500	
	H LUNDBECK A/S	4,840	266.800	1,291,312.000	
	TRYG A/S	11,107	161.300	1,791,559.100	
	PANDORA A/S	8,251	333.300	2,750,058.300	
	CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S	7,708	590.000	4,547,720.000	
	ISS A/S	16,240	185.550	3,013,332.000	
	ORSTED A/S	15,020	435.400	6,539,708.000	
デンマーク・クローネ 小計		347,098		117,667,978.950 (2,025,065,918)	
ニュージーラン ド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	71,110	7.100	504,881.000	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	29,894	11.250	336,307.500	
	A2 MILK CO LTD	55,091	10.570	582,311.870	
	FISHER & PAYKEL	42,678	12.250	522,805.500	
	FLETCHER BUILDING LTD	64,104	4.560	292,314.240	

	SPARK NEW ZEALAND LTD	159,623	4.270	681,590.210	
	MERIDIAN ENERGY LTD	90,173	3.220	290,357.060	
ニュージーランド・ドル 小計		512,673		3,210,567.380 (249,557,403)	
ノルウェー・クローネ	MARINE HARVEST	33,000	187.100	6,174,300.000	
	DNB ASA	79,783	145.750	11,628,372.250	
	NORSK HYDRO ASA	91,879	39.020	3,585,118.580	
	TELENOR ASA	62,076	163.350	10,140,114.600	
	ORKLA ASA	61,421	67.780	4,163,115.380	
	EQUINOR ASA	85,927	196.600	16,893,248.200	
	YARA INTERNATIONAL ASA	16,000	332.000	5,312,000.000	
	AKER BP ASA	8,552	241.000	2,061,032.000	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	16,683	129.500	2,160,448.500	
	SCHIBSTED ASA	7,445	268.500	1,998,982.500	
ノルウェー・クローネ 小計		462,766		64,116,732.010 (846,982,030)	
ユーロ	CRH PLC	71,394	22.020	1,572,095.880	
	PADDY POWER BETFAIR PLC	6,246	69.350	433,160.100	
	KERRY GROUP PLC-A	13,865	89.000	1,233,985.000	
	KINGSPAN GROUP PLC	3,296	35.940	118,458.240	
	UMICORE	15,320	34.410	527,161.200	
	AIR LIQUIDE	32,561	105.350	3,430,301.350	
	AIRBUS SE	47,562	87.490	4,161,199.380	
	AXA	158,512	19.360	3,068,792.320	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	39,913	17.595	702,269.230	
	ADIDAS AG	15,468	192.800	2,982,230.400	
	ASSICURAZIONI GENERALI	88,233	14.175	1,250,702.770	
	DASSAULT AVIATION SA	157	1,237.000	194,209.000	
	DANONE	50,307	62.970	3,167,831.790	
	SAFRAN SA	27,473	102.550	2,817,356.150	
	INTESA SANPAOLO	1,154,726	1.939	2,239,013.710	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	23,789	70.100	1,667,608.900	
	ACCOR SA	16,000	36.740	587,840.000	
	BOUYGUES	16,412	32.080	526,496.960	
	BNP PARIBAS	89,099	40.400	3,599,599.600	
	THALES SA	8,128	102.100	829,868.800	
	CAPGEMINI SA	13,759	94.000	1,293,346.000	
	CASINO GUICHARD PERRACHON	4,264	35.490	151,329.360	
	INGENICO GROUP	4,334	56.460	244,697.640	
	UNICREDIT SPA	170,144	10.646	1,811,353.020	
	NATIXIS	70,166	4.440	311,537.040	
	KONINKLIJKE DSM NV	15,111	73.980	1,117,911.780	
	COMMERZBANK AG	83,118	6.610	549,409.980	
EIFFAGE	5,949	74.600	443,795.400		
FRESENIUS SE & CO KGAA	34,640	39.880	1,381,443.200		

UNITED INTERNET	9,882	36.850	364,151.700	
FUCHS PETROLUB SE PREF	5,546	34.780	192,889.880	
PUBLICIS GROUPE	18,222	48.260	879,393.720	
FAURECIA	6,117	30.150	184,427.550	
IBERDROLA SA	483,541	6.566	3,174,930.200	
ENI SPA	208,385	13.940	2,904,886.900	
IMERYS SA	2,256	43.440	98,000.640	
JERONIMO MARTINS	19,517	10.580	206,489.860	
KBC GROUPE	20,803	58.960	1,226,544.880	
HANNOVER RUECK SE	4,868	116.700	568,095.600	
WARTSILA OYJ	34,935	13.560	473,718.600	
L'OREAL	20,735	206.500	4,281,777.500	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	21,833	243.250	5,310,877.250	
GEA GROUP AG	11,838	22.070	261,264.660	
BOLLORE	71,347	3.562	254,138.010	
MEDIOBANCA SPA	42,404	7.320	310,397.280	
MICHELIN(CGDE)-B	15,018	85.160	1,278,932.880	
CONTINENTAL AG	9,528	121.800	1,160,510.400	
DEUTSCHE POST AG-REG	81,561	25.520	2,081,436.720	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	14,426	12.315	177,656.190	
NOKIAN RENKAAT OYJ	9,399	26.450	248,603.550	
AXEL SPRINGER SE	3,067	51.600	158,257.200	
OMV AG	12,817	41.440	531,136.480	
VERBUND AG	3,000	36.020	108,060.000	
PERNOD-RICARD	17,210	137.450	2,365,514.500	
PEUGEOT SA	50,087	17.200	861,496.400	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG- PFD	13,249	51.920	687,888.080	
RENAULT SA	14,378	55.280	794,815.840	
REPSOL SA	113,583	14.400	1,635,595.200	
REMY COINTREAU	1,860	99.950	185,907.000	
MERCK KGAA	11,193	95.600	1,070,050.800	
COMPAGNIE DE SAINT- GOBAIN	35,748	29.550	1,056,353.400	
RWE AG	39,183	18.405	721,163.110	
SEB SA	1,405	116.400	163,542.000	
SOCIETE GENERALE-A	63,145	29.525	1,864,356.120	
VINCI S.A.	40,569	71.660	2,907,174.540	
SODEXO	8,639	88.520	764,724.280	
SOLVAY SA	5,091	87.540	445,666.140	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	44,923	61.060	2,742,998.380	
VIVENDI SA	86,200	20.930	1,804,166.000	
SAP SE	77,375	88.460	6,844,592.500	
TELEFONICA S.A	354,109	7.567	2,679,542.800	
TOTAL SA	186,773	47.340	8,841,833.820	
VALEO	17,731	24.250	429,976.750	
E.ON SE	181,272	8.694	1,575,978.760	

VOEST-ALPINE AG	9,875	26.200	258,725.000	
HENKEL AG & CO KGAA	7,858	87.900	690,718.200	
SIEMENS AG-REG	59,840	96.960	5,802,086.400	
UPM-KYMMENE OYJ	41,197	22.080	909,629.760	
ING GROEP NV-CVA	298,029	9.829	2,929,327.040	
PUMA AG	600	444.500	266,700.000	
BAYER AG	76,137	60.800	4,629,129.600	
STORA ENSO OYJ-R SHS	42,303	10.355	438,047.560	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	15,350	98.260	1,508,291.000	
DAIMLER AG	68,276	45.470	3,104,509.720	
BASF SE	70,061	58.400	4,091,562.400	
BEIERSDORF AG	8,371	92.580	774,987.180	
HOCHTIEF AG	1,707	115.400	196,987.800	
HEIDELBERGCEMENT AG	11,009	53.460	588,541.140	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	18,494	61.820	1,143,299.080	
ORANGE	160,420	14.495	2,325,287.900	
SAMPO OYJ-A SHS	36,209	37.610	1,361,820.490	
RANDSTAD NV	7,794	38.710	301,705.740	
ALLIANZ SE	33,747	173.780	5,864,553.660	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	189,631	3.056	579,512.330	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	102,303	22.000	2,250,666.000	
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	17,602	15.945	280,663.890	
HERMES INTL	2,703	472.300	1,276,626.900	
ENDESA S.A.	21,037	20.160	424,105.920	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	15,963	18.950	302,498.850	
ERSTE GROUP BANK AG	25,117	32.200	808,767.400	
MUENCHENER RUECKVER AG- REG	12,314	185.100	2,279,321.400	
ARCELOR MITTAL (NL)	58,189	18.570	1,080,569.730	
SOCIETE BIC SA	2,478	87.500	216,825.000	
DASSAULT SYSTEMES SA	10,913	103.450	1,128,949.850	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	19,033	31.450	598,587.850	
HEINEKEN NV	20,425	77.640	1,585,797.000	
AKZO NOBEL	21,135	70.400	1,487,904.000	
ASML HOLDING NV	33,271	140.640	4,679,233.440	
AEGON NV	150,349	4.357	655,070.590	
BANKINTER S.A.	57,960	7.054	408,849.840	
VOLKSWAGEN AG	2,329	139.100	323,963.900	
VOLKSWAGEN AG PFD	15,382	140.980	2,168,554.360	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	546,038	4.575	2,498,123.850	
KERING	6,164	389.300	2,399,645.200	
CNP ASSURANCES	13,987	18.900	264,354.300	
FORTUM OYJ	37,452	18.160	680,128.320	
AGEAS	12,993	39.950	519,070.350	

UCB SA	11,267	75.880	854,939.960	
THYSSENKRUPP AG	37,894	15.480	586,599.120	
UNILEVER NV-CVA	120,235	48.380	5,816,969.300	
CARREFOUR SA	51,094	14.670	749,548.980	
NATURGY ENERGY GROUP SA	29,010	22.170	643,151.700	
ATOS SE	7,050	66.500	468,825.000	
NOKIA OYJ	464,181	4.952	2,298,624.310	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	77,543	31.855	2,470,132.260	
WOLTERS KLUWER-CVA	21,935	52.100	1,142,813.500	
SANOFI	88,785	76.910	6,828,454.350	
STMICROELECTRONICS NV	50,879	11.645	592,485.950	
ELISA OYJ	9,517	35.980	342,421.660	
BANCO SANTANDER SA	1,258,657	3.873	4,874,778.560	
METSO OYJ	8,585	22.390	192,218.150	
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	34,596	19.390	670,816.440	
QIAGEN N.V.	17,387	30.720	534,128.640	
1&1 DRILLISCH AG	3,149	42.600	134,147.400	
DEUTSCHE BANK AG-REG	149,460	7.277	1,087,620.420	
BMW VORZUG	4,116	62.050	255,397.800	
ENEL SPA	674,493	4.742	3,198,445.800	
COLRUYT NV	4,673	57.400	268,230.200	
VOPAK (KON.)	5,364	38.850	208,391.400	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	263,620	14.985	3,950,345.700	
SARTORIUS AG	2,712	109.700	297,506.400	
LEONARDO SPA	26,269	8.054	211,570.520	
UBISOFT ENTERTAINMENT	5,911	68.020	402,066.220	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	99,068	17.635	1,747,064.180	
KONINKLIJKE KPN NV	291,029	2.567	747,071.440	
EUROFINS SCIENTIFIC	794	323.400	256,779.600	
TELEPERFORMANCE	4,436	139.100	617,047.600	
DEUTSCHE BOERSE AG	15,641	110.350	1,725,984.350	
EURAZEO	4,725	62.100	293,422.500	
BANCO SABADELL	563,371	1.028	579,145.380	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	5,814	74.700	434,305.800	
FRAPORT AG	3,149	64.160	202,039.840	
HEINEKEN HOLDING NV-A	9,791	74.550	729,919.050	
INDITEX	90,509	26.610	2,408,444.490	
JC DECAUX SA	6,058	25.840	156,538.720	
ANDRITZ AG	6,265	39.160	245,337.400	
MAPFRE SA	84,474	2.365	199,781.010	
ESSILORLUXOTTICA	19,354	109.300	2,115,392.200	
SNAM SPA	158,419	3.912	619,735.120	
CREDIT AGRICOLE SA	85,585	9.890	846,435.650	
ENAGAS	18,095	24.190	437,718.050	
WENDEL	2,220	101.000	224,220.000	
WIRECARD AG	9,891	132.450	1,310,062.950	
TENARIS SA	36,959	10.000	369,590.000	

TELECOM ITALIA SPA	792,163	0.548	434,105.320	
TELECOM ITALIA-RNC	497,596	0.468	232,874.920	
ATLANTIA SPA	34,969	17.540	613,356.260	
ILIAD SA	2,102	120.250	252,765.500	
PROXIMUS	14,283	22.550	322,081.650	
SES FDR	24,585	17.420	428,270.700	
TERNA SPA	112,686	4.933	555,880.030	
BIOMERIEUX	3,248	61.000	198,128.000	
GRIFOLS SA	23,518	23.580	554,554.440	
FERROVIAL SA	37,657	17.410	655,608.370	
LANXESS AG	6,856	42.990	294,739.440	
NESTE OYJ	10,840	67.760	734,518.400	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	9,641	23.120	222,899.920	
RECORDATI SPA	6,859	27.940	191,640.460	
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	35,583	7.530	267,939.990	
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	3,960	163.000	645,480.000	
KONE OYJ	24,915	41.490	1,033,723.350	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,000	86.700	86,700.000	
ENGIE	149,944	11.990	1,797,828.560	
ALSTOM	12,046	37.100	446,906.600	
TELENET GROUP HOLDING NV	3,634	39.640	144,051.760	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	12,542	17.550	220,112.100	
ELECTRICITE DE FRANCE	43,198	13.400	578,853.200	
IPSEN SA	2,487	116.350	289,362.450	
DEUTSCHE WOHNEN	26,714	42.170	1,126,529.380	
ARKEMA SA	5,230	76.400	399,572.000	
LEGRAND SA	23,308	49.750	1,159,573.000	
ADP	2,313	161.000	372,393.000	
ORION OYJ	8,051	28.840	232,190.840	
RTL GROUP SA	3,446	46.760	161,134.960	
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	37,921	14.295	542,080.690	
SYMRISE AG	9,628	68.540	659,903.120	
SCOR SE	13,875	40.000	555,000.000	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	17,397	21.260	369,860.220	
REXEL SA	23,245	9.274	215,574.130	
PRYSMIAN SPA	29,418	14.970	440,387.460	
CAIXABANK	297,224	3.300	980,839.200	
BUREAU VERITAS SA	21,480	18.015	386,962.200	
GETLINK	37,646	10.940	411,847.240	
SUEZ SA	25,406	12.330	313,255.980	
AMADEUS IT GROUP SA	36,055	60.260	2,172,674.300	
BRENTNAG AG	12,353	37.450	462,619.850	
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GROUP SA	44,747	6.448	288,528.650	

	EVONIK INDUSTRIES AG	11,575	22.110	255,923.250	
	EDENRED	18,306	31.230	571,696.380	
	BANKIA SA	100,675	2.666	268,399.550	
	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	61,541	3.461	212,993.400	
	HUGO BOSS AG -ORD	5,218	58.760	306,609.680	
	OSRAM LICHT AG	7,017	38.710	271,628.070	
	KION GROUP AG	4,686	45.630	213,822.180	
	VONOVIA SE	40,775	42.580	1,736,199.500	
	BANK OF IRELAND GROUP PLC	73,287	5.185	379,993.090	
	SIEMENS HEALTHINEERS AG	10,000	37.750	377,500.000	
	FERRARI NV	9,503	91.620	870,664.860	
	METRO AG	10,774	12.985	139,900.390	
	CNH INDUSTRIAL NV	78,645	8.198	644,731.710	
	AROUNDTOWN SA	16,815	7.110	119,554.650	
	AIB GROUP PLC	52,322	3.570	186,789.540	
	INNOGY SE-TEMPORARY	9,769	37.195	363,357.950	
	MONCLER SPA	14,353	27.940	401,022.820	
	NN GROUP NV	21,965	34.560	759,110.400	
	ZALANDO SE	6,674	25.440	169,786.560	
	FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	89,977	13.330	1,199,393.410	
	AENA SME SA	5,256	139.600	733,737.600	
	ABN AMRO GROUP NV	34,251	21.030	720,298.530	
	EXOR NV	7,726	49.170	379,887.420	
	COVESTRO AG	14,459	43.350	626,797.650	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	60,448	61.930	3,743,544.640	
	POSTE ITALIANE SPA	40,015	6.494	259,857.410	
	AMUNDI SA	3,894	47.180	183,718.920	
	PIRELLI & C SPA	34,086	5.860	199,743.960	
	UNIPER SE	13,897	22.430	311,709.710	
	DELIVERY HERO SE	7,238	29.560	213,955.280	
	ユーロ 小計	15,487,704		270,000,919.430 (34,684,318,110)	
香港・ドル	ASM PACIFIC TECH	16,600	72.750	1,207,650.000	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	164,000	15.160	2,486,240.000	
	BANK OF EAST ASIA	153,660	25.200	3,872,232.000	
	CLP HOLDINGS LTD	149,500	87.950	13,148,525.000	
	PCCW LTD	331,000	4.640	1,535,840.000	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	49,000	57.950	2,839,550.000	
	HONG KONG EXCHANGES &CLEAR	92,540	225.400	20,858,516.000	
	MTR CORP	118,500	39.600	4,692,600.000	
	HANG LUNG GROUP LTD	63,000	20.850	1,313,550.000	
	HANG SENG BANK LTD	56,000	177.000	9,912,000.000	

HENDERSON LAND DEVELOPMENT	92,228	39.200	3,615,337.600	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	96,500	53.050	5,119,325.000	
(THE) WHARF HOLDINGS LTD	95,750	20.150	1,929,362.500	
HONG KONG & CHINA GAS	837,050	15.880	13,292,354.000	
HYSAN DEVELOPMENT CO	50,000	38.600	1,930,000.000	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	186,000	49.400	9,188,400.000	
KERRY PROPERTIES LTD	33,000	27.850	919,050.000	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	262,000	29.300	7,676,600.000	
NWS HOLDINGS LTD	135,000	15.360	2,073,600.000	
YUE YUEN INDUSTRIAL HOLDINGS	50,500	22.100	1,116,050.000	
NEW WORLD DEVELOPMENT	441,266	10.440	4,606,817.040	
SHANGRI-LA ASIA LTD	104,000	10.940	1,137,760.000	
SINO LAND CO	255,400	13.580	3,468,332.000	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	135,000	111.200	15,012,000.000	
SWIRE PACIFIC LTD A	30,000	81.200	2,436,000.000	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	113,500	43.850	4,976,975.000	
WHEELLOCK & CO LTD	56,000	44.350	2,483,600.000	
MINTH GROUP LTD	44,000	24.850	1,093,400.000	
SJM HOLDINGS LTD	156,000	7.120	1,110,720.000	
WYNN MACAU LTD	124,400	17.980	2,236,712.000	
MGM CHINA HOLDINGS LTD	64,800	13.420	869,616.000	
AIA GROUP LTD	954,627	61.900	59,091,411.300	
HKT TRUST / HKT LTD	282,000	11.840	3,338,880.000	
SANDS CHINA LTD	232,800	34.800	8,101,440.000	
SWIRE PROPERTIES LTD	104,200	27.600	2,875,920.000	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT CO LTD	95,750	47.600	4,557,700.000	
HK ELECTRIC INVESTMENTS & HK ELECTRIC INVESTMENTS LTD	230,000	7.550	1,736,500.000	
WH GROUP LTD	701,500	5.810	4,075,715.000	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	224,832	75.800	17,042,265.600	
CK ASSET HOLDINGS LTD	222,832	55.450	12,356,034.400	
香港・ドル 小計	7,604,735		261,334,580.440 (3,784,124,725)	
合計	93,992,727		296,596,601,963 (296,596,601,963)	

(2) 株式以外の有価証券

平成30年12月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	オーストラリア・ドル	DEXUS	80,596.000	879,302.360	
		GOODMAN GROUP	121,619.000	1,307,404.250	
		GPT GROUP	144,955.000	784,206.550	

		LENLEASE GROUP	60,871.000	709,147.150	
		MIRVAC GROUP	295,783.000	665,511.750	
		SCENTRE GROUP	476,956.000	1,941,210.920	
		STOCKLAND	194,018.000	723,687.140	
		VICINITY CENTRES	270,443.000	738,309.390	
	オーストラリア・ドル	小計	1,645,241.000	7,748,779.510 (629,820,799)	
	シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	200,806.000	514,063.360	
		CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	206,300.000	363,088.000	
		CAPITALAND MALL TRUST	199,000.000	445,760.000	
		SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	192,100.000	341,938.000	
	シンガポール・ドル	小計	798,206.000	1,664,849.360 (137,050,399)	
投資信託受益証券 合計			2,443,447	766,871,198 (766,871,198)	
投資証券	アメリカ・ドル	AGNC INVESTMENT CORP	44,741.000	799,969.080	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	7,197.000	905,094.720	
		AMERICAN TOWER CORP	35,796.000	5,948,937.240	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	110,918.000	1,124,708.520	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	11,353.000	2,128,119.850	
		BOSTON PROPERTIES INC	10,792.000	1,370,368.160	
		BROOKFIELD PROPERTY REIT INC	19,124.000	316,119.720	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	8,062.000	750,249.720	
		CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	32,818.000	3,810,169.800	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	17,035.000	1,982,022.250	
		DUKE REALTY TRUST	23,396.000	665,148.280	
		EQUINIX INC	6,510.000	2,519,890.800	
		EQUITY RESIDENTIAL	29,876.000	2,136,432.760	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	5,024.000	1,319,302.400	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	9,741.000	951,500.880	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	6,000.000	796,800.000	
		HCP INC	39,277.000	1,170,454.600	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	64,001.000	1,159,058.110	
		INVITATION HOMES INC	22,567.000	489,929.570	
		IRON MOUNTAIN INC	19,265.000	654,624.700	
		KIMCO REALTY	32,980.000	553,404.400	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	11,649.000	537,834.330	
		MID AMERICA	10,258.000	1,045,085.040	
		NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	13,649.000	692,277.280	

	PROLOGIS INC	49,313.000	3,251,699.220	
	PUBLIC STORAGE	12,755.000	2,728,804.700	
	REALTY INCOME CORP	22,285.000	1,463,233.100	
	REGENCY CENTERS CORP	11,294.000	724,623.040	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	9,444.000	1,594,808.280	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	25,000.000	4,652,500.000	
	SL GREEN	7,097.000	660,872.640	
	THE MACERICH COMPANY	9,014.000	451,060.560	
	UDR INC	21,658.000	916,566.560	
	VENTAS INC	30,244.000	1,959,508.760	
	VEREIT INC	72,429.000	564,946.200	
	VORNADO REALTY TRUST	12,211.000	856,601.650	
	WELLTOWER INC	31,178.000	2,276,305.780	
	WEYERHAEUSER CO	63,699.000	1,636,427.310	
	WP CAREY INC	12,000.000	840,960.000	
アメリカ・ドル 小計		981,650.000	58,406,420.010 (6,606,350,168)	
イギリス・ポンド	BRITISH LAND CO PLC	71,871.000	390,403.270	
	HAMMERSON PLC	58,616.000	208,731.570	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	59,062.000	483,363.400	
	SEGRO PLC	82,914.000	500,966.380	
イギリス・ポンド 小計		272,463.000	1,583,464.620 (224,931,150)	
カナダ・ドル	H & R REAL ESTATE INVESTMENT	10,748.000	227,535.160	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	9,675.000	237,714.750	
	SMARTCENTRES REIT	2,582.000	82,365.800	
カナダ・ドル 小計		23,005.000	547,615.710 (46,185,909)	
ユーロ	COVIVIO	2,343.000	199,623.600	
	GECINA SA	3,670.000	449,942.000	
	ICADE	2,234.000	149,566.300	
	KLEPIERRE	17,042.000	474,960.540	
	UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	9,963.000	1,425,506.040	
ユーロ 小計		35,252.000	2,699,598.480 (346,790,421)	
香港・ドル	LINK REIT	163,500.000	12,540,450.000	
香港・ドル 小計		163,500.000	12,540,450.000 (181,585,716)	
投資証券 合計		1,475,870	7,405,843,364 (7,405,843,364)	
合計			8,172,714,562 (8,172,714,562)	

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

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入 投資信託 受益証券 時価比率	組入 投資証券 時価比率	有価証券の 合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	株式 596銘柄	65.29%	-%	-%	68.81%
	投資証券 39銘柄	-%	-%	2.12%	
イギリス・ポンド	株式 95銘柄	6.12%	-%	-%	6.32%
	投資証券 4銘柄	-%	-%	0.07%	
イスラエル・シケル	株式 8銘柄	0.10%	-%	-%	0.10%
オーストラリア・ドル	株式 61銘柄	2.34%	-%	-%	2.59%
	投資信託 受益証券 8銘柄	-%	0.20%	-%	
カナダ・ドル	株式 88銘柄	3.54%	-%	-%	3.63%
	投資証券 3銘柄	-%	-%	0.01%	
シンガポール・ドル	株式 21銘柄	0.45%	-%	-%	0.51%
	投資信託 受益証券 4銘柄	-%	0.04%	-%	
スイス・フラン	株式 38銘柄	3.16%	-%	-%	3.22%
スウェーデン・クローナ	株式 32銘柄	0.97%	-%	-%	0.99%
デンマーク・クローネ	株式 17銘柄	0.65%	-%	-%	0.66%
ニュージーランド・ドル	株式 7銘柄	0.08%	-%	-%	0.08%
ノルウェー・クローネ	株式 10銘柄	0.27%	-%	-%	0.28%
ユーロ	株式 237銘柄	11.15%	-%	-%	11.49%
	投資証券 5銘柄	-%	-%	0.11%	
香港・ドル	株式 40銘柄	1.22%	-%	-%	1.30%
	投資証券 1銘柄	-%	-%	0.06%	

(注) 「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

「外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

（単位：円）

科 目	注記 番号	平成30年6月11日現在	平成30年12月11日現在
資産の部			
流動資産			
預金		198,226,266	325,815,955
コール・ローン		50,687,140	425,362,599
投資信託受益証券		5,408,502,119	4,324,122,181
投資証券		47,114,890,486	37,296,193,890
派生商品評価勘定		133,720	13,233
未収入金		48,847,206	144,026,096
未収配当金		39,722,312	39,084,964
流動資産合計		52,861,009,249	42,554,618,918
資産合計		52,861,009,249	42,554,618,918
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		120	249,045
未払金		86,340,758	40,489,869
未払解約金		58,196,000	424,057,000
その他未払費用		510	-
流動負債合計		144,537,388	464,795,914
負債合計		144,537,388	464,795,914
純資産の部			
元本等			
元本	1	44,350,594,689	33,888,470,740
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		8,365,877,172	8,201,352,264
元本等合計		52,716,471,861	42,089,823,004
純資産合計		52,716,471,861	42,089,823,004
負債純資産合計		52,861,009,249	42,554,618,918

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	平成30年6月11日現在	平成30年12月11日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	43,966,878,704円	44,350,594,689円
同期中追加設定元本額	21,283,053,504円	23,510,305,162円
同期中一部解約元本額	20,899,337,519円	33,972,429,111円
元本の内訳		
ファンド名		
D I A M先進国RE I Tインデックスファンド<為替ヘッジなし>（ファンドラップ）	244,897,013円	245,728,884円
D I A M先進国RE I Tインデックスファンド<為替ヘッジあり>（ファンドラップ）	90,625,991円	86,793,572円
M I T O ラップ型ファンド（安定型）	5,197,248円	4,172,228円
M I T O ラップ型ファンド（中立型）	21,023,866円	16,225,550円
M I T O ラップ型ファンド（積極型）	39,466,459円	32,145,399円

グローバル8資産ラップファンド(安定型)	32,207,993円	30,410,645円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	46,051,893円	43,636,068円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	41,790,488円	39,542,249円
たわらノーロード 先進国リート	2,175,537,668円	2,992,157,809円
たわらノーロード 先進国リート<ラップ向け>	522,210,280円	592,872,085円
たわらノーロード 先進国リート<為替ヘッジあり>	138,439,636円	136,578,452円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	66,419,832円	167,838,710円
たわらノーロード バランス(堅実型)	400,391円	1,095,387円
たわらノーロード バランス(標準型)	7,905,227円	22,314,656円
たわらノーロード バランス(積極型)	32,636,289円	62,964,320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)	2,719,624円	6,767,021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)	14,541,627円	47,594,670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)	12,446,581円	42,037,959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)	33,563,394円	120,841,006円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	80,728円	124,517円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	881,429円	1,742,332円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	1,042,643円	1,282,078円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	3,534,345円	4,746,314円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	23,851,883円	22,970,248円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	605,308,573円	606,005,036円
マネックス資産設計ファンドエボリューション	64,548,816円	39,383,601円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	31,772,724円	172,886,995円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	104,551,468円	150,229,482円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	226,501,981円	297,809,813円
投資のソムリエ	6,010,068,047円	4,516,947,177円
投資のソムリエ<DC年金>	445,654,770円	405,407,229円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	119,939,477円	124,725,828円

投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	208,844,575円	240,140,544円
ダイナミック・ナビゲーション リスク抑制世界8資産バランス ファンド	282,304円	751,308円
ワールドアセットバランス(基本 コース)	3,795,337,659円	4,271,006,789円
ワールドアセットバランス(リ スク抑制コース)	1,383,436,091円	1,126,268,050円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2045)	5,622,314,658円	2,627,590,304円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2055)	1,637,534円	2,453,589円
リスク抑制世界8資産バランス ファンド(DC)	1,069,966円	1,852,660円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2035)	986,988円	1,461,600円
リスクコントロール世界資産分 散ファンド	2,386,033円	3,909,468円
9資産分散投資・スタンダード <DC年金>	112,763,676円	1,272,960,071円
DIAMパッシブ資産分散ファ ンド	-円	12,333円
DIAM外国リートインデック スファンド<DC年金>	1,192,999,535円	1,063,616,864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)	27,214,851円	32,602,838円
DIAMグローバル 私募ファ ンド(適格機関投資家向け)	1,478,631,738円	539,627,690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)	11,580,328円	11,580,328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)	11,315,005,751円	6,799,349,886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)	2,154,006,440円	593,754,543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)	1,669,544,120円	318,394,409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)	3,647,231,593円	3,386,407,330円
計	559,502,465円	558,752,816円
2. 受益権の総数	44,350,594,689円	33,888,470,740円
	44,350,594,689円	33,888,470,740円

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成29年12月12日 至 平成30年6月11日	自 平成30年6月12日 至 平成30年12月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成30年6月11日現在	平成30年12月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。	同左
2. 時価の算定方法	(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30年6月11日現在	平成30年12月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
投資信託受益証券	39,317,700	47,803,077
投資証券	101,727,959	39,326,002
合計	141,045,659	8,477,075

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成29年6月23日から平成30年6月11日まで及び平成30年6月23日から平成30年12月11日まで）に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	平成30年6月11日 現在				平成30年12月11日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
	市場取引以外の取引							
為替予約取引								
売 建	68,063,600	-	67,930,000	133,600	156,213,433	-	156,447,630	234,197
アメリカ・ドル	50,456,120	-	50,322,400	133,720	64,471,161	-	64,461,300	9,861
イギリス・ボンド	17,607,480	-	17,607,600	120	4,262,016	-	4,261,200	816
オーストラリア・ドル	-	-	-	-	42,303,920	-	42,422,140	118,220
カナダ・ドル	-	-	-	-	1,518,186	-	1,517,940	246
シンガポール・ドル	-	-	-	-	20,198,748	-	20,247,950	49,202
ニュージーランド・ドル	-	-	-	-	2,316,600	-	2,331,600	15,000
ユーロ	-	-	-	-	6,808,252	-	6,807,850	402
香港・ドル	-	-	-	-	14,334,550	-	14,397,650	63,100
買 建	-	-	-	-	3,705,565	-	3,703,950	1,615
シンガポール・ドル	-	-	-	-	3,705,565	-	3,703,950	1,615
合計	68,063,600	-	67,930,000	133,600	159,918,998	-	160,151,580	235,812

(注) 時価の算定方法

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

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

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

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成30年6月11日現在	平成30年12月11日現在
1口当たり純資産額	1,1886円	1,2420円
(1万口当たり純資産額)	(11,886円)	(12,420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12月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	オーストラリア・ドル	ABACUS PROPERTY GROUP	110,264.000	363,871.200	
		ARENA REIT	86,139.000	210,179.160	
		BWP TRUST	163,604.000	600,426.680	
		CHARTER HALL EDUCATION TRUST	74,923.000	221,022.850	
		CHARTER HALL GROUP	154,947.000	1,135,761.510	
		CHARTER HALL LONG WALE REIT	62,982.000	267,673.500	
		CHARTER HALL RETAIL REIT	104,645.000	484,506.350	
		CROMWELL PROPERTY GROUP	557,312.000	560,098.560	
		DEXUS	331,007.000	3,611,286.370	
		GDI PROPERTY GROUP	167,395.000	219,287.450	
		GOODMAN GROUP	526,351.000	5,658,273.250	
		GPT GROUP	588,462.000	3,183,579.420	
		GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA	91,726.000	344,889.760	
		HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD	45,873.000	146,793.600	
		INDUSTRIA REIT	28,737.000	77,015.160	
		INGENIA COMMUNITIES GROUP	72,350.000	218,497.000	
		INVESTA OFFICE FUND	166,842.000	930,978.360	
		MIRVAC GROUP	1,213,994.000	2,731,486.500	
		NATIONAL STORAGE REIT	214,554.000	378,687.810	
		PROPERTYLINK GROUP	137,268.000	162,662.580	
		RURAL FUNDS GROUP	113,861.000	251,632.810	
		SCENTRE GROUP	1,749,533.000	7,120,599.310	
		SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	296,746.000	792,311.820	
STOCKLAND	798,031.000	2,976,655.630			
VICINITY CENTRES	1,053,128.000	2,875,039.440			
VIVA ENERGY REIT	145,646.000	324,790.580			
	オーストラリア・ドル 小計		9,056,320.000	35,848,006.660 (2,913,725,981)	
	カナダ・ドル	KILLAM APARTMENT REIT	12,015.000	203,053.500	
	カナダ・ドル 小計		12,015.000	203,053.500 (17,125,533)	
	シンガポール・ドル	AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL REIT	199,095.000	266,787.300	

	ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	226,300.000	178,777.000	
	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	834,060.000	2,135,193.600	
	ASCOTT RESIDENCE TRUST	412,315.000	445,300.200	
	CACHE LOGISTICS TRUST	374,880.000	262,416.000	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	904,779.000	1,592,411.040	
	CAPITALAND MALL TRUST	882,260.000	1,976,262.400	
	CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST	211,680.000	290,001.600	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	251,400.000	382,128.000	
	ESR REIT	660,430.000	326,912.850	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	304,300.000	184,101.500	
	FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	161,800.000	168,272.000	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	190,900.000	414,253.000	
	FRASERS COMMERCIAL TRUST	231,780.000	322,174.200	
	FRASERS LOGISTICS & INDUSTRIAL TRUST	538,650.000	565,582.500	
	KEPPEL DC REIT	314,800.000	431,276.000	
	KEPPEL REIT	608,700.000	712,179.000	
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST	579,900.000	115,980.000	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	610,000.000	994,300.000	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	418,720.000	787,193.600	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	764,220.000	978,201.600	
	MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL TRUST	708,600.000	800,718.000	
	QUE HOSPITALITY TRUST	347,820.000	236,517.600	
	PARKWAY LIFE REIT	127,700.000	349,898.000	
	SABANA SHARIAH COMP IND REIT	246,100.000	99,670.500	
	SOILBUILD BUSINESS SPACE REIT	206,400.000	121,776.000	
	SPH REIT	184,800.000	184,800.000	
	STARHILL GLOBAL REIT	450,300.000	301,701.000	
	SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	730,490.000	1,300,272.200	
	シンガポール・ドル 小計	12,683,179.000	16,925,056.690 (1,393,270,667)	
	投資信託受益証券 合計	21,751,514	4,324,122,181 (4,324,122,181)	
投資証券	アメリカ・ドル	ACADIA REALTY TRUST	27,291.000	763,602.180

AGREE REALTY CORP	11,564.000	711,301.640	
ALEXANDER'S INC.	1,128.000	352,116.480	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	34,740.000	4,368,902.400	
AMERICAN ASSETS TRUST INC	12,814.000	534,087.520	
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	44,801.000	1,954,667.630	
AMERICAN HOMES 4 RENT	85,469.000	1,782,883.340	
AMERICOLD REALTY TRUST	19,469.000	540,848.820	
APARTMENT INVT & MGMT CO-A	51,600.000	2,425,716.000	
APPLE HOSPITALITY REIT INC	72,222.000	1,116,552.120	
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	28,982.000	135,056.120	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	45,451.000	8,519,789.950	
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH REIT INC	6,494.000	61,433.240	
BOSTON PROPERTIES INC	50,763.000	6,445,885.740	
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	10,659.000	105,097.740	
BRANDYWINE REALTY TRUST	59,741.000	818,451.700	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	100,689.000	1,666,402.950	
BRT APARTMENTS CORP	2,089.000	23,626.590	
CAMDEN PROPERTY TRUST	30,451.000	2,833,770.060	
CARETRUST REIT INC	24,830.000	502,807.500	
CBL & ASSOCIATES	49,465.000	126,630.400	
CEDAR REALTY TRUST INC	30,919.000	109,144.070	
CHATHAM LODGING TRUST	13,591.000	263,665.400	
CHESAPEAKE LODGING TRUST	18,496.000	524,176.640	
CITY OFFICE REIT INC	12,945.000	141,488.850	
CLIPPER REALTY INC	5,169.000	64,147.290	
COLONY CAPITAL INC	163,536.000	979,580.640	
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	39,466.000	826,418.040	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	5,236.000	161,216.440	
CORECIVIC INC	39,648.000	867,894.720	
CORESITE REALTY CORP	12,239.000	1,188,162.120	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	35,028.000	846,276.480	
COUSINS PROPERTIES INC	140,182.000	1,156,501.500	
CUBESMART	60,774.000	1,952,060.880	
CYRUSONE INC	34,204.000	1,973,570.800	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	69,645.000	687,396.150	

DIGITAL REALTY TRUST INC	67,765.000	7,884,457.750	
DOUGLAS EMMETT INC	53,258.000	1,939,123.780	
DUKE REALTY TRUST	117,285.000	3,334,412.550	
EAST GROUP	11,916.000	1,198,749.600	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	18,471.000	338,204.010	
EMPIRE STATE REALTY TRUST INC	45,334.000	724,437.320	
EPR PROPERTIES	24,731.000	1,728,449.590	
EQUITY COMMONWEALTH	40,488.000	1,265,654.880	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	29,239.000	3,020,973.480	
EQUITY RESIDENTIAL	121,105.000	8,660,218.550	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	21,708.000	5,700,520.800	
EXTRA SPACE STORAGE INC	41,549.000	4,058,506.320	
FARMLAND PARTNERS INC	10,419.000	59,492.490	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	24,123.000	3,203,534.400	
FIRST INDUSTRIAL RT	41,971.000	1,327,962.440	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST INC	22,576.000	624,226.400	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	32,718.000	242,440.380	
FRONT YARD RESIDENTIAL CORP	16,441.000	157,998.010	
GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	65,880.000	2,270,224.800	
GEO GROUP INC	40,685.000	936,568.700	
GETTY REALTY CORP	10,231.000	321,355.710	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	8,950.000	169,692.000	
GLADSTONE LAND CORP	3,683.000	49,720.500	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	5,145.000	49,597.800	
GLOBAL NET LEASE INC	25,570.000	508,075.900	
GOVERNMENT PROPERTIES INCOME TRUST	30,325.000	254,730.000	
HCP INC	154,354.000	4,599,749.200	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	41,733.000	1,296,226.980	
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA INC	67,849.000	1,917,412.740	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	11,433.000	211,396.170	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	34,444.000	1,464,903.320	
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	54,726.000	1,411,930.800	

HOST HOTELS & RESORTS INC	243,655.000	4,412,592.050	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	52,143.000	1,627,383.030	
INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	26,857.000	275,821.390	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES TRUST	6,888.000	147,334.320	
INFREIT INC	12,061.000	254,969.540	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES INC	2,897.000	146,269.530	
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	37,552.000	196,772.480	
INVITATION HOMES INC	97,042.000	2,106,781.820	
IRON MOUNTAIN INC	93,924.000	3,191,537.520	
JBG SMITH PROPERTIES	36,061.000	1,379,333.250	
KILROY REALTY CORP	33,002.000	2,287,038.600	
KIMCO REALTY	138,166.000	2,318,425.480	
KITE REALTY GROUP TRUST	25,038.000	414,629.280	
LEXINGTON REALTY TRUST	71,706.000	623,842.200	
LIBERTY PROPERTY TRUST	48,457.000	2,237,259.690	
LIFE STORAGE INC	15,513.000	1,561,538.580	
LTC PROPERTIES INC	13,313.000	585,905.130	
MACK CALI	30,302.000	653,311.120	
MANULIFE US REIT	412,100.000	311,135.500	
MEDEQUITIES REALTY TRUST INC	10,830.000	71,478.000	
MEDICAL PROPERTIES TRUST	119,308.000	2,025,849.840	
MID AMERICA	37,374.000	3,807,663.120	
MONMOUTH RE INVEST CP -CL A	26,786.000	365,361.040	
NATIONAL HEALTH INVS INC	14,072.000	1,129,559.440	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	51,496.000	2,611,877.120	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUST	17,276.000	497,548.800	
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP INC	27,744.000	135,113.280	
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	6,313.000	227,962.430	
NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP	15,308.000	240,488.680	
OMEGA HEALTHCARE INVS INC	65,703.000	2,443,494.570	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	4,095.000	107,248.050	
PARAMOUNT GROUP INC	69,078.000	973,999.800	

PARK HOTELS & RESORTS INC	65,779.000	1,956,267.460	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	43,479.000	1,465,677.090	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	18,579.000	143,801.460	
PHYSICIANS REALTY TRUST	60,757.000	1,071,753.480	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC	42,969.000	782,465.490	
PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES INC	12,292.000	185,732.120	
PROLOGIS INC	207,094.000	13,655,778.360	
PS BUSINESS PARKS	6,667.000	930,913.210	
PUBLIC STORAGE	49,284.000	10,543,818.960	
QTS REALTY TRUST INC	17,108.000	700,230.440	
REALTY INCOME CORP	95,337.000	6,259,827.420	
REGENCY CENTERS CORP	55,634.000	3,569,477.440	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	37,827.000	673,698.870	
RETAIL PROPERTIES OF AMERICA INC	73,381.000	937,809.180	
RETAIL VALUE INC	5,243.000	150,421.670	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	30,487.000	971,010.950	
RLJ LODGING TRUST	58,455.000	1,120,582.350	
RPT REALTY	24,044.000	339,260.840	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	17,104.000	1,245,513.280	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	59,470.000	1,124,577.700	
SAFETY INCOME & GROWTH INC	2,130.000	40,938.600	
SAUL CENTERS INC	3,341.000	175,202.040	
SELECT INCOME REIT	27,361.000	523,142.320	
SENIOR HOUSING PPTYS TRUST	79,299.000	1,060,227.630	
SERITAGE GROWTH PROPERTIES	8,499.000	324,066.870	
SIMON PROPERTY GROUP INC	101,525.000	18,893,802.500	
SITE CENTERS CORP	44,647.000	577,732.180	
SL GREEN	28,399.000	2,644,514.880	
SPIRIT MTA REIT	14,648.000	131,978.480	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	143,002.000	1,085,385.180	
STAG INDUSTRIAL INC	34,909.000	929,626.670	
STORE CAPITAL CORP	60,838.000	1,859,209.280	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	31,227.000	335,377.980	
SUN COMMUNITIES INC	28,340.000	3,064,120.800	

	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	76,128.000	1,098,527.040	
	TANGER FACTORY OUTLET	31,462.000	735,581.560	
	TAUBMAN CENTERS INC	20,356.000	1,068,486.440	
	TERRENO REALTY CORP	19,566.000	750,160.440	
	THE MACERICH COMPANY	35,184.000	1,760,607.360	
	TIER REIT INC	16,100.000	371,427.000	
	UDR INC	87,895.000	3,719,716.400	
	UMH PROPERTIES INC	9,749.000	126,152.060	
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	3,739.000	264,048.180	
	URBAN EDGE PROPERTIES	38,202.000	720,107.700	
	URSTADT BIDDLE PROPERTIES	9,368.000	196,353.280	
	VENTAS INC	117,192.000	7,592,869.680	
	VEREIT INC	317,304.000	2,474,971.200	
	VICI PROPERTIES INC	116,802.000	2,443,497.840	
	VORNADO REALTY TRUST	56,858.000	3,988,588.700	
	WASHINGTON PRIME GROUP INC	55,522.000	335,908.100	
	WASHINGTON REIT	26,370.000	702,496.800	
	WEINGARTEN REALTY INVST	39,733.000	1,130,801.180	
	WELLTOWER INC	122,342.000	8,932,189.420	
	WHITESTONE REIT	12,433.000	175,553.960	
	WP CAREY INC	52,886.000	3,706,250.880	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	37,487.000	734,745.200	
	アメリカ・ドル 小計	7,501,788.000	270,334,785.790 (30,577,567,621)	
イギリス・ボンド	ASSURA PLC	799,921.000	429,557.570	
	BIG YELLOW GROUP PLC	52,657.000	454,956.480	
	BRITISH LAND CO PLC	325,834.000	1,769,930.280	
	CAPITAL & REGIONAL PLC	169,910.000	58,618.950	
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	67,927.000	65,889.190	
	DERWENT LONDON PLC	36,223.000	1,046,844.700	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	167,778.000	156,033.540	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	91,491.000	629,915.530	
	HAMMERSON PLC	259,126.000	922,747.680	
	HANSTEEN HOLDINGS PLC	127,808.000	117,327.740	
	INTU PROPERTIES PLC	282,416.000	320,259.740	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	246,404.000	2,016,570.330	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	233,257.000	407,499.970	
	LXI REIT PLC	118,335.000	140,818.650	
	NEWRIVER REIT PLC	105,296.000	217,962.720	

	PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC	242,663.000	263,046.690	
	RDI REIT PLC	411,740.000	123,522.000	
	REGIONAL REIT LTD	105,299.000	98,559.860	
	SAFESTORE HOLDINGS LTD	70,126.000	361,850.160	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT TRUST LTD	185,769.000	104,030.640	
	SEGR0 PLC	331,030.000	2,000,083.260	
	SHAFTESBURY PLC	75,842.000	657,550.140	
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING REIT PLC	100,970.000	100,768.060	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	493,058.000	646,399.030	
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT LTD	198,649.000	160,905.690	
	UNITE GROUP PLC	86,436.000	714,393.540	
	WORKSPACE GROUP PLC	43,988.000	357,182.560	
イギリス・ポンド 小計		5,429,953.000	14,343,224.700 (2,037,455,068)	
イスラエル・シュケル	REIT 1 LTD	56,934.000	819,849.600	
イスラエル・シュケル 小計		56,934.000	819,849.600 (24,759,458)	
カナダ・ドル	AGELLAN COMMERCIAL REIT	5,891.000	83,593.290	
	ALLIED PROPERTIES REIT	16,128.000	726,405.120	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	24,849.000	235,071.540	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	7,469.000	301,896.980	
	CANADIAN APT PPTYS REIT	23,134.000	1,112,282.720	
	CHOICE PROPERTIES REIT	45,960.000	549,222.000	
	COMINAR REAL ESTATE INVT TR	29,403.000	355,482.270	
	CROMBIE REAL ESTATE INV	12,541.000	161,778.900	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	17,944.000	217,481.280	
	DREAM GLOBAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	31,978.000	414,115.100	
	DREAM INDUSTRIAL REIT	13,629.000	134,381.940	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV TRUST	10,318.000	244,742.960	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	7,641.000	411,697.080	
	H & R REAL ESTATE INVESTMENT	45,484.000	962,896.280	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	17,040.000	227,654.400	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT	5,590.000	102,073.400	
	NORTHVIEW APARTMENT REIT	8,956.000	228,198.880	

	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	14,401.000	148,762.330	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	49,806.000	1,223,733.420	
	SLATE OFFICE REIT	12,079.000	82,741.150	
	SLATE RETAIL REIT	7,739.000	90,546.300	
	SMARTCENTRES REIT	21,410.000	682,979.000	
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	13,699.000	127,674.680	
	TRUE NORTH COMMERCIAL REIT	10,465.000	61,952.800	
カナダ・ドル	小計	453,554.000	8,887,363.820 (749,560,264)	
ニュージーランド・ドル	ARGOSY PROPERTY LTD	256,712.000	296,502.360	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	350,499.000	548,530.930	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	458,095.000	629,880.620	
	PRECINCT PROPERTIES	345,966.000	498,191.040	
	STRIDE STAPLED GROUP	125,820.000	232,767.000	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	104,289.000	216,921.120	
ニュージーランド・ドル	小計	1,641,381.000	2,422,793.070 (188,323,704)	
ユーロ	AEDIFICA	6,065.000	453,662.000	
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	52,869.000	659,805.120	
	ALTAREA	1,117.000	192,570.800	
	BEFIMMO	7,779.000	398,284.800	
	BENI STABILI SPA	336,763.000	243,816.410	
	COFINIMMO SA	6,902.000	751,627.800	
	COVIVIO	17,929.000	1,527,550.800	
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	13,531.000	379,138.620	
	GECINA SA	17,984.000	2,204,838.400	
	GREEN REIT PLC	222,771.000	316,334.820	
	HAMBORNER REIT AG	25,228.000	216,960.800	
	HIBERNIA REIT PLC	216,119.000	290,896.170	
	ICADE	14,819.000	992,132.050	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE	16,157.000	93,128.940	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA	91,014.000	774,984.210	
	INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	6,925.000	141,270.000	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES REIT PLC	126,018.000	176,677.230	
	KLEPIERRE	67,894.000	1,892,205.780	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA	23,583.000	189,843.150	
	MERCIALYS	17,291.000	217,347.870	

	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	119,954.000	1,324,292.160	
	NSI NV	5,408.000	186,305.600	
	RETAIL ESTATES	2,390.000	175,904.000	
	UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	45,251.000	6,474,513.080	
	VASTNED RETAIL	5,441.000	171,391.500	
	WAREHOUSES DE PAUW	5,570.000	638,322.000	
	WERELDHAVE NV	13,612.000	368,340.720	
	ユーロ 小計	1,486,384.000	21,452,144.830 (2,755,742,525)	
	香港・ドル			
	CHAMPION REIT	644,070.000	3,497,300.100	
	FORTUNE REAL ESTATE (HK)	471,000.000	4,319,070.000	
	LINK REIT	700,020.000	53,691,534.000	
	PROSPERITY REIT	390,000.000	1,142,700.000	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	325,000.000	1,618,500.000	
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	447,000.000	2,221,590.000	
	香港・ドル 小計	2,977,090.000	66,490,694.100 (962,785,250)	
投資証券 合計		19,547,084	37,296,193,890 (37,296,193,890)	
合計			41,620,316,071 (41,620,316,071)	

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 156銘柄	-%	72.65%	73.47%
イギリス・ポンド	投資証券 27銘柄	-%	4.84%	4.90%
イスラエル・シケル	投資証券 1銘柄	-%	0.06%	0.06%
オーストラリア・ドル	投資信託受益証券 26銘柄	6.92%	-%	7.00%
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% -%	-% 1.78%	1.84%
シンガポール・ドル	投資信託受益証券 29銘柄	3.31%	-%	3.35%
ニュージーランド・ドル	投資証券 6銘柄	-%	0.45%	0.45%
ユーロ	投資証券 27銘柄	-%	6.55%	6.62%
香港・ドル	投資証券 6銘柄	-%	2.29%	2.31%

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

「為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成30年6月11日現在	平成30年12月11日現在
資産の部			
流動資産			
預金		2,910,245,030	3,894,841,992
コール・ローン		3,108,345,413	2,762,424,203
国債証券		281,954,244,331	309,476,392,363
派生商品評価勘定		59,538,999	1,231,454,286
未収入金		-	4,674,044,952
未収利息		1,752,077,848	1,733,464,955
前払費用		319,510,797	514,562,594
流動資産合計		290,103,962,418	324,287,185,345
資産合計		290,103,962,418	324,287,185,345
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		3,490,532,576	16,717,923
未払金		-	298,015,525
未払解約金		88,402,000	2,129,314,000
その他未払費用		2,930	-
流動負債合計		3,578,937,506	2,444,047,448
負債合計		3,578,937,506	2,444,047,448
純資産の部			
元本等			
元本	1	217,773,827,773	242,453,536,258
剰余金			
剰余金又は欠損金()		68,751,197,139	79,389,601,639
元本等合計		286,525,024,912	321,843,137,897
純資産合計		286,525,024,912	321,843,137,897
負債純資産合計		290,103,962,418	324,287,185,345

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	平成30年6月11日現在	平成30年12月11日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	184,770,487,694円	217,773,827,773円
同期中追加設定元本額	69,265,063,782円	138,702,045,486円
同期中一部解約元本額	36,261,723,703円	114,022,337,001円
元本の内訳		
ファンド名		
たわらノーロード 先進国債券 <為替ヘッジあり>	1,825,689,957円	2,425,313,608円
たわらノーロード バランス (堅実型)	11,905,634円	34,349,825円
たわらノーロード バランス (標準型)	32,979,567円	96,584,356円
たわらノーロード バランス (積極型)	32,197,500円	64,189,160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)	996,308円	3,115,711円
たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(安定型)	35,946,593円	96,294,168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)	42,097,855円	148,361,670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)	13,708,427円	49,851,900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)	12,937,105円	40,460,011円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(保守型)	501,860円	693,155円

たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	554,630円	948,827円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	2,623,214円	5,373,655円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	1,343,331円	1,683,987円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	1,802,746円	1,990,200円
投資のソムリエ	31,790,569,769円	53,654,441,596円
投資のソムリエ<DC年金>	2,358,441,751円	4,815,337,225円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	2,060,956,067円	3,029,242,102円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	37,389,577,479円	53,929,465,618円
ワールドアセットバランス(基本コース)	6,071,699,281円	5,321,193,820円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	24,248,058,692円	12,589,896,763円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	3,905,024円	6,304,008円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	2,558,403円	4,766,302円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	9,712,584円	18,484,570円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	7,009,842円	10,057,165円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	3,098,874,074円	6,392,523,126円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	-円	283,833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)	8,825,007,351円	8,815,504,674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)	19,933,515,218円	12,922,725,107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)	1,087,234,352円	475,524,709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)	6,954,082,433円	6,826,248,405円
DIAM世界アセットバランスファンド3VA(適格機関投資家限定)	33,063,469,353円	32,519,009,895円
DIAMバランス30VA(適格機関投資家限定)	25,667,266円	28,050,156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)	29,512,697,660円	29,022,086,210円
DIAMバランス20VA(適格機関投資家限定)	154,999,985円	149,419,781円

	D I A M世界アセットバランス ファンド7 V A (1 2 1 2) (適格機関投資家限定)	2,619,820,816円	2,501,377,202円
	D I A M世界アセットバランス ファンド7 V A (1 3 0 3) (適格機関投資家限定)	2,627,419,330円	2,597,230,650円
	D I A M世界アセットバランス ファンド7 V A (1 3 0 6) (適格機関投資家限定)	3,475,672,740円	3,430,389,721円
	D I A M世界アセットバランス ファンド7 V A (1 3 0 9) (適格機関投資家限定)	437,593,576円	424,763,387円
	計	217,773,827,773円	242,453,536,258円
2 .	受益権の総数	217,773,827,773口	242,453,536,258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12月12日 至 平成30年6月11日	自 平成30年6月12日 至 平成30年12月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成30年6月11日現在	平成30年12月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成30年6月11日現在	平成30年12月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
国債証券	8,008,384,999	698,445,061
合計	8,008,384,999	698,445,061

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(平成29年6月23日から平成30年6月11日まで及び平成30年6月23日から平成30年12月11日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	平成30年6月11日 現在				平成30年12月11日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	285,306,695,589	-	288,737,689,166	3,430,993,577	317,704,696,529	-	316,489,960,166	1,214,736,363
アメリカ・ドル	127,106,641,019	-	128,052,678,402	946,037,383	147,091,281,619	-	146,650,251,992	441,029,627
イギリス・ポンド	20,463,088,569	-	20,770,963,395	307,874,826	20,821,510,796	-	20,423,575,655	397,935,141
オーストラリア・ドル	6,213,211,657	-	6,292,205,036	78,993,379	6,737,859,860	-	6,608,502,120	129,357,740
カナダ・ドル	6,116,943,219	-	6,166,372,192	49,428,973	6,293,560,542	-	6,216,343,744	77,216,798
シンガポール・ドル	980,489,978	-	990,332,855	9,842,877	988,372,081	-	983,718,855	4,653,226
スウェーデン・クローナ	958,958,591	-	979,626,609	20,668,018	894,709,147	-	892,077,376	2,631,771
デンマーク・クローネ	1,575,955,541	-	1,601,663,536	25,707,995	1,499,577,983	-	1,498,063,381	1,514,602
ノルウェー・クローネ	682,032,581	-	697,179,264	15,146,683	570,451,408	-	571,309,022	857,614
ポーランド・ズロチ	1,744,906,707	-	1,793,301,444	48,394,737	1,628,386,125	-	1,626,679,856	1,706,269
マレーシア・リンギット	1,169,108,424	-	1,165,992,300	3,116,124	1,136,718,882	-	1,130,702,400	6,016,482
メキシコ・ペソ	2,333,605,685	-	2,318,007,875	15,597,810	2,219,215,942	-	2,211,949,828	7,266,114
ユーロ	114,143,234,915	-	116,131,672,620	1,988,437,705	126,081,852,367	-	125,999,091,739	82,760,628
南アフリカ・ランド	1,818,518,703	-	1,777,693,638	40,825,065	1,741,199,777	-	1,677,694,198	63,505,579
合計	285,306,695,589	-	288,737,689,166	3,430,993,577	317,704,696,529	-	316,489,960,166	1,214,736,363

(注) 時価の算定方法

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

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

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成30年6月11日現在	平成30年12月11日現在
1口当たり純資産額	1.3157円	1.3274円
(1万口当たり純資産額)	(13,157円)	(13,274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12月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	US T N/B 1.125 03/31/20	11,000,000.000	10,773,950.000	
		US T N/B 1.125 06/30/21	10,000,000.000	9,611,700.000	
		US T N/B 1.125 07/31/21	13,900,000.000	13,332,046.000	
		US T N/B 1.125 08/31/21	11,000,000.000	10,538,440.000	
		US T N/B 1.125 09/30/21	430,000.000	411,621.800	
		US T N/B 1.25 01/31/20	4,490,000.000	4,415,959.900	
		US T N/B 1.25 02/29/20	4,200,000.000	4,124,988.000	
		US T N/B 1.25 07/31/23	8,400,000.000	7,861,140.000	
		US T N/B 1.25 10/31/21	10,500,000.000	10,070,130.000	
		US T N/B 1.375 02/29/20	6,420,000.000	6,314,647.800	
		US T N/B 1.375 03/31/20	7,620,000.000	7,486,040.400	
		US T N/B 1.375 04/30/20	11,510,000.000	11,294,993.200	
		US T N/B 1.375 04/30/21	10,000,000.000	9,690,600.000	
		US T N/B 1.375 05/31/20	12,010,000.000	11,770,640.700	
		US T N/B 1.375 05/31/21	12,350,000.000	11,951,465.500	
		US T N/B 1.375 06/30/23	550,000.000	518,243.000	
		US T N/B 1.375 08/31/23	9,500,000.000	8,932,945.000	
		US T N/B 1.375 09/30/20	21,520,000.000	21,002,013.600	
		US T N/B 1.375 09/30/23	9,000,000.000	8,452,890.000	
		US T N/B 1.375 10/31/20	10,000,000.000	9,747,600.000	
		US T N/B 1.5 06/15/20	13,000,000.000	12,760,800.000	
		US T N/B 1.5 08/15/26	9,800,000.000	8,940,932.000	
		US T N/B 1.625 02/15/26	9,630,000.000	8,903,898.000	
		US T N/B 1.625 04/30/23	9,800,000.000	9,355,864.000	
		US T N/B 1.625 05/15/26	9,000,000.000	8,297,550.000	
		US T N/B 1.625 05/31/23	1,460,000.000	1,392,475.000	
		US T N/B 1.625 07/31/20	19,250,000.000	18,904,077.500	
		US T N/B 1.625 08/31/22	3,280,000.000	3,151,850.400	
		US T N/B 1.625 11/15/22	1,120,000.000	1,074,270.400	
		US T N/B 1.625 11/30/20	10,000,000.000	9,787,500.000	
		US T N/B 1.75 02/28/22	10,500,000.000	10,183,320.000	
		US T N/B 1.75 05/15/22	1,250,000.000	1,210,200.000	
		US T N/B 1.75 05/15/23	5,000,000.000	4,796,850.000	
		US T N/B 1.75 05/31/22	9,490,000.000	9,180,056.600	
		US T N/B 1.75 06/30/22	15,000,000.000	14,505,450.000	
		US T N/B 1.75 09/30/22	15,600,000.000	15,047,760.000	
US T N/B 1.75 11/30/21	1,380,000.000	1,341,608.400			
US T N/B 1.75 12/31/20	12,590,000.000	12,349,908.700			
US T N/B 1.875 01/31/22	6,840,000.000	6,663,117.600			
US T N/B 1.875 02/28/22	2,440,000.000	2,375,754.800			

US T N/B 1.875 03/31/22	13,300,000.000	12,944,624.000	
US T N/B 1.875 04/30/22	16,080,000.000	15,631,368.000	
US T N/B 1.875 08/31/24	7,320,000.000	6,988,843.200	
US T N/B 1.875 09/30/22	14,770,000.000	14,316,413.300	
US T N/B 2.0 01/31/20	11,430,000.000	11,335,702.500	
US T N/B 2.0 02/15/22	10,000,000.000	9,778,900.000	
US T N/B 2.0 02/15/23	14,000,000.000	13,597,500.000	
US T N/B 2.0 02/15/25	8,600,000.000	8,225,728.000	
US T N/B 2.0 05/31/21	11,560,000.000	11,358,971.600	
US T N/B 2.0 05/31/24	3,500,000.000	3,368,610.000	
US T N/B 2.0 06/30/24	210,000.000	201,959.100	
US T N/B 2.0 07/31/20	12,600,000.000	12,446,406.000	
US T N/B 2.0 08/15/25	11,600,000.000	11,051,668.000	
US T N/B 2.0 08/31/21	7,060,000.000	6,924,589.200	
US T N/B 2.0 09/30/20	12,660,000.000	12,496,686.000	
US T N/B 2.0 10/31/22	4,280,000.000	4,165,296.000	
US T N/B 2.0 11/15/21	7,900,000.000	7,741,052.000	
US T N/B 2.0 11/15/26	8,900,000.000	8,389,585.000	
US T N/B 2.0 11/30/22	12,020,000.000	11,692,214.600	
US T N/B 2.0 12/31/21	14,720,000.000	14,407,200.000	
US T N/B 2.125 03/31/24	10,500,000.000	10,183,320.000	
US T N/B 2.125 05/15/25	8,400,000.000	8,081,052.000	
US T N/B 2.125 07/31/24	2,100,000.000	2,031,897.000	
US T N/B 2.125 08/15/21	9,590,000.000	9,440,491.900	
US T N/B 2.125 08/31/20	11,660,000.000	11,536,987.000	
US T N/B 2.125 09/30/21	9,800,000.000	9,643,004.000	
US T N/B 2.125 09/30/24	2,720,000.000	2,628,825.600	
US T N/B 2.125 11/30/23	10,290,000.000	9,999,719.100	
US T N/B 2.125 11/30/24	3,970,000.000	3,831,645.500	
US T N/B 2.125 12/31/21	7,000,000.000	6,876,380.000	
US T N/B 2.125 12/31/22	13,500,000.000	13,184,640.000	
US T N/B 2.25 01/31/24	3,780,000.000	3,691,963.800	
US T N/B 2.25 02/15/27	10,300,000.000	9,868,636.000	
US T N/B 2.25 02/29/20	40,000.000	39,760.800	
US T N/B 2.25 03/31/21	11,920,000.000	11,796,032.000	
US T N/B 2.25 08/15/27	10,030,000.000	9,582,561.700	
US T N/B 2.25 08/15/46	6,000,000.000	5,013,240.000	
US T N/B 2.25 10/31/24	4,560,000.000	4,435,648.800	
US T N/B 2.25 11/15/24	12,600,000.000	12,248,460.000	
US T N/B 2.25 11/15/25	10,800,000.000	10,435,500.000	
US T N/B 2.25 11/15/27	12,870,000.000	12,272,703.300	
US T N/B 2.25 12/31/23	9,550,000.000	9,332,069.000	
US T N/B 2.25 12/31/24	4,530,000.000	4,402,208.700	
US T N/B 2.375 01/31/23	2,760,000.000	2,722,050.000	
US T N/B 2.375 05/15/27	9,600,000.000	9,283,488.000	
US T N/B 2.375 08/15/24	12,610,000.000	12,359,691.500	
US T N/B 2.5 01/31/25	2,980,000.000	2,935,985.400	
US T N/B 2.5 02/15/45	5,610,000.000	4,977,528.600	
US T N/B 2.5 02/15/46	5,600,000.000	4,949,392.000	

US T N/B 2.5 03/31/23	6,720,000.000	6,658,512.000	
US T N/B 2.5 05/15/24	10,790,000.000	10,658,469.900	
US T N/B 2.5 05/15/46	4,870,000.000	4,300,015.200	
US T N/B 2.5 08/15/23	6,700,000.000	6,629,851.000	
US T N/B 2.625 02/28/23	1,190,000.000	1,185,347.100	
US T N/B 2.625 03/31/25	2,400,000.000	2,379,936.000	
US T N/B 2.625 06/30/23	2,650,000.000	2,639,002.500	
US T N/B 2.625 08/15/20	13,350,000.000	13,321,297.500	
US T N/B 2.625 08/31/20	12,790,000.000	12,764,420.000	
US T N/B 2.625 11/15/20	11,860,000.000	11,834,026.600	
US T N/B 2.75 02/15/24	11,930,000.000	11,937,396.600	
US T N/B 2.75 02/15/28	10,150,000.000	10,068,292.500	
US T N/B 2.75 02/28/25	6,290,000.000	6,285,030.900	
US T N/B 2.75 04/30/23	10,670,000.000	10,682,483.900	
US T N/B 2.75 05/31/23	3,880,000.000	3,886,363.200	
US T N/B 2.75 06/30/25	8,100,000.000	8,089,227.000	
US T N/B 2.75 07/31/23	2,100,000.000	2,102,457.000	
US T N/B 2.75 08/15/42	3,220,000.000	3,021,744.600	
US T N/B 2.75 08/15/47	5,850,000.000	5,421,253.500	
US T N/B 2.75 08/31/23	7,030,000.000	7,042,021.300	
US T N/B 2.75 08/31/25	9,040,000.000	9,025,807.200	
US T N/B 2.75 09/15/21	2,960,000.000	2,961,243.200	
US T N/B 2.75 09/30/20	18,860,000.000	18,860,565.800	
US T N/B 2.75 11/15/23	7,000,000.000	7,006,510.000	
US T N/B 2.75 11/15/42	4,500,000.000	4,219,785.000	
US T N/B 2.75 11/15/47	6,690,000.000	6,199,689.900	
US T N/B 2.75 11/30/20	5,110,000.000	5,112,555.000	
US T N/B 2.875 04/30/25	4,220,000.000	4,246,037.400	
US T N/B 2.875 05/15/28	13,990,000.000	14,011,824.400	
US T N/B 2.875 05/15/43	5,980,000.000	5,728,182.200	
US T N/B 2.875 05/31/25	4,550,000.000	4,577,709.500	
US T N/B 2.875 07/31/25	2,720,000.000	2,737,000.000	
US T N/B 2.875 08/15/28	11,120,000.000	11,136,457.600	
US T N/B 2.875 08/15/45	5,230,000.000	4,985,654.400	
US T N/B 2.875 09/30/23	7,810,000.000	7,860,608.800	
US T N/B 2.875 10/15/21	13,100,000.000	13,149,518.000	
US T N/B 2.875 10/31/20	16,820,000.000	16,858,686.000	
US T N/B 2.875 10/31/23	9,290,000.000	9,353,822.300	
US T N/B 2.875 11/15/21	8,440,000.000	8,474,604.000	
US T N/B 2.875 11/15/46	6,200,000.000	5,908,352.000	
US T N/B 3.0 02/15/47	6,000,000.000	5,857,500.000	
US T N/B 3.0 02/15/48	6,450,000.000	6,285,202.500	
US T N/B 3.0 05/15/42	2,310,000.000	2,267,934.900	
US T N/B 3.0 05/15/45	6,200,000.000	6,060,500.000	
US T N/B 3.0 05/15/47	5,920,000.000	5,771,052.800	
US T N/B 3.0 08/15/48	9,240,000.000	9,007,521.600	
US T N/B 3.0 09/30/25	7,430,000.000	7,536,769.100	
US T N/B 3.0 10/31/25	6,560,000.000	6,654,267.200	
US T N/B 3.0 11/15/44	6,500,000.000	6,353,230.000	

US T N/B 3.0 11/15/45	8,640,000.000	8,440,848.000	
US T N/B 3.125 02/15/42	2,760,000.000	2,771,840.400	
US T N/B 3.125 02/15/43	6,130,000.000	6,132,819.800	
US T N/B 3.125 05/15/21	100,000.000	100,980.000	
US T N/B 3.125 05/15/48	9,870,000.000	9,853,023.600	
US T N/B 3.125 08/15/44	6,260,000.000	6,262,879.600	
US T N/B 3.125 11/15/28	4,690,000.000	4,798,057.600	
US T N/B 3.125 11/15/41	2,350,000.000	2,363,207.000	
US T N/B 3.375 05/15/44	6,300,000.000	6,574,617.000	
US T N/B 3.375 11/15/48	3,320,000.000	3,477,700.000	
US T N/B 3.5 02/15/39	2,150,000.000	2,309,551.500	
US T N/B 3.625 02/15/20	19,500,000.000	19,695,000.000	
US T N/B 3.625 02/15/21	2,010,000.000	2,047,989.000	
US T N/B 3.625 02/15/44	7,940,000.000	8,632,844.400	
US T N/B 3.625 08/15/43	7,880,000.000	8,557,758.800	
US T N/B 3.75 08/15/41	4,270,000.000	4,732,355.600	
US T N/B 3.75 11/15/43	7,740,000.000	8,576,848.800	
US T N/B 3.875 08/15/40	2,450,000.000	2,764,457.500	
US T N/B 4.25 05/15/39	1,790,000.000	2,124,783.700	
US T N/B 4.25 11/15/40	3,650,000.000	4,334,375.000	
US T N/B 4.375 02/15/38	1,210,000.000	1,457,287.700	
US T N/B 4.375 05/15/40	2,790,000.000	3,368,032.200	
US T N/B 4.375 05/15/41	2,100,000.000	2,539,026.000	
US T N/B 4.375 11/15/39	2,000,000.000	2,410,920.000	
US T N/B 4.5 02/15/36	2,180,000.000	2,642,552.400	
US T N/B 4.5 05/15/38	840,000.000	1,027,488.000	
US T N/B 4.5 08/15/39	2,000,000.000	2,449,200.000	
US T N/B 4.625 02/15/40	3,370,000.000	4,197,200.200	
US T N/B 4.75 02/15/41	2,600,000.000	3,303,014.000	
US T N/B 5.0 05/15/37	890,000.000	1,148,580.600	
US T N/B 5.25 02/15/29	830,000.000	1,002,606.800	
US T N/B 5.25 11/15/28	1,700,000.000	2,046,171.000	
US T N/B 5.375 02/15/31	2,300,000.000	2,882,889.000	
US T N/B 5.5 08/15/28	930,000.000	1,135,613.700	
US T N/B 6.0 02/15/26	800,000.000	967,312.000	
US T N/B 6.125 11/15/27	2,050,000.000	2,575,784.000	
US T N/B 6.25 05/15/30	1,200,000.000	1,591,020.000	
US T N/B 6.25 08/15/23	1,200,000.000	1,384,776.000	
US T N/B 6.5 11/15/26	500,000.000	631,285.000	
US T N/B 8.0 11/15/21	2,100,000.000	2,408,343.000	
アメリカ・ドル 小計	1,285,180,000.000 (145,366,709,800)	1,268,210,274.500 (143,447,264,149)	
イギリス・ボンド			
UK TREASURY 0.5 07/22/22	6,750,000.000	6,701,940.000	
UK TREASURY 0.75 07/22/23	4,080,000.000	4,072,492.800	
UK TREASURY 1.0 04/22/24	2,070,000.000	2,082,026.700	

UK TREASURY 1.25 07/22/27	3,650,000.000	3,705,407.000	
UK TREASURY 1.5 01/22/21	4,310,000.000	4,384,994.000	
UK TREASURY 1.5 07/22/26	2,850,000.000	2,963,886.000	
UK TREASURY 1.5 07/22/47	3,310,000.000	3,188,192.000	
UK TREASURY 1.625 10/22/28	3,000,000.000	3,128,250.000	
UK TREASURY 1.625 10/22/71	1,450,000.000	1,509,986.500	
UK TREASURY 1.75 07/22/57	3,380,000.000	3,574,350.000	
UK TREASURY 1.75 09/07/22	3,840,000.000	3,985,305.600	
UK TREASURY 1.75 09/07/37	3,080,000.000	3,163,468.000	
UK TREASURY 2.0 09/07/25	3,130,000.000	3,358,959.500	
UK TREASURY 2.25 09/07/23	1,970,000.000	2,104,748.000	
UK TREASURY 2.5 07/22/65	2,950,000.000	3,912,850.500	
UK TREASURY 2.75 09/07/24	2,500,000.000	2,767,725.000	
UK TREASURY 3.25 01/22/44	3,680,000.000	4,870,480.000	
UK TREASURY 3.5 01/22/45	4,560,000.000	6,318,792.000	
UK TREASURY 3.5 07/22/68	2,930,000.000	4,931,190.000	
UK TREASURY 3.75 07/22/52	3,730,000.000	5,810,221.000	
UK TREASURY 3.75 09/07/20	3,050,000.000	3,212,687.000	
UK TREASURY 3.75 09/07/21	2,200,000.000	2,383,326.000	
UK TREASURY 4.0 01/22/60	2,170,000.000	3,794,896.000	
UK TREASURY 4.0 03/07/22	2,350,000.000	2,598,747.500	
UK TREASURY 4.25 03/07/36	3,460,000.000	4,896,938.000	
UK TREASURY 4.25 06/07/32	2,440,000.000	3,319,620.000	
UK TREASURY 4.25 09/07/39	2,250,000.000	3,308,400.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/27	2,290,000.000	2,921,513.300	

	UK TREASURY 4.25 12/07/40	2,820,000.000	4,199,262.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/46	2,690,000.000	4,241,861.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/49	2,130,000.000	3,477,438.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/55	3,050,000.000	5,343,295.000	
	UK TREASURY 4.5 09/07/34	3,470,000.000	4,962,447.000	
	UK TREASURY 4.5 12/07/42	3,040,000.000	4,768,240.000	
	UK TREASURY 4.75 12/07/30	2,320,000.000	3,220,856.000	
	UK TREASURY 4.75 12/07/38	2,530,000.000	3,916,946.000	
	UK TREASURY 5.0 03/07/25	2,200,000.000	2,752,508.000	
	UK TREASURY 6.0 12/07/28	1,450,000.000	2,115,912.500	
	UK TREASURY 8.0 06/07/21	1,520,000.000	1,796,427.200	
	イギリス・ポンド 小計	114,650,000.000 (16,286,032,500)	143,766,585.100 (20,422,043,413)	
オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN 4.5 04/15/20	3,730,000.000	3,856,260.500	
	AUSTRALIAN 5.75 05/15/21	5,340,000.000	5,822,522.400	
	AUSTRALIAN 1.75 11/21/20	4,500,000.000	4,484,835.000	
	AUSTRALIAN 2.0 12/21/21	2,700,000.000	2,705,751.000	
	AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	4,120,000.000	4,052,844.000	
	AUSTRALIAN 2.25 11/21/22	2,190,000.000	2,211,133.500	
	AUSTRALIAN 2.5 05/21/30	1,620,000.000	1,622,737.800	
	AUSTRALIAN 2.75 04/21/24	4,000,000.000	4,120,800.000	
	AUSTRALIAN 2.75 05/21/41	590,000.000	572,807.400	
	AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	1,100,000.000	1,102,783.000	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	4,610,000.000	4,728,845.800	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/28	4,200,000.000	4,314,366.000	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/29	2,650,000.000	2,722,398.000	
	AUSTRALIAN 3.0 03/21/47	2,040,000.000	2,050,893.600	

	AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	5,390,000.000	5,712,807.100	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	4,560,000.000	4,894,932.000	
	AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	1,330,000.000	1,410,770.900	
	AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	2,010,000.000	2,287,601.100	
	AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	5,250,000.000	5,935,807.500	
	AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	2,220,000.000	2,721,786.600	
	AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	4,750,000.000	5,604,430.000	
	AUSTRALIAN 5.5 04/21/23	3,820,000.000	4,369,468.800	
	AUSTRALIAN 5.75 07/15/22	3,890,000.000	4,401,379.400	
	オーストラリア・ドル 小計	76,610,000.000 (6,226,860,800)	81,707,961.400 (6,641,223,103)	
カナダ・ドル	CANADA 8.0 06/01/27	900,000.000	1,315,098.000	
	CANADA 0.5 03/01/22	2,280,000.000	2,173,204.800	
	CANADA 0.75 03/01/21	5,890,000.000	5,729,909.800	
	CANADA 0.75 09/01/20	4,600,000.000	4,503,952.000	
	CANADA 0.75 09/01/21	2,790,000.000	2,697,176.700	
	CANADA 1.0 06/01/27	2,690,000.000	2,472,621.100	
	CANADA 1.0 09/01/22	2,300,000.000	2,217,499.000	
	CANADA 1.5 03/01/20	7,160,000.000	7,121,694.000	
	CANADA 1.5 06/01/23	2,200,000.000	2,152,920.000	
	CANADA 1.5 06/01/26	2,060,000.000	1,984,027.200	
	CANADA 1.75 03/01/23	1,910,000.000	1,890,479.800	
	CANADA 1.75 05/01/20	1,520,000.000	1,515,774.400	
	CANADA 1.75 08/01/20	1,940,000.000	1,932,259.400	
	CANADA 2.0 06/01/28	2,220,000.000	2,208,877.800	
	CANADA 2.0 09/01/23	2,820,000.000	2,819,295.000	
	CANADA 2.0 12/01/51	750,000.000	712,830.000	
	CANADA 2.25 03/01/24	670,000.000	677,812.200	
	CANADA 2.25 06/01/25	2,190,000.000	2,219,017.500	
	CANADA 2.25 06/01/29	810,000.000	823,373.100	
	CANADA 2.5 06/01/24	2,250,000.000	2,304,855.000	
	CANADA 2.75 06/01/22	1,850,000.000	1,895,713.500	
	CANADA 2.75 12/01/48	2,540,000.000	2,834,894.000	
	CANADA 2.75 12/01/64	770,000.000	896,503.300	
	CANADA 3.25 06/01/21	2,400,000.000	2,471,328.000	
	CANADA 3.5 06/01/20	2,000,000.000	2,044,460.000	
	CANADA 3.5 12/01/45	2,820,000.000	3,542,878.800	
	CANADA 4.0 06/01/41	2,480,000.000	3,249,196.800	
	CANADA 5.0 06/01/37	2,240,000.000	3,182,659.200	
	CANADA 5.75 06/01/29	1,700,000.000	2,282,505.000	
	CANADA 5.75 06/01/33	1,850,000.000	2,677,246.000	
	カナダ・ドル 小計	70,600,000.000	74,550,061.400	

		(5,954,404,000)	(6,287,552,178)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE 1.25 10/01/21	800,000.000	783,360.000	
	SINGAPORE 1.75 02/01/23	270,000.000	266,787.000	
	SINGAPORE 1.75 04/01/22	300,000.000	297,360.000	
	SINGAPORE 2.125 06/01/26	500,000.000	499,000.000	
	SINGAPORE 2.25 08/01/36	420,000.000	403,758.600	
	SINGAPORE 2.375 06/01/25	500,000.000	507,250.000	
	SINGAPORE 2.625 05/01/28	500,000.000	516,675.000	
	SINGAPORE 2.75 03/01/46	900,000.000	922,212.000	
	SINGAPORE 2.75 04/01/42	760,000.000	780,520.000	
	SINGAPORE 2.75 07/01/23	1,280,000.000	1,319,206.400	
	SINGAPORE 2.875 07/01/29	200,000.000	210,800.000	
	SINGAPORE 2.875 09/01/30	610,000.000	641,720.000	
	SINGAPORE 3.0 09/01/24	570,000.000	596,904.000	
	SINGAPORE 3.125 09/01/22	1,200,000.000	1,246,320.000	
	SINGAPORE 3.375 09/01/33	1,010,000.000	1,125,523.800	
SINGAPORE 3.5 03/01/27	1,260,000.000	1,385,370.000		
シンガポール・ドル 小計		11,080,000.000 (912,105,600)	11,502,766.800 (946,907,763)	
スウェーデン・クローナ	SWEDEN 0.75 05/12/28	8,540,000.000	8,763,064.800	
	SWEDEN 1.0 11/12/26	9,290,000.000	9,785,993.100	
	SWEDEN 1.5 11/13/23	12,920,000.000	13,896,622.800	
	SWEDEN 2.5 05/12/25	10,780,000.000	12,396,245.400	
	SWEDEN 3.5 03/30/39	7,610,000.000	10,773,324.800	
スウェーデン・クローナ 小計		49,140,000.000 (611,301,600)	55,615,250.900 (691,853,721)	
デンマーク・クローネ	DENMARK 0.5 11/15/27	14,860,000.000	15,231,202.800	
	DENMARK 1.5 11/15/23	8,570,000.000	9,305,734.500	
	DENMARK 1.75 11/15/25	12,910,000.000	14,488,247.500	
	DENMARK 4.5 11/15/39	21,610,000.000	37,793,945.100	
デンマーク・クローネ 小計		57,950,000.000 (997,319,500)	76,819,129.900 (1,322,057,226)	
ノルウェー・クローネ	NORWAY 1.5 02/19/26	5,610,000.000	5,542,175.100	
	NORWAY 1.75 02/17/27	7,030,000.000	7,025,219.600	
	NORWAY 1.75 03/13/25	5,990,000.000	6,042,592.200	
	NORWAY 2.0 04/26/28	2,820,000.000	2,858,690.400	
	NORWAY 2.0 05/24/23	9,380,000.000	9,618,721.000	
	NORWAY 3.0 03/14/24	9,430,000.000	10,140,833.400	
ノルウェー・クローネ 小計		40,260,000.000 (531,834,600)	41,228,231.700 (544,624,941)	
ポーランド・ズロチ	POLAND 1.75 07/25/21	4,500,000.000	4,504,950.000	
	POLAND 2.0 04/25/21	4,000,000.000	4,032,000.000	
	POLAND 2.25 04/25/22	4,880,000.000	4,922,944.000	

	POLAND 2.5 01/25/23	6,870,000.000	6,957,249.000	
	POLAND 2.5 07/25/26	5,520,000.000	5,401,044.000	
	POLAND 2.5 07/25/27	4,890,000.000	4,733,520.000	
	POLAND 2.75 04/25/28	4,230,000.000	4,140,112.500	
	POLAND 3.25 07/25/25	4,790,000.000	4,962,008.900	
	POLAND 4.0 10/25/23	4,070,000.000	4,382,372.500	
	POLAND 5.75 04/25/29	1,800,000.000	2,233,494.000	
	POLAND 5.75 09/23/22	3,380,000.000	3,827,647.200	
	POLAND 5.75 10/25/21	2,690,000.000	2,983,613.500	
ポーランド・ズロチ 小計		51,620,000.000 (1,544,470,400)	53,080,955.600 (1,588,182,192)	
マレーシア・リングgit	MALAYSIA 3.418 08/15/22	5,000,000.000	4,933,500.000	
	MALAYSIA 3.48 03/15/23	3,910,000.000	3,855,025.400	
	MALAYSIA 3.502 05/31/27	4,580,000.000	4,353,106.800	
	MALAYSIA 3.844 04/15/33	1,340,000.000	1,248,384.200	
	MALAYSIA 3.9 11/30/26	1,500,000.000	1,475,835.000	
	MALAYSIA 3.955 09/15/25	4,400,000.000	4,385,392.000	
	MALAYSIA 4.127 04/15/32	1,180,000.000	1,138,487.600	
	MALAYSIA 4.181 07/15/24	2,190,000.000	2,210,695.500	
	MALAYSIA 4.232 06/30/31	2,000,000.000	1,949,300.000	
	MALAYSIA 4.392 04/15/26	1,480,000.000	1,504,257.200	
	MALAYSIA 4.498 04/15/30	2,820,000.000	2,847,241.200	
	MALAYSIA 4.642 11/07/33	1,050,000.000	1,066,012.500	
	MALAYSIA 4.762 04/07/37	5,540,000.000	5,531,246.800	
	MALAYSIA 4.935 09/30/43	3,470,000.000	3,484,504.600	
MALAYSIA 5.248 09/15/28	1,480,000.000	1,595,810.000		
マレーシア・リングgit 小計		41,940,000.000 (1,135,315,800)	41,578,798.800 (1,125,538,084)	
メキシコ・ペソ	MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	13,880,000.000	14,575,249.200	
	MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	66,505,000.000	69,725,837.150	
	MEXICAN BONDS 5.75 03/05/26	24,224,000.000	20,055,291.840	
	MEXICAN BONDS 6.5 06/09/22	42,000,000.000	39,034,800.000	
	MEXICAN BONDS 6.5 06/10/21	47,648,000.000	45,240,346.560	
	MEXICAN BONDS 7.25 12/09/21	11,110,000.000	10,649,601.600	
	MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	37,069,000.000	33,683,858.920	
	MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	21,054,000.000	18,698,057.400	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	38,302,000.000	32,025,834.280	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	16,399,000.000	14,193,334.500	
	MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47	11,366,000.000	9,694,402.380	

	MEXICAN BONDS 8.0 12/07/23	22,730,000.000	21,896,036.300	
	MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	16,000,000.000	15,316,800.000	
	MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	17,526,000.000	16,019,640.300	
メキシコ・ペソ 小計		385,813,000.000 (2,145,120,280)	360,809,090.430 (2,006,098,543)	
ユーロ	AUSTRIA 0.5 04/20/27	2,300,000.000	2,317,687.000	
	AUSTRIA 0.75 02/20/28	760,000.000	776,507.200	
	AUSTRIA 0.75 10/20/26	1,700,000.000	1,756,168.000	
	AUSTRIA 07/15/23	2,330,000.000	2,343,630.500	
	AUSTRIA 09/20/22	800,000.000	808,392.000	
	AUSTRIA 1.2 10/20/25	1,940,000.000	2,075,644.800	
	AUSTRIA 1.5 02/20/47	760,000.000	797,635.200	
	AUSTRIA 1.5 11/02/86	340,000.000	326,770.600	
	AUSTRIA 1.65 10/21/24	1,580,000.000	1,731,395.600	
	AUSTRIA 1.75 10/20/23	1,820,000.000	1,987,986.000	
	AUSTRIA 2.1 09/20/17	730,000.000	864,955.100	
	AUSTRIA 2.4 05/23/34	1,190,000.000	1,438,460.100	
	AUSTRIA 3.15 06/20/44	1,460,000.000	2,091,070.400	
	AUSTRIA 3.4 11/22/22	3,350,000.000	3,841,612.500	
	AUSTRIA 3.5 09/15/21	5,430,000.000	6,027,843.000	
	AUSTRIA 3.65 04/20/22	1,270,000.000	1,442,275.500	
	AUSTRIA 3.8 01/26/62	600,000.000	1,063,932.000	
	AUSTRIA 3.9 07/15/20	2,450,000.000	2,624,758.500	
	AUSTRIA 4.15 03/15/37	1,730,000.000	2,628,216.000	
	AUSTRIA 4.85 03/15/26	1,400,000.000	1,868,230.000	
	AUSTRIA 6.25 07/15/27	1,160,000.000	1,734,037.600	
	BELGIUM 0.2 10/22/23	1,070,000.000	1,080,914.000	
	BELGIUM 0.5 10/22/24	1,500,000.000	1,528,620.000	
	BELGIUM 0.8 06/22/25	2,430,000.000	2,514,369.600	
	BELGIUM 0.8 06/22/27	2,050,000.000	2,084,153.000	
	BELGIUM 0.8 06/22/28	1,650,000.000	1,660,378.500	
	BELGIUM 1.0 06/22/26	2,050,000.000	2,135,423.500	
	BELGIUM 1.0 06/22/31	1,500,000.000	1,499,025.000	
	BELGIUM 1.25 04/22/33	700,000.000	710,451.000	
	BELGIUM 1.45 06/22/37	600,000.000	602,022.000	
	BELGIUM 1.6 06/22/47	2,040,000.000	1,996,650.000	
	BELGIUM 1.9 06/22/38	1,220,000.000	1,314,611.000	
	BELGIUM 2.15 06/22/66	640,000.000	660,224.000	
	BELGIUM 2.25 06/22/23	1,850,000.000	2,050,965.500	
BELGIUM 2.25 06/22/57	810,000.000	877,505.400		
BELGIUM 2.6 06/22/24	2,260,000.000	2,572,264.200		
BELGIUM 3.0 06/22/34	1,200,000.000	1,500,252.000		
BELGIUM 3.75 06/22/45	1,480,000.000	2,158,609.600		
BELGIUM 3.75 09/28/20	2,520,000.000	2,715,426.000		
BELGIUM 4.0 03/28/22	2,130,000.000	2,437,401.600		
BELGIUM 4.0 03/28/32	1,550,000.000	2,121,671.000		

BELGIUM 4.25 03/28/41	3,280,000.000	4,978,384.000	
BELGIUM 4.25 09/28/21	2,400,000.000	2,715,192.000	
BELGIUM 4.25 09/28/22	2,300,000.000	2,697,187.000	
BELGIUM 4.5 03/28/26	1,500,000.000	1,944,585.000	
BELGIUM 5.0 03/28/35	3,960,000.000	6,145,722.000	
BELGIUM 5.5 03/28/28	3,370,000.000	4,845,318.600	
BUNDESUBL 0.25 10/16/20	3,000,000.000	3,048,450.000	
BUNDESUBL 04/08/22	2,500,000.000	2,540,150.000	
BUNDESUBL 04/09/21	2,850,000.000	2,888,931.000	
BUNDESUBL 04/14/23	2,960,000.000	3,006,264.800	
BUNDESUBL 04/17/20	2,950,000.000	2,975,871.500	
BUNDESUBL 10/07/22	3,000,000.000	3,048,720.000	
BUNDESUBL 10/08/21	3,400,000.000	3,451,986.000	
BUNDESUBL 10/13/23	4,800,000.000	4,866,240.000	
BUNDESSCHAT 06/12/20	4,950,000.000	4,996,827.000	
BUNDESSCHAT 09/11/20	10,000.000	10,110.200	
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27	3,800,000.000	3,855,442.000	
DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28	2,610,000.000	2,610,913.500	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25	3,440,000.000	3,576,464.800	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26	4,000,000.000	4,154,520.000	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28	3,330,000.000	3,425,337.900	
DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27	4,490,000.000	4,639,561.900	
DEUTSCHLAND 08/15/26	3,770,000.000	3,767,624.900	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/24	3,100,000.000	3,313,218.000	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25	5,720,000.000	6,138,532.400	
DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48	1,920,000.000	2,128,531.200	
DEUTSCHLAND 1.5 02/15/23	3,100,000.000	3,346,729.000	
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/23	3,070,000.000	3,325,454.700	
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/24	2,600,000.000	2,846,012.000	
DEUTSCHLAND 1.5 09/04/22	3,300,000.000	3,541,362.000	
DEUTSCHLAND 1.75 02/15/24	2,090,000.000	2,310,035.200	
DEUTSCHLAND 1.75 07/04/22	3,350,000.000	3,616,325.000	
DEUTSCHLAND 2.0 01/04/22	2,700,000.000	2,909,304.000	

DEUTSCHLAND 2.0 08/15/23	2,900,000.000	3,219,348.000	
DEUTSCHLAND 2.25 09/04/20	3,000,000.000	3,151,170.000	
DEUTSCHLAND 2.25 09/04/21	2,700,000.000	2,907,576.000	
DEUTSCHLAND 2.5 01/04/21	2,200,000.000	2,342,758.000	
DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	4,250,000.000	5,931,385.000	
DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	4,440,000.000	6,300,937.200	
DEUTSCHLAND 3.0 07/04/20	3,200,000.000	3,383,008.000	
DEUTSCHLAND 3.25 01/04/20	2,300,000.000	2,397,612.000	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/21	2,490,000.000	2,734,742.100	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	2,330,000.000	3,601,015.000	
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	4,520,000.000	7,149,916.800	
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	2,100,000.000	3,544,422.000	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	1,800,000.000	2,577,690.000	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	3,040,000.000	4,967,329.600	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	2,400,000.000	4,362,816.000	
DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	2,600,000.000	4,186,182.000	
DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	3,660,000.000	5,475,140.400	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/24	1,180,000.000	1,571,984.200	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	1,400,000.000	2,312,044.000	
DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	1,670,000.000	2,587,347.700	
FINLAND 0.375 09/15/20	1,150,000.000	1,168,273.500	
FINLAND 0.5 04/15/26	730,000.000	743,607.200	
FINLAND 0.5 09/15/27	600,000.000	604,062.000	
FINLAND 0.5 09/15/28	280,000.000	279,154.400	
FINLAND 0.75 04/15/31	750,000.000	752,385.000	
FINLAND 0.875 09/15/25	450,000.000	471,856.500	
FINLAND 04/15/22	770,000.000	778,408.400	
FINLAND 09/15/23	750,000.000	754,200.000	
FINLAND 1.125 04/15/34	610,000.000	632,167.400	
FINLAND 1.375 04/15/47	390,000.000	415,162.800	

FINLAND 1.5 04/15/23	830,000.000	890,963.500	
FINLAND 1.625 09/15/22	690,000.000	739,693.800	
FINLAND 2.0 04/15/24	700,000.000	776,377.000	
FINLAND 2.625 07/04/42	780,000.000	1,049,848.800	
FINLAND 2.75 07/04/28	700,000.000	848,232.000	
FINLAND 3.375 04/15/20	8,020,000.000	8,445,300.600	
FINLAND 3.5 04/15/21	2,460,000.000	2,689,887.000	
FINLAND 4.0 07/04/25	740,000.000	928,204.200	
FRANCE BTAN 8.5 04/25/23	1,480,000.000	2,041,822.800	
FRANCE OAT 0.25 11/25/20	4,300,000.000	4,364,457.000	
FRANCE OAT 0.25 11/25/26	4,400,000.000	4,346,056.000	
FRANCE OAT 0.5 05/25/25	5,500,000.000	5,611,595.000	
FRANCE OAT 0.5 05/25/26	5,000,000.000	5,062,950.000	
FRANCE OAT 0.75 05/25/28	5,470,000.000	5,533,342.600	
FRANCE OAT 0.75 11/25/28	4,350,000.000	4,376,491.500	
FRANCE OAT 02/25/20	4,210,000.000	4,239,217.400	
FRANCE OAT 02/25/21	7,080,000.000	7,146,552.000	
FRANCE OAT 03/25/23	2,800,000.000	2,814,924.000	
FRANCE OAT 03/25/24	6,520,000.000	6,505,721.200	
FRANCE OAT 05/25/20	5,400,000.000	5,444,280.000	
FRANCE OAT 05/25/21	4,160,000.000	4,201,600.000	
FRANCE OAT 05/25/22	5,500,000.000	5,552,140.000	
FRANCE OAT 1.0 05/25/27	5,000,000.000	5,214,300.000	
FRANCE OAT 1.0 11/25/25	5,200,000.000	5,465,720.000	
FRANCE OAT 1.25 05/25/34	500,000.000	510,720.000	
FRANCE OAT 1.25 05/25/36	3,600,000.000	3,603,600.000	
FRANCE OAT 1.5 05/25/31	8,170,000.000	8,737,651.600	
FRANCE OAT 1.75 05/25/23	7,450,000.000	8,073,937.500	
FRANCE OAT 1.75 05/25/66	1,450,000.000	1,428,511.000	
FRANCE OAT 1.75 06/25/39	2,620,000.000	2,818,858.000	
FRANCE OAT 1.75 11/25/24	5,600,000.000	6,145,160.000	
FRANCE OAT 2.0 05/25/48	4,620,000.000	5,057,190.600	
FRANCE OAT 2.25 05/25/24	5,400,000.000	6,057,504.000	
FRANCE OAT 2.25 10/25/22	4,900,000.000	5,370,498.000	
FRANCE OAT 2.5 05/25/30	4,850,000.000	5,740,072.000	
FRANCE OAT 2.5 10/25/20	4,300,000.000	4,545,186.000	

FRANCE OAT 2.75 10/25/27	8,030,000.000	9,602,755.800	
FRANCE OAT 3.0 04/25/22	6,220,000.000	6,918,008.400	
FRANCE OAT 3.25 05/25/45	3,850,000.000	5,330,941.000	
FRANCE OAT 3.25 10/25/21	6,000,000.000	6,630,900.000	
FRANCE OAT 3.5 04/25/20	3,020,000.000	3,188,606.600	
FRANCE OAT 3.5 04/25/26	9,810,000.000	12,121,236.000	
FRANCE OAT 3.75 04/25/21	5,510,000.000	6,061,551.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/55	2,250,000.000	3,658,950.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/60	2,440,000.000	4,082,730.000	
FRANCE OAT 4.0 10/25/38	4,510,000.000	6,702,671.800	
FRANCE OAT 4.25 10/25/23	6,320,000.000	7,658,765.600	
FRANCE OAT 4.5 04/25/41	5,850,000.000	9,415,224.000	
FRANCE OAT 4.75 04/25/35	5,400,000.000	8,378,262.000	
FRANCE OAT 5.5 04/25/29	5,620,000.000	8,347,498.400	
FRANCE OAT 5.75 10/25/32	5,000,000.000	8,129,450.000	
FRANCE OAT 6.0 10/25/25	2,220,000.000	3,095,701.200	
IRISH 0.8 03/15/22	930,000.000	959,062.500	
IRISH 0.9 05/15/28	1,360,000.000	1,358,408.800	
IRISH 1.0 05/15/26	1,300,000.000	1,338,038.000	
IRISH 1.3 05/15/33	740,000.000	731,830.400	
IRISH 1.7 05/15/37	930,000.000	954,031.200	
IRISH 10/18/22	2,420,000.000	2,424,477.000	
IRISH 2.0 02/18/45	1,350,000.000	1,430,703.000	
IRISH 2.4 05/15/30	1,490,000.000	1,694,234.300	
IRISH 3.4 03/18/24	1,120,000.000	1,309,089.600	
IRISH 3.9 03/20/23	950,000.000	1,109,448.000	
IRISH 4.5 04/18/20	1,570,000.000	1,676,053.500	
IRISH 5.0 10/18/20	2,710,000.000	2,987,585.300	
IRISH 5.4 03/13/25	2,460,000.000	3,215,638.200	
ITALY BTPS 0.05 04/15/21	950,000.000	928,302.000	
ITALY BTPS 0.2 10/15/20	2,500,000.000	2,478,025.000	
ITALY BTPS 0.35 06/15/20	3,600,000.000	3,590,172.000	
ITALY BTPS 0.35 11/01/21	10,200,000.000	9,936,126.000	
ITALY BTPS 0.45 06/01/21	3,750,000.000	3,694,875.000	
ITALY BTPS 0.65 10/15/23	1,870,000.000	1,748,524.800	
ITALY BTPS 0.65 11/01/20	2,000,000.000	1,997,640.000	
ITALY BTPS 0.7 05/01/20	3,800,000.000	3,808,892.000	

ITALY BTPS 0.9 08/01/22	3,000,000.000	2,909,610.000	
ITALY BTPS 0.95 03/01/23	2,000,000.000	1,918,320.000	
ITALY BTPS 0.95 03/15/23	2,700,000.000	2,590,650.000	
ITALY BTPS 1.2 04/01/22	2,700,000.000	2,664,630.000	
ITALY BTPS 1.25 12/01/26	3,500,000.000	3,149,930.000	
ITALY BTPS 1.35 04/15/22	3,000,000.000	2,971,980.000	
ITALY BTPS 1.45 05/15/25	1,360,000.000	1,269,587.200	
ITALY BTPS 1.45 11/15/24	2,800,000.000	2,644,796.000	
ITALY BTPS 1.5 06/01/25	7,430,000.000	6,971,494.700	
ITALY BTPS 1.6 06/01/26	3,300,000.000	3,071,310.000	
ITALY BTPS 1.65 03/01/32	3,300,000.000	2,765,202.000	
ITALY BTPS 1.85 05/15/24	2,800,000.000	2,733,920.000	
ITALY BTPS 2.0 02/01/28	6,190,000.000	5,761,899.600	
ITALY BTPS 2.0 12/01/25	2,900,000.000	2,786,726.000	
ITALY BTPS 2.05 08/01/27	1,550,000.000	1,451,389.000	
ITALY BTPS 2.15 12/15/21	2,000,000.000	2,042,800.000	
ITALY BTPS 2.2 06/01/27	2,500,000.000	2,376,750.000	
ITALY BTPS 2.25 09/01/36	2,400,000.000	2,058,720.000	
ITALY BTPS 2.45 09/01/33	2,650,000.000	2,388,842.500	
ITALY BTPS 2.5 12/01/24	10,920,000.000	10,958,984.400	
ITALY BTPS 2.7 03/01/47	2,650,000.000	2,283,505.000	
ITALY BTPS 2.8 03/01/67	1,100,000.000	917,840.000	
ITALY BTPS 2.8 12/01/28	1,160,000.000	1,133,598.400	
ITALY BTPS 2.95 09/01/38	1,450,000.000	1,326,445.500	
ITALY BTPS 3.25 09/01/46	2,200,000.000	2,079,946.000	
ITALY BTPS 3.45 03/01/48	2,050,000.000	1,977,430.000	
ITALY BTPS 3.5 03/01/30	3,980,000.000	4,101,947.200	
ITALY BTPS 3.75 03/01/21	2,950,000.000	3,126,380.500	
ITALY BTPS 3.75 05/01/21	3,000,000.000	3,183,600.000	
ITALY BTPS 3.75 08/01/21	3,500,000.000	3,718,750.000	
ITALY BTPS 3.75 09/01/24	2,500,000.000	2,671,500.000	

ITALY BTPS 4.0 02/01/37	4,570,000.000	4,904,067.000	
ITALY BTPS 4.0 09/01/20	4,220,000.000	4,456,320.000	
ITALY BTPS 4.25 03/01/20	2,110,000.000	2,206,089.400	
ITALY BTPS 4.5 02/01/20	2,420,000.000	2,531,271.600	
ITALY BTPS 4.5 03/01/24	3,500,000.000	3,869,635.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/26	2,850,000.000	3,182,880.000	
ITALY BTPS 4.5 05/01/23	2,600,000.000	2,871,674.000	
ITALY BTPS 4.75 08/01/23	4,010,000.000	4,483,180.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/21	3,810,000.000	4,152,900.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/28	3,100,000.000	3,563,543.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/44	2,600,000.000	3,032,484.000	
ITALY BTPS 5.0 03/01/22	2,500,000.000	2,765,500.000	
ITALY BTPS 5.0 03/01/25	3,860,000.000	4,404,530.200	
ITALY BTPS 5.0 08/01/34	3,670,000.000	4,353,721.000	
ITALY BTPS 5.0 08/01/39	5,200,000.000	6,188,520.000	
ITALY BTPS 5.0 09/01/40	3,450,000.000	4,090,320.000	
ITALY BTPS 5.25 11/01/29	6,380,000.000	7,613,254.000	
ITALY BTPS 5.5 09/01/22	2,960,000.000	3,353,324.800	
ITALY BTPS 5.5 11/01/22	3,200,000.000	3,628,736.000	
ITALY BTPS 5.75 02/01/33	3,440,000.000	4,328,896.000	
ITALY BTPS 6.0 05/01/31	4,300,000.000	5,489,810.000	
ITALY BTPS 6.5 11/01/27	3,400,000.000	4,331,260.000	
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	2,238,050.000	
NETHERLANDS 0.25 01/15/20	2,150,000.000	2,171,908.500	
NETHERLANDS 0.25 07/15/25	2,400,000.000	2,431,128.000	
NETHERLANDS 0.5 07/15/26	3,140,000.000	3,217,872.000	
NETHERLANDS 0.75 07/15/27	2,390,000.000	2,482,994.900	
NETHERLANDS 0.75 07/15/28	2,340,000.000	2,418,366.600	
NETHERLANDS 01/15/22	2,800,000.000	2,838,864.000	
NETHERLANDS 01/15/24	1,640,000.000	1,650,364.800	
NETHERLANDS 1.75 07/15/23	3,350,000.000	3,659,808.000	
NETHERLANDS 2.0 07/15/24	2,030,000.000	2,266,352.900	
NETHERLANDS 2.25 07/15/22	2,280,000.000	2,498,674.800	

NETHERLANDS 2.5 01/15/33	2,110,000.000	2,643,851.100	
NETHERLANDS 2.75 01/15/47	2,510,000.000	3,662,165.300	
NETHERLANDS 3.25 07/15/21	2,760,000.000	3,032,826.000	
NETHERLANDS 3.5 07/15/20	2,290,000.000	2,441,598.000	
NETHERLANDS 3.75 01/15/23	1,670,000.000	1,952,397.000	
NETHERLANDS 3.75 01/15/42	2,860,000.000	4,644,840.200	
NETHERLANDS 4.0 01/15/37	2,310,000.000	3,586,275.000	
NETHERLANDS 5.5 01/15/28	2,070,000.000	3,032,550.000	
NETHERLANDS 7.5 01/15/23	590,000.000	780,039.000	
SPAIN 0.05 01/31/21	2,500,000.000	2,508,800.000	
SPAIN 0.35 07/30/23	1,000,000.000	997,970.000	
SPAIN 0.4 04/30/22	3,300,000.000	3,336,927.000	
SPAIN 0.45 10/31/22	2,600,000.000	2,628,210.000	
SPAIN 0.75 07/30/21	2,650,000.000	2,708,008.500	
SPAIN 1.15 07/30/20	4,500,000.000	4,604,625.000	
SPAIN 1.3 10/31/26	3,500,000.000	3,547,145.000	
SPAIN 1.4 01/31/20	3,600,000.000	3,672,540.000	
SPAIN 1.4 04/30/28	3,760,000.000	3,768,610.400	
SPAIN 1.4 07/30/28	2,080,000.000	2,071,971.200	
SPAIN 1.45 10/31/27	3,300,000.000	3,341,085.000	
SPAIN 1.5 04/30/27	2,700,000.000	2,753,190.000	
SPAIN 1.6 04/30/25	3,100,000.000	3,256,829.000	
SPAIN 1.95 04/30/26	3,000,000.000	3,194,580.000	
SPAIN 1.95 07/30/30	3,050,000.000	3,140,707.000	
SPAIN 2.15 10/31/25	4,650,000.000	5,030,974.500	
SPAIN 2.35 07/30/33	2,380,000.000	2,491,860.000	
SPAIN 2.7 10/31/48	1,730,000.000	1,754,393.000	
SPAIN 2.75 10/31/24	3,800,000.000	4,250,604.000	
SPAIN 2.9 10/31/46	2,500,000.000	2,668,575.000	
SPAIN 3.45 07/30/66	1,720,000.000	1,955,932.400	
SPAIN 3.8 04/30/24	2,980,000.000	3,483,769.000	
SPAIN 4.0 04/30/20	2,890,000.000	3,064,295.900	
SPAIN 4.2 01/31/37	3,000,000.000	3,940,260.000	
SPAIN 4.4 10/31/23	6,590,000.000	7,840,782.000	
SPAIN 4.65 07/30/25	3,380,000.000	4,205,632.600	
SPAIN 4.7 07/30/41	3,060,000.000	4,317,170.400	
SPAIN 4.8 01/31/24	3,000,000.000	3,648,390.000	
SPAIN 4.85 10/31/20	2,630,000.000	2,879,876.300	
SPAIN 4.9 07/30/40	2,970,000.000	4,272,048.000	
SPAIN 5.15 10/31/28	4,410,000.000	5,907,636.000	

	SPAIN 5.15 10/31/44	2,830,000.000	4,265,828.800	
	SPAIN 5.4 01/31/23	3,000,000.000	3,636,000.000	
	SPAIN 5.5 04/30/21	3,700,000.000	4,194,579.000	
	SPAIN 5.75 07/30/32	5,190,000.000	7,665,370.500	
	SPAIN 5.85 01/31/22	4,160,000.000	4,919,616.000	
	SPAIN 5.9 07/30/26	2,350,000.000	3,178,234.000	
	SPAIN 6.0 01/31/29	3,500,000.000	4,994,955.000	
	ユーロ 小計	847,720,000.000 (108,898,111,200)	959,196,253.400 (123,218,350,712)	
南アフリカ・ランド	SOUTH AFRICA 6.25 03/31/36	17,630,000.000	12,321,430.700	
	SOUTH AFRICA 6.5 02/28/41	13,680,000.000	9,329,349.600	
	SOUTH AFRICA 7.0 02/28/31	17,190,000.000	13,834,512.000	
	SOUTH AFRICA 8.0 01/31/30	15,820,000.000	14,050,691.200	
	SOUTH AFRICA 8.25 03/31/32	13,000,000.000	11,464,960.000	
	SOUTH AFRICA 8.5 01/31/37	16,500,000.000	14,361,105.000	
	SOUTH AFRICA 8.75 01/31/44	15,000,000.000	13,060,350.000	
	SOUTH AFRICA 8.75 02/28/48	58,790,000.000	51,248,418.800	
	SOUTH AFRICA 8.875 02/28/35	10,000,000.000	9,096,100.000	
	SOUTH AFRICA 9.0 01/31/40	9,000,000.000	8,119,530.000	
	南アフリカ・ランド 小計	186,610,000.000 (1,468,620,700)	156,886,447.300 (1,234,696,340)	
	国債証券 合計	292,078,206,780 (292,078,206,780)	309,476,392,363 (309,476,392,363)	
	合計	292,078,206,780 (292,078,206,780)	309,476,392,363 (309,476,392,363)	

(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 178銘柄	44.57%	46.35%
イギリス・ポンド	国債証券 39銘柄	6.35%	6.60%
オーストラリア・ドル	国債証券 23銘柄	2.06%	2.15%
カナダ・ドル	国債証券 30銘柄	1.95%	2.03%
シンガポール・ドル	国債証券 16銘柄	0.29%	0.31%
スウェーデン・クローナ	国債証券 5銘柄	0.21%	0.22%
デンマーク・クローネ	国債証券 4銘柄	0.41%	0.43%
ノルウェー・クローネ	国債証券 6銘柄	0.17%	0.18%
ポーランド・ズロチ	国債証券 12銘柄	0.49%	0.51%
マレーシア・リングギット	国債証券 15銘柄	0.35%	0.36%
メキシコ・ペソ	国債証券 14銘柄	0.62%	0.65%
ユーロ	国債証券 289銘柄	38.29%	39.82%
南アフリカ・ランド	国債証券 10銘柄	0.38%	0.40%

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

「エマージング株式パッシブ・マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成30年6月11日現在	平成30年12月11日現在
資産の部			
流動資産			
預金		5,601,548,359	2,139,537,250
コール・ローン		66,370,171	439,165,834
株式		62,622,552,042	44,442,360,635
投資信託受益証券		292,228,492	209,150,747
投資証券		110,906,923	68,992,188
派生商品評価勘定		11,391,900	1,090,080
未収入金		1,040,178	17,428,648
未収配当金		131,142,379	22,129,594
差入委託証拠金		960,057,177	457,594,564
流動資産合計		69,797,237,621	47,797,449,540
資産合計		69,797,237,621	47,797,449,540
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		25,466,490	75,190,211
未払金		3,476,050,285	-
未払解約金		32,651,000	681,247,000
その他未払費用		2,527	-
流動負債合計		3,534,170,302	756,437,211
負債合計		3,534,170,302	756,437,211
純資産の部			
元本等			
元本	1	54,153,814,826	43,585,591,471
剰余金			
剰余金又は欠損金()		12,109,252,493	3,455,420,858
元本等合計		66,263,067,319	47,041,012,329
純資産合計		66,263,067,319	47,041,012,329
負債純資産合計		69,797,237,621	47,797,449,540

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	平成30年6月11日現在	平成30年12月11日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	46,664,168,016円	54,153,814,826円
同期中追加設定元本額	22,786,309,118円	15,706,051,471円
同期中一部解約元本額	15,296,662,308円	26,274,274,826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 >	3,639,307,526円	4,142,427,950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)	519,366,252円	526,707,429円
M I T O ラップ型ファンド (安定型)	5,422,509円	3,828,134円
M I T O ラップ型ファンド (中立型)	15,490,682円	10,610,747円
M I T O ラップ型ファンド (積極型)	18,210,990円	13,230,020円
グローバル8資産ラップファン ド(安定型)	33,062,033円	27,864,451円
グローバル8資産ラップファン ド(中立型)	34,304,113円	28,537,703円
グローバル8資産ラップファン ド(積極型)	19,559,630円	16,073,343円
たわらノーロード 新興国株式	3,827,705,672円	4,389,883,451円
たわらノーロード 新興国株式 <ラップ向け>	1,202,738,458円	1,905,066,219円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	63,989,384円	190,681,329円
たわらノーロード バランス (堅実型)	389,510円	1,257,591円
たわらノーロード バランス (標準型)	1,536,758円	5,050,701円
たわらノーロード バランス (積極型)	5,240,617円	11,584,948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)	35,530円	113,508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)	2,671,553円	7,508,187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)	6,122,301円	22,682,320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)	4,075,066円	15,570,306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)	10,303,217円	47,322,762円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定型)	19,364円	34,527円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定成長型)	107,474円	484,295円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(成長型)	157,566円	329,078円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(積極型)	547,494円	830,968円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	429,132,057円	447,212,307円
D I A M D C 8資産 balan スファンド(新興国10)	50,799,988円	323,578,911円
D I A M D C 8資産 balan スファンド(新興国20)	168,040,185円	282,922,262円

DIAM DC 8資産バ ランスファンド(新興国30)	362,177,159円	556,578,683円
投資のソムリエ	4,222,449,231円	1,259,880,520円
クルーズコントロール	1,052,340,320円	582,870,316円
投資のソムリエ<DC年金>	313,360,884円	113,471,725円
DIAM 8資産バ ランスファ ンドN<DC年金>	188,411,503円	233,487,274円
クルーズコントロール<DC年 金>	441,607円	377,623円
DIAMコア資産設計ファンド (堅実型)	13,058,591円	7,991,023円
DIAMコア資産設計ファンド (積極型)	49,220,369円	19,170,778円
投資のソムリエ<DC年金>リ スク抑制型	161,263,510円	55,824,502円
ダイナミック・ナビゲーション	534,473円	572,764円
リスク抑制世界8資産バ ランス ファンド	2,933,470,326円	997,564,262円
ワールドアセットバランス(基 本コース)	1,964,816,977円	1,853,672,739円
ワールドアセットバランス(リ スク抑制コース)	7,712,821,183円	4,331,722,844円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2045)	1,414,527円	543,072円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2055)	924,199円	414,635円
リスク抑制世界8資産バ ランス ファンド(DC)	765,108円	342,685円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2035)	2,269,983円	856,271円
リスクコントロール世界資産分 散ファンド	76,172,088円	286,292,506円
9資産分散投資・スタンダード <DC年金>	-円	20,870円
エマージング株式パッシブファ ンドVA(適格機関投資家専 用)	4,455,331,749円	3,620,367,138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)	2,127,877,664円	2,125,580,212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)	11,096,231,306円	7,533,878,251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)	7,360,126,140円	7,582,717,331円
計	54,153,814,826円	43,585,591,471円
2. 受益権の総数	54,153,814,826口	43,585,591,471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12月12日 至 平成30年6月11日	自 平成30年6月12日 至 平成30年12月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成30年6月11日現在	平成30年12月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成30年6月11日現在	平成30年12月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
株式	173,802,402	5,694,899,784
投資信託受益証券	11,260,193	30,656,429
投資証券	9,789,244	18,795,325
合計	152,752,965	5,744,351,538

(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30年4月19日から平成30年6月11日まで及び平成30年4月19日から平成30年12月11日まで）に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	平成30年6月11日 現在				平成30年12月11日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	376,547,389	-	375,027,833	1,519,556	323,424,900	-	322,984,410	440,490
アメリカ・ドル	376,547,389	-	375,027,833	1,519,556	180,864,900	-	181,504,410	639,510
南アフリカ・ランド	-	-	-	-	142,560,000	-	141,480,000	1,080,000
買 建	354,668,589	-	356,587,702	1,919,113	-	-	-	-
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	731,215,978	-	731,615,535	3,438,669	323,424,900	-	322,984,410	440,490

(注) 時価の算定方法

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

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

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

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

株式関連

種類	平成30年6月11日 現在				平成30年12月11日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								
先物取引								
買 建	3,245,955,639	-	3,228,442,380	17,513,259	2,311,785,727	-	2,237,245,106	74,540,621
合計	3,245,955,639	-	3,228,442,380	17,513,259	2,311,785,727	-	2,237,245,106	74,540,621

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成30年6月11日現在	平成30年12月11日現在
1口当たり純資産額	1.2236円	1.0793円
(1万口当たり純資産額)	(12,236円)	(10,793円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

平成30年12月11日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	CTRI.P.COM INTERNATIONAL LTD ADR	34,700	28.560	991,032.000	
	CIA DE MINAS BUENAVENTURA SA ADR	17,000	14.910	253,470.000	
	SURGUTNEFTEGAZ SP ADR PREF	69,900	5.705	398,779.500	
	CREDICORP LTD	5,849	216.160	1,264,319.840	
	SINA CORP	5,300	62.820	332,946.000	
	MOBILE TELESYSTEMS PJSC ADR	38,725	6.910	267,589.750	
	NETEASE INC-ADR	6,400	236.820	1,515,648.000	
	SOUTHERN COPPER CORP	5,280	32.260	170,332.800	
	LUKOIL SPON ADR	40,288	77.380	3,117,485.440	
	GAZPROM PAO ADR	448,380	4.796	2,150,430.480	
	COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK SP GDR	103,943	4.105	426,686.010	
	INNER MONGOLIA YITAI COAL CO	105,800	1.218	128,864.400	
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRADE	63,980	1.326	84,837.480	
	SURGUTNEFTEGAZ ADR	74,317	4.134	307,226.470	
	51JOB INC ADR	2,300	67.600	155,480.000	
	X5 RETAIL GROUP NV GDR	10,913	23.620	257,765.060	
	NOVATEK PJSC GDR	7,591	167.000	1,267,697.000	
	BAIDU INC -SPON ADR	22,900	179.200	4,103,680.000	
	NOVOLIPETSK STEEL GDR	11,980	23.470	281,170.600	
	MMC NORILSK NICKEL ADR	57,716	18.850	1,087,946.600	
	ROSNEFT OIL CO GDR	104,550	6.410	670,165.500	
	NEW ORIENTAL EDUCATION & TECH	12,100	54.970	665,137.000	
	SEVERSTAL GDR	21,907	14.150	309,984.050	
	TATNEFT ADR	21,050	68.600	1,444,030.000	
	MAGNITOGORSK IRON & STEEL SPON GDR	19,500	9.110	177,645.000	
	VTB BANK OJSC GDR	172,000	1.204	207,088.000	
	DP WORLD LTD	15,219	16.370	249,135.030	
	MAGNIT PJSC GDR	28,329	13.510	382,724.790	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD ADR	32,600	5.300	172,780.000	
	TAL EDUCATION GROUP-ADR	30,400	26.900	817,760.000	
NOAH HOLDINGS LTD ADR	2,700	46.370	125,199.000		
SBERBANK ADR	224,930	11.510	2,588,944.300		
PHOSAGRO PJSC GDR	13,784	13.000	179,192.000		

	HUAZHU GROUP LTD ADR	11,800	30.620	361,316.000	
	YY INC-ADR	3,900	62.910	245,349.000	
	GDS HOLDINGS LTD ADR	5,600	27.090	151,704.000	
	58.COM INC ADR	7,300	57.980	423,254.000	
	AUTOHOME INC ADR	4,600	88.240	405,904.000	
	WEIBO CORP ADR	4,700	61.220	287,734.000	
	JD.COM INC ADR	57,800	20.510	1,185,478.000	
	ALIBABA GROUP HOLDING LTD-ADR	106,580	151.430	16,139,409.400	
	MOMO INC SPON ADR	13,100	24.260	317,806.000	
	BAOZUN INC-SPN ADR	3,400	33.940	115,396.000	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	28,400	34.960	992,864.000	
	POLYUS PJSC GDR	6,012	38.000	228,456.000	
	HUTCHISON CHINA MEDITECH LTD ADR	3,600	30.740	110,664.000	
アメリカ・ドル 小計		2,089,123		47,518,506.500 (5,374,818,271)	
アラブ首長国連邦・ディルハム	DUBAI ISLAMIC BANK PJSC	136,145	5.050	687,532.250	
	EMIRATES TELECOMMUNICATIONS GROUP CO PJSC	130,625	16.820	2,197,112.500	
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK PJSC	172,040	7.920	1,362,556.800	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	215,991	13.800	2,980,675.800	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	289,208	3.980	1,151,047.840	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	356,142	1.530	544,897.260	
	EMAAR DEVELOPMENT PJSC	77,463	4.310	333,865.530	
	EMAAR MALLS PJSC	178,166	1.700	302,882.200	
	DAMAC PROPERTIES DUBAI CO PJSC	190,235	1.730	329,106.550	
アラブ首長国連邦・ディルハム 小計		1,746,015		9,889,676.730 (305,096,527)	
イギリス・ポンド	POLYMETAL INTERNATIONAL PLC	12,287	8.138	99,991.600	
イギリス・ポンド 小計		12,287		99,991.600 (14,203,806)	
インド・ルピー	RELIANCE INDUSTRIES LTD	233,815	1,090.250	254,916,803.750	
	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	66,548	330.250	21,977,477.000	
	ASIAN PAINTS LTD	24,074	1,274.200	30,675,090.800	
	EICHER MOTORS LTD	923	22,404.850	20,679,676.550	
	GRASIM INDUSTRIES LTD	22,267	790.400	17,599,836.800	
	MAHINDRA & MAHINDRA LTD	63,234	710.550	44,930,918.700	
	SHREE CEMENT LTD	446	16,021.700	7,145,678.200	
	ICICI BANK LTD	191,895	346.350	66,462,833.250	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP LTD	58,463	226.700	13,253,562.100	
	STATE BANK OF INDIA LTD	150,942	274.200	41,388,296.400	

CONTAINER CORP OF INDIA LTD	15,148	664.100	10,059,786.800	
LIC HOUSING FINANCE LTD	26,242	419.850	11,017,703.700	
TATA STEEL LTD	28,060	502.850	14,109,971.000	
TATA MOTORS LTD	138,820	157.100	21,808,622.000	
JSW STEEL LTD	69,648	294.100	20,483,476.800	
TATA POWER CO LTD	82,406	77.650	6,398,825.900	
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	4,658	2,980.650	13,883,867.700	
NESTLE INDIA LTD	1,904	10,398.900	19,799,505.600	
GAIL INDIA LTD	70,027	332.050	23,252,465.350	
VEDANTA LTD	110,581	192.550	21,292,371.550	
AXIS BANK LTD	145,336	590.300	85,791,840.800	
TITAN COMPANY LTD	27,648	907.100	25,079,500.800	
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	122,655	137.100	16,816,000.500	
LUPIN LTD	18,317	812.750	14,887,141.750	
BAJAJ FINANCE LTD	14,571	2,395.550	34,905,559.050	
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP	131,396	1,906.500	250,506,474.000	
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISES LTD	43,870	466.150	20,450,000.500	
INFOSYS LTD	301,453	669.200	201,732,347.600	
WIPRO LTD	100,958	326.600	32,972,882.800	
INDIAN OIL CORP LTD	119,485	134.350	16,052,809.750	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	55,659	1,795.800	99,952,432.200	
HCL TECHNOLOGIES LTD	47,449	942.000	44,696,958.000	
DABUR INDIA LTD	43,516	405.600	17,650,089.600	
HERO MOTOCORP LTD	4,509	3,046.500	13,736,668.500	
DR REDDYS LABORATORIES LTD	8,183	2,690.450	22,015,952.350	
BHARTI AIRTEL LTD	105,866	294.950	31,225,176.700	
UNITED SPIRITS LTD	23,992	619.750	14,869,042.000	
SUN PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD	71,008	399.000	28,332,192.000	
DIVI'S LABORATORIES LTD	5,467	1,472.650	8,050,977.550	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	8,165	7,350.500	60,016,832.500	
GLENMARK PHARMACEUTICALS LTD	4,790	635.000	3,041,650.000	
AUROBINDO PHARMA LTD	17,598	733.300	12,904,613.400	
HAVELLS INDIA LTD	20,334	666.050	13,543,460.700	
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	51,716	149.650	7,739,299.400	
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE CO LTD	13,834	1,091.250	15,096,352.500	
PETRONET LNG LTD	52,875	208.450	11,021,793.750	
CIPLA LTD/INDIA	31,870	512.550	16,334,968.500	
LARSEN & TOUBRO LTD	36,754	1,367.750	50,270,283.500	
ULTRATECH CEMENT LTD	7,975	3,776.550	30,117,986.250	
ASHOK LEYLAND LTD	110,886	100.450	11,138,498.700	

	BOSCH LTD	496	18,483.850	9,167,989.600	
	TATA CONSULTANCY SERVICES LTD	72,050	1,975.800	142,356,390.000	
	NTPC LTD	175,055	136.200	23,842,491.000	
	PIRAMAL ENTERPRISES LTD	7,474	2,042.600	15,266,392.400	
	YES BANK LTD	153,758	165.650	25,470,012.700	
	AMBUJA CEMENTS LTD	54,635	204.900	11,194,711.500	
	BHARAT FORGE LTD	18,421	506.050	9,321,947.050	
	HINDALCO INDUSTRIES LTD	99,935	217.900	21,775,836.500	
	ITC LTD	294,156	270.450	79,554,490.200	
	PIDILITE INDUSTRIES LTD	11,666	1,123.050	13,101,501.300	
	UNITED PHOSPHORUS LTD	29,391	746.550	21,941,851.050	
	GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	32,823	737.800	24,216,809.400	
	TECH MAHINDRA LTD	32,685	687.900	22,484,011.500	
	VODAFONE IDEA LTD	196,527	33.000	6,485,391.000	
	MARICO LTD	35,723	346.250	12,369,088.750	
	PAGE INDUSTRIES LTD	528	24,126.900	12,739,003.200	
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	130,563	179.300	23,409,945.900	
	ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	40,710	359.150	14,620,996.500	
	REC LTD	55,173	100.350	5,536,610.550	
	BAJAJ FINSERV LTD	3,159	5,693.950	17,987,188.050	
	BAJAJ AUTO LTD	7,015	2,725.100	19,116,576.500	
	COAL INDIA LTD	62,457	238.150	14,874,134.550	
	MAHINDRA & MAHINDRA FINANCIAL SERVICES LTD	28,933	400.350	11,583,326.550	
	BHARTI INFRA TEL LTD	32,296	250.350	8,085,303.600	
	INDIABULLS HOUSING FINANCE LTD	25,466	686.600	17,484,955.600	
	TATA STEEL LTD-PARTLY PAID	2,333	87.750	204,720.750	
	CADILA HEALTHCARE LTD	16,962	340.400	5,773,864.800	
	AVENUE SUPERMARTS LTD	8,740	1,510.200	13,199,148.000	
	INTERGLOBE AVIATION LTD	8,300	1,004.550	8,337,765.000	
	インド・ルピー 小計	4,745,666		2,503,589,009.100 (3,930,634,744)	
インドネシア・ルピア	UNITED TRACTORS TBK PT	139,101	29,750.000	4,138,254,750.000	
	INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK PT	359,200	6,525.000	2,343,780,000.000	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	137,500	43,950.000	6,043,125,000.000	
	PT ASTRA INTERNATIONAL TBK	1,715,400	8,150.000	13,980,510,000.000	
	TELEKOMUNIKASI INDONESIA PERSERO TBK	4,307,500	3,680.000	15,851,600,000.000	

	CHAROEN POKPHAND INDONESIA TBK PT	675,600	7,000.000	4,729,200,000.000	
	GUDANG GARAM TBK PT	44,800	82,800.000	3,709,440,000.000	
	HANJAYA MANDALA SAMPOERNA TBK	655,400	3,750.000	2,457,750,000.000	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA TBK PT	149,500	20,750.000	3,102,125,000.000	
	INDAH KIAT PULP AND PAPER CORP TBK PT	262,000	11,475.000	3,006,450,000.000	
	BUKIT ASAM TBK PT	154,500	4,020.000	621,090,000.000	
	BANK DANAMON INDONESIA TBK PT	261,316	7,400.000	1,933,738,400.000	
	BANK MANDIRI	1,568,800	7,425.000	11,648,340,000.000	
	PABRIK KERTAS TJIWI KIMIA TBK PT	98,000	10,725.000	1,051,050,000.000	
	BANK RAKYAT INDONESIA	4,337,100	3,610.000	15,656,931,000.000	
	PERUSAHAAN GAS NEGARA PT	1,064,100	2,090.000	2,223,969,000.000	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSERO TBK PT	529,100	8,575.000	4,537,032,500.000	
	KALBE FARMA TBK PT	1,822,200	1,580.000	2,879,076,000.000	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK PT	276,500	11,950.000	3,304,175,000.000	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	839,300	25,900.000	21,737,870,000.000	
	JASA MARGA PERSERO TBK PT	200,125	4,520.000	904,565,000.000	
	ADARO ENERGY PT	1,434,500	1,310.000	1,879,195,000.000	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR TBK PT	170,700	9,725.000	1,660,057,500.000	
	TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE TBK PT	180,800	3,950.000	714,160,000.000	
	BANK TABUNGAN NEGARA TBK PT	480,300	2,680.000	1,287,204,000.000	
	PT SURYA CITRA MEDIA TBK	511,300	1,900.000	971,470,000.000	
	インドネシア・ルピア 小計	22,374,642		132,372,158,150.000 (1,032,502,834)	
オフショア・人民 元	LUXSHARE PRECISION INDUSTRY CO LTD	9,600	14.950	143,520.000	
	FOCUS MEDIA INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD	26,300	5.890	154,907.000	
	IFLYTEK CO LTD	6,400	24.320	155,648.000	
	YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD	2,300	76.250	175,375.000	
	JIANGSU YANGHE BREWERY JOINT-STOCK CO LTD	2,500	98.400	246,000.000	
	WULIANGYE YIBIN CO LTD	4,500	52.330	235,485.000	
	SUNING.COM CO LTD	29,500	10.660	314,470.000	
	BOE TECHNOLOGY GROUP CO LTD	79,900	2.720	217,328.000	

CHINA MERCHANTS SHEKOU INDUSTRIAL ZONE HOLDINGS CO LTD	12,300	17.960	220,908.000	
GREE ELECTRIC APPLIANCES INC OF ZHUHAI	5,700	35.830	204,231.000	
MIDEA GROUP CO LTD	8,000	37.060	296,480.000	
HANGZHOU HIKVISION DIGITAL TECHNOLOGY CO LTD	12,000	26.780	321,360.000	
PING AN BANK CO LTD	27,200	10.170	276,624.000	
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO LTD	79,000	4.390	346,810.000	
CHINA VANKE CO LTD	13,700	25.000	342,500.000	
WEICHAI POWER CO LTD	29,900	7.510	224,549.000	
GF SECURITIES CO LTD	22,700	13.030	295,781.000	
BYD CO LTD	7,500	55.390	415,425.000	
BANK OF SHANGHAI CO LTD	20,900	11.510	240,559.000	
PETROCHINA CO LTD	32,800	7.620	249,936.000	
INDUSTRIAL & COMMERCIAL BANK OF CHINA LTD	75,500	5.330	402,415.000	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA LTD	82,500	3.560	293,700.000	
BANK OF CHINA LTD	74,500	3.570	265,965.000	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL CORP	51,300	5.920	303,696.000	
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	17,100	28.340	484,614.000	
PING AN INSURANCE GROUP CO OF CHINA LTD	14,000	62.180	870,520.000	
INDUSTRIAL BANK CO LTD	27,400	15.880	435,112.000	
SHANGHAI PUDONG DEVELOPMENT BANK CO LTD	36,700	10.830	397,461.000	
CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	73,320	6.020	441,386.400	
SAIC MOTOR CORP LTD	10,900	24.300	264,870.000	
KWEICHOW MOUTAI CO LTD	1,800	577.230	1,039,014.000	
BANK OF COMMUNICATIONS CO LTD	79,200	5.790	458,568.000	
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	10,900	29.670	323,403.000	
CHINA YANGTZE POWER CO LTD	26,500	14.360	380,540.000	
DAQIN RAILWAY CO LTD	30,100	7.980	240,198.000	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD	60,800	3.810	231,648.000	
CHINA STATE CONSTRUCTION ENGINEERING CORP LTD	61,600	5.930	365,288.000	
HAITONG SECURITIES CO LTD	36,000	9.710	349,560.000	
HUAXIA BANK CO LTD	23,200	7.650	177,480.000	

INNER MONGOLIA YILI INDUSTRIAL GROUP CO LTD	10,400	22.580	234,832.000	
BANK OF BEIJING CO LTD	42,800	5.950	254,660.000	
BAOSHAN IRON & STEEL CO LTD	29,200	6.900	201,480.000	
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	4,200	30.690	128,898.000	
CHINA MERCHANTS SECURITIES CO LTD	22,800	13.950	318,060.000	
POLY DEVELOPMENTS AND HOLDINGS GROUP CO LTD	20,400	12.440	253,776.000	
CRRG CORP LTD	38,600	9.210	355,506.000	
JIANGSU HENGRUI MEDICINE CO LTD	4,900	59.000	289,100.000	
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION CORP LTD	27,400	11.360	311,264.000	
HUATAI SECURITIES CO LTD	30,600	16.880	516,528.000	
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD	21,100	8.160	172,176.000	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	11,000	25.710	282,810.000	
FOUNDER SECURITIES CO LTD	31,000	5.330	165,230.000	
KANGMEI PHARMACEUTICAL CO LTD	14,300	10.670	152,581.000	
CHINA INTERNATIONAL TRAVEL SERVICE CORP LTD	3,900	58.920	229,788.000	
AVIC CAPITAL CO LTD	49,800	4.470	222,606.000	
METALLURGICAL CORP OF CHINA LTD	54,400	3.110	169,184.000	
POWER CONSTRUCTION CORP OF CHINA LTD	36,100	4.820	174,002.000	
SICHUAN CHUANTOU ENERGY CO LTD	23,700	8.140	192,918.000	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD	9,900	17.770	175,923.000	
AECG AVIATION POWER CO LTD	9,500	22.980	218,310.000	
JOINTOWN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	16,000	14.690	235,040.000	
INDUSTRIAL SECURITIES CO LTD	53,200	5.010	266,532.000	
BEIJING TONGRENTANG CO LTD	6,400	28.800	184,320.000	
SHANDONG GOLD MINING CO LTD	8,000	28.780	230,240.000	
YONGHUI SUPERSTORES CO LTD	24,000	7.650	183,600.000	
AISINO CORP	6,400	23.020	147,328.000	

	CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD	28,600	7.220	206,492.000	
	ZHANGZHOU PIENZHEHUANG PHARMACEUTICAL CO LTD	1,800	85.000	153,000.000	
	HENGTONG OPTIC-ELECTRIC CO LTD	8,100	17.220	139,482.000	
	CHINA NATIONAL NUCLEAR POWER CO LTD	51,300	5.290	271,377.000	
	BANK OF JIANGSU CO LTD	32,400	6.210	201,204.000	
	ORIENT SECURITIES CO LTD/CHINA	24,800	8.990	222,952.000	
	EVERBRIGHT SECURITIES CO LTD	24,000	9.720	233,280.000	
オフショア・人民元 小計		2,007,020		20,497,813.400 (335,139,249)	
カタール・リアル	QATAR INSURANCE CO SAQ	14,417	37.140	535,447.380	
	QATAR NATIONAL BANK	36,289	196.990	7,148,570.110	
	COMMERCIAL BANK OF QATAR QSC	18,202	41.020	746,646.040	
	OOREDOO QSC	6,760	81.160	548,641.600	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	4,887	185.150	904,828.050	
	INDUSTRIES QATAR QSC	16,138	137.000	2,210,906.000	
	QATAR ISLAMIC BANK SAQ	10,281	155.260	1,596,228.060	
	MASRAF AL RAYAN	32,079	42.000	1,347,318.000	
	BARWA REAL ESTATE CO	11,235	40.540	455,466.900	
	EZDAN HOLDING GROUP QSC	59,601	12.900	768,852.900	
カタール・リアル 小計		209,889		16,262,905.040 (506,101,604)	
コロンビア・ペソ	INTERCONEXION ELECTRICA SA ESP	35,733	13,740.000	490,971,420.000	
	ECOPETROL SA	412,135	3,020.000	1,244,647,700.000	
	GRUPO DE INVERSIONES SURAMERICANA SA-PREF	10,138	30,600.000	310,222,800.000	
	GRUPO AVAL ACCIONES Y VALORES SA-PREF	341,831	1,040.000	355,504,240.000	
	CEMENTOS ARGOS SA	37,720	7,000.000	264,040,000.000	
	GRUPO ARGOS SA	28,217	16,680.000	470,659,560.000	
	BANCOLOMBIA SA	13,764	32,380.000	445,678,320.000	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	37,498	32,580.000	1,221,684,840.000	
	GRUPO DE INVERSIONES SURAMERICANA SA	19,105	32,620.000	623,205,100.000	
コロンビア・ペソ 小計		936,141		5,426,613,980.000 (192,644,796)	
タイ・パーツ	BANGKOK BANK PCL	15,900	213.000	3,386,700.000	
	BERLI JUCKER PCL NVDR	94,300	53.500	5,045,050.000	
	KRUNG THAI BANK PCL NVDR	348,000	20.500	7,134,000.000	
	ROBINSON PCL-NVDR	38,800	69.000	2,677,200.000	
	SIAM COMMERCIAL BANK PCL NVDR	162,900	139.000	22,643,100.000	

TRUE CORP PCL NVDR	820,155	5.950	4,879,922.250	
KASIKORNBANK PCL NVDR	60,200	192.500	11,588,500.000	
TMB BANK PCL -NVDR	1,010,000	2.340	2,363,400.000	
IRPC PCL NVDR	784,600	6.100	4,786,060.000	
BANPU PCL PUBLIC CO LTD NVDR	172,000	17.500	3,010,000.000	
ELECTRICITY GENERATING PCL NVDR	13,100	243.000	3,183,300.000	
CHAROEN POKPHAND FOODS PCL	311,500	25.250	7,865,375.000	
ADVANCED INFO SERVICE PCL	92,800	175.000	16,240,000.000	
HOME PRODUCT CENTER PCL- NVDR	380,520	15.400	5,860,008.000	
DELTA ELECTRONICS THAI PCL NVDR	44,200	69.250	3,060,850.000	
PTT PCL	831,200	49.500	41,144,400.000	
THAI UNION GROUP PCL- NVDR	162,600	17.300	2,812,980.000	
LAND AND HOUSES PCL NVDR	263,900	10.100	2,665,390.000	
SIAM CEMENT PCL NVDR	33,850	440.000	14,894,000.000	
AIRPORTS OF THAILAND PCL-NVDR	367,300	65.250	23,966,325.000	
KASIKORNBANK PCL - FOREIGN	97,700	192.000	18,758,400.000	
CENTRAL PATTANA PCL NVDR	119,200	76.500	9,118,800.000	
BANGKOK DUSIT MEDICAL SERVICES NVDR	322,400	26.750	8,624,200.000	
BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL- NVDR	25,800	196.500	5,069,700.000	
MINOR INTERNATIONAL PCL- NVDR	185,110	35.750	6,617,682.500	
THAI OIL PCL NVDR	65,600	73.500	4,821,600.000	
GLOW ENERGY PCL NVDR	54,000	86.250	4,657,500.000	
CP ALL PCL NVDR	428,400	71.500	30,630,600.000	
BTS GROUP HOLDINGS PCL	531,300	9.550	5,073,915.000	
PTT EXPLORATION & PRODUCTION PCL NVDR	99,145	135.000	13,384,575.000	
INDORAMA VENTURES PCL NVDR	139,122	54.500	7,582,149.000	
PTT GLOBAL CHEMICAL PCL- NVDR	156,508	79.250	12,403,259.000	
ENERGY ABSOLUTE PCL NVDR	118,000	48.750	5,752,500.000	
BANGKOK EXPRESSWAY & METRO PCL NVDR	740,700	9.200	6,814,440.000	
GULF ENERGY DEVELOPMENT PCL NVDR	14,300	76.000	1,086,800.000	
MUANGTHAI CAPITAL PCL NVDR	28,100	49.250	1,383,925.000	
タイ・パーツ 小計	9,133,210		330,986,605.750	

				(1,138,593,924)	
チェコ・コルナ	KOMERCNI BANKA AS	6,162	885.000	5,453,370.000	
	CEZ	15,014	530.500	7,964,927.000	
	MONETA MONEY BANK AS	37,459	76.400	2,861,867.600	
チェコ・コルナ 小計		58,635		16,280,164.600 (80,912,417)	
チリ・ペソ	BANCO SANTANDER CHILE	4,814,683	51.220	246,608,063.260	
	BANCO DE CREDITO E INVERSIONES	4,013	43,019.000	172,635,247.000	
	BANCO DE CHILE	2,035,145	95.570	194,498,807.650	
	EMPRESAS CMPC SA	103,228	2,187.200	225,780,281.600	
	EMPRESAS COPEC SA	34,981	8,800.700	307,857,286.700	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	10,642	8,461.700	90,049,411.400	
	ENTEL CHILE SA	10,666	5,482.700	58,478,478.200	
	ENEL AMERICAS SA	2,523,913	116.780	294,742,560.140	
	COLBUN SA	385,654	139.710	53,879,720.340	
	AGUAS ANDINAS SA	224,014	376.160	84,265,106.240	
	EMBOTELLADORA ANDINA SA	27,270	2,598.600	70,863,822.000	
	LATAM AIRLINES GROUP SA	26,485	6,552.100	173,532,368.500	
	SOCIEDAD QUIMICA Y MINERA DE CHILE SA	10,624	29,526.000	313,684,224.000	
	SACI FALABELLA	60,890	4,823.200	293,684,648.000	
	ITAU CORPBANCA	13,236,977	6.432	85,140,236.060	
	CENCOSUD SA	125,078	1,202.100	150,356,263.800	
ENEL CHILE SA	1,722,009	65.810	113,325,412.290		
チリ・ペソ 小計		25,356,272		2,929,381,937.180 (487,156,217)	
トルコ・リラ	AKBANK TAS	185,577	6.750	1,252,644.750	
	ANADOLU EFES BIRACILIK VE MALT SANAYII AS	4,454	20.600	91,752.400	
	ARCELIK	7,401	15.200	112,495.200	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	31,766	26.000	825,916.000	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIKALARI TAS	125,960	7.430	935,882.800	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	5,919	50.550	299,205.450	
	KOC HOLDING AS	67,325	14.660	986,984.500	
	PETKIM PETROKIMYA HOLDING	88,174	5.200	458,504.800	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI AS	79,624	5.260	418,822.240	
	TURK HAVA YOLLARI	36,589	16.100	589,082.900	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	72,290	12.200	881,938.000	
	TURKIYE GARANTI BANKASI AS	201,717	7.840	1,581,461.280	
	TURKIYE IS BANKASI	151,063	4.070	614,826.410	
	TUPRAS TURKIYE PETROL RAFINE	9,240	124.600	1,151,304.000	

	HACI OMER SABANCI HOLDING AS	88,752	7.490	664,752.480	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	19,011	84.750	1,611,182.250	
	TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	13,735	22.260	305,741.100	
	TURKIYE HALK BANKASI AS	61,970	7.150	443,085.500	
トルコ・リラ 小計		1,250,567		13,225,582.060 (280,911,363)	
ハンガリー・フォロント	RICHTER GEDEON NYRT	11,011	5,530.000	60,890,830.000	
	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NYRT	30,013	3,062.000	91,899,806.000	
	OTP BANK NYRT	17,606	11,290.000	198,771,740.000	
ハンガリー・フォロント 小計		58,630		351,562,376.000 (139,535,107)	
パキスタン・ルピー	MCB BANK LTD	39,000	198.660	7,747,740.000	
	OIL & GAS DEVELOPMENT CO LTD	74,500	146.510	10,914,995.000	
	HABIB BANK LTD	54,400	136.990	7,452,256.000	
パキスタン・ルピー 小計		167,900		26,114,991.000 (21,414,293)	
フィリピン・ペソ	AYALA LAND INC	641,100	40.300	25,836,330.000	
	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	128,910	50.600	6,522,846.000	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAND	47,550	93.500	4,445,925.000	
	AYALA CORP	21,583	910.000	19,640,530.000	
	ALLIANCE GLOBAL GROUP INC	307,700	11.660	3,587,782.000	
	DMCI HOLDINGS INC	351,850	12.700	4,468,495.000	
	GLOBE TELECOM INC	2,785	2,080.000	5,792,800.000	
	INTERNATIONAL CONTAINER TERM SERVICES INC	40,680	94.400	3,840,192.000	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	229,950	49.150	11,302,042.500	
	JOLLIBEE FOODS CORP	35,320	291.000	10,278,120.000	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	117,297	79.800	9,360,300.600	
	BDO UNIBANK INC	146,363	128.000	18,734,464.000	
	MEGAWORLD CORP	962,000	4.710	4,531,020.000	
	PLDT INC	8,600	1,168.000	10,044,800.000	
	ROBINSONS LAND CORP	218,722	20.700	4,527,545.400	
	SECURITY BANK CORP	23,420	160.000	3,747,200.000	
	SM PRIME HOLDINGS INC	900,475	35.450	31,921,838.750	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	63,330	128.000	8,106,240.000	
	SM INVESTMENTS CORP	19,828	900.000	17,845,200.000	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CORP	1,148,900	4.770	5,480,253.000	
ABOITIZ POWER CORP	128,200	32.750	4,198,550.000		

	MANILA ELECTRIC COMPANY	17,910	366.200	6,558,642.000	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	6,997	894.000	6,255,318.000	
フィリピン・ペソ	小計	5,569,470		227,026,434.250 (485,836,569)	
ブラジル・リアル	BRF SA	47,492	21.740	1,032,476.080	
	VALE SA	257,821	50.200	12,942,614.200	
	RAIA DROGASIL SA	20,600	60.900	1,254,540.000	
	TIM PARTICIPACOES SA	76,300	11.500	877,450.000	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	19,450	28.670	557,631.500	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	23,000	24.800	570,400.000	
	BANCO DO BRASIL SA	73,400	42.740	3,137,116.000	
	INVESTIMENTOS ITAU SA	378,560	11.750	4,448,080.000	
	LOJAS AMERICANAS SA	61,374	18.970	1,164,264.780	
	GERDAU SA	90,630	15.330	1,389,357.900	
	CIA BRASILEIRA DE DISTRIBUICAO GRUPO PAO DE ACUCAR	11,306	81.450	920,873.700	
	PETROLEO BRASILEIRO SA	241,810	26.470	6,400,710.700	
	PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	32,800	24.130	791,464.000	
	PETROLEO BRASILEIRO SA	326,012	23.440	7,641,721.280	
	KROTON EDUCACIONAL SA	122,968	9.750	1,198,938.000	
	CCR SA	100,520	12.020	1,208,250.400	
	WEG SA	74,072	17.210	1,274,779.120	
	BANCO BRADESCO SA PREF	273,125	37.160	10,149,325.000	
	BANCO BRADESCO SA	85,018	32.890	2,796,242.020	
	NATURA COSMETICOS SA	16,000	41.890	670,240.000	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	61,606	8.480	522,418.880	
	SUZANO PAPEL E CELULOSE SA	39,900	37.250	1,486,275.000	
	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	399,247	34.610	13,817,938.670	
	PORTO SEGURO SA	8,800	55.250	486,200.000	
	FIBRIA CELULOSE SA	18,590	66.680	1,239,581.200	
	B2W CIA DIGITAL	12,600	37.220	468,972.000	
	BRASKEM SA	12,930	49.390	638,612.700	
	ENGIE BRASIL SA	12,870	44.050	566,923.500	
	LOCALIZA RENT A CAR	33,780	26.810	905,641.800	
	TELEFONICA BRASIL S.A.	39,428	46.590	1,836,950.520	
	LOJAS RENNER SA	53,370	38.250	2,041,402.500	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	25,952	47.390	1,229,865.280	
	COSAN SA	16,200	33.510	542,862.000	
	EQUATORIAL ENERGIA SA	13,800	69.710	961,998.000	
	EMBRAER SA	55,760	20.880	1,164,268.800	
	M DIAS BRANCO SA	10,400	41.860	435,344.000	

	BR MALLS PARTICIPACOES SA	67,065	12.700	851,725.500	
	JBS SA	89,900	11.750	1,056,325.000	
	CIA ENERGETICA DE MINAS GERAIS	68,649	12.190	836,831.310	
	CIA DE SANEAMENTO BASICO DO ESTADO DE SAO PAULO	25,798	28.470	734,469.060	
	MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS IMOBILIARIOS SA	20,740	22.920	475,360.800	
	SUL AMERICA SA	17,869	28.870	515,878.030	
	HYPERA SA	28,000	32.030	896,840.000	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BAICAO	164,516	27.510	4,525,835.160	
	MAGAZINE LUIZA SA	6,500	160.530	1,043,445.000	
	BANCO SANTANDER BRASIL SA	37,100	42.300	1,569,330.000	
	CIELO SA	111,307	9.080	1,010,667.560	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	52,500	28.400	1,491,000.000	
	ATACADAO DISTRIBUICAO COMERCIO E INDUSTRIA LTDA	37,300	16.730	624,029.000	
	AMBEV SA	380,595	15.890	6,047,654.550	
	KLABIN SA	64,800	16.050	1,040,040.000	
	RUMO SA	82,100	15.800	1,297,180.000	
	IRB BRASIL RESSEGUROS S/A	10,500	75.200	789,600.000	
	ブラジル・リアル 小計	4,412,730		113,577,940.500 (3,274,452,024)	
ポーランド・ズロチ	BANK MILLENNIUM SA	49,782	9.030	449,531.460	
	MBANK	1,142	400.600	457,485.200	
	BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA	2,596	69.300	179,902.800	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	11,899	85.800	1,020,934.200	
	BANK PEKAO SA	14,392	106.600	1,534,187.200	
	ORANGE POLSKA SA	58,600	4.770	279,522.000	
	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	23,605	105.250	2,484,426.250	
	LPP SA	108	7,780.000	840,240.000	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	2,286	343.600	785,469.600	
	CD PROJEKT RED SA	6,015	140.200	843,303.000	
	POWSZECHNA KASA OSZCZEDNOSCI BANK POLSKI SA	74,465	39.500	2,941,367.500	
	CCC SA	2,763	196.000	541,548.000	
	GRUPA LOTOS SA	7,605	82.960	630,910.800	
	POLSKIE GORNICtwo NAFTOWE I GAZOWNICTWO SA	136,123	6.870	935,165.010	

	CYFROWY POLSAT SA	23,495	22.460	527,697.700	
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	70,529	11.180	788,514.220	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZEN SA	46,065	42.100	1,939,336.500	
	JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA SA	5,380	66.000	355,080.000	
	ALIOR BANK SA	9,007	54.800	493,583.600	
	DINO POLSKA SA	4,709	98.150	462,188.350	
ポーランド・ズロチ	小計	550,566		18,490,393.390 (553,232,570)	
マレーシア・リン ギット	AMMB HOLDINGS BHD	134,500	4.390	590,455.000	
	GENTING PLANTATIONS BHD	18,800	9.480	178,224.000	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	359,500	5.650	2,031,175.000	
	DIGI.COM BHD	288,700	4.390	1,267,393.000	
	MALAYSIA AIRPORTS HOLDINGS BHD	71,420	7.730	552,076.600	
	RHB BANK BHD	77,780	5.330	414,567.400	
	HAP SENG CONSOLIDATED BHD	63,200	9.700	613,040.000	
	TOP GLOVE CORP BHD	133,800	5.550	742,590.000	
	GAMUDA BHD	194,600	2.280	443,688.000	
	GENTING BHD	175,600	6.050	1,062,380.000	
	YTL CORP BHD	283,710	1.040	295,058.400	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP BHD	20,256	18.860	382,028.160	
	HONG LEONG BANK BHD	54,008	20.300	1,096,362.400	
	IJM CORP BHD	230,360	1.610	370,879.600	
	IOI CORP BHD	187,213	4.270	799,399.510	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	36,600	23.900	874,740.000	
	FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	12,800	32.040	410,112.000	
	MALAYAN BANKING BHD	295,675	9.370	2,770,474.750	
	ALLIANCE BANK MALAYSIA BHD	88,400	4.000	353,600.000	
	MISC BHD	90,280	6.010	542,582.800	
	NESTLE MALAYSIA BHD	4,800	144.900	695,520.000	
	PPB GROUP BHD	47,560	17.000	808,520.000	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	19,600	25.640	502,544.000	
	PETRONAS GAS BHD	60,400	19.100	1,153,640.000	
	GENTING MALAYSIA BHD	242,100	2.810	680,301.000	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD	14,700	36.700	539,490.000	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	49,100	2.580	126,678.000	
	SP SETIA BHD	66,300	2.380	157,794.000	
	TENAGA NASIONAL BHD	270,550	13.560	3,668,658.000	
	QL RESOURCES BHD	16,800	6.800	114,240.000	
	DIALOG GROUP BHD	320,544	3.170	1,016,124.480	

	PUBLIC BANK BHD(LOCAL)	230,130	24.700	5,684,211.000	
	AIRASIA GROUP BHD	147,900	3.090	457,011.000	
	SIME DARBY BERHAD	125,000	2.290	286,250.000	
	HARTELEGA HOLDINGS BHD	95,900	6.240	598,416.000	
	AXIATA GROUP BERHAD	219,800	3.800	835,240.000	
	MAXIS BHD	203,300	5.360	1,089,688.000	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	207,400	9.190	1,906,006.000	
	IHH HEALTHCARE BHD	220,400	5.400	1,190,160.000	
	WESTPORTS HOLDINGS BHD	109,200	3.610	394,212.000	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDINGS BHD	92,900	4.830	448,707.000	
	SIME DARBY PROPERTY BHD	232,700	0.950	221,065.000	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	216,100	4.480	968,128.000	
	IOI PROPERTIES GROUP SDN BHD	174,548	1.640	286,258.720	
	マレーシア・リンギット 小計	6,204,934		39,619,688.820 (1,072,504,977)	
メキシコ・ペソ	ALFA SAB DE CV	264,100	22.080	5,831,328.000	
	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	44,300	118.700	5,258,410.000	
	EL PUERTO DE LIVERPOOL SAB DE CV	19,100	124.690	2,381,579.000	
	GRUPO TELEVISIA SAB	208,500	53.680	11,192,280.000	
	GRUPO BIMBO SAB DE CV	105,300	38.950	4,101,435.000	
	GRUMA SAB DE CV	12,680	219.720	2,786,049.600	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INFRAESTRUCTURA	20,260	175.130	3,548,133.800	
	GRUPO CARSO SAB DE CV	37,600	68.330	2,569,208.000	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE SAB DE CV	209,700	93.150	19,533,555.000	
	MEXICHEM SAB DE CV	81,325	52.500	4,269,562.500	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	8,830	246.410	2,175,800.300	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO SAB DE CV	115,200	29.960	3,451,392.000	
	ALSEA SAB DE CV	43,700	50.000	2,185,000.000	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL SURESTE SAB DE CV	17,990	289.440	5,207,025.600	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV	305,952	42.210	12,914,233.920	
	AMERICA MOVIL SAB DE CV	2,717,078	13.960	37,930,408.880	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA SA	198,800	27.840	5,534,592.000	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	42,600	102.540	4,368,204.000	
	WAL-MART DE MEXICO SAB DE CV	449,900	49.980	22,486,002.000	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL PACIFICO SAB DE CV	31,200	143.500	4,477,200.000	

	MEGACABLE HOLDINGS SAB DE CV	18,400	94.910	1,746,344.000	
	INFRAESTRUCTURA ENERGETICA NOVA SAB DE CV	43,600	76.470	3,334,092.000	
	BANCO SANTANDER MEXICO SA-B	174,090	25.710	4,475,853.900	
メキシコ・ペソ 小計		5,170,205		171,757,689.500 (954,972,753)	
ユーロ	ALPHA BANK A.E.	125,732	1.250	157,165.000	
	TITAN CEMENT CO. S.A.	4,089	19.540	79,899.060	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	22,051	10.690	235,725.190	
	FF GROUP	3,130	4.800	15,024.000	
	MOTOR OIL HELLAS CORINTH REFIN	5,847	20.650	120,740.550	
	OPAP SA	19,846	8.500	168,691.000	
	JUMBO SA	4,749	13.560	64,396.440	
ユーロ 小計		185,444		841,641.240 (108,117,234)	
韓国・ウォン	CHEIL WORLDWIDE INC	7,097	23,200.000	164,650,400.000	
	HANMI SCIENCE CO LTD	1,164	76,900.000	89,511,600.000	
	HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	3,477	71,600.000	248,953,200.000	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANC	2,650	272,000.000	720,800,000.000	
	DB INSURANCE CO LTD	4,209	68,900.000	290,000,100.000	
	COWAY CO LTD	4,439	77,700.000	344,910,300.000	
	KT&G CORP	10,022	109,000.000	1,092,398,000.000	
	S-1 CORPORATION	1,444	105,000.000	151,620,000.000	
	KOREA GAS CORP	1,727	53,000.000	91,531,000.000	
	CJ CORP	1,179	127,500.000	150,322,500.000	
	KAKAO CORP	4,263	111,000.000	473,193,000.000	
	CJ ENM CO LTD	987	210,100.000	207,368,700.000	
	DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE	2,634	33,900.000	89,292,600.000	
	SK TELECOM CO LTD	1,859	283,500.000	527,026,500.000	
	DAELIM INDUSTRIAL CO	2,649	97,000.000	256,953,000.000	
	MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD	33,492	6,790.000	227,410,680.000	
	NCSOFT CORPORATION	1,387	497,500.000	690,032,500.000	
	LG UPLUS CORP	6,540	17,900.000	117,066,000.000	
	DAEWOO ENGINEERING & CONSTRUCT	13,540	4,940.000	66,887,600.000	
	POSCO DAEWOO CORP	3,600	18,550.000	66,780,000.000	
	LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD	722	1,162,000.000	838,964,000.000	
	LG CHEM LTD	3,673	345,000.000	1,267,185,000.000	
LG CHEM LTD	726	201,500.000	146,289,000.000		

LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD	201	692,000.000	139,092,000.000	
SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD	34,256	39,950.000	1,368,527,200.000	
S-OIL CORP	3,782	106,500.000	402,783,000.000	
HANWHA CHEMICAL CORPORATION	10,493	19,150.000	200,940,950.000	
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	5,997	31,700.000	190,104,900.000	
POSCO CHEMTECH CO LTD	1,672	61,800.000	103,329,600.000	
LOTTE CHEMICAL CORPORATION	1,313	266,000.000	349,258,000.000	
HOTEL SHILLA CO LTD	2,826	77,400.000	218,732,400.000	
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	3,207	135,500.000	434,548,500.000	
HYUNDAI MOBIS	5,855	180,000.000	1,053,900,000.000	
SK HYNIX INC	47,543	65,500.000	3,114,066,500.000	
HYUNDAI ENGINEERING & CONSTRUCTION CO LTD	6,587	55,700.000	366,895,900.000	
HYUNDAI MOTOR CO	1,954	65,900.000	128,768,600.000	
HYUNDAI MOTOR CO	10,785	110,500.000	1,191,742,500.000	
HYUNDAI STEEL CO	6,150	44,400.000	273,060,000.000	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	17,323	14,450.000	250,317,350.000	
KCC CORP	554	283,500.000	157,059,000.000	
KIA MOTORS CORP	22,988	31,000.000	712,628,000.000	
KOREA ZINC CO LTD	698	443,500.000	309,563,000.000	
KOREA ELECTRIC POWER CORP	22,108	32,100.000	709,666,800.000	
HANWHA CORP	3,785	30,100.000	113,928,500.000	
KOREAN AIR CO LTD	2,345	31,100.000	72,929,500.000	
OCI COMPANY LTD	1,829	104,000.000	190,216,000.000	
CJ LOGISTICS	860	159,000.000	136,740,000.000	
KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	1,509	83,100.000	125,397,900.000	
KT CORP	2,048	30,900.000	63,283,200.000	
HLB INC	2,994	81,600.000	244,310,400.000	
LG ELECTRONICS INC	9,110	65,300.000	594,883,000.000	
LOTTE CORP	1,940	53,800.000	104,372,000.000	
LG CORP	8,116	68,200.000	553,511,200.000	
NH INVESTMENT & SECURITIES CO LTD	13,362	13,550.000	181,055,100.000	
GS ENGINEERING & CONSTRUCTION	4,872	43,100.000	209,983,200.000	
NAVER CORP	11,313	119,000.000	1,346,247,000.000	
HYUNDAI DEPARTMENT STORE CO LTD	1,249	91,600.000	114,408,400.000	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO LTD	3,504	63,400.000	222,153,600.000	
OTTOGI CORP	112	736,000.000	82,432,000.000	
AMOREPACIFIC GROUP	1,754	64,200.000	112,606,800.000	

KANGWON LAND INC	10,655	32,950.000	351,082,250.000	
POSCO	6,264	248,000.000	1,553,472,000.000	
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	11,910	19,250.000	229,267,500.000	
SAMSUNG SDI CO LTD	4,723	204,000.000	963,492,000.000	
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO LTD	4,863	110,500.000	537,361,500.000	
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	397,189	40,200.000	15,966,997,800.000	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES CO LTD	32,995	7,450.000	245,812,750.000	
SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	70,564	33,150.000	2,339,196,600.000	
SHINSEGAE CO LTD	646	269,500.000	174,097,000.000	
YUHAN CORP	674	216,500.000	145,921,000.000	
HANON SYSTEMS	13,644	9,940.000	135,621,360.000	
HYUNDAI MARINE & FIRE INSURANCE CO LTD	4,648	40,200.000	186,849,600.000	
GS HOLDINGS CORP	2,892	51,200.000	148,070,400.000	
LG DISPLAY CO LTD	18,262	16,800.000	306,801,600.000	
CELLTRION INC	6,599	244,500.000	1,613,455,500.000	
VIROMED CO LTD	1,302	195,300.000	254,280,600.000	
HANA FINANCIAL GROUP	25,782	36,350.000	937,175,700.000	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	1,800	120,500.000	216,900,000.000	
CELLTRION PHARM INC	1,457	63,100.000	91,936,700.000	
LOTTE SHOPPING CO	839	214,000.000	179,546,000.000	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LTD	5,956	85,500.000	509,238,000.000	
AMOREPACIFIC CORP	2,677	174,000.000	465,798,000.000	
AMOREPACIFIC CORP-PREF	848	92,400.000	78,355,200.000	
SAMSUNG CARD CO	2,877	33,150.000	95,372,550.000	
SK INNOVATION CO LTD	5,196	184,000.000	956,064,000.000	
CJ CHEILJEDANG CORP	695	349,000.000	242,555,000.000	
STX PAN OCEAN CO LTD	18,395	4,380.000	80,570,100.000	
LG INNOTEK CO LTD	1,440	91,700.000	132,048,000.000	
SK HOLDINGS CO LTD	2,692	272,000.000	732,224,000.000	
KB FINANCIAL GROUP INC	32,019	45,200.000	1,447,258,800.000	
MEDY-TOX INC	409	574,800.000	235,093,200.000	
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES LTD	6,602	31,350.000	206,972,700.000	
BNK FINANCIAL GROUP INC	13,241	7,490.000	99,175,090.000	
HANMI PHARM CO LTD	520	476,000.000	247,520,000.000	
HANWHA LIFE INSURANCE CO LTD	27,836	4,285.000	119,277,260.000	
FILA KOREA LTD	3,324	52,800.000	175,507,200.000	
E-MART CO LTD	1,699	183,500.000	311,766,500.000	
DGB FINANCIAL GROUP INC	10,752	8,590.000	92,359,680.000	
GS RETAIL CO LTD	2,482	38,800.000	96,301,600.000	
HANKOOK TIRE CO LTD NEW	6,590	41,550.000	273,814,500.000	

	HDC HYUNDAI DEVELOPMENT CO-ENGINEERING & CONSTRUCTION	1,688	41,000.000	69,208,000.000	
	HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOLDINGS CO LTD	773	393,500.000	304,175,500.000	
	BGF RETAIL CO LTD	631	195,000.000	123,045,000.000	
	ORION CORP REPUBLIC OF KOREA	2,071	118,000.000	244,378,000.000	
	ORANGE LIFE INSURANCE LTD	3,735	28,300.000	105,700,500.000	
	NETMARBLE CORP	1,935	105,500.000	204,142,500.000	
	SAMSUNG SDS CO LTD	2,537	194,500.000	493,446,500.000	
	WOORI BANK	41,071	15,600.000	640,707,600.000	
	SAMSUNG C&T CORP	5,828	104,500.000	609,026,000.000	
	SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	1,432	334,500.000	479,004,000.000	
	PEARL ABYSS CORP	534	172,000.000	91,848,000.000	
	DOOSAN BOBCAT INC	3,636	32,050.000	116,533,800.000	
	SILLAJEN INC	4,787	81,800.000	391,576,600.000	
	CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	3,874	81,400.000	315,343,600.000	
韓国・ウォン 小計		1,228,964		61,825,332,520.000 (6,194,898,319)	
香港・ドル	JIANGXI COPPER CO LTD	91,000	9.290	845,390.000	
	JIANGSU EXPRESS	94,000	10.480	985,120.000	
	CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD	156,000	5.220	814,320.000	
	ANGANG STEEL CO LTD-H	104,000	6.070	631,280.000	
	CHINA MOBILE LIMITED	502,000	76.950	38,628,900.000	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	106,000	39.100	4,144,600.000	
	DATANG INTERNATIONAL POWER GEN	288,000	1.830	527,040.000	
	BEIJING ENTERPRISES	41,500	44.600	1,850,900.000	
	HUANENG POWER INTERNATIONAL IN	306,000	4.910	1,502,460.000	
	ALIBABA HEALTH INFORMATION TECHNOLOGY	290,000	6.890	1,998,100.000	
	YANZHOU COAL MINING CO LTD	136,000	6.990	950,640.000	
	HENGAN INTERNATIONAL GROUP	65,000	61.050	3,968,250.000	
	HUADIAN POWER INTL CORP- H	144,000	3.380	486,720.000	
	CHINA EASTERN AIRLINES CORP LT	124,000	4.650	576,600.000	
	CNOOC LTD	1,463,000	12.820	18,755,660.000	
	BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	270,000	6.350	1,714,500.000	
	CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LTD	368,000	12.760	4,695,680.000	

CHINA OVERSEAS LAND & INVESTME	307,120	26.000	7,985,120.000	
CHINA RESOURCES LAND LTD	220,888	28.100	6,206,952.800	
CITIC LTD	445,000	12.600	5,607,000.000	
CHINA TRAVEL INTERNATIONAL INV	198,000	2.210	437,580.000	
BEIJING CAPITAL INTERNATIONAL	162,000	8.300	1,344,600.000	
LENOVO GROUP LTD	552,000	5.250	2,898,000.000	
PETRO CHINA CO LTD	1,708,000	5.360	9,154,880.000	
CHINA UNICOM HONG KONG LTD	514,742	8.580	4,416,486.360	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS CO LTD	122,790	24.100	2,959,239.000	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL COR	2,065,200	6.400	13,217,280.000	
TONG REN TANG TECHNOLOGIES CO	54,000	11.000	594,000.000	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	77,000	20.400	1,570,800.000	
KINGDEE INTERNATIONAL SOFTWARE GROUP CO LTD	220,000	7.590	1,669,800.000	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	64,900	68.950	4,474,855.000	
KUNLUN ENERGY COMPANY LTD	288,000	9.160	2,638,080.000	
TOWNGAS CHINA CO LTD	91,000	5.880	535,080.000	
COSCO SHIPPING PORTS LTD	84,000	7.380	619,920.000	
YUEXIU PROPERTY CO LTD	444,000	1.390	617,160.000	
CHINA MERCHANTS PORT HOLDINGS CO LTD	104,000	14.320	1,489,280.000	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	374,000	2.680	1,002,320.000	
CHINA INVESTMENT FUND INTERNATIONAL HOLDINGS CO LTD	72,000	23.700	1,706,400.000	
SHENZHEN INTERNATIONAL HOLDING	84,500	15.140	1,279,330.000	
CHINA EVERBRIGHT LTD	82,000	14.080	1,154,560.000	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	139,000	26.600	3,697,400.000	
KINGBOARD HOLDINGS LTD	63,500	21.950	1,393,825.000	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LTD	419,000	14.060	5,891,140.000	
SHENZHEN INVESTMENT LTD	306,000	2.510	768,060.000	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LTD	82,000	30.800	2,525,600.000	
BYD CO LTD	45,000	53.900	2,425,500.000	
CHINA TELECOM CORP LTD	1,244,000	3.920	4,876,480.000	
CHINA OILFIELD SERVICES LTD	172,000	7.400	1,272,800.000	

ALIBABA PICTURES GROUP LTD	1,220,000	1.290	1,573,800.000	
SINOTRANS LTD	190,000	2.980	566,200.000	
MAANSHAN IRON & STEEL	100,000	3.550	355,000.000	
CHINA EVERBRIGHT INTERNATIONAL	275,592	6.720	1,851,978.240	
MMG LTD	220,000	3.400	748,000.000	
LEE & MAN PAPER MANUFACTURING LTD	97,000	7.040	682,880.000	
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	589,788	7.760	4,576,754.880	
AVICHINA INDUSTRY & TECHNOLOGY	126,000	5.180	652,680.000	
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS	163,200	14.380	2,346,816.000	
GREAT WALL MOTOR COMPANY LTD	300,500	4.690	1,409,345.000	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	610,000	16.180	9,869,800.000	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD	561,000	2.910	1,632,510.000	
CHINA ORIENTAL GROUP CO LTD	70,000	4.940	345,800.000	
SHANDONG WEIGAO GROUP MEDICAL-H	176,000	6.760	1,189,760.000	
SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	274,700	7.440	2,043,768.000	
WEICHAJ POWER CO LTD	176,440	8.370	1,476,802.800	
CHINA SHIPPING DEVELOPMENT CO	100,000	4.050	405,000.000	
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEMICAL	215,000	3.490	750,350.000	
SHANGHAI INDUSTRIAL	46,000	16.480	758,080.000	
TINGYI HOLDING CORP	178,000	10.080	1,794,240.000	
TSINGTAO BREWERY CO LTD	26,000	30.450	791,700.000	
GUANGDONG INVESTMENTS LTD	250,000	14.900	3,725,000.000	
CHINA TRADITIONAL CHINESE MEDICINE HOLDINGS CO LTD	208,000	5.090	1,058,720.000	
CHINA RESOURCES BEER HOLDINGS	123,333	27.000	3,329,991.000	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO LTD	52,000	6.330	329,160.000	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	589,500	5.290	3,118,455.000	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	235,000	23.500	5,522,500.000	
TENCENT HOLDINGS LTD	470,800	308.000	145,006,400.000	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	428,500	74.100	31,751,850.000	

BEIJING ENTERPRISES WATER GROUP LTD	466,000	4.270	1,989,820.000	
GOME RETAIL HOLDINGS LTD	970,240	0.670	650,060.800	
CHINA POWER INTERNATIONAL	350,000	1.740	609,000.000	
AIR CHINA / HONG KONG	132,000	7.310	964,920.000	
ZTE CORP	71,288	15.060	1,073,597.280	
SHANGHAI ELECTRIC GROUP CO LTD	250,000	2.640	660,000.000	
CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD	276,500	17.620	4,871,930.000	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO LTD	248,500	2.920	725,620.000	
BANK OF COMMUNICATIONS	659,205	5.850	3,856,349.250	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT HOLDINGS LTD	142,250	6.120	870,570.000	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	62,000	50.500	3,131,000.000	
CHINA CONSTRUCTION BANK	7,943,530	6.390	50,759,156.700	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP HOLDINGS LTD	64,000	95.700	6,124,800.000	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	224,000	6.830	1,529,920.000	
AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	106,000	9.810	1,039,860.000	
SSY GROUP LTD	144,000	6.690	963,360.000	
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS LTD	131,000	8.080	1,058,480.000	
CHINA NATIONAL BLDG MATERIAL	364,000	5.560	2,023,840.000	
BANK OF CHINA LTD	6,554,200	3.270	21,432,234.000	
SHUI ON LAND LTD	335,500	1.770	593,835.000	
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	95,500	18.580	1,774,390.000	
GREENTOWN CHINA HOLDINGS LTD	82,000	5.900	483,800.000	
GUANGZHOU R&F PROPERTIES CO LTD	62,000	11.600	719,200.000	
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	330,470	31.550	10,426,328.500	
IND & COMM BK OF CHINA - H	5,721,235	5.420	31,009,093.700	
ZHAOJIN MINING INDUSTRY CO LTD	96,000	7.650	734,400.000	
KINGBOARD LAMINATES HOLDING	104,000	7.140	742,560.000	
CHINA COMMUNICATIONS SERVICES	227,600	5.840	1,329,184.000	
CHINA COMMUNICATIONS CONSTRUCTION CO LTD	334,000	7.350	2,454,900.000	

CHINA COAL ENERGY CO	178,000	3.170	564,260.000	
HAITIAN INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	31,000	15.720	487,320.000	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC CO LTD	51,000	42.900	2,187,900.000	
HAIER ELECTRONICS GROUP CO LTD	103,000	17.640	1,816,920.000	
CHINA AGRI-INDUSTRIES HOLDINGS LTD	191,000	2.800	534,800.000	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD	641,142	9.060	5,808,746.520	
CHINA MOLYBDENUM CO LTD	369,000	3.040	1,121,760.000	
CHINA CITIC BANK-H	698,800	4.750	3,319,300.000	
KWG GROUP HOLDINGS LTD	121,000	6.700	810,700.000	
SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	60,600	69.350	4,202,610.000	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	77,000	36.050	2,775,850.000	
FOSUN INTERNATIONAL	230,028	12.020	2,764,936.560	
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP LTD	372,000	3.420	1,272,240.000	
SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD	141,000	3.440	485,040.000	
SOHO CHINA LTD	172,500	2.880	496,800.000	
KINGSOFT CORP LTD	76,000	12.280	933,280.000	
SINOTRUK HONG KONG LTD	64,500	11.940	770,130.000	
CHINA RAILWAY GROUP LTD	338,000	7.060	2,386,280.000	
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS LTD	122,000	6.540	797,880.000	
BYD ELECTRONIC INTERNATIONAL CO LTD	52,500	10.380	544,950.000	
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION CORP	128,500	9.990	1,283,715.000	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	355,000	5.430	1,927,650.000	
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	206,800	26.450	5,469,860.000	
CHINA EVERGRANDE GROUP	211,000	25.000	5,275,000.000	
CRRC CORP LTD - H	338,450	7.270	2,460,531.500	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDINGS LTD	126,000	7.490	943,740.000	
SUN ART RETAIL GROUP LTD	179,000	8.380	1,500,020.000	
BBMG CORP	222,000	2.500	555,000.000	
CHINA ZHONGWANG HOLDINGS LTD	145,200	3.500	508,200.000	
SINOPHARM GROUP CO	107,600	33.800	3,636,880.000	
CHINA RESOURCES CEMENT	200,000	7.170	1,434,000.000	
METALLURGICAL CORP OF CHINA LTD	276,000	1.950	538,200.000	

GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD	274,527	7.310	2,006,792.370	
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	154,000	4.520	696,080.000	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL BANK	196,000	4.310	844,760.000	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP CORP	242,000	5.620	1,360,040.000	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD	59,100	17.220	1,017,702.000	
HUANENG RENEWABLES CORP LTD	472,000	2.170	1,024,240.000	
SIHUA PHARMACEUTICAL HOLDINGS GROUP LTD	325,000	1.650	536,250.000	
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	205,000	25.150	5,155,750.000	
YUZHOU PROPERTIES CO LTD	166,000	3.190	529,540.000	
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	128,500	21.900	2,814,150.000	
NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	75,800	33.150	2,512,770.000	
CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	491,656	5.540	2,723,774.240	
KAISA GROUP HOLDINGS LTD	203,000	2.260	458,780.000	
XINJIANG GOLDWIND SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	60,000	7.470	448,200.000	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD	171,000	3.420	584,820.000	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA	2,526,000	3.380	8,537,880.000	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS LTD	55,000	15.580	856,900.000	
FAR EAST HORIZON LTD	199,000	7.540	1,500,460.000	
CITIC SECURITIES CO LTD	184,000	14.300	2,631,200.000	
FUTURE LAND DEVELOPMENT HOLDINGS LTD	172,000	4.860	835,920.000	
HAITONG SECURITIES CO LTD	210,000	8.480	1,780,800.000	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROUP OF CHINA LTD	618,000	3.160	1,952,880.000	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	46,000	24.300	1,117,800.000	
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	334,000	3.640	1,215,760.000	
SINOPEC ENGINEERING GROUP CO LTD	121,500	6.370	773,955.000	
CHINA GALAXY SECURITIES CO LTD	328,500	3.940	1,294,290.000	
HANERGY THIN FILM POWER GROUP	986,000	0.000	0.000	

NEXTEER AUTOMOTIVE GROUP LTD	85,000	11.720	996,200.000	
CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS CO LTD	323,000	0.000	0.000	
GREENTOWN SERVICE GROUP CO LTD	96,000	6.210	596,160.000	
JIAYUAN INTERNATIONAL GROUP LTD	94,000	13.040	1,225,760.000	
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO LTD	42,400	15.660	663,984.000	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA CO LTD	267,000	4.440	1,185,480.000	
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING LTD	31,000	19.940	618,140.000	
GENSCRIPT BIOTECH CORP	74,000	11.720	867,280.000	
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLDINGS CO LTD	95,000	12.260	1,164,700.000	
CHINA FIRST CAPITAL GROUP LTD	308,000	3.840	1,182,720.000	
CHINA TOWER CORP LTD	2,904,000	1.280	3,717,120.000	
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	276,000	2.820	778,320.000	
CHINA CINDA ASSET MANAGEMENT CO LTD	796,000	2.000	1,592,000.000	
LOGAN PROPERTY HOLDINGS CO LTD	134,000	8.700	1,165,800.000	
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS LTD	137,000	23.500	3,219,500.000	
CHINA VANKE CO LTD-H	103,361	26.100	2,697,722.100	
LUYE PHARMA GROUP LTD	108,000	5.380	581,040.000	
CAR INC	68,000	6.550	445,400.000	
HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	39,000	15.140	590,460.000	
CGN POWER CO LTD	981,000	1.850	1,814,850.000	
FULLSHARE HOLDINGS LTD	517,500	2.660	1,376,550.000	
BAIC MOTOR CORP LTD	163,500	4.400	719,400.000	
GF SECURITIES CO LTD	78,200	11.280	882,096.000	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD	51,200	23.550	1,205,760.000	
HUATAI SECURITIES CO LTD	112,600	12.740	1,434,524.000	
3SBIO INC	101,500	10.180	1,033,270.000	
LEGEND HOLDINGS CORP	31,500	22.450	707,175.000	
CHINA RESOURCES PHARMACEUTICAL GROUP LTD	89,000	10.700	952,300.000	
CHINA HUARONG ASSET MANAGEMENT CO LTD	904,000	1.510	1,365,040.000	
CHINA LITERATURE LTD	17,200	39.850	685,420.000	
DALI FOODS GROUP CO LTD	188,000	5.610	1,054,680.000	
CHINA RAILWAY SIGNAL & COMMUNICATION CORP LTD	141,000	5.390	759,990.000	

	CHINA REINSURANCE GROUP CORP	525,000	1.550	813,750.000	
	MEITU INC	152,500	2.850	434,625.000	
	BOC AVIATION LTD	15,700	59.650	936,505.000	
	ZHONGAN ONLINE P&C INSURANCE CO LTD	15,500	30.600	474,300.000	
	CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CORP LTD	81,600	14.940	1,219,104.000	
	WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	44,500	49.900	2,220,550.000	
	HENGTEEN NETWORKS GROUP LTD	2,096,000	0.265	555,440.000	
香港・ドル	小計	77,850,475		712,530,346.600 (10,317,439,419)	
台湾・ドル	ACER INC	278,532	18.800	5,236,401.600	
	ASUSTEK COMPUTER INC	59,554	213.500	12,714,779.000	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	37,616	139.000	5,228,624.000	
	ASIA CEMENT CORP	160,928	33.000	5,310,624.000	
	WALSIN TECHNOLOGY CORP	31,000	167.500	5,192,500.000	
	TAIWAN BUSINESS BANK	371,457	10.650	3,956,017.050	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMICONDUCTOR CORP	85,000	57.600	4,896,000.000	
	MICRO-STAR INTERNATIONAL CO LTD	65,000	69.100	4,491,500.000	
	CHICONY ELECTRONICS CO LTD	54,975	60.100	3,303,997.500	
	QUANTA COMPUTER INC	200,858	48.850	9,811,913.300	
	HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	89,070	45.600	4,061,592.000	
	EVA AIRWAYS CORP	149,269	15.450	2,306,206.050	
	CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	54,760	219.500	12,019,820.000	
	CHANG HWA COMMERCIAL BANK	509,345	17.450	8,888,070.250	
	CHINA AIRLINES	232,156	10.500	2,437,638.000	
	CHENG SHIN RUBBER INDUSTRY CO	158,169	41.300	6,532,379.700	
	CHINA STEEL CORP	1,075,058	23.800	25,586,380.400	
	CHINA LIFE INSURANCE CO LTD/TAIWAN	256,994	28.850	7,414,276.900	
	ADVANTECH CO LTD	29,889	223.500	6,680,191.500	
	COMPAL ELECTRONICS INC	240,304	17.300	4,157,259.200	
	DELTA ELECTRONICS INC	162,663	126.500	20,576,869.500	
	NANYA TECHNOLOGY CORP	73,000	52.100	3,803,300.000	
	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	296,327	107.000	31,706,989.000	
	AU OPTRONICS CORP	727,194	12.350	8,980,845.900	
	TAIWAN MOBILE CO LTD	146,800	107.500	15,781,000.000	
	EVERGREEN MARINE CORP	198,276	11.800	2,339,656.800	

FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	275,824	28.650	7,902,357.600	
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	29,825	185.000	5,517,625.000	
ECLAT TEXTILE CO LTD	13,322	333.000	4,436,226.000	
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	51,285	138.000	7,077,330.000	
FORMOSA PLASTICS CORP	359,633	99.500	35,783,483.500	
FORMOSA TAFFETA CO LTD	61,000	33.600	2,049,600.000	
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE CO	283,594	105.000	29,777,370.000	
GIANT MANUFACTURING	30,151	145.000	4,371,895.000	
MEDIATEK INC	120,507	229.000	27,596,103.000	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD	529,936	47.500	25,171,960.000	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	634,232	17.600	11,162,483.200	
HOTAI MOTOR CO LTD	15,000	238.500	3,577,500.000	
FAR EASTONE TELECOMMUNICATIONS CO LTD	144,000	72.400	10,425,600.000	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	876,141	15.100	13,229,729.100	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	655,920	47.600	31,221,792.000	
CHINA DEPT FINANCIAL HOLDING	924,403	9.910	9,160,833.730	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO LTD	829,168	20.200	16,749,193.600	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	1,071,225	67.700	72,521,932.500	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LTD	934,495	25.650	23,969,796.750	
LARGAN PRECISION CO LTD	8,220	3,055.000	25,112,100.000	
TAISHIN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	843,589	13.350	11,261,913.150	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING CO	831,061	9.900	8,227,503.900	
INVENTEC CO LTD	206,005	21.600	4,449,708.000	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	145,845	40.950	5,972,352.750	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	893,443	10.300	9,202,462.900	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,381,048	20.000	27,620,960.000	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO LTD	844,220	19.750	16,673,345.000	
POWERTECH TECHNOLOGY INC	61,560	70.100	4,315,356.000	
NAN YA PLASTICS CORP	414,828	72.600	30,116,512.800	
WISTRON CORP	266,916	18.850	5,031,366.600	
POU CHEN CORP	183,990	31.900	5,869,281.000	

UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CORP	413,297	68.200	28,186,855.400		
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	49,392	308.000	15,212,736.000		
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	108,480	113.000	12,258,240.000		
PHISON ELECTRONICS CORP	7,658	234.500	1,795,801.000		
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	54,393	46.800	2,545,592.400		
RUENTEX INDUSTRIES LTD	20,829	84.300	1,755,884.700		
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	75,588	61.000	4,610,868.000		
STANDARD FOODS CORP	34,639	47.900	1,659,208.100		
SYNNEX TECHNOLOGY INTERNATIONAL CORP	113,899	35.450	4,037,719.550		
TAIWAN CEMENT CORP	406,561	34.750	14,127,994.750		
TATUNG CO LTD	100,000	35.700	3,570,000.000		
TAIWAN SEMICONDUCTOR	2,030,083	219.000	444,588,177.000		
UNITED MICROELECTRONICS CORP	904,525	11.100	10,040,227.500		
WINBOND ELECTRONICS CORP	241,000	13.850	3,337,850.000		
YAGEO CORP	23,160	323.500	7,492,260.000		
TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	156,000	30.150	4,703,400.000		
INNOLUX CORPORATION	820,345	10.100	8,285,484.500		
WPG HOLDINGS CO LTD	75,203	36.550	2,748,669.650		
HIWIN TECHNOLOGIES CORP	19,073	236.500	4,510,764.500		
TAIMED BIOLOGICS INC	18,000	148.500	2,673,000.000		
PEGATRON CORP	143,554	49.800	7,148,989.200		
AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	9,000	330.000	2,970,000.000		
WIN SEMICONDUCTORS CORP	38,000	115.000	4,370,000.000		
CHAILEASE HOLDING CO LTD	101,737	97.100	9,878,662.700		
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING LTD	48,385	80.300	3,885,315.500		
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL HOLDING	742,412	17.700	13,140,692.400		
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	294,903	59.400	17,517,238.200		
GLOBALWAFERS CO LTD	21,000	316.500	6,646,500.000		
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	15,000	235.000	3,525,000.000		
台湾・ドル 小計	26,750,696		1,366,193,635.780 (5,000,268,706)		
南アフリカ・ランド	BIDVEST GROUP LTD	29,572	193.220	5,713,901.840	
	CLICKS GROUP LTD	16,495	175.000	2,886,625.000	
	TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	36,909	87.260	3,220,679.340	
	DISCOVERY LTD	31,052	145.200	4,508,750.400	

REDEFINE PROPERTIES LTD	469,360	9.640	4,524,630.400	
GOLD FIELDS LTD	64,234	43.750	2,810,237.500	
REMGRO LTD	39,466	192.230	7,586,549.180	
THE FOSCHINI GROUP LTD	19,873	167.420	3,327,137.660	
MMI HOLDINGS LTD	30,301	16.940	513,298.940	
GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	260,960	23.170	6,046,443.200	
EXXARO RESOURCES LTD	19,195	125.880	2,416,266.600	
CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	3,704	1,052.460	3,898,311.840	
LIBERTY HOLDINGS LTD	7,234	104.730	757,616.820	
MTN GROUP LTD	145,185	83.890	12,179,569.650	
ANGLOGOLD ASHANTI LTD	38,047	161.540	6,146,112.380	
TELKOM SA SOC LTD	22,080	58.460	1,290,796.800	
FIRSTSTRAND LTD	269,420	64.000	17,242,880.000	
PSG GROUP LTD	12,431	226.290	2,813,010.990	
NASPERS LTD	36,084	2,750.000	99,231,000.000	
NEDBANK GROUP LTD	34,119	256.690	8,758,006.110	
NETCARE LTD	105,465	25.340	2,672,483.100	
PICK'N PAY STORES LTD	31,255	69.250	2,164,408.750	
RMB HOLDINGS LTD	61,174	75.210	4,600,896.540	
ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	5,042	496.470	2,503,201.740	
SAPPI LTD	34,752	77.650	2,698,492.800	
SASOL LTD	45,354	413.690	18,762,496.260	
SHOPRITE HOLDINGS LTD	37,476	183.000	6,858,108.000	
MR PRICE GROUP LTD	23,411	236.670	5,540,681.370	
STANDARD BANK GROUP LTD	103,115	167.700	17,292,385.500	
SPAR GROUP LTD/THE	16,512	192.180	3,173,276.160	
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	88,009	54.180	4,768,327.620	
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LTD	34,576	138.320	4,782,552.320	
ABSA GROUP LTD	54,711	150.440	8,230,722.840	
TIGER BRANDS LTD	13,510	268.000	3,620,680.000	
SANLAM LTD	153,496	73.680	11,309,585.280	
INVESTEC LTD	19,077	78.460	1,496,781.420	
KUMBA IRON ORE LTD	5,327	267.140	1,423,054.780	
MONDI LTD	10,866	301.790	3,279,250.140	
LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDINGS LTD	110,218	25.570	2,818,274.260	
RMI HOLDINGS	55,278	35.490	1,961,816.220	
VODACOM GROUP PTY LTD	50,576	120.000	6,069,120.000	
NEPI ROCKCASTLE PLC	32,983	108.300	3,572,058.900	
OLD MUTUAL LTD	423,449	21.350	9,040,636.150	
REINET INVESTMENTS SCA	13,993	215.600	3,016,890.800	
FORTRESS REIT LTD-A	102,950	17.550	1,806,772.500	
BID CORP LTD	24,891	250.690	6,239,924.790	
南アフリカ・ランド 小計	3,243,187		335,574,702.890 (2,640,972,912)	

合計	201,312,668		44,442,360,635 (44,442,360,635)	
----	-------------	--	------------------------------------	--

(2) 株式以外の有価証券

平成30年12月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	メキシコ・ペソ	CEMEX SAB DE CV	1,231,475.000	11,932,992.750	
		FOMENTO ECONOMICO MEXICANO SAB DE CV	155,200.000	25,684,048.000	
	メキシコ・ペソ	小計	1,386,675.000	37,617,040.750 (209,150,747)	
投資信託受益証券 合計			1,386,675	209,150,747 (209,150,747)	
投資証券	メキシコ・ペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	283,800.000	6,206,706.000	
	メキシコ・ペソ	小計	283,800.000	6,206,706.000 (34,509,285)	
	南アフリカ・ランド	FORTRESS REIT LTD-B	57,784.000	791,062.960	
		HYPROP INVESTMENTS LTD	22,174.000	1,882,794.340	
		RESILIENT REIT LTD	28,600.000	1,707,706.000	
	南アフリカ・ランド	小計	108,558.000	4,381,563.300 (34,482,903)	
投資証券 合計			392,358	68,992,188 (68,992,188)	
合計				278,142,935 (278,142,935)	

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 46銘柄	11.43%	-%	-%	12.02%
アラブ首長国連邦・ディ ルハム	株式 9銘柄	0.65%	-%	-%	0.68%
イギリス・ポンド	株式 1銘柄	0.03%	-%	-%	0.03%
インド・ルピー	株式 79銘柄	8.36%	-%	-%	8.79%
インドネシア・ルピア	株式 26銘柄	2.19%	-%	-%	2.31%
オフショア・人民元	株式 73銘柄	0.71%	-%	-%	0.75%
カタール・リアル	株式 10銘柄	1.08%	-%	-%	1.13%
コロンビア・ペソ	株式 9銘柄	0.41%	-%	-%	0.43%
タイ・バーツ	株式 36銘柄	2.42%	-%	-%	2.55%
チェコ・コルナ	株式 3銘柄	0.17%	-%	-%	0.18%
チリ・ペソ	株式 17銘柄	1.04%	-%	-%	1.09%
トルコ・リラ	株式 18銘柄	0.60%	-%	-%	0.63%
ハンガリー・フォリント	株式 3銘柄	0.30%	-%	-%	0.31%
パキスタン・ルピー	株式 3銘柄	0.05%	-%	-%	0.05%
フィリピン・ペソ	株式 23銘柄	1.03%	-%	-%	1.09%
ブラジル・レアル	株式 53銘柄	6.96%	-%	-%	7.32%
ポーランド・ズロチ	株式 20銘柄	1.18%	-%	-%	1.24%
マレーシア・リンギット	株式 44銘柄	2.28%	-%	-%	2.40%
メキシコ・ペソ	株式 23銘柄	2.03%	-%	-%	2.68%
	投資信託 受益証券 2銘柄	-%	0.44%	-%	
	投資証券 1銘柄	-%	-%	0.07%	
ユーロ	株式 7銘柄	0.23%	-%	-%	0.24%
韓国・ウォン	株式 114銘柄	13.17%	-%	-%	13.85%
香港・ドル	株式 204銘柄	21.93%	-%	-%	23.07%
台湾・ドル	株式 86銘柄	10.63%	-%	-%	11.18%
南アフリカ・ランド	株式 46銘柄	5.61%	-%	-%	5.98%
	投資証券 3銘柄	-%	-%	0.07%	

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

「エマージング債券パッシブ・マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成30年6月11日現在	平成30年12月11日現在
資産の部			
流動資産			
預金		2,730,488,338	2,085,230,931
コール・ローン		35,239,669	413,785,204
国債証券		105,587,991,123	72,792,748,619
派生商品評価勘定		177,440	14,000
未収利息		1,381,612,990	682,685,314
前払費用		227,812,174	443,616,977
流動資産合計		109,963,321,734	76,418,081,045
資産合計		109,963,321,734	76,418,081,045
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		-	1,475,000
未払金		106,018,290	-
未払解約金		47,887,000	669,160,000
その他未払費用		1,745	-
流動負債合計		153,907,035	670,635,000
負債合計		153,907,035	670,635,000
純資産の部			
元本等			
元本	1	62,346,960,857	41,571,625,612
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		47,462,453,842	34,175,820,433
元本等合計		109,809,414,699	75,747,446,045
純資産合計		109,809,414,699	75,747,446,045
負債純資産合計		109,963,321,734	76,418,081,045

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	平成30年6月11日現在	平成30年12月11日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額 同期中追加設定元本額 同期中一部解約元本額	52,793,954,392円 30,461,258,820円 20,908,252,355円	62,346,960,857円 34,500,209,786円 55,275,545,031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）	270,169,437円	279,967,475円
たわらノーロード バランス （8資産均等型）	44,780,851円	115,331,162円
たわらノーロード バランス （堅実型）	2,136,474円	6,088,503円
たわらノーロード バランス （標準型）	6,369,299円	18,504,059円
たわらノーロード バランス （積極型）	5,500,910円	10,749,561円
たわらノーロード 最適化バランス（保守型）	77,307円	100,066円
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	107,110円	172,145円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	508,641円	1,049,206円
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	264,286円	339,294円
たわらノーロード 最適化バランス（積極型）	366,427円	515,789円

マネックス資産設計ファンド エボリューション	59,295,344円	58,646,088円
DIAM DC 8資産バラン スファンド(新興国10)	34,460,930円	196,510,788円
DIAM DC 8資産バラン スファンド(新興国20)	115,620,550円	172,561,704円
DIAM DC 8資産バラン スファンド(新興国30)	250,267,452円	342,893,758円
投資のソムリエ	8,475,207,388円	4,685,529,373円
クルーズコントロール	732,708,202円	356,233,786円
投資のソムリエ<DC年金>	628,888,132円	420,125,125円
DIAM 8資産バランスファ ンドN<DC年金>	128,445,770円	143,653,316円
クルーズコントロール<DC年 金>	307,329円	231,040円
DIAMコア資産設計ファンド (堅実型)	3,609,144円	1,903,366円
DIAMコア資産設計ファンド (積極型)	13,655,883円	4,718,529円
投資のソムリエ<DC年金>リ スク抑制型	279,800,713円	52,777,299円
ダイナミック・ナビゲーション	177,753円	516,298円
リスク抑制世界8資産バラン スファンド	5,073,901,777円	942,608,725円
ワールドアセットバランス(基 本コース)	900,646,679円	802,579,470円
ワールドアセットバランス(リ スク抑制コース)	3,569,428,137円	1,812,831,635円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤ-2045)	1,621,481円	2,540,137円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤ-2055)	1,060,296円	1,924,206円
リスク抑制世界8資産バラン スファンド(DC)	1,315,432円	321,207円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤ-2035)	2,619,348円	4,008,620円
リスクコントロール世界資産分 散ファンド	450,048,092円	177,970,229円
9資産分散投資・スタンダード <DC年金>	-円	13,655円
エマージング債券リスク抑制型 (適格機関投資家限定)	14,881,594,912円	12,056,800,976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)	3,003,197,407円	2,199,410,874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)	7,427,564,498円	4,690,970,113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)	4,926,615,765円	4,720,917,447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(適格機関投資家限定)	3,727,050,401円	1,931,893,385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)	2,897,668,503円	1,022,842,219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)	4,429,902,797円	4,334,874,984円
	計	62,346,960,857円	41,571,625,612円
2 .	受益権の総数	62,346,960,857口	41,571,625,612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12月12日 至 平成30年6月11日	自 平成30年6月12日 至 平成30年12月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成30年6月11日現在	平成30年12月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成30年6月11日現在	平成30年12月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
国債証券	4,212,743,594	1,205,945,631
合計	4,212,743,594	1,205,945,631

（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30年4月19日から平成30年6月11日まで及び平成30年4月19日から平成30年12月11日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	平成30年6月11日 現在				平成30年12月11日 現在			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	43,937,440	-	43,760,000	177,440	360,420,000	-	361,881,000	1,461,000
アメリカ・ドル	43,937,440	-	43,760,000	177,440	360,420,000	-	361,881,000	1,461,000
合計	43,937,440	-	43,760,000	177,440	360,420,000	-	361,881,000	1,461,000

（注）時価の算定方法

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

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成30年6月11日現在	平成30年12月11日現在
1口当たり純資産額	1.7613円	1.8221円
(1万口当たり純資産額)	(17,613円)	(18,221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12月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	BRAZIL 2.625 01/05/23	5,400,000.000	5,057,100.000	
		BRAZIL 4.25 01/07/25	9,500,000.000	9,278,745.000	
		BRAZIL 4.625 01/13/28	7,800,000.000	7,451,028.000	
		BRAZIL 4.875 01/22/21	9,800,000.000	10,018,148.000	
		BRAZIL 5.0 01/27/45	8,800,000.000	7,498,744.000	
		BRAZIL 5.625 01/07/41	6,900,000.000	6,477,375.000	
		BRAZIL 5.625 02/21/47	7,200,000.000	6,646,464.000	
		BRAZIL 6.0 04/07/26	5,800,000.000	6,136,980.000	
		BRAZIL 7.125 01/20/37	5,500,000.000	6,127,055.000	
		BRAZIL 8.25 01/20/34	4,800,000.000	5,794,080.000	
		BRAZIL 8.75 02/04/25	2,800,000.000	3,378,200.000	
		COLOMBIA 2.625 03/15/23	3,700,000.000	3,499,719.000	
		COLOMBIA 3.875 04/25/27	7,200,000.000	6,909,120.000	
		COLOMBIA 4.0 02/26/24	7,100,000.000	7,013,025.000	
		COLOMBIA 4.375 07/12/21	7,200,000.000	7,313,400.000	
		COLOMBIA 4.5 01/28/26	4,200,000.000	4,235,154.000	
		COLOMBIA 5.0 06/15/45	12,600,000.000	12,115,026.000	
		COLOMBIA 5.625 02/26/44	6,400,000.000	6,665,664.000	
		COLOMBIA 6.125 01/18/41	7,000,000.000	7,658,000.000	
		COLOMBIA 7.375 09/18/37	4,800,000.000	5,874,000.000	
		COLOMBIA 8.125 05/21/24	1,900,000.000	2,235,825.000	
		CROATIA 5.5 04/04/23	6,400,000.000	6,697,280.000	
		CROATIA 6.0 01/26/24	4,200,000.000	4,516,512.000	
		CROATIA 6.375 03/24/21	6,300,000.000	6,594,840.000	
		CROATIA 6.625 07/14/20	7,200,000.000	7,490,160.000	
		HUNGARY 5.375 02/21/23	6,300,000.000	6,615,441.000	
		HUNGARY 5.375 03/25/24	6,000,000.000	6,364,680.000	
		HUNGARY 5.75 11/22/23	7,200,000.000	7,710,264.000	
		HUNGARY 6.25 01/29/20	7,500,000.000	7,727,175.000	
		HUNGARY 6.375 03/29/21	9,000,000.000	9,502,110.000	
		HUNGARY 7.625 03/29/41	3,600,000.000	4,896,720.000	
		INDONESIA 2.95 01/11/23	2,800,000.000	2,664,872.000	
		INDONESIA 3.375 04/15/23	3,500,000.000	3,365,880.000	
		INDONESIA 3.5 01/11/28	2,000,000.000	1,822,880.000	
INDONESIA 3.75 04/25/22	4,800,000.000	4,738,992.000			
INDONESIA 3.85 07/18/27	1,600,000.000	1,503,360.000			
INDONESIA 4.1 04/24/28	3,400,000.000	3,274,642.000			
INDONESIA 4.125 01/15/25	6,400,000.000	6,236,032.000			
INDONESIA 4.35 01/08/27	4,200,000.000	4,094,286.000			
INDONESIA 4.35 01/11/48	3,800,000.000	3,340,694.000			

INDONESIA 4.625 04/15/43	3,200,000.000	2,900,000.000	
INDONESIA 4.75 01/08/26	6,000,000.000	6,031,380.000	
INDONESIA 4.875 05/05/21	7,700,000.000	7,870,555.000	
INDONESIA 5.125 01/15/45	4,200,000.000	4,044,264.000	
INDONESIA 5.25 01/08/47	3,000,000.000	2,917,560.000	
INDONESIA 5.25 01/17/42	5,100,000.000	5,036,913.000	
INDONESIA 5.875 01/15/24	4,800,000.000	5,097,216.000	
INDONESIA 5.95 01/08/46	2,400,000.000	2,568,264.000	
INDONESIA 6.75 01/15/44	4,700,000.000	5,492,796.000	
INDONESIA 7.75 01/17/38	4,500,000.000	5,703,480.000	
PANAMA 3.75 03/16/25	4,200,000.000	4,155,900.000	
PANAMA 3.875 03/17/28	4,000,000.000	3,926,000.000	
PANAMA 4.5 04/16/50	6,000,000.000	5,670,000.000	
PANAMA 4.5 05/15/47	3,600,000.000	3,448,404.000	
PANAMA 5.2 01/30/20	5,000,000.000	5,114,400.000	
PANAMA 6.7 01/26/36	7,000,000.000	8,509,200.000	
PANAMA 7.125 01/29/26	3,600,000.000	4,279,716.000	
PANAMA 9.375 04/01/29	3,700,000.000	5,129,310.000	
PERU 4.125 08/25/27	5,600,000.000	5,728,856.000	
PERU 5.625 11/18/50	10,000,000.000	11,491,900.000	
PERU 6.55 03/14/37	5,000,000.000	6,191,500.000	
PERU 7.35 07/21/25	8,400,000.000	10,123,260.000	
PHILIPPINES 3.0 02/01/28	4,200,000.000	3,921,666.000	
PHILIPPINES 3.7 02/02/42	3,800,000.000	3,507,210.000	
PHILIPPINES 3.7 03/01/41	4,400,000.000	4,073,784.000	
PHILIPPINES 3.95 01/20/40	4,600,000.000	4,403,488.000	
PHILIPPINES 4.0 01/15/21	4,000,000.000	4,037,320.000	
PHILIPPINES 4.2 01/21/24	3,400,000.000	3,479,968.000	
PHILIPPINES 5.0 01/13/37	3,200,000.000	3,496,000.000	
PHILIPPINES 5.5 03/30/26	2,400,000.000	2,648,544.000	
PHILIPPINES 6.375 01/15/32	2,400,000.000	2,929,824.000	
PHILIPPINES 6.375 10/23/34	4,200,000.000	5,220,936.000	
PHILIPPINES 6.5 01/20/20	2,800,000.000	2,906,260.000	
PHILIPPINES 7.75 01/14/31	4,300,000.000	5,733,534.000	
PHILIPPINES 9.5 02/02/30	4,600,000.000	6,720,968.000	
ROMANIA 4.375 08/22/23	6,200,000.000	6,178,176.000	
ROMANIA 4.875 01/22/24	3,600,000.000	3,665,052.000	
ROMANIA 6.125 01/22/44	3,200,000.000	3,440,128.000	
ROMANIA 6.75 02/07/22	7,300,000.000	7,825,600.000	
RUSSIA FOREIGN BOND 5.0 04/29/20	11,800,000.000	11,994,346.000	
RUSSIAN FEDERATION 03/31/30	7,843,500.000	8,495,059.540	
RUSSIAN FEDERATION 4.25 06/23/27	6,400,000.000	6,036,608.000	

RUSSIAN FEDERATION 4.375 03/21/29	3,600,000.000	3,396,240.000	
RUSSIAN FEDERATION 4.5 04/04/22	6,200,000.000	6,259,458.000	
RUSSIAN FEDERATION 4.75 05/27/26	8,400,000.000	8,268,036.000	
RUSSIAN FEDERATION 4.875 09/16/23	7,600,000.000	7,731,708.000	
RUSSIAN FEDERATION 5.25 06/23/47	16,400,000.000	15,132,280.000	
RUSSIAN FEDERATION 5.625 04/04/42	7,400,000.000	7,517,586.000	
RUSSIAN FEDERATION 5.875 09/16/43	4,200,000.000	4,397,484.000	
SOUTH AFRICA 4.3 10/12/28	6,000,000.000	5,261,640.000	
SOUTH AFRICA 4.665 01/17/24	4,300,000.000	4,175,515.000	
SOUTH AFRICA 4.875 04/14/26	4,000,000.000	3,775,400.000	
SOUTH AFRICA 5.0 10/12/46	3,000,000.000	2,487,630.000	
SOUTH AFRICA 5.375 07/24/44	3,000,000.000	2,579,010.000	
SOUTH AFRICA 5.5 03/09/20	5,800,000.000	5,884,912.000	
SOUTH AFRICA 5.65 09/27/47	3,600,000.000	3,139,452.000	
SOUTH AFRICA 5.875 05/30/22	2,800,000.000	2,891,560.000	
SOUTH AFRICA 5.875 09/16/25	6,000,000.000	6,026,460.000	
UNITED MEXICAN STATES 3.5 01/21/21	5,000,000.000	4,978,750.000	
UNITED MEXICAN STATES 3.6 01/30/25	7,000,000.000	6,664,000.000	
UNITED MEXICAN STATES 3.625 03/15/22	5,100,000.000	5,034,975.000	
UNITED MEXICAN STATES 3.75 01/11/28	6,800,000.000	6,339,300.000	
UNITED MEXICAN STATES 4.0 10/02/23	7,500,000.000	7,434,525.000	
UNITED MEXICAN STATES 4.125 01/21/26	6,200,000.000	6,024,044.000	
UNITED MEXICAN STATES 4.15 03/28/27	8,400,000.000	8,084,832.000	
UNITED MEXICAN STATES 4.35 01/15/47	4,800,000.000	4,086,000.000	
UNITED MEXICAN STATES 4.6 01/23/46	7,600,000.000	6,674,700.000	

	UNITED MEXICAN STATES 4.6 02/10/48	6,400,000.000	5,642,432.000	
	UNITED MEXICAN STATES 4.75 03/08/44	10,800,000.000	9,698,508.000	
	UNITED MEXICAN STATES 5.55 01/21/45	7,000,000.000	7,012,250.000	
	UNITED MEXICAN STATES 5.75 10/12/2110	5,800,000.000	5,421,608.000	
	UNITED MEXICAN STATES 6.05 01/11/40	7,700,000.000	8,087,772.000	
	UNITED MEXICAN STATES 6.75 09/27/34	4,200,000.000	4,764,060.000	
	アメリカ・ドル 小計	631,543,500.000 (71,433,885,285)	643,557,144.540 (72,792,748,619)	
国債証券 合計		71,433,885,285 (71,433,885,285)	72,792,748,619 (72,792,748,619)	
合計		71,433,885,285 (71,433,885,285)	72,792,748,619 (72,792,748,619)	

- (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 113銘柄	96.10%	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12月28日現在

資産総額	13,804,481,783円
負債総額	8,299,620円
純資産総額（ - ）	13,796,182,163円
発行済数量	13,963,023,469口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9881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12月28日現在

資産総額	52,709,343,920円
負債総額	31,275,230円
純資産総額（ - ）	52,678,068,690円
発行済数量	53,226,725,028口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9897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12月28日現在

資産総額	316,183,116,089円
負債総額	3,482,458,340円
純資産総額（ - ）	312,700,657,749円
発行済数量	99,909,201,016口
1口当たり純資産額（ / ）	3.1298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12月28日現在

資産総額	38,437,816,746円
負債総額	367,521円
純資産総額（ - ）	38,437,449,225円
発行済数量	33,801,806,664口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1371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12月28日現在

資産総額	317,743,428,728円
負債総額	38,566,594円
純資産総額（ - ）	317,704,862,134円
発行済数量	238,401,048,226口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3326円

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

平成30年12月28日現在

資産総額	45,350,993,748円
負債総額	16,256,455円
純資産総額(-)	45,334,737,293円
発行済数量	43,100,184,129口
1口当たり純資産額(/)	1.0518円

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

平成30年12月28日現在

資産総額	85,176,380,492円
負債総額	314,473,900円
純資産総額(-)	84,861,906,592円
発行済数量	47,034,074,889口
1口当たり純資産額(/)	1.8043円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 受益証券の名義書換

該当事項はありません。

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

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

(2) 受益者等名簿

該当事項はありません。

(3) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

(4) 受益権の譲渡制限

譲渡制限はありません。

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

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

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

(5) 受益権の譲渡の対抗要件

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

(6) 受益権の再分割

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

(7) 質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額(2018年12月28日現在)

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

直近5カ年の資本金の増減：該当事項はありません。

(2) 会社の機構(2018年12月28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。

2018年12月28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	1,125,331,148,458
追加型株式投資信託	858	12,392,989,077,369
単位型公社債投資信託	46	178,363,127,413
単位型株式投資信託	152	1,127,571,015,066
合計	1,094	14,824,254,368,306

3【委託会社等の経理状況】

- 1．委託会社であるアセットマネジメントOne株式会社(以下「委託会社」という。)の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年8月6日内閣府令第52号)により作成しております。
また、中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)、ならびに同規則第38条及び第57条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年8月6日内閣府令第52号)により作成しております。
- 2．財務諸表及び中間財務諸表の金額は、千円未満の端数を切り捨てて記載しております。
- 3．委託会社は、第33期事業年度(自平成29年4月1日至平成30年3月31日)の財務諸表について、新日本有限責任監査法人の監査を受け、第34期中間会計期間(自平成30年4月1日至平成30年9月30日)の中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の中間監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

	第32期 (平成29年3月31日現在)	第33期 (平成30年3月31日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金	27,972,477	49,071,217
金銭の信託	12,366,219	12,083,824
有価証券	297,560	-
未収委託者報酬	10,164,041	11,769,015
未収運用受託報酬	7,250,239	4,574,225
未収投資助言報酬	316,414	341,689
未収収益	52,278	59,526
前払費用	533,411	569,431
繰延税金資産	678,104	842,996
その他	445,717	427,238
流動資産計	60,076,462	79,739,165
固定資産		
有形固定資産	1,900,343	1,643,826
建物	1 1,243,812	1 1,156,953
器具備品	1 656,235	1 476,504
建設仮勘定	295	10,368
無形固定資産	1,614,084	1,934,700
商標権	5	-
ソフトウェア	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	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。 退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 過去勤務費用については、その発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年または10年）による定額法により按分した額を費用処理しております。 数理計算上の差異については、各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年または10年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生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	-
旧日本社不動産賃借料	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「其他有価証券」には含めておりません。

3. 当該事業年度中に売却した其他有価証券

第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(其他有価証券)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。

(1) 中間貸借対照表

(単位:千円)

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

(単位:千円)

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

(2) 中間損益計算書

(単位：千円)

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

(単位:千円)

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

(3) 中間株主資本等変動計算書

第34期中間会計期間（自平成30年4月1日至平成30年9月30日）

（単位：千円）

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

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

重要な会計方針

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

表示方法の変更

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

注記事項

（中間貸借対照表関係）

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

（中間損益計算書関係）

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

（中間株主資本等変動計算書関係）

第34期中間会計期間（自平成30年4月1日 至平成30年9月30日）

1.発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

(2) 基準日が当中間会計期間に属する配当のうち、配当の効力発生日が当中間会計期間後となるもの
該当事項はありません。

(金融商品関係)

第34期中間会計期間末（平成30年9月30日現在）

金融商品の時価等に関する事項

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

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

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

(注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3) 未収委託者報酬及び(4) 未収運用受託報酬

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

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

負債

(1) 未払手数料

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

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

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

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

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

（有価証券関係）

第34期中間会計期間末
（平成30年9月30日現在）

1. 子会社株式

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

2. その他有価証券

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

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

（企業結合等関係）

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

1. 結合当事企業

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

2. 企業結合日

平成28年10月1日

3. 企業結合の方法

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

4. 結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

5. 企業結合の主な目的

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

6. 合併比率

「3. 企業結合の方法」の吸収合併における合併比率は以下の通りであります。

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

(*) 普通株式と種類株式を合算して算定しております。

7. 交付した株式数

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

8. 経済的持分比率（議決権比率）

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

MHFGが企業結合日に追加取得した当社に対する経済的持分比率 20.00%

MHFGの追加取得後の当社に対する経済的持分比率 70.00%

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

9. 取得企業を決定するに至った主な根拠

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

10. 会計処理

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

11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

(1) 中間財務諸表に含まれる被取得企業の業績の期間

平成30年4月1日から平成30年9月30日まで

(2) 被取得企業の取得原価及びその内訳

取得の対価 MHAMの普通株式 144,212,500千円

取得原価 144,212,500千円

(3) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

a. 発生したのれん金額 76,224,837千円

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

c. のれんの償却方法及び償却期間 20年間の均等償却

(4) 企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

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

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

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

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

12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

(1) 貸借対照表項目

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

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

(2) 損益計算書項目

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

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

(資産除去債務関係)

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

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

(セグメント情報等)

第34期中間会計期間(自平成30年4月1日 至平成30年9月30日)

1.セグメント情報

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2.関連情報

(1)サービスごとの情報

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

(2)地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3)主要な顧客ごとの情報

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

(1株当たり情報)

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

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

1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

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

(重要な後発事象)

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

4【利害関係人との取引制限】

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

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

5【その他】

- (1) 定款の変更、事業譲渡又は事業譲受、出資の状況その他の重要事項

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

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

- (2) 訴訟事件その他の重要事項

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

a. 名称

みずほ信託銀行株式会社

b. 資本金の額

2018年3月末日現在 247,369百万円

c. 事業の内容

日本において銀行業務および信託業務を営んでいます。

(2) 販売会社

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

名 称	資本金の額 (単位:百万円)	事 業 の 内 容
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2018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

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

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

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

(3)投資信託説明書（請求目論見書）に約款の全文を掲載します。

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

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

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

独立監査人の監査報告書

平成30年5月30日

アセットマネジメントOne株式会社
取締役会 御中

新日本有限責任監査法人

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

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

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

利害関係

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

以上

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

(注2) 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31年1月25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30年6月12日から平成30年12月11日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ワールドアセットバランス（基本コース）の平成30年12月11日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

（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31年1月25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30年6月12日から平成30年12月11日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）の平成30年12月11日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

（注2）XBRLデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の中間監査報告書

平成30年11月30日

アセットマネジメントOne株式会社
取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

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

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

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

利害関係

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

以上

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

(注2) XBR Lデータは中間監査の対象には含まれておりません。