

【表紙】

| | |
|--|--|
| 【提出書類】 | 有価証券届出書の訂正届出書 |
| 【提出先】 | 関東財務局長 |
| 【提出日】 | 平成30年8月23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 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） |
| 【届出の対象とした募集内国 投資信託受益証券の金額】 | 当初自己設定： たわらノーロード スマートグローバルバランス （保守型） 100万円を上限とします。 たわらノーロード スマートグローバルバランス （安定型） 100万円を上限とします。 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） 100万円を上限とします。 たわらノーロード スマートグローバルバランス （成長型） 100万円を上限とします。 たわらノーロード スマートグローバルバランス （積極型） 100万円を上限とします。 継続申込期間： たわらノーロード スマートグローバルバランス （保守型） 1兆円を上限とします。 たわらノーロード スマートグローバルバランス （安定型） 1兆円を上限とします。 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） 1兆円を上限とします。 たわらノーロード スマートグローバルバランス （成長型） 1兆円を上限とします。 たわらノーロード スマートグローバルバランス （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。 |

1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

半期報告書の提出に伴い、平成29年11月8日付をもって提出した有価証券届出書(以下「原届出書」といいます。)について記載事項の一部に変更が生じるため、関係情報を訂正するため、また各ファンドが投資対象とするマザーファンドの約款変更(信用リスクを適正に管理する方法の追加)に伴う所要の変更等を行うため、本訂正届出書を提出するものです。

2【訂正の内容】

_____の部分は訂正部分を示します。

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】

原届出書の「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」につきましては、以下の内容に更新・訂正いたします。

<更新・訂正後>

各ファンドの目的は、以下の通りです。

| | |
|---------|--|
| (保守型) | 安定した収益の確保を図ることを目的として、運用を行います。 |
| (安定型) | 安定した収益の確保と信託財産の着実な成長を図ることを目的として、運用を行います。 |
| (安定成長型) | 信託財産の着実な成長と安定した収益の確保を図ることを目的として、運用を行います。 |
| (成長型) | 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。 |
| (積極型) | 信託財産の成長を図ることを目的として、積極的な運用を行います。 |

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^{*1*}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。なお、短期金融資産等に「DIAMマネーマザーファンド」を通じてまたは直接投資する場合があります。(以下および「DIAMマネーマザーファンド」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 | 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 |
| 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 各資産への投資比率を委託会社が決定するにあたっては、みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社から投資助言を受けます。

各ファンドにおける資産別の投資比率は、各資産に期待される収益率や過去一定期間における資産価格変動性(標準偏差)等、客観的に入手しうるデータに基づき、定量的に算出されます。

投資比率の見直しは原則として年2回行います。

みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社(FT社)について

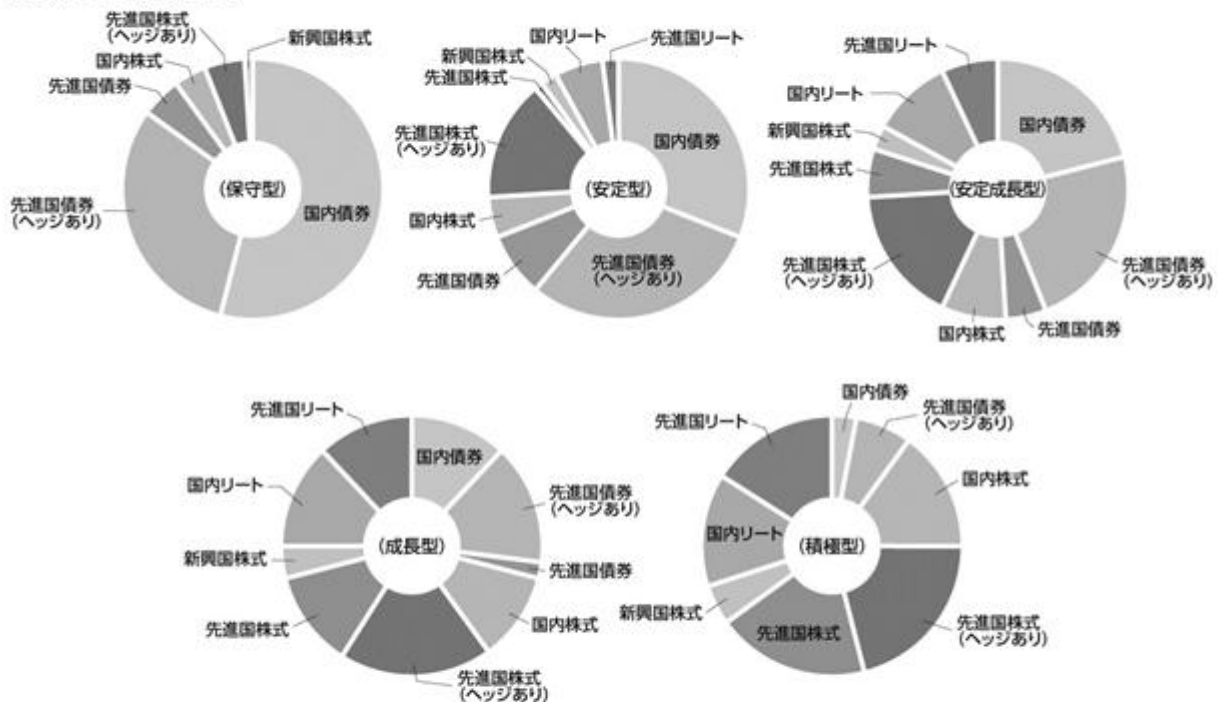
- FT社は数理科学をベースとした総合リスク管理やデリバティブズおよび投資・運用手法などの金融技術の開発を総合的に行う会社です。
- 資産運用に関連した業務としては、先進的な金融工学技術を活用し、精緻なリスク制御手法に基づいて資産運用商品の開発、コンサルティング、投資助言などを行なっています。

3 資産配分の組み合わせにより、運用方針*の異なる5つのファンドから選択できます。決定された投資比率に基づき、各マザーファンド受益証券への投資を行いポートフォリオを構築します。

なお、一部のマザーファンドへの投資配分比率がゼロとなる場合があります。

*ファンドの目的参照

(各ファンドの投資比率)



| 資産クラス | (保守型) | (安定型) | (安定成長型) | (成長型) | (積極型) |
|--------------|-------|-------|---------|-------|-------|
| 国内債券 | 54.0% | 31.0% | 21.0% | 12.0% | 3.0% |
| 先進国債券(ヘッジあり) | 31.0% | 30.0% | 23.0% | 15.0% | 7.0% |
| 先進国債券 | 5.0% | 8.0% | 5.0% | 2.0% | 0.0% |
| 国内株式 | 4.0% | 5.0% | 8.0% | 11.0% | 15.0% |
| 先進国株式(ヘッジあり) | 5.0% | 15.0% | 17.0% | 19.0% | 21.0% |
| 先進国株式 | 0.0% | 1.0% | 6.0% | 12.0% | 19.0% |
| 新興国株式 | 1.0% | 2.0% | 3.0% | 4.0% | 5.0% |
| 国内リート | 0.0% | 6.0% | 10.0% | 13.0% | 14.0% |
| 先進国リート | 0.0% | 2.0% | 7.0% | 12.0% | 16.0% |

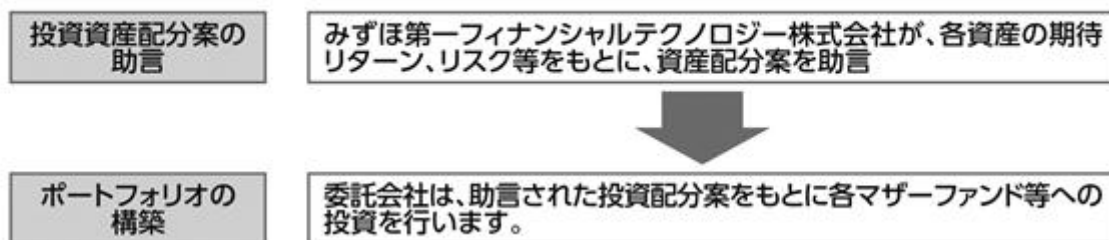
※2018年5月末現在のものであり、今後変更される可能性があります。

4 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。

運用プロセス



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。 |

< 属性区分 >

・ 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 | グローバル (日本を含む) | | |
| | 年2回 | 日本 | | |
| | 年4回 | 北米 | ファミリー ファンド | あり (一部ヘッジ) |
| 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) | 欧州 | | |
| | 年12回 (毎月) | アジア | | |
| | 日々 | オセアニア | | |
| 不動産投信 | その他 () | 中南米 | ファンド・オブ・ ファンズ | なし |
| その他資産 (投資信託証券 (資産複合 (債券、 株式、不動産投信) 資産配分変更型)) | | アフリカ | | |
| | | 中近東 (中東) | | |
| 資産複合 () 資産配分固定型 資産配分変更型 | | エマージング | | |

(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 配分変更型)) | 目論見書または投資信託約款において、投資信託証券への投資を通じて、 主として複数の資産 (債券、株式、不動産投信) を実質的な投資対象と し、組入比率については、機動的な変更を行う旨の記載があるものもしくは は固定的とする旨の記載がないものをいう。 |
|---|---|

| | |
|------------------|---|
| 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(<http://www.toushin.or.jp/>)でご覧いただけます。

(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】

<訂正前>

平成29年11月24日 信託契約締結、ファンドの設定、ファンドの運用開始(予定)

<訂正後>

平成29年11月24日 信託契約締結、ファンドの設定、ファンドの運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】

<訂正前>

(略)

委託会社の概況

(略)

資本金の額

20億円(平成29年8月31日現在)

(略)

大株主の状況

(平成29年8月31日現在)

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

1: A種種類株式(15,510株)を含みます。

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

<訂正後>

(略)

委託会社の概況

(略)

資本金の額

20億円(平成30年5月31日現在)

(略)

大株主の状況

(平成30年5月31日現在)

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

1：A種種類株式(15,510株)を含みます。

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

<訂正前>

(略)

<投資態度>

(略)

| 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 |
|------------------------------|----------------------------------|-------------------|
| (略) | | |
| 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド | シティ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 | シティ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) |
| (略) | | |

(略)

<訂正後>

(略)

<投資態度>

(略)

| 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 |
|------------------------------|-----------------------------------|-------------------|
| (略) | | |
| 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) |
| (略) | | |

(略)

(2) 【投資対象】

<訂正前>

(略)

(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 | 国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド |
| (略) | |

| | |
|--------|---|
| 投資態度 | <p>(略)</p> <p>TOPIXの指数値及び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TOPIXに関するすべての権利及び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、TOPIXの指数値の算出若しくは公表の方法の変更、TOPIXの指数値の算出若しくは公表の停止又はTOPIXの商標の変更若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、TOPIXの商標の使用もしくはTOPIXの引用に関して得られる結果について、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、TOPIXの指数値及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、TOPIXの指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。</p> <p>当マザーファンドはTOPIXの指数値に連動した投資成果を目標として運用していますが、当マザーファンドの基準価額とTOPIXの指数値の動向が乖離することがあります。</p> <p>当マザーファンド及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、保証又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、当マザーファンド及び当マザーファンドに投資するファンドの購入者又は公衆に対し、当マザーファンド及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、当社又は当マザーファンド及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、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及び当マザーファンドに投資するファンドの発行又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> |
| (略) | (略) |
| 主な投資制限 | <p>(略)</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> |
| ファンド名 | 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド |
| (略) | (略) |

| | |
|------|---|
| 投資態度 | <p>(略)</p> <p>2. 公社債（債券先物取引等を含みます。）の組入比率は、原則として高位を維持します。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。</p> <p>(略)</p> <p><u>NOMURA - B P I 総合は、野村證券株式会社が公表している指数で、その知的財産権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、対象インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、対象インデックスを用いて行われる事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。</u></p> |
|------|---|

(略)

| | |
|--------|---|
| 主な投資制限 | <p>(略)</p> <p>3. 同一銘柄の株式への投資割合は、<u>取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。</u></p> <p>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、<u>取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。</u></p> <p>(略)</p> <p>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。</p> |
|--------|---|

| | |
|-------|-----------------------|
| ファンド名 | 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド |
|-------|-----------------------|

(略)

| | |
|------|--|
| 投資態度 | <p>(略)</p> <p><u>M S C I コクサイ・インデックスは、M S C I I n c . が公表しているインデックスで、当指数に関する著作権、知的所有権その他一切の権利はM S C I I n c . に属しており、また、M S C I I n c . 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。</u></p> |
|------|--|

(略)

| | |
|--------|--|
| 主な投資制限 | <p>(略)</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> |
|--------|--|

| | |
|-------|-----------------------|
| ファンド名 | 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド |
|-------|-----------------------|

(略)

| | |
|--------|--|
| 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、「<u>シティ世界国債インデックス</u> (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>(略)</p> <p><u>シティ世界国債インデックスに関する著作権等の知的財産その他一切の権利はシティグループ・インデックスLLCに帰属します。</u></p> |
| 運用プロセス | <p>1.流動性基準等による対象銘柄群設定</p> <p><u>シティ世界国債インデックス</u>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。</p> <p>(略)</p> |
| 主な投資制限 | <p>(略)</p> <p>2.同一銘柄の株式への投資割合は、<u>取得時において信託財産の純資産総額の10%以下</u>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、<u>取得時において信託財産の純資産総額の10%以下</u>とします。</p> <p>(略)</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> |

| | |
|--------|---|
| 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 |
| | (略) |
| 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、「<u>シティ世界国債インデックス</u> (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>(略)</p> <p><u>シティ世界国債インデックスに関する著作権等の知的財産その他一切の権利はシティグループ・インデックスLLCに帰属します。</u></p> |
| | (略) |
| 主な投資制限 | <p>(略)</p> <p>3.同一銘柄の株式への投資割合は、<u>取得時において信託財産の純資産総額の10%以下</u>とします。</p> <p>4.同一銘柄の転換社債等への投資は、<u>取得時において信託財産の純資産総額の10%以下</u>とします。</p> <p>(略)</p> <p>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。</p> |

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

| | |
|--------|--|
| 投資態度 | (略) <u>MSCIエマージング・マーケット・インデックスは、MSCI Inc.が公表しているインデックスで、当指数に関する著作権、知的所有権その他一切の権利はMSCI Inc.に属しており、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。</u> |
| (略) | |
| 主な投資制限 | (略) 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。 |
| ファンド名 | J-REITインデックスファンド・マザーファンド |
| (略) | |

| | |
|--------|---|
| 投資態度 | <p>(略)</p> <p>東証REIT指数の指数値及び東証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」という。）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及び東証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。</p> <p>(株)東京証券取引所は、東証REIT指数の指数値の算出若しくは公表の方法の変更、東証REIT指数の指数値の算出若しくは公表の停止又は東証REIT指数の商標の変更若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REIT指数の商標の使用もしくは東証REIT指数の引用に関して得られる結果について、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REIT指数の指数値及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又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。</p> <p>当マザーファンドは東証REIT指数の指数値に連動した投資成果を目標として運用しますが、当マザーファンドの基準価額と東証REIT指数の指数値の動向が乖離することがあります。</p> <p>当マザーファンド及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、保証又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、当マザーファンド及び当マザーファンドに投資するファンドの購入者又は公衆に対し、当マザーファンド及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、当社又は当マザーファンド及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。</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及び当マザーファンドに投資するファンドの発行又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> |
| (略) | (略) |
| 主な投資制限 | <p>(略)</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、価格変動および金利変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</p> |
| 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 |
| (略) | (略) |
| 投資態度 | (略) |

Standard & Poor's®並びに S&P®は、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(以下「S&P」)の登録商標です。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(以下「ダウ・ジョーンズ」)の登録商標です。これらはS&Pダウ・ジョーンズ・インデックスLLCに対して使用許諾が与えられており、委託会社に対しては特定の目的のために使用するサブライセンスが与えられています。S&P 先進国 REITインデックスはS&Pダウ・ジョーンズ・インデックスLLCが所有しており、委託会社に対して使用許諾が与えられています。S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスLLC、ダウ・ジョーンズ、S&P、およびその関連会社(以下総称してS&Pダウ・ジョーンズ・インデックスとする)は、委託会社の商品を支持、推奨、販売、販売促進するものではなく、本商品の所有者もしくは一般の者に対して、有価証券全般または商品に関する投資について、またS&P 先進国 REITインデックスが市場全般のパフォーマンスに追従する能力について、何ら表明、条件付け又は保証するものではありません。S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスの委託会社に対するS&P 先進国 REITインデックスに関わる唯一の関係は、該当する指数、登録商標、サービスマーク、S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスの商号についての使用許諾を与えることです。

S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスは、S&P 先進国 REITインデックスに関する決定、作成及び計算において、委託会社又は本商品の所有者に関係なく行います。S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスは、S&P 先進国 REITインデックスに関する決定、作成及び計算において、委託会社又は本商品の所有者の要求等を考慮する義務を負いません。S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスは本商品の販売に関する時期、価格の決定、又は本商品を現金に換算する式の決定もしくは計算に責任を負わず、また関わっていません。S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスは、本商品の管理、マーケティング又は取引に関する義務又は責任を何ら負うものではありません。指数に基づく投資商品が指数のパフォーマンスに正確に連動し、プラスの投資リターンを上げる保証はありません。S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスは投資顧問会社ではありません。指数の構成銘柄はS&Pダウ・ジョーンズ・インデックスが売買及び保有を推奨する銘柄ではなく投資アドバイスをするものでもありません。

S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスは、S&P 先進国 REITインデックスの適格性、正確性、適時性、完全性、データの遅延、及び電子媒体を含む口頭または書面でのコミュニケーションについて保証しません。S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスは、障害、債務、誤り、欠落又は遅延に対する責任を負いません。

S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスは、特定の目的、使用、もしくは委託会社を得るであろう結果への商品的確性、もしくは適切性の保障に関して、明示的にも暗示的にも保証しません。以上のことに関わらず、いかなる場合においても、間接的、偶発的、罰則的、あるいは結果的な損害(利益の損失、トレーディング損失、損失時間、のれんを含む)について、仮にそれらの可能性について事前に通知されていたとしても、S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスが責任を負うことはありません。S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスと委託会社間

| | |
|--|---|
| | での合意及び協定において、S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスの許諾者を除き、第3の受益者は存在しません。 |
|--|---|

(略)

主な投資制限

(略)

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。

ファンド名

DIAMマネーマザーファンド

(略)

主な投資制限

(略)

7. デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます。)は、価格変動および金利変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。

(略)

<訂正後>

(略)

(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

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

(略)

| | |
|--------|--|
| 投資態度 | <p>(略)</p> <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> |
| (略) | (略) |
| 主な投資制限 | <p>(略)</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 | 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド |
| (略) | (略) |

| | |
|--------|--|
| 投資態度 | <p>(略)</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>(略)</p> <p><u>NOMURA - B P I 総合の知的財産権その他一切の権利は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。</u></p> |
| (略) | |
| 主な投資制限 | <p>(略)</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>(略)</p> <p>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。</p> <p>8. <u>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。</u></p> |
| ファンド名 | 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド |
| (略) | |

| | |
|------|-----|
| 投資態度 | (略) |
|------|-----|

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限りなく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

| | |
|--------|--|
| | <p>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> |
| (略) | |
| 主な投資制限 | <p>(略)</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 | 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド |
| (略) | |
| 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>(略)</p> <p>FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。</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> |
| 運用プロセス | <p>1. 流動性基準等による対象銘柄群設定</p> <p>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。</p> <p>(略)</p> |

| | |
|--------|---|
| 主な投資制限 | <p>(略)</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>(略)</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 |
| (略) | |
| 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>(略)</p> <p><u>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。</u></p> <p><u>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。</u></p> |
| (略) | |

| | |
|--------|--|
| 主な投資制限 | <p>(略)</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>(略)</p> <p>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。</p> <p>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。</p> |
|--------|--|

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

| | |
|------|-----|
| 投資態度 | (略) |
|------|-----|

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。 |
| (略) | |
| 主な投資制限 | (略) 5. 外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。 6. 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。 |
| ファンド名 | J - R E I Tインデックスファンド・マザーファンド |
| (略) | |

| | |
|--------|---|
| 投資態度 | <p>(略)</p> <p>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。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</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。</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> |
| (略) | (略) |
| 主な投資制限 | <p>(略)</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、価格変動および金利変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</p> <p>6. 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> |
| ファンド名 | 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド |

| | |
|------|-----|
| (略) | |
| 投資態度 | (略) |

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

S&P Dow Jones Indicesは、S & P 先進国 REIT インデックスまたはその関連データ、あるいは口頭または書面の通信(電子通信も含む)を含むがこれに限定されないあらゆる通信について、その妥当性、正確性、適時性、または完全性を保証しません。S&P Dow Jones Indicesは、これに含まれる過誤、遺漏または中断に対して、いかなる義務または責任も負わないものとします。S&P Dow Jones Indicesは、明示的または黙示的を問わず、いかなる保証もせず、商品性、特定の目的または使用への適合性、もしくはS & P 先進国 REIT インデックスを使用することによって、またはそれに関連するデータに関

して、委託会社、本商品の所有者、またはその他の人物や組織が得られる結果について、一切の保証を明示的に否認します。上記を制限することなく、いかなる場合においても、S&P Dow Jones Indicesは、利益の逸失、営業損失、時間または信用の喪失を含むがこれらに限定されない、間接的、特別、懲罰的、または派生的損害に対して、たとえその可能性について知らされていたとしても、契約の記述、不法行為、または厳格責任の有無を問わず、一切の責任を負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。

(略)

主な投資制限

(略)

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

D I A Mマネーマザーファンド

(略)

主な投資制限

(略)

7. デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます。)は、価格変動および金利変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。
8. 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

(略)

(3) 【運用体制】

< 訂正前 >

(略)

運用体制は平成29年8月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

(略)

< 訂正後 >

（略）

運用体制は平成30年5月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

（略）

3【投資リスク】

<リスク管理体制>

<訂正前>

（略）

上記体制は平成29年8月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

<訂正後>

上記体制は平成30年5月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

「参考情報」につきましては、以下の内容に更新・訂正いたします。

<更新・訂正後>

<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

(保守型)



(安定型)



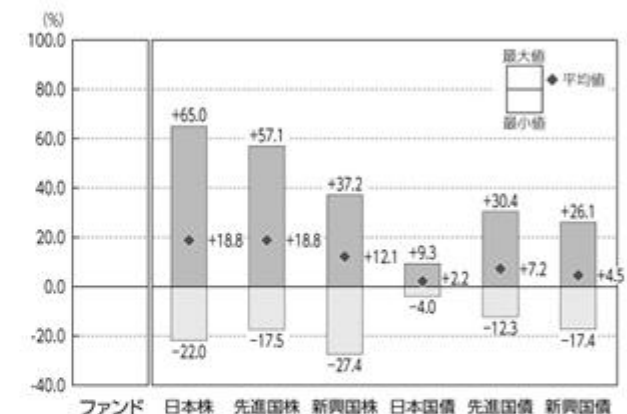
(安定成長型)



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

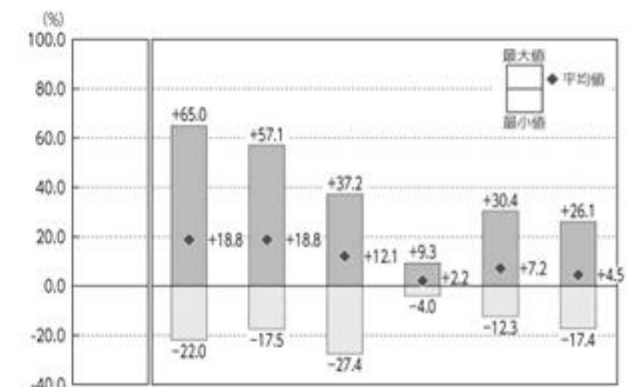
*ファンドは2018年5月末現在、設定後1年を経過していないため、年間騰落率はありません。

ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



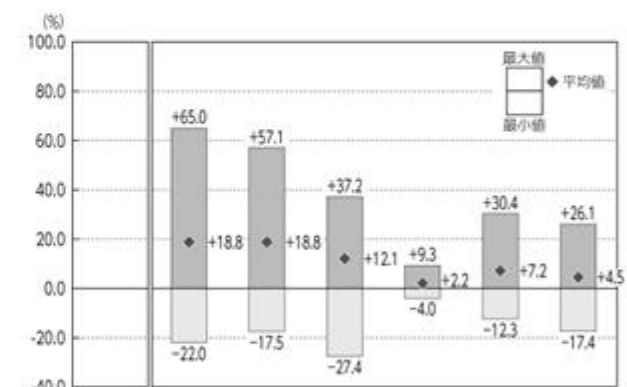
ファンド:2018年5月末現在、設定後1年を経過していないため、データはありません。

代表的な資産クラス:2013年6月～2018年5月



ファンド:2018年5月末現在、設定後1年を経過していないため、データはありません。

代表的な資産クラス:2013年6月～2018年5月



ファンド:2018年5月末現在、設定後1年を経過していないため、データはありません。

代表的な資産クラス:2013年6月～2018年5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。

<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

(成長型)



2013年6月 2014年6月 2015年6月 2016年6月 2017年6月 2018年5月

(積極型)

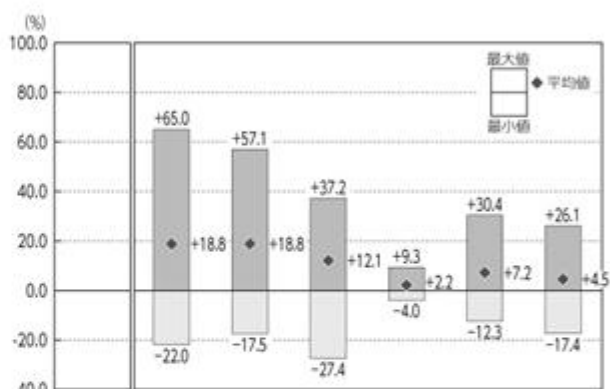


2013年6月 2014年6月 2015年6月 2016年6月 2017年6月 2018年5月

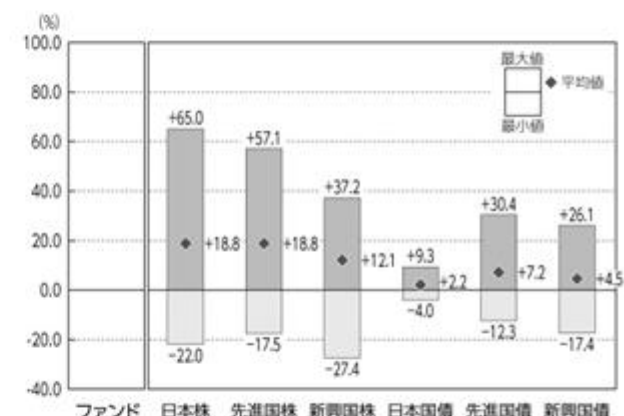
*ファンドの分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した基準価額が記載されていますので、実際の基準価額とは異なる場合があります。

*ファンドは2018年5月末現在、設定後1年を経過していないため、年間騰落率はありません。

ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



ファンド:2018年5月末現在、設定後1年を経過していないため、データはありません。
代表的な資産クラス:2013年6月~2018年5月



ファンド:2018年5月末現在、設定後1年を経過していないため、データはありません。
代表的な資産クラス:2013年6月~2018年5月

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

*全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

*各資産クラスの指数

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

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

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

4【手数料等及び税金】

(3)【信託報酬等】

<訂正前>

(略)

有価証券届出書提出日（平成29年11月8日）現在は、年率0.54%（税抜0.50%）になります。

配分は以下の通りです。

(略)

<訂正後>

(略)

平成30年8月23日現在は、年率0.54%（税抜0.50%）になります。

配分は以下の通りです。

(略)

(5)【課税上の取扱い】

<訂正前>

(略)

上記は、平成29年8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。

(略)

<訂正後>

(略)

上記は、平成30年5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。

(略)

5【運用状況】

原届出書の「第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 5 運用状況」につきましては、以下の内容に更新・訂正いたします。

<更新・訂正後>

(1)【投資状況】

たわらノーロード スマートグローバルバランス（保守型）

平成30年5月31日現在

| 資産の種類 | 時価合計（円） | 投資比率（％） |
|-----------------------|-----------|---------|
| 親投資信託受益証券 | 4,190,775 | 98.95 |
| 内 日本 | 4,190,775 | 98.95 |
| コール・ローン、その他の資産（負債控除後） | 44,502 | 1.05 |
| 純資産総額 | 4,235,277 | 100.00 |

その他資産の投資状況

平成30年5月31日現在

| 資産の種類 | 時価合計（円） | 投資比率（％） |
|------------|---------|---------|
| 為替予約取引（売建） | 189,842 | 4.48 |
| - | 189,842 | 4.48 |

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

たわらノーロード スマートグローバルバランス（安定型）

平成30年5月31日現在

| 資産の種類 | 時価合計（円） | 投資比率（％） |
|-----------------------|-------------|---------|
| 親投資信託受益証券 | 151,904,910 | 99.18 |
| 内 日本 | 151,904,910 | 99.18 |
| コール・ローン、その他の資産（負債控除後） | 1,262,521 | 0.82 |
| 純資産総額 | 153,167,431 | 100.00 |

その他資産の投資状況

平成30年5月31日現在

| 資産の種類 | 時価合計（円） | 投資比率（％） |
|------------|------------|---------|
| 為替予約取引（売建） | 21,960,255 | 14.34 |
| - | 21,960,255 | 14.34 |

（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）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 スマートグローバルバランス（安定成長型）

平成30年5月31日現在

| 資産の種類 | 時価合計（円） | 投資比率（％） |
|-----------------------|-------------|---------|
| 親投資信託受益証券 | 225,130,933 | 98.85 |
| 内 日本 | 225,130,933 | 98.85 |
| コール・ローン、その他の資産（負債控除後） | 2,611,935 | 1.15 |
| 純資産総額 | 227,742,868 | 100.00 |

その他資産の投資状況

平成30年5月31日現在

| 資産の種類 | 時価合計（円） | 投資比率（％） |
|------------|------------|---------|
| 為替予約取引（売建） | 36,153,409 | 15.87 |
| - | 36,153,409 | 15.87 |

（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 スマートグローバルバランス（成長型）

平成30年5月31日現在

| 資産の種類 | 時価合計（円） | 投資比率（％） |
|-----------------------|-------------|---------|
| 親投資信託受益証券 | 108,132,907 | 99.24 |
| 内 日本 | 108,132,907 | 99.24 |
| コール・ローン、その他の資産（負債控除後） | 822,964 | 0.76 |
| 純資産総額 | 108,955,871 | 100.00 |

その他資産の投資状況

平成30年5月31日現在

| 資産の種類 | 時価合計（円） | 投資比率（％） |
|------------|------------|---------|
| 為替予約取引（売建） | 19,949,929 | 18.31 |
| - | 19,949,929 | 18.31 |

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

たわらノーロード スマートグローバルバランス（積極型）

平成30年5月31日現在

| 資産の種類 | 時価合計（円） | 投資比率（％） |
|-----------------------|-------------|---------|
| 親投資信託受益証券 | 219,337,341 | 99.27 |
| 内 日本 | 219,337,341 | 99.27 |
| コール・ローン、その他の資産（負債控除後） | 1,617,955 | 0.73 |
| 純資産総額 | 220,955,296 | 100.00 |

その他資産の投資状況

平成30年5月31日現在

| 資産の種類 | 時価合計（円） | 投資比率（％） |
|------------|------------|---------|
| 為替予約取引（売建） | 44,607,775 | 20.19 |
| - | 44,607,775 | 20.19 |

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

(参考)

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

平成30年5月31日現在

| 資産の種類 | 時価合計（円） | 投資比率（％） |
|-----------------------|-----------------|---------|
| 株式 | 290,049,467,830 | 97.43 |
| 内 日本 | 290,049,467,830 | 97.43 |
| コール・ローン、その他の資産（負債控除後） | 7,651,548,774 | 2.57 |
| 純資産総額 | 297,701,016,604 | 100.00 |

その他資産の投資状況

平成30年5月31日現在

| 資産の種類 | 時価合計（円） | 投資比率（％） |
|--------------|---------------|---------|
| 株価指数先物取引（買建） | 6,489,540,000 | 2.18 |
| 内 日本 | 6,489,540,000 | 2.18 |

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

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

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

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年5月31日現在

| 資産の種類 | 時価合計（円） | 投資比率（％） |
|-----------------------|-----------------|---------|
| 国債証券 | 290,326,808,500 | 83.80 |
| 内 日本 | 290,326,808,500 | 83.80 |
| 地方債証券 | 22,653,491,882 | 6.54 |
| 内 日本 | 22,653,491,882 | 6.54 |
| 特殊債券 | 15,217,695,104 | 4.39 |
| 内 日本 | 15,217,695,104 | 4.39 |
| 社債券 | 16,021,763,550 | 4.62 |
| 内 日本 | 15,820,857,550 | 4.57 |
| 内 オランダ | 200,906,000 | 0.06 |
| コール・ローン、その他の資産（負債控除後） | 2,217,952,889 | 0.64 |
| 純資産総額 | 346,437,711,925 | 100.00 |

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

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

J-REITインデックスファンド・マザーファンド

平成30年5月31日現在

| 資産の種類 | 時価合計（円） | 投資比率（％） |
|-----------------------|----------------|---------|
| 投資証券 | 34,419,876,490 | 97.83 |
| 内 日本 | 34,419,876,490 | 97.83 |
| コール・ローン、その他の資産（負債控除後） | 762,537,110 | 2.17 |
| 純資産総額 | 35,182,413,600 | 100.00 |

その他資産の投資状況

平成30年5月31日現在

| 資産の種類 | 時価合計（円） | 投資比率（％） |
|-----------------|-------------|---------|
| 不動産投信指数先物取引（買建） | 608,634,000 | 1.73 |
| 内 日本 | 608,634,000 | 1.73 |

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年5月31日現在

| 資産の種類 | 時価合計（円） | 投資比率（％） |
|---------------|-----------------|---------|
| 株式 | 289,771,018,104 | 95.16 |
| 内 アメリカ | 183,481,337,625 | 60.26 |
| 内 イギリス | 19,941,131,732 | 6.55 |
| 内 フランス | 11,580,329,485 | 3.80 |
| 内 カナダ | 11,370,241,448 | 3.73 |
| 内 ドイツ | 11,311,072,347 | 3.71 |
| 内 スイス | 9,785,036,474 | 3.21 |
| 内 オーストラリア | 7,254,513,769 | 2.38 |
| 内 オランダ | 5,799,695,899 | 1.90 |
| 内 アイルランド | 4,153,367,817 | 1.36 |
| 内 スペイン | 3,490,016,449 | 1.15 |
| 内 スウェーデン | 3,002,663,347 | 0.99 |
| 内 香港 | 2,939,069,188 | 0.97 |
| 内 イタリア | 2,209,379,002 | 0.73 |
| 内 デンマーク | 1,988,285,265 | 0.65 |
| 内 ジャージー | 1,673,724,945 | 0.55 |
| 内 シンガポール | 1,427,424,185 | 0.47 |
| 内 パミュダ | 1,311,039,228 | 0.43 |
| 内 フィンランド | 1,224,802,627 | 0.40 |
| 内 ベルギー | 1,208,000,141 | 0.40 |
| 内 ケイマン諸島 | 856,730,697 | 0.28 |
| 内 ノルウェー | 796,260,605 | 0.26 |
| 内 オランダ領キュラソー | 789,981,437 | 0.26 |
| 内 イスラエル | 573,277,276 | 0.19 |
| 内 ルクセンブルグ | 382,643,160 | 0.13 |
| 内 オーストリア | 279,254,002 | 0.09 |
| 内 ニューゼーランド | 200,626,948 | 0.07 |
| 内 ポルトガル | 174,736,727 | 0.06 |
| 内 パナマ | 170,302,255 | 0.06 |
| 内 リベリア | 141,709,217 | 0.05 |
| 内 マン島 | 95,034,782 | 0.03 |
| 内 イギリス領バージン諸島 | 79,704,990 | 0.03 |
| 内 パプアニューギニア | 62,202,487 | 0.02 |
| 内 モーリシャス | 17,422,548 | 0.01 |
| 投資信託受益証券 | 755,367,870 | 0.25 |
| 内 オーストラリア | 597,816,823 | 0.20 |

| | | | |
|-----------------------|----------|-----------------|--------|
| | 内 シンガポール | 157,551,047 | 0.05 |
| 投資証券 | | 6,242,401,697 | 2.05 |
| | 内 アメリカ | 5,369,771,453 | 1.76 |
| | 内 フランス | 361,401,778 | 0.12 |
| | 内 イギリス | 310,925,693 | 0.10 |
| | 内 香港 | 156,135,551 | 0.05 |
| | 内 カナダ | 44,167,222 | 0.01 |
| コール・ローン、その他の資産(負債控除後) | | 7,735,485,239 | 2.54 |
| 純資産総額 | | 304,504,272,910 | 100.00 |

その他資産の投資状況

平成30年5月31日現在

| 資産の種類 | 時価合計(円) | 投資比率(%) |
|--------------|---------------|---------|
| 為替予約取引(買建) | 1,554,697,910 | 0.51 |
| - | 1,554,697,910 | 0.51 |
| 為替予約取引(売建) | 530,581,810 | 0.17 |
| - | 530,581,810 | 0.17 |
| 株価指数先物取引(買建) | 6,894,812,755 | 2.26 |
| 内 アメリカ | 4,753,258,057 | 1.56 |
| 内 ドイツ | 1,201,266,066 | 0.39 |
| 内 イギリス | 486,875,188 | 0.16 |
| 内 カナダ | 255,938,144 | 0.08 |
| 内 オーストラリア | 197,475,300 | 0.06 |

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

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

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

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

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年5月31日現在

| 資産の種類 | 時価合計(円) | 投資比率(%) |
|-----------------------|-----------------|---------|
| 国債証券 | 207,742,932,034 | 97.41 |
| 内 アメリカ | 92,471,347,643 | 43.36 |
| 内 フランス | 21,644,981,848 | 10.15 |
| 内 イタリア | 18,889,030,463 | 8.86 |
| 内 イギリス | 14,728,567,313 | 6.91 |
| 内 ドイツ | 14,294,600,423 | 6.70 |
| 内 スペイン | 12,376,060,135 | 5.80 |
| 内 ベルギー | 5,388,700,967 | 2.53 |
| 内 オランダ | 4,523,120,712 | 2.12 |
| 内 オーストラリア | 4,455,774,033 | 2.09 |
| 内 カナダ | 4,450,000,371 | 2.09 |
| 内 オーストリア | 3,477,300,068 | 1.63 |
| 内 アイルランド | 1,655,518,352 | 0.78 |
| 内 メキシコ | 1,604,904,323 | 0.75 |
| 内 南アフリカ | 1,274,845,718 | 0.60 |
| 内 ポーランド | 1,255,344,116 | 0.59 |
| 内 フィンランド | 1,247,247,213 | 0.58 |
| 内 デンマーク | 1,244,493,113 | 0.58 |
| 内 マレーシア | 899,202,246 | 0.42 |
| 内 シンガポール | 803,029,874 | 0.38 |
| 内 スウェーデン | 681,907,627 | 0.32 |
| 内 ノルウェー | 376,955,476 | 0.18 |
| コール・ローン、その他の資産(負債控除後) | 5,528,505,716 | 2.59 |
| 純資産総額 | 213,271,437,750 | 100.00 |

その他資産の投資状況

平成30年5月31日現在

| 資産の種類 | 時価合計(円) | 投資比率(%) |
|------------|---------------|---------|
| 為替予約取引(売建) | 1,575,271,528 | 0.74 |
| - | 1,575,271,528 | 0.74 |

(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30年5月31日現在

| 資産の種類 | 時価合計(円) | 投資比率(%) |
|-----------------------|----------------|---------|
| 投資信託受益証券 | 5,263,180,944 | 10.47 |
| 内 オーストラリア | 3,555,468,122 | 7.08 |
| 内 シンガポール | 1,687,751,243 | 3.36 |
| 内 カナダ | 19,961,579 | 0.04 |
| 投資証券 | 44,741,500,053 | 89.03 |
| 内 アメリカ | 35,507,252,292 | 70.66 |
| 内 イギリス | 2,865,425,525 | 5.70 |
| 内 フランス | 2,570,816,250 | 5.12 |
| 内 香港 | 1,025,960,926 | 2.04 |
| 内 カナダ | 897,095,038 | 1.79 |
| 内 スペイン | 498,587,678 | 0.99 |
| 内 ベルギー | 383,155,073 | 0.76 |
| 内 ニュージーランド | 227,013,793 | 0.45 |
| 内 オランダ | 225,941,432 | 0.45 |
| 内 アイルランド | 134,047,944 | 0.27 |
| 内 ドイツ | 128,598,355 | 0.26 |
| 内 シンガポール | 122,996,673 | 0.24 |
| 内 イタリア | 57,770,693 | 0.11 |
| 内 ガーンジー | 36,290,805 | 0.07 |
| 内 イスラエル | 31,494,662 | 0.06 |
| 内 マン島 | 29,052,914 | 0.06 |
| コール・ローン、その他の資産(負債控除後) | 248,625,440 | 0.49 |
| 純資産総額 | 50,253,306,437 | 100.00 |

その他資産の投資状況

平成30年5月31日現在

| 資産の種類 | 時価合計(円) | 投資比率(%) |
|------------|-------------|---------|
| 為替予約取引(買建) | 377,253,800 | 0.75 |
| - | 377,253,800 | 0.75 |
| 為替予約取引(売建) | 380,376,150 | 0.76 |
| - | 380,376,150 | 0.76 |

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

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

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

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年5月31日現在

| 資産の種類 | 時価合計(円) | 投資比率(%) |
|-----------------------|-----------------|---------|
| 国債証券 | 290,560,757,112 | 94.61 |
| 内 アメリカ | 128,718,323,756 | 41.91 |
| 内 フランス | 30,197,211,440 | 9.83 |
| 内 イタリア | 26,687,765,494 | 8.69 |
| 内 ドイツ | 20,834,620,333 | 6.78 |
| 内 イギリス | 20,791,194,039 | 6.77 |
| 内 スペイン | 17,338,418,356 | 5.65 |
| 内 ベルギー | 7,436,043,533 | 2.42 |
| 内 オランダ | 6,298,889,962 | 2.05 |
| 内 カナダ | 6,175,737,756 | 2.01 |
| 内 オーストラリア | 6,055,837,507 | 1.97 |
| 内 オーストリア | 4,719,527,322 | 1.54 |
| 内 アイルランド | 2,464,673,447 | 0.80 |
| 内 メキシコ | 2,069,927,922 | 0.67 |
| 内 フィンランド | 2,000,231,465 | 0.65 |
| 内 南アフリカ | 1,772,781,197 | 0.58 |
| 内 ポーランド | 1,714,062,671 | 0.56 |
| 内 デンマーク | 1,524,221,334 | 0.50 |
| 内 マレーシア | 1,142,274,104 | 0.37 |
| 内 シンガポール | 971,038,170 | 0.32 |
| 内 スウェーデン | 935,968,936 | 0.30 |
| 内 ノルウェー | 712,008,368 | 0.23 |
| コール・ローン、その他の資産(負債控除後) | 16,540,463,543 | 5.39 |
| 純資産総額 | 307,101,220,655 | 100.00 |

その他資産の投資状況

平成30年5月31日現在

| 資産の種類 | 時価合計(円) | 投資比率(%) |
|------------|-----------------|---------|
| 為替予約取引(売建) | 296,105,003,564 | 96.42 |
| - | 296,105,003,564 | 96.42 |

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

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

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

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

平成30年5月31日現在

| 資産の種類 | 時価合計（円） | 投資比率（％） |
|-----------------------|----------------|---------|
| 株式 | 57,349,455,795 | 91.57 |
| 内 ケイマン諸島 | 9,848,573,000 | 15.73 |
| 内 韓国 | 8,886,165,400 | 14.19 |
| 内 台湾 | 6,649,521,021 | 10.62 |
| 内 中国 | 5,838,440,893 | 9.32 |
| 内 インド | 4,928,961,241 | 7.87 |
| 内 南アフリカ | 3,664,651,830 | 5.85 |
| 内 ブラジル | 3,560,085,846 | 5.68 |
| 内 ロシア | 2,030,293,382 | 3.24 |
| 内 香港 | 2,006,142,767 | 3.20 |
| 内 タイ | 1,387,615,041 | 2.22 |
| 内 マレーシア | 1,379,793,632 | 2.20 |
| 内 メキシコ | 1,254,668,918 | 2.00 |
| 内 インドネシア | 1,160,045,235 | 1.85 |
| 内 チリ | 686,893,608 | 1.10 |
| 内 ポーランド | 627,114,882 | 1.00 |
| 内 フィリピン | 572,963,328 | 0.91 |
| 内 バミューダ | 563,615,721 | 0.90 |
| 内 トルコ | 464,450,046 | 0.74 |
| 内 アラブ首長国連邦 | 354,056,533 | 0.57 |
| 内 カタール | 350,418,074 | 0.56 |
| 内 コロンビア | 261,724,541 | 0.42 |
| 内 アメリカ | 223,156,338 | 0.36 |
| 内 ギリシャ | 174,977,659 | 0.28 |
| 内 ハンガリー | 152,793,530 | 0.24 |
| 内 チェコ | 116,844,286 | 0.19 |
| 内 エジプト | 62,106,342 | 0.10 |
| 内 マン島 | 44,880,702 | 0.07 |
| 内 パキスタン | 40,393,415 | 0.06 |
| 内 ペルー | 31,634,308 | 0.05 |
| 内 マルタ | 12,357,590 | 0.02 |
| 内 ルクセンブルグ | 11,144,017 | 0.02 |
| 内 オランダ | 2,972,669 | 0.00 |
| 投資信託受益証券 | 271,386,227 | 0.43 |
| 内 メキシコ | 271,386,227 | 0.43 |
| 投資証券 | 120,843,850 | 0.19 |
| 内 メキシコ | 55,183,953 | 0.09 |
| 内 南アフリカ | 52,649,121 | 0.08 |
| 内 トルコ | 13,010,776 | 0.02 |
| コール・ローン、その他の資産（負債控除後） | 4,887,300,705 | 7.80 |
| 純資産総額 | 62,628,986,577 | 100.00 |

その他資産の投資状況

平成30年5月31日現在

| 資産の種類 | 時価合計(円) | 投資比率(%) |
|--------------|---------------|---------|
| 為替予約取引(買建) | 710,615,220 | 1.13 |
| - | 710,615,220 | 1.13 |
| 為替予約取引(売建) | 331,413,000 | 0.53 |
| - | 331,413,000 | 0.53 |
| 株価指数先物取引(買建) | 4,487,468,078 | 7.17 |
| 内 アメリカ | 4,487,468,078 | 7.17 |

(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。

(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。

(2) 【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

たわらノーロード スマートグローバルバランス(保守型)

平成30年5月31日現在

| 順位 | 銘柄名 発行体の国/地域 | 種類 | 数量 | 簿価単価 簿価金額 (円) | 評価単価 評価金額 (円) | 利率(%) 償還日 | 投資 比率 |
|----|------------------------------------|-----------|-----------|---------------------|---------------------|--------------|----------|
| 1 | 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 | 1,755,700 | 1.2878 2,260,991 | 1.2919 2,268,188 | - - | 53.55% |
| 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 | 991,803 | 1.3278 1,317,000 | 1.3227 1,311,857 | - - | 30.97% |
| 3 | 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 | 118,740 | 1.8022 214,000 | 1.7660 209,694 | - - | 4.95% |
| 4 | 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本 | 親投資信託受益証券 | 56,458 | 3.3668 190,087 | 3.4109 192,572 | - - | 4.55% |
| 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 | 62,704 | 2.6498 166,157 | 2.6665 167,200 | - - | 3.95% |
| 6 | 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 | 34,708 | 1.2409 43,072 | 1.1889 41,264 | - - | 0.97% |

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成30年5月31日現在

| 種類 | 投資比率 |
|-----------|--------|
| 親投資信託受益証券 | 98.95% |
| 合計 | 98.95% |

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資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 スマートグローバルバランス(安定型)

平成30年5月31日現在

| 順位 | 銘柄名 発行体の国/地域 | 種類 | 数量 | 簿価単価 簿価金額 (円) | 評価単価 評価金額 (円) | 利率(%) 償還日 | 投資 比率 |
|----|--|---------------|------------|----------------------|----------------------|--------------|----------|
| 1 | 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 | 36,252,757 | 1.2898 46,760,324 | 1.2919 46,834,936 | - - | 30.58% |
| 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 | 34,781,927 | 1.3286 46,212,370 | 1.3227 46,006,054 | - - | 30.04% |
| 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 | 7,031,090 | 3.3226 23,362,105 | 3.4109 23,982,344 | - - | 15.66% |
| 4 | 外国債券パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本 | 親投資信託受 益証券 | 6,908,533 | 1.7952 12,402,417 | 1.7660 12,200,469 | - - | 7.97% |
| 5 | 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 | 5,068,797 | 1.7715 8,979,830 | 1.8144 9,196,825 | - - | 6.00% |
| 6 | 国内株式パッシブ・ファン ド(最適化法)・マザーファン ド 日本 | 親投資信託受 益証券 | 2,853,081 | 2.6557 7,577,111 | 2.6665 7,607,740 | - - | 4.97% |
| 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 | 2,649,048 | 1.1025 2,920,686 | 1.1656 3,087,730 | - - | 2.02% |
| 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 | 2,513,931 | 1.2365 3,108,703 | 1.1889 2,988,812 | - - | 1.95% |

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成30年5月31日現在

| 種類 | 投資比率 |
|-----------|--------|
| 親投資信託受益証券 | 99.18% |
| 合計 | 99.18% |

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資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 スマートグローバルバランス(安定成長型)

平成30年5月31日現在

| 順位 | 銘柄名 発行体の国/地域 | 種類 | 数量 | 簿価単価 簿価金額 (円) | 評価単価 評価金額 (円) | 利率(%) 償還日 | 投資 比率 |
|----|---------------------------------------|-----------|------------|----------------------|----------------------|--------------|----------|
| 1 | 為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本 | 親投資信託受益証券 | 39,648,150 | 1.3259 52,571,762 | 1.3227 52,442,608 | - - | 23.03% |
| 2 | 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本 | 親投資信託受益証券 | 14,915,017 | 3.3737 50,319,185 | 3.4109 50,873,631 | - - | 22.34% |
| 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 | 36,239,322 | 1.2895 46,732,125 | 1.2919 46,817,580 | - - | 20.56% |
| 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 | 12,563,792 | 1.7817 22,385,761 | 1.8144 22,795,744 | - - | 10.01% |
| 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 | 6,791,954 | 2.6748 18,167,418 | 2.6665 18,110,745 | - - | 7.95% |
| 6 | 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 | 13,792,621 | 1.1202 15,451,157 | 1.1656 16,076,679 | - - | 7.06% |
| 7 | 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本 | 親投資信託受益証券 | 6,423,313 | 1.7956 11,533,705 | 1.7660 11,343,570 | - - | 4.98% |
| 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 | 5,610,545 | 1.2355 6,931,954 | 1.1889 6,670,376 | - - | 2.93% |

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成30年5月31日現在

| 種類 | 投資比率 |
|-----------|--------|
| 親投資信託受益証券 | 98.85% |
| 合計 | 98.85% |

(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 スマートグローバルバランス(成長型)

平成30年5月31日現在

| 順位 | 銘柄名 発行体の国/地域 | 種類 | 数量 | 簿価単価 簿価金額 (円) | 評価単価 評価金額 (円) | 利率(%) 償還日 | 投資 比率 |
|----|--|---------------|------------|----------------------|----------------------|--------------|----------|
| 1 | 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 | 9,828,240 | 3.3605 33,028,134 | 3.4109 33,523,143 | - - | 30.77% |
| 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 | 12,363,113 | 1.3263 16,398,162 | 1.3227 16,352,689 | - - | 15.01% |
| 3 | 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 | 7,808,688 | 1.7767 13,873,786 | 1.8144 14,168,083 | - - | 13.00% |
| 4 | 外国リート・パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本 | 親投資信託受 益証券 | 11,311,959 | 1.1129 12,589,914 | 1.1656 13,185,219 | - - | 12.10% |
| 5 | 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 | 9,720,537 | 1.2895 12,535,250 | 1.2919 12,557,961 | - - | 11.53% |
| 6 | 国内株式パッシブ・ファンド (最適化法)・マザーファン ド 日本 | 親投資信託受 益証券 | 4,469,568 | 2.6605 11,891,321 | 2.6665 11,918,103 | - - | 10.94% |
| 7 | 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 | 3,580,861 | 1.2371 4,430,198 | 1.1889 4,257,285 | - - | 3.91% |
| 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 | 1,229,006 | 1.7908 2,200,927 | 1.7660 2,170,424 | - - | 1.99% |

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成30年5月31日現在

| 種類 | 投資比率 |
|-----------|--------|
| 親投資信託受益証券 | 99.24% |
| 合計 | 99.24% |

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

たわらノーロード スマートグローバルバランス(積極型)

平成30年5月31日現在

| 順位 | 銘柄名 発行体の国/地域 | 種類 | 数量 | 簿価単価 簿価金額 (円) | 評価単価 評価金額 (円) | 利率(%) 償還日 | 投資 比率 |
|----|--|---------------|------------|----------------------|----------------------|--------------|----------|
| 1 | 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 | 25,750,235 | 3.3772 86,964,995 | 3.4109 87,831,476 | - - | 39.75% |
| 2 | 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 | 30,619,728 | 1.1198 34,288,451 | 1.1656 35,690,354 | - - | 16.15% |
| 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 | 12,370,274 | 2.6764 33,107,926 | 2.6665 32,985,335 | - - | 14.93% |
| 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 | 17,079,104 | 1.7806 30,411,591 | 1.8144 30,988,326 | - - | 14.02% |
| 5 | 為替フルヘッジ外国債券パッ シブ・ファンド・マザーファン ド 日本 | 親投資信託受 益証券 | 11,716,848 | 1.3257 15,533,988 | 1.3227 15,497,874 | - - | 7.01% |
| 6 | 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 | 9,084,454 | 1.2385 11,251,602 | 1.1889 10,800,507 | - - | 4.89% |
| 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 | 4,290,943 | 1.2894 5,533,002 | 1.2919 5,543,469 | - - | 2.51% |

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成30年5月31日現在

| 種類 | 投資比率 |
|-----------|--------|
| 親投資信託受益証券 | 99.27% |
| 合計 | 99.27% |

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

(参考)

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

平成30年5月31日現在

| 順位 | 銘柄名 発行体の国/地域 | 種類 業種 | 数量 | 簿価単価 簿価金額 (円) | 評価単価 評価金額 (円) | 利率(%) 償還日 | 投資 比率 |
|----|-----------------------------|--------------|------------|----------------------------|----------------------------|--------------|----------|
| 1 | トヨタ自動車 日本 | 株式 輸送用機器 | 1,411,200 | 7,353.87 10,377,786,345 | 6,921.00 9,766,915,200 | - - | 3.28% |
| 2 | 三菱UFJフィナンシャル・ グループ 日本 | 株式 銀行業 | 8,017,300 | 789.07 6,326,237,988 | 655.80 5,257,745,340 | - - | 1.77% |
| 3 | 日本電信電話 日本 | 株式 情報・通信業 | 817,500 | 4,995.06 4,083,466,930 | 5,106.00 4,174,155,000 | - - | 1.40% |
| 4 | ソニー 日本 | 株式 電気機器 | 777,100 | 5,411.47 4,205,254,309 | 5,160.00 4,009,836,000 | - - | 1.35% |
| 5 | ソフトバンクグループ 日本 | 株式 情報・通信業 | 515,800 | 8,663.60 4,468,688,360 | 7,765.00 4,005,187,000 | - - | 1.35% |
| 6 | 三井住友フィナンシャルグ ループ 日本 | 株式 銀行業 | 866,800 | 4,791.32 4,153,117,332 | 4,503.00 3,903,200,400 | - - | 1.31% |
| 7 | キーエンス 日本 | 株式 電気機器 | 57,000 | 64,031.51 3,649,796,094 | 66,830.00 3,809,310,000 | - - | 1.28% |
| 8 | 本田技研工業 日本 | 株式 輸送用機器 | 1,044,500 | 3,838.03 4,008,829,431 | 3,447.00 3,600,391,500 | - - | 1.21% |
| 9 | 任天堂 日本 | 株式 その他製品 | 71,500 | 44,902.63 3,210,538,396 | 45,000.00 3,217,500,000 | - - | 1.08% |
| 10 | K D D I 日本 | 株式 情報・通信業 | 1,025,800 | 2,674.23 2,743,228,336 | 2,945.50 3,021,493,900 | - - | 1.01% |
| 11 | みずほフィナンシャルグル ープ 日本 | 株式 銀行業 | 15,556,900 | 199.50 3,103,658,490 | 189.70 2,951,143,930 | - - | 0.99% |
| 12 | リクルートホールディングス 日本 | 株式 サービス業 | 856,100 | 2,477.02 2,120,583,308 | 3,030.00 2,593,983,000 | - - | 0.87% |
| 13 | ファナック 日本 | 株式 電気機器 | 110,300 | 27,144.55 2,994,044,085 | 23,270.00 2,566,681,000 | - - | 0.86% |
| 14 | 三菱商事 日本 | 株式 卸売業 | 802,300 | 2,958.44 2,373,562,664 | 3,031.00 2,431,771,300 | - - | 0.82% |
| 15 | 花王 日本 | 株式 化学 | 285,500 | 7,687.57 2,194,801,419 | 8,442.00 2,410,191,000 | - - | 0.81% |
| 16 | 日本電産 日本 | 株式 電気機器 | 139,700 | 16,216.97 2,265,510,748 | 16,885.00 2,358,834,500 | - - | 0.79% |
| 17 | 東海旅客鉄道 日本 | 株式 陸運業 | 104,000 | 20,244.20 2,105,397,760 | 22,510.00 2,341,040,000 | - - | 0.79% |
| 18 | キヤノン 日本 | 株式 電気機器 | 624,600 | 4,052.58 2,531,245,392 | 3,714.00 2,319,764,400 | - - | 0.78% |
| 19 | セブン&アイ・ホールディ ングス 日本 | 株式 小売業 | 479,200 | 4,463.47 2,138,896,768 | 4,821.00 2,310,223,200 | - - | 0.78% |
| 20 | N T T ドコモ 日本 | 株式 情報・通信業 | 817,600 | 2,668.82 2,182,031,540 | 2,818.00 2,303,996,800 | - - | 0.77% |

| | | | | | | | |
|----|--------------------|------------|-----------|----------------------------|----------------------------|--------|-------|
| 21 | 東京海上ホールディングス 日本 | 株式 保険業 | 431,400 | 4,965.41 2,142,078,650 | 5,240.00 2,260,536,000 | - - | 0.76% |
| 22 | 東日本旅客鉄道 日本 | 株式 陸運業 | 208,500 | 10,438.62 2,176,454,112 | 10,755.00 2,242,417,500 | - - | 0.75% |
| 23 | 日立製作所 日本 | 株式 電気機器 | 2,787,000 | 811.45 2,261,513,650 | 796.60 2,220,124,200 | - - | 0.75% |
| 24 | 信越化学工業 日本 | 株式 化学 | 202,500 | 11,520.24 2,332,849,448 | 10,890.00 2,205,225,000 | - - | 0.74% |
| 25 | 日本たばこ産業 日本 | 株式 食料品 | 720,900 | 3,289.46 2,371,378,182 | 2,936.00 2,116,562,400 | - - | 0.71% |
| 26 | 小松製作所 日本 | 株式 機械 | 560,500 | 4,041.55 2,265,293,425 | 3,587.00 2,010,513,500 | - - | 0.68% |
| 27 | ダイキン工業 日本 | 株式 機械 | 158,500 | 12,218.86 1,936,690,552 | 12,580.00 1,993,930,000 | - - | 0.67% |
| 28 | アステラス製薬 日本 | 株式 医薬品 | 1,193,100 | 1,468.95 1,752,609,490 | 1,664.50 1,985,914,950 | - - | 0.67% |
| 29 | パナソニック 日本 | 株式 電気機器 | 1,326,200 | 1,597.31 2,118,356,926 | 1,489.50 1,975,374,900 | - - | 0.66% |
| 30 | 村田製作所 日本 | 株式 電気機器 | 121,800 | 15,196.94 1,850,987,684 | 16,185.00 1,971,333,000 | - - | 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30年5月31日現在

| 種類 | 投資比率 |
|----|--------|
| 株式 | 97.43% |
| 合計 | 97.43% |

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

平成30年5月31日現在

| 業種 | 国内/外国 | 投資比率 |
|------------|--------|--------|
| 電気機器 | 国内 | 13.23% |
| 輸送用機器 | | 8.29% |
| 化学 | | 7.34% |
| 情報・通信業 | | 7.20% |
| 銀行業 | | 6.66% |
| 機械 | | 5.17% |
| 小売業 | | 4.87% |
| 卸売業 | | 4.68% |
| 医薬品 | | 4.51% |
| サービス業 | | 4.38% |
| 食料品 | | 4.31% |
| 陸運業 | | 4.19% |
| 建設業 | | 3.05% |
| 不動産業 | | 2.39% |
| 保険業 | | 2.22% |
| その他製品 | | 2.21% |
| 電気・ガス業 | | 1.70% |
| 精密機器 | | 1.67% |
| その他金融業 | | 1.20% |
| 鉄鋼 | | 1.03% |
| ガラス・土石製品 | | 0.99% |
| 証券、商品先物取引業 | | 0.91% |
| 非鉄金属 | | 0.83% |
| ゴム製品 | | 0.80% |
| 石油・石炭製品 | | 0.67% |
| 繊維製品 | | 0.64% |
| 金属製品 | | 0.64% |
| 空運業 | | 0.60% |
| 鉱業 | | 0.30% |
| パルプ・紙 | | 0.27% |
| 海運業 | 0.19% | |
| 倉庫・運輸関連業 | 0.18% | |
| 水産・農林業 | 0.11% | |
| 合計 | 97.43% | |

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年5月31日現在

| 順位 | 銘柄名 発行体の国/地域 | 種類 | 数量 | 簿価単価 簿価金額 (円) | 評価単価 評価金額 (円) | 利率(%) 償還日 | 投資 比率 |
|----|------------------------|------|---------------|-------------------------|-------------------------|------------------------|----------|
| 1 | 124回 利付国庫債券(5年) 日本 | 国債証券 | 4,000,000,000 | 100.50 4,020,160,000 | 100.49 4,019,720,000 | 0.100000 2020/6/20 | 1.16% |
| 2 | 122回 利付国庫債券(5年) 日本 | 国債証券 | 4,000,000,000 | 100.42 4,016,960,000 | 100.37 4,014,920,000 | 0.100000 2019/12/20 | 1.16% |
| 3 | 118回 利付国庫債券(5年) 日本 | 国債証券 | 3,700,000,000 | 100.45 3,716,872,000 | 100.36 3,713,431,000 | 0.200000 2019/6/20 | 1.07% |
| 4 | 344回 利付国庫債券(10年) 日本 | 国債証券 | 3,500,000,000 | 100.68 3,524,010,000 | 100.99 3,534,930,000 | 0.100000 2026/9/20 | 1.02% |
| 5 | 345回 利付国庫債券(10年) 日本 | 国債証券 | 3,500,000,000 | 100.61 3,521,595,000 | 100.94 3,532,935,000 | 0.100000 2026/12/20 | 1.02% |
| 6 | 347回 利付国庫債券(10年) 日本 | 国債証券 | 3,500,000,000 | 100.51 3,517,885,000 | 100.81 3,528,455,000 | 0.100000 2027/6/20 | 1.02% |
| 7 | 348回 利付国庫債券(10年) 日本 | 国債証券 | 3,360,000,000 | 100.47 3,375,967,000 | 100.78 3,386,510,400 | 0.100000 2027/9/20 | 0.98% |
| 8 | 341回 利付国庫債券(10年) 日本 | 国債証券 | 3,060,000,000 | 102.43 3,134,418,000 | 102.65 3,141,181,800 | 0.300000 2025/12/20 | 0.91% |
| 9 | 342回 利付国庫債券(10年) 日本 | 国債証券 | 3,000,000,000 | 100.80 3,024,240,000 | 101.09 3,032,850,000 | 0.100000 2026/3/20 | 0.88% |
| 10 | 343回 利付国庫債券(10年) 日本 | 国債証券 | 3,000,000,000 | 100.74 3,022,470,000 | 101.04 3,031,470,000 | 0.100000 2026/6/20 | 0.88% |
| 11 | 346回 利付国庫債券(10年) 日本 | 国債証券 | 3,000,000,000 | 100.54 3,016,290,000 | 100.88 3,026,400,000 | 0.100000 2027/3/20 | 0.87% |
| 12 | 130回 利付国庫債券(5年) 日本 | 国債証券 | 3,000,000,000 | 100.77 3,023,130,000 | 100.82 3,024,630,000 | 0.100000 2021/12/20 | 0.87% |
| 13 | 128回 利付国庫債券(5年) 日本 | 国債証券 | 3,000,000,000 | 100.70 3,021,090,000 | 100.72 3,021,600,000 | 0.100000 2021/6/20 | 0.87% |
| 14 | 127回 利付国庫債券(5年) 日本 | 国債証券 | 3,000,000,000 | 100.65 3,019,500,000 | 100.66 3,019,800,000 | 0.100000 2021/3/20 | 0.87% |
| 15 | 125回 利付国庫債券(5年) 日本 | 国債証券 | 3,000,000,000 | 100.54 3,016,350,000 | 100.55 3,016,620,000 | 0.100000 2020/9/20 | 0.87% |

| | | | | | | | |
|----|------------------------|------|---------------|-------------------------|-------------------------|------------------------|-------|
| 16 | 123回 利付国庫債券(5年) 日本 | 国債証券 | 3,000,000,000 | 100.47 3,014,100,000 | 100.42 3,012,720,000 | 0.100000 2020/3/20 | 0.87% |
| 17 | 133回 利付国庫債券(5年) 日本 | 国債証券 | 2,860,000,000 | 100.89 2,885,679,000 | 100.97 2,887,827,800 | 0.100000 2022/9/20 | 0.83% |
| 18 | 321回 利付国庫債券(10年) 日本 | 国債証券 | 2,500,000,000 | 104.53 2,613,400,000 | 104.29 2,607,375,000 | 1.000000 2022/3/20 | 0.75% |
| 19 | 340回 利付国庫債券(10年) 日本 | 国債証券 | 2,500,000,000 | 103.15 2,578,850,000 | 103.33 2,583,400,000 | 0.400000 2025/9/20 | 0.75% |
| 20 | 305回 利付国庫債券(10年) 日本 | 国債証券 | 2,500,000,000 | 102.64 2,566,200,000 | 102.24 2,556,225,000 | 1.300000 2019/12/20 | 0.74% |
| 21 | 126回 利付国庫債券(5年) 日本 | 国債証券 | 2,500,000,000 | 100.59 2,514,950,000 | 100.61 2,515,375,000 | 0.100000 2020/12/20 | 0.73% |
| 22 | 338回 利付国庫債券(10年) 日本 | 国債証券 | 2,400,000,000 | 103.09 2,474,376,000 | 103.17 2,476,224,000 | 0.400000 2025/3/20 | 0.71% |
| 23 | 329回 利付国庫債券(10年) 日本 | 国債証券 | 2,270,000,000 | 104.73 2,377,375,100 | 104.62 2,374,942,100 | 0.800000 2023/6/20 | 0.69% |
| 24 | 310回 利付国庫債券(10年) 日本 | 国債証券 | 2,300,000,000 | 102.89 2,366,654,000 | 102.61 2,360,053,000 | 1.000000 2020/9/20 | 0.68% |
| 25 | 301回 利付国庫債券(10年) 日本 | 国債証券 | 2,300,000,000 | 102.20 2,350,623,000 | 101.73 2,339,974,000 | 1.500000 2019/6/20 | 0.68% |
| 26 | 339回 利付国庫債券(10年) 日本 | 国債証券 | 2,250,000,000 | 103.17 2,321,451,000 | 103.25 2,323,282,500 | 0.400000 2025/6/20 | 0.67% |
| 27 | 332回 利付国庫債券(10年) 日本 | 国債証券 | 2,210,000,000 | 103.92 2,296,693,300 | 103.85 2,295,107,100 | 0.600000 2023/12/20 | 0.66% |
| 28 | 312回 利付国庫債券(10年) 日本 | 国債証券 | 2,200,000,000 | 103.74 2,282,456,000 | 103.42 2,275,240,000 | 1.200000 2020/12/20 | 0.66% |
| 29 | 334回 利付国庫債券(10年) 日本 | 国債証券 | 2,100,000,000 | 104.13 2,186,793,000 | 104.13 2,186,835,000 | 0.600000 2024/6/20 | 0.63% |
| 30 | 129回 利付国庫債券(5年) 日本 | 国債証券 | 2,070,000,000 | 100.73 2,085,291,000 | 100.76 2,085,794,100 | 0.100000 2021/9/20 | 0.60% |

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成30年5月31日現在

| 種類 | 投資比率 |
|-------|--------|
| 国債証券 | 83.80% |
| 地方債証券 | 6.54% |
| 特殊債券 | 4.39% |
| 社債券 | 4.62% |
| 合計 | 99.36% |

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

J-REITインデックスファンド・マザーファンド

平成30年5月31日現在

| 順位 | 銘柄名 発行体の国/地域 | 種類 | 数量 | 簿価単価 簿価金額 (円) | 評価単価 評価金額 (円) | 利率(%) 償還日 | 投資 比率 |
|----|--------------------------|------|--------|-----------------------------|-----------------------------|--------------|----------|
| 1 | 日本ビルファンド投資法人 日本 | 投資証券 | 4,097 | 589,312.28 2,414,412,423 | 610,000.00 2,499,170,000 | - - | 7.10% |
| 2 | ジャパンリアルエステイト投資法人 日本 | 投資証券 | 4,210 | 566,446.16 2,384,738,345 | 571,000.00 2,403,910,000 | - - | 6.83% |
| 3 | 野村不動産マスターファンド投資法人 日本 | 投資証券 | 12,521 | 155,592.20 1,948,169,969 | 152,400.00 1,908,200,400 | - - | 5.42% |
| 4 | 日本リテールファンド投資法人 日本 | 投資証券 | 7,989 | 210,860.98 1,684,568,426 | 197,400.00 1,577,028,600 | - - | 4.48% |
| 5 | ユナイテッド・アーバン投資法人 日本 | 投資証券 | 9,331 | 165,930.68 1,548,299,209 | 166,800.00 1,556,410,800 | - - | 4.42% |
| 6 | オリックス不動産投資法人 日本 | 投資証券 | 8,395 | 169,226.95 1,420,660,280 | 171,900.00 1,443,100,500 | - - | 4.10% |
| 7 | 日本プロロジスリート投資法人 日本 | 投資証券 | 5,639 | 237,970.33 1,341,914,727 | 227,000.00 1,280,053,000 | - - | 3.64% |
| 8 | 大和ハウスリート投資法人 日本 | 投資証券 | 4,923 | 269,512.54 1,326,810,262 | 256,600.00 1,263,241,800 | - - | 3.59% |
| 9 | アドバンス・レジデンス投資法人 日本 | 投資証券 | 3,917 | 283,072.22 1,108,793,914 | 284,900.00 1,115,953,300 | - - | 3.17% |
| 10 | GLP投資法人 日本 | 投資証券 | 8,783 | 120,357.01 1,057,095,629 | 121,600.00 1,068,012,800 | - - | 3.04% |
| 11 | 日本プライムリアルティ投資法人 日本 | 投資証券 | 2,671 | 402,826.42 1,075,949,393 | 395,500.00 1,056,380,500 | - - | 3.00% |
| 12 | ジャパン・ホテル・リート投資法人 日本 | 投資証券 | 12,211 | 78,827.74 962,565,535 | 81,200.00 991,533,200 | - - | 2.82% |
| 13 | アクティビア・プロパティーズ投資法人 日本 | 投資証券 | 1,914 | 489,231.59 936,389,278 | 484,500.00 927,333,000 | - - | 2.64% |
| 14 | ケネディクス・オフィス投資法人 日本 | 投資証券 | 1,305 | 633,914.49 827,258,412 | 675,000.00 880,875,000 | - - | 2.50% |
| 15 | 積水ハウス・リート投資法人 日本 | 投資証券 | 10,600 | 70,622.62 748,603,371 | 71,400.00 756,843,570 | - - | 2.15% |
| 16 | 日本アコモデーションファンド投資法人 日本 | 投資証券 | 1,406 | 474,729.10 667,469,123 | 490,500.00 689,643,000 | - - | 1.96% |
| 17 | フロンティア不動産投資法人 日本 | 投資証券 | 1,439 | 470,658.50 677,277,592 | 449,000.00 646,111,000 | - - | 1.84% |
| 18 | 森ヒルズリート投資法人 日本 | 投資証券 | 4,545 | 140,466.24 638,419,067 | 140,000.00 636,300,000 | - - | 1.81% |

| | | | | | | | |
|----|-----------------------------|------|--------|---------------------------|---------------------------|--------|-------|
| 19 | 日本ロジスティクスファンド 投資法人 日本 | 投資証券 | 2,819 | 225,801.44 636,534,280 | 224,600.00 633,147,400 | - - | 1.80% |
| 20 | 産業ファンド投資法人 日本 | 投資証券 | 4,914 | 122,681.93 602,859,043 | 121,600.00 597,542,400 | - - | 1.70% |
| 21 | 大和証券オフィス投資法人 日本 | 投資証券 | 912 | 578,242.78 527,357,418 | 637,000.00 580,944,000 | - - | 1.65% |
| 22 | インヴィンシブル投資法人 日本 | 投資証券 | 11,604 | 49,697.44 576,689,137 | 50,000.00 580,200,000 | - - | 1.65% |
| 23 | ジャパンエクセレント投資法人 日本 | 投資証券 | 3,789 | 134,698.86 510,374,011 | 145,000.00 549,405,000 | - - | 1.56% |
| 24 | イオンリート投資法人 日本 | 投資証券 | 4,018 | 119,985.27 482,100,854 | 123,000.00 494,214,000 | - - | 1.40% |
| 25 | ヒューリックリート投資法人 日本 | 投資証券 | 2,873 | 174,068.94 500,100,070 | 171,100.00 491,570,300 | - - | 1.40% |
| 26 | 森トラスト総合リート投資法人 日本 | 投資証券 | 3,024 | 171,942.83 519,955,141 | 161,700.00 488,980,800 | - - | 1.39% |
| 27 | 東急リアル・エステート投資法人 日本 | 投資証券 | 2,837 | 139,258.44 395,076,215 | 149,300.00 423,564,100 | - - | 1.20% |
| 28 | 日本賃貸住宅投資法人 日本 | 投資証券 | 4,759 | 83,179.21 395,849,901 | 87,400.00 415,936,600 | - - | 1.18% |
| 29 | コンフォリア・レジデンシャル投資法人 日本 | 投資証券 | 1,604 | 243,193.09 390,081,731 | 258,500.00 414,634,000 | - - | 1.18% |
| 30 | プレミアム投資法人 日本 | 投資証券 | 3,821 | 114,874.22 438,934,426 | 107,700.00 411,521,700 | - - | 1.17% |

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成30年5月31日現在

| 種類 | 投資比率 |
|------|--------|
| 投資証券 | 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。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年5月31日現在

| 順位 | 銘柄名 発行体の国/地域 | 種類 業種 | 数量 | 簿価単価 簿価金額 (円) | 評価単価 評価金額 (円) | 利率(%) 償還日 | 投資 比率 |
|----|-------------------------------------|--------------------------|---------|-----------------------------|-----------------------------|--------------|----------|
| 1 | APPLE INC アメリカ | 株式 コンピュータ・周辺機器 | 381,669 | 18,243.51 6,962,984,136 | 20,381.24 7,778,891,306 | - - | 2.55% |
| 2 | MICROSOFT CORP アメリカ | 株式 ソフトウェア | 544,500 | 9,888.46 5,384,267,142 | 10,755.86 5,856,568,492 | - - | 1.92% |
| 3 | AMAZON.COM INC アメリカ | 株式 インターネット販売・通信販売 | 30,466 | 158,069.51 4,815,745,909 | 176,625.54 5,381,073,793 | - - | 1.77% |
| 4 | FACEBOOK INC アメリカ | 株式 インターネットソフトウェア・サービス | 177,316 | 19,521.54 3,461,481,531 | 20,399.72 3,617,198,347 | - - | 1.19% |
| 5 | JPMORGAN CHASE & CO アメリカ | 株式 銀行 | 258,225 | 12,507.81 3,229,831,601 | 11,777.64 3,041,282,380 | - - | 1.00% |
| 6 | EXXON MOBIL CORP アメリカ | 株式 石油・ガス・消耗燃料 | 315,280 | 8,314.97 2,621,545,189 | 8,859.05 2,793,081,284 | - - | 0.92% |
| 7 | ALPHABET INC-CL C アメリカ | 株式 インターネットソフトウェア・サービス | 23,400 | 116,489.03 2,725,843,405 | 116,069.86 2,716,034,724 | - - | 0.89% |
| 8 | JOHNSON & JOHNSON アメリカ | 株式 医薬品 | 200,134 | 14,102.58 2,822,405,861 | 13,149.43 2,631,649,824 | - - | 0.86% |
| 9 | ALPHABET INC-CL A アメリカ | 株式 インターネットソフトウェア・サービス | 22,200 | 116,811.56 2,593,216,839 | 117,120.98 2,600,085,955 | - - | 0.85% |
| 10 | BANK OF AMERICA CORP アメリカ | 株式 銀行 | 737,237 | 3,478.99 2,564,840,328 | 3,205.56 2,363,259,649 | - - | 0.78% |
| 11 | INTEL CORP アメリカ | 株式 半導体・半導体製造装置 | 348,219 | 4,955.65 1,725,652,570 | 6,052.41 2,107,566,247 | - - | 0.69% |
| 12 | WELLS FARGO & CO アメリカ | 株式 銀行 | 348,201 | 6,469.24 2,252,597,743 | 5,894.80 2,052,575,603 | - - | 0.67% |
| 13 | BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ | 株式 各種金融サービス | 93,679 | 21,840.66 2,046,011,546 | 21,098.66 1,976,502,306 | - - | 0.65% |
| 14 | CHEVRON CORP アメリカ | 株式 石油・ガス・消耗燃料 | 141,261 | 12,348.85 1,744,412,250 | 13,604.89 1,921,840,648 | - - | 0.63% |
| 15 | NESTLE SA-REGISTERED スイス | 株式 食品 | 231,295 | 8,497.67 1,965,470,493 | 8,282.36 1,915,669,150 | - - | 0.63% |

| | | | | | | | |
|----|--------------------------------|---|-----------|----------------------------|----------------------------|--------|-------|
| 16 | UNITEDHEALTH GROUP INC アメリカ | 株式 ヘルスケア・ プロバイ ダー/ヘルス ケア・サービ ス | 71,700 | 24,887.26 1,784,417,154 | 26,624.97 1,909,010,922 | - - | 0.63% |
| 17 | VISA INC アメリカ | 株式 情報技術サー ビス | 134,179 | 13,142.83 1,763,492,141 | 14,200.56 1,905,418,013 | - - | 0.63% |
| 18 | HOME DEPOT INC アメリカ | 株式 専門小売り | 86,514 | 20,076.95 1,736,937,330 | 20,336.68 1,759,407,793 | - - | 0.58% |
| 19 | PFIZER INC アメリカ | 株式 医薬品 | 446,210 | 3,834.37 1,710,935,177 | 3,918.63 1,748,534,123 | - - | 0.57% |
| 20 | CISCO SYSTEMS INC アメリカ | 株式 通信機器 | 364,860 | 4,584.28 1,672,621,536 | 4,657.79 1,699,443,083 | - - | 0.56% |
| 21 | BOEING CO アメリカ | 株式 航空宇宙・防 衛 | 41,769 | 37,599.76 1,570,504,691 | 38,935.25 1,626,286,582 | - - | 0.53% |
| 22 | VERIZON COMM INC アメリカ | 株式 各種電気通信 サービス | 306,879 | 5,372.13 1,648,596,181 | 5,282.81 1,621,186,518 | - - | 0.53% |
| 23 | AT&T INC アメリカ | 株式 各種電気通信 サービス | 456,680 | 3,959.82 1,808,370,828 | 3,540.35 1,616,811,148 | - - | 0.53% |
| 24 | HSBC HOLDINGS PLC イギリス | 株式 銀行 | 1,488,734 | 1,082.17 1,611,065,214 | 1,049.21 1,562,004,246 | - - | 0.51% |
| 25 | PROCTER & GAMBLE CO アメリカ | 株式 家庭用品 | 186,535 | 8,769.39 1,635,798,703 | 8,140.54 1,518,496,188 | - - | 0.50% |
| 26 | MASTERCARD INC アメリカ | 株式 情報技術サー ビス | 69,652 | 18,766.98 1,307,158,128 | 20,844.31 1,451,848,019 | - - | 0.48% |
| 27 | CITIGROUP INC アメリカ | 株式 銀行 | 196,708 | 8,332.93 1,639,154,230 | 7,248.11 1,425,762,402 | - - | 0.47% |
| 28 | COCA-COLA CO/THE アメリカ | 株式 飲料 | 298,559 | 4,791.52 1,430,553,733 | 4,688.23 1,399,713,559 | - - | 0.46% |
| 29 | NOVARTIS AG-REG SHS スイス | 株式 医薬品 | 166,499 | 8,729.96 1,453,530,491 | 8,200.92 1,365,445,978 | - - | 0.45% |
| 30 | ABBVIE INC アメリカ | 株式 バイオテクノ ロジー | 118,243 | 12,320.12 1,456,768,755 | 11,197.18 1,323,988,982 | - - | 0.43% |

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成30年5月31日現在

| 種類 | 投資比率 |
|----------|--------|
| 株式 | 95.16% |
| 投資信託受益証券 | 0.25% |
| 投資証券 | 2.05% |
| 合計 | 97.46% |

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

平成30年5月31日現在

| 業種 | 国内/外国 | 投資比率 |
|-------------------------|-------|-------|
| 銀行 | 外国 | 8.86% |
| 石油・ガス・消耗燃料 | | 6.46% |
| 医薬品 | | 4.95% |
| ソフトウェア | | 4.49% |
| 保険 | | 3.82% |
| インターネットソフトウェア・サービス | | 3.31% |
| 情報技術サービス | | 3.25% |
| 半導体・半導体製造装置 | | 3.17% |
| 資本市場 | | 3.01% |
| コンピュータ・周辺機器 | | 2.89% |
| 化学 | | 2.60% |
| インターネット販売・通信販売 | | 2.54% |
| 航空宇宙・防衛 | | 2.34% |
| ヘルスケア機器・用品 | | 2.25% |
| ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス | | 2.14% |
| バイオテクノロジー | | 2.07% |
| メディア | | 2.00% |
| 各種電気通信サービス | | 1.89% |
| 飲料 | | 1.88% |
| ホテル・レストラン・レジャー | | 1.84% |
| 電力 | | 1.71% |
| 食品 | | 1.70% |
| 金属・鉱業 | | 1.61% |
| 機械 | | 1.60% |
| 専門小売り | | 1.57% |
| コングロマリット | | 1.49% |
| 食品・生活必需品小売り | | 1.42% |
| 繊維・アパレル・贅沢品 | | 1.35% |
| 家庭用品 | | 1.11% |
| タバコ | | 1.03% |
| 陸運・鉄道 | | 1.01% |
| 自動車 | | 1.00% |
| 総合公益事業 | | 0.95% |
| 各種金融サービス | | 0.94% |
| 通信機器 | | 0.91% |
| 電気設備 | | 0.76% |
| パーソナル用品 | | 0.72% |
| 専門サービス | | 0.66% |

| | |
|--------------------|--------|
| ライフサイエンス・ツール/サービス | 0.59% |
| 航空貨物・物流サービス | 0.57% |
| エネルギー設備・サービス | 0.55% |
| 不動産管理・開発 | 0.54% |
| 消費者金融 | 0.49% |
| 自動車部品 | 0.46% |
| 電子装置・機器・部品 | 0.45% |
| 家庭用耐久財 | 0.43% |
| 複合小売り | 0.41% |
| 建設関連製品 | 0.39% |
| 商業サービス・用品 | 0.37% |
| 商社・流通業 | 0.33% |
| 建設・土木 | 0.33% |
| 無線通信サービス | 0.31% |
| 建設資材 | 0.31% |
| 容器・包装 | 0.27% |
| 運送インフラ | 0.23% |
| ガス | 0.14% |
| 旅客航空輸送業 | 0.13% |
| 紙製品・林産品 | 0.12% |
| 水道 | 0.08% |
| ヘルスケア・テクノロジー | 0.07% |
| 販売 | 0.07% |
| 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 | 0.06% |
| 海運業 | 0.06% |
| レジャー用品 | 0.05% |
| 各種消費者サービス | 0.02% |
| 貯蓄・抵当・不動産金融 | 0.01% |
| 合計 | 95.16% |

(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30年5月31日現在

| 順位 | 銘柄名 発行体の国/地域 | 種類 | 数量 | 簿価単価 簿価金額 (円) | 評価単価 評価金額 (円) | 利率(%) 償還日 | 投資 比率 |
|----|---------------------------------|------|---------------|-------------------------|-------------------------|------------------------|----------|
| 1 | US T N/B 2.625 08/15/20 アメリカ | 国債証券 | 1,793,550,000 | 100.65 1,805,243,946 | 100.37 1,800,275,812 | 2.625000 2020/8/15 | 0.84% |
| 2 | US T N/B 3.625 02/15/20 アメリカ | 国債証券 | 1,663,110,000 | 102.61 1,706,633,588 | 102.07 1,697,602,901 | 3.625000 2020/2/15 | 0.80% |
| 3 | US T N/B 2.0 02/15/22 アメリカ | 国債証券 | 1,672,893,000 | 97.89 1,637,728,789 | 97.86 1,637,210,192 | 2.000000 2022/2/15 | 0.77% |
| 4 | US T N/B 1.25 10/31/19 アメリカ | 国債証券 | 1,630,500,000 | 98.41 1,604,640,270 | 98.50 1,606,042,500 | 1.250000 2019/10/31 | 0.75% |
| 5 | US T N/B 0.875 07/31/19 アメリカ | 国債証券 | 1,630,500,000 | 98.16 1,600,612,935 | 98.38 1,604,118,510 | 0.875000 2019/7/31 | 0.75% |
| 6 | US T N/B 1.0 09/30/19 アメリカ | 国債証券 | 1,630,500,000 | 98.12 1,599,977,040 | 98.27 1,602,406,485 | 1.000000 2019/9/30 | 0.75% |
| 7 | US T N/B 3.5 05/15/20 アメリカ | 国債証券 | 1,521,800,000 | 102.59 1,561,260,274 | 102.04 1,552,875,156 | 3.500000 2020/5/15 | 0.73% |
| 8 | US T N/B 1.0 08/31/19 アメリカ | 国債証券 | 1,467,450,000 | 98.22 1,441,358,739 | 98.37 1,443,647,961 | 1.000000 2019/8/31 | 0.68% |
| 9 | US T N/B 1.625 11/15/22 アメリカ | 国債証券 | 1,467,450,000 | 95.65 1,403,671,694 | 95.71 1,404,496,395 | 1.625000 2022/11/15 | 0.66% |
| 10 | US T N/B 2.125 12/31/21 アメリカ | 国債証券 | 1,400,056,000 | 98.43 1,378,173,124 | 98.37 1,377,305,090 | 2.125000 2021/12/31 | 0.65% |
| 11 | US T N/B 1.75 09/30/22 アメリカ | 国債証券 | 1,358,750,000 | 96.21 1,307,253,375 | 96.35 1,309,169,212 | 1.750000 2022/9/30 | 0.61% |
| 12 | US T N/B 2.0 05/31/21 アメリカ | 国債証券 | 1,304,400,000 | 98.51 1,284,977,484 | 98.42 1,283,855,700 | 2.000000 2021/5/31 | 0.60% |
| 13 | US T N/B 1.375 04/30/20 アメリカ | 国債証券 | 1,304,400,000 | 98.01 1,278,507,660 | 98.07 1,279,329,432 | 1.375000 2020/4/30 | 0.60% |
| 14 | US T N/B 1.875 08/31/22 アメリカ | 国債証券 | 1,304,400,000 | 96.83 1,263,115,740 | 96.92 1,264,341,876 | 1.875000 2022/8/31 | 0.59% |
| 15 | US T N/B 2.25 03/31/21 アメリカ | 国債証券 | 1,250,050,000 | 99.41 1,242,724,707 | 99.25 1,240,674,625 | 2.250000 2021/3/31 | 0.58% |
| 16 | US T N/B 1.75 03/31/22 アメリカ | 国債証券 | 1,271,790,000 | 96.79 1,231,041,848 | 96.84 1,231,639,589 | 1.750000 2022/3/31 | 0.58% |
| 17 | US T N/B 1.75 05/15/22 アメリカ | 国債証券 | 1,260,920,000 | 96.67 1,219,044,846 | 96.73 1,219,687,916 | 1.750000 2022/5/15 | 0.57% |
| 18 | US T N/B 2.125 05/15/25 アメリカ | 国債証券 | 1,260,920,000 | 95.59 1,205,354,105 | 95.76 1,207,520,038 | 2.125000 2025/5/15 | 0.57% |
| 19 | US T N/B 1.125 05/31/19 アメリカ | 国債証券 | 1,195,700,000 | 98.73 1,180,562,438 | 98.89 1,182,475,558 | 1.125000 2019/5/31 | 0.55% |
| 20 | US T N/B 1.875 06/30/20 アメリカ | 国債証券 | 1,195,700,000 | 98.95 1,183,228,849 | 98.88 1,182,332,074 | 1.875000 2020/6/30 | 0.55% |
| 21 | US T N/B 2.125 08/15/21 アメリカ | 国債証券 | 1,195,700,000 | 98.74 1,180,658,094 | 98.62 1,179,211,297 | 2.125000 2021/8/15 | 0.55% |
| 22 | US T N/B 1.375 04/30/21 アメリカ | 国債証券 | 1,218,527,000 | 96.34 1,174,009,675 | 96.74 1,178,827,390 | 1.375000 2021/4/30 | 0.55% |
| 23 | US T N/B 1.25 01/31/20 アメリカ | 国債証券 | 1,173,960,000 | 98.10 1,151,666,499 | 98.17 1,152,582,188 | 1.250000 2020/1/31 | 0.54% |

| | | | | | | | |
|----|---------------------------------|------|---------------|-------------------------|-------------------------|------------------------|-------|
| 24 | US T N/B 2.0 11/30/20 アメリカ | 国債証券 | 1,141,350,000 | 98.96 1,129,479,960 | 98.81 1,127,790,762 | 2.000000 2020/11/30 | 0.53% |
| 25 | US T N/B 1.375 09/30/23 アメリカ | 国債証券 | 1,195,700,000 | 93.03 1,112,371,667 | 93.42 1,117,034,897 | 1.375000 2023/9/30 | 0.52% |
| 26 | US T N/B 2.25 11/15/24 アメリカ | 国債証券 | 1,152,220,000 | 96.53 1,112,341,665 | 96.89 1,116,385,958 | 2.250000 2024/11/15 | 0.52% |
| 27 | US T N/B 2.0 11/15/21 アメリカ | 国債証券 | 1,130,480,000 | 98.12 1,109,317,414 | 98.05 1,108,526,078 | 2.000000 2021/11/15 | 0.52% |
| 28 | US T N/B 2.75 11/15/23 アメリカ | 国債証券 | 1,087,000,000 | 100.15 1,088,695,720 | 100.22 1,089,456,620 | 2.750000 2023/11/15 | 0.51% |
| 29 | US T N/B 2.125 09/30/21 アメリカ | 国債証券 | 1,087,000,000 | 98.62 1,072,053,750 | 98.51 1,070,858,050 | 2.125000 2021/9/30 | 0.50% |
| 30 | FRANCE OAT 2.5 10/25/20 フランス | 国債証券 | 988,494,000 | 107.59 1,063,560,234 | 107.12 1,058,914,312 | 2.500000 2020/10/25 | 0.50% |

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成30年5月31日現在

| 種類 | 投資比率 |
|------|--------|
| 国債証券 | 97.41% |
| 合計 | 97.41% |

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資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30年5月31日現在

| 順位 | 銘柄名 発行体の国/地域 | 種類 | 数量 | 簿価単価 簿価金額 (円) | 評価単価 評価金額 (円) | 利率(%) 償還日 | 投資 比率 |
|----|---|--------------|-----------|----------------------------|----------------------------|--------------|----------|
| 1 | SIMON PROPERTY GROUP INC アメリカ | 投資証券 | 127,616 | 17,237.77 2,199,816,132 | 17,564.83 2,241,553,728 | - - | 4.46% |
| 2 | PROLOGIS INC アメリカ | 投資証券 | 218,587 | 6,544.90 1,430,631,162 | 7,043.75 1,539,674,367 | - - | 3.06% |
| 3 | PUBLIC STORAGE アメリカ | 投資証券 | 61,436 | 22,477.48 1,380,926,946 | 23,069.40 1,417,291,719 | - - | 2.82% |
| 4 | UNIBAIL-RODAMCO SE フランス | 投資証券 | 55,291 | 26,535.58 1,467,178,984 | 24,186.42 1,337,291,375 | - - | 2.66% |
| 5 | EQUITY RESIDENTIAL アメリカ | 投資証券 | 150,938 | 7,054.13 1,064,736,575 | 6,937.23 1,047,092,225 | - - | 2.08% |
| 6 | AVALONBAY COMMUNITIES INC アメリカ | 投資証券 | 56,609 | 19,795.92 1,120,627,504 | 18,028.98 1,020,602,642 | - - | 2.03% |
| 7 | DIGITAL REALTY TRUST INC アメリカ | 投資証券 | 84,223 | 12,330.87 1,038,543,473 | 11,741.77 988,927,431 | - - | 1.97% |
| 8 | WELLTOWER INC アメリカ | 投資証券 | 151,827 | 7,480.28 1,135,709,452 | 6,254.59 949,616,850 | - - | 1.89% |
| 9 | VENTAS INC アメリカ | 投資証券 | 146,007 | 6,902.84 1,007,864,370 | 5,957.84 869,887,366 | - - | 1.73% |
| 10 | LINK REIT 香港 | 投資証券 | 896,020 | 887.93 795,605,674 | 954.95 855,661,019 | - - | 1.70% |
| 11 | BOSTON PROPERTIES INC アメリカ | 投資証券 | 63,264 | 13,423.00 849,192,980 | 13,275.53 839,863,193 | - - | 1.67% |
| 12 | SCENTRE GROUP オーストラリア | 投資信託受益 証券 | 2,201,596 | 336.57 741,007,288 | 345.04 759,652,994 | - - | 1.51% |
| 13 | HOST HOTELS & RESORTS INC アメリカ | 投資証券 | 300,871 | 2,050.04 616,800,364 | 2,371.83 713,616,067 | - - | 1.42% |
| 14 | ESSEX PROPERTY TRUST INC アメリカ | 投資証券 | 27,064 | 27,474.13 743,559,991 | 26,229.30 709,870,045 | - - | 1.41% |
| 15 | REALTY INCOME CORP アメリカ | 投資証券 | 116,478 | 5,902.06 687,461,060 | 5,840.45 680,284,051 | - - | 1.35% |
| 16 | GGP INC アメリカ | 投資証券 | 258,813 | 2,447.69 633,495,548 | 2,243.56 580,664,564 | - - | 1.16% |
| 17 | ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT アメリカ | 投資証券 | 41,482 | 13,189.10 547,110,397 | 13,623.37 565,124,675 | - - | 1.12% |
| 18 | EXTRA SPACE STORAGE INC アメリカ | 投資証券 | 51,640 | 8,806.64 454,775,381 | 10,537.37 544,150,199 | - - | 1.08% |
| 19 | VORNADO REALTY TRUST アメリカ | 投資証券 | 70,831 | 7,926.73 561,458,692 | 7,548.12 534,641,454 | - - | 1.06% |
| 20 | GOODMAN GROUP オーストラリア | 投資信託受益 証券 | 663,156 | 687.60 455,986,137 | 765.85 507,881,338 | - - | 1.01% |
| 21 | HCP INC アメリカ | 投資証券 | 192,318 | 3,136.56 603,217,516 | 2,605.53 501,092,049 | - - | 1.00% |
| 22 | MID AMERICA アメリカ | 投資証券 | 46,545 | 11,130.49 518,068,927 | 10,216.71 475,536,906 | - - | 0.95% |

| | | | | | | | |
|----|-----------------------------------|------|---------|--------------------------|--------------------------|--------|-------|
| 23 | DUKE REALTY TRUST アメリカ | 投資証券 | 146,225 | 3,000.50 438,748,932 | 3,078.38 450,136,700 | - - | 0.90% |
| 24 | UDR INC アメリカ | 投資証券 | 109,831 | 4,144.70 455,217,302 | 3,961.02 435,043,666 | - - | 0.87% |
| 25 | IRON MOUNTAIN INC アメリカ | 投資証券 | 115,266 | 3,776.88 435,346,968 | 3,641.44 419,735,375 | - - | 0.84% |
| 26 | LAND SECURITIES GROUP PLC イギリス | 投資証券 | 307,299 | 1,445.01 444,052,285 | 1,349.75 414,778,889 | - - | 0.83% |
| 27 | BRITISH LAND CO PLC イギリス | 投資証券 | 406,458 | 910.23 369,972,461 | 974.91 396,261,041 | - - | 0.79% |
| 28 | SL GREEN アメリカ | 投資証券 | 36,989 | 11,133.41 411,813,924 | 10,571.07 391,013,493 | - - | 0.78% |
| 29 | FEDERAL REALTY INVS TRUST アメリカ | 投資証券 | 29,972 | 13,270.66 397,748,423 | 12,976.60 388,934,835 | - - | 0.77% |
| 30 | REGENCY CENTERS CORP アメリカ | 投資証券 | 60,848 | 6,592.66 401,150,552 | 6,349.16 386,334,113 | - - | 0.77% |

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成30年5月31日現在

| 種類 | 投資比率 |
|----------|--------|
| 投資信託受益証券 | 10.47% |
| 投資証券 | 89.03% |
| 合計 | 99.51% |

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年5月31日現在

| 順位 | 銘柄名 発行体の国/地域 | 種類 | 数量 | 簿価単価 簿価金額 (円) | 評価単価 評価金額 (円) | 利率(%) 償還日 | 投資 比率 |
|----|---------------------------------|------|---------------|-------------------------|-------------------------|------------------------|----------|
| 1 | US T N/B 0.875 09/15/19 アメリカ | 国債証券 | 2,445,750,000 | 98.56 2,410,714,557 | 98.16 2,400,748,200 | 0.875000 2019/9/15 | 0.78% |
| 2 | US T N/B 1.375 05/31/20 アメリカ | 国債証券 | 2,326,180,000 | 98.93 2,301,340,923 | 97.96 2,278,912,022 | 1.375000 2020/5/31 | 0.74% |
| 3 | US T N/B 3.625 02/15/20 アメリカ | 国債証券 | 2,119,650,000 | 104.27 2,210,336,667 | 102.07 2,163,611,541 | 3.625000 2020/2/15 | 0.70% |
| 4 | US T N/B 1.75 05/31/22 アメリカ | 国債証券 | 2,174,000,000 | 99.04 2,153,308,955 | 96.64 2,100,953,600 | 1.750000 2022/5/31 | 0.68% |
| 5 | US T N/B 2.125 08/31/20 アメリカ | 国債証券 | 1,867,466,000 | 101.38 1,893,314,091 | 99.25 1,853,590,727 | 2.125000 2020/8/31 | 0.60% |
| 6 | US T N/B 2.375 12/31/20 アメリカ | 国債証券 | 1,842,465,000 | 101.93 1,878,047,434 | 99.67 1,836,550,687 | 2.375000 2020/12/31 | 0.60% |
| 7 | US T N/B 1.0 11/30/19 アメリカ | 国債証券 | 1,847,900,000 | 98.68 1,823,533,827 | 98.02 1,811,440,933 | 1.000000 2019/11/30 | 0.59% |
| 8 | US T N/B 1.375 01/31/21 アメリカ | 国債証券 | 1,847,900,000 | 98.57 1,821,641,542 | 97.07 1,793,904,362 | 1.375000 2021/1/31 | 0.58% |
| 9 | US T N/B 1.0 11/15/19 アメリカ | 国債証券 | 1,739,200,000 | 98.75 1,717,490,272 | 98.08 1,705,842,144 | 1.000000 2019/11/15 | 0.56% |
| 10 | US T N/B 1.625 11/15/22 アメリカ | 国債証券 | 1,747,896,000 | 97.18 1,698,705,284 | 95.70 1,672,911,261 | 1.625000 2022/11/15 | 0.54% |
| 11 | US T N/B 1.625 08/15/22 アメリカ | 国債証券 | 1,728,330,000 | 98.89 1,709,201,087 | 95.98 1,658,851,134 | 1.625000 2022/8/15 | 0.54% |
| 12 | US T N/B 1.75 05/15/22 アメリカ | 国債証券 | 1,714,199,000 | 99.36 1,703,242,960 | 96.72 1,658,144,692 | 1.750000 2022/5/15 | 0.54% |
| 13 | US T N/B 1.75 09/30/22 アメリカ | 国債証券 | 1,695,720,000 | 99.18 1,681,960,754 | 96.35 1,633,843,177 | 1.750000 2022/9/30 | 0.53% |
| 14 | US T N/B 2.25 12/31/24 アメリカ | 国債証券 | 1,630,500,000 | 96.60 1,575,104,447 | 96.76 1,577,753,325 | 2.250000 2024/12/31 | 0.51% |
| 15 | US T N/B 1.75 06/30/22 アメリカ | 国債証券 | 1,630,500,000 | 96.82 1,578,710,645 | 96.62 1,575,470,625 | 1.750000 2022/6/30 | 0.51% |
| 16 | US T N/B 1.125 12/31/19 アメリカ | 国債証券 | 1,576,150,000 | 99.01 1,560,559,480 | 98.09 1,546,155,865 | 1.125000 2019/12/31 | 0.50% |
| 17 | US T N/B 2.0 02/15/23 アメリカ | 国債証券 | 1,521,800,000 | 99.25 1,510,484,202 | 97.10 1,477,683,018 | 2.000000 2023/2/15 | 0.48% |
| 18 | US T N/B 2.625 08/15/20 アメリカ | 国債証券 | 1,451,145,000 | 103.17 1,497,272,323 | 100.37 1,456,586,793 | 2.625000 2020/8/15 | 0.47% |
| 19 | US T N/B 1.125 07/31/21 アメリカ | 国債証券 | 1,510,930,000 | 97.00 1,465,616,548 | 95.64 1,445,053,452 | 1.125000 2021/7/31 | 0.47% |
| 20 | US T N/B 2.125 12/31/22 アメリカ | 国債証券 | 1,467,450,000 | 99.56 1,461,049,915 | 97.71 1,433,962,791 | 2.125000 2022/12/31 | 0.47% |
| 21 | US T N/B 2.25 01/31/24 アメリカ | 国債証券 | 1,456,580,000 | 101.82 1,483,089,756 | 97.50 1,420,165,500 | 2.250000 2024/1/31 | 0.46% |
| 22 | US T N/B 1.875 03/31/22 アメリカ | 国債証券 | 1,445,710,000 | 100.17 1,448,271,515 | 97.29 1,406,618,001 | 1.875000 2022/3/31 | 0.46% |
| 23 | US T N/B 1.5 06/15/20 アメリカ | 国債証券 | 1,413,100,000 | 99.94 1,412,338,703 | 98.19 1,387,537,021 | 1.500000 2020/6/15 | 0.45% |

| | | | | | | | |
|----|---------------------------------|------|---------------|-------------------------|------------------------|------------------------|-------|
| 24 | US T N/B 2.0 08/31/21 アメリカ | 国債証券 | 1,402,230,000 | 98.82 1,385,739,573 | 98.19 1,376,919,748 | 2.000000 2021/8/31 | 0.45% |
| 25 | US T N/B 2.0 09/30/20 アメリカ | 国債証券 | 1,376,142,000 | 101.15 1,392,077,077 | 98.93 1,361,513,610 | 2.000000 2020/9/30 | 0.44% |
| 26 | US T N/B 2.125 09/30/24 アメリカ | 国債証券 | 1,413,100,000 | 96.11 1,358,249,223 | 96.28 1,360,659,859 | 2.125000 2024/9/30 | 0.44% |
| 27 | US T N/B 2.0 07/31/20 アメリカ | 国債証券 | 1,369,620,000 | 101.35 1,388,112,922 | 99.06 1,356,772,964 | 2.000000 2020/7/31 | 0.44% |
| 28 | US T N/B 2.375 08/15/24 アメリカ | 国債証券 | 1,370,707,000 | 100.80 1,381,783,603 | 97.80 1,340,606,274 | 2.375000 2024/8/15 | 0.44% |
| 29 | US T N/B 2.25 11/15/24 アメリカ | 国債証券 | 1,369,620,000 | 99.35 1,360,827,658 | 96.89 1,327,024,818 | 2.250000 2024/11/15 | 0.43% |
| 30 | US T N/B 1.25 10/31/19 アメリカ | 国債証券 | 1,337,010,000 | 99.41 1,329,225,950 | 98.50 1,316,954,850 | 1.250000 2019/10/31 | 0.43% |

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成30年5月31日現在

| 種類 | 投資比率 |
|------|--------|
| 国債証券 | 94.61% |
| 合計 | 94.61% |

(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。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

平成30年5月31日現在

| 順位 | 銘柄名 発行体の国/地域 | 種類 業種 | 数量 | 簿価単価 簿価金額 (円) | 評価単価 評価金額 (円) | 利率(%) 償還日 | 投資 比率 |
|----|---|------------------------------|-----------|----------------------------|----------------------------|--------------|----------|
| 1 | TENCENT HOLDINGS LTD ケイマン諸島 | 株式 インターネット ソフトウェア・サービス | 576,800 | 5,503.14 3,174,214,720 | 5,470.75 3,155,528,600 | - - | 5.04% |
| 2 | ALIBABA GROUP HOLDING LTD- ADR ケイマン諸島 | 株式 インターネット ソフトウェア・サービス | 117,380 | 19,426.62 2,280,296,709 | 21,520.42 2,526,067,603 | - - | 4.03% |
| 3 | SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD 韓国 | 株式 コンピュータ・周辺機器 | 492,600 | 5,059.66 2,492,391,853 | 5,004.45 2,465,192,070 | - - | 3.94% |
| 4 | TAIWAN SEMICONDUCTOR 台湾 | 株式 半導体・半導 体製造装置 | 2,501,083 | 860.28 2,151,637,963 | 800.01 2,000,916,421 | - - | 3.19% |
| 5 | NASPERS LTD 南アフリカ | 株式 メディア | 44,143 | 26,101.25 1,152,187,495 | 26,187.21 1,155,982,222 | - - | 1.85% |
| 6 | CHINA CONSTRUCTION BANK 中国 | 株式 銀行 | 8,613,530 | 109.37 942,124,245 | 108.30 932,905,593 | - - | 1.49% |
| 7 | BAIDU INC -SPON ADR ケイマン諸島 | 株式 インターネット ソフトウェア・サービス | 27,600 | 25,604.88 706,694,804 | 26,265.18 724,918,995 | - - | 1.16% |
| 8 | IND & COMM BK OF CHINA - H 中国 | 株式 銀行 | 7,577,235 | 91.37 692,397,493 | 88.77 672,695,557 | - - | 1.07% |
| 9 | CHINA MOBILE LIMITED 香港 | 株式 無線通信サー ビス | 614,000 | 1,005.84 617,591,421 | 971.57 596,548,585 | - - | 0.95% |
| 10 | SK HYNIX INC 韓国 | 株式 半導体・半導 体製造装置 | 60,099 | 8,377.64 503,487,893 | 9,604.49 577,220,845 | - - | 0.92% |
| 11 | PING AN INSURANCE GROUP CO-H 中国 | 株式 保険 | 534,500 | 1,122.86 600,169,671 | 1,058.14 565,575,830 | - - | 0.90% |
| 12 | HON HAI PRECISION INDUSTRY 台湾 | 株式 電子装置・機 器・部品 | 1,611,532 | 312.75 504,017,251 | 316.38 509,869,386 | - - | 0.81% |
| 13 | BANK OF CHINA LTD 中国 | 株式 銀行 | 8,212,200 | 57.09 468,862,830 | 56.23 461,780,218 | - - | 0.74% |
| 14 | VALE SA ブラジル | 株式 金属・鉱業 | 311,021 | 1,341.60 417,266,352 | 1,476.87 459,339,792 | - - | 0.73% |
| 15 | SBERBANK ADR ロシア | 株式 銀行 | 280,870 | 1,544.29 433,745,993 | 1,565.27 439,640,193 | - - | 0.70% |

| | | | | | | | |
|----|--|------------------------------|-----------|--------------------------|--------------------------|--------|-------|
| 16 | HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP インド | 株式 貯蓄・抵当・ 不動産金融 | 150,810 | 3,058.14 461,198,664 | 2,901.09 437,514,287 | - - | 0.70% |
| 17 | RELIANCE INDUSTRIES LTD インド | 株式 石油・ガス・ 消耗燃料 | 292,811 | 1,528.78 447,645,638 | 1,484.08 434,555,534 | - - | 0.69% |
| 18 | ITAU UNIBANCO HOLDING SA ブラジル | 株式 銀行 | 316,098 | 1,474.18 465,986,709 | 1,253.72 396,300,470 | - - | 0.63% |
| 19 | SAMSUNG ELECTRONICS-PFD 韓国 | 株式 コンピュー タ・周辺機器 | 90,000 | 4,103.62 369,326,397 | 3,942.90 354,861,000 | - - | 0.57% |
| 20 | INFOSYS LTD インド | 株式 情報技術サー ビス | 172,537 | 1,826.73 315,179,228 | 1,962.95 338,682,194 | - - | 0.54% |
| 21 | LUKOIL SPON ADR ロシア | 株式 石油・ガス・ 消耗燃料 | 44,852 | 6,909.94 309,924,872 | 7,304.63 327,627,713 | - - | 0.52% |
| 22 | CNOOC LTD 香港 | 株式 石油・ガス・ 消耗燃料 | 1,761,000 | 173.11 304,858,480 | 178.38 314,141,268 | - - | 0.50% |
| 23 | BANCO BRADESCO SA PREF ブラジル | 株式 銀行 | 332,425 | 983.36 326,895,258 | 850.88 282,856,742 | - - | 0.45% |
| 24 | AMERICA MOVIL SAB DE CV メキシコ | 株式 無線通信サー ビス | 3,324,278 | 97.68 324,736,157 | 84.54 281,054,407 | - - | 0.45% |
| 25 | GAZPROM PAO ADR ロシア | 株式 石油・ガス・ 消耗燃料 | 559,050 | 494.84 276,643,583 | 491.65 274,856,988 | - - | 0.44% |
| 26 | AMBEV SA ブラジル | 株式 飲料 | 462,895 | 674.54 312,241,946 | 574.35 265,867,122 | - - | 0.42% |
| 27 | TATA CONSULTANCY SERVICES LTD インド | 株式 情報技術サー ビス | 44,975 | 5,147.22 231,496,285 | 5,692.84 256,035,568 | - - | 0.41% |
| 28 | POSCO 韓国 | 株式 金属・鉱業 | 7,262 | 33,725.39 244,913,819 | 34,576.19 251,092,364 | - - | 0.40% |
| 29 | JD.COM INC ADR ケイマン諸島 | 株式 インターネッ ト販売・通信 販売 | 64,400 | 4,365.82 281,159,313 | 3,891.46 250,610,024 | - - | 0.40% |
| 30 | CHINA PETROLEUM & CHEMICAL COR 中国 | 株式 石油・ガス・ 消耗燃料 | 2,501,200 | 102.01 255,159,755 | 100.13 250,458,912 | - - | 0.40% |

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成30年5月31日現在

| 種類 | 投資比率 |
|----------|--------|
| 株式 | 91.57% |
| 投資信託受益証券 | 0.43% |
| 投資証券 | 0.19% |
| 合計 | 92.20% |

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

平成30年5月31日現在

| 業種 | 国内/外国 | 投資比率 |
|--------------------|-------|--------|
| 銀行 | 外国 | 14.90% |
| インターネットソフトウェア・サービス | | 11.51% |
| 石油・ガス・消耗燃料 | | 6.67% |
| コンピュータ・周辺機器 | | 5.36% |
| 半導体・半導体製造装置 | | 5.19% |
| 保険 | | 3.19% |
| 金属・鉱業 | | 3.08% |
| 無線通信サービス | | 2.79% |
| 電子装置・機器・部品 | | 2.47% |
| 化学 | | 2.24% |
| メディア | | 2.22% |
| 不動産管理・開発 | | 2.17% |
| 自動車 | | 2.08% |
| 食品・生活必需品小売り | | 1.57% |
| 食品 | | 1.55% |
| 情報技術サービス | | 1.53% |
| コングロマリット | | 1.41% |
| 医薬品 | | 1.35% |
| 各種電気通信サービス | | 1.27% |
| 各種金融サービス | | 1.11% |
| 資本市場 | | 1.03% |
| 電力 | | 0.91% |
| 貯蓄・抵当・不動産金融 | | 0.85% |
| 飲料 | | 0.85% |
| 運送インフラ | | 0.82% |
| 建設資材 | | 0.81% |
| インターネット販売・通信販売 | | 0.79% |
| パーソナル用品 | | 0.78% |
| 機械 | | 0.72% |
| 建設・土木 | | 0.71% |
| ホテル・レストラン・レジャー | | 0.60% |
| 複合小売り | | 0.59% |
| ガス | | 0.58% |
| バイオテクノロジー | | 0.57% |
| 繊維・アパレル・贅沢品 | | 0.56% |
| 自動車部品 | | 0.56% |
| 各種消費者サービス | | 0.54% |
| タバコ | | 0.51% |

| | |
|-------------------------|--------|
| 紙製品・林産品 | 0.48% |
| ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス | 0.47% |
| 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 | 0.45% |
| 専門小売り | 0.41% |
| 家庭用品 | 0.40% |
| 家庭用耐久財 | 0.34% |
| ソフトウェア | 0.27% |
| 旅客航空輸送業 | 0.27% |
| エクイティ不動産投資信託(REITs) | 0.23% |
| 消費者金融 | 0.22% |
| 陸運・鉄道 | 0.19% |
| 水道 | 0.19% |
| 電気設備 | 0.17% |
| 航空宇宙・防衛 | 0.16% |
| ライフサイエンス・ツール/サービス | 0.12% |
| 商業サービス・用品 | 0.10% |
| エネルギー設備・サービス | 0.09% |
| ヘルスケア機器・用品 | 0.07% |
| 海運業 | 0.06% |
| 容器・包装 | 0.06% |
| 通信機器 | 0.06% |
| ヘルスケア・テクノロジー | 0.06% |
| 総合公益事業 | 0.06% |
| 販売 | 0.05% |
| 航空貨物・物流サービス | 0.04% |
| 建設関連製品 | 0.04% |
| 商社・流通業 | 0.03% |
| レジャー用品 | 0.02% |
| 合計 | 91.57% |

(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 スマートグローバルバランス(保守型)

平成30年5月31日現在

| 種類 | 取引所 | 資産の名称 | 買建/ 売建 | 数量 | 簿価金額 (円) | 評価金額 (円) | 投資 比率 |
|--------|-----|--------------------------------|-----------|-------|-------------|-------------|----------|
| 為替予約取引 | - | アメリカ・ドル売/円 買2018年06月 | 売建 | 1,205 | 131,453 | 130,911 | 3.09% |
| | | ユーロ売/円買201 8年06月 | 売建 | 205 | 27,083 | 25,979 | 0.61% |
| | | イギリス・ポンド売/ 円買2018年06月 | 売建 | 97 | 14,591 | 14,019 | 0.33% |
| | | カナダ・ドル売/円買 2018年06月 | 売建 | 88 | 7,485 | 7,420 | 0.18% |
| | | スイス・フラン売/円 買2018年06月 | 売建 | 56 | 6,180 | 6,163 | 0.15% |
| | | オーストラリア・ドル 売/円買2018年0 6月 | 売建 | 65 | 5,341 | 5,350 | 0.13% |

(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 スマートグローバルバランス(安定型)

平成30年5月31日現在

| 種類 | 取引所 | 資産の名称 | 買建/ 売建 | 数量 | 簿価金額 (円) | 評価金額 (円) | 投資 比率 |
|--------|-----|-------------------------|-----------|---------|-------------|-------------|----------|
| 為替予約取引 | - | アメリカ・ドル売/円買2018年06月 | 売建 | 134,600 | 14,691,198 | 14,622,944 | 9.55% |
| | | ユーロ売/円買2018年06月 | 売建 | 22,900 | 3,014,113 | 2,902,117 | 1.89% |
| | | イギリス・ポンド売/円買2018年06月 | 売建 | 10,800 | 1,618,479 | 1,560,924 | 1.02% |
| | | カナダ・ドル売/円買2018年06月 | 売建 | 9,800 | 834,216 | 826,336 | 0.54% |
| | | スイス・フラン売/円買2018年06月 | 売建 | 6,300 | 694,901 | 693,378 | 0.45% |
| | | オーストラリア・ドル売/円買2018年06月 | 売建 | 7,300 | 600,608 | 600,863 | 0.39% |
| | | 香港・ドル売/円買2018年06月 | 売建 | 17,900 | 248,997 | 247,736 | 0.16% |
| | | スウェーデン・クローナ売/円買2018年06月 | 売建 | 15,600 | 195,023 | 192,348 | 0.13% |
| | | デンマーク・クローネ売/円買2018年06月 | 売建 | 7,300 | 129,474 | 124,319 | 0.08% |
| | | シンガポール・ドル売/円買2018年06月 | 売建 | 1,300 | 107,001 | 105,508 | 0.07% |
| | | ノルウェー・クローネ売/円買2018年06月 | 売建 | 3,800 | 51,776 | 50,350 | 0.03% |
| | | イスラエル・シケル売/円買2018年06月 | 売建 | 600 | 18,208 | 18,252 | 0.01% |
| | | ニュージーランド・ドル売/円買2018年06月 | 売建 | 200 | 15,350 | 15,180 | 0.01% |

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

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

為替予約取引の数量は、現地通貨建契約金額です。

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)

平成30年5月31日現在

| 種類 | 取引所 | 資産の名称 | 買建/ 売建 | 数量 | 簿価金額 (円) | 評価金額 (円) | 投資 比率 |
|--------|-----|-------------------------|-----------|---------|-------------|-------------|----------|
| 為替予約取引 | - | アメリカ・ドル売/円買2018年06月 | 売建 | 223,300 | 24,407,032 | 24,259,312 | 10.65% |
| | | ユーロ売/円買2018年06月 | 売建 | 38,000 | 4,986,314 | 4,815,740 | 2.11% |
| | | イギリス・ポンド売/円買2018年06月 | 売建 | 18,000 | 2,689,327 | 2,601,540 | 1.14% |
| | | カナダ・ドル売/円買2018年06月 | 売建 | 16,300 | 1,387,285 | 1,374,416 | 0.60% |
| | | スイス・フラン売/円買2018年06月 | 売建 | 10,400 | 1,146,664 | 1,144,624 | 0.50% |
| | | オーストラリア・ドル売/円買2018年06月 | 売建 | 12,200 | 1,004,416 | 1,004,182 | 0.44% |
| | | 香港・ドル売/円買2018年06月 | 売建 | 22,800 | 317,159 | 315,552 | 0.14% |
| | | スウェーデン・クローナ売/円買2018年06月 | 売建 | 19,900 | 248,779 | 245,367 | 0.11% |
| | | デンマーク・クローネ売/円買2018年06月 | 売建 | 9,300 | 164,947 | 158,379 | 0.07% |
| | | シンガポール・ドル売/円買2018年06月 | 売建 | 1,600 | 131,694 | 129,856 | 0.06% |
| | | ノルウェー・クローネ売/円買2018年06月 | 売建 | 4,900 | 66,764 | 64,925 | 0.03% |
| | | イスラエル・シケル売/円買2018年06月 | 売建 | 800 | 24,278 | 24,336 | 0.01% |
| | | ニュージーランド・ドル売/円買2018年06月 | 売建 | 200 | 15,350 | 15,180 | 0.01% |

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

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

為替予約取引の数量は、現地通貨建契約金額です。

たわらノーロード スマートグローバルバランス(成長型)

平成30年5月31日現在

| 種類 | 取引所 | 資産の名称 | 買建/ 売建 | 数量 | 簿価金額 (円) | 評価金額 (円) | 投資 比率 |
|--------|-----|-------------------------|-----------|---------|-------------|-------------|----------|
| 為替予約取引 | - | アメリカ・ドル売/円買2018年06月 | 売建 | 122,800 | 13,405,257 | 13,340,992 | 12.24% |
| | | ユーロ売/円買2018年06月 | 売建 | 20,900 | 2,735,989 | 2,648,657 | 2.43% |
| | | イギリス・ポンド売/円買2018年06月 | 売建 | 9,900 | 1,477,394 | 1,430,847 | 1.31% |
| | | カナダ・ドル売/円買2018年06月 | 売建 | 8,900 | 756,475 | 750,448 | 0.69% |
| | | スイス・フラン売/円買2018年06月 | 売建 | 5,700 | 628,665 | 627,342 | 0.58% |
| | | オーストラリア・ドル売/円買2018年06月 | 売建 | 6,700 | 551,050 | 551,477 | 0.51% |
| | | 香港・ドル売/円買2018年06月 | 売建 | 14,400 | 200,311 | 199,296 | 0.18% |
| | | スウェーデン・クローナ売/円買2018年06月 | 売建 | 12,600 | 157,518 | 155,358 | 0.14% |
| | | デンマーク・クローネ売/円買2018年06月 | 売建 | 5,900 | 104,644 | 100,477 | 0.09% |
| | | シンガポール・ドル売/円買2018年06月 | 売建 | 1,000 | 82,309 | 81,160 | 0.07% |
| | | ノルウェー・クローネ売/円買2018年06月 | 売建 | 3,100 | 42,239 | 41,075 | 0.04% |
| | | イスラエル・シケル売/円買2018年06月 | 売建 | 500 | 15,174 | 15,210 | 0.01% |
| | | ニュージーランド・ドル売/円買2018年06月 | 売建 | 100 | 7,675 | 7,590 | 0.01% |

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

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

為替予約取引の数量は、現地通貨建契約金額です。

たわらノーロード スマートグローバルバランス(積極型)

平成30年5月31日現在

| 種類 | 取引所 | 資産の名称 | 買建/ 売建 | 数量 | 簿価金額 (円) | 評価金額 (円) | 投資 比率 |
|--------|-----|-------------------------|-----------|---------|-------------|-------------|----------|
| 為替予約取引 | - | アメリカ・ドル売/円買2018年06月 | 売建 | 275,400 | 30,072,478 | 29,919,456 | 13.54% |
| | | ユーロ売/円買2018年06月 | 売建 | 46,800 | 6,131,875 | 5,930,964 | 2.68% |
| | | イギリス・ポンド売/円買2018年06月 | 売建 | 22,200 | 3,312,883 | 3,208,566 | 1.45% |
| | | カナダ・ドル売/円買2018年06月 | 売建 | 20,100 | 1,709,488 | 1,694,832 | 0.77% |
| | | スイス・フラン売/円買2018年06月 | 売建 | 12,800 | 1,411,049 | 1,408,768 | 0.64% |
| | | オーストラリア・ドル売/円買2018年06月 | 売建 | 15,000 | 1,234,311 | 1,234,650 | 0.56% |
| | | 香港・ドル売/円買2018年06月 | 売建 | 28,900 | 402,013 | 399,976 | 0.18% |
| | | スウェーデン・クローナ売/円買2018年06月 | 売建 | 25,300 | 316,287 | 311,949 | 0.14% |
| | | デンマーク・クローネ売/円買2018年06月 | 売建 | 11,800 | 209,288 | 200,954 | 0.09% |
| | | シンガポール・ドル売/円買2018年06月 | 売建 | 2,000 | 164,618 | 162,320 | 0.07% |
| | | ノルウェー・クローネ売/円買2018年06月 | 売建 | 6,200 | 84,478 | 82,150 | 0.04% |
| | | イスラエル・シケル売/円買2018年06月 | 売建 | 1,000 | 30,348 | 30,420 | 0.01% |
| | | ニュージーランド・ドル売/円買2018年06月 | 売建 | 300 | 23,026 | 22,770 | 0.01% |

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

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

為替予約取引の数量は、現地通貨建契約金額です。

(参考)

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

平成30年5月31日現在

| 種類 | 取引所 | 資産の名称 | 買建/ 売建 | 数量 | 簿価金額 (円) | 評価金額 (円) | 投資 比率 |
|--------------|-------|-------------------|-----------|-----|---------------|---------------|----------|
| 株価指数先物 取引 | 大阪取引所 | TOPIX 先物 3006月 | 買建 | 372 | 6,589,375,528 | 6,489,540,000 | 2.18% |

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

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

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

J-REITインデックスファンド・マザーファンド

平成30年5月31日現在

| 種類 | 取引所 | 資産の名称 | 買建/ 売建 | 数量 | 簿価金額 (円) | 評価金額 (円) | 投資 比率 |
|-----------------|-------|-------------------|-----------|-----|-------------|-------------|----------|
| 不動産投信指 数先物取引 | 大阪取引所 | TREIT 先物 3006月 | 買建 | 351 | 579,165,008 | 608,634,000 | 1.73% |

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

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

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年5月31日現在

| 種類 | 取引所 | 資産の名称 | 買建/ 売建 | 数量 | 簿価金額 (円) | 評価金額 (円) | 投資 比率 |
|--------------|-------------------------------|-------------------------------------|-----------|------------|---------------|---------------|----------|
| 為替予約取引 | - | アメリカ・ドル買/円 売2018年06月 | 買建 | 10,086,000 | 1,093,292,142 | 1,096,247,340 | 0.36% |
| | | ユーロ買/円売201 8年06月 | 買建 | 1,880,000 | 235,103,400 | 238,252,400 | 0.08% |
| | | イギリス・ポンド買/ 円売2018年06月 | 買建 | 791,000 | 113,649,456 | 114,339,050 | 0.04% |
| | | カナダ・ドル買/円売 2018年06月 | 買建 | 726,000 | 60,407,556 | 61,230,840 | 0.02% |
| | | オーストラリア・ドル 買/円売2018年0 6月 | 買建 | 542,000 | 44,007,148 | 44,628,280 | 0.01% |
| | | アメリカ・ドル売/円 買2018年06月 | 売建 | 3,315,000 | 360,257,625 | 360,207,900 | 0.12% |
| | | ユーロ売/円買201 8年06月 | 売建 | 760,000 | 96,316,320 | 96,314,800 | 0.03% |
| | | イギリス・ポンド売/ 円買2018年06月 | 売建 | 244,000 | 35,269,468 | 35,267,760 | 0.01% |
| | | カナダ・ドル売/円買 2018年06月 | 売建 | 255,000 | 21,505,680 | 21,504,150 | 0.01% |
| | | オーストラリア・ドル 売/円買2018年0 6月 | 売建 | 210,000 | 17,289,720 | 17,287,200 | 0.01% |
| 株価指数先物 取引 | シカゴ商品 取引所 | S&P500 EMI NIFUT Jun 18 | 買建 | 321 | 4,687,627,715 | 4,753,258,057 | 1.56% |
| | EUREX 取引所 | DJ EURO ST OXX 50 Jun 18 | 買建 | 277 | 1,200,885,876 | 1,201,266,066 | 0.39% |
| | ICE-E EU | FTSE 100 I NDEX FUTUR E Jun18 | 買建 | 44 | 471,355,227 | 486,875,188 | 0.16% |
| | モン トリ オール 取引 所 | S&P/TSE 6 0 IX FUT J un18 | 買建 | 16 | 249,188,457 | 255,938,144 | 0.08% |
| | シド ニー 先 物 取引 所 | SPI 200 FU TURES Jun1 8 | 買建 | 16 | 195,066,562 | 197,475,300 | 0.06% |

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

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

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

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年5月31日現在

| 種類 | 取引所 | 資産の名称 | 買建/ 売建 | 数量 | 簿価金額 (円) | 評価金額 (円) | 投資 比率 |
|--------|-----|------------------------|-----------|-----------|---------------|---------------|----------|
| 為替予約取引 | - | ユーロ売/円買2018年06月 | 売建 | 9,664,488 | 1,224,800,000 | 1,224,780,670 | 0.57% |
| | | カナダ・ドル売/円買2018年06月 | 売建 | 1,601,569 | 135,070,000 | 135,060,390 | 0.06% |
| | | ノルウェー・クローネ売/円買2018年06月 | 売建 | 9,052,510 | 120,020,000 | 119,945,769 | 0.06% |
| | | スイス・フラン売/円買2018年06月 | 売建 | 858,381 | 94,470,000 | 94,464,849 | 0.04% |
| | | オーストラリア・ドル売/円買2018年06月 | 売建 | 12,388 | 1,020,000 | 1,019,850 | 0.00% |

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

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年5月31日現在

| 種類 | 取引所 | 資産の名称 | 買建/ 売建 | 数量 | 簿価金額 (円) | 評価金額 (円) | 投資 比率 |
|--------|-----|-------------------------|-----------|-----------|-------------|-------------|----------|
| 為替予約取引 | - | ユーロ買/円売2018年06月 | 買建 | 2,605,000 | 330,139,465 | 330,131,650 | 0.66% |
| | | オーストラリア・ドル買/円売2018年06月 | 買建 | 380,000 | 30,853,720 | 31,289,200 | 0.06% |
| | | 香港・ドル買/円売2018年06月 | 買建 | 600,000 | 8,291,760 | 8,304,000 | 0.02% |
| | | シンガポール・ドル買/円売2018年06月 | 買建 | 60,000 | 4,834,452 | 4,871,400 | 0.01% |
| | | ニュージーランド・ドル買/円売2018年06月 | 買建 | 35,000 | 2,618,140 | 2,657,550 | 0.01% |
| | | アメリカ・ドル売/円買2018年06月 | 売建 | 2,300,000 | 249,995,050 | 249,987,000 | 0.50% |
| | | カナダ・ドル売/円買2018年06月 | 売建 | 580,000 | 48,920,448 | 48,917,200 | 0.10% |
| | | オーストラリア・ドル売/円買2018年06月 | 売建 | 450,000 | 37,049,400 | 37,044,000 | 0.07% |
| | | イギリス・ポンド売/円買2018年06月 | 売建 | 145,000 | 20,960,765 | 20,959,750 | 0.04% |
| | | シンガポール・ドル売/円買2018年06月 | 売建 | 180,000 | 14,611,860 | 14,610,600 | 0.03% |
| | | 香港・ドル売/円買2018年06月 | 売建 | 640,000 | 8,862,720 | 8,857,600 | 0.02% |

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

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

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年5月31日現在

| 種類 | 取引所 | 資産の名称 | 買建/ 売建 | 数量 | 簿価金額 (円) | 評価金額 (円) | 投資 比率 |
|--------|-----|-------------------------|-----------|---------------|-----------------|-----------------|----------|
| 為替予約取引 | - | アメリカ・ドル売/円買2018年06月 | 売建 | 1,191,337,400 | 130,071,032,620 | 129,438,808,510 | 42.15% |
| | | ユーロ売/円買2018年06月 | 売建 | 963,585,900 | 127,310,460,961 | 122,115,241,107 | 39.76% |
| | | イギリス・ポンド売/円買2018年06月 | 売建 | 143,359,800 | 21,567,969,815 | 20,719,791,894 | 6.75% |
| | | カナダ・ドル売/円買2018年06月 | 売建 | 73,964,100 | 6,303,800,153 | 6,236,652,912 | 2.03% |
| | | オーストラリア・ドル売/円買2018年06月 | 売建 | 75,260,800 | 6,200,224,549 | 6,194,716,448 | 2.02% |
| | | メキシコ・ペソ売/円買2018年06月 | 売建 | 437,832,800 | 2,520,679,610 | 2,394,945,416 | 0.78% |
| | | 南アフリカ・ランド売/円買2018年06月 | 売建 | 219,192,900 | 1,910,314,886 | 1,896,018,585 | 0.62% |
| | | ポーランド・ズロチ売/円買2018年06月 | 売建 | 59,771,800 | 1,863,194,595 | 1,755,497,766 | 0.57% |
| | | デンマーク・クローネ売/円買2018年06月 | 売建 | 90,231,500 | 1,601,634,389 | 1,536,642,445 | 0.50% |
| | | マレーシア・リンギット売/円買2018年06月 | 売建 | 42,570,000 | 1,173,310,083 | 1,160,458,200 | 0.38% |
| | | シンガポール・ドル売/円買2018年06月 | 売建 | 12,090,500 | 997,672,997 | 981,385,885 | 0.32% |
| | | スウェーデン・クローナ売/円買2018年06月 | 売建 | 76,646,200 | 959,518,448 | 945,047,646 | 0.31% |
| | | ノルウェー・クローネ売/円買2018年06月 | 売建 | 55,079,000 | 751,489,614 | 729,796,750 | 0.24% |

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

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

為替予約取引の数量は、現地通貨建契約金額です。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

平成30年5月31日現在

| 種類 | 取引所 | 資産の名称 | 買建/ 売建 | 数量 | 簿価金額 (円) | 評価金額 (円) | 投資 比率 |
|--------------|--------|--------------------------------|-----------|-----------|---------------|---------------|----------|
| 為替予約取引 | - | アメリカ・ドル買/円 売2018年06月 | 買建 | 6,538,000 | 708,699,586 | 710,615,220 | 1.13% |
| | | アメリカ・ドル売/円 買2018年06月 | 売建 | 3,050,000 | 331,458,750 | 331,413,000 | 0.53% |
| 株価指数先物 取引 | ICE-US | MINI MSCI EMG MKT Jun 18 | 買建 | 737 | 4,637,461,578 | 4,487,468,078 | 7.17% |

(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) 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。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

直近日（平成30年5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 スマートグローバルバランス（保守型）

| | 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) |
|------------|-------------------------|-------------------------|----------------------------|----------------------------|
| 平成29年11月末日 | 1 | - | 1.0001 | - |
| 12月末日 | 1 | - | 1.0019 | - |
| 平成30年1月末日 | 0 | - | 0.9990 | - |
| 2月末日 | 1 | - | 0.9950 | - |
| 3月末日 | 2 | - | 0.9970 | - |
| 4月末日 | 3 | - | 0.9962 | - |
| 5月末日 | 4 | - | 0.9952 | - |

たわらノーロード スマートグローバルバランス（安定型）

| | 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) |
|------------|-------------------------|-------------------------|----------------------------|----------------------------|
| 平成29年11月末日 | 1 | - | 1.0009 | - |
| 12月末日 | 1 | - | 1.0061 | - |
| 平成30年1月末日 | 9 | - | 1.0109 | - |
| 2月末日 | 13 | - | 0.9989 | - |
| 3月末日 | 68 | - | 0.9965 | - |
| 4月末日 | 121 | - | 1.0013 | - |
| 5月末日 | 153 | - | 1.0015 | - |

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）

| | 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) |
|------------|-------------------------|-------------------------|----------------------------|----------------------------|
| 平成29年11月末日 | 1 | - | 1.0016 | - |
| 12月末日 | 1 | - | 1.0102 | - |
| 平成30年1月末日 | 10 | - | 1.0155 | - |
| 2月末日 | 27 | - | 0.9954 | - |
| 3月末日 | 59 | - | 0.9886 | - |
| 4月末日 | 136 | - | 0.9999 | - |
| 5月末日 | 227 | - | 1.0026 | - |

たわらノーロード スマートグローバルバランス(成長型)

| | 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) |
|------------|-------------------------|-------------------------|----------------------------|----------------------------|
| 平成29年11月末日 | 1 | - | 1.0023 | - |
| 12月末日 | 1 | - | 1.0148 | - |
| 平成30年1月末日 | 7 | - | 1.0229 | - |
| 2月末日 | 16 | - | 0.9940 | - |
| 3月末日 | 43 | - | 0.9822 | - |
| 4月末日 | 78 | - | 1.0003 | - |
| 5月末日 | 108 | - | 1.0058 | - |

たわらノーロード スマートグローバルバランス(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) |
|------------|-------------------------|-------------------------|----------------------------|----------------------------|
| 平成29年11月末日 | 1 | - | 1.0032 | - |
| 12月末日 | 1 | - | 1.0195 | - |
| 平成30年1月末日 | 13 | - | 1.0284 | - |
| 2月末日 | 21 | - | 0.9912 | - |
| 3月末日 | 72 | - | 0.9738 | - |
| 4月末日 | 128 | - | 0.9987 | - |
| 5月末日 | 220 | - | 1.0058 | - |

【分配の推移】

たわらノーロード スマートグローバルバランス(保守型)

| | 1口当たりの分配金(円) |
|----------------------------|--------------|
| 平成29年11月24日～ 平成30年5月23日 | - |

たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定型)

| | 1口当たりの分配金(円) |
|----------------------------|--------------|
| 平成29年11月24日～ 平成30年5月23日 | - |

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)

| | 1口当たりの分配金(円) |
|----------------------------|--------------|
| 平成29年11月24日～ 平成30年5月23日 | - |

たわらノーロード スマートグローバルバランス(成長型)

| | 1口当たりの分配金(円) |
|----------------------------|--------------|
| 平成29年11月24日～ 平成30年5月23日 | - |

たわらノーロード スマートグローバルバランス(積極型)

| | 1口当たりの分配金(円) |
|----------------------------|--------------|
| 平成29年11月24日～ 平成30年5月23日 | - |

【収益率の推移】

たわらノーロード スマートグローバルバランス(保守型)

| | 収益率(%) |
|----------------------------|--------|
| 平成29年11月24日～ 平成30年5月23日 | 0.4 |

(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 スマートグローバルバランス(安定型)

| | 収益率(%) |
|----------------------------|--------|
| 平成29年11月24日～ 平成30年5月23日 | 0.5 |

(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 スマートグローバルバランス(安定成長型)

| | 収益率(%) |
|----------------------------|--------|
| 平成29年11月24日～ 平成30年5月23日 | 1.0 |

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

なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

たわらノーロード スマートグローバルバランス(成長型)

| | 収益率(%) |
|----------------------------|--------|
| 平成29年11月24日～ 平成30年5月23日 | 1.6 |

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

なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

たわらノーロード スマートグローバルバランス(積極型)

| | 収益率(%) |
|----------------------------|--------|
| 平成29年11月24日～ 平成30年5月23日 | 2.0 |

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

なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

(4) 【設定及び解約の実績】

たわらノーロード スマートグローバルバランス(保守型)

| | 設定口数 | 解約口数 |
|----------------------------|-----------|------|
| 平成29年11月24日～ 平成30年5月23日 | 4,066,592 | 0 |

(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 スマートグローバルバランス(安定型)

| | 設定口数 | 解約口数 |
|----------------------------|-------------|-----------|
| 平成29年11月24日～ 平成30年5月23日 | 142,871,383 | 3,152,762 |

(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 スマートグローバルバランス(安定成長型)

| | 設定口数 | 解約口数 |
|----------------------------|-------------|-----------|
| 平成29年11月24日～ 平成30年5月23日 | 190,082,230 | 1,883,625 |

(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 スマートグローバルバランス(成長型)

| | 設定口数 | 解約口数 |
|----------------------------|------------|-----------|
| 平成29年11月24日～ 平成30年5月23日 | 90,649,960 | 6,643,479 |

(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 スマートグローバルバランス(積極型)

| | 設定口数 | 解約口数 |
|----------------------------|-------------|------------|
| 平成29年11月24日～ 平成30年5月23日 | 197,589,688 | 15,645,501 |

(注1) 本邦外における設定及び解約はございません。

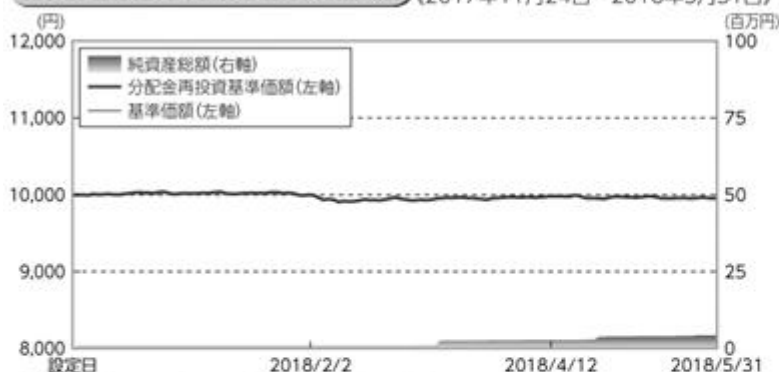
(注2) 第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

<< 参考情報 >>

データの基準日:2018年5月31日

たわらノーロード スマートグローバルバランス(保守型)

基準価額・純資産の推移 (2017年11月24日～2018年5月31日)



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。
 ※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額とは異なります。(設定日:2017年11月24日)
 ※設定時から10年以上経過した場合は、直近10年分を記載しています。

分配の推移

初回決算が2018年10月12日のため
基準日現在分配実績はありません。

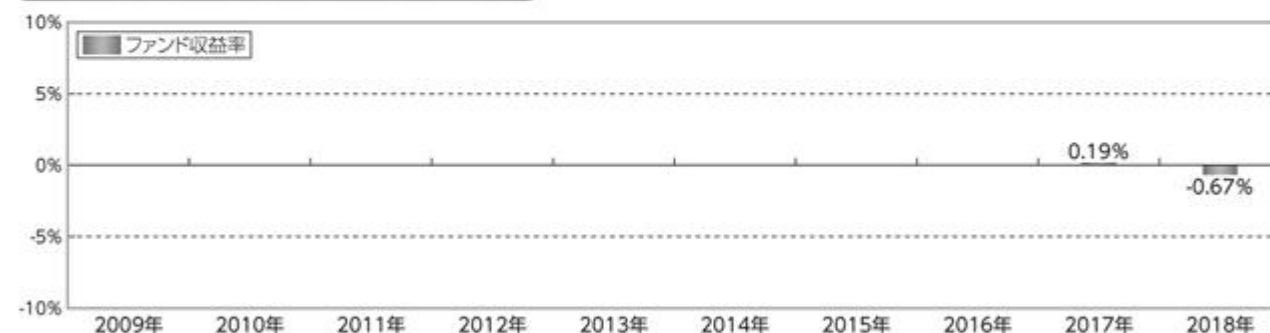
主要な資産の状況

■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 | 53.55% |
| 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 | 30.97% |
| 3 | 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド | 4.95% |
| 4 | 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド | 4.55% |
| 5 | 国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド | 3.95% |
| 6 | エマージング株式パッシブ・マザーファンド | 0.97% |

※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)



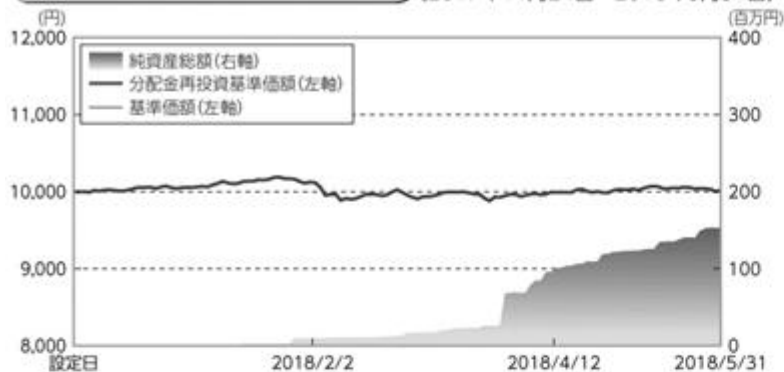
※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。
 ※2017年は設定日から年末までの収益率、および2018年については年初から基準日までの収益率を表示しています。
 ※当ファンドにはベンチマークはありません。

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

たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定型)

基準価額・純資産の推移

(2017年11月24日～2018年5月31日)



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。
 ※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額とは異なります。(設定日:2017年11月24日)
 ※設定時から10年以上経過した場合は、直近10年分を記載しています。

分配の推移

初回決算が2018年10月12日のため
 基準日現在分配実績はありません。

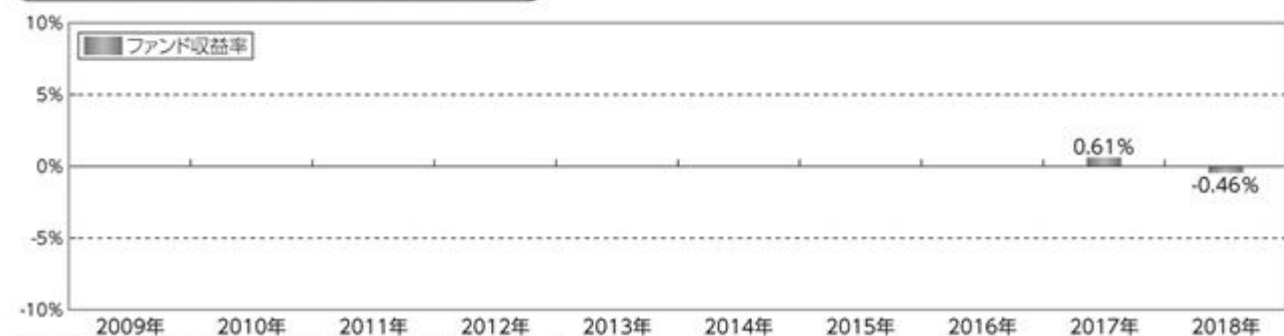
主要な資産の状況

■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 | 30.58% |
| 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 | 30.04% |
| 3 | 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド | 15.66% |
| 4 | 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド | 7.97% |
| 5 | J-REITインデックスファンド・マザーファンド | 6.00% |
| 6 | 国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド | 4.97% |
| 7 | 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド | 2.02% |
| 8 | エマージング株式パッシブ・マザーファンド | 1.95% |

※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)



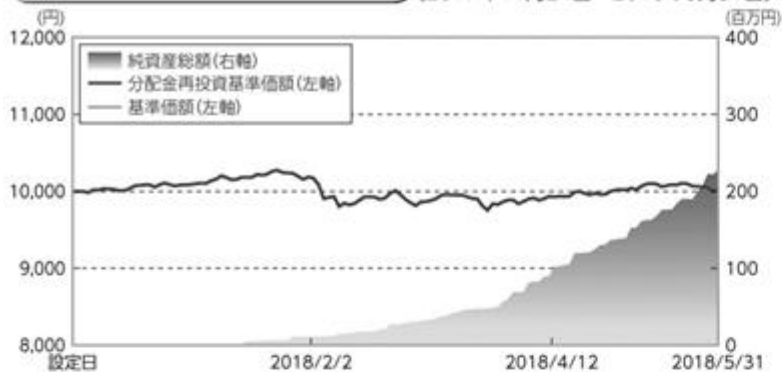
※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。
 ※2017年は設定日から年末までの収益率、および2018年については年初から基準日までの収益率を表示しています。
 ※当ファンドにはベンチマークはありません。

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

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)

基準価額・純資産の推移

(2017年11月24日～2018年5月31日)



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。
 ※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額とは異なります。(設定日:2017年11月24日)
 ※設定時から10年以上経過した場合は、直近10年分を記載しています。

分配の推移

初回決算が2018年10月12日のため
 基準日現在分配実績はありません。

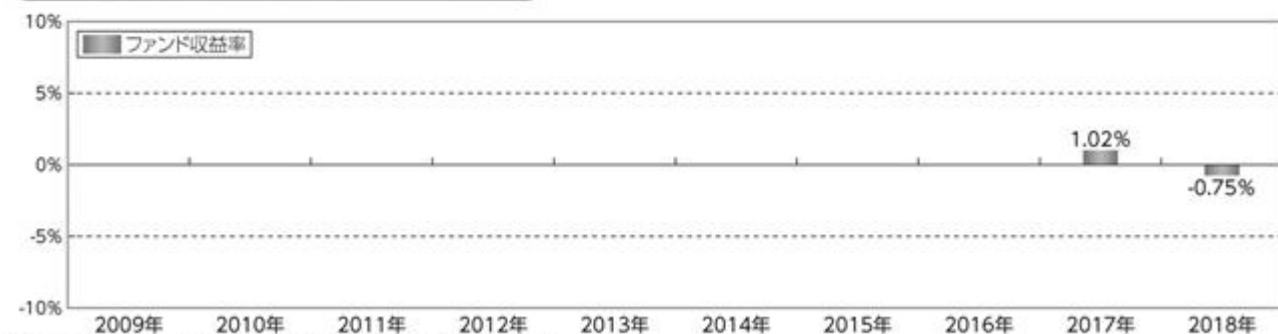
主要な資産の状況

■組入銘柄 ※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

| 順位 | 銘柄名 | 比率 |
|----|------------------------------|--------|
| 1 | 為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド | 23.03% |
| 2 | 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド | 22.34% |
| 3 | 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド | 20.56% |
| 4 | J-REITインデックスファンド・マザーファンド | 10.01% |
| 5 | 国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド | 7.95% |
| 6 | 外国リートパッシブ・ファンド・マザーファンド | 7.06% |
| 7 | 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド | 4.98% |
| 8 | エマージング株式パッシブ・マザーファンド | 2.93% |

※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2018年については年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。

たわらノーロード スマートグローバルバランス(成長型)

基準価額・純資産の推移

(2017年11月24日～2018年5月31日)



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。

※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額とは異なります。(設定日:2017年11月24日)

※設定時から10年以上経過した場合は、直近10年分を記載しています。

分配の推移

初回決算が2018年10月12日のため
基準日現在分配実績はありません。

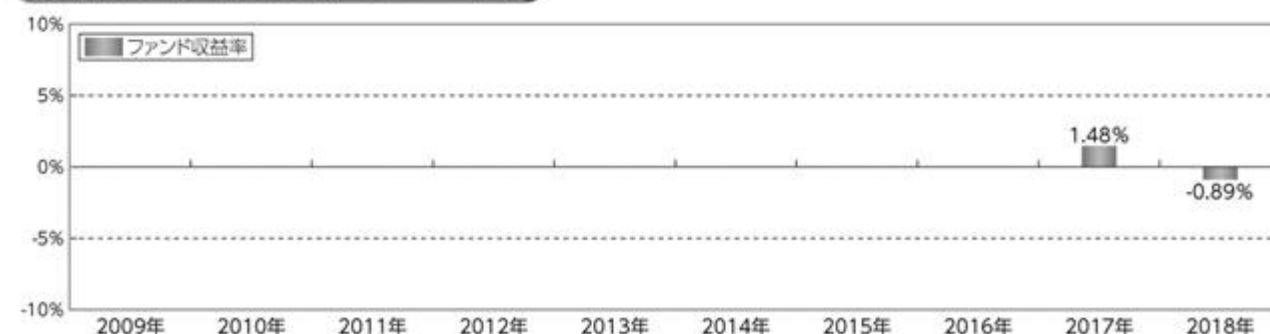
主要な資産の状況

■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 | 30.77% |
| 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 | 15.01% |
| 3 | J-REITインデックスファンド・マザーファンド | 13.00% |
| 4 | 外国リート/パッシブ・ファンド・マザーファンド | 12.10% |
| 5 | 国内債券/パッシブ・ファンド・マザーファンド | 11.53% |
| 6 | 国内株式/パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド | 10.94% |
| 7 | エマージング株式/パッシブ・マザーファンド | 3.91% |
| 8 | 外国債券/パッシブ・ファンド・マザーファンド | 1.99% |

※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2018年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

※当ファンドにはベンチマークはありません。

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

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

たわらノーロード スマートグローバルバランス(積極型)

基準価額・純資産の推移

(2017年11月24日～2018年5月31日)



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。
 ※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額とは異なります。(設定日:2017年11月24日)
 ※設定時から10年以上経過した場合は、直近10年分を記載しています。

分配の推移

初回決算が2018年10月12日のため
 基準日現在分配実績はありません。

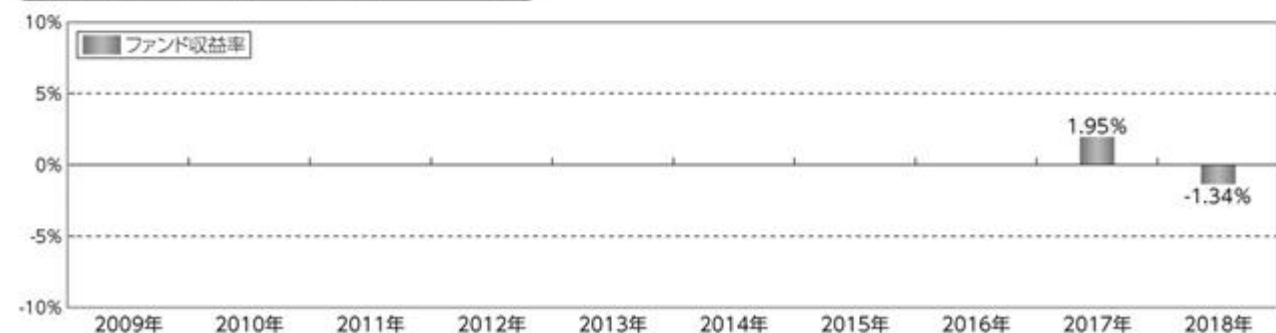
主要な資産の状況

■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 | 39.75% |
| 2 | 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド | 16.15% |
| 3 | 国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド | 14.93% |
| 4 | J-REITインデックスファンド・マザーファンド | 14.02% |
| 5 | 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 | 7.01% |
| 6 | エマージング株式パッシブ・マザーファンド | 4.89% |
| 7 | 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド | 2.51% |

※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2018年については年初から基準日までの収益率を表示しています。
 ※当ファンドにはベンチマークはありません。

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

データの基準日:2018年5月31日

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 | 3.28% |
| 2 | 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 株式 | 日本 | 銀行業 | 1.77% |
| 3 | 日本電信電話 | 株式 | 日本 | 情報・通信業 | 1.40% |
| 4 | ソニー | 株式 | 日本 | 電気機器 | 1.35% |
| 5 | ソフトバンクグループ | 株式 | 日本 | 情報・通信業 | 1.35% |

■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 | 124回 利付国庫債券(5年) | 国債証券 | 日本 | 0.100000 | 2020/6/20 | 1.16% |
| 2 | 122回 利付国庫債券(5年) | 国債証券 | 日本 | 0.100000 | 2019/12/20 | 1.16% |
| 3 | 118回 利付国庫債券(5年) | 国債証券 | 日本 | 0.200000 | 2019/6/20 | 1.07% |
| 4 | 344回 利付国庫債券(10年) | 国債証券 | 日本 | 0.100000 | 2026/9/20 | 1.02% |
| 5 | 345回 利付国庫債券(10年) | 国債証券 | 日本 | 0.100000 | 2026/12/20 | 1.02% |

■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 | 1.92% |
| 3 | AMAZON.COM INC | 株式 | アメリカ | インターネット販売・通信販売 | 1.77% |
| 4 | FACEBOOK INC | 株式 | アメリカ | インターネットソフトウェア・サービス | 1.19% |
| 5 | JPMORGAN CHASE & CO | 株式 | アメリカ | 銀行 | 1.00% |

■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 | 0.84% |
| 2 | US T N/B 3.625 02/15/20 | 国債証券 | アメリカ | 3.625000 | 2020/2/15 | 0.80% |
| 3 | US T N/B 2.0 02/15/22 | 国債証券 | アメリカ | 2.000000 | 2022/2/15 | 0.77% |
| 4 | US T N/B 1.25 10/31/19 | 国債証券 | アメリカ | 1.250000 | 2019/10/31 | 0.75% |
| 5 | US T N/B 0.875 07/31/19 | 国債証券 | アメリカ | 0.875000 | 2019/7/31 | 0.75% |

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

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

■為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

| 順位 | 銘柄名 | 種類 | 国/地域 | 利率(%) | 償還期限 | 比率 |
|----|-------------------------|------|------|----------|-----------|-------|
| 1 | US T N/B 0.875 09/15/19 | 国債証券 | アメリカ | 0.875000 | 2019/9/15 | 0.78% |
| 2 | US T N/B 1.375 05/31/20 | 国債証券 | アメリカ | 1.375000 | 2020/5/31 | 0.74% |
| 3 | US T N/B 3.625 02/15/20 | 国債証券 | アメリカ | 3.625000 | 2020/2/15 | 0.70% |
| 4 | US T N/B 1.75 05/31/22 | 国債証券 | アメリカ | 1.750000 | 2022/5/31 | 0.68% |
| 5 | US T N/B 2.125 08/31/20 | 国債証券 | アメリカ | 2.125000 | 2020/8/31 | 0.60% |

■エマージング株式パッシブ・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

| 順位 | 銘柄名 | 種類 | 国/地域 | 業種 | 比率 |
|----|-------------------------------|----|--------|--------------------|-------|
| 1 | TENCENT HOLDINGS LTD | 株式 | ケイマン諸島 | インターネットソフトウェア・サービス | 5.04% |
| 2 | ALIBABA GROUP HOLDING LTD-ADR | 株式 | ケイマン諸島 | インターネットソフトウェア・サービス | 4.03% |
| 3 | SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD | 株式 | 韓国 | コンピュータ・周辺機器 | 3.94% |
| 4 | TAIWAN SEMICONDUCTOR | 株式 | 台湾 | 半導体・半導体製造装置 | 3.19% |
| 5 | NASPERS LTD | 株式 | 南アフリカ | メディア | 1.85% |

■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 | 7.10% |
| 2 | ジャパンリアルエステイト投資法人 | 投資証券 | 日本 | 6.83% |
| 3 | 野村不動産マスターファンド投資法人 | 投資証券 | 日本 | 5.42% |
| 4 | 日本リテールファンド投資法人 | 投資証券 | 日本 | 4.48% |
| 5 | ユナイテッド・アーバン投資法人 | 投資証券 | 日本 | 4.42% |

■外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

| 順位 | 銘柄名 | 種類 | 国/地域 | 比率 |
|----|--------------------------|------|------|-------|
| 1 | SIMON PROPERTY GROUP INC | 投資証券 | アメリカ | 4.46% |
| 2 | PROLOGIS INC | 投資証券 | アメリカ | 3.06% |
| 3 | PUBLIC STORAGE | 投資証券 | アメリカ | 2.82% |
| 4 | UNIBAIL-RODAMCO SE | 投資証券 | フランス | 2.66% |
| 5 | EQUITY RESIDENTIAL | 投資証券 | アメリカ | 2.08% |

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

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

第3【ファンドの経理状況】

原届出書の「第二部 ファンド情報 第3 ファンドの経理状況」につきましては、以下の内容に更新・訂正いたします。

<更新・訂正後>

たわらノーロード スマートグローバルバランス(保守型)

(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29年11月24日から平成30年5月23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。

1【財務諸表】

【たわらノーロード スマートグローバルバランス(保守型)】

(1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

| | | 第1期中間計算期間末 平成30年5月23日現在 |
|-----------------|---|----------------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| コール・ローン | | 41,572 |
| 親投資信託受益証券 | | 4,014,356 |
| 派生商品評価勘定 | | 457 |
| 流動資産合計 | | 4,056,385 |
| 資産合計 | | 4,056,385 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 派生商品評価勘定 | | 2,329 |
| 未払受託者報酬 | | 364 |
| 未払委託者報酬 | | 4,510 |
| 流動負債合計 | | 7,203 |
| 負債合計 | | 7,203 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | | 1 4,066,592 |
| 剰余金 | | |
| 中間剰余金又は中間欠損金() | 2 | 17,410 |
| (分配準備積立金) | | - |
| 元本等合計 | | 4,049,182 |
| 純資産合計 | | 4,049,182 |
| 負債純資産合計 | | 4,056,385 |

(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24日 至 平成30年5月23日 |
|---|--|
| 営業収益 | |
| 有価証券売買等損益 | 5,356 |
| 為替差損益 | 3,304 |
| 営業収益合計 | 2,052 |
| 営業費用 | |
| 支払利息 | 4 |
| 受託者報酬 | 364 |
| 委託者報酬 | 4,510 |
| 営業費用合計 | 4,878 |
| 営業利益又は営業損失() | 2,826 |
| 経常利益又は経常損失() | 2,826 |
| 中間純利益又は中間純損失() | 2,826 |
| 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() | - |
| 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 | - |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | 14,584 |
| 中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | 14,584 |
| 分配金 | - |
| 中間剰余金又は中間欠損金() | 17,410 |

(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期中間計算期間末 平成30年5月23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 3,066,592円 - 円 |
| 2. 受益権の総数 | 4,066,592口 |
| 3. 2 元本の欠損 | 中間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17,410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期中間計算期間末 平成30年5月23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。 |
| 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)は短時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)

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期中間計算期間末 平成30年5月23日現在 | | | | |
|------------|----------------------------|-----|---------|-----------|-------------|
| | 契約額等 (円) | うち | | 時価 (円) | 評価損益 (円) |
| | | 1年超 | | | |
| 市場取引以外の取引 | | | | | |
| 為替予約取引 | | | | | |
| 売 建 | 192,133 | - | 194,005 | 1,872 | |
| アメリカ・ドル | 131,453 | - | 133,477 | 2,024 | |
| イギリス・ポンド | 14,591 | - | 14,438 | 153 | |
| オーストラリア・ドル | 5,341 | - | 5,452 | 111 | |
| カナダ・ドル | 7,485 | - | 7,604 | 119 | |
| スイス・フラン | 6,180 | - | 6,255 | 75 | |
| ユーロ | 27,083 | - | 26,779 | 304 | |
| 合計 | 192,133 | - | 194,005 | 1,872 | |

（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期中間計算期間末 平成30年5月23日現在 |
|---------------------------|----------------------------|
| 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) | 0.9957円 (9,957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)

(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29年11月24日から平成30年5月23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 スマートグローバルバランス(安定型)】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位:円)

| | | 第1期中間計算期間末 平成30年5月23日現在 |
|-----------------|--|----------------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| コール・ローン | | 1,814,216 |
| 親投資信託受益証券 | | 138,957,288 |
| 派生商品評価勘定 | | 43,525 |
| 流動資産合計 | | 140,815,029 |
| 資産合計 | | 140,815,029 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 派生商品評価勘定 | | 242,480 |
| 未払解約金 | | 5,012 |
| 未払受託者報酬 | | 8,270 |
| 未払委託者報酬 | | 95,494 |
| その他未払費用 | | 773 |
| 流動負債合計 | | 352,029 |
| 負債合計 | | 352,029 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | | 139,718,621 |
| 剰余金 | | |
| 中間剰余金又は中間欠損金() | | 744,379 |
| (分配準備積立金) | | - |
| 元本等合計 | | 140,463,000 |
| 純資産合計 | | 140,463,000 |
| 負債純資産合計 | | 140,815,029 |

（ 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24日 至 平成30年5月23日 |
|---|--|
| 営業収益 | |
| 有価証券売買等損益 | 1,578,288 |
| 為替差損益 | 509,554 |
| 営業収益合計 | 1,068,734 |
| 営業費用 | |
| 支払利息 | 115 |
| 受託者報酬 | 8,270 |
| 委託者報酬 | 95,494 |
| その他費用 | 773 |
| 営業費用合計 | 104,652 |
| 営業利益又は営業損失（ ） | 964,082 |
| 経常利益又は経常損失（ ） | 964,082 |
| 中間純利益又は中間純損失（ ） | 964,082 |
| 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（ ） | 4,071 |
| 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 | 413 |
| 中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | 413 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | 224,187 |
| 中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | 224,187 |
| 分配金 | - |
| 中間剰余金又は中間欠損金（ ） | 744,379 |

(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期中間計算期間末 平成30年5月23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 141,871,383円 3,152,762円 |
| 2. 受益権の総数 | 139,718,621口 |

(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期中間計算期間末 平成30年5月23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。 |
| 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)は短時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)

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期中間計算期間末 平成30年5月23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 | 19,995,102 | - | 20,194,057 | 198,955 |
| アメリカ・ドル | 13,156,812 | - | 13,358,862 | 202,050 |
| イギリス・ポンド | 1,457,355 | - | 1,443,845 | 13,510 |
| イスラエル・シケル | 18,208 | - | 18,666 | 458 |
| オーストラリア・ドル | 542,584 | - | 553,674 | 11,090 |
| カナダ・ドル | 748,867 | - | 760,408 | 11,541 |
| シンガポール・ドル | 107,001 | - | 107,549 | 548 |
| スイス・フラン | 617,682 | - | 625,520 | 7,838 |
| スウェーデン・クローナ | 195,023 | - | 199,212 | 4,189 |
| デンマーク・クローネ | 129,474 | - | 128,042 | 1,432 |
| ニュージーランド・ドル | 15,350 | - | 15,366 | 16 |
| ノルウェー・クローネ | 51,776 | - | 52,250 | 474 |
| ユーロ | 2,705,973 | - | 2,677,915 | 28,058 |
| 香港・ドル | 248,997 | - | 252,748 | 3,751 |
| 合計 | 19,995,102 | - | 20,194,057 | 198,955 |

(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期中間計算期間末 平成30年5月23日現在 |
|--------------|----------------------------|
| 1口当たり純資産額 | 1.0053円 |
| (1万口当たり純資産額) | (10,053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)

(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29年11月24日から平成30年5月23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 スマートグローバルバランス(安定成長型)】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位:円)

| | | 第1期中間計算期間末 平成30年5月23日現在 |
|-----------------|--|----------------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| コール・ローン | | 1,171,321 |
| 親投資信託受益証券 | | 189,360,070 |
| 派生商品評価勘定 | | 59,741 |
| 流動資産合計 | | 190,591,132 |
| 資産合計 | | 190,591,132 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 派生商品評価勘定 | | 355,166 |
| 未払解約金 | | 105,853 |
| 未払受託者報酬 | | 10,092 |
| 未払委託者報酬 | | 116,340 |
| その他未払費用 | | 950 |
| 流動負債合計 | | 588,401 |
| 負債合計 | | 588,401 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | | 188,198,605 |
| 剰余金 | | |
| 中間剰余金又は中間欠損金() | | 1,804,126 |
| (分配準備積立金) | | - |
| 元本等合計 | | 190,002,731 |
| 純資産合計 | | 190,002,731 |
| 負債純資産合計 | | 190,591,132 |

(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24日 至 平成30年5月23日 |
|---|--|
| 営業収益 | |
| 有価証券売買等損益 | 3,161,070 |
| 為替差損益 | 619,920 |
| 営業収益合計 | 2,541,150 |
| 営業費用 | |
| 支払利息 | 138 |
| 受託者報酬 | 10,092 |
| 委託者報酬 | 116,340 |
| その他費用 | 950 |
| 営業費用合計 | 127,520 |
| 営業利益又は営業損失() | 2,413,630 |
| 経常利益又は経常損失() | 2,413,630 |
| 中間純利益又は中間純損失() | 2,413,630 |
| 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() | 12,092 |
| 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 | 8,043 |
| 中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | 8,043 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | 605,455 |
| 中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | 605,455 |
| 分配金 | - |
| 中間剰余金又は中間欠損金() | 1,804,126 |

(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期中間計算期間末 平成30年5月23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 189,082,230円 1,883,625円 |
| 2. 受益権の総数 | 188,198,605口 |

(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期中間計算期間末 平成30年5月23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。 |
| 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)は短時間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p> |
| 3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、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)

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期中間計算期間末 平成30年5月23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 | 31,736,574 | - | 32,031,999 | 295,425 |
| アメリカ・ドル | 21,067,043 | - | 21,356,456 | 289,413 |
| イギリス・ポンド | 2,324,172 | - | 2,307,175 | 16,997 |
| イスラエル・シケル | 24,278 | - | 24,888 | 610 |
| オーストラリア・ドル | 863,660 | - | 880,845 | 17,185 |
| カナダ・ドル | 1,201,058 | - | 1,218,381 | 17,323 |
| シンガポール・ドル | 131,694 | - | 132,368 | 674 |
| スイス・フラン | 992,153 | - | 1,005,300 | 13,147 |
| スウェーデン・クローナ | 248,779 | - | 254,123 | 5,344 |
| デンマーク・クローネ | 164,947 | - | 163,122 | 1,825 |
| ニュージーランド・ドル | 15,350 | - | 15,366 | 16 |
| ノルウェー・クローネ | 66,764 | - | 67,375 | 611 |
| ユーロ | 4,319,517 | - | 4,284,664 | 34,853 |
| 香港・ドル | 317,159 | - | 321,936 | 4,777 |
| 合計 | 31,736,574 | - | 32,031,999 | 295,425 |

(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期中間計算期間末 平成30年5月23日現在 |
|--------------|----------------------------|
| 1口当たり純資産額 | 1.0096円 |
| (1万口当たり純資産額) | (10,096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)

(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29年11月24日から平成30年5月23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 スマートグローバルバランス(成長型)】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位:円)

| | | 第1期中間計算期間末 平成30年5月23日現在 |
|-----------------|--|----------------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| コール・ローン | | 1,606,247 |
| 親投資信託受益証券 | | 84,735,218 |
| 派生商品評価勘定 | | 35,971 |
| 流動資産合計 | | 86,377,436 |
| 資産合計 | | 86,377,436 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 派生商品評価勘定 | | 180,949 |
| 未払解約金 | | 767,366 |
| 未払受託者報酬 | | 5,919 |
| 未払委託者報酬 | | 68,591 |
| その他未払費用 | | 531 |
| 流動負債合計 | | 1,023,356 |
| 負債合計 | | 1,023,356 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | | 184,006,481 |
| 剰余金 | | |
| 中間剰余金又は中間欠損金() | | 1,347,599 |
| (分配準備積立金) | | - |
| 元本等合計 | | 85,354,080 |
| 純資産合計 | | 85,354,080 |
| 負債純資産合計 | | 86,377,436 |

(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24日 至 平成30年5月23日 |
|---|--|
| 営業収益 | |
| 有価証券売買等損益 | 2,419,218 |
| 為替差損益 | 362,777 |
| 営業収益合計 | 2,056,441 |
| 営業費用 | |
| 支払利息 | 85 |
| 受託者報酬 | 5,919 |
| 委託者報酬 | 68,591 |
| その他費用 | 531 |
| 営業費用合計 | 75,126 |
| 営業利益又は営業損失() | 1,981,315 |
| 経常利益又は経常損失() | 1,981,315 |
| 中間純利益又は中間純損失() | 1,981,315 |
| 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() | 7,508 |
| 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 | - |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | 641,224 |
| 中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | 3,812 |
| 中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | 637,412 |
| 分配金 | - |
| 中間剰余金又は中間欠損金() | 1,347,599 |

(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期中間計算期間末 平成30年5月23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 89,649,960円 6,643,479円 |
| 2. 受益権の総数 | 84,006,481口 |

(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期中間計算期間末 平成30年5月23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。 |
| 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)は短時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)

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期中間計算期間末 平成30年5月23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 | 15,697,436 | - | 15,842,414 | 144,978 |
| アメリカ・ドル | 10,317,625 | - | 10,467,765 | 150,140 |
| イギリス・ポンド | 1,143,015 | - | 1,131,260 | 11,755 |
| イスラエル・シケル | 15,174 | - | 15,555 | 381 |
| オーストラリア・ドル | 427,748 | - | 436,228 | 8,480 |
| カナダ・ドル | 587,501 | - | 596,229 | 8,728 |
| シンガポール・ドル | 82,309 | - | 82,730 | 421 |
| スイス・フラン | 485,696 | - | 491,480 | 5,784 |
| スウェーデン・クローナ | 157,518 | - | 160,902 | 3,384 |
| デンマーク・クローネ | 104,644 | - | 103,486 | 1,158 |
| ニュージーランド・ドル | 7,675 | - | 7,683 | 8 |
| ノルウェー・クローネ | 42,239 | - | 42,625 | 386 |
| ユーロ | 2,125,981 | - | 2,103,143 | 22,838 |
| 香港・ドル | 200,311 | - | 203,328 | 3,017 |
| 合計 | 15,697,436 | - | 15,842,414 | 144,978 |

(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期中間計算期間末 平成30年5月23日現在 |
|--------------|----------------------------|
| 1口当たり純資産額 | 1.0160円 |
| (1万口当たり純資産額) | (10,160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)

(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29年11月24日から平成30年5月23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 スマートグローバルバランス(積極型)】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位:円)

| | | 第1期中間計算期間末 平成30年5月23日現在 |
|-----------------|--|----------------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| コール・ローン | | 1,833,646 |
| 親投資信託受益証券 | | 184,283,615 |
| 派生商品評価勘定 | | 73,445 |
| 流動資産合計 | | 186,190,706 |
| 資産合計 | | 186,190,706 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 派生商品評価勘定 | | 427,782 |
| 未払受託者報酬 | | 10,660 |
| 未払委託者報酬 | | 123,146 |
| その他未払費用 | | 1,006 |
| 流動負債合計 | | 562,594 |
| 負債合計 | | 562,594 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | | 181,944,187 |
| 剰余金 | | |
| 中間剰余金又は中間欠損金() | | 3,683,925 |
| (分配準備積立金) | | - |
| 元本等合計 | | 185,628,112 |
| 純資産合計 | | 185,628,112 |
| 負債純資産合計 | | 186,190,706 |

(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24日 至 平成30年5月23日 |
|---|--|
| 営業収益 | |
| 有価証券売買等損益 | 5,815,615 |
| 為替差損益 | 758,027 |
| 営業収益合計 | 5,057,588 |
| 営業費用 | |
| 支払利息 | 240 |
| 受託者報酬 | 10,660 |
| 委託者報酬 | 123,146 |
| その他費用 | 1,006 |
| 営業費用合計 | 135,052 |
| 営業利益又は営業損失() | 4,922,536 |
| 経常利益又は経常損失() | 4,922,536 |
| 中間純利益又は中間純損失() | 4,922,536 |
| 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() | 26,825 |
| 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 | 135,781 |
| 中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | 135,781 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | 1,347,567 |
| 中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | 1,347,567 |
| 分配金 | - |
| 中間剰余金又は中間欠損金() | 3,683,925 |

(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期中間計算期間末 平成30年5月23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 196,589,688円 15,645,501円 |
| 2. 受益権の総数 | 181,944,187口 |

(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期中間計算期間末 平成30年5月23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。 |
| 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)は短時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)

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期中間計算期間末 平成30年5月23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 | 37,164,269 | - | 37,518,606 | 354,337 |
| アメリカ・ドル | 24,602,761 | - | 24,956,481 | 353,720 |
| イギリス・ポンド | 2,715,939 | - | 2,694,185 | 21,754 |
| イスラエル・シケル | 30,348 | - | 31,110 | 762 |
| オーストラリア・ドル | 1,011,880 | - | 1,031,847 | 19,967 |
| カナダ・ドル | 1,396,750 | - | 1,417,124 | 20,374 |
| シンガポール・ドル | 164,618 | - | 165,460 | 842 |
| スイス・フラン | 1,157,857 | - | 1,172,850 | 14,993 |
| スウェーデン・クローナ | 316,287 | - | 323,081 | 6,794 |
| デンマーク・クローネ | 209,288 | - | 206,972 | 2,316 |
| ニュージーランド・ドル | 23,026 | - | 23,049 | 23 |
| ノルウェー・クローネ | 84,478 | - | 85,250 | 772 |
| ユーロ | 5,049,024 | - | 5,003,129 | 45,895 |
| 香港・ドル | 402,013 | - | 408,068 | 6,055 |
| 合計 | 37,164,269 | - | 37,518,606 | 354,337 |

(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期中間計算期間末 平成30年5月23日現在 |
|--------------|----------------------------|
| 1口当たり純資産額 | 1.0202円 |
| (1万口当たり純資産額) | (10,202円) |

(参考)

「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)」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」受益証券及び「エマージング株式パッシブ・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、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5月23日現在 |
|-------------|----------|-----------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| コール・ローン | | 3,168,112,677 |
| 株式 | 2 | 301,703,639,750 |
| 派生商品評価勘定 | | 167,503,632 |
| 未収入金 | | 2,818,056 |
| 未収配当金 | | 2,777,959,649 |
| 流動資産合計 | | 307,820,033,764 |
| 資産合計 | | 307,820,033,764 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 派生商品評価勘定 | | 1,493,748 |
| 前受金 | | 200,220,000 |
| 未払解約金 | | 263,562,000 |
| 流動負債合計 | | 465,275,748 |
| 負債合計 | | 465,275,748 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 1 | 112,061,211,395 |
| 剰余金 | | |
| 剰余金又は欠損金() | | 195,293,546,621 |
| 元本等合計 | | 307,354,758,016 |
| 純資産合計 | | 307,354,758,016 |
| 負債純資産合計 | | 307,820,033,764 |

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5月23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 | 115,574,846,169円 13,563,368,733円 17,077,003,507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 | 9,654,259,709円 |
| DIAM国内株式パッシブ・ファンド | 1,963,036,161円 |
| MITO ラップ型ファンド（安定型） | 3,750,010円 |
| MITO ラップ型ファンド（中立型） | 8,909,366円 |
| MITO ラップ型ファンド（積極型） | 14,856,290円 |
| グローバル8資産ラップファンド（安定型） | 23,425,761円 |
| グローバル8資産ラップファンド（中立型） | 18,934,862円 |
| グローバル8資産ラップファンド（積極型） | 15,457,902円 |
| たわらノーロード TOPIX | 191,907,275円 |
| たわらノーロード バランス（8資産均等型） | 25,103,034円 |
| たわらノーロード バランス（堅実型） | 560,524円 |
| たわらノーロード バランス（標準型） | 3,796,905円 |

| | |
|---------------------------------------|-----------------|
| たわらノーロード バランス (積極型) | 10,876,196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) | 59,371円 |
| たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(安定型) | 2,578,567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) | 5,549,249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) | 3,404,851円 |
| たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(積極型) | 10,047,579円 |
| たわらノーロード 最適化バラ ンス(保守型) | 41,655円 |
| たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定型) | 60,306円 |
| たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定成長型) | 415,112円 |
| たわらノーロード 最適化バラ ンス(成長型) | 457,683円 |
| たわらノーロード 最適化バラ ンス(積極型) | 1,308,663円 |
| D I A M国内株式インデックス ファンド< D C年金> | 37,191,646,035円 |
| D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 1 安定型 | 779,271,405円 |
| D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 2 安定・成長型 | 2,740,562,009円 |
| D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 3 成長型 | 2,855,337,256円 |
| D I A M D C バランス3 0 インデックスファンド | 331,567,760円 |
| D I A M D C バランス5 0 インデックスファンド | 1,120,759,542円 |
| D I A M D C バランス7 0 インデックスファンド | 1,056,423,948円 |
| マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型> | 42,726,996円 |
| マネックス資産設計ファンド< 育成型> | 1,084,829,283円 |
| マネックス資産設計ファンド エボリューション | 25,558,900円 |
| D I A M D C 8資産バラ ンスファンド(新興国1 0) | 41,112,674円 |
| D I A M D C 8資産バラ ンスファンド(新興国2 0) | 107,171,507円 |
| D I A M D C 8資産バラ ンスファンド(新興国3 0) | 209,605,437円 |
| 投資のソムリエ | 2,487,274,484円 |
| クルーズコントロール | 1,625,592,720円 |
| 投資のソムリエ< D C年金> | 180,556,941円 |

| | |
|--|----------------|
| D I A M 8資産バランスファン ドN<DC年金> | 166,392,070円 |
| D I A M DC バランス・F (成長型) | 220,096,858円 |
| クルーズコントロール<DC年 金> | 652,797円 |
| D I A Mコア資産設計ファンド (堅実型) | 9,095,185円 |
| D I A Mコア資産設計ファンド (積極型) | 27,016,811円 |
| 投資のソムリエ<DC年金>リ スク抑制型 | 34,252,346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 | 1,941,778円 |
| 投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2045) | 618,840,924円 |
| 投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2055) | 769,577円 |
| リスク抑制世界8資産バランス ファンド(DC) | 533,560円 |
| 投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2035) | 164,969円 |
| 4資産分散投資・スタンダード <DC年金> | 1,340,007円 |
| D I A Mワールドバランス25 VA(適格機関投資家限定) | 4,992,877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) | 70,249,658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) | 126,385,709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) | 288,874,363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) | 15,997,852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) | 70,553,486円 |
| D I A M国内重視バランスファ ンド50VA(適格機関投資家 限定) | 17,154,020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) | 19,390,655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) | 30,249,893円 |
| D I A Mバランスファンド25 VA(適格機関投資家限定) | 54,216,690円 |
| D I A Mバランスファンド25 VA(適格機関投資家限定) | 1,043,808,777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) | 986,397,112円 |
| D I A Mバランスファンド50 V A (適格機関投資家限定) | 2,724,085,314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) | 194,921,068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) | 74,215,178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) | 571,083,407円 |
| D I A M世界アセットバランス ファンドV A (適格機関投資家 向け) | 1,056,807,183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 55 V A (適格機関投資家限 定) | 13,110,510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) | 401,585,024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) | 14,925,401,619円 |
| D I A M世界アセットバランス ファンド40 V A (適格機関投 資家限定) | 536,692,414円 |
| D I A M世界アセットバランス ファンド25 V A (適格機関投 資家限定) | 1,701,787,388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) | 9,799,167,963円 |
| D I A Mバランス30 V A (適 格機関投資家限定) | 4,723,516円 |
| D I A Mバランス50 V A (適 格機関投資家限定) | 386,824円 |
| D I A Mバランス70 V A (適 格機関投資家限定) | 3,682,782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) | 8,722,844,605円 |
| D I A M世界バランス25 V A (適格機関投資家限定) | 69,277,473円 |
| D I A M国内バランス30 V A (適格機関投資家限定) | 27,636,505円 |
| D I A Mバランス20 V A (適 格機関投資家限定) | 25,211,890円 |

| | | |
|----|---|-------------------|
| | D I A Mバランス40VA(適格機関投資家限定) | 97,482円 |
| | D I A Mバランス60VA(適格機関投資家限定) | 110,015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) | 426,902,115円 |
| | D I A M世界アセットバランスファンド7VA(1303)(適格機関投資家限定) | 1,311,785,878円 |
| | D I A M世界アセットバランスファンド7VA(1306)(適格機関投資家限定) | 1,737,262,933円 |
| | D I A M世界アセットバランスファンド7VA(1309)(適格機関投資家限定) | 73,956,736円 |
| | 計 | 112,061,211,395円 |
| 2. | 受益権の総数 | 112,061,211,395口 |
| 3. | 2 差入代用有価証券 | 株式 3,717,500,000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5月23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 | <p>(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p> |
| 3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、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）

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5月23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 | | | | | |
| 先物取引 | | | | | |
| 買 建 | 5,398,980,000 | - | | 5,565,090,000 | 166,110,000 |
| 合計 | 5,398,980,000 | - | | 5,565,090,000 | 166,110,000 |

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(1口当たり情報に関する注記)

| | 平成30年5月23日現在 |
|--------------|--------------|
| 1口当たり純資産額 | 2,7427円 |
| (1万口当たり純資産額) | (27,427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5月23日現在 |
|-------------|----------|-----------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| コール・ローン | | 2,114,359,472 |
| 国債証券 | | 290,437,815,000 |
| 地方債証券 | | 22,653,034,744 |
| 特殊債券 | | 15,515,360,716 |
| 社債券 | | 16,021,409,000 |
| 未収利息 | | 903,143,338 |
| 前払費用 | | 24,892,827 |
| 流動資産合計 | | 347,670,015,097 |
| 資産合計 | | 347,670,015,097 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払解約金 | | 251,412,000 |
| 流動負債合計 | | 251,412,000 |
| 負債合計 | | 251,412,000 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 1 | 269,363,641,662 |
| 剰余金 | | |
| 剰余金又は欠損金() | | 78,054,961,435 |
| 元本等合計 | | 347,418,603,097 |
| 純資産合計 | | 347,418,603,097 |
| 負債純資産合計 | | 347,670,015,097 |

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5月23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 | 279,914,708,344円 27,802,010,280円 38,353,076,962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 | 15,607,146,108円 |
| M I T O ラップ型ファンド（安定型） | 121,669,165円 |
| M I T O ラップ型ファンド（中立型） | 102,006,320円 |
| M I T O ラップ型ファンド（積極型） | 30,039,882円 |
| グローバル8資産ラップファンド（安定型） | 744,968,024円 |
| グローバル8資産ラップファンド（中立型） | 216,723,104円 |
| グローバル8資産ラップファンド（積極型） | 31,255,797円 |
| たわらノーロード 国内債券 | 3,702,289,346円 |
| たわらノーロード バランス（8資産均等型） | 51,666,584円 |
| たわらノーロード バランス（堅実型） | 10,701,237円 |
| たわらノーロード バランス（標準型） | 19,245,374円 |
| たわらノーロード バランス（積極型） | 4,497,134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） | 1,679,743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） | 33,094,191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） | 29,915,591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） | 7,488,963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) | 3,522,495円 |
| たわらノーロード 最適化バラ ンス(保守型) | 1,026,719円 |
| たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定型) | 584,255円 |
| たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定成長型) | 1,794,956円 |
| たわらノーロード 最適化バラ ンス(成長型) | 584,724円 |
| たわらノーロード 最適化バラ ンス(積極型) | 80,988円 |
| D I A M国内債券インデックス ファンド<DC年金> | 12,581,475,840円 |
| D I A Mバランス・ファンド< DC年金>1 安定型 | 5,629,647,144円 |
| D I A Mバランス・ファンド< DC年金>2 安定・成長型 | 8,163,859,625円 |
| D I A Mバランス・ファンド< DC年金>3 成長型 | 3,309,068,291円 |
| D I A M DC バランス30 インデックスファンド | 1,813,504,614円 |
| D I A M DC バランス50 インデックスファンド | 1,996,859,658円 |
| D I A M DC バランス70 インデックスファンド | 306,027,282円 |
| マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型> | 91,445,749円 |
| マネックス資産設計ファンド< 育成型> | 2,325,174,416円 |
| マネックス資産設計ファンド エボリューション | 4,808,536円 |
| D I A M DC 8資産バラ ンスファンド(新興国10) | 499,311,663円 |
| D I A M DC 8資産バラ ンスファンド(新興国20) | 469,614,228円 |
| D I A M DC 8資産バラ ンスファンド(新興国30) | 111,155,496円 |
| 投資のソムリエ | 3,656,031,803円 |
| クルーズコントロール | 3,311,213,200円 |
| 投資のソムリエ<DC年金> | 268,031,454円 |
| D I A M 8資産バランスファ ンドN<DC年金> | 1,980,355,404円 |
| D I A M DC バランス・F (成長型) | 257,000,151円 |
| クルーズコントロール<DC年 金> | 1,329,409円 |
| D I A Mコア資産設計ファンド (堅実型) | 7,395,428円 |
| D I A Mコア資産設計ファンド (積極型) | 22,017,403円 |
| 投資のソムリエ<DC年金>リ スク抑制型 | 176,425,685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 | 1,755,737円 3,304,020,060円 |
| 投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2045) | 681,903円 |
| 投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2055) | 456,439円 |
| リスク抑制世界8資産バランス ファンド(DC) | 855,190円 |
| 投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2035) | 1,191,102円 |
| 4資産分散投資・スタンダード <DC年金> | 27,913,106円 |
| DIAM高金利通貨ファンド | 9,608,918円 |
| DIAMエマージング債券ファ ンド | 9,450,010円 |
| DIAM国内債券バッシブファ ンド(適格機関投資家向け) | 22,723,091,558円 |
| DIAMワールドバランス25 VA(適格機関投資家限定) | 485,649,448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) | 319,010,134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) | 242,876,677円 |
| DIAM国際分散バランスファ ンド30VA(適格機関投資家 限定) | 78,509,133円 |
| DIAM国際分散バランスファ ンド50VA(適格機関投資家 限定) | 222,528,168円 |
| DIAM国内重視バランスファ ンド30VA(適格機関投資家 限定) | 90,211,759円 |
| DIAM国内重視バランスファ ンド50VA(適格機関投資家 限定) | 54,372,232円 |
| DIAM世界バランスファンド 40VA(適格機関投資家限 定) | 95,409,492円 |
| DIAM世界バランスファンド 50VA(適格機関投資家限 定) | 170,999,081円 |
| DIAMバランスファンド25 VA(適格機関投資家限定) | 5,856,549,014円 |
| DIAMバランスファンド3 7.5VA(適格機関投資家限 定) | 3,112,370,364円 |
| DIAMバランスファンド50 VA(適格機関投資家限定) | 5,729,224,798円 |

| | |
|--|------------------|
| D I A Mグローバル・アセ ト・バランスV A (適格機関投 資家限定) | 615,958,990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) | 389,712,534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) | 3,609,667,159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) | 2,222,324,140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) | 82,752,684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) | 690,841,222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) | 83,725,383,348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) | 1,128,744,330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) | 7,161,139,372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) | 27,481,298,417円 |
| D I A Mバランス30V A (適 格機関投資家限定) | 79,617,622円 |
| D I A Mバランス50V A (適 格機関投資家限定) | 2,035,295円 |
| D I A Mバランス70V A (適 格機関投資家限定) | 7,738,785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) | 30,584,145,451円 |
| D I A M世界バランス25V A (適格機関投資家限定) | 479,133,477円 |
| D I A M国内バランス30V A (適格機関投資家限定) | 135,640,228円 |
| D I A Mバランス20V A (適 格機関投資家限定) | 531,188,226円 |
| D I A Mバランス40V A (適 格機関投資家限定) | 715,639円 |
| D I A Mバランス60V A (適 格機関投資家限定) | 384,308円 |
| 計 | 269,363,641,662円 |

2. 受益権の総数

(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5月23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)

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5月23日現在 |
|--------------|--------------|
| 1口当たり純資産額 | 1,2898円 |
| (1万口当たり純資産額) | (12,898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5月23日現在 |
|-------------|----------|----------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| コール・ローン | | 1,144,494,840 |
| 投資証券 | | 34,783,080,785 |
| 派生商品評価勘定 | | 32,627,992 |
| 未収配当金 | | 134,022,703 |
| 差入委託証拠金 | | 10,492,092 |
| 流動資産合計 | | 36,104,718,412 |
| 資産合計 | | 36,104,718,412 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 前受金 | | 33,505,492 |
| 未払金 | | 526,570,875 |
| 未払解約金 | | 31,020,700 |
| 流動負債合計 | | 591,097,067 |
| 負債合計 | | 591,097,067 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 1 | 19,467,458,437 |
| 剰余金 | | |
| 剰余金又は欠損金() | | 16,046,162,908 |
| 元本等合計 | | 35,513,621,345 |
| 純資産合計 | | 35,513,621,345 |
| 負債純資産合計 | | 36,104,718,412 |

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5月23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 | 20,458,424,692円 |
| 同期中追加設定元本額 | 8,097,732,075円 |
| 同期中一部解約元本額 | 9,088,698,330円 |
| 元本の内訳 | |
| ファンド名 | |
| MITO ラップ型ファンド（安定型） | 329,588円 |
| MITO ラップ型ファンド（中立型） | 878,816円 |
| MITO ラップ型ファンド（積極型） | 2,224,282円 |
| グローバル8資産ラップファンド（安定型） | 1,990,694円 |
| グローバル8資産ラップファンド（中立型） | 2,801,841円 |
| グローバル8資産ラップファンド（積極型） | 2,563,110円 |
| たわらノーロード 国内リート | 1,236,628,092円 |
| たわらノーロード 国内リート<ラップ向け> | 342,663,843円 |
| たわらノーロード バランス（8資産均等型） | 38,184,519円 |
| たわらノーロード バランス（堅実型） | 425,962円 |
| たわらノーロード バランス（標準型） | 8,250,269円 |
| たわらノーロード バランス（積極型） | 16,591,552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) | 4,653,693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) | 10,431,771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) | 6,052,088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) | 14,103,312円 |
| たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定型) | 136,725円 |
| たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定成長型) | 832,551円 |
| たわらノーロード 最適化バラ ンス(成長型) | 786,980円 |
| たわらノーロード 最適化バラ ンス(積極型) | 2,199,855円 |
| マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型> | 14,493,488円 |
| マネックス資産設計ファンド< 育成型> | 368,359,319円 |
| マネックス資産設計ファンド エボリューション | 3,505,986円 |
| D I A M D C 8資産バラ ンスファンド(新興国10) | 18,332,448円 |
| D I A M D C 8資産バラ ンスファンド(新興国20) | 64,398,711円 |
| D I A M D C 8資産バラ ンスファンド(新興国30) | 142,281,069円 |
| 投資のソムリエ | 2,670,186,923円 |
| 投資のソムリエ<DC年金> | 193,635,682円 |
| D I A M 8資産バランスファ ンドN<DC年金> | 74,022,355円 |
| 投資のソムリエ<DC年金>リ スク抑制型 | 76,829,494円 |
| ダイナミック・ナビゲーション | 546,439円 |
| リスク抑制世界8資産バランス ファンド | 1,408,806,673円 |
| 投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2045) | 491,369円 |
| 投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2055) | 333,150円 |
| リスク抑制世界8資産バランス ファンド(DC) | 369,640円 |
| 投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2035) | 846,134円 |
| Jリートインデックスファンド (DC) | 7,471,959円 |
| D I A M J - R E I Tイン デックス私募ファンド2012 12(適格機関投資家限定) | 92,447,665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) | 835,107,361円 |
| DIAM J-REITイン デックスファンド(適格機関投 資家向け) | 9,665,715,853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) | 1,187,943,032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) | 934,201,774円 |
| 計 | 19,467,458,437円 |
| 2. 受益権の総数 | 19,467,458,437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5月23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 | <p>(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p> |
| 3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、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）

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5月23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 | 579,127,100 | - | 611,793,000 | 32,665,900 | |
| 合計 | 579,127,100 | - | 611,793,000 | 32,665,900 | |

(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ではありません。

(1口当たり情報に関する注記)

| | 平成30年5月23日現在 |
|--------------|--------------|
| 1口当たり純資産額 | 1,8243円 |
| (1万口当たり純資産額) | (18,243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5月23日現在 |
|-------------|----------|-----------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 預金 | | 4,284,976,268 |
| コール・ローン | | 582,068,955 |
| 株式 | | 299,269,463,609 |
| 投資信託受益証券 | | 860,438,255 |
| 投資証券 | | 6,245,321,608 |
| 派生商品評価勘定 | | 225,553,746 |
| 未収入金 | | 172,831,938 |
| 未収配当金 | | 693,486,471 |
| 差入委託証拠金 | | 2,368,772,590 |
| 流動資産合計 | | 314,702,913,440 |
| 資産合計 | | 314,702,913,440 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 派生商品評価勘定 | | 1,120,512 |
| 未払金 | | 96,100,090 |
| 未払解約金 | | 566,420,000 |
| 流動負債合計 | | 663,640,602 |
| 負債合計 | | 663,640,602 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 1 | 89,269,490,166 |
| 剰余金 | | |
| 剰余金又は欠損金（ ） | | 224,769,782,672 |
| 元本等合計 | | 314,039,272,838 |
| 純資産合計 | | 314,039,272,838 |
| 負債純資産合計 | | 314,702,913,440 |

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5月23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 | 87,596,863,898円 |
| | 同期中追加設定元本額 | 14,513,605,565円 |
| | 同期中一部解約元本額 | 12,840,979,297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 | 2,240,465,062円 |
| | M I T O ラップ型ファンド(安定型) | 2,606,179円 |
| | M I T O ラップ型ファンド(中立型) | 8,253,521円 |
| | M I T O ラップ型ファンド(積極型) | 15,610,811円 |
| | グローバル8資産ラップファンド(安定型) | 15,954,912円 |
| | グローバル8資産ラップファンド(中立型) | 17,780,776円 |
| | グローバル8資産ラップファンド(積極型) | 16,259,590円 |
| | たわらノーロード 先進国株式 | 6,602,416,729円 |
| | たわらノーロード 先進国株式<ラップ向け> | 424,449円 |
| | たわらノーロード 先進国株式<為替ヘッジあり> | 690,376,240円 |
| | たわらノーロード バランス(8資産均等型) | 19,783,522円 |
| | たわらノーロード バランス(堅実型) | 1,319,614円 |
| | たわらノーロード バランス(標準型) | 11,470,673円 |
| | たわらノーロード バランス(積極型) | 26,448,515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) | 56,458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) | 6,311,956円 |
| | たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定成長型) | 12,755,266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) | 7,588,270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) | 21,186,577円 |
| | たわらノーロード 最適化バランス(保守型) | 6,504円 |
| | たわらノーロード 最適化バランス(安定型) | 56,225円 |

| | |
|---|--------------------------|
| たわらノーロード 最適化バ ランス(安定成長型) | 405,064円 |
| たわらノーロード 最適化バ ランス(成長型) | 443,867円 |
| たわらノーロード 最適化バ ランス(積極型) | 1,475,525円 |
| D I A M外国株式インデックス ファンド< D C年金> | 38,240,980,025円 |
| D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 1 安定型 | 165,489,803円 |
| D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 2 安定・成長型 | 868,941,508円 |
| D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 3 成長型 | 1,079,012,893円 |
| D I A M D C バランス3 0 インデックスファンド | 131,919,721円 |
| D I A M D C バランス5 0 インデックスファンド | 384,231,018円 |
| D I A M D C バランス7 0 インデックスファンド | 336,764,927円 |
| マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型> | 31,471,673円 |
| マネックス資産設計ファンド< 育成型> | 799,032,499円 |
| マネックス資産設計ファンド エボリューション | 206,676,091円 |
| D I A M D C 8 資産バラン スファンド(新興国1 0) | 32,483,237円 |
| D I A M D C 8 資産バラン スファンド(新興国2 0) | 85,592,401円 |
| D I A M D C 8 資産バラン スファンド(新興国3 0) | 166,803,973円 |
| 投資のソムリエ | 572,789,502円 |
| クルーズコントロール | 644,045,015円 |
| 投資のソムリエ< D C年金> | 41,349,986円 |
| D I A M 8 資産バランスマ ンドN< D C年金> | 132,194,178円 |
| D I A M D C バランス・F (成長型) | 82,846,198円 |
| クルーズコントロール< D C年 金> | 258,440円 |
| D I A Mコア資産設計ファンド (堅実型) | 2,881,041円 |
| D I A Mコア資産設計ファンド (積極型) | 8,580,167円 |
| 投資のソムリエ< D C年金>リ スク抑制型 | 27,919,504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 | 382,109円 491,429,119円 |
| ワールドアセットバランス(基 本コース) | 679,300,871円 |

| | |
|-----------------------------------|----------------|
| ワールドアセットバランス(リスク抑制コース) | 2,666,297,369円 |
| 投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045) | 303,836円 |
| 投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055) | 214,563円 |
| リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC) | 132,362円 |
| 投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035) | 177,710円 |
| 4資産分散投資・スタンダード<DC年金> | 1,967,348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) | 91,840,552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) | 2,888,074,029円 |
| DIAM先進国株式パッシブファンド(適格機関投資家限定) | 158,462,591円 |
| 外国株式パッシブ・ファンド2(適格機関投資家限定) | 208,713,351円 |
| DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定) | 24,032,692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) | 100,958,661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) | 230,764,929円 |
| DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定) | 12,774,196円 |
| DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定) | 84,522,643円 |
| DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定) | 6,847,227円 |
| DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定) | 10,322,970円 |
| DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定) | 24,154,580円 |
| DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定) | 64,957,683円 |
| DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定) | 555,708,521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) | 689,440,836円 |
| D I A Mバランスファンド50 V A (適格機関投資家限定) | 2,176,135,035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) | 779,804,439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) | 177,051,101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) | 913,578,311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) | 279,699,403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 55 V A (適格機関投資家限 定) | 47,120,309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) | 126,495,152円 |
| D I A M世界アセットバランス ファンド2 V A (適格機関投資 家限定) | 7,947,411,030円 |
| D I A M世界アセットバランス ファンド40 V A (適格機関投 資家限定) | 428,739,577円 |
| D I A M世界アセットバランス ファンド25 V A (適格機関投 資家限定) | 1,359,482,474円 |
| D I A M世界アセットバランス ファンド3 V A (適格機関投資 家限定) | 5,217,814,407円 |
| D I A Mバランス30 V A (適 格機関投資家限定) | 18,843,968円 |
| D I A Mバランス50 V A (適 格機関投資家限定) | 1,236,246円 |
| D I A Mバランス70 V A (適 格機関投資家限定) | 10,773,604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) | 6,968,216,533円 |
| D I A Mバランス20 V A (適 格機関投資家限定) | 60,336,899円 |
| D I A Mバランス40 V A (適 格機関投資家限定) | 233,071円 |
| D I A Mバランス60 V A (適 格機関投資家限定) | 262,779円 |
| 計 | 89,269,490,166円 |

| | |
|------------|-----------------|
| 2 . 受益権の総数 | 89,269,490,166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5月23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 | <p>(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p> |
| 3 . 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、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）

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5月23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 | 230,787,735 | - | 230,531,860 | 255,875 |
| アメリカ・ドル | 20,067,560 | - | 20,065,660 | 1,900 |
| イギリス・ポンド | 98,092,221 | - | 97,969,620 | 122,601 |
| オーストラリア・ドル | 420,965 | - | 419,800 | 1,165 |
| カナダ・ドル | 521,232 | - | 518,760 | 2,472 |
| ユーロ | 111,685,757 | - | 111,558,020 | 127,737 |
| 買 建 | 161,450,258 | - | 161,337,940 | 112,318 |
| アメリカ・ドル | 157,214,733 | - | 157,102,790 | 111,943 |
| オーストラリア・ドル | 2,938,565 | - | 2,938,250 | 315 |
| カナダ・ドル | 1,296,960 | - | 1,296,900 | 60 |
| 合計 | 392,237,993 | - | 391,869,800 | 143,557 |

(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5月23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 先物取引 買 建 | 7,201,375,513 | - | 7,425,665,190 | 224,289,677 |
| 合計 | 7,201,375,513 | - | 7,425,665,190 | 224,289,677 |

(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5月23日現在 |
|--------------|--------------|
| 1口当たり純資産額 | 3.5179円 |
| (1万口当たり純資産額) | (35,179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5月23日現在 |
|-------------|----------|-----------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 預金 | | 3,317,806,527 |
| コール・ローン | | 701,185,098 |
| 国債証券 | | 214,385,149,987 |
| 未収利息 | | 1,686,210,919 |
| 前払費用 | | 66,475,722 |
| 流動資産合計 | | 220,156,828,253 |
| 資産合計 | | 220,156,828,253 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払解約金 | | 223,681,000 |
| 流動負債合計 | | 223,681,000 |
| 負債合計 | | 223,681,000 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 1 | 122,160,482,019 |
| 剰余金 | | |
| 剰余金又は欠損金() | | 97,772,665,234 |
| 元本等合計 | | 219,933,147,253 |
| 純資産合計 | | 219,933,147,253 |
| 負債純資産合計 | | 220,156,828,253 |

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 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. 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 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5月23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 | 129,683,662,710円 17,204,306,512円 24,727,487,203円 |
| 元本の内訳 | |
| ファンド名 | |
| D I A M外国債券バッシブ・ファンド | 7,047,824,949円 |
| M I T O ラップ型ファンド（安定型） | 13,042,629円 |
| M I T O ラップ型ファンド（中立型） | 37,652,944円 |
| M I T O ラップ型ファンド（積極型） | 44,291,125円 |
| グローバル8資産ラップファンド（安定型） | 79,872,294円 |
| グローバル8資産ラップファンド（中立型） | 80,011,315円 |
| グローバル8資産ラップファンド（積極型） | 46,089,578円 |
| たわらノーロード 先進国債券 | 1,925,831,573円 |
| たわらノーロード 先進国債券<ラップ向け> | 606,412円 |
| たわらノーロード バランス（8資産均等型） | 38,548,817円 |
| たわらノーロード バランス（堅実型） | 645,609円 |
| たわらノーロード バランス（標準型） | 3,331,613円 |
| たわらノーロード バランス（積極型） | 1,284,417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) | 111,422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) | 6,162,431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) | 5,180,097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) | 924,430円 |
| たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定型) | 90,584円 |
| たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定成長型) | 413,538円 |
| たわらノーロード 最適化バラ ンス(成長型) | 244,162円 |
| たわらノーロード 最適化バラ ンス(積極型) | 344,833円 |
| D I A M外国債券インデックス ファンド< D C年金> | 5,065,844,281円 |
| D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 1 安定型 | 491,188,985円 |
| D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 2 安定・成長型 | 1,595,478,359円 |
| D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 3 成長型 | 1,709,843,837円 |
| D I A M D C バランス3 0 インデックスファンド | 373,223,365円 |
| D I A M D C バランス5 0 インデックスファンド | 800,088,859円 |
| D I A M D C バランス7 0 インデックスファンド | 627,210,187円 |
| マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型> | 23,582,221円 |
| マネックス資産設計ファンド< 育成型> | 599,670,192円 |
| マネックス資産設計ファンド エボリューション | 17,303,931円 |
| D I A M D C 8資産 balan スファンド(新興国1 0) | 18,508,212円 |
| D I A M D C 8資産 balan スファンド(新興国2 0) | 42,590,924円 |
| D I A M D C 8資産 balan スファンド(新興国3 0) | 79,679,541円 |
| クルーズコントロール D I A M 8資産バランスマ ファンドN< D C年金> | 3,549,504,892円 73,287,083円 |
| D I A M D C バランス・F (成長型) | 134,176,645円 |
| クルーズコントロール< D C年 金> | 1,424,796円 |
| D I A Mコア資産設計ファンド (堅実型) | 10,626,959円 |

| | |
|--|----------------|
| D I A Mコア資産設計ファンド (積極型) | 31,484,665円 |
| ダイナミック・ナビゲーション | 358,265円 |
| 4資産分散投資・スタンダード <DC年金> | 5,750,332円 |
| D I A Mパッシブ資産分散ファ ンド | 1,370,643,849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) | 6,972,143,836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) | 4,074,076,473円 |
| 外国債券パッシブファンド(適 格機関投資家限定) | 3,312,147,806円 |
| 先進国債券パッシブファンド (適格機関投資家限定) | 6,091,932,007円 |
| D I A Mワールドバランス25 VA(適格機関投資家限定) | 105,057,530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) | 907,753,946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) | 691,342,130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) | 55,826,267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) | 105,474,980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) | 25,650,246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) | 9,657,991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) | 67,846,160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) | 81,055,478円 |
| D I A Mバランスファンド25 VA(適格機関投資家限定) | 3,643,627,930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) | 2,397,615,873円 |
| D I A Mバランスファンド50 VA(適格機関投資家限定) | 4,074,055,797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) | 730,950,015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) | 387,850,401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) | 3,428,740,836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) | 5,830,116,766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 5 5 V A (適格機関投資家限 定) | 29,460,622円 |
| D I A M世界バランスファンド 3 5 V A (適格機関投資家限 定) | 1,110,206,088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) | 14,877,800,770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) | 19,540,800,063円 |
| D I A Mバランス3 0 V A (適 格機関投資家限定) | 21,219,239円 |
| D I A Mバランス5 0 V A (適 格機関投資家限定) | 1,447,528円 |
| D I A Mバランス7 0 V A (適 格機関投資家限定) | 5,503,464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) | 17,395,885,042円 |
| D I A M世界バランス2 5 V A (適格機関投資家限定) | 103,512,812円 |
| D I A Mバランス2 0 V A (適 格機関投資家限定) | 113,246,173円 |
| D I A Mバランス4 0 V A (適 格機関投資家限定) | 363,474円 |
| D I A Mバランス6 0 V A (適 格機関投資家限定) | 163,595円 |
| 計 | 122,160,482,019円 |
| 2 . 受益権の総数 | 122,160,482,019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5月23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 | <p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 該当事項はありません。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p> |
| 3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | <p>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</p> <p>す。</p> |

(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5月23日現在 | |
|--------------|-----------|
| 1口当たり純資産額 | 1,8004円 |
| (1万口当たり純資産額) | (18,004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5月23日現在 |
|-------------|----------|----------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 預金 | | 133,938,859 |
| コール・ローン | | 326,508,435 |
| 投資信託受益証券 | | 5,714,464,255 |
| 投資証券 | | 43,653,471,345 |
| 派生商品評価勘定 | | 32,155 |
| 未収入金 | | 71,069,935 |
| 未収配当金 | | 109,311,763 |
| 流動資産合計 | | 50,008,796,747 |
| 資産合計 | | 50,008,796,747 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 派生商品評価勘定 | | 29,185 |
| 未払金 | | 53,810,416 |
| 未払解約金 | | 299,392,000 |
| 流動負債合計 | | 353,231,601 |
| 負債合計 | | 353,231,601 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 1 | 42,723,127,942 |
| 剰余金 | | |
| 剰余金又は欠損金() | | 6,932,437,204 |
| 元本等合計 | | 49,655,565,146 |
| 純資産合計 | | 49,655,565,146 |
| 負債純資産合計 | | 50,008,796,747 |

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5月23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 | 42,987,001,922円 |
| | 同期中追加設定元本額 | 20,232,375,848円 |
| | 同期中一部解約元本額 | 20,496,249,828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) | 238,117,701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) | 89,853,919円 |
| | M I T O ラップ型ファンド (安定型) | 5,257,557円 |
| | M I T O ラップ型ファンド (中立型) | 21,023,866円 |
| | M I T O ラップ型ファンド (積極型) | 39,466,459円 |
| | グローバル8資産ラップファン ド(安定型) | 32,207,993円 |
| | グローバル8資産ラップファン ド(中立型) | 45,211,021円 |
| | グローバル8資産ラップファン ド(積極型) | 41,466,545円 |
| | たわらノーロード 先進国リー ト | 2,118,902,977円 |
| | たわらノーロード 先進国リー ト<ラップ向け> | 511,594,267円 |
| | たわらノーロード 先進国リー ト<為替ヘッジあり> | 134,978,688円 |
| | たわらノーロード バランス (8資産均等型) | 60,520,319円 |
| | たわらノーロード バランス (堅実型) | 337,376円 |
| | たわらノーロード バランス (標準型) | 6,539,588円 |
| | たわらノーロード バランス (積極型) | 24,208,516円 |
| | たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(安定型) | 2,490,286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) | 11,725,835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) | 8,970,562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) | 25,882,159円 |
| | たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定型) | 97,568円 |

| | |
|---|----------------------------|
| たわらノーロード 最適化バ ランス(安定成長型) | 890,810円 |
| たわらノーロード 最適化バ ランス(成長型) | 1,026,441円 |
| たわらノーロード 最適化バ ランス(積極型) | 3,532,654円 |
| マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型> | 23,851,883円 |
| マネックス資産設計ファンド< 育成型> | 605,308,573円 |
| マネックス資産設計ファンド エボリューション | 64,548,816円 |
| D I A M D C 8資産バラン スファンド(新興国10) | 29,721,249円 |
| D I A M D C 8資産バラン スファンド(新興国20) | 101,335,190円 |
| D I A M D C 8資産バラン スファンド(新興国30) | 225,466,632円 |
| 投資のソムリエ | 6,884,778,621円 |
| 投資のソムリエ<DC年金> | 497,965,893円 |
| D I A M 8資産バランスマ ンドN<DC年金> | 119,939,477円 |
| 投資のソムリエ<DC年金>リ スク抑制型 | 83,037,311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 | 295,228円 1,460,112,521円 |
| ワールドアセットバランス(基 本コース) | 1,433,453,250円 |
| ワールドアセットバランス(リ スク抑制コース) | 5,295,022,918円 |
| 投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2045) | 1,534,206円 |
| 投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2055) | 1,078,542円 |
| リスク抑制世界8資産バラン スファンド(DC) | 399,887円 |
| 投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2035) | 2,686,179円 |
| D I A Mパッシブ資産分散ファ ンド | 1,192,999,535円 |
| D I A M外国リートインデック スファンド<DC年金> | 27,261,125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) | 1,698,529,413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) | 11,580,328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) | 12,008,758,387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) | 1,856,690,775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) | 1,465,670,521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) | 3,647,231,593円 |
| D I A M海外リートインデック スファンド(適格機関投資家限 定) | 559,566,782円 |
| 計 | 42,723,127,942円 |
| 2 . 受益権の総数 | 42,723,127,942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5月23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)

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5月23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 | 26,861,215 | - | 26,844,900 | 16,315 |
| シンガポール・ドル | 9,918,960 | - | 9,934,800 | 15,840 |
| ユーロ | 9,160,305 | - | 9,144,100 | 16,205 |
| 香港・ドル | 7,781,950 | - | 7,766,000 | 15,950 |
| 買 建 | 6,363,885 | - | 6,350,540 | 13,345 |
| オーストラリア・ドル | 4,209,650 | - | 4,198,000 | 11,650 |
| シンガポール・ドル | 2,154,235 | - | 2,152,540 | 1,695 |
| 合計 | 33,225,100 | - | 33,195,440 | 2,970 |

(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5月23日現在 |
|--------------|--------------|
| 1口当たり純資産額 | 1.1623円 |
| (1万口当たり純資産額) | (11,623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5月23日現在 |
|-------------|----------|-----------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 預金 | | 2,742,437,210 |
| コール・ローン | | 3,848,213,701 |
| 国債証券 | | 289,490,014,770 |
| 派生商品評価勘定 | | 1,867,950,925 |
| 未収利息 | | 1,825,694,994 |
| 前払費用 | | 360,741,340 |
| 流動資産合計 | | 300,135,052,940 |
| 資産合計 | | 300,135,052,940 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 派生商品評価勘定 | | 2,122,100,723 |
| 未払解約金 | | 1,759,094,000 |
| 流動負債合計 | | 3,881,194,723 |
| 負債合計 | | 3,881,194,723 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 1 | 225,239,029,166 |
| 剰余金 | | |
| 剰余金又は欠損金() | | 71,014,829,051 |
| 元本等合計 | | 296,253,858,217 |
| 純資産合計 | | 296,253,858,217 |
| 負債純資産合計 | | 300,135,052,940 |

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5月23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 | 176,903,631,403円 69,492,681,677円 21,157,283,914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） | 1,789,490,824円 9,747,700円 26,289,199円 22,918,378円 947,080円 31,689,281円 32,674,546円 9,509,422円 9,603,176円 495,046円 |

| | |
|--|-----------------|
| たわらノーロード 最適化バ ランス(安定型) | 640,732円 |
| たわらノーロード 最適化バ ランス(安定成長型) | 2,550,545円 |
| たわらノーロード 最適化バ ランス(成長型) | 1,272,239円 |
| たわらノーロード 最適化バ ランス(積極型) | 1,733,936円 |
| 投資のソムリエ | 36,344,554,513円 |
| 投資のソムリエ<DC年金> | 2,637,510,260円 |
| 投資のソムリエ<DC年金>リ スク抑制型 | 2,363,601,782円 |
| リスク抑制世界8資産バラン スファンド | 43,768,685,493円 |
| ワールドアセットバランス(基 本コース) | 5,836,649,761円 |
| ワールドアセットバランス(リ スク抑制コース) | 22,485,913,248円 |
| 投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2045) | 4,958,457円 |
| 投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2055) | 3,356,646円 |
| リスク抑制世界8資産バラン スファンド(DC) | 11,343,489円 |
| 投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2035) | 10,289,131円 |
| 外国債券パッシブファンド2 (為替フルヘッジ)(適格機関 投資家限定) | 8,825,007,351円 |
| 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) | 20,370,507,693円 |
| DIAM世界アセットバランス ファンド40VA(適格機関投 資家限定) | 1,098,916,162円 |
| DIAM世界アセットバランス ファンド25VA(適格機関投 資家限定) | 6,971,919,992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) | 33,445,618,259円 |
| DIAMバランス30VA(適 格機関投資家限定) | 29,052,903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) | 29,776,019,689円 |
| DIAMバランス20VA(適 格機関投資家限定) | 155,055,771円 |
| DIAM世界アセットバランス ファンド7VA(1212) (適格機関投資家限定) | 2,619,820,816円 |

| | |
|---|------------------|
| D I A M世界アセットバランス ファンド7 V A (1 3 0 3) (適格機関投資家限定) | 2,627,419,330円 |
| D I A M世界アセットバランス ファンド7 V A (1 3 0 6) (適格機関投資家限定) | 3,475,672,740円 |
| D I A M世界アセットバランス ファンド7 V A (1 3 0 9) (適格機関投資家限定) | 437,593,576円 |
| 計 | 225,239,029,166円 |
| 2 . 受益権の総数 | 225,239,029,166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5月23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)

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5月23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 | 296,961,956,651 | - | 297,216,106,449 | 254,149,798 |
| アメリカ・ドル | 127,351,199,289 | - | 129,212,595,765 | 1,861,396,476 |
| イギリス・ポンド | 21,135,986,265 | - | 20,898,182,760 | 237,803,505 |
| オーストラリア・ドル | 6,200,224,549 | - | 6,313,628,512 | 113,403,963 |
| カナダ・ドル | 6,246,307,368 | - | 6,332,323,543 | 86,016,175 |
| シンガポール・ドル | 997,672,997 | - | 1,000,247,065 | 2,574,068 |
| スウェーデン・クローナ | 959,518,448 | - | 978,771,974 | 19,253,526 |
| デンマーク・クローネ | 1,601,634,389 | - | 1,582,660,510 | 18,973,879 |
| ノルウェー・クローネ | 751,489,614 | - | 757,336,250 | 5,846,636 |
| ポーランド・ズロチ | 1,863,194,595 | - | 1,819,453,592 | 43,741,003 |
| マレーシア・リンギット | 1,173,310,083 | - | 1,186,425,900 | 13,115,817 |
| メキシコ・ペソ | 2,213,887,645 | - | 2,136,617,154 | 77,270,491 |
| ユーロ | 124,732,819,023 | - | 123,248,386,086 | 1,484,432,937 |
| 南アフリカ・ランド | 1,734,712,386 | - | 1,749,477,338 | 14,764,952 |
| 合計 | 296,961,956,651 | - | 297,216,106,449 | 254,149,798 |

(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5月23日現在 |
|--------------|--------------|
| 1口当たり純資産額 | 1.3153円 |
| (1万口当たり純資産額) | (13,153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5月23日現在 |
|-------------|----------|----------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 預金 | | 3,744,461,013 |
| コール・ローン | | 470,252,459 |
| 株式 | | 60,183,866,171 |
| 投資信託受益証券 | | 278,793,423 |
| 投資証券 | | 124,600,972 |
| 派生商品評価勘定 | | 1,872,209 |
| 未収入金 | | 610,642 |
| 未収配当金 | | 69,369,593 |
| 差入委託証拠金 | | 1,077,518,063 |
| 流動資産合計 | | 65,951,344,545 |
| 資産合計 | | 65,951,344,545 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 派生商品評価勘定 | | 120,480,424 |
| 未払解約金 | | 413,028,000 |
| 流動負債合計 | | 533,508,424 |
| 負債合計 | | 533,508,424 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 1 | 52,614,444,153 |
| 剰余金 | | |
| 剰余金又は欠損金（ ） | | 12,803,391,968 |
| 元本等合計 | | 65,417,836,121 |
| 純資産合計 | | 65,417,836,121 |
| 負債純資産合計 | | 65,951,344,545 |

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5月23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 | 48,115,881,290円 |
| | 同期中追加設定元本額 | 20,407,728,860円 |
| | 同期中一部解約元本額 | 15,909,165,997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 > | 3,469,998,128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) | 504,326,351円 |
| | M I T O ラップ型ファンド (安定型) | 5,484,637円 |
| | M I T O ラップ型ファンド (中立型) | 15,490,682円 |
| | M I T O ラップ型ファンド (積極型) | 18,210,990円 |
| | グローバル8資産ラップファン ド(安定型) | 33,062,033円 |
| | グローバル8資産ラップファン ド(中立型) | 33,677,120円 |
| | グローバル8資産ラップファン ド(積極型) | 19,406,764円 |
| | たわらノーロード 新興国株式 | 3,751,943,342円 |
| | たわらノーロード 新興国株式 <ラップ向け> | 1,167,348,445円 |
| | たわらノーロード バランス (8資産均等型) | 55,577,378円 |
| | たわらノーロード バランス (堅実型) | 311,068円 |
| | たわらノーロード バランス (標準型) | 1,206,433円 |
| | たわらノーロード バランス (積極型) | 3,720,907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) | 32,235円 |
| | たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(安定型) | 2,280,539円 |
| | たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(安定成長 型) | 4,601,121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) | 2,737,314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) | 7,406,086円 |
| | たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定型) | 21,744円 |
| | たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定成長型) | 101,698円 |

| | |
|---|-----------------|
| たわらノーロード 最適化バ ランス(成長型) | 144,425円 |
| たわらノーロード 最適化バ ランス(積極型) | 510,388円 |
| マネックス資産設計ファンド エボリューション | 429,132,057円 |
| D I A M D C 8資産バラン スファンド(新興国10) | 44,941,724円 |
| D I A M D C 8資産バラン スファンド(新興国20) | 157,059,043円 |
| D I A M D C 8資産バラン スファンド(新興国30) | 347,427,496円 |
| 投資のソムリエ | 4,658,002,566円 |
| クルーズコントロール | 1,731,972,160円 |
| 投資のソムリエ<DC年金> | 336,928,674円 |
| D I A M 8資産バランスマ ファンドN<DC年金> | 177,856,455円 |
| クルーズコントロール<DC年 金> | 695,119円 |
| D I A Mコア資産設計ファンド (堅実型) | 19,397,271円 |
| D I A Mコア資産設計ファンド (積極型) | 57,569,915円 |
| 投資のソムリエ<DC年金>リ スク抑制型 | 74,005,680円 |
| ダイナミック・ナビゲーション | 1,570,802円 |
| リスク抑制世界8資産バラン スファンド | 1,365,161,096円 |
| ワールドアセットバランス(基 本コース) | 1,787,762,556円 |
| ワールドアセットバランス(リ スク抑制コース) | 7,253,759,545円 |
| 投資のソムリエ(ターゲット・ イヤ-2045) | 1,139,514円 |
| 投資のソムリエ(ターゲット・ イヤ-2055) | 778,497円 |
| リスク抑制世界8資産バラン スファンド(DC) | 361,264円 |
| 投資のソムリエ(ターゲット・ イヤ-2035) | 1,236,057円 |
| エマージング株式パッシブファ ンドVA(適格機関投資家専 用) | 4,726,306,572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) | 2,128,161,716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) | 10,996,327,543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) | 7,219,291,003円 |
| 計 | 52,614,444,153円 |

52,614,444,153口

2. 受益権の総数

(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5月23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 | <p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p> |
| 3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、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)

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5月23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 | 23,188,341 | - | 23,171,830 | 16,511 |
| アメリカ・ドル | 23,188,341 | - | 23,171,830 | 16,511 |
| 合計 | 23,188,341 | - | 23,171,830 | 16,511 |

(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5月23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 | 4,892,823,936 | - | 4,774,232,232 | 118,591,704 |
| 合計 | 4,892,823,936 | - | 4,774,232,232 | 118,591,704 |

(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5月23日現在 |
|--------------|--------------|
| 1口当たり純資産額 | 1,2433円 |
| (1万口当たり純資産額) | (12,433円) |

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

たわらノーロード スマートグローバルバランス(保守型)

平成30年5月31日現在

| | |
|----------------|------------|
| 資産総額 | 4,235,776円 |
| 負債総額 | 499円 |
| 純資産総額(-) | 4,235,277円 |
| 発行済数量 | 4,255,493口 |
| 1口当たり純資産額(/) | 0.9952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)

平成30年5月31日現在

| | |
|----------------|--------------|
| 資産総額 | 153,186,203円 |
| 負債総額 | 18,772円 |
| 純資産総額(-) | 153,167,431円 |
| 発行済数量 | 152,931,681口 |
| 1口当たり純資産額(/) | 1.0015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)

平成30年5月31日現在

| | |
|----------------|--------------|
| 資産総額 | 227,773,535円 |
| 負債総額 | 30,667円 |
| 純資産総額(-) | 227,742,868円 |
| 発行済数量 | 227,151,361口 |
| 1口当たり純資産額(/) | 1.0026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)

平成30年5月31日現在

| | |
|----------------|--------------|
| 資産総額 | 108,995,796円 |
| 負債総額 | 39,925円 |
| 純資産総額(-) | 108,955,871円 |
| 発行済数量 | 108,332,797口 |
| 1口当たり純資産額(/) | 1.0058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)

平成30年5月31日現在

| | |
|----------------|--------------|
| 資産総額 | 221,013,811円 |
| 負債総額 | 58,515円 |
| 純資産総額(-) | 220,955,296円 |
| 発行済数量 | 219,684,045口 |
| 1口当たり純資産額(/) | 1.0058円 |

(参考)

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

平成30年5月31日現在

| | |
|----------------|------------------|
| 資産総額 | 297,948,166,851円 |
| 負債総額 | 247,150,247円 |
| 純資産総額(-) | 297,701,016,604円 |
| 発行済数量 | 111,642,842,861口 |
| 1口当たり純資産額(/) | 2.6665円 |

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年5月31日現在

| | |
|----------------|------------------|
| 資産総額 | 347,239,598,925円 |
| 負債総額 | 801,887,000円 |
| 純資産総額(-) | 346,437,711,925円 |
| 発行済数量 | 268,170,752,853口 |
| 1口当たり純資産額(/) | 1.2919円 |

J-REITインデックスファンド・マザーファンド

平成30年5月31日現在

| | |
|----------------|-----------------|
| 資産総額 | 35,367,944,998円 |
| 負債総額 | 185,531,398円 |
| 純資産総額(-) | 35,182,413,600円 |
| 発行済数量 | 19,390,909,829口 |
| 1口当たり純資産額(/) | 1.8144円 |

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年5月31日現在

| | |
|----------------|------------------|
| 資産総額 | 304,674,950,971円 |
| 負債総額 | 170,678,061円 |
| 純資産総額(-) | 304,504,272,910円 |
| 発行済数量 | 89,272,668,561口 |
| 1口当たり純資産額(/) | 3.4109円 |

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年5月31日現在

| | |
|----------------|------------------|
| 資産総額 | 214,812,073,972円 |
| 負債総額 | 1,540,636,222円 |
| 純資産総額(-) | 213,271,437,750円 |
| 発行済数量 | 120,763,347,224口 |
| 1口当たり純資産額(/) | 1.7660円 |

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年5月31日現在

| | |
|----------------|-----------------|
| 資産総額 | 51,063,679,691円 |
| 負債総額 | 810,373,254円 |
| 純資産総額(-) | 50,253,306,437円 |
| 発行済数量 | 43,114,666,503口 |
| 1口当たり純資産額(/) | 1.1656円 |

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年5月31日現在

| | |
|----------------|------------------|
| 資産総額 | 307,318,462,598円 |
| 負債総額 | 217,241,943円 |
| 純資産総額(-) | 307,101,220,655円 |
| 発行済数量 | 232,177,374,741口 |
| 1口当たり純資産額(/) | 1.3227円 |

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

平成30年5月31日現在

| | |
|----------------|-----------------|
| 資産総額 | 62,886,544,583円 |
| 負債総額 | 257,558,006円 |
| 純資産総額(-) | 62,628,986,577円 |
| 発行済数量 | 52,676,726,005口 |
| 1口当たり純資産額(/) | 1.1889円 |

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】

原届出書の「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」につきましては、以下の内容に更新・訂正いたします。

<更新・訂正後>

(1) 資本金の額（平成30年5月31日現在）

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

直近5カ年の資本金の増減：該当事項はありません。

(2) 会社の機構（平成30年5月31日現在）

会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。

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

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

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

また、取締役会の決議によって、取締役社長を定めることができます。

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

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

投資運用の意思決定機構

1.投資環境見通しおよび運用方針の策定

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

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】

原届出書の「第三部 委託会社等の情報 第1 委託会社等の概況 2 事業の内容及び営業の概況」につきましては、以下の内容に更新・訂正いたします。

<更新・訂正後>

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

平成30年5月31日現在、委託会社の運用する投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除く）

| 基本的性格 | 本数 | 純資産総額（単位：円） |
|------------|-------|--------------------|
| 追加型公社債投資信託 | 38 | 1,218,770,107,069 |
| 追加型株式投資信託 | 851 | 12,572,858,790,063 |
| 単位型公社債投資信託 | 52 | 199,168,764,583 |
| 単位型株式投資信託 | 142 | 899,691,682,408 |
| 合計 | 1,083 | 14,890,489,344,123 |

3【委託会社等の経理状況】

原届出書の「第三部 委託会社等の情報 第1 委託会社等の概況 3 委託会社等の経理状況」につきましては、以下の内容に更新・訂正いたします。

<更新・訂正後>

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

(1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

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

（単位：千円）

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

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

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

（単位：千円）

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

（３）【株主資本等変動計算書】

第32期（自平成28年4月1日至平成29年3月31日）

（単位：千円）

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

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

第33期(自平成29年4月1日至平成30年3月31日)

(単位:千円)

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

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

重要な会計方針

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

会計上の見積りの変更

第33期（自平成29年4月1日 至平成30年3月31日）

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

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

追加情報

第33期（自平成29年4月1日 至平成30年3月31日）

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

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

注記事項

（貸借対照表関係）

1. 有形固定資産の減価償却累計額

（千円）

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

（損益計算書関係）

1. 関係会社に対する事項

（千円）

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

2. 固定資産売却益の内訳

（千円）

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

3. 固定資産除却損の内訳

(千円)

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

4. 固定資産売却損の内訳

(千円)

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

5. 本社移転費用の内訳

(千円)

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

(株主資本等変動計算書関係)

第32期(自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

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

第33期(自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

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

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

営業債務である未払手数料は、1年以内の支払期日であります。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

(4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

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

第32期（平成29年3月31日現在）

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

第33期(平成30年3月31日現在)

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

(注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3) 未収委託者報酬及び(4) 未収運用受託報酬

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

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

負 債

(1) 未払手数料

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

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(千円)

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

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

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

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第32期(平成29年3月31日現在)

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

第33期(平成30年3月31日現在)

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

(有価証券関係)

1. 子会社株式及び関連会社株式

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

2. その他有価証券

第32期(平成29年3月31日現在)

(千円)

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

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

第33期(平成30年3月31日現在)

(千円)

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

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

3. 当該事業年度中に売却した其他有価証券

第32期(自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)

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

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

第33期(自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)

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

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

4. 減損処理を行った有価証券

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

第33期において、該当事項はありません。

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

（退職給付関係）

1. 採用している退職給付制度の概要

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

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

2. 確定給付制度

（1）退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

（千円）

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

（2）年金資産の期首残高と期末残高の調整表

（千円）

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

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

（千円）

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

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(千円)

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

(注) 特別損失に計上しております。

(5) 年金資産に関する事項

年金資産の主な内訳

年金資産合計に対する主な分類ごとの比率は、次のとおりであります。

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

長期期待運用収益率の設定方法

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

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎

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

3. 簡便法を適用した確定給付制度

(1) 簡便法を適用した制度の、退職給付引当金の期首残高と期末残高の調整表

(千円)

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

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

(千円)

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

(3) 退職給付費用

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

4. 確定拠出制度

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

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

繰延税金資産の純額

1,571,992

1,699,533

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

(企業結合等関係)

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

1. 結合当事企業

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

2. 企業結合日

平成28年10月1日

3. 企業結合の方法

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

4. 結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

5. 企業結合の主な目的

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

6. 合併比率

「3. 企業結合の方法」の吸収合併における合併比率は以下の通りであります。

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

(*) 普通株式と種類株式を合算して算定しております。

7. 交付した株式数

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

8. 経済的持分比率(議決権比率)

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

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

9. 取得企業を決定するに至った主な根拠

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

10. 会計処理

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

11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

(1) 財務諸表に含まれる被取得企業の業績の期間

平成29年4月1日から平成30年3月31日まで

(2) 被取得企業の取得原価及びその内訳

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

(3) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

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

(4) 企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

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

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

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

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

12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

(1) 貸借対照表項目

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

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

(2) 損益計算書項目

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

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

(資産除去債務関係)

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

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

(セグメント情報等)

1. セグメント情報

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

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

(1) サービスごとの情報

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

(2) 地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

(1) 親会社及び法人主要株主等

第32期(自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)

該当はありません。

第33期(自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)

該当はありません。

(2) 子会社及び関連会社等

第32期(自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)

該当はありません。

第33期(自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)

該当はありません。

(3) 兄弟会社等

第32期(自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)

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

第33期(自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

株式会社みずほフィナンシャルグループ

(東京証券取引所及びニューヨーク証券取引所に上場)

(2) 重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません。

(1株当たり情報)

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

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

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

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

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

5【その他】

<訂正前>

(1) 定款の変更、事業譲渡又は事業譲受、出資の状況その他の重要事項

該当事項はありません。

(略)

<訂正後>

(1) 定款の変更、事業譲渡又は事業譲受、出資の状況その他の重要事項

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

(略)

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】

原届出書の「第三部 委託会社等の情報 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」につきましては、以下の内容に更新・訂正いたします。

<更新・訂正後>

(1)受託会社

a. 名称

みずほ信託銀行株式会社

b. 資本金の額

平成30年3月末日現在 247,369百万円

c. 事業の内容

日本において銀行業務および信託業務を営んでいます。

(2)販売会社

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

| 名 称 | 資本金の額 (単位:百万円) | 事 業 の 内 容 |
|-----------|-------------------|---------------------|
| 株式会社みずほ銀行 | 1,404,065 | 日本において銀行業務を営んでおります。 |

(注) 資本金の額は平成30年3月末日現在

(注) 確定拠出年金向けの取扱販売会社を含みます。

(3)投資顧問会社

a. 名称

みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社

b. 資本金の額

平成30年3月末日現在 200百万円

c. 事業の内容

日本において投資顧問業務を営んでいます。

独立監査人の中間監査報告書

平成30年7月13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 スマートグローバルバランス（保守型）の平成29年11月24日から平成30年5月23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 スマートグローバルバランス（保守型）の平成30年5月23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29年11月24日から平成30年5月23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）XBRLデータは監査の対象には含まれておりません。

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

平成30年7月13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 スマートグローバルバランス（安定型）の平成29年11月24日から平成30年5月23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 スマートグローバルバランス（安定型）の平成30年5月23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29年11月24日から平成30年5月23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）XBRLデータは監査の対象には含まれておりません。

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

平成30年7月13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 スマートグローバルバランス（安定成長型）の平成29年11月24日から平成30年5月23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 スマートグローバルバランス（安定成長型）の平成30年5月23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29年11月24日から平成30年5月23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）XBRLデータは監査の対象には含まれておりません。

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

平成30年7月13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 スマートグローバルバランス（成長型）の平成29年11月24日から平成30年5月23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 スマートグローバルバランス（成長型）の平成30年5月23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29年11月24日から平成30年5月23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）XBRLデータは監査の対象には含まれておりません。

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

平成30年7月13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 スマートグローバルバランス（積極型）の平成29年11月24日から平成30年5月23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 スマートグローバルバランス（積極型）の平成30年5月23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29年11月24日から平成30年5月23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）XBRLデータは監査の対象には含まれておりません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成30年5月30日

アセットマネジメントOne株式会社
取締役会 御中

新日本有限責任監査法人

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

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

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

利害関係

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

以上

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

(注2) XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。