

**【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7月12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】	たわらノーロード バランス(堅実型) たわらノーロード バランス(標準型) たわらノーロード バランス(積極型)
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】	たわらノーロード バランス(堅実型) 1兆円を上限とします。 たわらノーロード バランス(標準型) 1兆円を上限とします。 たわらノーロード バランス(積極型) 1兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 第一部【証券情報】

### （１）【ファンドの名称】

たわらノーロード バランス（堅実型）

たわらノーロード バランス（標準型）

たわらノーロード バランス（積極型）

（以下、総称して「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、「たわらノーロード バランス（堅実型）」は「（堅実型）」、「たわらノーロード バランス（標準型）」は「（標準型）」、「たわらノーロード バランス（積極型）」は「（積極型）」という場合があります。）

### （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、1兆円を上限とします。

### （４）【発行（売出）価格】

お申込日の翌営業日の基準価額 とします。

「分配金再投資コース」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】

ありません。

(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「分配金再投資コース」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。

「分配金再投資コース」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。

確定拠出年金制度によるお申込みの場合は、1円以上1円単位となります。

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7月13日から2020年1月15日まで

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

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

(8) 【申込取扱場所】

各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、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、

払込取扱場所についてご不明な点は、以下の方法でご確認ください。

・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

( 1 1 ) 【振替機関に関する事項】

ファンドの受益権にかかる振替機関は以下の通りです。

株式会社証券保管振替機構

( 1 2 ) 【その他】

お申込みには、販売会社所定の方法でお申込みください。

確定拠出年金制度のご利用によるお申込みの場合には、確定拠出年金制度にかかる手続きが必要となります。この場合、「分配金再投資コース」でのお申込みとなります。

確定拠出年金制度によるお申込みの場合、取扱いが一部異なる場合があります。

各ファンドは、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「分配金再投資コース」があり、「分配金再投資コース」を取得申込者が選択した場合、取得申込者は販売会社との間で「自動けいぞく投資約款」にしたが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。

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

ただし、海外休業日にはお申込みの受付を行いません。

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

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

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

### 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1兆円とします。ただし、委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

#### <ファンドの特色>

## 1 主としてマザーファンド<sup>\*1\*2</sup>への投資を通じて、実質的に国内外の株式、公社債および不動産投資信託証券に投資します。

\*1 各マザーファンドは各資産クラスの代表的な指数(インデックス)に連動した投資成果をめざして運用を行います。

\*2 各ファンドが投資するマザーファンドは下記のとおりです。(以下を総称して「マザーファンド」あるいは個別に「各マザーファンド」といいます。)

マザーファンド	マザーファンドが連動対象とする指数	資産クラス
国内株式パッシブ・ファンド (最適化法)・マザーファンド	東証株価指数(TOPIX)(配当込み)	国内株式
国内債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	NOMURA-BPI総合	国内債券
外国株式パッシブ・ファンド・ マザーファンド <sup>*3</sup>	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)	先進国株式* 先進国株式* (ヘッジあり)
外国債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース、為替ヘッジなし)	先進国債券*
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	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)	先進国債券* (ヘッジあり)
エマージング株式パッシブ・ マザーファンド	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)	新興国株式
エマージング債券パッシブ・ マザーファンド	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)	新興国債券
J-REITインデックスファンド・ マザーファンド	東証REIT指数(配当込み)	国内リート
外国リート・パッシブ・ファンド・ マザーファンド	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)	先進国リート*

\*3 先進国株式については、各ファンドにおいてその一部または全部の為替ヘッジを行います。

\*先進国株式、先進国債券、先進国リートについては日本を除きます(以下同じ。)

## 2 資産配分が異なる3つのファンドから選択できます。

### 【各ファンドの特長】

(堅実型):債券の組み入れ比率を高め、堅実な運用を行います。

(標準型):債券と株式・リートへバランスよく資産を配分します。

(積極型):株式・リートの組み入れ比率を高め、積極的な運用を行います。

各マザーファンドへの投資を通じた各資産クラスの資産配分比率は以下を基本とします。

### 【各ファンドの基本配分比率】



資産クラス	(堅実型)	(標準型)	(積極型)
国内債券	36%	17%	3%
先進国債券(ヘッジあり)	33%	23%	13%
先進国債券	3%	4%	1%
新興国債券	8%	6%	3%
国内株式	4%	7%	13%
先進国株式(ヘッジあり)	12%	21%	24%
先進国株式	0%	6%	16%
新興国株式	1%	1%	2%
国内リート	2%	10%	13%
先進国リート	1%	5%	12%

### 運用プロセス

ポートフォリオ  
構築

各ファンドの資産配分比率に基づき、各マザーファンドへ資金を  
配分します。



リバランス

時価変動等により、資産配分比率が基本配分比率から一定以上  
乖離した場合はリバランスを行います。

## 3 実質組入外貨建資産の一部について、対円での為替ヘッジを行います。

●実質組入外貨建資産のうち、先進国株式および先進国債券<sup>\*</sup>については、その一部または全部につき為替ヘッジを行います。なお、先進国株式においては一部の通貨について委託会社はその通貨と相関が高いと判断する通貨を用いて、円に対する為替ヘッジを行う「代替ヘッジ」を行うことがあります。

※先進国債券についての為替ヘッジは、為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドへの投資を通じて行います。

## 4 マザーファンドの組入比率は、原則として高位を維持します。

## ■ 分配方針

年1回の決算時(毎年10月12日(休業日の場合は翌営業日))に、繰越分を含めた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 >

- ・ 商品分類表  
各ファンド

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉となる資産)
単位型	国内	株式 債券
追加型	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	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいう。
内外	目論見書または投資信託約款において、国内および海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。
資産複合	目論見書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う。



## &lt; 属性区分 &gt;

## ・属性区分表

## 各ファンド

投資対象資産 (実際の組入資産)	決算頻度	投資対象地域	投資形態	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 (日本を含む)  日本		
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ( )	年6回 (隔月)  年12回 (毎月)	北米  欧州  アジア  オセアニア	ファミリー ファンド	あり (一部ヘッジ)
不動産投信  その他資産 (投資信託証券 (資産複合(債券、 株式、不動産投信) 資産配分固定型))	日々  その他 ( )	中南米  アフリカ  中近東 (中東)  エマージング	ファンド・オブ・ ファンズ	なし
資産複合 ( ) 資産配分固定型 資産配分変更型				

(注1) 「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2) 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

その他資産（投資信託証券（資産複合（債券、株式、不動産投信）資産配分固定型））	目論見書または投資信託約款において、投資信託証券への投資を通じて、主として複数の資産（債券、株式、不動産投信）を実質的な投資対象とし、組入比率については、固定的とする旨の記載があるものをいう。
年 1 回	目論見書または投資信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいう。
グローバル（日本を含む）	目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本を含む世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
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う。
為替ヘッジあり	目論見書または投資信託約款において、対円での為替のフルヘッジまたは一部の資産に対円での為替のヘッジを行う旨の記載があるものをいう。

（注1）商品分類および属性区分は、委託会社が目論見書または約款の記載内容等に基づいて分類しています。

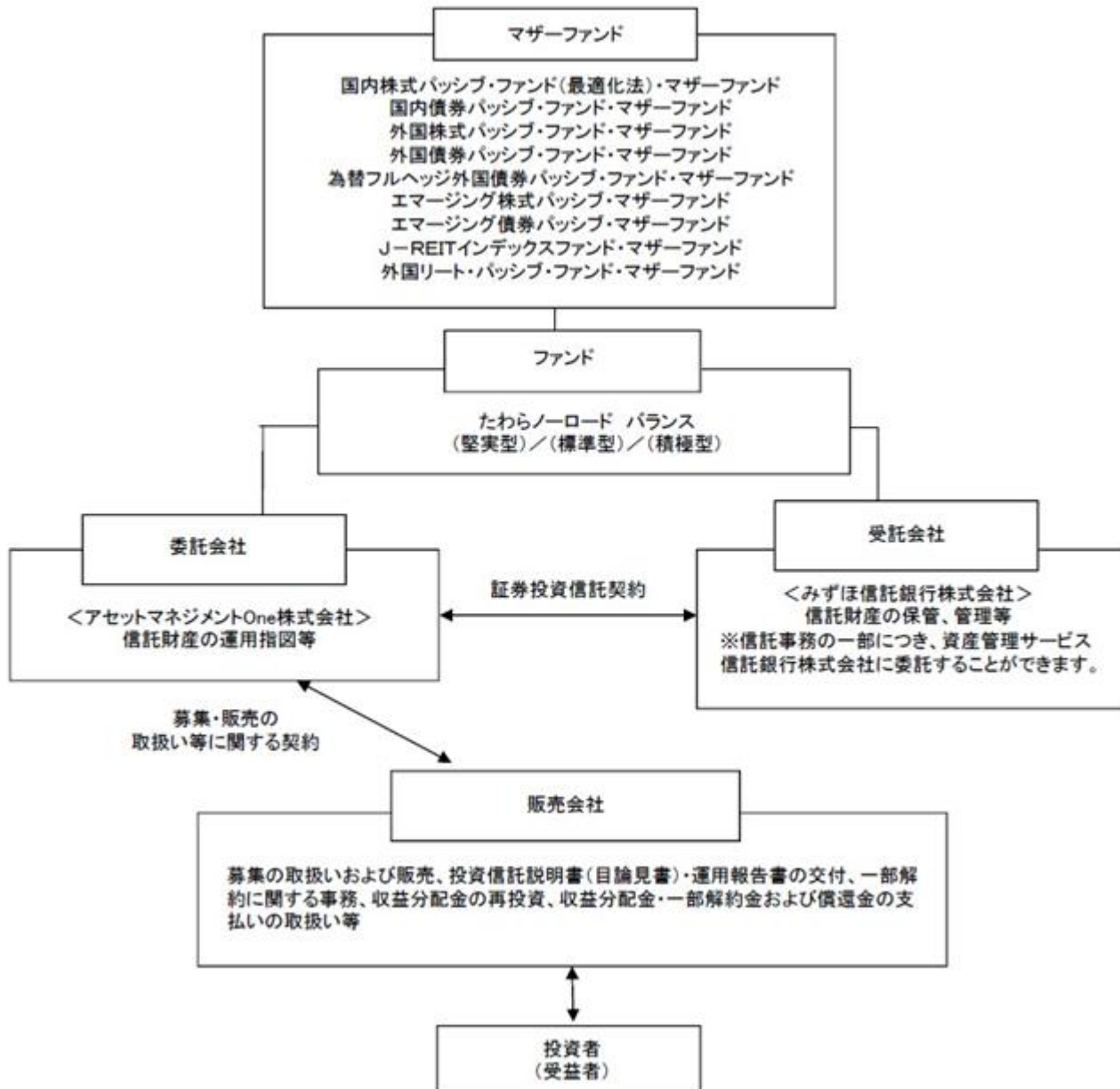
（注2）各ファンドが該当しない商品分類および属性区分の定義につきましては、一般社団法人投資信託協会のホームページ（<https://www.toushin.or.jp/>）をご覧ください。

（注3）各ファンドはマザーファンド受益証券（投資信託証券）への投資を通じて、債券、株式、不動産投信を主要投資対象とします。したがって、「商品分類」における投資対象資産と、「属性区分」における投資対象資産の分類・区分は異なります。

## （2）【ファンドの沿革】

2017年11月8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。

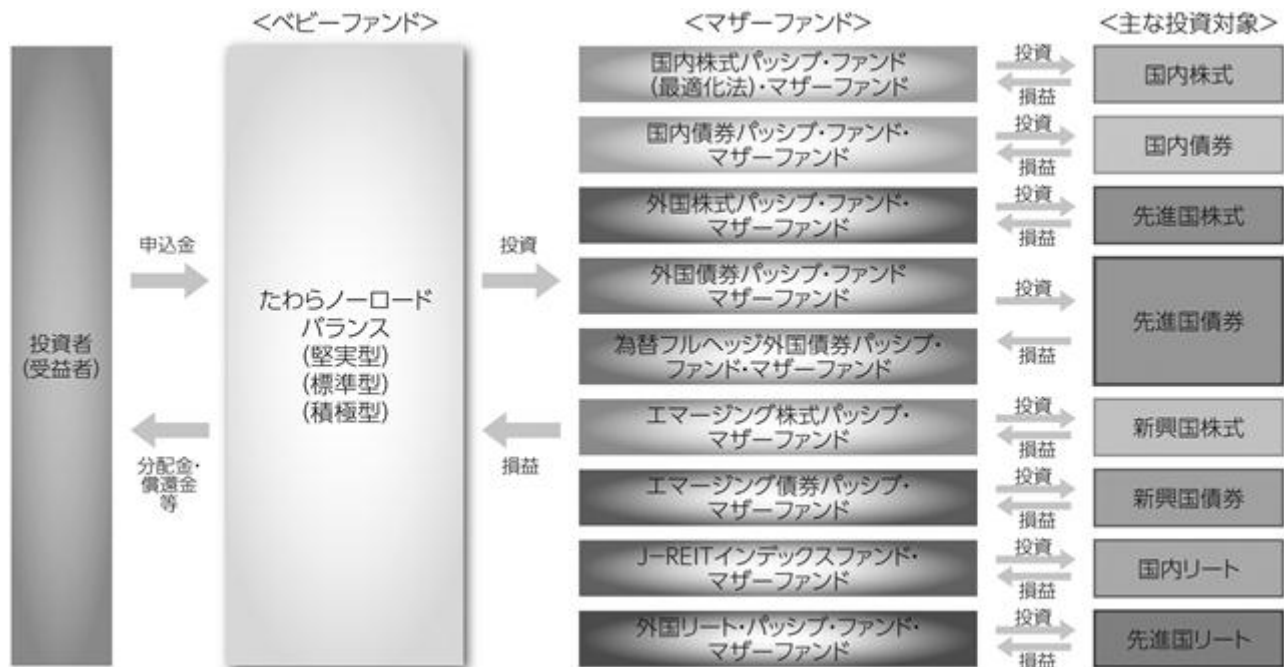
- ・「募集・販売の取扱い等に関する契約」の概要

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。

## 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各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（2019年4月26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「D I A M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	D I A Mアセットマネジメント株式会社、みずほ投信投資顧問株式会社、新光投信株式会社、みずほ信託銀行株式会社（資産運用部門）が統合し、商号をアセットマネジメントOne株式会社に変更

## 大株主の状況

(2019年4月26日現在)

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

1：A種種類株式（15,510株）を含みます。

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

## 2【投資方針】

### (1)【投資方針】

#### <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>

「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」受益証券、「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「外国債券パッシブ・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、「エマージング債券パッシブ・マザーファンド」受益証券、「J-REITインデックスファンド・マザーファンド」受益証券、「外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券を主要投資対象とします。

#### <投資態度>

この投資信託は、主として次のマザーファンド受益証券への投資を通じて、各資産クラスの代表的な指数に連動する投資成果をめざして運用を行い、実質的に国内株式、国内債券、先進国株式（除く日本）、先進国債券（除く日本）、先進国債券（除く日本、ヘッジあり）、新興国株式、新興国債券、国内リート、先進国リート（除く日本）に投資します。

なお、先進国株式（除く日本）については各ファンドにおいてその全部または一部の為替ヘッジ<sup>(注)</sup>を行います。

(注)一部の通貨については流動性の観点等から為替ヘッジが困難であるため、主要国通貨で代替的にヘッジする場合があります。

マザーファンド	マザーファンドが連動対象とする指数	資産クラス
国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	東証株価指数（TOPIX）（配当込み）	国内株式
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	NOMURA-BPI総合	国内債券
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	M S C I 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）	先進国株式（除く日本） 先進国株式（除く日本、ヘッジあり）

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）	先進国債券（除く日本）
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	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）	先進国債券（除く日本、ヘッジあり）
エマージング株式パッシブ・マザーファンド	M S C I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）	新興国株式
エマージング債券パッシブ・マザーファンド	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）	新興国債券
J - R E I Tインデックスファンド・マザーファンド	東証REIT指数（配当込み）	国内リート
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	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）	先進国リート（除く日本）

上記マザーファンドを以下「各マザーファンド」または総称して「マザーファンド」ということがあります。

各マザーファンド受益証券への配分比率は以下を基本とします。

マザーファンド受益証券	資産クラス	堅実型	標準型	積極型
国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	国内株式	4%	7%	13%
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	国内債券	36%	17%	3%
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	先進国株式（除く日本）	0%	6%	16%
	先進国株式（除く日本、ヘッジあり）	12%	21%	24%
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	先進国債券（除く日本）	3%	4%	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	先進国債券（除く日本、ヘッジあり）	33%	23%	13%
エマージング株式パッシブ・マザーファンド	新興国株式	1%	1%	2%
エマージング債券パッシブ・マザーファンド	新興国債券	8%	6%	3%

J-REITインデックスファンド・マザーファンド	国内リート	2%	10%	13%
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	先進国リート (除く日本)	1%	5%	12%

時価変動等により、各資産クラスの組入比率が基本配分比率から一定以上乖離した場合にはリバランスすることとします。

マザーファンド受益証券の組入比率は、原則として高位を維持します。

ファンドの資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

## (2) 【投資対象】

投資の対象とする資産の種類(約款第16条)

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ.有価証券

ロ.デリバティブ取引にかかる権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第23条、第24条および第25条に定めるものに限ります。)

ハ.金銭債権

ニ.約束手形

2.次に掲げる特定資産以外の資産

イ.為替手形

運用の指図範囲等(約款第17条第1項)

委託会社は、信託金を、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親投資信託である国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド、国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド、外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド、外国債券パッシブ・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、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、J-REITインデックスファンド・マザーファンド、外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンドの各受益証券を含む次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することを指図します。

1. 株券または新株引受権証券

2. 国債証券

3. 地方債証券

4. 特別の法律により法人の発行する債券

5. 社債券(新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。))の新株引受権証券を除きます。なお、社債券のうちで、新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの、ならびに会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を総称して以下「転換社債型新株予約権付社債」といいます。)

6. 資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
  7. 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。)
  8. 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。)
  9. 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。)
  10. コマーシャル・ペーパー
  11. 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。)および新株予約権証券
  12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、上記1.~11.の証券または証書の性質を有するもの
  13. 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
  14. 投資証券、新投資口予約権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、15.で定めるものを除きます。)
  15. 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ます。)または外国投資証券で投資法人債券に類する証券
  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、12.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6.までの証券ならびに15.の証券ならびに12.および18.の証券または証書のうち2.から6.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、13.の証券および14.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	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、NOMURA - B P I 総合に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主な投資対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	<p>1.主としてわが国の公社債に投資し、「NOMURA - B P I 総合」に連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>2.公社債(債券先物取引等を含みます。)の組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</p> <p>3.公社債の組入比率の調整には、債券先物取引等を活用する場合があります。</p> <div style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin-top: 10px;"> <p>NOMURA - B P I 総合の知的財産権その他一切の権利は野村証券株式会社に帰属します。なお、野村証券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。</p> </div>

## 運用プロセス

## 1.流動性基準等による対象銘柄群設定

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

## 2.最適化法によるポートフォリオの構築

1) 債券種別・格付けから発生するベンチマーク乖離要因

2) 金利の期間構造、スプレッドの期間構造から発生するベンチマーク乖離要因

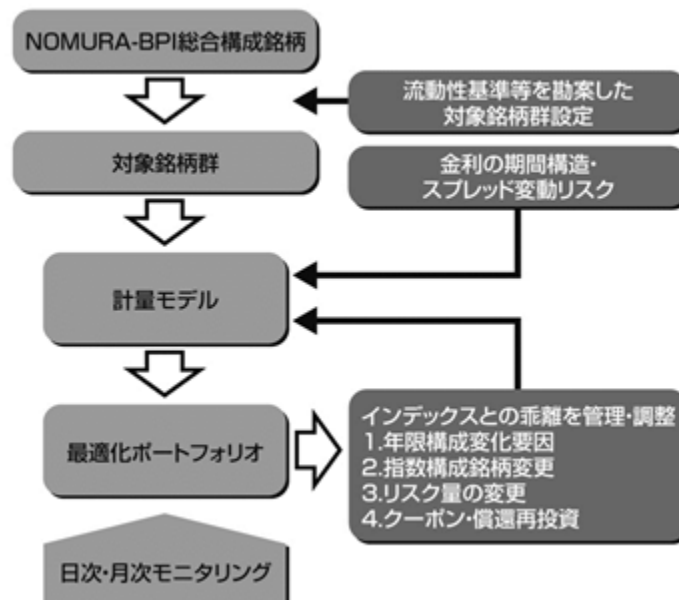
1)、2)が最小になると判断されるポートフォリオを構築します。

## 3.インデックスとの乖離を管理

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

インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。

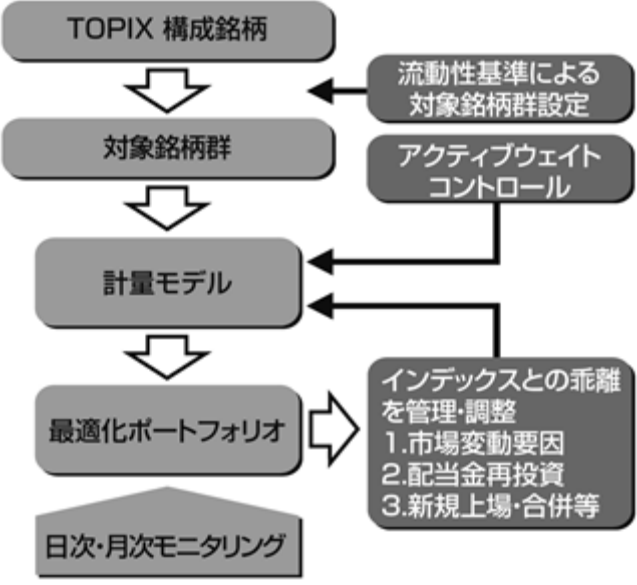
- ・ 年限構成変化要因   ・ 指数構成銘柄変更
- ・ リスク量の変更   ・ クーボン、償還再投資



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

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

投資態度	<p>1.主として東京証券取引所第1部に上場されている株式に投資し、「東証株価指数(TOPIX)(配当込み)」に連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>2.最適化法によるポートフォリオ構築を行い、運用コストの最小化と徹底したリスク管理を行います。</p> <p>3.株式(株価指数先物取引を含みます。)の組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</p> <p>4.株式の組入比率の調整には、株価指数先物取引等を活用します。</p> <p>5.非株式割合は原則として信託財産総額の50%以下とします。また、外貨建資産割合は原則として信託財産総額の10%以下とします。</p> <div style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin-top: 10px;"> <p>東証株価指数(TOPIX)の指数値およびTOPIXの商標は、株式会社東京証券取引所(以下「株東京証券取引所」といいます。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など東証株価指数(TOPIX)に関するすべての権利・ノウハウおよびTOPIXの商標に関するすべての権利は株東京証券取引所が有しています。</p> <p>株東京証券取引所は、東証株価指数(TOPIX)の指数値の算出もしくは公表の方法の変更、東証株価指数(TOPIX)の指数値の算出もしくは公表の停止またはTOPIXの商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。</p> <p>株東京証券取引所は、東証株価指数(TOPIX)の指数値およびTOPIXの商標の使用に関して得られる結果ならびに特定日の東証株価指数(TOPIX)の指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。</p> <p>株東京証券取引所は、東証株価指数(TOPIX)の指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、株東京証券取引所は、東証株価指数(TOPIX)の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。</p> <p>当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドは、株東京証券取引所により提供、保証または販売されるものではありません。</p> <p>株東京証券取引所は、当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドの購入者または公衆に対し、当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を持ちません。</p> <p>株東京証券取引所は、委託会社または当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドの購入者のニーズを、東証株価指数(TOPIX)の指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。</p> <p>以上の項目に限らず、株東京証券取引所は当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドの発行または売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を負いません。</p> </div>
------	--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

運用プロセス	<p>1.流動性基準による対象銘柄群設定 マーケットインパクトの低減を図る為、TOPIX採用銘柄のうち、流動性が低い銘柄を除外して投資対象銘柄群を設定します。</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、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。 インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>・市場変動に伴うもの：推定トラッキングエラーの増加に伴い実施</li> <li>・新規上場、合併等に伴うもの：指数に与える影響を勘案し、決定</li> <li>・配当金再投資に伴うもの：キャッシュ比率の上昇に伴い実施</li> </ul> 
主な投資制限	<p>1.株式への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>2.デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</p> <p>3.外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。</p> <p>4.一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>

ファンド名	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標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、為替ヘッジなし)」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。</p> <div style="border: 1px solid black; padding: 5px;"><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。</p><p>このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。</p></div>

## 運用プロセス

## 1.流動性基準等による対象銘柄群設定

FTSE世界国債インデックス構成銘柄のうち、流動性基準等を勘案して投資対象銘柄群を設定します。

## 2.最適化法によるポートフォリオの構築

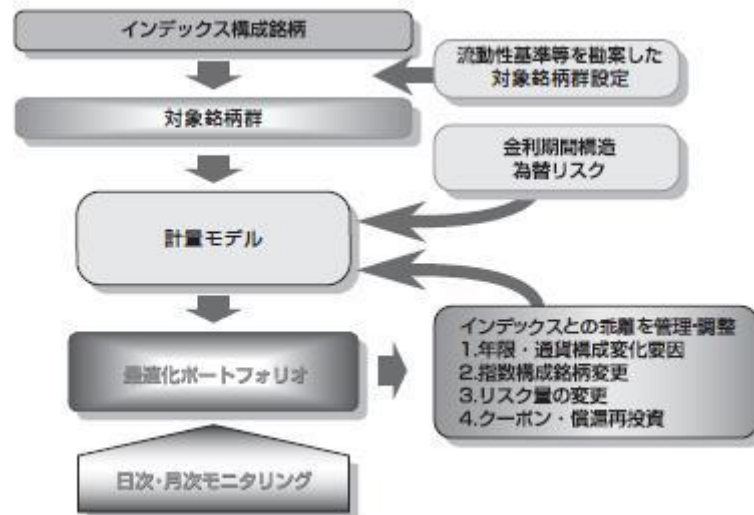
金利の期間構造、通貨エクスポージャーから発生するベンチマーク乖離要因が最小となるポートフォリオを構築します。

## 3.インデックスとの乖離を管理

日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理して、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。

インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。

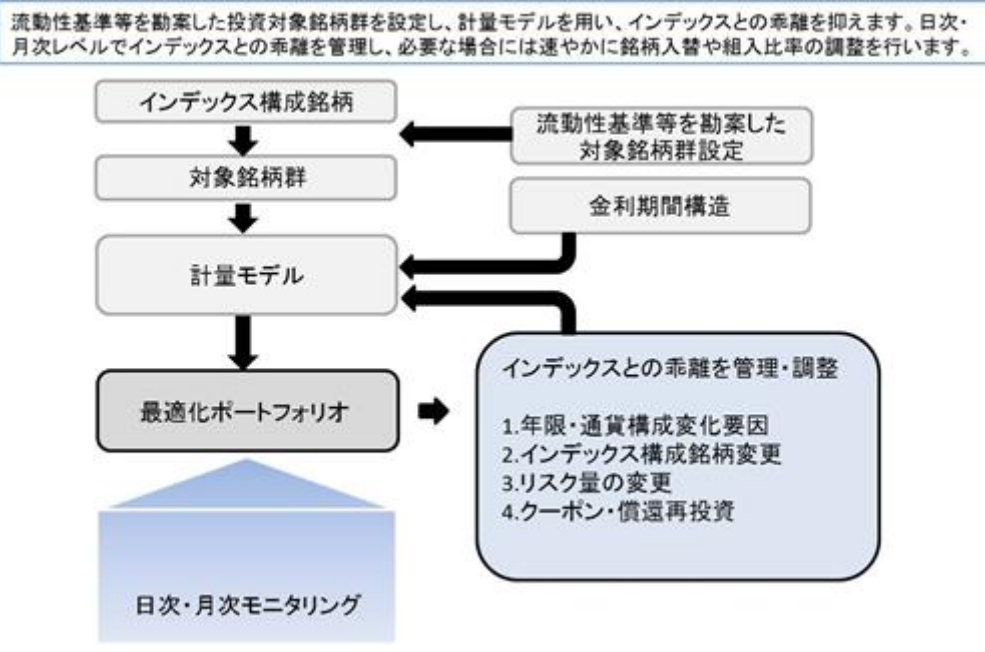
- ・ 年限・通貨構成変化要因
- ・ 指数構成銘柄変更
- ・ リスク量の変更
- ・ クーポン・償還再投資



主な投資制限	<p>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せん。</p> <p>株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>2. 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。</p> <p>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、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>4. 外貨建資産への投資には、制限を設けません。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
--------	------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

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> <div style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin-top: 10px;"> <p>FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。</p> <p>このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。</p> </div>



運用プロセス	<p>流動性基準等を勘案した投資対象銘柄群を設定し、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。</p>  <pre> graph TD     A[インデックス構成銘柄] --&gt; B[対象銘柄群]     B --&gt; C[計量モデル]     C --&gt; D[最適化ポートフォリオ]     D --&gt; E[日次・月次モニタリング]          F[流動性基準等を勘案した対象銘柄群設定] --&gt; B     G[金利期間構造] --&gt; C          D --&gt; H[インデックスとの乖離を管理・調整]     subgraph H [インデックスとの乖離を管理・調整]         H1[1.年限・通貨構成変化要因]         H2[2.インデックス構成銘柄変更]         H3[3.リスク量の変更]         H4[4.クーポン・償還再投資]     end   </pre>
主な投資制限	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. 株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限ります。</li> <li>2. 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</li> <li>3. 同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</li> <li>4. 同一銘柄の転換社債等への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</li> <li>5. 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</li> <li>6. デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</li> <li>7. 外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。</li> <li>8. 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</li> </ol>

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

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

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

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

本証券、本商品もしくは本ファンドの購入者、販売者もしくは所有者、またはその他いかなる者もしくは団体も、MSCIの承認が必要か否かの確認を事前にMSCIに求めることなく、本証券を保証、推奨、販売、または宣伝するためにMSCIのトレードネーム、トレードマークまたはサービスマークを使用したり、それらに言及することはできません。いかなる状況においても、いかな

る者または団体も、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。

### 運用プロセス

#### 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。

#### 2.最適化法によるポートフォリオの構築

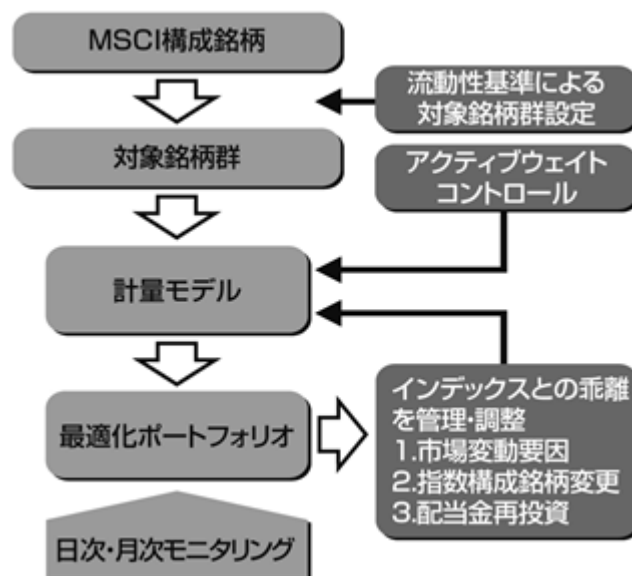
インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差(アクティブウェイト)を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。

#### 3.インデックスとの乖離を管理

日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理して、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。

- ・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



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

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

## 投資態度

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

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

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

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

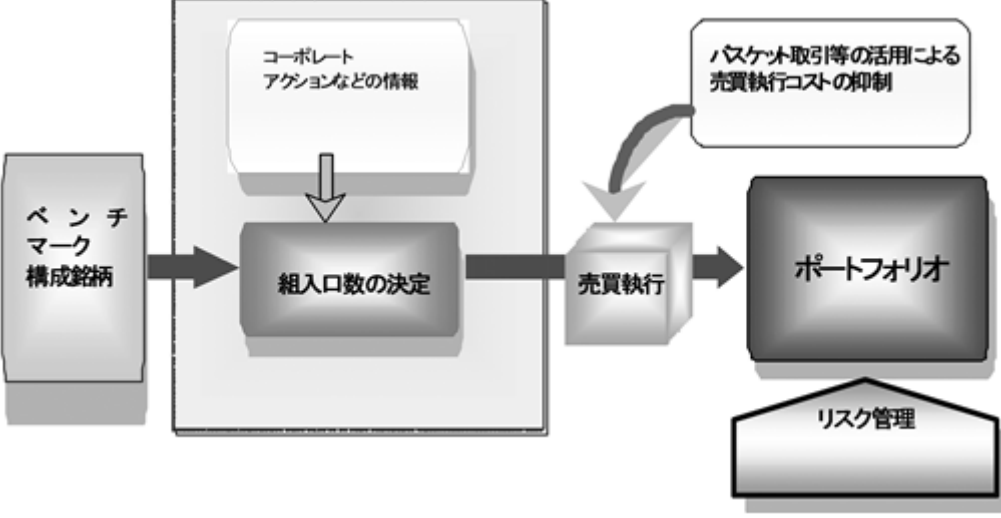
株東京証券取引所は、東証REIT指数の指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、株東京証券取引所は、東証REIT指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。

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

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

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

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

運用プロセス	<ul style="list-style-type: none"> <li>・原則としてベンチマーク構成全銘柄をその構成比率で保有します。ベンチマーク構成銘柄および採用予定銘柄を投資対象銘柄とします。</li> <li>・新規上場、公募増資、第三者割当等ベンチマーク構成の変更情報を事前に取得し、最適な執行方法によりリバランスを実施します。</li> <li>・配当金入金等によりキャッシュ比率が上昇した場合にもリバランスを実施します。</li> </ul> 
主な投資制限	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. 投資信託証券への投資割合には制限を設けません。</li> <li>2. 同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として信託財産の純資産総額の30%を超えないものとします。ただし、東証REIT指数採用の不動産投資信託証券の上場時価総額の合計額に占める同一銘柄の不動産投資信託証券の時価総額の割合が30%を超えている場合、当該同一銘柄の不動産投資信託証券への投資割合は、原則として当該同一銘柄の不動産投資信託証券の時価総額が東証REIT指数採用の不動産投資信託証券の上場時価総額の合計額に占める割合の範囲で投資することができるものとします。</li> <li>3. 株式への投資は行いません。</li> <li>4. 外貨建資産への投資は行いません。</li> <li>5. デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます。)は、価格変動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。</li> <li>6. 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</li> </ol>

ファンド名	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"><li>1.主に日本を除く世界各国の不動産投資信託証券を主要投資対象とし、S &amp; P 先進国 REIT インデックス(除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)に連動する投資成果をめざして運用を行います。</li><li>2.不動産投資信託証券への投資割合は、原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</li><li>3.外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。ただし、金利・為替状況によってはヘッジを行う場合があります。</li></ol>





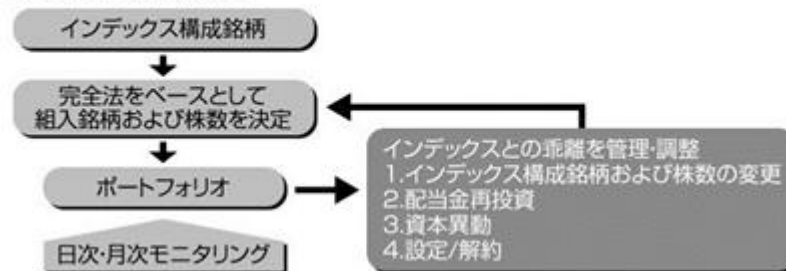
S & P 先進国 R E I T インデックスは、S&P Globalの一部門であるS&Pダウ・ジョーンズ・インデックスLLCまたはその関連会社(「SPDJI」)の商品であり、これを利用するライセンスが委託会社に付与されています。Standard & Poor's®およびS&P®は、S&P Globalの一部門であるスタンダード・プアーズ・ファイナンシャル・サービシーズLLC(「S&P」)の登録商標で、Dow Jones®は、ダウ・ジョーンズ・トレードマーク・ホールディングズLLC(「Dow Jones」)の登録商標です。指数に直接投資することはできません。本商品は、SPDJI、Dow Jones、S&P、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



## 主な投資制限

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	エマージング債券パッシブ・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、主として新興国の債券に投資し、JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース・為替ヘッジなし）の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。
主な投資対象	新興国の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	<p>1.主として新興国の債券に投資し、JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース・為替ヘッジなし）の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>2.原則として、新興国の債券の組入比率は高位を維持します。</p> <p>3.組入債券は、当初組入時において、S&amp;PもしくはMoody'sの外貨建て長期格付がBB-格もしくはBa3格以上を取得している債券とします。但し、両社が格付を付与している場合には、どちらか低い方の格付を基準とします。また、当ファンドが保有する債券の格付が上記基準未満となった場合は、当該債券を速やかに売却するものとします。</p> <p>4.外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。</p> <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] --&gt; B[対象銘柄群]     B --&gt; C[計量モデル]     C --&gt; D[最適化ポートフォリオ]     E[信用格付基準等を勘案した対象銘柄群設定] --&gt; B     F[金利期間構造] --&gt; C     D --&gt; G[インデックスとの乖離を管理・調整]     G --&gt; H[1. 年限・通貨構成変化要因 2. インデックス構成銘柄変更 3. リスク量の変更 4. クーポン・償還再投資]     I[日次・月次モニタリング]   </pre>

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

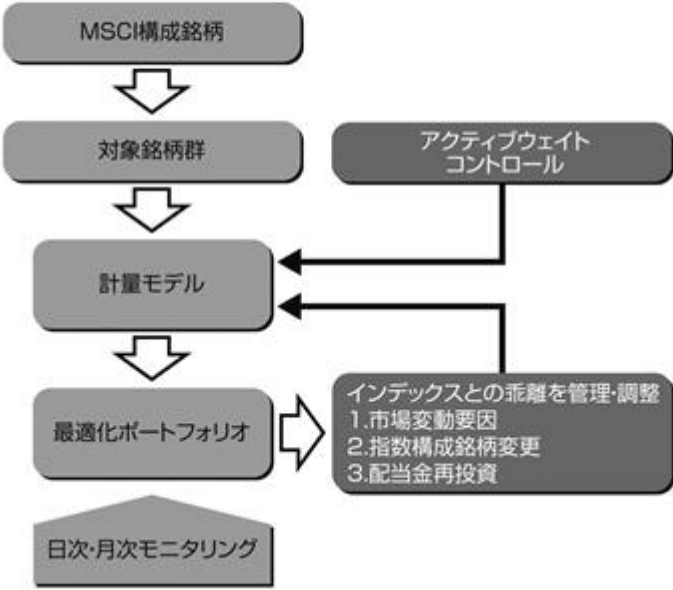
ファンド名	エマージング株式パッシブ・マザーファンド
基本方針	<p>この投資信託は、主として海外の証券取引所に上場している株式<sup>(*)</sup>に投資し、MSCIEマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>(*) DR（預託証券）もしくは株式と同等の投資効果が得られる権利を表示する証券および証書等を含みます。</p>
主な投資対象	海外の証券取引所に上場している株式を主要投資対象とします。

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

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

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

本証券、本商品もしくは本ファンドの購入者、販売者もしくは所有者、またはその他いかなる者もしくは団体も、MSCIの承認が必要か否かの確認を事前にMSCIに求めることなく、本証券を保証、推奨、販売、または宣伝するためにMSCIのトレードネーム、トレードマークまたはサービスマークを使用したり、それらに言及することはできません。いかなる状況においても、いかな

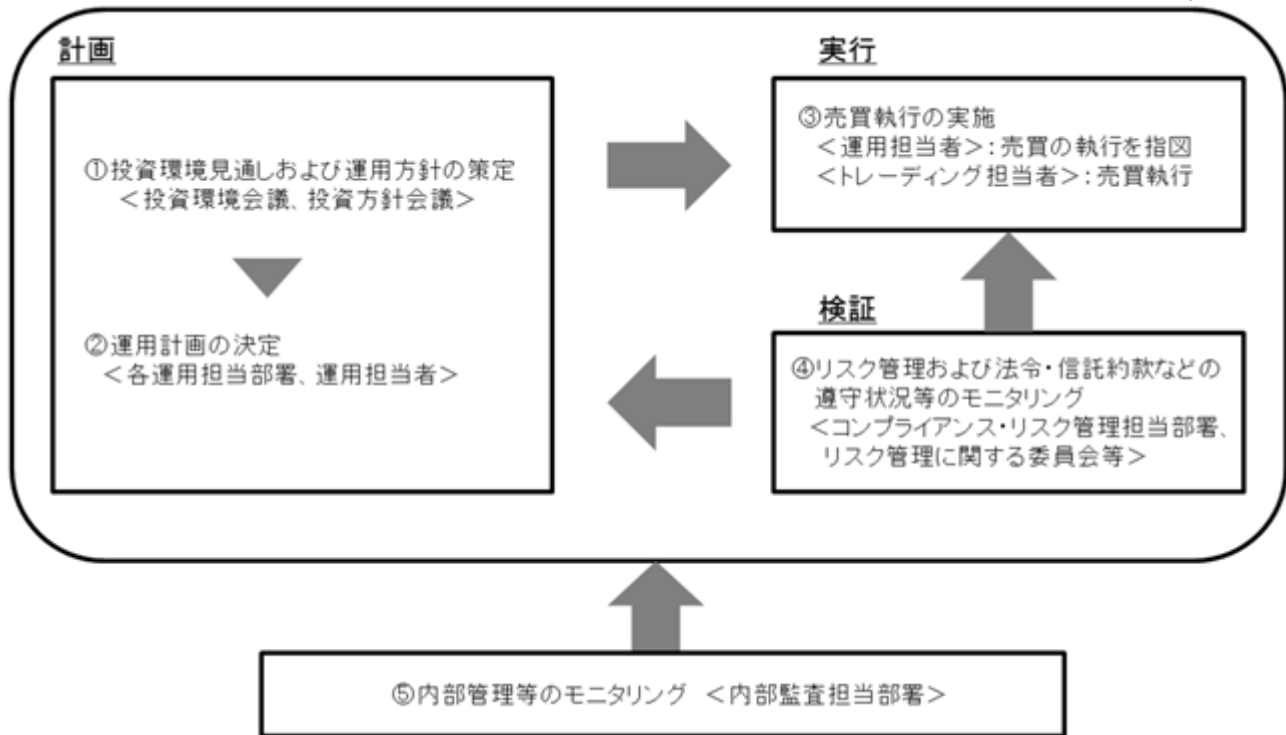
	<p>る者または団体も、事前にMSCIの書面による承認を得ることなくMSCIとの関係を主張することはできません。</p>
運用プロセス	<p>現地口座の開設可否、預託証券の利用可否を基準に投資対象銘柄群を設定し、インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差(アクティブウェイト)を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用いて、インデックスとの乖離を抑えます。 日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理して、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。</p>  <pre> graph TD     A[MSCI構成銘柄] --&gt; B[対象銘柄群]     B --&gt;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

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。

#### 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

各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2019年4月26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10月12日(休業日の場合は翌営業日))に、原則として以下の方針に基づき収益の分配を行います。

(1) 分配対象額の範囲は、繰越分を含めた経費控除後の配当等収益(マザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち、信託財産に属するとみなした額(以下「みなし配当等収益」といいます。))を含みます。)および売買益(評価益を含み、みなし配当等収益を控除して得た額)等の全額とします。

(2) 分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して、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) 留保益の運用については、特に制限を設けず、運用の基本方針に基づいて運用を行います。

### 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、信託報酬および当該信託報酬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、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、繰越欠損金のあるとき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、）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。

「分配金再投資コース」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】

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）

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）

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）

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。（約款「運用の基本方針」2.運用方法（3）投資制限）

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。（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。(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22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(上記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を差引いた額)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、組入貸付債権信託受益権、組入抵当証券および組入指定金銭信託の受益証券の利払金および償還金を加えた額を限度とし、かつ信

託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに上記(2)投資対象 運用の指図範囲等1.~4.に掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。

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。)の時価総額の範囲内とします。

2.先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに上記(2)投資対象 運用の指図範囲等1.~4.に掲げる金融商品で運用している額(以下2.において「金融商品運用額等」といいます。)の範囲内とします。ただし、ヘッジ対象金利商品が外貨建で、信託財産の外貨建資産組入可能額(約款上の組入可能額から保有外貨建資産の時価総額を差引いた額をいいます。以下同じ。)に信託財産が限月までに受取る外貨建組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに外貨建組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額が当該金融商品運用額等の額より少ない場合には外貨建資産組入可能額に信託財産が限月までに受取る外貨建組入有価証券にかかる利払金および償還金等を加えた額を限度とします。

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

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

#### 金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図(約款第25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、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、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、
- 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26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27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、担保の受入れの指図を行うものとします。

公社債の空売りの指図および範囲(約款第28条)

- 1) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、公社債(信託財産により借入れた公社債を含みます。)の引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)の売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内で行うものとします。
- 3) 信託財産の一部解約等の事由により、上記2)の売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。

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

#### 特別な場合の外貨建有価証券への投資制限(約款第30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31条)

委託会社は、信託財産に属する外貨建資産とマザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。)との合計額について、当該外貨建資産の為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約を指図することができます。

#### 資金の借入れ(約款第37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

資産配分比率が高い資産の価値が下落した場合や、複数または全ての資産の価値が同時に下落した場合等は、基準価額の下落要因となります。

投資に際して資産配分を行う場合には、一般に当該資産への資産配分の比率に応じて、投資全体の成果に影響をおよぼします。各ファンドは、公社債、株式およびリートに資産配分を行いますが、配分比率が高い資産の価値が下落した場合や、複数または全ての資産の価値が同時に下落した場合等には、基準価額が下落する要因となります。

#### 株価変動リスク

投資する企業の株価の下落は、基準価額の下落要因となります。

株式の価格は、国内外の政治・経済・社会情勢の変化、発行企業の業績・経営状況の変化、市場の需給関係等の影響を受け変動します。株式市場や各ファンドが実質的に投資する企業の株価が下落した場合には、その影響を受け、基準価額が下落する要因となります。

#### 金利変動リスク

金利の上昇は、基準価額の下落要因となる可能性があります。

金利の変動は、公社債等の価格に影響をおよぼします。金利変動は、公社債・株式・リート等の各資産への投資の相対的魅力度を変化させるため、金利変動により各資産の市場の間で資金移動が起こる場合があります、基準価額を下落させる要因となる可能性があります。

#### 不動産投資信託証券（リート）の価格変動リスク

リートの価格の下落は、基準価額の下落要因となります。

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、関係法令・規制等の変更等の影響を受けます。また、老朽化・災害等の発生による保有不動産の滅失・損壊等が発生する可能性があります。各ファンドが実質的に投資するリートの市場価格が下落した場合には、基準価額が下落する要因となります。

#### 為替変動リスク

為替相場の円高は、基準価額の下落要因となります。

為替相場は、各国の政治情勢、経済状況等の様々な要因により変動し、外貨建資産の円換算価格に影響をおよぼします。各ファンドは一部の実質組入外貨建資産について、対円での為替ヘッジを行います。

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

為替ヘッジを行う資産については、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。また、為替ヘッジには円金利がヘッジ対象通貨の金利よりも低い場合、その金利差相当分程度のコストがかかることにご留意ください。

#### 信用リスク

投資する有価証券の発行者の財政難・経営不安・倒産等の発生は、基準価額の下落要因となります。

有価証券等の価格は、その発行体に債務不履行等が発生または予想される場合には、その影響を受け変動します。各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、各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、基準価額が下落する要因となります。

## 流動性リスク

投資資産の市場規模が小さいことなどで希望する価格で売買できない場合は、基準価額の下落要因となります。

有価証券等を売却または取得する際に市場規模や取引量、取引規制等により、その取引価格が影響を受ける場合があります。一般に市場規模が小さい場合や取引量が少ない場合には、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要因となります。

## カントリーリスク

投資する国・地域の政治・経済の不安定化等は、基準価額の下落要因となります。

投資対象国・地域の政治経済情勢、通貨規制、資本規制、税制、また取引規制等の要因によって資産価格や通貨価値が大きく変動する場合があります。海外に投資する場合には、これらの影響を受け、基準価額が下落する要因となります。各ファンドが実質的に投資を行う株式・債券や通貨の発行者が属する新興国の経済状況は、先進国経済と比較して一般的に脆弱である可能性があります。そのため、当該国のインフレ、国際収支、外貨準備高等の悪化等が株式・債券市場や為替市場におよぼす影響は、先進国以上に大きいものになることが予想されます。さらに、政府当局による海外からの投資規制や課徴的な税制、海外への送金規制等の種々な規制の導入や政策の変更等の要因も株式・債券市場や為替市場に著しい影響をおよぼす可能性があります。

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。当該方式は、運用の効率化に資するものですが、一方で、各ファンドが主要投資対象とするマザーファンドに対し、他のベビーファンドにより多額の追加設定・一部解約等がなされた場合には、マザーファンドにおける売買ならびに組入比率の変化等により、各ファンドの基準価額や運用が影響を受ける場合があります。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、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、お申込みの受付または解約の受付を中止することおよびすでに受付けたお申込みの受付または解約の受付を取り消すことができるものとします。

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、各ファンドの受益権口数が10億口を下回ることとなった場合、マザーファンドのベンチマークである対象インデックスが改廃された場合、その他やむを得ない事情が発生した場合は、当初定められていた信託期間の途中で信託を終了（繰上償還）する場合があります。

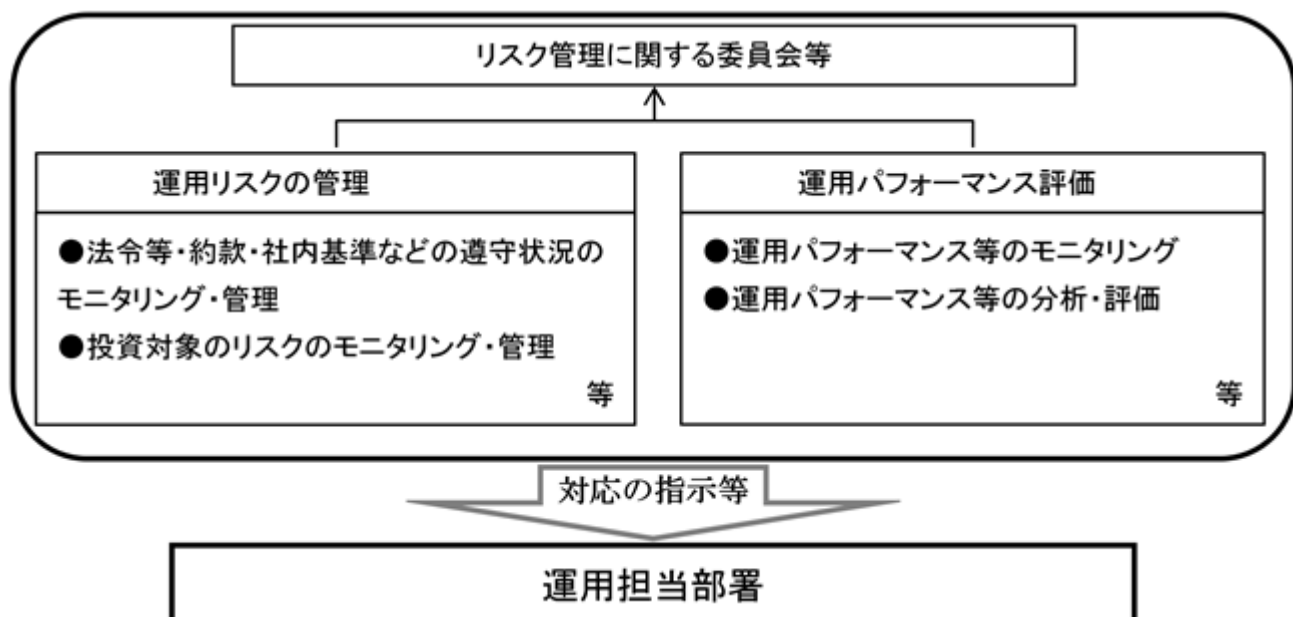
#### 注意事項

- ・各ファンドは、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変動リスクもあります。）に投資しますので、基準価額は変動します。
- ・投資信託は、預金等や保険契約ではありません。また、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。加えて、証券会社を通して購入していない場合には投資者保護基金の対象にもなりません。
- ・投資信託は、購入金額について元本保証および利回り保証のいずれもありません。
- ・投資信託は、投資した資産の価値が減少して購入金額を下回る場合があります、これによる損失は購入者が負担することとなります。

#### <リスク管理体制>

委託会社における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2019年4月26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

#### 堅実型



2014年5月 2015年5月 2016年5月 2017年5月 2018年5月 2019年4月

#### 標準型



2014年5月 2015年5月 2016年5月 2017年5月 2018年5月 2019年4月

#### 積極型

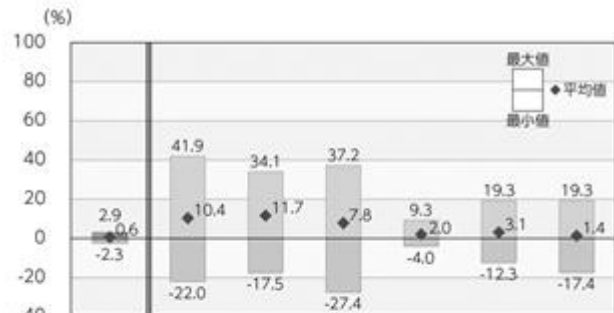


2014年5月 2015年5月 2016年5月 2017年5月 2018年5月 2019年4月

\*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。

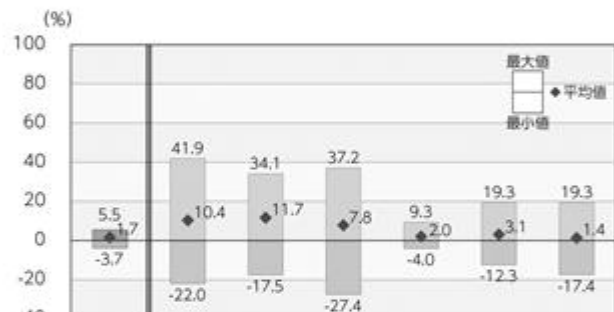
\*ファンドの年間騰落率は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した年間騰落率が記載されていますので、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

### 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



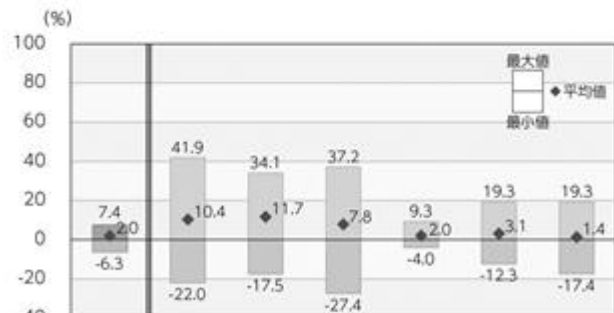
ファンド:2018年11月~2019年4月

代表的な資産クラス:2014年5月~2019年4月



ファンド:2018年11月~2019年4月

代表的な資産クラス:2014年5月~2019年4月



ファンド:2018年11月~2019年4月

代表的な資産クラス:2014年5月~2019年4月

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

\*全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

## 各資産クラスの指数

日本株	東証株価指数(TOPIX) (配当込み)	「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。
先進国株	MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、円ベース)	「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。
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)	「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。
日本国債	NOMURA-BPI国債	「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。
先進国債	FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)	「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。
新興国債	JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイド(円ベース)	「JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイド」は、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが公表している新興国の現地通貨建ての国債で構成されている時価総額加重平均指数です。同指数に関する著作権等の知的財産その他一切の権利はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。また、同社は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

(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。

## 4【手数料等及び税金】

## (1)【申込手数料】

ありません。

## (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0.2376%\*（税抜0.22%）以内

2019年7月12日現在は、年率0.2376%（税抜0.22%）になります。

\*消費税率が10%になった場合は、年率0.242%となります。

配分は以下の通りです。

支払先	内訳（税抜）	主な役務
委託会社	年率0.10%	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0.10%	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0.02%	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（ファンドの基準価額に反映）され、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日（休業日の場合は翌営業日）および毎計算期末または信託終了のときに信託報酬にかかる消費税等相当額とともに信託財産から支払われます。

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

## (4)【その他の手数料等】

## ・ 信託財産留保額

ありません。

## ・ その他の費用

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

信託財産に関する租税、特定資産の価格等の調査に要する費用および当該費用にかかる消費税等に相当する金額、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（ファンドの基準価額に反映）され、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日（休業日の場合は翌営業日）および毎計算期末または信託終了のとき、当該監査に要する費用にかかる消費税等相当額とともに信託財産から支払われます。

有価証券の売買時の売買委託手数料および有価証券取引にかかる手数料・税金、先物・オプション取引に要する費用、当該手数料にかかる消費税等相当額および外国での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および外国での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、定期的に見直されるものや売買条件等により異なるものがあるため、事前に料率・上限額等を示すことができません。上場不動産投資信託(リート)は市場の需給により価格形成されるため、上場不動産投資信託(リート)の費用は表示しておりません。税法が改正された場合等は、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。

公募株式投資信託は税法上、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)」の適用対象です。また、販売会社によっては非課税累積投資契約に係る少額投資非課税制度「愛称：つみたてNISA(つみたてニーサ)」の適用対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

NISAまたはつみたてNISA(いずれかの選択)、およびジュニアNISAをご利用の場合、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。

受益者が確定拠出年金法に規定する資産管理機関および国民年金基金連合会等の場合は、所得税(復興特別所得税を含みます。)および地方税がかかりません。また、確定拠出年金制度の加入者については、確定拠出年金の積立金の運用にかかる税制が適用されます。

上記は、2019年4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「分配金再投資コース」の両コースで同一ファンドの受益権を取得する場合はコース別に個別元本の算出が行われる場合があります。

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

##### < 収益分配金の課税について >

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

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

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

税法が改正された場合等は、上記内容が変更になることがあります。

## 5【運用状況】

## (1)【投資状況】

たわらノーロード バランス（堅実型）

平成31年4月26日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	224,955,506	99.52
内 日本	224,955,506	99.52
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	1,076,890	0.48
純資産総額	226,032,396	100.00

その他資産の投資状況

平成31年4月26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）	26,292,215	11.63
-	26,292,215	11.63

（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。

たわらノーロード バランス（標準型）

平成31年4月26日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	919,539,240	99.26
内 日本	919,539,240	99.26
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	6,808,896	0.74
純資産総額	926,348,136	100.00

その他資産の投資状況

平成31年4月26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）	183,793,732	19.84
-	183,793,732	19.84

（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。

たわらノーロード バランス（積極型）

平成31年4月26日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	916,669,394	99.59
内 日本	916,669,394	99.59
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	3,782,864	0.41
純資産総額	920,452,258	100.00

## その他資産の投資状況

平成31年4月26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）	213,307,040	23.17
-	213,307,040	23.17

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

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

（参考）

## 国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

平成31年4月26日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	264,759,812,660	97.37
内 日本	264,759,812,660	97.37
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	7,149,802,638	2.63
純資産総額	271,909,615,298	100.00

## その他資産の投資状況

平成31年4月26日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引（買建）	6,363,100,000	2.34
内 日本	6,363,100,000	2.34

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

## 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成31年4月26日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	232,617,975,600	80.23
内 日本	232,617,975,600	80.23
地方債証券	22,132,278,047	7.63
内 日本	22,132,278,047	7.63
特殊債券	18,020,970,577	6.22
内 日本	18,020,970,577	6.22
社債券	13,765,461,740	4.75
内 日本	13,360,859,740	4.61
内 フランス	404,602,000	0.14
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	3,398,295,561	1.17
純資産総額	289,934,981,525	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

## J-REITインデックスファンド・マザーファンド

平成31年4月26日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	32,472,172,130	97.45
内 日本	32,472,172,130	97.45
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	849,746,917	2.55
純資産総額	33,321,919,047	100.00

## その他資産の投資状況

平成31年4月26日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
不動産投信指数先物取引（買建）	661,108,500	1.98
内 日本	661,108,500	1.98

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

## 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成31年4月26日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	356,649,308,720	96.02
内 アメリカ	231,782,586,408	62.40
内 イギリス	22,270,267,373	6.00
内 カナダ	13,916,030,910	3.75
内 フランス	13,802,460,966	3.72
内 スイス	12,913,683,205	3.48
内 ドイツ	11,857,980,955	3.19
内 オーストラリア	8,589,389,986	2.31
内 オランダ	6,616,479,179	1.78
内 アイルランド	6,206,653,492	1.67
内 スペイン	4,055,972,576	1.09
内 香港	3,827,667,014	1.03
内 スウェーデン	3,400,356,570	0.92
内 イタリア	2,557,029,426	0.69
内 デンマーク	2,313,171,768	0.62
内 シンガポール	1,704,751,434	0.46
内 フィンランド	1,603,959,232	0.43
内 バミューダ	1,477,429,270	0.40
内 ベルギー	1,349,381,611	0.36
内 ジャージー	1,236,066,513	0.33
内 ケイマン諸島	1,030,959,562	0.28
内 ノルウェー	963,485,845	0.26
内 イスラエル	743,798,530	0.20
内 オランダ領キュラソー	586,606,563	0.16
内 ルクセンブルグ	420,715,460	0.11
内 オーストリア	324,872,174	0.09
内 ニューージーランド	291,491,991	0.08
内 パナマ	213,428,349	0.06

	内 ポルトガル	210,062,209	0.06
	内 リベリア	190,732,431	0.05
	内 パプアニューギニア	67,647,804	0.02
	内 イギリス領バージン諸島	60,441,923	0.02
	内 マン島	47,280,873	0.01
	内 モーリシャス	16,467,118	0.00
投資信託受益証券		823,448,221	0.22
	内 オーストラリア	673,677,645	0.18
	内 シンガポール	149,770,576	0.04
投資証券		8,567,397,719	2.31
	内 アメリカ	7,532,322,169	2.03
	内 イギリス	287,029,544	0.08
	内 香港	241,641,760	0.07
	内 オランダ	233,047,864	0.06
	内 フランス	206,472,462	0.06
	内 カナダ	66,883,920	0.02
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		5,388,822,088	1.45
純資産総額		371,428,976,748	100.00

#### その他資産の投資状況

平成31年4月26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）	1,229,422,990	0.33
-	1,229,422,990	0.33
株価指数先物取引（買建）	4,041,617,236	1.09
内 アメリカ	2,814,789,137	0.76
内 ドイツ	685,862,415	0.18
内 イギリス	255,457,286	0.07
内 カナダ	148,175,244	0.04
内 オーストラリア	137,333,154	0.04

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

（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。

## 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成31年4月26日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	188,223,302,831	97.36
内 アメリカ	89,030,749,987	46.05
内 フランス	18,561,169,095	9.60
内 イタリア	16,230,958,670	8.40
内 ドイツ	12,654,542,407	6.55
内 イギリス	12,128,589,433	6.27
内 スペイン	11,002,080,470	5.69
内 ベルギー	4,762,727,390	2.46
内 オーストラリア	3,962,099,487	2.05
内 オランダ	3,763,589,073	1.95
内 カナダ	3,548,998,204	1.84
内 オーストリア	2,904,461,637	1.50
内 メキシコ	1,467,873,505	0.76
内 アイルランド	1,359,899,731	0.70
内 フィンランド	1,205,283,822	0.62
内 ポーランド	1,108,371,326	0.57
内 南アフリカ	1,062,743,967	0.55
内 デンマーク	949,069,371	0.49
内 マレーシア	815,309,210	0.42
内 シンガポール	666,000,750	0.34
内 スウェーデン	647,800,202	0.34
内 ノルウェー	390,985,094	0.20
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	5,096,097,358	2.64
純資産総額	193,319,400,189	100.00

## その他資産の投資状況

平成31年4月26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）	1,346,214,766	0.70
-	1,346,214,766	0.70

（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。



## 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成31年4月26日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	5,384,036,864	10.35
内 オーストラリア	3,529,374,599	6.79
内 シンガポール	1,828,136,085	3.52
内 カナダ	26,526,180	0.05
投資証券	46,414,844,930	89.25
内 アメリカ	37,634,573,545	72.37
内 イギリス	2,639,168,624	5.07
内 香港	1,227,737,795	2.36
内 フランス	1,192,379,425	2.29
内 オランダ	1,179,846,947	2.27
内 カナダ	924,077,816	1.78
内 ベルギー	452,529,990	0.87
内 スペイン	364,190,930	0.70
内 ニュージーランド	235,184,136	0.45
内 ドイツ	142,196,864	0.27
内 アイルランド	127,141,043	0.24
内 シンガポール	122,899,191	0.24
内 ガーンジー	94,816,397	0.18
内 イスラエル	35,198,947	0.07
内 マン島	20,095,488	0.04
内 イタリア	15,811,907	0.03
内 韓国	6,995,885	0.01
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	204,457,913	0.39
純資産総額	52,003,339,707	100.00

## その他資産の投資状況

平成31年4月26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）	21,144,600	0.04
-	21,144,600	0.04

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

## 為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成31年4月26日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	391,715,681,994	97.83
内 アメリカ	186,096,976,822	46.48
内 フランス	37,808,205,850	9.44
内 イタリア	33,265,809,158	8.31
内 イギリス	25,964,864,679	6.48
内 ドイツ	25,720,108,259	6.42
内 スペイン	22,054,798,218	5.51
内 ベルギー	10,510,195,881	2.62
内 オランダ	8,227,928,284	2.05
内 オーストラリア	8,109,070,080	2.03
内 カナダ	7,255,259,726	1.81
内 オーストリア	6,132,109,177	1.53
内 アイルランド	4,015,361,624	1.00
内 フィンランド	3,741,137,166	0.93
内 メキシコ	2,802,913,609	0.70
内 南アフリカ	2,116,756,530	0.53
内 ポーランド	2,085,547,020	0.52
内 デンマーク	1,791,688,776	0.45
内 シンガポール	1,190,086,080	0.30
内 スウェーデン	1,162,356,150	0.29
内 マレーシア	1,154,298,638	0.29
内 ノルウェー	510,210,267	0.13
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	8,706,069,573	2.17
純資産総額	400,421,751,567	100.00

## その他資産の投資状況

平成31年4月26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）	401,269,851,238	100.21
-	401,269,851,238	100.21

（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31年4月26日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	53,528,145,667	89.90
内 ケイマン諸島	9,402,025,247	15.79
内 韓国	6,897,225,548	11.58
内 台湾	6,185,259,265	10.39
内 中国	5,931,599,411	9.96
内 インド	4,853,514,933	8.15
内 ブラジル	3,785,558,904	6.36
内 南アフリカ	3,216,738,418	5.40
内 ロシア	2,005,211,148	3.37

内 香港	1,928,031,229	3.24
内 タイ	1,241,039,491	2.08
内 メキシコ	1,188,259,767	2.00
内 インドネシア	1,149,780,790	1.93
内 マレーシア	1,142,499,950	1.92
内 ポーランド	608,218,769	1.02
内 フィリピン	584,638,872	0.98
内 バミューダ	561,386,337	0.94
内 カタール	549,450,382	0.92
内 チリ	532,418,421	0.89
内 アラブ首長国連邦	426,421,590	0.72
内 トルコ	275,359,912	0.46
内 コロンビア	237,388,585	0.40
内 アメリカ	190,110,142	0.32
内 ハンガリー	168,751,738	0.28
内 ギリシャ	124,461,577	0.21
内 チェコ	83,942,467	0.14
内 エジプト	67,180,868	0.11
内 オランダ	41,552,096	0.07
内 マン島	30,906,080	0.05
内 ベルギー	29,358,388	0.05
内 ジャージー	26,145,624	0.04
内 ルクセンブルグ	25,416,820	0.04
内 パキスタン	19,826,911	0.03
内 シンガポール	18,465,987	0.03
新株予約権証券	222,507	0.00
内 タイ	222,507	0.00
投資信託受益証券	250,420,518	0.42
内 メキシコ	250,420,518	0.42
投資証券	77,214,705	0.13
内 メキシコ	47,302,661	0.08
内 南アフリカ	29,912,044	0.05
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	5,684,891,190	9.55
純資産総額	59,540,894,587	100.00

## その他資産の投資状況

平成31年4月26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）	500,930,420	0.84
-	500,930,420	0.84
株価指数先物取引（買建）	5,136,582,622	8.63
内 アメリカ	5,136,582,622	8.63

（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31年4月26日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	97,889,019,082	96.69
内 メキシコ	14,976,062,687	14.79
内 インドネシア	12,960,464,503	12.80
内 ロシア	11,142,871,469	11.01
内 ブラジル	10,735,514,218	10.60
内 コロンビア	9,199,242,165	9.09
内 フィリピン	8,993,066,373	8.88
内 ハンガリー	5,652,834,126	5.58
内 パナマ	5,449,530,082	5.38
内 南アフリカ	5,288,106,708	5.22
内 ペルー	4,797,858,654	4.74
内 ルーマニア	4,777,823,298	4.72
内 クロアチア	3,915,644,799	3.87
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	3,352,479,889	3.31
純資産総額	101,241,498,971	100.00

## その他資産の投資状況

平成31年4月26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）	290,524,000	0.29
-	290,524,000	0.29
為替予約取引（売建）	458,093,000	0.45
-	458,093,000	0.45

（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】

たわらノーロード バランス(堅実型)

平成31年4月26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	国内債券パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	61,191,636	1.2893 78,896,028	1.3101 80,167,162	- -	35.47%
2	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	55,200,089	1.3189 72,805,732	1.3521 74,636,040	- -	33.02%
3	外国株式パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	7,358,152	3.3964 24,991,649	3.7169 27,349,515	- -	12.10%
4	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	9,393,424	1.8179 17,077,021	1.9229 18,062,615	- -	7.99%
5	国内株式パッシブ・ファンド (最適化法)・マザーファン ド 日本	親投資信託受 益証券	3,565,719	2.5212 8,989,952	2.5266 9,009,145	- -	3.99%
6	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	3,657,516	1.8036 6,596,927	1.8395 6,728,000	- -	2.98%
7	J-REITインデックス ファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	2,192,984	1.9034 4,174,133	2.0510 4,497,810	- -	1.99%
8	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	1,737,888	1.2014 2,088,068	1.3149 2,285,148	- -	1.01%
9	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	1,848,211	1.0902 2,014,935	1.2012 2,220,071	- -	0.98%

(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31年4月26日現在

種類	投資比率
親投資信託受益証券	99.52%
合計	99.52%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

## たわらノーロード バランス(標準型)

平成31年4月26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	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	66,382,140	3.4006 225,739,627	3.7169 246,735,776	- -	26.64%
2	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	157,933,033	1.3198 208,451,896	1.3521 213,541,253	- -	23.05%
3	国内債券パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	116,747,008	1.2899 150,598,787	1.3101 152,950,255	- -	16.51%
4	J-REITインデックス ファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	45,143,132	1.9095 86,202,030	2.0510 92,588,563	- -	10.00%
5	国内株式パッシブ・ファンド (最適化法)・マザーファン ド 日本	親投資信託受 益証券	25,755,475	2.5248 65,027,701	2.5266 65,073,783	- -	7.02%
6	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	28,895,319	1.8211 52,623,754	1.9229 55,562,808	- -	6.00%
7	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	35,721,605	1.2033 42,985,587	1.3149 46,970,338	- -	5.07%
8	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	20,100,259	1.8045 36,271,298	1.8395 36,974,426	- -	3.99%
9	エマージング株式パッシブ・ マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	7,610,755	1.0921 8,311,769	1.2012 9,142,038	- -	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31年4月26日現在

種類	投資比率
親投資信託受益証券	99.26%
合計	99.26%

(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。

## たわらノーロード バランス(積極型)

平成31年4月26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	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	99,263,730	3.4121 338,702,823	3.7169 368,953,358	- -	40.08%
2	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	88,372,332	1.3163 116,328,628	1.3521 119,488,230	- -	12.98%
3	国内株式パッシブ・ファンド (最適化法)・マザーファン ド 日本	親投資信託受 益証券	47,224,346	2.5463 120,250,192	2.5266 119,317,032	- -	12.96%
4	J-REITインデックス ファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	58,099,390	1.8961 110,162,622	2.0510 119,161,848	- -	12.95%
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	85,132,217	1.1979 101,981,926	1.3149 111,940,352	- -	12.16%
6	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	14,341,085	1.8171 26,060,587	1.9229 27,576,472	- -	3.00%
7	国内債券パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	17,535,402	1.2875 22,577,186	1.3101 22,973,130	- -	2.50%
8	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	15,087,393	1.0849 16,369,421	1.2012 18,122,976	- -	1.97%
9	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	4,966,565	1.8024 8,952,053	1.8395 9,135,996	- -	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31年4月26日現在

種類	投資比率
親投資信託受益証券	99.59%
合計	99.59%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

(参考)

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

平成31年4月26日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	1,270,500	6,575.00 8,353,537,500	6,905.00 8,772,802,500	- -	3.23%
2	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	467,600	9,962.00 4,658,231,200	11,555.00 5,403,118,000	- -	1.99%
3	三菱UFJフィナンシャル・ グループ 日本	株式 銀行業	7,740,300	578.10 4,474,667,430	549.90 4,256,390,970	- -	1.57%
4	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	995,400	4,473.43 4,452,857,793	4,112.00 4,093,084,800	- -	1.51%
5	ソニー 日本	株式 電気機器	764,900	4,713.00 3,604,973,700	5,212.00 3,986,658,800	- -	1.47%
6	キーエンス 日本	株式 電気機器	56,000	62,260.00 3,486,560,000	69,120.00 3,870,720,000	- -	1.42%
7	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	765,100	4,636.00 3,547,003,600	4,616.00 3,531,701,600	- -	1.30%
8	三井住友フィナンシャルグ ループ 日本	株式 銀行業	792,500	3,928.00 3,112,940,000	4,021.00 3,186,642,500	- -	1.17%
9	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	961,700	3,002.00 2,887,023,400	3,101.00 2,982,231,700	- -	1.10%
10	みずほフィナンシャルグル ープ 日本	株式 銀行業	15,279,300	173.40 2,649,430,620	173.50 2,650,958,550	- -	0.97%
11	リクルートホールディングス 日本	株式 サービス業	780,500	2,916.00 2,275,938,000	3,329.00 2,598,284,500	- -	0.96%
12	K D D I 日本	株式 情報・通信業	985,900	2,658.50 2,621,015,150	2,540.50 2,504,678,950	- -	0.92%
13	任天堂 日本	株式 その他製品	65,200	29,315.00 1,911,338,000	38,000.00 2,477,600,000	- -	0.91%
14	東海旅客鉄道 日本	株式 陸運業	102,100	23,625.00 2,412,112,500	23,895.00 2,439,679,500	- -	0.90%
15	三菱商事 日本	株式 卸売業	787,900	3,156.00 2,486,612,400	3,056.00 2,407,822,400	- -	0.89%
16	花王 日本	株式 化学	276,800	8,049.00 2,227,963,200	8,557.00 2,368,577,600	- -	0.87%
17	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	402,000	5,341.00 2,147,082,000	5,602.00 2,252,004,000	- -	0.83%
18	ファナック 日本	株式 電気機器	108,300	18,795.00 2,035,498,500	20,775.00 2,249,932,500	- -	0.83%
19	ダイキン工業 日本	株式 機械	155,600	11,755.00 1,829,078,000	14,100.00 2,193,960,000	- -	0.81%
20	日本電産 日本	株式 電気機器	137,200	13,145.00 1,803,494,000	15,785.00 2,165,702,000	- -	0.80%
21	村田製作所 日本	株式 電気機器	358,800	5,796.66 2,079,844,074	5,960.00 2,138,448,000	- -	0.79%



22	東日本旅客鉄道 日本	株式 陸運業	202,700	10,160.00 2,059,432,000	10,465.00 2,121,255,500	- -	0.78%
23	信越化学工業 日本	株式 化学	196,800	9,244.00 1,819,219,200	10,430.00 2,052,624,000	- -	0.75%
24	資生堂 日本	株式 化学	226,600	7,200.00 1,631,520,000	8,718.00 1,975,498,800	- -	0.73%
25	キヤノン 日本	株式 電気機器	613,700	3,185.00 1,954,634,500	3,089.00 1,895,719,300	- -	0.70%
26	日立製作所 日本	株式 電気機器	513,300	3,503.00 1,798,089,900	3,689.00 1,893,563,700	- -	0.70%
27	セブン&アイ・ホールディングス 日本	株式 小売業	470,600	4,768.00 2,243,820,800	3,859.00 1,816,045,400	- -	0.67%
28	三菱電機 日本	株式 電気機器	1,140,000	1,390.50 1,585,170,000	1,582.00 1,803,480,000	- -	0.66%
29	HOYA 日本	株式 精密機器	229,600	6,590.00 1,513,064,000	7,815.00 1,794,324,000	- -	0.66%
30	第一三共 日本	株式 医薬品	326,200	3,604.00 1,175,624,800	5,481.00 1,787,902,200	- -	0.66%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

平成31年4月26日現在

種類	投資比率
株式	97.37%
合計	97.37%

(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。

## 投資株式の業種別投資比率

平成31年4月26日現在

業種	国内/外国	投資比率
電気機器	国内	13.28%
情報・通信業		8.32%
輸送用機器		7.83%
化学		7.30%
銀行業		5.88%
医薬品		5.39%
機械		5.10%
サービス業		4.91%
卸売業		4.81%
陸運業		4.54%
小売業		4.45%
食料品		4.06%
建設業		2.79%
不動産業		2.25%
保険業		2.15%
その他製品		2.07%
精密機器		2.02%
電気・ガス業		1.69%
その他金融業		1.07%
鉄鋼		0.94%
ガラス・土石製品		0.87%
ゴム製品		0.76%
証券、商品先物取引業		0.76%
非鉄金属		0.76%
繊維製品		0.63%
石油・石炭製品		0.60%
空運業		0.55%
金属製品		0.55%
パルプ・紙		0.28%
鉱業		0.28%
倉庫・運輸関連業		0.19%
海運業	0.17%	
水産・農林業	0.11%	
合計	97.37%	

(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。

## 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成31年4月26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	125回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	3,000,000,000	100.43 3,013,170,000	100.35 3,010,710,000	0.100000 2020/9/20	1.04%
2	350回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,850,000,000	101.50 2,892,978,000	101.78 2,900,986,500	0.100000 2028/3/20	1.00%
3	339回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,640,000,000	103.63 2,735,978,400	103.52 2,733,060,000	0.400000 2025/6/20	0.94%
4	345回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,610,000,000	101.90 2,659,668,300	101.88 2,659,276,800	0.100000 2026/12/20	0.92%
5	342回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,600,000,000	101.90 2,649,426,000	101.84 2,647,866,000	0.100000 2026/3/20	0.91%
6	341回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,510,000,000	103.21 2,590,771,800	103.11 2,588,136,300	0.300000 2025/12/20	0.89%
7	332回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,460,000,000	103.76 2,552,496,000	103.58 2,548,240,200	0.600000 2023/12/20	0.88%
8	343回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,500,000,000	101.93 2,548,275,000	101.87 2,546,800,000	0.100000 2026/6/20	0.88%
9	340回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,450,000,000	103.76 2,542,267,000	103.63 2,539,131,000	0.400000 2025/9/20	0.88%
10	126回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	2,500,000,000	100.50 2,512,700,000	100.42 2,510,550,000	0.100000 2020/12/20	0.87%
11	328回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,390,000,000	103.15 2,465,285,000	102.99 2,461,652,200	0.600000 2023/3/20	0.85%
12	346回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,370,000,000	101.88 2,414,556,000	101.90 2,415,243,300	0.100000 2027/3/20	0.83%
13	349回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,360,000,000	101.64 2,398,744,800	101.82 2,403,117,200	0.100000 2027/12/20	0.83%
14	351回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,360,000,000	101.40 2,393,205,200	101.74 2,401,229,200	0.100000 2028/6/20	0.83%
15	329回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,270,000,000	104.22 2,365,794,000	104.02 2,361,367,500	0.800000 2023/6/20	0.81%

16	347回 利付国庫債券(10年)	日本	国債証券	2,300,000,000	101.85 2,342,697,000	101.88 2,343,401,000	0.100000 2027/6/20	0.81%
17	335回 利付国庫債券(10年)	日本	国債証券	2,250,000,000	103.76 2,334,651,000	103.63 2,331,720,000	0.500000 2024/9/20	0.80%
18	352回 利付国庫債券(10年)	日本	国債証券	2,270,000,000	101.25 2,298,375,000	101.65 2,307,477,700	0.100000 2028/9/20	0.80%
19	344回 利付国庫債券(10年)	日本	国債証券	2,230,000,000	101.92 2,272,816,000	101.86 2,271,544,900	0.100000 2026/9/20	0.78%
20	348回 利付国庫債券(10年)	日本	国債証券	2,230,000,000	101.73 2,268,645,900	101.86 2,271,478,000	0.100000 2027/9/20	0.78%
21	312回 利付国庫債券(10年)	日本	国債証券	2,200,000,000	102.53 2,255,726,000	102.21 2,248,642,000	1.200000 2020/12/20	0.78%
22	128回 利付国庫債券(5年)	日本	国債証券	2,200,000,000	100.63 2,213,948,000	100.55 2,212,166,000	0.100000 2021/6/20	0.76%
23	334回 利付国庫債券(10年)	日本	国債証券	2,120,000,000	104.15 2,208,001,200	103.97 2,204,312,400	0.600000 2024/6/20	0.76%
24	333回 利付国庫債券(10年)	日本	国債証券	2,100,000,000	103.96 2,183,196,000	103.78 2,179,380,000	0.600000 2024/3/20	0.75%
25	325回 利付国庫債券(10年)	日本	国債証券	2,100,000,000	103.48 2,173,218,000	103.29 2,169,090,000	0.800000 2022/9/20	0.75%
26	129回 利付国庫債券(5年)	日本	国債証券	2,120,000,000	100.70 2,134,850,500	100.63 2,133,377,200	0.100000 2021/9/20	0.74%
27	338回 利付国庫債券(10年)	日本	国債証券	2,060,000,000	103.45 2,131,209,600	103.37 2,129,586,800	0.400000 2025/3/20	0.73%
28	135回 利付国庫債券(5年)	日本	国債証券	2,100,000,000	101.11 2,123,352,000	101.07 2,122,491,000	0.100000 2023/3/20	0.73%
29	131回 利付国庫債券(5年)	日本	国債証券	2,020,000,000	100.83 2,036,927,600	100.76 2,035,412,600	0.100000 2022/3/20	0.70%
30	132回 利付国庫債券(5年)	日本	国債証券	2,000,000,000	100.90 2,018,140,000	100.84 2,016,940,000	0.100000 2022/6/20	0.70%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 投資有価証券の種類別投資比率

平成31年4月26日現在

種類	投資比率
国債証券	80.23%
地方債証券	7.63%
特殊債券	6.22%
社債券	4.75%
合計	98.83%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

## J-REITインデックスファンド・マザーファンド

平成31年4月26日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	日本ビルファンド投資法人 日本	投資証券	3,354	658,801.67 2,209,620,811	717,000.00 2,404,818,000	- -	7.22%
2	ジャパンリアルエステイト投資法人 日本	投資証券	3,463	596,369.14 2,065,226,360	617,000.00 2,136,671,000	- -	6.41%
3	野村不動産マスターファンド投資法人 日本	投資証券	10,775	152,889.46 1,647,383,954	163,100.00 1,757,402,500	- -	5.27%
4	日本リテールファンド投資法人 日本	投資証券	6,545	208,984.08 1,367,800,812	213,000.00 1,394,085,000	- -	4.18%
5	ユナイテッド・アーバン投資法人 日本	投資証券	7,638	172,449.37 1,317,168,319	177,800.00 1,358,036,400	- -	4.08%
6	オリックス不動産投資法人 日本	投資証券	6,900	178,468.16 1,231,430,334	195,500.00 1,348,950,000	- -	4.05%
7	大和ハウスリート投資法人 日本	投資証券	4,646	255,112.62 1,185,253,259	255,500.00 1,187,053,000	- -	3.56%
8	日本プロロジスリート投資法人 日本	投資証券	4,645	231,087.10 1,073,399,606	239,000.00 1,110,155,000	- -	3.33%
9	アドバンス・レジデンス投資法人 日本	投資証券	3,375	295,552.76 997,490,596	310,500.00 1,047,937,500	- -	3.14%
10	GLP投資法人 日本	投資証券	8,581	116,755.86 1,001,882,109	119,800.00 1,028,003,800	- -	3.09%
11	ジャパン・ホテル・リート投資法人 日本	投資証券	11,147	82,141.42 915,630,493	90,700.00 1,011,032,900	- -	3.03%
12	日本プライムリアルティ投資法人 日本	投資証券	2,192	414,408.88 908,384,274	445,000.00 975,440,000	- -	2.93%

13	アクティビア・プロパティーズ投資法人 日本	投資証券	1,819	473,212.16 860,772,925	465,000.00 845,835,000	- -	2.54%
14	ケネディクス・オフィス投資法人 日本	投資証券	1,071	701,376.43 751,174,161	745,000.00 797,895,000	- -	2.39%
15	積水ハウス・リート投資法人 日本	投資証券	8,935	73,137.59 653,484,374	80,300.00 717,480,500	- -	2.15%
16	インヴィンシブル投資法人 日本	投資証券	11,947	48,921.39 584,463,918	56,300.00 672,616,100	- -	2.02%
17	日本アコモデーションファンド投資法人 日本	投資証券	1,151	520,544.04 599,146,195	569,000.00 654,919,000	- -	1.97%
18	大和証券オフィス投資法人 日本	投資証券	799	685,831.09 547,979,048	751,000.00 600,049,000	- -	1.80%
19	森ヒルズリート投資法人 日本	投資証券	3,972	140,562.26 558,313,309	148,300.00 589,047,600	- -	1.77%
20	フロンティア不動産投資法人 日本	投資証券	1,178	448,714.24 528,585,377	463,000.00 545,414,000	- -	1.64%
21	日本ロジスティクスファンド投資法人 日本	投資証券	2,263	225,411.38 510,105,958	238,100.00 538,820,300	- -	1.62%
22	産業ファンド投資法人 日本	投資証券	4,035	118,705.27 478,975,786	126,600.00 510,831,000	- -	1.53%
23	ヒューリックリート投資法人 日本	投資証券	2,799	170,125.76 476,182,026	182,500.00 510,817,500	- -	1.53%
24	ジャパンエクセレント投資法人 日本	投資証券	3,101	148,739.19 461,240,255	159,400.00 494,299,400	- -	1.48%
25	イオンリート投資法人 日本	投資証券	3,555	125,223.81 445,170,676	134,600.00 478,503,000	- -	1.44%
26	日本リート投資法人 日本	投資証券	1,118	357,886.35 400,116,947	415,500.00 464,529,000	- -	1.39%
27	プレミア投資法人 日本	投資証券	3,292	117,424.11 386,560,187	137,900.00 453,966,800	- -	1.36%
28	コンフォリア・レジデンシャル投資法人 日本	投資証券	1,436	272,951.05 391,957,715	294,300.00 422,614,800	- -	1.27%
29	森トラスト総合リート投資法人 日本	投資証券	2,475	163,471.43 404,591,799	167,900.00 415,552,500	- -	1.25%
30	東急リアル・エステート投資法人 日本	投資証券	2,322	157,109.63 364,808,564	175,000.00 406,350,000	- -	1.22%

(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31年4月26日現在

種類	投資比率
投資証券	97.45%
合計	97.45%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

## 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成31年4月26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	412,475	19,103.97 7,879,914,150	22,960.56 9,470,660,285	- -	2.55%
2	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフトウェア	633,637	11,962.10 7,579,635,206	14,445.42 9,153,157,344	- -	2.46%
3	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 インターネット販売・通信販売	36,117	181,515.18 6,555,783,965	212,766.66 7,684,493,549	- -	2.07%
4	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	208,740	18,336.50 3,827,562,731	21,616.13 4,512,151,184	- -	1.21%
5	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	27,525	125,457.77 3,453,225,190	141,316.88 3,889,747,190	- -	1.05%
6	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	288,360	11,455.67 3,303,359,019	12,707.27 3,664,270,828	- -	0.99%
7	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	25,795	126,298.20 3,257,862,263	141,751.97 3,656,492,298	- -	0.98%
8	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	232,816	15,024.98 3,498,057,909	15,619.85 3,636,551,579	- -	0.98%
9	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 石油・ガス・消耗燃料	367,491	8,533.09 3,135,836,124	9,196.30 3,379,560,055	- -	0.91%
10	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	265,023	9,651.36 2,557,832,503	10,657.75 2,824,549,090	- -	0.76%
11	VISA INC アメリカ	株式 情報技術サービス	152,457	16,012.44 2,441,209,479	18,010.08 2,745,763,833	- -	0.74%
12	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 銀行	808,577	3,175.42 2,567,572,790	3,364.44 2,720,415,270	- -	0.73%
13	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 各種金融サービス	113,163	22,680.94 2,566,643,552	23,706.60 2,682,710,824	- -	0.72%
14	INTEL CORP アメリカ	株式 半導体・半導体製造装置	396,284	5,683.09 2,252,121,005	6,443.67 2,553,526,690	- -	0.69%



15	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品	216,494	11,012.86 2,384,218,181	11,551.86 2,500,910,110	- -	0.67%
16	CISCO SYSTEMS INC アメリカ	株式 通信機器	389,909	5,413.53 2,110,787,967	6,300.51 2,456,625,748	- -	0.66%
17	THE WALT DISNEY CO アメリカ	株式 娯楽	155,657	12,426.22 1,934,229,165	15,350.29 2,389,380,713	- -	0.64%
18	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 専門小売り	97,969	20,995.36 2,056,894,766	23,097.02 2,262,792,442	- -	0.61%
19	VERIZON COMM INC アメリカ	株式 各種電気通信 サービス	358,767	6,046.04 2,169,122,003	6,246.82 2,241,153,767	- -	0.60%
20	PFIZER INC アメリカ	株式 医薬品	500,973	4,694.34 2,351,739,847	4,430.37 2,219,500,008	- -	0.60%
21	MASTERCARD INC アメリカ	株式 情報技術サー ビス	79,593	24,585.74 1,956,853,480	27,471.47 2,186,537,388	- -	0.59%
22	CHEVRON CORP アメリカ	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	165,788	13,219.14 2,191,575,674	13,187.11 2,186,265,421	- -	0.59%
23	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	83,204	29,658.98 2,467,745,816	25,813.86 2,147,816,532	- -	0.58%
24	AT&T INC アメリカ	株式 各種電気通信 サービス	631,496	3,333.64 2,105,180,670	3,393.52 2,142,999,989	- -	0.58%
25	WELLS FARGO & CO アメリカ	株式 銀行	388,191	5,426.96 2,106,697,805	5,313.99 2,062,844,450	- -	0.56%
26	BOEING CO アメリカ	株式 航空宇宙・防 衛	46,850	45,838.36 2,147,527,493	42,816.18 2,005,938,033	- -	0.54%
27	MERCK & CO. INC. アメリカ	株式 医薬品	225,419	8,829.43 1,990,323,309	8,538.62 1,924,769,210	- -	0.52%
28	COMCAST CORP-CL A アメリカ	株式 メディア	392,285	4,169.31 1,635,558,047	4,801.72 1,883,642,926	- -	0.51%
29	COCA-COLA CO/THE アメリカ	株式 飲料	349,868	5,098.91 1,783,947,918	5,350.90 1,872,110,080	- -	0.50%
30	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN スイス	株式 医薬品	61,398	29,663.30 1,821,267,661	28,983.90 1,779,554,106	- -	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31年4月26日現在

種類	投資比率
株式	96.02%
投資信託受益証券	0.22%
投資証券	2.31%
合計	98.55%

（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

平成31年4月26日現在

業種	国内/外国	投資比率
銀行	外国	8.04%
石油・ガス・消耗燃料		5.95%
医薬品		5.24%
ソフトウェア		5.21%
情報技術サービス		3.90%
保険		3.83%
インタラクティブ・メディアおよびサービス		3.42%
半導体・半導体製造装置		3.17%
コンピュータ・周辺機器		2.86%
資本市場		2.78%
インターネット販売・通信販売		2.56%
ヘルスケア機器・用品		2.52%
化学		2.30%
航空宇宙・防衛		2.27%
各種電気通信サービス		1.98%
飲料		1.97%
電力		1.91%
食品		1.89%
ホテル・レストラン・レジャー		1.88%
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス		1.79%
バイオテクノロジー		1.75%
専門小売り		1.72%
機械		1.56%
繊維・アパレル・贅沢品		1.45%
食品・生活必需品小売り		1.44%
娯楽		1.43%
金属・鉱業		1.40%
コングロマリット		1.36%
家庭用品		1.29%
メディア		1.28%
陸運・鉄道		1.11%
総合公益事業		1.06%
通信機器		0.99%
各種金融サービス		0.98%
タバコ		0.93%
自動車		0.85%
電気設備		0.74%
専門サービス		0.73%

パーソナル用品	0.72%
ライフサイエンス・ツール/サービス	0.72%
不動産管理・開発	0.57%
航空貨物・物流サービス	0.51%
電子装置・機器・部品	0.50%
複合小売り	0.48%
消費者金融	0.48%
商業サービス・用品	0.45%
建設関連製品	0.39%
家庭用耐久財	0.38%
エネルギー設備・サービス	0.37%
自動車部品	0.34%
建設・土木	0.33%
商社・流通業	0.30%
建設資材	0.28%
無線通信サービス	0.28%
容器・包装	0.27%
運送インフラ	0.21%
ガス	0.17%
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.11%
旅客航空輸送業	0.10%
ヘルスケア・テクノロジー	0.10%
紙製品・林産品	0.09%
水道	0.08%
販売	0.07%
レジャー用品	0.06%
海運業	0.06%
各種消費者サービス	0.01%
合計	96.02%

(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。

## 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成31年4月26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 2.625 08/15/20 アメリカ	国債証券	1,845,525,000	100.12 1,847,758,085	100.26 1,850,489,462	2.625000 2020/8/15	0.96%
2	US T N/B 3.5 05/15/20 アメリカ	国債証券	1,565,900,000	101.14 1,583,751,260	101.12 1,583,453,739	3.500000 2020/5/15	0.82%
3	US T N/B 2.0 05/31/21 アメリカ	国債証券	1,342,200,000	98.92 1,327,771,350	99.35 1,333,542,810	2.000000 2021/5/31	0.69%
4	US T N/B 1.375 04/30/20 アメリカ	国債証券	1,342,200,000	98.67 1,324,362,162	98.96 1,328,241,120	1.375000 2020/4/30	0.69%
5	US T N/B 1.375 04/30/21 アメリカ	国債証券	1,253,838,500	97.62 1,224,097,450	98.11 1,230,228,721	1.375000 2021/4/30	0.64%
6	US T N/B 2.0 02/15/22 アメリカ	国債証券	1,235,942,500	98.65 1,219,331,432	99.21 1,226,227,991	2.000000 2022/2/15	0.63%
7	US T N/B 2.125 08/15/21 アメリカ	国債証券	1,230,350,000	99.14 1,219,867,418	99.58 1,225,293,261	2.125000 2021/8/15	0.63%
8	US T N/B 1.875 06/30/20 アメリカ	国債証券	1,230,350,000	99.11 1,219,486,009	99.39 1,222,844,865	1.875000 2020/6/30	0.63%
9	US T N/B 2.0 11/15/21 アメリカ	国債証券	1,163,240,000	98.77 1,149,013,574	99.27 1,154,783,245	2.000000 2021/11/15	0.60%
10	US T N/B 2.125 12/31/21 アメリカ	国債証券	1,155,410,500	99.04 1,144,387,883	99.55 1,150,257,369	2.125000 2021/12/31	0.60%
11	US T N/B 2.125 09/30/21 アメリカ	国債証券	1,118,500,000	99.11 1,108,623,645	99.57 1,113,690,450	2.125000 2021/9/30	0.58%
12	US T N/B 2.5 01/31/21 アメリカ	国債証券	1,097,248,500	99.96 1,096,824,161	100.23 1,099,859,951	2.500000 2021/1/31	0.57%
13	US T N/B 2.25 03/31/21 アメリカ	国債証券	1,091,656,000	99.49 1,086,110,387	99.83 1,089,822,017	2.250000 2021/3/31	0.56%
14	US T N/B 2.75 11/15/23 アメリカ	国債証券	1,048,034,500	101.18 1,060,474,669	101.82 1,067,192,570	2.750000 2023/11/15	0.55%
15	US T N/B 2.125 06/30/22 アメリカ	国債証券	1,062,575,000	98.88 1,050,695,411	99.44 1,056,677,708	2.125000 2022/6/30	0.55%
16	US T N/B 2.0 02/15/23 アメリカ	国債証券	1,062,575,000	98.20 1,043,480,527	98.88 1,050,695,411	2.000000 2023/2/15	0.54%
17	US T N/B 2.0 02/15/25 アメリカ	国債証券	1,062,575,000	97.05 1,031,271,540	97.93 1,040,654,077	2.000000 2025/2/15	0.54%
18	US T N/B 1.625 08/15/22 アメリカ	国債証券	1,062,575,000	97.17 1,032,514,753	97.85 1,039,740,263	1.625000 2022/8/15	0.54%
19	US T N/B 2.625 08/31/20 アメリカ	国債証券	1,034,612,500	100.13 1,036,019,573	100.33 1,038,047,413	2.625000 2020/8/31	0.54%
20	US T N/B 1.625 11/15/22 アメリカ	国債証券	1,053,627,000	96.97 1,021,723,174	97.70 1,029,425,187	1.625000 2022/11/15	0.53%
21	US T N/B 2.5 05/15/24 アメリカ	国債証券	1,006,650,000	100.03 1,006,962,061	100.79 1,014,662,934	2.500000 2024/5/15	0.52%
22	US T N/B 2.375 08/15/24 アメリカ	国債証券	995,465,000	99.31 988,616,200	100.12 996,709,331	2.375000 2024/8/15	0.52%
23	US T N/B 1.75 12/31/20 アメリカ	国債証券	1,006,650,000	98.63 992,879,028	99.00 996,583,500	1.750000 2020/12/31	0.52%

24	US T N/B 1.75 05/15/22 アメリカ	国債証券	1,006,650,000	97.76 984,151,372	98.37 990,291,937	1.750000 2022/5/15	0.51%
25	US T N/B 2.125 05/15/25 アメリカ	国債証券	998,820,500	97.58 974,698,984	98.45 983,438,664	2.125000 2025/5/15	0.51%
26	US T N/B 1.75 03/31/22 アメリカ	国債証券	989,872,500	97.87 968,837,709	98.46 974,707,653	1.750000 2022/3/31	0.50%
27	US T N/B 1.75 09/30/22 アメリカ	国債証券	977,569,000	97.50 953,198,204	98.17 959,767,468	1.750000 2022/9/30	0.50%
28	US T N/B 2.25 11/15/24 アメリカ	国債証券	960,791,500	98.56 946,975,318	99.35 954,555,963	2.250000 2024/11/15	0.49%
29	US T N/B 1.625 11/30/20 アメリカ	国債証券	951,843,500	98.44 937,042,333	98.85 940,906,818	1.625000 2020/11/30	0.49%
30	US T N/B 1.75 01/31/23 アメリカ	国債証券	958,554,500	97.25 932,261,350	97.99 939,306,725	1.750000 2023/1/31	0.49%

(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31年4月26日現在

種類	投資比率
国債証券	97.36%
合計	97.36%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

## 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成31年4月26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	119,388	19,631.43 2,343,758,115	19,892.52 2,374,928,476	- -	4.57%
2	PROLOGIS INC アメリカ	投資証券	243,599	7,231.93 1,761,692,552	8,440.20 2,056,024,523	- -	3.95%
3	PUBLIC STORAGE アメリカ	投資証券	57,927	23,690.32 1,372,309,707	24,247.96 1,404,611,665	- -	2.70%
4	WELLTOWER INC アメリカ	投資証券	149,157	7,426.10 1,107,654,909	8,248.93 1,230,386,770	- -	2.37%
5	EQUITY RESIDENTIAL アメリカ	投資証券	142,817	7,399.76 1,056,811,879	8,497.24 1,213,550,967	- -	2.33%
6	AVALONBAY COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	53,412	19,817.10 1,058,471,053	22,364.40 1,194,527,733	- -	2.30%
7	DIGITAL REALTY TRUST INC アメリカ	投資証券	80,150	12,223.73 979,732,179	13,400.74 1,074,069,992	- -	2.07%
8	LINK REIT 香港	投資証券	815,020	1,073.02 874,534,305	1,302.65 1,061,686,618	- -	2.04%
9	UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD オランダ	投資証券	53,083	20,708.28 1,099,258,137	19,322.43 1,025,692,710	- -	1.97%
10	REALTY INCOME CORP アメリカ	投資証券	117,186	6,697.72 784,880,126	7,838.44 918,556,367	- -	1.77%
11	VENTAS INC アメリカ	投資証券	137,395	6,499.62 893,015,387	6,652.83 914,066,677	- -	1.76%
12	BOSTON PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	59,602	13,752.37 819,669,122	15,199.29 905,908,469	- -	1.74%
13	ESSEX PROPERTY TRUST INC アメリカ	投資証券	25,346	27,532.09 697,828,490	31,132.32 789,080,010	- -	1.52%
14	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT アメリカ	投資証券	43,505	13,986.71 608,492,157	15,924.08 692,777,296	- -	1.33%
15	GOODMAN GROUP オーストラリア	投資信託受益 証券	619,321	828.79 513,292,704	1,038.14 642,947,105	- -	1.24%
16	SCENTRE GROUP オーストラリア	投資信託受益 証券	2,054,975	326.09 670,109,740	308.93 634,854,523	- -	1.22%
17	HCP INC アメリカ	投資証券	184,423	3,045.19 561,604,554	3,346.55 617,181,159	- -	1.19%
18	HOST HOTELS & RESORTS INC アメリカ	投資証券	285,835	2,198.66 628,455,393	2,113.96 604,245,185	- -	1.16%
19	WP CAREY INC アメリカ	投資証券	65,753	7,666.41 504,089,869	8,739.95 574,678,524	- -	1.11%
20	EXTRA SPACE STORAGE INC アメリカ	投資証券	49,150	10,602.44 521,110,342	11,413.17 560,957,502	- -	1.08%
21	UDR INC アメリカ	投資証券	106,424	4,398.44 468,099,728	4,998.57 531,968,505	- -	1.02%
22	MID AMERICA アメリカ	投資証券	43,978	11,079.52 487,255,385	12,078.68 531,196,255	- -	1.02%

23	VORNADO REALTY TRUST アメリカ	投資証券	67,128	7,823.73 525,191,860	7,752.32 520,397,971	- -	1.00%
24	REGENCY CENTERS CORP アメリカ	投資証券	64,866	6,956.83 451,262,047	7,540.92 489,149,770	- -	0.94%
25	DUKE REALTY TRUST アメリカ	投資証券	139,122	3,156.53 439,142,977	3,447.21 479,583,723	- -	0.92%
26	SUN COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	33,457	11,316.72 378,623,700	13,672.54 457,442,304	- -	0.88%
27	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES アメリカ	投資証券	34,829	10,750.94 374,444,744	12,963.41 451,502,781	- -	0.87%
28	FEDERAL REALTY INVS TRUST アメリカ	投資証券	28,733	14,040.42 403,423,575	14,956.58 429,747,470	- -	0.83%
29	SEGRO PLC イギリス	投資証券	419,541	926.85 388,851,802	986.91 414,053,134	- -	0.80%
30	CAMDEN PROPERTY TRUST アメリカ	投資証券	37,107	10,254.46 380,512,349	11,150.32 413,755,165	- -	0.80%

(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31年4月26日現在

種類	投資比率
投資信託受益証券	10.35%
投資証券	89.25%
合計	99.61%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

## 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31年4月26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 2.75 07/31/23 アメリカ	国債証券	3,356,618,500	101.37 3,402,623,625	101.74 3,415,359,323	2.750000 2023/7/31	0.85%
2	US T N/B 2.0 02/15/25 アメリカ	国債証券	2,962,906,500	97.46 2,887,927,948	97.93 2,901,781,738	2.000000 2025/2/15	0.72%
3	US T N/B 2.5 02/28/21 アメリカ	国債証券	2,644,134,000	100.17 2,648,869,300	100.26 2,651,246,720	2.500000 2021/2/28	0.66%
4	US T N/B 1.25 03/31/21 アメリカ	国債証券	2,662,030,000	98.16 2,613,226,338	97.97 2,608,150,512	1.250000 2021/3/31	0.65%
5	US T N/B 1.875 10/31/22 アメリカ	国債証券	2,499,847,500	99.00 2,474,880,773	98.54 2,463,499,717	1.875000 2022/10/31	0.62%
6	US T N/B 2.75 02/15/28 アメリカ	国債証券	2,396,945,500	100.69 2,413,684,815	101.92 2,442,990,823	2.750000 2028/2/15	0.61%
7	US T N/B 1.5 08/15/26 アメリカ	国債証券	2,351,087,000	91.83 2,159,185,914	93.71 2,203,391,714	1.500000 2026/8/15	0.55%
8	US T N/B 1.625 07/31/20 アメリカ	国債証券	2,153,112,500	97.92 2,108,536,342	99.03 2,132,421,088	1.625000 2020/7/31	0.53%
9	US T N/B 2.75 09/30/20 アメリカ	国債証券	2,109,491,000	99.89 2,107,254,939	100.51 2,120,270,499	2.750000 2020/9/30	0.53%
10	FRANCE OAT 2.75 10/25/27 フランス	国債証券	1,697,787,000	119.41 2,027,386,242	122.11 2,073,184,683	2.750000 2027/10/25	0.52%
11	US T N/B 2.5 01/31/21 アメリカ	国債証券	2,007,707,500	99.96 2,006,931,059	100.23 2,012,485,843	2.500000 2021/1/31	0.50%
12	FRANCE OAT 2.5 05/25/30 フランス	国債証券	1,639,328,400	120.48 1,975,069,276	122.02 2,000,456,053	2.500000 2030/5/25	0.50%
13	FRANCE OAT 5.75 10/25/32 フランス	国債証券	1,195,291,800	166.60 1,991,403,707	166.59 1,991,356,138	5.750000 2032/10/25	0.50%
14	US T N/B 2.5 02/15/22 アメリカ	国債証券	1,893,620,500	100.04 1,894,555,039	100.54 1,903,883,923	2.500000 2022/2/15	0.48%
15	US T N/B 2.875 10/31/20 アメリカ	国債証券	1,881,317,000	100.07 1,882,746,800	100.74 1,895,351,624	2.875000 2020/10/31	0.47%
16	US T N/B 2.625 02/15/29 アメリカ	国債証券	1,806,377,500	100.19 1,809,861,026	100.80 1,820,900,775	2.625000 2029/2/15	0.45%
17	US T N/B 2.375 03/15/22 アメリカ	国債証券	1,691,172,000	100.08 1,692,614,484	100.25 1,695,450,665	2.375000 2022/3/15	0.42%
18	US T N/B 3.125 11/15/28 アメリカ	国債証券	1,584,914,500	103.84 1,645,798,630	105.03 1,664,778,341	3.125000 2028/11/15	0.42%
19	US T N/B 1.625 05/15/26 アメリカ	国債証券	1,756,045,000	92.15 1,618,207,788	94.77 1,664,256,527	1.625000 2026/5/15	0.42%
20	FRANCE OAT 4.25 10/25/23 フランス	国債証券	1,366,936,200	122.61 1,676,035,551	120.80 1,651,395,623	4.250000 2023/10/25	0.41%
21	SPAIN 1.45 10/31/27 スペイン	国債証券	1,569,675,600	104.15 1,634,864,352	104.98 1,648,002,412	1.450000 2027/10/31	0.41%
22	US T N/B 2.0 12/31/21 アメリカ	国債証券	1,646,432,000	97.07 1,598,323,174	99.26 1,634,330,724	2.000000 2021/12/31	0.41%
23	US T N/B 2.5 01/15/22 アメリカ	国債証券	1,601,692,000	100.17 1,604,535,307	100.51 1,609,876,646	2.500000 2022/1/15	0.40%



24	US T N/B 2.5 12/31/20 アメリカ	国債証券	1,605,047,500	100.06 1,606,097,698	100.21 1,608,482,301	2.500000 2020/12/31	0.40%
25	FRANCE OAT 4.5 04/25/41 フランス	国債証券	962,701,200	159.80 1,538,430,447	166.88 1,606,575,016	4.500000 2041/4/25	0.40%
26	US T N/B 2.875 05/15/28 アメリカ	国債証券	1,522,278,500	99.99 1,522,143,781	102.91 1,566,637,695	2.875000 2028/5/15	0.39%
27	US T N/B 2.0 02/15/23 アメリカ	国債証券	1,565,900,000	96.70 1,514,272,277	98.88 1,548,393,238	2.000000 2023/2/15	0.39%
28	ITALY BTPS 1.45 05/15/25 イタリア	国債証券	1,574,650,800	97.33 1,532,689,407	97.12 1,529,379,589	1.450000 2025/5/15	0.38%
29	US T N/B 2.875 08/15/28 アメリカ	国債証券	1,476,420,000	99.14 1,463,743,552	102.91 1,519,442,878	2.875000 2028/8/15	0.38%
30	US T N/B 1.125 07/31/21 アメリカ	国債証券	1,554,715,000	95.43 1,483,773,354	97.39 1,514,261,315	1.125000 2021/7/31	0.38%

(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。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

平成31年4月26日現在

種類	投資比率
国債証券	97.83%
合計	97.83%

(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31年4月26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	508,600	5,641.25 2,869,142,801	5,458.72 2,776,309,060	- -	4.66%
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	115,334	20,977.46 2,419,415,236	21,014.37 2,423,672,272	- -	4.07%
3	TAIWAN SEMICONDUCTOR 台湾	株式 半導体・半導 体製造装置	2,193,083	944.01 2,070,303,248	965.67 2,117,805,426	- -	3.56%
4	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD 韓国	株式 コンピュー タ・周辺機器	425,222	4,545.02 1,932,646,746	4,313.18 1,834,063,278	- -	3.08%
5	NASPERS LTD 南アフリカ	株式 インターネッ ト販売・通信 販売	39,023	27,983.06 1,091,983,098	28,325.73 1,105,355,145	- -	1.86%
6	CHINA CONSTRUCTION BANK 中国	株式 銀行	8,568,530	102.10 874,860,622	98.53 844,313,813	- -	1.42%
7	PING AN INSURANCE GROUP CO-H 中国	株式 保険	464,000	1,346.85 624,941,648	1,314.05 609,723,376	- -	1.02%
8	CHINA MOBILE LIMITED 香港	株式 無線通信サー ビス	547,000	1,083.76 592,816,720	1,057.37 578,386,313	- -	0.97%
9	RELIANCE INDUSTRIES LTD インド	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	253,290	2,163.43 547,977,084	2,209.56 559,660,465	- -	0.94%
10	IND & COMM BK OF CHINA - H 中国	株式 銀行	6,184,235	86.41 534,414,378	83.56 516,776,939	- -	0.87%
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	24,629	19,051.41 469,217,189	18,782.97 462,605,780	- -	0.78%
12	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP インド	株式 貯蓄・抵当・ 不動産金融	144,973	3,262.98 473,045,014	3,147.79 456,344,777	- -	0.77%
13	LUKOIL SPON ADR ロシア	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	43,770	9,715.29 425,238,287	9,786.87 428,371,518	- -	0.72%

14	ITAU UNIBANCO HOLDING SA ブラジル	株式 銀行	432,347	915.01 395,605,071	952.58 411,849,428	- -	0.69%
15	SK HYNIX INC 韓国	株式 半導体・半導 体製造装置	51,790	7,747.31 401,233,702	7,747.31 401,233,702	- -	0.67%
16	VALE SA ブラジル	株式 金属・鉱業	280,921	1,476.06 414,656,953	1,421.82 399,419,798	- -	0.67%
17	SBERBANK ADR ロシア	株式 銀行	242,421	1,666.56 404,010,353	1,616.23 391,808,698	- -	0.66%
18	BANK OF CHINA LTD 中国	株式 銀行	7,073,200	54.47 385,299,838	53.04 375,213,455	- -	0.63%
19	HON HAI PRECISION INDUSTRY 台湾	株式 電子装置・機 器・部品	1,171,225	331.39 388,141,622	313.34 367,001,011	- -	0.62%
20	BANCO BRADESCO SA PREF ブラジル	株式 銀行	359,050	969.51 348,105,120	1,018.97 365,863,871	- -	0.61%
21	INFOSYS LTD インド	株式 情報技術サー ビス	310,730	1,165.80 362,249,344	1,172.96 364,475,569	- -	0.61%
22	CNOOC LTD 香港	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	1,585,000	211.61 335,415,164	209.05 331,346,786	- -	0.56%
23	TATA CONSULTANCY SERVICES LTD インド	株式 情報技術サー ビス	80,017	3,432.19 274,634,187	3,533.94 282,776,077	- -	0.47%
24	PETROLEO BRASILEIRO SA ブラジル	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	348,312	755.68 263,215,024	785.34 273,546,829	- -	0.46%
25	GAZPROM PAO ADR ロシア	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	485,843	566.40 275,185,556	544.37 264,480,272	- -	0.44%
26	AMERICA MOVIL SAB DE CV メキシコ	株式 無線通信サー ビス	2,994,678	87.52 262,099,309	86.93 260,341,433	- -	0.44%
27	QATAR NATIONAL BANK カタール	株式 銀行	42,998	5,543.41 238,355,861	6,054.63 260,337,071	- -	0.44%
28	SAMSUNG ELECTRONICS-PFD 韓国	株式 コンピュー タ・周辺機器	73,243	3,665.96 268,506,640	3,477.59 254,709,856	- -	0.43%
29	PETROLEO BRASILEIRO SA ブラジル	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	263,110	852.58 224,323,639	866.14 227,891,410	- -	0.38%
30	AMBEV SA ブラジル	株式 飲料	417,895	481.66 201,284,350	517.25 216,159,322	- -	0.36%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 投資有価証券の種類別投資比率

平成31年4月26日現在

種類	投資比率
株式	89.90%
新株予約権証券	0.00%
投資信託受益証券	0.42%
投資証券	0.13%
合計	90.45%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 投資株式の業種別投資比率

平成31年4月26日現在

業種	国内/外国	投資比率
銀行	外国	15.19%
石油・ガス・消耗燃料		7.12%
インターネット販売・通信販売		6.84%
インタラクティブ・メディアおよびサービス		6.28%
半導体・半導体製造装置		5.14%
コンピュータ・周辺機器		4.38%
保険		3.58%
金属・鉱業		2.97%
無線通信サービス		2.56%
不動産管理・開発		2.49%
電子装置・機器・部品		2.08%
化学		2.06%
自動車		1.72%
情報技術サービス		1.67%
食品		1.53%
食品・生活必需品小売り		1.52%
各種電気通信サービス		1.37%
コングロマリット		1.25%
資本市場		1.23%
医薬品		1.18%
建設資材		0.91%
貯蓄・抵当・不動産金融		0.85%
電力		0.85%
運送インフラ		0.85%
各種金融サービス		0.84%
飲料		0.82%
娯楽		0.73%
繊維・アパレル・贅沢品		0.71%
ホテル・レストラン・レジャー		0.68%
パーソナル用品		0.67%
建設・土木		0.67%
機械		0.63%
ガス		0.56%
独立系発電事業者・エネルギー販売業者		0.53%
タバコ		0.53%
自動車部品		0.52%
複合小売り		0.51%

各種消費者サービス	0.49%
バイオテクノロジー	0.45%
専門小売り	0.42%
家庭用品	0.40%
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	0.38%
紙製品・林産品	0.34%
家庭用耐久財	0.32%
メディア	0.31%
旅客航空輸送業	0.26%
陸運・鉄道	0.26%
消費者金融	0.24%
水道	0.24%
ライフサイエンス・ツール/サービス	0.23%
エクイティ不動産投資信託(REITs)	0.17%
航空貨物・物流サービス	0.16%
電気設備	0.16%
航空宇宙・防衛	0.15%
商業サービス・用品	0.13%
ソフトウェア	0.10%
海運業	0.09%
ヘルスケア機器・用品	0.09%
エネルギー設備・サービス	0.08%
レジャー用品	0.08%
ヘルスケア・テクノロジー	0.07%
通信機器	0.06%
総合公益事業	0.06%
容器・包装	0.05%
商社・流通業	0.04%
専門サービス	0.04%
建設関連製品	0.03%
合計	89.90%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## エマージング債券パッシブ・マザーファンド

平成31年4月26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	2,796,250,000	101.94 2,850,497,250	102.14 2,856,089,750	5.250000 2047/6/23	2.82%
2	COLOMBIA 5.0 06/15/45 コロンビア	国債証券	1,789,600,000	103.75 1,856,710,000	104.00 1,861,184,000	5.000000 2045/6/15	1.84%
3	PERU 5.625 11/18/50 ペルー	国債証券	1,342,200,000	128.01 1,718,244,174	127.84 1,715,908,746	5.625000 2050/11/18	1.69%
4	HUNGARY 6.375 03/29/21 ハンガリー	国債証券	1,454,050,000	106.44 1,547,792,603	106.46 1,547,981,630	6.375000 2021/3/29	1.53%
5	UNITED MEXICAN STATES 4.75 03/08/44 メキシコ	国債証券	1,498,790,000	97.25 1,457,573,275	98.00 1,468,814,200	4.750000 2044/3/8	1.45%
6	RUSSIAN FEDERATION 03/31/30 ロシア	国債証券	1,291,867,500	111.49 1,440,432,262	111.49 1,440,432,262	7.500000 2030/3/31	1.42%
7	PERU 7.35 07/21/25 ペルー	国債証券	1,152,055,000	124.18 1,430,621,899	124.04 1,429,124,227	7.350000 2025/7/21	1.41%
8	ROMANIA 6.75 02/07/22 ルーマニア	国債証券	1,286,275,000	109.18 1,404,380,770	109.28 1,405,667,045	6.750000 2022/2/7	1.39%
9	RUSSIAN FEDERATION 5.625 04/04/42 ロシア	国債証券	1,207,980,000	109.60 1,324,018,558	109.92 1,327,835,775	5.625000 2042/4/4	1.31%
10	BRAZIL 4.875 01/22/21 ブラジル	国債証券	1,275,090,000	103.30 1,317,167,970	103.05 1,313,980,245	4.875000 2021/1/22	1.30%
11	UNITED MEXICAN STATES 5.55 01/21/45 メキシコ	国債証券	1,163,240,000	108.77 1,265,325,942	109.27 1,271,130,510	5.550000 2045/1/21	1.26%
12	UNITED MEXICAN STATES 6.05 01/11/40 メキシコ	国債証券	1,107,315,000	113.50 1,256,813,598	114.37 1,266,491,531	6.050000 2040/1/11	1.25%
13	BRAZIL 4.25 01/07/25 ブラジル	国債証券	1,241,535,000	100.87 1,252,398,431	101.22 1,256,756,219	4.250000 2025/1/7	1.24%
14	RUSSIAN FEDERATION 4.875 09/16/23 ロシア	国債証券	1,163,240,000	105.24 1,224,205,408	105.36 1,225,636,193	4.875000 2023/9/16	1.21%
15	CROATIA 6.625 07/14/20 クロアチア	国債証券	1,174,425,000	104.18 1,223,586,430	104.15 1,223,210,614	6.625000 2020/7/14	1.21%
16	UNITED MEXICAN STATES 4.0 10/02/23 メキシコ	国債証券	1,174,425,000	102.87 1,208,154,486	102.92 1,208,800,419	4.000000 2023/10/2	1.19%
17	UNITED MEXICAN STATES 4.15 03/28/27 メキシコ	国債証券	1,163,240,000	101.00 1,174,872,400	101.25 1,177,780,500	4.150000 2027/3/28	1.16%
18	INDONESIA 4.875 05/05/21 インドネシア	国債証券	1,129,685,000	103.51 1,169,438,615	103.64 1,170,839,424	4.875000 2021/5/5	1.16%

19	ROMANIA 4.375 08/22/23 ルーマニア	国債証券	1,118,500,000	103.60 1,158,766,000	103.70 1,159,884,500	4.375000 2023/8/22	1.15%
20	HUNGARY 5.375 02/21/23 ハンガリー	国債証券	1,073,760,000	107.68 1,156,267,718	107.80 1,157,588,443	5.375000 2023/2/21	1.14%
21	PANAMA 6.7 01/26/36 パナマ	国債証券	883,615,000	129.10 1,140,835,326	129.26 1,142,249,110	6.700000 2036/1/26	1.13%
22	RUSSIAN FEDERATION 4.5 04/04/22 ロシア	国債証券	1,096,130,000	103.18 1,130,986,934	103.26 1,131,929,605	4.500000 2022/4/4	1.12%
23	INDONESIA 4.125 01/15/25 インドネシア	国債証券	1,096,130,000	102.49 1,123,467,482	103.00 1,129,013,900	4.125000 2025/1/15	1.12%
24	COLOMBIA 5.625 02/26/44 コロンビア	国債証券	1,006,650,000	111.43 1,121,780,560	111.56 1,123,089,205	5.625000 2044/2/26	1.11%
25	BRAZIL 4.625 01/13/28 ブラジル	国債証券	1,096,130,000	100.02 1,096,414,993	100.37 1,100,240,487	4.625000 2028/1/13	1.09%
26	PHILIPPINES 9.5 02/02/30 フィリピン	国債証券	715,840,000	153.03 1,095,485,744	153.43 1,098,356,262	9.500000 2030/2/2	1.08%
27	BRAZIL 5.0 01/27/45 ブラジル	国債証券	1,207,980,000	90.31 1,090,950,897	90.81 1,096,990,797	5.000000 2045/1/27	1.08%
28	COLOMBIA 3.875 04/25/27 コロンビア	国債証券	1,073,760,000	100.54 1,079,644,204	101.30 1,087,751,092	3.875000 2027/4/25	1.07%
29	UNITED MEXICAN STATES 4.6 01/23/46 メキシコ	国債証券	1,118,500,000	95.30 1,065,930,500	95.85 1,072,082,250	4.600000 2046/1/23	1.06%
30	HUNGARY 5.375 03/25/24 ハンガリー	国債証券	961,910,000	109.39 1,052,233,349	109.67 1,054,936,316	5.375000 2024/3/25	1.04%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

平成31年4月26日現在

種類	投資比率
国債証券	96.69%
合計	96.69%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資株式の業種別投資比率

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】

たわらノーロード バランス(堅実型)

平成31年4月26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05月	売建	167,900	18,584,313	18,751,072	8.30%
		ユーロ売/円買201 9年05月	売建	25,600	3,191,270	3,184,128	1.41%
		イギリス・ポンド売/ 円買2019年05月	売建	12,000	1,732,176	1,728,840	0.76%
		カナダ・ドル売/円買 2019年05月	売建	12,500	1,037,287	1,035,625	0.46%
		スイス・フラン売/円 買2019年05月	売建	8,100	903,984	887,760	0.39%
		オーストラリア・ドル 売/円買2019年0 5月	売建	9,000	709,150	704,790	0.31%

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

(注2) 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。



## たわらノーロード バランス(標準型)

平成31年4月26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05月	売建	1,126,800	124,721,886	125,841,024	13.58%
		ユーロ売/円買2019年05月	売建	171,500	21,379,018	21,331,170	2.30%
		イギリス・ポンド売/円買2019年05月	売建	80,600	11,634,448	11,612,042	1.25%
		カナダ・ドル売/円買2019年05月	売建	83,800	6,953,975	6,942,830	0.75%
		スイス・フラン売/円買2019年05月	売建	54,500	6,082,363	5,973,200	0.64%
		オーストラリア・ドル売/円買2019年05月	売建	60,500	4,767,067	4,737,755	0.51%
		香港・ドル売/円買2019年05月	売建	182,200	2,573,210	2,592,706	0.28%
		スウェーデン・クローナ売/円買2019年05月	売建	152,200	1,820,799	1,782,262	0.19%
		デンマーク・クローネ売/円買2019年05月	売建	73,300	1,224,652	1,221,178	0.13%
		シンガポール・ドル売/円買2019年05月	売建	11,100	908,002	909,423	0.10%
		ノルウェー・クローネ売/円買2019年05月	売建	38,600	497,168	496,396	0.05%
		イスラエル・シケル売/円買2019年05月	売建	6,200	189,442	190,836	0.02%
		ニュージーランド・ドル売/円買2019年05月	売建	2,200	166,225	162,910	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。

## たわらノーロード バランス(積極型)

平成31年4月26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05月	売建	1,307,700	144,745,128	146,043,936	15.87%
		ユーロ売/円買2019年05月	売建	199,000	24,807,141	24,751,620	2.69%
		イギリス・ポンド売/円買2019年05月	売建	93,600	13,510,972	13,484,952	1.47%
		カナダ・ドル売/円買2019年05月	売建	97,300	8,074,245	8,061,305	0.88%
		スイス・フラン売/円買2019年05月	売建	63,200	7,053,309	6,926,720	0.75%
		オーストラリア・ドル売/円買2019年05月	売建	70,200	5,531,373	5,497,362	0.60%
		香港・ドル売/円買2019年05月	売建	211,400	2,985,602	3,008,222	0.33%
		スウェーデン・クローナ売/円買2019年05月	売建	176,600	2,112,701	2,067,986	0.22%
		デンマーク・クローネ売/円買2019年05月	売建	85,100	1,421,799	1,417,766	0.15%
		シンガポール・ドル売/円買2019年05月	売建	12,900	1,055,245	1,056,897	0.11%
		ノルウェー・クローネ売/円買2019年05月	売建	44,800	577,024	576,128	0.06%
		イスラエル・シケル売/円買2019年05月	売建	7,200	219,997	221,616	0.02%
		ニュージーランド・ドル売/円買2019年05月	売建	2,600	196,448	192,530	0.02%

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

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

為替予約取引の数量は、現地通貨建契約金額です。

(参考)

## 国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

平成31年4月26日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
株価指数先物 取引	大阪取引所	TOPIX 先物 3106月	買建	394	6,347,645,656	6,363,100,000	2.34%

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

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

## 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

## J-REITインデックスファンド・マザーファンド

平成31年4月26日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
不動産投信指 数先物取引	大阪取引所	TREIT 先物 3106月	買建	351	645,877,908	661,108,500	1.98%

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

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

## 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成31年4月26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05月	売建	7,615,000	850,894,008	850,900,100	0.23%
		ユーロ売/円買201 9年05月	売建	1,721,000	214,018,052	214,057,980	0.06%
		イギリス・ポンド売/ 円買2019年05月	売建	535,000	76,945,840	77,093,500	0.02%
		カナダ・ドル売/円買 2019年05月	売建	677,000	56,106,984	56,109,760	0.02%
		オーストラリア・ドル 売/円買2019年0 5月	売建	399,000	31,255,465	31,261,650	0.01%
株価指数先物 取引	シカゴ商品 取引所	S&P500 EMI NI FUT Jun 19	買建	172	2,766,292,375	2,814,789,137	0.76%
	EUREX 取引所	DJ EURO ST OXX 50 Jun 19	買建	161	667,447,956	685,862,415	0.18%
	ICE-E EU	FTSE 100 I NDEX FUTUR E Jun19	買建	24	253,621,408	255,457,286	0.07%
	モントリ オール取引 所	S&P/TSE 6 0 IX FUT J un19	買建	9	144,838,995	148,175,244	0.04%
	シドニー先 物取引所	SPI 200 FU TURES Jun1 9	買建	11	135,751,233	137,333,154	0.04%

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

(注2) 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。

## 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成31年4月26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	-	ユーロ売/円買2019年05月	売建	5,432,022	675,510,000	675,634,936	0.35%
		アメリカ・ドル売/円買2019年05月	売建	4,583,012	512,060,000	512,060,000	0.26%
		イギリス・ポンド売/円買2019年05月	売建	615,278	88,650,000	88,661,690	0.05%
		カナダ・ドル売/円買2019年05月	売建	491,486	40,730,000	40,734,423	0.02%
		オーストラリア・ドル売/円買2019年05月	売建	371,760	29,120,000	29,123,717	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。

## 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成31年4月26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05月	買建	170,000	21,147,966	21,144,600	0.04%

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

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

為替予約取引の数量は、現地通貨建契約金額です。

## 為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成31年4月26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05月	売建	1,698,196,100	187,568,392,192	189,722,468,292	47.38%
		ユーロ売/円買201 9年05月	売建	1,249,566,100	155,502,198,846	155,421,031,518	38.81%
		イギリス・ポンド売/ 円買2019年05月	売建	186,237,600	26,860,095,830	26,834,975,784	6.70%
		オーストラリア・ドル 売/円買2019年0 5月	売建	108,943,300	8,558,048,731	8,534,618,122	2.13%
		カナダ・ドル売/円買 2019年05月	売建	89,037,000	7,363,479,766	7,378,496,190	1.84%
		メキシコ・ペソ売/円 買2019年05月	売建	498,640,300	2,819,342,174	2,912,059,352	0.73%
		南アフリカ・ランド 売/円買2019年0 5月	売建	297,561,900	2,290,712,173	2,291,226,630	0.57%
		ポーランド・ズロチ 売/円買2019年0 5月	売建	74,448,100	2,145,475,125	2,155,272,495	0.54%
		デンマーク・クローネ 売/円買2019年0 5月	売建	111,702,300	1,860,234,253	1,860,960,318	0.46%
		スウェーデン・クロー ナ売/円買2019年 05月	売建	107,322,000	1,280,472,733	1,256,740,620	0.31%
		シンガポール・ドル 売/円買2019年0 5月	売建	14,700,500	1,198,521,033	1,204,705,975	0.30%
		マレーシア・リングイ ット売/円買2019年 05月	売建	41,940,000	1,139,279,130	1,131,960,600	0.28%
ノルウェー・クローネ 売/円買2019年0 5月	売建	43,926,600	563,724,114	565,335,342	0.14%		

(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31年4月26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05月	売建	4,483,000	500,925,937	500,930,420	0.84%
株価指数先物 取引	ICE-US	MINI MSCI EMG MKT Jun 19	買建	854	5,211,139,595	5,136,582,622	8.63%

(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31年4月26日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
為替予約取引	-	アメリカ・ドル買/円 売2019年05月	買建	2,600,000	291,662,800	290,524,000	0.29%
		アメリカ・ドル売/円 買2019年05月	売建	4,100,000	458,093,000	458,093,000	0.45%

(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31年4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。

たわらノーロード バランス(堅実型)

	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30年10月12日)	100	100	0.9809	0.9809
平成30年4月末日	31	-	0.9910	-
5月末日	44	-	0.9910	-
6月末日	56	-	0.9929	-
7月末日	70	-	0.9972	-
8月末日	81	-	0.9967	-
9月末日	89	-	0.9988	-
10月末日	111	-	0.9811	-
11月末日	131	-	0.9882	-
12月末日	144	-	0.9789	-
平成31年1月末日	174	-	0.9952	-
2月末日	191	-	1.0049	-
3月末日	215	-	1.0173	-
4月末日	226	-	1.0199	-

たわらノーロード バランス(標準型)

	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30年10月12日)	408	408	0.9942	0.9942
平成30年4月末日	116	-	0.9969	-
5月末日	176	-	1.0002	-
6月末日	221	-	1.0046	-
7月末日	269	-	1.0155	-
8月末日	330	-	1.0201	-
9月末日	370	-	1.0271	-
10月末日	457	-	0.9918	-
11月末日	539	-	1.0059	-
12月末日	565	-	0.9717	-
平成31年1月末日	696	-	1.0060	-
2月末日	767	-	1.0246	-
3月末日	861	-	1.0393	-
4月末日	926	-	1.0492	-



## たわらノーロード バランス(積極型)

	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30年10月12日)	524	524	0.9980	0.9980
平成30年4月末日	176	-	0.9952	-
5月末日	255	-	1.0021	-
6月末日	360	-	1.0084	-
7月末日	411	-	1.0257	-
8月末日	470	-	1.0355	-
9月末日	505	-	1.0484	-
10月末日	573	-	0.9934	-
11月末日	644	-	1.0135	-
12月末日	633	-	0.9502	-
平成31年1月末日	748	-	1.0025	-
2月末日	813	-	1.0305	-
3月末日	878	-	1.0459	-
4月末日	920	-	1.0639	-

## 【分配の推移】

## たわらノーロード バランス(堅実型)

	1口当たりの分配金(円)
第1計算期間	0.0000
平成30年10月13日～ 平成31年4月12日	-

## たわらノーロード バランス(標準型)

	1口当たりの分配金(円)
第1計算期間	0.0000
平成30年10月13日～ 平成31年4月12日	-

## たわらノーロード バランス(積極型)

	1口当たりの分配金(円)
第1計算期間	0.0000
平成30年10月13日～ 平成31年4月12日	-

## 【収益率の推移】

## たわらノーロード バランス(堅実型)

	収益率(%)
第1計算期間	1.9
平成30年10月13日～ 平成31年4月12日	3.9

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

なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

## たわらノーロード バランス(標準型)

	収益率(%)
第1計算期間	0.6
平成30年10月13日～ 平成31年4月12日	5.2

(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。

## たわらノーロード バランス(積極型)

	収益率(%)
第1計算期間	0.2
平成30年10月13日～ 平成31年4月12日	6.1

(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】

## たわらノーロード バランス(堅実型)

	設定口数	解約口数
第1計算期間	114,478,557	11,678,700
平成30年10月13日～ 平成31年4月12日	128,470,728	13,831,809

(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。

## たわらノーロード バランス(標準型)

	設定口数	解約口数
第1計算期間	436,043,104	24,826,128
平成30年10月13日～ 平成31年4月12日	502,151,823	48,185,922

(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。

## たわらノーロード バランス(積極型)

	設定口数	解約口数
第1計算期間	608,175,973	82,444,445
平成30年10月13日～ 平成31年4月12日	403,704,319	71,711,685

(注1) 本邦外における設定及び解約はございません。

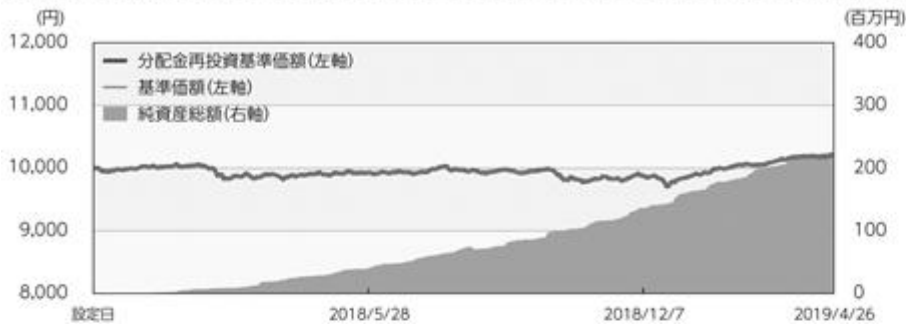
(注2) 第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

&lt;&lt; 参考情報 &gt;&gt;

データの基準日:2019年4月26日

## 堅 実 型

## 基準価額・純資産の推移 (2017年11月8日～2019年4月26日)



## 分配の推移(税引前)

第1期(2018.10.12)	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万円当たりです。

※基準価額は1万円当たり・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11月8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。

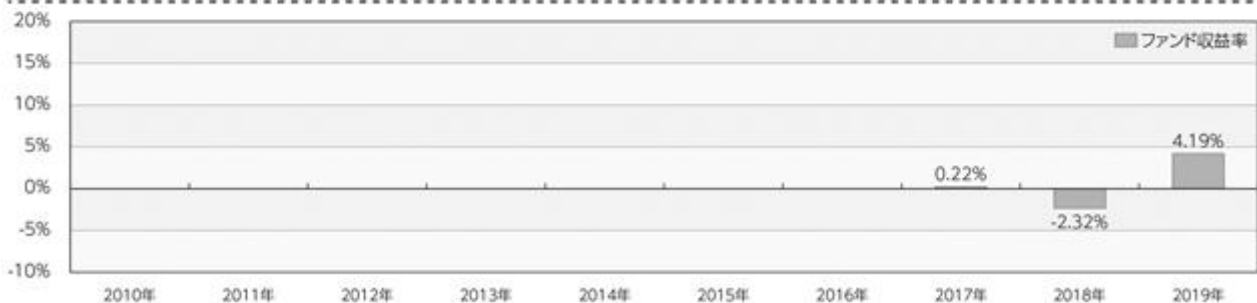
## 主要な資産の状況

■組入銘柄 ※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

順位	銘柄名	比率(%)
1	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	35.47
2	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	33.02
3	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	12.10
4	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	7.99
5	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	3.99
6	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	2.98
7	J-REITインデックスファンド・マザーファンド	1.99
8	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	1.01
9	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	0.98

※マザーファンドについては、「各マザーファンドの主要な資産の状況」をご参照ください。

## 年間収益率の推移(暦年ベース)

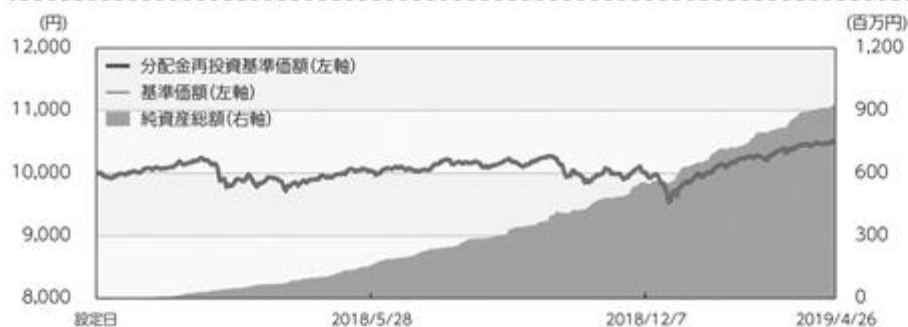


※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。  
 ※2017年は設定日から年末までの収益率、および2019年については年初から基準日までの収益率を表示しています。  
 ※当ファンドにはベンチマークはありません。

○掲載データ等はあくまでも過去の実績であり、将来の運用成果を示唆、保証するものではありません。  
 ○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

## 標準型

## 基準価額・純資産の推移 (2017年11月8日～2019年4月26日)



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。

※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額とは異なります。  
(設定日:2017年11月8日)

※設定時から10年以上経過した場合は、直近10年分を記載しています。

## 分配の推移(税引前)

第1期(2018.10.12)	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たりです。

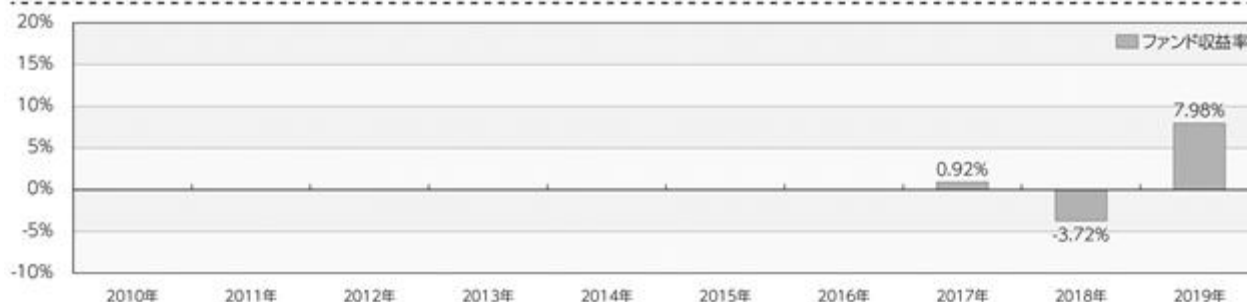
## 主要な資産の状況

## ■組入銘柄 ※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

順位	銘柄名	比率(%)
1	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	26.64
2	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	23.05
3	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	16.51
4	J-REITインデックスファンド・マザーファンド	10.00
5	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	7.02
6	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	6.00
7	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	5.07
8	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	3.99
9	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	0.99

※マザーファンドについては、「各マザーファンドの主要な資産の状況」をご参照ください。

## 年間収益率の推移(暦年ベース)



※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。

※2017年は設定日から年末までの収益率、および2019年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

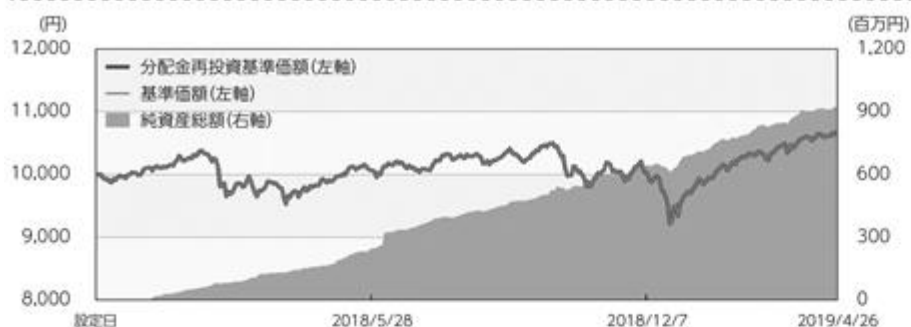
※当ファンドにはベンチマークはありません。

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

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

## 積 極 型

## 基準価額・純資産の推移 (2017年11月8日～2019年4月26日)



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。

※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額とは異なります。  
(設定日:2017年11月8日)

※設定時から10年以上経過した場合は、直近10年分を記載しています。

## 分配の推移(税引前)

第1期(2018.10.12)	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たりです。

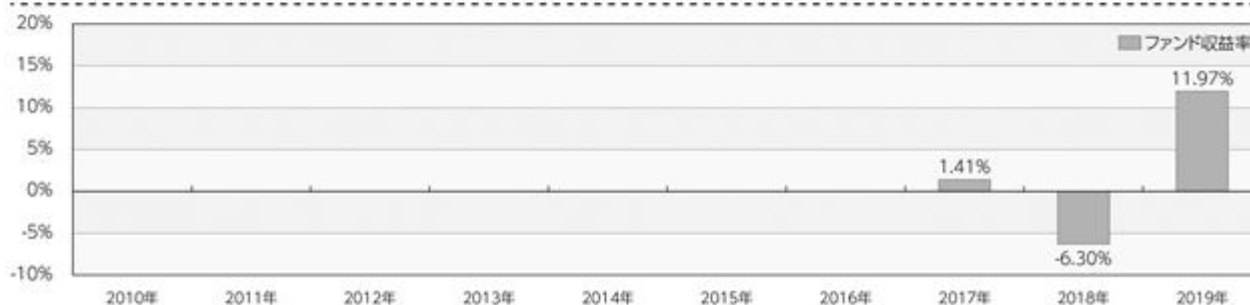
## 主要な資産の状況

## ■組入銘柄 ※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

順位	銘柄名	比率(%)
1	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	40.08
2	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	12.98
3	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	12.96
4	J-REITインデックスファンド・マザーファンド	12.95
5	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	12.16
6	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	3.00
7	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	2.50
8	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	1.97
9	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	0.99

※マザーファンドについては、「各マザーファンドの主要な資産の状況」をご参照ください。

## 年間収益率の推移(暦年ベース)



※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。

※2017年は設定日から年末までの収益率、および2019年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

※当ファンドにはベンチマークはありません。

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

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

## 各マザーファンドの主要な資産の状況

### ■国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

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

#### 組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	業種	比率(%)
1	トヨタ自動車	株式	日本	輸送用機器	3.23
2	ソフトバンクグループ	株式	日本	情報・通信業	1.99
3	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	日本	銀行業	1.57
4	武田薬品工業	株式	日本	医薬品	1.51
5	ソニー	株式	日本	電気機器	1.47

### ■国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

#### 組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還期限	比率(%)
1	125回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.100000	2020/9/20	1.04
2	350回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.100000	2028/3/20	1.00
3	339回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.400000	2025/6/20	0.94
4	345回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.100000	2026/12/20	0.92
5	342回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.100000	2026/3/20	0.91

### ■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	2.55
2	MICROSOFT CORP	株式	アメリカ	ソフトウェア	2.46
3	AMAZON.COM INC	株式	アメリカ	インターネット販売・通信販売	2.07
4	FACEBOOK INC	株式	アメリカ	インタラクティブ・メディアおよびサービス	1.21
5	ALPHABET INC-CL C	株式	アメリカ	インタラクティブ・メディアおよびサービス	1.05

### ■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 2.625 08/15/20	国債証券	アメリカ	2.625000	2020/8/15	0.96
2	US T N/B 3.5 05/15/20	国債証券	アメリカ	3.500000	2020/5/15	0.82
3	US T N/B 2.0 05/31/21	国債証券	アメリカ	2.000000	2021/5/31	0.69
4	US T N/B 1.375 04/30/20	国債証券	アメリカ	1.375000	2020/4/30	0.69
5	US T N/B 1.375 04/30/21	国債証券	アメリカ	1.375000	2021/4/30	0.64

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

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

### ■為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

#### 組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還期限	比率(%)
1	US T N/B 2.75 07/31/23	国債証券	アメリカ	2.750000	2023/7/31	0.85
2	US T N/B 2.0 02/15/25	国債証券	アメリカ	2.000000	2025/2/15	0.72
3	US T N/B 2.5 02/28/21	国債証券	アメリカ	2.500000	2021/2/28	0.66
4	US T N/B 1.25 03/31/21	国債証券	アメリカ	1.250000	2021/3/31	0.65
5	US T N/B 1.875 10/31/22	国債証券	アメリカ	1.875000	2022/10/31	0.62

### ■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	4.66
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	4.07
3	TAIWAN SEMICONDUCTOR	株式	台湾	半導体・半導体製造装置	3.56
4	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	株式	韓国	コンピュータ・周辺機器	3.08
5	NASPERS LTD	株式	南アフリカ	インターネット販売・通信販売	1.86

### ■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	2.82
2	COLOMBIA 5.0 06/15/45	国債証券	コロンビア	5.000000	2045/6/15	1.84
3	PERU 5.625 11/18/50	国債証券	ペルー	5.625000	2050/11/18	1.69
4	HUNGARY 6.375 03/29/21	国債証券	ハンガリー	6.375000	2021/3/29	1.53
5	UNITED MEXICAN STATES 4.75 03/08/44	国債証券	メキシコ	4.750000	2044/3/8	1.45

### ■J-REITインデックスファンド・マザーファンド

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

#### 組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	比率(%)
1	日本ビルファンド投資法人	投資証券	日本	7.22
2	ジャパンリアルエステイト投資法人	投資証券	日本	6.41
3	野村不動産マスターファンド投資法人	投資証券	日本	5.27
4	日本リートールファンド投資法人	投資証券	日本	4.18
5	ユナイテッド・アーバン投資法人	投資証券	日本	4.08

### ■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	4.57
2	PROLOGIS INC	投資証券	アメリカ	3.95
3	PUBLIC STORAGE	投資証券	アメリカ	2.70
4	WELLTOWER INC	投資証券	アメリカ	2.37
5	EQUITY RESIDENTIAL	投資証券	アメリカ	2.33

○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。

確定拠出年金制度のご利用によるお申込みの場合には、確定拠出年金制度にかかる手続きが必要となります。この場合、「分配金再投資コース」でのお申込みとなります。

確定拠出年金制度によるお申込みの場合は、取扱いが一部異なる場合があります。

各ファンドは、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「分配金再投資コース」があり、「分配金再投資コース」を取得申込者が選択した場合、取得申込者は販売会社との間で「自動けいぞく投資約款」にしたが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。

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

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

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

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

#### ・お申込価額

お申込日の翌営業日の基準価額 とします。

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

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

< 基準価額の照会方法等 >

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

各ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・ 販売会社へのお問い合わせ
- ・ 委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

・ お申込手数料

ありません。

・ 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「分配金再投資コース」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。

「分配金再投資コース」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。

確定拠出年金制度によるお申込みの場合は、1円以上1円単位となります。

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てします。各取得申込日の発行価額の総額は、販売会社によって、追加信託が行われる日に、委託会社の指定する口座を經由して受託会社の指定するファンド口座（受託会社が信託事務の一部について委託を行っている場合は当該委託先の口座）に払込まれます。

## 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、決済機能の停止、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6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および借入有価証券を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則に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
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11月8日から原則として無期限です。

ただし、下記「(5)その他 イ．償還規定」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。

## (4) 【計算期間】

- a. 計算期間は、原則として毎年10月13日から翌年10月12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、各ファンドにおいて受益権口数が10億口を下回ることとなった場合、マザーファンドのベンチマークである対象インデックスが改廃された場合、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っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発送します。
- c. 上記b.の書面決議において、受益者(委託会社およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下イ.償還規定c.において同じ。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- 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き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、信託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け出ます。なお、信託約款は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. の変更事項にあっては、その内容が重大なものに該当する場合に限り、上記a. の併合事項にあっては、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、信託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、信託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、この投資信託において併合の書面決議が可決された場合にあっては、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信託約款を変更しようとするときは、上記a. からg. の規定にしたがいます。
- i. この信託は、受益者が一部解約請求を行ったときは、委託会社が信託契約の一部の解約をすることにより当該請求に応じ、当該受益権の公正な価格が当該受益者に一部解約金として支払われることとなる委託者指図型投資信託に該当するため、重大な約款の変更等を行う場合において、投資信託及び投資法人に関する法律第18条第1項に定める反対受益者による受益権買取請求の規定の適用を受けません。

## 八. 関係法人との契約の更改

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

## 二. 公告

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

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

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

## ホ. 運用報告書

・委託会社は、毎年10月12日（休業日の場合は翌営業日とします。）および償還時に交付運用報告書を作成し、販売会社を通じて受益者に対して交付します。

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

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

## 4【受益者の権利等】

### (1) 収益分配金請求権

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

受益者が収益分配金支払開始日から5年間支払いを請求しないときは、その権利を失い、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、「分配金再投資コース」により収益分配金を再投資する受益者に対しては、委託会社は受託会社から受けた収益分配金を、原則として毎計算期間終了日の翌営業日に販売会社に交付します。販売会社は、受益者に対し遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の売付を行います。再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

### (2) 償還金請求権

受益者は、持ち分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

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

されている受益権については原則として取得申込者(とします。 )に、原則として償還日(休業日  
の場合は翌営業日)から起算して5営業日までにお支払いを開始します。

(3)一部解約請求権

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

(4)帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

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



### 第3【ファンドの経理状況】

#### たわらノーロード バランス(堅実型)

- (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) 当ファンドの第1期計算期間は信託約款の規定に基づき、平成29年11月8日から平成30年10月12日までとなっております。
- (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1期計算期間(平成29年11月8日から平成30年10月12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】

## 【たわらノーロード バランス(堅実型)】

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

		第1期
		平成30年10月12日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		1,115,594
親投資信託受益証券		99,653,934
派生商品評価勘定		170,816
流動資産合計		100,940,344
資産合計		100,940,344
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		941
未払解約金		36,257
未払受託者報酬		6,093
未払委託者報酬		61,312
その他未払費用		1,142
流動負債合計		105,745
負債合計		105,745
純資産の部		
元本等		
元本	1	102,799,857
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	2	1,965,258
(分配準備積立金)		700,278
元本等合計		100,834,599
純資産合計		100,834,599
負債純資産合計		100,940,344

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第1期 自 平成29年11月8日 至 平成30年10月12日
<b>営業収益</b>	
有価証券売買等損益	1,046,066
為替差損益	218,391
営業収益合計	1,264,457
<b>営業費用</b>	
支払利息	215
受託者報酬	7,284
委託者報酬	73,696
その他費用	1,325
営業費用合計	82,520
営業利益又は営業損失( )	1,346,977
経常利益又は経常損失( )	1,346,977
当期純利益又は当期純損失( )	1,346,977
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( )	9,491
期首剰余金又は期首欠損金( )	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	75,468
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	75,468
剰余金減少額又は欠損金増加額	684,258
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	684,258
分配金	1 -
期末剰余金又は期末欠損金( )	1,965,258

## (3)【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

## (貸借対照表に関する注記)

項目	第1期 平成30年10月12日現在
1. 1 期首元本額	1,000,000円
期中追加設定元本額	113,478,557円
期中一部解約元本額	11,678,700円
2. 受益権の総数	102,799,857口
3. 2 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は1,965,258円であります。

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第1期 自 平成29年11月8日 至 平成30年10月12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(700,278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(101,131円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象収益は801,409円(1万口当たり77.96円)であります。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1期 自 平成29年11月8日 至 平成30年10月12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。
2． 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、主要投資対象である親投資信託受益証券が保有する金融商品に係る、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。
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。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第1期 平成30年10月12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。
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。
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。

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	第1期 平成30年10月12日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	
親投資信託受益証券		1,038,337
合計		1,038,337

## (デリバティブ取引等に関する注記)

## 通貨関連

種類	第1期 平成30年10月12日 現在			
	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	11,930,433	-	11,760,558	169,875
アメリカ・ドル	8,425,558	-	8,308,174	117,384
イギリス・ポンド	830,379	-	831,320	941
オーストラリア・ドル	311,748	-	303,316	8,432
カナダ・ドル	459,836	-	447,148	12,688
スイス・フラン	383,153	-	374,220	8,933
ユーロ	1,519,759	-	1,496,380	23,379
合計	11,930,433	-	11,760,558	169,875

## (注) 時価の算定方法

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

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

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

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

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (1口当たり情報に関する注記)

	第1期 平成30年10月12日現在
1口当たり純資産額	0.9809円
(1万口当たり純資産額)	(9,809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10月12日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	1,496,735	3,925,935	
	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	28,242,803	36,111,247	
	J-REITインデックスファンド・マザーファンド	1,085,989	2,016,572	
	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	3,180,770	10,994,649	
	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	1,694,648	3,044,096	
	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	829,408	973,973	
	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	25,762,701	33,576,528	
	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	911,236	970,830	
	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	4,452,625	8,040,104	
親投資信託受益証券 合計		67,656,915	99,653,934	
合計		67,656,915	99,653,934	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

たわらノーロード バランス(標準型)

- (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) 当ファンドの第1期計算期間は信託約款の規定に基づき、平成29年11月8日から平成30年10月12日までとなっております。
- (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1期計算期間(平成29年11月8日から平成30年10月12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。

## 【たわらノーロード バランス(標準型)】

## (1) 【貸借対照表】

(単位:円)

		第1期 平成30年10月12日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン		2,841,762
親投資信託受益証券		405,322,034
派生商品評価勘定		1,235,928
流動資産合計		409,399,724
<b>資産合計</b>		<b>409,399,724</b>
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定		10,088
未払解約金		297,601
未払受託者報酬		24,341
未払委託者報酬		243,865
その他未払費用		4,760
流動負債合計		580,655
<b>負債合計</b>		<b>580,655</b>
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本		1 411,216,976
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	2	2,397,907
(分配準備積立金)		3,438,663
元本等合計		408,819,069
<b>純資産合計</b>		<b>408,819,069</b>
<b>負債純資産合計</b>		<b>409,399,724</b>

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第1期 自 平成29年11月8日 至 平成30年10月12日
<b>営業収益</b>	
有価証券売買等損益	4,082,966
為替差損益	1,405,396
営業収益合計	5,488,362
<b>営業費用</b>	
支払利息	1,101
受託者報酬	29,046
委託者報酬	291,447
その他費用	5,638
営業費用合計	327,232
営業利益又は営業損失( )	5,815,594
経常利益又は経常損失( )	5,815,594
当期純利益又は当期純損失( )	5,815,594
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( )	119,728
期首剰余金又は期首欠損金( )	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	3,611,877
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	3,611,877
剰余金減少額又は欠損金増加額	74,462
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	74,462
分配金	1 -
期末剰余金又は期末欠損金( )	2,397,907

## (3)【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

## (貸借対照表に関する注記)

項目	第1期 平成30年10月12日現在
1. 1 期首元本額	1,000,000円
期中追加設定元本額	435,043,104円
期中一部解約元本額	24,826,128円
2. 受益権の総数	411,216,976口
3. 2 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は2,397,907円であります。

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第1期 自 平成29年11月8日 至 平成30年10月12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(3,438,663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(487,638円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象収益は3,926,301円(1万口当たり95.48円)であります。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1期 自 平成29年11月8日 至 平成30年10月12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。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、主要投資対象である親投資信託受益証券が保有する金融商品に係る、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。
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。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第1期 平成30年10月12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。
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。
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。

(有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	第1期 平成30年10月12日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	
親投資信託受益証券		4,127,559
合計		4,127,559

(デリバティブ取引等に関する注記)

## 通貨関連

種類	第1期 平成30年10月12日 現在			
	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	89,118,288	-	87,892,448	1,225,840
アメリカ・ドル	60,598,228	-	59,791,980	806,248
イギリス・ポンド	5,945,956	-	5,952,845	6,889
イスラエル・シケル	97,109	-	95,666	1,443
オーストラリア・ドル	2,260,651	-	2,203,032	57,619
カナダ・ドル	3,311,690	-	3,224,625	87,065
シンガポール・ドル	407,307	-	399,399	7,908
スイス・フラン	2,783,500	-	2,721,600	61,900
スウェーデン・クローナ	886,597	-	865,692	20,905
デンマーク・クローネ	540,597	-	531,920	8,677
ニュージーランド・ドル	67,701	-	65,781	1,920
ノルウェー・クローネ	252,811	-	247,246	5,565
ユーロ	10,918,505	-	10,760,924	157,581
香港・ドル	1,047,636	-	1,031,738	15,898
合計	89,118,288	-	87,892,448	1,225,840

(注) 時価の算定方法

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

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



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

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

( 関連当事者との取引に関する注記 )

該当事項はありません。

( 1口当たり情報に関する注記 )

	第1期 平成30年10月12日現在
1口当たり純資産額 ( 1万口当たり純資産額 )	0.9942円 (9,942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10月12日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	10,718,179	28,113,783	
	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	53,757,715	68,734,614	
	J-REITインデックスファンド・マザーファンド	22,327,336	41,459,630	
	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	30,643,847	105,923,521	
	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	9,240,402	16,598,534	
	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	17,050,297	20,022,163	
	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	73,544,050	95,849,960	
	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	3,704,213	3,946,468	
	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	13,664,153	24,673,361	
親投資信託受益証券 合計		234,650,192	405,322,034	
合計		234,650,192	405,322,034	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

たわらノーロード バランス(積極型)

- (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) 当ファンドの第1期計算期間は信託約款の規定に基づき、平成29年11月8日から平成30年10月12日までとなっております。
- (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1期計算期間(平成29年11月8日から平成30年10月12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。

## 【たわらノーロード バランス(積極型)】

## (1) 【貸借対照表】

(単位:円)

		第1期
		平成30年10月12日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		3,928,340
親投資信託受益証券		519,870,011
派生商品評価勘定		1,833,052
流動資産合計		525,631,403
資産合計		525,631,403
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		14,896
未払解約金		530,153
未払受託者報酬		36,407
未払委託者報酬		364,325
その他未払費用		7,161
流動負債合計		952,942
負債合計		952,942
純資産の部		
元本等		
元本	1	525,731,528
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	2	1,053,067
(分配準備積立金)		6,024,382
元本等合計		524,678,461
純資産合計		524,678,461
負債純資産合計		525,631,403

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第1期 自 平成29年11月8日 至 平成30年10月12日
営業収益	
有価証券売買等損益	4,038,989
為替差損益	2,446,459
営業収益合計	6,485,448
営業費用	
支払利息	2,088
受託者報酬	44,765
委託者報酬	448,445
その他費用	8,762
営業費用合計	504,060
営業利益又は営業損失( )	6,989,508
経常利益又は経常損失( )	6,989,508
当期純利益又は当期純損失( )	6,989,508
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額( )	1,442,757
期首剰余金又は期首欠損金( )	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	7,839,649
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	7,839,649
剰余金減少額又は欠損金増加額	460,451
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	460,451
分配金	1 -
期末剰余金又は期末欠損金( )	1,053,067

## (3)【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

## (貸借対照表に関する注記)

項目	第1期 平成30年10月12日現在
1. 1 期首元本額	1,000,000円
期中追加設定元本額	607,175,973円
期中一部解約元本額	82,444,445円
2. 受益権の総数	525,731,528口
3. 2 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は1,053,067円であります。

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第1期 自 平成29年11月8日 至 平成30年10月12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(6,024,382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(692,553円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象収益は6,716,935円(1万口当たり127.76円)であります。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1期 自 平成29年11月8日 至 平成30年10月12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。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、主要投資対象である親投資信託受益証券が保有する金融商品に係る、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。
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。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第1期 平成30年10月12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。
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。
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。



## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	第1期 平成30年10月12日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	
親投資信託受益証券		4,266,697
合計		4,266,697

## （デリバティブ取引等に関する注記）

## 通貨関連

種類	第1期 平成30年10月12日 現在			
	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	132,036,328	-	130,218,172	1,818,156
アメリカ・ドル	89,775,187	-	88,579,467	1,195,720
イギリス・ポンド	8,807,737	-	8,817,930	10,193
イスラエル・シケル	140,965	-	138,870	2,095
オーストラリア・ドル	3,358,024	-	3,272,620	85,404
カナダ・ドル	4,910,302	-	4,781,044	129,258
シンガポール・ドル	598,492	-	586,872	11,620
スイス・フラン	4,129,063	-	4,037,040	92,023
スウェーデン・クローナ	1,315,802	-	1,284,777	31,025
デンマーク・クローネ	801,147	-	788,288	12,859
ニュージーランド・ドル	97,791	-	95,017	2,774
ノルウェー・クローネ	374,329	-	366,088	8,241
ユーロ	16,173,447	-	15,939,700	233,747
香港・ドル	1,554,042	-	1,530,459	23,583
合計	132,036,328	-	130,218,172	1,818,156

## （注）時価の算定方法

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

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

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

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

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

- 3．換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （1口当たり情報に関する注記）

	第1期 平成30年10月12日現在
1口当たり純資産額	0.9980円
（1万口当たり純資産額）	(9,980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10月12日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	25,761,119	67,571,415	
	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	10,644,651	13,610,250	
	J-REITインデックスファンド・マザーファンド	37,826,155	70,239,387	
	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	58,912,437	203,636,729	
	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	3,039,080	5,459,099	
	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	53,328,227	62,623,336	
	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	54,030,866	70,418,427	
	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	9,490,560	10,111,242	
	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	8,971,660	16,200,126	
親投資信託受益証券 合計		262,004,755	519,870,011	
合計		262,004,755	519,870,011	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

(参考)

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

同親投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

「国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成30年10月12日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		5,541,292,683
株式	2	275,713,338,725
未収入金		11,886,304
未収配当金		2,479,578,947
前払金		343,139,000
流動資産合計		284,089,235,659
資産合計		284,089,235,659
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		256,768,108
未払金		99,013,076
未払解約金		218,203,000
流動負債合計		573,984,184
負債合計		573,984,184
純資産の部		
元本等		
元本	1	108,086,790,523
剰余金		
剰余金又は欠損金( )		175,428,460,952
元本等合計		283,515,251,475
純資産合計		283,515,251,475
負債純資産合計		284,089,235,659

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

## （貸借対照表に関する注記）

項目	平成30年10月12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	116,880,020,103円
同期中追加設定元本額	26,280,794,786円
同期中一部解約元本額	35,074,024,366円
元本の内訳	
ファンド名	
DIAM DC 国内株式インデックスファンド	10,894,193,839円
DIAM国内株式パッシブ・ファンド	2,191,345,986円
MITO ラップ型ファンド（安定型）	3,392,166円
MITO ラップ型ファンド（中立型）	7,399,968円
MITO ラップ型ファンド（積極型）	12,999,220円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	23,906,761円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	19,553,564円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	16,730,426円
たわらノーロード TOPIX	285,478,397円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	58,149,026円
たわらノーロード バランス（堅実型）	1,496,735円
たわらノーロード バランス（標準型）	10,718,179円

たわらノーロード バランス (積極型)	25,761,119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)	183,257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)	5,735,251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)	18,753,835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)	15,568,481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)	37,051,050円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(保守型)	40,828円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定型)	70,944円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定成長型)	624,356円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(成長型)	535,203円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(積極型)	1,596,424円
D I A M国内株式インデックス ファンド<DC年金>	37,182,114,438円
D I A Mバランス・ファンド< DC年金>1安定型	816,531,612円
D I A Mバランス・ファンド< DC年金>2安定・成長型	2,847,785,821円
D I A Mバランス・ファンド< DC年金>3成長型	2,997,103,644円
D I A M DC バランス30 インデックスファンド	335,014,767円
D I A M DC バランス50 インデックスファンド	1,133,587,915円
D I A M DC バランス70 インデックスファンド	1,076,982,515円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型>	41,354,593円
マネックス資産設計ファンド< 育成型>	1,081,393,977円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	25,211,643円
D I A M DC 8資産バラ ンスファンド(新興国10)	270,349,553円
D I A M DC 8資産バラ ンスファンド(新興国20)	169,556,877円
D I A M DC 8資産バラ ンスファンド(新興国30)	302,458,993円
投資のソムリエ	2,603,577,387円
クルーズコントロール	1,094,278,101円
投資のソムリエ<DC年金>	226,394,802円

D I A M 8 資産バランスファンドN<DC年金>	185,086,296円
D I A M DC バランス・F (成長型)	241,068,650円
クルーズコントロール<DC年金>	633,819円
D I A Mコア資産設計ファンド (堅実型)	9,690,606円
D I A Mコア資産設計ファンド (積極型)	25,515,262円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	73,476,645円
ダイナミック・ナビゲーション リスク抑制世界8資産バランス ファンド	1,319,223円 1,388,764,282円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2045)	1,099,505円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2055)	793,044円
リスク抑制世界8資産バランス ファンド(DC)	436,709円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2035)	1,452,537円
4資産分散投資・スタンダード <DC年金>	13,612,792円
リスクコントロール世界資産分 散ファンド	235,255,917円
9資産分散投資・スタンダード <DC年金>	18,666円
D I A Mワールドバランス25 VA(適格機関投資家限定)	62,827,883円
日米資産配分戦略ファンド(イン カム重視型)(為替ヘッジあり) (適格機関投資家限定)	55,539,660円
D I A Mグローバル・バランス ファンド25VA(適格機関投 資家限定)	110,246,818円
D I A Mグローバル・バランス ファンド50VA(適格機関投 資家限定)	270,358,342円
D I A M国際分散バランスファ ンド30VA(適格機関投資家 限定)	14,259,379円
D I A M国際分散バランスファ ンド50VA(適格機関投資家 限定)	60,980,777円
D I A M国内重視バランスファ ンド30VA(適格機関投資家 限定)	15,221,233円
D I A M国内重視バランスファ ンド50VA(適格機関投資家 限定)	14,774,325円

D I A M世界バランスファンド 4 0 V A ( 適格機関投資家限 定 )	29,165,799円
D I A M世界バランスファンド 5 0 V A ( 適格機関投資家限 定 )	51,769,778円
D I A Mバランスファンド2 5 V A ( 適格機関投資家限定 )	971,742,856円
D I A Mバランスファンド3 7 . 5 V A ( 適格機関投資家限 定 )	921,626,851円
D I A Mバランスファンド5 0 V A ( 適格機関投資家限定 )	2,591,259,916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 )	183,476,305円
D I A Mグローバル・アセッ ト・バランスV A 2 ( 適格機関 投資家限定 )	49,363,658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 )	524,439,521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 )	421,703,927円
D I A Mグローバル 私募ファ ンド ( 適格機関投資家向け )	10,313,671円
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 )	7,124,683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 )	57,585,354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 )	10,226,006,007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 )	378,222,399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 )	1,642,740,603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 )	9,442,344,440円
D I A Mバランス3 0 V A ( 適 格機関投資家限定 )	3,071,696円
D I A Mバランス5 0 V A ( 適 格機関投資家限定 )	2,949,084円
D I A Mバランス7 0 V A ( 適 格機関投資家限定 )	3,687,674円



D I A M世界アセットバランス ファンド4 V A ( 適格機関投資 家限定)	8,430,015,213円	
D I A M世界バランス2 5 V A ( 適格機関投資家限定)	65,631,920円	
D I A M国内バランス3 0 V A ( 適格機関投資家限定)	26,139,818円	
D I A Mバランス2 0 V A ( 適 格機関投資家限定)	24,002,219円	
D I A Mバランス4 0 V A ( 適 格機関投資家限定)	96,992円	
D I A Mバランス6 0 V A ( 適 格機関投資家限定)	110,708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)	405,365,089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)	1,261,532,817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)	1,669,062,351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)	68,825,151円	
計	108,086,790,523円	
2 . 受益権の総数	108,086,790,523口	
3 . 2 差入代用有価証券	株式	3,304,000,000円

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成29年11月8日 至 平成30年10月12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。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価の変動によるリスクを有しております。
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。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成30年10月12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。
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。
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。

（有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	平成30年10月12日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
株式	7,357,253,208
合計	7,357,253,208

（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8日から平成30年10月12日まで）に対応する金額であります。

## (デリバティブ取引等に関する注記)

## 株式関連

種類	平成30年10月12日 現在			
	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	5,208,993,500	-	4,952,320,000	256,673,500
合計	5,208,993,500	-	4,952,320,000	256,673,500

## (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10月12日現在
1口当たり純資産額	2,6230円
(1万口当たり純資産額)	(26,230円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

平成30年10月12日現在

銘柄	株式数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
極洋	5,000	3,175.00	15,875,000	
日本水産	143,200	714.00	102,244,800	
マルハニチロ	24,100	4,085.00	98,448,500	
ハウスイ	900	1,018.00	916,200	
カネコ種苗	4,300	1,519.00	6,531,700	
サカタのタネ	18,800	3,800.00	71,440,000	
ホクト	12,900	1,917.00	24,729,300	
ホクリヨウ	2,100	771.00	1,619,100	
ヒノキヤグループ	3,200	2,728.00	8,729,600	
ショーボンドホールディングス	12,000	8,280.00	99,360,000	
ミライト・ホールディングス	43,600	1,798.00	78,392,800	
タマホーム	9,500	1,105.00	10,497,500	
サンヨーホームズ	2,200	927.00	2,039,400	
日本アクア	3,500	361.00	1,263,500	
ファーストコーポレーション	4,300	1,107.00	4,760,100	
ベステラ	2,300	1,450.00	3,335,000	
TATERU	18,100	578.00	10,461,800	
スペースバリューホールディングス	18,800	1,102.00	20,717,600	
住石ホールディングス	32,900	132.00	4,342,800	
日鉄鉱業	3,500	4,860.00	17,010,000	
三井松島ホールディングス	6,400	1,856.00	11,878,400	
国際石油開発帝石	618,400	1,346.50	832,675,600	
石油資源開発	20,200	2,430.00	49,086,000	
K&Oエナジーグループ	7,500	1,607.00	12,052,500	
ダイセキ環境ソリューション	2,900	887.00	2,572,300	
第一カッター興業	1,700	2,216.00	3,767,200	
安藤・間	103,800	820.00	85,116,000	
東急建設	49,000	1,042.00	51,058,000	
コムシスホールディングス	48,947	3,165.00	154,917,255	
ミサワホーム	10,600	888.00	9,412,800	
ピーアールホールディングス	12,600	447.00	5,632,200	
高松コンストラクショングループ	8,200	3,005.00	24,641,000	
東建コーポレーション	4,800	7,310.00	35,088,000	
ソネック	1,600	764.00	1,222,400	
ヤマウラ	5,900	877.00	5,174,300	
大成建設	126,600	5,040.00	638,064,000	
大林組	381,300	1,049.00	399,983,700	
清水建設	389,000	995.00	387,055,000	
飛島建設	11,500	1,774.00	20,401,000	
長谷工コーポレーション	148,400	1,445.00	214,438,000	
松井建設	14,000	845.00	11,830,000	
銭高組	1,800	5,310.00	9,558,000	
鹿島建設	279,400	1,572.00	439,216,800	

不動テトラ	9,500	1,901.00	18,059,500
大末建設	4,100	1,200.00	4,920,000
鉄建建設	7,700	2,784.00	21,436,800
西松建設	29,400	2,776.00	81,614,400
三井住友建設	91,700	728.00	66,757,600
大豊建設	9,200	3,050.00	28,060,000
前田建設工業	90,700	1,441.00	130,698,700
佐田建設	8,200	415.00	3,403,000
ナカノフドー建設	9,700	642.00	6,227,400
奥村組	20,900	3,455.00	72,209,500
東鉄工業	15,300	2,803.00	42,885,900
イチケン	2,300	2,133.00	4,905,900
富士ピー・エス	3,400	545.00	1,853,000
浅沼組	4,500	3,315.00	14,917,500
戸田建設	147,800	797.00	117,796,600
熊谷組	20,000	3,035.00	60,700,000
青木あすなろ建設	8,400	902.00	7,576,800
北野建設	2,600	3,840.00	9,984,000
植木組	1,600	2,622.00	4,195,200
矢作建設工業	17,200	810.00	13,932,000
ピーエス三菱	15,100	576.00	8,697,600
日本ハウスホールディングス	24,300	613.00	14,895,900
大東建託	45,300	14,495.00	656,623,500
新日本建設	15,100	1,105.00	16,685,500
N I P P O	29,500	1,922.00	56,699,000
東亜道路工業	2,500	3,560.00	8,900,000
前田道路	39,800	2,216.00	88,196,800
日本道路	3,400	6,400.00	21,760,000
東亜建設工業	10,300	2,247.00	23,144,100
若築建設	6,800	1,518.00	10,322,400
東洋建設	39,900	458.00	18,274,200
五洋建設	151,200	716.00	108,259,200
世紀東急工業	17,100	667.00	11,405,700
福田組	4,100	5,080.00	20,828,000
日本ドライケミカル	2,900	1,241.00	3,598,900
住友林業	81,300	1,854.00	150,730,200
日本基礎技術	14,100	377.00	5,315,700
巴コーポレーション	15,800	455.00	7,189,000
大和ハウス工業	375,700	3,366.00	1,264,606,200
ライト工業	24,400	1,490.00	36,356,000
積水ハウス	413,800	1,659.00	686,494,200
日特建設	10,800	724.00	7,819,200
北陸電気工事	7,000	989.00	6,923,000
ユアテック	17,800	879.00	15,646,200
四電工	1,800	2,668.00	4,802,400
中電工	16,400	2,505.00	41,082,000
関電工	50,600	1,102.00	55,761,200
きんでん	84,600	1,727.00	146,104,200
東京エネシス	14,400	1,038.00	14,947,200
トーエネック	3,500	3,110.00	10,885,000

住友電設	10,000	1,735.00	17,350,000
日本電設工業	19,500	2,282.00	44,499,000
協和エクシオ	48,438	3,165.00	153,306,270
新日本空調	9,800	1,678.00	16,444,400
日本工営	7,300	2,776.00	20,264,800
九電工	25,100	4,210.00	105,671,000
三機工業	27,000	1,132.00	30,564,000
日揮	109,500	2,396.00	262,362,000
中外炉工業	3,900	2,639.00	10,292,100
ヤマト	10,400	666.00	6,926,400
太平電業	8,600	2,858.00	24,578,800
高砂熱学工業	35,000	1,933.00	67,655,000
三晃金属工業	1,400	3,285.00	4,599,000
NEC ネットエスアイ	12,300	2,430.00	29,889,000
朝日工業社	2,500	3,260.00	8,150,000
明星工業	23,000	843.00	19,389,000
大気社	16,100	3,460.00	55,706,000
ダイダン	8,500	2,575.00	21,887,500
日比谷総合設備	14,200	1,846.00	26,213,200
東芝プラントシステム	27,600	2,292.00	63,259,200
日本製粉	37,800	1,901.00	71,857,800
日清製粉グループ本社	139,400	2,432.00	339,020,800
日東富士製粉	800	5,250.00	4,200,000
昭和産業	10,400	2,844.00	29,577,600
鳥越製粉	10,000	998.00	9,980,000
中部飼料	13,900	1,425.00	19,807,500
フィード・ワン	76,500	197.00	15,070,500
東洋精糖	1,900	1,189.00	2,259,100
日本甜菜製糖	6,500	1,930.00	12,545,000
三井製糖	9,000	3,020.00	27,180,000
塩水港精糖	13,500	252.00	3,402,000
日新製糖	5,500	2,228.00	12,254,000
L I F U L L	37,700	566.00	21,338,200
ジェイエイシーリクルートメント	8,800	2,350.00	20,680,000
日本M&Aセンター	75,100	3,195.00	239,944,500
メンバーズ	3,600	1,172.00	4,219,200
中広	1,200	708.00	849,600
タケエイ	11,300	781.00	8,825,300
E・Jホールディングス	1,400	1,344.00	1,881,600
トラスト・テック	5,300	3,825.00	20,272,500
コシダカホールディングス	29,000	1,490.00	43,210,000
アルトナー	1,700	968.00	1,645,600
パソナグループ	10,300	1,517.00	15,625,100
C D S	2,700	1,366.00	3,688,200
リンクアンドモチベーション	20,000	1,282.00	25,640,000
G C A	11,000	927.00	10,197,000
エス・エム・エス	42,800	1,990.00	85,172,000
パーソルホールディングス	100,100	2,383.00	238,538,300
リニカル	7,000	1,684.00	11,788,000
クックパッド	34,100	417.00	14,219,700

エスクリ	3,800	725.00	2,755,000
アイ・ケイ・ケイ	5,300	767.00	4,065,100
森永製菓	26,800	4,365.00	116,982,000
中村屋	2,800	4,615.00	12,922,000
江崎グリコ	31,800	5,600.00	178,080,000
名糖産業	5,500	1,515.00	8,332,500
井村屋グループ	4,500	3,170.00	14,265,000
不二家	6,300	2,475.00	15,592,500
山崎製パン	93,200	2,123.00	197,863,600
第一屋製パン	1,900	1,120.00	2,128,000
モロゾフ	1,800	5,610.00	10,098,000
亀田製菓	7,100	5,070.00	35,997,000
寿スピリッツ	11,000	4,500.00	49,500,000
カルビー	51,900	3,655.00	189,694,500
森永乳業	22,800	2,996.00	68,308,800
六甲バター	8,300	2,440.00	20,252,000
ヤクルト本社	66,300	8,900.00	590,070,000
明治ホールディングス	75,400	7,530.00	567,762,000
雪印メグミルク	27,500	2,735.00	75,212,500
プリマハム	16,000	2,354.00	37,664,000
日本ハム	49,300	4,120.00	203,116,000
林兼産業	4,000	681.00	2,724,000
丸大食品	12,100	2,013.00	24,357,300
S Foods	8,000	4,535.00	36,280,000
伊藤ハム米久ホールディングス	73,300	740.00	54,242,000
学情	4,400	1,658.00	7,295,200
スタジオアリス	5,500	2,466.00	13,563,000
シミックホールディングス	6,000	2,230.00	13,380,000
システナ	35,700	1,443.00	51,515,100
NJS	2,300	1,778.00	4,089,400
デジタルアーツ	5,500	5,060.00	27,830,000
新日鉄住金ソリューションズ	16,600	3,475.00	57,685,000
総合警備保障	43,100	4,700.00	202,570,000
キューブシステム	6,400	922.00	5,900,800
いちご	160,100	361.00	57,796,100
エイジア	2,200	1,375.00	3,025,000
日本駐車場開発	135,200	168.00	22,713,600
コア	4,700	1,277.00	6,001,900
カカクコム	81,700	2,099.00	171,488,300
アイロムグループ	3,700	1,748.00	6,467,600
セントケア・ホールディング	4,600	650.00	2,990,000
サイネックス	1,600	752.00	1,203,200
ルネサンス	5,300	2,444.00	12,953,200
ディップ	15,300	2,659.00	40,682,700
SBSホールディングス	11,200	1,504.00	16,844,800
オプトホールディング	6,700	2,979.00	19,959,300
新日本科学	13,200	559.00	7,378,800
ツクイ	25,500	1,030.00	26,265,000
キャリアデザインセンター	2,700	1,516.00	4,093,200
エムスリー	228,200	2,275.00	519,155,000



ツカダ・グローバルホールディング	6,900	617.00	4,257,300
プラス	800	651.00	520,800
アウトソーシング	56,700	1,581.00	89,642,700
ウェルネット	10,900	1,037.00	11,303,300
ワールドホールディングス	3,000	3,110.00	9,330,000
ディー・エヌ・エー	58,500	1,897.00	110,974,500
博報堂DYホールディングス	150,700	1,930.00	290,851,000
ぐるなび	17,100	917.00	15,680,700
エスアールジータカミヤ	12,900	644.00	8,307,600
ジャパンベストレスキューシステム	8,600	1,138.00	9,786,800
ファンコミュニケーションズ	29,800	660.00	19,668,000
ライク	4,300	1,628.00	7,000,400
ビジネス・ブレークスルー	5,100	396.00	2,019,600
WDBホールディングス	5,000	3,550.00	17,750,000
ティア	5,000	859.00	4,295,000
CDG	1,000	1,593.00	1,593,000
バリューコマース	7,300	2,201.00	16,067,300
インフォマート	59,400	1,264.00	75,081,600
サッポロホールディングス	41,700	2,299.00	95,868,300
アサヒグループホールディングス	238,600	4,798.00	1,144,802,800
キリンホールディングス	515,400	2,702.00	1,392,610,800
宝ホールディングス	85,300	1,667.00	142,195,100
オエノンホールディングス	32,300	400.00	12,920,000
養命酒製造	3,400	2,386.00	8,112,400
コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールディングス	87,200	2,952.00	257,414,400
サントリー食品インターナショナル	76,200	4,460.00	339,852,000
ダイドーグループホールディングス	5,800	5,630.00	32,654,000
伊藤園	37,700	5,120.00	193,024,000
キーコーヒー	11,200	2,085.00	23,352,000
ユニカフェ	3,400	1,268.00	4,311,200
ジャパンフーズ	1,600	1,395.00	2,232,000
日清オイリオグループ	13,400	3,275.00	43,885,000
不二製油グループ本社	30,900	3,410.00	105,369,000
かどや製油	1,200	6,150.00	7,380,000
J-オイルミルズ	5,900	3,755.00	22,154,500
ローソン	28,200	6,770.00	190,914,000
サンエー	8,500	5,010.00	42,585,000
カワチ薬品	8,700	2,158.00	18,774,600
エービーシー・マート	20,300	6,480.00	131,544,000
ハードオフコーポレーション	4,900	953.00	4,669,700
高千穂交易	4,300	1,012.00	4,351,600
アスクル	9,700	3,300.00	32,010,000
ゲオホールディングス	18,600	1,643.00	30,559,800
アダストリア	17,200	1,723.00	29,635,600
ジーフット	6,800	746.00	5,072,800
シー・ヴィ・エス・バイエリア	1,500	765.00	1,147,500
伊藤忠食品	2,700	5,750.00	15,525,000
くらコーポレーション	6,500	6,720.00	43,680,000
キャンドウ	5,400	1,683.00	9,088,200

エレマテック	5,300	2,580.00	13,674,000
パルグループホールディングス	5,700	2,870.00	16,359,000
JALUX	3,100	2,829.00	8,769,900
エディオン	43,400	1,222.00	53,034,800
あらた	5,600	5,040.00	28,224,000
サーラコーポレーション	22,700	657.00	14,913,900
ワッツ	3,700	886.00	3,278,200
トーメンデバイス	1,700	2,591.00	4,404,700
ハローズ	4,100	2,631.00	10,787,100
J Pホールディングス	34,100	296.00	10,093,600
あみやき亭	2,400	4,260.00	10,224,000
東京エレクトロン デバイス	4,100	1,817.00	7,449,700
ひらまつ	15,400	435.00	6,699,000
フィールズ	8,600	911.00	7,834,600
双日	661,600	394.00	260,670,400
アルフレッサ ホールディングス	124,200	2,916.00	362,167,200
大黒天物産	2,700	4,310.00	11,637,000
ハニーズホールディングス	10,800	917.00	9,903,600
ファーマライズホールディングス	2,500	595.00	1,487,500
キッコーマン	82,000	6,530.00	535,460,000
味の素	262,000	1,835.00	480,770,000
キュービー	63,500	2,588.00	164,338,000
ハウス食品グループ本社	43,400	3,350.00	145,390,000
カゴメ	45,700	3,045.00	139,156,500
焼津水産化学工業	5,500	1,065.00	5,857,500
アリアケジャパン	10,400	10,610.00	110,344,000
ピエトロ	1,500	1,635.00	2,452,500
エバラ食品工業	2,400	2,146.00	5,150,400
ニチレイ	54,200	2,895.00	156,909,000
横浜冷凍	29,200	883.00	25,783,600
東洋水産	62,500	4,230.00	264,375,000
イトアンド	3,600	1,662.00	5,983,200
大冷	1,300	1,941.00	2,523,300
ヨシムラ・フード・ホールディングス	2,300	890.00	2,047,000
日清食品ホールディングス	44,700	7,430.00	332,121,000
永谷園ホールディングス	5,800	2,908.00	16,866,400
一正蒲鉾	4,500	992.00	4,464,000
フジッコ	12,400	2,268.00	28,123,200
ロック・フィールド	12,300	1,790.00	22,017,000
日本たばこ産業	657,800	2,869.50	1,887,557,100
ケンコーマヨネーズ	7,600	2,563.00	19,478,800
わらべや日洋ホールディングス	7,500	1,892.00	14,190,000
なとり	6,300	1,804.00	11,365,200
イフジ産業	1,900	765.00	1,453,500
ピククルスコーポレーション	2,200	2,320.00	5,104,000
北の達人コーポレーション	34,800	655.00	22,794,000
ユーグレナ	45,400	734.00	33,323,600
片倉工業	13,600	1,272.00	17,299,200
ゲンゼ	8,900	5,260.00	46,814,000
ヒューリック	233,700	1,000.00	233,700,000

神栄	1,600	1,176.00	1,881,600
ラサ商事	4,900	981.00	4,806,900
アルペン	8,600	1,955.00	16,813,000
ハブ	2,800	899.00	2,517,200
ラクーン	6,600	583.00	3,847,800
クオールホールディングス	12,400	2,414.00	29,933,600
アルコニックス	11,900	1,446.00	17,207,400
神戸物産	8,500	6,270.00	53,295,000
ソリトンシステムズ	6,200	976.00	6,051,200
ジーンズ	7,600	6,060.00	46,056,000
ビックカメラ	59,700	1,426.00	85,132,200
DCMホールディングス	60,300	1,055.00	63,616,500
ペッパーフードサービス	8,800	3,635.00	31,988,000
Monotaro	70,700	3,040.00	214,928,000
東京一番フーズ	2,300	647.00	1,488,100
DDホールディングス	2,400	2,629.00	6,309,600
あいホールディングス	17,900	2,327.00	41,653,300
ディー・ブイエックス	4,000	1,402.00	5,608,000
きちり	3,000	806.00	2,418,000
アークランドサービスホールディングス	8,200	2,190.00	17,958,000
J・フロントリテイリング	133,500	1,551.00	207,058,500
ドトール・日レスホールディングス	19,700	2,002.00	39,439,400
マツモトキヨシホールディングス	46,200	4,225.00	195,195,000
ブロンコビリー	5,800	3,370.00	19,546,000
ZOZO	109,800	3,135.00	344,223,000
トレジャー・ファクトリー	3,300	722.00	2,382,600
物語コーポレーション	3,200	10,140.00	32,448,000
ココカラファイン	11,700	6,700.00	78,390,000
三越伊勢丹ホールディングス	209,100	1,258.00	263,047,800
東洋紡	43,900	1,735.00	76,166,500
ユニチカ	34,600	632.00	21,867,200
富士紡ホールディングス	6,600	3,385.00	22,341,000
日清紡ホールディングス	73,800	1,303.00	96,161,400
倉敷紡績	12,000	2,694.00	32,328,000
ダイワボウホールディングス	9,500	6,860.00	65,170,000
シキボウ	5,800	1,246.00	7,226,800
日東紡績	16,800	2,503.00	42,050,400
トヨタ紡織	33,100	2,019.00	66,828,900
マクニカ・富士エレホールディングス	21,400	1,828.00	39,119,200
Hamee	2,800	1,692.00	4,737,600
ラクト・ジャパン	2,400	7,140.00	17,136,000
ウエルシアホールディングス	29,600	5,910.00	174,936,000
クリエイトSDホールディングス	16,500	2,813.00	46,414,500
バイタルケーエスケー・ホールディングス	21,000	1,203.00	25,263,000
八洲電機	8,700	876.00	7,621,200
メディアスホールディングス	6,100	842.00	5,136,200
UKCホールディングス	7,200	2,414.00	17,380,800
ジューテックホールディングス	2,500	1,039.00	2,597,500

丸善CHIホールディングス	13,000	351.00	4,563,000
大光	2,800	699.00	1,957,200
OCHIホールディングス	3,200	1,324.00	4,236,800
TOKAIホールディングス	59,100	1,028.00	60,754,800
黒谷	1,800	505.00	909,000
ミサワ	1,800	468.00	842,400
ティーライフ	1,500	1,052.00	1,578,000
Cominix	1,700	868.00	1,475,600
エー・ピーカンパニー	2,100	597.00	1,253,700
三洋貿易	5,600	1,935.00	10,836,000
チムニー	3,400	2,869.00	9,754,600
シュッピン	6,700	1,365.00	9,145,500
ビューティガレージ	1,600	2,148.00	3,436,800
ウイン・パートナーズ	8,100	1,172.00	9,493,200
ネクステージ	17,100	930.00	15,903,000
ジョイフル本田	32,700	1,657.00	54,183,900
鳥貴族	3,700	2,193.00	8,114,100
キリン堂ホールディングス	4,000	1,579.00	6,316,000
ホットランド	5,800	1,334.00	7,737,200
すかいらーくホールディングス	104,200	1,686.00	175,681,200
綿半ホールディングス	4,200	2,592.00	10,886,400
日本毛織	36,600	883.00	32,317,800
ダイトウボウ	18,300	95.00	1,738,500
トーア紡コーポレーション	4,700	544.00	2,556,800
ガイドーリミテッド	13,100	371.00	4,860,100
ヨシックス	1,800	2,796.00	5,032,800
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	37,100	1,276.00	47,339,600
三栄建築設計	4,500	1,672.00	7,524,000
スター・マイカ	5,200	1,608.00	8,361,600
野村不動産ホールディングス	74,500	2,133.00	158,908,500
三重交通グループホールディングス	22,700	518.00	11,758,600
サムティ	15,500	1,637.00	25,373,500
ディア・ライフ	13,400	511.00	6,847,400
コーセーアールイー	2,500	872.00	2,180,000
エー・ディー・ワークス	149,400	38.00	5,677,200
日本商業開発	6,300	1,724.00	10,861,200
プレサンスコーポレーション	15,500	1,332.00	20,646,000
ユニゾホールディングス	15,400	2,059.00	31,708,600
THEグローバル社	5,300	806.00	4,271,800
日本管理センター	7,400	1,231.00	9,109,400
サンセイランディック	2,900	1,174.00	3,404,600
エストラスト	1,600	831.00	1,329,600
フージャースホールディングス	27,200	664.00	18,060,800
オープンハウス	18,200	4,950.00	90,090,000
東急不動産ホールディングス	271,000	650.00	176,150,000
飯田グループホールディングス	93,400	1,960.00	183,064,000
イーランド	1,800	774.00	1,393,200
ムゲンエステート	7,700	672.00	5,174,400
帝国繊維	12,500	2,604.00	32,550,000

日本コース工業	95,800	111.00	10,633,800
ゴルフダイジェスト・オンライン	4,500	965.00	4,342,500
ミタチ産業	2,800	839.00	2,349,200
B E E N O S	2,600	1,817.00	4,724,200
あさひ	8,300	1,393.00	11,561,900
日本調剤	4,000	3,575.00	14,300,000
コスモス薬品	5,600	23,920.00	133,952,000
シップヘルスケアホールディングス	23,300	4,115.00	95,879,500
トーエル	5,400	934.00	5,043,600
一六堂	2,400	374.00	897,600
ソフトクリエイイトホールディングス	5,400	1,697.00	9,163,800
オンリー	1,800	906.00	1,630,800
セブン&アイ・ホールディングス	468,600	4,848.00	2,271,772,800
薬王堂	4,900	3,710.00	18,179,000
クリエイイト・レストランツ・ホールディングス	30,100	1,248.00	37,564,800
明治電機工業	3,800	1,900.00	7,220,000
ツルハホールディングス	24,200	12,850.00	310,970,000
デリカフーズホールディングス	2,100	1,522.00	3,196,200
スターティアホールディングス	2,500	634.00	1,585,000
サンマルクホールディングス	8,000	2,580.00	20,640,000
フェリシモ	2,800	1,310.00	3,668,000
トリドールホールディングス	13,800	2,057.00	28,386,600
帝人	97,600	2,050.00	200,080,000
東レ	862,500	808.60	697,417,500
クラレ	187,600	1,580.00	296,408,000
旭化成	741,500	1,538.00	1,140,427,000
サカイオーベックス	2,900	2,223.00	6,446,700
T O K Y O B A S E	9,900	583.00	5,771,700
稲葉製作所	6,300	1,354.00	8,530,200
宮地エンジニアリンググループ	3,200	2,794.00	8,940,800
トーカロ	31,200	1,015.00	31,668,000
アルファ	4,000	1,413.00	5,652,000
S U M C O	124,000	1,606.00	199,144,000
川田テクノロジーズ	2,200	6,750.00	14,850,000
R S T e c h n o l o g i e s	2,200	4,740.00	10,428,000
ピーロット	1,800	1,263.00	2,273,400
ファーストブラザーズ	3,000	1,229.00	3,687,000
ハウズドゥ	4,100	2,064.00	8,462,400
シーアールイー	3,700	893.00	3,304,100
プロパティエージェント	900	1,045.00	940,500
ケイアイスター不動産	4,000	2,142.00	8,568,000
アグレ都市デザイン	1,200	813.00	975,600
グッドコムアセット	1,900	1,879.00	3,570,100
ジェイ・エス・ピー	400	4,940.00	1,976,000
住江織物	3,000	2,881.00	8,643,000
日本フェルト	6,200	499.00	3,093,800
イチカワ	1,600	1,612.00	2,579,200
エコナックホールディングス	21,200	119.00	2,522,800
日東製網	1,300	1,622.00	2,108,600

芦森工業	2,300	2,103.00	4,836,900
アツギ	7,900	1,133.00	8,950,700
ウイルプラスホールディングス	1,000	925.00	925,000
ジャパンミート	4,200	2,063.00	8,664,600
コメダホールディングス	20,800	2,297.00	47,777,600
サツドラホールディングス	1,800	2,021.00	3,637,800
ダイユー・リックホールディングス	5,300	1,076.00	5,702,800
バロックジャパンリミテッド	9,000	946.00	8,514,000
クスリのアオキホールディングス	8,900	8,410.00	74,849,000
ダイニック	4,500	903.00	4,063,500
共和レザー	6,900	920.00	6,348,000
力の源ホールディングス	2,400	1,029.00	2,469,600
スシローグローバルホールディングス	12,300	5,920.00	72,816,000
LIXILビバ	14,200	1,666.00	23,657,200
セーレン	27,400	1,783.00	48,854,200
ソトー	4,300	995.00	4,278,500
東海染工	1,700	1,300.00	2,210,000
小松マテール	18,200	1,009.00	18,363,800
ワコールホールディングス	32,400	3,085.00	99,954,000
ホギメディカル	15,000	3,425.00	51,375,000
レナウン	32,400	119.00	3,855,600
クラウドシアホールディングス	2,700	513.00	1,385,100
T S Iホールディングス	41,000	743.00	30,463,000
マツオカコーポレーション	2,800	3,175.00	8,890,000
T I S	37,100	5,130.00	190,323,000
ネオス	3,300	1,000.00	3,300,000
電算システム	4,300	2,111.00	9,077,300
グリー	59,800	494.00	29,541,200
コーエーテクモホールディングス	22,800	1,851.00	42,202,800
三菱総合研究所	4,400	4,075.00	17,930,000
ボルテージ	2,200	742.00	1,632,400
電算	1,200	2,198.00	2,637,600
A G S	6,200	755.00	4,681,000
ファインデックス	9,300	743.00	6,909,900
ヒト・コミュニケーションズ	2,500	1,811.00	4,527,500
ブレインパッド	2,300	6,640.00	15,272,000
K L a b	19,900	1,055.00	20,994,500
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	8,100	2,614.00	21,173,400
イーブクイニシアティブジャパン	1,800	2,356.00	4,240,800
ネクソン	282,900	1,385.00	391,816,500
アイスタイル	28,300	1,161.00	32,856,300
エムアップ	3,700	2,597.00	9,608,900
エイチーム	6,900	1,826.00	12,599,400
テクノスジャパン	10,000	964.00	9,640,000
e n i s h	3,800	649.00	2,466,200
コロブラ	31,800	699.00	22,228,200
オルトプラス	6,600	509.00	3,359,400
ブロードリーフ	55,200	720.00	39,744,000
クロス・マーケティンググループ	3,100	507.00	1,571,700

デジタルハーツホールディングス	5,900	1,578.00	9,310,200
メディアドゥホールディングス	3,600	2,280.00	8,208,000
じげん	11,800	761.00	8,979,800
ブイキューブ	5,900	563.00	3,321,700
サイバーリンクス	1,700	1,117.00	1,898,900
ディー・エル・イー	7,300	331.00	2,416,300
フィックスターズ	10,600	1,428.00	15,136,800
VOYAGE GROUP	5,800	1,376.00	7,980,800
オブティム	1,900	4,360.00	8,284,000
セレス	3,600	2,039.00	7,340,400
特種東海製紙	6,500	4,455.00	28,957,500
ベリサーブ	1,500	4,760.00	7,140,000
ティーガイア	11,100	2,738.00	30,391,800
セック	1,500	5,100.00	7,650,000
日本アジアグループ	11,800	408.00	4,814,400
豆蔵ホールディングス	8,300	886.00	7,353,800
テクマトリックス	5,500	2,158.00	11,869,000
プロシップ	1,600	2,666.00	4,265,600
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	268,400	216.00	57,974,400
GMOペイメントゲートウェイ	18,300	6,370.00	116,571,000
ザッパラス	5,400	397.00	2,143,800
システムリサーチ	1,500	5,030.00	7,545,000
インターネットイニシアティブ	18,100	2,169.00	39,258,900
さくらインターネット	13,200	679.00	8,962,800
ヴィンクス	3,100	1,469.00	4,553,900
GMOクラウド	2,400	3,650.00	8,760,000
SRAホールディングス	5,900	3,320.00	19,588,000
MINORIソリューションズ	2,100	1,383.00	2,904,300
システムインテグレータ	1,600	2,491.00	3,985,600
朝日ネット	10,100	503.00	5,080,300
eBASE	2,900	1,716.00	4,976,400
アバント	3,000	1,483.00	4,449,000
アドソル日進	4,300	2,102.00	9,038,600
フリービット	7,400	972.00	7,192,800
コムチュア	5,600	4,030.00	22,568,000
サイバーコム	1,900	1,901.00	3,611,900
アステリア	5,500	1,010.00	5,555,000
王子ホールディングス	500,400	793.00	396,817,200
日本製紙	53,300	2,000.00	106,600,000
三菱製紙	16,900	617.00	10,427,300
北越コーポレーション	66,400	567.00	37,648,800
中越パルプ工業	4,800	1,540.00	7,392,000
巴川製紙所	3,500	1,315.00	4,602,500
大王製紙	47,400	1,520.00	72,048,000
阿波製紙	2,800	598.00	1,674,400
マークライNZ	3,800	1,737.00	6,600,600
メディカル・データ・ビジョン	9,800	1,899.00	18,610,200
gumi	12,900	656.00	8,462,400
ショーケース・ティービー	2,300	972.00	2,235,600

モバイルファクトリー	3,100	1,780.00	5,518,000	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	4,900	1,605.00	7,864,500	
P C Iホールディングス	1,900	2,815.00	5,348,500	
パイブドHD	1,800	1,085.00	1,953,000	
アイビーシー	1,800	1,502.00	2,703,600	
ネオジャパン	2,600	981.00	2,550,600	
P R T I M E S	700	2,432.00	1,702,400	
ランドコンピュータ	1,100	1,108.00	1,218,800	
オープンドア	4,400	2,868.00	12,619,200	
マイネット	3,500	1,137.00	3,979,500	
アカツキ	2,900	4,675.00	13,557,500	
ベネフィットジャパン	600	860.00	516,000	
U b i c o mホールディングス	1,600	1,073.00	1,716,800	
L I N E	33,900	4,020.00	136,278,000	
カナミックネットワーク	1,700	1,992.00	3,386,400	
ノムラシステムコーポレーション	900	1,081.00	972,900	
レンゴー	114,600	939.00	107,609,400	
トーモク	6,800	1,986.00	13,504,800	
ザ・パック	8,400	3,385.00	28,434,000	
シンクロ・フード	3,800	786.00	2,986,800	
オークネット	5,800	1,251.00	7,255,800	
A O I T Y O H O L D I N G S	12,100	1,370.00	16,577,000	
マクロミル	14,000	2,344.00	32,816,000	
ビーグリー	2,100	1,411.00	2,963,100	
オロ	1,100	5,680.00	6,248,000	
昭和電工	73,900	5,640.00	416,796,000	
住友化学	875,200	600.00	525,120,000	
住友精化	5,000	6,040.00	30,200,000	
日産化学	68,200	5,900.00	402,380,000	
ラサ工業	4,200	2,068.00	8,685,600	
クレハ	10,200	8,040.00	82,008,000	
多木化学	1,600	8,000.00	12,800,000	
テイカ	9,100	2,509.00	22,831,900	
石原産業	21,300	1,518.00	32,333,400	
片倉コープアグリ	2,800	1,199.00	3,357,200	
日東エフシー	6,900	748.00	5,161,200	
日本曹達	16,600	3,220.00	53,452,000	
東ソー	171,800	1,611.00	276,769,800	
トクヤマ	34,500	2,880.00	99,360,000	
セントラル硝子	24,200	2,752.00	66,598,400	
東亜合成	69,800	1,159.00	80,898,200	
大阪ソーダ	11,800	2,777.00	32,768,600	
関東電化工業	28,400	1,114.00	31,637,600	
デンカ	43,700	3,910.00	170,867,000	
イビデン	69,500	1,460.00	101,470,000	
信越化学工業	195,900	9,172.00	1,796,794,800	
日本カーバイド工業	3,800	1,694.00	6,437,200	
堺化学工業	8,200	2,761.00	22,640,200	
第一稀元素化学工業	9,100	1,239.00	11,274,900	



エア・ウォーター	98,000	1,932.00	189,336,000
大陽日酸	91,600	1,662.00	152,239,200
日本化学工業	4,400	3,315.00	14,586,000
東邦アセチレン	1,700	1,466.00	2,492,200
日本パーカライジング	60,700	1,434.00	87,043,800
高圧ガス工業	17,600	836.00	14,713,600
チタン工業	1,300	2,487.00	3,233,100
四国化成工業	17,100	1,392.00	23,803,200
戸田工業	2,300	2,764.00	6,357,200
ステラ ケミファ	6,000	3,735.00	22,410,000
保土谷化学工業	3,900	2,988.00	11,653,200
日本触媒	18,700	8,070.00	150,909,000
大日精化工業	9,200	3,370.00	31,004,000
カネカ	32,100	5,010.00	160,821,000
協和発酵キリン	142,200	2,011.00	285,964,200
三菱瓦斯化学	98,000	2,126.00	208,348,000
三井化学	108,100	2,648.00	286,248,800
J S R	119,600	1,905.00	227,838,000
東京応化工業	19,100	3,175.00	60,642,500
大阪有機化学工業	10,300	1,512.00	15,573,600
三菱ケミカルホールディングス	796,300	979.30	779,816,590
K Hネオケム	16,800	3,815.00	64,092,000
ダイセル	160,300	1,265.00	202,779,500
住友ベークライト	19,300	4,370.00	84,341,000
積水化学工業	243,000	1,883.00	457,569,000
日本ゼオン	100,300	1,183.00	118,654,900
アイカ工業	33,400	4,180.00	139,612,000
宇部興産	59,900	2,717.00	162,748,300
積水樹脂	18,300	2,059.00	37,679,700
タキロンシーアイ	24,000	583.00	13,992,000
旭有機材	7,000	2,515.00	17,605,000
日立化成	58,700	1,986.00	116,578,200
ニチパン	5,800	2,431.00	14,099,800
リケンテクノス	25,600	544.00	13,926,400
大倉工業	5,600	2,004.00	11,222,400
積水化成品工業	14,900	941.00	14,020,900
群栄化学工業	2,700	3,095.00	8,356,500
タイガースポリマー	5,800	720.00	4,176,000
ミライアル	3,900	1,025.00	3,997,500
ダイキアクシス	3,900	1,271.00	4,956,900
ダイキョーニシカワ	23,500	1,135.00	26,672,500
竹本容器	1,900	2,917.00	5,542,300
森六ホールディングス	5,900	2,904.00	17,133,600
日本化薬	77,200	1,289.00	99,510,800
カーリットホールディングス	11,000	867.00	9,537,000
E P Sホールディングス	16,400	2,253.00	36,949,200
ソルクシーズ	4,800	936.00	4,492,800
レグス	2,700	1,238.00	3,342,600
プレステージ・インターナショナル	22,500	1,355.00	30,487,500
フェイス	3,900	1,179.00	4,598,100

ハイマックス	1,500	1,876.00	2,814,000
アミューズ	7,200	2,981.00	21,463,200
野村総合研究所	70,800	5,450.00	385,860,000
ドリームインキュベータ	3,600	1,943.00	6,994,800
サイバネットシステム	9,200	673.00	6,191,600
クイック	6,700	1,894.00	12,689,800
T A C	6,500	261.00	1,696,500
C Eホールディングス	2,800	784.00	2,195,200
ケネディクス	101,400	594.00	60,231,600
日本システム技術	1,800	2,301.00	4,141,800
電通	132,100	5,410.00	714,661,000
インテージホールディングス	13,100	935.00	12,248,500
テイクアンドギヴ・ニーズ	5,100	2,006.00	10,230,600
東邦システムサイエンス	3,700	866.00	3,204,200
ぴあ	3,600	5,310.00	19,116,000
イオンファンタジー	3,500	4,220.00	14,770,000
ソースネクスト	16,600	1,269.00	21,065,400
シーティーエス	10,700	760.00	8,132,000
ネクシィーズグループ	3,300	2,018.00	6,659,400
メディカルシステムネットワーク	12,900	480.00	6,192,000
日本精化	9,800	1,191.00	11,671,800
扶桑化学工業	11,300	2,354.00	26,600,200
トリケミカル研究所	2,700	4,570.00	12,339,000
F I G	9,900	320.00	3,168,000
A D E K A	51,100	1,857.00	94,892,700
日油	46,000	3,440.00	158,240,000
ミヨシ油脂	4,400	1,263.00	5,557,200
新日本理化	18,800	215.00	4,042,000
ハリマ化成グループ	9,200	945.00	8,694,000
花王	279,100	8,529.00	2,380,443,900
第一工業製薬	4,500	3,265.00	14,692,500
石原ケミカル	2,800	2,154.00	6,031,200
日華化学	3,700	1,208.00	4,469,600
ニイタカ	1,700	1,808.00	3,073,600
三洋化成工業	7,500	5,350.00	40,125,000
武田薬品工業	418,100	4,394.00	1,837,131,400
アステラス製薬	1,116,300	1,828.50	2,041,154,550
大日本住友製薬	84,100	2,539.00	213,529,900
塩野義製薬	160,000	7,236.00	1,157,760,000
田辺三菱製薬	138,500	1,752.00	242,652,000
わかもと製薬	13,600	281.00	3,821,600
あすか製薬	12,900	1,492.00	19,246,800
日本新薬	29,700	6,910.00	205,227,000
ピオフェルミン製薬	1,800	2,785.00	5,013,000
中外製薬	118,400	6,740.00	798,016,000
科研製薬	20,400	5,760.00	117,504,000
エーザイ	135,900	10,270.00	1,395,693,000
理研ピタミン	4,300	3,850.00	16,555,000
ロート製薬	62,300	3,795.00	236,428,500
小野薬品工業	268,000	2,929.00	784,972,000

久光製薬	33,500	7,100.00	237,850,000
有機合成薬品工業	7,800	259.00	2,020,200
持田製薬	7,900	8,660.00	68,414,000
参天製薬	215,200	1,728.00	371,865,600
扶桑薬品工業	3,900	2,741.00	10,689,900
日本ケミファ	1,500	4,450.00	6,675,000
ツムラ	40,600	3,610.00	146,566,000
日医工	29,900	1,564.00	46,763,600
テルモ	174,000	6,840.00	1,190,160,000
みらかホールディングス	32,300	2,823.00	91,182,900
キッセイ薬品工業	20,100	3,320.00	66,732,000
生化学工業	22,000	1,652.00	36,344,000
栄研化学	18,400	2,406.00	44,270,400
日水製薬	4,800	1,309.00	6,283,200
鳥居薬品	6,100	2,564.00	15,640,400
JCRファーマ	8,000	5,810.00	46,480,000
東和薬品	5,500	8,640.00	47,520,000
富士製薬工業	7,700	1,852.00	14,260,400
沢井製薬	22,800	5,870.00	133,836,000
ゼリア新薬工業	24,300	2,223.00	54,018,900
第一三共	324,800	4,467.00	1,450,881,600
キョーリン製薬ホールディングス	31,700	2,550.00	80,835,000
大幸薬品	6,000	1,877.00	11,262,000
ダイト	6,600	3,635.00	23,991,000
大塚ホールディングス	216,200	5,347.00	1,156,021,400
大正製薬ホールディングス	25,400	12,690.00	322,326,000
ペプチドリーム	51,900	4,260.00	221,094,000
大日本塗料	13,600	1,211.00	16,469,600
日本ペイントホールディングス	91,700	3,680.00	337,456,000
関西ペイント	124,900	1,792.00	223,820,800
神東塗料	8,800	206.00	1,812,800
中国塗料	34,100	1,021.00	34,816,100
日本特殊塗料	7,500	2,352.00	17,640,000
藤倉化成	15,000	641.00	9,615,000
太陽ホールディングス	9,200	4,250.00	39,100,000
DIC	50,300	3,550.00	178,565,000
サカタインクス	24,200	1,256.00	30,395,200
東洋インキSCホールディングス	23,500	2,707.00	63,614,500
T&K TOKA	8,000	1,092.00	8,736,000
アルプス技研	9,500	2,442.00	23,199,000
サニックス	17,200	265.00	4,558,000
ダイオーズ	2,100	1,312.00	2,755,200
日本空調サービス	11,300	790.00	8,927,000
オリエンタルランド	128,100	10,765.00	1,378,996,500
フォーカスシステムズ	6,300	967.00	6,092,100
ダスキン	29,200	2,634.00	76,912,800
パーク24	65,300	3,145.00	205,368,500
明光ネットワークジャパン	13,700	914.00	12,521,800
ファルコホールディングス	5,500	1,725.00	9,487,500
クレスコ	2,500	3,235.00	8,087,500

フジ・メディア・ホールディングス	115,600	1,962.00	226,807,200
秀英予備校	2,300	489.00	1,124,700
田谷	1,900	658.00	1,250,200
ラウンドワン	33,700	1,418.00	47,786,600
リゾートトラスト	45,900	1,703.00	78,167,700
オービック	35,100	10,600.00	372,060,000
ジャストシステム	18,100	2,472.00	44,743,200
TDCソフト	9,700	1,177.00	11,416,900
ヤフー	803,200	380.00	305,216,000
ビー・エム・エル	13,900	3,450.00	47,955,000
ワタベウェディング	1,800	528.00	950,400
トレンドマイクロ	59,300	6,910.00	409,763,000
りらいあコミュニケーションズ	17,100	1,375.00	23,512,500
インフォメーション・ディベロプメント	3,500	1,571.00	5,498,500
リソー教育	18,300	1,016.00	18,592,800
日本オラクル	18,000	8,260.00	148,680,000
早稲田アカデミー	1,600	1,929.00	3,086,400
アルファシステムズ	3,700	2,807.00	10,385,900
フューチャー	15,100	1,665.00	25,141,500
CAC Holdings	8,400	1,035.00	8,694,000
ソフトバンク・テクノロジー	4,700	3,005.00	14,123,500
トーセ	3,000	995.00	2,985,000
ユー・エス・エス	132,500	2,016.00	267,120,000
オービックビジネスコンサルタント	5,600	9,450.00	52,920,000
伊藤忠テクノソリューションズ	50,700	2,256.00	114,379,200
アイティフォー	13,500	960.00	12,960,000
東京個別指導学院	3,800	1,556.00	5,912,800
東計電算	1,700	3,170.00	5,389,000
サイバーエージェント	66,800	5,290.00	353,372,000
楽天	505,600	821.30	415,249,280
エクスネット	1,800	1,073.00	1,931,400
クリーク・アンド・リバー社	5,500	1,137.00	6,253,500
テー・オー・ダブリュー	10,300	841.00	8,662,300
大塚商会	60,300	3,875.00	233,662,500
サイボウズ	13,000	639.00	8,307,000
ソフトブレーン	8,800	495.00	4,356,000
セントラルスポーツ	4,100	4,220.00	17,302,000
パラカ	2,800	2,078.00	5,818,400
電通国際情報サービス	6,900	3,990.00	27,531,000
デジタルガレージ	20,100	3,270.00	65,727,000
イーエムシステムズ	7,700	1,182.00	9,101,400
ウェザーニューズ	3,800	3,340.00	12,692,000
C I J	8,700	749.00	6,516,300
東洋ビジネスエンジニアリング	1,100	2,187.00	2,405,700
日本エンタープライズ	11,500	232.00	2,668,000
WOWOW	5,400	3,415.00	18,441,000
スカラ	9,000	1,031.00	9,279,000
フルキャストホールディングス	10,800	2,350.00	25,380,000
エン・ジャパン	9,200	5,390.00	49,588,000

富士フイルムホールディングス	235,800	4,808.00	1,133,726,400	
コニカミノルタ	265,700	1,158.00	307,680,600	
資生堂	225,600	7,583.00	1,710,724,800	
ライオン	158,100	2,167.00	342,602,700	
高砂香料工業	7,100	3,745.00	26,589,500	
マンダム	22,100	3,410.00	75,361,000	
ミルボン	14,000	4,865.00	68,110,000	
ファンケル	27,600	4,810.00	132,756,000	
コーセー	19,200	19,430.00	373,056,000	
コタ	5,500	1,530.00	8,415,000	
シーズ・ホールディングス	13,700	3,685.00	50,484,500	
シーボン	1,400	2,707.00	3,789,800	
ポーラ・オルビスホールディングス	48,500	3,640.00	176,540,000	
ノエビアホールディングス	7,200	5,420.00	39,024,000	
アジュバンコスメジャパン	2,500	967.00	2,417,500	
エステー	8,100	2,003.00	16,224,300	
アグロ カネショウ	4,600	2,331.00	10,722,600	
コニシ	18,700	1,668.00	31,191,600	
長谷川香料	13,500	2,145.00	28,957,500	
星光PMC	7,600	1,010.00	7,676,000	
小林製薬	31,800	7,580.00	241,044,000	
荒川化学工業	10,200	1,726.00	17,605,200	
メック	7,800	1,721.00	13,423,800	
日本高純度化学	3,000	2,345.00	7,035,000	
タカラバイオ	29,700	3,010.00	89,397,000	
JCU	13,700	2,569.00	35,195,300	
新田ゼラチン	7,800	804.00	6,271,200	
OATアグリオ	1,600	3,225.00	5,160,000	
デクセリアルズ	29,200	1,063.00	31,039,600	
アース製薬	8,600	5,260.00	45,236,000	
北興化学工業	11,600	602.00	6,983,200	
大成ラミック	3,400	3,075.00	10,455,000	
クミアイ化学工業	46,900	773.00	36,253,700	
日本農薬	27,200	669.00	18,196,800	
昭和シェル石油	106,200	2,461.00	261,358,200	
富士興産	4,300	618.00	2,657,400	
ニチレキ	14,500	1,118.00	16,211,000	
ユシロ化学工業	6,300	1,431.00	9,015,300	
ビービー・カストロール	4,100	1,542.00	6,322,200	
富士石油	27,600	467.00	12,889,200	
MORESCO	4,100	1,611.00	6,605,100	
出光興産	95,300	6,000.00	571,800,000	
JXTGホールディングス	1,811,500	798.10	1,445,758,150	
コスモエネルギーホールディングス	32,900	4,585.00	150,846,500	
横浜ゴム	65,700	2,266.00	148,876,200	
東洋ゴム工業	58,200	1,862.00	108,368,400	
ブリヂストン	348,900	4,220.00	1,472,358,000	
住友ゴム工業	101,900	1,608.00	163,855,200	
藤倉ゴム工業	9,900	549.00	5,435,100	
オカモト	8,000	5,240.00	41,920,000	

アキレス	8,600	2,248.00	19,332,800
フコク	5,000	928.00	4,640,000
ニッタ	11,700	4,050.00	47,385,000
クリエートメディック	3,800	1,193.00	4,533,400
住友理工	22,000	1,047.00	23,034,000
三ツ星ベルト	13,600	2,919.00	39,698,400
パンドー化学	21,600	1,242.00	26,827,200
A G C	114,500	4,440.00	508,380,000
日本板硝子	57,400	1,196.00	68,650,400
石塚硝子	1,600	2,397.00	3,835,200
有沢製作所	19,100	925.00	17,667,500
日本山村硝子	4,700	1,773.00	8,333,100
日本電気硝子	49,100	3,440.00	168,904,000
オハラ	4,500	2,793.00	12,568,500
住友大阪セメント	21,500	4,580.00	98,470,000
太平洋セメント	71,700	3,380.00	242,346,000
リソルホールディングス	1,200	4,300.00	5,160,000
日本ヒューム	11,400	946.00	10,784,400
日本コンクリート工業	24,400	324.00	7,905,600
三谷セキサン	5,900	2,712.00	16,000,800
アジアパイルホールディングス	14,600	713.00	10,409,800
東海カーボン	103,100	2,093.00	215,788,300
日本カーボン	5,500	7,870.00	43,285,000
東洋炭素	6,600	3,200.00	21,120,000
ノリタケカンパニーリミテド	6,200	6,230.00	38,626,000
T O T O	87,300	4,580.00	399,834,000
日本碍子	138,500	1,686.00	233,511,000
日本特殊陶業	95,700	2,966.00	283,846,200
ダントーホールディングス	8,800	130.00	1,144,000
M A R U W A	3,900	6,420.00	25,038,000
品川リフラクトリーズ	3,000	4,800.00	14,400,000
黒崎播磨	2,200	8,210.00	18,062,000
ヨータイ	9,100	842.00	7,662,200
イソライト工業	5,800	531.00	3,079,800
東京窯業	14,400	464.00	6,681,600
ニッカトー	5,200	1,113.00	5,787,600
フジインコーポレーテッド	10,100	2,722.00	27,492,200
クニミネ工業	3,000	1,001.00	3,003,000
エーアンドエーマテリアル	2,400	1,127.00	2,704,800
ニチアス	31,200	2,716.00	84,739,200
新日鐵住金	502,400	2,228.00	1,119,347,200
神戸製鋼所	205,400	1,001.00	205,605,400
中山製鋼所	15,600	661.00	10,311,600
合同製鐵	6,000	2,083.00	12,498,000
ジェイ エフ イー ホールディングス	303,200	2,469.50	748,752,400
日新製鋼	31,000	1,575.00	48,825,000
東京製鐵	60,100	804.00	48,320,400
共英製鋼	12,700	2,080.00	26,416,000
大和工業	23,900	3,190.00	76,241,000

東京鐵鋼	4,600	1,698.00	7,810,800
大阪製鐵	7,500	2,060.00	15,450,000
淀川製鋼所	16,500	2,549.00	42,058,500
丸一鋼管	39,700	3,410.00	135,377,000
モリ工業	3,600	2,670.00	9,612,000
大同特殊鋼	19,900	4,985.00	99,201,500
日本高周波鋼業	4,200	746.00	3,133,200
日本冶金工業	92,900	305.00	28,334,500
山陽特殊製鋼	12,900	2,638.00	34,030,200
愛知製鋼	6,300	4,045.00	25,483,500
日立金属	120,900	1,303.00	157,532,700
日本金属	2,800	1,513.00	4,236,400
大平洋金属	6,900	3,960.00	27,324,000
新日本電工	67,200	279.00	18,748,800
栗本鐵工所	5,600	1,754.00	9,822,400
虹 技	1,700	1,765.00	3,000,500
日本鑄鉄管	1,200	1,501.00	1,801,200
日本製鋼所	36,600	2,544.00	93,110,400
三菱製鋼	8,300	2,028.00	16,832,400
日亜鋼業	16,400	328.00	5,379,200
日本精線	1,800	3,920.00	7,056,000
エンビプロ・ホールディングス	2,300	723.00	1,662,900
大紀アルミニウム工業所	18,500	704.00	13,024,000
日本軽金属ホールディングス	327,700	235.00	77,009,500
三井金属鉱業	30,300	3,180.00	96,354,000
東邦亜鉛	6,200	4,165.00	25,823,000
三菱マテリアル	74,200	3,240.00	240,408,000
住友金属鉱山	143,500	3,753.00	538,555,500
D O W Aホールディングス	28,400	3,355.00	95,282,000
古河機械金属	18,500	1,526.00	28,231,000
エス・サイエンス	53,200	73.00	3,883,600
大阪チタニウムテクノロジーズ	11,700	1,944.00	22,744,800
東邦チタニウム	20,100	1,356.00	27,255,600
U A C J	17,000	2,586.00	43,962,000
C Kサンエツ	2,100	3,145.00	6,604,500
古河電気工業	37,400	3,355.00	125,477,000
住友電気工業	419,700	1,567.00	657,669,900
フジクラ	135,500	503.00	68,156,500
昭和電線ホールディングス	14,100	749.00	10,560,900
東京特殊電線	1,500	2,064.00	3,096,000
タツタ電線	22,300	573.00	12,777,900
カナレ電気	1,800	2,070.00	3,726,000
平河ヒューテック	5,500	1,668.00	9,174,000
リョービ	13,800	3,740.00	51,612,000
アーレスティ	13,700	799.00	10,946,300
アサヒホールディングス	19,200	1,988.00	38,169,600
東洋製罐グループホールディングス	71,500	2,307.00	164,950,500
ホッカンホールディングス	5,600	2,079.00	11,642,400
コロナ	6,200	1,189.00	7,371,800
横河ブリッジホールディングス	20,800	2,101.00	43,700,800

OSJBホールディングス	56,100	294.00	16,493,400
駒井ハルテック	2,400	2,266.00	5,438,400
高田機工	1,100	2,764.00	3,040,400
三和ホールディングス	107,700	1,298.00	139,794,600
文化シャッター	33,100	826.00	27,340,600
三協立山	15,600	1,406.00	21,933,600
アルインコ	8,100	1,013.00	8,205,300
東洋シャッター	2,800	640.00	1,792,000
LIXILグループ	165,500	2,061.00	341,095,500
日本フィルコン	8,600	589.00	5,065,400
ノーリツ	25,100	1,647.00	41,339,700
長府製作所	11,400	2,410.00	27,474,000
リンナイ	20,100	8,220.00	165,222,000
ユニプレス	21,900	2,188.00	47,917,200
ダイニチ工業	6,000	754.00	4,524,000
日東精工	15,500	659.00	10,214,500
三洋工業	1,400	2,101.00	2,941,400
岡部	22,800	1,022.00	23,301,600
ジーテクト	12,400	1,658.00	20,559,200
中国工業	1,700	613.00	1,042,100
東ブレ	20,900	2,542.00	53,127,800
高周波熱錬	21,600	1,055.00	22,788,000
東京製綱	8,000	1,351.00	10,808,000
サンコール	6,300	803.00	5,058,900
モリテックスチール	8,800	526.00	4,628,800
パイオラックス	16,600	2,542.00	42,197,200
エイチワン	11,000	1,300.00	14,300,000
日本発条	111,900	1,098.00	122,866,200
中央発條	1,300	3,645.00	4,738,500
アドバネクス	1,800	1,892.00	3,405,600
三浦工業	48,600	3,280.00	159,408,000
タクマ	38,100	1,453.00	55,359,300
テクノプロ・ホールディングス	20,400	6,540.00	133,416,000
アトラ	2,100	676.00	1,419,600
インターワークス	2,400	899.00	2,157,600
KeepPer 技研	3,500	1,114.00	3,899,000
ファーストロジック	2,000	939.00	1,878,000
三機サービス	1,700	2,363.00	4,017,100
Gunosy	6,600	2,081.00	13,734,600
デザインワン・ジャパン	2,100	677.00	1,421,700
イー・ガーディアン	5,200	2,631.00	13,681,200
リブセンス	5,900	345.00	2,035,500
ジャパンマテリアル	29,600	1,441.00	42,653,600
ベクトル	13,000	2,215.00	28,795,000
ウチヤマホールディングス	5,400	495.00	2,673,000
ライクキッズネクスト	2,200	1,235.00	2,717,000
キャリアリンク	3,600	478.00	1,720,800
IBJ	7,300	769.00	5,613,700
アサンテ	3,900	2,284.00	8,907,600
N・フィールド	7,000	1,767.00	12,369,000



バリューHR	2,200	2,191.00	4,820,200
M&Aキャピタルパートナーズ	2,700	6,200.00	16,740,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	4,500	1,453.00	6,538,500
E R Iホールディングス	3,000	1,035.00	3,105,000
アピスト	1,700	3,920.00	6,664,000
シグマクシス	5,700	1,151.00	6,560,700
ウィルグループ	4,700	1,000.00	4,700,000
エスクロー・エージェント・ジャパン	14,900	482.00	7,181,800
日本ビューホテル	3,400	1,392.00	4,732,800
リクルートホールディングス	836,800	3,469.00	2,902,859,200
エラン	3,700	3,180.00	11,766,000
ツガミ	30,200	1,013.00	30,592,600
オークマ	13,000	6,160.00	80,080,000
東芝機械	12,700	2,248.00	28,549,600
アマダホールディングス	173,300	1,097.00	190,110,100
アイダエンジニアリング	28,500	955.00	27,217,500
滝澤鉄工所	3,500	1,661.00	5,813,500
F U J I	33,600	1,663.00	55,876,800
牧野フライス製作所	11,500	4,505.00	51,807,500
オーエスジー	55,200	2,316.00	127,843,200
ダイジェット工業	1,400	1,872.00	2,620,800
旭ダイヤモンド工業	33,400	751.00	25,083,400
D M G森精機	71,000	1,728.00	122,688,000
ソディック	24,500	882.00	21,609,000
ディスコ	15,200	17,500.00	266,000,000
日東工器	6,900	2,617.00	18,057,300
日進工具	3,000	2,957.00	8,871,000
パンチ工業	9,300	696.00	6,472,800
富士ダイス	5,600	835.00	4,676,000
土木管理総合試験所	4,700	603.00	2,834,100
日本郵政	615,500	1,339.00	824,154,500
ベルシステム24ホールディングス	18,200	1,696.00	30,867,200
鎌倉新書	7,900	1,353.00	10,688,700
一蔵	1,400	809.00	1,132,600
L I T A L I C O	2,400	2,119.00	5,085,600
グローバルグループ	1,300	1,732.00	2,251,600
エボラブルアジア	3,100	2,430.00	7,533,000
アトラエ	2,000	2,278.00	4,556,000
ストライク	2,700	3,435.00	9,274,500
ソラスト	19,800	1,350.00	26,730,000
セラク	2,400	703.00	1,687,200
インソース	3,600	2,282.00	8,215,200
豊田自動織機	91,900	5,910.00	543,129,000
豊和工業	6,200	869.00	5,387,800
O K K	4,300	1,106.00	4,755,800
石川製作所	2,900	1,457.00	4,225,300
東洋機械金属	8,800	699.00	6,151,200
津田駒工業	2,400	2,224.00	5,337,600
エンシュウ	2,900	1,469.00	4,260,100

島精機製作所	14,200	4,590.00	65,178,000
オプトラン	10,900	2,630.00	28,667,000
NCホールディングス	3,500	658.00	2,303,000
フリー	8,000	922.00	7,376,000
ヤマシンフィルタ	17,000	765.00	13,005,000
日阪製作所	16,200	1,096.00	17,755,200
やまびこ	21,800	1,309.00	28,536,200
平田機工	4,200	7,870.00	33,054,000
ベガサスミシン製造	10,500	955.00	10,027,500
ナプテスコ	61,700	2,730.00	168,441,000
三井海洋開発	12,000	3,680.00	44,160,000
レオン自動機	10,000	2,091.00	20,910,000
S M C	35,600	33,500.00	1,192,600,000
新川	9,200	549.00	5,050,800
ホソカワミクロン	4,000	5,830.00	23,320,000
ユニオンツール	4,900	3,965.00	19,428,500
オイレス工業	14,500	2,290.00	33,205,000
日精エー・エス・ピー機械	3,200	3,970.00	12,704,000
サトーホールディングス	14,800	3,530.00	52,244,000
技研製作所	7,700	3,425.00	26,372,500
日本エアテック	3,500	741.00	2,593,500
カワタ	2,200	2,224.00	4,892,800
日精樹脂工業	9,400	1,107.00	10,405,800
オカダアイヨン	3,800	1,688.00	6,414,400
ワイエイシーホールディングス	3,800	782.00	2,971,600
小松製作所	548,000	3,283.00	1,799,084,000
住友重機械工業	64,900	3,775.00	244,997,500
日立建機	53,100	3,615.00	191,956,500
日工	3,100	2,503.00	7,759,300
巴工業	4,900	2,272.00	11,132,800
井関農機	11,300	1,984.00	22,419,200
T O W A	8,900	973.00	8,659,700
丸山製作所	2,400	1,698.00	4,075,200
北川鉄工所	5,500	2,841.00	15,625,500
シンニッタン	17,400	422.00	7,342,800
ローツェ	5,500	1,938.00	10,659,000
タカキタ	4,000	700.00	2,800,000
クボタ	608,900	1,867.00	1,136,816,300
荏原実業	3,300	2,012.00	6,639,600
東洋エンジニアリング	15,000	835.00	12,525,000
三菱化工機	3,900	1,797.00	7,008,300
月島機械	22,500	1,384.00	31,140,000
帝国電機製作所	7,900	1,558.00	12,308,200
東京機械製作所	4,400	404.00	1,777,600
新東工業	27,000	1,043.00	28,161,000
澁谷工業	9,900	3,855.00	38,164,500
アイチコーポレーション	19,600	613.00	12,014,800
小森コーポレーション	28,500	1,301.00	37,078,500
鶴見製作所	9,500	1,749.00	16,615,500
住友精密工業	1,800	3,745.00	6,741,000

酒井重工業	2,100	3,600.00	7,560,000
荏原製作所	50,300	3,540.00	178,062,000
石井鐵工所	1,800	1,829.00	3,292,200
西島製作所	11,600	987.00	11,449,200
北越工業	12,800	1,215.00	15,552,000
千代田化工建設	82,600	812.00	67,071,200
ダイキン工業	155,000	14,180.00	2,197,900,000
オルガノ	4,100	2,971.00	12,181,100
トーヨーカネツ	4,600	2,695.00	12,397,000
栗田工業	61,400	2,880.00	176,832,000
椿本チエイン	13,400	4,715.00	63,181,000
大同工業	4,900	1,108.00	5,429,200
日機装	36,600	1,441.00	52,740,600
木村化工機	9,400	406.00	3,816,400
新興プランテック	24,500	1,053.00	25,798,500
アネスト岩田	19,100	1,025.00	19,577,500
ダイフク	57,700	5,180.00	298,886,000
サムコ	3,100	1,291.00	4,002,100
加藤製作所	5,400	3,485.00	18,819,000
油研工業	2,200	2,184.00	4,804,800
タダノ	54,700	1,277.00	69,851,900
フジテック	35,000	1,369.00	47,915,000
C K D	31,500	1,308.00	41,202,000
キトー	8,600	1,877.00	16,142,200
平和	35,100	2,464.00	86,486,400
理想科学工業	11,300	2,493.00	28,170,900
S A N K Y O	28,400	4,245.00	120,558,000
日本金銭機械	10,400	1,189.00	12,365,600
マースグループホールディングス	7,200	2,262.00	16,286,400
福島工業	7,000	5,460.00	38,220,000
オーイズミ	4,700	490.00	2,303,000
ダイコク電機	5,200	1,669.00	8,678,800
竹内製作所	19,000	2,479.00	47,101,000
アマノ	35,100	2,260.00	79,326,000
J U K I	15,800	1,309.00	20,682,200
サンデンホールディングス	13,800	1,416.00	19,540,800
蛇の目ミシン工業	10,300	645.00	6,643,500
ブラザー工業	138,600	2,142.00	296,881,200
マックス	17,400	1,530.00	26,622,000
モリタホールディングス	18,200	2,329.00	42,387,800
グローリー	33,900	2,702.00	91,597,800
新晃工業	11,500	1,680.00	19,320,000
大和冷機工業	16,400	1,151.00	18,876,400
セガサミーホールディングス	112,500	1,525.00	171,562,500
日本ピストンリング	4,100	2,219.00	9,097,900
リケン	5,300	5,760.00	30,528,000
T P R	12,800	2,828.00	36,198,400
ツバキ・ナカシマ	17,100	2,189.00	37,431,900
ホシザキ	33,200	11,250.00	373,500,000
大豊工業	9,200	1,180.00	10,856,000

日本精工	233,200	1,214.00	283,104,800
NTN	262,700	443.00	116,376,100
ジェイテクト	121,000	1,605.00	194,205,000
不二越	10,500	4,995.00	52,447,500
ミネベアミツミ	210,700	1,832.00	386,002,400
日本トムソン	36,200	669.00	24,217,800
THK	70,800	2,579.00	182,593,200
ユーシン精機	10,000	1,126.00	11,260,000
前澤給装工業	4,500	1,866.00	8,397,000
イーグル工業	14,000	1,355.00	18,970,000
前澤工業	8,300	437.00	3,627,100
日本ピラー工業	11,500	1,472.00	16,928,000
キッツ	46,000	893.00	41,078,000
日立製作所	545,000	3,502.00	1,908,590,000
三菱電機	1,135,100	1,429.50	1,622,625,450
富士電機	68,300	4,150.00	283,445,000
東洋電機製造	4,500	1,638.00	7,371,000
安川電機	131,600	3,190.00	419,804,000
シンフォニアテクノロジー	14,600	1,509.00	22,031,400
明電舎	19,300	1,720.00	33,196,000
オリジン電気	3,300	1,658.00	5,471,400
山洋電気	5,500	4,720.00	25,960,000
デンヨー	10,500	1,737.00	18,238,500
アイモバイル	2,200	727.00	1,599,400
キャリアインデックス	2,900	1,623.00	4,706,700
MS-Japan	4,300	1,973.00	8,483,900
船場	1,800	1,051.00	1,891,800
グレイステクノロジー	2,500	3,185.00	7,962,500
フルテック	1,200	1,125.00	1,350,000
グリーンズ	2,300	1,400.00	3,220,000
ツナグ・ソリューションズ	1,000	902.00	902,000
日総工産	3,500	2,709.00	9,481,500
キュービーネットホールディングス	5,500	2,101.00	11,555,500
三櫻工業	14,400	707.00	10,180,800
マキタ	148,000	5,130.00	759,240,000
東芝テック	16,200	3,325.00	53,865,000
芝浦メカトロニクス	1,700	3,485.00	5,924,500
マブチモーター	31,400	3,930.00	123,402,000
日本電産	136,600	14,730.00	2,012,118,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	4,800	2,129.00	10,219,200
トレックス・セミコンダクター	3,200	1,625.00	5,200,000
東光高岳	5,700	1,662.00	9,473,400
ダブル・スコープ	16,600	956.00	15,869,600
宮越ホールディングス	4,200	917.00	3,851,400
ダイヘン	12,500	2,564.00	32,050,000
田淵電機	15,700	185.00	2,904,500
ヤーマン	16,500	2,033.00	33,544,500
JVCケンウッド	93,400	295.00	27,553,000
ミマキエンジニアリング	10,100	1,168.00	11,796,800
第一精工	4,700	1,467.00	6,894,900

日新電機	26,600	890.00	23,674,000
大崎電気工業	24,300	818.00	19,877,400
オムロン	120,600	4,515.00	544,509,000
日東工業	18,200	1,900.00	34,580,000
I D E C	14,000	2,169.00	30,366,000
不二電機工業	1,300	1,363.00	1,771,900
ジーエス・ユアサ コーポレーション	40,900	2,474.00	101,186,600
サクサホールディングス	2,800	2,060.00	5,768,000
メルコホールディングス	5,500	4,035.00	22,192,500
テクノメディカ	2,600	2,035.00	5,291,000
日本電気	146,900	3,030.00	445,107,000
富士通	116,700	7,340.00	856,578,000
沖電気工業	46,100	1,405.00	64,770,500
岩崎通信機	5,000	779.00	3,895,000
電気興業	6,400	3,010.00	19,264,000
サンケン電気	13,200	2,498.00	32,973,600
ナカヨ	2,100	1,565.00	3,286,500
アイホン	6,400	1,597.00	10,220,800
ルネサスエレクトロニクス	117,500	671.00	78,842,500
セイコーエプソン	169,000	1,860.00	314,340,000
ワコム	88,000	421.00	37,048,000
アルバック	26,100	3,865.00	100,876,500
アクセル	4,800	625.00	3,000,000
E I Z O	10,400	4,675.00	48,620,000
ジャパンディスプレイ	233,100	109.00	25,407,900
日本信号	31,300	1,066.00	33,365,800
京三製作所	26,600	549.00	14,603,400
能美防災	15,000	2,422.00	36,330,000
ホーチキ	8,200	1,534.00	12,578,800
星和電機	3,900	447.00	1,743,300
エレコム	10,000	2,700.00	27,000,000
パナソニック	1,296,700	1,249.50	1,620,226,650
シャープ	112,500	2,026.00	227,925,000
アンリツ	82,800	1,800.00	149,040,000
富士通ゼネラル	34,700	1,795.00	62,286,500
ソニー	760,600	6,258.00	4,759,834,800
T D K	59,400	10,690.00	634,986,000
帝国通信工業	5,000	1,247.00	6,235,000
タムラ製作所	43,800	634.00	27,769,200
アルプス電気	97,700	2,793.00	272,876,100
池上通信機	3,600	1,259.00	4,532,400
パイオニア	189,300	113.00	21,390,900
日本電波工業	10,200	504.00	5,140,800
鈴木	5,500	742.00	4,081,000
日本トリム	2,400	5,450.00	13,080,000
ローランド ディー・ジー・	5,700	2,588.00	14,751,600
フォスター電機	13,200	1,396.00	18,427,200
クラリオン	11,900	1,812.00	21,562,800
S M K	2,900	2,763.00	8,012,700
ヨコオ	7,300	1,356.00	9,898,800

ティアック	8,300	277.00	2,299,100
ホシデン	28,600	1,003.00	28,685,800
ヒロセ電機	18,500	10,830.00	200,355,000
日本航空電子工業	29,200	1,831.00	53,465,200
TOA	12,200	1,188.00	14,493,600
マクセルホールディングス	22,600	1,589.00	35,911,400
古野電気	13,500	1,314.00	17,739,000
ユニデンホールディングス	3,100	2,543.00	7,883,300
アルパイン	27,100	2,056.00	55,717,600
スミダコーポレーション	9,600	1,285.00	12,336,000
アイコム	6,200	2,413.00	14,960,600
リオン	4,800	2,491.00	11,956,800
本多通信工業	8,900	751.00	6,683,900
船井電機	11,500	643.00	7,394,500
横河電機	113,600	2,350.00	266,960,000
新電元工業	4,000	5,100.00	20,400,000
アズビル	68,000	2,272.00	154,496,000
東亜ディーケーケー	5,600	1,298.00	7,268,800
日本光電工業	46,900	3,535.00	165,791,500
チノー	3,900	1,497.00	5,838,300
共和電業	11,900	416.00	4,950,400
日本電子材料	4,500	793.00	3,568,500
堀場製作所	22,500	5,390.00	121,275,000
アドバンテスト	63,300	2,173.00	137,550,900
小野測器	5,300	837.00	4,436,100
エスベック	10,000	1,850.00	18,500,000
キーエンス	55,700	58,200.00	3,241,740,000
日置電機	5,900	3,255.00	19,204,500
シスメックス	88,400	8,640.00	763,776,000
日本マイクロニクス	18,300	703.00	12,864,900
メガチップス	9,000	2,075.00	18,675,000
OBARA GROUP	6,600	5,070.00	33,462,000
IMAGICA GROUP	9,400	599.00	5,630,600
澤藤電機	1,200	2,115.00	2,538,000
デンソー	251,900	5,274.00	1,328,520,600
コーセル	15,800	1,133.00	17,901,400
イリソ電子工業	9,500	5,780.00	54,910,000
オプテックスグループ	20,000	2,176.00	43,520,000
千代田インテグレ	4,800	2,298.00	11,030,400
アイ・オー・データ機器	4,700	1,301.00	6,114,700
レーザーテック	23,300	3,275.00	76,307,500
スタンレー電気	86,600	3,840.00	332,544,000
岩崎電気	4,400	1,519.00	6,683,600
ウシオ電機	68,900	1,380.00	95,082,000
岡谷電機産業	8,100	486.00	3,936,600
ヘリオス テクノ ホールディング	9,600	823.00	7,900,800
日本セラミック	11,500	2,854.00	32,821,000
遠藤照明	5,700	802.00	4,571,400
古河電池	8,100	850.00	6,885,000
双信電機	5,000	468.00	2,340,000

山一電機	8,200	1,401.00	11,488,200	
図研	7,400	1,711.00	12,661,400	
日本電子	20,400	2,174.00	44,349,600	
カシオ計算機	91,300	1,743.00	159,135,900	
ファナック	107,900	19,450.00	2,098,655,000	
日本シイエムケイ	20,000	764.00	15,280,000	
エンプラス	5,200	3,155.00	16,406,000	
大真空	4,200	1,215.00	5,103,000	
ローム	50,900	7,420.00	377,678,000	
浜松ホトニクス	81,400	4,160.00	338,624,000	
三井ハイテック	15,000	1,280.00	19,200,000	
新光電気工業	42,800	860.00	36,808,000	
京セラ	186,300	6,365.00	1,185,799,500	
協栄産業	1,400	1,861.00	2,605,400	
太陽誘電	55,100	2,460.00	135,546,000	
村田製作所	119,100	16,495.00	1,964,554,500	
ユーシン	17,000	752.00	12,784,000	
双葉電子工業	18,600	1,845.00	34,317,000	
日東電工	85,800	7,947.00	681,852,600	
北陸電気工業	4,600	1,208.00	5,556,800	
東海理化電機製作所	29,900	2,245.00	67,125,500	
ニチコン	35,700	1,006.00	35,914,200	
日本ケミコン	9,200	2,689.00	24,738,800	
K O A	15,700	1,604.00	25,182,800	
三井E & Sホールディングス	41,000	2,074.00	85,034,000	
日立造船	90,000	440.00	39,600,000	
三菱重工業	190,200	4,293.00	816,528,600	
川崎重工業	88,300	3,120.00	275,496,000	
I H I	87,200	4,295.00	374,524,000	
名村造船所	34,100	548.00	18,686,800	
サノヤホールディングス	13,900	228.00	3,169,200	
スプリックス	3,000	2,800.00	8,400,000	
日本車輛製造	4,100	2,801.00	11,484,100	
三菱ロジスネクスト	13,500	1,339.00	18,076,500	
近畿車輛	1,700	2,408.00	4,093,600	
F P G	35,800	1,046.00	37,446,800	
島根銀行	2,300	1,200.00	2,760,000	
じもとホールディングス	75,600	172.00	13,003,200	
全国保証	31,500	4,245.00	133,717,500	
めぶきフィナンシャルグループ	581,700	378.00	219,882,600	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	15,100	2,006.00	30,290,600	
九州フィナンシャルグループ	183,800	522.00	95,943,600	
かんぼ生命保険	42,300	2,675.00	113,152,500	
ゆうちょ銀行	317,200	1,319.00	418,386,800	
富山第一銀行	28,400	444.00	12,609,600	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	668,500	544.00	363,664,000	
ジェイリース	2,000	649.00	1,298,000	
西日本フィナンシャルホールディングス	71,800	1,243.00	89,247,400	

マーキュリアインベストメント	4,300	916.00	3,938,800	
イントラスト	2,300	551.00	1,267,300	
アルヒ	12,800	1,971.00	25,228,800	
日産自動車	1,338,600	1,007.00	1,347,970,200	
いすゞ自動車	328,900	1,600.50	526,404,450	
トヨタ自動車	1,379,900	6,608.00	9,118,379,200	*
日野自動車	162,000	1,147.00	185,814,000	
三菱自動車工業	420,100	726.00	304,992,600	
エフテック	7,200	1,200.00	8,640,000	
レシップホールディングス	4,100	798.00	3,271,800	
GMB	1,800	1,278.00	2,300,400	
ファルテック	1,900	1,022.00	1,941,800	
武蔵精密工業	24,100	1,666.00	40,150,600	
日産車体	44,300	923.00	40,888,900	
新明和工業	49,400	1,450.00	71,630,000	
極東開発工業	21,100	1,738.00	36,671,800	
日信工業	23,100	1,733.00	40,032,300	
トピー工業	9,300	3,160.00	29,388,000	
ティラド	4,100	2,947.00	12,082,700	
曙ブレーキ工業	52,800	237.00	12,513,600	
タチエス	19,300	1,631.00	31,478,300	
NOK	61,000	1,733.00	105,713,000	
フタバ産業	34,800	722.00	25,125,600	
KYB	11,800	4,505.00	53,159,000	
市光工業	16,900	855.00	14,449,500	
大同メタル工業	14,600	903.00	13,183,800	
プレス工業	60,300	542.00	32,682,600	
ミクニ	14,400	705.00	10,152,000	
太平洋工業	23,800	1,828.00	43,506,400	
ケーヒン	26,100	2,263.00	59,064,300	
河西工業	13,900	1,078.00	14,984,200	
アイシン精機	93,500	4,900.00	458,150,000	
マツダ	356,200	1,286.50	458,251,300	
今仙電機製作所	10,500	1,074.00	11,277,000	
本田技研工業	1,021,400	3,092.00	3,158,168,800	
スズキ	225,000	5,903.00	1,328,175,000	
SUBARU	352,400	3,266.00	1,150,938,400	
安永	5,500	1,846.00	10,153,000	
ヤマハ発動機	160,300	2,852.00	457,175,600	
ショーワ	29,500	1,534.00	45,253,000	
小糸製作所	68,000	6,420.00	436,560,000	
TBK	13,400	477.00	6,391,800	
エクセディ	13,700	3,405.00	46,648,500	
ミツバ	20,800	936.00	19,468,800	
豊田合成	41,300	2,539.00	104,860,700	
愛三工業	20,000	873.00	17,460,000	
盟和産業	1,700	1,218.00	2,070,600	
日本プラスト	6,100	937.00	5,715,700	
ヨロズ	11,500	1,618.00	18,607,000	
エフ・シー・シー	18,600	2,950.00	54,870,000	



新家工業	2,500	1,881.00	4,702,500
シマノ	45,800	15,970.00	731,426,000
テイ・エス テック	26,400	3,410.00	90,024,000
関西みらいフィナンシャルグループ	49,000	989.00	48,461,000
三十三フィナンシャルグループ	9,400	2,177.00	20,463,800
第四北越フィナンシャルグループ	19,350	4,375.00	84,656,250
ジャムコ	5,600	3,020.00	16,912,000
小野建	9,900	1,685.00	16,681,500
はるやまホールディングス	5,300	922.00	4,886,600
ノジマ	19,800	2,288.00	45,302,400
佐鳥電機	8,200	1,077.00	8,831,400
カップ・クリエイト	13,900	1,339.00	18,612,100
エコートレーディング	2,400	645.00	1,548,000
伯東	6,800	1,523.00	10,356,400
コンドーテック	8,700	1,053.00	9,161,100
中山福	6,200	679.00	4,209,800
ライトオン	9,400	950.00	8,930,000
ナガイレーベン	16,200	2,513.00	40,710,600
ジーンズメイト	3,400	616.00	2,094,400
三菱食品	12,300	2,886.00	35,497,800
良品計画	14,800	32,700.00	483,960,000
三城ホールディングス	13,800	479.00	6,610,200
松田産業	8,200	1,467.00	12,029,400
第一興商	16,600	5,190.00	86,154,000
メディカルホールディングス	112,100	2,323.00	260,408,300
アドヴァン	11,400	1,055.00	12,027,000
S P K	2,300	2,379.00	5,471,700
萩原電気ホールディングス	4,100	3,010.00	12,341,000
アルビス	3,600	3,030.00	10,908,000
アズワン	8,800	8,030.00	70,664,000
スズデン	3,900	1,336.00	5,210,400
尾家産業	3,200	1,433.00	4,585,600
シモジマ	6,800	1,000.00	6,800,000
ドウシシャ	11,900	2,358.00	28,060,200
小津産業	2,400	1,971.00	4,730,400
コナカ	14,200	495.00	7,029,000
高速	6,600	1,161.00	7,662,600
ハウス オブ ローゼ	1,400	1,785.00	2,499,000
G - 7ホールディングス	3,300	2,691.00	8,880,300
たけびし	3,900	1,580.00	6,162,000
イオン北海道	11,200	806.00	9,027,200
コジマ	16,500	529.00	8,728,500
ヒマラヤ	3,500	1,007.00	3,524,500
コーナン商事	15,900	2,701.00	42,945,900
ネットワンシステムズ	45,500	2,419.00	110,064,500
エコス	4,500	1,871.00	8,419,500
ワタミ	13,200	1,300.00	17,160,000
マルシェ	2,900	801.00	2,322,900
リックス	2,500	1,585.00	3,962,500
システムソフト	26,600	115.00	3,059,000

ドンキホーテホールディングス	72,400	6,880.00	498,112,000
丸文	9,800	781.00	7,653,800
西松屋チェーン	24,500	1,048.00	25,676,000
ゼンショーホールディングス	58,000	2,073.00	120,234,000
ハピネット	7,600	1,732.00	13,163,200
幸楽苑ホールディングス	7,100	1,616.00	11,473,600
ハークスレイ	2,600	1,028.00	2,672,800
橋本総業ホールディングス	2,200	1,482.00	3,260,400
日本ライフライン	31,800	2,166.00	68,878,800
サイゼリヤ	18,400	2,045.00	37,628,000
タカショー	5,000	471.00	2,355,000
エクセル	4,500	1,792.00	8,064,000
V Tホールディングス	37,900	470.00	17,813,000
マルカキカイ	3,600	2,247.00	8,089,200
アルゴグラフィックス	5,200	4,780.00	24,856,000
魚力	3,100	1,461.00	4,529,100
I D O M	33,900	330.00	11,187,000
日本エム・ディ・エム	7,500	1,478.00	11,085,000
ポブラ	2,900	630.00	1,827,000
フジ・コーポレーション	2,200	2,288.00	5,033,600
ユナイテッドアローズ	13,800	4,590.00	63,342,000
進和	6,600	2,035.00	13,431,000
エスケイジャパン	2,700	615.00	1,660,500
ダイトロン	5,100	1,988.00	10,138,800
ハイデイ日高	14,700	2,238.00	32,898,600
シークス	14,200	1,679.00	23,841,800
京都きもの友禅	7,000	506.00	3,542,000
コロワイド	37,200	2,780.00	103,416,000
ピーシーデポコーポレーション	16,600	567.00	9,412,200
田中商事	3,400	657.00	2,233,800
オーハシテクニカ	6,300	1,491.00	9,393,300
壱番屋	7,900	4,525.00	35,747,500
白銅	4,000	1,870.00	7,480,000
トップカルチャー	4,000	422.00	1,688,000
P L A N T	2,500	1,212.00	3,030,000
スギホールディングス	24,500	5,390.00	132,055,000
島津製作所	135,600	3,225.00	437,310,000
J M S	10,400	603.00	6,271,200
クボテック	2,400	379.00	909,600
長野計器	9,000	1,012.00	9,108,000
ブイ・テクノロジー	2,600	14,510.00	37,726,000
スター精密	18,100	1,820.00	32,942,000
東京計器	7,200	1,070.00	7,704,000
愛知時計電機	1,500	4,350.00	6,525,000
インターアクション	6,000	1,673.00	10,038,000
オーバル	11,200	286.00	3,203,200
東京精密	20,500	2,892.00	59,286,000
マニー	13,800	5,340.00	73,692,000
ニコン	197,800	1,979.00	391,446,200
トプコン	60,900	1,938.00	118,024,200

オリンパス	169,100	4,230.00	715,293,000
理研計器	10,800	2,229.00	24,073,200
S C R E E Nホールディングス	21,500	6,410.00	137,815,000
キヤノン電子	10,400	2,203.00	22,911,200
タムロン	10,000	2,201.00	22,010,000
H O Y A	228,500	6,179.00	1,411,901,500
シード	4,800	1,831.00	8,788,800
ノーリツ鋼機	11,500	2,790.00	32,085,000
エー・アンド・デイ	10,300	892.00	9,187,600
キヤノン	611,000	3,496.00	2,136,056,000
リコー	341,200	1,200.00	409,440,000
シチズン時計	135,500	685.00	92,817,500
リズム時計工業	3,800	2,014.00	7,653,200
大研医器	10,100	827.00	8,352,700
メニコン	15,600	2,589.00	40,388,400
シンシア	1,700	628.00	1,067,600
中本パックス	2,900	1,793.00	5,199,700
スノーピーク	4,000	1,675.00	6,700,000
パラマウントベッドホールディングス	12,000	5,120.00	61,440,000
トランザクション	6,100	722.00	4,404,200
S H O B I	3,300	387.00	1,277,100
ニホンフラッシュ	5,300	2,028.00	10,748,400
前田工織	12,500	2,316.00	28,950,000
永大産業	14,800	487.00	7,207,600
アートネイチャー	12,100	707.00	8,554,700
バンダイナムコホールディングス	117,300	4,090.00	479,757,000
アイフィスジャパン	2,500	778.00	1,945,000
共立印刷	18,800	330.00	6,204,000
S H O E I	5,500	4,410.00	24,255,000
フランスベッドホールディングス	13,100	951.00	12,458,100
マーベラス	18,900	856.00	16,178,400
パイロットコーポレーション	19,800	6,550.00	129,690,000
萩原工業	6,300	1,815.00	11,434,500
エイベックス	20,600	1,547.00	31,868,200
トッパン・フォームズ	24,300	1,015.00	24,664,500
フジシールインターナショナル	25,400	3,510.00	89,154,000
タカラトミー	47,500	1,139.00	54,102,500
廣済堂	10,500	473.00	4,966,500
エステールホールディングス	3,300	739.00	2,438,700
アーク	57,700	106.00	6,116,200
レック	13,400	2,437.00	32,655,800
タカノ	5,000	952.00	4,760,000
三光合成	8,700	404.00	3,514,800
プロネクサス	9,700	1,130.00	10,961,000
ホクシン	8,000	167.00	1,336,000
ウッドワン	3,700	1,252.00	4,632,400
大建工業	8,900	2,094.00	18,636,600
きもと	19,300	285.00	5,500,500
凸版印刷	160,100	1,729.00	276,812,900
大日本印刷	148,600	2,542.00	377,741,200

図書印刷	7,600	814.00	6,186,400
共同印刷	3,500	2,773.00	9,705,500
N I S S H A	23,300	2,007.00	46,763,100
光村印刷	1,000	2,321.00	2,321,000
藤森工業	9,500	3,605.00	34,247,500
ヴィア・ホールディングス	13,600	704.00	9,574,400
宝印刷	5,900	1,819.00	10,732,100
前澤化成工業	7,800	1,120.00	8,736,000
アシックス	112,700	1,594.00	179,643,800
ツツミ	3,500	2,089.00	7,311,500
ウェーブロックホールディングス	2,900	910.00	2,639,000
J S P	6,600	2,668.00	17,608,800
ニチハ	17,100	2,636.00	45,075,600
エフピコ	9,300	6,160.00	57,288,000
小松ウオール工業	3,800	2,044.00	7,767,200
ヤマハ	74,300	5,260.00	390,818,000
河合楽器製作所	3,800	4,630.00	17,594,000
クリナップ	10,500	727.00	7,633,500
ピジョン	68,600	5,960.00	408,856,000
天馬	8,900	1,850.00	16,465,000
兼松サステック	900	1,844.00	1,659,600
キングジム	9,400	939.00	8,826,600
象印マホービン	21,100	1,371.00	28,928,100
リンテック	27,000	2,766.00	74,682,000
信越ポリマー	23,300	838.00	19,525,400
東リ	28,200	333.00	9,390,600
イトーキ	20,900	603.00	12,602,700
任天堂	69,900	40,000.00	2,796,000,000
三菱鉛筆	18,700	1,872.00	35,006,400
松風	5,500	1,300.00	7,150,000
タカラスタンダード	23,500	1,841.00	43,263,500
コクヨ	54,400	1,885.00	102,544,000
ナカバヤシ	11,200	618.00	6,921,600
ニフコ	41,700	2,798.00	116,676,600
立川ブラインド工業	5,000	1,121.00	5,605,000
グローブライト	5,100	2,875.00	14,662,500
オカムラ	39,600	1,431.00	56,667,600
バルカー	9,200	2,843.00	26,155,600
M U T O Hホールディングス	1,600	2,283.00	3,652,800
伊藤忠商事	820,400	2,174.00	1,783,549,600
丸紅	918,700	975.10	895,824,370
スクロール	17,200	622.00	10,698,400
高島	1,800	2,033.00	3,659,400
ヨンドシーホールディングス	11,400	2,334.00	26,607,600
三陽商会	6,700	2,216.00	14,847,200
長瀬産業	67,400	1,836.00	123,746,400
ナイガイ	4,300	507.00	2,180,100
蝶理	7,100	1,960.00	13,916,000
豊田通商	124,800	4,155.00	518,544,000
オンワードホールディングス	68,900	679.00	46,783,100

三共生興	19,000	464.00	8,816,000
兼松	47,600	1,594.00	75,874,400
美津濃	11,200	2,710.00	30,352,000
ツカモトコーポレーション	2,000	1,203.00	2,406,000
ユニー・ファミリーマートホールディングス	35,700	12,730.00	454,461,000
ルックホールディングス	4,100	1,203.00	4,932,300
三井物産	921,100	1,975.00	1,819,172,500
日本紙パルプ商事	5,800	4,310.00	24,998,000
東京エレクトロン	75,600	14,730.00	1,113,588,000
日立ハイテクノロジーズ	38,800	3,615.00	140,262,000
カメイ	14,600	1,414.00	20,644,400
東都水産	1,700	2,338.00	3,974,600
OUGホールディングス	1,800	2,735.00	4,923,000
スターゼン	4,500	4,500.00	20,250,000
セイコーホールディングス	17,500	2,959.00	51,782,500
山善	43,600	1,297.00	56,549,200
椿本興業	2,500	3,215.00	8,037,500
住友商事	705,100	1,822.00	1,284,692,200
日本ユニシス	31,000	2,789.00	86,459,000
内田洋行	5,200	2,784.00	14,476,800
三菱商事	784,500	3,420.00	2,682,990,000
第一実業	5,100	3,825.00	19,507,500
キャノンマーケティングジャパン	31,900	2,179.00	69,510,100
西華産業	6,800	1,883.00	12,804,400
佐藤商事	9,900	1,127.00	11,157,300
菱洋エレクトロ	10,400	1,707.00	17,752,800
東京産業	11,100	729.00	8,091,900
ユアサ商事	10,600	3,900.00	41,340,000
神鋼商事	2,500	3,100.00	7,750,000
小林産業	6,700	327.00	2,190,900
阪和興業	20,900	3,610.00	75,449,000
正栄食品工業	5,800	4,225.00	24,505,000
カナデン	10,700	1,151.00	12,315,700
菱電商事	8,100	1,576.00	12,765,600
ニプロ	78,600	1,475.00	115,935,000
フルサト工業	6,100	1,715.00	10,461,500
岩谷産業	24,800	3,900.00	96,720,000
すてきナイスグループ	4,700	1,254.00	5,893,800
昭光通商	4,000	878.00	3,512,000
ニチモウ	1,700	1,610.00	2,737,000
極東貿易	3,100	2,076.00	6,435,600
イワキ	13,300	598.00	7,953,400
兼松エレクトロニクス	7,100	3,610.00	25,631,000
三愛石油	30,000	1,301.00	39,030,000
稲畑産業	26,900	1,673.00	45,003,700
G S Iクレオス	2,900	1,429.00	4,144,100
明和産業	10,300	469.00	4,830,700
キムラタン	54,600	33.00	1,801,800
ゴールドウイン	6,700	8,750.00	58,625,000

ユニ・チャーム	240,700	3,300.00	794,310,000
デサント	27,100	2,418.00	65,527,800
キング	5,800	455.00	2,639,000
ワキタ	23,900	1,314.00	31,404,600
ヤマトインターナショナル	7,300	468.00	3,416,400
東邦ホールディングス	33,100	2,865.00	94,831,500
サンゲツ	36,600	2,081.00	76,164,600
ミツウロコグループホールディングス	16,200	770.00	12,474,000
シナネンホールディングス	4,600	2,622.00	12,061,200
伊藤忠エネクス	24,700	1,100.00	27,170,000
サンリオ	31,300	2,256.00	70,612,800
サンワテクノス	7,200	1,299.00	9,352,800
リョーサン	12,400	3,695.00	45,818,000
新光商事	12,300	1,515.00	18,634,500
トーホー	5,100	2,192.00	11,179,200
三信電気	10,300	1,915.00	19,724,500
東陽テクニカ	12,900	886.00	11,429,400
モスフードサービス	14,700	3,005.00	44,173,500
加賀電子	10,100	2,476.00	25,007,600
三益半導体工業	8,800	1,563.00	13,754,400
ソーダニッカ	11,500	632.00	7,268,000
立花エレテック	7,600	1,764.00	13,406,400
木曽路	13,700	2,686.00	36,798,200
S R Sホールディングス	13,100	997.00	13,060,700
千趣会	20,200	403.00	8,140,600
タカキュー	8,800	199.00	1,751,200
ケーヨー	20,600	540.00	11,124,000
上新電機	13,100	2,992.00	39,195,200
日本瓦斯	20,500	4,865.00	99,732,500
ロイヤルホールディングス	19,900	2,827.00	56,257,300
東天紅	800	1,606.00	1,284,800
いなげや	12,500	1,613.00	20,162,500
島忠	25,300	3,465.00	87,664,500
チヨダ	13,200	2,215.00	29,238,000
ライフコーポレーション	8,500	2,828.00	24,038,000
リンガーハット	13,700	2,321.00	31,797,700
MrMaxHD	14,000	517.00	7,238,000
テンアライド	10,200	442.00	4,508,400
AOKIホールディングス	22,400	1,471.00	32,950,400
オークワ	15,600	1,180.00	18,408,000
コメリ	17,200	2,583.00	44,427,600
青山商事	21,500	3,375.00	72,562,500
しまむら	13,000	9,580.00	124,540,000
はせがわ	5,700	481.00	2,741,700
高島屋	87,700	1,770.00	155,229,000
松屋	22,500	1,122.00	25,245,000
エイチ・ツー・オーリテイリング	53,000	1,745.00	92,485,000
近鉄百貨店	4,300	3,650.00	15,695,000
パルコ	10,700	1,166.00	12,476,200
丸井グループ	102,400	2,483.00	254,259,200

クレディセゾン	85,000	1,793.00	152,405,000
アクシアル リテイリング	9,200	3,845.00	35,374,000
井筒屋	6,100	259.00	1,579,900
イオン	430,200	2,556.50	1,099,806,300
イズミ	20,200	6,310.00	127,462,000
フォーバル	4,900	998.00	4,890,200
平和堂	22,700	2,985.00	67,759,500
フジ	13,300	2,271.00	30,204,300
ヤオコー	12,700	6,470.00	82,169,000
ゼビオホールディングス	15,200	1,628.00	24,745,600
ケーズホールディングス	98,600	1,360.00	134,096,000
PALTAC	15,700	5,030.00	78,971,000
三谷産業	12,900	335.00	4,321,500
Olympicグループ	6,600	842.00	5,557,200
日産東京販売ホールディングス	16,500	341.00	5,626,500
新生銀行	91,300	1,760.00	160,688,000
あおぞら銀行	66,700	3,865.00	257,795,500
三菱UFJフィナンシャル・グループ	7,796,700	685.60	5,345,417,520
りそなホールディングス	1,228,500	611.90	751,719,150
三井住友トラスト・ホールディングス	220,100	4,485.00	987,148,500
三井住友フィナンシャルグループ	838,100	4,436.00	3,717,811,600
千葉銀行	396,500	756.00	299,754,000
群馬銀行	223,900	554.00	124,040,600
武蔵野銀行	17,900	3,060.00	54,774,000
千葉興業銀行	30,700	475.00	14,582,500
筑波銀行	46,500	261.00	12,136,500
七十七銀行	35,100	2,501.00	87,785,100
青森銀行	8,700	3,205.00	27,883,500
秋田銀行	7,200	2,803.00	20,181,600
山形銀行	12,600	2,361.00	29,748,600
岩手銀行	7,800	4,645.00	36,231,000
東邦銀行	100,100	404.00	40,440,400
東北銀行	5,700	1,322.00	7,535,400
みちのく銀行	7,200	1,778.00	12,801,600
ふくおかフィナンシャルグループ	90,900	3,015.00	274,063,500
静岡銀行	281,800	1,000.00	281,800,000
十六銀行	15,000	2,770.00	41,550,000
スルガ銀行	114,500	598.00	68,471,000
八十二銀行	202,600	505.00	102,313,000
山梨中央銀行	13,800	1,811.00	24,991,800
大垣共立銀行	17,700	2,762.00	48,887,400
福井銀行	9,500	2,166.00	20,577,000
北國銀行	12,700	4,095.00	52,006,500
清水銀行	4,500	2,051.00	9,229,500
富山銀行	2,100	4,050.00	8,505,000
滋賀銀行	21,000	2,770.00	58,170,000
南都銀行	13,000	2,749.00	35,737,000
百五銀行	107,500	433.00	46,547,500
京都銀行	42,700	5,510.00	235,277,000
紀陽銀行	42,200	1,647.00	69,503,400

ほくほくフィナンシャルグループ	74,500	1,481.00	110,334,500
広島銀行	165,200	747.00	123,404,400
山陰合同銀行	66,400	927.00	61,552,800
中国銀行	77,400	1,068.00	82,663,200
鳥取銀行	3,500	1,631.00	5,708,500
伊予銀行	159,800	676.00	108,024,800
百十四銀行	11,900	3,105.00	36,949,500
四国銀行	17,100	1,294.00	22,127,400
阿波銀行	17,900	3,125.00	55,937,500
大分銀行	6,400	3,895.00	24,928,000
宮崎銀行	7,500	3,135.00	23,512,500
佐賀銀行	6,800	2,190.00	14,892,000
十八銀行	6,900	3,525.00	24,322,500
沖縄銀行	10,900	3,915.00	42,673,500
琉球銀行	23,900	1,297.00	30,998,300
セブン銀行	420,300	332.00	139,539,600
みずほフィナンシャルグループ	15,213,000	193.20	2,939,151,600
高知銀行	4,100	1,069.00	4,382,900
山口フィナンシャルグループ	139,800	1,184.00	165,523,200
アクリーティブ	6,200	414.00	2,566,800
芙蓉総合リース	12,900	6,490.00	83,721,000
興銀リース	21,000	2,807.00	58,947,000
東京センチュリー	22,600	6,470.00	146,222,000
SBIホールディングス	126,700	3,180.00	402,906,000
日本証券金融	45,900	663.00	30,431,700
アイフル	187,900	326.00	61,255,400
日本アジア投資	10,100	283.00	2,858,300
長野銀行	3,700	1,662.00	6,149,400
名古屋銀行	9,100	3,690.00	33,579,000
北洋銀行	168,700	361.00	60,900,700
愛知銀行	3,800	4,715.00	17,917,000
中京銀行	4,600	2,284.00	10,506,400
大光銀行	3,700	2,176.00	8,051,200
愛媛銀行	15,700	1,178.00	18,494,600
トマト銀行	4,200	1,420.00	5,964,000
京葉銀行	49,700	866.00	43,040,200
栃木銀行	57,900	364.00	21,075,600
北日本銀行	3,500	2,550.00	8,925,000
東和銀行	19,700	1,013.00	19,956,100
福島銀行	10,500	671.00	7,045,500
大東銀行	5,400	1,064.00	5,745,600
リコーリース	8,800	3,505.00	30,844,000
イオンフィナンシャルサービス	79,400	2,231.00	177,141,400
アコム	225,000	423.00	95,175,000
ジャックス	13,600	2,259.00	30,722,400
オリエントコーポレーション	242,300	165.00	39,979,500
日立キャピタル	30,800	2,974.00	91,599,200
アプラスフィナンシャル	53,800	103.00	5,541,400
オリックス	746,900	1,826.50	1,364,212,850
三菱UFJリース	284,100	633.00	179,835,300



ジャフコ	16,100	4,220.00	67,942,000
九州リースサービス	4,800	702.00	3,369,600
トモニホールディングス	92,400	456.00	42,134,400
大和証券グループ本社	958,200	665.90	638,065,380
野村ホールディングス	1,926,100	538.10	1,036,434,410
岡三証券グループ	95,400	557.00	53,137,800
丸三証券	35,600	931.00	33,143,600
東洋証券	39,900	247.00	9,855,300
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	123,900	624.00	77,313,600
光世証券	2,600	1,172.00	3,047,200
水戸証券	32,300	373.00	12,047,900
いちよし証券	23,500	1,079.00	25,356,500
松井証券	54,800	1,168.00	64,006,400
S O M P Oホールディングス	219,500	4,619.00	1,013,870,500
だいこう証券ビジネス	5,500	515.00	2,832,500
日本取引所グループ	321,300	1,880.00	604,044,000
マネックスグループ	114,100	530.00	60,473,000
カブドットコム証券	71,600	375.00	26,850,000
極東証券	15,000	1,355.00	20,325,000
岩井コスモホールディングス	11,500	1,486.00	17,089,000
藍澤證券	20,900	720.00	15,048,000
フィデアホールディングス	108,600	160.00	17,376,000
池田泉州ホールディングス	118,900	369.00	43,874,100
アニコムホールディングス	7,700	3,350.00	25,795,000
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	292,700	3,587.00	1,049,914,900
ソニーフィナンシャルホールディングス	92,000	2,451.00	225,492,000
マネーパートナーズグループ	14,300	374.00	5,348,200
小林洋行	3,200	281.00	899,200
第一生命ホールディングス	633,300	2,288.00	1,448,990,400
東京海上ホールディングス	421,700	5,375.00	2,266,637,500
アドバンテッジリスクマネジメント	3,600	1,093.00	3,934,800
イー・ギャランティ	11,900	1,147.00	13,649,300
アサックス	4,600	595.00	2,737,000
N E Cキャピタルソリューション	4,600	1,837.00	8,450,200
T & Dホールディングス	346,200	1,886.00	652,933,200
アドバンスクリエイト	2,600	2,321.00	6,034,600
三井不動産	559,000	2,514.50	1,405,605,500
三菱地所	833,300	1,805.50	1,504,523,150
平和不動産	19,800	2,014.00	39,877,200
東京建物	122,400	1,208.00	147,859,200
ダイビル	28,800	1,159.00	33,379,200
京阪神ビルディング	18,600	821.00	15,270,600
住友不動産	268,700	3,901.00	1,048,198,700
太平洋興発	4,700	920.00	4,324,000
大京	17,800	2,124.00	37,807,200
テオーシー	38,600	770.00	29,722,000
東京楽天地	1,800	4,825.00	8,685,000

レオパレス21	133,600	569.00	76,018,400
スターツコーポレーション	15,200	2,318.00	35,233,600
フジ住宅	14,300	828.00	11,840,400
空港施設	11,200	612.00	6,854,400
明和地所	6,100	636.00	3,879,600
ゴールドクレスト	8,900	1,782.00	15,859,800
リログループ	59,300	2,942.00	174,460,600
日本エスリード	4,400	1,490.00	6,556,000
日神不動産	14,900	548.00	8,165,200
日本エスコン	20,200	731.00	14,766,200
タカラレーベン	52,400	332.00	17,396,800
サンヨーハウジング名古屋	6,300	1,050.00	6,615,000
イオンモール	72,100	2,033.00	146,579,300
ファースト住建	4,200	1,434.00	6,022,800
ランド	302,700	12.00	3,632,400
カチタス	15,300	2,967.00	45,395,100
東祥	6,700	4,705.00	31,523,500
トーセイ	15,400	1,012.00	15,584,800
穴吹興産	1,200	3,105.00	3,726,000
エヌ・ティ・ティ都市開発	69,600	1,306.00	90,897,600
サンフロンティア不動産	13,500	1,131.00	15,268,500
エフ・ジェー・ネクスト	8,600	859.00	7,387,400
インテリックス	3,100	769.00	2,383,900
ランドビジネス	5,600	559.00	3,130,400
グランディハウス	9,700	465.00	4,510,500
東武鉄道	119,700	3,115.00	372,865,500
相鉄ホールディングス	36,300	3,515.00	127,594,500
東京急行電鉄	308,300	1,875.00	578,062,500
京浜急行電鉄	155,500	1,802.00	280,211,000
小田急電鉄	168,800	2,498.00	421,662,400
京王電鉄	63,400	5,950.00	377,230,000
京成電鉄	79,000	3,690.00	291,510,000
富士急行	15,500	3,305.00	51,227,500
新京成電鉄	2,900	2,191.00	6,353,900
東日本旅客鉄道	201,800	9,790.00	1,975,622,000
西日本旅客鉄道	101,700	7,550.00	767,835,000
東海旅客鉄道	101,600	22,250.00	2,260,600,000
西武ホールディングス	144,700	2,045.00	295,911,500
鴻池運輸	16,100	1,780.00	28,658,000
西日本鉄道	31,400	2,865.00	89,961,000
ハマキョウレックス	8,100	3,880.00	31,428,000
サカイ引越センター	5,900	5,940.00	35,046,000
近鉄グループホールディングス	107,500	4,310.00	463,325,000
阪急阪神ホールディングス	143,400	3,790.00	543,486,000
南海電気鉄道	50,900	2,747.00	139,822,300
京阪ホールディングス	47,900	4,200.00	201,180,000
神戸電鉄	2,500	4,020.00	10,050,000
名古屋鉄道	86,100	2,685.00	231,178,500
山陽電気鉄道	8,300	2,489.00	20,658,700
トランコム	3,000	7,480.00	22,440,000

日本通運	42,200	6,920.00	292,024,000
ヤマトホールディングス	188,500	3,295.00	621,107,500
山九	27,600	6,000.00	165,600,000
日新	9,200	2,380.00	21,896,000
丸運	5,800	334.00	1,937,200
丸全昭和運輸	7,600	2,953.00	22,442,800
センコーグループホールディングス	64,600	870.00	56,202,000
トナミホールディングス	2,500	6,130.00	15,325,000
ニッコンホールディングス	40,900	2,756.00	112,720,400
日本石油輸送	1,300	2,788.00	3,624,400
福山通運	15,800	4,445.00	70,231,000
セイノーホールディングス	80,500	1,572.00	126,546,000
エスライン	2,900	1,255.00	3,639,500
神奈川中央交通	2,600	3,670.00	9,542,000
日立物流	23,700	2,962.00	70,199,400
丸和運輸機関	5,600	3,910.00	21,896,000
C & F ロジホールディングス	11,800	1,286.00	15,174,800
日本郵船	89,900	2,049.00	184,205,100
商船三井	68,100	3,115.00	212,131,500
川崎汽船	49,700	2,102.00	104,469,400
NSユナイテッド海運	5,100	2,683.00	13,683,300
明治海運	11,400	389.00	4,434,600
飯野海運	54,800	520.00	28,496,000
共栄タンカー	800	1,849.00	1,479,200
九州旅客鉄道	90,200	3,230.00	291,346,000
SGホールディングス	101,500	2,877.00	292,015,500
日本航空	196,800	3,803.00	748,430,400
ANAホールディングス	208,800	3,671.00	766,504,800
パスコ	2,100	1,272.00	2,671,200
西本Wismettacホールディングス	2,500	5,020.00	12,550,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	900	1,376.00	1,238,400
Genky DrugStores	4,400	4,080.00	17,952,000
国際紙バルブ商事	19,600	345.00	6,762,000
総合メディカルホールディングス	9,700	2,407.00	23,347,900
ブックオフグループホールディングス	6,300	716.00	4,510,800
三菱倉庫	37,200	2,790.00	103,788,000
三井倉庫ホールディングス	12,300	1,930.00	23,739,000
住友倉庫	37,500	1,415.00	53,062,500
澁澤倉庫	5,800	1,676.00	9,720,800
ヤマタネ	5,500	2,037.00	11,203,500
東陽倉庫	19,400	333.00	6,460,200
乾汽船	8,300	976.00	8,100,800
日本トランスシティ	26,000	468.00	12,168,000
ケイヒン	2,000	1,545.00	3,090,000
中央倉庫	6,500	1,124.00	7,306,000
川西倉庫	2,100	1,589.00	3,336,900
安田倉庫	9,600	880.00	8,448,000
東洋埠頭	3,100	1,625.00	5,037,500
宇徳	9,200	526.00	4,839,200

上組	66,300	2,377.00	157,595,100	
サンリツ	2,700	717.00	1,935,900	
キムラユニティー	2,800	1,175.00	3,290,000	
キューソー流通システム	2,700	2,730.00	7,371,000	
近鉄エクスプレス	20,200	1,941.00	39,208,200	
東海運	5,900	327.00	1,929,300	
エーアイテイー	7,700	1,159.00	8,924,300	
内外トランスライン	3,400	1,728.00	5,875,200	
日本コンセプト	2,900	1,160.00	3,364,000	
東京放送ホールディングス	61,500	2,194.00	134,931,000	
日本テレビホールディングス	102,200	1,863.00	190,398,600	
朝日放送グループホールディングス	11,100	795.00	8,824,500	
テレビ朝日ホールディングス	30,600	2,120.00	64,872,000	
スカパーJ S A Tホールディングス	85,000	512.00	43,520,000	
テレビ東京ホールディングス	9,200	2,655.00	24,426,000	
日本BS放送	3,800	1,269.00	4,822,200	
ビジョン	3,400	4,675.00	15,895,000	
USEN-NEXT HOLDINGS	4,200	1,388.00	5,829,600	
ワイヤレスゲート	4,900	613.00	3,003,700	
コネクシオ	7,900	1,921.00	15,175,900	
日本通信	100,500	156.00	15,678,000	
クロップス	2,300	767.00	1,764,100	
日本電信電話	799,300	4,889.00	3,907,777,700	
KDDI	981,500	2,932.00	2,877,758,000	
光通信	13,100	20,670.00	270,777,000	
NTTドコモ	799,800	2,911.50	2,328,617,700	
エムティーアイ	12,900	597.00	7,701,300	
GMOインターネット	40,600	1,653.00	67,111,800	
アйдママーケティングコミュニケーション	2,300	665.00	1,529,500	
カドカワ	32,500	1,150.00	37,375,000	
学研ホールディングス	3,700	5,680.00	21,016,000	
ゼンリン	20,200	3,375.00	68,175,000	
昭文社	5,100	618.00	3,151,800	
インプレスホールディングス	9,200	182.00	1,674,400	
東京電力ホールディングス	906,200	565.00	512,003,000	
中部電力	347,300	1,642.50	570,440,250	
関西電力	463,100	1,671.50	774,071,650	
中国電力	156,900	1,422.00	223,111,800	
北陸電力	111,200	1,112.00	123,654,400	
東北電力	265,800	1,489.00	395,776,200	
四国電力	102,200	1,413.00	144,408,600	
九州電力	250,700	1,339.00	335,687,300	
北海道電力	113,800	709.00	80,684,200	
沖縄電力	23,000	2,253.00	51,819,000	
電源開発	90,300	3,075.00	277,672,500	
エフオン	6,800	1,205.00	8,194,000	
イーレックス	17,900	958.00	17,148,200	
レノバ	11,800	1,206.00	14,230,800	

東京瓦斯	238,600	2,697.00	643,504,200
大阪瓦斯	220,200	2,100.50	462,530,100
東邦瓦斯	56,200	4,045.00	227,329,000
北海道瓦斯	6,000	1,491.00	8,946,000
広島ガス	23,400	370.00	8,658,000
西部瓦斯	13,700	2,551.00	34,948,700
静岡ガス	35,000	929.00	32,515,000
メタウォーター	6,400	2,987.00	19,116,800
アイネット	6,300	1,726.00	10,873,800
松竹	7,400	13,110.00	97,014,000
東宝	73,300	3,560.00	260,948,000
エイチ・アイ・エス	19,300	3,580.00	69,094,000
東映	4,200	13,020.00	54,684,000
ラックランド	2,000	3,000.00	6,000,000
エヌ・ティ・ティ・データ	346,000	1,502.00	519,692,000
共立メンテナンス	19,400	4,905.00	95,157,000
イチネンホールディングス	12,200	1,395.00	17,019,000
建設技術研究所	7,500	1,630.00	12,225,000
スペース	7,000	1,309.00	9,163,000
長大	4,300	874.00	3,758,200
アインホールディングス	15,000	8,560.00	128,400,000
燦ホールディングス	2,500	2,672.00	6,680,000
ピー・シー・エー	1,700	1,907.00	3,241,900
スバル興業	800	5,580.00	4,464,000
東京テアトル	4,600	1,343.00	6,177,800
タナベ経営	2,000	1,728.00	3,456,000
ビジネスブレイン太田昭和	1,900	2,195.00	4,170,500
ナガワ	2,100	5,250.00	11,025,000
よみうりランド	2,300	4,300.00	9,890,000
東京都競馬	7,100	4,060.00	28,826,000
常磐興産	4,400	1,778.00	7,823,200
カナモト	15,300	4,030.00	61,659,000
東京ドーム	43,900	989.00	43,417,100
D T S	11,600	4,280.00	49,648,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	51,800	4,260.00	220,668,000
シーイーシー	13,200	2,456.00	32,419,200
カブコン	47,700	2,663.00	127,025,100
西尾レントオール	11,000	3,775.00	41,525,000
アイ・エス・ビー	2,100	2,432.00	5,107,200
アゴーラ・ホスピタリティ・グループ	60,400	30.00	1,812,000
日本空港ビルデング	32,700	4,610.00	150,747,000
トランス・コスモス	12,100	2,752.00	33,299,200
乃村工藝社	25,300	2,497.00	63,174,100
ジャステック	6,400	1,161.00	7,430,400
S C S K	25,700	4,990.00	128,243,000
藤田観光	4,300	3,315.00	14,254,500
K N T - C Tホールディングス	6,700	1,222.00	8,187,400
日本管財	11,600	2,058.00	23,872,800

トーカイ	10,500	2,416.00	25,368,000
白洋舎	1,200	3,030.00	3,636,000
セコム	115,100	9,340.00	1,075,034,000
日本システムウエア	3,700	1,864.00	6,896,800
セントラル警備保障	5,300	5,440.00	28,832,000
アイネス	14,100	1,239.00	17,469,900
丹青社	22,200	1,116.00	24,775,200
メイテック	12,700	5,010.00	63,627,000
T K C	9,400	4,590.00	43,146,000
富士ソフト	16,600	5,410.00	89,806,000
応用地質	11,700	1,394.00	16,309,800
船井総研ホールディングス	22,500	2,311.00	51,997,500
N S D	18,300	2,458.00	44,981,400
進学会ホールディングス	5,000	617.00	3,085,000
丸紅建材リース	1,100	2,402.00	2,642,200
オオバ	8,600	673.00	5,787,800
コナミホールディングス	45,600	4,450.00	202,920,000
いであ	2,100	1,112.00	2,335,200
学究社	3,900	1,747.00	6,813,300
ベネッセホールディングス	39,700	3,065.00	121,680,500
イオンディライト	13,300	3,845.00	51,138,500
ナック	7,200	997.00	7,178,400
福井コンピュータホールディングス	3,200	1,878.00	6,009,600
ニチイ学館	20,500	920.00	18,860,000
ダイセキ	18,200	2,829.00	51,487,800
ステップ	4,000	1,551.00	6,204,000
日鉄住金物産	8,800	5,080.00	44,704,000
泉州電業	3,700	2,897.00	10,718,900
元気寿司	2,800	6,230.00	17,444,000
トラスコ中山	23,300	2,914.00	67,896,200
ヤマダ電機	382,200	569.00	217,471,800
オートバックスセブン	44,400	1,898.00	84,271,200
モリト	8,200	849.00	6,961,800
アークランドサカモト	19,000	1,445.00	27,455,000
ニトリホールディングス	44,400	15,250.00	677,100,000
グルメ杵屋	7,800	1,184.00	9,235,200
愛眼	9,100	338.00	3,075,800
ケーユーホールディングス	5,800	934.00	5,417,200
吉野家ホールディングス	36,700	1,757.00	64,481,900
加藤産業	17,500	3,645.00	63,787,500
イノテック	9,600	1,249.00	11,990,400
イエローハット	10,500	2,834.00	29,757,000
松屋フーズホールディングス	5,400	3,510.00	18,954,000
J B C Cホールディングス	8,800	1,370.00	12,056,000
J Kホールディングス	11,200	749.00	8,388,800
サガミホールディングス	15,000	1,362.00	20,430,000
日伝	9,200	1,890.00	17,388,000
関西スーパーマーケット	8,500	1,097.00	9,324,500
ミロク情報サービス	9,800	2,260.00	22,148,000
北沢産業	9,200	226.00	2,079,200

杉本商事	6,000	1,911.00	11,466,000	
因幡電機産業	14,800	4,650.00	68,820,000	
王将フードサービス	8,200	7,770.00	63,714,000	
プレナス	12,600	1,785.00	22,491,000	
ミニストップ	8,300	2,086.00	17,313,800	
アークス	20,900	2,918.00	60,986,200	
パローホールディングス	26,000	2,452.00	63,752,000	
バイテックホールディングス	5,100	2,414.00	12,311,400	
東テック	3,700	3,030.00	11,211,000	
ミスミグループ本社	129,900	2,584.00	335,661,600	
藤久	900	1,050.00	945,000	
アルテック	8,200	287.00	2,353,400	
ベルク	5,000	5,710.00	28,550,000	
大 庄	5,900	1,670.00	9,853,000	
タキヒヨー	3,700	1,992.00	7,370,400	
ファーストリテイリング	15,000	56,070.00	841,050,000	
ソフトバンクグループ	504,200	9,976.00	5,029,899,200	
蔵王産業	1,800	1,492.00	2,685,600	
スズケン	51,000	5,230.00	266,730,000	
サンドラッグ	42,100	3,940.00	165,874,000	
サクスパー ホールディングス	10,500	943.00	9,901,500	
ジェコス	7,700	1,140.00	8,778,000	
ヤマザワ	2,200	1,695.00	3,729,000	
やまや	2,300	2,872.00	6,605,600	
ルネサスイーストン	10,200	512.00	5,222,400	
ペルーナ	27,500	1,256.00	34,540,000	
合計	130,846,435		275,713,338,725	

\*担保として以下の有価証券が差し入れられております。

銘柄	株式数
トヨタ自動車	500,000

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

## 「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

(単位:円)

科 目	注記 番号	平成30年10月12日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		1,789,467,326
国債証券		285,051,548,800
地方債証券		21,978,991,778
特殊債券		17,157,003,948
社債券		15,127,644,060
未収利息		531,500,447
前払費用		20,245,776
流動資産合計		341,656,402,135
資産合計		341,656,402,135
負債の部		
流動負債		
未払金		1,222,747,000
未払解約金		352,701,000
流動負債合計		1,575,448,000
負債合計		1,575,448,000
純資産の部		
元本等		
元本	1	265,980,959,111
剰余金		
剰余金又は欠損金( )		74,099,995,024
元本等合計		340,080,954,135
純資産合計		340,080,954,135
負債純資産合計		341,656,402,135



## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

## （貸借対照表に関する注記）

項目	平成30年10月12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	283,369,079,957円 80,022,572,430円 97,410,693,276円
元本の内訳	
ファンド名	
D I A M国内債券パッシブ・ファンド	17,213,319,359円
M I T O ラップ型ファンド（安定型）	116,744,280円
M I T O ラップ型ファンド（中立型）	91,662,889円
M I T O ラップ型ファンド（積極型）	28,460,338円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	822,678,821円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	242,214,024円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	36,643,048円
たわらノーロード 国内債券	4,817,544,677円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	118,661,211円
たわらノーロード バランス（堅実型）	28,242,803円
たわらノーロード バランス（標準型）	53,757,715円
たわらノーロード バランス（積極型）	10,644,651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）	5,245,008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）	74,013,081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）	94,847,777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）	26,936,285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)	13,511,245円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(保守型)	1,245,980円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定型)	660,435円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定成長型)	2,989,789円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(成長型)	675,145円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(積極型)	17,517円
D I A M国内債券インデックス ファンド<DC年金>	12,871,301,141円
D I A Mバランス・ファンド< DC年金> 1 安定型	5,951,215,208円
D I A Mバランス・ファンド< DC年金> 2 安定・成長型	8,557,028,547円
D I A Mバランス・ファンド< DC年金> 3 成長型	3,470,237,031円
D I A M DC バランス30 インデックスファンド	1,837,771,482円
D I A M DC バランス50 インデックスファンド	2,032,813,435円
D I A M DC バランス70 インデックスファンド	316,274,220円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型>	88,374,891円
マネックス資産設計ファンド< 育成型>	2,317,324,650円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	4,391,950円
D I A M DC 8資産バラ ンスファンド(新興国10)	3,186,425,011円
D I A M DC 8資産バラ ンスファンド(新興国20)	756,301,058円
D I A M DC 8資産バラ ンスファンド(新興国30)	161,357,166円
投資のソムリエ	9,687,855,915円
クルーズコントロール	2,306,772,131円
投資のソムリエ<DC年金>	841,937,321円
D I A M 8資産バランスファ ンドN<DC年金>	2,259,771,712円
D I A M DC バランス・F (成長型)	286,078,562円
クルーズコントロール<DC年 金>	1,335,920円
D I A Mコア資産設計ファンド (堅実型)	6,776,762円
D I A Mコア資産設計ファンド (積極型)	17,808,694円
投資のソムリエ<DC年金>リ スク抑制型	644,288,090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	515,269円 12,200,329,309円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2045)	2,416,181円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2055)	1,740,009円
リスク抑制世界8資産バランス ファンド(DC)	3,821,192円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2035)	3,490,471円
4資産分散投資・スタンダード <DC年金>	75,271,661円
リスクコントロール世界資産分 散ファンド	758,397,642円
9資産分散投資・スタンダード <DC年金>	290,676円
DIAMエマージング債券ファ ンド	9,450,010円
DIAM国内債券パッシブファ ンド(適格機関投資家向け)	22,706,710,305円
DIAMワールドバランス25 VA(適格機関投資家限定)	451,828,315円
DIAMグローバル・バランス ファンド25VA(適格機関投 資家限定)	289,466,887円
DIAMグローバル・バランス ファンド50VA(適格機関投 資家限定)	236,494,470円
DIAM国際分散バランスファ ンド30VA(適格機関投資家 限定)	72,823,300円
DIAM国際分散バランスファ ンド50VA(適格機関投資家 限定)	200,165,850円
DIAM国内重視バランスファ ンド30VA(適格機関投資家 限定)	83,310,095円
DIAM国内重視バランスファ ンド50VA(適格機関投資家 限定)	43,155,088円
DIAM世界バランスファンド 40VA(適格機関投資家限 定)	95,738,566円
DIAM世界バランスファンド 50VA(適格機関投資家限 定)	169,898,524円
DIAMバランスファンド25 VA(適格機関投資家限定)	5,671,947,788円
DIAMバランスファンド3 7.5VA(適格機関投資家限 定)	3,025,448,569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)	5,669,701,197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)	602,332,656円
D I A Mグローバル・アセッ ト・バランスV A 2 (適格機関 投資家限定)	269,865,242円
D I A M アクサ グローバ ル バランスファンド30V A (適格機関投資家限定)	3,452,703,759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)	923,203,788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)	194,752,933円
D I A M世界バランスファンド 55V A (適格機関投資家限 定)	46,910,967円
D I A M世界バランスファンド 35V A (適格機関投資家限 定)	97,843,684円
D I A M世界アセットバランス ファンド2V A (適格機関投資 家限定)	59,694,379,629円
D I A M世界アセットバランス ファンド40V A (適格機関投 資家限定)	827,727,378円
D I A M世界アセットバランス ファンド25V A (適格機関投 資家限定)	7,191,254,876円
D I A M世界アセットバランス ファンド3V A (適格機関投資 家限定)	27,546,015,188円
D I A Mバランス30V A (適 格機関投資家限定)	53,798,122円
D I A Mバランス50V A (適 格機関投資家限定)	16,094,725円
D I A Mバランス70V A (適 格機関投資家限定)	8,024,060円
D I A M世界アセットバランス ファンド4V A (適格機関投資 家限定)	30,749,110,925円
D I A M世界バランス25V A (適格機関投資家限定)	469,748,503円
D I A M国内バランス30V A (適格機関投資家限定)	133,450,015円
D I A Mバランス20V A (適 格機関投資家限定)	526,036,110円
D I A Mバランス40V A (適 格機関投資家限定)	737,508円
D I A Mバランス60V A (適 格機関投資家限定)	400,694円

計	265,980,959,111円
2. 受益権の総数	265,980,959,111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11月8日 至 平成30年10月12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。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。
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。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成30年10月12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。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
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。

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	平成30年10月12日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
国債証券	3,401,685,400
地方債証券	133,288,487
特殊債証券	147,774,035
社債証券	105,227,190
合計	3,787,975,112

(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15日から平成30年10月12日まで)に対応する金額であります。

## (デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (1口当たり情報に関する注記)

	平成30年10月12日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2786円 (12,786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10月12日現在

種 類	銘 柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
国債証券	384回 利付国庫債券(2年)	1,000,000,000	1,002,940,000	
	386回 利付国庫債券(2年)	1,000,000,000	1,003,250,000	
	387回 利付国庫債券(2年)	1,000,000,000	1,003,450,000	
	388回 利付国庫債券(2年)	800,000,000	802,912,000	
	390回 利付国庫債券(2年)	1,200,000,000	1,204,620,000	
	391回 利付国庫債券(2年)	1,400,000,000	1,405,656,000	
	122回 利付国庫債券(5年)	4,000,000,000	4,011,080,000	
	123回 利付国庫債券(5年)	3,000,000,000	3,009,840,000	
	124回 利付国庫債券(5年)	2,200,000,000	2,208,316,000	
	125回 利付国庫債券(5年)	3,000,000,000	3,012,750,000	
	126回 利付国庫債券(5年)	2,500,000,000	2,511,750,000	
	127回 利付国庫債券(5年)	3,000,000,000	3,015,330,000	
	128回 利付国庫債券(5年)	3,000,000,000	3,016,500,000	
	129回 利付国庫債券(5年)	2,420,000,000	2,434,229,600	
	130回 利付国庫債券(5年)	3,000,000,000	3,018,660,000	
	131回 利付国庫債券(5年)	2,020,000,000	2,033,190,600	
	132回 利付国庫債券(5年)	2,000,000,000	2,013,640,000	
	133回 利付国庫債券(5年)	2,460,000,000	2,477,441,400	
	134回 利付国庫債券(5年)	1,790,000,000	1,803,120,700	
	135回 利付国庫債券(5年)	2,100,000,000	2,115,834,000	
	136回 利付国庫債券(5年)	750,000,000	755,805,000	
	2回 利付国庫債券(40年)	460,000,000	616,832,400	
	3回 利付国庫債券(40年)	460,000,000	618,621,800	
	4回 利付国庫債券(40年)	770,000,000	1,038,198,700	
	5回 利付国庫債券(40年)	700,000,000	907,186,000	
	6回 利付国庫債券(40年)	700,000,000	887,481,000	
	7回 利付国庫債券(40年)	750,000,000	907,515,000	
	8回 利付国庫債券(40年)	840,000,000	939,750,000	
	9回 利付国庫債券(40年)	1,210,000,000	975,090,600	
	10回 利付国庫債券(40年)	1,120,000,000	1,071,067,200	
	11回 利付国庫債券(40年)	390,000,000	358,807,800	
	305回 利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,525,455,000	
	306回 利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,532,805,000	
	307回 利付国庫債券(10年)	1,400,000,000	1,428,616,000	
	308回 利付国庫債券(10年)	800,000,000	819,184,000	
	309回 利付国庫債券(10年)	1,000,000,000	1,020,610,000	
	310回 利付国庫債券(10年)	2,300,000,000	2,349,864,000	
	311回 利付国庫債券(10年)	1,020,000,000	1,038,166,200	
	312回 利付国庫債券(10年)	2,200,000,000	2,263,228,000	
	313回 利付国庫債券(10年)	1,790,000,000	1,851,414,900	

314回	利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,544,175,000
315回	利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,552,590,000
316回	利付国庫債券(10年)	500,000,000	516,185,000
317回	利付国庫債券(10年)	1,000,000,000	1,035,280,000
318回	利付国庫債券(10年)	1,600,000,000	1,651,744,000
319回	利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,557,180,000
320回	利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,552,395,000
321回	利付国庫債券(10年)	1,100,000,000	1,141,217,000
322回	利付国庫債券(10年)	1,000,000,000	1,034,030,000
324回	利付国庫債券(10年)	2,000,000,000	2,065,320,000
325回	利付国庫債券(10年)	2,900,000,000	3,000,630,000
326回	利付国庫債券(10年)	500,000,000	516,250,000
327回	利付国庫債券(10年)	1,450,000,000	1,503,200,500
328回	利付国庫債券(10年)	2,890,000,000	2,975,977,500
329回	利付国庫債券(10年)	2,270,000,000	2,362,162,000
330回	利付国庫債券(10年)	1,200,000,000	1,250,724,000
331回	利付国庫債券(10年)	650,000,000	671,047,000
332回	利付国庫債券(10年)	2,960,000,000	3,059,130,400
333回	利付国庫債券(10年)	2,500,000,000	2,586,300,000
334回	利付国庫債券(10年)	2,600,000,000	2,692,404,000
335回	利付国庫債券(10年)	2,750,000,000	2,834,920,000
336回	利付国庫債券(10年)	1,150,000,000	1,186,271,000
337回	利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,528,755,000
338回	利付国庫債券(10年)	2,650,000,000	2,718,979,500
339回	利付国庫債券(10年)	3,100,000,000	3,181,747,000
340回	利付国庫債券(10年)	3,100,000,000	3,183,731,000
341回	利付国庫債券(10年)	3,060,000,000	3,121,414,200
342回	利付国庫債券(10年)	3,000,000,000	3,015,540,000
343回	利付国庫債券(10年)	3,000,000,000	3,013,770,000
344回	利付国庫債券(10年)	2,800,000,000	2,809,940,000
345回	利付国庫債券(10年)	2,700,000,000	2,707,668,000
346回	利付国庫債券(10年)	3,000,000,000	3,005,010,000
347回	利付国庫債券(10年)	2,900,000,000	2,902,494,000
348回	利付国庫債券(10年)	2,900,000,000	2,900,000,000
349回	利付国庫債券(10年)	2,610,000,000	2,607,624,900
350回	利付国庫債券(10年)	3,400,000,000	3,393,642,000
351回	利付国庫債券(10年)	2,340,000,000	2,332,161,000
1回	利付国庫債券(30年)	100,000,000	127,950,000
2回	利付国庫債券(30年)	100,000,000	124,417,000
3回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	247,312,000
4回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	262,856,000
5回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	247,316,000
6回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	253,412,000
7回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	377,877,000
8回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	239,298,000
11回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	237,034,000
12回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	373,173,000
13回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	369,222,000
14回	利付国庫債券(30年)	500,000,000	645,775,000
15回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	261,774,000



16回	利付国庫債券(30年)	400,000,000	524,628,000	
17回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	259,604,000	
18回	利付国庫債券(30年)	420,000,000	539,263,200	
19回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	257,006,000	
20回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	395,820,000	
21回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	386,658,000	
22回	利付国庫債券(30年)	470,000,000	621,683,100	
23回	利付国庫債券(30年)	600,000,000	794,922,000	
24回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	398,079,000	
25回	利付国庫債券(30年)	400,000,000	517,404,000	
26回	利付国庫債券(30年)	700,000,000	918,981,000	
27回	利付国庫債券(30年)	700,000,000	933,240,000	
28回	利付国庫債券(30年)	900,000,000	1,202,751,000	
29回	利付国庫債券(30年)	900,000,000	1,189,458,000	
30回	利付国庫債券(30年)	960,000,000	1,253,548,800	
31回	利付国庫債券(30年)	900,000,000	1,161,297,000	
32回	利付国庫債券(30年)	1,060,000,000	1,391,557,400	
33回	利付国庫債券(30年)	1,300,000,000	1,632,163,000	
34回	利付国庫債券(30年)	1,140,000,000	1,480,073,400	
35回	利付国庫債券(30年)	1,250,000,000	1,574,200,000	
36回	利付国庫債券(30年)	1,300,000,000	1,640,132,000	
37回	利付国庫債券(30年)	1,450,000,000	1,801,117,500	
38回	利付国庫債券(30年)	900,000,000	1,099,629,000	
39回	利付国庫債券(30年)	800,000,000	995,728,000	
40回	利付国庫債券(30年)	650,000,000	795,021,500	
41回	利付国庫債券(30年)	680,000,000	816,822,800	
42回	利付国庫債券(30年)	800,000,000	961,264,000	
43回	利付国庫債券(30年)	800,000,000	961,568,000	
44回	利付国庫債券(30年)	650,000,000	781,508,000	
45回	利付国庫債券(30年)	870,000,000	1,006,181,100	
46回	利付国庫債券(30年)	980,000,000	1,133,360,200	
47回	利付国庫債券(30年)	1,010,000,000	1,191,577,800	
48回	利付国庫債券(30年)	940,000,000	1,063,788,600	
49回	利付国庫債券(30年)	990,000,000	1,120,115,700	
50回	利付国庫債券(30年)	1,000,000,000	985,590,000	
51回	利付国庫債券(30年)	930,000,000	801,018,300	
52回	利付国庫債券(30年)	1,060,000,000	963,200,800	
53回	利付国庫債券(30年)	900,000,000	838,359,000	
54回	利付国庫債券(30年)	900,000,000	881,622,000	
55回	利付国庫債券(30年)	980,000,000	958,743,800	
56回	利付国庫債券(30年)	900,000,000	879,336,000	
57回	利付国庫債券(30年)	930,000,000	907,456,800	
58回	利付国庫債券(30年)	1,130,000,000	1,101,139,800	
59回	利付国庫債券(30年)	800,000,000	758,080,000	
45回	利付国庫債券(20年)	900,000,000	932,562,000	
46回	利付国庫債券(20年)	500,000,000	519,625,000	
47回	利付国庫債券(20年)	250,000,000	261,242,500	
48回	利付国庫債券(20年)	500,000,000	528,560,000	
50回	利付国庫債券(20年)	780,000,000	818,142,000	
51回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	633,966,000	

5 2回	利付国庫債券(20年)	550,000,000	585,607,000	
5 4回	利付国庫債券(20年)	700,000,000	751,254,000	
5 5回	利付国庫債券(20年)	410,000,000	439,483,100	
5 8回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	646,848,000	
6 0回	利付国庫債券(20年)	590,000,000	626,497,400	
6 1回	利付国庫債券(20年)	500,000,000	523,760,000	
6 4回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	658,002,000	
6 5回	利付国庫債券(20年)	550,000,000	605,550,000	
6 7回	利付国庫債券(20年)	520,000,000	574,714,400	
7 0回	利付国庫債券(20年)	750,000,000	853,440,000	
7 2回	利付国庫債券(20年)	350,000,000	393,946,000	
7 3回	利付国庫債券(20年)	790,000,000	887,928,400	
7 5回	利付国庫債券(20年)	440,000,000	499,386,800	
7 8回	利付国庫債券(20年)	640,000,000	720,736,000	
8 1回	利付国庫債券(20年)	240,000,000	272,985,600	
8 3回	利付国庫債券(20年)	780,000,000	896,009,400	
8 5回	利付国庫債券(20年)	440,000,000	507,306,800	
8 8回	利付国庫債券(20年)	1,200,000,000	1,407,084,000	
9 0回	利付国庫債券(20年)	1,200,000,000	1,403,268,000	
9 2回	利付国庫債券(20年)	1,300,000,000	1,515,267,000	
9 3回	利付国庫債券(20年)	700,000,000	812,840,000	
9 4回	利付国庫債券(20年)	800,000,000	935,664,000	
9 5回	利付国庫債券(20年)	1,200,000,000	1,429,008,000	
9 7回	利付国庫債券(20年)	1,100,000,000	1,305,062,000	
9 9回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,654,716,000	
1 0 0回	利付国庫債券(20年)	850,000,000	1,015,758,500	
1 0 2回	利付国庫債券(20年)	660,000,000	803,596,200	
1 0 5回	利付国庫債券(20年)	950,000,000	1,132,941,500	
1 0 6回	利付国庫債券(20年)	350,000,000	420,829,500	
1 0 7回	利付国庫債券(20年)	650,000,000	777,094,500	
1 0 8回	利付国庫債券(20年)	750,000,000	881,610,000	
1 0 9回	利付国庫債券(20年)	770,000,000	907,406,500	
1 1 0回	利付国庫債券(20年)	400,000,000	479,588,000	
1 1 1回	利付国庫債券(20年)	770,000,000	933,948,400	
1 1 2回	利付国庫債券(20年)	750,000,000	901,822,500	
1 1 3回	利付国庫債券(20年)	1,500,000,000	1,808,745,000	
1 1 4回	利付国庫債券(20年)	1,100,000,000	1,329,284,000	
1 1 5回	利付国庫債券(20年)	300,000,000	365,817,000	
1 1 6回	利付国庫債券(20年)	740,000,000	904,835,000	
1 1 7回	利付国庫債券(20年)	950,000,000	1,151,010,500	
1 1 8回	利付国庫債券(20年)	700,000,000	841,876,000	
1 1 9回	利付国庫債券(20年)	700,000,000	825,937,000	
1 2 0回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	693,888,000	
1 2 1回	利付国庫債券(20年)	1,130,000,000	1,348,361,200	
1 2 2回	利付国庫債券(20年)	500,000,000	590,815,000	
1 2 3回	利付国庫債券(20年)	1,130,000,000	1,377,922,000	
1 2 4回	利付国庫債券(20年)	500,000,000	603,785,000	
1 2 5回	利付国庫債券(20年)	720,000,000	888,681,600	
1 2 6回	利付国庫債券(20年)	450,000,000	544,257,000	
1 2 7回	利付国庫債券(20年)	350,000,000	419,100,500	

128回	利付国庫債券(20年)	700,000,000	839,881,000		
129回	利付国庫債券(20年)	700,000,000	831,299,000		
130回	利付国庫債券(20年)	900,000,000	1,070,046,000		
131回	利付国庫債券(20年)	450,000,000	529,411,500		
132回	利付国庫債券(20年)	660,000,000	777,645,000		
133回	利付国庫債券(20年)	910,000,000	1,083,755,400		
134回	利付国庫債券(20年)	900,000,000	1,072,863,000		
135回	利付国庫債券(20年)	500,000,000	589,590,000		
136回	利付国庫債券(20年)	350,000,000	408,201,500		
137回	利付国庫債券(20年)	690,000,000	814,786,500		
138回	利付国庫債券(20年)	640,000,000	738,489,600		
139回	利付国庫債券(20年)	580,000,000	676,848,400		
140回	利付国庫債券(20年)	1,350,000,000	1,595,268,000		
141回	利付国庫債券(20年)	1,100,000,000	1,301,498,000		
142回	利付国庫債券(20年)	750,000,000	897,525,000		
143回	利付国庫債券(20年)	970,000,000	1,134,958,200		
144回	利付国庫債券(20年)	760,000,000	878,826,000		
145回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,659,238,000		
146回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,659,938,000		
147回	利付国庫債券(20年)	1,500,000,000	1,757,610,000		
148回	利付国庫債券(20年)	1,300,000,000	1,504,503,000		
149回	利付国庫債券(20年)	1,520,000,000	1,760,190,400		
150回	利付国庫債券(20年)	1,500,000,000	1,714,380,000		
151回	利付国庫債券(20年)	1,410,000,000	1,567,130,400		
152回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,554,658,000		
153回	利付国庫債券(20年)	1,360,000,000	1,531,033,600		
154回	利付国庫債券(20年)	1,500,000,000	1,663,905,000		
155回	利付国庫債券(20年)	1,600,000,000	1,721,120,000		
156回	利付国庫債券(20年)	1,370,000,000	1,335,188,300		
157回	利付国庫債券(20年)	1,300,000,000	1,219,803,000		
158回	利付国庫債券(20年)	1,330,000,000	1,311,646,000		
159回	利付国庫債券(20年)	1,420,000,000	1,421,164,400		
160回	利付国庫債券(20年)	1,300,000,000	1,321,567,000		
161回	利付国庫債券(20年)	1,200,000,000	1,195,980,000		
162回	利付国庫債券(20年)	1,200,000,000	1,193,904,000		
163回	利付国庫債券(20年)	1,210,000,000	1,200,695,100		
164回	利付国庫債券(20年)	1,460,000,000	1,419,762,400		
165回	利付国庫債券(20年)	1,220,000,000	1,183,936,800		
国債証券 合計		264,340,000,000	285,051,548,800		
地方債証券	680回	東京都公募公債	200,000,000	203,924,000	
	685回	東京都公募公債	500,000,000	509,340,000	
	688回	東京都公募公債	200,000,000	203,558,000	
	697回	東京都公募公債	500,000,000	514,540,000	
	701回	東京都公募公債	700,000,000	719,782,000	
	708回	東京都公募公債	500,000,000	515,745,000	
	720回	東京都公募公債	300,000,000	311,430,000	
	726回	東京都公募公債	400,000,000	413,540,000	
	5回	東京都公募公債 20年	100,000,000	112,770,000	
	9回	東京都公募公債 20年	200,000,000	234,800,000	
	10回	東京都公募公債 20年	300,000,000	350,874,000	

22年度12回 北海道公募公債	200,000,000	205,758,000	
194回 神奈川県公募公債	300,000,000	309,156,000	
208回 神奈川県公募公債	300,000,000	307,563,000	
336回 大阪府公募公債	200,000,000	204,212,000	
345回 大阪府公募公債	300,000,000	308,088,000	
356回 大阪府公募公債	200,000,000	206,436,000	
364回 大阪府公募公債	300,000,000	308,526,000	
374回 大阪府公募公債	300,000,000	312,138,000	
26年度11回 京都府公募公債	350,000,000	357,539,000	
26年度17回 兵庫県公募公債	200,000,000	203,970,000	
1回 兵庫県公募公債(12年)	300,000,000	316,656,000	
22年度8回 静岡県公募公債	200,000,000	203,880,000	
23年度9回 静岡県公募公債	200,000,000	206,264,000	
1回 静岡県公募公債 20年	100,000,000	114,017,000	
22年度6回 愛知県公募公債	200,000,000	204,160,000	
23年度20回 愛知県公募公債	500,000,000	517,915,000	
25年度4回 愛知県公募公債	300,000,000	310,881,000	
22年度1回 広島県公募公債	200,000,000	204,376,000	
23年度2回 埼玉県公募公債	200,000,000	206,072,000	
26年度5回 埼玉県公募公債	400,000,000	411,536,000	
25年度11回 福岡県公募公債	200,000,000	206,352,000	
24年度2回 福岡県公募公債(20年)	300,000,000	344,730,000	
24年度7回 千葉県公募公債	300,000,000	308,529,000	
25年度5回 千葉県公募公債	200,000,000	207,372,000	
80回 共同発行市場公募地方債	200,000,000	203,406,000	
94回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,777,000	
99回 共同発行市場公募地方債	700,000,000	721,539,000	
106回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	309,108,000	
109回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	517,730,000	
111回 共同発行市場公募地方債	700,000,000	721,707,000	
119回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	516,010,000	
121回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	511,300,000	
126回 共同発行市場公募地方債	793,900,000	822,496,278	
127回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	514,915,000	
128回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	308,712,000	
137回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	513,130,000	
139回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	512,700,000	
142回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	506,685,000	
144回 共同発行市場公募地方債	400,000,000	408,672,000	
146回 共同発行市場公募地方債	400,000,000	410,812,000	
148回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	513,705,000	
166回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	498,895,000	
29年度4回 大阪市公募公債	200,000,000	198,422,000	
488回 名古屋市公募公債 10年	450,000,000	462,820,500	
4回 京都市公募公債 20年	100,000,000	118,229,000	
22年度3回 横浜市公募公債	200,000,000	204,438,000	
22年度5回 横浜市公募公債	200,000,000	205,386,000	
23年度4回 横浜市公募公債	450,000,000	463,932,000	
25年度2回 横浜市公募公債	400,000,000	415,500,000	
25年度4回 札幌市公募公債	200,000,000	206,822,000	

	2回 川崎市公募公債 15年	100,000,000	102,724,000	
	21年度2回 北九州市公募公債	200,000,000	203,216,000	
	23年度1回 千葉市公募公債	200,000,000	206,774,000	
地方債証券 合計		21,243,900,000	21,978,991,778	
特殊債券	78回 日本政策投資銀行債券	200,000,000	199,664,000	
	19回 高速道路機構債	150,000,000	211,464,000	
	26回 高速道路機構債	200,000,000	267,224,000	
	96回 高速道路機構債	700,000,000	720,391,000	
	116回 高速道路機構債	100,000,000	103,235,000	
	9回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	104,735,000	
	18回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	319,203,000	
	121回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	583,505,000	
	149回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	400,000,000	412,728,000	
	180回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1,000,000,000	1,030,460,000	
	189回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	511,820,000	
	193回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	520,305,000	
	195回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	330,000,000	344,018,400	
	241回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	511,705,000	
	260回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	220,850,000	
	309回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	800,000,000	797,968,000	
	319回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	197,402,000	
	28回 日本道路・機構承継債	400,000,000	529,292,000	
	1回 地方公共団体金融機構債券 20年	200,000,000	234,426,000	
	8回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	305,103,000	
	10回 政保地方公共団体金融機構債券	500,000,000	509,455,000	
	15回 政保地方公共団体金融機構債券	200,000,000	203,806,000	
	20回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	308,430,000	
	24回 地方公共団体金融機構債券	300,000,000	309,318,000	
	19回 政保地方公共団体金融機構債券	200,000,000	234,350,000	
	36回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	309,789,000	
	44回 政保地方公共団体金融機構債券	400,000,000	413,988,000	
	50回 政保地方公共団体金融機構債券	500,000,000	521,035,000	
	56回 政保地方公共団体金融機構債券	542,000,000	562,010,640	
	64回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	308,475,000	
	44回 地方公共団体金融機構債券 20年	200,000,000	219,698,000	
	39回 住宅金融支援機構債券	200,000,000	237,930,000	
	75回 住宅金融支援機構債券	350,000,000	418,278,000	
	222回 住宅金融支援機構債券	300,000,000	298,149,000	

6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	44,469,000	46,779,609	
8回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	31,276,000	32,960,838	
9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	46,818,000	49,376,603	
2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	49,590,000	52,645,239	
13回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	18,125,000	18,663,675	
14回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	91,320,000	93,583,822	
43回貸付債権担保住宅金融公庫債券	16,636,000	17,601,387	
44回貸付債権担保住宅金融公庫債券	62,808,000	66,288,191	
51回貸付債権担保住宅金融公庫債券	47,139,000	49,678,849	
1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	79,800,000	83,605,662	
29回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	165,570,000	177,207,915	
36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	288,768,000	306,391,511	
126回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	288,900,000	288,238,419	
128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	290,259,000	289,437,567	
131回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	294,219,000	292,736,136	
132回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	294,663,000	293,145,485	
い第779号 利付商工債	200,000,000	200,428,000	
い第783号 利付商工債	300,000,000	300,897,000	
302回 利附信金中金債	300,000,000	300,618,000	
325回 利附信金中金債	400,000,000	399,360,000	
220号 利附商工債(3年)	300,000,000	299,970,000	
55回 鉄道建設運輸施設債	500,000,000	517,180,000	
特殊債券 合計	16,282,360,000	17,157,003,948	
社債券			
1回 B P C E S A円貨社債(ソーシャルボンド)	200,000,000	198,916,000	
337回 東京交通債	200,000,000	210,518,000	
27回 ラボバンク・ネダーランド円貨社債	200,000,000	200,742,000	
22回 中日本高速道路債券	300,000,000	305,892,000	
34回 政保西日本高速道路債券	200,000,000	201,172,000	
7回 キリンホールディングス社債	100,000,000	101,628,000	
9回 日本たばこ産業社債	200,000,000	200,478,000	
19回 三菱ケミカルホールディングス社債	100,000,000	101,208,000	
6回 J Xホールディングス社債	100,000,000	104,182,000	
23回 ジェイ エフ イー ホールディングス社債	100,000,000	99,671,000	
30回 豊田自動織機社債	200,000,000	199,802,000	
12回 パナソニック社債	200,000,000	200,820,000	
13回 パナソニック社債	100,000,000	101,335,000	
56回 日産自動車社債	100,000,000	100,620,000	
14回 トヨタ自動車社債	200,000,000	207,256,000	
16回 トヨタ自動車社債	200,000,000	204,948,000	
94回 丸紅社債	100,000,000	103,738,000	

45回	住友商事社債	100,000,000	103,182,000	
47回	住友商事社債	100,000,000	102,908,000	
48回	クレディセゾン社債	100,000,000	103,385,000	
57回	東京三菱銀行社債	200,000,000	216,846,000	
7回	東京三菱銀行劣後社債	200,000,000	204,774,000	
25回	三菱東京UFJ銀行劣後社債	200,000,000	204,822,000	
28回	三菱東京UFJ銀行劣後社債	200,000,000	206,390,000	
32回	三菱東京UFJ銀行劣後社債	300,000,000	311,637,000	
6回	りそな銀行劣後社債	100,000,000	102,757,000	
7回	三菱UFJ信託銀行劣後債	200,000,000	204,920,000	
9回	三菱UFJ信託銀行劣後債	100,000,000	103,871,000	
12回	住友信託銀行劣後債	100,000,000	102,534,000	
10回	三井住友信託銀行社債	200,000,000	203,716,000	
10回	セブン銀行社債	100,000,000	103,004,000	
22回	三井住友銀行劣後社債	200,000,000	204,998,000	
23回	三井住友銀行劣後社債	400,000,000	412,676,000	
15回	トヨタファイナンス社債	200,000,000	206,340,000	
47回	日立キャピタル社債	200,000,000	205,232,000	
14回	大和証券グループ本社社債	100,000,000	101,707,000	
26回	野村ホールディングス社債	100,000,000	102,793,000	
42回	野村ホールディングス社債	200,000,000	203,726,000	
46回	野村ホールディングス社債	200,000,000	200,628,000	
38回	三井不動産社債	200,000,000	203,968,000	
72回	三菱地所社債	100,000,000	111,899,000	
87回	住友不動産社債	100,000,000	100,966,000	
15回	東日本旅客鉄道社債	300,000,000	314,619,000	
19回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	107,615,000	
21回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	107,493,000	
39回	東日本旅客鉄道社債	300,000,000	336,519,000	
42回	東日本旅客鉄道社債	200,000,000	225,830,000	
9回	西日本旅客鉄道社債	200,000,000	214,988,000	
10回	西日本旅客鉄道社債	300,000,000	327,804,000	
5回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	103,342,000	
6回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	107,653,000	
11回	東海旅客鉄道社債	300,000,000	312,807,000	
13回	東海旅客鉄道社債	200,000,000	219,094,000	
14回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	110,929,000	
4回	東京地下鉄社債	120,000,000	139,432,800	
60回	日本電信電話社債	300,000,000	307,875,000	
496回	中部電力社債	500,000,000	510,510,000	
518回	中部電力社債	200,000,000	199,912,000	
377回	中国電力社債	400,000,000	416,756,000	
379回	中国電力社債	300,000,000	303,621,000	
260回	北陸電力社債	100,000,000	103,640,000	
301回	北陸電力社債	100,000,000	104,107,000	
307回	北陸電力社債	100,000,000	105,011,000	
471回	東北電力社債	400,000,000	417,784,000	
473回	東北電力社債	300,000,000	303,516,000	
253回	四国電力社債	200,000,000	207,106,000	
424回	九州電力社債	200,000,000	209,510,000	

4 2 6 回 九州電力社債	400,000,000	415,704,000	
3 2 0 回 北海道電力社債	200,000,000	202,544,000	
3 2 1 回 北海道電力社債	161,000,000	165,936,260	
3 4 0 回 北海道電力社債	300,000,000	299,628,000	
1 3 回 電源開発社債	200,000,000	222,122,000	
3 8 回 電源開発社債	300,000,000	310,599,000	
2 3 回 東京瓦斯社債	300,000,000	312,150,000	
1 8 回 大阪ガス社債	100,000,000	105,559,000	
2 7 回 N T T データ社債	100,000,000	103,323,000	
社債券 合計	14,581,000,000	15,127,644,060	
合計	316,447,260,000	339,315,188,586	

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。



## 「J-REITインデックスファンド・マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成30年10月12日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		412,192,140
投資証券		30,974,659,260
派生商品評価勘定		2,770,092
未収入金		4,123,781,900
未収配当金		372,030,177
差入委託証拠金		10,492,092
流動資産合計		35,895,925,661
資産合計		35,895,925,661
負債の部		
流動負債		
前受金		8,561,592
未払解約金		933,441,100
流動負債合計		942,002,692
負債合計		942,002,692
純資産の部		
元本等		
元本	1	18,823,627,962
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）		16,130,295,007
元本等合計		34,953,922,969
純資産合計		34,953,922,969
負債純資産合計		35,895,925,661

## 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	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。
2 . デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3 . 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

## （貸借対照表に関する注記）

項目	平成30年10月12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	21,270,304,083円
同期中追加設定元本額	14,058,053,872円
同期中一部解約元本額	16,504,729,993円
元本の内訳	
ファンド名	
MITO ラップ型ファンド（安定型）	280,843円
MITO ラップ型ファンド（中立型）	1,043,545円
MITO ラップ型ファンド（積極型）	2,059,335円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	1,947,882円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	2,803,635円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	2,608,500円
たわらノーロード 国内リート	1,507,521,334円
たわらノーロード 国内リート<ラップ向け>	581,568,842円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	84,219,485円
たわらノーロード バランス（堅実型）	1,085,989円
たわらノーロード バランス（標準型）	22,327,336円
たわらノーロード バランス（積極型）	37,826,155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)	10,219,217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)	34,805,451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)	23,100,049円
たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(積極型)	47,696,714円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定型)	158,328円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定成長型)	1,390,993円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(成長型)	916,194円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(積極型)	2,509,126円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型>	14,015,062円
マネックス資産設計ファンド< 育成型>	367,133,345円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	2,122,432円
D I A M D C 8資産バラ ンスファンド(新興国10)	113,081,002円
D I A M D C 8資産バラ ンスファンド(新興国20)	98,264,882円
D I A M D C 8資産バラ ンスファンド(新興国30)	199,795,556円
投資のソムリエ	2,696,770,852円
投資のソムリエ<DC年金>	234,092,796円
D I A M 8資産バランスファ ンドN<DC年金>	80,069,705円
投資のソムリエ<DC年金>リ スク抑制型	93,638,129円
ダイナミック・ナビゲーション	535,629円
リスク抑制世界8資産バランス ファンド	1,777,279,186円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2045)	713,168円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2055)	517,033円
リスク抑制世界8資産バランス ファンド(DC)	559,025円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2035)	1,030,966円
リスクコントロール世界資産分 散ファンド	298,782,794円
9資産分散投資・スタンダード <DC年金>	8,057円
Jリートインデックスファンド (DC)	7,708,043円

DIAM J-REITイン デックス私募ファンド2012 12(適格機関投資家限定)	90,762,161円
DIAM J-REITイン デックス私募ファンド2014 01(適格機関投資家限定)	820,082,232円
DIAM J-REITイン デックスファンド(適格機関投 資家向け)	7,928,752,440円
日米資産配分戦略ファンド(イ ンカム重視型)(為替ヘッジあ り)(適格機関投資家限定)	63,619,023円
DIAMグローバル 私募ファ ンド(適格機関投資家向け)	14,402,370円
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)	880,959,211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)	672,843,910円
計	18,823,627,962円
2. 受益権の総数	18,823,627,962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11月8日 至 平成30年10月12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。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、不動産投信指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、不動産投資信託証券の価格の変動によるリスクを有しております。
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。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成30年10月12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。
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。
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。

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	平成30年10月12日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
投資証券	135,809,448
合計	135,809,448

(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6月7日から平成30年10月12日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

## 不動産投信関連

種類	平成30年10月12日 現在			
	契約額等 (円)	うち	時価 (円)	評価損益 (円)
		1年超		
市場取引  不動産投信指数先物取引  買 建	607,932,000	-	610,740,000	2,808,000
合計	607,932,000	-	610,740,000	2,808,000

(注) 1. 時価の算定方法

不動産投信指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成30年10月12日現在
1口当たり純資産額	1,8569円
(1万口当たり純資産額)	(18,569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10月12日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
投資証券	C R E ロジスティクスファンド投資法人	365	39,493,000	
	G L P 投資法人	9,045	999,472,500	
	M C U B S M i d C i t y 投資法人	4,113	349,193,700	
	O n e リート投資法人	532	127,946,000	
	いちごオフィスリート投資法人	3,028	280,090,000	
	いちごホテルリート投資法人	638	88,235,400	
	さくら総合リート投資法人	790	70,547,000	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	1,749	839,520,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人	3,557	1,019,436,200	
	イオンリート投資法人	3,747	454,511,100	
	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	21,637	346,841,110	
	インヴィンシブル投資法人	12,773	598,415,050	
	オリックス不動産投資法人	7,273	1,265,502,000	
	グローバル・ワン不動産投資法人	2,334	266,542,800	
	ケネディクス・オフィス投資法人	1,129	804,977,000	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	2,165	371,297,500	
	ケネディクス商業リート投資法人	1,338	322,591,800	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	1,392	372,638,400	
	サムティ・レジデンシャル投資法人	731	65,570,700	
	ザイマックス・リート投資法人	337	38,350,600	
	ジャパン・ホテル・リート投資法人	10,569	860,316,600	
	ジャパンエクセレント投資法人	3,269	488,715,500	
	ジャパンリアルエステイト投資法人	3,650	2,113,350,000	
	スターアジア不動産投資法人	1,133	117,038,900	
	スターツプロシード投資法人	575	98,210,000	
	タカラレーベン不動産投資法人	546	47,938,800	
	トーセイ・リート投資法人	587	67,152,800	
	ヒューリックリート投資法人	2,632	427,700,000	
	フロンティア不動産投資法人	1,242	541,512,000	
	プレミア投資法人	3,470	404,255,000	
	ヘルスケア&メディカル投資法人	483	54,627,300	
	マリモ地方創生リート投資法人	314	35,011,000	
	ユナイテッド・アーバン投資法人	8,050	1,402,310,000	
	ラサールロジポート投資法人	2,754	282,009,600	
阪急阪神リート投資法人	1,514	212,868,400		
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	623	204,967,000		
三菱地所物流リート投資法人	386	95,380,600		
産業ファンド投資法人	4,253	485,267,300		
森トラスト・ホテルリート投資法人	856	118,128,000		



森トラスト総合リート投資法人	2,609	417,179,100	
森ヒルズリート投資法人	4,186	586,040,000	
星野リゾート・リート投資法人	555	304,695,000	
積水ハウス・リート投資法人	9,418	680,921,400	
大江戸温泉リート投資法人	589	50,771,800	
大和ハウスリート投資法人	4,570	1,166,721,000	
大和証券オフィス投資法人	842	564,140,000	
投資法人みらい	849	162,498,600	
東急リアル・エステート投資法人	2,447	381,487,300	
日本アコモデーションファンド投資法人	1,213	612,565,000	
日本ビルファンド投資法人	3,535	2,280,075,000	
日本プライムリアルティ投資法人	2,311	927,866,500	
日本プロロジスリート投資法人	4,896	1,096,214,400	
日本ヘルスケア投資法人	167	29,642,500	
日本リート投資法人	1,178	429,381,000	
日本リテールファンド投資法人	6,899	1,404,636,400	
日本ロジスティクスファンド投資法人	2,408	537,947,200	
日本賃貸住宅投資法人	4,106	366,665,800	
福岡リート投資法人	1,888	323,036,800	
平和不動産リート投資法人	2,273	251,393,800	
野村不動産マスターファンド投資法人	10,819	1,622,850,000	
投資証券 合計	193,337	30,974,659,260	
合計	193,337	30,974,659,260	

投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

## 「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成30年10月12日現在
資産の部		
流動資産		
預金		10,075,136,166
コール・ローン		596,850,688
株式		290,425,195,264
投資信託受益証券		698,118,371
投資証券		6,303,157,544
派生商品評価勘定		18,567,265
未収入金		188,087,295
未収配当金		336,342,104
差入委託証拠金		2,833,142,613
流動資産合計		311,474,597,310
資産合計		311,474,597,310
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		727,057,421
未払解約金		887,541,000
流動負債合計		1,614,598,421
負債合計		1,614,598,421
純資産の部		
元本等		
元本	1	89,642,239,133
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）		220,217,759,756
元本等合計		309,859,998,889
純資産合計		309,859,998,889
負債純資産合計		311,474,597,310

## 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10月12日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額 同期中追加設定元本額 同期中一部解約元本額 元本の内訳 ファンド名	87,780,369,310円 24,048,653,617円 22,186,783,794円

D I A M外国株式パッシブ・ ファンド	2,638,181,967円
M I T O ラップ型ファンド (安定型)	2,913,395円
M I T O ラップ型ファンド (中立型)	8,722,459円
M I T O ラップ型ファンド (積極型)	17,210,299円
グローバル8資産ラップファン ド(安定型)	20,527,857円
グローバル8資産ラップファン ド(中立型)	23,048,530円
グローバル8資産ラップファン ド(積極型)	22,143,577円
たわらノーロード 先進国株式	7,715,472,661円
たわらノーロード 先進国株式 <ラップ向け>	424,170円
たわらノーロード 先進国株式 <為替ヘッジあり>	913,386,536円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	43,357,338円
たわらノーロード バランス (堅実型)	3,180,770円
たわらノーロード バランス (標準型)	30,643,847円
たわらノーロード バランス (積極型)	58,912,437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)	200,628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)	13,473,000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)	39,630,983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)	30,040,456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)	70,805,494円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(保守型)	14,928円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定型)	61,750円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定成長型)	642,860円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(成長型)	554,670円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(積極型)	1,827,756円
D I A M外国株式インデックス ファンド<DC年金>	39,512,031,956円
D I A Mバランス・ファンド< DC年金>1安定型	158,416,607円

DIAMバランス・ファンド< DC年金>2安定・成長型	838,916,152円
DIAMバランス・ファンド< DC年金>3成長型	1,056,140,169円
DIAM DC バランス30 インデックスファンド	123,352,569円
DIAM DC バランス50 インデックスファンド	357,204,541円
DIAM DC バランス70 インデックスファンド	318,837,293円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型>	30,441,363円
マネックス資産設計ファンド< 育成型>	796,380,003円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	209,146,305円
DIAM DC 8資産 balan スファンド(新興国10)	196,337,172円
DIAM DC 8資産 balan スファンド(新興国20)	124,912,903円
DIAM DC 8資産 balan スファンド(新興国30)	221,831,396円
投資のソムリエ	2,561,519,510円
クルーズコントロール	407,756,197円
投資のソムリエ<DC年金>	222,689,229円
DIAM 8資産バランスマ ンD<DC年金>	135,266,314円
DIAM DC バランス・F (成長型)	85,144,549円
クルーズコントロール<DC年 金>	236,244円
DIAMコア資産設計ファンド (堅実型)	2,405,749円
DIAMコア資産設計ファンド (積極型)	6,300,167円
投資のソムリエ<DC年金>リ スク抑制型	70,852,416円
ダイナミック・ナビゲーション	1,428,890円
リスク抑制世界8資産バラン スファンド	1,340,930,384円
ワールドアセットバランス(基 本コース)	609,630,220円
ワールドアセットバランス(リ スク抑制コース)	2,115,016,080円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2045)	1,288,905円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2055)	928,926円
リスク抑制世界8資産バラン スファンド(DC)	419,590円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2035)	1,765,184円

4資産分散投資・スタンダード <DC年金>	5,073,861円
リスクコントロール世界資産分 散ファンド	225,974,073円
9資産分散投資・スタンダード <DC年金>	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)	91,118,948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)	2,865,678,103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)	158,341,575円
外国株式パッシブ・ファンド2 (適格機関投資家限定)	206,237,678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)	20,111,940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)	82,409,794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)	202,104,662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)	10,658,870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)	68,391,773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)	5,688,290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)	7,362,707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)	21,802,018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)	58,081,886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)	484,094,127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)	602,767,403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)	1,936,996,412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)	684,969,447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)	110,822,092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)	785,732,551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)	104,542,172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
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)	24,066,858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)	17,108,371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)	5,094,268,968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)	282,718,187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)	1,227,955,973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)	4,705,201,284円
D I A Mバランス3 0 V A (適 格機関投資家限定)	11,502,672円
D I A Mバランス5 0 V A (適 格機関投資家限定)	8,825,591円
D I A Mバランス7 0 V A (適 格機関投資家限定)	10,114,789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)	6,301,456,431円
D I A Mバランス2 0 V A (適 格機関投資家限定)	53,919,416円
D I A Mバランス4 0 V A (適 格機関投資家限定)	217,282円
D I A Mバランス6 0 V A (適 格機関投資家限定)	248,614円
計	89,642,239,133円
2 . 受益権の総数	89,642,239,133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11月8日 至 平成30年10月12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。
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いません。
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。



## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成30年10月12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。
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。
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。

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	平成30年10月12日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
株式	2,167,164,903
投資信託受益証券	41,132,512
投資証券	68,180,059
合計	2,057,852,332

(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10月12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10月12日 現在			
	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	321,129,975	-	321,057,130	72,845
アメリカ・ドル	235,085,760	-	234,750,880	334,880
イギリス・ポンド	18,254,184	-	18,270,420	16,236
オーストラリア・ドル	2,144,097	-	2,158,110	14,013
カナダ・ドル	12,395,952	-	12,398,400	2,448
ユーロ	53,249,982	-	53,479,320	229,338
買 建	5,214,820,752	-	5,214,526,160	294,592
アメリカ・ドル	3,748,545,733	-	3,748,275,040	270,693
イギリス・ポンド	185,983,473	-	185,972,080	11,393
オーストラリア・ドル	135,581,801	-	135,561,280	20,521
カナダ・ドル	200,971,870	-	200,957,400	14,470
ユーロ	943,737,875	-	943,760,360	22,485
合計	5,535,950,727	-	5,535,583,290	221,747

## (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10月12日 現在			
	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	18,032,835,931	-	17,324,567,522	708,268,409
合計	18,032,835,931	-	17,324,567,522	708,268,409

## (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10月12日現在
1口当たり純資産額	3.4566円
(1万口当たり純資産額)	(34,566円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

平成30年10月12日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	AMAZON.COM INC	30,663	1,719.360	52,720,735.680	
	ABBOTT LABORATORIES	129,962	68.380	8,886,801.560	
	AES CORP	45,579	14.440	658,160.760	
	ABIOMED INC	3,100	367.540	1,139,374.000	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	68,075	139.020	9,463,786.500	
	ADVANCED MICRO DEVICES	68,629	25.300	1,736,313.700	
	ADOBE INC	36,476	238.590	8,702,808.840	
	CHUBB LTD	34,634	126.820	4,392,283.880	
	AGCO CORP	5,610	56.220	315,394.200	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	16,380	157.090	2,573,134.200	
	ALLEGHANY CORP	1,054	599.340	631,704.360	
	RALPH LAUREN CORP	3,497	117.650	411,422.050	
	ALLSTATE CORP	25,754	93.170	2,399,500.180	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	55,523	153.620	8,529,443.260	
	AMGEN INC	49,209	193.850	9,539,164.650	
	HESS CORP	20,421	65.500	1,337,575.500	
	AMERICAN EXPRESS CO	53,581	101.580	5,442,757.980	
	AMERICAN ELECTRIC POWER	36,659	71.220	2,610,853.980	
	AFLAC INC	56,436	44.490	2,510,837.640	
	AMERICAN INTL GROUP	66,725	50.140	3,345,591.500	
	AMERCO	551	332.220	183,053.220	
	ANALOG DEVICES	27,711	83.670	2,318,579.370	
	ANADARKO PETROLEUM CORP	39,893	66.280	2,644,108.040	
	ALEXION PHARMACEUTICALS INC	16,015	119.310	1,910,749.650	
	JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	69,855	33.730	2,356,209.150	
	JONES LANG LASALLE INC	2,818	131.300	370,003.400	
	VALERO ENERGY CORP	32,105	106.890	3,431,703.450	
	APACHE CORP	30,595	44.630	1,365,454.850	
	ANSYS INC	6,519	153.510	1,000,731.690	
	APPLE INC	365,473	214.450	78,375,684.850	
	APPLIED MATERIALS INC	77,970	32.790	2,556,636.300	
	ALBEMARLE CORP	7,904	94.360	745,821.440	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	42,401	48.670	2,063,656.670		
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	7,831	81.300	636,660.300		
AMEREN CORP	17,312	64.040	1,108,660.480		

ARROW ELECTRONICS INC	5,756	67.500	388,530.000	
AUTOLIV INC	6,197	80.500	498,858.500	
AUTODESK INC	16,259	130.890	2,128,140.510	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	33,092	138.180	4,572,652.560	
AUTOZONE INC	2,015	769.010	1,549,555.150	
AVERY DENNISON CORP	6,262	97.190	608,603.780	
AVNET INC	10,288	39.480	406,170.240	
BALL CORP	24,324	43.510	1,058,337.240	
BERKSHIRE HATHAWAY INC- CL B	94,579	205.190	19,406,665.010	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	73,749	49.190	3,627,713.310	
BAXTER INTERNATIONAL INC	37,776	70.170	2,650,741.920	
BECTON DICKINSON & CO	19,749	238.490	4,709,939.010	
AMETEK INC	16,775	71.850	1,205,283.750	
VERIZON COMM INC	306,879	53.330	16,365,857.070	
WR BERKLEY CORP	8,134	74.410	605,250.940	
BEST BUY CO INC	19,210	70.750	1,359,107.500	
YUM! BRANDS INC	23,738	87.070	2,066,867.660	
FIRSTENERGY CORP	35,496	37.210	1,320,806.160	
H&R BLOCK INC	16,114	25.970	418,480.580	
BOEING CO	41,469	358.110	14,850,463.590	
ROBERT HALF INTL INC	8,158	64.400	525,375.200	
BORGWARNER INC	14,648	37.870	554,719.760	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	101,641	36.000	3,659,076.000	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	9,894	91.110	901,442.340	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	8,731	122.260	1,067,452.060	
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	1,838	554.450	1,019,079.100	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	121,395	57.500	6,980,212.500	
AFFILIATED MANAGERS GROUP INC	3,788	123.190	466,643.720	
INGREDION INC	5,305	100.000	530,500.000	
ONEOK INC	30,787	65.220	2,007,928.140	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	5,900	104.060	613,954.000	
UNITED RENTALS INC	6,332	139.840	885,466.880	
SEMPRA ENERGY	18,112	114.470	2,073,280.640	
FEDEX CORP	18,964	217.420	4,123,152.880	
VERISIGN INC	7,896	139.120	1,098,491.520	
AMPHENOL CORP	23,100	84.260	1,946,406.000	
BROWN-FORMAN CORP	19,683	45.750	900,497.250	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	127,092	5.970	758,739.240	
CSX CORP	62,392	68.770	4,290,697.840	
CABOT OIL & GAS CORP	32,261	23.190	748,132.590	
CAMPBELL SOUP CO	14,050	37.140	521,817.000	

SEAGATE TECHNOLOGY	20,613	43.340	893,367.420	
CONSTELLATION BRANDS INC	12,969	217.770	2,824,259.130	
CARDINAL HEALTH INC	22,125	51.530	1,140,101.250	
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	31,716	57.850	1,834,770.600	
CATERPILLAR INC	44,558	140.970	6,281,341.260	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	9,832	110.270	1,084,174.640	
CELGENE CORP	56,186	80.710	4,534,772.060	
CITRIX SYSTEMS INC	10,896	102.110	1,112,590.560	
CENTURYLINK INC	73,540	20.140	1,481,095.600	
CERNER CORP	22,947	61.600	1,413,535.200	
JPMORGAN CHASE & CO	254,725	108.130	27,543,414.250	
CHURCH & DWIGHT CO INC	18,822	54.870	1,032,763.140	
CIGNA CORP	18,009	206.000	3,709,854.000	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	10,982	72.960	801,246.720	
CINTAS CORP	6,282	184.020	1,156,013.640	
CISCO SYSTEMS INC	349,354	44.120	15,413,498.480	
CLOROX COMPANY	9,331	142.180	1,326,681.580	
COCA-COLA CO/THE	298,559	44.640	13,327,673.760	
COPART INC	15,900	49.050	779,895.000	
COGNEX CORP	11,508	43.660	502,439.280	
COLGATE-PALMOLIVE CO	62,296	62.350	3,884,155.600	
MARRIOTT INTERNATIONAL- CL A	22,744	114.630	2,607,144.720	
COMERICA INC	12,068	85.800	1,035,434.400	
COMCAST CORP-CL A	345,846	33.670	11,644,634.820	
CA INC	22,732	43.470	988,160.040	
CONAGRA BRANDS INC	28,323	34.870	987,623.010	
CONSOLIDATED EDISON INC	23,350	76.050	1,775,767.500	
CMS ENERGY CORP	19,291	49.210	949,310.110	
COOPER COS INC	3,794	250.590	950,738.460	
MOLSON COORS BREWING CO	13,855	59.590	825,619.450	
CORNING INC	61,112	31.340	1,915,250.080	
SEALED AIR CORP	13,870	34.940	484,617.800	
CUMMINS INC	11,239	145.470	1,634,937.330	
DR HORTON INC	24,498	37.920	928,964.160	
DANAHER CORP	47,175	101.270	4,777,412.250	
MOODY'S CORP	12,963	153.310	1,987,357.530	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	43,966	70.290	3,090,370.140	
TARGET CORP	37,486	82.800	3,103,840.800	
DEERE & CO	22,801	146.470	3,339,662.470	
MORGAN STANLEY	99,843	43.490	4,342,172.070	
REPUBLIC SERVICES INC	17,375	70.100	1,217,987.500	
COSTAR GROUP INC	2,786	375.000	1,044,750.000	
THE WALT DISNEY CO	112,062	111.150	12,455,691.300	
DOLLAR TREE INC	17,493	79.510	1,390,868.430	

DOVER CORP	10,736	81.340	873,266.240	
OMNICOM GROUP	16,993	68.070	1,156,713.510	
DTE ENERGY CO	13,122	110.580	1,451,030.760	
DUKE ENERGY CORP	52,625	79.980	4,208,947.500	
FLOWSERVE CORP	8,406	49.420	415,424.520	
DARDEN RESTAURANTS INC	9,436	104.050	981,815.800	
EBAY INC	71,564	31.400	2,247,109.600	
BANK OF AMERICA CORP	722,337	28.360	20,485,477.320	
CITIGROUP INC	190,608	68.380	13,033,775.040	
EASTMAN CHEMICAL CO	10,193	82.050	836,335.650	
E*TRADE FINANCIAL CORP	18,740	49.520	928,004.800	
EATON CORP PLC	32,234	79.530	2,563,570.020	
EATON VANCE CORP	9,184	46.660	428,525.440	
CADENCE DESIGN SYS INC	20,877	39.130	816,917.010	
DISH NETWORK CORP	16,150	31.870	514,700.500	
ECOLAB INC	19,009	145.950	2,774,363.550	
ELECTRONIC ARTS INC	23,050	103.600	2,387,980.000	
SALESFORCE.COM INC	52,600	139.240	7,324,024.000	
EMERSON ELECTRIC CO	47,931	71.200	3,412,687.200	
ATMOS ENERGY CORP	8,221	93.350	767,430.350	
ENERGY CORP	13,599	81.200	1,104,238.800	
EOG RESOURCES INC	43,300	121.620	5,266,146.000	
EQUIFAX INC	8,495	118.520	1,006,827.400	
EQT CORP	20,049	45.350	909,222.150	
ESTEE LAUDER COS INC/THE	16,134	128.080	2,066,442.720	
EXPEDITORS INTERNATIONAL	12,550	66.480	834,324.000	
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	41,833	93.740	3,921,425.420	
EXXON MOBIL CORP	315,280	81.600	25,726,848.000	
FMC CORP	10,614	83.160	882,660.240	
NEXTERA ENERGY INC	35,113	169.090	5,937,257.170	
ASSURANT INC	4,089	103.150	421,780.350	
FASTENAL CO	21,654	51.250	1,109,767.500	
FIFTH THIRD BANCORP	52,173	27.230	1,420,670.790	
M&T BANK CORP	10,399	160.450	1,668,519.550	
FISERV INC	30,704	75.900	2,330,433.600	
FLIR SYSTEMS INC	11,623	55.200	641,589.600	
MACY'S INC	24,741	32.140	795,175.740	
FORD MOTOR CO	278,818	8.810	2,456,386.580	
FRANKLIN RESOURCES INC	22,314	28.540	636,841.560	
FREEMPORT-MCMORAN INC	96,812	13.230	1,280,822.760	
FLEX LTD	35,913	11.790	423,414.270	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	12,176	71.290	868,027.040	
GAP INC/THE	18,295	26.630	487,195.850	
DENTSPLY SIRONA INC	17,477	35.680	623,579.360	
GENERAL DYNAMICS CORP	19,047	192.940	3,674,928.180	
GENERAL MILLS INC	44,775	42.850	1,918,608.750	
GENUINE PARTS CO	11,759	94.750	1,114,165.250	
GILEAD SCIENCES INC	97,302	72.500	7,054,395.000	

GARTNER INC	7,153	145.050	1,037,542.650	
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	18,097	20.500	370,988.500	
MCKESSON CORP	15,054	129.240	1,945,578.960	
NVIDIA CORP	42,765	235.130	10,055,334.450	
GENERAL ELECTRIC CO	641,549	12.720	8,160,503.280	
WW GRAINGER INC	3,832	309.000	1,184,088.000	
HALLIBURTON CO	66,065	39.750	2,626,083.750	
MONSTER BEVERAGE CORP	32,522	52.830	1,718,137.260	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	26,624	212.970	5,670,113.280	
HARLEY-DAVIDSON INC	12,901	40.930	528,037.930	
HARRIS CORP	8,954	154.220	1,380,885.880	
HASBRO INC	9,136	97.810	893,592.160	
HENRY SCHEIN INC	11,426	83.540	954,528.040	
HELMERICH & PAYNE INC	7,213	68.240	492,215.120	
HERSHEY FOODS CORP	10,132	102.090	1,034,375.880	
HP INC	122,725	23.010	2,823,902.250	
F5 NETWORKS INC	4,874	164.710	802,796.540	
CROWN HOLDINGS INC NPR	10,472	45.500	476,476.000	
UNITED THERAPEUTICS CORP	3,447	121.380	418,396.860	
JUNIPER NETWORKS INC	27,740	26.780	742,877.200	
HOLLYFRONTIER CORP	12,551	66.040	828,868.040	
HOLOGIC INC	19,133	39.340	752,692.220	
UNUM GROUP	16,000	36.910	590,560.000	
HOME DEPOT INC	85,485	189.740	16,219,923.900	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	12,887	97.300	1,253,905.100	
HORMEL FOODS CORP	19,345	39.680	767,609.600	
CENTERPOINT ENERGY INC	31,952	27.150	867,496.800	
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,337	198.500	463,894.500	
HUMANA INC	10,468	319.910	3,348,817.880	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	5,927	110.290	653,688.830	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	82,761	14.700	1,216,586.700	
RED HAT INC	13,147	117.380	1,543,194.860	
NEKTAR THERAPEUTICS	12,000	47.900	574,800.000	
BIOGEN INC	15,971	327.270	5,226,829.170	
IDEX CORP	5,924	134.180	794,882.320	
ILLINOIS TOOL WORKS	22,895	129.350	2,961,468.250	
INTUIT INC	18,126	200.690	3,637,706.940	
IDEXX LABORATORIES INC	6,255	214.110	1,339,258.050	
INGERSOLL-RAND PLC	18,874	95.930	1,810,582.820	
INTEL CORP	348,219	44.230	15,401,726.370	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	5,578	132.630	739,810.140	
INTERNATIONAL PAPER CO	28,375	42.820	1,215,017.500	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	29,157	21.600	629,791.200	



JACOBS ENGINEERING GROUP INC	9,631	72.190	695,261.890	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	5,919	147.320	871,987.080	
INCYTE CORP	12,360	61.750	763,230.000	
JOHNSON & JOHNSON	198,834	133.840	26,611,942.560	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	25,530	46.820	1,195,314.600	
KLA-TENCOR CORP	11,724	91.770	1,075,911.480	
DEVON ENERGY CORP	39,484	36.040	1,423,003.360	
KELLOGG CO	18,922	67.620	1,279,505.640	
EAST WEST BANCORP INC	11,000	57.290	630,190.000	
KEYCORP	79,276	19.240	1,525,270.240	
KIMBERLY-CLARK CORP	26,156	108.130	2,828,248.280	
BLACKROCK INC/NEW YORK	8,949	417.680	3,737,818.320	
KOHL'S CORP	11,357	70.820	804,302.740	
KROGER CO	60,317	26.740	1,612,876.580	
LAM RESEARCH CORP	12,122	137.620	1,668,229.640	
PACKAGING CORP OF AMERICA	7,057	88.360	623,556.520	
AKAMAI TECHNOLOGIES	12,622	61.340	774,233.480	
LEGGETT & PLATT INC	9,588	39.060	374,507.280	
LENNAR CORP	21,933	43.310	949,918.230	
JEFFERIES FINANCIAL GROUP INC	21,462	20.770	445,765.740	
ELI LILLY & CO	73,039	107.910	7,881,638.490	
L BRANDS INC	16,262	30.210	491,275.020	
LINCOLN NATIONAL CORP	16,362	63.990	1,047,004.380	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	51,308	113.760	5,836,798.080	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	25,175	64.890	1,633,605.750	
LOCKHEED MARTIN CORP	19,173	326.260	6,255,382.980	
LOEWS CORP	21,346	47.240	1,008,385.040	
LOWE'S COS INC	60,996	104.230	6,357,613.080	
DOMINION ENERGY INC	48,002	71.780	3,445,583.560	
SCANA CORP	10,902	39.770	433,572.540	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	40,298	25.950	1,045,733.100	
MCCORMICK & CO INC	9,307	131.670	1,225,452.690	
MCDONALD'S CORPORATION	58,315	162.970	9,503,595.550	
S&P GLOBAL INC	18,409	180.030	3,314,172.270	
EVEREST RE GROUP LTD	2,855	215.000	613,825.000	
MANPOWERGROUP INC	4,257	75.880	323,021.160	
MARKEL CORPORATION	989	1,131.050	1,118,608.450	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	16,081	139.770	2,247,641.370	
MARSH & MCLENNAN COS	37,853	79.640	3,014,612.920	
MASCO CORP	23,043	32.600	751,201.800	

MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	4,387	168.860	740,788.820	
MATTEL INC	24,003	13.990	335,801.970	
METLIFE INC	64,937	43.760	2,841,643.120	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	20,342	51.520	1,048,019.840	
MEDTRONIC PLC	100,647	93.110	9,371,242.170	
ACTIVISION BLIZZARD INC	54,568	73.850	4,029,846.800	
CVS HEALTH CORP	75,876	73.190	5,553,364.440	
MERCK & CO. INC.	201,289	68.370	13,762,128.930	
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	31,900	16.360	521,884.000	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	7,176	168.250	1,207,362.000	
MICROSOFT CORP	542,300	105.910	57,434,993.000	
MICRON TECH INC	86,870	41.970	3,645,933.900	
MIDDLEBY CORP	4,100	114.110	467,851.000	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	17,529	67.700	1,186,713.300	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	45,086	17.720	798,923.920	
3M CO	44,134	196.730	8,682,481.820	
MOHAWK INDUSTRIES INC	4,873	157.220	766,133.060	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	12,062	117.940	1,422,592.280	
KANSAS CITY SOUTHERN	7,247	102.950	746,078.650	
MYLAN NV	38,244	32.600	1,246,754.400	
ILLUMINA INC	11,065	307.450	3,401,934.250	
XCEL ENERGY INC	37,554	47.620	1,788,321.480	
NATIONAL OILWELL VARCO INC	26,938	41.900	1,128,702.200	
NETAPP INC	20,587	73.960	1,522,614.520	
NEWFIELD EXPLORATION CO	13,740	25.180	345,973.200	
NEWELL BRANDS INC	36,206	17.670	639,760.020	
NEWMONT MINING CORP	38,093	32.720	1,246,402.960	
NVR INC	236	2,272.880	536,399.680	
NIKE INC-CL B	95,097	74.510	7,085,677.470	
NOBLE ENERGY INC	36,582	30.980	1,133,310.360	
NORDSTROM INC	9,487	59.290	562,484.230	
NORFOLK SOUTHERN CORP	21,159	168.130	3,557,462.670	
EVERSOURCE ENERGY	23,085	61.680	1,423,882.800	
NISOURCE INC	31,548	24.650	777,658.200	
TAPESTRY INC	22,269	42.680	950,440.920	
NORTHERN TRUST CORP	16,090	99.160	1,595,484.400	
NORTHROP GRUMMAN CORP	12,188	297.620	3,627,392.560	
WELLS FARGO & CO	344,095	51.440	17,700,246.800	
NUCOR CORP	23,780	60.460	1,437,738.800	
CHENIERE ENERGY INC	15,927	63.900	1,017,735.300	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	36,024	90.940	3,276,022.560	

OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	56,876	76.530	4,352,720.280	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	4,917	136.310	670,236.270	
OGE ENERGY CORP	16,028	36.280	581,495.840	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	6,375	330.350	2,105,981.250	
ORACLE CORP	227,904	46.780	10,661,349.120	
PACCAR INC	26,537	62.850	1,667,850.450	
EXELON CORP	69,910	42.730	2,987,254.300	
PARKER HANNIFIN CORP	9,885	165.600	1,636,956.000	
PAYCHEX INC	23,141	67.530	1,562,711.730	
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	6,526	54.860	358,016.360	
ALIGN TECHNOLOGY INC	5,854	312.860	1,831,482.440	
PPL CORPORATION	52,183	29.970	1,563,924.510	
PEPSICO INC	104,692	105.060	10,998,941.520	
PENTAIR PLC	11,775	39.200	461,580.000	
PFIZER INC	433,636	42.810	18,563,957.160	
CONOCOPHILLIPS	87,473	72.790	6,367,159.670	
PVH CORP	5,387	124.300	669,604.100	
PG&E CORP	38,695	46.620	1,803,960.900	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	12,758	171.660	2,190,038.280	
ALTRIA GROUP INC	141,336	61.120	8,638,456.320	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	35,408	131.610	4,660,046.880	
POLARIS INDUSTRIES INC	3,845	93.170	358,238.650	
GARMIN LTD	7,795	62.970	490,851.150	
AETNA INC	23,744	198.950	4,723,868.800	
FLUOR CORP (NEW)	9,821	46.530	456,971.130	
PPG INDUSTRIES INC	19,079	96.380	1,838,834.020	
IPG PHOTONICS CORP	2,441	131.860	321,870.260	
PRAXAIR INC	21,319	154.260	3,288,668.940	
COSTCO WHOLESALE CORP	32,871	221.820	7,291,445.220	
T ROWE PRICE GROUP INC	18,363	98.510	1,808,939.130	
QUEST DIAGNOSTICS	10,378	100.440	1,042,366.320	
PROCTER & GAMBLE CO	186,535	78.870	14,712,015.450	
PROGRESSIVE CORP	43,996	66.970	2,946,412.120	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	37,115	53.590	1,988,992.850	
PULTE GROUP INC	21,209	23.310	494,381.790	
NEW YORK COMMUNITY BANCORP INC	30,388	10.120	307,526.560	
GLOBAL PAYMENTS INC	11,769	112.780	1,327,307.820	
QUALCOMM INC	104,477	64.290	6,716,826.330	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	10,187	87.720	893,603.640	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	2,550	133.110	339,430.500	

REGENERON PHARMACEUTICALS	5,659	371.670	2,103,280.530	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA INC	4,642	136.280	632,611.760	
RESMED INC	10,594	101.840	1,078,892.960	
US BANCORP	116,678	51.820	6,046,253.960	
SEATTLE GENETICS INC /WA	7,317	70.880	518,628.960	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	31,422	27.320	858,449.040	
ROSS STORES INC	28,189	94.320	2,658,786.480	
ROLLINS INC	8,252	55.550	458,398.600	
ROPER TECHNOLOGIES INC	7,723	273.270	2,110,464.210	
ROCKWELL AUTOMATION INC	9,567	170.600	1,632,130.200	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	12,293	116.850	1,436,437.050	
RAYTHEON COMPANY	21,317	190.990	4,071,333.830	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	3,848	211.690	814,583.120	
ACCENTURE PLC-CL A	47,780	156.000	7,453,680.000	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	111,556	41.190	4,594,991.640	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	9,849	136.070	1,340,153.430	
ROCKWELL COLLINS INC	12,086	134.340	1,623,633.240	
THE TRAVELERS COMPANIES INC	19,755	124.310	2,455,744.050	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	24,562	101.170	2,484,937.540	
BOOKING HOLDINGS INC	3,571	1,781.710	6,362,486.410	
SCHLUMBERGER LTD	103,099	59.120	6,095,212.880	
SCHWAB (CHARLES) CORP	90,105	48.130	4,336,753.650	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	15,475	121.150	1,874,796.250	
BUNGE LTD	10,334	66.610	688,347.740	
SEI INVESTMENTS CO	9,315	54.830	510,741.450	
ANTHEM INC	19,325	268.520	5,189,149.000	
AMERISOURCEBERGEN CORP	12,257	87.310	1,070,158.670	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	21,442	55.620	1,192,604.040	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	6,319	407.220	2,573,223.180	
CENTENE CORP	15,113	138.930	2,099,649.090	
SVB FINANCIAL GROUP	4,107	292.890	1,202,899.230	
IAC INTERACTIVE CORP	5,766	193.200	1,113,991.200	
SMITH (A.O.) CORP	9,565	47.870	457,876.550	
ACUITY BRANDS INC	3,087	119.440	368,711.280	
SNAP-ON INC	3,932	167.820	659,868.240	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	31,808	97.700	3,107,641.600	
ADVANCE AUTO PARTS	5,273	161.040	849,163.920	
EDISON INTERNATIONAL	24,600	68.410	1,682,886.000	
SOUTHERN CO	75,642	43.540	3,293,452.680	
BB&T CORP	59,388	47.440	2,817,366.720	

SOUTHWEST AIRLINES	11,352	57.030	647,404.560	
AT&T INC	540,606	31.750	17,164,240.500	
CHEVRON CORP	141,261	118.430	16,729,540.230	
STANLEY BLACK & DECKER INC	11,629	130.920	1,522,468.680	
STATE STREET CORP	27,099	81.730	2,214,801.270	
STARBUCKS CORP	104,312	54.860	5,722,556.320	
STEEL DYNAMICS INC	19,030	42.330	805,539.900	
STRYKER CORP	25,320	168.720	4,271,990.400	
NETFLIX INC	32,015	321.100	10,280,016.500	
STERICYCLE INC	6,853	52.990	363,140.470	
SUNTRUST BANKS INC	34,756	63.460	2,205,615.760	
SYMANTEC CORP	47,004	19.460	914,697.840	
KNIGHT SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	9,793	30.720	300,840.960	
SYNOPSIS INC	10,656	85.750	913,752.000	
SYSCO CORP	35,926	68.490	2,460,571.740	
INTUITIVE SURGICAL INC	8,408	508.220	4,273,113.760	
TELEFLEX INC	3,203	244.550	783,293.650	
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	71,553	20.450	1,463,258.850	
TEXAS INSTRUMENTS INC	73,391	99.530	7,304,606.230	
TEXTRON INC	19,076	65.070	1,241,275.320	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	30,141	226.090	6,814,578.690	
TIFFANY & CO	8,733	111.450	973,292.850	
TOLL BROTHERS INC	9,526	31.350	298,640.100	
TORCHMARK CORP	7,699	83.580	643,482.420	
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	11,279	90.150	1,016,801.850	
DAVITA INC	10,878	70.170	763,309.260	
TRACTOR SUPPLY CO	9,276	85.230	790,593.480	
TRIMBLE INC	20,073	37.970	762,171.810	
TYSON FOODS INC	21,621	60.230	1,302,232.830	
UGI CORP	12,068	53.730	648,413.640	
MARATHON OIL CORP	64,347	19.960	1,284,366.120	
UNION PACIFIC CORP	57,263	152.090	8,709,129.670	
UNITED TECHNOLOGIES CORP	56,111	129.370	7,259,080.070	
UNITEDHEALTH GROUP INC	71,700	257.120	18,435,504.000	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	6,351	120.850	767,518.350	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	6,848	103.970	711,986.560	
VF CORP	24,309	85.470	2,077,690.230	
CBS CORP	27,376	53.820	1,473,376.320	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	19,280	175.660	3,386,724.800	
VULCAN MATERIALS CO	10,136	100.370	1,017,350.320	

WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	63,286	70.900	4,486,977.400	
WALMART INC	109,762	93.920	10,308,847.040	
WASTE MANAGEMENT INC	32,216	88.040	2,836,296.640	
WATERS CORP	5,963	178.320	1,063,322.160	
ALLERGAN PLC	25,196	182.220	4,591,215.120	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	8,855	102.170	904,715.350	
VAIL RESORTS INC	3,098	239.610	742,311.780	
WESTERN DIGITAL CORP	22,254	54.130	1,204,609.020	
WABTEC CORP	5,497	96.890	532,604.330	
WHIRLPOOL CORP	5,553	104.350	579,455.550	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	13,529	85.260	1,153,482.540	
WYNN RESORTS LTD	7,179	116.220	834,343.380	
NASDAQ INC	9,132	79.650	727,363.800	
CME GROUP INC	25,415	176.030	4,473,802.450	
WILLIAMS COS INC	89,081	26.590	2,368,663.790	
LKQ CORP	22,948	28.320	649,887.360	
ALLIANT ENERGY CORP	16,383	42.620	698,243.460	
WEC ENERGY GROUP INC	23,117	67.520	1,560,859.840	
TD AMERITRADE HOLDING CORP	21,581	49.770	1,074,086.370	
CARMAX INC	13,513	67.850	916,857.050	
XEROX CORP	17,455	24.740	431,836.700	
XILINX INC	19,197	73.990	1,420,386.030	
CIMAREX ENERGY CO	7,003	94.560	662,203.680	
TJX COMPANIES INC	47,171	107.760	5,083,146.960	
ZIONS BANCORP NA	16,584	49.180	815,601.120	
DAIRY FARM INTERNATIONAL HLDNGS	27,400	8.530	233,722.000	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	76,400	6.080	464,512.000	
JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	15,700	57.990	910,443.000	
JARDINE STRATEGIC HOLDINGS LTD	17,100	33.780	577,638.000	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	6,051	79.300	479,844.300	
SIGNATURE BANK	4,171	111.870	466,609.770	
CBRE GROUP INC	24,276	39.010	947,006.760	
LIBERTY GLOBAL PLC	12,435	24.880	309,382.800	
REGIONS FINANCIAL CORP	84,486	17.740	1,498,781.640	
DOMINO'S PIZZA INC	3,256	270.880	881,985.280	
WESTLAKE CHEMICAL CORP	3,000	79.540	238,620.000	
T-MOBILE US INC	25,388	66.210	1,680,939.480	
LAS VEGAS SANDS CORP	30,271	55.490	1,679,737.790	
MOSAIC CO/THE	26,525	32.690	867,102.250	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX NEWS	32,515	44.790	1,456,346.850	

TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC	78,440	45.110	3,538,428.400	
CELANESE CORP	9,491	98.310	933,060.210	
DISCOVERY INC-A	10,423	31.020	323,321.460	
EXPEDIA GROUP INC	8,709	115.690	1,007,544.210	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	18,475	51.130	944,626.750	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	10,578	135.380	1,432,049.640	
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	41,818	24.370	1,019,104.660	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	43,585	72.490	3,159,476.650	
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	14,696	18.230	267,908.080	
VIACOM INC-CLASS B	24,612	31.190	767,648.280	
LIVE NATION	8,864	49.500	438,768.000	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,807	433.930	784,111.510	
UNITED CONTINENTAL HOLIDINGS INC	6,191	80.120	496,022.920	
TRANSDIGM GROUP INC	3,812	321.130	1,224,147.560	
MASTERCARD INC	69,052	194.510	13,431,304.520	
QURATE RETAIL INC	35,733	20.870	745,747.710	
HANESBRANDS INC	27,619	16.170	446,599.230	
WESTERN UNION CO	35,222	17.670	622,372.740	
OWENS CORNING	7,333	51.460	377,356.180	
LEIDOS HOLDINGS INC	9,322	64.750	603,599.500	
AERCAP HOLDINGS NV	11,586	52.840	612,204.240	
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLDINGS INC	9,175	83.080	762,259.000	
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT-ADR	18,099	18.200	329,401.800	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	8,330	115.730	964,030.900	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	22,746	16.470	374,626.620	
DELTA AIR LINES INC	13,898	51.480	715,469.040	
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	6,354	59.110	375,584.940	
DISCOVER FINANCIAL	25,202	74.180	1,869,484.360	
TE CONNECTIVITY LTD	26,204	78.660	2,061,206.640	
CONCHO RESOURCES INC/MIDLAND TX	14,552	150.560	2,190,949.120	
WABCO HOLDING INC	4,076	109.130	444,813.880	
LULULEMON ATHLETICA INC	7,883	140.510	1,107,640.330	
VMWARE INC	5,491	141.490	776,921.590	
MERCADOLIBRE INC	3,215	304.860	980,124.900	
ULTA BEAUTY INC	4,332	267.570	1,159,113.240	
INVESCO LTD	29,824	20.070	598,567.680	
MSCI INC	6,462	151.590	979,574.580	

PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	114,627	82.310	9,434,948.370	
VISA INC	134,179	133.730	17,943,757.670	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	13,492	87.450	1,179,875.400	
DISCOVERY INC-C	23,054	28.450	655,886.300	
MARATHON PETROLEUM CORP	53,981	78.730	4,249,924.130	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	11,624	48.000	557,952.000	
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	147,783	17.420	2,574,379.860	
XYLEM INC	12,873	69.040	888,751.920	
ALKERMES PLC	12,053	41.590	501,284.270	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	24,984	97.030	2,424,197.520	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,479	233.080	810,885.320	
SPLUNK INC	10,674	99.090	1,057,686.660	
HCA HEALTHCARE INC	21,696	132.430	2,873,201.280	
VERISK ANALYTICS INC	11,859	113.330	1,343,980.470	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	3,987	155.380	619,500.060	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	6,544	200.600	1,312,726.400	
FIRST REPUBLIC BANK/SAN FRANCISCO CA	11,868	90.840	1,078,089.120	
CIT GROUP INC	9,287	49.270	457,570.490	
NXP SEMICONDUCTOR NV	25,955	77.290	2,006,061.950	
TARGA RESOURCES CORP	16,445	55.290	909,244.050	
LEAR CORP	5,132	137.540	705,855.280	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	8,640	100.800	870,912.000	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	17,000	49.510	841,670.000	
DOLLAR GENERAL CORP	19,686	101.960	2,007,184.560	
FORTINET INC	11,399	77.120	879,090.880	
AON PLC	18,487	148.220	2,740,143.140	
TESLA INC	9,463	252.230	2,386,852.490	
GENERAL MOTORS CO	95,770	32.310	3,094,328.700	
WORLDPAY INC	21,000	92.090	1,933,890.000	
XPO LOGISTICS INC	9,000	99.240	893,160.000	
TRIPADVISOR INC	9,263	44.650	413,592.950	
ALLY FINANCIAL INC	31,409	25.960	815,377.640	
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	12,138	61.960	752,070.480	
VOYA FINANCIAL INC	13,525	47.260	639,191.500	
APTIV PLC	19,069	73.920	1,409,580.480	
PHILLIPS 66	32,776	109.460	3,587,660.960	
FACEBOOK INC	178,452	153.350	27,365,614.200	
IQVIA HOLDINGS INC	11,751	122.580	1,440,437.580	
DIAMONDBACK ENERGY INC	7,054	124.630	879,140.020	



SERVICENOW INC	12,906	174.970	2,258,162.820	
PALO ALTO NETWORKS INC	7,006	203.170	1,423,409.020	
WORKDAY INC	10,417	124.750	1,299,520.750	
ABBVIE INC	112,000	90.700	10,158,400.000	
ZOETIS INC	36,976	87.000	3,216,912.000	
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDINGS LTD	16,470	50.620	833,711.400	
COTY INC	38,541	11.130	428,961.330	
NEWS CORP/NEW-CL A	30,263	12.700	384,340.100	
HD SUPPLY HOLDINGS INC	12,891	38.030	490,244.730	
CDW CORP	10,824	80.370	869,924.880	
SPRINT CORP	63,882	6.210	396,707.220	
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	10,199	31.270	318,922.730	
ARCONIC INC	27,513	21.170	582,450.210	
LIBERTY MEDIA CORP- LIBERTY-C	13,175	32.780	431,876.500	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	5,006	40.660	203,543.960	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-C	13,368	40.690	543,943.920	
DELL TECHNOLOGIES INC	15,074	91.740	1,382,888.760	
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	15,410	16.820	259,196.200	
BAKER HUGHES A GE CO	31,904	30.660	978,176.640	
TECHNIPFMC LTD	32,556	29.830	971,145.480	
BROADCOM INC	30,394	228.900	6,957,186.600	
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	6,291	43.200	271,771.200	
ANTERO RESOURCES CORP	13,163	18.850	248,122.550	
VEEVA SYSTEMS INC	9,087	89.200	810,560.400	
TWITTER INC	51,498	27.000	1,390,446.000	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING PLC	11,392	44.640	508,538.880	
EVERGY INC	21,000	55.540	1,166,340.000	
PLAINS GP HOLDINGS LP	7,837	23.900	187,304.300	
COMMSCOPE HOLDING CO INC	12,920	25.180	325,325.600	
ALLEGION PLC	7,325	82.760	606,217.000	
PERRIGO CO PLC	10,553	69.790	736,493.870	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	20,000	73.100	1,462,000.000	
ARAMARK	17,307	39.350	681,030.450	
SABRE CORP	17,624	23.000	405,352.000	
PARSLEY ENERGY INC	17,454	28.540	498,137.160	
ARISTA NETWORKS INC	3,748	215.460	807,544.080	
IHS MARKIT LTD	30,253	50.480	1,527,171.440	
FNF GROUP	20,660	35.010	723,306.600	
SYNCHRONY FINANCIAL	53,885	29.730	1,602,001.050	
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	34,845	36.990	1,288,916.550	
CDK GLOBAL INC	8,309	56.890	472,699.010	

	KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	14,300	60.440	864,292.000	
	QORVO INC	8,784	71.390	627,089.760	
	ZAYO GROUP HOLDINGS INC	16,089	30.930	497,632.770	
	LIBERTY BROADBAND CORP-C W/I	7,818	78.040	610,116.720	
	AXALTA COATING SYSTEMS LTD	14,710	25.860	380,400.600	
	GODADDY INC	11,400	72.000	820,800.000	
	NIELSEN HOLDINGS PLC	26,840	25.750	691,130.000	
	TRANSUNION	13,841	67.110	928,869.510	
	SQUARE INC	20,423	69.030	1,409,799.690	
	DOWDUPONT INC	173,668	58.980	10,242,938.640	
	COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS PLC	17,100	42.620	728,802.000	
	WESTROCK CO	17,744	41.950	744,360.800	
	KRAFT HEINZ CO	46,854	53.820	2,521,682.280	
	FORTIVE CORP	23,630	78.580	1,856,845.400	
	WASTE CONNECTIONS INC	18,879	75.040	1,416,680.160	
	ALPHABET INC-CL A	22,200	1,090.740	24,214,428.000	
	HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	113,242	14.630	1,656,730.460	
	PAYPAL HOLDINGS INC	83,973	75.900	6,373,550.700	
	FIRST DATA CORP	35,404	22.350	791,279.400	
	DXC TECHNOLOGY CO	21,351	85.870	1,833,410.370	
	ZILLOW GROUP INC-C	8,134	38.160	310,393.440	
	ALPHABET INC-CL C	23,300	1,079.320	25,148,156.000	
	L3 TECHNOLOGIES INC	5,892	195.180	1,150,000.560	
	CHEMOURS CO	12,723	35.290	448,994.670	
	ATHENE HOLDING LTD	11,784	48.390	570,227.760	
	CHARTER COMMUNICATIONS INC	12,506	301.920	3,775,811.520	
	VISTRA ENERGY CORP	30,000	24.210	726,300.000	
	アメリカ・ドル 小計	22,730,381		1,755,779,598.630 (196,980,913,171)	
イギリス・ポンド	ANTOFAGASTA PLC	25,905	7.680	198,950.400	
	ASHTED GROUP	35,233	19.790	697,261.070	
	SEVERN TRENT PLC	14,897	18.500	275,594.500	
	BHP BILLITON PLC	153,323	15.640	2,397,971.720	
	BARCLAYS PLC	1,292,957	1.680	2,172,167.760	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	64,682	4.878	315,518.790	
	BT GROUP PLC	638,910	2.370	1,514,216.700	
	BUNZL PLC	26,515	21.930	581,473.950	
	EASYJET PLC	13,628	11.780	160,537.840	
	AVIVA PLC	303,368	4.388	1,331,178.780	
	CRODA INTERNATIONAL	10,645	45.140	480,515.300	
	DIAGEO PLC	183,390	25.235	4,627,846.650	
	SCHRODERS PLC	10,932	28.820	315,060.240	
	DCC PLC	5,936	62.350	370,109.600	

NATIONAL GRID PLC	253,078	7.990	2,022,093.220	
KINGFISHER PLC	165,680	2.534	419,833.120	
BAE SYSTEMS PLC	225,176	5.822	1,310,974.670	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	169,676	34.050	5,777,467.800	
NEXT PLC	9,731	52.540	511,266.740	
IMPERIAL BRANDS PLC	72,328	26.780	1,936,943.840	
JOHNSON MATTHEY PLC	15,017	30.890	463,875.130	
ANGLO AMERICAN PLC	79,906	16.200	1,294,477.200	
COMPASS GROUP PLC	115,111	15.550	1,789,976.050	
HSBC HOLDINGS PLC	1,488,734	6.301	9,380,512.930	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	423,649	2.459	1,041,752.890	
CENTRICA PLC	392,766	1.471	577,758.780	
UNILEVER PLC	91,931	39.445	3,626,218.290	
MEGGITT PLC	62,181	4.973	309,226.110	
MORRISON <WM.> SUPERMARKETS	155,682	2.483	386,558.400	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	54,487	7.044	383,806.420	
RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	80,864	5.510	445,560.640	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	25,308	23.060	583,602.480	
PEARSON PLC	65,009	7.800	507,070.200	
PERSIMMON PLC	23,150	21.780	504,207.000	
PRUDENTIAL PLC	193,029	15.820	3,053,718.780	
RIO TINTO PLC	90,035	36.290	3,267,370.150	
VODAFONE GROUP PLC	1,993,578	1.509	3,008,309.200	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	50,208	64.490	3,237,913.920	
RELX PLC	147,464	14.940	2,203,112.160	
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	116,966	8.716	1,019,475.650	
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	330,000	2.442	805,860.000	
ST JAMES'S PLACE PLC	40,884	10.570	432,143.880	
TRAVIS PERKINS PLC	20,357	10.040	204,384.280	
SSE PLC	73,043	11.240	821,003.320	
BP PLC	1,481,204	5.544	8,211,794.970	
SHIRE PLC	67,647	42.525	2,876,688.670	
SAGE GROUP PLC(THE)	85,271	5.560	474,106.760	
SMITHS GROUP PLC	31,720	13.530	429,171.600	
STANDARD CHARTERED PLC	210,236	5.702	1,198,765.670	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	5,397,548	0.579	3,125,180.290	
TAYLOR WIMPLEY PLC	253,022	1.578	399,268.710	
TESCO PLC	740,567	2.183	1,616,657.760	
3I GROUP PLC	66,784	8.494	567,263.290	
SMITH & NEPHEW PLC	66,155	12.925	855,053.370	
GLAXOSMITHKLINE PLC	369,384	14.516	5,361,978.140	

WEIR GROUP	18,336	15.975	292,917.600	
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	21,888	40.770	892,373.760	
BABCOCK INT'L GROUP	21,302	6.480	138,036.960	
WPP PLC	90,628	10.650	965,188.200	
FERGUSON PLC	17,278	55.670	961,866.260	
ASTRAZENECA PLC	94,694	56.160	5,318,015.040	
WHITBREAD PLC	12,159	45.550	553,842.450	
CARNIVAL PLC	13,153	43.150	567,551.950	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	120,290	2.916	350,765.640	
JOHN WOOD GROUP PLC	48,988	7.236	354,477.160	
INTERTEK GROUP PLC	11,273	44.350	499,957.550	
BURBERRY GROUP PLC	29,893	17.405	520,287.660	
INVESTEC PLC	50,655	4.667	236,406.880	
INTERCONTINENTAL HOTELS	12,362	42.150	521,058.300	
ITV PLC	247,210	1.559	385,400.390	
SAINSBURY (J) PLC	137,215	3.064	420,426.760	
RANDGOLD RESOURCES LTD NPR	6,998	57.060	399,305.880	
G4S PLC	122,250	2.170	265,282.500	
ADMIRAL GROUP PLC	15,893	19.325	307,132.220	
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	10,726	33.100	355,030.600	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	341,563	24.850	8,487,840.550	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	279,650	25.200	7,047,180.000	
TUI AG-DI	30,153	13.480	406,462.440	
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	184,183	2.789	513,686.380	
EXPERIAN PLC	71,068	17.285	1,228,410.380	
MONDI PLC	28,318	17.750	502,644.500	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	21,290	18.505	393,971.450	
FRESNILLO PLC NPR	15,639	8.390	131,211.210	
INFORMA PLC	102,475	7.166	734,335.850	
GLENCORE PLC	861,237	3.112	2,680,169.540	
GVC HOLDINGS PLC	36,000	9.000	324,000.000	
NMC HEALTH PLC	8,149	31.380	255,715.620	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP PLC	112,694	3.221	362,987.370	
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	30,616	4.474	136,975.980	
COCA-COLA HBC AG	13,406	23.170	310,617.020	
CONVATEC GROUP PLC	118,400	2.218	262,611.200	
ROYAL MAIL PLC	55,060	3.412	187,864.720	
MERLIN ENTERTAINMENTS PLC	50,037	3.749	187,588.710	

	MICRO FOCUS INTERNATIONAL PLC	32,342	13.455	435,161.610	
	AUTO TRADER GROUP PLC	76,348	4.050	309,209.400	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	335,000	1.705	571,175.000	
イギリス・ボンド	小計	22,481,706		131,655,948.470 (19,558,807,704)	
イスラエル・シュケル	BANK HAPOALIM BM	78,428	25.500	1,999,914.000	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	103,061	23.180	2,388,953.980	
	BEZEQ ISRAELI TELECOMMUNICATION CORP LTD	188,230	4.149	780,966.270	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,760	435.800	767,008.000	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	49,411	22.050	1,089,512.550	
	NICE LTD	4,035	386.500	1,559,527.500	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	10,444	62.710	654,943.240	
	AZRIELI GROUP	4,428	180.400	798,811.200	
	INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCES INC	647	485.200	313,924.400	
イスラエル・シュケル	小計	440,444		10,353,561.140 (319,510,897)	
オーストラリア・ドル	RAMSAY HEALTH CARE LTD	11,115	53.620	595,986.300	
	AUST AND NZ BANKING GROUP LT	218,921	26.010	5,694,135.210	
	AMCOR LTD	80,741	13.330	1,076,277.530	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	253,113	26.290	6,654,340.770	
	BANK OF QUEENSLAND LTD	30,569	10.380	317,306.220	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	114,125	3.760	429,110.000	
	TELSTRA CORP LTD	272,919	3.110	848,778.090	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD	39,014	10.000	390,140.000	
	AMP LTD	200,498	3.050	611,518.900	
	ASX LTD	15,573	58.700	914,135.100	
	BHP BILLITON LTD	239,570	33.400	8,001,638.000	
	CALTEX AUSTRALIA LTD	20,946	29.470	617,278.620	
	HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	22,182	3.430	76,084.260	
	COMPUTERSHARE LT	38,040	19.650	747,486.000	
	CSL LIMITED	34,057	185.500	6,317,573.500	
	REA GROUP LTD	4,119	77.520	319,304.880	
	TRANSURBAN GROUP	167,883	10.900	1,829,924.700	
	COCA-COLA AMATIL LTD	48,601	9.900	481,149.900	
	COCHLEAR LTD	3,992	186.570	744,787.440	
	ORIGIN ENERGY LTD	121,721	8.250	1,004,198.250	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	129,233	67.000	8,658,611.000		
BORAL LIMITED	86,101	6.390	550,185.390		

	RIO TINTO LIMITED	30,902	76.610	2,367,402.220	
	APA GROUP	77,562	9.810	760,883.220	
	ARISTOCRAT LEISU	43,933	27.310	1,199,810.230	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	171,471	6.990	1,198,582.290	
	TPG TELECOM LTD	28,719	7.680	220,561.920	
	FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	3,275	51.030	167,123.250	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	28,489	19.400	552,686.600	
	ORICA LTD	25,308	16.310	412,773.480	
	CIMIC GROUP LTD	8,709	47.020	409,497.180	
	BLUESCOPE STEEL LTD	36,941	14.670	541,924.470	
	SYDNEY AIRPORT	85,130	6.610	562,709.300	
	MACQUARIE GROUP LTD	24,250	115.490	2,800,632.500	
	SUNCORP GROUP LTD	93,181	13.730	1,279,375.130	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	202,508	26.000	5,265,208.000	
	NEWCREST MINING LTD	59,818	19.300	1,154,487.400	
	OIL SEARCH LTD	93,715	8.530	799,388.950	
	INCITEC PIVOT LTD	136,426	3.910	533,425.660	
	QBE INSURANCE GROUP LIMITED	95,390	11.360	1,083,630.400	
	CHALLENGER FINANCIAL SERVICES	45,707	10.440	477,181.080	
	SANTOS LTD	133,862	6.970	933,018.140	
	SONIC HEALTHCARE	26,192	23.950	627,298.400	
	TABCORP HOLDINGS LTD	126,348	4.620	583,727.760	
	WESFARMERS LTD	84,335	47.450	4,001,695.750	
	ALUMINA LIMITED	184,613	2.610	481,839.930	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	68,074	36.650	2,494,912.100	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	99,142	27.820	2,758,130.440	
	SEEK LTD	25,899	19.830	513,577.170	
	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES LTD	4,581	51.730	236,975.130	
	AUSNET SERVICES	165,066	1.635	269,882.910	
	AGL ENERGY LTD	46,315	19.030	881,374.450	
	BRAMBLES LTD	115,255	10.390	1,197,499.450	
	CROWN RESORTS LTD	32,861	13.070	429,493.270	
	AURIZON HOLDINGS LTD	139,184	4.020	559,519.680	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	50,789	16.140	819,734.460	
	HEALTHSCOPE LTD	149,047	2.030	302,565.410	
	MEDIBANK PVT LTD	177,176	2.800	496,092.800	
	SOUTH32 LTD(AUD)	367,057	3.810	1,398,487.170	
オーストラリア・ドル	小計	5,440,263		87,653,057.760 (7,007,861,967)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	16,141	48.710	786,228.110	

ALIMENTATION COUCHE TARD INC	30,728	61.460	1,888,542.880	
BARRICK GOLD CORP	83,648	16.440	1,375,173.120	
ATCO LTD	7,193	35.350	254,272.550	
BANK OF MONTREAL	47,406	103.150	4,889,928.900	
BANK OF NOVA SCOTIA	87,876	71.990	6,326,193.240	
NATIONAL BANK OF CANADA	23,756	60.910	1,446,977.960	
BCE INC	11,568	50.880	588,579.840	
BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT	63,537	54.000	3,430,998.000	
BAUSCH HEALTH COS INC	25,819	31.350	809,425.650	
BOMBARDIER INC 'B'	151,615	3.820	579,169.300	
SAPUTO INC	18,601	38.350	713,348.350	
BLACKBERRY LTD	39,652	12.400	491,684.800	
CGI GROUP INC	19,367	77.500	1,500,942.500	
CCL INDUSTRIES INC	11,340	54.350	616,329.000	
CAE INC	23,000	24.170	555,910.000	
CAMECO CORP	32,627	15.100	492,667.700	
ROGERS COMM-CL B	25,967	64.470	1,674,092.490	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	32,680	115.700	3,781,076.000	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	91,420	37.650	3,441,963.000	
CANADIAN TIRE CORP-CL A	4,862	146.530	712,428.860	
CANADIAN UTILITIES LTD	9,119	29.370	267,825.030	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	54,813	109.770	6,016,823.010	
FIRST CAPITAL REALTY INC	11,417	18.810	214,753.770	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	13,930	37.570	523,350.100	
OPEN TEXT CORP	19,756	44.270	874,598.120	
EMPIRE CO LTD	15,093	22.980	346,837.140	
KINROSS GOLD CORP	99,741	3.850	384,002.850	
FINNING INTERNATIONAL INC	9,892	31.340	310,015.280	
FORTIS INC	33,302	41.110	1,369,045.220	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	55,296	14.690	812,298.240	
TELUS CORP	15,945	44.270	705,885.150	
GREAT WEST LIFECO INC	19,248	30.070	578,787.360	
IMPERIAL OIL LTD	21,542	42.440	914,242.480	
ENBRIDGE INC	125,330	41.490	5,199,941.700	
IGM FINANCIAL INC	8,426	32.220	271,485.720	
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	87,995	2.500	219,987.500	
MANULIFE FINANCIAL CORP	145,162	20.310	2,948,240.220	
LINAMAR CORP	3,827	54.970	210,370.190	
LOBLAW CO LTD	15,354	62.670	962,235.180	
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANCE AND FINANCIAL SERVICES INC	6,524	47.760	311,586.240	

MAGNA INTERNATIONAL INC	25,339	61.860	1,567,470.540	
SUN LIFE FINANCIAL INC	45,976	48.190	2,215,583.440	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,985	656.380	1,302,914.300	
METRO INC	19,226	39.250	754,620.500	
HUSKY ENERGY INC	28,749	19.930	572,967.570	
CRESCENT POINT ENERGY CORP	39,992	7.550	301,939.600	
EMERA INC	6,509	38.420	250,075.780	
METHANEX CORP	5,281	96.170	507,873.770	
ONEX CORP	6,646	83.140	552,548.440	
GOLDCORP INC	66,602	14.100	939,088.200	
POWER CORP OF CANADA	25,052	26.960	675,401.920	
POWER FINANCIAL CORP	17,484	28.260	494,097.840	
ROYAL BANK OF CANADA	106,200	98.700	10,481,940.000	
SNC-LAVALIN GROUP INC	13,134	44.360	582,624.240	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	10,607	264.970	2,810,536.790	
SHAW COMM INC-B	35,748	24.020	858,666.960	
SUNCOR ENERGY INC	122,908	46.360	5,698,014.880	
LUNDIN MINING CORP	35,268	5.960	210,197.280	
ENCANA CORP	69,257	14.760	1,022,233.320	
TECK RESOURCES LTD-CL B	41,016	30.530	1,252,218.480	
THOMSON REUTERS CORP	20,469	57.920	1,185,564.480	
TORONTO DOMINION BANK (THE) C\$	136,076	74.110	10,084,592.360	
TRANSCANADA CORP	68,885	51.290	3,533,111.650	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	5,696	64.750	368,816.000	
WESTON (GEORGE) LTD	3,105	90.380	280,629.900	
INTACT FINANCIAL CORP	10,785	102.560	1,106,109.600	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	33,943	23.410	794,605.630	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,494	888.370	1,327,224.780	
FRANCO-NEVADA CORP NPR	14,687	86.250	1,266,753.750	
CI FINANCIAL CORP	20,695	19.000	393,205.000	
TOURMALINE OIL CORP	15,779	21.280	335,777.120	
KEYERA CORP	13,728	34.150	468,811.200	
ALTAGAS LTD	23,944	20.990	502,584.560	
PEMBINA PIPELINE CORP	38,497	43.450	1,672,694.650	
DOLLARAMA INC	22,512	38.000	855,456.000	
CENOVUS ENERGY INC W/I	80,545	11.690	941,571.050	
VERMILION ENERGY INC	12,923	39.900	515,627.700	
ARC RESOURCES LTD	22,997	13.880	319,198.360	
INTER PIPELINE LTD	24,083	21.880	526,936.040	
NUTRIEN LTD	45,351	70.430	3,194,070.930	
WSP GLOBAL INC	8,400	65.350	548,940.000	
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	14,961	21.750	325,401.750	



	SEVEN GENERATIONS ENERGY LTD	17,231	15.280	263,289.680	
	RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	17,753	73.280	1,300,939.840	
	AURORA CANNABIS INC	50,000	12.620	631,000.000	
	SHOPIFY INC	6,500	166.720	1,083,680.000	
	HYDRO ONE LTD	27,340	19.230	525,748.200	
カナダ・ドル 小計		3,101,873		127,201,596.830 (10,954,601,519)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE TECH ENG	125,000	3.430	428,750.000	
	SEMBCORP INDUSTRIES	81,400	2.870	233,618.000	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	123,700	2.650	327,805.000	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	692,140	0.240	166,113.600	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	134,800	24.310	3,276,988.000	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	29,000	8.160	236,640.000	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	5,944	28.220	167,739.680	
	SINGAPORE AIRPORT TERMINAL SERVICES LTD	42,300	4.850	205,155.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	68,900	6.860	472,654.000	
	CAPITALAND LTD	192,415	3.100	596,486.500	
	GENTING SINGAPORE LTD	416,400	0.950	395,580.000	
	KEPPEL CORP LTD	98,400	6.700	659,280.000	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	177,900	2.140	380,706.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	225,453	10.680	2,407,838.040	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	591,922	3.140	1,858,635.080	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	47,500	9.180	436,050.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	94,500	25.230	2,384,235.000	
	UOL GROUP LIMITED	40,500	6.210	251,505.000	
	VENTURE CORP LTD	21,000	16.280	341,880.000	
WILMAR INTERNATIONAL LTD	142,300	3.060	435,438.000		
YANGZIJIANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	188,800	1.230	232,224.000		
シンガポール・ドル 小計		3,540,274		15,895,320.900 (1,297,535,046)	
スイス・フラン	CREDIT SUISSE GROUP AG	187,381	13.380	2,507,157.780	
	NESTLE SA-REGISTERED	231,295	78.700	18,202,916.500	
	CIE FINANC RICHEMONT	39,186	72.160	2,827,661.760	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN	52,431	234.750	12,308,177.250	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2,835	221.200	627,102.000	
	SIKA INHABER	9,060	127.700	1,156,962.000	
	SGS SA-REG	405	2,293.000	928,665.000	
	NOVARTIS AG-REG SHS	160,986	81.460	13,113,919.560	

BALOISE HOLDING AG -R	4,127	145.000	598,415.000	
BARRY CALLEBAUT AG	144	1,800.000	259,200.000	
CLARIANT AG-REG	19,496	22.770	443,923.920	
SWISSCOM AG-REG	1,795	431.700	774,901.500	
ABB LTD	139,628	21.170	2,955,924.760	
ADECCO GROUP AG-REG	12,341	48.680	600,759.880	
GEBERIT AG	2,801	426.000	1,193,226.000	
LONZA GROUP AG-REG	5,389	308.600	1,663,045.400	
LINDT & SPRUENGLI PART	75	6,430.000	482,250.000	
LINDT & SPRUENGLI NAMEN	9	75,700.000	681,300.000	
GIVAUDAN-REG	692	2,283.000	1,579,836.000	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	11,199	301.200	3,373,138.800	
LAFARGEHOLCIM LTD	35,730	44.830	1,601,775.900	
TEMENOS GROUP	4,521	129.400	585,017.400	
SONOVA HOLDING AG	4,142	163.850	678,666.700	
KUEHNE & NAGEL INTL AG	3,687	141.750	522,632.250	
STRAUMANN HOLDING AG	782	664.500	519,639.000	
THE SWATCH GROUP AG-B	2,311	338.800	782,966.800	
THE SWATCH GROUP AG-REG	4,592	66.000	303,072.000	
SCHINDLER NAMEN	1,663	215.200	357,877.600	
SWISS LIFE HOLDING AG	2,614	360.700	942,869.800	
VIFOR PHARMA AG	3,050	142.350	434,167.500	
EMS-CHEMIE HOLDING	553	535.000	295,855.000	
SWISS PRIME SITE AG	5,990	78.800	472,012.000	
PARGESA HOLDING PORTEUR	3,000	72.500	217,500.000	
DUFREY GROUP	2,390	104.850	250,591.500	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,272	707.000	899,304.000	
JULIUS BAER GROUP LTD	17,849	45.200	806,774.800	
SWISS RE LTD	24,162	88.500	2,138,337.000	
UBS GROUP AG	285,455	14.130	4,033,479.150	
スイス・フラン 小計	1,285,038		82,121,021.510 (9,309,238,998)	
スウェーデン・ク ローナ				
ATLAS COPCO AB-A SHS	48,377	230.900	11,170,249.300	
ATLAS COPCO AB-B SHS	30,899	213.700	6,603,116.300	
ERICSSON LM-B SHS	221,748	74.580	16,537,965.840	
LUNDBERGS B	7,382	280.400	2,069,912.800	
SKF AB-B SHS	24,866	157.550	3,917,638.300	
SANDVIK AB	85,032	141.950	12,070,292.400	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	128,935	92.800	11,965,168.000	
SKANSKA AB-B SHS	21,179	166.500	3,526,303.500	
SWEDBANK AB	66,507	194.450	12,932,286.150	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	108,388	104.700	11,348,223.600	
VOLVO AB-B SHS	113,672	144.900	16,471,072.800	
SWEDISH MATCH AB	11,481	438.300	5,032,122.300	

	TELE2 AB-B SHS	26,976	107.450	2,898,571.200	
	INDUSTRIVARDEN C	11,403	186.050	2,121,528.150	
	ELECTROLUX AB-SER B	19,191	186.950	3,587,757.450	
	SECURITAS AB-B SHS	24,098	146.700	3,535,176.600	
	INVESTOR AB-B SHS	33,412	385.200	12,870,302.400	
	HENNES&MAURITZ AB-B SHS	66,448	162.300	10,784,510.400	
	ASSA ABLOY AB-B	77,223	170.950	13,201,271.850	
	TELIA CO AB	216,239	41.080	8,883,098.120	
	LUNDIN PETROLEUM AB	16,790	289.000	4,852,310.000	
	BOLIDEN AB	21,855	239.250	5,228,808.750	
	ALFA LAVAL AB	23,343	224.600	5,242,837.800	
	KINNEVIK AB-B	18,310	250.500	4,586,655.000	
	MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR SA	5,332	500.000	2,666,000.000	
	ICA GRUPPEN AB	5,920	278.400	1,648,128.000	
	HUSQVARNA AB-B SHS	33,692	70.680	2,381,350.560	
	HEXAGON AB	18,360	469.200	8,614,512.000	
	EPIROC AB-A	48,377	94.540	4,573,561.580	
	EPIROC AB-B	30,899	86.730	2,679,870.270	
	ESSITY AB-B	46,071	219.000	10,089,549.000	
	NORDEA BANK ABP	218,620	87.470	19,122,691.400	
	スウェーデン・クローネ 小計	1,831,025		243,212,841.820 (3,042,592,651)	
デンマーク・クローネ	CARLSBERG AS-B	7,330	723.600	5,303,988.000	
	A P MOLLER A/S	481	8,244.000	3,965,364.000	
	AP MOLLER MAERSK A	273	7,765.000	2,119,845.000	
	DANSKE BANK A/S	54,380	141.200	7,678,456.000	
	GENMAB A/S	4,613	894.400	4,125,867.200	
	NOVOZYMES-B SHS	15,904	325.700	5,179,932.800	
	NOVO NORDISK A/S-B	135,241	267.300	36,149,919.300	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	15,808	393.700	6,223,609.600	
	COLOPLAST-B	8,286	605.200	5,014,687.200	
	DSV A/S	14,452	541.800	7,830,093.600	
	WILLIAM DEMANT	6,537	200.600	1,311,322.200	
	H LUNDBECK A/S	4,840	375.300	1,816,452.000	
	TRYG A/S	11,107	154.700	1,718,252.900	
	PANDORA A/S	8,251	390.000	3,217,890.000	
	CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S	7,708	596.000	4,593,968.000	
	ISS A/S	11,125	213.600	2,376,300.000	
	ORSTED A/S	15,020	409.500	6,150,690.000	
	デンマーク・クローネ 小計	321,356		104,776,637.800 (1,827,304,563)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	71,110	6.820	484,970.200	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	29,894	12.550	375,169.700	
	A2 MILK CO LTD	55,091	9.040	498,022.640	
	FISHER & PAYKEL	42,678	13.900	593,224.200	

	FLETCHER BUILDING LTD	64,104	6.180	396,162.720	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	159,623	3.825	610,557.970	
	MERIDIAN ENERGY LTD	90,173	3.140	283,143.220	
ニュージーランド・ドル 小計		512,673		3,241,250.650 (237,324,372)	
ノルウェー・クローネ	MARINE HARVEST	33,000	184.500	6,088,500.000	
	DNB ASA	70,426	161.550	11,377,320.300	
	NORSK HYDRO ASA	91,879	42.660	3,919,558.140	
	TELENOR ASA	53,178	152.350	8,101,668.300	
	ORKLA ASA	61,421	67.000	4,115,207.000	
	EQUINOR ASA	87,000	221.300	19,253,100.000	
	YARA INTERNATIONAL ASA	16,000	383.400	6,134,400.000	
	AKER BP ASA	8,552	307.200	2,627,174.400	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	16,683	128.200	2,138,760.600	
SCHIBSTED ASA	7,445	257.500	1,917,087.500		
ノルウェー・クローネ 小計		445,584		65,672,776.240 (898,403,579)	
ユーロ	CRH PLC	65,287	26.280	1,715,742.360	
	PADDY POWER BETFAIR PLC	6,246	68.150	425,664.900	
	KERRY GROUP PLC-A	11,576	87.700	1,015,215.200	
	UMICORE	15,320	40.740	624,136.800	
	AIR LIQUIDE	32,310	106.550	3,442,630.500	
	AIRBUS SE	43,659	97.330	4,249,330.470	
	AXA	146,116	22.620	3,305,143.920	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	39,913	16.705	666,746.660	
	ADIDAS AG	14,139	192.650	2,723,878.350	
	ASSICURAZIONI GENERALI	88,233	14.280	1,259,967.240	
	DASSAULT AVIATION SA	157	1,417.000	222,469.000	
	DANONE	46,365	63.930	2,964,114.450	
	SAFRAN SA	25,571	106.500	2,723,311.500	
	INTESA SANPAOLO	1,068,877	2.034	2,174,095.810	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	24,725	74.300	1,837,067.500	
	ACCOR SA	16,000	41.160	658,560.000	
	BOUYGUES	16,412	36.010	590,996.120	
	BNP PARIBAS	82,934	50.190	4,162,457.460	
	THALES SA	8,128	110.150	895,299.200	
	CAPGEMINI SA	11,481	101.950	1,170,487.950	
	CASINO GUICHARD PERRACHON	4,264	37.190	158,578.160	
	INGENICO GROUP	4,334	67.840	294,018.560	
	UNICREDIT SPA	150,691	11.938	1,798,949.150	
	NATIXIS	70,166	5.370	376,791.420	
	KONINKLIJKE DSM NV	13,216	79.520	1,050,936.320	
	COMMERZBANK AG	83,118	8.556	711,157.600	
EIFFAGE	5,949	89.560	532,792.440		
FRESENIUS SE & CO KGAA	30,924	67.780	2,096,028.720		

UNITED INTERNET	9,882	36.280	358,518.960	
FUCHS PETROLUB SE PREF	5,546	44.840	248,682.640	
PUBLICIS GROUPE	15,068	51.160	770,878.880	
MAN SE	3,396	91.000	309,036.000	
FAURECIA	6,117	45.410	277,772.970	
IBERDROLA SA	445,063	6.214	2,765,621.480	
ENI SPA	190,886	15.710	2,998,819.060	
IMERYS SA	2,256	56.750	128,028.000	
JERONIMO MARTINS	19,517	11.285	220,249.340	
KBC GROUPE	18,378	64.220	1,180,235.160	
HANNOVER RUECK SE	4,868	116.100	565,174.800	
WARTSILA OYJ	34,935	14.540	507,954.900	
L'OREAL	18,584	187.600	3,486,358.400	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	20,764	261.950	5,439,129.800	
GEA GROUP AG	11,838	26.170	309,800.460	
BOLLORE	71,347	3.552	253,424.540	
MEDIOBANCA SPA	42,404	7.744	328,376.570	
MICHELIN(CGDE)-B	12,118	98.940	1,198,954.920	
CONTINENTAL AG	8,317	137.000	1,139,429.000	
DEUTSCHE POST AG-REG	73,325	28.190	2,067,031.750	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	14,426	9.380	135,315.880	
NOKIAN RENKAAT OYJ	9,399	32.680	307,159.320	
AXEL SPRINGER SE	3,067	57.200	175,432.400	
OMV AG	9,766	48.410	472,772.060	
PERNOD-RICARD	15,401	130.100	2,003,670.100	
PEUGEOT SA	42,232	20.750	876,314.000	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG- PFD	10,591	53.420	565,771.220	
RENAULT SA	14,378	70.650	1,015,805.700	
REPSOL SA	103,827	16.440	1,706,915.880	
REMY COINTREAU	1,860	101.000	187,860.000	
MERCK KGAA	9,551	86.160	822,914.160	
COMPAGNIE DE SAINT- GOBAIN	35,706	33.305	1,189,188.330	
RWE AG	39,183	17.320	678,649.560	
SEB SA	1,405	143.600	201,758.000	
LUXOTTICA GROUP SPA	11,602	53.080	615,834.160	
SOCIETE GENERALE-A	58,110	36.070	2,096,027.700	
VINCI S.A.	37,228	77.560	2,887,403.680	
SODEXO	6,286	87.040	547,133.440	
SOLVAY SA	5,036	105.550	531,549.800	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	39,729	61.820	2,456,046.780	
VIVENDI SA	79,680	21.450	1,709,136.000	
SAP SE	73,011	97.080	7,087,907.880	
TELEFONICA S.A	358,674	7.013	2,515,380.760	
TOTAL SA	178,965	53.210	9,522,727.650	
VALEO	17,731	30.980	549,306.380	

E.ON SE	164,012	8.343	1,368,352.110	
VOEST-ALPINE AG	9,875	36.400	359,450.000	
HENKEL AG & CO KGAA	7,858	83.700	657,714.600	
SIEMENS AG-REG	56,716	100.500	5,699,958.000	
UPM-KYMMENE OYJ	41,197	30.040	1,237,557.880	
ING GROEP NV-CVA	290,820	10.820	3,146,672.400	
PUMA AG	600	416.000	249,600.000	
BAYER AG	69,537	77.320	5,376,600.840	
STORA ENSO OYJ-R SHS	42,303	14.285	604,298.350	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	13,222	94.620	1,251,065.640	
DAIMLER AG	67,488	52.700	3,556,617.600	
BASF SE	68,209	70.000	4,774,630.000	
BEIERSDORF AG	6,780	89.620	607,623.600	
HOCHTIEF AG	1,707	133.100	227,201.700	
HEIDELBERGCEMENT AG	11,009	61.800	680,356.200	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	16,408	85.020	1,395,008.160	
ORANGE	141,819	13.700	1,942,920.300	
SAMPO OYJ-A SHS	32,949	41.080	1,353,544.920	
RANDSTAD NV	7,794	42.860	334,050.840	
ALLIANZ SE	32,994	182.280	6,014,146.320	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	189,631	3.080	584,063.480	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	93,187	19.152	1,784,717.420	
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	17,602	21.460	377,738.920	
HERMES INTL	2,285	498.400	1,138,844.000	
ENDESA S.A.	21,037	17.970	378,034.890	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	15,963	18.875	301,301.620	
ERSTE GROUP BANK AG	20,754	35.900	745,068.600	
MUENCHENER RUECKVER AG- REG	11,602	183.750	2,131,867.500	
ARCELOR MITTAL (NL)	47,245	24.200	1,143,329.000	
SOCIETE BIC SA	2,478	72.250	179,035.500	
DASSAULT SYSTEMES SA	8,961	113.200	1,014,385.200	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	19,033	34.070	648,454.310	
HEINEKEN NV	20,425	75.580	1,543,721.500	
AKZO NOBEL	18,209	73.720	1,342,367.480	
ASML HOLDING NV	30,496	150.000	4,574,400.000	
AEGON NV	120,404	5.332	641,994.120	
BANKINTER S.A.	57,960	7.950	460,782.000	
VOLKSWAGEN AG	2,329	137.800	320,936.200	
VOLKSWAGEN AG PFD	13,901	140.480	1,952,812.480	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	504,414	5.289	2,667,845.640	
KERING	5,479	372.300	2,039,831.700	
CNP ASSURANCES	13,987	19.790	276,802.730	
FORTUM OYJ	29,739	19.845	590,170.450	

AGEAS	12,993	43.520	565,455.360	
UCB SA	8,747	72.540	634,507.380	
THYSSENKRUPP AG	29,903	19.920	595,667.760	
UNILEVER NV-CVA	114,914	45.855	5,269,381.470	
CARREFOUR SA	39,144	15.675	613,582.200	
NATURGY ENERGY GROUP SA	29,010	21.990	637,929.900	
ATOS SE	7,050	95.660	674,403.000	
NOKIA OYJ	417,248	4.441	1,852,998.360	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	73,000	35.115	2,563,395.000	
WOLTERS KLUWER-CVA	20,558	49.040	1,008,164.320	
SANOFI	84,037	75.420	6,338,070.540	
STMICROELECTRONICS NV	50,879	14.405	732,911.990	
ELISA OYJ	9,517	35.800	340,708.600	
BANCO SANTANDER SA	1,201,199	4.260	5,117,107.740	
METSO OYJ	8,585	28.550	245,101.750	
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	34,596	18.095	626,014.620	
QIAGEN N.V.	17,387	29.540	513,611.980	
1&1 DRILLISCH AG	3,149	37.620	118,465.380	
DEUTSCHE BANK AG-REG	149,244	9.471	1,413,489.920	
BMW VORZUG	4,116	64.600	265,893.600	
K & S	14,982	17.600	263,683.200	
ENEL SPA	607,499	4.346	2,640,190.650	
COLRUYT NV	4,673	47.930	223,976.890	
VOPAK (KON.)	5,364	40.710	218,368.440	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	246,287	14.000	3,448,018.000	
SARTORIUS AG	2,712	120.700	327,338.400	
LEONARDO SPA	26,269	9.798	257,383.660	
UBISOFT ENTERTAINMENT	5,911	86.580	511,774.380	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	81,774	18.075	1,478,065.050	
KONINKLIJKE KPN NV	228,967	2.321	531,432.400	
EUROFINS SCIENTIFIC	794	406.800	322,999.200	
TELEPERFORMANCE	4,436	145.700	646,325.200	
DEUTSCHE BOERSE AG	13,844	108.950	1,508,303.800	
EURAZEO	4,725	64.700	305,707.500	
BANCO SABADELL	367,753	1.286	472,930.350	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	5,814	81.440	473,492.160	
FRAPORT AG	3,149	67.380	212,179.620	
HEINEKEN HOLDING NV-A	8,014	73.250	587,025.500	
INDITEX	82,035	24.850	2,038,569.750	
JC DECAUX SA	6,058	28.600	173,258.800	
ANDRITZ AG	6,265	46.640	292,199.600	
MAPFRE SA	84,474	2.590	218,787.660	
ESSILORLUXOTTICA	15,607	115.250	1,798,706.750	
SNAM SPA	158,419	3.561	564,130.050	
CREDIT AGRICOLE SA	85,585	12.244	1,047,902.740	
ENAGAS	18,095	22.860	413,651.700	
WENDEL	2,220	114.100	253,302.000	

WIRECARD AG	8,803	159.550	1,404,518.650	
TENARIS SA	36,959	14.070	520,013.130	
TELECOM ITALIA SPA	792,163	0.502	397,665.820	
TELECOM ITALIA-RNC	497,596	0.432	214,961.470	
ATLANTIA SPA	34,969	17.400	608,460.600	
ILIAD SA	2,102	103.850	218,292.700	
PROXIMUS	14,283	21.870	312,369.210	
SES FDR	24,585	19.080	469,081.800	
TERNA SPA	112,686	4.480	504,833.280	
BIOMERIEUX	3,248	63.100	204,948.800	
GRIFOLS SA	23,518	22.000	517,396.000	
FERROVIAL SA	37,657	17.355	653,537.230	
LANXESS AG	6,856	59.360	406,972.160	
NESTE OYJ	8,839	69.660	615,724.740	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	9,641	23.820	229,648.620	
RECORDATI SPA	6,859	28.930	198,430.870	
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	35,583	6.505	231,467.410	
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	3,960	173.600	687,456.000	
KONE OYJ	23,717	41.400	981,883.800	
ENGIE	139,590	11.860	1,655,537.400	
ALSTOM	12,046	37.040	446,183.840	
TELENET GROUP HOLDING NV	3,634	44.000	159,896.000	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	12,542	21.510	269,778.420	
ELECTRICITE DE FRANCE	43,198	14.655	633,066.690	
IPSEN SA	2,487	123.700	307,641.900	
DEUTSCHE WOHNEN	26,714	39.360	1,051,463.040	
ARKEMA SA	5,230	98.120	513,167.600	
LEGRAND SA	19,920	57.740	1,150,180.800	
ADP	2,313	178.400	412,639.200	
ORION OYJ	8,051	29.650	238,712.150	
RTL GROUP SA	3,446	58.850	202,797.100	
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	37,921	15.850	601,047.850	
SYMRISE AG	9,628	71.460	688,016.880	
SCOR SE	13,875	39.990	554,861.250	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	17,397	28.620	497,902.140	
REXEL SA	23,245	11.665	271,152.920	
PRYSMIAN SPA	14,925	17.590	262,530.750	
CAIXABANK	262,372	3.864	1,013,805.400	
BUREAU VERITAS SA	21,480	19.500	418,860.000	
GETLINK	37,646	10.805	406,765.030	
SUEZ SA	25,406	12.875	327,102.250	
AMADEUS IT GROUP SA	32,520	71.560	2,327,131.200	
BRENTAG AG	12,353	47.640	588,496.920	



	INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GROUP SA	44,747	6.654	297,746.530	
	EVONIK INDUSTRIES AG	11,575	28.030	324,447.250	
	EDENRED	18,306	30.620	560,529.720	
	BANKIA SA	100,675	3.236	325,784.300	
	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	61,541	3.472	213,670.350	
	HUGO BOSS AG -ORD	5,218	61.880	322,889.840	
	OSRAM LICHT AG	7,017	30.000	210,510.000	
	KION GROUP AG	4,686	45.450	212,978.700	
	VONOVIA SE	35,308	38.980	1,376,305.840	
	BANK OF IRELAND GROUP PLC	73,287	6.305	462,074.530	
	SIEMENS HEALTHINEERS AG	10,000	33.495	334,950.000	
	FERRARI NV	9,503	100.900	958,852.700	
	METRO AG	10,774	13.335	143,671.290	
	CNH INDUSTRIAL NV	78,645	9.732	765,373.140	
	AIB GROUP PLC	52,322	4.380	229,170.360	
	LINDE AG-TENDER	13,854	197.400	2,734,779.600	
	INNOGY SE-TEMPORARY	9,769	36.730	358,815.370	
	MONCLER SPA	14,353	31.280	448,961.840	
	NN GROUP NV	21,965	37.740	828,959.100	
	ZALANDO SE	6,674	31.970	213,367.780	
	FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	76,719	14.040	1,077,134.760	
	AENA SME SA	5,256	138.000	725,328.000	
	ABN AMRO GROUP NV	34,251	22.800	780,922.800	
	EXOR NV	7,726	51.840	400,515.840	
	COVESTRO AG	14,459	61.720	892,409.480	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	57,180	73.520	4,203,873.600	
	POSTE ITALIANE SPA	40,015	6.276	251,134.140	
	AMUNDI SA	3,894	59.860	233,094.840	
	SCHAEFFLER AG	12,644	9.954	125,858.370	
	PIRELLI & C SPA	34,086	6.112	208,333.630	
	UNIPER SE	13,897	24.880	345,757.360	
	DELIVERY HERO SE	7,238	34.540	250,000.520	
ユーロ	小計	14,444,530		273,485,065.350 (35,585,876,704)	
香港・ドル	ASM PACIFIC TECH	16,600	74.250	1,232,550.000	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	164,000	14.080	2,309,120.000	
	BANK OF EAST ASIA	76,260	26.800	2,043,768.000	
	CLP HOLDINGS LTD	119,500	88.000	10,516,000.000	
	PCCW LTD	331,000	4.240	1,403,440.000	
	LI & FUNG LTD	532,400	1.650	878,460.000	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	49,000	60.650	2,971,850.000	

HONG KONG EXCHANGES &CLEAR	89,040	196.700	17,514,168.000	
MTR CORP	118,500	39.300	4,657,050.000	
HANG LUNG GROUP LTD	63,000	19.500	1,228,500.000	
HANG SENG BANK LTD	56,000	204.600	11,457,600.000	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	92,228	37.150	3,426,270.200	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	96,500	53.300	5,143,450.000	
(THE) WHARF HOLDINGS LTD	95,750	18.980	1,817,335.000	
HONG KONG & CHINA GAS	671,050	14.820	9,944,961.000	
HYSAN DEVELOPMENT CO	50,000	38.050	1,902,500.000	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	186,000	42.800	7,960,800.000	
KERRY PROPERTIES LTD	33,000	24.250	800,250.000	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	262,000	34.100	8,934,200.000	
NWS HOLDINGS LTD	135,000	15.240	2,057,400.000	
YUE YUEN INDUSTRIAL HOLDINGS	50,500	20.500	1,035,250.000	
NEW WORLD DEVELOPMENT	441,266	9.950	4,390,596.700	
SHANGRI-LA ASIA LTD	104,000	10.640	1,106,560.000	
SINO LAND CO	255,400	12.200	3,115,880.000	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	114,000	105.400	12,015,600.000	
SWIRE PACIFIC LTD A	30,000	82.450	2,473,500.000	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	113,500	44.750	5,079,125.000	
WHEELLOCK & CO LTD	56,000	42.250	2,366,000.000	
MINTH GROUP LTD	44,000	26.300	1,157,200.000	
SJM HOLDINGS LTD	156,000	6.390	996,840.000	
WYNN MACAU LTD	124,400	15.920	1,980,448.000	
MGM CHINA HOLDINGS LTD	64,800	11.600	751,680.000	
AIA GROUP LTD	904,027	60.500	54,693,633.500	
HKT TRUST / HKT LTD	282,000	10.960	3,090,720.000	
SANDS CHINA LTD	169,200	33.150	5,608,980.000	
SWIRE PROPERTIES LTD	104,200	27.200	2,834,240.000	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT CO LTD	95,750	49.100	4,701,325.000	
HK ELECTRIC INVESTMENTS & HK ELECTRIC INVESTMENTS LTD	230,000	7.560	1,738,800.000	
WH GROUP LTD	701,500	5.840	4,096,760.000	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	199,332	81.900	16,325,290.800	
CK ASSET HOLDINGS LTD	184,332	54.450	10,036,877.400	
香港・ドル 小計	7,661,035		237,794,978.600 (3,405,224,093)	
合計	84,236,182		290,425,195,264 (290,425,195,264)	

## (2) 株式以外の有価証券

平成30年10月12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	822,079.200	
		GOODMAN GROUP	121,619.000	1,225,919.520	
		GPT GROUP	144,955.000	724,775.000	
		LENDLEASE GROUP	37,363.000	673,281.260	
		MIRVAC GROUP	295,783.000	680,300.900	
		SCENTRE GROUP	383,688.000	1,481,035.680	
		STOCKLAND	194,018.000	779,952.360	
		VICINITY CENTRES	270,443.000	708,560.660	
	オーストラリア・ドル	小計	1,528,465.000	7,095,904.580 (567,317,571)	
	シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	200,806.000	497,998.880	
		CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	206,300.000	346,584.000	
		CAPITALAND MALL TRUST	199,000.000	413,920.000	
		SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	192,100.000	343,859.000	
	シンガポール・ドル	小計	798,206.000	1,602,361.880 (130,800,800)	
	投資信託受益証券	合計		2,326,671	698,118,371 (698,118,371)
投資証券	アメリカ・ドル	AGNC INVESTMENT CORP	32,741.000	582,789.800	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	7,304.000	874,946.160	
		AMERICAN TOWER CORP	32,749.000	4,607,129.320	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	77,528.000	766,751.920	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	10,542.000	1,825,768.980	
		BOSTON PROPERTIES INC	11,168.000	1,277,284.160	
		BROOKFIELD PROPERTY REIT INC	19,124.000	371,961.800	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	6,285.000	561,061.950	
		CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	30,388.000	3,199,248.640	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	15,118.000	1,625,185.000	
		DUKE REALTY TRUST	24,470.000	656,774.800	
		EQUINIX INC	5,887.000	2,337,609.960	
		EQUITY RESIDENTIAL	27,070.000	1,701,890.900	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	5,024.000	1,204,202.560	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	9,741.000	824,186.010	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	6,000.000	715,260.000	
		HCP INC	34,130.000	846,765.300	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	51,147.000	984,068.280	
INVITATION HOMES INC	22,567.000	477,743.390			

	IRON MOUNTAIN INC	19,265.000	606,847.500	
	KIMCO REALTY	32,980.000	494,700.000	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	11,649.000	471,784.500	
	MID AMERICA	8,123.000	778,102.170	
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	10,544.000	455,922.560	
	PROLOGIS INC	49,313.000	3,098,828.920	
	PUBLIC STORAGE	11,851.000	2,319,003.680	
	REALTY INCOME CORP	22,285.000	1,247,068.600	
	REGENCY CENTERS CORP	11,294.000	696,500.980	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	8,169.000	1,197,983.850	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	23,209.000	3,954,813.600	
	SL GREEN	7,097.000	643,343.050	
	THE MACERICH COMPANY	9,014.000	451,330.980	
	UDR INC	21,658.000	829,284.820	
	VENTAS INC	25,041.000	1,336,187.760	
	VEREIT INC	72,429.000	501,208.680	
	VORNADO REALTY TRUST	12,211.000	827,905.800	
	WELLTOWER INC	26,516.000	1,636,832.680	
	WEYERHAEUSER CO	56,867.000	1,620,709.500	
アメリカ・ドル 小計		868,498.000	48,608,988.560 (5,453,442,426)	
イギリス・ポンド	BRITISH LAND CO PLC	71,871.000	413,258.250	
	HAMMERSON PLC	58,616.000	254,393.440	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	59,062.000	491,632.080	
	SEGRO PLC	82,914.000	502,293.010	
イギリス・ポンド 小計		272,463.000	1,661,576.780 (246,843,846)	
カナダ・ドル	H & R REAL ESTATE INVESTMENT	10,748.000	203,997.040	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	9,675.000	229,781.250	
	SMARTCENTRES REIT	2,582.000	75,962.440	
カナダ・ドル 小計		23,005.000	509,740.730 (43,898,871)	
ユーロ	COVIVIO	2,343.000	197,749.200	
	GECINA SA	3,670.000	485,908.000	
	ICADE	2,234.000	163,305.400	
	KLEPIERRE	17,042.000	494,729.260	
	UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	10,338.000	1,666,692.360	
ユーロ 小計		35,627.000	3,008,384.220 (391,450,955)	
香港・ドル	LINK REIT	163,500.000	11,698,425.000	
香港・ドル 小計		163,500.000	11,698,425.000 (167,521,446)	
投資証券 合計		1,363,093	6,303,157,544 (6,303,157,544)	
合計			7,001,275,915	

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	63.57%	-%	-%	68.06%
	投資証券 38銘柄	-%	-%	1.76%	
イギリス・ポンド	株式 96銘柄	6.31%	-%	-%	6.66%
	投資証券 4銘柄	-%	-%	0.08%	
イスラエル・シケル	株式 9銘柄	0.10%	-%	-%	0.11%
オーストラリア・ドル	株式 59銘柄	2.26%	-%	-%	2.55%
	投資信託受 益証券 8銘柄	-%	0.18%	-%	
カナダ・ドル	株式 88銘柄	3.54%	-%	-%	3.70%
	投資証券 3銘柄	-%	-%	0.01%	
シンガポール・ドル	株式 21銘柄	0.42%	-%	-%	0.48%
	投資信託受 益証券 4銘柄	-%	0.04%	-%	
スイス・フラン	株式 38銘柄	3.00%	-%	-%	3.13%
スウェーデン・クローナ	株式 32銘柄	0.98%	-%	-%	1.02%
デンマーク・クローネ	株式 17銘柄	0.59%	-%	-%	0.61%
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	0.29%	-%	-%	0.30%
ユーロ	株式 238銘柄	11.48%	-%	-%	12.10%
	投資証券 5銘柄	-%	-%	0.13%	
香港・ドル	株式 41銘柄	1.10%	-%	-%	1.20%
	投資証券 1銘柄	-%	-%	0.05%	

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

## 「外国債券パッシブ・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10月12日現在
資産の部		
流動資産		
預金		2,752,784,135
コール・ローン		1,828,346,767
国債証券		196,712,880,950
派生商品評価勘定		3,641,715
未収入金		319,943,440
未収利息		1,780,970,670
前払費用		26,041,528
流動資産合計		203,424,609,205
資産合計		203,424,609,205
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		719,032
未払金		1,192,646,625
未払解約金		217,931,000
流動負債合計		1,411,296,657
負債合計		1,411,296,657
純資産の部		
元本等		
元本	1	112,458,205,288
剰余金		
剰余金又は欠損金( )		89,555,107,260
元本等合計		202,013,312,548
純資産合計		202,013,312,548
負債純資産合計		203,424,609,205

## 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10月12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	131,651,234,057円  25,881,266,870円 45,074,295,639円
元本の内訳 ファンド名 D I A M外国債券パッシブ・ファンド M I T O ラップ型ファンド（安定型） M I T O ラップ型ファンド（中立型） M I T O ラップ型ファンド（積極型） グローバル8資産ラップファンド（安定型） グローバル8資産ラップファンド（中立型） グローバル8資産ラップファンド（積極型） たわらノーロード 先進国債券 たわらノーロード 先進国債券<ラップ向け> たわらノーロード バランス（8資産均等型） たわらノーロード バランス（堅実型）	7,828,695,366円 12,133,962円 32,672,527円 40,635,275円 85,434,297円 86,584,078円 52,316,242円 2,746,620,338円 606,412円 87,793,845円 1,694,648円

たわらノーロード バランス (標準型)	9,240,402円
たわらノーロード バランス (積極型)	3,039,080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)	278,668円
たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(安定型)	15,745,793円
たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(安定成長 型)	24,978,110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)	7,894,293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)	3,760,811円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定型)	126,040円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定成長型)	954,451円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(成長型)	439,864円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(積極型)	717,124円
D I A M外国債券インデックス ファンド<DC年金>	5,130,305,928円
D I A Mバランス・ファンド< DC年金>1安定型	508,593,929円
D I A Mバランス・ファンド< DC年金>2安定・成長型	1,661,755,217円
D I A Mバランス・ファンド< DC年金>3成長型	1,750,297,361円
D I A M DC バランス30 インデックスファンド	375,375,876円
D I A M DC バランス50 インデックスファンド	812,877,584円
D I A M DC バランス70 インデックスファンド	646,291,543円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型>	22,797,155円
マネックス資産設計ファンド< 育成型>	597,658,723円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	16,493,279円
D I A M DC 8資産 balan スファンド(新興国10)	116,556,212円
D I A M DC 8資産 balan スファンド(新興国20)	67,061,918円
D I A M DC 8資産 balan スファンド(新興国30)	112,693,813円
クルーズコントロール	2,461,568,454円
D I A M 8資産バランスファ ンドN<DC年金>	81,966,152円



D I A M D C バランス・F (成長型)	145,173,468円
クルーズコントロール<DC年金>	1,425,658円
D I A Mコア資産設計ファンド (堅実型)	7,283,621円
D I A Mコア資産設計ファンド (積極型)	18,963,158円
ダイナミック・ナビゲーション	364,709円
4資産分散投資・スタンダード <DC年金>	15,420,153円
9資産分散投資・スタンダード <DC年金>	11,075円
D I A Mパッシブ資産分散ファ ンド	1,315,797,580円
D I A M為替フルヘッジ型外国 債券パッシブ私募ファンド(適 格機関投資家向け)	6,773,540,012円
D I A M外国債券パッシブファ ンド(適格機関投資家向け)	4,135,915,089円
外国債券パッシブファンド(適 格機関投資家限定)	3,316,290,366円
先進国債券パッシブファンド (適格機関投資家限定)	6,087,743,818円
D I A Mワールドバランス25 VA(適格機関投資家限定)	95,731,710円
D I A Mグローバル・バランス ファンド25VA(適格機関投 資家限定)	806,989,317円
D I A Mグローバル・バランス ファンド50VA(適格機関投 資家限定)	659,285,763円
D I A M国際分散バランスファ ンド30VA(適格機関投資家 限定)	50,717,767円
D I A M国際分散バランスファ ンド50VA(適格機関投資家 限定)	92,921,832円
D I A M国内重視バランスファ ンド30VA(適格機関投資家 限定)	23,232,912円
D I A M国内重視バランスファ ンド50VA(適格機関投資家 限定)	7,499,874円
D I A M世界バランスファンド 40VA(適格機関投資家限 定)	66,675,797円
D I A M世界バランスファンド 50VA(適格機関投資家限 定)	79,005,779円
D I A Mバランスファンド25 VA(適格機関投資家限定)	3,456,312,316円

D I A Mバランスファンド3 7.5 V A (適格機関投資家限 定)	2,282,689,021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)	3,948,633,035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)	699,334,985円
D I A Mグローバル・アセッ ト・バランスV A 2 (適格機関 投資家限定)	263,420,576円
D I A M アクサ グローバ ル バランスファンド30 V A (適格機関投資家限定)	3,216,272,025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)	2,354,914,119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)	13,975,529円
D I A M世界バランスファンド 55 V A (適格機関投資家限 定)	16,311,743円
D I A M世界バランスファンド 35 V A (適格機関投資家限 定)	156,842,701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)	10,386,113,603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)	19,186,986,411円
D I A Mバランス30 V A (適 格機関投資家限定)	14,080,569円
D I A Mバランス50 V A (適 格機関投資家限定)	11,257,433円
D I A Mバランス70 V A (適 格機関投資家限定)	5,627,956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)	17,130,207,794円
D I A M世界バランス25 V A (適格機関投資家限定)	100,006,763円
D I A Mバランス20 V A (適 格機関投資家限定)	110,036,727円
D I A Mバランス40 V A (適 格機関投資家限定)	369,121円
D I A Mバランス60 V A (適 格機関投資家限定)	168,633円
計	112,458,205,288円
2. 受益権の総数	112,458,205,288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11月8日 至 平成30年10月12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。
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。
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。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成30年10月12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。
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。
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。

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	平成30年10月12日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
国債証券	3,527,726,683
合計	3,527,726,683

(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22日から平成30年10月12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10月12日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買 建	1,350,330,000	-	1,353,252,683	2,922,683
アメリカ・ドル	504,760,000	-	504,040,968	719,032
ユーロ	845,570,000	-	849,211,715	3,641,715
合計	1,350,330,000	-	1,353,252,683	2,922,683

(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10月12日現在
1口当たり純資産額	1.7963円
(1万口当たり純資産額)	(17,963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10月12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 1.0 11/30/19	6,500,000.000	6,375,525.000	
		US T N/B 1.25 01/31/20	10,800,000.000	10,593,180.000	
		US T N/B 1.25 10/31/19	15,000,000.000	14,777,250.000	
		US T N/B 1.375 01/31/20	8,600,000.000	8,449,500.000	
		US T N/B 1.375 03/31/20	6,300,000.000	6,173,496.000	
		US T N/B 1.375 04/30/20	12,000,000.000	11,743,080.000	
		US T N/B 1.375 04/30/21	11,210,000.000	10,793,996.900	
		US T N/B 1.375 05/31/20	3,500,000.000	3,420,130.000	
		US T N/B 1.375 06/30/23	7,000,000.000	6,506,710.000	
		US T N/B 1.375 09/30/23	5,900,000.000	5,462,515.000	
		US T N/B 1.5 08/15/26	7,000,000.000	6,223,420.000	
		US T N/B 1.5 10/31/19	5,180,000.000	5,116,234.200	
		US T N/B 1.625 02/15/26	5,500,000.000	4,971,890.000	
		US T N/B 1.625 05/15/26	8,500,000.000	7,657,225.000	
		US T N/B 1.625 05/31/23	5,300,000.000	4,990,268.000	
		US T N/B 1.625 08/15/22	9,500,000.000	9,042,765.000	
		US T N/B 1.625 11/15/22	11,050,000.000	10,481,919.500	
		US T N/B 1.625 11/30/20	8,510,000.000	8,291,888.700	
		US T N/B 1.75 01/31/23	10,000,000.000	9,506,200.000	
		US T N/B 1.75 03/31/22	11,700,000.000	11,242,881.000	
		US T N/B 1.75 05/15/22	11,600,000.000	11,130,548.000	
		US T N/B 1.75 05/15/23	7,000,000.000	6,631,380.000	
		US T N/B 1.75 09/30/22	10,230,000.000	9,769,650.000	
		US T N/B 1.75 10/31/20	6,000,000.000	5,868,720.000	
		US T N/B 1.75 12/31/20	9,000,000.000	8,784,810.000	
		US T N/B 1.875 02/28/22	1,680,000.000	1,622,762.400	
		US T N/B 1.875 06/30/20	11,000,000.000	10,826,310.000	
		US T N/B 1.875 08/31/22	12,000,000.000	11,524,680.000	
		US T N/B 1.875 08/31/24	5,760,000.000	5,404,492.800	
		US T N/B 2.0 02/15/22	15,390,000.000	14,935,379.400	
		US T N/B 2.0 02/15/23	9,500,000.000	9,124,370.000	
		US T N/B 2.0 02/15/25	9,500,000.000	8,923,255.000	
		US T N/B 2.0 05/31/21	12,000,000.000	11,726,160.000	
		US T N/B 2.0 05/31/24	6,180,000.000	5,854,561.200	
		US T N/B 2.0 08/15/25	9,000,000.000	8,405,820.000	
		US T N/B 2.0 09/30/20	6,000,000.000	5,903,400.000	
US T N/B 2.0 11/15/21	10,400,000.000	10,119,200.000			
US T N/B 2.0 11/15/26	7,000,000.000	6,443,780.000			
US T N/B 2.0 11/30/20	10,500,000.000	10,312,050.000			
US T N/B 2.0 11/30/22	6,590,000.000	6,343,336.300			

US T N/B 2.125 01/31/21	5,000,000.000	4,915,600.000	
US T N/B 2.125 05/15/25	9,980,000.000	9,422,517.200	
US T N/B 2.125 06/30/22	9,500,000.000	9,226,115.000	
US T N/B 2.125 08/15/21	11,000,000.000	10,765,370.000	
US T N/B 2.125 08/31/20	3,000,000.000	2,960,610.000	
US T N/B 2.125 09/30/21	10,000,000.000	9,774,200.000	
US T N/B 2.125 09/30/24	6,780,000.000	6,444,661.200	
US T N/B 2.125 12/31/21	12,880,000.000	12,563,023.200	
US T N/B 2.125 12/31/22	8,000,000.000	7,731,840.000	
US T N/B 2.25 02/15/27	8,000,000.000	7,481,200.000	
US T N/B 2.25 03/31/21	11,500,000.000	11,325,660.000	
US T N/B 2.25 08/15/27	8,000,000.000	7,459,360.000	
US T N/B 2.25 08/15/46	4,500,000.000	3,634,425.000	
US T N/B 2.25 11/15/24	10,600,000.000	10,132,858.000	
US T N/B 2.25 11/15/25	7,000,000.000	6,630,260.000	
US T N/B 2.25 11/15/27	8,100,000.000	7,538,022.000	
US T N/B 2.25 12/31/23	6,610,000.000	6,371,907.800	
US T N/B 2.375 05/15/27	6,330,000.000	5,978,874.900	
US T N/B 2.375 08/15/24	8,900,000.000	8,587,076.000	
US T N/B 2.375 12/31/20	8,300,000.000	8,211,107.000	
US T N/B 2.5 02/15/45	4,500,000.000	3,863,295.000	
US T N/B 2.5 02/15/46	5,000,000.000	4,276,150.000	
US T N/B 2.5 03/31/23	1,020,000.000	999,671.400	
US T N/B 2.5 05/15/24	9,000,000.000	8,760,870.000	
US T N/B 2.5 05/15/46	4,400,000.000	3,758,876.000	
US T N/B 2.5 08/15/23	8,000,000.000	7,824,960.000	
US T N/B 2.625 03/31/25	4,080,000.000	3,977,020.800	
US T N/B 2.625 06/30/23	1,820,000.000	1,791,262.200	
US T N/B 2.625 08/15/20	16,500,000.000	16,436,805.000	
US T N/B 2.625 08/31/20	9,250,000.000	9,214,202.500	
US T N/B 2.625 11/15/20	6,000,000.000	5,970,180.000	
US T N/B 2.75 02/15/24	9,400,000.000	9,284,662.000	
US T N/B 2.75 02/15/28	5,950,000.000	5,765,907.000	
US T N/B 2.75 02/28/25	5,810,000.000	5,708,731.700	
US T N/B 2.75 05/31/23	3,270,000.000	3,238,052.100	
US T N/B 2.75 06/30/25	790,000.000	774,934.700	
US T N/B 2.75 07/31/23	6,500,000.000	6,431,425.000	
US T N/B 2.75 08/15/42	2,800,000.000	2,546,012.000	
US T N/B 2.75 08/15/47	5,150,000.000	4,599,568.000	
US T N/B 2.75 08/31/23	2,170,000.000	2,147,280.100	
US T N/B 2.75 08/31/25	1,640,000.000	1,607,446.000	
US T N/B 2.75 11/15/23	10,000,000.000	9,886,700.000	
US T N/B 2.75 11/15/42	3,400,000.000	3,090,532.000	
US T N/B 2.75 11/15/47	3,230,000.000	2,895,113.600	
US T N/B 2.875 05/15/28	7,120,000.000	6,968,700.000	
US T N/B 2.875 05/15/43	3,880,000.000	3,601,105.600	
US T N/B 2.875 07/31/25	3,390,000.000	3,349,726.800	
US T N/B 2.875 08/15/28	1,570,000.000	1,536,260.700	
US T N/B 2.875 08/15/45	4,900,000.000	4,526,375.000	

US T N/B 2.875 11/15/46	4,400,000.000	4,054,864.000	
US T N/B 3.0 02/15/47	4,430,000.000	4,183,559.100	
US T N/B 3.0 02/15/48	4,020,000.000	3,786,960.600	
US T N/B 3.0 05/15/42	980,000.000	932,293.600	
US T N/B 3.0 05/15/45	5,000,000.000	4,733,200.000	
US T N/B 3.0 05/15/47	4,680,000.000	4,399,902.000	
US T N/B 3.0 08/15/48	2,920,000.000	2,752,100.000	
US T N/B 3.0 11/15/44	5,100,000.000	4,829,037.000	
US T N/B 3.0 11/15/45	3,900,000.000	3,689,127.000	
US T N/B 3.125 02/15/42	1,800,000.000	1,752,750.000	
US T N/B 3.125 02/15/43	2,600,000.000	2,523,404.000	
US T N/B 3.125 05/15/21	8,000,000.000	8,045,600.000	
US T N/B 3.125 05/15/48	4,350,000.000	4,202,839.500	
US T N/B 3.125 08/15/44	4,600,000.000	4,458,044.000	
US T N/B 3.125 11/15/41	1,800,000.000	1,753,308.000	
US T N/B 3.375 05/15/44	3,910,000.000	3,958,562.200	
US T N/B 3.375 11/15/19	4,000,000.000	4,028,400.000	
US T N/B 3.5 02/15/39	1,300,000.000	1,349,764.000	
US T N/B 3.5 05/15/20	14,000,000.000	14,150,920.000	
US T N/B 3.625 02/15/20	15,300,000.000	15,469,065.000	
US T N/B 3.625 02/15/21	5,500,000.000	5,590,860.000	
US T N/B 3.625 02/15/44	4,510,000.000	4,758,365.700	
US T N/B 3.625 08/15/43	2,790,000.000	2,942,557.200	
US T N/B 3.75 08/15/41	2,000,000.000	2,148,740.000	
US T N/B 3.75 11/15/43	4,120,000.000	4,433,490.800	
US T N/B 3.875 08/15/40	2,100,000.000	2,296,203.000	
US T N/B 4.25 05/15/39	720,000.000	828,050.400	
US T N/B 4.25 11/15/40	2,000,000.000	2,305,460.000	
US T N/B 4.375 02/15/38	750,000.000	873,337.500	
US T N/B 4.375 05/15/40	2,000,000.000	2,341,080.000	
US T N/B 4.375 05/15/41	2,000,000.000	2,347,640.000	
US T N/B 4.375 11/15/39	1,660,000.000	1,939,859.400	
US T N/B 4.5 02/15/36	2,000,000.000	2,345,620.000	
US T N/B 4.5 05/15/38	1,100,000.000	1,302,202.000	
US T N/B 4.5 08/15/39	1,400,000.000	1,662,052.000	
US T N/B 4.625 02/15/40	2,300,000.000	2,777,963.000	
US T N/B 4.75 02/15/41	1,800,000.000	2,218,626.000	
US T N/B 5.0 05/15/37	800,000.000	999,624.000	
US T N/B 5.25 02/15/29	1,000,000.000	1,186,010.000	
US T N/B 5.25 11/15/28	1,500,000.000	1,771,515.000	
US T N/B 5.375 02/15/31	1,500,000.000	1,839,135.000	
US T N/B 5.5 08/15/28	1,100,000.000	1,319,395.000	
US T N/B 6.0 02/15/26	2,360,000.000	2,812,435.600	
US T N/B 6.125 11/15/27	1,400,000.000	1,731,618.000	
US T N/B 6.25 05/15/30	1,400,000.000	1,820,098.000	
US T N/B 6.25 08/15/23	1,000,000.000	1,147,100.000	
US T N/B 8.0 11/15/21	6,000,000.000	6,897,600.000	
アメリカ・ドル 小計	813,800,000.000 (91,300,222,000)	793,151,589.500 (88,983,676,826)	



イギリス・ボンド	UK TREASURY 0.5 07/22/22	2,350,000.000	2,298,135.500	
	UK TREASURY 0.75 07/22/23	1,360,000.000	1,329,155.200	
	UK TREASURY 1.25 07/22/27	2,730,000.000	2,656,808.700	
	UK TREASURY 1.5 01/22/21	2,700,000.000	2,735,694.000	
	UK TREASURY 1.5 07/22/26	2,400,000.000	2,404,920.000	
	UK TREASURY 1.5 07/22/47	2,400,000.000	2,104,560.000	
	UK TREASURY 1.625 10/22/28	820,000.000	816,080.400	
	UK TREASURY 1.625 10/22/71	430,000.000	380,240.400	
	UK TREASURY 1.75 07/22/57	1,530,000.000	1,421,523.000	
	UK TREASURY 1.75 09/07/22	3,000,000.000	3,073,020.000	
	UK TREASURY 1.75 09/07/37	1,250,000.000	1,194,000.000	
	UK TREASURY 2.0 09/07/25	930,000.000	967,851.000	
	UK TREASURY 2.25 09/07/23	2,800,000.000	2,935,772.000	
	UK TREASURY 2.5 07/22/65	2,000,000.000	2,310,480.000	
	UK TREASURY 2.75 09/07/24	2,000,000.000	2,161,820.000	
	UK TREASURY 3.25 01/22/44	2,600,000.000	3,188,120.000	
	UK TREASURY 3.5 01/22/45	2,520,000.000	3,230,640.000	
	UK TREASURY 3.5 07/22/68	1,900,000.000	2,801,360.000	
	UK TREASURY 3.75 07/22/52	1,780,000.000	2,521,370.000	
	UK TREASURY 3.75 09/07/20	2,900,000.000	3,057,470.000	
	UK TREASURY 3.75 09/07/21	1,850,000.000	1,997,204.500	
	UK TREASURY 4.0 01/22/60	1,600,000.000	2,498,080.000	
	UK TREASURY 4.0 03/07/22	2,000,000.000	2,198,820.000	
	UK TREASURY 4.25 03/07/36	2,450,000.000	3,268,545.000	
UK TREASURY 4.25 06/07/32	1,850,000.000	2,383,725.000		

	UK TREASURY 4.25 09/07/39	1,550,000.000	2,131,870.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/27	1,700,000.000	2,091,867.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/40	1,980,000.000	2,753,586.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/46	1,930,000.000	2,817,607.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/49	1,560,000.000	2,341,404.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/55	1,940,000.000	3,063,454.000	
	UK TREASURY 4.5 09/07/34	1,680,000.000	2,268,672.000	
	UK TREASURY 4.5 12/07/42	1,720,000.000	2,514,124.000	
	UK TREASURY 4.75 12/07/30	1,500,000.000	1,989,450.000	
	UK TREASURY 4.75 12/07/38	1,610,000.000	2,338,686.000	
	UK TREASURY 5.0 03/07/25	2,030,000.000	2,483,116.300	
	UK TREASURY 6.0 12/07/28	1,350,000.000	1,903,500.000	
	UK TREASURY 8.0 06/07/21	1,700,000.000	2,013,786.000	
	イギリス・ポンド 小計	72,400,000.000 (10,755,744,000)	86,646,517.000 (12,872,206,566)	
オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN 5.75 05/15/21	3,700,000.000	4,043,878.000	
	AUSTRALIAN 1.75 11/21/20	2,400,000.000	2,386,128.000	
	AUSTRALIAN 2.0 12/21/21	1,770,000.000	1,764,690.000	
	AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	2,570,000.000	2,467,457.000	
	AUSTRALIAN 2.25 11/21/22	890,000.000	891,771.100	
	AUSTRALIAN 2.75 04/21/24	3,100,000.000	3,160,760.000	
	AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	900,000.000	870,048.000	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	2,900,000.000	2,907,511.000	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/28	2,700,000.000	2,704,239.000	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/29	1,560,000.000	1,558,330.800	
	AUSTRALIAN 3.0 03/21/47	1,250,000.000	1,201,062.500	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	3,100,000.000	3,240,368.000	

	AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	3,100,000.000	3,244,212.000	
	AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	900,000.000	919,377.000	
	AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	1,200,000.000	1,318,728.000	
	AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	3,600,000.000	4,008,924.000	
	AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	1,500,000.000	1,784,490.000	
	AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	3,600,000.000	4,173,624.000	
	AUSTRALIAN 5.5 04/21/23	3,000,000.000	3,419,010.000	
	AUSTRALIAN 5.75 07/15/22	3,500,000.000	3,953,145.000	
オーストラリア・ドル 小計		47,240,000.000 (3,776,838,000)	50,017,753.400 (3,998,919,384)	
カナダ・ドル	CANADA 8.0 06/01/27	1,000,000.000	1,425,500.000	
	CANADA 0.75 03/01/21	1,090,000.000	1,051,784.600	
	CANADA 0.75 09/01/20	2,400,000.000	2,334,408.000	
	CANADA 0.75 09/01/21	600,000.000	574,122.000	
	CANADA 1.0 06/01/27	800,000.000	708,200.000	
	CANADA 1.0 09/01/22	800,000.000	760,376.000	
	CANADA 1.5 03/01/20	2,300,000.000	2,278,886.000	
	CANADA 1.5 06/01/23	2,300,000.000	2,213,221.000	
	CANADA 1.5 06/01/26	1,700,000.000	1,586,032.000	
	CANADA 1.75 03/01/23	1,160,000.000	1,130,582.400	
	CANADA 1.75 05/01/20	2,770,000.000	2,750,582.300	
	CANADA 2.0 06/01/28	1,020,000.000	976,517.400	
	CANADA 2.0 12/01/51	150,000.000	133,297.500	
	CANADA 2.25 06/01/25	1,500,000.000	1,481,775.000	
	CANADA 2.5 06/01/24	1,600,000.000	1,607,504.000	
	CANADA 2.75 06/01/22	3,900,000.000	3,956,589.000	
	CANADA 2.75 12/01/48	1,450,000.000	1,526,995.000	
	CANADA 2.75 12/01/64	750,000.000	809,265.000	
	CANADA 3.25 06/01/21	4,700,000.000	4,814,492.000	
	CANADA 3.5 06/01/20	2,800,000.000	2,857,204.000	
CANADA 3.5 12/01/45	1,900,000.000	2,269,303.000		
CANADA 4.0 06/01/41	1,800,000.000	2,256,624.000		
CANADA 5.0 06/01/37	1,400,000.000	1,912,722.000		
CANADA 5.75 06/01/29	1,600,000.000	2,081,264.000		
CANADA 5.75 06/01/33	1,550,000.000	2,160,514.000		
カナダ・ドル 小計		43,040,000.000 (3,706,604,800)	45,657,760.200 (3,932,046,308)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE 1.25 10/01/21	1,000,000.000	973,200.000	
	SINGAPORE 2.25 08/01/36	200,000.000	182,020.000	
	SINGAPORE 2.375 06/01/25	500,000.000	497,000.000	
	SINGAPORE 2.75 03/01/46	660,000.000	637,725.000	
	SINGAPORE 2.75 04/01/42	550,000.000	533,225.000	

	SINGAPORE 2.875 07/01/29	400,000.000	408,520.000	
	SINGAPORE 2.875 09/01/30	460,000.000	467,360.000	
	SINGAPORE 3.0 09/01/24	810,000.000	835,515.000	
	SINGAPORE 3.125 09/01/22	1,600,000.000	1,651,200.000	
	SINGAPORE 3.25 09/01/20	1,340,000.000	1,370,083.000	
	SINGAPORE 3.375 09/01/33	480,000.000	510,537.600	
	SINGAPORE 3.5 03/01/27	900,000.000	963,900.000	
シンガポール・ドル 小計		8,900,000.000 (726,507,000)	9,030,285.600 (737,142,214)	
スウェーデン・クローナ	SWEDEN 0.75 05/12/28	4,970,000.000	4,981,629.800	
	SWEDEN 1.0 11/12/26	7,000,000.000	7,237,090.000	
	SWEDEN 1.5 11/13/23	9,700,000.000	10,358,242.000	
	SWEDEN 2.5 05/12/25	7,300,000.000	8,313,021.000	
	SWEDEN 3.5 03/30/39	6,200,000.000	8,476,330.000	
	SWEDEN 3.5 06/01/22	12,870,000.000	14,533,190.100	
スウェーデン・クローナ 小計		48,040,000.000 (600,980,400)	53,899,502.900 (674,282,781)	
デンマーク・クローネ	DENMARK 0.5 11/15/27	7,130,000.000	7,154,028.100	
	DENMARK 1.5 11/15/23	5,500,000.000	5,932,575.000	
	DENMARK 1.75 11/15/25	9,470,000.000	10,490,676.600	
	DENMARK 3.0 11/15/21	13,000,000.000	14,342,900.000	
	DENMARK 4.5 11/15/39	15,240,000.000	25,770,230.400	
デンマーク・クローネ 小計		50,340,000.000 (877,929,600)	63,690,410.100 (1,110,760,752)	
ノルウェー・クローネ	NORWAY 1.5 02/19/26	6,000,000.000	5,836,800.000	
	NORWAY 1.75 02/17/27	3,970,000.000	3,900,644.100	
	NORWAY 1.75 03/13/25	3,800,000.000	3,780,506.000	
	NORWAY 2.0 05/24/23	7,600,000.000	7,723,728.000	
	NORWAY 3.0 03/14/24	6,200,000.000	6,606,100.000	
ノルウェー・クローネ 小計		27,570,000.000 (377,157,600)	27,847,778.100 (380,957,604)	
ポーランド・ズロチ	POLAND 1.5 04/25/20	3,000,000.000	3,001,140.000	
	POLAND 1.75 07/25/21	2,200,000.000	2,198,460.000	
	POLAND 2.0 04/25/21	1,130,000.000	1,137,345.000	
	POLAND 2.25 04/25/22	4,000,000.000	4,014,400.000	
	POLAND 2.5 01/25/23	1,350,000.000	1,354,050.000	
	POLAND 2.5 07/25/26	4,200,000.000	4,029,690.000	
	POLAND 2.5 07/25/27	3,000,000.000	2,840,580.000	
	POLAND 2.75 04/25/28	960,000.000	920,784.000	
	POLAND 3.25 07/25/25	3,300,000.000	3,359,895.000	
	POLAND 4.0 10/25/23	3,100,000.000	3,309,715.000	
	POLAND 5.25 10/25/20	4,900,000.000	5,259,170.000	
	POLAND 5.75 04/25/29	1,440,000.000	1,770,163.200	
	POLAND 5.75 09/23/22	3,200,000.000	3,613,376.000	
POLAND 5.75 10/25/21	3,680,000.000	4,096,024.000		

ポーランド・ズロチ 小計		39,460,000.000 (1,192,086,600)	40,904,792.200 (1,235,733,772)	
マレーシア・リングgit	MALAYSIA 3.418 08/15/22	3,000,000.000	2,962,350.000	
	MALAYSIA 3.48 03/15/23	1,220,000.000	1,202,700.400	
	MALAYSIA 3.492 03/31/20	2,200,000.000	2,199,934.000	
	MALAYSIA 3.502 05/31/27	2,570,000.000	2,445,663.400	
	MALAYSIA 3.733 06/15/28	2,000,000.000	1,938,660.000	
	MALAYSIA 3.844 04/15/33	1,210,000.000	1,118,753.900	
	MALAYSIA 3.892 03/15/27	800,000.000	785,088.000	
	MALAYSIA 4.127 04/15/32	1,850,000.000	1,765,399.500	
	MALAYSIA 4.16 07/15/21	4,000,000.000	4,053,880.000	
	MALAYSIA 4.181 07/15/24	2,430,000.000	2,456,001.000	
	MALAYSIA 4.378 11/29/19	3,680,000.000	3,717,940.800	
	MALAYSIA 4.392 04/15/26	3,070,000.000	3,125,382.800	
	MALAYSIA 4.498 04/15/30	1,800,000.000	1,805,544.000	
	MALAYSIA 4.935 09/30/43	2,000,000.000	2,016,780.000	
	MALAYSIA 5.248 09/15/28	1,600,000.000	1,701,072.000	
マレーシア・リングgit 小計		33,430,000.000 (902,944,300)	33,295,149.800 (899,301,996)	
メキシコ・ペソ	MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	13,000,000.000	15,103,010.000	
	MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	35,000,000.000	38,375,400.000	
	MEXICAN BONDS 5.75 03/05/26	14,859,000.000	12,944,120.670	
	MEXICAN BONDS 6.5 06/09/22	26,000,000.000	24,801,400.000	
	MEXICAN BONDS 6.5 06/10/21	38,000,000.000	36,685,200.000	
	MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	10,000,000.000	9,596,000.000	
	MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	10,000,000.000	9,617,000.000	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	22,000,000.000	20,748,200.000	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	7,000,000.000	6,679,400.000	
	MEXICAN BONDS 8.0 06/11/20	30,000,000.000	30,036,000.000	
	MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47	5,000,000.000	4,837,250.000	
	MEXICAN BONDS 8.0 12/07/23	14,000,000.000	14,002,660.000	
	MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	31,000,000.000	31,687,580.000	
	MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	15,000,000.000	15,307,500.000	
	メキシコ・ペソ 小計		270,859,000.000 (1,603,485,280)	270,420,720.670 (1,600,890,666)
ユーロ	AUSTRIA 0.5 04/20/27	500,000.000	494,945.000	

AUSTRIA 0.75 10/20/26	1,300,000.000	1,322,568.000	
AUSTRIA 07/15/23	350,000.000	349,352.500	
AUSTRIA 09/20/22	1,790,000.000	1,798,144.500	
AUSTRIA 1.2 10/20/25	1,000,000.000	1,058,100.000	
AUSTRIA 1.5 02/20/47	230,000.000	231,851.500	
AUSTRIA 1.5 11/02/86	290,000.000	258,662.600	
AUSTRIA 1.65 10/21/24	1,250,000.000	1,358,325.000	
AUSTRIA 1.75 10/20/23	1,400,000.000	1,520,120.000	
AUSTRIA 2.1 09/20/17	100,000.000	109,372.000	
AUSTRIA 2.4 05/23/34	900,000.000	1,064,880.000	
AUSTRIA 3.15 06/20/44	810,000.000	1,124,919.900	
AUSTRIA 3.4 11/22/22	1,500,000.000	1,718,055.000	
AUSTRIA 3.5 09/15/21	1,900,000.000	2,113,750.000	
AUSTRIA 3.65 04/20/22	1,200,000.000	1,363,620.000	
AUSTRIA 3.8 01/26/62	820,000.000	1,387,292.400	
AUSTRIA 3.9 07/15/20	1,700,000.000	1,830,900.000	
AUSTRIA 4.15 03/15/37	1,480,000.000	2,200,020.000	
AUSTRIA 4.85 03/15/26	1,100,000.000	1,459,128.000	
AUSTRIA 6.25 07/15/27	1,150,000.000	1,704,461.000	
BELGIUM 0.2 10/22/23	150,000.000	150,210.000	
BELGIUM 0.5 10/22/24	1,070,000.000	1,080,518.100	
BELGIUM 0.8 06/22/25	2,000,000.000	2,047,820.000	
BELGIUM 0.8 06/22/27	1,100,000.000	1,102,937.000	
BELGIUM 0.8 06/22/28	690,000.000	683,631.300	
BELGIUM 1.0 06/22/26	1,500,000.000	1,542,735.000	
BELGIUM 1.0 06/22/31	1,300,000.000	1,279,057.000	
BELGIUM 1.25 04/22/33	510,000.000	508,791.300	
BELGIUM 1.45 06/22/37	440,000.000	436,176.400	
BELGIUM 1.6 06/22/47	900,000.000	863,712.000	
BELGIUM 1.9 06/22/38	800,000.000	851,824.000	
BELGIUM 2.15 06/22/66	700,000.000	713,860.000	
BELGIUM 2.25 06/22/23	1,700,000.000	1,875,236.000	
BELGIUM 2.25 06/22/57	280,000.000	299,303.200	
BELGIUM 2.6 06/22/24	1,510,000.000	1,708,912.300	
BELGIUM 3.0 06/22/34	850,000.000	1,050,982.500	
BELGIUM 3.75 06/22/45	1,130,000.000	1,624,634.900	
BELGIUM 3.75 09/28/20	2,200,000.000	2,383,282.000	
BELGIUM 4.0 03/28/22	1,500,000.000	1,719,330.000	
BELGIUM 4.0 03/28/32	950,000.000	1,288,304.500	
BELGIUM 4.25 03/28/41	1,740,000.000	2,612,749.200	
BELGIUM 4.25 09/28/21	1,870,000.000	2,124,207.800	
BELGIUM 4.25 09/28/22	1,950,000.000	2,287,369.500	
BELGIUM 4.5 03/28/26	1,200,000.000	1,547,520.000	
BELGIUM 5.0 03/28/35	2,200,000.000	3,388,880.000	
BELGIUM 5.5 03/28/28	2,500,000.000	3,572,875.000	
BUNDESABL 0.25 10/16/20	1,500,000.000	1,524,525.000	
BUNDESABL 04/08/22	3,000,000.000	3,034,620.000	
BUNDESABL 04/09/21	2,200,000.000	2,227,236.000	
BUNDESABL 10/07/22	2,730,000.000	2,756,863.200	

BUNDESSCHAT 12/13/19	800,000.000	805,848.000	
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27	2,680,000.000	2,659,605.200	
DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28	890,000.000	867,153.700	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25	2,200,000.000	2,254,560.000	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26	2,690,000.000	2,744,553.200	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28	2,210,000.000	2,218,066.500	
DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27	2,700,000.000	2,724,354.000	
DEUTSCHLAND 08/15/26	2,800,000.000	2,738,624.000	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/24	2,600,000.000	2,745,678.000	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25	2,500,000.000	2,642,900.000	
DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48	1,060,000.000	1,091,598.600	
DEUTSCHLAND 1.5 02/15/23	2,100,000.000	2,255,400.000	
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/23	2,500,000.000	2,690,775.000	
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/24	2,000,000.000	2,167,740.000	
DEUTSCHLAND 1.5 09/04/22	1,650,000.000	1,764,592.500	
DEUTSCHLAND 1.75 02/15/24	1,500,000.000	1,643,010.000	
DEUTSCHLAND 1.75 07/04/22	2,700,000.000	2,907,414.000	
DEUTSCHLAND 2.0 01/04/22	2,700,000.000	2,908,170.000	
DEUTSCHLAND 2.0 08/15/23	1,500,000.000	1,654,050.000	
DEUTSCHLAND 2.25 09/04/20	4,200,000.000	4,426,128.000	
DEUTSCHLAND 2.25 09/04/21	1,070,000.000	1,153,567.000	
DEUTSCHLAND 2.5 01/04/21	2,200,000.000	2,350,062.000	
DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	2,700,000.000	3,565,296.000	
DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	2,700,000.000	3,607,281.000	
DEUTSCHLAND 3.0 07/04/20	3,000,000.000	3,187,170.000	
DEUTSCHLAND 3.25 01/04/20	3,600,000.000	3,775,752.000	

DEUTSCHLAND 3.25 07/04/21	3,150,000.000	3,470,166.000	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	1,650,000.000	2,430,070.500	
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	2,600,000.000	3,967,808.000	
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	1,660,000.000	2,695,026.600	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	1,420,000.000	1,999,814.400	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	2,200,000.000	3,488,760.000	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	1,480,000.000	2,585,737.600	
DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	2,050,000.000	3,229,406.000	
DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	1,600,000.000	2,356,640.000	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/24	1,700,000.000	2,260,337.000	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	1,100,000.000	1,783,485.000	
DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	1,120,000.000	1,712,860.800	
FINLAND 0.375 09/15/20	500,000.000	508,565.000	
FINLAND 0.5 04/15/26	600,000.000	601,560.000	
FINLAND 0.5 09/15/27	300,000.000	296,004.000	
FINLAND 0.75 04/15/31	450,000.000	440,181.000	
FINLAND 0.875 09/15/25	300,000.000	310,428.000	
FINLAND 04/15/22	320,000.000	322,160.000	
FINLAND 09/15/23	230,000.000	229,353.700	
FINLAND 1.125 04/15/34	420,000.000	423,477.600	
FINLAND 1.5 04/15/23	950,000.000	1,015,170.000	
FINLAND 1.625 09/15/22	400,000.000	427,472.000	
FINLAND 2.0 04/15/24	680,000.000	749,244.400	
FINLAND 2.625 07/04/42	660,000.000	856,026.600	
FINLAND 2.75 07/04/28	630,000.000	750,021.300	
FINLAND 3.375 04/15/20	980,000.000	1,038,045.400	
FINLAND 3.5 04/15/21	700,000.000	769,013.000	
FINLAND 4.0 07/04/25	800,000.000	994,984.000	
FRANCE BTAN 8.5 04/25/23	1,700,000.000	2,354,636.000	
FRANCE OAT 0.25 11/25/26	3,000,000.000	2,915,760.000	
FRANCE OAT 0.5 05/25/25	3,700,000.000	3,730,377.000	
FRANCE OAT 0.5 05/25/26	3,560,000.000	3,550,601.600	
FRANCE OAT 0.5 11/25/19	500,000.000	505,835.000	
FRANCE OAT 0.75 05/25/28	3,590,000.000	3,568,998.500	



FRANCE OAT 0.75 11/25/28	1,370,000.000	1,353,409.300	
FRANCE OAT 03/25/23	1,900,000.000	1,897,397.000	
FRANCE OAT 05/25/21	2,510,000.000	2,533,092.000	
FRANCE OAT 05/25/22	3,000,000.000	3,017,190.000	
FRANCE OAT 1.0 05/25/27	4,000,000.000	4,105,400.000	
FRANCE OAT 1.0 11/25/25	3,700,000.000	3,842,450.000	
FRANCE OAT 1.25 05/25/34	400,000.000	399,968.000	
FRANCE OAT 1.25 05/25/36	2,840,000.000	2,791,152.000	
FRANCE OAT 1.5 05/25/31	4,980,000.000	5,227,755.000	
FRANCE OAT 1.75 05/25/23	4,400,000.000	4,746,940.000	
FRANCE OAT 1.75 05/25/66	1,250,000.000	1,185,250.000	
FRANCE OAT 1.75 06/25/39	1,200,000.000	1,259,580.000	
FRANCE OAT 1.75 11/25/24	4,500,000.000	4,898,655.000	
FRANCE OAT 2.0 05/25/48	1,710,000.000	1,817,097.300	
FRANCE OAT 2.25 05/25/24	4,000,000.000	4,455,320.000	
FRANCE OAT 2.25 10/25/22	3,400,000.000	3,720,518.000	
FRANCE OAT 2.5 05/25/30	3,900,000.000	4,546,659.000	
FRANCE OAT 2.5 10/25/20	7,800,000.000	8,273,148.000	
FRANCE OAT 2.75 10/25/27	4,000,000.000	4,715,760.000	
FRANCE OAT 3.0 04/25/22	5,300,000.000	5,897,681.000	
FRANCE OAT 3.25 05/25/45	2,700,000.000	3,650,265.000	
FRANCE OAT 3.25 10/25/21	5,200,000.000	5,760,560.000	
FRANCE OAT 3.5 04/25/20	6,500,000.000	6,903,325.000	
FRANCE OAT 3.5 04/25/26	3,430,000.000	4,198,663.000	
FRANCE OAT 3.75 04/25/21	4,640,000.000	5,127,246.400	
FRANCE OAT 4.0 04/25/55	1,900,000.000	3,006,750.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/60	1,600,000.000	2,592,800.000	
FRANCE OAT 4.0 10/25/38	3,100,000.000	4,520,544.000	
FRANCE OAT 4.25 10/25/23	5,000,000.000	6,044,450.000	
FRANCE OAT 4.5 04/25/41	3,620,000.000	5,710,188.000	
FRANCE OAT 4.75 04/25/35	3,100,000.000	4,739,156.000	
FRANCE OAT 5.5 04/25/29	3,650,000.000	5,355,535.500	
FRANCE OAT 5.75 10/25/32	3,390,000.000	5,441,967.000	
FRANCE OAT 6.0 10/25/25	2,900,000.000	4,023,518.000	

IRISH 0.8 03/15/22	950,000.000	977,084.500	
IRISH 0.9 05/15/28	340,000.000	334,808.200	
IRISH 1.0 05/15/26	1,200,000.000	1,220,592.000	
IRISH 1.3 05/15/33	450,000.000	436,878.000	
IRISH 1.7 05/15/37	750,000.000	753,975.000	
IRISH 2.0 02/18/45	960,000.000	991,718.400	
IRISH 2.4 05/15/30	1,100,000.000	1,233,837.000	
IRISH 3.4 03/18/24	930,000.000	1,082,315.400	
IRISH 3.9 03/20/23	700,000.000	816,284.000	
IRISH 4.5 04/18/20	1,130,000.000	1,214,411.000	
IRISH 5.0 10/18/20	850,000.000	942,905.000	
IRISH 5.4 03/13/25	1,260,000.000	1,641,893.400	
ITALY BTPS 0.35 11/01/21	1,700,000.000	1,601,876.000	
ITALY BTPS 0.65 10/15/23	2,100,000.000	1,883,847.000	
ITALY BTPS 0.65 11/01/20	3,600,000.000	3,518,640.000	
ITALY BTPS 0.9 08/01/22	980,000.000	917,368.200	
ITALY BTPS 0.95 03/15/23	2,500,000.000	2,308,000.000	
ITALY BTPS 1.05 12/01/19	2,000,000.000	1,998,100.000	
ITALY BTPS 1.25 12/01/26	2,000,000.000	1,724,800.000	
ITALY BTPS 1.35 04/15/22	2,500,000.000	2,394,725.000	
ITALY BTPS 1.45 09/15/22	1,500,000.000	1,430,955.000	
ITALY BTPS 1.45 11/15/24	2,020,000.000	1,833,473.200	
ITALY BTPS 1.5 06/01/25	2,500,000.000	2,249,725.000	
ITALY BTPS 1.6 06/01/26	1,500,000.000	1,338,300.000	
ITALY BTPS 1.65 03/01/32	2,260,000.000	1,818,554.200	
ITALY BTPS 1.85 05/15/24	2,100,000.000	1,970,220.000	
ITALY BTPS 2.0 02/01/28	1,130,000.000	1,008,152.100	
ITALY BTPS 2.0 12/01/25	2,700,000.000	2,490,345.000	
ITALY BTPS 2.05 08/01/27	2,780,000.000	2,502,083.400	
ITALY BTPS 2.15 12/15/21	2,200,000.000	2,178,880.000	
ITALY BTPS 2.2 06/01/27	2,040,000.000	1,864,968.000	
ITALY BTPS 2.25 09/01/36	1,500,000.000	1,224,300.000	
ITALY BTPS 2.45 09/01/33	1,100,000.000	951,291.000	
ITALY BTPS 2.5 12/01/24	970,000.000	937,737.800	
ITALY BTPS 2.7 03/01/47	1,650,000.000	1,344,915.000	

ITALY BTPS 2.8 03/01/67	830,000.000	658,937.000	
ITALY BTPS 2.8 12/01/28	650,000.000	609,290.500	
ITALY BTPS 2.95 09/01/38	800,000.000	702,056.000	
ITALY BTPS 3.25 09/01/46	2,000,000.000	1,799,880.000	
ITALY BTPS 3.45 03/01/48	1,430,000.000	1,305,518.500	
ITALY BTPS 3.5 03/01/30	2,950,000.000	2,912,210.500	
ITALY BTPS 3.75 03/01/21	3,300,000.000	3,423,288.000	
ITALY BTPS 3.75 05/01/21	2,300,000.000	2,380,730.000	
ITALY BTPS 3.75 08/01/21	3,200,000.000	3,311,360.000	
ITALY BTPS 3.75 09/01/24	1,900,000.000	1,959,622.000	
ITALY BTPS 4.0 02/01/37	3,020,000.000	3,105,164.000	
ITALY BTPS 4.0 09/01/20	3,700,000.000	3,843,449.000	
ITALY BTPS 4.25 03/01/20	4,600,000.000	4,769,556.000	
ITALY BTPS 4.5 02/01/20	4,500,000.000	4,672,485.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/24	3,700,000.000	3,951,489.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/26	2,900,000.000	3,123,880.000	
ITALY BTPS 4.5 05/01/23	1,400,000.000	1,494,136.000	
ITALY BTPS 4.75 08/01/23	1,900,000.000	2,051,620.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/21	2,470,000.000	2,625,116.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/28	2,400,000.000	2,651,808.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/44	1,790,000.000	1,989,441.800	
ITALY BTPS 5.0 03/01/22	3,600,000.000	3,872,880.000	
ITALY BTPS 5.0 03/01/25	2,400,000.000	2,645,568.000	
ITALY BTPS 5.0 08/01/34	2,800,000.000	3,203,480.000	
ITALY BTPS 5.0 08/01/39	2,430,000.000	2,764,125.000	
ITALY BTPS 5.0 09/01/40	2,490,000.000	2,821,917.000	
ITALY BTPS 5.25 11/01/29	2,900,000.000	3,326,300.000	
ITALY BTPS 5.5 09/01/22	3,900,000.000	4,287,621.000	
ITALY BTPS 5.5 11/01/22	2,500,000.000	2,750,100.000	
ITALY BTPS 5.75 02/01/33	2,400,000.000	2,916,480.000	
ITALY BTPS 6.0 05/01/31	3,100,000.000	3,803,080.000	
ITALY BTPS 6.5 11/01/27	3,300,000.000	4,057,680.000	
ITALY BTPS 7.25 11/01/26	1,800,000.000	2,283,660.000	
ITALY BTPS 9.0 11/01/23	1,900,000.000	2,430,860.000	

NETHERLANDS 0.25 01/15/20	2,150,000.000	2,174,574.500	
NETHERLANDS 0.25 07/15/25	1,700,000.000	1,699,439.000	
NETHERLANDS 0.5 07/15/26	1,700,000.000	1,714,960.000	
NETHERLANDS 0.75 07/15/27	1,450,000.000	1,477,811.000	
NETHERLANDS 0.75 07/15/28	950,000.000	960,896.500	
NETHERLANDS 01/15/22	1,900,000.000	1,918,278.000	
NETHERLANDS 01/15/24	1,680,000.000	1,673,901.600	
NETHERLANDS 1.75 07/15/23	2,000,000.000	2,171,020.000	
NETHERLANDS 2.0 07/15/24	1,560,000.000	1,728,682.800	
NETHERLANDS 2.25 07/15/22	1,550,000.000	1,695,343.500	
NETHERLANDS 2.5 01/15/33	1,480,000.000	1,804,786.000	
NETHERLANDS 2.75 01/15/47	1,350,000.000	1,868,724.000	
NETHERLANDS 3.25 07/15/21	1,860,000.000	2,049,180.600	
NETHERLANDS 3.5 07/15/20	1,670,000.000	1,789,638.800	
NETHERLANDS 3.75 01/15/23	590,000.000	688,235.000	
NETHERLANDS 3.75 01/15/42	1,540,000.000	2,397,472.000	
NETHERLANDS 4.0 01/15/37	1,700,000.000	2,565,640.000	
NETHERLANDS 5.5 01/15/28	1,600,000.000	2,317,120.000	
SPAIN 0.05 01/31/21	400,000.000	400,124.000	
SPAIN 0.35 07/30/23	900,000.000	887,373.000	
SPAIN 0.4 04/30/22	2,200,000.000	2,208,162.000	
SPAIN 0.45 10/31/22	800,000.000	800,952.000	
SPAIN 0.75 07/30/21	1,700,000.000	1,731,433.000	
SPAIN 1.15 07/30/20	2,100,000.000	2,148,951.000	
SPAIN 1.3 10/31/26	2,000,000.000	1,993,040.000	
SPAIN 1.4 01/31/20	5,460,000.000	5,578,318.200	
SPAIN 1.4 04/30/28	1,920,000.000	1,890,489.600	
SPAIN 1.4 07/30/28	1,550,000.000	1,516,070.500	
SPAIN 1.45 10/31/27	2,540,000.000	2,526,817.400	
SPAIN 1.5 04/30/27	2,000,000.000	2,006,800.000	
SPAIN 1.6 04/30/25	2,500,000.000	2,590,950.000	
SPAIN 1.95 04/30/26	1,790,000.000	1,877,226.700	
SPAIN 1.95 07/30/30	2,240,000.000	2,265,289.600	
SPAIN 2.15 10/31/25	2,100,000.000	2,240,259.000	

	SPAIN 2.35 07/30/33	1,480,000.000	1,522,920.000	
	SPAIN 2.7 10/31/48	600,000.000	594,414.000	
	SPAIN 2.75 10/31/24	2,700,000.000	2,987,766.000	
	SPAIN 2.9 10/31/46	1,800,000.000	1,878,066.000	
	SPAIN 3.45 07/30/66	1,000,000.000	1,108,050.000	
	SPAIN 3.8 04/30/24	1,720,000.000	1,993,101.600	
	SPAIN 4.0 04/30/20	2,400,000.000	2,556,168.000	
	SPAIN 4.2 01/31/37	1,960,000.000	2,535,103.200	
	SPAIN 4.3 10/31/19	4,200,000.000	4,403,574.000	
	SPAIN 4.4 10/31/23	2,300,000.000	2,718,002.000	
	SPAIN 4.65 07/30/25	2,600,000.000	3,204,500.000	
	SPAIN 4.7 07/30/41	2,100,000.000	2,912,931.000	
	SPAIN 4.8 01/31/24	2,200,000.000	2,656,984.000	
	SPAIN 4.85 10/31/20	2,900,000.000	3,191,363.000	
	SPAIN 4.9 07/30/40	2,000,000.000	2,835,000.000	
	SPAIN 5.15 10/31/28	2,380,000.000	3,158,022.000	
	SPAIN 5.15 10/31/44	1,500,000.000	2,222,430.000	
	SPAIN 5.4 01/31/23	2,800,000.000	3,382,512.000	
	SPAIN 5.5 04/30/21	3,600,000.000	4,096,908.000	
	SPAIN 5.75 07/30/32	2,400,000.000	3,500,688.000	
	SPAIN 5.85 01/31/22	2,300,000.000	2,722,188.000	
	SPAIN 5.9 07/30/26	2,500,000.000	3,348,725.000	
	SPAIN 6.0 01/31/29	2,750,000.000	3,878,352.500	
	ユーロ 小計	541,810,000.000 (70,500,317,200)	608,811,808.500 (79,218,592,522)	
南アフリカ・ランド	SOUTH AFRICA 10.5 12/21/26	25,000,000.000	26,734,500.000	
	SOUTH AFRICA 6.25 03/31/36	14,700,000.000	10,213,266.000	
	SOUTH AFRICA 6.5 02/28/41	11,760,000.000	7,988,568.000	
	SOUTH AFRICA 7.0 02/28/31	11,600,000.000	9,324,080.000	
	SOUTH AFRICA 7.75 02/28/23	10,000,000.000	9,682,500.000	
	SOUTH AFRICA 8.0 01/31/30	13,110,000.000	11,629,225.500	
	SOUTH AFRICA 8.25 03/31/32	10,000,000.000	8,825,400.000	
	SOUTH AFRICA 8.5 01/31/37	10,910,000.000	9,486,463.200	
	SOUTH AFRICA 8.75 01/31/44	10,000,000.000	8,697,500.000	
	SOUTH AFRICA 8.75 02/28/48	20,280,000.000	17,582,962.800	
	SOUTH AFRICA 8.875 02/28/35	12,510,000.000	11,394,108.000	
	SOUTH AFRICA 9.0 01/31/40	8,000,000.000	7,190,720.000	
南アフリカ・ランド 小計	157,870,000.000	138,749,293.500		

	(1,215,599,000)	(1,068,369,560)	
国債証券 合計	187,536,415,780 (187,536,415,780)	196,712,880,950 (196,712,880,950)	
合計	187,536,415,780 (187,536,415,780)	196,712,880,950 (196,712,880,950)	

- (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 136銘柄	44.05%	45.24%
イギリス・ポンド	国債証券 38銘柄	6.37%	6.54%
オーストラリア・ドル	国債証券 20銘柄	1.98%	2.03%
カナダ・ドル	国債証券 25銘柄	1.95%	2.00%
シンガポール・ドル	国債証券 12銘柄	0.36%	0.37%
スウェーデン・クローナ	国債証券 6銘柄	0.33%	0.34%
デンマーク・クローネ	国債証券 5銘柄	0.55%	0.56%
ノルウェー・クローネ	国債証券 5銘柄	0.19%	0.19%
ポーランド・ズロチ	国債証券 14銘柄	0.61%	0.63%
マレーシア・リングギット	国債証券 15銘柄	0.45%	0.46%
メキシコ・ペソ	国債証券 14銘柄	0.79%	0.81%
ユーロ	国債証券 270銘柄	39.21%	40.27%
南アフリカ・ランド	国債証券 12銘柄	0.53%	0.54%

(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10月12日現在
資産の部		
流動資産		
預金		294,634,390
コール・ローン		539,303,592
投資信託受益証券		5,118,845,237
投資証券		38,370,724,101
派生商品評価勘定		513,182
未収入金		5,903,572,159
未収配当金		191,643,696
流動資産合計		50,419,236,357
資産合計		50,419,236,357
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		342,141
未払解約金		557,043,000
流動負債合計		557,385,141
負債合計		557,385,141
純資産の部		
元本等		
元本	1	42,461,597,968
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）		7,400,253,248
元本等合計		49,861,851,216
純資産合計		49,861,851,216
負債純資産合計		50,419,236,357

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

## （貸借対照表に関する注記）

項目	平成30年10月12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	42,945,375,842円
同期中追加設定元本額	34,271,878,040円
同期中一部解約元本額	34,755,655,914円
元本の内訳	
ファンド名	
DIAM先進国REITインデックスファンド<為替ヘッジなし>（ファンドラップ）	245,882,806円
DIAM先進国REITインデックスファンド<為替ヘッジあり>（ファンドラップ）	91,619,154円
MITO ラップ型ファンド（安定型）	4,347,931円
MITO ラップ型ファンド（中立型）	16,514,233円
MITO ラップ型ファンド（積極型）	32,595,652円



グローバル8資産ラップファンド(安定型)	30,645,626円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	43,636,068円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	41,934,413円
たわらノーロード 先進国リート	2,782,419,098円
たわらノーロード 先進国リート<ラップ向け>	476,186,868円
たわらノーロード 先進国リート<為替ヘッジあり>	134,698,862円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	128,981,698円
たわらノーロード バランス(堅実型)	829,408円
たわらノーロード バランス(標準型)	17,050,297円
たわらノーロード バランス(積極型)	53,328,227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)	5,181,872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)	37,066,332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)	35,155,142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)	94,871,775円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	106,587円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	1,412,707円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	1,210,693円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	4,036,986円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	23,065,104円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	603,261,794円
マネックス資産設計ファンドエボリューション	39,383,601円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	172,886,995円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	150,229,482円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	302,213,922円
投資のソムリエ	7,747,585,548円
投資のソムリエ<DC年金>	671,952,334円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	120,383,081円

投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	306,243,675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	805,560円
ワールドアセットバランス(基本コース)	5,796,933,677円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	1,228,816,340円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	4,269,406,350円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	2,147,459円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	1,538,625円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	1,814,787円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	2,946,447円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	985,394,183円
DIAMパッシブ資産分散ファンド	12,333円
DIAM外国リートインデックスファンド<DC年金>	7,103,861,552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)	28,707,690円
DIAMグローバル 私募ファンド(適格機関投資家向け)	634,397,425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
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)	7,696,523,460円
DIAMグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンドII(適格機関投資家限定)	1,401,016,372円
P-Oneマルチアセット戦略ファンド(適格機関投資家限定)	1,078,666,100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)	3,241,156,712円
計	558,954,597円
2. 受益権の総数	42,461,597,968円
	42,461,597,968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11月8日 至 平成30年10月12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。
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。
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。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成30年10月12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。
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。
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。

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	平成30年10月12日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
投資信託受益証券	140,992,745
投資証券	2,172,134,960
合計	2,313,127,705

(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6月23日から平成30年10月12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10月12日 現在			
	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	6,686,188,721	-	6,686,017,680	171,041
アメリカ・ドル	4,755,927,440	-	4,755,584,000	343,440
イギリス・ポンド	378,800,205	-	378,777,000	23,205
イスラエル・シケル	4,562,248	-	4,567,280	5,032
オーストラリア・ドル	489,787,630	-	489,970,900	183,270
カナダ・ドル	127,437,176	-	127,428,000	9,176
シンガポール・ドル	230,862,421	-	230,930,300	67,879
ニュージーランド・ドル	30,870,860	-	30,890,400	19,540
ユーロ	506,154,741	-	506,166,800	12,059
香港・ドル	161,786,000	-	161,703,000	83,000
合計	6,686,188,721	-	6,686,017,680	171,041

(注) 時価の算定方法

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

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成30年10月12日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1743円 (11,743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10月12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	131,242.000	422,599.240	
		ARENA REIT	108,676.000	255,388.600	
		BWP TRUST	195,018.000	639,659.040	
		CHARTER HALL GROUP	190,240.000	1,308,851.200	
		CHARTER HALL LONG WALE REIT	72,501.000	303,779.190	
		CHARTER HALL RETAIL REIT	131,982.000	547,725.300	
		CROMWELL PROPERTY GROUP	609,874.000	634,268.960	
		DEXUS	419,104.000	4,274,860.800	
		FOLKESTONE EDUCATION TRUST	88,555.000	241,755.150	
		GDI PROPERTY GROUP	208,566.000	279,478.440	
		GOODMAN GROUP	659,856.000	6,651,348.480	
		GPT GROUP	737,537.000	3,687,685.000	
		GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA	100,372.000	366,357.800	
		HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD	62,650.000	192,962.000	
		INDUSTRIA REIT	42,579.000	114,111.720	
		INGENIA COMMUNITIES GROUP	90,384.000	266,632.800	
		INVESTA OFFICE FUND	209,299.000	1,155,330.480	
		MIRVAC GROUP	1,522,187.000	3,501,030.100	
		NATIONAL STORAGE REIT	264,889.000	431,769.070	
		PROPERTYLINK GROUP	162,771.000	186,372.790	
		RURAL FUNDS GROUP	130,171.000	269,453.970	
		SCENTRE GROUP	2,193,246.000	8,465,929.560	
		SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	306,029.000	731,409.310	
STOCKLAND	1,010,885.000	4,063,757.700			
VICINITY CENTRES	1,320,060.000	3,458,557.200			
VIVA ENERGY REIT	183,737.000	393,197.180			
	オーストラリア・ドル 小計		11,152,410.000	42,844,271.080 (3,425,399,473)	
	カナダ・ドル	KILLAM APARTMENT REIT	16,557.000	258,289.200	
	カナダ・ドル 小計		16,557.000	258,289.200 (22,243,866)	
	シンガポール・ドル	AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL REIT	223,495.000	303,953.200	

	ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	317,200.000	249,002.000	
	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	1,057,160.000	2,621,756.800	
	ASCOTT RESIDENCE TRUST	495,715.000	525,457.900	
	CACHE LOGISTICS TRUST	466,580.000	328,938.900	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	1,146,679.000	1,926,420.720	
	CAPITALAND MALL TRUST	1,117,860.000	2,325,148.800	
	CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST	241,380.000	330,690.600	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	309,000.000	469,680.000	
	ESR REIT	539,430.000	258,926.400	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	353,000.000	211,800.000	
	FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	238,200.000	276,312.000	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	239,800.000	527,560.000	
	FRASERS COMMERCIAL TRUST	267,080.000	368,570.400	
	FRASERS LOGISTICS & INDUSTRIAL TRUST	670,350.000	683,757.000	
	KEPPEL DC REIT	398,700.000	518,310.000	
	KEPPEL REIT	736,100.000	839,154.000	
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST	817,600.000	204,400.000	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	778,300.000	1,221,931.000	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	516,320.000	986,171.200	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	858,020.000	1,029,624.000	
	MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL TRUST	875,000.000	962,500.000	
	QUE HOSPITALITY TRUST	490,620.000	333,621.600	
	PARKWAY LIFE REIT	153,400.000	397,306.000	
	SABANA SHARIAH COMP IND REIT	357,200.000	148,238.000	
	SOILBUILD BUSINESS SPACE REIT	276,100.000	158,757.500	
	SPH REIT	251,100.000	247,333.500	
	STARHILL GLOBAL REIT	567,800.000	377,587.000	
	SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	916,190.000	1,639,980.100	
	シンガポール・ドル 小計	15,675,379.000	20,472,888.620 (1,671,201,898)	
	投資信託受益証券 合計	26,844,346	5,118,845,237 (5,118,845,237)	
投資証券	アメリカ・ドル	ACADIA REALTY TRUST	28,681.000	770,658.470

AGREE REALTY CORP	10,870.000	560,783.300	
ALEXANDER'S INC.	1,318.000	440,277.900	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	37,594.000	4,503,385.260	
AMERICAN ASSETS TRUST INC	13,194.000	473,664.600	
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	48,573.000	1,919,604.960	
AMERICAN HOMES 4 RENT	91,074.000	1,846,069.980	
AMERICOLD REALTY TRUST	20,048.000	487,166.400	
APARTMENT INVT & MGMT CO-A	55,826.000	2,351,949.380	
APPLE HOSPITALITY REIT INC	76,550.000	1,260,778.500	
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	35,470.000	201,824.300	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	49,180.000	8,517,484.200	
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH REIT INC	8,916.000	80,333.160	
BOSTON PROPERTIES INC	54,924.000	6,281,657.880	
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	13,863.000	144,036.570	
BRANDYWINE REALTY TRUST	62,975.000	916,286.250	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	107,190.000	1,678,595.400	
BRT APARTMENTS CORP	4,756.000	52,125.760	
CAMDEN PROPERTY TRUST	32,953.000	2,941,714.310	
CARETRUST REIT INC	28,292.000	480,115.240	
CBL & ASSOCIATES	74,111.000	271,246.260	
CEDAR REALTY TRUST INC	39,696.000	161,562.720	
CHATHAM LODGING TRUST	18,605.000	365,774.300	
CHESAPEAKE LODGING TRUST	21,199.000	628,338.360	
CITY OFFICE REIT INC	14,463.000	167,626.170	
CLIPPER REALTY INC	5,169.000	65,387.850	
COLONY CAPITAL INC	172,789.000	971,074.180	
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	41,586.000	887,029.380	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	6,974.000	199,037.960	
CORECIVIC INC	41,826.000	978,728.400	
CORESITE REALTY CORP	12,981.000	1,298,749.050	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	36,443.000	998,173.770	
COUSINS PROPERTIES INC	148,625.000	1,236,560.000	
CUBESMART	65,862.000	1,797,373.980	
CYRUSONE INC	37,106.000	2,172,185.240	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	73,149.000	781,231.320	



DIGITAL REALTY TRUST INC	73,325.000	7,882,437.500	
DOUGLAS EMMETT INC	57,238.000	2,067,436.560	
DUKE REALTY TRUST	126,915.000	3,406,398.600	
EAST GROUP	12,626.000	1,144,294.380	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	20,980.000	379,738.000	
EMPIRE STATE REALTY TRUST INC	47,582.000	747,513.220	
EPR PROPERTIES	26,341.000	1,756,944.700	
EQUITY COMMONWEALTH	42,943.000	1,234,611.250	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	31,634.000	2,897,674.400	
EQUITY RESIDENTIAL	131,035.000	8,238,170.450	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	23,488.000	5,629,838.720	
EXTRA SPACE STORAGE INC	44,948.000	3,803,050.280	
FARMLAND PARTNERS INC	14,523.000	88,445.070	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	26,098.000	3,111,142.580	
FIRST INDUSTRIAL RT	44,563.000	1,331,988.070	
FOREST CITY REALTY TRUST INC	94,790.000	2,380,176.900	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST INC	23,427.000	588,486.240	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	42,731.000	312,790.920	
FRONT YARD RESIDENTIAL CORP	21,318.000	201,668.280	
GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	71,296.000	2,428,341.760	
GEO GROUP INC	42,981.000	1,013,921.790	
GETTY REALTY CORP	13,357.000	364,646.100	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	11,089.000	202,041.580	
GLADSTONE LAND CORP	5,903.000	70,304.730	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	8,278.000	74,005.320	
GLOBAL NET LEASE INC	24,906.000	473,712.120	
GOVERNMENT PROPERTIES INCOME TRUST	40,598.000	413,693.620	
HCP INC	166,982.000	4,142,823.420	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	44,270.000	1,210,341.800	
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA INC	73,554.000	1,854,296.340	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	14,668.000	298,200.440	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	36,643.000	1,630,613.500	

HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	58,193.000	1,544,442.220	
HOST HOTELS & RESORTS INC	263,700.000	5,073,588.000	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	55,513.000	1,707,024.750	
INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	35,389.000	342,565.520	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES TRUST	8,484.000	182,999.880	
INFREIT INC	16,796.000	340,790.840	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES INC	2,926.000	129,329.200	
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	47,370.000	254,376.900	
INVITATION HOMES INC	105,247.000	2,228,078.990	
IRON MOUNTAIN INC	101,628.000	3,201,282.000	
JBG SMITH PROPERTIES	38,311.000	1,369,235.140	
KILROY REALTY CORP	35,716.000	2,452,260.560	
KIMCO REALTY	149,472.000	2,242,080.000	
KITE REALTY GROUP TRUST	29,182.000	447,068.240	
LASALLE HOTEL PROPERTIES	39,028.000	1,250,457.120	
LEXINGTON REALTY TRUST	74,842.000	583,019.180	
LIBERTY PROPERTY TRUST	52,422.000	2,123,091.000	
LIFE STORAGE INC	16,493.000	1,479,916.890	
LTC PROPERTIES INC	13,900.000	595,754.000	
MACK CALI	31,683.000	617,818.500	
MANULIFE US REIT	507,900.000	391,083.000	
MEDEQUITIES REALTY TRUST INC	13,143.000	116,052.690	
MEDICAL PROPERTIES TRUST	129,297.000	1,824,380.670	
MID AMERICA	40,441.000	3,873,843.390	
MONMOUTH RE INVEST CP -CL A	32,241.000	486,194.280	
NATIONAL HEALTH INVS INC	14,891.000	1,064,706.500	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	55,702.000	2,408,554.480	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUST	19,749.000	491,947.590	
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP INC	34,578.000	196,403.040	
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	7,762.000	261,657.020	
NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP	21,513.000	279,669.000	
OMEGA HEALTHCARE INVS INC	71,067.000	2,282,672.040	

ONE LIBERTY PROPERTIES INC	5,545.000	140,454.850	
PARAMOUNT GROUP INC	73,007.000	1,032,318.980	
PARK HOTELS & RESORTS INC	71,342.000	2,108,869.520	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	24,300.000	784,647.000	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	28,137.000	250,982.040	
PHYSICIANS REALTY TRUST	64,271.000	1,036,048.520	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC	45,200.000	810,436.000	
PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES INC	16,100.000	268,065.000	
PROLOGIS INC	224,091.000	14,081,878.440	
PS BUSINESS PARKS	7,029.000	854,023.500	
PUBLIC STORAGE	53,328.000	10,435,223.040	
QTS REALTY TRUST INC	17,940.000	711,859.200	
RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES	27,788.000	350,962.440	
REALTY INCOME CORP	103,146.000	5,772,050.160	
REGENCY CENTERS CORP	60,201.000	3,712,595.670	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	39,639.000	702,799.470	
RETAIL PROPERTIES OF AMERICA INC	77,381.000	904,583.890	
RETAIL VALUE INC	6,244.000	188,943.440	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	32,211.000	972,450.090	
RLJ LODGING TRUST	61,973.000	1,236,361.350	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	18,162.000	1,427,896.440	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	63,074.000	1,375,643.940	
SAFETY INCOME & GROWTH INC	4,225.000	72,247.500	
SAUL CENTERS INC	4,786.000	246,431.140	
SELECT INCOME REIT	26,222.000	521,555.580	
SENIOR HOUSING PPTYS TRUST	84,080.000	1,389,001.600	
SERITAGE GROWTH PROPERTIES	11,250.000	479,925.000	
SIMON PROPERTY GROUP INC	110,087.000	18,758,824.800	
DDR CORP	51,172.000	613,552.280	
SL GREEN	30,731.000	2,785,765.150	
SPIRIT MTA REIT	17,097.000	189,263.790	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	151,405.000	1,140,079.650	
STAG INDUSTRIAL INC	36,838.000	937,158.720	
STORE CAPITAL CORP	64,821.000	1,776,095.400	

	SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	36,560.000	463,946.400	
	SUN COMMUNITIES INC	30,662.000	2,944,471.860	
	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	80,669.000	1,197,127.960	
	TANGER FACTORY OUTLET	33,003.000	717,815.250	
	TAUBMAN CENTERS INC	21,549.000	1,161,706.590	
	TERRENO REALTY CORP	20,544.000	719,040.000	
	THE MACERICH COMPANY	37,494.000	1,877,324.580	
	TIER REIT INC	17,663.000	388,762.630	
	UDR INC	95,100.000	3,641,379.000	
	UMH PROPERTIES INC	13,794.000	205,944.420	
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	5,390.000	378,162.400	
	URBAN EDGE PROPERTIES	40,147.000	801,735.590	
	URSTADT BIDDLE PROPERTIES	11,757.000	232,318.320	
	VENTAS INC	126,789.000	6,765,461.040	
	VEREIT INC	343,243.000	2,375,241.560	
	VICI PROPERTIES INC	24,592.000	507,332.960	
	VORNADO REALTY TRUST	61,528.000	4,171,598.400	
	WASHINGTON PRIME GROUP INC	64,777.000	420,402.730	
	WASHINGTON REIT	27,683.000	777,338.640	
	WEINGARTEN REALTY INVST	42,086.000	1,160,731.880	
	WELLTOWER INC	132,367.000	8,171,014.910	
	WHITESTONE REIT	15,682.000	203,552.360	
	WP CAREY INC	38,038.000	2,393,731.340	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	39,447.000	875,723.400	
	アメリカ・ドル 小計	8,251,827.000	272,731,539.840 (30,597,751,454)	
イギリス・ポンド	ASSURA PLC	833,187.000	462,418.780	
	BIG YELLOW GROUP PLC	54,961.000	474,038.620	
	BRITISH LAND CO PLC	352,752.000	2,028,324.000	
	CAPITAL & REGIONAL PLC	226,616.000	90,873.010	
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	81,480.000	86,368.800	
	DERWENT LONDON PLC	39,209.000	1,089,618.110	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	223,053.000	212,123.400	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	99,224.000	657,061.320	
	HAMMERSON PLC	280,871.000	1,218,980.140	
	HANSTEEN HOLDINGS PLC	167,573.000	162,043.090	
	INTU PROPERTIES PLC	302,574.000	553,105.270	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	266,738.000	2,220,327.110	

	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	242,483.000	429,437.390	
	LXI REIT PLC	73,400.000	82,575.000	
	NEWRIVER REIT PLC	106,233.000	274,081.140	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC	253,742.000	279,623.680	
	RDI REIT PLC	528,881.000	174,530.730	
	REGIONAL REIT LTD	118,301.000	117,472.890	
	SAFESTORE HOLDINGS LTD	73,132.000	374,435.840	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT TRUST LTD	215,249.000	127,212.150	
	SEGR0 PLC	358,320.000	2,170,702.560	
	SHAFTESBURY PLC	81,270.000	717,614.100	
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING REIT PLC	86,466.000	89,924.640	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	519,849.000	753,781.050	
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT LTD	232,175.000	199,902.670	
	UNITE GROUP PLC	92,831.000	779,316.240	
	WORKSPACE GROUP PLC	45,418.000	426,929.200	
	イギリス・ボンド 小計	5,955,988.000	16,252,820.930 (2,414,519,077)	
	イスラエル・シュケル REIT 1 LTD	61,301.000	904,189.750	
	イスラエル・シュケル 小計	61,301.000	904,189.750 (27,903,296)	
カナダ・ドル	AGELLAN COMMERCIAL REIT	7,030.000	88,507.700	
	ALLIED PROPERTIES REIT	17,200.000	708,984.000	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	25,727.000	288,656.940	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	7,797.000	374,879.760	
	CANADIAN APT PPTYS REIT	25,044.000	1,134,743.640	
	CHOICE PROPERTIES REIT	47,331.000	560,872.350	
	COMINAR REAL ESTATE INVT TR	30,644.000	347,196.520	
	CROMBIE REAL ESTATE INV	14,636.000	184,559.960	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	12,724.000	153,960.400	
	DREAM GLOBAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	32,490.000	437,640.300	
	DREAM INDUSTRIAL REIT	16,864.000	156,497.920	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV TRUST	9,964.000	229,969.120	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	7,744.000	407,179.520	
	H & R REAL ESTATE INVESTMENT	49,205.000	933,910.900	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	17,332.000	198,278.080	

	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT	7,446.000	117,274.500	
	NORTHVIEW APARTMENT REIT	11,387.000	280,803.420	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	16,839.000	178,156.620	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	53,909.000	1,280,338.750	
	SLATE OFFICE REIT	12,079.000	92,162.770	
	SLATE RETAIL REIT	7,739.000	95,886.210	
	SMARTCENTRES REIT	22,912.000	674,071.040	
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	17,461.000	152,609.140	
	TRUE NORTH COMMERCIAL REIT	13,972.000	88,722.200	
カナダ・ドル 小計		485,476.000	9,165,861.760 (789,364,015)	
ニュージーランド・ドル	ARGOSY PROPERTY LTD	333,057.000	363,032.130	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	431,670.000	656,138.400	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	590,230.000	799,761.650	
	PRECINCT PROPERTIES	419,292.000	591,201.720	
	STRIDE STAPLED GROUP	154,189.000	294,500.990	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	132,691.000	274,670.370	
ニュージーランド・ドル 小計		2,061,129.000	2,979,305.260 (218,144,732)	
ユーロ	AEDIFICA	6,371.000	476,550.800	
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	55,526.000	687,967.140	
	ALTAREA	1,263.000	241,233.000	
	BEFIMMO	8,029.000	393,019.550	
	BENI STABILI SPA	351,757.000	250,450.980	
	COFINIMMO SA	7,469.000	775,282.200	
	COVIVIO	19,101.000	1,612,124.400	
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	14,208.000	437,322.240	
	GECINA SA	19,471.000	2,577,960.400	
	GREEN REIT PLC	227,925.000	333,226.350	
	HAMBORNER REIT AG	29,345.000	257,942.550	
	HIBERNIA REIT PLC	240,684.000	334,550.760	
	ICADE	15,948.000	1,165,798.800	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE	20,030.000	118,457.420	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA	104,285.000	886,943.920	
	INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	7,065.000	152,604.000	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES REIT PLC	140,481.000	199,483.020	
	KLEPIERRE	73,619.000	2,137,159.570	

	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA	27,341.000	220,641.870	
	MERCIALYS	22,420.000	293,702.000	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	129,787.000	1,457,508.010	
	NSI NV	6,300.000	208,845.000	
	RETAIL ESTATES	2,885.000	200,219.000	
	UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	48,976.000	7,895,910.720	
	VASTNED RETAIL	6,823.000	224,476.700	
	WAREHOUSES DE PAUW	5,938.000	642,491.600	
	WERELDHAVE NV	14,068.000	415,006.000	
	ユーロ 小計	1,607,115.000	24,596,878.000 (3,200,545,765)	
	香港・ドル			
	CHAMPION REIT	833,070.000	4,398,609.600	
	FORTUNE REAL ESTATE (HK)	582,000.000	5,092,500.000	
	LINK REIT	877,520.000	62,786,556.000	
	PROSPERITY REIT	528,000.000	1,525,920.000	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	420,000.000	2,087,400.000	
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	521,000.000	2,495,590.000	
	香港・ドル 小計	3,761,590.000	78,386,575.600 (1,122,495,762)	
投資証券 合計		22,184,426	38,370,724,101 (38,370,724,101)	
合計			43,489,569,338 (43,489,569,338)	

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

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

通貨	銘柄数	組入 投資信託受益証券 時価比率	組入 投資証券 時価比率	有価証券の 合計金額 に対する比率
アメリカ・ドル	投資証券 158銘柄	-%	61.37%	70.36%
イギリス・ポンド	投資証券 27銘柄	-%	4.84%	5.55%
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	6.87%	-%	7.88%
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% -%	-% 1.58%	1.87%
シンガポール・ドル	投資信託受益証券 29銘柄	3.35%	-%	3.84%
ニュージーランド・ドル	投資証券 6銘柄	-%	0.44%	0.50%
ユーロ	投資証券 27銘柄	-%	6.42%	7.36%
香港・ドル	投資証券 6銘柄	-%	2.25%	2.58%

(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10月12日現在
資産の部		
流動資産		
預金		2,238,574,988
コール・ローン		4,542,441,306
国債証券		236,764,262,990
派生商品評価勘定		3,045,784,161
未収入金		127,323
未収利息		1,765,217,579
前払費用		150,044,200
流動資産合計		248,506,452,547
資産合計		248,506,452,547
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		51,091,178
未払金		5,234,109,621
未払解約金		2,321,928,000
流動負債合計		7,607,128,799
負債合計		7,607,128,799
純資産の部		
元本等		
元本	1	184,831,343,228
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）		56,067,980,520
元本等合計		240,899,323,748
純資産合計		240,899,323,748
負債純資産合計		248,506,452,547

## 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10月12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	175,071,669,912円  115,160,612,049円 105,400,938,733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> たわらノーロード バランス （堅実型） たわらノーロード バランス （標準型） たわらノーロード バランス （積極型） たわらノーロード スマートグ ローバルバランス（保守型） たわらノーロード スマートグ ローバルバランス（安定型） 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） たわらノーロード スマートグ ローバルバランス（成長型） たわらノーロード スマートグ ローバルバランス（積極型） たわらノーロード 最適化バラ ンス（保守型）	2,236,676,779円 25,762,701円 73,544,050円 54,030,866円 3,113,787円 73,305,576円 114,845,501円 41,424,797円 31,581,384円 631,284円

たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	807,811円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	4,325,681円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	1,578,056円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	1,679,959円
投資のソムリエ	17,802,580,996円
投資のソムリエ<DC年金>	1,547,430,490円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	1,277,473,727円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	24,196,246,204円
ワールドアセットバランス(基本コース)	5,778,866,668円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	20,349,115,209円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	4,505,067円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	3,239,196円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	7,579,656円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	7,405,591円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	7,438,170,372円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	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)	8,816,848,501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)	14,524,821,842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)	806,049,131円
DIAM世界アセットバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	7,003,027,220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)	33,533,550,223円
DIAMバランス30VA(適格機関投資家限定)	19,601,120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)	29,944,184,780円
DIAMバランス20VA(適格機関投資家限定)	153,294,210円

D I A M世界アセットバランス ファンド7VA(1212) (適格機関投資家限定)	2,501,377,202円
D I A M世界アセットバランス ファンド7VA(1303) (適格機関投資家限定)	2,597,230,650円
D I A M世界アセットバランス ファンド7VA(1306) (適格機関投資家限定)	3,430,389,721円
D I A M世界アセットバランス ファンド7VA(1309) (適格機関投資家限定)	424,763,387円
計	184,831,343,228円
2. 受益権の総数	184,831,343,228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11月8日 至 平成30年10月12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。
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。
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。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成30年10月12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。
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。
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。

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	平成30年10月12日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
国債証券	4,624,196,570
合計	4,624,196,570

(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6月23日から平成30年10月12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10月12日 現在			
	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	245,423,003,370	-	242,427,958,235	2,995,045,135
アメリカ・ドル	111,067,881,289	-	109,822,279,776	1,245,601,513
イギリス・ポンド	15,724,052,614	-	15,774,772,040	50,719,426
オーストラリア・ドル	5,149,936,701	-	5,013,574,020	136,362,681
カナダ・ドル	4,893,126,260	-	4,797,467,000	95,659,260
シンガポール・ドル	999,063,251	-	981,323,343	17,739,908
スウェーデン・クローナ	910,453,406	-	891,595,206	18,858,200
デンマーク・クローネ	1,524,893,677	-	1,502,612,960	22,280,717
ノルウェー・クローネ	605,821,781	-	594,066,570	11,755,211
ポーランド・ズロチ	1,533,907,611	-	1,504,583,934	29,323,677
マレーシア・リングギット	1,167,226,830	-	1,146,410,100	20,816,730
メキシコ・ペソ	2,132,459,347	-	2,081,657,004	50,802,343
ユーロ	98,341,633,387	-	96,998,240,264	1,343,393,123
南アフリカ・ランド	1,372,547,216	-	1,319,376,018	53,171,198
買 建	5,019,650,000	-	5,019,297,848	352,152
アメリカ・ドル	4,169,570,000	-	4,169,198,248	371,752
ユーロ	850,080,000	-	850,099,600	19,600
合計	250,442,653,370	-	247,447,256,083	2,994,692,983

(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10月12日現在
1口当たり純資産額	1.3033円
(1万口当たり純資産額)	(13,033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10月12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 1.0 11/30/19	17,000,000.000	16,674,450.000	
		US T N/B 1.125 03/31/20	11,000,000.000	10,739,080.000	
		US T N/B 1.125 06/30/21	10,000,000.000	9,537,500.000	
		US T N/B 1.125 07/31/21	13,900,000.000	13,236,414.000	
		US T N/B 1.125 08/31/21	11,000,000.000	10,456,820.000	
		US T N/B 1.125 09/30/21	430,000.000	408,160.300	
		US T N/B 1.125 12/31/19	14,500,000.000	14,217,830.000	
		US T N/B 1.25 02/29/20	4,200,000.000	4,114,026.000	
		US T N/B 1.25 07/31/23	8,400,000.000	7,750,932.000	
		US T N/B 1.25 10/31/21	10,500,000.000	9,988,860.000	
		US T N/B 1.375 03/31/20	7,620,000.000	7,466,990.400	
		US T N/B 1.375 04/30/20	11,510,000.000	11,263,570.900	
		US T N/B 1.375 04/30/21	10,000,000.000	9,628,900.000	
		US T N/B 1.375 05/31/20	12,010,000.000	11,735,931.800	
		US T N/B 1.375 05/31/21	12,350,000.000	11,874,278.000	
		US T N/B 1.375 06/30/23	550,000.000	511,241.500	
		US T N/B 1.375 08/31/23	9,500,000.000	8,806,025.000	
		US T N/B 1.375 09/30/23	9,000,000.000	8,332,650.000	
		US T N/B 1.375 10/31/20	10,000,000.000	9,706,200.000	
		US T N/B 1.5 06/15/20	13,000,000.000	12,722,190.000	
		US T N/B 1.5 08/15/26	9,800,000.000	8,712,788.000	
		US T N/B 1.625 02/15/26	5,970,000.000	5,396,760.600	
		US T N/B 1.625 04/30/23	9,800,000.000	9,237,186.000	
		US T N/B 1.625 05/15/26	9,000,000.000	8,107,650.000	
		US T N/B 1.625 05/31/23	1,460,000.000	1,374,677.600	
		US T N/B 1.625 07/31/20	19,250,000.000	18,843,825.000	
		US T N/B 1.625 11/15/22	1,120,000.000	1,062,420.800	
		US T N/B 1.625 11/30/20	10,000,000.000	9,743,700.000	
		US T N/B 1.625 12/31/19	18,850,000.000	18,598,164.000	
		US T N/B 1.75 02/28/22	10,500,000.000	10,100,475.000	
		US T N/B 1.75 05/15/22	1,250,000.000	1,199,412.500	
		US T N/B 1.75 05/15/23	5,000,000.000	4,736,700.000	
		US T N/B 1.75 05/31/22	9,490,000.000	9,094,077.200	
		US T N/B 1.75 06/30/22	15,000,000.000	14,369,400.000	
		US T N/B 1.75 09/30/22	15,600,000.000	14,898,000.000	
		US T N/B 1.875 03/31/22	13,300,000.000	12,834,500.000	
		US T N/B 2.0 02/15/22	10,000,000.000	9,704,600.000	
		US T N/B 2.0 02/15/23	14,000,000.000	13,446,440.000	
		US T N/B 2.0 02/15/25	8,600,000.000	8,077,894.000	
		US T N/B 2.0 05/31/21	11,560,000.000	11,296,200.800	



US T N/B 2.0 06/30/24	210,000.000	198,777.600	
US T N/B 2.0 07/31/20	12,600,000.000	12,415,914.000	
US T N/B 2.0 08/15/25	11,600,000.000	10,834,168.000	
US T N/B 2.0 08/31/21	7,060,000.000	6,882,652.800	
US T N/B 2.0 09/30/20	12,660,000.000	12,456,174.000	
US T N/B 2.0 10/31/22	4,280,000.000	4,123,138.000	
US T N/B 2.0 11/15/21	7,900,000.000	7,686,700.000	
US T N/B 2.0 11/15/26	8,900,000.000	8,192,806.000	
US T N/B 2.0 11/30/22	12,020,000.000	11,570,091.400	
US T N/B 2.125 03/31/24	10,500,000.000	10,034,010.000	
US T N/B 2.125 05/15/25	8,400,000.000	7,930,776.000	
US T N/B 2.125 08/15/21	9,590,000.000	9,385,445.300	
US T N/B 2.125 08/31/20	11,660,000.000	11,506,904.200	
US T N/B 2.125 09/30/21	9,800,000.000	9,578,716.000	
US T N/B 2.125 09/30/24	2,720,000.000	2,585,468.800	
US T N/B 2.125 11/30/24	3,970,000.000	3,766,815.400	
US T N/B 2.125 12/31/21	7,000,000.000	6,827,730.000	
US T N/B 2.125 12/31/22	13,500,000.000	13,047,480.000	
US T N/B 2.25 01/31/24	3,780,000.000	3,640,593.600	
US T N/B 2.25 02/15/27	10,300,000.000	9,632,045.000	
US T N/B 2.25 03/31/21	11,920,000.000	11,739,292.800	
US T N/B 2.25 08/15/27	10,030,000.000	9,352,172.600	
US T N/B 2.25 08/15/46	6,000,000.000	4,845,900.000	
US T N/B 2.25 11/15/24	12,600,000.000	12,044,718.000	
US T N/B 2.25 11/15/25	10,800,000.000	10,229,544.000	
US T N/B 2.25 11/15/27	5,080,000.000	4,727,549.600	
US T N/B 2.25 12/31/24	4,530,000.000	4,326,467.100	
US T N/B 2.375 01/31/23	2,760,000.000	2,693,346.000	
US T N/B 2.375 05/15/27	9,600,000.000	9,067,488.000	
US T N/B 2.375 08/15/24	12,610,000.000	12,166,632.400	
US T N/B 2.5 01/31/25	2,980,000.000	2,886,159.800	
US T N/B 2.5 02/15/45	4,380,000.000	3,760,273.800	
US T N/B 2.5 02/15/46	5,600,000.000	4,789,288.000	
US T N/B 2.5 03/31/23	6,720,000.000	6,586,070.400	
US T N/B 2.5 05/15/24	10,790,000.000	10,503,309.700	
US T N/B 2.5 05/15/46	4,050,000.000	3,459,874.500	
US T N/B 2.5 08/15/23	6,700,000.000	6,553,404.000	
US T N/B 2.625 02/28/23	1,190,000.000	1,173,161.500	
US T N/B 2.625 03/31/25	2,400,000.000	2,339,424.000	
US T N/B 2.625 08/15/20	13,350,000.000	13,298,869.500	
US T N/B 2.625 08/31/20	12,790,000.000	12,740,502.700	
US T N/B 2.625 11/15/20	11,860,000.000	11,801,055.800	
US T N/B 2.75 02/15/24	11,930,000.000	11,783,618.900	
US T N/B 2.75 02/15/28	7,080,000.000	6,860,944.800	
US T N/B 2.75 02/28/25	6,290,000.000	6,180,365.300	
US T N/B 2.75 04/30/23	10,670,000.000	10,565,754.100	
US T N/B 2.75 05/31/23	3,880,000.000	3,842,092.400	
US T N/B 2.75 07/31/23	2,100,000.000	2,077,845.000	
US T N/B 2.75 08/15/42	3,220,000.000	2,927,913.800	

US T N/B 2.75 08/15/47	5,850,000.000	5,224,752.000	
US T N/B 2.75 08/31/23	7,030,000.000	6,956,395.900	
US T N/B 2.75 08/31/25	2,970,000.000	2,911,045.500	
US T N/B 2.75 09/15/21	2,960,000.000	2,945,762.400	
US T N/B 2.75 11/15/23	7,000,000.000	6,920,690.000	
US T N/B 2.75 11/15/42	4,500,000.000	4,090,410.000	
US T N/B 2.75 11/15/47	3,780,000.000	3,388,089.600	
US T N/B 2.875 04/30/25	4,220,000.000	4,174,466.200	
US T N/B 2.875 05/15/28	8,420,000.000	8,241,075.000	
US T N/B 2.875 05/15/43	5,150,000.000	4,779,818.000	
US T N/B 2.875 05/31/25	4,550,000.000	4,498,448.500	
US T N/B 2.875 08/15/28	3,660,000.000	3,581,346.600	
US T N/B 2.875 08/15/45	4,590,000.000	4,240,012.500	
US T N/B 2.875 11/15/46	6,200,000.000	5,713,672.000	
US T N/B 3.0 02/15/47	6,000,000.000	5,666,220.000	
US T N/B 3.0 02/15/48	6,450,000.000	6,076,093.500	
US T N/B 3.0 05/15/42	2,310,000.000	2,197,549.200	
US T N/B 3.0 05/15/45	6,200,000.000	5,869,168.000	
US T N/B 3.0 05/15/47	5,920,000.000	5,565,688.000	
US T N/B 3.0 08/15/48	2,250,000.000	2,120,625.000	
US T N/B 3.0 11/15/44	6,500,000.000	6,154,655.000	
US T N/B 3.0 11/15/45	3,600,000.000	3,405,348.000	
US T N/B 3.125 02/15/42	2,760,000.000	2,687,550.000	
US T N/B 3.125 02/15/43	3,680,000.000	3,571,587.200	
US T N/B 3.125 05/15/21	100,000.000	100,570.000	
US T N/B 3.125 05/15/48	5,860,000.000	5,661,756.200	
US T N/B 3.125 08/15/44	6,260,000.000	6,066,816.400	
US T N/B 3.125 11/15/41	2,350,000.000	2,289,041.000	
US T N/B 3.375 05/15/44	6,300,000.000	6,378,246.000	
US T N/B 3.375 11/15/19	2,250,000.000	2,265,975.000	
US T N/B 3.5 02/15/39	2,150,000.000	2,232,302.000	
US T N/B 3.625 02/15/20	19,500,000.000	19,715,475.000	
US T N/B 3.625 02/15/21	2,010,000.000	2,043,205.200	
US T N/B 3.625 02/15/44	4,480,000.000	4,726,713.600	
US T N/B 3.625 08/15/43	3,700,000.000	3,902,316.000	
US T N/B 3.75 11/15/43	4,420,000.000	4,756,317.800	
US T N/B 3.875 08/15/40	2,450,000.000	2,678,903.500	
US T N/B 4.25 05/15/39	1,790,000.000	2,058,625.300	
US T N/B 4.375 02/15/38	1,210,000.000	1,408,984.500	
US T N/B 4.375 05/15/40	2,320,000.000	2,715,652.800	
US T N/B 4.375 05/15/41	2,100,000.000	2,465,022.000	
US T N/B 4.375 11/15/39	2,000,000.000	2,337,180.000	
US T N/B 4.5 02/15/36	2,180,000.000	2,556,725.800	
US T N/B 4.5 05/15/38	400,000.000	473,528.000	
US T N/B 4.5 08/15/39	2,000,000.000	2,374,360.000	
US T N/B 4.625 02/15/40	3,370,000.000	4,070,319.700	
US T N/B 4.75 02/15/41	2,600,000.000	3,204,682.000	
US T N/B 5.0 05/15/37	890,000.000	1,112,081.700	
US T N/B 5.25 02/15/29	830,000.000	984,388.300	

	US T N/B 5.25 11/15/28	1,700,000.000	2,007,717.000	
	US T N/B 5.375 02/15/31	2,300,000.000	2,820,007.000	
	US T N/B 5.5 08/15/28	930,000.000	1,115,488.500	
	US T N/B 6.0 02/15/26	800,000.000	953,368.000	
	US T N/B 6.125 11/15/27	2,050,000.000	2,535,583.500	
	US T N/B 6.25 05/15/30	1,200,000.000	1,560,084.000	
	US T N/B 6.25 08/15/23	1,200,000.000	1,376,520.000	
	US T N/B 6.5 11/15/26	500,000.000	621,990.000	
	US T N/B 8.0 11/15/21	2,100,000.000	2,414,160.000	
アメリカ・ドル 小計		991,230,000.000 (111,206,093,700)	962,590,939.900 (107,993,077,547)	
イギリス・ボンド	UK TREASURY 0.5 07/22/22	1,780,000.000	1,740,715.400	
	UK TREASURY 0.75 07/22/23	4,080,000.000	3,987,465.600	
	UK TREASURY 1.25 07/22/27	1,230,000.000	1,197,023.700	
	UK TREASURY 1.5 01/22/21	4,310,000.000	4,366,978.200	
	UK TREASURY 1.5 07/22/26	2,850,000.000	2,855,842.500	
	UK TREASURY 1.5 07/22/47	3,310,000.000	2,902,539.000	
	UK TREASURY 1.625 10/22/28	1,770,000.000	1,761,539.400	
	UK TREASURY 1.625 10/22/71	980,000.000	866,594.400	
	UK TREASURY 1.75 07/22/57	1,770,000.000	1,644,507.000	
	UK TREASURY 1.75 09/07/22	3,840,000.000	3,933,465.600	
	UK TREASURY 1.75 09/07/37	2,060,000.000	1,967,712.000	
	UK TREASURY 2.0 09/07/25	1,420,000.000	1,477,794.000	
	UK TREASURY 2.25 09/07/23	1,970,000.000	2,065,525.300	
	UK TREASURY 2.5 07/22/65	2,140,000.000	2,472,213.600	
	UK TREASURY 2.75 09/07/24	2,500,000.000	2,702,275.000	
	UK TREASURY 3.25 01/22/44	3,150,000.000	3,862,530.000	
	UK TREASURY 3.5 01/22/45	2,300,000.000	2,948,600.000	
	UK TREASURY 3.5 07/22/68	2,050,000.000	3,022,520.000	
	UK TREASURY 3.75 07/22/52	2,170,000.000	3,073,805.000	

	UK TREASURY 3.75 09/07/20	3,050,000.000	3,215,615.000	
	UK TREASURY 3.75 09/07/21	2,200,000.000	2,375,054.000	
	UK TREASURY 4.0 01/22/60	2,100,000.000	3,278,730.000	
	UK TREASURY 4.0 03/07/22	2,350,000.000	2,583,613.500	
	UK TREASURY 4.25 03/07/36	1,050,000.000	1,400,805.000	
	UK TREASURY 4.25 06/07/32	2,440,000.000	3,143,940.000	
	UK TREASURY 4.25 09/07/39	2,250,000.000	3,094,650.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/27	2,050,000.000	2,522,545.500	
	UK TREASURY 4.25 12/07/40	2,820,000.000	3,921,774.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/46	2,690,000.000	3,927,131.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/49	2,130,000.000	3,196,917.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/55	1,870,000.000	2,952,917.000	
	UK TREASURY 4.5 09/07/34	2,850,000.000	3,848,640.000	
	UK TREASURY 4.5 12/07/42	1,900,000.000	2,777,230.000	
	UK TREASURY 4.75 12/07/30	2,320,000.000	3,077,016.000	
	UK TREASURY 4.75 12/07/38	1,830,000.000	2,658,258.000	
	UK TREASURY 5.0 03/07/25	2,200,000.000	2,691,062.000	
	UK TREASURY 6.0 12/07/28	1,450,000.000	2,044,500.000	
	UK TREASURY 8.0 06/07/21	1,520,000.000	1,800,561.600	
	イギリス・ボンド 小計	86,750,000.000 (12,887,580,000)	103,360,605.300 (15,355,251,523)	
	オーストラリア・ドル			
	AUSTRALIAN 5.75 05/15/21	5,340,000.000	5,836,299.600	
	AUSTRALIAN 1.75 11/21/20	4,500,000.000	4,473,990.000	
	AUSTRALIAN 2.0 12/21/21	2,700,000.000	2,691,900.000	
	AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	4,120,000.000	3,955,612.000	
	AUSTRALIAN 2.25 11/21/22	2,190,000.000	2,194,358.100	

	AUSTRALIAN 2.75 04/21/24	4,000,000.000	4,078,400.000	
	AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	1,100,000.000	1,063,392.000	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	4,610,000.000	4,621,939.900	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/28	3,590,000.000	3,595,636.300	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/29	680,000.000	679,272.400	
	AUSTRALIAN 3.0 03/21/47	2,040,000.000	1,960,134.000	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	2,230,000.000	2,330,974.400	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	2,350,000.000	2,459,322.000	
	AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	1,330,000.000	1,358,634.900	
	AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	1,190,000.000	1,307,738.600	
	AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	3,420,000.000	3,808,477.800	
	AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	2,220,000.000	2,641,045.200	
	AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	4,750,000.000	5,506,865.000	
	AUSTRALIAN 5.5 04/21/23	1,690,000.000	1,926,042.300	
	AUSTRALIAN 5.75 07/15/22	3,890,000.000	4,393,638.300	
	オーストラリア・ドル 小計	57,940,000.000 (4,632,303,000)	60,883,672.800 (4,867,649,640)	
カナダ・ドル	CANADA 8.0 06/01/27	900,000.000	1,282,950.000	
	CANADA 0.5 03/01/22	2,280,000.000	2,145,662.400	
	CANADA 0.75 03/01/21	190,000.000	183,338.600	
	CANADA 0.75 09/01/20	4,600,000.000	4,474,282.000	
	CANADA 0.75 09/01/21	2,790,000.000	2,669,667.300	
	CANADA 1.0 06/01/27	290,000.000	256,722.500	
	CANADA 1.0 09/01/22	2,300,000.000	2,186,081.000	
	CANADA 1.25 02/01/20	2,360,000.000	2,333,237.600	
	CANADA 1.5 03/01/20	4,250,000.000	4,210,985.000	
	CANADA 1.5 06/01/23	2,200,000.000	2,116,994.000	
	CANADA 1.5 06/01/26	2,060,000.000	1,921,897.600	
	CANADA 1.75 05/01/20	1,520,000.000	1,509,344.800	
	CANADA 2.0 06/01/28	2,220,000.000	2,125,361.400	
	CANADA 2.0 09/01/23	1,450,000.000	1,424,842.500	
	CANADA 2.0 12/01/51	540,000.000	479,871.000	
	CANADA 2.25 06/01/25	2,190,000.000	2,163,391.500	
	CANADA 2.5 06/01/24	2,250,000.000	2,260,552.500	
	CANADA 2.75 06/01/22	1,850,000.000	1,876,843.500	
	CANADA 2.75 12/01/48	1,710,000.000	1,800,801.000	
	CANADA 2.75 12/01/64	770,000.000	830,845.400	
	CANADA 3.25 06/01/21	2,400,000.000	2,458,464.000	

	CANADA 3.5 06/01/20	2,000,000.000	2,040,860.000	
	CANADA 3.5 12/01/45	1,750,000.000	2,090,147.500	
	CANADA 4.0 06/01/41	2,480,000.000	3,109,126.400	
	CANADA 5.0 06/01/37	1,430,000.000	1,953,708.900	
	CANADA 5.75 06/01/29	1,700,000.000	2,211,343.000	
	CANADA 5.75 06/01/33	1,410,000.000	1,965,370.800	
カナダ・ドル 小計		51,890,000.000 (4,468,766,800)	54,082,692.200 (4,657,601,452)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE 1.25 10/01/21	800,000.000	778,560.000	
	SINGAPORE 1.75 02/01/23	270,000.000	264,465.000	
	SINGAPORE 1.75 04/01/22	300,000.000	295,050.000	
	SINGAPORE 2.125 06/01/26	400,000.000	388,800.000	
	SINGAPORE 2.25 06/01/21	800,000.000	801,240.000	
	SINGAPORE 2.25 08/01/36	300,000.000	273,030.000	
	SINGAPORE 2.375 06/01/25	500,000.000	497,000.000	
	SINGAPORE 2.75 03/01/46	750,000.000	724,687.500	
	SINGAPORE 2.75 04/01/42	760,000.000	736,820.000	
	SINGAPORE 2.75 07/01/23	700,000.000	712,901.000	
	SINGAPORE 2.875 07/01/29	200,000.000	204,260.000	
	SINGAPORE 2.875 09/01/30	610,000.000	619,760.000	
	SINGAPORE 3.0 09/01/24	570,000.000	587,955.000	
	SINGAPORE 3.125 09/01/22	1,200,000.000	1,238,400.000	
	SINGAPORE 3.375 09/01/33	680,000.000	723,261.600	
SINGAPORE 3.5 03/01/27	1,260,000.000	1,349,460.000		
シンガポール・ドル 小計		10,100,000.000 (824,463,000)	10,195,650.100 (832,270,918)	
スウェーデン・クローナ	SWEDEN 0.75 05/12/28	5,700,000.000	5,713,338.000	
	SWEDEN 1.0 11/12/26	9,290,000.000	9,604,652.300	
	SWEDEN 1.5 11/13/23	12,920,000.000	13,796,751.200	
	SWEDEN 2.5 05/12/25	6,380,000.000	7,265,352.600	
	SWEDEN 3.5 03/30/39	5,600,000.000	7,656,040.000	
	SWEDEN 3.5 06/01/22	17,760,000.000	20,055,124.800	
スウェーデン・クローナ 小計		57,650,000.000 (721,201,500)	64,091,258.900 (801,781,649)	
デンマーク・クローネ	DENMARK 0.25 11/15/20	5,000,000.000	5,083,600.000	
	DENMARK 0.5 11/15/27	9,780,000.000	9,812,958.600	
	DENMARK 1.5 11/15/23	8,570,000.000	9,244,030.500	
	DENMARK 1.75 11/15/25	10,420,000.000	11,543,067.600	
	DENMARK 3.0 11/15/21	13,540,000.000	14,938,682.000	
	DENMARK 4.5 11/15/39	16,490,000.000	27,883,930.400	
デンマーク・クローネ 小計		63,800,000.000 (1,112,672,000)	78,506,269.100 (1,369,149,333)	
ノルウェー・クローネ	NORWAY 1.5 02/19/26	5,610,000.000	5,457,408.000	

	NORWAY 1.75 02/17/27	7,030,000.000	6,907,185.900	
	NORWAY 1.75 03/13/25	5,990,000.000	5,959,271.300	
	NORWAY 2.0 05/24/23	9,380,000.000	9,532,706.400	
	NORWAY 3.0 03/14/24	9,430,000.000	10,047,665.000	
ノルウェー・クローネ 小計		37,440,000.000 (512,179,200)	37,904,236.600 (518,529,957)	
ポーランド・ズロチ	POLAND 07/25/20	1,500,000.000	1,461,450.000	
	POLAND 1.75 07/25/21	4,500,000.000	4,496,850.000	
	POLAND 2.0 04/25/21	4,000,000.000	4,026,000.000	
	POLAND 2.25 04/25/22	2,350,000.000	2,358,460.000	
	POLAND 2.5 01/25/23	2,640,000.000	2,647,920.000	
	POLAND 2.5 07/25/26	5,520,000.000	5,296,164.000	
	POLAND 2.5 07/25/27	4,890,000.000	4,630,145.400	
	POLAND 2.75 04/25/28	1,000,000.000	959,150.000	
	POLAND 3.25 07/25/25	2,520,000.000	2,565,738.000	
	POLAND 4.0 10/25/23	4,070,000.000	4,345,335.500	
	POLAND 5.25 10/25/20	2,880,000.000	3,091,104.000	
	POLAND 5.75 04/25/29	1,800,000.000	2,212,704.000	
	POLAND 5.75 09/23/22	3,380,000.000	3,816,628.400	
POLAND 5.75 10/25/21	2,690,000.000	2,994,104.500		
ポーランド・ズロチ 小計		43,740,000.000 (1,321,385,400)	44,901,753.800 (1,356,481,982)	
マレーシア・リングgit	MALAYSIA 3.418 08/15/22	5,000,000.000	4,937,250.000	
	MALAYSIA 3.48 03/15/23	3,910,000.000	3,854,556.200	
	MALAYSIA 3.502 05/31/27	4,580,000.000	4,358,419.600	
	MALAYSIA 3.844 04/15/33	1,340,000.000	1,238,950.600	
	MALAYSIA 3.9 11/30/26	1,500,000.000	1,478,280.000	
	MALAYSIA 4.127 04/15/32	1,180,000.000	1,126,038.600	
	MALAYSIA 4.16 07/15/21	6,460,000.000	6,547,016.200	
	MALAYSIA 4.181 07/15/24	2,190,000.000	2,213,433.000	
	MALAYSIA 4.232 06/30/31	2,000,000.000	1,947,200.000	
	MALAYSIA 4.378 11/29/19	5,160,000.000	5,213,199.600	
	MALAYSIA 4.392 04/15/26	1,480,000.000	1,506,699.200	
	MALAYSIA 4.498 04/15/30	2,820,000.000	2,828,685.600	
	MALAYSIA 4.935 09/30/43	3,470,000.000	3,499,113.300	
MALAYSIA 5.248 09/15/28	1,480,000.000	1,573,491.600		
マレーシア・リングgit 小計		42,570,000.000 (1,149,815,700)	42,322,333.500 (1,143,126,228)	
メキシコ・ペソ	MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	13,880,000.000	16,125,367.600	
	MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	17,236,000.000	18,898,239.840	
	MEXICAN BONDS 5.75 03/05/26	24,224,000.000	21,102,253.120	
	MEXICAN BONDS 6.5 06/09/22	42,000,000.000	40,063,800.000	
	MEXICAN BONDS 6.5 06/10/21	47,647,000.000	45,998,413.800	

	MEXICAN BONDS 7.25 12/09/21	9,886,000.000	9,685,116.480	
	MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	34,386,000.000	32,996,805.600	
	MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	21,054,000.000	20,247,631.800	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	16,833,000.000	15,875,202.300	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	16,399,000.000	15,647,925.800	
	MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47	11,366,000.000	10,996,036.700	
	MEXICAN BONDS 8.0 12/07/23	22,730,000.000	22,734,318.700	
	MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	16,000,000.000	16,354,880.000	
	MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	17,526,000.000	17,885,283.000	
	メキシコ・ペソ 小計	311,167,000.000 (1,842,108,640)	304,611,274.740 (1,803,298,746)	
ユーロ	AUSTRIA 0.5 04/20/27	2,300,000.000	2,276,747.000	
	AUSTRIA 0.75 02/20/28	570,000.000	571,778.400	
	AUSTRIA 0.75 10/20/26	1,700,000.000	1,729,512.000	
	AUSTRIA 07/15/23	900,000.000	898,335.000	
	AUSTRIA 09/20/22	800,000.000	803,640.000	
	AUSTRIA 1.2 10/20/25	1,100,000.000	1,163,910.000	
	AUSTRIA 1.5 02/20/47	760,000.000	766,118.000	
	AUSTRIA 1.5 11/02/86	340,000.000	303,259.600	
	AUSTRIA 1.65 10/21/24	1,580,000.000	1,716,922.800	
	AUSTRIA 1.75 10/20/23	1,820,000.000	1,976,156.000	
	AUSTRIA 2.1 09/20/17	520,000.000	568,734.400	
	AUSTRIA 2.4 05/23/34	1,190,000.000	1,408,008.000	
	AUSTRIA 3.15 06/20/44	800,000.000	1,111,032.000	
	AUSTRIA 3.5 09/15/21	480,000.000	534,000.000	
	AUSTRIA 3.65 04/20/22	1,270,000.000	1,443,164.500	
	AUSTRIA 3.8 01/26/62	430,000.000	727,482.600	
	AUSTRIA 3.9 07/15/20	2,240,000.000	2,412,480.000	
	AUSTRIA 4.15 03/15/37	1,730,000.000	2,571,645.000	
	AUSTRIA 4.85 03/15/26	1,400,000.000	1,857,072.000	
	AUSTRIA 6.25 07/15/27	1,160,000.000	1,719,282.400	
	BELGIUM 0.2 10/22/23	1,060,000.000	1,061,484.000	
	BELGIUM 0.5 10/22/24	1,500,000.000	1,514,745.000	
	BELGIUM 0.8 06/22/25	2,430,000.000	2,488,101.300	
	BELGIUM 0.8 06/22/27	2,050,000.000	2,055,473.500	
	BELGIUM 0.8 06/22/28	1,370,000.000	1,357,354.900	
	BELGIUM 1.0 06/22/26	2,050,000.000	2,108,404.500	
	BELGIUM 1.0 06/22/31	1,500,000.000	1,475,835.000	
	BELGIUM 1.25 04/22/33	700,000.000	698,341.000	
	BELGIUM 1.45 06/22/37	600,000.000	594,786.000	



BELGIUM 1.6 06/22/47	1,570,000.000	1,506,697.600	
BELGIUM 1.9 06/22/38	1,220,000.000	1,299,031.600	
BELGIUM 2.15 06/22/66	640,000.000	652,672.000	
BELGIUM 2.25 06/22/23	1,850,000.000	2,040,698.000	
BELGIUM 2.25 06/22/57	410,000.000	438,265.400	
BELGIUM 2.6 06/22/24	1,630,000.000	1,844,719.900	
BELGIUM 3.0 06/22/34	1,200,000.000	1,483,740.000	
BELGIUM 3.75 06/22/45	1,480,000.000	2,127,840.400	
BELGIUM 3.75 09/28/20	2,500,000.000	2,708,275.000	
BELGIUM 4.0 03/28/22	2,130,000.000	2,441,448.600	
BELGIUM 4.0 03/28/32	1,550,000.000	2,101,970.500	
BELGIUM 4.25 03/28/41	1,370,000.000	2,057,164.600	
BELGIUM 4.25 09/28/21	2,400,000.000	2,726,256.000	
BELGIUM 4.25 09/28/22	2,300,000.000	2,697,923.000	
BELGIUM 4.5 03/28/26	1,500,000.000	1,934,400.000	
BELGIUM 5.0 03/28/35	1,090,000.000	1,679,036.000	
BELGIUM 5.5 03/28/28	3,370,000.000	4,816,235.500	
BUNDESABL 0.25 10/16/20	3,000,000.000	3,049,050.000	
BUNDESABL 04/08/22	2,500,000.000	2,528,850.000	
BUNDESABL 04/09/21	2,850,000.000	2,885,283.000	
BUNDESABL 04/14/23	2,960,000.000	2,980,483.200	
BUNDESABL 04/17/20	2,950,000.000	2,977,995.500	
BUNDESABL 10/07/22	3,000,000.000	3,029,520.000	
BUNDESABL 10/08/21	3,400,000.000	3,442,568.000	
BUNDESSCHAT 12/13/19	4,000,000.000	4,029,240.000	
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27	3,800,000.000	3,771,082.000	
DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28	760,000.000	740,490.800	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25	3,440,000.000	3,525,312.000	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26	4,000,000.000	4,081,120.000	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28	3,330,000.000	3,342,154.500	
DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27	4,490,000.000	4,530,499.800	
DEUTSCHLAND 08/15/26	3,770,000.000	3,687,361.600	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/24	3,100,000.000	3,273,693.000	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25	1,170,000.000	1,236,877.200	
DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48	1,160,000.000	1,194,579.600	
DEUTSCHLAND 1.5 02/15/23	3,100,000.000	3,329,400.000	
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/23	3,070,000.000	3,304,271.700	

DEUTSCHLAND 1.5 05/15/24	2,600,000.000	2,818,062.000	
DEUTSCHLAND 1.5 09/04/22	3,300,000.000	3,529,185.000	
DEUTSCHLAND 1.75 02/15/24	2,090,000.000	2,289,260.600	
DEUTSCHLAND 1.75 07/04/22	3,350,000.000	3,607,347.000	
DEUTSCHLAND 2.0 01/04/22	2,700,000.000	2,908,170.000	
DEUTSCHLAND 2.0 08/15/23	2,900,000.000	3,197,830.000	
DEUTSCHLAND 2.25 09/04/20	3,000,000.000	3,161,520.000	
DEUTSCHLAND 2.25 09/04/21	2,700,000.000	2,910,870.000	
DEUTSCHLAND 2.5 01/04/21	2,200,000.000	2,350,062.000	
DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	2,400,000.000	3,169,152.000	
DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	2,960,000.000	3,954,648.800	
DEUTSCHLAND 3.0 07/04/20	3,200,000.000	3,399,648.000	
DEUTSCHLAND 3.25 01/04/20	2,300,000.000	2,412,286.000	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/21	2,490,000.000	2,743,083.600	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	2,330,000.000	3,431,554.100	
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	2,740,000.000	4,181,459.200	
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	2,100,000.000	3,409,371.000	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	1,800,000.000	2,534,976.000	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	1,390,000.000	2,204,262.000	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	2,400,000.000	4,193,088.000	
DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	2,600,000.000	4,095,832.000	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/24	1,180,000.000	1,568,939.800	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	1,400,000.000	2,269,890.000	
DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	1,670,000.000	2,553,997.800	
FINLAND 0.375 09/15/20	1,150,000.000	1,169,699.500	
FINLAND 0.5 04/15/26	730,000.000	731,898.000	

FINLAND 0.5 09/15/27	600,000.000	592,008.000	
FINLAND 0.75 04/15/31	750,000.000	733,635.000	
FINLAND 0.875 09/15/25	450,000.000	465,642.000	
FINLAND 04/15/22	770,000.000	775,197.500	
FINLAND 09/15/23	750,000.000	747,892.500	
FINLAND 1.125 04/15/34	480,000.000	483,974.400	
FINLAND 1.5 04/15/23	830,000.000	886,938.000	
FINLAND 2.0 04/15/24	700,000.000	771,281.000	
FINLAND 2.625 07/04/42	780,000.000	1,011,667.800	
FINLAND 2.75 07/04/28	700,000.000	833,357.000	
FINLAND 4.0 07/04/25	740,000.000	920,360.200	
FRANCE BTAN 8.5 04/25/23	1,480,000.000	2,049,918.400	
FRANCE OAT 0.25 11/25/20	4,300,000.000	4,363,425.000	
FRANCE OAT 0.25 11/25/26	4,400,000.000	4,276,448.000	
FRANCE OAT 0.5 05/25/25	5,500,000.000	5,545,155.000	
FRANCE OAT 0.5 05/25/26	5,000,000.000	4,986,800.000	
FRANCE OAT 0.75 05/25/28	5,470,000.000	5,438,000.500	
FRANCE OAT 0.75 11/25/28	940,000.000	928,616.600	
FRANCE OAT 02/25/20	4,200,000.000	4,231,920.000	
FRANCE OAT 02/25/21	2,400,000.000	2,420,376.000	
FRANCE OAT 03/25/23	2,800,000.000	2,796,164.000	
FRANCE OAT 05/25/20	5,400,000.000	5,447,196.000	
FRANCE OAT 05/25/21	4,160,000.000	4,198,272.000	
FRANCE OAT 05/25/22	5,500,000.000	5,531,515.000	
FRANCE OAT 1.0 05/25/27	5,000,000.000	5,131,750.000	
FRANCE OAT 1.0 11/25/25	5,200,000.000	5,400,200.000	
FRANCE OAT 1.25 05/25/34	500,000.000	499,960.000	
FRANCE OAT 1.25 05/25/36	3,600,000.000	3,538,080.000	
FRANCE OAT 1.5 05/25/31	5,500,000.000	5,773,625.000	
FRANCE OAT 1.75 05/25/23	2,970,000.000	3,204,184.500	
FRANCE OAT 1.75 05/25/66	1,450,000.000	1,374,890.000	
FRANCE OAT 1.75 06/25/39	1,500,000.000	1,574,475.000	
FRANCE OAT 1.75 11/25/24	5,600,000.000	6,096,104.000	
FRANCE OAT 2.0 05/25/48	2,860,000.000	3,039,121.800	
FRANCE OAT 2.25 05/25/24	5,400,000.000	6,014,682.000	
FRANCE OAT 2.25 10/25/22	4,900,000.000	5,361,923.000	
FRANCE OAT 2.5 05/25/30	4,850,000.000	5,654,178.500	

FRANCE OAT 2.5 10/25/20	4,300,000.000	4,560,838.000	
FRANCE OAT 2.75 10/25/27	2,460,000.000	2,900,192.400	
FRANCE OAT 3.0 04/25/22	6,220,000.000	6,921,429.400	
FRANCE OAT 3.25 05/25/45	3,850,000.000	5,205,007.500	
FRANCE OAT 3.25 10/25/21	6,000,000.000	6,646,800.000	
FRANCE OAT 3.5 04/25/20	3,010,000.000	3,196,770.500	
FRANCE OAT 3.5 04/25/26	1,680,000.000	2,056,488.000	
FRANCE OAT 3.75 04/25/21	5,510,000.000	6,088,605.100	
FRANCE OAT 4.0 04/25/55	2,250,000.000	3,560,625.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/60	1,270,000.000	2,058,035.000	
FRANCE OAT 4.0 10/25/38	4,510,000.000	6,576,662.400	
FRANCE OAT 4.25 10/25/23	6,320,000.000	7,640,184.800	
FRANCE OAT 4.5 04/25/41	3,490,000.000	5,505,126.000	
FRANCE OAT 4.75 04/25/35	2,520,000.000	3,852,475.200	
FRANCE OAT 5.5 04/25/29	5,620,000.000	8,246,057.400	
FRANCE OAT 5.75 10/25/32	5,000,000.000	8,026,500.000	
FRANCE OAT 6.0 10/25/25	2,220,000.000	3,080,072.400	
IRISH 0.9 05/15/28	800,000.000	787,784.000	
IRISH 1.0 05/15/26	920,000.000	935,787.200	
IRISH 1.3 05/15/33	740,000.000	718,421.600	
IRISH 1.7 05/15/37	930,000.000	934,929.000	
IRISH 2.0 02/18/45	1,350,000.000	1,394,604.000	
IRISH 2.4 05/15/30	1,490,000.000	1,671,288.300	
IRISH 3.4 03/18/24	1,120,000.000	1,303,433.600	
IRISH 3.9 03/20/23	950,000.000	1,107,814.000	
IRISH 4.5 04/18/20	1,570,000.000	1,687,279.000	
IRISH 5.0 10/18/20	400,000.000	443,720.000	
IRISH 5.4 03/13/25	980,000.000	1,277,028.200	
ITALY BTPS 0.05 04/15/21	950,000.000	902,177.000	
ITALY BTPS 0.2 10/15/20	2,500,000.000	2,422,900.000	
ITALY BTPS 0.35 06/15/20	3,600,000.000	3,531,420.000	
ITALY BTPS 0.45 06/01/21	3,750,000.000	3,591,375.000	
ITALY BTPS 0.65 10/15/23	1,870,000.000	1,677,520.900	
ITALY BTPS 0.65 11/01/20	2,000,000.000	1,954,800.000	
ITALY BTPS 0.7 05/01/20	3,800,000.000	3,753,260.000	
ITALY BTPS 0.9 08/01/22	3,000,000.000	2,808,270.000	
ITALY BTPS 0.95 03/01/23	2,000,000.000	1,847,280.000	

ITALY BTPS 0.95 03/15/23	2,700,000.000	2,492,640.000	
ITALY BTPS 1.2 04/01/22	2,700,000.000	2,577,150.000	
ITALY BTPS 1.25 12/01/26	3,500,000.000	3,018,400.000	
ITALY BTPS 1.35 04/15/22	3,000,000.000	2,873,670.000	
ITALY BTPS 1.45 05/15/25	1,360,000.000	1,219,892.800	
ITALY BTPS 1.45 11/15/24	2,800,000.000	2,541,448.000	
ITALY BTPS 1.6 06/01/26	3,300,000.000	2,944,260.000	
ITALY BTPS 1.65 03/01/32	3,300,000.000	2,655,411.000	
ITALY BTPS 1.85 05/15/24	2,800,000.000	2,626,960.000	
ITALY BTPS 2.0 12/01/25	2,900,000.000	2,674,815.000	
ITALY BTPS 2.05 08/01/27	1,550,000.000	1,395,046.500	
ITALY BTPS 2.15 12/15/21	2,000,000.000	1,980,800.000	
ITALY BTPS 2.2 06/01/27	2,500,000.000	2,285,500.000	
ITALY BTPS 2.25 09/01/36	2,400,000.000	1,958,880.000	
ITALY BTPS 2.45 09/01/33	1,800,000.000	1,556,658.000	
ITALY BTPS 2.7 03/01/47	2,650,000.000	2,160,015.000	
ITALY BTPS 2.8 03/01/67	1,100,000.000	873,290.000	
ITALY BTPS 2.8 12/01/28	740,000.000	693,653.800	
ITALY BTPS 2.95 09/01/38	1,450,000.000	1,272,476.500	
ITALY BTPS 3.25 09/01/46	2,200,000.000	1,979,868.000	
ITALY BTPS 3.45 03/01/48	1,430,000.000	1,305,518.500	
ITALY BTPS 3.5 03/01/30	3,980,000.000	3,929,016.200	
ITALY BTPS 3.75 03/01/21	2,950,000.000	3,060,212.000	
ITALY BTPS 3.75 05/01/21	3,000,000.000	3,105,300.000	
ITALY BTPS 3.75 08/01/21	3,500,000.000	3,621,800.000	
ITALY BTPS 3.75 09/01/24	2,500,000.000	2,578,450.000	
ITALY BTPS 4.0 02/01/37	4,570,000.000	4,698,874.000	
ITALY BTPS 4.0 09/01/20	4,220,000.000	4,383,609.400	
ITALY BTPS 4.25 03/01/20	2,100,000.000	2,177,406.000	
ITALY BTPS 4.5 02/01/20	2,420,000.000	2,512,758.600	
ITALY BTPS 4.5 03/01/24	3,500,000.000	3,737,895.000	

ITALY BTPS 4.5 03/01/26	2,850,000.000	3,070,020.000	
ITALY BTPS 4.5 05/01/23	2,600,000.000	2,774,824.000	
ITALY BTPS 4.75 08/01/23	4,010,000.000	4,329,998.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/28	3,100,000.000	3,425,252.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/44	2,600,000.000	2,889,692.000	
ITALY BTPS 5.0 03/01/22	2,500,000.000	2,689,500.000	
ITALY BTPS 5.0 03/01/25	3,860,000.000	4,254,955.200	
ITALY BTPS 5.0 08/01/34	3,670,000.000	4,198,847.000	
ITALY BTPS 5.0 08/01/39	780,000.000	887,250.000	
ITALY BTPS 5.0 09/01/40	3,450,000.000	3,909,885.000	
ITALY BTPS 5.25 11/01/29	3,000,000.000	3,441,000.000	
ITALY BTPS 5.5 09/01/22	2,960,000.000	3,254,194.400	
ITALY BTPS 5.5 11/01/22	3,200,000.000	3,520,128.000	
ITALY BTPS 5.75 02/01/33	2,330,000.000	2,831,416.000	
ITALY BTPS 6.0 05/01/31	4,300,000.000	5,275,240.000	
ITALY BTPS 6.5 11/01/27	3,400,000.000	4,180,640.000	
ITALY BTPS 7.25 11/01/26	2,150,000.000	2,727,705.000	
ITALY BTPS 9.0 11/01/23	1,700,000.000	2,174,980.000	
NETHERLANDS 0.25 01/15/20	2,150,000.000	2,174,574.500	
NETHERLANDS 0.25 07/15/25	2,400,000.000	2,399,208.000	
NETHERLANDS 0.75 07/15/27	2,390,000.000	2,435,840.200	
NETHERLANDS 0.75 07/15/28	900,000.000	910,323.000	
NETHERLANDS 01/15/22	2,800,000.000	2,826,936.000	
NETHERLANDS 01/15/24	1,640,000.000	1,634,046.800	
NETHERLANDS 1.75 07/15/23	670,000.000	727,291.700	
NETHERLANDS 2.0 07/15/24	1,020,000.000	1,130,292.600	
NETHERLANDS 2.25 07/15/22	2,280,000.000	2,493,795.600	
NETHERLANDS 2.5 01/15/33	2,110,000.000	2,573,039.500	
NETHERLANDS 2.75 01/15/47	1,920,000.000	2,657,740.800	
NETHERLANDS 3.25 07/15/21	2,760,000.000	3,040,719.600	
NETHERLANDS 3.75 01/15/42	2,130,000.000	3,315,984.000	
NETHERLANDS 4.0 01/15/37	2,310,000.000	3,486,252.000	

	NETHERLANDS 5.5 01/15/28	2,070,000.000	2,997,774.000	
	NETHERLANDS 7.5 01/15/23	590,000.000	781,868.000	
	SPAIN 0.05 01/31/21	2,500,000.000	2,500,775.000	
	SPAIN 0.35 07/30/23	1,000,000.000	985,970.000	
	SPAIN 0.4 04/30/22	3,300,000.000	3,312,243.000	
	SPAIN 0.45 10/31/22	2,600,000.000	2,603,094.000	
	SPAIN 0.75 07/30/21	2,650,000.000	2,698,998.500	
	SPAIN 1.15 07/30/20	4,500,000.000	4,604,895.000	
	SPAIN 1.3 10/31/26	3,500,000.000	3,487,820.000	
	SPAIN 1.4 01/31/20	3,600,000.000	3,678,012.000	
	SPAIN 1.4 04/30/28	3,760,000.000	3,702,208.800	
	SPAIN 1.45 10/31/27	3,300,000.000	3,282,873.000	
	SPAIN 1.5 04/30/27	2,700,000.000	2,709,180.000	
	SPAIN 1.6 04/30/25	3,100,000.000	3,212,778.000	
	SPAIN 1.95 04/30/26	3,000,000.000	3,146,190.000	
	SPAIN 1.95 07/30/30	3,050,000.000	3,084,434.500	
	SPAIN 2.15 10/31/25	2,350,000.000	2,506,956.500	
	SPAIN 2.35 07/30/33	2,380,000.000	2,449,020.000	
	SPAIN 2.7 10/31/48	1,080,000.000	1,069,945.200	
	SPAIN 2.75 10/31/24	3,800,000.000	4,205,004.000	
	SPAIN 2.9 10/31/46	2,500,000.000	2,608,425.000	
	SPAIN 3.45 07/30/66	550,000.000	609,427.500	
	SPAIN 3.8 04/30/24	2,980,000.000	3,453,164.400	
	SPAIN 4.0 04/30/20	2,870,000.000	3,056,750.900	
	SPAIN 4.2 01/31/37	3,000,000.000	3,880,260.000	
	SPAIN 4.65 07/30/25	3,380,000.000	4,165,850.000	
	SPAIN 4.7 07/30/41	3,060,000.000	4,244,556.600	
	SPAIN 4.8 01/31/24	3,000,000.000	3,623,160.000	
	SPAIN 4.85 10/31/20	2,630,000.000	2,894,236.100	
	SPAIN 4.9 07/30/40	1,060,000.000	1,502,550.000	
	SPAIN 5.15 10/31/28	1,320,000.000	1,751,508.000	
	SPAIN 5.15 10/31/44	2,000,000.000	2,963,240.000	
	SPAIN 5.4 01/31/23	3,000,000.000	3,624,120.000	
	SPAIN 5.5 04/30/21	3,700,000.000	4,210,711.000	
	SPAIN 5.75 07/30/32	2,410,000.000	3,515,274.200	
	SPAIN 5.85 01/31/22	4,160,000.000	4,923,609.600	
	SPAIN 5.9 07/30/26	2,350,000.000	3,147,801.500	
	SPAIN 6.0 01/31/29	3,500,000.000	4,936,085.000	
	ユーロ 小計	656,630,000.000 (85,440,695,600)	728,842,012.400 (94,836,922,653)	
	南アフリカ・ランド			
	SOUTH AFRICA 10.5 12/21/26	39,540,000.000	42,283,285.200	
	SOUTH AFRICA 6.25 03/31/36	17,630,000.000	12,248,971.400	
	SOUTH AFRICA 6.5 02/28/41	13,680,000.000	9,292,824.000	

	SOUTH AFRICA 7.0 02/28/31	17,190,000.000	13,817,322.000	
	SOUTH AFRICA 8.0 01/31/30	15,820,000.000	14,033,131.000	
	SOUTH AFRICA 8.25 03/31/32	13,000,000.000	11,473,020.000	
	SOUTH AFRICA 8.5 01/31/37	16,500,000.000	14,347,080.000	
	SOUTH AFRICA 8.75 01/31/44	15,000,000.000	13,046,250.000	
	SOUTH AFRICA 8.75 02/28/48	13,710,000.000	11,886,707.100	
	SOUTH AFRICA 8.875 02/28/35	10,000,000.000	9,108,000.000	
	SOUTH AFRICA 9.0 01/31/40	9,000,000.000	8,089,560.000	
	南アフリカ・ランド 小計	181,070,000.000 (1,394,239,000)	159,626,150.700 (1,229,121,360)	
国債証券	合計	227,513,503,540 (227,513,503,540)	236,764,262,990 (236,764,262,990)	
合計		227,513,503,540 (227,513,503,540)	236,764,262,990 (236,764,262,990)	

(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 147銘柄	44.83%	45.61%
イギリス・ポンド	国債証券 38銘柄	6.37%	6.49%
オーストラリア・ドル	国債証券 20銘柄	2.02%	2.06%
カナダ・ドル	国債証券 27銘柄	1.93%	1.97%
シンガポール・ドル	国債証券 16銘柄	0.35%	0.35%
スウェーデン・クローナ	国債証券 6銘柄	0.33%	0.34%
デンマーク・クローネ	国債証券 6銘柄	0.57%	0.58%
ノルウェー・クローネ	国債証券 5銘柄	0.22%	0.22%
ポーランド・ズロチ	国債証券 14銘柄	0.56%	0.57%
マレーシア・リングgit	国債証券 14銘柄	0.47%	0.48%
メキシコ・ペソ	国債証券 14銘柄	0.75%	0.76%
ユーロ	国債証券 267銘柄	39.37%	40.06%
南アフリカ・ランド	国債証券 11銘柄	0.51%	0.52%

(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10月12日現在
資産の部		
流動資産		
預金		3,683,826,146
コール・ローン		580,368,131
株式		48,275,462,755
投資信託受益証券		279,126,129
投資証券		93,277,428
派生商品評価勘定		1,236,237
未収入金		2,566,448
未収配当金		78,401,183
差入委託証拠金		1,058,690,063
流動資産合計		54,052,954,520
資産合計		54,052,954,520
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		168,414,282
未払金		30,827,011
未払解約金		682,226,000
流動負債合計		881,467,293
負債合計		881,467,293
純資産の部		
元本等		
元本	1	49,906,024,818
剰余金		
剰余金又は欠損金( )		3,265,462,409
元本等合計		53,171,487,227
純資産合計		53,171,487,227
負債純資産合計		54,052,954,520

## 注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

<p>1. 有価証券の評価基準及び評価方法</p>	<p>株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
<p>2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法</p>	<p>先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>為替予約取引 原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
<p>3. 収益及び費用の計上基準</p>	<p>受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>
<p>4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項</p>	<p>外貨建取引等の処理基準 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10月12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	48,119,660,826円
	同期中追加設定元本額	35,136,430,371円
	同期中一部解約元本額	33,350,066,379円
	元本の内訳	
	ファンド名	
	DIAM新興国株式インデック スファンド<DC年金>	3,998,466,681円
	DIAM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)	526,663,191円
	MITO ラップ型ファンド (安定型)	3,985,301円
	MITO ラップ型ファンド (中立型)	10,799,409円
	MITO ラップ型ファンド (積極型)	13,414,427円
	グローバル8資産ラップファン ド(安定型)	28,092,719円
	グローバル8資産ラップファン ド(中立型)	28,537,703円
	グローバル8資産ラップファン ド(積極型)	17,048,590円
	たわらノーロード 新興国株式	4,143,846,622円
	たわらノーロード 新興国株式 <ラップ向け>	1,771,389,117円
	たわらノーロード バランス (8資産均等型)	141,717,362円
	たわらノーロード バランス (堅実型)	911,236円
	たわらノーロード バランス (標準型)	3,704,213円
	たわらノーロード バランス (積極型)	9,490,560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)	108,437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)	5,437,197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)	16,630,235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)	12,267,696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)	35,053,630円
	たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定型)	27,969円
	たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定成長型)	369,091円

たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	293,335円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	668,349円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	447,212,307円
D I A M D C 8資産バランス ファンド(新興国10)	314,439,194円
D I A M D C 8資産バランス ファンド(新興国20)	267,422,836円
D I A M D C 8資産バランス ファンド(新興国30)	533,698,629円
投資のソムリエ	3,362,324,690円
クルーズコントロール	1,329,932,944円
投資のソムリエ<DC年金>	292,031,702円
D I A M 8資産バランスファ ンドN<DC年金>	211,686,781円
クルーズコントロール<DC年 金>	770,395円
D I A Mコア資産設計ファンド (堅実型)	19,663,281円
D I A Mコア資産設計ファンド (積極型)	51,388,252円
投資のソムリエ<DC年金>リ スク抑制型	100,151,426円
ダイナミック・ナビゲーション	564,769円
リスク抑制世界8資産バランス ファンド	1,889,566,731円
ワールドアセットバランス(基 本コース)	1,897,818,968円
ワールドアセットバランス(リ スク抑制コース)	6,652,378,641円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤ-2045)	1,147,064円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤ-2055)	824,219円
リスク抑制世界8資産バランス ファンド(DC)	595,341円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤ-2035)	1,488,465円
リスクコントロール世界資産分 散ファンド	270,188,548円
9資産分散投資・スタンダード <DC年金>	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)	3,861,381,492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)	2,126,266,886円
D I A M世界アセットバランス ファンド2VA(適格機関投資 家限定)	8,067,518,091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)	7,436,619,226円
計		49,906,024,818円
2 .	受益権の総数	49,906,024,818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11月8日 至 平成30年10月12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。
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いません。
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。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成30年10月12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。
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。
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。

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	平成30年10月12日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
株式	7,072,834,005
投資信託受益証券	4,748,395
投資証券	18,247,921
合計	7,095,830,321

(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10月12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10月12日 現在			
	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	2,435,402,841	-	2,435,203,604	199,237
アメリカ・ドル	1,346,331,040	-	1,346,035,970	295,070
カタール・リアル	20,803,121	-	20,642,634	160,487
タイ・バーツ	68,598,680	-	68,400,000	198,680
フィリピン・ペソ	51,848,000	-	51,750,000	98,000
マレーシア・リングギット	148,368,000	-	148,445,000	77,000
韓国・ウォン	395,040,000	-	396,000,000	960,000
香港・ドル	42,939,000	-	42,930,000	9,000
台湾・ドル	361,475,000	-	361,000,000	475,000
買 建	20,803,121	-	20,536,771	266,350
アメリカ・ドル	20,803,121	-	20,536,771	266,350
合計	2,456,205,962	-	2,455,740,375	67,113

(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10月12日 現在			
	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	2,110,229,391	-	1,943,118,459	167,110,932
合計	2,110,229,391	-	1,943,118,459	167,110,932

## (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10月12日現在
1口当たり純資産額	1.0654円
(1万口当たり純資産額)	(10,654円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

平成30年10月12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	37,000	35.150	1,300,550.000	
	CIA DE MINAS BUENAVENTURA SA ADR	18,800	14.000	263,200.000	
	SURGUTNEFTEGAZ SP ADR PREF	69,900	5.447	380,745.300	
	CREDICORP LTD	6,349	214.290	1,360,527.210	
	SINA CORP	6,000	59.010	354,060.000	
	MOBILE TELESYSTEMS PJSC ADR	48,925	7.930	387,975.250	
	NETEASE INC-ADR	7,300	211.400	1,543,220.000	
	SOUTHERN COPPER CORP	7,580	42.690	323,590.200	
	LUKOIL SPON ADR	39,430	72.400	2,854,732.000	
	GAZPROM PAO ADR	501,010	4.900	2,454,949.000	
	COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK SP GDR	110,249	4.255	469,109.490	
	INNER MONGOLIA YITAI COAL CO	105,800	1.146	121,246.800	
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRADE	96,280	1.283	123,527.240	
	SURGUTNEFTEGAZ ADR	74,317	3.996	296,970.730	
	51JOB INC ADR	2,300	58.400	134,320.000	
	X5 RETAIL GROUP NV GDR	12,426	19.400	241,064.400	
	NOVATEK PJSC GDR	8,459	169.900	1,437,184.100	
	BAIDU INC -SPON ADR	25,200	198.000	4,989,600.000	
	NOVOLIPETSK STEEL GDR	13,240	25.200	333,648.000	
	MMC NORILSK NICKEL ADR	61,384	16.850	1,034,320.400	
	ROSNEFT OIL CO GDR	114,000	6.944	791,616.000	
	NEW ORIENTAL EDUCATION & TECH	12,900	58.570	755,553.000	
	SEVERSTAL GDR	21,907	16.000	350,512.000	
	TATNEFT ADR	23,860	70.400	1,679,744.000	
	MAGNITOGORSK IRON & STEEL SPON GDR	19,500	9.410	183,495.000	
	VTB BANK OJSC GDR	192,000	1.273	244,416.000	
	DP WORLD LTD	15,686	18.500	290,191.000	
	MAGNIT PJSC GDR	33,117	12.295	407,173.510	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD ADR	43,400	5.060	219,604.000	
	FANG HOLDINGS LTD ADR	19,300	2.200	42,460.000	
RUSHYDRO PJSC ADR	141,960	0.829	117,684.840		
TAL EDUCATION GROUP-ADR	32,200	21.480	691,656.000		
NOAH HOLDINGS LTD ADR	2,700	35.140	94,878.000		

	SBERBANK ADR	249,900	11.440	2,858,856.000	
	PHOSAGRO PJSC GDR	13,784	13.010	179,329.840	
	HUAZHU GROUP LTD ADR	11,800	26.680	314,824.000	
	YY INC-ADR	4,700	68.030	319,741.000	
	GDS HOLDINGS LTD ADR	5,600	25.890	144,984.000	
	58.COM INC ADR	8,400	61.870	519,708.000	
	AUTOHOME INC ADR	5,400	65.910	355,914.000	
	WEIBO CORP ADR	4,700	55.820	262,354.000	
	JD.COM INC ADR	65,500	23.480	1,537,940.000	
	ALIBABA GROUP HOLDING LTD-ADR	104,880	141.900	14,882,472.000	
	MOMO INC SPON ADR	13,100	35.510	465,181.000	
	BAOZUN INC-SPN ADR	3,400	36.880	125,392.000	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	33,200	32.050	1,064,060.000	
	POLYUS PJSC GDR	6,012	32.150	193,285.800	
アメリカ・ドル 小計		2,454,855		49,497,565.110 (5,553,131,831)	
アラブ首長国連邦・ディルハム	DUBAI ISLAMIC BANK PJSC	168,000	5.250	882,000.000	
	EMIRATES TELECOMMUNICATIONS GROUP CO PJSC	156,450	16.540	2,587,683.000	
	DUBAI INVESTMENTS PJSC	169,895	1.720	292,219.400	
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK PJSC	194,762	7.880	1,534,724.560	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	127,622	14.640	1,868,386.080	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	322,486	4.880	1,573,731.680	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	356,142	1.700	605,441.400	
	EMAAR DEVELOPMENT PJSC	77,463	5.150	398,934.450	
	EMAAR MALLS PJSC	178,166	1.820	324,262.120	
	DAMAC PROPERTIES DUBAI CO PJSC	190,235	1.940	369,055.900	
アラブ首長国連邦・ディルハム 小計		1,941,221		10,436,438.590 (319,250,656)	
インド・ルピー	RELIANCE INDUSTRIES LTD	258,730	1,087.800	281,446,494.000	
	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	66,548	278.150	18,510,326.200	
	ASIAN PAINTS LTD	26,486	1,219.050	32,287,758.300	
	EICHER MOTORS LTD	1,197	22,357.450	26,761,867.650	
	GRASIM INDUSTRIES LTD	28,851	878.350	25,341,275.850	
	MAHINDRA & MAHINDRA LTD	67,342	730.150	49,169,761.300	
	SHREE CEMENT LTD	830	14,823.750	12,303,712.500	
	ICICI BANK LTD	213,994	311.700	66,701,929.800	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP LTD	58,463	207.950	12,157,380.850	
	STATE BANK OF INDIA LTD	162,789	262.150	42,675,136.350	
	CONTAINER CORP OF INDIA LTD	15,148	594.400	9,003,971.200	

LIC HOUSING FINANCE LTD	26,242	410.750	10,778,901.500	
TATA STEEL LTD	31,902	555.150	17,710,395.300	
TATA MOTORS LTD	138,820	182.950	25,397,119.000	
JSW STEEL LTD	76,971	361.700	27,840,410.700	
TATA POWER CO LTD	114,770	62.250	7,144,432.500	
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	2,743	5,570.200	15,279,058.600	
NESTLE INDIA LTD	2,343	9,384.400	21,987,649.200	
BHARAT HEAVY ELECTRICALS LTD	92,082	73.300	6,749,610.600	
GAIL INDIA LTD	70,027	350.250	24,526,956.750	
VEDANTA LTD	110,581	207.900	22,989,789.900	
AXIS BANK LTD	162,278	580.850	94,259,176.300	
TITAN COMPANY LTD	27,648	778.900	21,535,027.200	
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	122,655	152.950	18,760,082.250	
LUPIN LTD	22,500	836.550	18,822,375.000	
BAJAJ FINANCE LTD	15,656	2,162.100	33,849,837.600	
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP	144,729	1,684.550	243,803,236.950	
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISES LTD	43,870	463.900	20,351,293.000	
INFOSYS LTD	318,055	673.350	214,162,334.250	
WIPRO LTD	100,958	313.050	31,604,901.900	
INDIAN OIL CORP LTD	139,469	131.000	18,270,439.000	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	59,221	1,526.100	90,377,168.100	
HCL TECHNOLOGIES LTD	50,316	1,009.000	50,768,844.000	
DABUR INDIA LTD	52,045	393.350	20,471,900.750	
HERO MOTOCORP LTD	4,509	2,871.000	12,945,339.000	
DR REDDYS LABORATORIES LTD	10,085	2,459.000	24,799,015.000	
BHARTI AIRTEL LTD	125,025	285.350	35,675,883.750	
UNITED SPIRITS LTD	28,139	496.700	13,976,641.300	
SUN PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD	75,490	586.700	44,289,983.000	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	9,620	6,875.500	66,142,310.000	
GLENMARK PHARMACEUTICALS LTD	13,988	598.100	8,366,222.800	
AUROBINDO PHARMA LTD	23,572	756.250	17,826,325.000	
HAVELLS INDIA LTD	24,800	579.950	14,382,760.000	
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	64,460	228.550	14,732,333.000	
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE CO LTD	15,042	1,046.350	15,739,196.700	
PETRONET LNG LTD	52,875	212.100	11,214,787.500	
CIPLA LTD/INDIA	31,870	616.200	19,638,294.000	
LARSEN & TOUBRO LTD	42,451	1,225.850	52,038,558.350	
ULTRATECH CEMENT LTD	9,111	3,688.750	33,608,201.250	
ASHOK LEYLAND LTD	110,886	111.800	12,397,054.800	
BOSCH LTD	774	18,283.650	14,151,545.100	

TATA CONSULTANCY SERVICES LTD	83,649	1,979.950	165,620,837.550	
NTPC LTD	175,055	163.150	28,560,223.250	
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	7,474	2,232.350	16,684,583.900	
YES BANK LTD	153,758	240.200	36,932,671.600	
AMBUJA CEMENTS LTD	54,635	207.850	11,355,884.750	
BHARAT FORGE LTD	18,421	555.250	10,228,260.250	
HINDALCO INDUSTRIES LTD	99,935	216.500	21,635,927.500	
ITC LTD	310,220	265.200	82,270,344.000	
PIDILITE INDUSTRIES LTD	11,666	959.650	11,195,276.900	
UNITED PHOSPHORUS LTD	32,882	605.150	19,898,542.300	
SIEMENS INDIA LTD	7,396	886.650	6,557,663.400	
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	32,823	727.950	23,893,502.850	
TECH MAHINDRA LTD	42,065	695.450	29,254,104.250	
VODAFONE IDEA LTD	196,527	34.550	6,790,007.850	
MARICO LTD	45,380	305.750	13,874,935.000	
PAGE INDUSTRIES LTD	528	28,058.800	14,815,046.400	
POWER GRID CORP OF INDIA LTD	149,485	185.700	27,759,364.500	
ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	49,342	313.500	15,468,717.000	
RURAL ELECTRIFICATION CORP LTD	55,173	100.000	5,517,300.000	
BAJAJ FINSERV LTD	3,603	5,592.000	20,147,976.000	
BAJAJ AUTO LTD	8,027	2,525.800	20,274,596.600	
COAL INDIA LTD	62,457	266.600	16,651,036.200	
MAHINDRA & MAHINDRA FINANCIAL SERVICES LTD	32,995	372.400	12,287,338.000	
BHARTI INFRATEL LTD	32,296	259.750	8,388,886.000	
INDIABULLS HOUSING FINANCE LTD	25,466	891.700	22,708,032.200	
TATA STEEL LTD-PARTLY PAID	2,333	113.500	264,795.500	
CADILA HEALTHCARE LTD	16,962	374.400	6,350,572.800	
AVENUE SUPERMARTS LTD	11,937	1,326.100	15,829,655.700	
INTERGLOBE AVIATION LTD	8,300	760.800	6,314,640.000	
インド・ルピー 小計	5,199,746		2,723,255,727.150 (4,166,581,263)	
インドネシア・ルピア				
UNITED TRACTORS TBK PT	163,401	31,400.000	5,130,791,400.000	
INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK PT	359,200	5,525.000	1,984,580,000.000	
UNILEVER INDONESIA TBK PT	137,500	44,100.000	6,063,750,000.000	
PT ASTRA INTERNATIONAL TBK	1,798,100	6,725.000	12,092,222,500.000	
TELEKOMUNIKASI INDONESIA PERSERO TBK	4,532,900	3,570.000	16,182,453,000.000	

	CHAROEN POKPHAND INDONESIA TBK PT	675,600	4,930.000	3,330,708,000.000	
	GUDANG GARAM TBK PT	48,600	74,725.000	3,631,635,000.000	
	HANJAYA MANDALA SAMPOERNA TBK	924,800	3,870.000	3,578,976,000.000	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA TBK PT	185,600	16,475.000	3,057,760,000.000	
	INDAH KIAT PULP AND PAPER CORP TBK PT	262,000	14,025.000	3,674,550,000.000	
	BANK DANAMON INDONESIA TBK PT	261,316	6,925.000	1,809,613,300.000	
	BANK MANDIRI	1,666,500	6,275.000	10,457,287,500.000	
	MATAHARI DEPARTMENT STORE TBK	276,500	6,000.000	1,659,000,000.000	
	BANK RAKYAT INDONESIA	4,985,300	2,910.000	14,507,223,000.000	
	PERUSAHAAN GAS NEGARA PT	1,064,100	2,140.000	2,277,174,000.000	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSERO TBK PT	669,100	6,725.000	4,499,697,500.000	
	KALBE FARMA TBK PT	1,822,200	1,255.000	2,286,861,000.000	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK PT	276,500	8,900.000	2,460,850,000.000	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	900,100	22,725.000	20,454,772,500.000	
	JASA MARGA PERSERO TBK PT	200,125	4,310.000	862,538,750.000	
	BUMI SERPONG DAMAI PT	851,700	965.000	821,890,500.000	
	ADARO ENERGY PT	1,434,500	1,720.000	2,467,340,000.000	
	PAKUWON JATI TBK	1,912,800	440.000	841,632,000.000	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR TBK PT	239,000	8,575.000	2,049,425,000.000	
	TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE TBK PT	180,800	4,780.000	864,224,000.000	
	BANK TABUNGAN NEGARA TBK PT	480,300	2,300.000	1,104,690,000.000	
	WASKITA KARYA PERSERO TBK PT	392,000	1,575.000	617,400,000.000	
	PT SURYA CITRA MEDIA TBK	511,300	1,730.000	884,549,000.000	
	インドネシア・ルピア 小計	27,211,842		129,653,593,950.000 (959,436,595)	
オフショア・人民 元	LUXSHARE PRECISION INDUSTRY CO LTD	9,600	14.680	140,928.000	
	FOCUS MEDIA INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD	26,300	7.290	191,727.000	
	IFLYTEK CO LTD	6,400	24.210	154,944.000	
	YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD	2,300	70.230	161,529.000	
	JIANGSU YANGHE BREWERY JOINT-STOCK CO LTD	2,500	111.000	277,500.000	
	WULIANGYE YIBIN CO LTD	4,500	58.720	264,240.000	
	SUNING.COM CO LTD	29,500	12.030	354,885.000	

BOE TECHNOLOGY GROUP CO LTD	79,900	2.730	218,127.000	
CHINA MERCHANTS SHEKOU INDUSTRIAL ZONE HOLDINGS CO LTD	12,300	16.100	198,030.000	
GREE ELECTRIC APPLIANCES INC OF ZHUHAI	5,700	37.050	211,185.000	
MIDEA GROUP CO LTD	8,000	40.300	322,400.000	
HANGZHOU HIKVISION DIGITAL TECHNOLOGY CO LTD	12,000	23.810	285,720.000	
PING AN BANK CO LTD	27,200	9.860	268,192.000	
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO LTD	79,000	4.020	317,580.000	
CHINA VANKE CO LTD	13,700	20.930	286,741.000	
WEICHAJ POWER CO LTD	29,900	8.090	241,891.000	
GF SECURITIES CO LTD	22,700	13.170	298,959.000	
BYD CO LTD	7,500	42.820	321,150.000	
BANK OF SHANGHAI CO LTD	20,900	11.260	235,334.000	
PETROCHINA CO LTD	32,800	8.830	289,624.000	
INDUSTRIAL & COMMERCIAL BANK OF CHINA LTD	75,500	5.400	407,700.000	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA LTD	82,500	3.650	301,125.000	
BANK OF CHINA LTD	74,500	3.500	260,750.000	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL CORP	51,300	6.400	328,320.000	
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	32,300	28.450	918,935.000	
PING AN INSURANCE GROUP CO OF CHINA LTD	14,000	61.850	865,900.000	
INDUSTRIAL BANK CO LTD	27,400	15.020	411,548.000	
SHANGHAI PUDONG DEVELOPMENT BANK CO LTD	36,700	9.800	359,660.000	
CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	73,320	5.960	436,987.200	
SAIC MOTOR CORP LTD	10,900	28.460	310,214.000	
KWEICHOW MOUTAI CO LTD	1,800	644.990	1,160,982.000	
BANK OF COMMUNICATIONS CO LTD	79,200	5.500	435,600.000	
CITIC SECURITIES CO LTD	33,200	15.170	503,644.000	
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	10,900	32.800	357,520.000	
CHINA YANGTZE POWER CO LTD	26,500	15.370	407,305.000	
DAQIN RAILWAY CO LTD	30,100	7.590	228,459.000	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD	60,800	3.710	225,568.000	
CHINA STATE CONSTRUCTION ENGINEERING CORP LTD	61,600	5.100	314,160.000	

HAITONG SECURITIES CO LTD	36,000	7.920	285,120.000	
HUAXIA BANK CO LTD	23,200	7.550	175,160.000	
INNER MONGOLIA YILI INDUSTRIAL GROUP CO LTD	10,400	24.190	251,576.000	
BANK OF BEIJING CO LTD	42,800	5.700	243,960.000	
BAOSHAN IRON & STEEL CO LTD	29,200	7.180	209,656.000	
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	4,200	33.490	140,658.000	
CHINA MERCHANTS SECURITIES CO LTD	22,800	12.100	275,880.000	
POLY REAL ESTATE GROUP CO LTD	20,400	10.980	223,992.000	
CRRC CORP LTD	38,600	8.180	315,748.000	
JIANGSU HENGRUI MEDICINE CO LTD	4,900	55.550	272,195.000	
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION CORP LTD	27,400	11.010	301,674.000	
HUATAI SECURITIES CO LTD	30,600	14.230	435,438.000	
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD	21,100	8.220	173,442.000	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	11,000	27.980	307,780.000	
FOUNDER SECURITIES CO LTD	31,000	4.790	148,490.000	
KANGMEI PHARMACEUTICAL CO LTD	14,300	21.680	310,024.000	
CHINA INTERNATIONAL TRAVEL SERVICE CORP LTD	3,900	60.500	235,950.000	
AVIC CAPITAL CO LTD	49,800	4.360	217,128.000	
METALLURGICAL CORP OF CHINA LTD	54,400	3.300	179,520.000	
POWER CONSTRUCTION CORP OF CHINA LTD	36,100	4.880	176,168.000	
SICHUAN CHUANTOU ENERGY CO LTD	23,700	7.920	187,704.000	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD	9,900	19.290	190,971.000	
AECC AVIATION POWER CO LTD	9,500	21.910	208,145.000	
JOINTOWN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	16,000	14.440	231,040.000	
INDUSTRIAL SECURITIES CO LTD	53,200	4.040	214,928.000	
BEIJING TONGRENTANG CO LTD	6,400	29.090	186,176.000	
SHANDONG GOLD MINING CO LTD	8,000	25.790	206,320.000	



	YONGHUI SUPERSTORES CO LTD	24,000	7.440	178,560.000	
	AISINO CORP	6,400	24.120	154,368.000	
	CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD	28,600	5.850	167,310.000	
	ZHANGZHOU PIENZHEHUANG PHARMACEUTICAL CO LTD	1,800	88.460	159,228.000	
	HENGTONG OPTIC-ELECTRIC CO LTD	8,100	20.250	164,025.000	
	FOSHAN HAITIAN FLAVOURING & FOOD CO LTD	6,200	72.460	449,252.000	
	GUOTAI JUNAN SECURITIES CO LTD	33,800	13.780	465,764.000	
	CHINA NATIONAL NUCLEAR POWER CO LTD	51,300	5.600	287,280.000	
	BANK OF JIANGSU CO LTD	32,400	6.040	195,696.000	
	ORIENT SECURITIES CO LTD/CHINA	24,800	7.950	197,160.000	
	EVERBRIGHT SECURITIES CO LTD	24,000	8.270	198,480.000	
オフショア・人民元 小計		2,095,420		22,197,029.200 (361,367,635)	
カタール・リアル	QATAR INSURANCE CO SAQ	14,417	37.120	535,159.040	
	QATAR NATIONAL BANK	42,093	180.000	7,576,740.000	
	COMMERCIAL BANK OF QATAR QSC	18,202	38.020	692,040.040	
	OOREDOO QSC	8,410	67.660	569,020.600	
	DOHA BANK QSC	18,035	21.200	382,342.000	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	4,887	190.010	928,578.870	
	INDUSTRIES QATAR QSC	16,138	130.000	2,097,940.000	
	QATAR ISLAMIC BANK SAQ	10,281	139.010	1,429,161.810	
	MASRAF AL RAYAN	32,079	37.270	1,195,584.330	
	BARWA REAL ESTATE CO	9,376	36.460	341,848.960	
	EZDAN HOLDING GROUP QSC	84,431	10.330	872,172.230	
カタール・リアル 小計		258,349		16,620,587.880 (513,077,548)	
コロンビア・ペソ	INTERCONEXION ELECTRICA SA ESP	45,324	12,720.000	576,521,280.000	
	ECOPETROL SA	412,135	3,900.000	1,607,326,500.000	
	GRUPO DE INVERSIONES SURAMERICANA SA-PREF	10,138	32,020.000	324,618,760.000	
	GRUPO AVAL ACCIONES Y VALORES SA-PREF	341,831	1,125.000	384,559,875.000	
	CEMENTOS ARGOS SA	37,720	7,400.000	279,128,000.000	
	GRUPO ARGOS SA	28,217	15,300.000	431,720,100.000	
	BANCOLOMBIA SA	20,855	30,260.000	631,072,300.000	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	42,495	30,840.000	1,310,545,800.000	
	GRUPO DE INVERSIONES SURAMERICANA SA	25,428	33,360.000	848,278,080.000	

コロンビア・ペソ 小計		964,143		6,393,770,695.000 (232,093,876)	
タイ・パーツ	BANGKOK BANK PCL	27,700	210.000	5,817,000.000	
	BERLI JUCKER PCL NVDR	116,700	56.000	6,535,200.000	
	KRUNG THAI BANK PCL NVDR	348,000	19.500	6,786,000.000	
	ROBINSON PCL-NVDR	38,800	65.250	2,531,700.000	
	SIAM COMMERCIAL BANK PCL NVDR	162,900	140.500	22,887,450.000	
	TRUE CORP PCL NVDR	1,030,755	5.850	6,029,916.750	
	KASIKORNBANK PCL NVDR	60,200	209.000	12,581,800.000	
	TMB BANK PCL -NVDR	1,010,000	2.280	2,302,800.000	
	IRPC PCL NVDR	1,065,500	6.300	6,712,650.000	
	BANPU PCL PUBLIC CO LTD NVDR	172,000	18.300	3,147,600.000	
	ELECTRICITY GENERATING PCL NVDR	13,100	231.000	3,026,100.000	
	CHAROEN POKPHAND FOODS PCL	311,500	23.900	7,444,850.000	
	ADVANCED INFO SERVICE PCL	92,800	196.000	18,188,800.000	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	380,520	14.900	5,669,748.000	
	DELTA ELECTRONICS THAI PCL NVDR	44,200	69.000	3,049,800.000	
	PTT PCL	946,600	51.000	48,276,600.000	
	THAI UNION GROUP PCL-NVDR	162,600	16.100	2,617,860.000	
	LAND AND HOUSES PCL NVDR	263,900	10.700	2,823,730.000	
	SIAM CEMENT PCL NVDR	33,850	422.000	14,284,700.000	
	AIRPORTS OF THAILAND PCL-NVDR	387,600	62.500	24,225,000.000	
	KASIKORNBANK PCL - FOREIGN	106,000	211.000	22,366,000.000	
	CENTRAL PATTANA PCL NVDR	119,200	79.250	9,446,600.000	
	BANGKOK DUSIT MEDICAL SERVICES NVDR	373,900	24.800	9,272,720.000	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR	38,900	186.000	7,235,400.000	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	236,810	38.000	8,998,780.000	
	THAI OIL PCL NVDR	98,500	82.500	8,126,250.000	
	GLOW ENERGY PCL NVDR	54,000	82.250	4,441,500.000	
CP ALL PCL NVDR	453,300	67.250	30,484,425.000		
BTS GROUP HOLDINGS PCL	531,300	9.450	5,020,785.000		
PTT EXPLORATION & PRODUCTION PCL NVDR	120,745	146.000	17,628,770.000		
INDORAMA VENTURES PCL NVDR	166,322	57.000	9,480,354.000		
PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	196,708	77.000	15,146,516.000		

	ENERGY ABSOLUTE PCL NVDR	118,000	45.750	5,398,500.000	
	BANGKOK EXPRESSWAY & METRO PCL NVDR	740,700	8.250	6,110,775.000	
タイ・パーツ 小計		10,023,610		364,096,679.750 (1,248,851,612)	
チェコ・コルナ	KOMERCNI BANKA AS	7,067	893.000	6,310,831.000	
	O2 CZECH REPUBLIC AS	5,677	252.000	1,430,604.000	
	CEZ	15,014	559.500	8,400,333.000	
	MONETA MONEY BANK AS	57,258	79.900	4,574,914.200	
チェコ・コルナ 小計		85,016		20,716,682.200 (104,412,078)	
チリ・ペソ	BANCO SANTANDER CHILE	5,959,453	51.400	306,315,884.200	
	BANCO DE CREDITO E INVERSIONES	4,581	43,306.000	198,384,786.000	
	BANCO DE CHILE	2,321,052	98.270	228,089,780.040	
	EMPRESAS CMPC SA	116,383	2,520.700	293,366,628.100	
	EMPRESAS COPEC SA	34,981	9,873.700	345,391,899.700	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	15,170	9,015.500	136,765,135.000	
	ENTEL CHILE SA	16,500	5,316.800	87,727,200.000	
	ENEL AMERICAS SA	2,523,913	100.310	253,173,713.030	
	COLBUN SA	780,648	137.880	107,635,746.240	
	AGUAS ANDINAS SA	224,014	350.550	78,528,107.700	
	EMBOTELLADORA ANDINA SA	27,270	2,494.200	68,016,834.000	
	LATAM AIRLINES GROUP SA	26,485	6,447.700	170,767,334.500	
	SOCIEDAD QUIMICA Y MINERA DE CHILE SA	10,624	29,298.000	311,261,952.000	
	SACI FALABELLA	68,025	5,240.100	356,457,802.500	
	ITAU CORPBANCA	13,236,977	6.619	87,615,550.760	
	CENCOSUD SA	125,078	1,548.900	193,733,314.200	
ENEL CHILE SA	2,764,879	62.620	173,136,722.980		
チリ・ペソ 小計		28,256,033		3,396,368,390.950 (559,721,510)	
トルコ・リラ	AKBANK TAS	185,577	6.430	1,193,260.110	
	ANADOLU EFES BIRACILIK VE MALT SANAYII AS	21,520	18.700	402,424.000	
	ARCELIK	30,429	12.700	386,448.300	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	31,766	26.260	834,175.160	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIKALARI TAS	125,960	10.650	1,341,474.000	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	5,919	66.000	390,654.000	
	KOC HOLDING AS	67,325	16.450	1,107,496.250	
	PETKIM PETROKIMYA HOLDING	88,174	5.200	458,504.800	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI AS	79,624	5.290	421,210.960	
	TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKASI AS	17,797	22.400	398,652.800	

	TURK HAVA YOLLARI	57,827	16.500	954,145.500	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	98,512	10.620	1,046,197.440	
	TURKIYE GARANTI BANKASI AS	201,717	7.120	1,436,225.040	
	TURKIYE IS BANKASI	162,502	4.020	653,258.040	
	TUPRAS TURKIYE PETROL RAFINE	11,716	137.000	1,605,092.000	
	ULKER BISKUVI SANAYI AS	13,121	16.340	214,397.140	
	YAPI VE KREDI BANKASI AS	143,015	1.660	237,404.900	
	HACI OMER SABANCI HOLDING AS	98,354	7.420	729,786.680	
	COCA-COLA ICECEK AS	6,451	30.460	196,497.460	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	19,011	80.500	1,530,385.500	
	TURKIYE VAKIFLAR BANKASI TAO	90,731	3.590	325,724.290	
	TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	13,735	27.340	375,514.900	
	TURKIYE HALK BANKASI AS	61,970	6.930	429,452.100	
トルコ・リラ 小計		1,632,753		16,668,381.370 (316,032,511)	
ハンガリー・フォロント	RICHTER GEDEON NYRT	14,830	5,120.000	75,929,600.000	
	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NYRT	30,013	2,902.000	87,097,726.000	
	OTP BANK NYRT	20,222	9,835.000	198,883,370.000	
ハンガリー・フォロント 小計		65,065		361,910,696.000 (144,872,852)	
パキスタン・ルピー	LUCKY CEMENT LTD	9,900	448.310	4,438,269.000	
	MCB BANK LTD	39,000	192.820	7,519,980.000	
	OIL & GAS DEVELOPMENT CO LTD	74,500	151.390	11,278,555.000	
	UNITED BANK LTD	51,400	139.580	7,174,412.000	
	HABIB BANK LTD	54,400	133.870	7,282,528.000	
パキスタン・ルピー 小計		229,200		37,693,744.000 (32,416,620)	
フィリピン・ペソ	AYALA LAND INC	641,100	38.500	24,682,350.000	
	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	188,940	46.550	8,795,157.000	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAND	88,540	81.900	7,251,426.000	
	AYALA CORP	21,583	882.000	19,036,206.000	
	ALLIANCE GLOBAL GROUP INC	307,700	11.480	3,532,396.000	
	DMCI HOLDINGS INC	351,850	12.180	4,285,533.000	
	GLOBE TELECOM INC	2,785	2,148.000	5,982,180.000	
	INTERNATIONAL CONTAINER TERM SERVICES INC	40,680	93.000	3,783,240.000	

	JG SUMMIT HOLDINGS INC	290,050	45.400	13,168,270.000	
	JOLLIBEE FOODS CORP	44,130	254.000	11,209,020.000	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	82,037	65.350	5,361,117.950	
	BDO UNIBANK INC	172,483	108.900	18,783,398.700	
	MEGAWORLD CORP	962,000	4.080	3,924,960.000	
	PLDT INC	9,520	1,364.000	12,985,280.000	
	ROBINSONS LAND CORP	218,722	19.100	4,177,590.200	
	SECURITY BANK CORP	23,420	133.200	3,119,544.000	
	SM PRIME HOLDINGS INC	900,475	33.700	30,346,007.500	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	90,210	128.000	11,546,880.000	
	SM INVESTMENTS CORP	23,458	850.500	19,951,029.000	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CORP	1,148,900	4.970	5,710,033.000	
	ABOITIZ POWER CORP	128,200	33.500	4,294,700.000	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	24,000	357.000	8,568,000.000	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	9,387	671.000	6,298,677.000	
フィリピン・ペソ	小計	5,770,170		236,792,995.350 (490,161,500)	
ブラジル・リアル	BRF SA	47,492	20.440	970,736.480	
	VALE SA	287,921	56.480	16,261,778.080	
	RAIA DROGASIL SA	20,600	67.480	1,390,088.000	
	TIM PARTICIPACOES SA	76,300	11.430	872,109.000	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	19,450	23.990	466,605.500	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	23,000	19.720	453,560.000	
	BANCO DO BRASIL SA	77,600	37.200	2,886,720.000	
	INVESTIMENTOS ITAU SA	424,160	10.750	4,559,720.000	
	LOJAS AMERICANAS SA	68,374	17.130	1,171,246.620	
	GERDAU SA	90,630	15.740	1,426,516.200	
	CIA BRASILEIRA DE DISTRIBUICAO GRUPO PAO DE ACUCAR	14,606	80.300	1,172,861.800	
	PETROLEO BRASILEIRO SA	267,910	28.100	7,528,271.000	
	PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	32,800	24.250	795,400.000	
	PETROLEO BRASILEIRO SA	354,512	25.290	8,965,608.480	
	KROTON EDUCACIONAL SA	122,968	11.150	1,371,093.200	
	CCR SA	121,420	9.890	1,200,843.800	
	WEG SA	74,072	18.430	1,365,146.960	
	BANCO BRADESCO SA PREF	306,225	31.930	9,777,764.250	
	BANCO BRADESCO SA	90,118	27.960	2,519,699.280	
	NATURA COSMETICOS SA	19,400	28.650	555,810.000	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	61,606	9.140	563,078.840	
	SUZANO PAPEL E CELULOSE SA	39,900	41.540	1,657,446.000	
	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	294,598	47.500	13,993,405.000	

	PORTO SEGURO SA	8,800	54.390	478,632.000	
	FIBRIA CELULOSE SA	22,490	72.420	1,628,725.800	
	BRASKEM SA	17,030	52.320	891,009.600	
	ENGIE BRASIL SA	17,370	35.440	615,592.800	
	LOCALIZA RENT A CAR	45,880	24.100	1,105,708.000	
	TELEFONICA BRASIL S.A.	39,428	38.300	1,510,092.400	
	LOJAS RENNER SA	62,870	34.450	2,165,871.500	
	EDP - ENERGIAS DO BRASIL SA	31,864	13.610	433,669.040	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	32,152	40.220	1,293,153.440	
	COSAN SA	16,500	34.230	564,795.000	
	EQUATORIAL ENERGIA SA	16,700	58.810	982,127.000	
	EMBRAER SA	63,360	18.450	1,168,992.000	
	M DIAS BRANCO SA	10,400	44.200	459,680.000	
	ODONTOPREV SA	32,200	12.480	401,856.000	
	BR MALLS PARTICIPACOES SA	85,565	11.320	968,595.800	
	JBS SA	89,900	9.140	821,686.000	
	CIA ENERGETICA DE MINAS GERAIS	96,249	10.150	976,927.350	
	CIA DE SANEAMENTO BASICO DO ESTADO DE SAO PAULO	34,698	27.180	943,091.640	
	MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS IMOBILIARIOS SA	31,140	20.650	643,041.000	
	SUL AMERICA SA	17,869	23.440	418,849.360	
	HYPERA SA	33,300	30.920	1,029,636.000	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BAICAO	185,916	23.820	4,428,519.120	
	MAGAZINE LUIZA SA	7,300	150.700	1,100,110.000	
	BANCO SANTANDER BRASIL SA	37,100	39.330	1,459,143.000	
	CIELO SA	111,307	12.430	1,383,546.010	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	62,400	27.150	1,694,160.000	
	ATACADAO DISTRIBUICAO COMERCIO E INDUSTRIA LTDA	37,300	14.550	542,715.000	
	AMBEV SA	427,595	16.990	7,264,839.050	
	KLABIN SA	64,800	17.670	1,145,016.000	
	RUMO SA	97,800	15.360	1,502,208.000	
	IRB BRASIL RESSEGUROS S/A	10,500	63.220	663,810.000	
ブラジル・リアル	小計	4,783,445		122,611,306.400 (3,637,877,461)	
ポーランド・ズロチ	BANK MILLENNIUM SA	49,782	8.800	438,081.600	
	MBANK	1,595	400.200	638,319.000	

BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA	2,596	71.600	185,873.600	
KGHM POLSKA MIEDZ SA	11,899	84.600	1,006,655.400	
BANK PEKAO SA	16,219	101.950	1,653,527.050	
ORANGE POLSKA SA	58,600	4.410	258,426.000	
POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	26,492	93.620	2,480,181.040	
LPP SA	130	8,220.000	1,068,600.000	
SANTANDER BANK POLSKA SA	3,142	345.800	1,086,503.600	
CD PROJEKT RED SA	6,015	152.000	914,280.000	
POWSZECHNA KASA OSZCZEDNOSCI BANK POLSKI SA	77,884	39.630	3,086,542.920	
CCC SA	2,763	211.000	582,993.000	
GRUPA LOTOS SA	9,480	71.480	677,630.400	
POLSKIE GORNICtwo NAFTOWE I GAZOWNICTWO SA	167,192	6.340	1,059,997.280	
CYFROWY POLSAT SA	23,495	23.440	550,722.800	
GRUPA AZOTY SA	3,853	27.580	106,265.740	
POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	70,529	9.510	670,730.790	
POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZEN SA	53,451	38.700	2,068,553.700	
JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA SA	6,170	65.200	402,284.000	
ALIOR BANK SA	9,405	62.000	583,110.000	
DINO POLSKA SA	4,709	88.150	415,098.350	
PLAY COMMUNICATIONS SA	15,228	17.160	261,312.480	
ポーランド・ズロチ 小計	620,629		20,195,688.750 (610,111,757)	
マレーシア・リン ギット				
AMMB HOLDINGS BHD	195,500	3.950	772,225.000	
GENTING PLANTATIONS BHD	18,800	9.360	175,968.000	
CIMB GROUP HOLDINGS BHD	419,200	5.660	2,372,672.000	
DIGI.COM BHD	288,700	4.390	1,267,393.000	
MALAYSIA AIRPORTS HOLDINGS BHD	91,320	8.350	762,522.000	
RHB BANK BHD	108,980	5.260	573,234.800	
HAP SENG CONSOLIDATED BHD	70,000	9.570	669,900.000	
TOP GLOVE CORP BHD	66,900	10.700	715,830.000	
GAMUDA BHD	194,600	2.300	447,580.000	
GENTING BHD	200,900	7.140	1,434,426.000	
YTL CORP BHD	283,710	1.150	326,266.500	
HONG LEONG FINANCIAL GROUP BHD	20,256	18.720	379,192.320	
HONG LEONG BANK BHD	62,308	20.300	1,264,852.400	
IJM CORP BHD	230,360	1.540	354,754.400	
IOI CORP BHD	187,213	4.510	844,330.630	

	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	43,200	24.680	1,066,176.000	
	FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	12,800	35.640	456,192.000	
	MALAYAN BANKING BHD	343,775	9.280	3,190,232.000	
	ALLIANCE BANK MALAYSIA BHD	88,400	4.100	362,440.000	
	MISC BHD	90,280	5.660	510,984.800	
	NESTLE MALAYSIA BHD	5,800	145.000	841,000.000	
	PPB GROUP BHD	57,360	16.760	961,353.600	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	19,600	26.000	509,600.000	
	PETRONAS GAS BHD	60,400	17.240	1,041,296.000	
	GENTING MALAYSIA BHD	281,900	4.410	1,243,179.000	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD	14,700	34.500	507,150.000	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	132,500	2.640	349,800.000	
	SP SETIA BHD	178,500	2.130	380,205.000	
	TENAGA NASIONAL BHD	281,150	14.280	4,014,822.000	
	UMW HOLDINGS BHD	39,000	4.400	171,600.000	
	DIALOG GROUP BHD	320,544	3.310	1,061,000.640	
	PUBLIC BANK BHD(LOCAL)	262,930	24.900	6,546,957.000	
	AIRASIA GROUP BHD	147,900	2.700	399,330.000	
	MY EG SERVICES BHD	165,800	1.470	243,726.000	
	SIME DARBY BERHAD	232,700	2.600	605,020.000	
	HARTALEGA HOLDINGS BHD	145,400	6.150	894,210.000	
	AXIATA GROUP BERHAD	264,600	4.010	1,061,046.000	
	MAXIS BHD	203,300	5.450	1,107,985.000	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	228,600	9.220	2,107,692.000	
	ASTRO MALAYSIA HOLDINGS BHD	140,500	1.460	205,130.000	
	IHH HEALTHCARE BHD	220,400	5.000	1,102,000.000	
	FGV HOLDINGS BHD	126,400	1.390	175,696.000	
	WESTPORTS HOLDINGS BHD	130,000	3.500	455,000.000	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDINGS BHD	153,100	4.830	739,473.000	
	SIME DARBY PROPERTY BHD	232,700	1.070	248,989.000	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	216,100	5.240	1,132,364.000	
	IOI PROPERTIES GROUP SDN BHD	174,548	1.380	240,876.240	
	マレーシア・リンギット 小計	7,453,634		46,293,672.330 (1,250,392,090)	
メキシコ・ペソ	ALFA SAB DE CV	264,100	22.960	6,063,736.000	
	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	51,400	115.930	5,958,802.000	
	EL PUERTO DE LIVERPOOL SAB DE CV	19,100	141.060	2,694,246.000	
	GRUPO TELEVISIA SAB	219,600	62.570	13,740,372.000	
	GRUPO BIMBO SAB DE CV	149,100	38.610	5,756,751.000	



	GRUMA SAB DE CV	19,445	229.310	4,458,932.950	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INFRAESTRUCTURA	20,260	196.220	3,975,417.200	
	GRUPO CARSO SAB DE CV	37,600	60.600	2,278,560.000	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE SAB DE CV	234,700	132.080	30,999,176.000	
	MEXICHEM SAB DE CV	103,425	63.410	6,558,179.250	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	14,695	335.300	4,927,233.500	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO SAB DE CV	156,700	31.320	4,907,844.000	
	ALSEA SAB DE CV	43,700	59.090	2,582,233.000	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL SURESTE SAB DE CV	17,990	354.440	6,376,375.600	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV	318,352	51.330	16,341,008.160	
	AMERICA MOVIL SAB DE CV	3,050,278	14.750	44,991,600.500	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA SA	198,800	28.600	5,685,680.000	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	43,400	116.080	5,037,872.000	
	WAL-MART DE MEXICO SAB DE CV	474,900	53.740	25,521,126.000	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL PACIFICO SAB DE CV	31,200	191.540	5,976,048.000	
	INFRAESTRUCTURA ENERGETICA NOVA SAB DE CV	53,200	89.310	4,751,292.000	
	BANCO SANTANDER MEXICO SA-B	174,090	28.230	4,914,560.700	
メキシコ・ペソ 小計		5,696,035		214,497,045.860 (1,269,822,511)	
ユーロ	PIRAEUS BANK S.A	25,000	1.170	29,250.000	
	ALPHA BANK A.E.	125,732	1.156	145,346.190	
	NATIONAL BANK OF GREECE	46,501	1.568	72,913.560	
	TITAN CEMENT CO. S.A.	5,217	19.000	99,123.000	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	24,351	9.520	231,821.520	
	FF GROUP	3,130	4.800	15,024.000	
	EUROBANK ERGASIAS	194,100	0.501	97,244.100	
	MOTOR OIL HELLAS CORINTH REFIN	5,847	22.400	130,972.800	
	OPAP SA	19,846	8.370	166,111.020	
	JUMBO SA	10,420	12.200	127,124.000	
ユーロ 小計		460,144		1,114,930.190 (145,074,716)	
韓国・ウォン	CHEIL WORLDWIDE INC	7,097	21,450.000	152,230,650.000	
	HANMI SCIENCE CO LTD	1,164	75,800.000	88,231,200.000	
	HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	3,477	75,800.000	263,556,600.000	

SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANC	2,595	277,500.000	720,112,500.000	
DB INSURANCE CO LTD	5,060	69,700.000	352,682,000.000	
COWAY CO LTD	4,439	80,800.000	358,671,200.000	
KT&G CORP	10,519	99,400.000	1,045,588,600.000	
S-1 CORPORATION	1,444	90,100.000	130,104,400.000	
KOREA GAS CORP	2,997	58,000.000	173,826,000.000	
CJ CORP	1,547	117,500.000	181,772,500.000	
KAKAO CORP	4,774	98,500.000	470,239,000.000	
CJ ENM CO LTD	987	238,000.000	234,906,000.000	
SK TELECOM CO LTD	1,859	270,000.000	501,930,000.000	
DAELIM INDUSTRIAL CO	2,649	79,600.000	210,860,400.000	
MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD	40,612	7,110.000	288,751,320.000	
NCSOFT CORPORATION	1,574	404,500.000	636,683,000.000	
LG UPLUS CORP	20,384	16,850.000	343,470,400.000	
DOOSAN HEAVY INDUSTRIES AND CONSTRUCTION CO LTD	7,766	12,600.000	97,851,600.000	
DAEWOO ENGINEERING & CONSTRUCT	13,540	5,210.000	70,543,400.000	
POSCO DAEWOO CORP	3,600	19,750.000	71,100,000.000	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD	810	1,047,000.000	848,070,000.000	
LG CHEM LTD	4,012	307,000.000	1,231,684,000.000	
LG CHEM LTD	726	180,000.000	130,680,000.000	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD	201	659,000.000	132,459,000.000	
SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD	37,095	43,900.000	1,628,470,500.000	
S-OIL CORP	4,133	129,000.000	533,157,000.000	
HANWHA CHEMICAL CORPORATION	10,493	16,750.000	175,757,750.000	
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	5,997	28,500.000	170,914,500.000	
LOTTE CHEMICAL CORPORATION	1,576	268,000.000	422,368,000.000	
HOTEL SHILLA CO LTD	2,826	82,200.000	232,297,200.000	
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	3,604	127,500.000	459,510,000.000	
HYUNDAI MOBIS	6,133	195,500.000	1,199,001,500.000	
SK HYNIX INC	52,126	69,000.000	3,596,694,000.000	
HYUNDAI ENGINEERING & CONSTRUCTION CO LTD	7,403	53,900.000	399,021,700.000	
HYUNDAI MOTOR CO	2,642	69,300.000	183,090,600.000	
HYUNDAI MOTOR CO	13,513	116,000.000	1,567,508,000.000	
HYUNDAI STEEL CO	7,476	49,950.000	373,426,200.000	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	22,788	14,300.000	325,868,400.000	
KCC CORP	554	295,500.000	163,707,000.000	
KIA MOTORS CORP	22,988	33,100.000	760,902,800.000	
KOREA ZINC CO LTD	834	392,500.000	327,345,000.000	

KOREA ELECTRIC POWER CORP	22,108	23,850.000	527,275,800.000	
HANWHA CORP	3,785	28,900.000	109,386,500.000	
KOREAN AIR CO LTD	5,301	25,450.000	134,910,450.000	
OCI COMPANY LTD	1,829	99,100.000	181,253,900.000	
CJ LOGISTICS	860	140,000.000	120,400,000.000	
KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	1,930	81,600.000	157,488,000.000	
KT CORP	2,048	29,000.000	59,392,000.000	
HLB INC	2,994	84,200.000	252,094,800.000	
LG ELECTRONICS INC	8,926	62,300.000	556,089,800.000	
LOTTE CORP	3,366	58,300.000	196,237,800.000	
HANSSEM CO LTD	1,100	63,900.000	70,290,000.000	
LG CORP	8,649	62,900.000	544,022,100.000	
NH INVESTMENT & SECURITIES CO LTD	13,362	12,100.000	161,680,200.000	
GS ENGINEERING & CONSTRUCTION	4,872	49,350.000	240,433,200.000	
NAVER CORP	2,531	704,000.000	1,781,824,000.000	
HYUNDAI DEPARTMENT STORE CO LTD	1,249	88,100.000	110,036,900.000	
DONGSUH CO INC	3,149	20,400.000	64,239,600.000	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO LTD	4,223	62,100.000	262,248,300.000	
OTTOGI CORP	112	670,000.000	75,040,000.000	
AMOREPACIFIC GROUP	2,818	73,200.000	206,277,600.000	
KANGWON LAND INC	10,655	28,150.000	299,938,250.000	
POSCO	6,891	257,000.000	1,770,987,000.000	
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	15,569	18,200.000	283,355,800.000	
SAMSUNG SDI CO LTD	4,950	227,000.000	1,123,650,000.000	
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO LTD	4,863	125,000.000	607,875,000.000	
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	436,407	43,100.000	18,809,141,700.000	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES CO LTD	42,202	7,250.000	305,964,500.000	
SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	77,783	34,650.000	2,695,180,950.000	
SHINSEGAE CO LTD	646	288,000.000	186,048,000.000	
YUHAN CORP	836	206,500.000	172,634,000.000	
HANON SYSTEMS	19,093	11,900.000	227,206,700.000	
HYUNDAI MARINE & FIRE INSURANCE CO LTD	6,480	39,800.000	257,904,000.000	
GS HOLDINGS CORP	4,842	51,700.000	250,331,400.000	
LG DISPLAY CO LTD	22,210	17,350.000	385,343,500.000	
CELLTRION INC	7,192	271,500.000	1,952,628,000.000	
VIROMED CO LTD	1,302	211,100.000	274,852,200.000	
HANA FINANCIAL GROUP	25,829	43,200.000	1,115,812,800.000	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	1,800	110,500.000	198,900,000.000	

CELLTRION PHARM INC	1,457	68,900.000	100,387,300.000		
LOTTE SHOPPING CO	1,227	202,500.000	248,467,500.000		
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LTD	6,421	90,900.000	583,668,900.000		
AMOREPACIFIC CORP	2,661	197,500.000	525,547,500.000		
AMOREPACIFIC CORP-PREF	848	116,000.000	98,368,000.000		
SAMSUNG CARD CO	2,877	34,800.000	100,119,600.000		
SK INNOVATION CO LTD	5,628	206,000.000	1,159,368,000.000		
CJ CHEILJEDANG CORP	870	312,000.000	271,440,000.000		
STX PAN OCEAN CO LTD	18,395	4,725.000	86,916,375.000		
KEPCO PLANT SERVICE & ENGINEERING CO LTD	2,170	30,200.000	65,534,000.000		
LG INNOTEK CO LTD	1,440	118,000.000	169,920,000.000		
SK HOLDINGS CO LTD	2,618	268,500.000	702,933,000.000		
KB FINANCIAL GROUP INC	35,095	52,800.000	1,853,016,000.000		
MEDY-TOX INC	409	517,800.000	211,780,200.000		
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES LTD	6,602	30,600.000	202,021,200.000		
BNK FINANCIAL GROUP INC	25,264	8,210.000	207,417,440.000		
HANMI PHARM CO LTD	610	433,500.000	264,435,000.000		
HANWHA LIFE INSURANCE CO LTD	27,836	4,795.000	133,473,620.000		
E-MART CO LTD	1,699	205,500.000	349,144,500.000		
DGB FINANCIAL GROUP INC	18,575	10,100.000	187,607,500.000		
GS RETAIL CO LTD	2,482	40,800.000	101,265,600.000		
HANKOOK TIRE CO LTD NEW	6,590	45,600.000	300,504,000.000		
HDC HYUNDAI DEVELOPMENT CO-ENGINEERING & CONSTRUCTION	3,444	42,200.000	145,336,800.000		
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOLDINGS CO LTD	942	375,000.000	353,250,000.000		
BGF RETAIL CO LTD	854	205,000.000	175,070,000.000		
ORION CORP REPUBLIC OF KOREA	2,071	96,800.000	200,472,800.000		
ORANGE LIFE INSURANCE LTD	3,735	30,650.000	114,477,750.000		
NETMARBLE CORP	2,446	126,000.000	308,196,000.000		
SAMSUNG SDS CO LTD	3,043	204,000.000	620,772,000.000		
WOORI BANK	41,071	16,150.000	663,296,650.000		
SAMSUNG C&T CORP	6,626	115,000.000	761,990,000.000		
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	1,432	467,000.000	668,744,000.000		
PEARL ABYSS CORP	534	197,400.000	105,411,600.000		
DOOSAN BOBCAT INC	2,723	38,050.000	103,610,150.000		
SILLAJEN INC	5,635	79,600.000	448,546,000.000		
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	3,490	80,500.000	280,945,000.000		
韓国・ウォン 小計	1,380,596		70,856,872,655.000 (7,014,830,393)		
香港・ドル	JIANGXI COPPER CO LTD	138,000	8.300	1,145,400.000	

JIANGSU EXPRESS	124,000	9.500	1,178,000.000	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD	156,000	4.130	644,280.000	
ANGANG STEEL CO LTD-H	104,000	6.280	653,120.000	
CHINA MOBILE LIMITED	559,000	78.500	43,881,500.000	
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	111,500	42.600	4,749,900.000	
DATANG INTERNATIONAL POWER GEN	288,000	1.820	524,160.000	
BEIJING ENTERPRISES	52,500	41.750	2,191,875.000	
HUANENG POWER INTERNATIONAL IN	400,000	4.710	1,884,000.000	
ALIBABA HEALTH INFORMATION TECHNOLOGY	322,000	6.160	1,983,520.000	
YANZHOU COAL MINING CO LTD	188,000	8.500	1,598,000.000	
HENGAN INTERNATIONAL GROUP	65,000	65.300	4,244,500.000	
HUADIAN POWER INTL CORP- H	144,000	2.730	393,120.000	
CHONGQING CHANGAN AUTOMOBILE	63,600	5.430	345,348.000	
CHINA EASTERN AIRLINES CORP LT	124,000	4.180	518,320.000	
CNOOC LTD	1,617,000	14.280	23,090,760.000	
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	270,000	10.760	2,905,200.000	
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LTD	426,000	15.080	6,424,080.000	
CHINA OVERSEAS LAND & INVESTME	343,120	22.600	7,754,512.000	
CHINA RESOURCES LAND LTD	252,888	24.200	6,119,889.600	
CITIC LTD	521,000	11.500	5,991,500.000	
CHINA TRAVEL INTERNATIONAL INV	198,000	2.220	439,560.000	
BEIJING CAPITAL INTERNATIONAL	162,000	8.070	1,307,340.000	
LENOVO GROUP LTD	642,000	4.670	2,998,140.000	
PETRO CHINA CO LTD	1,894,000	5.990	11,345,060.000	
SKYWORTH DIGITAL HOLDINGS LTD	162,000	2.010	325,620.000	
CHINA UNICOM HONG KONG LTD	552,742	8.810	4,869,657.020	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS CO LTD	145,390	24.650	3,583,863.500	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL COR	2,283,200	6.720	15,343,104.000	
TONG REN TANG TECHNOLOGIES CO	54,000	10.560	570,240.000	

TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	90,000	17.140	1,542,600.000	
KINGDEE INTERNATIONAL SOFTWARE GROUP CO LTD	220,000	6.810	1,498,200.000	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	68,800	65.800	4,527,040.000	
KUNLUN ENERGY COMPANY LTD	288,000	8.620	2,482,560.000	
TOWNGAS CHINA CO LTD	91,000	5.480	498,680.000	
COSCO SHIPPING PORTS LTD	162,000	8.350	1,352,700.000	
YUEXIU PROPERTY CO LTD	696,000	1.230	856,080.000	
CHINA MERCHANTS PORT HOLDINGS CO LTD	132,000	13.340	1,760,880.000	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	374,000	3.140	1,174,360.000	
SHENZHEN INTERNATIONAL HOLDING	84,500	14.620	1,235,390.000	
CHINA EVERBRIGHT LTD	82,000	12.580	1,031,560.000	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	157,400	21.000	3,305,400.000	
KINGBOARD HOLDINGS LTD	63,500	22.950	1,457,325.000	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LTD	448,000	12.900	5,779,200.000	
SHENZHEN INVESTMENT LTD	306,000	2.140	654,840.000	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LTD	86,000	31.300	2,691,800.000	
BYD CO LTD	55,500	47.500	2,636,250.000	
CHINA TELECOM CORP LTD	1,244,000	4.010	4,988,440.000	
CHINA OILFIELD SERVICES LTD	172,000	7.620	1,310,640.000	
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	1,220,000	0.940	1,146,800.000	
SINOTRANS LTD	190,000	2.900	551,000.000	
CHINA EVERBRIGHT INTERNATIONAL	324,592	6.290	2,041,683.680	
MMG LTD	220,000	3.080	677,600.000	
LEE & MAN PAPER MANUFACTURING LTD	170,000	6.670	1,133,900.000	
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	625,788	8.590	5,375,518.920	
AVICHINA INDUSTRY & TECHNOLOGY	225,000	4.570	1,028,250.000	
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS	197,200	13.280	2,618,816.000	
GREAT WALL MOTOR COMPANY LTD	300,500	4.650	1,397,325.000	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	680,000	16.660	11,328,800.000	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD	561,000	2.750	1,542,750.000	
SHANDONG WEIGAO GROUP MEDICAL-H	176,000	6.780	1,193,280.000	

SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	274,700	6.920	1,900,924.000	
WEICHAI POWER CO LTD	176,440	8.280	1,460,923.200	
CHINA SHIPPING DEVELOPMENT CO	100,000	4.100	410,000.000	
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEMICAL	353,000	3.640	1,284,920.000	
SHANGHAI INDUSTRIAL	46,000	16.020	736,920.000	
TINGYI HOLDING CORP	178,000	12.460	2,217,880.000	
TSINGTAO BREWERY CO LTD	40,000	33.700	1,348,000.000	
GUANGDONG INVESTMENTS LTD	266,000	14.120	3,755,920.000	
CHINA TRADITIONAL CHINESE MEDICINE HOLDINGS CO LTD	208,000	4.480	931,840.000	
CHINA RESOURCES BEER HOLDINGS	133,333	27.300	3,639,990.900	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO LTD	146,000	6.280	916,880.000	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	634,500	6.190	3,927,555.000	
CHINA SHIPPING CONTAINER LINES	247,000	0.920	227,240.000	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	248,000	22.700	5,629,600.000	
TENCENT HOLDINGS LTD	517,100	267.000	138,065,700.000	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	474,500	72.100	34,211,450.000	
BEIJING ENTERPRISES WATER GROUP LTD	560,000	3.810	2,133,600.000	
GOME RETAIL HOLDINGS LTD	970,240	0.720	698,572.800	
CHINA POWER INTERNATIONAL	350,000	1.610	563,500.000	
AIR CHINA / HONG KONG	198,000	6.550	1,296,900.000	
ZTE CORP	71,288	10.920	778,464.960	
SHANGHAI ELECTRIC GROUP CO LTD	250,000	2.510	627,500.000	
CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD	306,500	17.820	5,461,830.000	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO LTD	248,500	2.880	715,680.000	
BANK OF COMMUNICATIONS	752,205	5.520	4,152,171.600	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT HOLDINGS LTD	206,250	7.620	1,571,625.000	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	66,500	69.950	4,651,675.000	
CHINA CONSTRUCTION BANK	8,756,530	6.090	53,327,267.700	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP HOLDINGS LTD	69,000	84.000	5,796,000.000	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	262,000	7.620	1,996,440.000	

AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	160,000	8.820	1,411,200.000	
SSY GROUP LTD	144,000	6.450	928,800.000	
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS LTD	168,000	7.670	1,288,560.000	
CHINA NATIONAL BLDG MATERIAL	364,000	5.910	2,151,240.000	
BANK OF CHINA LTD	7,192,200	3.270	23,518,494.000	
SHUI ON LAND LTD	335,500	1.600	536,800.000	
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	122,500	15.180	1,859,550.000	
GREENTOWN CHINA HOLDINGS LTD	82,000	5.150	422,300.000	
GUANGZHOU R&F PROPERTIES CO LTD	100,400	12.080	1,212,832.000	
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	349,470	28.600	9,994,842.000	
IND & COMM BK OF CHINA - H	6,295,235	5.160	32,483,412.600	
ZHAOJIN MINING INDUSTRY CO LTD	96,000	6.280	602,880.000	
KINGBOARD LAMINATES HOLDING	104,000	6.300	655,200.000	
CHINA COMMUNICATIONS SERVICES	227,600	6.490	1,477,124.000	
CHINA COMMUNICATIONS CONSTRUCTION CO LTD	397,000	7.720	3,064,840.000	
CHINA COAL ENERGY CO	178,000	3.240	576,720.000	
HAITIAN INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	64,000	15.620	999,680.000	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC CO LTD	51,000	41.050	2,093,550.000	
HAIER ELECTRONICS GROUP CO LTD	129,000	17.640	2,275,560.000	
CHINA AGRI-INDUSTRIES HOLDINGS LTD	191,000	2.620	500,420.000	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD	684,142	7.980	5,459,453.160	
CHINA MOLYBDENUM CO LTD	369,000	2.720	1,003,680.000	
CHINA CITIC BANK-H	811,800	4.760	3,864,168.000	
KWG GROUP HOLDINGS LTD	121,000	5.670	686,070.000	
SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	64,700	71.300	4,613,110.000	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	97,000	30.350	2,943,950.000	
FOSUN INTERNATIONAL	230,028	11.980	2,755,735.440	
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP LTD	502,000	2.970	1,490,940.000	
SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD	308,500	2.850	879,225.000	
SOHO CHINA LTD	172,500	2.700	465,750.000	



KINGSOFT CORP LTD	76,000	12.080	918,080.000	
GCL POLY ENERGY HOLDINGS LTD	1,362,000	0.485	660,570.000	
SINOTRUK HONG KONG LTD	64,500	13.240	853,980.000	
CHINA RAILWAY GROUP LTD	338,000	7.410	2,504,580.000	
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS LTD	122,000	7.850	957,700.000	
BYD ELECTRONIC INTERNATIONAL CO LTD	79,000	8.690	686,510.000	
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION CORP	178,000	10.180	1,812,040.000	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	450,000	5.540	2,493,000.000	
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	232,000	27.500	6,380,000.000	
CHINA EVERGRANDE GROUP	237,000	19.300	4,574,100.000	
CRRC CORP LTD - H	386,450	6.810	2,631,724.500	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDINGS LTD	126,000	8.720	1,098,720.000	
CHONG SING HOLDINGS FINTECH GROUP LTD	1,656,000	0.390	645,840.000	
SUN ART RETAIL GROUP LTD	240,000	9.350	2,244,000.000	
BBMG CORP	222,000	2.320	515,040.000	
CHINA ZHONGWANG HOLDINGS LTD	145,200	3.290	477,708.000	
SINOPHARM GROUP CO	107,600	36.750	3,954,300.000	
CHINA RESOURCES CEMENT	248,000	7.930	1,966,640.000	
METALLURGICAL CORP OF CHINA LTD	276,000	2.020	557,520.000	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD	274,527	7.300	2,004,047.100	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL BANK	285,000	3.980	1,134,300.000	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP CORP	317,000	6.170	1,955,890.000	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD	79,100	17.320	1,370,012.000	
HUANENG RENEWABLES CORP LTD	472,000	2.160	1,019,520.000	
SIHUAN PHARMACEUTICAL HOLDINGS GROUP LTD	325,000	1.560	507,000.000	
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	218,000	19.980	4,355,640.000	
YUZHOU PROPERTIES CO LTD	166,000	2.800	464,800.000	
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	128,500	17.200	2,210,200.000	
NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	75,800	35.200	2,668,160.000	
CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	563,156	5.420	3,052,305.520	
KAISA GROUP HOLDINGS LTD	203,000	2.230	452,690.000	

XINJIANG GOLDWIND SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	60,000	6.570	394,200.000	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD	257,000	3.240	832,680.000	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA	2,697,000	3.530	9,520,410.000	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS LTD	55,000	15.600	858,000.000	
FAR EAST HORIZON LTD	199,000	7.050	1,402,950.000	
CITIC SECURITIES CO LTD	184,000	12.020	2,211,680.000	
FUTURE LAND DEVELOPMENT HOLDINGS LTD	172,000	4.160	715,520.000	
HAITONG SECURITIES CO LTD	294,000	6.550	1,925,700.000	
CHINA INTERNATIONAL MARINE CONTAINERS GROUP CO LTD	39,400	7.270	286,438.000	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROUP OF CHINA LTD	706,000	3.390	2,393,340.000	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	46,000	26.350	1,212,100.000	
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	334,000	3.040	1,015,360.000	
SINOPEC ENGINEERING GROUP CO LTD	121,500	8.000	972,000.000	
CHINA GALAXY SECURITIES CO LTD	328,500	3.330	1,093,905.000	
HANERGY THIN FILM POWER GROUP	986,000	0.000	0.000	
NEXTEER AUTOMOTIVE GROUP LTD	85,000	10.320	877,200.000	
CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS CO LTD	323,000	0.000	0.000	
GREENTOWN SERVICE GROUP CO LTD	96,000	5.180	497,280.000	
JIAYUAN INTERNATIONAL GROUP LTD	94,000	13.240	1,244,560.000	
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO LTD	42,400	15.500	657,200.000	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA CO LTD	267,000	4.680	1,249,560.000	
GENSCRIPT BIOTECH CORP	74,000	11.500	851,000.000	
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLDINGS CO LTD	95,000	10.980	1,043,100.000	
CHINA FIRST CAPITAL GROUP LTD	308,000	3.510	1,081,080.000	
CHINA TOWER CORP LTD	3,154,000	1.100	3,469,400.000	
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	276,000	2.270	626,520.000	

	CHINA CINDA ASSET MANAGEMENT CO LTD	796,000	1.830	1,456,680.000	
	LOGAN PROPERTY HOLDINGS CO LTD	134,000	7.380	988,920.000	
	CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS LTD	147,500	23.600	3,481,000.000	
	CHINA VANKE CO LTD-H	113,761	21.750	2,474,301.750	
	LUYE PHARMA GROUP LTD	108,000	5.740	619,920.000	
	CAR INC	68,000	6.190	420,920.000	
	HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	39,000	13.080	510,120.000	
	CGN POWER CO LTD	981,000	1.790	1,755,990.000	
	FULLSHARE HOLDINGS LTD	702,500	3.090	2,170,725.000	
	BAIC MOTOR CORP LTD	163,500	5.110	835,485.000	
	GF SECURITIES CO LTD	127,400	8.960	1,141,504.000	
	FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD	51,200	25.600	1,310,720.000	
	HUATAI SECURITIES CO LTD	112,600	10.600	1,193,560.000	
	3SBIO INC	130,000	11.340	1,474,200.000	
	LEGEND HOLDINGS CORP	31,500	20.750	653,625.000	
	CHINA RESOURCES PHARMACEUTICAL GROUP LTD	146,000	11.440	1,670,240.000	
	CHINA HUARONG ASSET MANAGEMENT CO LTD	904,000	1.360	1,229,440.000	
	CHINA LITERATURE LTD	17,200	40.950	704,340.000	
	DALI FOODS GROUP CO LTD	188,000	5.300	996,400.000	
	CHINA RAILWAY SIGNAL & COMMUNICATION CORP LTD	141,000	5.200	733,200.000	
	CHINA REINSURANCE GROUP CORP	525,000	1.390	729,750.000	
	MEITU INC	152,500	4.670	712,175.000	
	BOC AVIATION LTD	20,300	54.900	1,114,470.000	
	ZHONGAN ONLINE P&C INSURANCE CO LTD	15,500	26.300	407,650.000	
	CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CORP LTD	101,600	11.880	1,207,008.000	
	WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	44,500	62.400	2,776,800.000	
	HENG TEN NETWORKS GROUP LTD	2,096,000	0.280	586,880.000	
香港・ドル	小計	88,299,075		753,390,117.950 (10,788,546,489)	
台湾・ドル	ACER INC	278,532	20.650	5,751,685.800	
	ASUSTEK COMPUTER INC	64,554	239.000	15,428,406.000	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	46,616	105.000	4,894,680.000	
	ASIA CEMENT CORP	209,928	38.150	8,008,753.200	
	WALSIN TECHNOLOGY CORP	31,000	156.500	4,851,500.000	
	TAIWAN BUSINESS BANK	371,457	10.450	3,881,725.650	

VANGUARD INTERNATIONAL SEMICONDUCTOR CORP	85,000	54.000	4,590,000.000	
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO LTD	65,000	74.400	4,836,000.000	
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	54,975	54.500	2,996,137.500	
QUANTA COMPUTER INC	235,858	48.800	11,509,870.400	
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	90,070	45.600	4,107,192.000	
EVA AIRWAYS CORP	149,269	13.700	2,044,985.300	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	59,760	277.500	16,583,400.000	
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	509,345	17.500	8,913,537.500	
CHINA AIRLINES	232,156	8.980	2,084,760.880	
CHENG SHIN RUBBER INDUSTRY CO	188,169	43.350	8,157,126.150	
CHINA STEEL CORP	1,122,058	24.200	27,153,803.600	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD/TAIWAN	279,994	28.500	7,979,829.000	
ADVANTECH CO LTD	29,889	195.000	5,828,355.000	
COMPAL ELECTRONICS INC	360,304	17.450	6,287,304.800	
DELTA ELECTRONICS INC	188,663	111.500	21,035,924.500	
NANYA TECHNOLOGY CORP	110,000	48.500	5,335,000.000	
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	348,327	108.500	37,793,479.500	
AU OPTRONICS CORP	810,194	11.300	9,155,192.200	
TAIWAN MOBILE CO LTD	146,800	108.000	15,854,400.000	
EVERGREEN MARINE CORP	187,590	11.550	2,166,664.500	
FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	275,824	32.350	8,922,906.400	
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	29,825	162.500	4,846,562.500	
ECLAT TEXTILE CO LTD	18,322	341.000	6,247,802.000	
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	51,285	123.500	6,333,697.500	
FORMOSA PLASTICS CORP	402,633	103.000	41,471,199.000	
FORMOSA TAFFETA CO LTD	61,000	33.250	2,028,250.000	
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE CO	318,594	114.000	36,319,716.000	
GIANT MANUFACTURING	30,151	115.000	3,467,365.000	
MEDIATEK INC	135,507	210.500	28,524,223.500	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD	598,936	49.650	29,737,172.400	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	701,232	17.500	12,271,560.000	
HOTAI MOTOR CO LTD	25,000	228.500	5,712,500.000	
FAR EASTONE TELECOMMUNICATIONS CO LTD	144,000	71.800	10,339,200.000	

YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	876,141	14.950	13,098,307.950	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	737,920	50.100	36,969,792.000	
CHINA DEPT FINANCIAL HOLDING	1,183,403	10.200	12,070,710.600	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO LTD	947,168	21.600	20,458,828.800	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	1,492,532	70.100	104,626,493.200	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LTD	981,495	26.500	26,009,617.500	
LARGAN PRECISION CO LTD	10,220	3,235.000	33,061,700.000	
TAISHIN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	956,589	13.900	13,296,587.100	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING CO	831,061	10.450	8,684,587.450	
INVENTEC CO LTD	268,005	23.800	6,378,519.000	
HTC CORPORATION	79,832	30.400	2,426,892.800	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	218,845	33.050	7,232,827.250	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	990,443	10.250	10,152,040.750	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,580,048	21.150	33,418,015.200	
MACRONIX INTERNATIONAL	196,861	19.150	3,769,888.150	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO LTD	915,220	19.950	18,258,639.000	
POWERTECH TECHNOLOGY INC	61,560	69.400	4,272,264.000	
NAN YA PLASTICS CORP	465,828	76.100	35,449,510.800	
WISTRON CORP	266,916	17.000	4,537,572.000	
POU CHEN CORP	183,990	29.200	5,372,508.000	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CORP	435,297	70.200	30,557,849.400	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	51,392	319.000	16,394,048.000	
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	108,480	126.500	13,722,720.000	
PHISON ELECTRONICS CORP	16,658	194.500	3,239,981.000	
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	54,393	45.400	2,469,442.200	
RUENTEX INDUSTRIES LTD	68,715	54.000	3,710,610.000	
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	94,588	64.000	6,053,632.000	
STANDARD FOODS CORP	34,639	43.650	1,511,992.350	
SYNNEX TECHNOLOGY INTERNATIONAL CORP	144,899	34.000	4,926,566.000	
TAIWAN CEMENT CORP	406,561	37.600	15,286,693.600	
TECO ELECTRIC AND MACHINERY CO LTD	161,000	19.200	3,091,200.000	
TAIWAN SEMICONDUCTOR	2,233,083	227.500	508,026,382.500	

	UNITED MICROELECTRONICS CORP	1,073,525	13.750	14,760,968.750	
	WINBOND ELECTRONICS CORP	324,000	12.050	3,904,200.000	
	YAGEO CORP	23,160	388.000	8,986,080.000	
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	192,000	27.050	5,193,600.000	
	INNOLUX CORPORATION	820,345	9.110	7,473,342.950	
	WPG HOLDINGS CO LTD	130,203	37.750	4,915,163.250	
	HIWIN TECHNOLOGIES CORP	23,073	201.500	4,649,209.500	
	TAIMED BIOLOGICS INC	18,000	183.500	3,303,000.000	
	PEGATRON CORP	178,554	53.800	9,606,205.200	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	13,000	233.500	3,035,500.000	
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	38,000	109.000	4,142,000.000	
	CHAILEASE HOLDING CO LTD	101,737	92.000	9,359,804.000	
	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING LTD	48,385	62.600	3,028,901.000	
	TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL HOLDING	828,412	17.500	14,497,210.000	
	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	311,903	61.800	19,275,605.400	
	GLOBALWAFERS CO LTD	21,000	246.500	5,176,500.000	
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	15,000	198.500	2,977,500.000	
	GENERAL INTERFACE SOLUTION HOLDING LTD	18,000	105.000	1,890,000.000	
台湾・ドル	小計	30,279,896		1,578,163,076.430 (5,697,168,706)	
南アフリカ・ランド	BIDVEST GROUP LTD	29,572	175.910	5,202,010.520	
	CLICKS GROUP LTD	22,975	156.140	3,587,316.500	
	TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	44,326	78.000	3,457,428.000	
	DISCOVERY LTD	31,052	154.800	4,806,849.600	
	REDEFINE PROPERTIES LTD	469,360	9.550	4,482,388.000	
	GOLD FIELDS LTD	81,159	38.600	3,132,737.400	
	REMGRO LTD	46,304	186.840	8,651,439.360	
	THE FOSCHINI GROUP LTD	19,873	162.190	3,223,201.870	
	MMI HOLDINGS LTD	111,471	16.500	1,839,271.500	
	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	260,960	23.060	6,017,737.600	
	EXXARO RESOURCES LTD	25,340	146.500	3,712,310.000	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	3,704	968.520	3,587,398.080	
	LIBERTY HOLDINGS LTD	15,137	107.000	1,619,659.000	
	MTN GROUP LTD	151,630	84.000	12,736,920.000	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	38,047	136.880	5,207,873.360	
	TELKOM SA SOC LTD	31,588	49.700	1,569,923.600	
	FIRSTRAND LTD	303,471	60.050	18,223,433.550	

PSG GROUP LTD	15,546	210.500	3,272,433.000	
NASPERS LTD	39,866	2,681.280	106,891,908.480	
CORONATION FUND MANAGERS LTD	26,700	49.230	1,314,441.000	
NEDBANK GROUP LTD	36,512	238.140	8,694,967.680	
NETCARE LTD	105,465	23.860	2,516,394.900	
PICK'N PAY STORES LTD	31,255	64.910	2,028,762.050	
RMB HOLDINGS LTD	61,174	68.400	4,184,301.600	
ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	6,200	475.990	2,951,138.000	
SAPPI LTD	48,883	81.900	4,003,517.700	
SASOL LTD	50,151	520.820	26,119,643.820	
SHOPRITE HOLDINGS LTD	40,566	181.670	7,369,625.220	
MR PRICE GROUP LTD	23,411	222.050	5,198,412.550	
STANDARD BANK GROUP LTD	116,717	159.000	18,558,003.000	
SPAR GROUP LTD/THE	16,512	168.000	2,774,016.000	
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	88,009	48.040	4,227,952.360	
IMPERIAL HOLDINGS LTD	16,774	157.750	2,646,098.500	
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LTD	34,576	154.690	5,348,561.440	
ABSA GROUP LTD	64,032	144.620	9,260,307.840	
TIGER BRANDS LTD	16,282	246.000	4,005,372.000	
SANLAM LTD	154,608	71.040	10,983,352.320	
INVESTEC LTD	29,312	90.770	2,660,650.240	
KUMBA IRON ORE LTD	5,327	290.990	1,550,103.730	
PIONEER FOODS LTD	15,500	78.490	1,216,595.000	
MONDI LTD	10,866	347.470	3,775,609.020	
LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDINGS LTD	135,845	23.460	3,186,923.700	
RMI HOLDINGS	55,278	34.710	1,918,699.380	
VODACOM GROUP PTY LTD	55,182	119.560	6,597,559.920	
NEPI ROCKCASTLE PLC	32,983	125.960	4,154,538.680	
OLD MUTUAL LTD	443,070	21.130	9,362,069.100	
REINET INVESTMENTS SCA	14,237	254.460	3,622,747.020	
FORTRESS REIT LTD-A	102,950	17.060	1,756,327.000	
BID CORP LTD	29,931	275.620	8,249,582.220	
南アフリカ・ランド 小計	3,609,689		371,458,512.410 (2,860,230,545)	
合計	228,770,566		48,275,462,755 (48,275,462,755)	

## (2) 株式以外の有価証券

平成30年10月12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	1,300,875.000	15,090,150.000	
		FOMENTO ECONOMICO MEXICANO SAB DE CV	175,900.000	32,059,534.000	
	メキシコ・ペソ	小計	1,476,775.000	47,149,684.000 (279,126,129)	
投資信託受益証券 合計			1,476,775	279,126,129 (279,126,129)	
投資証券	トルコ・リラ	EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATIRIM	231,071.000	404,374.250	
	トルコ・リラ	小計	231,071.000	404,374.250 (7,666,936)	
	メキシコ・ペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	316,200.000	7,794,330.000	
	メキシコ・ペソ	小計	316,200.000	7,794,330.000 (46,142,434)	
	南アフリカ・ランド	FORTRESS REIT LTD-B	95,302.000	1,477,181.000	
		HYPROP INVESTMENTS LTD	22,174.000	1,998,320.880	
		RESILIENT REIT LTD	28,600.000	1,650,220.000	
南アフリカ・ランド	小計	146,076.000	5,125,721.880 (39,468,058)		
投資証券 合計			693,347	93,277,428 (93,277,428)	
合計				372,403,557 (372,403,557)	

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 47銘柄	10.44%	-%	-%	11.41%
アラブ首長国連邦・ディ ルハム	株式 10銘柄	0.60%	-%	-%	0.66%
インド・ルピー	株式 80銘柄	7.84%	-%	-%	8.56%
インドネシア・ルピア	株式 28銘柄	1.80%	-%	-%	1.97%
オフショア・人民元	株式 76銘柄	0.68%	-%	-%	0.74%
カタール・リアル	株式 11銘柄	0.96%	-%	-%	1.05%
コロンビア・ペソ	株式 9銘柄	0.44%	-%	-%	0.48%
タイ・バーツ	株式 34銘柄	2.35%	-%	-%	2.57%
チェコ・コルナ	株式 4銘柄	0.20%	-%	-%	0.21%
チリ・ペソ	株式 17銘柄	1.05%	-%	-%	1.15%
トルコ・リラ	株式 23銘柄 投資証券 1銘柄	0.59% -%	-% -%	-% 0.01%	0.67%
ハンガリー・フォリント	株式 3銘柄	0.27%	-%	-%	0.30%
パキスタン・ルピー	株式 5銘柄	0.06%	-%	-%	0.07%
フィリピン・ペソ	株式 23銘柄	0.92%	-%	-%	1.01%
ブラジル・レアル	株式 54銘柄	6.84%	-%	-%	7.48%
ポーランド・ズロチ	株式 22銘柄	1.15%	-%	-%	1.25%
マレーシア・リンギット	株式 47銘柄	2.35%	-%	-%	2.57%
メキシコ・ペソ	株式 22銘柄 投資信託 受益証券 2銘柄 投資証券 1銘柄	2.39% -% -%	-% 0.52% -%	-% -% 0.09%	3.28%
ユーロ	株式 10銘柄	0.27%	-%	-%	0.30%
韓国・ウォン	株式 115銘柄	13.19%	-%	-%	14.42%
香港・ドル	株式 205銘柄	20.29%	-%	-%	22.18%
台湾・ドル	株式 89銘柄	10.71%	-%	-%	11.71%
南アフリカ・ランド	株式 49銘柄 投資証券 3銘柄	5.38% -%	-% -%	-% 0.07%	5.96%

(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10月12日現在
資産の部		
流動資産		
預金		1,785,331,074
コール・ローン		484,022,298
国債証券		79,853,904,347
派生商品評価勘定		5,629,000
未収入金		18,769,071,746
未収利息		989,456,811
前払費用		163,520,452
流動資産合計		102,050,935,728
資産合計		102,050,935,728
負債の部		
流動負債		
未払解約金		570,785,000
流動負債合計		570,785,000
負債合計		570,785,000
純資産の部		
元本等		
元本	1	56,199,014,389
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）		45,281,136,339
元本等合計		101,480,150,728
純資産合計		101,480,150,728
負債純資産合計		102,050,935,728

## 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10月12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	53,347,180,448円
同期中追加設定元本額	44,866,082,826円
同期中一部解約元本額	42,014,248,885円
元本の内訳	
ファンド名	
DIAM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）	273,439,997円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	86,496,478円
たわらノーロード バランス（堅実型）	4,452,625円
たわらノーロード バランス（標準型）	13,664,153円
たわらノーロード バランス（積極型）	8,971,660円
たわらノーロード 最適化バランス（保守型）	91,216円
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	141,671円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	821,482円
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	310,046円
たわらノーロード 最適化バランス（積極型）	422,739円

マネックス資産設計ファンド エボリューション	58,646,088円
DIAM DC 8資産バラン スファンド(新興国10)	195,394,626円
DIAM DC 8資産バラン スファンド(新興国20)	168,433,969円
DIAM DC 8資産バラン スファンド(新興国30)	335,742,291円
投資のソムリエ	8,561,194,872円
クルーズコントロール	809,063,156円
投資のソムリエ<DC年金>	741,598,209円
DIAM 8資産バランスファ ンドN<DC年金>	136,462,429円
クルーズコントロール<DC年 金>	468,493円
DIAMコア資産設計ファンド (堅実型)	4,745,911円
DIAMコア資産設計ファンド (積極型)	12,527,493円
投資のソムリエ<DC年金>リ スク抑制型	193,344,732円
ダイナミック・ナビゲーション	177,753円
リスク抑制世界8資産バラン ス ファンド	3,643,414,698円
ワールドアセットバランス(基 本コース)	818,794,191円
ワールドアセットバランス(リ スク抑制コース)	2,855,738,733円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤ-2045)	2,174,682円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤ-2055)	1,585,888円
リスク抑制世界8資産バラン ス ファンド(DC)	1,132,324円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤ-2035)	3,151,566円
リスクコントロール世界資産分 散ファンド	457,307,222円
9資産分散投資・スタンダード <DC年金>	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)	14,137,760,067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)	2,310,945,945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)	5,140,437,726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)	4,748,109,654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)	3,811,858,365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)	2,928,571,287円
	P - O n eマルチアセット戦略 ファンド(適格機関投資家限 定)	3,731,406,297円
	計	56,199,014,389円
2 .	受益権の総数	56,199,014,389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11月8日 至 平成30年10月12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。
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。
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。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成30年10月12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。
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。
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。

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	平成30年10月12日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	
国債証券	2,609,301,152	
合計	2,609,301,152	

（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10月12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10月12日 現在			
	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	19,261,794,000	-	19,256,165,000	5,629,000
アメリカ・ドル	19,261,794,000	-	19,256,165,000	5,629,000
合計	19,261,794,000	-	19,256,165,000	5,629,000

## （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10月12日現在
1口当たり純資産額	1.8057円
(1万口当たり純資産額)	(18,057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10月12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	6,200,000.000	5,716,400.000	
		BRAZIL 4.25 01/07/25	12,500,000.000	12,046,875.000	
		BRAZIL 4.625 01/13/28	9,800,000.000	9,180,150.000	
		BRAZIL 4.875 01/22/21	10,600,000.000	10,766,950.000	
		BRAZIL 5.0 01/27/45	9,400,000.000	7,831,328.000	
		BRAZIL 5.625 01/07/41	6,700,000.000	6,169,025.000	
		BRAZIL 5.625 02/21/47	8,400,000.000	7,531,692.000	
		BRAZIL 6.0 04/07/26	6,200,000.000	6,506,900.000	
		BRAZIL 7.125 01/20/37	6,500,000.000	7,125,625.000	
		BRAZIL 8.25 01/20/34	5,000,000.000	5,902,000.000	
		BRAZIL 8.75 02/04/25	2,000,000.000	2,389,000.000	
		COLOMBIA 2.625 03/15/23	1,500,000.000	1,417,305.000	
		COLOMBIA 3.875 04/25/27	7,200,000.000	6,875,712.000	
		COLOMBIA 4.0 02/26/24	8,300,000.000	8,243,975.000	
		COLOMBIA 4.375 07/12/21	8,400,000.000	8,540,700.000	
		COLOMBIA 4.5 01/28/26	4,600,000.000	4,617,802.000	
		COLOMBIA 5.0 06/15/45	12,000,000.000	11,604,000.000	
		COLOMBIA 5.625 02/26/44	6,800,000.000	7,116,268.000	
		COLOMBIA 6.125 01/18/41	7,600,000.000	8,386,676.000	
		COLOMBIA 7.375 09/18/37	4,600,000.000	5,675,250.000	
		COLOMBIA 8.125 05/21/24	2,300,000.000	2,721,590.000	
		CROATIA 5.5 04/04/23	7,800,000.000	8,239,374.000	
		CROATIA 6.0 01/26/24	5,000,000.000	5,421,350.000	
		CROATIA 6.375 03/24/21	4,700,000.000	4,964,610.000	
		CROATIA 6.625 07/14/20	4,800,000.000	5,036,496.000	
		CROATIA 6.75 11/05/19	10,800,000.000	11,169,360.000	
		HUNGARY 5.375 02/21/23	5,700,000.000	6,022,677.000	
		HUNGARY 5.375 03/25/24	7,000,000.000	7,469,140.000	
		HUNGARY 5.75 11/22/23	9,000,000.000	9,716,670.000	
		HUNGARY 6.25 01/29/20	7,900,000.000	8,190,009.000	
		HUNGARY 6.375 03/29/21	10,400,000.000	11,063,000.000	
		HUNGARY 7.625 03/29/41	3,800,000.000	5,192,320.000	
		INDONESIA 3.375 04/15/23	4,500,000.000	4,334,670.000	
		INDONESIA 3.5 01/11/28	3,000,000.000	2,734,920.000	
		INDONESIA 3.75 04/25/22	5,600,000.000	5,534,592.000	
		INDONESIA 3.85 07/18/27	2,400,000.000	2,246,712.000	
INDONESIA 4.1 04/24/28	2,400,000.000	2,279,184.000			
INDONESIA 4.125 01/15/25	9,400,000.000	9,149,208.000			

INDONESIA 4.35 01/08/27	4,200,000.000	4,083,618.000	
INDONESIA 4.35 01/11/48	3,000,000.000	2,613,990.000	
INDONESIA 4.625 04/15/43	4,000,000.000	3,634,640.000	
INDONESIA 4.75 01/08/26	5,800,000.000	5,822,272.000	
INDONESIA 4.875 05/05/21	9,700,000.000	9,970,145.000	
INDONESIA 5.125 01/15/45	5,200,000.000	4,983,680.000	
INDONESIA 5.25 01/08/47	3,600,000.000	3,525,228.000	
INDONESIA 5.25 01/17/42	5,900,000.000	5,797,104.000	
INDONESIA 5.875 01/15/24	5,000,000.000	5,300,500.000	
INDONESIA 5.95 01/08/46	3,200,000.000	3,406,848.000	
INDONESIA 6.75 01/15/44	4,700,000.000	5,521,278.000	
INDONESIA 7.75 01/17/38	5,300,000.000	6,734,604.000	
PANAMA 3.75 03/16/25	5,000,000.000	4,955,050.000	
PANAMA 3.875 03/17/28	5,200,000.000	5,088,252.000	
PANAMA 4.5 05/15/47	4,000,000.000	3,852,920.000	
PANAMA 5.2 01/30/20	5,800,000.000	5,950,858.000	
PANAMA 6.7 01/26/36	8,400,000.000	10,227,000.000	
PANAMA 7.125 01/29/26	3,800,000.000	4,479,250.000	
PANAMA 9.375 04/01/29	4,300,000.000	6,052,250.000	
PERU 4.125 08/25/27	5,400,000.000	5,467,500.000	
PERU 5.625 11/18/50	11,400,000.000	12,964,536.000	
PERU 6.55 03/14/37	4,800,000.000	5,899,680.000	
PERU 7.35 07/21/25	9,800,000.000	11,830,560.000	
PHILIPPINES 3.0 02/01/28	5,600,000.000	5,104,736.000	
PHILIPPINES 3.7 02/02/42	3,800,000.000	3,398,302.000	
PHILIPPINES 3.7 03/01/41	5,600,000.000	5,036,472.000	
PHILIPPINES 3.95 01/20/40	5,200,000.000	4,847,336.000	
PHILIPPINES 4.0 01/15/21	3,400,000.000	3,443,248.000	
PHILIPPINES 4.2 01/21/24	4,800,000.000	4,880,928.000	
PHILIPPINES 5.0 01/13/37	3,600,000.000	3,848,796.000	
PHILIPPINES 5.5 03/30/26	2,800,000.000	3,035,172.000	
PHILIPPINES 6.375 01/15/32	2,800,000.000	3,369,716.000	
PHILIPPINES 6.375 10/23/34	5,000,000.000	6,109,850.000	
PHILIPPINES 6.5 01/20/20	3,600,000.000	3,756,852.000	

PHILIPPINES 7.75 01/14/31	5,100,000.000	6,737,967.000	
PHILIPPINES 9.5 02/02/30	5,200,000.000	7,552,792.000	
ROMANIA 4.375 08/22/23	7,000,000.000	7,036,750.000	
ROMANIA 4.875 01/22/24	3,400,000.000	3,484,966.000	
ROMANIA 6.125 01/22/44	3,400,000.000	3,724,802.000	
ROMANIA 6.75 02/07/22	8,700,000.000	9,447,504.000	
RUSSIA FOREIGN BOND 5.0 04/29/20	13,800,000.000	14,037,774.000	
RUSSIAN FEDERATION 03/31/30	10,333,500.000	11,265,788.370	
RUSSIAN FEDERATION 4.25 06/23/27	5,800,000.000	5,452,522.000	
RUSSIAN FEDERATION 4.5 04/04/22	6,000,000.000	6,052,980.000	
RUSSIAN FEDERATION 4.75 05/27/26	9,200,000.000	9,054,732.000	
RUSSIAN FEDERATION 4.875 09/16/23	8,000,000.000	8,185,920.000	
RUSSIAN FEDERATION 5.25 06/23/47	20,400,000.000	18,980,160.000	
RUSSIAN FEDERATION 5.625 04/04/42	8,200,000.000	8,379,662.000	
RUSSIAN FEDERATION 5.875 09/16/43	4,000,000.000	4,212,880.000	
SOUTH AFRICA 4.3 10/12/28	6,400,000.000	5,525,184.000	
SOUTH AFRICA 4.665 01/17/24	4,500,000.000	4,324,185.000	
SOUTH AFRICA 4.875 04/14/26	4,200,000.000	3,912,636.000	
SOUTH AFRICA 5.0 10/12/46	3,400,000.000	2,762,500.000	
SOUTH AFRICA 5.375 07/24/44	2,600,000.000	2,205,268.000	
SOUTH AFRICA 5.5 03/09/20	6,400,000.000	6,491,008.000	
SOUTH AFRICA 5.65 09/27/47	4,200,000.000	3,622,164.000	
SOUTH AFRICA 5.875 05/30/22	3,200,000.000	3,290,688.000	
SOUTH AFRICA 5.875 09/16/25	6,200,000.000	6,159,638.000	
UNITED MEXICAN STATES 3.5 01/21/21	5,200,000.000	5,211,388.000	
UNITED MEXICAN STATES 3.6 01/30/25	8,000,000.000	7,696,000.000	
UNITED MEXICAN STATES 3.625 03/15/22	4,500,000.000	4,506,930.000	

	UNITED MEXICAN STATES 3.75 01/11/28	7,200,000.000	6,759,000.000	
	UNITED MEXICAN STATES 4.0 10/02/23	10,100,000.000	10,119,493.000	
	UNITED MEXICAN STATES 4.125 01/21/26	6,400,000.000	6,284,800.000	
	UNITED MEXICAN STATES 4.15 03/28/27	9,200,000.000	8,927,404.000	
	UNITED MEXICAN STATES 4.35 01/15/47	5,000,000.000	4,392,500.000	
	UNITED MEXICAN STATES 4.6 01/23/46	8,400,000.000	7,589,484.000	
	UNITED MEXICAN STATES 4.6 02/10/48	5,800,000.000	5,263,500.000	
	UNITED MEXICAN STATES 4.75 03/08/44	12,800,000.000	11,840,000.000	
	UNITED MEXICAN STATES 5.55 01/21/45	8,400,000.000	8,694,000.000	
	UNITED MEXICAN STATES 5.75 10/12/2110	6,600,000.000	6,426,750.000	
	UNITED MEXICAN STATES 6.05 01/11/40	8,900,000.000	9,678,750.000	
	UNITED MEXICAN STATES 6.75 09/27/34	5,400,000.000	6,360,660.000	
	アメリカ・ドル 小計	696,033,500.000 (78,087,998,365)	711,773,815.370 (79,853,904,346)	
国債証券	合計	78,087,998,365 (78,087,998,365)	79,853,904,347 (79,853,904,347)	
合計		78,087,998,365 (78,087,998,365)	79,853,904,347 (79,853,904,347)	

(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 111銘柄	78.69%	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。

たわらノーロード バランス(堅実型)

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間(平成30年10月13日から平成31年4月12日まで)の中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による中間監査を受けております。

## 【中間財務諸表】

## 【たわらノーロード バランス(堅実型)】

## (1) 【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第1期 平成30年10月12日現在	第2期中間計算期間末 平成31年4月12日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	1,115,594	3,391,446
親投資信託受益証券	99,653,934	220,616,524
派生商品評価勘定	170,816	672
未収入金	-	185,000
流動資産合計	100,940,344	224,193,642
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	941	208,613
未払解約金	36,257	2,106,087
未払受託者報酬	6,093	16,973
未払委託者報酬	61,312	170,181
その他未払費用	1,142	3,144
流動負債合計	105,745	2,504,998
負債合計	105,745	2,504,998
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,102,799,857	1,217,438,776
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )	2,196,258	2,424,868
(分配準備積立金)	700,278	646,658
元本等合計	100,834,599	221,688,644
純資産合計	100,834,599	221,688,644
負債純資産合計	100,940,344	224,193,642

## ( 2 ) 【中間損益及び剰余金計算書】

( 単位 : 円 )

	第1期中間計算期間 自 平成29年11月8日 至 平成30年5月7日	第2期中間計算期間 自 平成30年10月13日 至 平成31年4月12日
<b>営業収益</b>		
有価証券売買等損益	10,129	7,352,590
為替差損益	14,817	142,653
営業収益合計	4,688	7,209,937
<b>営業費用</b>		
支払利息	14	506
受託者報酬	1,191	16,973
委託者報酬	12,384	170,181
その他費用	183	3,144
営業費用合計	13,772	190,804
営業利益又は営業損失( )	18,460	7,019,133
経常利益又は経常損失( )	18,460	7,019,133
中間純利益又は中間純損失( )	18,460	7,019,133
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額( )	14,521	263,274
期首剰余金又は期首欠損金( )	-	1,965,258
剰余金増加額又は欠損金減少額	5,259	215,177
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	5,259	215,177
剰余金減少額又は欠損金増加額	300,990	755,910
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	300,990	755,910
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金( )	299,670	4,249,868



## (3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第1期 平成30年10月12日現在	第2期中間計算期間末 平成31年4月12日現在
1. 1 期首元本額 期中追加設定元本額 期中一部解約元本額	1,000,000円 113,478,557円 11,678,700円	102,799,857円 128,470,728円 13,831,809円
2. 受益権の総数	102,799,857口	217,438,776口
3. 2 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は1,965,258円であります。	

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	第1期 平成30年10月12日現在	第2期中間計算期間末 平成31年4月12日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間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、中間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）

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

## 通貨関連

種類	第1期 平成30年10月12日現在				第2期中間計算期間末 平成31年4月12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	11,930,433	-	11,760,558	169,875	26,158,180	-	26,366,121	207,941
アメリカ・ドル	8,425,558	-	8,308,174	117,384	18,584,313	-	18,724,208	139,895
イギリス・ポンド	830,379	-	831,320	941	1,732,176	-	1,750,080	17,904
オーストラリア・ドル	311,748	-	303,316	8,432	709,150	-	715,950	6,800
カナダ・ドル	459,836	-	447,148	12,688	1,037,287	-	1,042,875	5,588
スイス・フラン	383,153	-	374,220	8,933	903,984	-	903,312	672
ユーロ	1,519,759	-	1,496,380	23,379	3,191,270	-	3,229,696	38,426
合計	11,930,433	-	11,760,558	169,875	26,158,180	-	26,366,121	207,941

(注) 時価の算定方法

1. 中間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。  
 中間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。  
 中間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。
  - ・ 中間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。
  - ・ 中間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. 中間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、中間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。

(1口当たり情報に関する注記)

	第1期 平成30年10月12日現在	第2期中間計算期間末 平成31年4月12日現在
1口当たり純資産額	0.9809円	1.0195円
(1万口当たり純資産額)	(9,809円)	(10,195円)

たわらノーロード バランス(標準型)

- (1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。
- なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間(平成30年10月13日から平成31年4月12日まで)の中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による中間監査を受けております。

## 【たわらノーロード バランス(標準型)】

## (1) 【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第1期 平成30年10月12日現在	第2期中間計算期間末 平成31年4月12日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	2,841,762	9,490,341
親投資信託受益証券	405,322,034	899,686,161
派生商品評価勘定	1,235,928	5,638
流動資産合計	409,399,724	909,182,140
<b>資産合計</b>	<b>409,399,724</b>	<b>909,182,140</b>
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	10,088	1,464,908
未払解約金	297,601	1,710,314
未払受託者報酬	24,341	68,130
未払委託者報酬	243,865	681,814
その他未払費用	4,760	12,864
流動負債合計	580,655	3,938,030
<b>負債合計</b>	<b>580,655</b>	<b>3,938,030</b>
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,411,216,976	1,865,182,877
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )	2,239,907	2,40,061,233
(分配準備積立金)	3,438,663	3,200,650
元本等合計	408,819,069	905,244,110
<b>純資産合計</b>	<b>408,819,069</b>	<b>905,244,110</b>
<b>負債純資産合計</b>	<b>409,399,724</b>	<b>909,182,140</b>

## (2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第1期中間計算期間 自 平成29年11月8日 至 平成30年5月7日	第2期中間計算期間 自 平成30年10月13日 至 平成31年4月12日
<b>営業収益</b>		
有価証券売買等損益	147,842	41,696,127
為替差損益	67,546	1,086,570
営業収益合計	215,388	40,609,557
<b>営業費用</b>		
支払利息	178	2,203
受託者報酬	4,705	68,130
委託者報酬	47,582	681,814
その他費用	877	12,864
営業費用合計	53,342	765,011
営業利益又は営業損失( )	162,046	39,844,546
経常利益又は経常損失( )	162,046	39,844,546
中間純利益又は中間純損失( )	162,046	39,844,546
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額( )	47,929	953,534
期首剰余金又は期首欠損金( )	-	2,397,907
剰余金増加額又は欠損金減少額	-	3,568,128
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	242,586
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	3,325,542
剰余金減少額又は欠損金増加額	458,381	-
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	57,351	-
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	401,030	-
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金( )	248,406	40,061,233

## (3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第1期 平成30年10月12日現在	第2期中間計算期間末 平成31年4月12日現在
1. 1 期首元本額 期中追加設定元本額 期中一部解約元本額	1,000,000円 435,043,104円 24,826,128円	411,216,976円 502,151,823円 48,185,922円
2. 受益権の総数	411,216,976口	865,182,877口
3. 2 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は2,397,907円であります。	

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	第1期 平成30年10月12日現在	第2期中間計算期間末 平成31年4月12日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間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、中間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）

該当事項はありません。



(デリバティブ取引等に関する注記)

## 通貨関連

種類	第1期 平成30年10月12日現在				第2期中間計算期間末 平成31年4月12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	89,118,288	-	87,892,448	1,225,840	182,918,255	-	184,377,525	1,459,270
アメリカ・ドル	60,598,228	-	59,791,980	806,248	124,721,886	-	125,660,736	938,850
イギリス・ポンド	5,945,956	-	5,952,845	6,889	11,634,448	-	11,754,704	120,256
イスラエル・シ ケル	97,109	-	95,666	1,443	189,442	-	193,502	4,060
オーストラリア・ ドル	2,260,651	-	2,203,032	57,619	4,767,067	-	4,812,775	45,708
カナダ・ドル	3,311,690	-	3,224,625	87,065	6,953,975	-	6,991,434	37,459
シンガポール・ド ル	407,307	-	399,399	7,908	908,002	-	913,752	5,750
スイス・フラン	2,783,500	-	2,721,600	61,900	6,082,363	-	6,077,840	4,523
スウェーデン・ク ローナ	886,597	-	865,692	20,905	1,820,799	-	1,835,532	14,733
デンマーク・ク ローネ	540,597	-	531,920	8,677	1,224,652	-	1,238,770	14,118
ニュージーラン ド・ドル	67,701	-	65,781	1,920	166,225	-	165,110	1,115
ノルウェー・ク ローネ	252,811	-	247,246	5,565	497,168	-	506,046	8,878
ユーロ	10,918,505	-	10,760,924	157,581	21,379,018	-	21,636,440	257,422
香港・ドル	1,047,636	-	1,031,738	15,898	2,573,210	-	2,590,884	17,674
合計	89,118,288	-	87,892,448	1,225,840	182,918,255	-	184,377,525	1,459,270

(注) 時価の算定方法

1. 中間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。
 

中間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。

中間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。

  - ・ 中間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。
  - ・ 中間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. 中間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、中間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。

(1口当たり情報に関する注記)

	第1期 平成30年10月12日現在	第2期中間計算期間末 平成31年4月12日現在
1口当たり純資産額	0.9942円	1.0463円
(1万口当たり純資産額)	(9,942円)	(10,463円)

たわらノーロード バランス(積極型)

- (1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。
- なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間(平成30年10月13日から平成31年4月12日まで)の中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による中間監査を受けております。

## 【たわらノーロード バランス(積極型)】

## (1) 【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第1期 平成30年10月12日現在	第2期中間計算期間末 平成31年4月12日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	3,928,340	8,309,062
親投資信託受益証券	519,870,011	905,503,364
派生商品評価勘定	1,833,052	6,563
流動資産合計	525,631,403	913,818,989
資産合計	525,631,403	913,818,989
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	14,896	1,700,152
未払解約金	530,153	2,757,040
未払受託者報酬	36,407	75,672
未払委託者報酬	364,325	757,270
その他未払費用	7,161	14,299
流動負債合計	952,942	5,304,433
負債合計	952,942	5,304,433
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1 525,731,528	1 857,724,162
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )	2 1,053,067	2 50,790,394
(分配準備積立金)	6,024,382	5,459,147
元本等合計	524,678,461	908,514,556
純資産合計	524,678,461	908,514,556
負債純資産合計	525,631,403	913,818,989

## (2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第1期中間計算期間 自 平成29年11月8日 至 平成30年5月7日	第2期中間計算期間 自 平成30年10月13日 至 平成31年4月12日
<b>営業収益</b>		
有価証券売買等損益	10,718	53,197,353
為替差損益	201,457	1,067,436
営業収益合計	212,175	52,129,917
<b>営業費用</b>		
支払利息	380	2,484
受託者報酬	8,358	75,672
委託者報酬	84,120	757,270
その他費用	1,598	14,299
営業費用合計	94,456	849,725
営業利益又は営業損失( )	117,719	51,280,192
経常利益又は経常損失( )	117,719	51,280,192
中間純利益又は中間純損失( )	117,719	51,280,192
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額( )	300,319	1,484,740
期首剰余金又は期首欠損金( )	-	1,053,067
剰余金増加額又は欠損金減少額	-	2,048,009
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	209,826
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	1,838,183
剰余金減少額又は欠損金増加額	854,696	-
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	60,982	-
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	793,714	-
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金( )	436,658	50,790,394

## (3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第1期 平成30年10月12日現在	第2期中間計算期間末 平成31年4月12日現在
1. 1 期首元本額 期中追加設定元本額 期中一部解約元本額	1,000,000円 607,175,973円 82,444,445円	525,731,528円 403,704,319円 71,711,685円
2. 受益権の総数	525,731,528口	857,724,162口
3. 2 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は1,053,067円であります。	

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	第1期 平成30年10月12日現在	第2期中間計算期間末 平成31年4月12日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間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、中間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）

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

## 通貨関連

種類	第1期 平成30年10月12日現在				第2期中間計算期間末 平成31年4月12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	132,036,328	-	130,218,172	1,818,156	212,290,984	-	213,984,573	1,693,589
アメリカ・ドル	89,775,187	-	88,579,467	1,195,720	144,745,128	-	145,834,704	1,089,576
イギリス・ポンド	8,807,737	-	8,817,930	10,193	13,510,972	-	13,650,624	139,652
イスラエル・シ ケル	140,965	-	138,870	2,095	219,997	-	224,712	4,715
オーストラリア・ ドル	3,358,024	-	3,272,620	85,404	5,531,373	-	5,584,410	53,037
カナダ・ドル	4,910,302	-	4,781,044	129,258	8,074,245	-	8,117,739	43,494
シンガポール・ド ル	598,492	-	586,872	11,620	1,055,245	-	1,061,928	6,683
スイス・フラン	4,129,063	-	4,037,040	92,023	7,053,309	-	7,048,064	5,245
スウェーデン・ク ローナ	1,315,802	-	1,284,777	31,025	2,112,701	-	2,129,796	17,095
デンマーク・ク ローネ	801,147	-	788,288	12,859	1,421,799	-	1,438,190	16,391
ニュージーラン ド・ドル	97,791	-	95,017	2,774	196,448	-	195,130	1,318
ノルウェー・ク ローネ	374,329	-	366,088	8,241	577,024	-	587,328	10,304
ユーロ	16,173,447	-	15,939,700	233,747	24,807,141	-	25,105,840	298,699
香港・ドル	1,554,042	-	1,530,459	23,583	2,985,602	-	3,006,108	20,506
合計	132,036,328	-	130,218,172	1,818,156	212,290,984	-	213,984,573	1,693,589

(注) 時価の算定方法

1. 中間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。
 

中間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。

中間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。

  - ・ 中間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。
  - ・ 中間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. 中間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、中間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。

(1口当たり情報に関する注記)

	第1期 平成30年10月12日現在	第2期中間計算期間末 平成31年4月12日現在
1口当たり純資産額	0.9980円	1.0592円
(1万口当たり純資産額)	(9,980円)	(10,592円)

（参考）

「たわらノーロード バランス（堅実型）」、「たわらノーロード バランス（標準型）」、「たわらノーロード バランス（積極型）」は、「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」受益証券、「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「J-REITインデックスファンド・マザーファンド」受益証券、「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「外国債券パッシブ・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、「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、中間貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同親投資信託の受益証券であります。

同親投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」の状況

貸借対照表

（単位：円）

科 目	注記 番号	平成30年10月12日現在	平成31年4月12日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		5,541,292,683	4,633,314,149
株式	2	275,713,338,725	267,286,829,800
派生商品評価勘定		-	27,115,004
未収入金		11,886,304	19,373,269
未収配当金		2,479,578,947	3,050,078,310
前払金		343,139,000	-
流動資産合計		284,089,235,659	275,016,710,532
資産合計		284,089,235,659	275,016,710,532
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		256,768,108	7,622,680
前受金		-	4,355,600
未払金		99,013,076	-
未払解約金		218,203,000	1,111,073,000
流動負債合計		573,984,184	1,123,051,280
負債合計		573,984,184	1,123,051,280
純資産の部			
元本等			
元本	1	108,086,790,523	109,259,530,939
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		175,428,460,952	164,634,128,313
元本等合計		283,515,251,475	273,893,659,252
純資産合計		283,515,251,475	273,893,659,252
負債純資産合計		284,089,235,659	275,016,710,532

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

## （貸借対照表に関する注記）

項目	平成30年10月12日現在	平成31年4月12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	116,880,020,103円	108,086,790,523円
同期中追加設定元本額	26,280,794,786円	20,165,407,197円
同期中一部解約元本額	35,074,024,366円	18,992,666,781円
元本の内訳		
ファンド名		
DIAM DC 国内株式インデックスファンド	10,894,193,839円	12,663,060,371円
DIAM国内株式パッシブ・ファンド	2,191,345,986円	2,168,058,243円
MITO ラップ型ファンド（安定型）	3,392,166円	2,776,822円
MITO ラップ型ファンド（中立型）	7,399,968円	6,407,379円
MITO ラップ型ファンド（積極型）	12,999,220円	10,231,251円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	23,906,761円	23,981,540円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	19,553,564円	17,383,331円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	16,730,426円	13,797,232円
たわらノーロード TOPIX	285,478,397円	424,450,343円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	58,149,026円	138,369,476円
たわらノーロード バランス（堅実型）	1,496,735円	3,499,027円
たわらノーロード バランス（標準型）	10,718,179円	25,155,957円

たわらノーロード バランス (積極型)	25,761,119円	46,807,638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)	183,257円	327,596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)	5,735,251円	14,822,793円
たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(安定成長 型)	18,753,835円	44,105,156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)	15,568,481円	33,970,221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)	37,051,050円	87,965,706円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(保守型)	40,828円	113,955円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定型)	70,944円	348,435円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定成長型)	624,356円	1,053,496円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(成長型)	535,203円	755,495円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(積極型)	1,596,424円	2,286,740円
D I A M国内株式インデックス ファンド< D C年金>	37,182,114,438円	38,035,371,746円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 1 安定型	816,531,612円	930,183,626円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 2 安定・成長型	2,847,785,821円	3,146,301,944円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 3 成長型	2,997,103,644円	3,265,847,751円
D I A M D C バランス3 0 インデックスファンド	335,014,767円	362,592,699円
D I A M D C バランス5 0 インデックスファンド	1,133,587,915円	1,201,139,471円
D I A M D C バランス7 0 インデックスファンド	1,076,982,515円	1,128,860,255円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型>	41,354,593円	41,151,160円
マネックス資産設計ファンド< 育成型>	1,081,393,977円	1,121,126,791円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	25,211,643円	26,814,455円
D I A M D C 8資産バラ ンスファンド(新興国1 0)	270,349,553円	298,987,432円
D I A M D C 8資産バラ ンスファンド(新興国2 0)	169,556,877円	204,079,632円
D I A M D C 8資産バラ ンスファンド(新興国3 0)	302,458,993円	357,516,716円
投資のソムリエ	2,603,577,387円	1,187,816,155円
クルーズコントロール	1,094,278,101円	1,096,017,260円
投資のソムリエ< D C年金>	226,394,802円	116,986,239円

D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	185,086,296円	229,870,413円
D I A M DC バランス・F(成長型)	241,068,650円	283,212,905円
クルーズコントロール<DC年金>	633,819円	768,190円
D I A Mコア資産設計ファンド(堅実型)	9,690,606円	10,502,085円
D I A Mコア資産設計ファンド(積極型)	25,515,262円	28,804,907円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	73,476,645円	73,451,697円
ダイナミック・ナビゲーションリスク抑制世界8資産バランスファンド	1,319,223円	525,651円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	1,388,764,282円	1,115,435,590円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	1,099,505円	1,230,593円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	793,044円	1,088,011円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	436,709円	510,392円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	1,452,537円	2,348,788円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	13,612,792円	17,571,153円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	235,255,917円	127,614,872円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	18,666円	5,190,940円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	-円	281,173円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	-円	281,173円
D I A Mワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	-円	281,173円
日米資産配分戦略ファンド(インカム重視型)(為替ヘッジあり)(適格機関投資家限定)	62,827,883円	69,109,314円
D I A Mグローバル・バランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	55,539,660円	170,735,594円
D I A Mグローバル・バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	110,246,818円	115,326,011円
D I A M国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	270,358,342円	279,228,920円
D I A M国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	14,259,379円	15,104,246円
D I A M国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	60,980,777円	63,194,214円

D I A M国内重視バランスファン ド30VA(適格機関投資家 限定)	15,221,233円	16,724,300円
D I A M国内重視バランスファン ド50VA(適格機関投資家 限定)	14,774,325円	13,710,162円
D I A M世界バランスファンド 40VA(適格機関投資家限 定)	29,165,799円	26,468,214円
D I A M世界バランスファンド 50VA(適格機関投資家限 定)	51,769,778円	53,161,852円
D I A Mバランスファンド25 VA(適格機関投資家限定)	971,742,856円	1,000,899,800円
D I A Mバランスファンド3 7.5VA(適格機関投資家限 定)	921,626,851円	961,878,655円
D I A Mバランスファンド50 VA(適格機関投資家限定)	2,591,259,916円	2,673,066,024円
D I A Mグローバル・アセッ ト・バランスVA(適格機関投 資家限定)	183,476,305円	191,105,727円
D I A Mグローバル・アセッ ト・バランスVA2(適格機関 投資家限定)	49,363,658円	51,608,997円
D I A M アクサ グローバ ル バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	524,439,521円	546,618,622円
D I A M世界アセットバランス ファンドVA(適格機関投資家 向け)	421,703,927円	308,797,608円
D I A Mグローバル 私募ファン ド(適格機関投資家向け)	10,313,671円	10,473,598円
D I A M世界バランスファンド 55VA(適格機関投資家限 定)	7,124,683円	3,257,762円
D I A M世界バランスファンド 35VA(適格機関投資家限 定)	57,585,354円	44,788,612円
D I A M世界アセットバランス ファンド2VA(適格機関投資 家限定)	10,226,006,007円	7,259,085,741円
D I A M世界アセットバランス ファンド40VA(適格機関投 資家限定)	378,222,399円	75,420,682円
D I A M世界アセットバランス ファンド25VA(適格機関投 資家限定)	1,642,740,603円	1,799,675,896円
D I A M世界アセットバランス ファンド3VA(適格機関投資 家限定)	9,442,344,440円	10,322,349,293円
D I A Mバランス30VA(適 格機関投資家限定)	3,071,696円	4,930,852円

	D I A Mバランス50VA(適格機関投資家限定)	2,949,084円	297,689円
	D I A Mバランス70VA(適格機関投資家限定)	3,687,674円	3,734,305円
	D I A M世界アセットバランスファンド4VA(適格機関投資家限定)	8,430,015,213円	9,209,443,633円
	D I A M世界バランス25VA(適格機関投資家限定)	65,631,920円	63,993,329円
	D I A M国内バランス30VA(適格機関投資家限定)	26,139,818円	25,852,788円
	D I A Mバランス20VA(適格機関投資家限定)	24,002,219円	26,313,803円
	D I A Mバランス40VA(適格機関投資家限定)	96,992円	107,163円
	D I A Mバランス60VA(適格機関投資家限定)	110,708円	120,862円
	D I A M世界アセットバランスファンド7VA(1212)(適格機関投資家限定)	405,365,089円	426,124,037円
	D I A M世界アセットバランスファンド7VA(1303)(適格機関投資家限定)	1,261,532,817円	1,366,625,210円
	D I A M世界アセットバランスファンド7VA(1306)(適格機関投資家限定)	1,669,062,351円	1,837,729,242円
	D I A M世界アセットバランスファンド7VA(1309)(適格機関投資家限定)	68,825,151円	72,976,941円
	計	108,086,790,523円	109,259,530,939円
2.	受益権の総数	108,086,790,523口	109,259,530,939口
3.	2 差入代用有価証券	株式 3,304,000,000円	株式 3,394,500,000円

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成30年10月12日現在	平成31年4月12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）

該当事項はありません。



(デリバティブ取引等に関する注記)

## 株式関連

種類	平成30年10月12日 現在				平成31年4月12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	5,208,993,500	-	4,952,320,000	256,673,500	6,390,313,400	-	6,409,935,000	19,621,600
合計	5,208,993,500	-	4,952,320,000	256,673,500	6,390,313,400	-	6,409,935,000	19,621,600

(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。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成30年10月12日現在	平成31年4月12日現在
1口当たり純資産額	2.6230円	2.5068円
(1万口当たり純資産額)	(26,230円)	(25,068円)

## 「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成30年10月12日現在	平成31年4月12日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		1,789,467,326	2,904,463,071
国債証券		285,051,548,800	235,479,857,500
地方債証券		21,978,991,778	22,333,816,779
特殊債券		17,157,003,948	18,029,768,675
社債券		15,127,644,060	14,176,031,420
未収利息		531,500,447	430,260,455
前払費用		20,245,776	9,732,026
流動資産合計		341,656,402,135	293,363,929,926
資産合計		341,656,402,135	293,363,929,926
負債の部			
流動負債			
未払金		1,222,747,000	-
未払解約金		352,701,000	970,632,000
流動負債合計		1,575,448,000	970,632,000
負債合計		1,575,448,000	970,632,000
純資産の部			
元本等			
元本	1	265,980,959,111	222,857,337,072
剰余金			
剰余金又は欠損金( )		74,099,995,024	69,535,960,854
元本等合計		340,080,954,135	292,393,297,926
純資産合計		340,080,954,135	292,393,297,926
負債純資産合計		341,656,402,135	293,363,929,926

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

## （貸借対照表に関する注記）

項目	平成30年10月12日現在	平成31年4月12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	283,369,079,957円 80,022,572,430円 97,410,693,276円	265,980,959,111円 58,316,361,791円 101,439,983,830円
元本の内訳 ファンド名		
D I A M国内債券パッシブ・ファンド	17,213,319,359円	18,538,919,752円
M I T O ラップ型ファンド（安定型）	116,744,280円	98,053,779円
M I T O ラップ型ファンド（中立型）	91,662,889円	82,246,467円
M I T O ラップ型ファンド（積極型）	28,460,338円	23,215,265円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	822,678,821円	853,555,568円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	242,214,024円	223,136,638円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	36,643,048円	31,300,209円
たわらノーロード 国内債券	4,817,544,677円	6,648,037,754円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	118,661,211円	254,312,438円
たわらノーロード バランス（堅実型）	28,242,803円	59,891,315円
たわらノーロード バランス（標準型）	53,757,715円	113,537,404円
たわらノーロード バランス（積極型）	10,644,651円	17,190,013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）	5,245,008円	7,791,762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）	74,013,081円	137,782,578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）	94,847,777円	171,399,075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）	26,936,285円	46,931,665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)	13,511,245円	14,673,502円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(保守型)	1,245,980円	3,047,217円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定型)	660,435円	2,690,825円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定成長型)	2,989,789円	3,651,993円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(成長型)	675,145円	714,123円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(積極型)	17,517円	17,517円
D I A M国内債券インデックス ファンド< D C年金>	12,871,301,141円	13,252,487,617円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 1 安定型	5,951,215,208円	6,110,390,220円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 2 安定・成長型	8,557,028,547円	8,548,716,549円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 3 成長型	3,470,237,031円	3,401,223,759円
D I A M D C バランス3 0 インデックスファンド	1,837,771,482円	1,792,490,668円
D I A M D C バランス5 0 インデックスファンド	2,032,813,435円	1,973,088,952円
D I A M D C バランス7 0 インデックスファンド	316,274,220円	308,704,546円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型>	88,374,891円	87,183,872円
マネックス資産設計ファンド< 育成型>	2,317,324,650円	2,376,748,298円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	4,391,950円	2,490,772円
D I A M D C 8資産バラ ンスファンド(新興国1 0)	3,186,425,011円	3,237,527,938円
D I A M D C 8資産バラ ンスファンド(新興国2 0)	756,301,058円	806,207,052円
D I A M D C 8資産バラ ンスファンド(新興国3 0)	161,357,166円	169,080,945円
投資のソムリエ	9,687,855,915円	4,557,086,188円
クルーズコントロール	2,306,772,131円	2,099,756,582円
投資のソムリエ< D C年金>	841,937,321円	449,706,296円
D I A M 8資産バランスファ ンドN< D C年金>	2,259,771,712円	2,511,207,678円
D I A M D C バランス・F (成長型)	286,078,562円	296,038,436円
クルーズコントロール< D C年 金>	1,335,920円	1,471,499円
D I A Mコア資産設計ファンド (堅実型)	6,776,762円	6,730,841円
D I A Mコア資産設計ファンド (積極型)	17,808,694円	18,359,905円
投資のソムリエ< D C年金>リ スク抑制型	644,288,090円	478,675,883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	515,269円 12,200,329,309円	751,240円 7,290,177,041円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2045)	2,416,181円	1,686,598円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2055)	1,740,009円	1,488,746円
リスク抑制世界8資産バランス ファンド(DC)	3,821,192円	3,354,116円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2035)	3,490,471円	2,825,226円
4資産分散投資・スタンダード <DC年金>	75,271,661円	87,919,051円
リスクコントロール世界資産分 散ファンド	758,397,642円	1,013,020,634円
9資産分散投資・スタンダード <DC年金>	290,676円	74,513,442円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2040)	-円	389,686円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2050)	-円	389,686円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2060)	-円	389,686円
DIAMエマージング債券ファ ンド	9,450,010円	9,450,010円
DIAM国内債券パッシブファ ンド(適格機関投資家向け)	22,706,710,305円	7,855,574,077円
DIAMワールドバランス25 VA(適格機関投資家限定)	451,828,315円	429,578,182円
One収益追求型マルチアセッ ト戦略ファンド(適格機関投資 家限定)	-円	2,650,787,553円
One収益追求型マルチアセッ ト戦略ファンドII(適格機関 投資家限定)	-円	2,646,517,337円
One収益追求型マルチアセッ ト戦略ファンドIII(適格機 関投資家限定)	-円	2,631,578,948円
DIAMグローバル・バランス ファンド25VA(適格機関投 資家限定)	289,466,887円	261,696,785円
DIAMグローバル・バランス ファンド50VA(適格機関投 資家限定)	236,494,470円	210,992,596円
DIAM国際分散バランスファ ンド30VA(適格機関投資家 限定)	72,823,300円	66,672,886円
DIAM国際分散バランスファ ンド50VA(適格機関投資家 限定)	200,165,850円	179,266,800円
DIAM国内重視バランスファ ンド30VA(適格機関投資家 限定)	83,310,095円	79,085,471円

D I A M国内重視バランスファン ド5 0 V A ( 適格機関投資家 限定 )	43,155,088円	34,566,256円
D I A M世界バランスファンド 4 0 V A ( 適格機関投資家限 定 )	95,738,566円	75,081,969円
D I A M世界バランスファンド 5 0 V A ( 適格機関投資家限 定 )	169,898,524円	150,807,546円
D I A Mバランスファンド2 5 V A ( 適格機関投資家限定 )	5,671,947,788円	5,048,339,364円
D I A Mバランスファンド3 7 . 5 V A ( 適格機関投資家限 定 )	3,025,448,569円	2,728,317,215円
D I A Mバランスファンド5 0 V A ( 適格機関投資家限定 )	5,669,701,197円	5,053,823,406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 )	602,332,656円	542,211,925円
D I A Mグローバル・アセッ ト・バランスV A 2 ( 適格機関 投資家限定 )	269,865,242円	244,146,269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 )	3,452,703,759円	3,102,506,498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 )	923,203,788円	583,770,492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 )	194,752,933円	188,050,355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 )	46,910,967円	18,491,174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 )	97,843,684円	68,878,786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 )	59,694,379,629円	36,602,775,937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 )	827,727,378円	142,598,138円
D I A M世界アセットバランス ファンド2 5 V A ( 適格機関投 資家限定 )	7,191,254,876円	6,807,951,794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 )	27,546,015,188円	26,024,659,078円
D I A Mバランス3 0 V A ( 適 格機関投資家限定 )	53,798,122円	74,798,009円
D I A Mバランス5 0 V A ( 適 格機関投資家限定 )	16,094,725円	1,409,737円

D I A Mバランス70VA(適格機関投資家限定)	8,024,060円	7,060,380円
D I A M世界アセットバランスファンド4VA(適格機関投資家限定)	30,749,110,925円	29,028,382,531円
D I A M世界バランス25VA(適格機関投資家限定)	469,748,503円	398,905,432円
D I A M国内バランス30VA(適格機関投資家限定)	133,450,015円	114,101,434円
D I A Mバランス20VA(適格機関投資家限定)	526,036,110円	499,031,047円
D I A Mバランス40VA(適格機関投資家限定)	737,508円	713,239円
D I A Mバランス60VA(適格機関投資家限定)	400,694円	381,909円
計	265,980,959,111円	222,857,337,072円
2. 受益権の総数	265,980,959,111口	222,857,337,072口

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成30年10月12日現在	平成31年4月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

## （有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

## （デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

## （1口当たり情報に関する注記）

	平成30年10月12日現在	平成31年4月12日現在
1口当たり純資産額	1,2786円	1,3120円
（1万口当たり純資産額）	（12,786円）	（13,120円）



## 「J-REITインデックスファンド・マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

(単位:円)

科 目	注記 番号	平成30年10月12日現在	平成31年4月12日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		412,192,140	1,202,181,958
投資証券		30,974,659,260	32,139,392,100
派生商品評価勘定		2,770,092	8,561,592
未収入金		4,123,781,900	-
未収配当金		372,030,177	327,952,223
差入委託証拠金		10,492,092	11,545,092
流動資産合計		35,895,925,661	33,689,632,965
資産合計		35,895,925,661	33,689,632,965
負債の部			
流動負債			
前受金		8,561,592	7,859,592
未払金		-	55,128,782
未払解約金		933,441,100	659,750,000
流動負債合計		942,002,692	722,738,374
負債合計		942,002,692	722,738,374
純資産の部			
元本等			
元本	1	18,823,627,962	16,233,655,149
剰余金			
剰余金又は欠損金( )		16,130,295,007	16,733,239,442
元本等合計		34,953,922,969	32,966,894,591
純資産合計		34,953,922,969	32,966,894,591
負債純資産合計		35,895,925,661	33,689,632,965

## 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	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。
2 . デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3 . 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

## （貸借対照表に関する注記）

項目	平成30年10月12日現在	平成31年4月12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	21,270,304,083円	18,823,627,962円
同期中追加設定元本額	14,058,053,872円	12,429,899,946円
同期中一部解約元本額	16,504,729,993円	15,019,872,759円
元本の内訳		
ファンド名		
MITO ラップ型ファンド（安定型）	280,843円	401,306円
MITO ラップ型ファンド（中立型）	1,043,545円	1,033,619円
MITO ラップ型ファンド（積極型）	2,059,335円	1,548,925円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	1,947,882円	3,503,591円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	2,803,635円	2,804,347円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	2,608,500円	2,088,113円
たわらノーロード 国内リート	1,507,521,334円	2,194,383,411円
たわらノーロード 国内リート<ラップ向け>	581,568,842円	689,572,688円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	84,219,485円	171,335,090円
たわらノーロード バランス（堅実型）	1,085,989円	2,158,279円
たわらノーロード バランス（標準型）	22,327,336円	44,498,125円
たわらノーロード バランス（積極型）	37,826,155円	57,959,499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)	10,219,217円	17,829,022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)	34,805,451円	58,944,458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)	23,100,049円	37,716,579円
たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(積極型)	47,696,714円	87,134,691円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定型)	158,328円	628,557円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定成長型)	1,390,993円	1,689,858円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(成長型)	916,194円	1,118,129円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(積極型)	2,509,126円	2,750,621円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型>	14,015,062円	12,063,581円
マネックス資産設計ファンド< 育成型>	367,133,345円	328,658,062円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	2,122,432円	3,869,053円
D I A M D C 8資産 balan スファンド(新興国10)	113,081,002円	110,530,283円
D I A M D C 8資産 balan スファンド(新興国20)	98,264,882円	98,788,849円
D I A M D C 8資産 balan スファンド(新興国30)	199,795,556円	196,185,572円
投資のソムリエ	2,696,770,852円	2,626,252,529円
投資のソムリエ<DC年金>	234,092,796円	259,695,816円
D I A M 8資産 balan スファ ンドN<DC年金>	80,069,705円	81,718,845円
投資のソムリエ<DC年金>リ スク抑制型	93,638,129円	108,379,773円
ダイナミック・ナビゲーション リスク抑制世界8資産 balan スファンド	535,629円	481,020円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2045)	1,777,279,186円	1,650,955,375円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2055)	713,168円	974,315円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2055)	517,033円	860,526円
リスク抑制世界8資産 balan スファンド(DC)	559,025円	758,860円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2035)	1,030,966円	1,645,626円
リスクコントロール世界資産分 散ファンド	298,782,794円	230,177,514円
9資産分散投資・スタンダード <DC年金>	8,057円	1,927,860円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2040)	-円	224,564円

投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2050)	- 円	224,564円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2060)	- 円	224,564円
Jリートインデックスファンド (DC)	7,708,043円	11,689,620円
DIAM J-REITイン デックス私募ファンド2012 12(適格機関投資家限定)	90,762,161円	88,960,407円
DIAM J-REITイン デックス私募ファンド2014 01(適格機関投資家限定)	820,082,232円	803,967,943円
DIAM J-REITイン デックスファンド(適格機関投 資家向け)	7,928,752,440円	4,599,473,533円
日米資産配分戦略ファンド(イン カム重視型)(為替ヘッジあ り)(適格機関投資家限定)	63,619,023円	191,001,640円
DIAMグローバル 私募ファ ンド(適格機関投資家向け)	14,402,370円	15,360,153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)	880,959,211円	1,429,505,794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)	672,843,910円	- 円
計	18,823,627,962円	16,233,655,149円
2. 受益権の総数	18,823,627,962口	16,233,655,149口

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成30年10月12日現在	平成31年4月12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）

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

## 不動産投信関連

種類	平成30年10月12日 現在				平成31年4月12日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引  不動産投信指数先物 取引  買 建	607,932,000	-	610,740,000	2,808,000	645,840,000	-	654,439,500	8,599,500
合計	607,932,000	-	610,740,000	2,808,000	645,840,000	-	654,439,500	8,599,500

(注) 1. 時価の算定方法

不動産投信指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成30年10月12日現在	平成31年4月12日現在
1口当たり純資産額	1.8569円	2.0308円
(1万口当たり純資産額)	(18,569円)	(20,308円)

## 「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10月12日現在	平成31年4月12日現在
資産の部			
流動資産			
預金		10,075,136,166	7,076,249,628
コール・ローン		596,850,688	134,757,050
株式		290,425,195,264	353,470,429,702
投資信託受益証券		698,118,371	828,114,981
投資証券		6,303,157,544	8,729,811,617
派生商品評価勘定		18,567,265	121,830,178
未収入金		188,087,295	18,421,943
未収配当金		336,342,104	623,838,795
差入委託証拠金		2,833,142,613	1,935,397,880
流動資産合計		311,474,597,310	372,938,851,774
資産合計		311,474,597,310	372,938,851,774
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		727,057,421	5,559,447
未払解約金		887,541,000	842,712,000
流動負債合計		1,614,598,421	848,271,447
負債合計		1,614,598,421	848,271,447
純資産の部			
元本等			
元本	1	89,642,239,133	101,020,730,473
剰余金			
剰余金又は欠損金( )		220,217,759,756	271,069,849,854
元本等合計		309,859,998,889	372,090,580,327
純資産合計		309,859,998,889	372,090,580,327
負債純資産合計		311,474,597,310	372,938,851,774

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

<p>1. 有価証券の評価基準及び評価方法</p>	<p>株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
<p>2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法</p>	<p>先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>為替予約取引 原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
<p>3. 収益及び費用の計上基準</p>	<p>受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>
<p>4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項</p>	<p>外貨建取引等の処理基準 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10月12日現在	平成31年4月12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	87,780,369,310円	89,642,239,133円
同期中追加設定元本額	24,048,653,617円	26,313,224,825円
同期中一部解約元本額	22,186,783,794円	14,934,733,485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	2,638,181,967円	2,463,990,777円
M I T O ラップ型ファンド(安定型)	2,913,395円	2,983,123円
M I T O ラップ型ファンド(中立型)	8,722,459円	7,633,761円
M I T O ラップ型ファンド(積極型)	17,210,299円	11,545,416円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	20,527,857円	26,003,896円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	23,048,530円	20,709,909円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	22,143,577円	15,567,979円
たわらノーロード 先進国株式	7,715,472,661円	9,057,536,182円
たわらノーロード 先進国株式<ラップ向け>	424,170円	423,588円
たわらノーロード 先進国株式<為替ヘッジあり>	913,386,536円	1,139,490,237円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	43,357,338円	95,107,883円
たわらノーロード バランス(堅実型)	3,180,770円	7,358,152円
たわらノーロード バランス(標準型)	30,643,847円	66,266,603円
たわらノーロード バランス(積極型)	58,912,437円	99,306,311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)	200,628円	338,089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)	13,473,000円	23,628,183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)	39,630,983円	67,192,687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)	30,040,456円	52,326,211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)	70,805,494円	128,301,657円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	14,928円	39,745円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	61,750円	243,228円

たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	642,860円	817,423円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	554,670円	690,019円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	1,827,756円	2,218,265円
DIAM外国株式インデックスファンド<DC年金>	39,512,031,956円	40,486,415,855円
DIAMバランス・ファンド<DC年金> 1 安定型	158,416,607円	170,576,657円
DIAMバランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型	838,916,152円	882,529,653円
DIAMバランス・ファンド<DC年金> 3 成長型	1,056,140,169円	1,086,873,138円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	123,352,569円	127,447,207円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	357,204,541円	360,157,922円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	318,837,293円	319,459,047円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	30,441,363円	29,147,086円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	796,380,003円	793,874,061円
マネックス資産設計ファンドエボリューション	209,146,305円	200,950,172円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	196,337,172円	210,522,133円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	124,912,903円	142,329,955円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	221,831,396円	249,403,292円
投資のソムリエ	2,561,519,510円	1,814,508,893円
クルーズコントロール	407,756,197円	377,119,771円
投資のソムリエ<DC年金>	222,689,229円	178,936,611円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	135,266,314円	161,531,099円
DIAM DC バランス・F(成長型)	85,144,549円	93,327,739円
クルーズコントロール<DC年金>	236,244円	264,280円
DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)	2,405,749円	2,403,581円
DIAMコア資産設計ファンド(積極型)	6,300,167円	6,609,443円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	70,852,416円	71,221,054円
ダイナミック・ナビゲーション	1,428,890円	1,499,638円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	1,340,930,384円	1,084,088,064円
ワールドアセットバランス(基本コース)	609,630,220円	538,208,747円

ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	2,115,016,080円	2,085,654,998円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	1,288,905円	1,460,617円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	928,926円	1,291,637円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	419,590円	492,897円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	1,765,184円	1,207,534円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	5,073,861円	6,029,076円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	225,974,073円	155,880,500円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	13,989円	3,566,357円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	-円	334,672円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	-円	334,672円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	-円	334,672円
DIAM外国株式インデックスファンドVA(適格機関投資家専用)	91,118,948円	88,543,691円
DIAM外国株式パッシブ私募ファンド(適格機関投資家向け)	2,865,678,103円	2,365,730,642円
DIAM先進国株式パッシブファンド(適格機関投資家限定)	158,341,575円	12,396,554,671円
外国株式パッシブ・ファンド2(適格機関投資家限定)	206,237,678円	206,133,975円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	20,111,940円	20,682,097円
DIAMグローバル・バランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	82,409,794円	80,564,707円
DIAMグローバル・バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	202,104,662円	195,036,692円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	10,658,870円	10,550,883円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	68,391,773円	66,247,792円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	5,688,290円	5,840,568円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	7,362,707円	6,385,786円

D I A M世界バランスファンド 4 0 V A ( 適格機関投資家限 定)	21,802,018円	18,487,694円
D I A M世界バランスファンド 5 0 V A ( 適格機関投資家限 定)	58,081,886円	55,730,669円
D I A Mバランスファンド2 5 V A ( 適格機関投資家限定)	484,094,127円	465,912,533円
D I A Mバランスファンド3 7 . 5 V A ( 適格機関投資家限 定)	602,767,403円	587,828,469円
D I A Mバランスファンド5 0 V A ( 適格機関投資家限定)	1,936,996,412円	1,867,072,125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)	684,969,447円	667,491,649円
D I A Mグローバル・アセッ ト・バランスV A 2 ( 適格機関 投資家限定)	110,822,092円	108,139,533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)	785,732,551円	763,956,210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)	104,542,172円	71,720,329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)	24,066,858円	10,238,600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)	17,108,371円	12,605,625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)	5,094,268,968円	3,379,149,110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)	282,718,187円	52,680,850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)	1,227,955,973円	1,257,063,303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)	4,705,201,284円	4,805,853,704円
D I A Mバランス3 0 V A ( 適 格機関投資家限定)	11,502,672円	17,233,157円
D I A Mバランス5 0 V A ( 適 格機関投資家限定)	8,825,591円	833,729円
D I A Mバランス7 0 V A ( 適 格機関投資家限定)	10,114,789円	9,579,558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)	6,301,456,431円	6,432,778,281円
	D I A Mバランス2 0 V A (適 格機関投資家限定)	53,919,416円	55,155,631円
	D I A Mバランス4 0 V A (適 格機関投資家限定)	217,282円	226,151円
	D I A Mバランス6 0 V A (適 格機関投資家限定)	248,614円	255,030円
	計	89,642,239,133円	101,020,730,473円
2 .	受益権の総数	89,642,239,133口	101,020,730,473口

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成30年10月12日現在	平成31年4月12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）

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

## 通貨関連

種類	平成30年10月12日 現在				平成31年4月12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	321,129,975	-	321,057,130	72,845	1,099,467,848	-	1,103,955,330	4,487,482
アメリカ・ドル	235,085,760	-	234,750,880	334,880	778,107,710	-	781,474,010	3,366,300
イギリス・ポンド	18,254,184	-	18,270,420	16,236	62,478,496	-	62,616,840	138,344
オーストラリア・ドル	2,144,097	-	2,158,110	14,013	26,830,236	-	26,852,160	21,924
カナダ・ドル	12,395,952	-	12,398,400	2,448	45,684,540	-	45,790,880	106,340
ユーロ	53,249,982	-	53,479,320	229,338	186,366,866	-	187,221,440	854,574
買 建	5,214,820,752	-	5,214,526,160	294,592	-	-	-	-
アメリカ・ドル	3,748,545,733	-	3,748,275,040	270,693	-	-	-	-
イギリス・ポンド	185,983,473	-	185,972,080	11,393	-	-	-	-
オーストラリア・ドル	135,581,801	-	135,561,280	20,521	-	-	-	-
カナダ・ドル	200,971,870	-	200,957,400	14,470	-	-	-	-
ユーロ	943,737,875	-	943,760,360	22,485	-	-	-	-
合計	5,535,950,727	-	5,535,583,290	221,747	1,099,467,848	-	1,103,955,330	4,487,482

(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10月12日 現在				平成31年4月12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	18,032,835,931	-	17,324,567,522	708,268,409	8,442,742,044	-	8,563,500,257	120,758,213
合計	18,032,835,931	-	17,324,567,522	708,268,409	8,442,742,044	-	8,563,500,257	120,758,213

(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。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成30年10月12日現在	平成31年4月12日現在
1口当たり純資産額	3.4566円	3.6833円
(1万口当たり純資産額)	(34,566円)	(36,833円)



## 「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10月12日現在	平成31年4月12日現在
資産の部			
流動資産			
預金		2,752,784,135	2,590,220,776
コール・ローン		1,828,346,767	327,402,164
国債証券		196,712,880,950	191,731,195,909
派生商品評価勘定		3,641,715	47,944
未収入金		319,943,440	766,697,219
未収利息		1,780,970,670	1,666,946,322
前払費用		26,041,528	52,481,411
流動資産合計		203,424,609,205	197,134,991,745
資産合計		203,424,609,205	197,134,991,745
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		719,032	7,817,885
未払金		1,192,646,625	-
未払解約金		217,931,000	1,380,502,100
流動負債合計		1,411,296,657	1,388,319,985
負債合計		1,411,296,657	1,388,319,985
純資産の部			
元本等			
元本	1	112,458,205,288	105,473,931,436
剰余金			
剰余金又は欠損金( )		89,555,107,260	90,272,740,324
元本等合計		202,013,312,548	195,746,671,760
純資産合計		202,013,312,548	195,746,671,760
負債純資産合計		203,424,609,205	197,134,991,745

## 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10月12日現在	平成31年4月12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	131,651,234,057円	112,458,205,288円
同期中追加設定元本額	25,881,266,870円	10,395,304,205円
同期中一部解約元本額	45,074,295,639円	17,379,578,057円
元本の内訳		
ファンド名		
D I A M外国債券パッシブ・ファンド	7,828,695,366円	7,847,951,732円
M I T O ラップ型ファンド（安定型）	12,133,962円	8,220,777円
M I T O ラップ型ファンド（中立型）	32,672,527円	27,516,031円
M I T O ラップ型ファンド（積極型）	40,635,275円	33,090,801円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	85,434,297円	71,426,569円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	86,584,078円	74,651,150円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	52,316,242円	44,617,036円
たわらノーロード 先進国債券	2,746,620,338円	3,853,055,468円
たわらノーロード 先進国債券<ラップ向け>	606,412円	606,247円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	87,793,845円	188,256,409円
たわらノーロード バランス（堅実型）	1,694,648円	3,585,939円

たわらノーロード バランス (標準型)	9,240,402円	19,557,023円
たわらノーロード バランス (積極型)	3,039,080円	4,872,923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)	278,668円	659,292円
たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(安定型)	15,745,793円	33,265,635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)	24,978,110円	59,389,305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)	7,894,293円	17,592,834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)	3,760,811円	20,902,862円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定型)	126,040円	703,971円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定成長型)	954,451円	1,576,213円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(成長型)	439,864円	625,918円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(積極型)	717,124円	1,026,102円
D I A M外国債券インデックス ファンド< D C年金>	5,130,305,928円	5,474,020,689円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 1 安定型	508,593,929円	537,272,707円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 2 安定・成長型	1,661,755,217円	1,705,477,031円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 3 成長型	1,750,297,361円	1,765,920,058円
D I A M D C バランス3 0 インデックスファンド	375,375,876円	369,540,190円
D I A M D C バランス5 0 インデックスファンド	812,877,584円	800,764,253円
D I A M D C バランス7 0 インデックスファンド	646,291,543円	620,721,465円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型>	22,797,155円	22,350,096円
マネックス資産設計ファンド< 育成型>	597,658,723円	609,542,332円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	16,493,279円	10,876,029円
D I A M D C 8 資産バラ ンスファンド(新興国1 0)	116,556,212円	120,567,843円
D I A M D C 8 資産バラ ンスファンド(新興国2 0)	67,061,918円	73,194,203円
D I A M D C 8 資産バラ ンスファンド(新興国3 0)	112,693,813円	120,507,291円
クルーズコントロール	2,461,568,454円	2,238,132,880円
D I A M 8 資産バランスファ ンドN< D C年金>	81,966,152円	92,429,886円

D I A M D C バランス・F (成長型)	145,173,468円	153,444,763円
クルーズコントロール<DC年金>	1,425,658円	1,568,227円
D I A Mコア資産設計ファンド (堅実型)	7,283,621円	7,115,256円
D I A Mコア資産設計ファンド (積極型)	18,963,158円	19,600,627円
ダイナミック・ナビゲーション	364,709円	357,565円
4資産分散投資・スタンダード <DC年金>	15,420,153円	18,014,393円
9資産分散投資・スタンダード <DC年金>	11,075円	2,824,525円
D I A Mパッシブ資産分散ファ ンド	1,315,797,580円	1,293,843,278円
D I A M為替フルヘッジ型外国 債券パッシブ私募ファンド(適 格機関投資家向け)	6,773,540,012円	6,956,217,810円
D I A M外国債券パッシブファ ンド(適格機関投資家向け)	4,135,915,089円	3,701,885,314円
外国債券パッシブファンド(適 格機関投資家限定)	3,316,290,366円	2,487,091,451円
先進国債券パッシブファンド (適格機関投資家限定)	6,087,743,818円	6,082,563,475円
D I A Mワールドバランス25 VA(適格機関投資家限定)	95,731,710円	93,139,643円
D I A Mグローバル・バランス ファンド25VA(適格機関投 資家限定)	806,989,317円	746,352,851円
D I A Mグローバル・バランス ファンド50VA(適格機関投 資家限定)	659,285,763円	602,002,775円
D I A M国際分散バランスファ ンド30VA(適格機関投資家 限定)	50,717,767円	47,514,109円
D I A M国際分散バランスファ ンド50VA(適格機関投資家 限定)	92,921,832円	85,161,928円
D I A M国内重視バランスファ ンド30VA(適格機関投資家 限定)	23,232,912円	22,538,189円
D I A M国内重視バランスファ ンド50VA(適格機関投資家 限定)	7,499,874円	6,154,833円
D I A M世界バランスファンド 40VA(適格機関投資家限 定)	66,675,797円	53,506,580円
D I A M世界バランスファンド 50VA(適格機関投資家限 定)	79,005,779円	71,641,773円
D I A Mバランスファンド25 VA(適格機関投資家限定)	3,456,312,316円	3,146,159,172円

D I A Mバランスファンド3 7.5 V A (適格機関投資家限 定)	2,282,689,021円	2,105,275,232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)	3,948,633,035円	3,599,657,718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)	699,334,985円	644,233,551円
D I A Mグローバル・アセッ ト・バランスV A 2 (適格機関 投資家限定)	263,420,576円	243,619,032円
D I A M アクサ グローバ ル バランスファンド30 V A (適格機関投資家限定)	3,216,272,025円	2,940,331,693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)	2,354,914,119円	1,526,448,660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)	13,975,529円	14,665,687円
D I A M世界バランスファンド 55 V A (適格機関投資家限 定)	16,311,743円	6,584,678円
D I A M世界バランスファンド 35 V A (適格機関投資家限 定)	156,842,701円	110,273,347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)	10,386,113,603円	6,514,773,937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)	19,186,986,411円	18,536,418,626円
D I A Mバランス30 V A (適 格機関投資家限定)	14,080,569円	19,981,901円
D I A Mバランス50 V A (適 格機関投資家限定)	11,257,433円	1,005,859円
D I A Mバランス70 V A (適 格機関投資家限定)	5,627,956円	5,037,615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)	17,130,207,794円	16,539,050,421円
D I A M世界バランス25 V A (適格機関投資家限定)	100,006,763円	86,235,059円
D I A Mバランス20 V A (適 格機関投資家限定)	110,036,727円	106,645,796円
D I A Mバランス40 V A (適 格機関投資家限定)	369,121円	363,412円
D I A Mバランス60 V A (適 格機関投資家限定)	168,633円	163,485円
計	112,458,205,288円	105,473,931,436円
2. 受益権の総数	112,458,205,288口	105,473,931,436口



## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成30年10月12日現在	平成31年4月12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）

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

## 通貨関連

種類	平成30年10月12日 現在				平成31年4月12日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	-	-	-	-	1,263,610,000	-	1,271,379,941	7,769,941
アメリカ・ドル	-	-	-	-	634,830,000	-	638,830,909	4,000,909
イギリス・ボンド	-	-	-	-	91,250,000	-	91,551,702	301,702
オーストラリア・ドル	-	-	-	-	29,710,000	-	29,746,959	36,959
カナダ・ドル	-	-	-	-	26,200,000	-	26,283,038	83,038
ユーロ	-	-	-	-	457,690,000	-	461,085,277	3,395,277
南アフリカ・ランド	-	-	-	-	23,930,000	-	23,882,056	47,944
買 建	1,350,330,000	-	1,353,252,683	2,922,683	-	-	-	-
アメリカ・ドル	504,760,000	-	504,040,968	719,032	-	-	-	-
ユーロ	845,570,000	-	849,211,715	3,641,715	-	-	-	-
合計	1,350,330,000	-	1,353,252,683	2,922,683	1,263,610,000	-	1,271,379,941	7,769,941

(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。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成30年10月12日現在	平成31年4月12日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.7963円 (17,963円)	1.8559円 (18,559円)



## 「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10月12日現在	平成31年4月12日現在
資産の部			
流動資産			
預金		294,634,390	-
コール・ローン		539,303,592	263,461,434
投資信託受益証券		5,118,845,237	5,415,323,774
投資証券		38,370,724,101	46,770,863,969
派生商品評価勘定		513,182	2,100
未収入金		5,903,572,159	311,825,157
未収配当金		191,643,696	189,935,561
流動資産合計		50,419,236,357	52,951,411,995
資産合計		50,419,236,357	52,951,411,995
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		342,141	70,473
前受金		-	75,189,904
未払金		-	14,233,941
未払解約金		557,043,000	220,373,000
流動負債合計		557,385,141	309,867,318
負債合計		557,385,141	309,867,318
純資産の部			
元本等			
元本	1	42,461,597,968	39,465,439,179
剰余金			
剰余金又は欠損金( )		7,400,253,248	13,176,105,498
元本等合計		49,861,851,216	52,641,544,677
純資産合計		49,861,851,216	52,641,544,677
負債純資産合計		50,419,236,357	52,951,411,995

## 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10月12日現在	平成31年4月12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	42,945,375,842円	42,461,597,968円
同期中追加設定元本額	34,271,878,040円	29,400,262,589円
同期中一部解約元本額	34,755,655,914円	32,396,421,378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）	245,882,806円	161,406,935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）	91,619,154円	87,538,841円
M I T O ラップ型ファンド（安定型）	4,347,931円	5,855,648円
M I T O ラップ型ファンド（中立型）	16,514,233円	14,992,063円
M I T O ラップ型ファンド（積極型）	32,595,652円	22,650,724円

グローバル8資産ラップファンド(安定型)	30,645,626円	50,995,377円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	43,636,068円	40,673,577円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	41,934,413円	30,538,014円
たわらノーロード 先進国リート	2,782,419,098円	3,560,537,128円
たわらノーロード 先進国リート<ラップ向け>	476,186,868円	581,091,507円
たわらノーロード 先進国リート<為替ヘッジあり>	134,698,862円	127,979,450円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	128,981,698円	264,540,237円
たわらノーロード バランス(堅実型)	829,408円	1,651,582円
たわらノーロード バランス(標準型)	17,050,297円	34,350,379円
たわらノーロード バランス(積極型)	53,328,227円	82,600,038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)	5,181,872円	13,961,977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)	37,066,332円	73,856,835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)	35,155,142円	63,996,988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)	94,871,775円	175,468,275円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	106,587円	547,487円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	1,412,707円	1,764,432円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	1,210,693円	1,532,307円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	4,036,986円	4,547,694円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	23,065,104円	19,145,911円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	603,261,794円	521,415,552円
マネックス資産設計ファンドエボリューション	39,383,601円	55,127,322円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	172,886,995円	175,540,190円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	150,229,482円	156,207,868円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	302,213,922円	305,007,961円
投資のソムリエ	7,747,585,548円	9,092,298,432円
投資のソムリエ<DC年金>	671,952,334円	897,103,974円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	120,383,081円	133,367,913円

投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	306,243,675円	336,721,162円
ダイナミック・ナビゲーション	805,560円	766,231円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	5,796,933,677円	5,124,060,090円
ワールドアセットバランス(基本コース)	1,228,816,340円	959,359,775円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	4,269,406,350円	3,735,792,629円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	2,147,459円	3,022,669円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	1,538,625円	2,670,924円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	1,814,787円	2,331,127円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	2,946,447円	5,016,120円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	985,394,183円	708,353,729円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	12,333円	2,971,738円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	-円	696,833円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	-円	696,833円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	-円	696,833円
DIAMパッシブ資産分散ファンド	1,103,861,552円	873,202,469円
DIAM外国リートインデックスファンド<DC年金>	28,707,690円	35,194,296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)	634,397,425円	387,590,592円
DIAMグローバル 私募ファンド(適格機関投資家向け)	11,580,328円	12,032,969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)	7,696,523,460円	4,553,534,253円
DIAMグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンド(適格機関投資家限定)	1,401,016,372円	1,942,981,720円
DIAMグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンドII(適格機関投資家限定)	1,078,666,100円	-円
P-Oneマルチアセット戦略ファンド(適格機関投資家限定)	3,241,156,712円	3,461,256,521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)	558,954,597円	558,197,048円
計	42,461,597,968円	39,465,439,179円

2 . 受益権の総数	42,461,597,968口	39,465,439,179口
------------	-----------------	-----------------

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成30年10月12日現在	平成31年4月12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）

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

## 通貨関連

種類	平成30年10月12日 現在				平成31年4月12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	6,686,188,721	-	6,686,017,680	171,041	166,023,387	-	166,091,760	68,373
アメリカ・ドル	4,755,927,440	-	4,755,584,000	343,440	100,591,470	-	100,593,000	1,530
イギリス・ポンド	378,800,205	-	378,777,000	23,205	8,319,241	-	8,319,720	479
イスラエル・シユケル	4,562,248	-	4,567,280	5,032	-	-	-	-
オーストラリア・ドル	489,787,630	-	489,970,900	183,270	22,930,302	-	22,947,840	17,538
カナダ・ドル	127,437,176	-	127,428,000	9,176	4,177,970	-	4,178,000	30
シンガポール・ドル	230,862,421	-	230,930,300	67,879	11,103,840	-	11,131,600	27,760
ニュージーランド・ドル	30,870,860	-	30,890,400	19,540	-	-	-	-
ユーロ	506,154,741	-	506,166,800	12,059	10,091,424	-	10,092,800	1,376
香港・ドル	161,786,000	-	161,703,000	83,000	8,809,140	-	8,828,800	19,660
合計	6,686,188,721	-	6,686,017,680	171,041	166,023,387	-	166,091,760	68,373

(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。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成30年10月12日現在	平成31年4月12日現在
1口当たり純資産額	1.1743円	1.3339円
(1万口当たり純資産額)	(11,743円)	(13,339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」の状況

## 貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成30年10月12日現在	平成31年4月12日現在
資産の部			
流動資産			
預金		2,238,574,988	4,840,121,328
コール・ローン		4,542,441,306	3,005,597,809
国債証券		236,764,262,990	370,874,111,310
派生商品評価勘定		3,045,784,161	4,382,730
未収入金		127,323	-
未収利息		1,765,217,579	2,412,939,963
前払費用		150,044,200	615,456,018
流動資産合計		248,506,452,547	381,752,609,158
資産合計		248,506,452,547	381,752,609,158
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		51,091,178	4,860,818,432
未払金		5,234,109,621	32,972,152
未払解約金		2,321,928,000	118,130,000
流動負債合計		7,607,128,799	5,011,920,584
負債合計		7,607,128,799	5,011,920,584
純資産の部			
元本等			
元本	1	184,831,343,228	278,015,141,684
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		56,067,980,520	98,725,546,890
元本等合計		240,899,323,748	376,740,688,574
純資産合計		240,899,323,748	376,740,688,574
負債純資産合計		248,506,452,547	381,752,609,158



## 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10月12日現在	平成31年4月12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	175,071,669,912円	184,831,343,228円
同期中追加設定元本額	115,160,612,049円	173,971,193,939円
同期中一部解約元本額	105,400,938,733円	80,787,395,483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>	2,236,676,779円	2,824,835,227円
たわらノーロード バランス (堅実型)	25,762,701円	53,873,431円
たわらノーロード バランス (標準型)	73,544,050円	153,130,873円
たわらノーロード バランス (積極型)	54,030,866円	86,719,127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)	3,113,787円	4,766,657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)	73,305,576円	130,796,727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)	114,845,501円	196,827,595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)	41,424,797円	66,787,823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)	31,581,384円	47,233,720円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(保守型)	631,284円	1,614,201円

たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	807,811円	3,287,957円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	4,325,681円	5,343,158円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	1,578,056円	1,803,640円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	1,679,959円	1,484,415円
投資のソムリエ	17,802,580,996円	42,590,120,397円
投資のソムリエ<DC年金>	1,547,430,490円	4,205,019,004円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	1,277,473,727円	3,393,769,610円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	24,196,246,204円	51,660,691,127円
ワールドアセットバランス(基本コース)	5,778,866,668円	4,215,669,452円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	20,349,115,209円	16,227,274,641円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	4,505,067円	12,507,764円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	3,239,196円	11,049,068円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	7,579,656円	23,850,247円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	7,405,591円	23,824,031円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	7,438,170,372円	7,193,653,838円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	283,833円	72,105,915円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	-円	2,865,316円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	-円	2,865,316円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	-円	2,865,316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)	8,816,848,501円	20,022,423,729円
先進国債券パッシブファンド(為替ヘッジあり)(適格機関投資家限定)	-円	40,853,795,154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)	14,524,821,842円	8,830,888,275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)	806,049,131円	137,686,912円
DIAM世界アセットバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	7,003,027,220円	6,573,160,438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)	33,533,550,223円	31,410,697,284円
D I A Mバランス3 0 V A ( 適 格機関投資家限定)	19,601,120円	27,080,990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)	29,944,184,780円	28,027,276,876円
D I A Mバランス2 0 V A ( 適 格機関投資家限定)	153,294,210円	144,533,373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)	2,501,377,202円	2,343,618,618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)	2,597,230,650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)	3,430,389,721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)	424,763,387円	399,724,071円
計	184,831,343,228円	278,015,141,684円
2 . 受益権の総数	184,831,343,228口	278,015,141,684口

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成30年10月12日現在	平成31年4月12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）

該当事項はありません。



メキシコ・ペソ	2,132,459,347	-	2,081,657,004	50,802,343	2,819,342,174	-	2,941,977,770	122,635,596
ユーロ南アフリカ・ランド	98,341,633,387	-	96,998,240,264	1,343,393,123	145,993,302,861	-	148,169,823,136	2,176,520,275
買建	1,372,547,216	-	1,319,376,018	53,171,198	1,683,725,583	-	1,755,004,402	71,278,819
アメリカ・ドル	5,019,650,000	-	5,019,297,848	352,152	-	-	-	-
ユーロ	4,169,570,000	-	4,169,198,248	371,752	-	-	-	-
	850,080,000	-	850,099,600	19,600	-	-	-	-
合計	250,442,653,370	-	247,447,256,083	2,994,692,983	374,890,111,404	-	379,746,547,106	4,856,435,702

## (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。

## (1口当たり情報に関する注記)

	平成30年10月12日現在	平成31年4月12日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.3033円 (13,033円)	1.3551円 (13,551円)

## 「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10月12日現在	平成31年4月12日現在
資産の部			
流動資産			
預金		3,683,826,146	2,820,922,987
コール・ローン		580,368,131	55,281,468
株式		48,275,462,755	57,420,331,596
新株予約権証券		-	211,350
投資信託受益証券		279,126,129	278,400,257
投資証券		93,277,428	83,400,945
派生商品評価勘定		1,236,237	101,440,612
未収入金		2,566,448	-
未収配当金		78,401,183	121,835,332
差入委託証拠金		1,058,690,063	1,122,366,009
流動資産合計		54,052,954,520	62,004,190,556
資産合計		54,052,954,520	62,004,190,556
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		168,414,282	3,847,200
未払金		30,827,011	4,651
未払解約金		682,226,000	639,477,000
流動負債合計		881,467,293	643,328,851
負債合計		881,467,293	643,328,851
純資産の部			
元本等			
元本	1	49,906,024,818	50,663,577,203
剰余金			
剰余金又は欠損金( )		3,265,462,409	10,697,284,502
元本等合計		53,171,487,227	61,360,861,705
純資産合計		53,171,487,227	61,360,861,705
負債純資産合計		54,052,954,520	62,004,190,556

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

<p>1. 有価証券の評価基準及び評価方法</p>	<p>株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>新株予約権証券 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>投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
<p>2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法</p>	<p>先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>為替予約取引 原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
<p>3. 収益及び費用の計上基準</p>	<p>受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>
<p>4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項</p>	<p>外貨建取引等の処理基準 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10月12日現在	平成31年4月12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	48,119,660,826円	49,906,024,818円
同期中追加設定元本額	35,136,430,371円	20,874,772,642円
同期中一部解約元本額	33,350,066,379円	20,117,220,257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 >	3,998,466,681円	4,472,203,479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)	526,663,191円	499,585,330円
M I T O ラップ型ファンド (安定型)	3,985,301円	3,316,467円
M I T O ラップ型ファンド (中立型)	10,799,409円	11,116,546円
M I T O ラップ型ファンド (積極型)	13,414,427円	13,466,899円
グローバル8資産ラップファン ド(安定型)	28,092,719円	29,063,383円
グローバル8資産ラップファン ド(中立型)	28,537,703円	30,019,978円
グローバル8資産ラップファン ド(積極型)	17,048,590円	17,894,922円
たわらノーロード 新興国株式	4,143,846,622円	4,699,459,328円
たわらノーロード 新興国株式 <ラップ向け>	1,771,389,117円	1,784,733,850円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	141,717,362円	290,919,969円
たわらノーロード バランス (堅実型)	911,236円	1,805,667円
たわらノーロード バランス (標準型)	3,704,213円	7,560,261円
たわらノーロード バランス (積極型)	9,490,560円	15,013,195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)	108,437円	174,756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)	5,437,197円	10,607,696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)	16,630,235円	31,562,658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)	12,267,696円	22,439,587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)	35,053,630円	55,545,186円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定型)	27,969円	124,211円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定成長型)	369,091円	502,524円

たわらノーロード 最適化バ ランス(成長型)	293,335円	374,068円
たわらノーロード 最適化バ ランス(積極型)	668,349円	1,090,439円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	447,212,307円	453,215,866円
D I A M D C 8資産バラン スファンド(新興国10)	314,439,194円	322,361,801円
D I A M D C 8資産バラン スファンド(新興国20)	267,422,836円	291,153,227円
D I A M D C 8資産バラン スファンド(新興国30)	533,698,629円	572,621,496円
投資のソムリエ	3,362,324,690円	8,054,382,424円
クルーズコントロール	1,329,932,944円	1,134,187,407円
投資のソムリエ<DC年金>	292,031,702円	794,559,986円
D I A M 8資産バランスマ ンドN<DC年金>	211,686,781円	247,104,657円
クルーズコントロール<DC年 金>	770,395円	794,812円
D I A Mコア資産設計ファンド (堅実型)	19,663,281円	18,102,848円
D I A Mコア資産設計ファンド (積極型)	51,388,252円	49,706,299円
投資のソムリエ<DC年金>リ スク抑制型	100,151,426円	186,431,702円
ダイナミック・ナビゲーション	564,769円	1,713,505円
リスク抑制世界8資産バラン スファンド	1,889,566,731円	2,843,208,568円
ワールドアセットバランス(基 本コース)	1,897,818,968円	1,641,892,969円
ワールドアセットバランス(リ スク抑制コース)	6,652,378,641円	6,277,274,398円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2045)	1,147,064円	2,599,644円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2055)	824,219円	2,301,914円
リスク抑制世界8資産バラン スファンド(DC)	595,341円	1,284,566円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2035)	1,488,465円	4,280,116円
リスクコントロール世界資産分 散ファンド	270,188,548円	274,183,673円
9資産分散投資・スタンダード <DC年金>	20,870円	5,367,594円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2040)	-円	596,693円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2050)	-円	596,693円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2060)	-円	596,693円
エマージング株式バッシブファ ンドVA(適格機関投資家専 用)	3,861,381,492円	2,882,007,336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)	2,126,266,886円	-円
	D I A M世界アセットバランスファンド2 V A (適格機関投資家限定)	8,067,518,091円	5,209,731,183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)	7,436,619,226円	7,392,738,734円
	計	49,906,024,818円	50,663,577,203円
2 .	受益権の総数	49,906,024,818口	50,663,577,203口

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成30年10月12日現在	平成31年4月12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）

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

## 通貨関連

種類	平成30年10月12日 現在				平成31年4月12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	2,435,402,841	-	2,435,203,604	199,237	1,008,194,560	-	1,012,041,760	3,847,200
アメリカ・ドル	1,346,331,040	-	1,346,035,970	295,070	1,008,194,560	-	1,012,041,760	3,847,200
カタール・リアル	20,803,121	-	20,642,634	160,487	-	-	-	-
タイ・バーツ	68,598,680	-	68,400,000	198,680	-	-	-	-
フィリピン・ペソ	51,848,000	-	51,750,000	98,000	-	-	-	-
マレーシア・リン ギット	148,368,000	-	148,445,000	77,000	-	-	-	-
韓国・ウォン	395,040,000	-	396,000,000	960,000	-	-	-	-
香港・ドル	42,939,000	-	42,930,000	9,000	-	-	-	-
台湾・ドル	361,475,000	-	361,000,000	475,000	-	-	-	-
買 建	20,803,121	-	20,536,771	266,350	-	-	-	-
アメリカ・ドル	20,803,121	-	20,536,771	266,350	-	-	-	-
合計	2,456,205,962	-	2,455,740,375	67,113	1,008,194,560	-	1,012,041,760	3,847,200

(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10月12日 現在				平成31年4月12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	2,110,229,391	-	1,943,118,459	167,110,932	3,044,341,391	-	3,145,782,003	101,440,612
合計	2,110,229,391	-	1,943,118,459	167,110,932	3,044,341,391	-	3,145,782,003	101,440,612

(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。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成30年10月12日現在	平成31年4月12日現在
1口当たり純資産額	1.0654円	1.2111円
(1万口当たり純資産額)	(10,654円)	(12,111円)

## 「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10月12日現在	平成31年4月12日現在
資産の部			
流動資産			
預金		1,785,331,074	1,275,446,763
コール・ローン		484,022,298	45,875,951
国債証券		79,853,904,347	105,382,531,082
派生商品評価勘定		5,629,000	-
未収入金		18,769,071,746	1,270,830,880
未収利息		989,456,811	952,979,294
前払費用		163,520,452	141,562,537
流動資産合計		102,050,935,728	109,069,226,507
資産合計		102,050,935,728	109,069,226,507
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		-	4,130,000
未払解約金		570,785,000	660,112,000
流動負債合計		570,785,000	664,242,000
負債合計		570,785,000	664,242,000
純資産の部			
元本等			
元本	1	56,199,014,389	56,490,342,363
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		45,281,136,339	51,914,642,144
元本等合計		101,480,150,728	108,404,984,507
純資産合計		101,480,150,728	108,404,984,507
負債純資産合計		102,050,935,728	109,069,226,507

## 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10月12日現在	平成31年4月12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	53,347,180,448円	56,199,014,389円
同期中追加設定元本額	44,866,082,826円	51,572,841,181円
同期中一部解約元本額	42,014,248,885円	51,281,513,207円
元本の内訳		
ファンド名		
DIAM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）	273,439,997円	245,772,822円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	86,496,478円	182,097,559円
たわらノーロード バランス（堅実型）	4,452,625円	9,241,026円
たわらノーロード バランス（標準型）	13,664,153円	28,367,816円
たわらノーロード バランス（積極型）	8,971,660円	14,181,439円
たわらノーロード 最適化バランス（保守型）	91,216円	223,599円
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	141,671円	606,908円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	821,482円	1,070,265円
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	310,046円	379,183円
たわらノーロード 最適化バランス（積極型）	422,739円	498,417円



マネックス資産設計ファンド エボリューション	58,646,088円	65,812,114円
DIAM DC 8資産バラン スファンド(新興国10)	195,394,626円	196,851,738円
DIAM DC 8資産バラン スファンド(新興国20)	168,433,969円	178,790,603円
DIAM DC 8資産バラン スファンド(新興国30)	335,742,291円	351,300,641円
投資のソムリエ	8,561,194,872円	8,772,909,195円
クルーズコントロール	809,063,156円	720,989,640円
投資のソムリエ<DC年金>	741,598,209円	866,443,655円
DIAM 8資産バランスファ ンドN<DC年金>	136,462,429円	150,180,507円
クルーズコントロール<DC年 金>	468,493円	505,453円
DIAMコア資産設計ファンド (堅実型)	4,745,911円	4,605,473円
DIAMコア資産設計ファンド (積極型)	12,527,493円	12,652,628円
投資のソムリエ<DC年金>リ スク抑制型	193,344,732円	329,284,222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	177,753円	523,034円
ワールドアセットバランス(基 本コース)	3,643,414,698円	5,014,673,512円
ワールドアセットバランス(リ スク抑制コース)	818,794,191円	1,007,730,855円
ワールドアセットバランス(リ スク抑制コース)	2,855,738,733円	3,896,242,405円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2045)	2,174,682円	3,475,708円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2055)	1,585,888円	3,070,777円
リスク抑制世界8資産バラン スファンド(DC)	1,132,324円	2,294,446円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2035)	3,151,566円	5,824,329円
リスクコントロール世界資産分 散ファンド	457,307,222円	698,429,996円
9資産分散投資・スタンダード <DC年金>	13,655円	3,413,750円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2040)	-円	795,968円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2050)	-円	795,968円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2060)	-円	795,968円
エマージング債券リスク抑制型 (適格機関投資家限定)	14,137,760,067円	16,237,347,272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)	2,310,945,945円	1,690,589,441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 )	5,140,437,726円	3,157,179,327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 )	4,748,109,654円	4,491,617,738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 )	3,811,858,365円	3,910,785,285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 )	2,928,571,287円	- 円
	P - O n eマルチアセット戦略 ファンド( 適格機関投資家限 定 )	3,731,406,297円	4,231,991,681円
	計	56,199,014,389円	56,490,342,363円
2 .	受益権の総数	56,199,014,389口	56,490,342,363口

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成30年10月12日現在	平成31年4月12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）

該当事項はありません。

## （デリバティブ取引等に関する注記）

## 通貨関連

種類	平成30年10月12日 現在				平成31年4月12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	19,261,794,000	-	19,256,165,000	5,629,000	945,889,000	-	950,019,000	4,130,000
アメリカ・ドル	19,261,794,000	-	19,256,165,000	5,629,000	945,889,000	-	950,019,000	4,130,000
合計	19,261,794,000	-	19,256,165,000	5,629,000	945,889,000	-	950,019,000	4,130,000

## （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。

## （1口当たり情報に関する注記）

	平成30年10月12日現在	平成31年4月12日現在
1口当たり純資産額	1.8057円	1.9190円
（1万口当たり純資産額）	（18,057円）	（19,190円）

## 2【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

たわらノーロード バランス（堅実型）

平成31年4月26日現在

資産総額	227,149,375円
負債総額	1,116,979円
純資産総額（ - ）	226,032,396円
発行済数量	221,630,093口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0199円

たわらノーロード バランス（標準型）

平成31年4月26日現在

資産総額	928,644,521円
負債総額	2,296,385円
純資産総額（ - ）	926,348,136円
発行済数量	882,889,018口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0492円

たわらノーロード バランス（積極型）

平成31年4月26日現在

資産総額	924,429,359円
負債総額	3,977,101円
純資産総額（ - ）	920,452,258円
発行済数量	865,151,569口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0639円

（参考）

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

平成31年4月26日現在

資産総額	273,800,965,426円
負債総額	1,891,350,128円
純資産総額（ - ）	271,909,615,298円
発行済数量	107,619,823,886口
1口当たり純資産額（ / ）	2.5266円

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成31年4月26日現在

資産総額	291,213,194,525円
負債総額	1,278,213,000円
純資産総額（ - ）	289,934,981,525円
発行済数量	221,309,020,088口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3101円

## J-REITインデックスファンド・マザーファンド

平成31年4月26日現在

資産総額	33,941,999,357円
負債総額	620,080,310円
純資産総額( - )	33,321,919,047円
発行済数量	16,246,659,520口
1口当たり純資産額( / )	2.0510円

## 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成31年4月26日現在

資産総額	372,641,756,230円
負債総額	1,212,779,482円
純資産総額( - )	371,428,976,748円
発行済数量	99,930,993,668口
1口当たり純資産額( / )	3.7169円

## 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成31年4月26日現在

資産総額	193,951,925,155円
負債総額	632,524,966円
純資産総額( - )	193,319,400,189円
発行済数量	105,094,460,953口
1口当たり純資産額( / )	1.8395円

## 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成31年4月26日現在

資産総額	52,179,817,289円
負債総額	176,477,582円
純資産総額( - )	52,003,339,707円
発行済数量	39,548,784,757口
1口当たり純資産額( / )	1.3149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31年4月26日現在

資産総額	403,472,616,816円
負債総額	3,050,865,249円
純資産総額( - )	400,421,751,567円
発行済数量	296,158,943,137口
1口当たり純資産額( / )	1.3521円

## エマージング株式パッシブ・マザーファンド

平成31年4月26日現在

資産総額	59,604,100,404円
負債総額	63,205,817円
純資産総額( - )	59,540,894,587円
発行済数量	49,566,627,667口
1口当たり純資産額( / )	1.2012円

## エマージング債券パッシブ・マザーファンド

平成31年4月26日現在

資産総額	101,604,993,771円
負債総額	363,494,800円
純資産総額( - )	101,241,498,971円
発行済数量	52,649,584,512口
1口当たり純資産額( / )	1.9229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(2019年4月26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(2019年4月26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。

2019年4月26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	26	1,146,595,911,916
追加型株式投資信託	871	13,561,034,565,287
単位型公社債投資信託	46	176,328,445,456
単位型株式投資信託	161	1,240,583,444,476
合計	1,104	16,124,542,367,135

### 3【委託会社等の経理状況】

1. 委託会社であるアセットマネジメントOne株式会社（以下「委託会社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。
2. 財務諸表の金額は、千円未満の端数を切り捨てて記載しております。
3. 委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき第34期事業年度（自2018年4月1日至2019年3月31日）の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の監査を受けております。

## (1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

	第33期 (2018年3月31日現在)	第34期 (2019年3月31日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金	49,071,217	41,087,475
金銭の信託	12,083,824	18,773,228
有価証券	-	153,518
未収委託者報酬	11,769,015	12,438,085
未収運用受託報酬	4,574,225	3,295,109
未収投資助言報酬	341,689	327,064
未収収益	59,526	56,925
前払費用	569,431	573,874
その他	427,238	491,914
流動資産計	78,896,169	77,197,195
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 1,156,953	1 1,096,916
器具備品	1 476,504	1 364,399
建設仮勘定	10,368	-
無形固定資産		
ソフトウェア	1,026,319	885,545
ソフトウェア仮勘定	904,389	1,522,040
電話加入権	3,931	3,931
電信電話専用施設利用権	60	23
投資その他の資産		
投資有価証券	1,721,433	1,611,931
関係会社株式	3,229,196	4,499,196
長期差入保証金	1,518,725	1,312,328
繰延税金資産	1,699,533	1,748,459
その他	101,425	97,892
固定資産計	11,848,840	13,142,665
資産合計	90,745,010	90,339,861

(単位:千円)

	第33期 (2018年3月31日現在)	第34期 (2019年3月31日現在)
(負債の部)		
流動負債		
預り金	1,003,550	2,183,889
未払金	5,081,728	5,697,942
未払収益分配金	1,031	1,053
未払償還金	57,275	48,968
未払手数料	4,629,133	4,883,723
その他未払金	394,288	764,196
未払費用	7,711,038	6,724,986
未払法人税等	5,153,972	3,341,238
未払消費税等	1,660,259	576,632
賞与引当金	1,393,911	1,344,466
役員賞与引当金	49,986	48,609
本社移転費用引当金	156,587	-
流動負債計	22,211,034	19,917,766
固定負債		
退職給付引当金	1,637,133	1,895,158
時効後支払損引当金	199,026	177,851
固定負債計	1,836,160	2,073,009
負債合計	24,047,195	21,990,776
(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	44,349,855	45,949,372
利益準備金	123,293	123,293
その他利益剰余金	44,226,562	45,826,079
別途積立金	24,580,000	31,680,000
研究開発積立金	300,000	-
運用責任準備積立金	200,000	-
繰越利益剰余金	19,146,562	14,146,079
株主資本計	65,902,812	67,502,329
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	795,002	846,755
評価・換算差額等計	795,002	846,755
純資産合計	66,697,815	68,349,085
負債・純資産合計	90,745,010	90,339,861

## (2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	第33期 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)		第34期 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	
	営業収益			
委託者報酬	84,705,447		84,812,585	
運用受託報酬	19,124,427		16,483,356	
投資助言報酬	1,217,672		1,235,553	
その他営業収益	117,586		113,622	
営業収益計		105,165,133		102,645,117
営業費用				
支払手数料	37,242,284		36,100,556	
広告宣伝費	379,873		387,028	
公告費	1,485		375	
調査費	23,944,438		24,389,003	
調査費	10,677,166		9,956,757	
委託調査費	13,267,272		14,432,246	
委託計算費	1,073,938		936,075	
営業雑経費	1,215,963		1,254,114	
通信費	48,704		47,007	
印刷費	947,411		978,185	
協会費	64,331		63,558	
諸会費	22,412		22,877	
支払販売手数料	133,104		142,485	
営業費用計		63,857,984		63,067,153
一般管理費				
給料	11,304,873		10,859,354	
役員報酬	189,022		189,198	
給料・手当	9,565,921		9,098,957	
賞与	1,549,929		1,571,197	
交際費	58,863		60,115	
寄付金	5,150		7,255	
旅費交通費	395,605		361,479	
租税公課	625,498		588,172	
不動産賃借料	1,534,255		1,511,876	
退職給付費用	595,876		521,184	
固定資産減価償却費	1,226,472		590,667	
福利厚生費	49,797		45,292	
修繕費	4,620		16,247	
賞与引当金繰入額	1,393,911		1,344,466	
役員賞与引当金繰入額	49,986		48,609	
機器リース料	148		130	
事務委託費	3,037,804		3,302,806	
事務用消耗品費	144,804		131,074	
器具備品費	5,253		8,112	
諸経費	149,850		188,367	
一般管理費計		20,582,772		19,585,212
営業利益		20,724,376		19,992,752

(単位:千円)

	第33期 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)		第34期 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	
営業外収益				
受取利息		1,430		1,749
受取配当金		74,278		73,517
時効成立分配金・償還金		256		8,582
為替差益		8,530		-
投資信託解約益		236,398		-
投資信託償還益		93,177		-
受取負担金		-		177,066
雑収入		10,306		24,919
時効後支払損引当金戻入額		17,429		19,797
営業外収益計		441,807		305,633
営業外費用				
為替差損		-		17,542
投資信託解約損		4,138		-
投資信託償還損		17,065		-
金銭の信託運用損		99,303		175,164
雑損失		-		5,659
営業外費用計		120,507		198,365
経常利益		21,045,676		20,100,019
特別利益				
固定資産売却益		1		-
投資有価証券売却益		479,323		353,644
関係会社株式売却益	1	1,492,680	1	-
本社移転費用引当金戻入額		138,294		-
その他特別利益		350		-
特別利益計		2,110,649		353,644
特別損失				
固定資産除却損	2	36,992	2	19,121
固定資産売却損		134		-
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		804,083		19,121
税引前当期純利益		22,352,243		20,434,543
法人税、住民税及び事業税		6,951,863		6,386,793
法人税等調整額		249,832		71,767
法人税等合計		6,702,031		6,315,026
当期純利益		15,650,211		14,119,516



## (3)【株主資本等変動計算書】

第33期(自 2017年4月1日 至 2018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

第34期(自 2018年4月1日 至 2019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	19,146,562
当期変動額									
剰余金の配当									12,520,000
当期純利益									14,119,516
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期変動額(純額)									
当期変動額合計	-	-	-	-	-	7,100,000	300,000	200,000	5,000,483
当期末残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	31,680,000	-	-	14,146,079

	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
当期変動額					
剰余金の配当	12,520,000	12,520,000			12,520,000
当期純利益	14,119,516	14,119,516			14,119,516
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期変動額(純額)		-	51,753	51,753	51,753
当期変動額合計	1,599,516	1,599,516	51,753	51,753	1,651,270
当期末残高	45,949,372	67,502,329	846,755	846,755	68,349,085

## 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、2016年4月1日以降に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。</p> <p>(2) 無形固定資産 定額法を採用しております。 なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法を採用しております。</p>
4. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、期末日の直物等為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
5. 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金は、従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当事業年度に見合う分を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金は、役員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当事業年度に見合う分を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金は、従業員の退職給付に備えるため、退職一時金制度について、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき計上しております。</p> <p>退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。</p> <p>数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 過去勤務費用については、その発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を費用処理しております。</p> <p>数理計算上の差異については、各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年または10年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生翌事業年度から費用処理しております。</p> <p>(4) 時効後支払損引当金は、時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。</p> <p>(5) 本社移転費用引当金は、本社移転に関連して発生する損失に備えるため、発生すると見込まれる額を計上しております。</p>
6. 消費税等の会計処理	消費税及び地方消費税の会計処理は税抜き方式によっております。

## 表示方法の変更

第34期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

「『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)を当事業年度から適用し、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。

この結果、前事業年度の貸借対照表において、「流動資産」の「繰延税金資産」842,996千円は、「投資その他の資産」の「繰延税金資産」1,699,533千円に含めて表示しております。

## 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33期 (2018年3月31日現在)	第34期 (2019年3月31日現在)
建物	140,580	229,897
器具備品	847,466	927,688

(損益計算書関係)

## 1. 関係会社に対する事項

(千円)

	第33期 (自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日)	第34期 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)
関係会社株式売却益	1,492,680	-

## 2. 固定資産除却損の内訳

(千円)

	第33期 (自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日)	第34期 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)
建物	298	1,550
器具備品	8,217	439
ソフトウェア	28,472	17,130
電話加入権	3	-

(株主資本等変動計算書関係)

第33期(自 2017年4月1日 至 2018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
2017年6月21日 定時株主総会	普通株式	3,200,000	80,000	2017年3月31日	2017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

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
2018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	2018年3月31日	2018年6月21日
	A種種類株式					

## 第34期（自 2018年4月1日 至 2019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
2018年6月20日 定時株主総会	普通株式	12,520,000	313,000	2018年3月31日	2018年6月21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

2019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
2019年6月20日 定時株主総会	普通株式	利益 剰余金	11,280,000	282,000	2019年3月31日	2019年6月21日
	A種種類株式					

## （金融商品関係）

### 1. 金融商品の状況に関する事項

#### （1）金融商品に対する取組方針

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

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

#### （2）金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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あります。

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おります。

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おります。

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33期(2018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	-

第34期(2019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	41,087,475	41,087,475	-
(2) 金銭の信託	18,773,228	18,773,228	-
(3) 未収委託者報酬	12,438,085	12,438,085	-
(4) 未収運用受託報酬	3,295,109	3,295,109	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	1,488,684	1,488,684	-
資産計	77,082,582	77,082,582	-
(1) 未払手数料	4,883,723	4,883,723	-
負債計	4,883,723	4,883,723	-

(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33期 (2018年3月31日現在)	第34期 (2019年3月31日現在)
非上場株式	272,464	276,764
関係会社株式	3,229,196	4,499,196

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33期(2018年3月31日現在)

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

## 第34期(2019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	41,087,475	-	-	-
(2) 金銭の信託	18,773,228	-	-	-
(3) 未収委託者報酬	12,438,085	-	-	-
(4) 未収運用受託報酬	3,295,109	-	-	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券(投資信託)	153,518	1,995	996	-

## (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33期の貸借対照表計上額3,229,196千円、第34期の貸借対照表計上額4,499,196千円)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33期（2018年3月31日現在）

（千円）

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

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

第34期（2019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	1,326,372	111,223	1,215,148
投資信託	158,321	153,000	5,321
小計	1,484,694	264,223	1,220,470
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	3,990	4,000	9
小計	3,990	4,000	9
合計	1,488,684	268,223	1,220,460

（注）非上場株式（貸借対照表計上額276,674千円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

## 3. 当該事業年度中に売却したその他有価証券

第33期（自 2017年4月1日 至 2018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。

## 第34期(自2018年4月1日至2019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	394,222	353,644	-
投資信託	-	-	-

## (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2017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33期	第34期
	(自2017年4月1日 至2018年3月31日)	(自2018年4月1日 至2019年3月31日)
退職給付債務の期首残高	2,718,372	2,154,607
勤務費用	269,128	300,245
利息費用	7,523	1,918
数理計算上の差異の発生額	61,792	10,147
退職給付の支払額	111,758	158,018
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	-
その他	-	438
退職給付債務の期末残高	2,154,607	2,289,044

## (2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

(千円)

	第33期	第34期
	(自2017年4月1日 至2018年3月31日)	(自2018年4月1日 至2019年3月31日)
年金資産の期首残高	1,363,437	-
期待運用収益	17,042	-
事業主からの拠出額	36,672	-
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	-	-

## (3) 退職給付債務の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

(千円)

	第33期	第34期
	(2018年3月31日現在)	(2019年3月31日現在)
非積立型制度の退職給付債務	2,154,607	2,289,044
未積立退職給付債務	2,154,607	2,289,044
未認識数理計算上の差異	204,636	150,568
未認識過去勤務費用	312,836	243,317
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	1,637,133	1,895,158
退職給付引当金	1,637,133	1,895,158
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	1,637,133	1,895,158

## (4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(千円)

	第33期 (自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日)	第34期 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)
勤務費用	269,128	300,245
利息費用	7,523	1,918
期待運用収益	17,042	-
数理計算上の差異の費用処理額	88,417	43,920
過去勤務費用の費用処理額	39,611	69,519
退職一時金制度改定に伴う費用処理額	70,560	-
その他	1,620	3,640
確定給付制度に係る退職給付費用	456,577	411,963
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) 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33期 (2018年3月31日現在)	第34期 (2019年3月31日現在)
割引率	0.09%	0.09%
予想昇給率	1.00% ~ 4.42%	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33期 (自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日)	第34期 (自 2018年4月 1日 至 2019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	53,156	-
制度への拠出額	35,640	-
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	-	-

## (2) 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 53,156千円 当事業年度 - 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86,141千円、当事業年度104,720千円であります。

## (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33期	第34期
	(2018年3月31日現在)	(2019年3月31日現在)
	(千円)	(千円)
繰延税金資産		
未払事業税	290,493	173,805
未払事業所税	11,683	10,915
賞与引当金	426,815	411,675
未払法定福利費	81,186	80,253
未払給与	9,186	7,961
受取負担金	-	138,994
運用受託報酬	-	102,490
資産除去債務	90,524	10,152
減価償却超過額(一括償却資産)	11,331	4,569
減価償却超過額	176,791	125,839
繰延資産償却超過額(税法上)	34,977	135,542
退職給付引当金	501,290	580,297
時効後支払損引当金	60,941	54,458
ゴルフ会員権評価損	13,173	7,360
関係会社株式評価損	166,740	166,740
投資有価証券評価損	28,976	28,976
本社移転費用引当金	47,947	-
その他	29,193	29,494
繰延税金資産小計	1,981,254	2,069,527
評価性引当額	-	-
繰延税金資産合計	1,981,254	2,069,527
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	281,720	321,067
繰延税金負債合計	281,720	321,067
繰延税金資産の純額	1,699,533	1,748,459

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、2016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、2016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

2016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) 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

## (2) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

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

## (3) 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。

## (4) 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

	第33期 (2018年3月31日現在)	第34期 (2019年3月31日現在)
流動資産	- 千円	- 千円
固定資産	114,270,495千円	104,326,078千円
資産合計	114,270,495千円	104,326,078千円
流動負債	- 千円	- 千円
固定負債	13,059,836千円	10,571,428千円
負債合計	13,059,836千円	10,571,428千円
純資産	101,210,659千円	93,754,650千円

(注) 固定資産及び資産合計には、のれん及び顧客関連資産の金額が含まれております。

のれん	70,507,975千円	66,696,733千円
顧客関連資産	45,200,838千円	39,959,586千円

## (2) 損益計算書項目

	第33期 (自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日)	第34期 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)
営業収益	- 千円	- 千円
営業利益	9,012,128千円	9,043,138千円
経常利益	9,012,128千円	9,043,138千円
税引前当期純利益	9,012,128千円	9,091,728千円
当期純利益	7,419,617千円	7,489,721千円
1株当たり当期純利益	185,490円43銭	187,243円04銭

(注) 営業利益には、のれん及び顧客関連資産の償却額が含まれております。

のれんの償却額	3,811,241千円	3,811,241千円
顧客関連資産の償却額	5,233,360千円	5,241,252千円

(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33期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)及び第34期(自 2018年4月1日 至 2019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33期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

該当はありません。

第34期(自 2018年4月1日 至 2019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33期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

該当はありません。

第34期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

該当はありません。

## (3) 兄弟会社等

## 第33期(自 2017年4月1日 至 2018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

## 第34期(自 2018年4月1日 至 2019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	6,048,352	未払 手数料	915,980
								子会社株式 の取得	1,270,000	-	-
	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	10,215,017	未払 手数料	1,670,194

## 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) 子会社株式の取得は、独立した第三者機関により算定された価格を基礎として協議の上、合理的に決定しております。

(注3) 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33期 (自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日)	第34期 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)
1株当たり純資産額	1,667,445円37銭	1,708,727円13銭
1株当たり当期純利益金額	391,255円29銭	352,987円92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33期 (自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日)	第34期 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)
当期純利益金額	15,650,211千円	14,119,516千円
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	15,650,211千円	14,119,516千円
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	40,000株
(うち普通株式)	(24,490株)	(24,490株)
(うちA種種類株式)	(15,510株)	(15,510株)

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

#### 4【利害関係人との取引制限】

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

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

#### 5【その他】

- (1) 定款の変更、事業譲渡又は事業譲受、出資の状況その他の重要事項

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。
株式会社常陽銀行	85,113	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社福岡銀行	82,329	日本において銀行業務を営んでおります。
カブドットコム証券株式会社	7,196	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
株式会社SBI証券	48,323	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
岡三オンライン証券株式会社	2,500	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
楽天証券株式会社	7,495	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
東武証券株式会社(1)	420	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
マネックス証券株式会社	12,200	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
松井証券株式会社	11,944	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。

(注) 資本金の額は2018年3月末日現在

(1)(標準型)(積極型)の取扱いはありません。

## 2【関係業務の概要】

「受託会社」は、以下の業務を行います。

- (1) 委託会社の指図に基づく信託財産の管理、保管、処分
- (2) 信託財産の計算
- (3) 信託財産に関する報告書の作成

#### (4) その他上記に付帯する業務

「販売会社」は、以下の業務を行います。

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

### 3【資本関係】

該当事項はありません。

持株比率5%以上を記載します。

### 第3【その他】

(1)目論見書の表紙等にロゴ・マーク、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

2019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

## 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2018年4月1日から2019年3月31日までの第34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2019年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 利害関係

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

以上

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

(注2) XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。

## 独立監査人の監査報告書

平成30年11月22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」に掲げられているたわらノーロード バランス（堅実型）の平成29年11月8日から平成30年10月12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、たわらノーロード バランス（堅実型）の平成30年10月12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30年11月22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」に掲げられているたわらノーロード バランス（標準型）の平成29年11月8日から平成30年10月12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、たわらノーロード バランス（標準型）の平成30年10月12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30年11月22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」に掲げられているたわらノーロード バランス（積極型）の平成29年11月8日から平成30年10月12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、たわらノーロード バランス（積極型）の平成30年10月12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

令和1年5月31日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 丘本 正彦 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」に掲げられているたわらノーロード バランス（堅実型）の平成30年10月13日から平成31年4月12日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

### 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

### 監査人の責任

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

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要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、たわらノーロード バランス（堅実型）の平成31年4月12日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成30年10月13日から平成31年4月12日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

### 利害関係

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

以上

---

(注1) 上記は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。

## 独立監査人の中間監査報告書

令和1年5月31日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 丘本 正彦 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」に掲げられているたわらノーロード バランス（標準型）の平成30年10月13日から平成31年4月12日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

### 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

### 監査人の責任

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

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要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、たわらノーロード バランス（標準型）の平成31年4月12日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成30年10月13日から平成31年4月12日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

### 利害関係

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

以上

---

(注1) 上記は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。

## 独立監査人の中間監査報告書

令和1年5月31日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 丘本 正彦 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」に掲げられているたわらノーロード バランス（積極型）の平成30年10月13日から平成31年4月12日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

### 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

### 監査人の責任

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

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要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、たわらノーロード バランス（積極型）の平成31年4月12日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成30年10月13日から平成31年4月12日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

### 利害関係

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

以上

---

(注1) 上記は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。