

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	2019年8月9日
【発行者名】	アセットマネジメントOne株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 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】	酒井 隆
【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】	リスクコントロール世界資産分散ファンド
【届出の対象とした募集内国投資信託受 益証券の金額】	1兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

リスクコントロール世界資産分散ファンド

ただし、愛称として「マイスタート」という名称を用いる場合があります。

（以下「ファンド」または「当ファンド」といいます。）

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

契約型の追加型証券投資信託の受益権（以下「受益権」といいます。）

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

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

（３）【発行（売出）価額の総額】

1兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

お申込日の翌営業日の基準価額 とします。

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

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

< 基準価額の照会方法等 >

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

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

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

(5) 【申込手数料】

お申込日の翌営業日の基準価額に、1.08%^{*}(税抜1.0%)を上限に各販売会社が定める手数料率を乗じて得た額とします。

*消費税率が10%になった場合は、1.1%となります。

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

「分配金再投資コース」により、収益分配金を再投資する場合は、お申込手数料はかかりません。

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

(6) 【申込単位】

各販売会社が定める単位とします。

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

取扱コースおよびお申込単位は、販売会社にお問い合わせください。

「分配金再投資コース」により収益分配金を再投資する場合は、1口単位となります。

当初元本は1口当たり1円です。

(7) 【申込期間】

継続申込期間：2019年8月10日から2020年2月10日まで

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

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

(8) 【申込取扱場所】

当ファンドのお申込みにかかる取扱い等は販売会社が行います。

販売会社は、以下の方法でご確認ください。

・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

(9) 【払込期日】

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

(10) 【払込取扱場所】

取得申込者は、販売会社の定める方法により、販売会社を買付代金を支払うものとし、

払込取扱場所についてご不明な点は、以下の方法でご確認ください。

・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

(11)【振替機関に関する事項】

ファンドの受益権にかかる振替機関は以下の通りです。

株式会社証券保管振替機構

(12)【その他】

お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

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

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

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

ただし、海外休業日にはお申込みの受付を行いません。

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

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

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

振替受益権について

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

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

（参考）

投資信託振替制度

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

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

当ファンドは、信託財産の成長を図ることを目的として運用を行います。

当ファンドの信託金限度額は、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 国内外の8資産に分散投資を行い、中長期的に安定的なリターンの獲得をめざします。

●主に国内外の公社債、株式および不動産投資信託証券(リート)の8資産にマザーファンド*1を通じて投資します。*2*3

*1 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド、国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド、為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド、外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド、J-REITインデックスファンド・マザーファンド、外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド、エマージング債券パッシブ・マザーファンド、エマージング株式パッシブ・マザーファンド

*2 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。

*3 有価証券指数等先物等、指数に連動する投資成果をめざす上場している投資信託証券(ETF)へ直接投資する場合があります。

また、DIAMマネーマザーファンドや短期金融資産等へ投資する場合があります。

2 基本資産配分によるポートフォリオの変動リスク*1を年率2%程度*2に抑えた安定的な運用をめざします。

●各資産への基本配分比率は、統計的手法を用い、資産価格に影響を与える「変動要因」の偏りをなくすように資産配分比率および通貨配分比率を決定します。その後、各資産の収益率のトレンドを勘案し、ポートフォリオの変動リスクが2%程度となるよう最終的に基本配分比率を決定します。基本配分比率は原則月次で見直しますが、経済環境、運用環境の大きな変化などにより委託会社が必要と判断した場合には、適宜、基本配分比率の見直しを行うことがあります。

●通貨配分比率の決定にあたっては、実質組入外貨建資産は投資環境に応じて弾力的に対円での為替ヘッジを行います。ただし、投資環境によっては、為替予約取引の売建を、実質組入外貨建資産の額を超えて行う場合があります。

*1 価格変動リスクの大きさを表し、この値が小さいほど、価格の変動が小さいことを意味します。

*2 上記数値は目標値であり、常にリスク水準が一定であること、あるいは目標値が達成されることのいずれかを約束するものではありません。また、上記数値は長期的なリスク水準の目標を表すものであり、年率2%程度の収益を目標とすることを意味するものではありません。上記数値が達成されるかどうかを問わず、実際の運用成績がマイナスとなる可能性があります。

3 基準価額の下落を一定水準(下値目安値*1)までに抑えることをめざします。

- 基本配分比率をもとに分散投資を行いつつ、基準価額の下落を一定水準(下値目安値)までに抑えることを目標に、基準価額の水準や市場環境等に応じて投資対象資産の合計資産比率*2を機動的に変更します。

下値目安値は、過去1年間の基準価額の最高値から-10%の水準となるよう毎営業日決定します。ただし、当該水準は委託会社の判断により今後変更する場合があります。

- *1 基準価額が下値目安値を下回らないことを委託会社が保証等するものではありません(相場急落の場合などには、基準価額が下値目安値を下回る場合があります。)
- *2 合計資産比率とは、「DIAMマネーマザーファンド」を除く8つのマザーファンドと有価証券指数等先物取引およびETF等への投資比率の合計をいいます。なお、合計資産比率の変更の際も、基本配分比率をもとに運用を行います。

4 年1回決算を行います。

- 毎年11月11日(休業日の場合は翌営業日)の決算時に、基準価額水準、市況動向等を勘案して分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。

運用プロセス

基本配分比率の決定

資産価格に影響を与える「変動要因」および各資産の「トレンド」を勘案し、基本配分比率を決定します。
基本配分比率は月次で見直します。



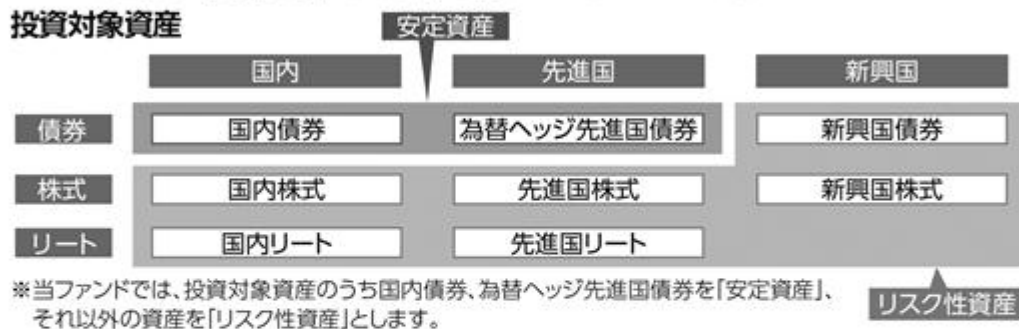
合計資産比率の機動的な変更

基準価額の下落を一定水準(下値目安値)までに抑えることを目標に機動的に合計資産比率を変更します。
下値目安値は毎営業日決定します。

リスクを抑えるための2つの運用手法により、安定的なリターンをめざします。



当ファンドでは、投資対象資産である国内外の8資産に対して、資産価格に影響を与える「変動要因」に着目した分散投資を行うことで、特定の要因で大きく基準価額が変動するリスクを回避し、変動を抑えて運用を行うことをめざします。

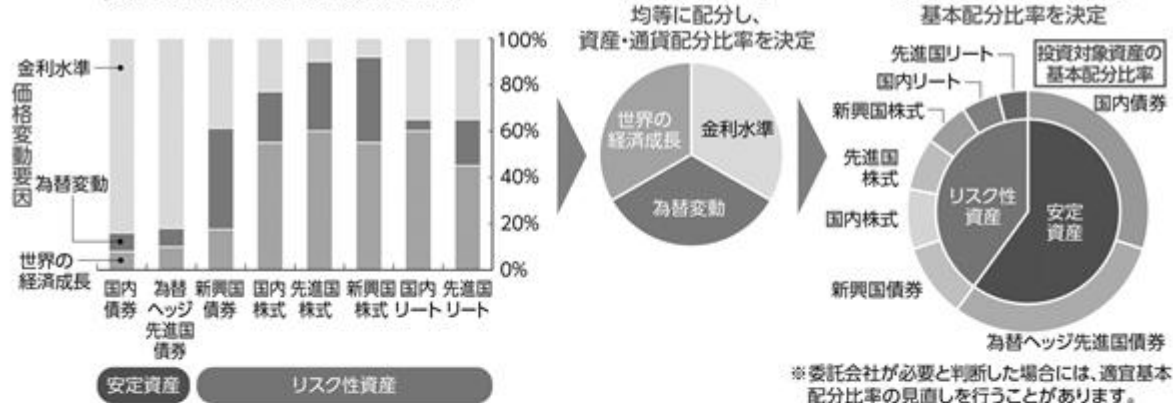


当ファンドの基本配分比率決定のイメージ

資産価格に影響を与える変動要因を判定し、変動要因の偏りをなくすように資産配分比率および通貨配分比率を決定します。その後、各資産のトレンドを勘案した上で、基準価額の変動が小さくなるように最終的に基本配分比率を決定します。基本配分比率は、月次で決定し、原則月間を通じて維持します。

通貨配分比率の決定にあたっては、実質組入外貨建資産は投資環境に応じて弾力的に対円での為替ヘッジを行います。ただし、投資環境によっては、為替予約取引の売建を、実質組入外貨建資産の額を超えて行う場合があります。

(例)各資産における価格変動要因の比率



価格変動要因が変化した場合

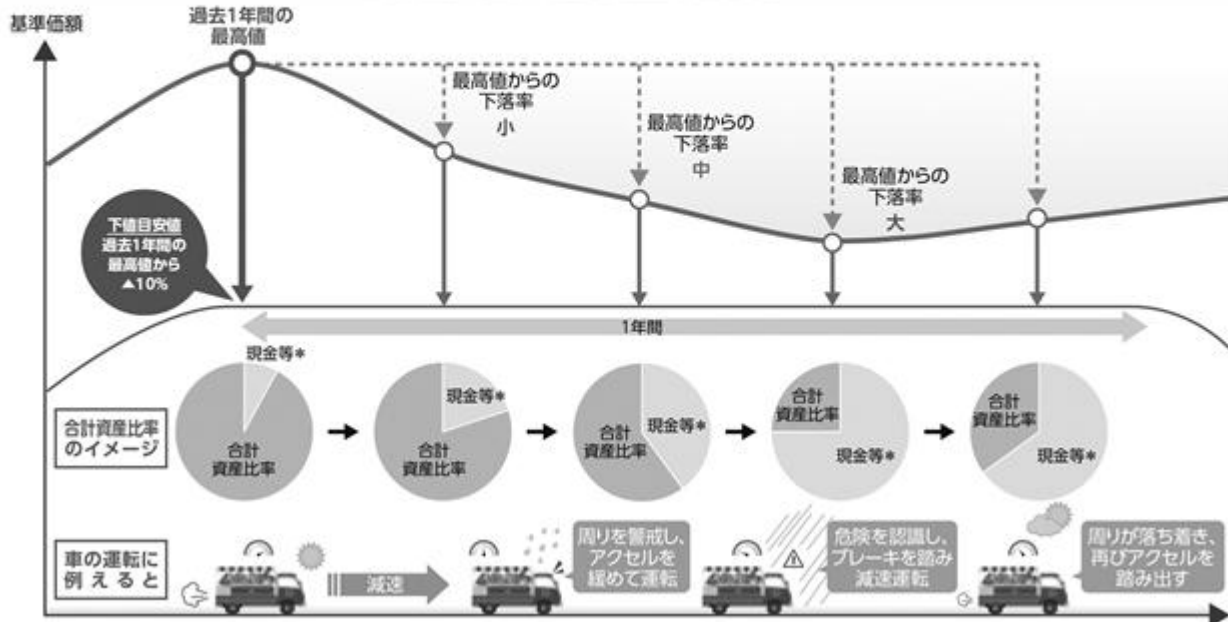


※上記はイメージ図であり、実際にはこれと異なる場合があります。また、変動要因のすべてを網羅したものではありません。



当ファンドでは、基準価額下落時や各資産の値動きが大きい時等には、現金等の比率を増やすことで基準価額の下落を一定水準（下値目安値）までに抑えることをめざします。

下値目安値と合計資産比率変更イメージ



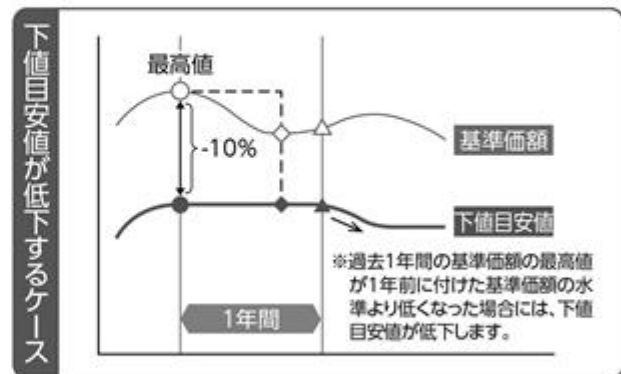
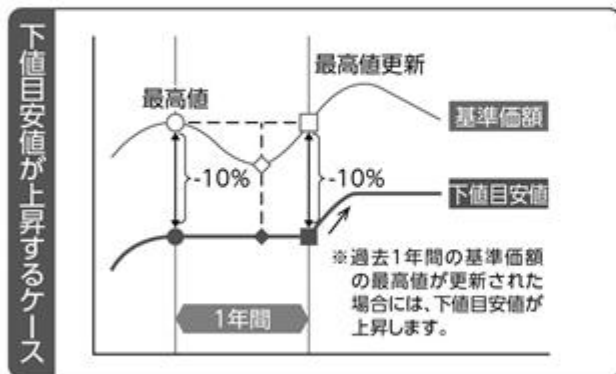
*現金等とは、短期国債およびコール・ローンなどの短期金融資産等をいい、当該資産への投資は、「DIAMマネーマザーファンド」を通じて、または直接投資を行います。

*合計資産比率とは、「DIAMマネーマザーファンド」を除く8つのマザーファンドと有価証券指数等先物取引およびETF等への投資比率の合計をいいます。なお、合計資産比率の変更の際も、基本配分比率をもとに運用を行います。

下値目安値について

下値目安値は過去1年間の基準価額の最高値から-10%の水準となるよう毎営業日決定します。ただし、当該水準は委託会社の判断により今後変更する場合があります。

*設定後1年に満たない場合は、設定来の最高値をもとに下値目安値を決定します。



*下値目安値は、必ずしも上昇または低下するものではありません。基準価額の上昇局面でも基準価額が過去1年間の最高値を更新できない場合には、下値目安値は上昇せず同じ水準が継続します。基準価額の下落局面でも過去1年間の基準価額の最高値が維持されている場合には、下値目安値は低下せず同じ水準が継続します。

*下値目安値は、基準価額がこれを下回らないように目標とされる水準であり、基準価額が下値目安値を下回らないことを委託会社が保証等するものではありません。

*上記はイメージ図であり、実際にはこれと異なる場合があります。また、将来の運用成果等を示唆・保証するものではありません。

■ 分配方針

年1回の決算時(毎年11月11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

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) 当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

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	年6回 (隔月)	欧州		
その他債券 クレジット属性 ()	年12回 (毎月)	アジア オセアニア		
	日々	中南米	ファンド・オブ・ ファンズ	なし
不動産投信	その他 ()	アフリカ		
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))		中近東 (中東)		
		エマージング		
資産複合 () 資産配分固定型 資産配分変更型				

(注1) 「為替ヘッジ」は、対円での為替リスクに対するヘッジの有無を記載しております。

(注2) 当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。

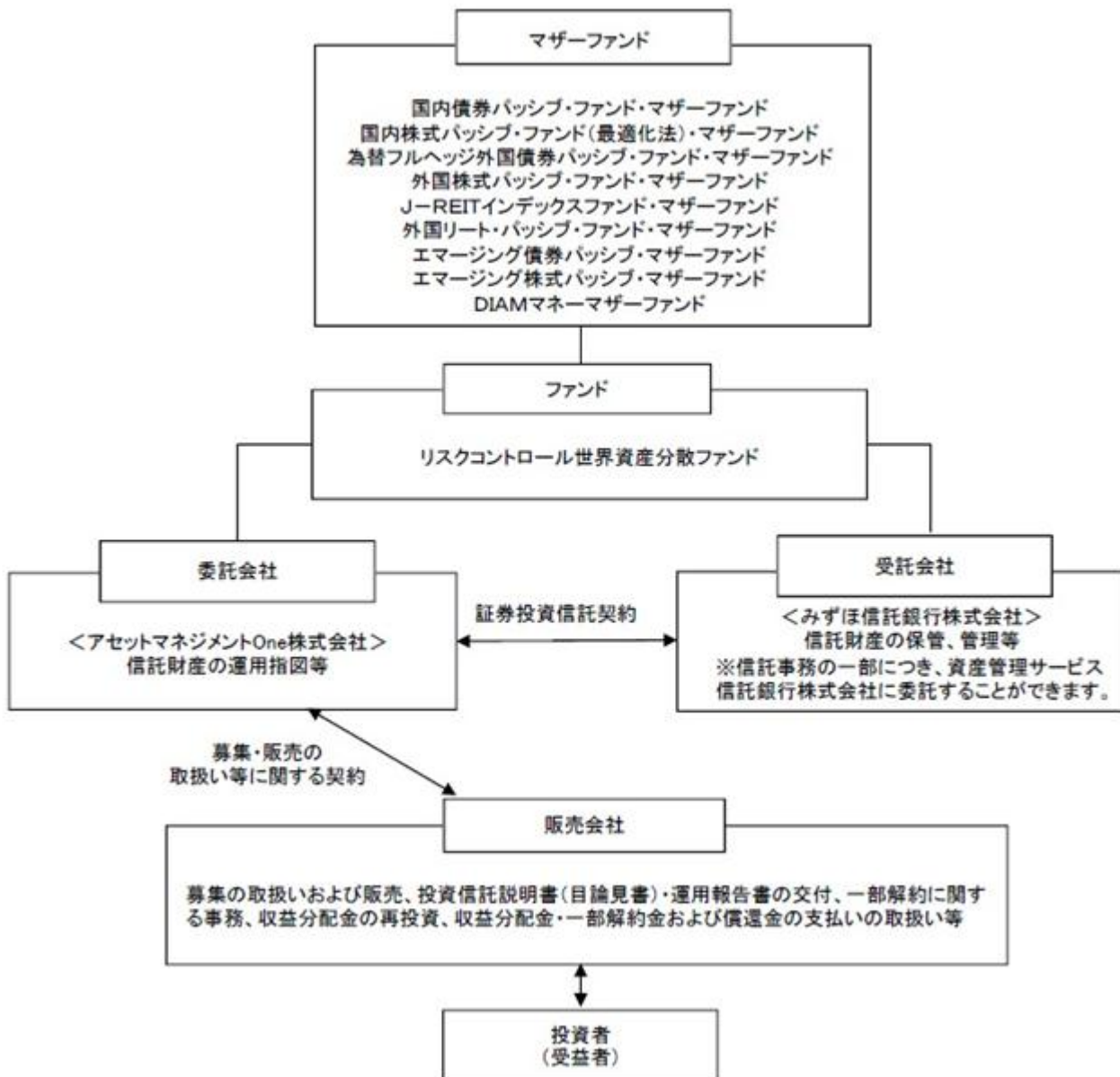
（注2）当ファンドが該当しない商品分類および属性区分の定義につきましては、一般社団法人投資信託協会のホームページ（<https://www.toushin.or.jp/>）をご覧ください。

（注3）当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】

2018年5月25日 信託契約締結、ファンドの設定、ファンドの運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】



・「証券投資信託契約」の概要

委託会社と受託会社との間においては、当ファンドにかかる証券投資信託契約を締結しております。当該契約の内容は、当ファンドの運用の基本方針、投資対象、投資制限、受益者の権利等を規定したものです。

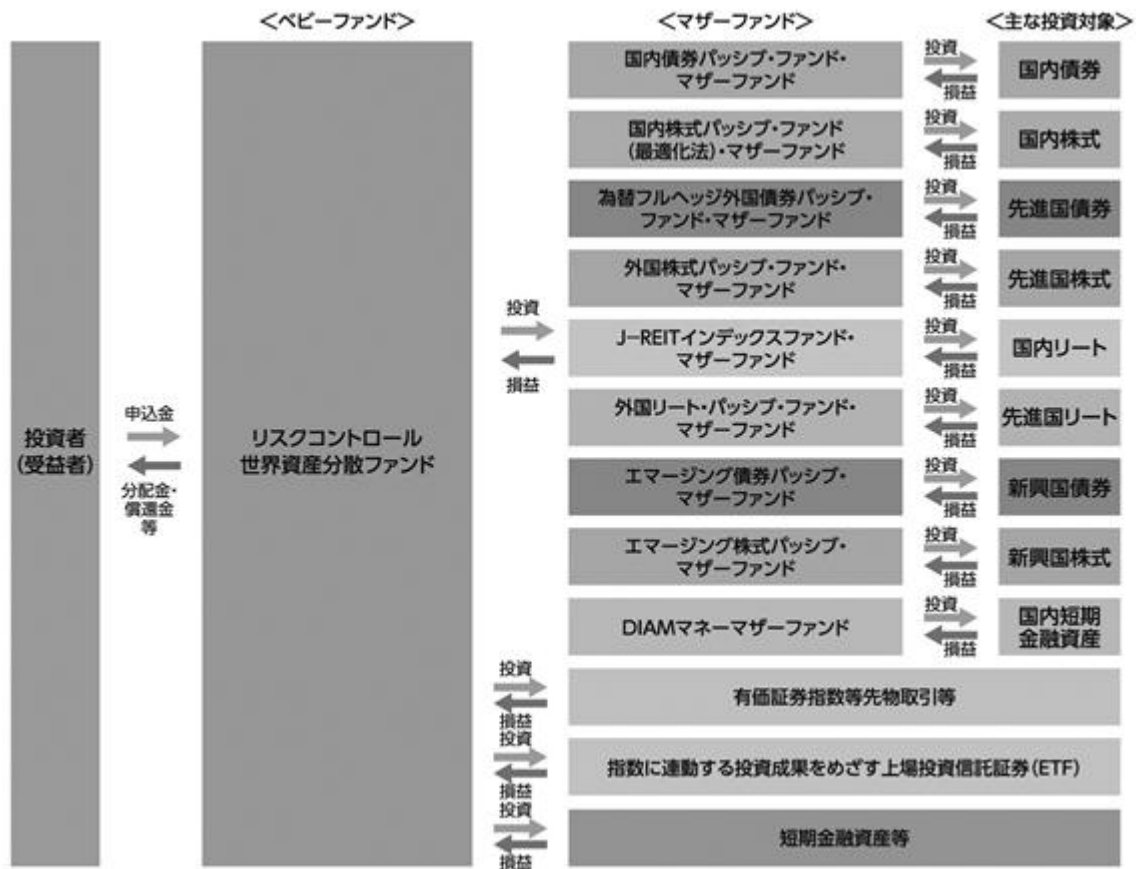
・「募集・販売の取扱い等に関する契約」の概要

委託会社と販売会社との間においては、募集・販売の取扱い等に関する契約を締結しております。当該契約の内容は、証券投資信託の募集・販売の取扱い、一部解約に関する事務、収益分配金の再投資、収益分配金、一部解約金および償還金の受益者への支払い等に関する包括的な規則を定めたものです。

ファミリーファンド方式とは

当ファンドは「ファミリーファンド方式」により運用を行います。

「ファミリーファンド方式」とは、複数のファンドを合同運用する仕組みで、投資者からの資金をまとめてベビーファンド（当ファンド）とし、その資金の全部または一部をマザーファンド受益証券に投資して、その実質的な運用を各マザーファンドにて行う仕組みです。



委託会社の概況

名称：アセットマネジメントOne株式会社

本店の所在の場所：東京都千代田区丸の内一丁目8番2号

資本金の額

20億円（2019年5月31日現在）

委託会社の沿革

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

2016年10月1日 D I A Mアセットマネジメント株式会社、みずほ投信投資顧問株式会社、新光投信株式会社、みずほ信託銀行株式会社(資産運用部門)が統合し、商号をアセットマネジメントOne株式会社に変更

大株主の状況

(2019年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】

<基本方針>

この投資信託は、信託財産の成長を図ることを目的として運用を行います。

<投資対象>

「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド」受益証券、「為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「外国株式パッシブ・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、「外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「エマージング債券パッシブ・マザーファンド」受益証券、「エマージング株式パッシブ・マザーファンド」受益証券を主要投資対象とします。なお、有価証券指数等先物取引等、指数に連動する投資成果をめざす上場している投資信託証券(ETF)に投資する場合があります。また、「DIAMマネーマザーファンド」受益証券や短期金融資産等に投資する場合があります。

<投資態度>

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

- ・国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
- ・国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド
- ・為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
- ・外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
- ・J-REITインデックスファンド・マザーファンド
- ・外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド
- ・エマージング債券パッシブ・マザーファンド

・エマージング株式パッシブ・マザーファンド

(上記マザーファンドおよびDIAMマネーマザーファンドを以下「各マザーファンド」、または総称して「マザーファンド」ということがあります。)

上記のほか、DIAMマネーマザーファンドや短期金融資産等に投資する場合があります。

一部のマザーファンドへの投資配分比率がゼロとなる場合があります。

各資産への基本配分比率は、統計的手法を用い、資産価格に影響を与える「変動要因」の偏りをなくすように資産配分比率、および通貨配分比率を決定します。その後各資産のトレンドを勘案し、ポートフォリオの変動リスクが2%程度¹となるよう最終的に基本配分比率を決定します²。基本配分比率は原則月次で見直しますが、経済環境、運用環境の大きな変化などにより委託会社が必要と判断した場合には、適宜見直しを行うことがあります。

1 上記数値は目標値であり、常にリスク水準が一定であること、あるいは目標値が達成されることのいずれを約束するものではありません。また、上記数値は基本資産配分に基づくポートフォリオの長期的なリスク水準の目標を表すものであり、年率2%程度の収益を目標とすることを意味するものではありません。上記数値が達成されるかどうかを問わず、実際の運用成績がマイナスとなる可能性があります。

2 実質組入外貨建資産は投資環境に応じて弾力的に為替ヘッジを行います。ただし、投資環境によっては、為替予約取引の売建を、実質組入外貨建資産の額を超えて行う場合があります。

基準価額の下落を一定水準(下値目安値^(*))までに抑えることを目標に、基準価額の水準や市場環境等に応じて投資対象資産の合計資産比率^(**)を機動的に変更します。下値目安値は、毎営業日、委託会社の判断により過去1年間の基準価額の最高値から一定の水準に設定します。ただし、当該水準は委託会社の判断により今後変更する場合があります。

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

(**) 合計資産比率とは、「DIAMマネーマザーファンド」を除く8つのマザーファンドと有価証券指数等先物取引およびETF等への投資比率の合計をいいます。

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

(2)【投資対象】

投資の対象とする資産の種類(約款第16条)

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ.有価証券

ロ.デリバティブ取引にかかる権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第24条、第25条および第26条に定めるものに限りません。)

ハ.金銭債権

ニ.約束手形

2.次に掲げる特定資産以外の資産

イ.為替手形

運用の指図範囲等（約款第17条第1項）

委託会社は、信託金を、主としてアセットマネジメントOne株式会社を委託会社とし、みずほ信託銀行株式会社を受託会社として締結された親投資信託である国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド、国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド、為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド、外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド、J-REITインデックスファンド・マザーファンド、外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド、エマージング債券パッシブ・マザーファンド、エマージング株式パッシブ・マザーファンド、DIAMマネーマザーファンド（以下総称して「マザーファンド」といいます。）の各受益証券（以下総称して「マザーファンド受益証券」といいます。）を含む次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

1. 株券または新株引受権証書
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券（新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。なお、社債券のうちで、新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの、ならびに会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を総称して以下「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）
6. 資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
8. 協同組織金融機関の優先出資に関する法律に規定する優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
9. 資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
10. コマーシャル・ペーパー
11. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、1.～11.の証券または証書の性質を有するもの
13. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
14. 投資証券、新投資口予約権証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいい、15.で定めるものを除きます。）
15. 投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）または外国投資証券で投資法人債券に類する証券
16. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）

17. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限ります。）
18. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
19. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
20. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
21. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
22. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
23. 外国の者に対する権利で22.の有価証券の性質を有するもの
- なお、1.の証券または証書、12.および18.の証券または証書のうち1.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、2.から6.までの証券ならびに15.の証券ならびに12.および18.の証券または証書のうち2.から6.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、13.の証券および14.の証券を以下「投資信託証券」といいます。

運用の指図範囲等（約款第17条第2項）

委託会社は、信託金を、上記 に掲げる有価証券のほか次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することの指図をすることができます。

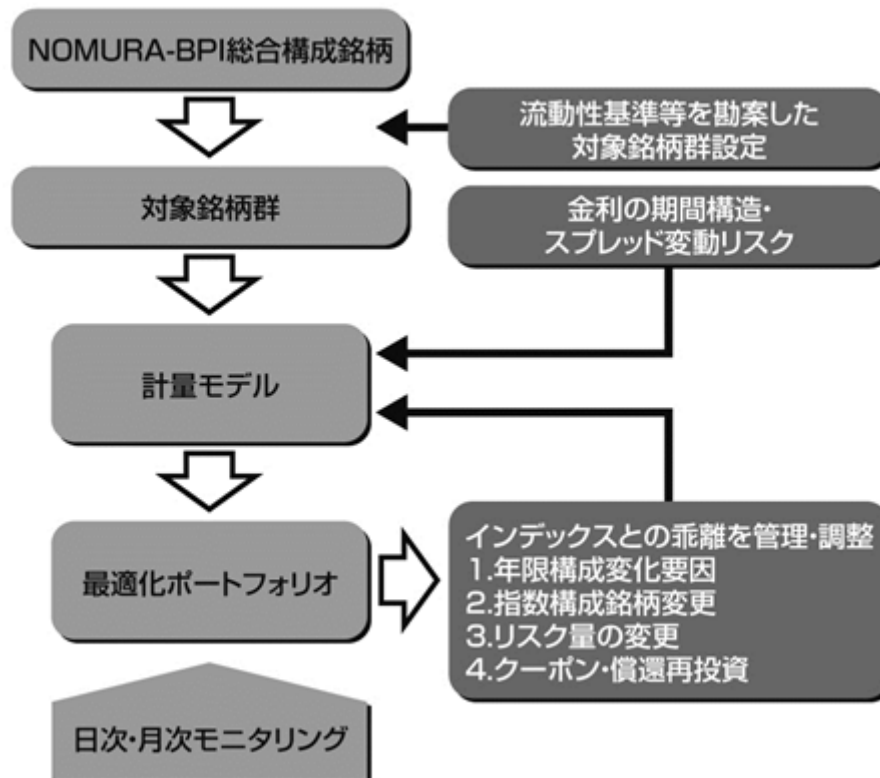
1. 預金
2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
6. 外国の者に対する権利で5.の権利の性質を有するもの

（参考）当ファンドが投資対象とするマザーファンドの概要

ファンド名	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、NOMURA - B P I 総合に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主な投資対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	<p>1. 主としてわが国の公社債に投資し、「NOMURA - B P I 総合」 に連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>2. 公社債（債券先物取引等を含みます。）の組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</p> <p>3. 公社債の組入比率の調整には、債券先物取引等を活用する場合があります。</p> <div style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin-top: 10px;"> <p>NOMURA - B P I 総合の知的財産権その他一切の権利は野村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。</p> </div>

運用プロセス

- 1.流動性基準等による対象銘柄群設定
NOMURA - B P I 総合構成銘柄のうち、流動性基準等を勘案して投資対象銘柄群を設定します。
- 2.最適化法によるポートフォリオの構築
 - 1) 債券種別・格付けから発生するベンチマーク乖離要因
 - 2) 金利の期間構造、スプレッドの期間構造から発生するベンチマーク乖離要因
 1)、2) が最小になると判断されるポートフォリオを構築します。
- 3.インデックスとの乖離を管理
日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。
インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。
 - ・ 年限構成変化要因 ・ 指数構成銘柄変更
 - ・ リスク量の変更 ・ クーポン、償還再投資



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

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

投資態度	<p>1.主として東京証券取引所第1部に上場されている株式に投資し、「東証株価指数(TOPIX)(配当込み)」に連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>2.最適化法によるポートフォリオ構築を行い、運用コストの最小化と徹底したリスク管理を行います。</p> <p>3.株式(株価指数先物取引を含みます。)の組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</p> <p>4.株式の組入比率の調整には、株価指数先物取引等を活用します。</p> <p>5.非株式割合は原則として信託財産総額の50%以下とします。また、外貨建資産割合は原則として信託財産総額の10%以下とします。</p> <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>
------	--

運用プロセス

1.流動性基準による対象銘柄群設定

マーケットインパクトの低減を図る為、TOPIX採用銘柄のうち、流動性が低い銘柄を除外して投資対象銘柄群を設定します。

2.最適化法によるポートフォリオの構築

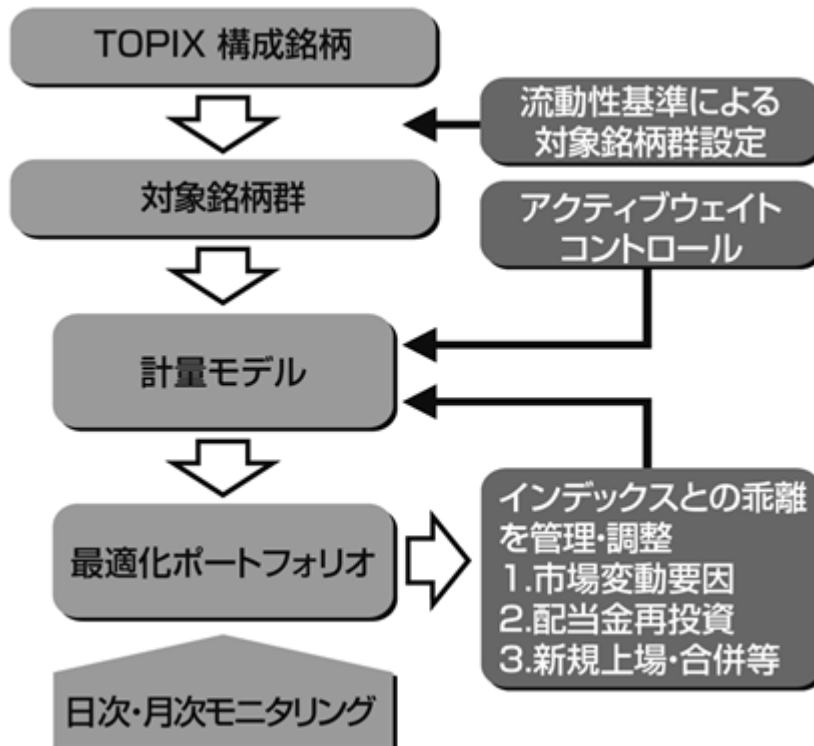
インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差（アクティブウェイト）を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。

3.インデックスとの乖離を管理

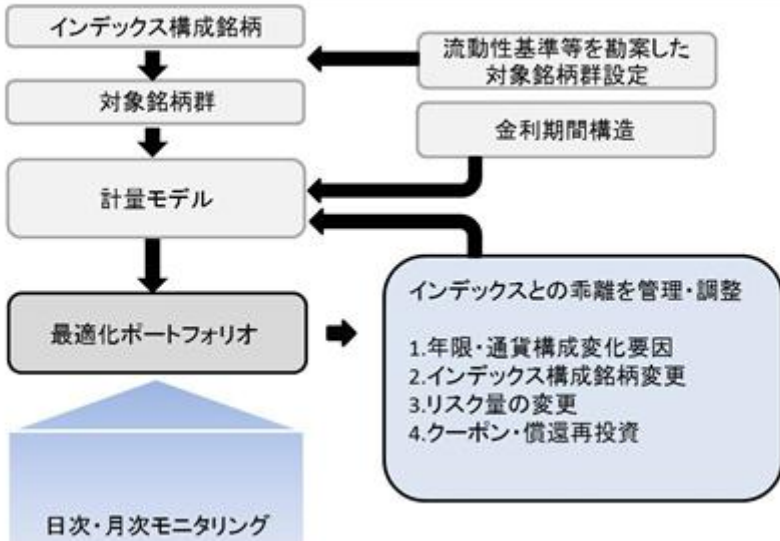
日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。

インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。

- ・市場変動に伴うもの：推定トラッキングエラーの増加に伴い実施
- ・新規上場、合併等に伴うもの：指数に与える影響を勘案し、決定
- ・配当金再投資に伴うもの：キャッシュ比率の上昇に伴い実施



主な投資制限	<ol style="list-style-type: none">1. 株式への投資割合には、制限を設けません。2. デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます。)は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。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。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。
--------	---

ファンド名	為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を図ることを目的として運用を行います。
主な投資対象	海外の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	<p>1.主に日本を除く世界主要国の公社債に投資し、「FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジあり）」に連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>2.外国債券への投資は原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</p> <p>3.外貨建資産の為替リスクは原則フルヘッジとします。</p> <div style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin-top: 10px;"> <p>FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。</p> <p>このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。</p> </div>
運用プロセス	<p>流動性基準等を勘案した投資対象銘柄群を設定し、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。</p>  <pre> graph TD A[インデックス構成銘柄] --> B[対象銘柄群] B --> C[計量モデル] D[流動性基準等を勘案した対象銘柄群設定] --> C E[金利期間構造] --> C C --> F[最適化ポートフォリオ] F --> G[日次・月次モニタリング] F --> H[インデックスとの乖離を管理・調整] H --> I["1.年限・通貨構成変化要因 2.インデックス構成銘柄変更 3.リスク量の変更 4.クーポン・償還再投資"] </pre>

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

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

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

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

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

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

る者または団体も、事前にMSCIの書面による承認を得ることなくMSCIとの関係を主張することはできません。

運用プロセス

1.流動性基準による対象銘柄群設定

取引コスト、マーケットインパクトの低減を図る為、MSCIコクサイ・インデックス構成銘柄のうち、流動性が著しく低くかつ時価総額比率が小さい銘柄を除外して投資銘柄群を設定します。

2.最適化法によるポートフォリオの構築

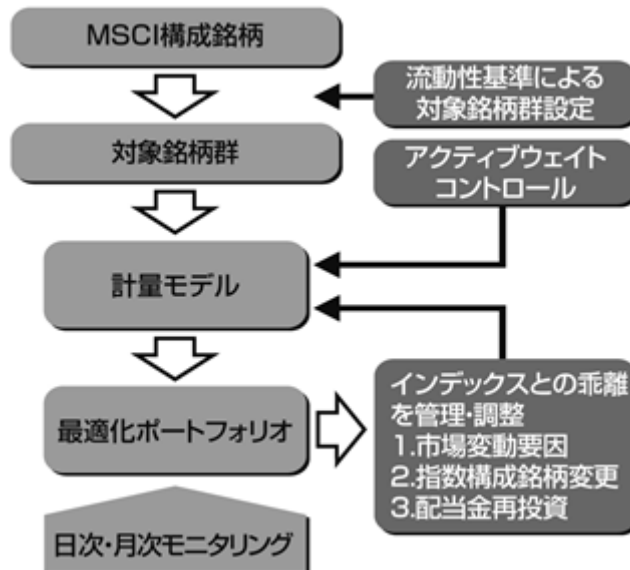
インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差(アクティブウェイト)を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。

3.インデックスとの乖離を管理

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

インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。

- ・市場変動に伴うもの：推定トラッキングエラーの増加に伴い実施
- ・ベンチマーク構成銘柄の変更に伴うもの：四半期に一度の銘柄入替、コーポレートアクションおよび指数構築手法の変更に伴い実施
- ・配当金再投資に伴うもの：キャッシュ比率の上昇に伴い実施



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

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

投資態度

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

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

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

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

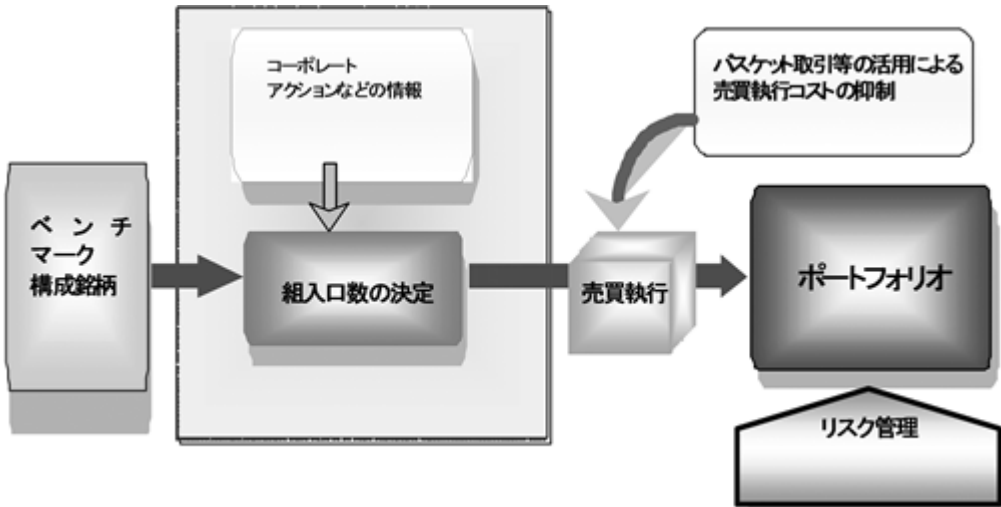
株東京証券取引所は、東証REIT指数の指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、株東京証券取引所は、東証REIT指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。

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

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

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

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

運用プロセス	<ul style="list-style-type: none"> ・原則としてベンチマーク構成全銘柄をその構成比率で保有します。ベンチマーク構成銘柄および採用予定銘柄を投資対象銘柄とします。 ・新規上場、公募増資、第三者割当等ベンチマーク構成の変更情報を事前に取得し、最適な執行方法によりリバランスを実施します。 ・配当金入金等によりキャッシュ比率が上昇した場合にもリバランスを実施します。 
主な投資制限	<p>投資信託証券への投資割合には制限を設けません。</p> <p>同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として信託財産の純資産総額の30%を超えないものとします。ただし、東証REIT指数採用の不動産投資信託証券の上場時価総額の合計額に占める同一銘柄の不動産投資信託証券の時価総額の割合が30%を超えている場合、当該同一銘柄の不動産投資信託証券への投資割合は、原則として当該同一銘柄の不動産投資信託証券の時価総額が東証REIT指数採用の不動産投資信託証券の上場時価総額の合計額に占める割合の範囲で投資することができるものとします。</p> <p>株式への投資は行いません。</p> <p>外貨建資産への投資は行いません。</p> <p>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>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
基本方針	この投資信託は、S & P 先進国 REIT インデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）に連動する投資成果をめざして運用を行います。

主な投資対象	日本を除く世界各国の不動産投資信託証券を主要投資対象とします。 海外の証券取引所に上場(これに準ずるものを含まず。)されている不動産投資信託証券とします。
投資態度	1.主に日本を除く世界各国の不動産投資信託証券を主要投資対象とし、S & P 先進国REITインデックス(除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)に連動する投資成果をめざして運用を行います。 2.不動産投資信託証券への投資割合は、原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。 3.外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。ただし、金利・為替状況によってはヘッジを行う場合があります。

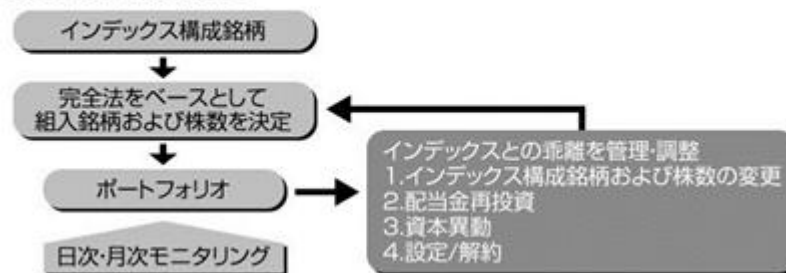
S & P 先進国 R E I T インデックスは、S&P Globalの一部門であるS&Pダウ・ジョーンズ・インデックスLLCまたはその関連会社(「SPDJI」)の商品であり、これを利用するライセンスが委託会社に付与されています。Standard & Poor's®およびS&P®は、S&P Globalの一部門であるスタンダード・プアーズ・ファイナンシャル・サービシーズLLC(「S&P」)の登録商標で、Dow Jones®は、ダウ・ジョーンズ・トレードマーク・ホールディングズLLC(「Dow Jones」)の登録商標です。指数に直接投資することはできません。本商品は、SPDJI、Dow Jones、S&P、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

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

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

運用プロセス

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



主な投資制限

1. 投資信託証券への投資割合には制限を設けません。
2. 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
3. 株式への直接投資は行いません。
4. 同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として信託財産の純資産総額の30%以内とします。ただし、S & P 先進国 REITインデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）における時価の構成割合が30%を超える不動産投資信託証券がある場合には、指数との連動性を維持するために当該不動産投資信託証券をS & P 先進国 REITインデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）の構成割合の範囲で組入れることができるものとします。
5. デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。
6. 外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。
7. 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

ファンド名

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

基本方針	この投資信託は、主として新興国の債券に投資し、JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス(円換算ベース・為替ヘッジなし)の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。
主な投資対象	新興国の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	<p>1.主として新興国の債券に投資し、JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス(円換算ベース・為替ヘッジなし)の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>2.原則として、新興国の債券の組入比率は高位を維持します。</p> <p>3.組入債券は、当初組入時において、S&PもしくはMoody'sの外貨建て長期格付がBB-格もしくはBa3格以上を取得している債券とします。但し、両社が格付を付与している場合には、どちらか低い方の格付を基準とします。また、当ファンドが保有する債券の格付が上記基準未滿となった場合は、当該債券を速やかに売却するものとします。</p> <p>4.外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。</p> <div style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin-top: 10px;"> <p>JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラスに関する著作権等の知的財産その他一切の権利はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。</p> </div>
運用プロセス	<p>信用格付基準等を勘案した投資対象銘柄群を設定し、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。</p> <pre> graph TD A[インデックス構成銘柄] --> B[対象銘柄群] B --> C[計量モデル] C --> D[最適化ポートフォリオ] E[信用格付基準等を勘案した対象銘柄群設定] --> B F[金利期間構造] --> C D --> G[日次・月次モニタリング] H[インデックスとの乖離を管理・調整] --> D I["1. 年限・通貨構成変化要因 2. インデックス構成銘柄変更 3. リスク量の変更 4. クーポン・償還再投資"] --> H </pre>

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

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

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

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

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

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

	る者または団体も、事前にMSCIの書面による承認を得ることなくMSCIとの関係を主張することはできません。
運用プロセス	<p>現地口座の開設可否、預託証券の利用可否を基準に投資対象銘柄群を設定し、インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差(アクティブウェイト)を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用いて、インデックスとの乖離を抑えます。 日々・月次レベルでインデックスとの乖離を管理して、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。</p> <pre> graph TD A[MSCI構成銘柄] --> B[対象銘柄群] B --> C[計量モデル] C --> D[最適化ポートフォリオ] D --> E[日々・月次モニタリング] F[アクティブウェイトコントロール] --> C F --> D G["インデックスとの乖離を管理・調整 1.市場変動要因 2.指数構成銘柄変更 3.配当金再投資"] --> D </pre>
主な投資制限	<ol style="list-style-type: none"> 株式への投資割合には、制限を設けません。 外貨建資産への投資には、制限を設けません。 投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 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。 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。

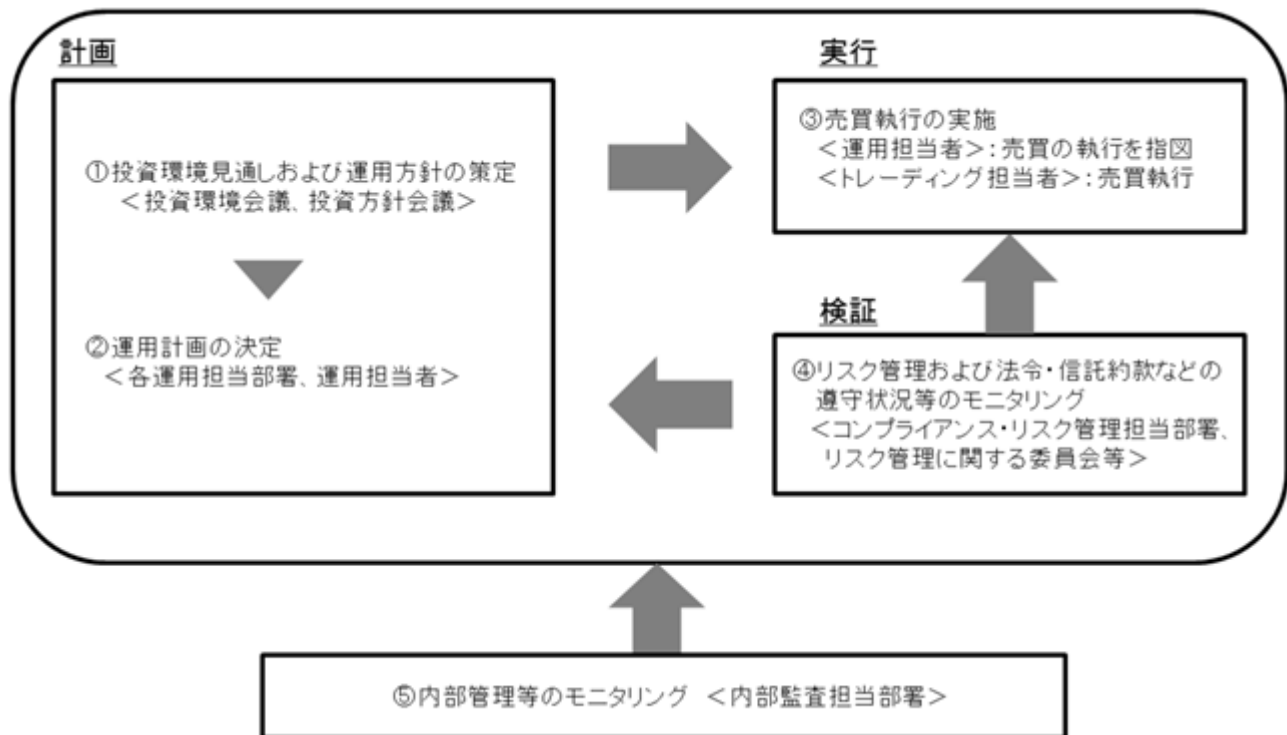
ファンド名	D I A Mマネーマザーファンド
基本方針	この投資信託は、安定した収益の確保をめざします。
主な投資対象	国内発行体の公社債、転換社債、ユーロ円債、資産担保証券ならびにCD、CP、コールローン等の国内短期金融資産を主要投資対象とします。

投資態度	<p>国内の国債、政府保証債、政府機関債、地方債等のほか、取得時において主要格付機関^(*)の長期発行体格付(複数の格付機関が付与している場合は高い方の格付)がAA-格相当以上の社債、転換社債、ユーロ円債、資産担保証券、さらに、国内格付機関の短期格付がa-1格相当以上のCD、CPを主要投資対象とします。</p> <p>(*)主要格付機関とは、R&I、JCR、Moody's、S&Pとします。</p> <p>国債および政府保証債を除き、原則として、ファンドの元本総額に対する1発行体当たりの有価証券の額面総額の割合は5%以内とします。</p> <p>ポートフォリオ全体の修正デュレーションは1年未満を基本として運用します。</p>
運用プロセス	<p>マクロ経済分析を主体としたファンダメンタルズ分析、投資家の需給動向等分析および信用リスク市場の分析等に基づき、短期金利の方向性見通し、セクター別のクレジットスプレッドの拡縮等を予測し、ファンドのデュレーションおよびセクター配分を決定します(トップダウンアプローチ)。</p>
主な投資制限	<p>株式への投資割合は、純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の株式への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>新株引受権証券及び新株予約権証券への投資割合は、取得時において、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建て資産への投資は行いません。</p> <p>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>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>

資金動向、市況動向等によっては、上記の運用ができない場合があります。

(3) 【運用体制】

a. ファンドの運用体制



投資環境見通しおよび運用方針の策定

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

運用計画の決定

各ファンドの運用は「投資環境会議」および「投資方針会議」における協議の内容を踏まえて、ファンド毎に個別に任命された運用担当者が行います。運用担当者は月次で運用計画書を作成し、運用本部長の承認を受けます。運用担当者は承認を受けた運用計画に基づき、運用を行います。

売買執行の実施

運用担当者は、売買計画に基づいて売買の執行を指図します。トレーディング担当者は、最良執行をめざして売買の執行を行います。

モニタリング

運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署（人数60～70人程度）は、運用に関するパフォーマンス測定、リスク管理および法令・信託約款などの遵守状況等のモニタリングを実施し、必要に応じて対応を指示します。

定期的で開催されるリスク管理に関する委員会等において運用リスク管理状況、運用実績、法令・信託約款などの遵守状況等について検証・報告を行います。

内部管理等のモニタリング

内部監査担当部署（人数10～20人程度）が運用、管理等に関する業務執行の適正性・妥当性・効率性等の観点からモニタリングを実施します。

b．ファンドの関係法人に関する管理

当ファンドの関係法人である受託会社に対して、その業務に関する委託会社の管理担当部署は、内部統制に関する外部監査人による報告書等の定期的な提出を求め、必要に応じて具体的な事項に関するヒアリングを行う等の方法により、適切な業務執行体制にあることを確認します。

c．運用体制に関する社内規則

運用体制に関する社内規則として運用管理規程および職務責任権限規程等を設けており、運用担当者の任務と権限の範囲を明示するほか、各投資対象の取り扱いに関して基準を設け、ファンドの商品性に則った適切な運用の実現を図ります。

また、売買執行、投資信託財産管理および法令遵守チェック等に関する各々の規程・内規を定めています。

運用体制は2019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。

上記体制は、マザーファンドを通じた実質的な運用体制を記載しております。

（４）【分配方針】

収益分配方針

毎決算時（原則として毎年11月11日（休業日の場合は翌営業日））に、原則として以下の方針に基づき収益の分配を行います。

- (1) 分配対象額の範囲は、繰越分を含めた経費控除後の配当等収益（マザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち、信託財産に属するとみなした額（以下「みなし配当等収益」といいます。）を含みます。）および売買益（評価益を含み、みなし配当等収益を控除して得た額）等の全額とします。
- (2) 分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して、決定します。ただし、分配対象額が少額の場合は分配を行わない場合があります。
- (3) 留保益の運用については、特に制限を設けず、運用の基本方針に基づいて運用を行います。

収益の分配方式

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

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

金額を控除し、繰越欠損金のあるときはその全額を売買益をもって補填した後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。

(2)上記(1)の1)および2)におけるみなし配当等収益とは、マザーファンドの信託財産にかかる配当等収益の額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占めるこの信託の信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

(3)毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

収益分配金の支払い

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

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

(5)【投資制限】

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

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

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

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

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

デリバティブ取引の利用はヘッジ目的に限定します。(約款「運用の基本方針」2.運用方法(3)投資制限)

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

投資する株式等の範囲(約款第20条)

1)委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者

割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。

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

信用取引の指図範囲(約款第23条)

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

先物取引等の運用指図(約款第24条)

- 1)委託会社は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。)ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします(以下同じ。)。
- 1.先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする有価証券(以下「ヘッジ対象有価証券」といいます。)の時価総額の範囲内とします。
 - 2.先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象有価証券の組入可能額(信託財産の組入ヘッジ対象有価証券を差引いた額)に信託財産が限月までに受取る組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券、組入貸付債権信託受益権、組入抵当証券および組入指定金銭信託の受益証券の利払金および償還金を加えた額を限度とし、かつ信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに上記(2)投資対象 運用の指図範囲等1.~4.に掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。
 - 3.コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、 で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

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

- 1.先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の売予約と合せてヘッジ対象とする外貨建資産の時価総額とマザーファンドの信託財産に属するヘッジ対象とする外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占めるヘッジ対象とする外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。)との合計額の範囲内とします。
- 2.先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の買予約と合せて、外貨建有価証券の買付代金等実需の範囲内とします。
- 3.コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点の保有外貨建資産の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

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

- 1.先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする金利商品(信託財産が1年以内に受取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに上記(2)投資対象 運用の指図範囲等1.~4.に掲げる金融商品で運用されているものをいい、以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。)の時価総額の範囲内とします。
- 2.先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに上記(2)投資対象 運用の指図範囲等1.~4.に掲げる金融商品で運用している額(以下2.において「金融商品運用額等」といいます。)の範囲内とします。ただし、ヘッジ対象金利商品が外貨建で、信託財産の外貨建資産組入可能額(約款上の組入可能額から保有外貨建資産の時価総額を差引いた額をいいます。以下同じ。)に信託財産が限月までに受取る外貨建組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに外貨建組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額が当該金融商品運用額等の額より少ない場合には外貨建資産組入可能額に信託財産が限月までに受取る外貨建組入有価証券にかかる利払金および償還金等を加えた額を限度とします。
- 3.コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点のヘッジ対象金利商品の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

スワップ取引の運用指図(約款第25条)

- 1)委託会社は、信託財産に属する資産の価格変動リスクや為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利、または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行うことの指図をすることができます。
- 2)スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

- 3) スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。以下3)において同じ。)が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、当該純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。
- 4) 上記3)においてマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- 5) スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- 6) 委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供または受入れが必要と認めるときは、担保の提供または受入れの指図を行うものとします。

金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図(約款第26条)

- 1) 委託会社は、信託財産に属する資産の価格変動リスクや為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。
- 2) 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 3) 金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(「金利先渡取引の想定元本の合計額」といいます。以下3)において同じ。)が、信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額とマザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(「ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額」といいます。以下3)において同じ。)を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額が減少して、金利先渡取引の想定元本の合計額がヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかにその超える額に相当する金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
- 4) 上記3)においてマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- 5) 為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(「為替先渡取引の想定元本の合計額」といいます。以下5)において同

じ。)が、信託財産にかかるヘッジ対象とする外貨建資産(「ヘッジ対象外貨建資産」といいます。以下5)において同じ。)の時価総額とマザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(「ヘッジ対象外貨建資産の時価総額の合計額」といいます。以下5)において同じ。)を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、ヘッジ対象外貨建資産の時価総額の合計額が減少して、為替先渡取引の想定元本の合計額がヘッジ対象外貨建資産の時価総額の合計額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかにその超える額に相当する為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。

6)上記5)においてマザーファンドの信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象外貨建資産の時価総額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

7)金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。

8)委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供または受入れが必要と認めるときは、担保の提供または受入れの指図を行うものとします。

デリバティブ取引等にかかる投資制限(約款第27条)

デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところにしたがい、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。

有価証券の貸付の指図および範囲(約款第28条)

1)委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の1.2.の範囲内で貸付の指図をすることができます。

1.株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。

2.公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。

2)上記1)1.2.に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。

3)委託会社は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

公社債の空売りの指図および範囲(約款第29条)

1)委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、公社債(信託財産により借入れた公社債を含みます。)の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

2)上記1)の売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内で行うものとします。

- 3) 信託財産の一部解約等の事由により、上記2)の売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。

公社債の借入れの指図および範囲(約款第30条)

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

特別な場合の外貨建有価証券への投資制限(約款第31条)

外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

外国為替予約取引の指図(約款第32条)

- 1) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、または為替変動リスクを回避するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。
- 2) 上記1)の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約とマザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約のうち信託財産に属するとみなした額との合計額と、信託財産にかかる為替の売予約とマザーファンドの信託財産にかかる為替の売予約のうち信託財産に属するとみなした額との合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産(マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額を含みます。)の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- 3) 上記2)においてマザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産にかかる為替の売予約のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる為替の売予約の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- 4) 上記2)の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

資金の借入れ(約款第38条)

- 1) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、および運用の安定性を図るため、一部解約に伴う支払資金の手当て(一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。)を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ(コール市場を通じる場合を含みます。)の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

- 2)一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は、借入れ指図を行う日の信託財産の純資産総額の10%以内における、当該有価証券等の売却代金または解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。
- 3)収益分配金の再投資にかかる借入期間は信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- 4)借入金の利息は信託財産中より支弁します。

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

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

3【投資リスク】

<基準価額の主な変動要因>

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

また、投資信託は預貯金と異なります。

資産配分リスク

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

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

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

株価変動リスク

投資する企業の株価の下落は、基準価額の下落要因となります。

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

金利変動リスク

金利の上昇は、基準価額の下落要因となる可能性があります。

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

不動産投資信託証券(リート)の価格変動リスク

リーートの価格の下落は、基準価額の下落要因となります。

リーートの価格は、リートが投資対象とする不動産等の価値、当該不動産等による賃貸収入の増減、不動産市況の変動、景気や株式市況等の動向、関係法令・規制等の変更等の影響を受けます。また、老朽化・災害等の発生による保有不動産の滅失・損壊等が発生する可能性があります。当ファンドが実質的に投資するリーートの市場価格が下落した場合には、基準価額が下落する要因となります。

為替変動リスク

為替相場の円高は、基準価額の下落要因となります。

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

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

為替ヘッジを行う資産については、為替リスクの低減をめざしますが、為替リスクを完全に排除できるものではなく為替相場の影響を受ける場合があります。また、当ファンドは投資環境によっては、為替予約取引の売建を実質組入外貨建資産の額を超えて行う場合があるため、為替相場の影響を受けます。なお、為替ヘッジには円金利がヘッジ対象通貨の金利よりも低い場合、その金利差相当分程度のコストがかかることにご留意ください。

信用リスク

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

有価証券等の価格は、その発行体に債務不履行等が発生または予想される場合には、その影響を受け変動します。

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

流動性リスク

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

有価証券等を売却または取得する際に市場規模や取引量、取引規制等により、その取引価格が影響を受ける場合があります。一般に市場規模が小さい場合や取引量が少ない場合には、市場実勢から期待できる価格どおりに取引できないことや、値動きが大きくなることがあり、基準価額に影響をおよぼす要因となります。

カントリーリスク

投資する国・地域の政治・経済の不安定化等は、基準価額の下落要因となります。

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

基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

<その他の留意点>

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

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

収益分配金に関する留意点として、以下の事項にご留意ください。

- ・収益分配は、計算期間中に発生した運用収益（経費控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。））を超えて行われる場合があります。したがって、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。
- ・受益者の個別元本の状況によっては、分配金の全額または一部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。個別元本とは、追加型投資信託を保有する受益者毎の取得元本のこと、受益者毎に異なります。

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

当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行います。当該方式は、運用の効率化に資するものですが、一方で、当ファンドが主要投資対象とするマザーファンドに対し、他のベビーファンドにより多額の追加設定・一部解約等がなされた場合には、マザーファンドにおける売買ならびに組入比率の変化等により、当ファンドの基準価額や運用が影響を受ける場合があります。

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

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

当ファンドは、信託契約を解約することが受益者のために有利であると認める場合、受益権口数が10億口を下回ることとなった場合、マザーファンドのベンチマークである対象インデックスが改廃された場合、その他やむを得ない事情が発生した場合は、当初定められていた信託期間の途中でも信託を終了(繰上償還)する場合があります。

当ファンドは過去1年間の基準価額の最高値をもとに下値目安値を毎営業日決定し、合計資産比率を調整します。そのため、基準価額は、長期的に10%以上下落する場合があります。また、相場急変時等においては、基準価額が下値目安値を下回る場合もあります。したがって、損失が常に一定範囲に限定されるわけではないことにご留意ください。

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

注意事項

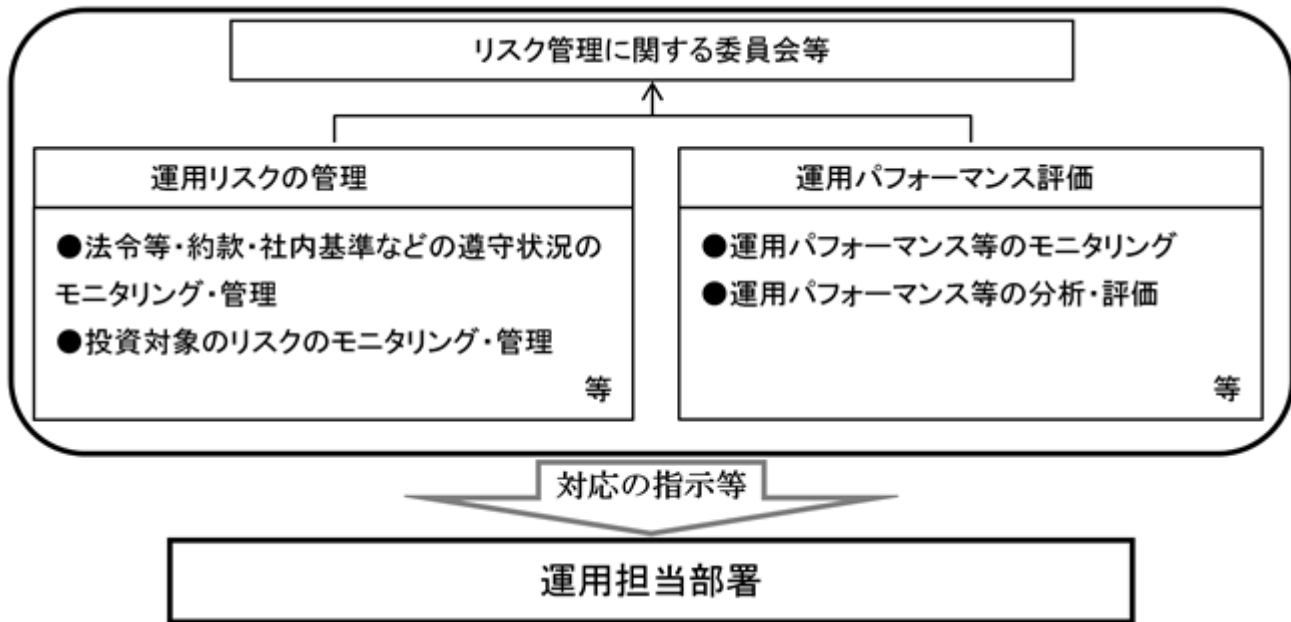
- ・当ファンドは、実質的に債券、株式、不動産投資信託証券(リート)など値動きのある有価証券(外貨建資産には為替変動リスクもあります。)に投資しますので、基準価額は変動します。
- ・投資信託は、預金等や保険契約ではありません。また、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。加えて、証券会社を通して購入していない場合には投資者保護基金の対象にもなりません。
- ・投資信託は、購入金額について元本保証および利回り保証のいずれもありません。
- ・投資信託は、投資した資産の価値が減少して購入金額を下回る場合があり、これによる損失は購入者が負担することとなります。

<リスク管理体制>

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

- ・運用リスクの管理：運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。
- ・運用パフォーマンス評価：運用担当部署から独立したリスク管理担当部署が、ファンドの運用パフォーマンスについて定期的に分析を行い、結果の評価を行います。

- ・リスク管理に関する委員会等：上記のとおり運用リスクの管理状況、運用パフォーマンス評価等の報告を受け、リスク管理に関する委員会等は総合的な見地から運用状況全般の管理・評価を行います。



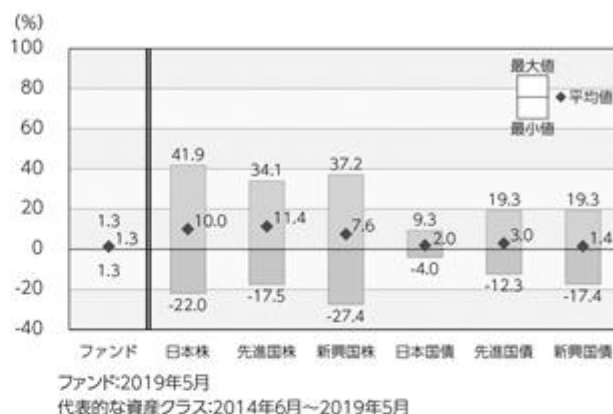
リスク管理体制は2019年5月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

<参考情報>

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



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



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

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

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

*全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

*2019年5月末現在、ファンドの年間騰落率は、1データのみです。

各資産クラスの指数

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

(注)海外の指数は為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

お申込時に、お申込日の翌営業日の基準価額に1.08%^{*}（税抜1.0%）を上限に各販売会社が定める手数料率を乗じて得た額とします。

*消費税率が10%になった場合は、1.1%となります。

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

「分配金再投資コース」により、収益分配金を再投資する場合は、お申込手数料はかかりません。

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

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

(2)【換金（解約）手数料】

ありません。

(3)【信託報酬等】

ファンドの日々の純資産総額に対して年率1.0692%^{*}（税抜0.99%）

*消費税率が10%になった場合は、年率1.089%となります。

支払先	内訳（税抜）	主な役務
委託会社	年率0.48%	信託財産の運用、目論見書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価
販売会社	年率0.48%	購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価
受託会社	年率0.03%	運用財産の保管・管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率

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

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

(4)【その他の手数料等】

・信託財産留保額

ありません。

・その他の費用

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

信託財産に関する租税、特定資産の価格等の調査に要する費用および当該費用にかかる消費税等に相当する金額、信託事務の処理に要する諸費用ならびに受託会社の立て替えた立替金の利息および借入金の利息等は、受益者の負担とし、信託財産から支払われます。

監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用は、受益者の負担とし、毎日計上(ファンドの基準価額に反映)され、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日(休業日の場合は翌営業日)および毎計算期末または信託終了のとき、当該監査に要する費用にかかる消費税等相当額とともに信託財産から支払われます。

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

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

上記の「その他の費用」については、定期的に見直されるものや売買条件等により異なるものがあるため、事前に料率・上限額等を示すことができません。

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

税法が改正された場合等は、上記内容が変更になることがあります。

(5)【課税上の取扱い】

当ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

個人の受益者に対する課税

収益分配時

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

詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

解約時および償還時

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

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

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

損益通算について

解約(換金)時および償還時の差損(譲渡損)については、確定申告を行うことにより上場株式等(上場株式、上場投資信託(ETF)、上場不動産投資信託(REIT)、公募株式投資信託および特定公社債等(公募公社債投資信託を含みます。))など。以下同じ。)の譲渡益ならび

に上場株式等の配当所得および利子所得の金額（配当所得については申告分離課税を選択したものに限り、）との損益通算ならびに3年間の繰越控除の対象とすることができます。また、特定口座（源泉徴収口座）をご利用の場合、その口座内において損益通算を行います（確定申告不要）。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

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

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

法人の受益者に対する課税

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

なお、益金不算入制度の適用はありません。

上記は、2019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。

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

個別元本方式について

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

< 個別元本について >

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

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

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

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

< 収益分配金の課税について >

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

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

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

税法が改正された場合等は、上記内容が変更になることがあります。

5【運用状況】

(1)【投資状況】

令和1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	15,974,490,000	90.02
内 日本	15,974,490,000	90.02
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	1,771,697,057	9.98
純資産総額	17,746,187,057	100.00

その他資産の投資状況

令和1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）	2,690,104,000	15.16
-	2,690,104,000	15.16

（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

令和1年5月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	247,185,211,850	97.78
内 日本	247,185,211,850	97.78
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	5,616,415,917	2.22
純資産総額	252,801,627,767	100.00

その他資産の投資状況

令和1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）	5,587,260,000	2.21
内 日本	5,587,260,000	2.21

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

（注3）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

令和1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	242,927,284,200	81.54
内 日本	242,927,284,200	81.54
地方債証券	21,725,280,280	7.29
内 日本	21,725,280,280	7.29
特殊債券	18,039,698,411	6.06
内 日本	18,039,698,411	6.06
社債券	13,563,200,690	4.55
内 日本	13,158,112,690	4.42
内 フランス	405,088,000	0.14
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	1,652,288,749	0.55
純資産総額	297,907,752,330	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

令和1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	31,793,480,500	97.41
内 日本	31,793,480,500	97.41
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	845,176,478	2.59
純資産総額	32,638,656,978	100.00

その他資産の投資状況

令和1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）	672,867,000	2.06
内 日本	672,867,000	2.06

（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）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

令和1年5月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	337,514,118,450	95.35
内 アメリカ	218,847,204,271	61.83
内 イギリス	21,309,761,954	6.02
内 カナダ	13,243,569,560	3.74
内 フランス	12,933,869,054	3.65
内 スイス	12,806,915,465	3.62
内 ドイツ	11,058,824,037	3.12
内 オーストラリア	8,410,648,755	2.38
内 アイルランド	6,229,798,854	1.76
内 オランダ	6,160,827,238	1.74
内 スペイン	3,920,113,255	1.11
内 香港	3,560,534,784	1.01
内 スウェーデン	3,040,788,313	0.86
内 イタリア	2,352,224,294	0.66
内 デンマーク	2,184,089,905	0.62
内 シンガポール	1,517,656,466	0.43
内 フィンランド	1,479,723,877	0.42
内 バミューダ	1,425,938,364	0.40
内 ベルギー	1,262,641,897	0.36
内 ジャージー	1,077,178,294	0.30
内 ケイマン諸島	889,435,983	0.25
内 ノルウェー	865,539,573	0.24
内 イスラエル	761,200,251	0.22
内 オランダ領キュラソー	465,990,829	0.13
内 ルクセンブルグ	358,443,188	0.10
内 ニュージーランド	294,207,883	0.08
内 オーストリア	279,646,671	0.08
内 パナマ	217,410,496	0.06
内 リベリア	207,105,842	0.06
内 ポルトガル	195,847,650	0.06
内 パプアニューギニア	56,791,123	0.02
内 イギリス領バージン諸島	44,853,240	0.01
内 マン島	40,797,611	0.01
内 モーリシャス	14,539,473	0.00
投資信託受益証券	820,220,752	0.23
内 オーストラリア	675,321,242	0.19
内 シンガポール	144,899,510	0.04
投資証券	8,695,180,998	2.46
内 アメリカ	7,734,706,897	2.19
内 香港	246,433,411	0.07
内 イギリス	232,140,421	0.07
内 オランダ	198,147,913	0.06
内 フランス	194,299,297	0.05
内 カナダ	89,453,059	0.03
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	6,931,349,374	1.96

純資産総額	353,960,869,574	100.00
-------	-----------------	--------

その他資産の投資状況

令和1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)	290,858,280	0.08
-	290,858,280	0.08
為替予約取引(売建)	59,991,500	0.02
-	59,991,500	0.02
株価指数先物取引(買建)	6,715,498,937	1.90
内 アメリカ	4,730,120,740	1.34
内 ドイツ	1,137,375,428	0.32
内 イギリス	417,520,177	0.12
内 カナダ	249,432,832	0.07
内 オーストラリア	181,049,760	0.05

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

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

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

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

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和1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	4,895,545,037	10.29
内 オーストラリア	3,204,151,165	6.74
内 シンガポール	1,665,358,416	3.50
内 カナダ	26,035,456	0.05
投資証券	42,465,648,623	89.27
内 アメリカ	34,594,994,649	72.73
内 イギリス	2,289,624,583	4.81
内 香港	1,171,613,339	2.46
内 フランス	1,053,348,911	2.21
内 オランダ	957,490,838	2.01
内 カナダ	892,747,924	1.88
内 ベルギー	442,353,175	0.93
内 スペイン	335,505,928	0.71
内 ニュージーランド	220,566,828	0.46
内 ドイツ	128,253,711	0.27
内 アイルランド	117,967,389	0.25
内 シンガポール	109,211,138	0.23
内 ガーンジー	90,587,591	0.19
内 イスラエル	32,402,177	0.07
内 イタリア	11,760,577	0.02
内 マン島	11,749,128	0.02
内 韓国	5,470,737	0.01
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	207,388,410	0.44
純資産総額	47,568,582,070	100.00

その他資産の投資状況

令和1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）	709,043,600	1.49
-	709,043,600	1.49

（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

令和1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	354,195,138,059	94.82
内 アメリカ	169,271,935,333	45.32
内 フランス	34,463,867,996	9.23
内 イタリア	29,840,300,148	7.99
内 ドイツ	23,688,946,449	6.34
内 イギリス	22,702,469,348	6.08
内 スペイン	19,837,681,946	5.31
内 ベルギー	8,977,301,068	2.40
内 オランダ	7,658,827,119	2.05
内 オーストラリア	7,129,890,538	1.91
内 カナダ	6,523,160,500	1.75
内 オーストリア	5,683,465,320	1.52
内 アイルランド	2,959,235,898	0.79
内 フィンランド	2,900,823,097	0.78
内 メキシコ	2,741,836,735	0.73
内 ポーランド	2,071,524,956	0.55
内 南アフリカ	1,962,996,096	0.53
内 デンマーク	1,781,402,744	0.48
内 スウェーデン	1,177,720,176	0.32
内 シンガポール	1,153,568,519	0.31
内 マレーシア	1,117,571,489	0.30
内 ノルウェー	550,612,584	0.15
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	19,332,066,240	5.18
純資産総額	373,527,204,299	100.00

その他資産の投資状況

令和1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）	356,575,564,588	95.46
-	356,575,564,588	95.46

（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

令和1年5月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	49,959,206,563	90.01
内 ケイマン諸島	8,024,866,032	14.46
内 韓国	6,162,530,114	11.10
内 中国	5,739,418,585	10.34
内 台湾	5,468,741,857	9.85
内 インド	4,912,897,899	8.85
内 ブラジル	3,842,296,775	6.92
内 南アフリカ	2,908,689,349	5.24
内 ロシア	1,972,153,823	3.55

内 香港	1,762,568,454	3.18
内 タイ	1,469,831,354	2.65
内 マレーシア	1,102,816,384	1.99
内 メキシコ	1,077,714,274	1.94
内 インドネシア	1,054,000,333	1.90
内 フィリピン	582,849,300	1.05
内 ポーランド	560,252,987	1.01
内 カタール	524,405,510	0.94
内 バミューダ	523,751,932	0.94
内 チリ	468,376,876	0.84
内 アラブ首長国連邦	383,415,099	0.69
内 トルコ	246,224,795	0.44
内 コロンビア	213,393,195	0.38
内 アメリカ	168,724,691	0.30
内 ハンガリー	159,605,854	0.29
内 ギリシャ	158,021,581	0.28
内 アルゼンチン	118,076,584	0.21
内 チェコ	78,867,762	0.14
内 エジプト	65,063,950	0.12
内 ルクセンブルグ	48,348,113	0.09
内 オランダ	38,979,185	0.07
内 ペルー	31,643,551	0.06
内 ジャージー	26,731,178	0.05
内 マン島	25,885,374	0.05
内 シンガポール	20,209,933	0.04
内 パキスタン	17,853,880	0.03
新株予約権証券	168,551	0.00
内 タイ	168,551	0.00
投資信託受益証券	262,153,941	0.47
内 メキシコ	243,886,552	0.44
内 アイルランド	18,267,389	0.03
投資証券	36,798,950	0.07
内 メキシコ	36,798,950	0.07
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	5,242,958,762	9.45
純資産総額	55,501,286,767	100.00

その他資産の投資状況

令和1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）	409,419,953	0.74
-	409,419,953	0.74
為替予約取引（売建）	369,960,045	0.67
-	369,960,045	0.67
株価指数先物取引（買建）	4,550,220,259	8.20
内 アメリカ	4,550,220,259	8.20

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

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

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

令和1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	105,812,691,825	96.53
内 メキシコ	16,709,640,527	15.24
内 ブラジル	12,661,560,815	11.55
内 インドネシア	12,590,274,167	11.49
内 ロシア	12,268,986,631	11.19
内 フィリピン	10,827,816,051	9.88
内 コロンビア	10,730,043,730	9.79
内 ハンガリー	6,102,999,713	5.57
内 南アフリカ	5,901,175,284	5.38
内 パナマ	5,687,870,793	5.19
内 ルーマニア	5,094,002,359	4.65
内 ペルー	4,083,904,297	3.73
内 クロアチア	3,154,417,458	2.88
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	3,807,409,683	3.47
純資産総額	109,620,101,508	100.00

その他資産の投資状況

令和1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）	8,801,065,000	8.03
-	8,801,065,000	8.03

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

(2) 【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

令和1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	6,327,320,445	1.3135 8,311,337,433	1.3708 8,673,490,866	- -	48.88%
2	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	1,777,034,135	1.2962 2,303,417,692	1.3183 2,342,664,100	- -	13.20%
3	エマージング債券パッシブ・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	991,212,691	1.8419 1,825,765,631	1.9071 1,890,341,723	- -	10.65%
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	692,422,492	1.2604 872,734,795	1.2780 884,915,944	- -	4.99%
5	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	244,929,621	3.5825 877,480,963	3.4824 852,942,912	- -	4.81%
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	617,919,718	1.1273 696,642,113	1.0861 671,122,605	- -	3.78%
7	J-REITインデックスファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	164,765,051	1.9499 321,285,974	2.0865 343,782,278	- -	1.94%
8	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	133,436,155	2.5480 340,006,510	2.3624 315,229,572	- -	1.78%

(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

令和1年5月31日現在

種類	投資比率
親投資信託受益証券	90.02%
合計	90.02%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

令和1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	1,268,800	6,571.87 8,338,398,200	6,384.00 8,100,019,200	- -	3.20%
2	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	467,000	9,970.05 4,656,013,500	10,250.00 4,786,750,000	- -	1.89%
3	ソニー 日本	株式 電気機器	764,000	4,726.32 3,610,912,800	5,257.00 4,016,348,000	- -	1.59%
4	三菱UFJフィナンシャル・ グループ 日本	株式 銀行業	7,729,700	576.47 4,455,957,390	501.10 3,873,352,670	- -	1.53%
5	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	764,100	4,641.89 3,546,870,000	4,866.00 3,718,110,600	- -	1.47%
6	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	994,000	4,456.51 4,429,777,817	3,669.00 3,646,986,000	- -	1.44%
7	キーエンス 日本	株式 電気機器	55,900	62,257.85 3,480,214,000	61,510.00 3,438,409,000	- -	1.36%
8	三井住友フィナンシャルグ ループ 日本	株式 銀行業	791,500	3,925.23 3,106,819,600	3,783.00 2,994,244,500	- -	1.18%
9	KDDI 日本	株式 情報・通信業	984,500	2,661.60 2,620,349,650	2,788.50 2,745,278,250	- -	1.09%
10	リクルートホールディングス 日本	株式 サービス業	779,500	2,928.37 2,282,666,400	3,468.00 2,703,306,000	- -	1.07%
11	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	960,400	2,994.94 2,876,347,700	2,651.00 2,546,020,400	- -	1.01%
12	任天堂 日本	株式 その他製品	65,100	29,521.90 1,921,875,900	38,700.00 2,519,370,000	- -	1.00%
13	みずほフィナンシャルグル ープ 日本	株式 銀行業	15,256,800	172.97 2,639,028,180	153.70 2,344,970,160	- -	0.93%
14	花王 日本	株式 化学	276,400	8,061.13 2,228,098,600	8,480.00 2,343,872,000	- -	0.93%
15	東海旅客鉄道 日本	株式 陸運業	101,900	23,606.51 2,405,504,300	22,645.00 2,307,525,500	- -	0.91%
16	三菱商事 日本	株式 卸売業	786,900	3,149.25 2,478,145,300	2,833.00 2,229,287,700	- -	0.88%
17	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	401,500	5,344.46 2,145,801,900	5,401.00 2,168,501,500	- -	0.86%
18	東日本旅客鉄道 日本	株式 陸運業	202,400	10,163.95 2,057,184,800	10,310.00 2,086,744,000	- -	0.83%
19	ダイキン工業 日本	株式 機械	155,400	11,793.76 1,832,751,800	13,230.00 2,055,942,000	- -	0.81%
20	ファナック 日本	株式 電気機器	108,200	18,790.96 2,033,182,200	18,475.00 1,998,995,000	- -	0.79%

21	日立製作所 日本	株式 電気機器	512,600	3,506.87 1,797,626,600	3,686.00 1,889,443,600	- -	0.75%
22	キヤノン 日本	株式 電気機器	612,800	3,182.70 1,950,364,000	3,065.00 1,878,232,000	- -	0.74%
23	日本電産 日本	株式 電気機器	137,000	13,159.05 1,802,791,000	13,590.00 1,861,830,000	- -	0.74%
24	信越化学工業 日本	株式 化学	196,500	9,241.43 1,815,942,900	9,047.00 1,777,735,500	- -	0.70%
25	資生堂 日本	株式 化学	226,300	7,215.42 1,632,850,000	7,833.00 1,772,607,900	- -	0.70%
26	NTTドコモ 日本	株式 情報・通信業	707,200	2,553.48 1,805,821,650	2,495.50 1,764,817,600	- -	0.70%
27	HOYA 日本	株式 精密機器	229,200	6,612.40 1,515,563,000	7,558.00 1,732,293,600	- -	0.69%
28	セブン&アイ・ホールディングス 日本	株式 小売業	470,000	4,744.22 2,229,784,500	3,666.00 1,723,020,000	- -	0.68%
29	第一三共 日本	株式 医薬品	325,900	3,642.59 1,187,122,000	5,255.00 1,712,604,500	- -	0.68%
30	オリエンタルランド 日本	株式 サービス業	128,500	11,641.10 1,495,882,100	13,250.00 1,702,625,000	- -	0.67%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

令和1年5月31日現在

種類	投資比率
株式	97.78%
合計	97.78%

(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

令和1年5月31日現在

業種	国内/外国	投資比率
電気機器	国内	12.83%
情報・通信業		8.94%
輸送用機器		7.53%
化学		7.16%
銀行業		5.85%
医薬品		5.42%
サービス業		5.21%
機械		4.88%
卸売業		4.85%
陸運業		4.80%
小売業		4.51%
食料品		4.13%
建設業		2.80%
不動産業		2.42%
保険業		2.27%
その他製品		2.14%
精密機器		2.08%
電気・ガス業		1.69%
その他金融業		1.08%
鉄鋼		0.87%
ガラス・土石製品		0.82%
ゴム製品		0.75%
証券、商品先物取引業		0.74%
非鉄金属		0.72%
繊維製品		0.63%
石油・石炭製品		0.60%
空運業		0.55%
金属製品		0.52%
パルプ・紙		0.27%
鉱業		0.25%
倉庫・運輸関連業		0.20%
海運業	0.15%	
水産・農林業	0.11%	
合計		97.78%

(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

令和1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	125回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	3,000,000,000	100.43 3,013,170,000	100.35 3,010,530,000	0.100000 2020/9/20	1.01%
2	343回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,880,000,000	101.92 2,935,364,000	102.14 2,941,747,200	0.100000 2026/6/20	0.99%
3	350回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,800,000,000	101.55 2,843,405,000	102.18 2,861,096,000	0.100000 2028/3/20	0.96%
4	340回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,700,000,000	103.74 2,801,176,000	103.82 2,803,329,000	0.400000 2025/9/20	0.94%
5	341回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,710,000,000	103.19 2,796,556,000	103.31 2,799,890,700	0.300000 2025/12/20	0.94%
6	344回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,730,000,000	101.91 2,782,306,000	102.18 2,789,623,200	0.100000 2026/9/20	0.94%
7	342回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,730,000,000	101.88 2,781,476,000	102.06 2,786,401,800	0.100000 2026/3/20	0.94%
8	345回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,610,000,000	101.90 2,659,668,300	102.22 2,667,942,000	0.100000 2026/12/20	0.90%
9	332回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,460,000,000	103.76 2,552,496,000	103.67 2,550,306,600	0.600000 2023/12/20	0.86%
10	126回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	2,500,000,000	100.50 2,512,700,000	100.42 2,510,650,000	0.100000 2020/12/20	0.84%
11	328回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,390,000,000	103.15 2,465,285,000	103.05 2,463,086,200	0.600000 2023/3/20	0.83%
12	346回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,370,000,000	101.88 2,414,556,000	102.21 2,422,448,100	0.100000 2027/3/20	0.81%
13	349回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,360,000,000	101.64 2,398,744,800	102.20 2,412,108,800	0.100000 2027/12/20	0.81%
14	351回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,360,000,000	101.40 2,393,205,200	102.15 2,410,787,200	0.100000 2028/6/20	0.81%
15	329回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,270,000,000	104.22 2,365,794,000	104.07 2,362,593,300	0.800000 2023/6/20	0.79%

16	347回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,300,000,000	101.85 2,342,697,000	102.24 2,351,612,000	0.100000 2027/6/20	0.79%
17	335回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,250,000,000	103.76 2,334,651,000	103.74 2,334,330,000	0.500000 2024/9/20	0.78%
18	339回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,240,000,000	103.60 2,320,827,000	103.67 2,322,252,800	0.400000 2025/6/20	0.78%
19	352回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,270,000,000	101.25 2,298,375,000	102.11 2,318,033,200	0.100000 2028/9/20	0.78%
20	130回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	2,300,000,000	100.73 2,316,869,000	100.74 2,317,066,000	0.100000 2021/12/20	0.78%
21	348回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,230,000,000	101.73 2,268,645,900	102.22 2,279,706,700	0.100000 2027/9/20	0.77%
22	334回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,170,000,000	104.10 2,259,155,000	104.07 2,258,492,600	0.600000 2024/6/20	0.76%
23	312回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,200,000,000	102.53 2,255,726,000	102.12 2,246,772,000	1.200000 2020/12/20	0.75%
24	128回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	2,200,000,000	100.63 2,213,948,000	100.57 2,212,650,000	0.100000 2021/6/20	0.74%
25	333回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,100,000,000	103.96 2,183,196,000	103.87 2,181,312,000	0.600000 2024/3/20	0.73%
26	325回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,100,000,000	103.48 2,173,218,000	103.32 2,169,720,000	0.800000 2022/9/20	0.73%
27	338回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,080,000,000	103.41 2,150,970,000	103.51 2,153,153,600	0.400000 2025/3/20	0.72%
28	129回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	2,120,000,000	100.70 2,134,850,500	100.65 2,133,928,400	0.100000 2021/9/20	0.72%
29	135回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	2,100,000,000	101.11 2,123,352,000	101.14 2,124,087,000	0.100000 2023/3/20	0.71%
30	134回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	2,080,000,000	101.01 2,101,028,000	101.07 2,102,276,800	0.100000 2022/12/20	0.71%

(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

令和1年5月31日現在

種類	投資比率
国債証券	81.54%
地方債証券	7.29%
特殊債券	6.06%
社債券	4.55%
合計	99.45%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

J-REITインデックスファンド・マザーファンド

令和1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	3,232	677,182.93 2,188,655,231	742,000.00 2,398,144,000	- -	7.35%
2	ジャパンリアルエステイト投資法人 日本	投資証券	3,338	606,434.06 2,024,276,920	645,000.00 2,153,010,000	- -	6.60%
3	野村不動産マスターファンド投資法人 日本	投資証券	10,385	156,002.64 1,620,087,439	168,400.00 1,748,834,000	- -	5.36%
4	日本リテールファンド投資法人 日本	投資証券	6,308	211,083.32 1,331,513,606	218,600.00 1,378,928,800	- -	4.22%
5	ユナイテッド・アーバン投資法人 日本	投資証券	7,362	174,233.52 1,282,707,191	179,000.00 1,317,798,000	- -	4.04%
6	オリックス不動産投資法人 日本	投資証券	6,651	181,807.82 1,209,203,874	194,600.00 1,294,284,600	- -	3.97%
7	大和ハウスリート投資法人 日本	投資証券	4,479	255,608.20 1,144,869,158	256,600.00 1,149,311,400	- -	3.52%
8	日本プロロジスリート投資法人 日本	投資証券	4,477	232,976.41 1,043,035,432	236,100.00 1,057,019,700	- -	3.24%
9	アドバンス・レジデンス投資法人 日本	投資証券	3,253	299,530.08 974,371,360	314,000.00 1,021,442,000	- -	3.13%
10	GLP投資法人 日本	投資証券	8,271	118,266.21 978,179,825	120,800.00 999,136,800	- -	3.06%
11	日本プライムリアルティ投資法人 日本	投資証券	2,113	424,664.19 897,315,443	464,000.00 980,432,000	- -	3.00%
12	ジャパン・ホテル・リート投資法人 日本	投資証券	10,744	83,460.85 896,703,461	88,100.00 946,546,400	- -	2.90%

13	アクティビア・プロパティーズ投資法人 日本	投資証券	1,754	474,636.40 832,512,251	469,500.00 823,503,000	- -	2.52%
14	ケネディクス・オフィス投資法人 日本	投資証券	1,033	710,678.56 734,130,957	747,000.00 771,651,000	- -	2.36%
15	積水ハウス・リート投資法人 日本	投資証券	8,612	74,888.06 644,936,037	81,100.00 698,433,200	- -	2.14%
16	インヴィンシブル投資法人 日本	投資証券	11,515	50,720.49 584,046,458	57,800.00 665,567,000	- -	2.04%
17	日本アコモデーションファンド投資法人 日本	投資証券	1,109	531,901.64 589,878,927	573,000.00 635,457,000	- -	1.95%
18	大和証券オフィス投資法人 日本	投資証券	770	702,210.26 540,701,901	751,000.00 578,270,000	- -	1.77%
19	森ヒルズリート投資法人 日本	投資証券	3,828	142,526.73 545,592,344	149,500.00 572,286,000	- -	1.75%
20	産業ファンド投資法人 日本	投資証券	4,096	121,475.79 497,564,867	130,100.00 532,889,600	- -	1.63%
21	日本ロジスティクスファンド投資法人 日本	投資証券	2,181	229,594.08 500,744,689	241,800.00 527,365,800	- -	1.62%
22	フロンティア不動産投資法人 日本	投資証券	1,135	451,147.77 512,052,720	458,500.00 520,397,500	- -	1.59%
23	ヒューリックリート投資法人 日本	投資証券	2,698	172,511.98 465,437,327	179,800.00 485,100,400	- -	1.49%
24	ジャパンエクセレント投資法人 日本	投資証券	2,989	151,324.42 452,308,717	161,200.00 481,826,800	- -	1.48%
25	イオンリート投資法人 日本	投資証券	3,426	127,382.65 436,412,989	136,000.00 465,936,000	- -	1.43%
26	日本リート投資法人 日本	投資証券	1,077	371,809.70 400,439,057	424,500.00 457,186,500	- -	1.40%
27	プレミア投資法人 日本	投資証券	3,173	121,788.87 386,436,086	138,500.00 439,460,500	- -	1.35%
28	コンフォリア・レジデンシャル投資法人 日本	投資証券	1,384	278,479.94 385,416,244	297,500.00 411,740,000	- -	1.26%
29	森トラスト総合リート投資法人 日本	投資証券	2,386	165,721.28 395,410,990	172,500.00 411,585,000	- -	1.26%
30	東急リアル・エステート投資法人 日本	投資証券	2,238	161,770.28 362,041,889	177,100.00 396,349,800	- -	1.21%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

令和1年5月31日現在

種類	投資比率
投資証券	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。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和1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	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフトウェア	642,913	11,745.85 7,551,564,936	13,749.83 8,839,946,254	- -	2.50%
2	APPLE INC アメリカ	株式 コンピュー タ・周辺機器	416,132	18,692.47 7,778,536,271	19,498.88 8,114,111,261	- -	2.29%
3	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 インターネッ ト販売・通信 販売	36,862	178,150.50 6,566,983,968	198,632.75 7,322,000,622	- -	2.07%
4	FACEBOOK INC アメリカ	株式 インタラク ティブ・メ ディアおよび サービス	210,585	17,967.51 3,783,689,715	20,013.97 4,214,642,630	- -	1.19%
5	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	235,372	14,683.71 3,456,136,161	14,447.54 3,400,548,644	- -	0.96%
6	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	289,205	11,208.27 3,241,489,820	11,708.08 3,386,035,739	- -	0.96%
7	ALPHABET INC-CL C アメリカ	株式 インタラク ティブ・メ ディアおよび サービス	27,628	122,655.54 3,388,727,462	122,259.01 3,377,771,983	- -	0.95%
8	ALPHABET INC-CL A アメリカ	株式 インタラク ティブ・メ ディアおよび サービス	26,536	123,500.62 3,277,212,544	122,637.39 3,254,305,982	- -	0.92%
9	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	376,291	8,329.04 3,134,143,884	7,870.63 2,961,650,695	- -	0.84%
10	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	270,292	9,603.16 2,595,657,594	10,686.71 2,888,532,489	- -	0.82%
11	VISA INC アメリカ	株式 情報技術サー ビス	154,312	15,702.90 2,423,147,248	17,799.43 2,746,666,197	- -	0.78%
12	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品	221,066	10,787.11 2,384,663,904	11,518.88 2,546,434,671	- -	0.72%
13	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 各種金融サー ビス	115,267	22,161.93 2,554,539,938	21,843.56 2,517,842,368	- -	0.71%
14	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 銀行	810,849	3,103.86 2,516,767,696	2,970.21 2,408,397,970	- -	0.68%
15	THE WALT DISNEY CO アメリカ	株式 娯楽	158,993	12,218.08 1,942,589,729	14,457.39 2,298,624,126	- -	0.65%

16	CISCO SYSTEMS INC アメリカ	株式 通信機器	388,533	5,297.60 2,058,295,376	5,858.41 2,276,187,632	- -	0.64%
17	VERIZON COMM INC アメリカ	株式 各種電気通信 サービス	365,019	5,924.23 2,162,459,301	6,214.92 2,268,567,095	- -	0.64%
18	UNITEDHEALTH GROUP INC アメリカ	株式 ヘルスケア・ プロバイ ダー/ヘルス ケア・サービ ス	85,014	28,945.73 2,460,792,309	26,629.15 2,263,851,408	- -	0.64%
19	PFIZER INC アメリカ	株式 医薬品	491,623	4,589.39 2,256,252,355	4,582.18 2,252,707,044	- -	0.64%
20	AT&T INC アメリカ	株式 各種電気通信 サービス	643,662	3,266.18 2,102,322,270	3,484.20 2,242,653,319	- -	0.63%
21	MASTERCARD INC アメリカ	株式 情報技術サー ビス	80,427	24,112.51 1,939,297,394	27,798.21 2,235,727,311	- -	0.63%
22	CHEVRON CORP アメリカ	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	167,704	12,921.78 2,167,034,468	12,617.95 2,116,081,827	- -	0.60%
23	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 専門小売り	99,862	20,537.92 2,050,958,396	20,896.50 2,086,767,161	- -	0.59%
24	MERCK & CO. INC. アメリカ	株式 医薬品	228,496	8,633.98 1,972,830,917	8,713.80 1,991,069,541	- -	0.56%
25	INTEL CORP アメリカ	株式 半導体・半導 体製造装置	397,345	5,547.15 2,204,134,225	4,891.67 1,943,681,728	- -	0.55%
26	COCA-COLA CO/THE アメリカ	株式 飲料	358,678	4,994.19 1,791,306,933	5,385.97 1,931,832,534	- -	0.55%
27	WELLS FARGO & CO アメリカ	株式 銀行	382,232	5,301.19 2,026,287,620	4,926.66 1,883,130,162	- -	0.53%
28	COMCAST CORP-CL A アメリカ	株式 メディア	399,325	4,085.45 1,631,422,845	4,564.68 1,822,793,396	- -	0.51%
29	NOVARTIS AG-REG SHS スイス	株式 医薬品	192,356	8,541.70 1,643,048,819	9,444.72 1,816,749,945	- -	0.51%
30	BOEING CO アメリカ	株式 航空宇宙・防 衛	47,433	44,670.79 2,118,869,974	38,261.78 1,814,871,162	- -	0.51%

(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

令和1年5月31日現在

種類	投資比率
株式	95.35%
投資信託受益証券	0.23%
投資証券	2.46%
合計	98.04%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

令和1年5月31日現在

業種	国内/外国	投資比率
銀行	外国	7.81%
石油・ガス・消耗燃料		5.63%
医薬品		5.35%
ソフトウェア		5.29%
情報技術サービス		4.16%
保険		3.92%
インタラクティブ・メディアおよびサービス		3.26%
資本市場		2.77%
半導体・半導体製造装置		2.69%
ヘルスケア機器・用品		2.66%
コンピュータ・周辺機器		2.58%
インターネット販売・通信販売		2.56%
航空宇宙・防衛		2.29%
化学		2.22%
各種電気通信サービス		2.11%
飲料		2.08%
電力		1.99%
食品		1.99%
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス		1.89%
ホテル・レストラン・レジャー		1.86%
バイオテクノロジー		1.80%
専門小売り		1.63%
機械		1.52%
食品・生活必需品小売り		1.47%
娯楽		1.43%
繊維・アパレル・贅沢品		1.42%
金属・鉱業		1.38%
家庭用品		1.37%
コングロマリット		1.34%
メディア		1.28%
陸運・鉄道		1.12%
総合公益事業		1.09%
各種金融サービス		0.96%
通信機器		0.96%
タバコ		0.91%
自動車		0.78%
専門サービス		0.76%
ライフサイエンス・ツール/サービス		0.76%

パーソナル用品	0.76%
電気設備	0.68%
不動産管理・開発	0.57%
電子装置・機器・部品	0.50%
消費者金融	0.50%
商業サービス・用品	0.49%
複合小売り	0.48%
航空貨物・物流サービス	0.45%
建設関連製品	0.40%
家庭用耐久財	0.37%
建設・土木	0.34%
エネルギー設備・サービス	0.31%
無線通信サービス	0.29%
建設資材	0.28%
自動車部品	0.28%
容器・包装	0.27%
商社・流通業	0.26%
運送インフラ	0.21%
ガス	0.18%
ヘルスケア・テクノロジー	0.12%
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.10%
旅客航空輸送業	0.09%
水道	0.09%
紙製品・林産品	0.08%
販売	0.07%
海運業	0.05%
レジャー用品	0.05%
各種消費者サービス	0.01%
合計	95.35%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和1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	112,628	18,984.63 2,138,201,600	17,831.14 2,008,286,536	- -	4.22%
2	PROLOGIS INC アメリカ	投資証券	229,799	7,307.99 1,679,370,896	8,018.27 1,842,591,622	- -	3.87%
3	PUBLIC STORAGE アメリカ	投資証券	54,720	23,664.26 1,294,908,454	25,509.31 1,395,869,640	- -	2.93%
4	WELLTOWER INC アメリカ	投資証券	140,896	7,593.12 1,069,841,021	8,831.91 1,244,381,298	- -	2.62%
5	EQUITY RESIDENTIAL アメリカ	投資証券	134,919	7,478.06 1,008,932,402	8,291.67 1,118,704,526	- -	2.35%
6	AVALONBAY COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	50,516	19,988.67 1,009,747,898	22,024.01 1,112,564,909	- -	2.34%
7	LINK REIT 香港	投資証券	764,020	1,116.03 852,671,212	1,328.48 1,014,986,817	- -	2.13%
8	DIGITAL REALTY TRUST INC アメリカ	投資証券	75,807	12,172.69 922,775,476	12,873.85 975,928,644	- -	2.05%
9	VENTAS INC アメリカ	投資証券	129,936	6,509.51 845,819,822	7,016.53 911,700,829	- -	1.92%
10	REALTY INCOME CORP アメリカ	投資証券	110,836	6,780.06 751,474,749	7,569.89 839,017,347	- -	1.76%
11	UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD オランダ	投資証券	50,216	19,486.25 978,521,859	16,428.81 824,989,273	- -	1.73%
12	BOSTON PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	56,374	13,674.22 770,870,886	14,305.38 806,451,582	- -	1.70%
13	ESSEX PROPERTY TRUST INC アメリカ	投資証券	23,971	27,934.11 669,608,579	31,217.90 748,324,415	- -	1.57%
14	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT アメリカ	投資証券	40,865	14,147.57 578,140,623	15,916.25 650,417,736	- -	1.37%
15	HCP INC アメリカ	投資証券	173,225	3,074.89 532,648,319	3,433.90 594,838,020	- -	1.25%
16	GOODMAN GROUP オーストラリア	投資信託受益 証券	581,066	849.43 493,579,939	1,002.90 582,754,345	- -	1.23%
17	WP CAREY INC アメリカ	投資証券	61,597	7,827.73 482,164,763	8,976.26 552,911,229	- -	1.16%
18	SCENTRE GROUP オーストラリア	投資信託受益 証券	1,930,561	309.02 596,598,467	286.22 552,566,713	- -	1.16%
19	HOST HOTELS & RESORTS INC アメリカ	投資証券	268,512	2,129.10 571,690,868	2,012.22 540,306,290	- -	1.14%
20	EXTRA SPACE STORAGE INC アメリカ	投資証券	46,166	10,621.65 490,359,148	11,554.97 533,447,095	- -	1.12%
21	MID AMERICA アメリカ	投資証券	41,306	11,170.68 461,416,402	12,394.86 511,982,186	- -	1.08%
22	UDR INC アメリカ	投資証券	99,970	4,428.35 442,702,385	4,835.89 483,444,843	- -	1.02%

23	VORNADO REALTY TRUST アメリカ	投資証券	62,901	7,573.86 476,403,591	7,266.97 457,099,805	- -	0.96%
24	REGENCY CENTERS CORP アメリカ	投資証券	60,775	6,890.61 418,777,148	7,141.20 434,006,916	- -	0.91%
25	DUKE REALTY TRUST アメリカ	投資証券	130,346	3,138.96 409,151,541	3,280.79 427,639,156	- -	0.90%
26	SUN COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	31,343	11,628.43 364,469,955	13,510.33 423,454,411	- -	0.89%
27	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES アメリカ	投資証券	32,628	11,066.01 361,062,019	12,901.19 420,940,327	- -	0.88%
28	CAMDEN PROPERTY TRUST アメリカ	投資証券	35,071	10,295.61 361,077,446	11,176.59 391,974,258	- -	0.82%
29	FEDERAL REALTY INVS TRUST アメリカ	投資証券	26,991	13,863.21 374,182,143	14,285.69 385,585,242	- -	0.81%
30	DEXUS オーストラリア	投資信託受益 証券	393,283	833.51 327,807,625	963.63 378,981,342	- -	0.80%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

令和1年5月31日現在

種類	投資比率
投資信託受益証券	10.29%
投資証券	89.27%
合計	99.56%

(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

令和1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 07/31/20 アメリカ	国債証券	2,657,448,000	100.38 2,667,573,115	100.41 2,668,449,834	2.625000 2020/7/31	0.71%
2	US T N/B 1.625 07/31/20 アメリカ	国債証券	2,105,180,000	97.92 2,061,596,194	99.26 2,089,791,134	1.625000 2020/7/31	0.56%
3	US T N/B 2.75 09/30/20 アメリカ	国債証券	2,062,529,600	99.89 2,060,343,318	100.68 2,076,616,677	2.750000 2020/9/30	0.56%
4	US T N/B 2.5 01/31/21 アメリカ	国債証券	1,963,012,000	99.96 1,962,252,844	100.58 1,974,436,729	2.500000 2021/1/31	0.53%
5	US T N/B 2.875 10/31/20 アメリカ	国債証券	1,839,435,200	100.07 1,840,833,170	100.93 1,856,597,130	2.875000 2020/10/31	0.50%
6	US T N/B 2.5 02/28/21 アメリカ	国債証券	1,715,858,400	100.17 1,718,929,786	100.63 1,726,771,259	2.500000 2021/2/28	0.46%
7	US T N/B 2.75 02/15/28 アメリカ	国債証券	1,633,838,400	103.01 1,683,022,762	104.35 1,705,057,415	2.750000 2028/2/15	0.46%
8	US T N/B 2.375 03/15/22 アメリカ	国債証券	1,653,523,200	100.08 1,654,933,572	100.97 1,669,727,727	2.375000 2022/3/15	0.45%
9	US T N/B 3.125 11/15/28 アメリカ	国債証券	1,549,631,200	103.84 1,609,159,930	107.67 1,668,627,379	3.125000 2028/11/15	0.45%
10	FRANCE OAT 4.25 10/25/23 フランス	国債証券	1,337,922,600	122.61 1,640,461,231	120.92 1,617,923,041	4.250000 2023/10/25	0.43%
11	US T N/B 2.875 08/15/28 アメリカ	国債証券	1,533,227,200	99.42 1,524,433,083	105.46 1,617,064,063	2.875000 2028/8/15	0.43%
12	US T N/B 2.0 12/31/21 アメリカ	国債証券	1,609,779,200	97.07 1,562,741,370	99.96 1,609,264,070	2.000000 2021/12/31	0.43%
13	FRANCE OAT 4.5 04/25/41 フランス	国債証券	942,267,600	159.80 1,505,776,834	170.13 1,603,155,249	4.500000 2041/4/25	0.43%
14	US T N/B 2.5 01/15/22 アメリカ	国債証券	1,566,035,200	100.17 1,568,815,209	101.16 1,584,310,830	2.500000 2022/1/15	0.42%
15	US T N/B 2.5 12/31/20 アメリカ	国債証券	1,569,316,000	100.06 1,570,342,819	100.52 1,577,586,295	2.500000 2020/12/31	0.42%
16	US T N/B 2.875 05/15/28 アメリカ	国債証券	1,488,389,600	99.99 1,488,257,880	105.39 1,568,732,870	2.875000 2028/5/15	0.42%
17	US T N/B 2.625 02/15/29 アメリカ	国債証券	1,482,921,600	100.37 1,488,422,912	103.45 1,534,126,882	2.625000 2029/2/15	0.41%
18	US T N/B 2.0 02/15/23 アメリカ	国債証券	1,531,040,000	96.70 1,480,561,611	99.89 1,529,478,339	2.000000 2023/2/15	0.41%
19	US T N/B 2.75 11/15/23 アメリカ	国債証券	1,457,768,800	100.89 1,470,809,268	102.99 1,501,385,242	2.750000 2023/11/15	0.40%
20	US T N/B 1.125 07/31/21 アメリカ	国債証券	1,520,104,000	95.43 1,450,741,654	98.02 1,490,051,543	1.125000 2021/7/31	0.40%
21	US T N/B 2.125 12/31/22 アメリカ	国債証券	1,476,360,000	97.32 1,436,911,660	100.35 1,481,660,132	2.125000 2022/12/31	0.40%
22	US T N/B 2.625 08/15/20 アメリカ	国債証券	1,459,956,000	100.09 1,461,372,157	100.45 1,466,627,998	2.625000 2020/8/15	0.39%
23	US T N/B 2.875 10/15/21 アメリカ	国債証券	1,432,616,000	100.02 1,432,945,501	101.90 1,459,864,356	2.875000 2021/10/15	0.39%

24	US T N/B 1.875 03/31/22 アメリカ	国債証券	1,454,488,000	96.97 1,410,504,282	99.63 1,449,135,484	1.875000 2022/3/31	0.39%
25	US T N/B 2.25 11/15/27 アメリカ	国債証券	1,407,463,200	93.30 1,313,178,432	100.45 1,413,937,530	2.250000 2027/11/15	0.38%
26	US T N/B 2.625 08/31/20 アメリカ	国債証券	1,398,714,400	99.61 1,393,278,478	100.47 1,405,428,229	2.625000 2020/8/31	0.38%
27	US T N/B 2.375 08/15/24 アメリカ	国債証券	1,379,029,600	97.41 1,343,367,894	101.54 1,400,349,397	2.375000 2024/8/15	0.37%
28	US T N/B 2.25 11/15/24 アメリカ	国債証券	1,377,936,000	96.53 1,330,245,635	100.91 1,390,530,335	2.250000 2024/11/15	0.37%
29	US T N/B 2.625 02/28/23 アメリカ	国債証券	1,356,064,000	100.27 1,359,751,610	102.12 1,384,880,360	2.625000 2023/2/28	0.37%
30	US T N/B 2.0 09/30/20 アメリカ	国債証券	1,384,497,600	98.70 1,366,637,580	99.70 1,380,385,642	2.000000 2020/9/30	0.37%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

令和1年5月31日現在

種類	投資比率
国債証券	94.82%
合計	94.82%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資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

令和1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 インタラク ティブ・メ ディアおよび サービス	511,900	5,385.82 2,757,001,564	4,522.13 2,314,881,418	- -	4.17%
2	ALIBABA GROUP HOLDING LTD- ADR ケイマン諸島	株式 インターネッ ト販売・通信 販売	127,273	19,754.55 2,514,221,559	16,521.01 2,102,679,167	- -	3.79%
3	TAIWAN SEMICONDUCTOR 台湾	株式 半導体・半導 体製造装置	2,200,083	891.07 1,960,449,596	799.25 1,758,438,338	- -	3.17%
4	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD 韓国	株式 コンピュー タ・周辺機器	427,247	4,266.06 1,822,661,853	3,910.34 1,670,683,170	- -	3.01%
5	NASPERS LTD 南アフリカ	株式 インターネッ ト販売・通信 販売	39,254	26,310.98 1,032,811,418	24,133.78 947,347,431	- -	1.71%
6	CHINA CONSTRUCTION BANK 中国	株式 銀行	8,583,530	98.09 841,978,791	86.42 741,857,330	- -	1.34%
7	PING AN INSURANCE GROUP CO-H 中国	株式 保険	493,500	1,295.55 639,354,104	1,209.99 597,131,052	- -	1.08%
8	RELIANCE INDUSTRIES LTD インド	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	254,856	2,118.14 539,821,964	2,101.00 535,453,730	- -	0.96%
9	CHINA MOBILE LIMITED 香港	株式 無線通信サー ビス	544,500	1,049.97 571,712,242	976.49 531,702,616	- -	0.96%
10	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP インド	株式 貯蓄・抵当・ 不動産金融	146,019	3,227.15 471,225,772	3,451.35 503,962,967	- -	0.91%
11	IND & COMM BK OF CHINA - H 中国	株式 銀行	5,827,235	83.95 489,209,438	78.06 454,897,273	- -	0.82%
12	ITAU UNIBANCO HOLDING SA ブラジル	株式 銀行	429,647	895.97 384,951,046	962.94 413,726,860	- -	0.75%
13	VALE SA ブラジル	株式 金属・鉱業	284,121	1,425.58 405,040,026	1,372.77 390,034,063	- -	0.70%
14	SBERBANK ADR ロシア	株式 銀行	243,502	1,623.28 395,273,744	1,592.28 387,723,754	- -	0.70%
15	BANCO BRADESCO SA PREF ブラジル	株式 銀行	363,650	948.74 345,010,824	1,018.12 370,239,519	- -	0.67%

16	INFOSYS LTD インド	株式 情報技術サービス	313,352	1,145.11 358,823,297	1,159.00 363,177,788	- -	0.65%
17	GAZPROM PAO ADR ロシア	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	483,486	568.74 274,981,766	709.96 343,258,195	- -	0.62%
18	LUKOIL SPON ADR ロシア	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	37,740	9,440.22 356,274,167	8,759.73 330,592,436	- -	0.60%
19	BANK OF CHINA LTD 中国	株式 銀行	6,952,200	52.33 363,845,895	45.30 314,969,421	- -	0.57%
20	BAIDU INC -SPON ADR ケイマン諸島	株式 インタラク ティブ・メ ディアおよび サービス	24,909	17,792.64 443,196,908	12,228.63 304,603,074	- -	0.55%
21	SK HYNIX INC 韓国	株式 半導体・半導 体製造装置	49,053	7,273.17 356,770,979	6,056.20 297,075,269	- -	0.54%
22	CNOOC LTD 香港	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	1,591,000	203.49 323,759,367	182.05 289,651,732	- -	0.52%
23	HON HAI PRECISION INDUSTRY 台湾	株式 電子装置・機 器・部品	1,115,225	312.28 348,265,473	253.96 283,227,001	- -	0.51%
24	TATA CONSULTANCY SERVICES LTD インド	株式 情報技術サー ビス	80,435	3,361.55 270,386,344	3,391.15 272,767,471	- -	0.49%
25	PETROLEO BRASILEIRO SA ブラジル	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	374,912	733.98 275,179,417	717.81 269,118,394	- -	0.48%
26	AMERICA MOVIL SAB DE CV メキシコ	株式 無線通信サー ビス	3,017,678	82.88 250,112,136	79.01 238,448,466	- -	0.43%
27	SAMSUNG ELECTRONICS-PFD 韓国	株式 コンピュー タ・周辺機器	73,481	3,436.11 252,489,199	3,165.95 232,637,539	- -	0.42%
28	QATAR NATIONAL BANK カタール	株式 銀行	39,877	5,425.01 216,333,205	5,636.23 224,756,342	- -	0.40%
29	AXIS BANK LTD インド	株式 銀行	170,862	1,225.83 209,449,024	1,275.92 218,007,780	- -	0.39%
30	PETROLEO BRASILEIRO SA ブラジル	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	267,010	823.86 219,979,511	791.93 211,453,896	- -	0.38%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

令和1年5月31日現在

種類	投資比率
株式	90.01%
新株予約権証券	0.00%
投資信託受益証券	0.47%
投資証券	0.07%
合計	90.55%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

令和1年5月31日現在

業種	国内/外国	投資比率
銀行	外国	15.73%
石油・ガス・消耗燃料		7.40%
インターネット販売・通信販売		6.43%
インタラクティブ・メディアおよびサービス		5.46%
半導体・半導体製造装置		4.59%
コンピュータ・周辺機器		4.25%
保険		3.65%
金属・鉱業		3.01%
無線通信サービス		2.78%
不動産管理・開発		2.47%
化学		2.06%
自動車		1.76%
電子装置・機器・部品		1.73%
情報技術サービス		1.68%
食品		1.68%
食品・生活必需品小売り		1.62%
各種電気通信サービス		1.35%
資本市場		1.30%
コングロマリット		1.23%
医薬品		1.16%
建設資材		1.03%
貯蓄・抵当・不動産金融		1.01%
電力		0.94%
運送インフラ		0.92%
飲料		0.90%
各種金融サービス		0.87%
建設・土木		0.75%
繊維・アパレル・贅沢品		0.74%
娯楽		0.68%
ホテル・レストラン・レジャー		0.66%
パーソナル用品		0.64%
独立系発電事業者・エネルギー販売業者		0.58%
機械		0.58%
ガス		0.56%
タバコ		0.53%
複合小売り		0.52%
各種消費者サービス		0.52%

ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	0.51%
自動車部品	0.49%
専門小売り	0.44%
家庭用品	0.42%
バイオテクノロジー	0.41%
家庭用耐久財	0.35%
紙製品・林産品	0.30%
メディア	0.30%
陸運・鉄道	0.30%
消費者金融	0.27%
旅客航空輸送業	0.26%
水道	0.26%
電気設備	0.25%
ライフサイエンス・ツール/サービス	0.24%
エクイティ不動産投資信託(REITs)	0.18%
ソフトウェア	0.16%
航空貨物・物流サービス	0.16%
航空宇宙・防衛	0.15%
商業サービス・用品	0.14%
ヘルスケア機器・用品	0.10%
海運業	0.09%
エネルギー設備・サービス	0.08%
レジャー用品	0.07%
ヘルスケア・テクノロジー	0.07%
総合公益事業	0.06%
通信機器	0.06%
容器・包装	0.05%
商社・流通業	0.05%
建設関連製品	0.03%
専門サービス	0.03%
合計	90.01%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

令和1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	RUSSIAN FEDERATION 5.25 06/23/47 ロシア	国債証券	2,952,720,000	102.73 3,033,329,256	104.94 3,098,732,004	5.250000 2047/6/23	2.83%
2	COLOMBIA 5.0 06/15/45 コロンビア	国債証券	1,968,480,000	104.05 2,048,203,440	104.55 2,058,045,840	5.000000 2045/6/15	1.88%
3	BRAZIL 4.25 01/07/25 ブラジル	国債証券	1,651,336,000	101.19 1,671,034,470	102.27 1,688,920,407	4.250000 2025/1/7	1.54%
4	UNITED MEXICAN STATES 4.75 03/08/44 メキシコ	国債証券	1,684,144,000	97.78 1,646,906,920	99.75 1,679,933,640	4.750000 2044/3/8	1.53%
5	HUNGARY 6.375 03/29/21 ハンガリー	国債証券	1,531,040,000	106.48 1,630,349,816	106.53 1,631,047,532	6.375000 2021/3/29	1.49%
6	ROMANIA 6.75 02/07/22 ルーマニア	国債証券	1,476,360,000	109.18 1,611,958,744	109.21 1,612,332,756	6.750000 2022/2/7	1.47%
7	PERU 5.625 11/18/50 ペルー	国債証券	1,202,960,000	128.22 1,542,435,312	130.52 1,570,151,510	5.625000 2050/11/18	1.43%
8	UNITED MEXICAN STATES 6.05 01/11/40 メキシコ	国債証券	1,301,384,000	113.99 1,483,531,719	115.00 1,496,604,613	6.050000 2040/1/11	1.37%
9	BRAZIL 5.0 01/27/45 ブラジル	国債証券	1,618,528,000	90.88 1,470,968,114	92.31 1,494,111,752	5.000000 2045/1/27	1.36%
10	RUSSIAN FEDERATION 5.625 04/04/42 ロシア	国債証券	1,290,448,000	110.54 1,426,558,330	111.87 1,443,753,222	5.625000 2042/4/4	1.32%
11	RUSSIAN FEDERATION 4.875 09/16/23 ロシア	国債証券	1,356,064,000	105.62 1,432,314,603	106.29 1,441,401,107	4.875000 2023/9/16	1.31%
12	PHILIPPINES 9.5 02/02/30 フィリピン	国債証券	918,624,000	153.68 1,411,754,486	155.79 1,431,133,515	9.500000 2030/2/2	1.31%
13	PANAMA 6.7 01/26/36 パナマ	国債証券	1,082,664,000	129.78 1,405,132,738	131.55 1,424,244,492	6.700000 2036/1/26	1.30%
14	UNITED MEXICAN STATES 4.15 03/28/27 メキシコ	国債証券	1,356,064,000	101.50 1,376,514,320	102.32 1,387,592,488	4.150000 2027/3/28	1.27%
15	RUSSIAN FEDERATION 03/31/30 ロシア	国債証券	1,181,088,000	111.50 1,316,913,120	112.34 1,326,881,502	7.500000 2030/3/31	1.21%
16	BRAZIL 4.625 01/13/28 ブラジル	国債証券	1,290,448,000	100.35 1,295,044,182	101.32 1,307,559,340	4.625000 2028/1/13	1.19%
17	UNITED MEXICAN STATES 4.0 10/02/23 メキシコ	国債証券	1,257,640,000	103.12 1,296,974,604	103.40 1,300,412,336	4.000000 2023/10/2	1.19%
18	BRAZIL 4.875 01/22/21 ブラジル	国債証券	1,246,704,000	103.37 1,288,720,112	103.35 1,288,481,051	4.875000 2021/1/22	1.18%
19	COLOMBIA 6.125 01/18/41 コロンビア	国債証券	1,093,600,000	117.42 1,284,113,868	117.50 1,284,990,936	6.125000 2041/1/18	1.17%

20	UNITED MEXICAN STATES 5.55 01/21/45 メキシコ	国債証券	1,137,344,000	109.21 1,242,131,002	111.62 1,269,560,240	5.550000 2045/1/21	1.16%
21	PHILIPPINES 7.75 01/14/31 フィリピン	国債証券	885,816,000	141.18 1,250,611,542	142.98 1,266,592,865	7.750000 2031/1/14	1.16%
22	RUSSIAN FEDERATION 4.5 04/04/22 ロシア	国債証券	1,181,088,000	103.76 1,225,580,022	103.96 1,227,894,517	4.500000 2022/4/4	1.12%
23	BRAZIL 7.125 01/20/37 ブラジル	国債証券	1,017,048,000	117.75 1,197,628,700	118.42 1,204,449,264	7.125000 2037/1/20	1.10%
24	COLOMBIA 7.375 09/18/37 コロンビア	国債証券	918,624,000	130.20 1,196,048,448	130.82 1,201,789,848	7.375000 2037/9/18	1.10%
25	RUSSIAN FEDERATION 4.75 05/27/26 ロシア	国債証券	1,137,344,000	103.65 1,178,878,928	104.92 1,193,358,192	4.750000 2026/5/27	1.09%
26	PHILIPPINES 6.375 10/23/34 フィリピン	国債証券	874,880,000	132.78 1,161,672,225	134.87 1,179,976,902	6.375000 2034/10/23	1.08%
27	HUNGARY 5.375 03/25/24 ハンガリー	国債証券	1,049,856,000	109.83 1,153,107,150	110.72 1,162,495,050	5.375000 2024/3/25	1.06%
28	RUSSIAN FEDERATION 4.25 06/23/27 ロシア	国債証券	1,137,344,000	100.48 1,142,825,998	101.29 1,152,038,484	4.250000 2027/6/23	1.05%
29	INDONESIA 4.875 05/05/21 インドネシア	国債証券	1,104,536,000	103.51 1,143,404,621	103.53 1,143,570,302	4.875000 2021/5/5	1.04%
30	COLOMBIA 4.0 02/26/24 コロンビア	国債証券	1,104,536,000	102.85 1,136,119,824	103.37 1,141,814,090	4.000000 2024/2/26	1.04%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

令和1年5月31日現在

種類	投資比率
国債証券	96.53%
合計	96.53%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

令和1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2019年06月	売建	7,910,000	979,244,021	962,963,400	5.43%
		イギリス・ポンド売/円買2019年06月	売建	4,340,000	626,350,818	598,008,600	3.37%
		アメリカ・ドル売/円買2019年06月	売建	3,990,000	440,338,631	436,067,100	2.46%
		カナダ・ドル売/円買2019年06月	売建	4,310,000	353,950,814	348,075,600	1.96%
		オーストラリア・ドル売/円買2019年06月	売建	4,570,000	352,391,818	344,989,300	1.94%

(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

令和1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 0106月	買建	371	5,698,404,204	5,587,260,000	2.21%

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

(注2) 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

令和1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 0106月	買建	351	645,877,908	672,867,000	2.06%

(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。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和1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	-	スイス・フラン買/円 売2019年06月	買建	1,770,000	192,437,940	192,328,200	0.05%
		スウェーデン・クロー ナ買/円売2019年 06月	買建	3,700,000	42,461,200	42,402,000	0.01%
		アメリカ・ドル買/円 売2019年06月	買建	314,000	34,326,480	34,326,480	0.01%
		ノルウェー・クローネ 買/円売2019年0 6月	買建	1,400,000	17,540,600	17,430,000	0.00%
		イギリス・ポンド買/ 円売2019年06月	買建	20,000	2,755,960	2,756,000	0.00%
		カナダ・ドル買/円売 2019年06月	買建	20,000	1,615,560	1,615,600	0.00%
		デンマーク・クローネ 売/円買2019年0 6月	売建	2,000,000	32,665,400	32,600,000	0.01%
		ユーロ売/円買201 9年06月	売建	225,000	27,388,575	27,391,500	0.01%
株価指数先物 取引	シカゴ商品 取引所	S&P500 EMI NI FUT Jun 19	買建	310	4,823,521,015	4,730,120,740	1.34%
	EUREX 取引所	DJ EURO ST OXX 50 Jun 19	買建	282	1,143,481,906	1,137,375,428	0.32%
	ICE-E U	FTSE 100 I NDEX FUTUR E Jun19	買建	42	418,549,692	417,520,177	0.12%
	モントリ オール取引 所	S&P/TSE 6 0 IX FUT J un19	買建	16	252,535,552	249,432,832	0.07%
	シドニー先 物取引所	SPI 200 FU TURES Jun1 9	買建	15	180,857,184	181,049,760	0.05%

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

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

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

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和1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	-	オーストラリア・ドル 買/円売2019年0 6月	買建	4,320,000	327,473,260	326,160,000	0.69%
		シンガポール・ドル 買/円売2019年0 6月	買建	2,090,000	165,919,580	165,632,100	0.35%
		香港・ドル買/円売2 019年06月	買建	9,100,000	127,092,180	126,763,000	0.27%
		カナダ・ドル買/円売 2019年06月	買建	280,000	22,620,024	22,618,400	0.05%
		ニュージーランド・ド ル買/円売2019年 06月	買建	300,000	21,421,620	21,336,000	0.04%
		ユーロ買/円売201 9年06月	買建	140,000	17,043,572	17,043,600	0.04%
		アメリカ・ドル買/円 売2019年06月	買建	150,000	16,400,490	16,399,500	0.03%
		イギリス・ポンド買/ 円売2019年06月	買建	95,000	13,091,712	13,091,000	0.03%

(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

令和1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2019年06月	売建	1,557,646,300	172,759,188,877	170,250,740,590	45.58%
		ユーロ売/円買2019年06月	売建	1,120,010,300	139,658,438,335	136,350,053,922	36.50%
		イギリス・ポンド売/円買2019年06月	売建	166,528,000	24,115,641,699	22,945,893,120	6.14%
		オーストラリア・ドル売/円買2019年06月	売建	95,395,100	7,447,127,877	7,201,376,099	1.93%
		カナダ・ドル売/円買2019年06月	売建	87,149,600	7,190,665,867	7,039,073,192	1.88%
		メキシコ・ペソ売/円買2019年06月	売建	498,640,300	2,897,992,709	2,792,385,680	0.75%
		ポーランド・ズロチ売/円買2019年06月	売建	74,448,100	2,162,685,292	2,111,348,116	0.57%
		南アフリカ・ランド売/円買2019年06月	売建	275,540,200	2,126,806,630	2,030,731,274	0.54%
		デンマーク・クローネ売/円買2019年06月	売建	111,702,300	1,868,201,978	1,820,747,490	0.49%
		スウェーデン・クローナ売/円買2019年06月	売建	107,322,000	1,257,298,694	1,229,910,120	0.33%
		シンガポール・ドル売/円買2019年06月	売建	14,700,500	1,200,548,526	1,164,720,615	0.31%
		マレーシア・リングギット売/円買2019年06月	売建	41,940,000	1,115,759,178	1,091,698,200	0.29%
		ノルウェー・クローネ売/円買2019年06月	売建	43,926,600	565,047,183	546,886,170	0.15%

(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

令和1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	-	南アフリカ・ランド 買/円売2019年0 6月	買建	34,000,000	254,488,967	250,580,000	0.45%
		インドネシア・ルピア 買/円売2019年0 6月	買建	11,788,565,426	89,558,702	89,593,097	0.16%
		アメリカ・ドル買/円 売2019年06月	買建	391,495	42,801,705	42,798,278	0.08%
		コロンビア・ペソ買/ 円売2019年06月	買建	813,802,456	26,568,971	26,448,578	0.05%
		アメリカ・ドル売/円 買2019年06月	売建	3,382,864	370,616,640	369,796,973	0.67%
		ブラジル・レアル売/ 円買2019年06月	売建	5,940	163,785	163,072	0.00%
株価指数先物 取引	ICE - US	MINI MSCI EMG MKT Ju n19	買建	836	4,764,046,946	4,550,220,259	8.20%

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

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

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

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

令和1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2019年06月	買建	80,500,000	8,821,995,000	8,801,065,000	8.03%

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

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

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

直近日(令和1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。

	純資産総額 (分配落) (百万円)	純資産総額 (分配付) (百万円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (平成30年11月12日)	16,055	16,055	0.9834	0.9834
平成30年5月末日	6,206	-	0.9986	-
6月末日	9,467	-	1.0013	-
7月末日	12,286	-	1.0004	-
8月末日	14,556	-	1.0001	-
9月末日	15,917	-	0.9961	-
10月末日	16,049	-	0.9834	-
11月末日	16,133	-	0.9883	-
12月末日	15,987	-	0.9852	-
平成31年1月末日	16,061	-	0.9929	-
2月末日	16,142	-	0.9955	-
3月末日	15,977	-	1.0130	-
4月末日	15,882	-	1.0100	-
令和1年5月末日	17,746	-	1.0118	-

【分配の推移】

	1口当たりの分配金(円)
第1計算期間	0.0000
平成30年11月13日～ 令和1年5月12日	-

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	1.7
平成30年11月13日～ 令和1年5月12日	2.3

(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】

	設定口数	解約口数
第1計算期間	17,241,080,294	914,894,367
平成30年11月13日～ 令和1年5月12日	2,148,675,803	2,534,811,130

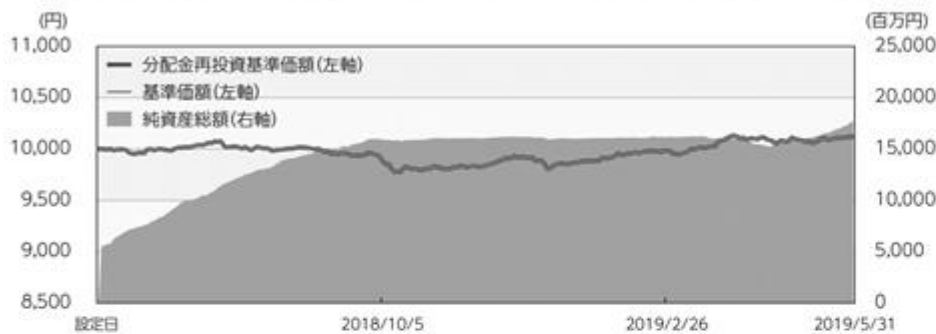
(注1) 本邦外における設定及び解約はございません。

(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:2019年5月31日

基準価額・純資産の推移 (2018年5月25日～2019年5月31日)



※基準価額は1万円当たり・信託報酬控除後の価額です。
 ※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額とは異なります。
 (設定日:2018年5月25日)
 ※設定時から10年以上経過した場合は、直近10年分を記載しています。

分配の推移(税引前)

第1期(2018.11.12)	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万円当たりです。

主要な資産の状況

■組入銘柄

※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

順位	銘柄名	比率(%)
1	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	48.88
2	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	13.20
3	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	10.65
4	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	4.99
5	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	4.81
6	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	3.78
7	J-REITインデックスファンド・マザーファンド	1.94
8	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	1.78

■国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還期限	比率(%)
1	125回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.100000	2020/9/20	1.01
2	343回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.100000	2026/6/20	0.99
3	350回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.100000	2028/3/20	0.96
4	340回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.400000	2025/9/20	0.94
5	341回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.300000	2025/12/20	0.94

○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。

■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	3.20
2	ソフトバンクグループ	株式	日本	情報・通信業	1.89
3	ソニー	株式	日本	電気機器	1.59
4	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	日本	銀行業	1.53
5	日本電信電話	株式	日本	情報・通信業	1.47

■為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還期限	比率(%)
1	US T N/B 2.625 07/31/20	国債証券	アメリカ	2.625000	2020/7/31	0.71
2	US T N/B 1.625 07/31/20	国債証券	アメリカ	1.625000	2020/7/31	0.56
3	US T N/B 2.75 09/30/20	国債証券	アメリカ	2.750000	2020/9/30	0.56
4	US T N/B 2.5 01/31/21	国債証券	アメリカ	2.500000	2021/1/31	0.53
5	US T N/B 2.875 10/31/20	国債証券	アメリカ	2.875000	2020/10/31	0.50

■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	MICROSOFT CORP	株式	アメリカ	ソフトウェア	2.50
2	APPLE INC	株式	アメリカ	コンピュータ・周辺機器	2.29
3	AMAZON.COM INC	株式	アメリカ	インターネット販売・通信販売	2.07
4	FACEBOOK INC	株式	アメリカ	インタラクティブ・メディアおよびサービス	1.19
5	JOHNSON & JOHNSON	株式	アメリカ	医薬品	0.96

■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	7.35
2	ジャパンリアルエステイト投資法人	投資証券	日本	6.60
3	野村不動産マスターファンド投資法人	投資証券	日本	5.36
4	日本リテールファンド投資法人	投資証券	日本	4.22
5	ユナイテッド・アーバン投資法人	投資証券	日本	4.04

○掲載データ等はい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。

■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	4.22
2	PROLOGIS INC	投資証券	アメリカ	3.87
3	PUBLIC STORAGE	投資証券	アメリカ	2.93
4	WELLTOWER INC	投資証券	アメリカ	2.62
5	EQUITY RESIDENTIAL	投資証券	アメリカ	2.35

■エマージング債券パッシブ・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還期限	比率(%)
1	RUSSIAN FEDERATION 5.25 06/23/47	国債証券	ロシア	5.250000	2047/6/23	2.83
2	COLOMBIA 5.0 06/15/45	国債証券	コロンビア	5.000000	2045/6/15	1.88
3	BRAZIL 4.25 01/07/25	国債証券	ブラジル	4.250000	2025/1/7	1.54
4	UNITED MEXICAN STATES 4.75 03/08/44	国債証券	メキシコ	4.750000	2044/3/8	1.53
5	HUNGARY 6.375 03/29/21	国債証券	ハンガリー	6.375000	2021/3/29	1.49

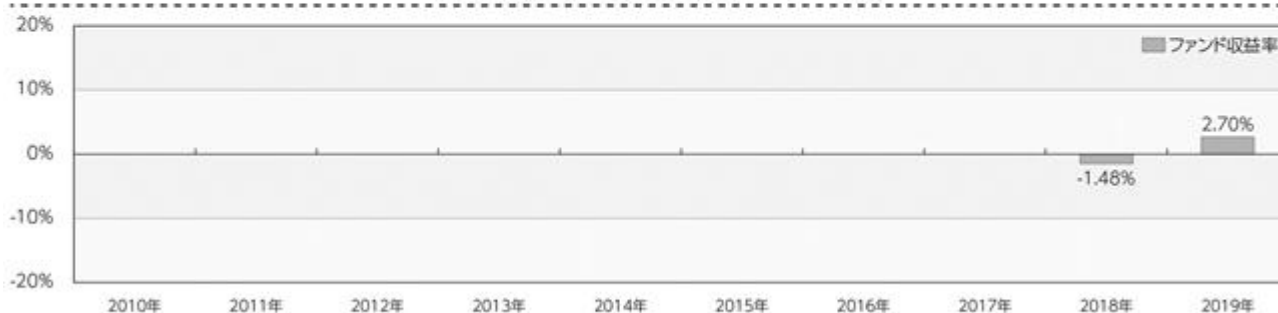
■エマージング株式パッシブ・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	業種	比率(%)
1	TENCENT HOLDINGS LTD	株式	ケイマン諸島	インタラクティブ・メディアおよびサービス	4.17
2	ALIBABA GROUP HOLDING LTD-ADR	株式	ケイマン諸島	インターネット販売・通信販売	3.79
3	TAIWAN SEMICONDUCTOR	株式	台湾	半導体・半導体製造装置	3.17
4	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	株式	韓国	コンピュータ・周辺機器	3.01
5	NASPERS LTD	株式	南アフリカ	インターネット販売・通信販売	1.71

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。

※2018年は設定日から年末までの収益率、および2019年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

※当ファンドにはベンチマークはありません。

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

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

- ・お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

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

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

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

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

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

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

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

- ・お申込価額

お申込日の翌営業日の基準価額 とします。

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

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

< 基準価額の照会方法等 >

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

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

・お申込手数料

お申込日の翌営業日の基準価額に、1.08%^{*}（税抜1.0%）を上限に各販売会社が定める手数料率を乗じて得た額とします。

*消費税率が10%になった場合は、1.1%となります。

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

「分配金再投資コース」により、収益分配金を再投資する場合は、お申込手数料はかかりません。

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

・お申込単位

各販売会社が定める単位とします。

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

取扱コースおよびお申込単位は、販売会社にお問い合わせください。

「分配金再投資コース」により、収益分配金を再投資する場合は、1口単位となります。

当初元本は1口当たり1円です。

・払込期日

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

2【換金（解約）手続等】

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

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

海外休業日には、解約の受付を行いません。

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

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

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

・解約価額

解約価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

当ファンドの解約価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

・解約単位

各販売会社が定める単位とします。

解約単位は販売会社にお問い合わせください。

・解約代金の受渡日

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

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

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

<主な投資対象の時価評価方法の原則>

投資対象	評価方法
マザーファンド 受益証券	計算日の基準価額
公社債等	計算日における以下のいずれかの価額 ・日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値） ・金融商品取引業者、銀行などの提示する価額（売り気配相場を除きます。） ・価格情報会社の提供する価額
株式	計算日における金融商品取引所等の最終相場
不動産投資信託 証券	計算日における金融商品取引所等の最終相場
外貨建資産の 円換算	計算日の国内における対顧客電信売買相場の仲値
外国為替予約の 円換算	計算日の国内における対顧客先物売買相場の仲値

外国で取引されているものについては、計算時に知りうる直近の日

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

す。

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

(2)【保管】

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

信託期間は、2018年5月25日（設定日）から原則として2028年5月11日までです。

下記(5)その他 イ．償還規定の場合には、信託終了前に信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。また、委託会社は、信託期間満了前に、信託期間の延長が受益者に有利であると認めるときは、受託会社と協議のうえ、信託期間を延長することができます。

(4)【計算期間】

- a. 計算期間は、原則として毎年11月12日から翌年11月11日までとします。
- b. 上記a.の規定にかかわらず、上記a.の原則により各計算期間終了日に該当する日(以下「該当日」といいます。)が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。ただし、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。

(5)【その他】

イ.償還規定

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

任することはできないものとします。委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は信託契約を解約し、信託を終了させます。

- i. この信託は、受益者が一部解約請求を行ったときは、委託会社が信託契約の一部の解約をすることにより当該請求に応じ、当該受益権の公正な価格が当該受益者に一部解約金として支払われることとなる委託者指図型投資信託に該当するため、信託契約の解約を行う場合において、投資信託及び投資法人に関する法律第18条第1項に定める反対受益者による受益権買取請求の規定の適用を受けません。

ロ. 信託約款の変更等

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

八. 関係法人との契約の更改

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

二. 公告

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

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

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

ホ. 運用報告書

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

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

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

4【受益者の権利等】

(1) 収益分配金請求権

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

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

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

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

(2) 償還金請求権

受益者は、持ち分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

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

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

(3)一部解約請求権

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

(4)帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドの第1期計算期間は信託約款の規定に基づき、平成30年5月25日から平成30年11月12日までとなっております。
- (3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第1期計算期間(平成30年5月25日から平成30年11月12日まで)の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

1【財務諸表】

【リスクコントロール世界資産分散ファンド】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

		第1期 平成30年11月12日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		892,499,865
親投資信託受益証券		15,277,997,195
流動資産合計		16,170,497,060
資産合計		16,170,497,060
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		36,190,431
未払解約金		15,147,911
未払受託者報酬		1,913,786
未払委託者報酬		61,242,669
その他未払費用		250,846
流動負債合計		114,745,643
負債合計		114,745,643
純資産の部		
元本等		
元本		1 16,326,185,927
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()		2 270,434,510
(分配準備積立金)		98,696,164
元本等合計		16,055,751,417
純資産合計		16,055,751,417
負債純資産合計		16,170,497,060

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位 : 円)

	第1期 自 平成30年5月25日 至 平成30年11月12日
営業収益	
有価証券売買等損益	174,002,805
為替差損益	30,482,645
営業収益合計	204,485,450
営業費用	
支払利息	391,775
受託者報酬	1,913,786
委託者報酬	61,242,669
その他費用	264,118
営業費用合計	63,812,348
営業利益又は営業損失()	268,297,798
経常利益又は経常損失()	268,297,798
当期純利益又は当期純損失()	268,297,798
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額()	6,954,323
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	9,091,035
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	20,698
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	9,070,337
分配金	1 -
期末剰余金又は期末欠損金()	270,434,510

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	第1期 平成30年11月12日現在
1. 1 期首元本額	5,541,516,151円
期中追加設定元本額	11,699,564,143円
期中一部解約元本額	914,894,367円
2. 受益権の総数	16,326,185,927口
3. 2 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は270,434,510円であります。

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第1期 自 平成30年5月25日 至 平成30年11月12日
1. 1 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(98,696,164円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(13,140,329円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象収益は111,836,493円(1万口当たり68.50円)であります。分配を行っておりません。なお、分配金の計算過程においては、親投資信託の配当等収益及び収益調整金相当額を充当する方法によっております。

（金融商品に関する注記）

1．金融商品の状況に関する事項

項目	第1期 自 平成30年5月25日 至 平成30年11月12日
1． 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2． 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、主要投資対象である親投資信託受益証券が保有する金融商品に係る、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。
3． 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

2．金融商品の時価等に関する事項

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第1期 平成30年11月12日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	
親投資信託受益証券		112,200,357
合計		112,200,357

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	第1期 平成30年11月12日 現在			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売 建	2,572,930,069	-	2,609,120,500	36,190,431
アメリカ・ドル	159,741,054	-	161,510,800	1,769,746
イギリス・ボンド	1,129,067,940	-	1,148,784,000	19,716,060
オーストラリア・ドル	160,841,808	-	165,141,600	4,299,792
カナダ・ドル	319,893,420	-	322,462,800	2,569,380
ユーロ	803,385,847	-	811,221,300	7,835,453
合計	2,572,930,069	-	2,609,120,500	36,190,431

(注) 時価の算定方法

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

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	第1期 平成30年11月12日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9834円 (9,834円)

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

平成30年11月12日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	126,294,522	325,423,094	
	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	1,797,723,485	2,305,041,052	
	J-REITインデックスファンド・マザーファンド	255,955,063	486,263,428	
	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	93,812,225	333,145,973	
	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	856,495,571	1,069,677,318	
	為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	6,589,414,795	8,609,729,371	
	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	303,188,905	334,872,145	
	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	999,638,917	1,813,844,814	
親投資信託受益証券 合計		11,022,523,483	15,277,997,195	
合計		11,022,523,483	15,277,997,195	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

(参考)

当ファンドは、「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、「外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「エマージング株式パッシブ・マザーファンド」受益証券及び「エマージング債券パッシブ・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同親投資信託の受益証券であります。

同親投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

「国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成30年11月12日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		5,155,250,321
株式	2	272,635,488,350
派生商品評価勘定		125,473,720
未収入金		2,490,000
未収配当金		2,490,276,626
流動資産合計		280,408,979,017
資産合計		280,408,979,017
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		36,093,260
前受金		96,415,000
未払解約金		100,079,000
流動負債合計		232,587,260
負債合計		232,587,260
純資産の部		
元本等		
元本	1	108,734,086,652
剰余金		
剰余金又は欠損金()		171,442,305,105
元本等合計		280,176,391,757
純資産合計		280,176,391,757
負債純資産合計		280,408,979,017

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11月12日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額 同期中追加設定元本額 同期中一部解約元本額	112,039,446,703円 17,951,318,450円 21,256,678,501円
元本の内訳 ファンド名	
D I A M D C 国内株式インデックスファンド	11,697,020,513円
D I A M国内株式パッシブ・ファンド	2,636,340,260円
M I T O ラップ型ファンド（安定型）	3,392,166円
M I T O ラップ型ファンド（中立型）	7,271,489円
M I T O ラップ型ファンド（積極型）	12,819,569円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	23,465,281円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	19,553,564円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	15,762,405円
たわらノーロード T O P I X	329,917,368円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	71,295,544円
たわらノーロード バランス（堅実型）	1,824,425円
たわらノーロード バランス（標準型）	13,158,737円

たわらノーロード バランス (積極型)	30,484,387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)	207,028円
たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(安定型)	7,013,112円
たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(安定成長 型)	24,379,741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)	18,546,921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)	45,453,081円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(保守型)	45,290円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定型)	81,801円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定成長型)	802,595円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(成長型)	594,633円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(積極型)	1,996,341円
D I A M国内株式インデックス ファンド< D C年金>	38,157,146,657円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 1 安定型	866,672,184円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 2 安定・成長型	2,921,011,264円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 3 成長型	3,056,587,421円
D I A M D C バランス3 0 インデックスファンド	343,429,890円
D I A M D C バランス5 0 インデックスファンド	1,146,466,084円
D I A M D C バランス7 0 インデックスファンド	1,093,778,761円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型>	41,354,593円
マネックス資産設計ファンド< 育成型>	1,084,339,387円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	26,126,648円
D I A M D C 8資産バラ ンスファンド(新興国1 0)	278,344,409円
D I A M D C 8資産バラ ンスファンド(新興国2 0)	179,762,429円
D I A M D C 8資産バラ ンスファンド(新興国3 0)	314,461,765円
投資のソムリエ	435,971,927円
クルーズコントロール	842,058,816円
投資のソムリエ< D C年金>	38,585,097円

D I A M 8 資産バランスファンドN<DC年金>	198,688,170円
D I A M DC バランス・F (成長型)	253,355,924円
クルーズコントロール<DC年金>	564,859円
D I A Mコア資産設計ファンド (堅実型)	6,887,934円
D I A Mコア資産設計ファンド (積極型)	19,416,091円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	23,826,329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	449,675円 436,641,186円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2045)	957,696円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2055)	698,794円
リスク抑制世界8資産バランス ファンド(DC)	137,950円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2035)	1,294,784円
4資産分散投資・スタンダード <DC年金>	14,501,814円
リスクコントロール世界資産分 散ファンド	126,294,522円
9資産分散投資・スタンダード <DC年金>	18,666円
D I A Mワールドバランス25 VA(適格機関投資家限定)	67,427,854円
日米資産配分戦略ファンド(イン カム重視型)(為替ヘッジあり) (適格機関投資家限定)	54,483,445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)	114,888,153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)	281,866,607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)	15,210,643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)	64,068,386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)	16,333,666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)	15,639,738円

D I A M世界バランスファンド 4 0 V A (適格機関投資家限 定)	30,068,459円
D I A M世界バランスファンド 5 0 V A (適格機関投資家限 定)	54,409,906円
D I A Mバランスファンド2 5 V A (適格機関投資家限定)	1,031,544,058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)	969,394,849円
D I A Mバランスファンド5 0 V A (適格機関投資家限定)	2,699,937,775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)	190,097,600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)	52,061,278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)	556,287,813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)	415,622,156円
D I A Mグローバル 私募ファ ンド (適格機関投資家向け)	10,313,671円
D I A M世界バランスファンド 5 5 V A (適格機関投資家限 定)	7,515,147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)	54,862,660円
D I A M世界アセットバランス ファンド2 V A (適格機関投資 家限定)	10,522,058,392円
D I A M世界アセットバランス ファンド4 0 V A (適格機関投 資家限定)	318,492,171円
D I A M世界アセットバランス ファンド2 5 V A (適格機関投 資家限定)	1,757,785,389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)	10,040,664,400円
D I A Mバランス3 0 V A (適 格機関投資家限定)	4,713,385円
D I A Mバランス5 0 V A (適 格機関投資家限定)	283,368円
D I A Mバランス7 0 V A (適 格機関投資家限定)	3,856,479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)	8,983,887,646円	
D I A M世界バランス2 5 V A (適格機関投資家限定)	70,355,143円	
D I A M国内バランス3 0 V A (適格機関投資家限定)	28,070,236円	
D I A Mバランス2 0 V A (適 格機関投資家限定)	25,624,221円	
D I A Mバランス4 0 V A (適 格機関投資家限定)	102,630円	
D I A Mバランス6 0 V A (適 格機関投資家限定)	115,943円	
D I A M世界アセットバランス ファンド7 V A (1 2 1 2) (適格機関投資家限定)	405,365,089円	
D I A M世界アセットバランス ファンド7 V A (1 3 0 3) (適格機関投資家限定)	1,261,532,817円	
D I A M世界アセットバランス ファンド7 V A (1 3 0 6) (適格機関投資家限定)	1,669,062,351円	
D I A M世界アセットバランス ファンド7 V A (1 3 0 9) (適格機関投資家限定)	68,825,151円	
計	108,734,086,652円	
2 . 受益権の総数	108,734,086,652口	
3 . 2 差入代用有価証券	株式	3,354,500,000円

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成30年5月25日 至 平成30年11月12日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成30年11月12日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
株式	11,601,195,788
合計	11,601,195,788

(注) 「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成30年2月8日から平成30年11月12日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

株式関連

種類	平成30年11月12日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引				
先物取引				
買 建	9,685,780,000	-	9,775,350,000	89,570,000
合計	9,685,780,000	-	9,775,350,000	89,570,000

（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はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	平成30年11月12日現在
1口当たり純資産額	2.5767円
（1万口当たり純資産額）	（25,767円）

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

平成30年11月12日現在

銘柄	株式数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
極洋	5,100	3,160.00	16,116,000	
日本水産	156,300	712.00	111,285,600	
マルハニチロ	22,600	4,395.00	99,327,000	
ハウスイ	900	939.00	845,100	
カネコ種苗	4,300	1,455.00	6,256,500	
サカタのタネ	19,000	3,750.00	71,250,000	
ホクト	13,100	2,058.00	26,959,800	
ホクリヨウ	2,100	739.00	1,551,900	
ヒノキヤグループ	3,300	2,395.00	7,903,500	
ショーボンドホールディングス	12,200	8,220.00	100,284,000	
ミライト・ホールディングス	40,000	1,693.00	67,720,000	
タマホーム	9,700	1,161.00	11,261,700	
サンヨーホームズ	2,300	887.00	2,040,100	
日本アクア	3,800	352.00	1,337,600	
ファーストコーポレーション	4,300	1,113.00	4,785,900	
ベステラ	3,000	1,433.00	4,299,000	
TATERU	19,000	616.00	11,704,000	
スペースバリューホールディングス	19,100	1,053.00	20,112,300	
住石ホールディングス	33,700	120.00	4,044,000	
日鉄鉱業	3,600	5,210.00	18,756,000	
三井松島ホールディングス	6,500	1,567.00	10,185,500	
国際石油開発帝石	627,200	1,300.00	815,360,000	
石油資源開発	22,500	2,440.00	54,900,000	
K&Oエナジーグループ	7,600	1,591.00	12,091,600	
ダイセキ環境ソリューション	3,000	860.00	2,580,000	
第一カッター興業	1,700	2,314.00	3,933,800	
安藤・間	99,900	693.00	69,230,700	
東急建設	45,800	1,120.00	51,296,000	
コムシスホールディングス	55,400	2,982.00	165,202,800	
ミサワホーム	12,300	812.00	9,987,600	
ピーアールホールディングス	12,900	411.00	5,301,900	
高松コンストラクショングループ	9,700	2,983.00	28,935,100	
東建コーポレーション	4,800	7,920.00	38,016,000	
ソネック	1,600	791.00	1,265,600	
ヤマウラ	6,100	889.00	5,422,900	
大成建設	128,400	5,040.00	647,136,000	
大林組	386,800	1,078.00	416,970,400	
清水建設	394,500	937.00	369,646,500	
飛島建設	11,000	1,758.00	19,338,000	
長谷工コーポレーション	161,200	1,405.00	226,486,000	
松井建設	14,300	859.00	12,283,700	
銭高組	1,600	5,440.00	8,704,000	
鹿島建設	302,300	1,545.00	467,053,500	

不動テトラ	9,800	1,873.00	18,355,400
大末建設	4,600	1,150.00	5,290,000
鉄建建設	7,800	2,919.00	22,768,200
西松建設	27,800	2,705.00	75,199,000
三井住友建設	93,000	720.00	66,960,000
大豊建設	8,700	3,515.00	30,580,500
前田建設工業	92,000	1,160.00	106,720,000
佐田建設	8,200	418.00	3,427,600
ナカノフドー建設	9,900	672.00	6,652,800
奥村組	21,200	3,630.00	76,956,000
東鉄工業	15,500	3,115.00	48,282,500
イチケン	2,400	2,206.00	5,294,400
富士ピー・エス	4,000	528.00	2,112,000
浅沼組	4,600	3,430.00	15,778,000
戸田建設	149,900	754.00	113,024,600
熊谷組	18,400	3,440.00	63,296,000
青木あすなろ建設	6,400	1,013.00	6,483,200
北野建設	2,700	3,960.00	10,692,000
植木組	1,600	2,439.00	3,902,400
矢作建設工業	17,600	786.00	13,833,600
ピーエス三菱	13,600	731.00	9,941,600
日本ハウスホールディングス	24,600	509.00	12,521,400
大東建託	46,000	15,695.00	721,970,000
新日本建設	15,400	1,093.00	16,832,200
N I P P O	34,200	1,861.00	63,646,200
東亜道路工業	2,400	3,570.00	8,568,000
前田道路	40,400	2,247.00	90,778,800
日本道路	3,500	6,060.00	21,210,000
東亜建設工業	11,300	1,711.00	19,334,300
若築建設	6,500	1,579.00	10,263,500
東洋建設	47,200	436.00	20,579,200
五洋建設	153,300	705.00	108,076,500
世紀東急工業	18,900	667.00	12,606,300
福田組	4,200	5,170.00	21,714,000
日本ドライケミカル	3,200	1,299.00	4,156,800
住友林業	91,400	1,647.00	150,535,800
日本基礎技術	13,500	373.00	5,035,500
巴コーポレーション	16,100	460.00	7,406,000
大和ハウス工業	357,200	3,584.00	1,280,204,800
ライト工業	24,800	1,450.00	35,960,000
積水ハウス	394,900	1,725.50	681,399,950
日特建設	11,000	729.00	8,019,000
北陸電気工事	6,300	1,055.00	6,646,500
ユアテック	20,700	911.00	18,857,700
四電工	1,800	2,644.00	4,759,200
中電工	16,600	2,477.00	41,118,200
関電工	58,700	1,162.00	68,209,400
きんでん	85,800	1,907.00	163,620,600
東京エネシス	13,300	962.00	12,794,600
トーエネック	3,500	3,240.00	11,340,000

住友電設	8,900	1,911.00	17,007,900
日本電設工業	22,000	2,347.00	51,634,000
協和エクシオ	50,500	2,960.00	149,480,000
新日本空調	10,900	1,877.00	20,459,300
日本工営	7,400	2,722.00	20,142,800
九電工	25,400	4,405.00	111,887,000
三機工業	29,600	1,270.00	37,592,000
日揮	111,100	1,884.00	209,312,400
中外炉工業	3,600	2,472.00	8,899,200
ヤマト	11,600	637.00	7,389,200
太平電業	8,700	2,794.00	24,307,800
高砂熱学工業	32,500	2,047.00	66,527,500
三晃金属工業	1,400	2,977.00	4,167,800
NEC ネットエスアイ	12,500	2,573.00	32,162,500
朝日工業社	2,500	3,195.00	7,987,500
明星工業	23,400	866.00	20,264,400
大気社	17,600	3,230.00	56,848,000
ダイダン	8,600	2,578.00	22,170,800
日比谷総合設備	12,300	1,921.00	23,628,300
東芝プラントシステム	27,900	2,326.00	64,895,400
日本製粉	38,400	1,887.00	72,460,800
日清製粉グループ本社	130,500	2,318.00	302,499,000
日東富士製粉	800	5,350.00	4,280,000
昭和産業	10,700	2,858.00	30,580,600
鳥越製粉	10,400	952.00	9,900,800
中部飼料	14,100	1,446.00	20,388,600
フィード・ワン	77,800	223.00	17,349,400
東洋精糖	1,900	1,212.00	2,302,800
日本甜菜製糖	6,600	1,993.00	13,153,800
三井製糖	9,100	3,045.00	27,709,500
塩水港精糖	13,500	247.00	3,334,500
日新製糖	5,500	2,274.00	12,507,000
L I F U L L	38,200	753.00	28,764,600
ジェイエイシーリクルートメント	8,800	2,390.00	21,032,000
日本M&Aセンター	82,000	2,750.00	225,500,000
メンバーズ	3,700	1,121.00	4,147,700
中広	1,100	766.00	842,600
タケエイ	11,400	839.00	9,564,600
E・Jホールディングス	1,400	1,275.00	1,785,000
トラスト・テック	5,300	2,990.00	15,847,000
コシダカホールディングス	29,400	1,325.00	38,955,000
アルトナー	2,000	812.00	1,624,000
パソナグループ	10,400	1,348.00	14,019,200
C D S	2,700	1,315.00	3,550,500
リンクアンドモチベーション	20,200	1,071.00	21,634,200
G C A	11,200	845.00	9,464,000
エス・エム・エス	40,400	1,978.00	79,911,200
パーソルホールディングス	110,000	2,084.00	229,240,000
リニカル	6,200	1,691.00	10,484,200
クックパッド	34,500	419.00	14,455,500

エスクリ	3,000	734.00	2,202,000
アイ・ケイ・ケイ	5,500	722.00	3,971,000
森永製菓	29,100	4,965.00	144,481,500
中村屋	2,800	4,590.00	12,852,000
江崎グリコ	34,700	5,550.00	192,585,000
名糖産業	5,600	1,492.00	8,355,200
井村屋グループ	4,900	3,150.00	15,435,000
不二家	6,500	2,504.00	16,276,000
山崎製パン	94,500	2,280.00	215,460,000
第一屋製パン	1,900	1,103.00	2,095,700
モロゾフ	1,800	5,500.00	9,900,000
亀田製菓	7,200	5,380.00	38,736,000
寿スピリッツ	12,200	4,475.00	54,595,000
カルビー	52,700	3,765.00	198,415,500
森永乳業	23,100	3,340.00	77,154,000
六甲バター	8,400	2,478.00	20,815,200
ヤクルト本社	85,600	8,070.00	690,792,000
明治ホールディングス	81,900	8,710.00	713,349,000
雪印メグミルク	27,800	2,995.00	83,261,000
プリマハム	16,300	2,494.00	40,652,200
日本ハム	49,900	4,245.00	211,825,500
林兼産業	4,000	657.00	2,628,000
丸大食品	12,400	1,859.00	23,051,600
S Foods	10,400	4,800.00	49,920,000
伊藤ハム米久ホールディングス	74,400	749.00	55,725,600
学情	4,400	1,465.00	6,446,000
スタジオアリス	5,500	2,630.00	14,465,000
シミックホールディングス	6,100	2,173.00	13,255,300
システナ	40,300	1,338.00	53,921,400
NJS	2,400	1,768.00	4,243,200
デジタルアーツ	6,100	6,090.00	37,149,000
新日鉄住金ソリューションズ	16,900	3,280.00	55,432,000
総合警備保障	43,800	5,000.00	219,000,000
キューブシステム	6,000	814.00	4,884,000
いちご	144,400	403.00	58,193,200
エイジア	2,200	1,399.00	3,077,800
日本駐車場開発	136,800	161.00	22,024,800
コア	4,800	1,407.00	6,753,600
カカクコム	82,800	2,154.00	178,351,200
アイロムグループ	4,200	2,266.00	9,517,200
セントケア・ホールディング	6,000	591.00	3,546,000
サイネックス	1,600	812.00	1,299,200
ルネサンス	6,100	2,299.00	14,023,900
ディップ	17,700	2,384.00	42,196,800
SBSホールディングス	11,400	1,425.00	16,245,000
オプトホールディング	6,700	1,977.00	13,245,900
新日本科学	14,900	616.00	9,178,400
ツクイ	25,900	976.00	25,278,400
キャリアデザインセンター	2,800	1,622.00	4,541,600
エムスリー	231,600	1,804.00	417,806,400

ツカダ・グローバルホールディング	7,100	615.00	4,366,500
プラス	800	675.00	540,000
アウトソーシング	57,900	1,405.00	81,349,500
ウェルネット	11,100	1,119.00	12,420,900
ワールドホールディングス	3,000	2,784.00	8,352,000
ディー・エヌ・エー	59,300	2,143.00	127,079,900
博報堂DYホールディングス	152,900	1,781.00	272,314,900
ぐるなび	15,600	932.00	14,539,200
エスアールジータカミヤ	11,400	645.00	7,353,000
ジャパンベストレスキューシステム	8,700	1,365.00	11,875,500
ファンコミュニケーションズ	30,200	614.00	18,542,800
ライク	4,300	1,672.00	7,189,600
ビジネス・ブレイクスルー	4,600	378.00	1,738,800
WDBホールディングス	5,000	2,903.00	14,515,000
ティア	5,100	771.00	3,932,100
CDG	1,000	1,481.00	1,481,000
バリューコマース	7,400	1,480.00	10,952,000
インフォマート	60,300	1,469.00	88,580,700
サッポロホールディングス	42,300	2,486.00	105,157,800
アサヒグループホールディングス	242,000	5,048.00	1,221,616,000
麒麟ホールディングス	522,700	2,609.50	1,363,985,650
宝ホールディングス	86,500	1,434.00	124,041,000
オエノンホールディングス	33,000	384.00	12,672,000
養命酒製造	3,600	2,327.00	8,377,200
コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールディングス	88,500	3,340.00	295,590,000
サントリー食品インターナショナル	77,300	4,590.00	354,807,000
ダイドーグループホールディングス	6,500	5,990.00	38,935,000
伊藤園	38,300	5,230.00	200,309,000
キーコーヒー	11,400	2,097.00	23,905,800
ユニカフェ	3,600	1,292.00	4,651,200
ジャパンフーズ	1,600	1,236.00	1,977,600
日清オイリオグループ	14,900	3,500.00	52,150,000
不二製油グループ本社	28,200	3,290.00	92,778,000
かどや製油	1,200	6,080.00	7,296,000
J-オイルミルズ	6,000	3,900.00	23,400,000
ローソン	28,700	7,490.00	214,963,000
サンエー	8,600	4,795.00	41,237,000
カワチ薬品	8,800	2,250.00	19,800,000
エービーシー・マート	17,700	6,420.00	113,634,000
ハードオフコーポレーション	4,500	943.00	4,243,500
高千穂交易	4,400	1,068.00	4,699,200
アスクル	9,900	3,040.00	30,096,000
ゲオホールディングス	17,200	1,858.00	31,957,600
アダストリア	15,700	2,032.00	31,902,400
ジーフット	7,000	756.00	5,292,000
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	1,400	753.00	1,054,200
伊藤忠食品	2,700	5,210.00	14,067,000
くらコーポレーション	6,700	6,880.00	46,096,000
キャンドウ	5,400	1,721.00	9,293,400

エレマテック	5,300	2,298.00	12,179,400
パルグループホールディングス	5,800	3,280.00	19,024,000
JALUX	3,200	2,761.00	8,835,200
エディオン	48,000	1,222.00	58,656,000
あらた	6,300	4,710.00	29,673,000
サーラコーポレーション	23,000	685.00	15,755,000
ワッツ	3,800	828.00	3,146,400
トーメンデバイス	1,700	2,532.00	4,304,400
ハローズ	4,300	2,632.00	11,317,600
J Pホールディングス	31,400	341.00	10,707,400
あみやき亭	2,500	4,115.00	10,287,500
東京エレクトロン デバイス	4,100	2,055.00	8,425,500
ひらまつ	22,600	407.00	9,198,200
フィールズ	9,900	1,001.00	9,909,900
双日	626,100	421.00	263,588,100
アルフレッサ ホールディングス	126,000	3,120.00	393,120,000
大黒天物産	2,600	4,330.00	11,258,000
ハニーズホールディングス	11,000	920.00	10,120,000
ファーマライズホールディングス	2,500	641.00	1,602,500
キッコーマン	76,200	6,210.00	473,202,000
味の素	265,700	1,924.00	511,206,800
キュービー	64,300	2,770.00	178,111,000
ハウス食品グループ本社	44,100	3,900.00	171,990,000
カゴメ	46,300	3,300.00	152,790,000
焼津水産化学工業	5,700	1,050.00	5,985,000
アリアケジャパン	10,600	10,000.00	106,000,000
ピエトロ	1,500	1,649.00	2,473,500
エバラ食品工業	2,400	2,183.00	5,239,200
ニチレイ	60,000	3,055.00	183,300,000
横浜冷凍	29,700	931.00	27,650,700
東洋水産	59,400	3,945.00	234,333,000
イトアアンド	4,000	1,690.00	6,760,000
大冷	1,400	1,865.00	2,611,000
ヨシムラ・フード・ホールディングス	3,100	677.00	2,098,700
日清食品ホールディングス	49,100	7,350.00	360,885,000
永谷園ホールディングス	6,200	2,716.00	16,839,200
一正蒲鉾	4,600	1,008.00	4,636,800
フジッコ	12,500	2,497.00	31,212,500
ロック・フィールド	12,500	1,702.00	21,275,000
日本たばこ産業	667,200	2,870.50	1,915,197,600
ケンコーマヨネーズ	6,500	2,219.00	14,423,500
わらべや日洋ホールディングス	7,600	1,908.00	14,500,800
なとり	6,500	1,864.00	12,116,000
イフジ産業	1,900	745.00	1,415,500
ピッケルスコーポレーション	2,800	2,338.00	6,546,400
北の達人コーポレーション	45,400	531.00	24,107,400
ユーグレナ	45,900	674.00	30,936,600
片倉工業	13,900	1,220.00	16,958,000
ゲンゼ	8,300	4,615.00	38,304,500
ヒューリック	237,000	1,048.00	248,376,000

神栄	1,500	1,122.00	1,683,000
ラサ商事	6,100	957.00	5,837,700
アルペン	8,700	1,966.00	17,104,200
ハブ	3,600	943.00	3,394,800
ラクーンホールディングス	6,700	623.00	4,174,100
クオールホールディングス	16,700	2,116.00	35,337,200
アルコニックス	12,000	1,325.00	15,900,000
神戸物産	17,100	3,095.00	52,924,500
ソリトンシステムズ	6,400	987.00	6,316,800
ジーンズ	7,700	6,940.00	53,438,000
ビックカメラ	60,500	1,535.00	92,867,500
DCMホールディングス	61,100	1,128.00	68,920,800
ペッパーフードサービス	8,900	3,645.00	32,440,500
Monotaro	71,600	2,625.00	187,950,000
東京一番フーズ	2,300	633.00	1,455,900
DDホールディングス	2,500	2,573.00	6,432,500
あいホールディングス	18,200	2,173.00	39,548,600
ディービーエクス	3,900	1,236.00	4,820,400
きちり	2,900	838.00	2,430,200
アークランドサービスホールディングス	8,300	2,310.00	19,173,000
J.フロントリテイリング	145,000	1,615.00	234,175,000
ドトール・日レスホールディングス	19,900	2,128.00	42,347,200
マツモトキヨシホールディングス	46,900	4,225.00	198,152,500
ブロンコビリー	5,900	3,055.00	18,024,500
ZOZO	122,500	2,552.00	312,620,000
トレジャー・ファクトリー	3,400	714.00	2,427,600
物語コーポレーション	3,200	11,220.00	35,904,000
ココカラファイン	12,700	6,590.00	83,693,000
三越伊勢丹ホールディングス	212,000	1,363.00	288,956,000
東洋紡	47,700	1,611.00	76,844,700
ユニチカ	33,000	580.00	19,140,000
富士紡ホールディングス	5,900	3,475.00	20,502,500
日清紡ホールディングス	63,900	1,103.00	70,481,700
倉敷紡績	10,800	2,810.00	30,348,000
ダイワボウホールディングス	10,300	6,770.00	69,731,000
シキボウ	5,900	1,169.00	6,897,100
日東紡績	17,100	2,291.00	39,176,100
トヨタ紡織	40,200	1,938.00	77,907,600
マクニカ・富士エレホールディングス	31,400	1,713.00	53,788,200
Hamee	2,900	1,665.00	4,828,500
ラクト・ジャパン	2,500	7,380.00	18,450,000
ウエルシアホールディングス	30,000	6,290.00	188,700,000
クリエイトSDホールディングス	16,700	2,990.00	49,933,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	21,400	1,219.00	26,086,600
八洲電機	8,900	821.00	7,306,900
メディアスホールディングス	6,300	858.00	5,405,400
UKCホールディングス	7,300	2,540.00	18,542,000
ジューテックホールディングス	2,500	1,054.00	2,635,000

丸善CHIホールディングス	13,600	355.00	4,828,000
大光	2,800	712.00	1,993,600
OCHIホールディングス	3,200	1,252.00	4,006,400
TOKAIホールディングス	59,900	954.00	57,144,600
黒谷	1,800	504.00	907,200
ミサワ	2,200	472.00	1,038,400
ティーライフ	1,500	1,004.00	1,506,000
Cominix	1,700	854.00	1,451,800
エー・ピーカンパニー	2,100	622.00	1,306,200
三洋貿易	5,700	2,078.00	11,844,600
チムニー	3,500	2,776.00	9,716,000
シュッピン	7,700	1,120.00	8,624,000
ビューティガレージ	1,600	1,713.00	2,740,800
ウイン・パートナーズ	7,400	1,275.00	9,435,000
ネクステージ	17,400	1,128.00	19,627,200
ジョイフル本田	33,200	1,653.00	54,879,600
鳥貴族	3,700	2,202.00	8,147,400
キリン堂ホールディングス	4,500	1,558.00	7,011,000
ホットランド	5,900	1,472.00	8,684,800
すかいらーくホールディングス	105,600	1,778.00	187,756,800
綿半ホールディングス	4,200	2,797.00	11,747,400
日本毛織	37,000	930.00	34,410,000
ダイトウボウ	17,800	99.00	1,762,200
トーア紡コーポレーション	4,700	548.00	2,575,600
ガイドーリミテッド	14,100	368.00	5,188,800
ヨシックス	1,800	2,947.00	5,304,600
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	33,000	1,303.00	42,999,000
三栄建築設計	4,600	1,636.00	7,525,600
スター・マイカ	5,200	1,633.00	8,491,600
野村不動産ホールディングス	75,600	2,212.00	167,227,200
三重交通グループホールディングス	23,100	580.00	13,398,000
サムティ	15,700	1,550.00	24,335,000
ディア・ライフ	14,500	526.00	7,627,000
コーセーアールイー	3,400	874.00	2,971,600
エー・ディー・ワークス	160,900	38.00	6,114,200
日本商業開発	7,100	1,761.00	12,503,100
プレサンスコーポレーション	17,900	1,360.00	24,344,000
ユニゾホールディングス	17,100	2,328.00	39,808,800
THEグローバル社	5,200	653.00	3,395,600
日本管理センター	7,500	1,309.00	9,817,500
サンセイランディック	3,000	1,163.00	3,489,000
エストラスト	1,500	783.00	1,174,500
フージャースホールディングス	25,400	667.00	16,941,800
オープンハウス	18,500	4,620.00	85,470,000
東急不動産ホールディングス	305,200	630.00	192,276,000
飯田グループホールディングス	94,700	2,042.00	193,377,400
イーランド	1,600	740.00	1,184,000
ムゲンエステート	7,900	696.00	5,498,400
帝国繊維	12,600	2,673.00	33,679,800

日本コークス工業	97,800	107.00	10,464,600
ゴルフダイジェスト・オンライン	4,600	910.00	4,186,000
ミタチ産業	2,700	792.00	2,138,400
B E E N O S	2,600	1,572.00	4,087,200
あさひ	9,400	1,408.00	13,235,200
日本調剤	4,000	3,460.00	13,840,000
コスモス薬品	5,700	23,180.00	132,126,000
シップヘルスケアホールディングス	23,600	3,830.00	90,388,000
トーエル	5,500	858.00	4,719,000
一六堂	2,400	512.00	1,228,800
ソフトクリエイイトホールディングス	4,900	1,693.00	8,295,700
オンリー	2,000	1,224.00	2,448,000
セブン&アイ・ホールディングス	475,300	5,030.00	2,390,759,000
薬王堂	4,900	3,540.00	17,346,000
クリエイイト・レストランツ・ホールディングス	30,500	1,259.00	38,399,500
明治電機工業	3,600	2,252.00	8,107,200
ツルハホールディングス	24,600	12,350.00	303,810,000
デリカフーズホールディングス	2,000	1,474.00	2,948,000
スターティアホールディングス	2,200	702.00	1,544,400
サンマルクホールディングス	8,900	2,750.00	24,475,000
フェリシモ	2,500	1,211.00	3,027,500
トリドールホールディングス	14,000	2,089.00	29,246,000
帝人	91,900	1,954.00	179,572,600
東レ	874,600	901.00	788,014,600
クラレ	190,300	1,642.00	312,472,600
旭化成	802,100	1,243.00	997,010,300
サカイオーベックス	2,800	2,421.00	6,778,800
T O K Y O B A S E	10,100	645.00	6,514,500
稲葉製作所	6,500	1,407.00	9,145,500
宮地エンジニアリンググループ	3,500	2,258.00	7,903,000
トーカロ	29,400	999.00	29,370,600
アルファ	4,000	1,423.00	5,692,000
S U M C O	125,800	1,638.00	206,060,400
川田テクノロジーズ	2,500	7,520.00	18,800,000
R S T e c h n o l o g i e s	2,300	4,815.00	11,074,500
ピーロット	1,800	1,214.00	2,185,200
ファーストブラザーズ	3,100	1,299.00	4,026,900
ハウズドゥ	4,200	1,265.00	5,313,000
シーアールイー	3,700	992.00	3,670,400
プロパティエージェント	1,100	1,105.00	1,215,500
ケイアイスター不動産	3,000	1,879.00	5,637,000
アグレ都市デザイン	1,400	711.00	995,400
グッドコムアセット	2,000	1,512.00	3,024,000
ジェイ・エス・ピー	400	4,605.00	1,842,000
住江織物	3,000	2,736.00	8,208,000
日本フェルト	6,200	480.00	2,976,000
イチカワ	1,600	1,549.00	2,478,400
エコナックホールディングス	20,800	112.00	2,329,600
日東製網	1,300	1,560.00	2,028,000

芦森工業	2,400	1,796.00	4,310,400
アツギ	9,400	1,037.00	9,747,800
ウイルプラスホールディングス	1,100	938.00	1,031,800
ジャパンミート	4,300	2,152.00	9,253,600
コメダホールディングス	26,000	2,303.00	59,878,000
サツドラホールディングス	1,800	1,996.00	3,592,800
デファクトスタンダード	700	682.00	477,400
ダイユー・リックホールディングス	6,100	1,111.00	6,777,100
パロックジャパンリミテッド	9,100	1,034.00	9,409,400
クスリのアオキホールディングス	9,000	8,660.00	77,940,000
ダイニック	4,400	856.00	3,766,400
共和レザー	7,100	873.00	6,198,300
力の源ホールディングス	3,200	1,069.00	3,420,800
スシローグローバルホールディングス	12,400	6,400.00	79,360,000
L I X I L ビバ	9,600	1,845.00	17,712,000
セーレン	27,700	1,979.00	54,818,300
ソトー	4,300	998.00	4,291,400
東海染工	1,600	1,155.00	1,848,000
小松マテーレ	18,500	926.00	17,131,000
ワコールホールディングス	32,800	3,080.00	101,024,000
ホギメディカル	14,000	3,245.00	45,430,000
レナウン	32,800	118.00	3,870,400
クラウドシアホールディングス	2,700	512.00	1,382,400
T S I ホールディングス	41,600	813.00	33,820,800
マツオカコーポレーション	3,600	3,495.00	12,582,000
ワールド	11,600	2,311.00	26,807,600
T I S	37,600	5,280.00	198,528,000
ネオス	3,800	1,293.00	4,913,400
電算システム	4,300	2,262.00	9,726,600
グリー	60,600	488.00	29,572,800
コーエーテクモホールディングス	23,100	1,810.00	41,811,000
三菱総合研究所	4,400	3,890.00	17,116,000
ボルテージ	2,200	660.00	1,452,000
電算	1,200	2,104.00	2,524,800
A G S	6,400	788.00	5,043,200
ファインデックス	9,500	682.00	6,479,000
ヒト・コミュニケーションズ	2,600	1,969.00	5,119,400
ブレインパッド	2,400	6,120.00	14,688,000
K L a b	20,100	1,065.00	21,406,500
ポールトゥウィン・ピットクルーホールディングス	7,500	2,387.00	17,902,500
イーブクイニシアティブジャパン	1,800	1,545.00	2,781,000
ネクソン	287,600	1,197.00	344,257,200
アイスタイル	28,700	1,007.00	28,900,900
エムアップ	3,900	2,368.00	9,235,200
エイチーム	7,100	1,861.00	13,213,100
テクノスジャパン	9,500	970.00	9,215,000
e n i s h	3,900	556.00	2,168,400
コロブラ	32,200	828.00	26,661,600
オルトプラス	6,900	409.00	2,822,100

ブロードリーフ	56,000	683.00	38,248,000
クロス・マーケティンググループ	3,100	467.00	1,447,700
デジタルハーツホールディングス	5,100	1,650.00	8,415,000
メディアドゥホールディングス	3,300	2,568.00	8,474,400
じげん	12,000	711.00	8,532,000
ブイキューブ	5,900	538.00	3,174,200
サイバーリンクス	1,700	1,055.00	1,793,500
ディー・エル・イー	7,100	286.00	2,030,600
フィックスターズ	10,800	1,366.00	14,752,800
VOYAGE GROUP	6,000	1,380.00	8,280,000
オブティム	2,500	3,780.00	9,450,000
セレス	3,700	2,099.00	7,766,300
特種東海製紙	7,200	4,270.00	30,744,000
ベリサーブ	1,100	6,020.00	6,622,000
ティーガイア	11,300	2,486.00	28,091,800
セック	1,800	4,560.00	8,208,000
日本アジアグループ	12,000	381.00	4,572,000
豆蔵ホールディングス	7,700	1,081.00	8,323,700
テクマトリックス	8,000	1,877.00	15,016,000
プロシップ	1,600	2,600.00	4,160,000
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	272,200	232.00	63,150,400
GMOペイメントゲートウェイ	18,600	5,710.00	106,206,000
ザッパラス	5,600	381.00	2,133,600
システムリサーチ	1,500	3,545.00	5,317,500
インターネットイニシアティブ	18,400	2,516.00	46,294,400
さくらインターネット	13,500	568.00	7,668,000
ヴィンクス	3,800	1,726.00	6,558,800
GMOクラウド	2,500	3,045.00	7,612,500
SRAホールディングス	6,000	2,922.00	17,532,000
MINORIソリューションズ	2,200	1,504.00	3,308,800
システムインテグレータ	1,600	2,064.00	3,302,400
朝日ネット	9,500	518.00	4,921,000
eBASE	3,400	1,531.00	5,205,400
アバント	3,000	1,327.00	3,981,000
アドソル日進	4,000	2,006.00	8,024,000
フリービット	7,500	864.00	6,480,000
コムチュア	6,300	3,355.00	21,136,500
サイバーコム	2,000	1,817.00	3,634,000
アステリア	5,600	894.00	5,006,400
王子ホールディングス	507,600	764.00	387,806,400
日本製紙	54,000	2,095.00	113,130,000
三菱製紙	18,500	589.00	10,896,500
北越コーポレーション	74,800	576.00	43,084,800
中越パルプ工業	4,800	1,563.00	7,502,400
巴川製紙所	3,800	1,145.00	4,351,000
大王製紙	54,900	1,385.00	76,036,500
阿波製紙	2,800	584.00	1,635,200
マークラインズ	3,900	1,546.00	6,029,400
メディカル・データ・ビジョン	10,000	1,711.00	17,110,000

g u m i	13,000	654.00	8,502,000	
ショーケース・ティービー	2,400	995.00	2,388,000	
モバイルファクトリー	3,100	1,443.00	4,473,300	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	5,000	1,536.00	7,680,000	
P C Iホールディングス	2,000	2,964.00	5,928,000	
パイプドHD	1,800	1,032.00	1,857,600	
アイビーシー	1,800	1,270.00	2,286,000	
ネオジャパン	2,100	910.00	1,911,000	
P R T I M E S	700	1,987.00	1,390,900	
ランドコンピュータ	1,300	1,095.00	1,423,500	
オープンドア	5,600	2,589.00	14,498,400	
マイネット	3,600	1,111.00	3,999,600	
アカツキ	4,000	5,590.00	22,360,000	
ベネフィットジャパン	600	775.00	465,000	
U b i c o mホールディングス	2,000	1,080.00	2,160,000	
L I N E	34,400	3,390.00	116,616,000	
カナミックネットワーク	1,700	2,069.00	3,517,300	
ノムラシステムコーポレーション	900	1,081.00	972,900	
レンゴー	116,300	899.00	104,553,700	
トーモク	7,000	1,953.00	13,671,000	
ザ・パック	8,500	3,405.00	28,942,500	
チェンジ	700	4,770.00	3,339,000	
シンクロ・フード	4,800	621.00	2,980,800	
オークネット	5,900	1,194.00	7,044,600	
A O I T Y O H O L D I N G S	12,300	1,259.00	15,485,700	
マクロミル	14,200	1,952.00	27,718,400	
ビーグリー	2,100	1,387.00	2,912,700	
オロ	1,100	4,290.00	4,719,000	
昭和電工	74,900	4,865.00	364,388,500	
住友化学	887,500	610.00	541,375,000	
住友精化	5,500	4,840.00	26,620,000	
日産化学	69,200	5,900.00	408,280,000	
ラサ工業	4,000	1,854.00	7,416,000	
クレハ	10,400	7,880.00	81,952,000	
多木化学	1,600	8,130.00	13,008,000	
テイカ	9,200	2,090.00	19,228,000	
石原産業	21,700	1,506.00	32,680,200	
片倉コープアグリ	2,800	1,166.00	3,264,800	
日東エフシー	7,300	795.00	5,803,500	
日本曹達	17,800	2,776.00	49,412,800	
東ソー	174,300	1,561.00	272,082,300	
トクヤマ	32,500	2,687.00	87,327,500	
セントラル硝子	24,600	2,724.00	67,010,400	
東亜合成	70,800	1,231.00	87,154,800	
大阪ソーダ	12,100	2,749.00	33,262,900	
関東電化工業	26,700	1,089.00	29,076,300	
デンカ	44,300	3,590.00	159,037,000	
イビデン	70,500	1,620.00	114,210,000	
信越化学工業	198,700	10,170.00	2,020,779,000	

日本カーバイド工業	3,800	1,960.00	7,448,000
堺化学工業	7,500	2,846.00	21,345,000
第一稀元素化学工業	9,200	1,147.00	10,552,400
エア・ウォーター	92,400	1,872.00	172,972,800
大陽日酸	92,900	1,960.00	182,084,000
日本化学工業	3,800	2,701.00	10,263,800
東邦アセチレン	1,700	1,475.00	2,507,500
日本パーカライジング	61,600	1,488.00	91,660,800
高压ガス工業	18,000	879.00	15,822,000
チタン工業	1,400	2,503.00	3,504,200
四国化成工業	19,000	1,222.00	23,218,000
戸田工業	2,400	2,495.00	5,988,000
ステラ ケミファ	6,600	3,395.00	22,407,000
保土谷化学工業	3,900	2,753.00	10,736,700
日本触媒	19,000	7,080.00	134,520,000
大日精化工業	9,300	3,390.00	31,527,000
カネカ	30,000	4,440.00	133,200,000
協和発酵キリン	144,200	2,262.00	326,180,400
三菱瓦斯化学	116,000	1,844.00	213,904,000
三井化学	102,300	2,811.00	287,565,300
J S R	113,100	1,790.00	202,449,000
東京応化工業	19,300	3,160.00	60,988,000
大阪有機化学工業	10,400	1,431.00	14,882,400
三菱ケミカルホールディングス	753,700	940.40	708,779,480
K Hネオケム	17,100	3,315.00	56,686,500
ダイセル	175,100	1,279.00	223,952,900
住友ベークライト	19,500	4,170.00	81,315,000
積水化学工業	246,400	1,873.00	461,507,200
日本ゼオン	101,700	1,202.00	122,243,400
アイカ工業	33,800	3,425.00	115,765,000
宇部興産	56,900	2,563.00	145,834,700
積水樹脂	18,600	2,107.00	39,190,200
タキロンシーアイ	24,400	596.00	14,542,400
旭有機材	7,800	2,038.00	15,896,400
日立化成	52,100	1,803.00	93,936,300
ニチバン	5,900	2,244.00	13,239,600
リケンテクノス	30,800	518.00	15,954,400
大倉工業	5,800	2,111.00	12,243,800
積水化成成品工業	16,800	1,002.00	16,833,600
群栄化学工業	2,700	3,215.00	8,680,500
タイガースポリマー	6,100	704.00	4,294,400
ミライアル	3,300	999.00	3,296,700
ダイキアクシス	4,000	1,350.00	5,400,000
ダイキョーニシカワ	23,800	1,026.00	24,418,800
竹本容器	2,000	2,847.00	5,694,000
森六ホールディングス	6,100	3,025.00	18,452,500
日本化薬	71,700	1,450.00	103,965,000
カーリットホールディングス	12,000	909.00	10,908,000
E P Sホールディングス	16,600	2,110.00	35,026,000
ソルクシーズ	4,800	855.00	4,104,000

レグス	2,700	1,137.00	3,069,900
プレステージ・インターナショナル	20,600	1,272.00	26,203,200
フェイス	3,900	1,243.00	4,847,700
ハイマックス	1,400	1,796.00	2,514,400
アミューズ	6,700	2,933.00	19,651,100
野村総合研究所	71,800	5,170.00	371,206,000
ドリームインキュベータ	3,300	1,905.00	6,286,500
サイバネットシステム	9,300	687.00	6,389,100
クイック	6,800	1,601.00	10,886,800
T A C	6,400	256.00	1,638,400
C Eホールディングス	3,000	791.00	2,373,000
ケネディクス	102,800	559.00	57,465,200
日本システム技術	1,800	2,014.00	3,625,200
電通	134,000	5,340.00	715,560,000
インテージホールディングス	14,500	1,085.00	15,732,500
テイクアンドギヴ・ニーズ	4,200	2,233.00	9,378,600
東邦システムサイエンス	3,400	887.00	3,015,800
ぴあ	3,100	5,380.00	16,678,000
イオンファンタジー	3,500	3,700.00	12,950,000
ソースネクスト	21,800	1,035.00	22,563,000
シーティーエス	12,400	733.00	9,089,200
ネクシィーズグループ	3,400	1,994.00	6,779,600
メディカルシステムネットワーク	12,100	484.00	5,856,400
日本精化	9,100	1,119.00	10,182,900
扶桑化学工業	11,400	2,377.00	27,097,800
トリケミカル研究所	2,500	4,645.00	11,612,500
F I G	10,000	450.00	4,500,000
A D E K A	55,600	1,766.00	98,189,600
日油	43,400	3,705.00	160,797,000
ミヨシ油脂	4,700	1,271.00	5,973,700
新日本理化	20,500	214.00	4,387,000
ハリマ化成グループ	9,400	1,030.00	9,682,000
花王	279,500	7,752.00	2,166,684,000
第一工業製薬	4,200	2,605.00	10,941,000
石原ケミカル	2,900	2,110.00	6,119,000
日華化学	3,700	1,171.00	4,332,700
ニイタカ	1,700	1,788.00	3,039,600
三洋化成工業	7,600	5,450.00	41,420,000
武田薬品工業	454,500	4,559.00	2,072,065,500
アステラス製薬	1,061,400	1,712.00	1,817,116,800
大日本住友製薬	85,300	2,936.00	250,440,800
塩野義製薬	150,600	7,528.00	1,133,716,800
田辺三菱製薬	120,400	1,710.00	205,884,000
わかもと製薬	13,400	281.00	3,765,400
あすか製薬	14,200	1,200.00	17,040,000
日本新薬	30,100	7,480.00	225,148,000
ビオフェルミン製薬	1,800	2,878.00	5,180,400
中外製薬	120,000	6,890.00	826,800,000
科研製薬	20,800	5,810.00	120,848,000
エーザイ	137,800	10,350.00	1,426,230,000

理研ビタミン	5,500	3,660.00	20,130,000
ロート製薬	59,000	3,610.00	212,990,000
小野薬品工業	271,900	2,709.50	736,713,050
久光製薬	34,000	6,930.00	235,620,000
有機合成薬品工業	7,800	256.00	1,996,800
持田製薬	8,700	9,690.00	84,303,000
参天製薬	218,300	1,870.00	408,221,000
扶桑薬品工業	3,900	2,768.00	10,795,200
日本ケミファ	1,500	4,085.00	6,127,500
ツムラ	35,700	3,570.00	127,449,000
日医工	28,200	1,655.00	46,671,000
テルモ	162,900	6,335.00	1,031,971,500
みらかホールディングス	30,800	2,943.00	90,644,400
キッセイ薬品工業	20,400	3,475.00	70,890,000
生化学工業	22,300	1,616.00	36,036,800
栄研化学	20,200	2,471.00	49,914,200
日水製薬	4,900	1,255.00	6,149,500
鳥居薬品	6,200	2,391.00	14,824,200
JCRファーマ	8,100	5,340.00	43,254,000
東和薬品	5,500	8,880.00	48,840,000
富士製薬工業	7,800	1,884.00	14,695,200
沢井製薬	23,600	5,910.00	139,476,000
ゼリア新薬工業	22,800	2,104.00	47,971,200
第一三共	329,400	4,468.00	1,471,759,200
キョーリン製薬ホールディングス	29,500	2,700.00	79,650,000
大幸薬品	5,100	2,150.00	10,965,000
ダイト	6,700	3,505.00	23,483,500
大塚ホールディングス	219,300	5,683.00	1,246,281,900
大正製薬ホールディングス	25,800	12,440.00	320,952,000
ペプチドリーム	53,000	4,395.00	232,935,000
大日本塗料	12,800	1,142.00	14,617,600
日本ペイントホールディングス	93,000	3,745.00	348,285,000
関西ペイント	126,700	1,716.00	217,417,200
神東塗料	8,800	189.00	1,663,200
中国塗料	37,000	982.00	36,334,000
日本特殊塗料	8,400	1,872.00	15,724,800
藤倉化成	15,400	633.00	9,748,200
太陽ホールディングス	9,300	3,790.00	35,247,000
DIC	51,000	3,385.00	172,635,000
サカタインクス	24,600	1,177.00	28,954,200
東洋インキSCホールディングス	23,800	2,624.00	62,451,200
T&K TOKA	8,800	1,109.00	9,759,200
アルプス技研	9,600	2,155.00	20,688,000
サニックス	19,200	234.00	4,492,800
ダイオーズ	2,600	1,320.00	3,432,000
日本空調サービス	12,500	792.00	9,900,000
オリエンタルランド	130,000	10,955.00	1,424,150,000
フォーカスシステムズ	7,600	1,078.00	8,192,800
ダスキン	29,600	2,463.00	72,904,800
パーク24	66,300	3,015.00	199,894,500

明光ネットワークジャパン	13,900	998.00	13,872,200	
ファルコホールディングス	6,100	1,652.00	10,077,200	
クレスコ	3,400	3,520.00	11,968,000	
フジ・メディア・ホールディングス	117,200	1,809.00	212,014,800	
秀英予備校	2,300	494.00	1,136,200	
田谷	1,900	650.00	1,235,000	
ラウンドワン	34,100	1,152.00	39,283,200	
リゾートトラスト	46,500	1,722.00	80,073,000	
オービック	39,200	9,810.00	384,552,000	
ジャストシステム	16,100	2,298.00	36,997,800	
TDCソフト	9,900	976.00	9,662,400	
ヤフー	736,500	327.00	240,835,500	
ビー・エム・エル	14,200	2,869.00	40,739,800	
ワタベウェディング	1,700	791.00	1,344,700	
トレンドマイクロ	60,200	6,410.00	385,882,000	
りらいあコミュニケーションズ	19,900	1,054.00	20,974,600	
インフォメーション・ディベロプメント	3,200	1,624.00	5,196,800	
リソー教育	18,600	1,222.00	22,729,200	
日本オラクル	18,300	7,430.00	135,969,000	
早稲田アカデミー	1,500	2,412.00	3,618,000	
アルファシステムズ	3,700	2,805.00	10,378,500	
フューチャー	15,300	1,654.00	25,306,200	
CAC Holdings	8,500	1,081.00	9,188,500	
ソフトバンク・テクノロジー	4,800	2,075.00	9,960,000	
トーセ	3,100	934.00	2,895,400	
ユー・エス・エス	134,400	2,068.00	277,939,200	
オービックビジネスコンサルタント	5,800	9,600.00	55,680,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	51,500	2,039.00	105,008,500	
アイティフォー	13,700	797.00	10,918,900	
東京個別指導学院	3,900	1,400.00	5,460,000	
東計電算	1,600	3,430.00	5,488,000	
サイバーエージェント	67,800	4,805.00	325,779,000	
楽天	512,700	934.00	478,861,800	
エクスネット	2,100	930.00	1,953,000	
クリーク・アンド・リバー社	6,400	1,031.00	6,598,400	
テー・オー・ダブリュー	10,500	881.00	9,250,500	
大塚商会	61,100	4,045.00	247,149,500	
サイボウズ	13,200	741.00	9,781,200	
ソフトブレーン	8,900	569.00	5,064,100	
セントラルスポーツ	4,100	3,775.00	15,477,500	
パラカ	2,900	1,932.00	5,602,800	
電通国際情報サービス	7,000	4,080.00	28,560,000	
デジタルガレージ	22,000	3,190.00	70,180,000	
イーエムシステムズ	9,100	1,255.00	11,420,500	
ウェザーニューズ	3,800	3,420.00	12,996,000	
C I J	8,900	753.00	6,701,700	
東洋ビジネスエンジニアリング	1,100	2,162.00	2,378,200	
日本エンタープライズ	11,900	233.00	2,772,700	
WOWOW	5,400	3,315.00	17,901,000	

スカラ	9,100	918.00	8,353,800
フルキャストホールディングス	11,000	2,152.00	23,672,000
エン・ジャパン	12,000	4,100.00	49,200,000
富士フイルムホールディングス	239,100	4,702.00	1,124,248,200
コニカミノルタ	251,500	1,048.00	263,572,000
資生堂	228,700	7,039.00	1,609,819,300
ライオン	160,400	2,048.00	328,499,200
高砂香料工業	7,900	3,975.00	31,402,500
マンダム	25,900	3,190.00	82,621,000
ミルボン	14,200	4,215.00	59,853,000
ファンケル	25,600	5,430.00	139,008,000
コーセー	19,500	17,360.00	338,520,000
コタ	5,500	1,506.00	8,283,000
シーズ・ホールディングス	13,900	5,860.00	81,454,000
シーボン	1,300	2,712.00	3,525,600
ポーラ・オルビスホールディングス	49,100	3,045.00	149,509,500
ノエビアホールディングス	7,300	5,170.00	37,741,000
アジュバンコスメジャパン	2,600	996.00	2,589,600
エステー	8,200	2,140.00	17,548,000
アグロ カネショウ	4,700	2,309.00	10,852,300
コニシ	20,400	1,686.00	34,394,400
長谷川香料	13,700	2,045.00	28,016,500
星光P M C	7,700	932.00	7,176,400
小林製薬	32,300	7,360.00	237,728,000
荒川化学工業	10,400	1,601.00	16,650,400
メック	7,900	1,424.00	11,249,600
日本高純度化学	3,000	2,321.00	6,963,000
タカラバイオ	30,100	2,657.00	79,975,700
J C U	14,900	2,051.00	30,559,900
新田ゼラチン	7,300	778.00	5,679,400
O A Tアグリオ	1,600	2,510.00	4,016,000
デクセリアルズ	29,600	1,005.00	29,748,000
アース製薬	8,700	5,450.00	47,415,000
北興化学工業	12,000	594.00	7,128,000
大成ラミック	3,400	3,075.00	10,455,000
クミアイ化学工業	47,600	702.00	33,415,200
日本農薬	27,600	617.00	17,029,200
昭和シェル石油	107,700	2,025.00	218,092,500
富士興産	4,300	612.00	2,631,600
ニチレキ	14,800	1,089.00	16,117,200
ユシロ化学工業	6,000	1,400.00	8,400,000
ビーピー・カストロール	4,100	1,490.00	6,109,000
富士石油	27,900	380.00	10,602,000
M O R E S C O	4,200	1,675.00	7,035,000
出光興産	89,200	4,785.00	426,822,000
J X T Gホールディングス	1,959,700	724.90	1,420,586,530
コスモエネルギーホールディングス	33,300	3,945.00	131,368,500
横浜ゴム	66,700	2,320.00	154,744,000
東洋ゴム工業	59,100	1,701.00	100,529,100
ブリヂストン	353,800	4,263.00	1,508,249,400

住友ゴム工業	103,400	1,572.00	162,544,800
藤倉ゴム工業	10,200	533.00	5,436,600
オカモト	8,000	5,620.00	44,960,000
アキレス	8,400	2,299.00	19,311,600
フコク	5,200	966.00	5,023,200
ニッタ	13,000	4,095.00	53,235,000
クリエートメディック	3,900	1,111.00	4,332,900
住友理工	22,400	1,070.00	23,968,000
三ツ星ベルト	15,200	2,567.00	39,018,400
バンドー化学	22,000	1,330.00	29,260,000
A G C	116,100	3,880.00	450,468,000
日本板硝子	55,000	993.00	54,615,000
石塚硝子	1,500	2,221.00	3,331,500
有沢製作所	18,100	870.00	15,747,000
日本山村硝子	4,900	1,747.00	8,560,300
日本電気硝子	49,800	2,975.00	148,155,000
オハラ	4,500	2,420.00	10,890,000
住友大阪セメント	23,200	4,580.00	106,256,000
太平洋セメント	72,700	3,655.00	265,718,500
リソルホールディングス	1,200	4,150.00	4,980,000
日本ヒューム	11,600	931.00	10,799,600
日本コンクリート工業	25,000	323.00	8,075,000
三谷セキサン	5,400	2,808.00	15,163,200
アジアパイルホールディングス	16,300	702.00	11,442,600
東海カーボン	104,500	1,769.00	184,860,500
日本カーボン	5,500	6,290.00	34,595,000
東洋炭素	6,800	2,902.00	19,733,600
ノリタケカンパニーリミテド	6,900	5,630.00	38,847,000
T O T O	88,600	4,365.00	386,739,000
日本碍子	140,500	1,683.00	236,461,500
日本特殊陶業	97,100	2,575.00	250,032,500
ダントーホールディングス	8,800	128.00	1,126,400
M A R U W A	4,000	6,440.00	25,760,000
品川リフラクトリーズ	3,000	5,050.00	15,150,000
黒崎播磨	2,300	7,260.00	16,698,000
ヨータイ	10,100	773.00	7,807,300
イソライト工業	5,900	509.00	3,003,100
東京窯業	14,700	424.00	6,232,800
ニッカトー	5,200	1,023.00	5,319,600
フジインコーポレーテッド	10,300	2,544.00	26,203,200
クニミネ工業	3,900	1,002.00	3,907,800
エーアンドエーマテリアル	2,400	1,136.00	2,726,400
ニチアス	31,500	2,381.00	75,001,500
新日鐵住金	509,500	2,197.50	1,119,626,250
神戸製鋼所	208,300	984.00	204,967,200
中山製鋼所	15,800	610.00	9,638,000
合同製鐵	5,500	2,006.00	11,033,000
ジェイ エフ イー ホールディングス	307,400	2,172.50	667,826,500
日新製鋼	27,500	1,552.00	42,680,000

東京製鐵	60,900	920.00	56,028,000
共英製鋼	12,800	2,354.00	30,131,200
大和工業	24,200	3,070.00	74,294,000
東京鐵鋼	4,700	1,474.00	6,927,800
大阪製鐵	7,600	2,014.00	15,306,400
淀川製鋼所	15,400	2,435.00	37,499,000
丸一鋼管	40,300	3,345.00	134,803,500
モリ工業	3,400	3,030.00	10,302,000
大同特殊鋼	18,600	4,620.00	85,932,000
日本高周波鋼業	4,300	700.00	3,010,000
日本冶金工業	94,100	293.00	27,571,300
山陽特殊製鋼	14,300	2,713.00	38,795,900
愛知製鋼	6,400	4,155.00	26,592,000
日立金属	122,700	1,404.00	172,270,800
日本金属	2,600	1,509.00	3,923,400
大平洋金属	7,700	3,245.00	24,986,500
新日本電工	68,100	267.00	18,182,700
栗本鐵工所	5,800	1,671.00	9,691,800
虹 技	1,600	1,672.00	2,675,200
日本鑄鉄管	1,200	1,318.00	1,581,600
日本製鋼所	34,500	2,466.00	85,077,000
三菱製鋼	8,500	1,952.00	16,592,000
日垂鋼業	16,200	324.00	5,248,800
日本精線	1,600	3,590.00	5,744,000
エンビプロ・ホールディングス	2,300	691.00	1,589,300
大紀アルミニウム工業所	18,700	704.00	13,164,800
日本軽金属ホールディングス	310,100	247.00	76,594,700
三井金属鉱業	30,700	2,587.00	79,420,900
東邦亜鉛	6,300	3,930.00	24,759,000
三菱マテリアル	75,200	3,025.00	227,480,000
住友金属鉱山	155,900	3,397.00	529,592,300
DOWAホールディングス	26,600	3,530.00	93,898,000
古河機械金属	18,800	1,495.00	28,106,000
エス・サイエンス	50,400	76.00	3,830,400
大阪チタニウムテクノロジーズ	13,200	2,026.00	26,743,200
東邦チタニウム	20,400	1,408.00	28,723,200
UACJ	17,300	2,358.00	40,793,400
CKサンエツ	2,100	2,927.00	6,146,700
古河電気工業	32,800	3,150.00	103,320,000
住友電気工業	425,600	1,578.00	671,596,800
フジクラ	137,400	480.00	65,952,000
昭和電線ホールディングス	13,200	691.00	9,121,200
東京特殊電線	1,500	2,050.00	3,075,000
タツタ電線	22,600	562.00	12,701,200
カナレ電気	1,800	2,055.00	3,699,000
平河ヒューテック	4,700	1,363.00	6,406,100
リョービ	14,000	3,410.00	47,740,000
アールスティ	14,000	730.00	10,220,000
アサヒホールディングス	21,400	2,401.00	51,381,400
東洋製罐グループホールディングス	72,500	2,400.00	174,000,000

ホッカホールディングス	5,800	1,715.00	9,947,000
コロナ	6,400	1,138.00	7,283,200
横河ブリッジホールディングス	21,200	1,915.00	40,598,000
OSJBホールディングス	57,100	279.00	15,930,900
駒井ハルテック	2,200	2,303.00	5,066,600
高田機工	1,000	2,732.00	2,732,000
三和ホールディングス	117,600	1,349.00	158,642,400
文化シャッター	33,600	780.00	26,208,000
三協立山	15,800	1,324.00	20,919,200
アルインコ	9,100	1,067.00	9,709,700
東洋シャッター	2,800	640.00	1,792,000
LIXILグループ	168,000	1,451.00	243,768,000
日本フィルコン	8,800	605.00	5,324,000
ノーリツ	25,400	1,768.00	44,907,200
長府製作所	11,600	2,391.00	27,735,600
リンナイ	20,300	8,140.00	165,242,000
ユニプレス	22,300	2,264.00	50,487,200
ダイニチ工業	6,000	747.00	4,482,000
日東精工	15,700	638.00	10,016,600
三洋工業	1,400	2,066.00	2,892,400
岡部	23,100	988.00	22,822,800
ジーテクト	12,600	1,743.00	21,961,800
中国工業	1,700	609.00	1,035,300
東プレ	21,200	2,409.00	51,070,800
高周波熱錬	22,000	955.00	21,010,000
東京製綱	7,000	1,233.00	8,631,000
サンコール	6,500	785.00	5,102,500
モリテックスチール	8,900	475.00	4,227,500
パイオラックス	18,200	2,844.00	51,760,800
エイチワン	11,200	1,123.00	12,577,600
日本発条	113,400	991.00	112,379,400
中央発條	1,300	3,530.00	4,589,000
アドパネクス	1,500	1,902.00	2,853,000
三浦工業	49,300	2,779.00	137,004,700
タクマ	41,500	1,480.00	61,420,000
テクノプロ・ホールディングス	20,700	5,640.00	116,748,000
アトラ	2,100	498.00	1,045,800
インターワークス	2,100	794.00	1,667,400
アイ・アールジャパンホールディングス	3,500	1,277.00	4,469,500
Keeper 技研	3,600	1,108.00	3,988,800
ファーストロジック	2,100	843.00	1,770,300
三機サービス	1,700	1,929.00	3,279,300
Gunosy	6,800	2,816.00	19,148,800
デザインワン・ジャパン	2,100	483.00	1,014,300
イー・ガーディアン	5,200	2,615.00	13,598,000
リブセンス	5,900	353.00	2,082,700
ジャパンマテリアル	30,100	1,149.00	34,584,900
ベクトル	13,400	1,973.00	26,438,200
ウチヤマホールディングス	5,600	493.00	2,760,800

ライクキッズネクスト	2,300	1,092.00	2,511,600
キャリアリンク	4,000	432.00	1,728,000
I B J	7,400	733.00	5,424,200
アサンテ	4,400	2,231.00	9,816,400
N・フィールド	7,100	1,438.00	10,209,800
バリューHR	2,300	2,261.00	5,200,300
M&Aキャピタルパートナーズ	2,800	4,600.00	12,880,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	4,500	1,305.00	5,872,500
E R Iホールディングス	3,100	948.00	2,938,800
アビスト	1,700	3,760.00	6,392,000
シグマクシス	5,200	1,107.00	5,756,400
ウィルグループ	7,100	1,108.00	7,866,800
エスクロー・エージェント・ジャパン	15,100	486.00	7,338,600
日本ビューホテル	3,500	1,274.00	4,459,000
リクルートホールディングス	788,000	3,028.00	2,386,064,000
エラン	3,800	3,325.00	12,635,000
ツガミ	25,500	1,047.00	26,698,500
オークマ	14,500	5,600.00	81,200,000
東芝機械	12,800	2,004.00	25,651,200
アマダホールディングス	175,600	1,115.00	195,794,000
アイダエンジニアリング	31,600	966.00	30,525,600
滝澤鉄工所	3,600	1,634.00	5,882,400
F U J I	34,100	1,504.00	51,286,400
牧野フライス製作所	13,300	4,475.00	59,517,500
オーエスジー	56,000	2,325.00	130,200,000
ダイジェット工業	1,300	1,883.00	2,447,900
旭ダイヤモンド工業	29,800	744.00	22,171,200
D M G 森精機	72,000	1,563.00	112,536,000
ソディック	24,800	890.00	22,072,000
ディスコ	15,400	17,490.00	269,346,000
日東工器	6,200	2,570.00	15,934,000
日進工具	3,400	2,480.00	8,432,000
パンチ工業	7,900	617.00	4,874,300
富士ダイス	5,100	830.00	4,233,000
土木管理総合試験所	4,800	634.00	3,043,200
日本郵政	901,700	1,374.00	1,238,935,800
ベルシステム24ホールディングス	18,400	1,528.00	28,115,200
鎌倉新書	8,000	1,062.00	8,496,000
一蔵	1,400	733.00	1,026,200
L I T A L I C O	2,500	2,166.00	5,415,000
グローバルグループ	1,300	1,470.00	1,911,000
エボラブルアジア	3,100	2,255.00	6,990,500
アトラエ	2,100	2,392.00	5,023,200
ストライク	2,800	3,030.00	8,484,000
ソラスト	26,700	1,320.00	35,244,000
セラク	2,400	802.00	1,924,800
インソース	3,600	2,419.00	8,708,400
豊田自動織機	93,200	5,720.00	533,104,000
豊和工業	6,300	897.00	5,651,100

OKK	4,700	1,122.00	5,273,400
石川製作所	2,700	1,457.00	3,933,900
東洋機械金属	8,200	626.00	5,133,200
津田駒工業	2,400	2,076.00	4,982,400
エンシュウ	3,000	1,465.00	4,395,000
島精機製作所	15,700	3,355.00	52,673,500
オプトラ	11,100	2,140.00	23,754,000
NCホールディングス	3,500	608.00	2,128,000
フリー	9,100	936.00	8,517,600
ヤマシンフィルタ	19,800	880.00	17,424,000
日阪製作所	14,100	1,047.00	14,762,700
やまびこ	22,100	1,325.00	29,282,500
平田機工	5,400	7,310.00	39,474,000
ペガサスミシン製造	10,700	900.00	9,630,000
タツモ	3,600	1,124.00	4,046,400
ナプテスコ	62,600	2,836.00	177,533,600
三井海洋開発	12,100	3,100.00	37,510,000
レオン自動機	11,200	1,753.00	19,633,600
S M C	33,700	36,930.00	1,244,541,000
新川	8,600	507.00	4,360,200
ホソカワミクロン	4,000	5,320.00	21,280,000
ユニオンツール	4,900	3,980.00	19,502,000
オイレス工業	15,900	1,996.00	31,736,400
日精エー・エス・ピー機械	3,300	4,125.00	13,612,500
サトーホールディングス	13,700	3,015.00	41,305,500
技研製作所	7,900	3,945.00	31,165,500
日本エアーテック	3,500	725.00	2,537,500
カワタ	2,300	1,661.00	3,820,300
日精樹脂工業	9,600	1,097.00	10,531,200
オカダアイヨン	3,900	1,749.00	6,821,100
ワイエイシイホールディングス	4,600	782.00	3,597,200
小松製作所	521,200	3,115.00	1,623,538,000
住友重機械工業	65,900	3,690.00	243,171,000
日立建機	46,100	3,205.00	147,750,500
日工	3,200	2,503.00	8,009,600
巴工業	4,900	2,305.00	11,294,500
井関農機	11,500	2,025.00	23,287,500
T O W A	9,800	807.00	7,908,600
丸山製作所	2,400	1,650.00	3,960,000
北川鉄工所	5,200	2,909.00	15,126,800
シンニッタン	17,800	367.00	6,532,600
ローツェ	5,000	1,878.00	9,390,000
タカキタ	4,100	672.00	2,755,200
クボタ	617,500	1,885.50	1,164,296,250
荏原実業	3,300	1,879.00	6,200,700
東洋エンジニアリング	15,200	875.00	13,300,000
三菱化工機	4,000	1,716.00	6,864,000
月島機械	22,800	1,327.00	30,255,600
帝国電機製作所	8,000	1,786.00	14,288,000
東京機械製作所	4,400	427.00	1,878,800

新東工業	27,300	992.00	27,081,600
澁谷工業	10,100	4,210.00	42,521,000
アイチコーポレーション	19,900	660.00	13,134,000
小森コーポレーション	31,100	1,255.00	39,030,500
鶴見製作所	9,000	2,012.00	18,108,000
住友精密工業	1,800	3,595.00	6,471,000
酒井重工業	2,100	2,930.00	6,153,000
荏原製作所	51,000	3,345.00	170,595,000
石井鐵工所	1,700	1,884.00	3,202,800
西島製作所	11,800	939.00	11,080,200
北越工業	11,900	1,235.00	14,696,500
千代田化工建設	93,000	339.00	31,527,000
ダイキン工業	157,100	12,905.00	2,027,375,500
オルガノ	4,200	3,090.00	12,978,000
トーヨーカネツ	4,300	2,493.00	10,719,900
栗田工業	62,300	3,010.00	187,523,000
椿本チエイン	15,000	4,295.00	64,425,000
大同工業	5,500	1,019.00	5,604,500
日機装	37,200	1,284.00	47,764,800
木村化工機	9,600	402.00	3,859,200
新興プランテック	23,200	1,066.00	24,731,200
アネスト岩田	17,900	1,269.00	22,715,100
ダイフク	63,300	5,440.00	344,352,000
サムコ	3,200	1,194.00	3,820,800
加藤製作所	5,900	2,989.00	17,635,100
油研工業	2,000	2,170.00	4,340,000
タダノ	55,500	1,365.00	75,757,500
フジテック	41,800	1,351.00	56,471,800
C K D	32,000	1,261.00	40,352,000
キトー	8,700	1,919.00	16,695,300
平和	32,100	2,657.00	85,289,700
理想科学工業	10,200	2,062.00	21,032,400
S A N K Y O	28,800	4,445.00	128,016,000
日本金銭機械	12,700	1,071.00	13,601,700
マースグループホールディングス	7,300	2,362.00	17,242,600
福島工業	7,100	4,560.00	32,376,000
オーイズミ	4,700	495.00	2,326,500
ダイコク電機	5,300	1,645.00	8,718,500
竹内製作所	19,200	2,452.00	47,078,400
アマノ	32,900	2,333.00	76,755,700
J U K I	16,000	1,520.00	24,320,000
サンデンホールディングス	14,000	918.00	12,852,000
蛇の目マシン工業	10,500	580.00	6,090,000
ブラザー工業	150,000	1,882.00	282,300,000
マックス	17,700	1,523.00	26,957,100
モリタホールディングス	20,100	2,089.00	41,988,900
グローリー	31,900	3,015.00	96,178,500
新晃工業	10,700	1,628.00	17,419,600
大和冷機工業	16,600	1,275.00	21,165,000
セガサミーホールディングス	114,200	1,640.00	187,288,000

日本ピストンリング	4,200	2,145.00	9,009,000
リケン	5,300	5,560.00	29,468,000
T P R	15,500	2,718.00	42,129,000
ツバキ・ナカシマ	17,300	1,971.00	34,098,300
ホシザキ	33,600	9,110.00	306,096,000
大豊工業	9,400	1,144.00	10,753,600
日本精工	236,400	1,088.00	257,203,200
N T N	247,400	378.00	93,517,200
ジェイテクト	110,400	1,374.00	151,689,600
不二越	10,700	4,750.00	50,825,000
ミネベアミツミ	213,700	1,753.00	374,616,100
日本トムソン	34,200	596.00	20,383,200
T H K	71,800	2,586.00	185,674,800
ユ-シン精機	8,900	1,282.00	11,409,800
前澤給装工業	4,500	1,888.00	8,496,000
イーグル工業	14,200	1,506.00	21,385,200
前澤工業	8,500	388.00	3,298,000
日本ピラー工業	11,600	1,570.00	18,212,000
キッツ	46,600	963.00	44,875,800
日立製作所	518,300	3,467.00	1,796,946,100
三菱電機	1,151,100	1,464.50	1,685,785,950
富士電機	74,700	3,615.00	270,040,500
東洋電機製造	4,500	1,595.00	7,177,500
安川電機	133,400	3,345.00	446,223,000
シンフォニア テクノロジー	16,000	1,625.00	26,000,000
明電舎	22,800	1,619.00	36,913,200
オリジン電気	3,100	1,947.00	6,035,700
山洋電気	5,600	4,470.00	25,032,000
デンヨー	10,600	1,641.00	17,394,600
アイモバイル	2,600	705.00	1,833,000
キャリアインデックス	3,700	1,416.00	5,239,200
M S - J a p a n	4,400	1,497.00	6,586,800
船場	1,900	1,033.00	1,962,700
グレイステクノロジー	3,000	2,386.00	7,158,000
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	6,500	2,016.00	13,104,000
フルテック	1,200	1,136.00	1,363,200
グリーンズ	2,400	1,476.00	3,542,400
ツナグ・ソリューションズ	1,000	811.00	811,000
日総工産	2,700	2,280.00	6,156,000
キュービーネットホールディングス	5,600	2,013.00	11,272,800
三櫻工業	14,600	672.00	9,811,200
マキタ	140,100	4,585.00	642,358,500
東芝テック	14,400	3,200.00	46,080,000
芝浦メカトロニクス	2,000	4,270.00	8,540,000
マブチモーター	31,800	3,915.00	124,497,000
日本電産	138,500	14,530.00	2,012,405,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	6,200	2,532.00	15,698,400
トレックス・セミコンダクター	3,900	1,588.00	6,193,200
東光高岳	5,800	1,691.00	9,807,800

ダブル・スコープ	16,800	1,180.00	19,824,000
宮越ホールディングス	4,300	901.00	3,874,300
ダイヘン	12,600	2,644.00	33,314,400
田淵電機	15,500	165.00	2,557,500
ヤーマン	16,700	1,995.00	33,316,500
JVCケンウッド	84,400	315.00	26,586,000
ミマキエンジニアリング	10,300	917.00	9,445,100
第一精工	4,800	1,333.00	6,398,400
日新電機	27,000	931.00	25,137,000
大崎電気工業	22,900	846.00	19,373,400
オムロン	122,300	4,845.00	592,543,500
日東工業	18,400	2,010.00	36,984,000
I D E C	15,400	2,467.00	37,991,800
不二電機工業	1,200	1,380.00	1,656,000
ジーエス・ユアサ コーポレーション	41,400	2,575.00	106,605,000
サクサホールディングス	2,800	2,166.00	6,064,800
メルコホールディングス	4,800	3,915.00	18,792,000
テクノメディカ	2,600	2,157.00	5,608,200
日本電気	149,000	3,305.00	492,445,000
富士通	111,000	7,086.00	786,546,000
沖電気工業	49,900	1,540.00	76,846,000
岩崎通信機	5,500	797.00	4,383,500
電気興業	6,000	2,573.00	15,438,000
サンケン電気	13,400	2,539.00	34,022,600
ナカヨ	2,100	1,532.00	3,217,200
アイホン	6,600	1,595.00	10,527,000
ルネサスエレクトロニクス	119,200	611.00	72,831,200
セイコーエプソン	142,800	1,866.00	266,464,800
ワコム	83,400	595.00	49,623,000
アルバック	26,400	4,165.00	109,956,000
アクセル	4,700	603.00	2,834,100
E I Z O	10,600	4,005.00	42,453,000
ジャパンディスプレイ	272,100	105.00	28,570,500
日本信号	29,300	1,022.00	29,944,600
京三製作所	24,700	520.00	12,844,000
能美防災	15,200	2,405.00	36,556,000
ホーチキ	7,300	1,262.00	9,212,600
星和電機	3,800	506.00	1,922,800
エレコム	10,400	2,917.00	30,336,800
パナソニック	1,315,100	1,160.00	1,525,516,000
シャープ	114,200	1,768.00	201,905,600
アンリツ	74,100	1,818.00	134,713,800
富士通ゼネラル	35,100	1,604.00	56,300,400
ソニー	771,700	6,056.00	4,673,415,200
T D K	60,200	9,570.00	576,114,000
帝国通信工業	5,100	1,239.00	6,318,900
タムラ製作所	44,300	617.00	27,333,100
アルプス電気	106,300	2,664.00	283,183,200
池上通信機	3,600	1,405.00	5,058,000
パイオニア	191,900	97.00	18,614,300

日本電波工業	10,500	523.00	5,491,500
鈴木	5,700	753.00	4,292,100
日本トリム	2,200	6,120.00	13,464,000
ローランド ディー・ジー	5,900	2,374.00	14,006,600
フォスター電機	13,500	1,605.00	21,667,500
クラリオン	10,100	2,471.00	24,957,100
SMK	3,200	2,463.00	7,881,600
ヨコオ	8,200	1,522.00	12,480,400
ティアック	8,000	262.00	2,096,000
ホシデン	33,900	933.00	31,628,700
ヒロセ電機	16,500	12,100.00	199,650,000
日本航空電子工業	26,400	1,481.00	39,098,400
TOA	12,400	1,126.00	13,962,400
マクセルホールディングス	24,800	1,643.00	40,746,400
古野電気	14,800	1,272.00	18,825,600
ユニデンホールディングス	3,400	2,637.00	8,965,800
アルパイン	19,900	1,912.00	38,048,800
スミダコーポレーション	9,800	1,452.00	14,229,600
アイコム	6,400	2,405.00	15,392,000
リオン	5,300	2,214.00	11,734,200
本多通信工業	9,900	625.00	6,187,500
船井電機	11,700	620.00	7,254,000
横河電機	115,200	2,284.00	263,116,800
新電元工業	4,100	4,655.00	19,085,500
アズビル	74,300	2,279.00	169,329,700
東亜ディーケーケー	5,700	1,041.00	5,933,700
日本光電工業	50,700	3,300.00	167,310,000
チノー	4,000	1,346.00	5,384,000
共和電業	12,200	430.00	5,246,000
日本電子材料	4,400	783.00	3,445,200
堀場製作所	22,800	5,370.00	122,436,000
アドバンテスト	78,400	2,324.00	182,201,600
小野測器	5,400	744.00	4,017,600
エスベック	10,200	2,071.00	21,124,200
キーエンス	56,500	60,840.00	3,437,460,000
日置電機	6,000	4,250.00	25,500,000
シスメックス	89,700	6,700.00	600,990,000
日本マイクロニクス	18,600	758.00	14,098,800
メガチップス	9,100	2,497.00	22,722,700
OBARA GROUP	6,700	4,785.00	32,059,500
IMAGICA GROUP	9,600	607.00	5,827,200
澤藤電機	1,400	2,034.00	2,847,600
デンソー	255,400	5,225.00	1,334,465,000
原田工業	3,500	873.00	3,055,500
コーセル	16,000	1,208.00	19,328,000
イリソ電子工業	10,500	4,995.00	52,447,500
オブテックスグループ	20,200	2,045.00	41,309,000
千代田インテグレ	4,800	2,396.00	11,500,800
アイ・オー・データ機器	4,800	1,293.00	6,206,400
レーザーテック	23,600	3,405.00	80,358,000

スタンレー電気	81,600	3,420.00	279,072,000
岩崎電気	4,500	1,571.00	7,069,500
ウシオ電機	69,900	1,324.00	92,547,600
岡谷電機産業	8,200	437.00	3,583,400
ヘリオス テクノ ホールディング	10,600	764.00	8,098,400
日本セラミック	11,700	2,829.00	33,099,300
遠藤照明	5,900	829.00	4,891,100
古河電池	8,200	818.00	6,707,600
双信電機	5,600	432.00	2,419,200
山一電機	8,300	1,304.00	10,823,200
図研	7,500	1,896.00	14,220,000
日本電子	22,700	1,952.00	44,310,400
カシオ計算機	101,800	1,659.00	168,886,200
ファナック	109,400	20,085.00	2,197,299,000
日本シイエムケイ	29,300	877.00	25,696,100
エンプラス	5,200	3,160.00	16,432,000
大真空	4,200	1,127.00	4,733,400
ローム	55,600	8,140.00	452,584,000
浜松ホトニクス	82,600	3,840.00	317,184,000
三井ハイテック	12,700	1,233.00	15,659,100
新光電気工業	38,600	790.00	30,494,000
京セラ	175,500	6,077.00	1,066,513,500
協栄産業	1,300	1,715.00	2,229,500
太陽誘電	51,200	2,325.00	119,040,000
村田製作所	120,800	17,850.00	2,156,280,000
ユーシン	18,200	978.00	17,799,600
双葉電子工業	18,800	1,777.00	33,407,600
日東電工	86,900	6,200.00	538,780,000
北陸電気工業	4,300	1,102.00	4,738,600
東海理化電機製作所	30,300	2,219.00	67,235,700
ニチコン	36,200	880.00	31,856,000
日本ケミコン	8,200	2,271.00	18,622,200
K O A	17,400	1,596.00	27,770,400
三井E & Sホールディングス	41,600	1,179.00	49,046,400
日立造船	91,200	412.00	37,574,400
三菱重工業	192,900	4,322.00	833,713,800
川崎重工業	89,600	2,707.00	242,547,200
I H I	88,500	4,005.00	354,442,500
名村造船所	34,600	550.00	19,030,000
サノヤスホールディングス	15,300	223.00	3,411,900
スプリックス	3,100	2,740.00	8,494,000
日本車輛製造	4,200	2,618.00	10,995,600
三菱ロジスネクスト	13,700	1,293.00	17,714,100
近畿車輛	1,700	2,390.00	4,063,000
F P G	36,300	1,289.00	46,790,700
島根銀行	2,500	1,001.00	2,502,500
じもとホールディングス	77,000	154.00	11,858,000
全国保証	32,000	4,270.00	136,640,000
めぶきフィナンシャルグループ	589,800	348.00	205,250,400
東京きらぼしフィナンシャルグループ	15,300	1,970.00	30,141,000

九州フィナンシャルグループ	186,200	537.00	99,989,400	
かんぽ生命保険	42,900	2,813.00	120,677,700	
ゆうちょ銀行	321,900	1,347.00	433,599,300	
富山第一銀行	27,400	452.00	12,384,800	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	723,100	512.00	370,227,200	
ジェイリース	2,400	621.00	1,490,400	
西日本フィナンシャルホールディングス	72,700	1,212.00	88,112,400	
マーキュリアインベストメント	4,400	854.00	3,757,600	
イントラスト	3,200	444.00	1,420,800	
日本モーゲージサービス	1,500	1,258.00	1,887,000	
アルヒ	10,300	1,782.00	18,354,600	
日産自動車	1,357,800	1,029.00	1,397,176,200	
いすゞ自動車	363,900	1,614.50	587,516,550	
トヨタ自動車	1,282,900	6,709.00	8,606,976,100	*
日野自動車	143,700	1,091.00	156,776,700	
三菱自動車工業	426,100	762.00	324,688,200	
エフテック	8,100	1,098.00	8,893,800	
レシップホールディングス	4,200	726.00	3,049,200	
G M B	2,300	1,181.00	2,716,300	
ファルテック	1,900	988.00	1,877,200	
武蔵精密工業	27,100	1,720.00	46,612,000	
日産車体	22,500	988.00	22,230,000	
新明和工業	53,600	1,491.00	79,917,600	
極東開発工業	22,900	1,571.00	35,975,900	
日信工業	21,000	1,548.00	32,508,000	
トピー工業	9,500	2,725.00	25,887,500	
ティラド	4,200	2,801.00	11,764,200	
曙ブレーキ工業	63,200	194.00	12,260,800	
タチエス	19,500	1,507.00	29,386,500	
N O K	61,900	1,603.00	99,225,700	
フタバ産業	32,000	667.00	21,344,000	
K Y B	12,000	2,767.00	33,204,000	
市光工業	17,200	766.00	13,175,200	
大同メタル工業	18,700	889.00	16,624,300	
プレス工業	57,100	592.00	33,803,200	
ミクニ	14,600	603.00	8,803,800	
太平洋工業	24,100	1,642.00	39,572,200	
ケーヒン	26,400	2,087.00	55,096,800	
河西工業	14,100	997.00	14,057,700	
アイシン精機	94,800	4,395.00	416,646,000	
マツダ	361,300	1,204.50	435,185,850	
今仙電機製作所	10,700	1,059.00	11,331,300	
本田技研工業	971,200	3,282.00	3,187,478,400	
スズキ	210,600	5,425.00	1,142,505,000	
S U B A R U	357,400	2,674.50	955,866,300	
安永	5,600	1,864.00	10,438,400	
ヤマハ発動機	162,600	2,333.00	379,345,800	
ショーワ	27,200	1,557.00	42,350,400	

小糸製作所	69,000	6,000.00	414,000,000
T B K	13,900	457.00	6,352,300
エクセディ	15,600	2,961.00	46,191,600
ミツバ	21,200	769.00	16,302,800
豊田合成	37,200	2,316.00	86,155,200
愛三工業	18,000	836.00	15,048,000
盟和産業	1,700	1,173.00	1,994,100
日本プラスト	9,000	916.00	8,244,000
ヨロズ	10,800	1,625.00	17,550,000
エフ・シー・シー	20,700	2,931.00	60,671,700
新家工業	2,500	1,785.00	4,462,500
シマノ	46,400	15,370.00	713,168,000
テイ・エス テック	26,700	3,400.00	90,780,000
関西みらいフィナンシャルグループ	53,300	905.00	48,236,500
三十三フィナンシャルグループ	9,800	1,999.00	19,590,200
第四北越フィナンシャルグループ	19,700	4,025.00	79,292,500
ジャムコ	5,800	2,964.00	17,191,200
小野建	10,000	1,705.00	17,050,000
はるやまホールディングス	5,200	906.00	4,711,200
ノジマ	20,200	2,629.00	53,105,800
佐島電機	8,400	1,071.00	8,996,400
カッパ・クリエイト	15,900	1,456.00	23,150,400
エコートレーディング	2,400	650.00	1,560,000
伯東	7,800	1,352.00	10,545,600
コンドーテック	8,800	1,053.00	9,266,400
中山福	6,200	582.00	3,608,400
ライトオン	9,600	956.00	9,177,600
ナガイレーベン	16,400	2,658.00	43,591,200
ジーンズメイト	3,400	658.00	2,237,200
三菱食品	12,500	3,040.00	38,000,000
良品計画	16,100	29,580.00	476,238,000
三城ホールディングス	14,200	488.00	6,929,600
松田産業	8,300	1,476.00	12,250,800
第一興商	16,900	5,200.00	87,880,000
メディバルホールディングス	122,400	2,522.00	308,692,800
アドヴァン	17,400	1,096.00	19,070,400
S P K	2,300	2,409.00	5,540,700
萩原電気ホールディングス	4,200	3,325.00	13,965,000
アルビス	4,300	3,055.00	13,136,500
アズワン	8,100	8,410.00	68,121,000
スズデン	4,000	1,346.00	5,384,000
尾家産業	3,200	1,346.00	4,307,200
シモジマ	7,000	1,125.00	7,875,000
ドウシシャ	10,700	1,998.00	21,378,600
小津産業	2,400	1,973.00	4,735,200
コナカ	14,700	514.00	7,555,800
高速	6,900	1,143.00	7,886,700
ハウス オブ ローゼ	1,400	1,901.00	2,661,400
G - 7ホールディングス	3,300	2,578.00	8,507,400
たけびし	4,000	1,557.00	6,228,000

イオン北海道	11,500	814.00	9,361,000
コジマ	16,700	487.00	8,132,900
ヒマラヤ	3,600	978.00	3,520,800
コーナン商事	14,900	2,783.00	41,466,700
ネットワンシステムズ	40,000	2,287.00	91,480,000
エコス	4,200	2,136.00	8,971,200
ワタミ	14,900	1,437.00	21,411,300
マルシェ	3,100	801.00	2,483,100
リックス	2,500	1,667.00	4,167,500
システムソフト	27,300	115.00	3,139,500
ドンキホーテホールディングス	73,500	7,040.00	517,440,000
丸文	10,100	779.00	7,867,900
西松屋チェーン	24,900	1,029.00	25,622,100
ゼンショーホールディングス	53,500	2,642.00	141,347,000
ハビネット	9,500	1,708.00	16,226,000
幸楽苑ホールディングス	7,200	1,954.00	14,068,800
ハークスレイ	2,500	1,069.00	2,672,500
橋本総業ホールディングス	2,200	1,447.00	3,183,400
日本ライフライン	35,600	1,689.00	60,128,400
サイゼリヤ	18,700	2,245.00	41,981,500
タカショー	5,700	477.00	2,718,900
エクセル	4,200	1,989.00	8,353,800
V Tホールディングス	38,500	490.00	18,865,000
マルカキカイ	3,700	2,395.00	8,861,500
アルゴグラフィックス	4,800	4,445.00	21,336,000
魚力	3,200	1,429.00	4,572,800
I D O M	38,200	392.00	14,974,400
日本エム・ディ・エム	6,600	1,494.00	9,860,400
ポブラ	2,900	614.00	1,780,600
フジ・コーポレーション	2,300	2,041.00	4,694,300
ユナイテッドアローズ	13,000	4,160.00	54,080,000
進和	6,700	2,438.00	16,334,600
エスケイジャパン	2,700	891.00	2,405,700
ダイترون	5,200	1,672.00	8,694,400
ハイデイ日高	14,900	2,310.00	34,419,000
シークス	14,400	1,665.00	23,976,000
京都きもの友禅	7,300	467.00	3,409,100
コロワイド	37,700	2,867.00	108,085,900
ピーシーデポコーポレーション	15,000	556.00	8,340,000
田中商事	3,400	651.00	2,213,400
オーハシテクニカ	6,400	1,427.00	9,132,800
壱番屋	8,000	4,415.00	35,320,000
白銅	3,700	1,762.00	6,519,400
トップカルチャー	4,300	371.00	1,595,300
P L A N T	2,700	1,138.00	3,072,600
スギホールディングス	24,900	5,330.00	132,717,000
島津製作所	148,100	2,636.00	390,391,600
J M S	10,400	602.00	6,260,800
クボテック	2,400	346.00	830,400
長野計器	9,000	980.00	8,820,000

ブイ・テクノロジー	2,700	14,490.00	39,123,000
スター精密	19,800	1,625.00	32,175,000
東京計器	7,300	1,143.00	8,343,900
愛知時計電機	1,500	3,945.00	5,917,500
インターアクション	6,100	2,181.00	13,304,100
オーバル	10,900	278.00	3,030,200
東京精密	20,800	2,901.00	60,340,800
マニー	14,000	5,110.00	71,540,000
ニコン	200,600	1,876.00	376,325,600
トプコン	61,800	1,601.00	98,941,800
オリンパス	171,500	3,745.00	642,267,500
理研計器	10,200	2,300.00	23,460,000
S C R E E Nホールディングス	20,000	5,950.00	119,000,000
キャノン電子	10,600	2,188.00	23,192,800
タムロン	10,200	1,858.00	18,951,600
H O Y A	231,800	6,917.00	1,603,360,600
シード	4,900	1,937.00	9,491,300
ノーリツ鋼機	9,100	1,881.00	17,117,100
エー・アンド・デイ	10,500	936.00	9,828,000
朝日インテック	41,600	4,840.00	201,344,000
キャノン	619,800	3,298.00	2,044,100,400
リコー	346,100	1,133.00	392,131,300
シチズン時計	125,900	631.00	79,442,900
リズム時計工業	3,800	1,982.00	7,531,600
大研医器	9,200	787.00	7,240,400
メニコン	15,800	2,493.00	39,389,400
シンシア	1,700	544.00	924,800
中本パックス	3,200	1,844.00	5,900,800
スノーピーク	4,200	1,533.00	6,438,600
パラマウントベッドホールディングス	13,200	4,705.00	62,106,000
トランザクション	6,300	863.00	5,436,900
S H O B I	3,300	398.00	1,313,400
ニホンフラッシュ	4,900	2,006.00	9,829,400
前田工織	12,700	2,545.00	32,321,500
永大産業	15,400	432.00	6,652,800
アートネイチャー	12,300	680.00	8,364,000
バンダイナムコホールディングス	119,000	4,750.00	565,250,000
アイフィスジャパン	2,500	711.00	1,777,500
共立印刷	19,500	268.00	5,226,000
S H O E I	5,500	4,845.00	26,647,500
フランスベッドホールディングス	16,400	978.00	16,039,200
マーベラス	17,200	941.00	16,185,200
パイロットコーポレーション	20,100	5,690.00	114,369,000
萩原工業	6,400	1,717.00	10,988,800
エイベックス	19,400	1,512.00	29,332,800
トッパン・フォームズ	24,700	996.00	24,601,200
フジシールインターナショナル	25,800	3,465.00	89,397,000
タカラトミー	48,200	1,295.00	62,419,000
廣済堂	10,700	452.00	4,836,400
エステールホールディングス	3,300	724.00	2,389,200

アーク	43,900	98.00	4,302,200
レック	12,300	1,967.00	24,194,100
タカノ	4,600	872.00	4,011,200
三光合成	8,900	410.00	3,649,000
プロネクサス	9,900	1,100.00	10,890,000
ホクシン	7,300	158.00	1,153,400
ウッドワン	3,700	1,149.00	4,251,300
大建工業	8,700	2,111.00	18,365,700
きもと	19,600	230.00	4,508,000
凸版印刷	162,500	1,723.00	279,987,500
大日本印刷	162,200	2,591.00	420,260,200
図書印刷	10,800	869.00	9,385,200
共同印刷	3,600	2,620.00	9,432,000
N I S S H A	23,600	2,086.00	49,229,600
光村印刷	1,000	2,284.00	2,284,000
藤森工業	10,300	3,245.00	33,423,500
ヴィア・ホールディングス	13,900	709.00	9,855,100
宝印刷	6,000	1,834.00	11,004,000
前澤化成工業	8,000	1,106.00	8,848,000
アシックス	114,300	1,544.00	176,479,200
ツツミ	3,600	2,099.00	7,556,400
ウェーブロックホールディングス	2,400	883.00	2,119,200
J S P	6,700	2,388.00	15,999,600
ニチハ	16,000	2,575.00	41,200,000
エフピコ	9,500	6,490.00	61,655,000
小松ウオール工業	3,500	2,157.00	7,549,500
ヤマハ	68,500	5,260.00	360,310,000
河合楽器製作所	3,500	3,955.00	13,842,500
クリナップ	10,800	654.00	7,063,200
ピジョン	69,600	5,160.00	359,136,000
天馬	8,000	2,078.00	16,624,000
兼松サステック	800	1,781.00	1,424,800
キングジム	9,600	901.00	8,649,600
象印マホービン	21,400	1,208.00	25,851,200
リンテック	27,400	2,619.00	71,760,600
信越ポリマー	20,700	891.00	18,443,700
東リ	28,800	310.00	8,928,000
イトーキ	21,200	606.00	12,847,200
任天堂	70,900	36,290.00	2,572,961,000
三菱鉛筆	19,000	2,098.00	39,862,000
松風	5,800	1,267.00	7,348,600
タカラスタンダード	23,800	1,805.00	42,959,000
コクヨ	55,200	1,764.00	97,372,800
ナカバヤシ	11,500	601.00	6,911,500
ニフコ	46,100	2,777.00	128,019,700
立川ブラインド工業	5,100	1,196.00	6,099,600
グローブライト	5,600	2,967.00	16,615,200
オカムラ	40,200	1,637.00	65,807,400
バルカー	9,300	2,737.00	25,454,100
M U T O Hホールディングス	1,500	2,291.00	3,436,500

伊藤忠商事	832,100	2,080.00	1,730,768,000	
丸紅	1,118,100	891.80	997,121,580	
スクロール	17,400	461.00	8,021,400	
高島	1,800	2,036.00	3,664,800	
ヨンドシーホールディングス	12,600	2,469.00	31,109,400	
三陽商会	6,800	1,965.00	13,362,000	
長瀬産業	63,800	1,727.00	110,182,600	
ナイガイ	4,300	492.00	2,115,600	
蝶理	7,300	1,953.00	14,256,900	
豊田通商	126,600	4,050.00	512,730,000	
オンワードホールディングス	69,800	697.00	48,650,600	
三共生興	19,400	454.00	8,807,600	
兼松	45,300	1,512.00	68,493,600	
美津濃	11,400	2,605.00	29,697,000	
ツカモトコーポレーション	2,000	1,171.00	2,342,000	
ユニー・ファミリーマートホールディングス	31,700	15,000.00	475,500,000	
ルックホールディングス	4,100	1,203.00	4,932,300	
三井物産	934,100	1,896.00	1,771,053,600	
日本紙パルプ商事	6,500	4,300.00	27,950,000	
東京エレクトロン	76,800	15,295.00	1,174,656,000	
日立ハイテクノロジーズ	34,500	4,100.00	141,450,000	
カメイ	14,800	1,379.00	20,409,200	
東都水産	1,600	2,271.00	3,633,600	
OUGホールディングス	1,900	2,695.00	5,120,500	
スターゼン	4,200	4,655.00	19,551,000	
セイコーホールディングス	17,800	2,676.00	47,632,800	
山善	44,300	1,171.00	51,875,300	
椿本興業	2,500	3,490.00	8,725,000	
住友商事	670,500	1,782.00	1,194,831,000	
日本ユニシス	35,300	2,764.00	97,569,200	
内田洋行	5,200	2,741.00	14,253,200	
三菱商事	795,600	3,117.00	2,479,885,200	
第一実業	5,200	3,905.00	20,306,000	
キャノンマーケティングジャパン	32,400	2,170.00	70,308,000	
西華産業	6,400	1,806.00	11,558,400	
佐藤商事	10,200	1,036.00	10,567,200	
菱洋エレクトロ	11,500	1,713.00	19,699,500	
東京産業	11,300	618.00	6,983,400	
ユアサ商事	11,600	3,650.00	42,340,000	
神鋼商事	2,500	2,891.00	7,227,500	
小林産業	6,600	310.00	2,046,000	
阪和興業	19,700	3,445.00	67,866,500	
正栄食品工業	6,000	4,555.00	27,330,000	
カナデン	10,900	1,282.00	13,973,800	
菱電商事	9,000	1,605.00	14,445,000	
ニプロ	79,700	1,496.00	119,231,200	
フルサト工業	6,300	1,909.00	12,026,700	
岩谷産業	25,100	4,020.00	100,902,000	
すてきナイスグループ	4,700	1,157.00	5,437,900	

昭光通商	4,100	822.00	3,370,200
ニチモウ	1,700	1,748.00	2,971,600
極東貿易	3,500	2,009.00	7,031,500
イワキ	13,600	551.00	7,493,600
兼松エレクトロニクス	6,100	3,785.00	23,088,500
三愛石油	30,400	1,215.00	36,936,000
稲畑産業	27,200	1,624.00	44,172,800
G S Iクレオス	3,000	1,511.00	4,533,000
明和産業	10,700	447.00	4,782,900
キムラタン	53,600	32.00	1,715,200
ゴールドウイン	10,200	10,740.00	109,548,000
ユニ・チャーム	244,100	3,149.00	768,670,900
デサント	27,500	2,717.00	74,717,500
キング	5,800	494.00	2,865,200
ワキタ	24,200	1,262.00	30,540,400
ヤマトインターナショナル	7,500	464.00	3,480,000
東邦ホールディングス	33,600	3,125.00	105,000,000
サンゲツ	34,300	2,180.00	74,774,000
ミツウロコグループホールディングス	16,500	717.00	11,830,500
シナネンホールディングス	4,700	2,704.00	12,708,800
伊藤忠エネクス	25,000	1,099.00	27,475,000
サンリオ	35,000	2,190.00	76,650,000
サンワテクノス	6,900	1,314.00	9,066,600
リョーサン	12,500	3,515.00	43,937,500
新光商事	10,700	1,768.00	18,917,600
トーヨー	5,200	2,355.00	12,246,000
三信電気	9,400	2,036.00	19,138,400
東陽テクニカ	13,100	931.00	12,196,100
モスフードサービス	14,900	3,015.00	44,923,500
加賀電子	11,300	2,328.00	26,306,400
三益半導体工業	8,900	1,530.00	13,617,000
ソーダニッカ	11,900	655.00	7,794,500
立花エレテック	8,400	1,783.00	14,977,200
木曽路	13,900	2,622.00	36,445,800
S R Sホールディングス	13,400	1,011.00	13,547,400
千趣会	20,500	302.00	6,191,000
タカキュー	8,600	196.00	1,685,600
ケーヨー	21,000	584.00	12,264,000
上新電機	13,400	2,950.00	39,530,000
日本瓦斯	20,800	3,650.00	75,920,000
ロイヤルホールディングス	20,100	2,729.00	54,852,900
東天紅	800	1,516.00	1,212,800
いなげや	12,700	1,622.00	20,599,400
島忠	25,700	3,015.00	77,485,500
チヨダ	11,900	2,096.00	24,942,400
ライフコーポレーション	8,600	2,820.00	24,252,000
リンガーハット	14,000	2,393.00	33,502,000
M r M a x H D	15,600	535.00	8,346,000
テンアライド	10,800	424.00	4,579,200
A O K Iホールディングス	22,700	1,475.00	33,482,500

オークワ	16,200	1,198.00	19,407,600
コメリ	17,500	2,939.00	51,432,500
青山商事	21,800	2,991.00	65,203,800
しまむら	13,200	9,750.00	128,700,000
はせがわ	5,700	473.00	2,696,100
高島屋	88,900	1,893.00	168,287,700
松屋	22,800	1,116.00	25,444,800
エイチ・ツー・オー リテイリング	58,200	1,914.00	111,394,800
近鉄百貨店	4,400	3,655.00	16,082,000
パルコ	10,900	1,267.00	13,810,300
丸井グループ	95,900	2,692.00	258,162,800
クレディセゾン	79,500	1,854.00	147,393,000
アクシアル リテイリング	9,400	3,915.00	36,801,000
井筒屋	6,000	256.00	1,536,000
イオン	436,300	2,774.00	1,210,296,200
イズミ	23,000	6,470.00	148,810,000
フォーバル	5,000	991.00	4,955,000
平和堂	23,000	3,040.00	69,920,000
フジ	13,700	2,183.00	29,907,100
ヤオコー	12,900	6,370.00	82,173,000
ゼビオホールディングス	13,700	1,593.00	21,824,100
ケーズホールディングス	117,800	1,262.00	148,663,600
PALTAC	20,400	5,760.00	117,504,000
三谷産業	13,500	320.00	4,320,000
Olympicグループ	6,700	776.00	5,199,200
日産東京販売ホールディングス	17,000	351.00	5,967,000
新生銀行	83,300	1,762.00	146,774,600
あおぞら銀行	63,400	3,955.00	250,747,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	7,907,500	680.00	5,377,100,000
りそなホールディングス	1,245,900	611.00	761,244,900
三井住友トラスト・ホールディングス	223,200	4,610.00	1,028,952,000
三井住友フィナンシャルグループ	800,300	4,502.00	3,602,950,600
千葉銀行	402,100	739.00	297,151,900
群馬銀行	227,000	551.00	125,077,000
武蔵野銀行	16,900	3,135.00	52,981,500
千葉興業銀行	31,200	451.00	14,071,200
筑波銀行	47,300	254.00	12,014,200
七十七銀行	35,600	2,372.00	84,443,200
青森銀行	8,800	3,045.00	26,796,000
秋田銀行	7,300	2,596.00	18,950,800
山形銀行	12,800	2,400.00	30,720,000
岩手銀行	7,900	4,410.00	34,839,000
東邦銀行	101,500	393.00	39,889,500
東北銀行	5,900	1,314.00	7,752,600
みちのく銀行	7,300	1,824.00	13,315,200
ふくおかフィナンシャルグループ	92,200	2,843.00	262,124,600
静岡銀行	285,700	1,078.00	307,984,600
十六銀行	15,200	2,660.00	40,432,000
スルガ銀行	116,100	527.00	61,184,700
八十二銀行	205,400	508.00	104,343,200

山梨中央銀行	14,100	1,739.00	24,519,900
大垣共立銀行	17,900	2,620.00	46,898,000
福井銀行	9,700	2,005.00	19,448,500
北國銀行	12,100	4,265.00	51,606,500
清水銀行	4,700	1,936.00	9,099,200
富山銀行	2,100	3,940.00	8,274,000
滋賀銀行	22,700	2,801.00	63,582,700
南都銀行	13,300	2,659.00	35,364,700
百五銀行	102,100	443.00	45,230,300
京都銀行	40,700	5,350.00	217,745,000
紀陽銀行	40,200	1,732.00	69,626,400
ほくほくフィナンシャルグループ	75,600	1,490.00	112,644,000
広島銀行	167,500	711.00	119,092,500
山陰合同銀行	67,300	926.00	62,319,800
中国銀行	73,200	1,063.00	77,811,600
鳥取銀行	4,000	1,611.00	6,444,000
伊予銀行	150,300	686.00	103,105,800
百十四銀行	12,100	3,010.00	36,421,000
四国銀行	16,300	1,375.00	22,412,500
阿波銀行	18,200	3,115.00	56,693,000
大分銀行	7,000	3,750.00	26,250,000
宮崎銀行	7,600	3,295.00	25,042,000
佐賀銀行	6,900	2,179.00	15,035,100
十八銀行	7,000	3,130.00	21,910,000
沖縄銀行	10,400	3,945.00	41,028,000
琉球銀行	26,200	1,326.00	34,741,200
セブン銀行	383,500	377.00	144,579,500
みずほフィナンシャルグループ	15,428,600	196.60	3,033,262,760
高知銀行	4,200	973.00	4,086,600
山口フィナンシャルグループ	141,700	1,192.00	168,906,400
芙蓉総合リース	13,000	6,400.00	83,200,000
興銀リース	21,300	2,873.00	61,194,900
東京センチュリー	22,900	5,650.00	129,385,000
SBIホールディングス	135,300	3,165.00	428,224,500
日本証券金融	50,000	656.00	32,800,000
アイフル	173,000	310.00	53,630,000
日本アジア投資	9,900	277.00	2,742,300
長野銀行	3,800	1,696.00	6,444,800
名古屋銀行	9,200	3,750.00	34,500,000
北洋銀行	171,000	342.00	58,482,000
愛知銀行	4,100	4,575.00	18,757,500
中京銀行	4,700	2,283.00	10,730,100
大光銀行	3,700	2,088.00	7,725,600
愛媛銀行	15,900	1,221.00	19,413,900
トマト銀行	4,500	1,345.00	6,052,500
京葉銀行	50,100	818.00	40,981,800
栃木銀行	58,800	316.00	18,580,800
北日本銀行	3,600	2,487.00	8,953,200
東和銀行	19,900	950.00	18,905,000
福島銀行	9,900	607.00	6,009,300

大東銀行	5,500	916.00	5,038,000
リコーリース	8,900	3,685.00	32,796,500
イオンフィナンシャルサービス	72,500	2,285.00	165,662,500
アコム	228,200	433.00	98,810,600
ジャックス	12,500	2,282.00	28,525,000
オリエントコーポレーション	306,900	188.00	57,697,200
日立キャピタル	26,800	3,020.00	80,936,000
アプラスフィナンシャル	55,100	99.00	5,454,900
オリックス	757,600	1,809.50	1,370,877,200
三菱UFJリース	256,200	594.00	152,182,800
ジャフコ	18,600	4,555.00	84,723,000
九州リースサービス	5,600	701.00	3,925,600
トモニホールディングス	87,700	456.00	39,991,200
大和証券グループ本社	911,000	643.10	585,864,100
野村ホールディングス	2,083,600	528.00	1,100,140,800
岡三証券グループ	96,700	573.00	55,409,100
丸三証券	33,700	911.00	30,700,700
東洋証券	40,700	227.00	9,238,900
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	135,400	626.00	84,760,400
光世証券	2,700	1,092.00	2,948,400
水戸証券	32,900	342.00	11,251,800
いちよし証券	23,800	972.00	23,133,600
松井証券	55,600	1,222.00	67,943,200
SOMPOホールディングス	222,700	4,893.00	1,089,671,100
だいこう証券ビジネス	4,700	519.00	2,439,300
日本取引所グループ	306,600	2,158.00	661,642,800
マネックスグループ	106,000	507.00	53,742,000
カブドットコム証券	84,800	426.00	36,124,800
極東証券	15,200	1,367.00	20,778,400
岩井コスモホールディングス	11,600	1,500.00	17,400,000
藍澤証券	21,300	768.00	16,358,400
フィデアホールディングス	110,500	151.00	16,685,500
池田泉州ホールディングス	120,500	359.00	43,259,500
アニコムホールディングス	8,800	3,770.00	33,176,000
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	296,900	3,548.00	1,053,401,200
ソニーフィナンシャルホールディングス	93,300	2,654.00	247,618,200
マネーパートナーズグループ	13,300	384.00	5,107,200
小林洋行	3,200	288.00	921,600
第一生命ホールディングス	642,400	2,217.50	1,424,522,000
東京海上ホールディングス	411,600	5,542.00	2,281,087,200
アドバンテッジリスクマネジメント	4,300	1,086.00	4,669,800
イー・ギャランティ	10,600	990.00	10,494,000
アサックス	4,600	591.00	2,718,600
NECキャピタルソリューション	4,700	1,763.00	8,286,100
T&Dホールディングス	351,100	1,870.50	656,732,550
アドバンスクリエイト	2,600	2,020.00	5,252,000
三井不動産	602,400	2,751.50	1,657,503,600

三菱地所	795,500	1,859.00	1,478,834,500
平和不動産	21,500	2,011.00	43,236,500
東京建物	124,000	1,207.00	149,668,000
ダイビル	33,400	1,184.00	39,545,600
京阪神ビルディング	20,300	905.00	18,371,500
住友不動産	255,200	4,154.00	1,060,100,800
太平洋興発	4,600	873.00	4,015,800
大京	18,100	2,965.00	53,666,500
テーオーシー	26,000	910.00	23,660,000
東京楽天地	1,700	5,040.00	8,568,000
レオパレス21	144,500	490.00	70,805,000
スターツコーポレーション	15,400	2,658.00	40,933,200
フジ住宅	14,500	893.00	12,948,500
空港施設	13,500	593.00	8,005,500
明和地所	6,300	635.00	4,000,500
ゴールドクレスト	8,900	1,891.00	16,829,900
リログループ	60,100	2,897.00	174,109,700
日本エスリード	4,400	1,523.00	6,701,200
日神不動産	16,800	530.00	8,904,000
日本エスコン	20,500	720.00	14,760,000
タカラレーベン	53,100	329.00	17,469,900
サンヨーハウジング名古屋	6,400	1,036.00	6,630,400
イオンモール	56,900	2,143.00	121,936,700
ファースト住建	4,300	1,210.00	5,203,000
ランド	462,200	10.00	4,622,000
カチタス	12,600	3,120.00	39,312,000
東祥	6,800	3,740.00	25,432,000
トーセイ	15,600	1,036.00	16,161,600
穴吹興産	1,200	3,055.00	3,666,000
エヌ・ティ・ティ都市開発	70,600	1,679.00	118,537,400
サンフロンティア不動産	15,700	1,178.00	18,494,600
エフ・ジェー・ネクスト	9,900	924.00	9,147,600
インテリックス	3,300	797.00	2,630,100
ランドビジネス	5,800	556.00	3,224,800
グランディハウス	10,000	445.00	4,450,000
東武鉄道	121,400	3,250.00	394,550,000
相鉄ホールディングス	39,500	3,465.00	136,867,500
東京急行電鉄	312,700	1,931.00	603,823,700
京浜急行電鉄	157,700	1,766.00	278,498,200
小田急電鉄	184,400	2,433.00	448,645,200
京王電鉄	64,300	6,130.00	394,159,000
京成電鉄	86,300	3,575.00	308,522,500
富士急行	15,700	3,000.00	47,100,000
新京成電鉄	2,900	2,156.00	6,252,400
東日本旅客鉄道	204,700	10,155.00	2,078,728,500
西日本旅客鉄道	103,200	7,886.00	813,835,200
東海旅客鉄道	103,100	22,105.00	2,279,025,500
西武ホールディングス	146,700	2,197.00	322,299,900
鴻池運輸	18,400	1,793.00	32,991,200
西日本鉄道	31,900	2,907.00	92,733,300

ハマキョウレックス	8,800	3,950.00	34,760,000
サカイ引越センター	6,100	6,280.00	38,308,000
近鉄グループホールディングス	109,000	4,500.00	490,500,000
阪急阪神ホールディングス	145,400	3,820.00	555,428,000
南海電気鉄道	48,600	2,767.00	134,476,200
京阪ホールディングス	48,500	4,650.00	225,525,000
神戸電鉄	2,800	3,995.00	11,186,000
名古屋鉄道	87,300	2,825.00	246,622,500
山陽電気鉄道	8,400	2,341.00	19,664,400
トランコム	3,100	6,550.00	20,305,000
日本通運	42,800	7,440.00	318,432,000
ヤマトホールディングス	191,100	2,948.50	563,458,350
山九	30,300	5,670.00	171,801,000
日新	9,400	2,048.00	19,251,200
丸運	5,800	330.00	1,914,000
丸全昭和運輸	8,800	3,045.00	26,796,000
センコーグループホールディングス	60,100	824.00	49,522,400
トナミホールディングス	2,600	6,100.00	15,860,000
ニッコンホールディングス	41,500	2,937.00	121,885,500
日本石油輸送	1,300	2,815.00	3,659,500
福山通運	14,000	4,850.00	67,900,000
セイノーホールディングス	81,700	1,760.00	143,792,000
エスライン	2,900	1,217.00	3,529,300
神奈川中央交通	2,700	3,825.00	10,327,500
日立物流	24,000	3,010.00	72,240,000
丸和運輸機関	5,700	3,595.00	20,491,500
C & F ロジホールディングス	11,100	1,420.00	15,762,000
日本郵船	91,200	1,923.00	175,377,600
商船三井	64,700	2,718.00	175,854,600
川崎汽船	33,600	1,660.00	55,776,000
N S ユナイテッド海運	6,000	2,787.00	16,722,000
明治海運	11,300	389.00	4,395,700
飯野海運	51,600	490.00	25,284,000
共栄タンカー	800	1,919.00	1,535,200
九州旅客鉄道	91,500	3,540.00	323,910,000
S G ホールディングス	103,000	2,834.00	291,902,000
日本航空	199,600	4,111.00	820,555,600
A N A ホールディングス	199,300	4,030.00	803,179,000
パスコ	2,100	1,229.00	2,580,900
西本Wismettacホールディングス	2,600	5,140.00	13,364,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	900	1,265.00	1,138,500
Genky DrugStores	4,400	3,545.00	15,598,000
国際紙パルプ商事	19,900	344.00	6,845,600
総合メディカルホールディングス	9,900	2,640.00	26,136,000
ブックオフグループホールディングス	6,000	756.00	4,536,000
三菱倉庫	37,700	2,742.00	103,373,400
三井倉庫ホールディングス	13,400	2,058.00	27,577,200
住友倉庫	41,000	1,436.00	58,876,000
澁澤倉庫	6,100	1,638.00	9,991,800

ヤマタネ	5,700	1,863.00	10,619,100
東陽倉庫	19,200	308.00	5,913,600
乾汽船	9,800	952.00	9,329,600
日本トランスシティ	24,100	490.00	11,809,000
ケイヒン	2,000	1,436.00	2,872,000
中央倉庫	6,500	1,082.00	7,033,000
川西倉庫	2,100	1,667.00	3,500,700
安田倉庫	9,100	885.00	8,053,500
東洋埠頭	3,100	1,529.00	4,739,900
宇徳	9,500	536.00	5,092,000
上組	67,300	2,428.00	163,404,400
サンリツ	2,700	681.00	1,838,700
キムラユニティー	3,000	1,138.00	3,414,000
キューソー流通システム	2,800	2,628.00	7,358,400
近鉄エクスプレス	20,600	1,832.00	37,739,200
東海運	5,900	304.00	1,793,600
エーアイティー	7,100	1,089.00	7,731,900
内外トランスライン	3,500	1,716.00	6,006,000
日本コンセプト	3,000	1,130.00	3,390,000
東京放送ホールディングス	74,900	2,050.00	153,545,000
日本テレビホールディングス	103,700	1,865.00	193,400,500
朝日放送グループホールディングス	11,300	804.00	9,085,200
テレビ朝日ホールディングス	31,000	2,292.00	71,052,000
スカパーJ S A Tホールディングス	86,300	536.00	46,256,800
テレビ東京ホールディングス	9,300	2,562.00	23,826,600
日本BS放送	3,900	1,247.00	4,863,300
ビジョン	3,500	4,340.00	15,190,000
USEN-NEXT HOLDINGS	4,300	1,121.00	4,820,300
ワイヤレスゲート	5,000	560.00	2,800,000
コネクシオ	8,000	1,604.00	12,832,000
日本通信	96,200	133.00	12,794,600
クロップス	2,100	780.00	1,638,000
日本電信電話	772,600	4,573.00	3,533,099,800
KDDI	995,500	2,466.50	2,455,400,750
光通信	13,300	19,110.00	254,163,000
NTTドコモ	811,100	2,550.00	2,068,305,000
エムティーアイ	13,200	589.00	7,774,800
GMOインターネット	41,100	1,662.00	68,308,200
アйдママーケティングコミュニケーション	2,300	557.00	1,281,100
カドカワ	32,900	1,373.00	45,171,700
学研ホールディングス	3,800	6,280.00	23,864,000
ゼンリン	22,500	2,750.00	61,875,000
昭文社	5,100	577.00	2,942,700
インプレスホールディングス	9,100	166.00	1,510,600
東京電力ホールディングス	918,900	598.00	549,502,200
中部電力	352,200	1,628.00	573,381,600
関西電力	469,700	1,819.50	854,619,150
中国電力	159,100	1,417.00	225,444,700

北陸電力	112,700	1,007.00	113,488,900
東北電力	269,600	1,447.00	390,111,200
四国電力	103,700	1,322.00	137,091,400
九州電力	237,300	1,330.00	315,609,000
北海道電力	107,700	696.00	74,959,200
沖縄電力	21,300	2,124.00	45,241,200
電源開発	91,600	2,981.00	273,059,600
エフオン	6,900	1,046.00	7,217,400
イーレックス	20,000	938.00	18,760,000
レノバ	11,900	1,292.00	15,374,800
東京瓦斯	225,800	2,847.50	642,965,500
大阪瓦斯	223,300	2,158.00	481,881,400
東邦瓦斯	57,000	4,300.00	245,100,000
北海道瓦斯	6,200	1,477.00	9,157,400
広島ガス	23,900	350.00	8,365,000
西部瓦斯	13,000	2,467.00	32,071,000
静岡ガス	35,400	1,004.00	35,541,600
メタウォーター	5,600	3,120.00	17,472,000
アイネット	6,400	1,626.00	10,406,400
松竹	7,500	11,280.00	84,600,000
東宝	74,300	3,710.00	275,653,000
エイチ・アイ・エス	19,600	3,600.00	70,560,000
東映	4,800	12,560.00	60,288,000
ラックランド	2,100	2,977.00	6,251,700
エヌ・ティ・ティ・データ	300,800	1,401.00	421,420,800
共立メンテナンス	16,800	5,390.00	90,552,000
イチネンホールディングス	11,500	1,514.00	17,411,000
建設技術研究所	7,600	1,587.00	12,061,200
スペース	7,200	1,251.00	9,007,200
長 大	4,400	888.00	3,907,200
アインホールディングス	15,200	8,810.00	133,912,000
燦ホールディングス	2,400	2,743.00	6,583,200
ピー・シー・エー	1,500	2,020.00	3,030,000
スバル興業	700	5,370.00	3,759,000
東京テアトル	4,300	1,332.00	5,727,600
タナベ経営	2,100	1,712.00	3,595,200
ビジネスブレイン太田昭和	1,900	2,200.00	4,180,000
ナガワ	3,100	5,490.00	17,019,000
よみうりランド	2,400	4,140.00	9,936,000
東京都競馬	7,200	3,505.00	25,236,000
常盤興産	4,500	1,707.00	7,681,500
カナモト	15,500	4,120.00	63,860,000
東京ドーム	41,100	1,011.00	41,552,100
D T S	12,600	4,245.00	53,487,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	52,600	3,900.00	205,140,000
シーイーシー	12,100	2,414.00	29,209,400
カプコン	48,400	2,257.00	109,238,800
西尾レントオール	11,200	4,180.00	46,816,000
アイ・エス・ピー	2,200	2,289.00	5,035,800

アゴーラ・ホスピタリティー・グループ	59,100	28.00	1,654,800	
日本空港ビルデング	36,200	4,215.00	152,583,000	
トランス・コスモス	12,200	2,580.00	31,476,000	
乃村工藝社	25,700	2,596.00	66,717,200	
ジャステック	6,600	1,117.00	7,372,200	
S C S K	29,800	4,690.00	139,762,000	
藤田観光	4,400	3,070.00	13,508,000	
K N T - C Tホールディングス	5,900	1,225.00	7,227,500	
日本管財	11,800	2,071.00	24,437,800	
トーカイ	10,600	2,578.00	27,326,800	
白洋舎	1,200	3,105.00	3,726,000	
セコム	116,700	9,085.00	1,060,219,500	
日本システムウエア	3,700	2,314.00	8,561,800	
セントラル警備保障	5,300	5,150.00	27,295,000	
アイネス	14,300	1,290.00	18,447,000	
丹青社	20,800	1,132.00	23,545,600	
メイテック	13,900	4,940.00	68,666,000	
T K C	9,500	4,135.00	39,282,500	
富士ソフト	16,900	5,540.00	93,626,000	
応用地質	11,800	1,336.00	15,764,800	
船井総研ホールディングス	22,800	2,308.00	52,622,400	
N S D	18,500	2,399.00	44,381,500	
進学会ホールディングス	4,900	559.00	2,739,100	
丸紅建材リース	1,100	2,195.00	2,414,500	
オオバ	8,700	696.00	6,055,200	
コナミホールディングス	46,200	5,050.00	233,310,000	
いであ	2,100	1,074.00	2,255,400	
学究社	3,700	1,696.00	6,275,200	
ベネッセホールディングス	40,300	3,205.00	129,161,500	
イオンディライト	13,500	4,005.00	54,067,500	
ナック	7,000	1,136.00	7,952,000	
福井コンピュータホールディングス	3,700	1,681.00	6,219,700	
ニチイ学館	15,700	1,154.00	18,117,800	
ダイセキ	18,400	2,815.00	51,796,000	
ステップ	4,100	1,659.00	6,801,900	
日鉄住金物産	8,100	5,310.00	43,011,000	
泉州電業	3,800	2,571.00	9,769,800	
元気寿司	3,200	5,470.00	17,504,000	
トラスコ中山	23,600	2,946.00	69,525,600	
ヤマダ電機	345,300	543.00	187,497,900	
オートバックスセブン	45,000	1,805.00	81,225,000	
モリト	8,300	882.00	7,320,600	
アーランドサカモト	19,200	1,564.00	30,028,800	
ニトリホールディングス	49,100	14,545.00	714,159,500	
グルメ杵屋	8,200	1,222.00	10,020,400	
愛眼	9,100	324.00	2,948,400	
ケーユーホールディングス	5,800	937.00	5,434,600	
吉野家ホールディングス	39,600	1,896.00	75,081,600	
加藤産業	17,700	3,495.00	61,861,500	

イノテック	7,800	1,314.00	10,249,200
イエローハット	10,700	2,925.00	31,297,500
松屋フーズホールディングス	5,500	3,735.00	20,542,500
JBC Cホールディングス	8,900	1,659.00	14,765,100
J Kホールディングス	10,400	691.00	7,186,400
サガミホールディングス	15,200	1,380.00	20,976,000
日伝	9,400	1,795.00	16,873,000
関西スーパーマーケット	8,600	1,024.00	8,806,400
ミロク情報サービス	11,200	2,473.00	27,697,600
北沢産業	8,600	240.00	2,064,000
杉本商事	6,200	1,870.00	11,594,000
因幡電機産業	16,100	4,725.00	76,072,500
王将フードサービス	8,300	7,210.00	59,843,000
プレナス	12,700	1,877.00	23,837,900
ミニストップ	8,400	2,137.00	17,950,800
アークス	21,300	2,793.00	59,490,900
パローホールディングス	24,500	2,940.00	72,030,000
バイテックホールディングス	5,100	2,545.00	12,979,500
東テク	3,800	2,778.00	10,556,400
ミスミグループ本社	141,900	2,377.00	337,296,300
藤久	900	981.00	882,900
アルテック	8,100	273.00	2,211,300
ベルク	5,600	5,970.00	33,432,000
大 庄	6,100	1,714.00	10,455,400
タキヒヨー	3,500	1,937.00	6,779,500
ファーストリテイリング	15,200	60,800.00	924,160,000
ソフトバンクグループ	472,100	8,777.00	4,143,621,700
蔵王産業	1,900	1,477.00	2,806,300
スズケン	51,700	5,990.00	309,683,000
サンドラッグ	42,600	4,205.00	179,133,000
サックスパー ホールディングス	9,600	1,105.00	10,608,000
ジェコス	7,900	1,114.00	8,800,600
ヤマザワ	2,200	1,691.00	3,720,200
やまや	1,900	2,446.00	4,647,400
ルネサスイーストン	10,500	464.00	4,872,000
ベルーナ	27,800	1,193.00	33,165,400
合計	132,697,400		272,635,488,350

*担保として以下の有価証券が差し入れられております。

銘柄	株式数
トヨタ自動車	500,000

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成30年11月12日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		10,671,441,201
国債証券		281,418,097,000
地方債証券		21,797,227,799
特殊債券		17,887,346,574
社債券		15,237,807,960
未収利息		736,262,657
前払費用		49,723,823
流動資産合計		347,797,907,014
資産合計		347,797,907,014
負債の部		
流動負債		
未払解約金		9,655,308,000
流動負債合計		9,655,308,000
負債合計		9,655,308,000
純資産の部		
元本等		
元本	1	263,721,851,914
剰余金		
剰余金又は欠損金()		74,420,747,100
元本等合計		338,142,599,014
純資産合計		338,142,599,014
負債純資産合計		347,797,907,014

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11月12日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額 同期中追加設定元本額 同期中一部解約元本額	269,142,481,010円 68,401,864,960円 73,822,494,056円
元本の内訳	
ファンド名	
D I A M国内債券パッシブ・ファンド	17,408,404,294円
M I T O ラップ型ファンド（安定型）	116,744,280円
M I T O ラップ型ファンド（中立型）	90,125,269円
M I T O ラップ型ファンド（積極型）	28,070,090円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	808,008,087円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	242,214,024円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	34,579,469円
たわらノーロード 国内債券	4,989,236,046円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	137,544,608円
たわらノーロード バランス（堅実型）	32,166,405円
たわらノーロード バランス（標準型）	62,077,910円
たわらノーロード バランス（積極型）	11,623,832円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（保守型）	5,379,624円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（安定型）	81,880,890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）	111,554,132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）	29,055,116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)	15,002,139円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(保守型)	1,295,989円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定型)	690,905円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定成長型)	3,474,718円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(成長型)	679,107円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(積極型)	17,517円
D I A M国内債券インデックス ファンド<DC年金>	12,888,678,854円
D I A Mバランス・ファンド< DC年金> 1 安定型	5,907,177,396円
D I A Mバランス・ファンド< DC年金> 2 安定・成長型	8,536,682,088円
D I A Mバランス・ファンド< DC年金> 3 成長型	3,449,028,586円
D I A M DC バランス30 インデックスファンド	1,826,821,087円
D I A M DC バランス50 インデックスファンド	2,023,278,584円
D I A M DC バランス70 インデックスファンド	316,274,220円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型>	88,374,891円
マネックス資産設計ファンド< 育成型>	2,323,339,829円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	2,827,451円
D I A M DC 8資産バラ ンスファンド(新興国10)	3,170,586,023円
D I A M DC 8資産バラ ンスファンド(新興国20)	749,121,254円
D I A M DC 8資産バラ ンスファンド(新興国30)	161,069,244円
投資のソムリエ	8,284,268,559円
クルーズコントロール	1,724,636,935円
投資のソムリエ<DC年金>	733,113,467円
D I A M 8資産バランスファ ンドN<DC年金>	2,256,116,469円
D I A M DC バランス・F (成長型)	286,051,968円
クルーズコントロール<DC年 金>	1,156,783円
D I A Mコア資産設計ファンド (堅実型)	4,671,623円
D I A Mコア資産設計ファンド (積極型)	13,207,726円
投資のソムリエ<DC年金>リ スク抑制型	996,404,083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	1,733,391円 18,251,393,459円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2045)	2,587,926円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2055)	1,888,453円
リスク抑制世界8資産バランス ファンド(DC)	5,733,648円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2035)	3,709,153円
4資産分散投資・スタンダード <DC年金>	75,826,070円
リスクコントロール世界資産分 散ファンド	1,797,723,485円
9資産分散投資・スタンダード <DC年金>	290,676円
DIAMエマージング債券ファ ンド	9,450,010円
DIAM国内債券パッシブファ ンド(適格機関投資家向け)	22,705,000,385円
DIAMワールドバランス25 VA(適格機関投資家限定)	438,328,491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)	272,739,106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)	222,896,584円
DIAM国際分散バランスファ ンド30VA(適格機関投資家 限定)	70,267,221円
DIAM国際分散バランスファ ンド50VA(適格機関投資家 限定)	190,121,761円
DIAM国内重視バランスファ ンド30VA(適格機関投資家 限定)	80,778,823円
DIAM国内重視バランスファ ンド50VA(適格機関投資家 限定)	41,245,185円
DIAM世界バランスファンド 40VA(適格機関投資家限 定)	89,222,117円
DIAM世界バランスファンド 50VA(適格機関投資家限 定)	161,461,305円
DIAMバランスファンド25 VA(適格機関投資家限定)	5,444,421,012円
DIAMバランスファンド3 7.5VA(適格機関投資家限 定)	2,877,336,317円

D I A Mバランスファンド50 V A (適格機関投資家限定)	5,340,448,902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)	564,247,587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)	258,167,248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)	3,303,558,731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)	822,350,080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)	44,645,422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)	88,242,707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)	55,525,240,297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)	630,206,232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)	6,958,172,222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)	26,484,173,718円
D I A Mバランス30V A (適 格機関投資家限定)	74,743,861円
D I A Mバランス50V A (適 格機関投資家限定)	1,402,145円
D I A Mバランス70V A (適 格機関投資家限定)	7,629,980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)	29,631,100,239円
D I A M世界バランス25V A (適格機関投資家限定)	457,580,297円
D I A M国内バランス30V A (適格機関投資家限定)	129,163,855円
D I A Mバランス20V A (適 格機関投資家限定)	508,066,309円
D I A Mバランス40V A (適 格機関投資家限定)	711,790円
D I A Mバランス60V A (適 格機関投資家限定)	381,210円

計	263,721,851,914円
2. 受益権の総数	263,721,851,914口

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成30年5月25日 至 平成30年11月12日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成30年11月12日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
国債証券	2,538,616,500
地方債証券	109,688,466
特殊債券	126,749,519
社債券	97,016,290
合計	2,872,070,775

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(平成30年2月15日から平成30年11月12日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成30年11月12日現在
1口当たり純資産額	1.2822円
(1万口当たり純資産額)	(12,822円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

平成30年11月12日現在

種 類	銘 柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
国債証券	384回 利付国庫債券(2年)	1,000,000,000	1,002,930,000	
	386回 利付国庫債券(2年)	1,000,000,000	1,003,400,000	
	387回 利付国庫債券(2年)	1,000,000,000	1,003,550,000	
	388回 利付国庫債券(2年)	800,000,000	803,064,000	
	390回 利付国庫債券(2年)	1,200,000,000	1,204,800,000	
	391回 利付国庫債券(2年)	1,400,000,000	1,405,894,000	
	392回 利付国庫債券(2年)	1,800,000,000	1,807,956,000	
	122回 利付国庫債券(5年)	3,000,000,000	3,008,430,000	
	123回 利付国庫債券(5年)	3,000,000,000	3,010,110,000	
	124回 利付国庫債券(5年)	2,200,000,000	2,208,624,000	
	125回 利付国庫債券(5年)	3,000,000,000	3,013,350,000	
	126回 利付国庫債券(5年)	2,500,000,000	2,512,900,000	
	127回 利付国庫債券(5年)	3,000,000,000	3,016,230,000	
	128回 利付国庫債券(5年)	2,200,000,000	2,212,892,000	
	129回 利付国庫債券(5年)	2,420,000,000	2,435,221,800	
	130回 利付国庫債券(5年)	3,000,000,000	3,020,070,000	
	131回 利付国庫債券(5年)	2,020,000,000	2,034,584,400	
	132回 利付国庫債券(5年)	2,000,000,000	2,015,180,000	
	133回 利付国庫債券(5年)	2,460,000,000	2,479,975,200	
	134回 利付国庫債券(5年)	1,790,000,000	1,805,107,600	
	135回 利付国庫債券(5年)	2,100,000,000	2,118,333,000	
	136回 利付国庫債券(5年)	1,200,000,000	1,210,800,000	
	2回 利付国庫債券(40年)	460,000,000	620,287,000	
	3回 利付国庫債券(40年)	440,000,000	595,878,800	
	4回 利付国庫債券(40年)	630,000,000	856,648,800	
	5回 利付国庫債券(40年)	700,000,000	915,103,000	
	6回 利付国庫債券(40年)	700,000,000	896,595,000	
	7回 利付国庫債券(40年)	750,000,000	917,047,500	
	8回 利付国庫債券(40年)	840,000,000	951,123,600	
	9回 利付国庫債券(40年)	1,210,000,000	989,707,400	
	10回 利付国庫債券(40年)	1,100,000,000	1,066,549,000	
	11回 利付国庫債券(40年)	490,000,000	457,160,200	
	305回 利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,523,910,000	
	306回 利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,531,290,000	
	307回 利付国庫債券(10年)	1,400,000,000	1,427,314,000	
	308回 利付国庫債券(10年)	800,000,000	818,536,000	
	309回 利付国庫債券(10年)	1,000,000,000	1,019,960,000	
	310回 利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,531,740,000	
	311回 利付国庫債券(10年)	1,020,000,000	1,037,799,000	
	312回 利付国庫債券(10年)	2,200,000,000	2,261,886,000	

313回	利付国庫債券(10年)	1,790,000,000	1,850,269,300	
314回	利付国庫債券(10年)	800,000,000	823,168,000	
315回	利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,551,840,000	
316回	利付国庫債券(10年)	500,000,000	515,975,000	
317回	利付国庫債券(10年)	1,000,000,000	1,034,910,000	
318回	利付国庫債券(10年)	1,600,000,000	1,651,280,000	
319回	利付国庫債券(10年)	600,000,000	622,686,000	
320回	利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,552,050,000	
321回	利付国庫債券(10年)	1,100,000,000	1,141,019,000	
322回	利付国庫債券(10年)	1,000,000,000	1,033,930,000	
323回	利付国庫債券(10年)	750,000,000	777,232,500	
324回	利付国庫債券(10年)	2,000,000,000	2,065,400,000	
325回	利付国庫債券(10年)	2,900,000,000	3,001,500,000	
326回	利付国庫債券(10年)	500,000,000	516,470,000	
327回	利付国庫債券(10年)	1,450,000,000	1,503,737,000	
328回	利付国庫債券(10年)	2,390,000,000	2,462,512,600	
329回	利付国庫債券(10年)	2,270,000,000	2,363,319,700	
330回	利付国庫債券(10年)	1,950,000,000	2,033,577,000	
331回	利付国庫債券(10年)	650,000,000	671,528,000	
332回	利付国庫債券(10年)	2,460,000,000	2,545,017,600	
333回	利付国庫債券(10年)	2,500,000,000	2,589,900,000	
334回	利付国庫債券(10年)	2,950,000,000	3,060,241,500	
335回	利付国庫債券(10年)	2,250,000,000	2,323,980,000	
336回	利付国庫債券(10年)	1,150,000,000	1,189,065,500	
337回	利付国庫債券(10年)	1,650,000,000	1,685,854,500	
338回	利付国庫債券(10年)	2,750,000,000	2,828,787,500	
339回	利付国庫債券(10年)	3,100,000,000	3,190,241,000	
340回	利付国庫債券(10年)	3,100,000,000	3,192,597,000	
341回	利付国庫債券(10年)	3,060,000,000	3,130,747,200	
342回	利付国庫債券(10年)	3,000,000,000	3,025,350,000	
343回	利付国庫債券(10年)	3,000,000,000	3,023,940,000	
344回	利付国庫債券(10年)	2,800,000,000	2,819,768,000	
345回	利付国庫債券(10年)	2,700,000,000	2,716,362,000	
346回	利付国庫債券(10年)	3,000,000,000	3,016,230,000	
347回	利付国庫債券(10年)	2,900,000,000	2,913,659,000	
348回	利付国庫債券(10年)	2,900,000,000	2,910,208,000	
349回	利付国庫債券(10年)	2,610,000,000	2,617,073,100	
350回	利付国庫債券(10年)	3,400,000,000	3,404,726,000	
351回	利付国庫債券(10年)	2,740,000,000	2,740,000,000	
352回	利付国庫債券(10年)	1,000,000,000	998,530,000	
1回	利付国庫債券(30年)	100,000,000	127,955,000	
2回	利付国庫債券(30年)	100,000,000	124,662,000	
3回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	247,692,000	
4回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	263,224,000	
5回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	247,778,000	
6回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	254,056,000	
7回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	378,912,000	
8回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	239,890,000	
11回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	237,668,000	
12回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	374,118,000	

13回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	370,200,000	
14回	利付国庫債券(30年)	500,000,000	647,410,000	
15回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	262,442,000	
16回	利付国庫債券(30年)	400,000,000	526,000,000	
17回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	260,310,000	
18回	利付国庫債券(30年)	420,000,000	540,787,800	
19回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	257,748,000	
20回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	396,954,000	
21回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	387,822,000	
22回	利付国庫債券(30年)	470,000,000	623,534,900	
23回	利付国庫債券(30年)	600,000,000	796,692,000	
24回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	398,988,000	
25回	利付国庫債券(30年)	400,000,000	519,080,000	
26回	利付国庫債券(30年)	700,000,000	921,193,000	
27回	利付国庫債券(30年)	700,000,000	935,550,000	
28回	利付国庫債券(30年)	900,000,000	1,205,838,000	
29回	利付国庫債券(30年)	900,000,000	1,191,600,000	
30回	利付国庫債券(30年)	960,000,000	1,255,939,200	
31回	利付国庫債券(30年)	900,000,000	1,162,566,000	
32回	利付国庫債券(30年)	960,000,000	1,262,860,800	
33回	利付国庫債券(30年)	1,100,000,000	1,384,141,000	
34回	利付国庫債券(30年)	1,140,000,000	1,484,793,000	
35回	利付国庫債券(30年)	1,250,000,000	1,579,462,500	
36回	利付国庫債券(30年)	1,300,000,000	1,645,748,000	
37回	利付国庫債券(30年)	1,250,000,000	1,558,175,000	
38回	利付国庫債券(30年)	750,000,000	919,702,500	
39回	利付国庫債券(30年)	800,000,000	999,368,000	
40回	利付国庫債券(30年)	650,000,000	797,979,000	
41回	利付国庫債券(30年)	680,000,000	819,923,600	
42回	利付国庫債券(30年)	800,000,000	964,952,000	
43回	利付国庫債券(30年)	600,000,000	723,966,000	
44回	利付国庫債券(30年)	780,000,000	941,467,800	
45回	利付国庫債券(30年)	870,000,000	1,010,217,900	
46回	利付国庫債券(30年)	980,000,000	1,137,946,600	
47回	利付国庫債券(30年)	960,000,000	1,137,168,000	
48回	利付国庫債券(30年)	940,000,000	1,068,206,600	
49回	利付国庫債券(30年)	990,000,000	1,124,798,400	
50回	利付国庫債券(30年)	1,000,000,000	990,000,000	
51回	利付国庫債券(30年)	930,000,000	805,742,700	
52回	利付国庫債券(30年)	1,060,000,000	968,808,200	
53回	利付国庫債券(30年)	900,000,000	843,219,000	
54回	利付国庫債券(30年)	900,000,000	887,688,000	
55回	利付国庫債券(30年)	830,000,000	817,624,700	
56回	利付国庫債券(30年)	900,000,000	885,465,000	
57回	利付国庫債券(30年)	930,000,000	913,818,000	
58回	利付国庫債券(30年)	1,130,000,000	1,108,914,200	
59回	利付国庫債券(30年)	800,000,000	763,488,000	
60回	利付国庫債券(30年)	350,000,000	351,652,000	
45回	利付国庫債券(20年)	900,000,000	930,933,000	
46回	利付国庫債券(20年)	500,000,000	518,865,000	

47回	利付国庫債券(20年)	250,000,000	260,877,500	
48回	利付国庫債券(20年)	500,000,000	527,855,000	
50回	利付国庫債券(20年)	780,000,000	817,276,200	
51回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	633,210,000	
52回	利付国庫債券(20年)	550,000,000	584,892,000	
54回	利付国庫債券(20年)	700,000,000	750,316,000	
55回	利付国庫債券(20年)	410,000,000	439,093,600	
58回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	646,524,000	
60回	利付国庫債券(20年)	590,000,000	626,444,300	
61回	利付国庫債券(20年)	500,000,000	523,900,000	
64回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	657,864,000	
65回	利付国庫債券(20年)	550,000,000	605,621,500	
67回	利付国庫債券(20年)	520,000,000	574,990,000	
70回	利付国庫債券(20年)	750,000,000	853,905,000	
72回	利付国庫債券(20年)	350,000,000	394,278,500	
73回	利付国庫債券(20年)	790,000,000	889,113,400	
75回	利付国庫債券(20年)	440,000,000	500,082,000	
78回	利付国庫債券(20年)	640,000,000	721,920,000	
81回	利付国庫債券(20年)	240,000,000	273,451,200	
83回	利付国庫債券(20年)	780,000,000	897,592,800	
85回	利付国庫債券(20年)	440,000,000	508,266,000	
88回	利付国庫債券(20年)	750,000,000	881,100,000	
90回	利付国庫債券(20年)	1,200,000,000	1,406,184,000	
92回	利付国庫債券(20年)	1,300,000,000	1,518,088,000	
93回	利付国庫債券(20年)	700,000,000	814,485,000	
94回	利付国庫債券(20年)	800,000,000	937,504,000	
95回	利付国庫債券(20年)	1,200,000,000	1,431,816,000	
97回	利付国庫債券(20年)	500,000,000	594,475,000	
99回	利付国庫債券(20年)	900,000,000	1,065,708,000	
100回	利付国庫債券(20年)	850,000,000	1,017,195,000	
102回	利付国庫債券(20年)	660,000,000	804,724,800	
105回	利付国庫債券(20年)	950,000,000	1,134,803,500	
106回	利付国庫債券(20年)	350,000,000	421,498,000	
107回	利付国庫債券(20年)	650,000,000	778,446,500	
108回	利付国庫債券(20年)	750,000,000	883,237,500	
109回	利付国庫債券(20年)	770,000,000	909,154,400	
110回	利付国庫債券(20年)	750,000,000	900,855,000	
111回	利付国庫債券(20年)	570,000,000	692,641,200	
112回	利付国庫債券(20年)	750,000,000	903,540,000	
113回	利付国庫債券(20年)	1,500,000,000	1,811,370,000	
114回	利付国庫債券(20年)	1,100,000,000	1,332,034,000	
115回	利付国庫債券(20年)	700,000,000	855,288,000	
116回	利付国庫債券(20年)	740,000,000	906,736,800	
117回	利付国庫債券(20年)	950,000,000	1,153,480,500	
118回	利付国庫債券(20年)	700,000,000	843,801,000	
119回	利付国庫債券(20年)	700,000,000	827,911,000	
120回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	695,622,000	
121回	利付国庫債券(20年)	730,000,000	873,167,600	
122回	利付国庫債券(20年)	500,000,000	592,275,000	
123回	利付国庫債券(20年)	680,000,000	831,177,600	

1 2 4 回	利付国庫債券(20年)	500,000,000	605,265,000	
1 2 5 回	利付国庫債券(20年)	720,000,000	890,834,400	
1 2 6 回	利付国庫債券(20年)	450,000,000	545,634,000	
1 2 7 回	利付国庫債券(20年)	350,000,000	420,178,500	
1 2 8 回	利付国庫債券(20年)	1,050,000,000	1,263,171,000	
1 2 9 回	利付国庫債券(20年)	200,000,000	238,158,000	
1 3 0 回	利付国庫債券(20年)	900,000,000	1,073,034,000	
1 3 1 回	利付国庫債券(20年)	450,000,000	530,914,500	
1 3 2 回	利付国庫債券(20年)	660,000,000	779,915,400	
1 3 3 回	利付国庫債券(20年)	910,000,000	1,086,858,500	
1 3 4 回	利付国庫債券(20年)	500,000,000	597,785,000	
1 3 5 回	利付国庫債券(20年)	500,000,000	591,355,000	
1 3 6 回	利付国庫債券(20年)	500,000,000	584,920,000	
1 3 7 回	利付国庫債券(20年)	690,000,000	817,291,200	
1 3 8 回	利付国庫債券(20年)	640,000,000	740,832,000	
1 3 9 回	利付国庫債券(20年)	580,000,000	678,965,400	
1 4 0 回	利付国庫債券(20年)	1,350,000,000	1,600,290,000	
1 4 1 回	利付国庫債券(20年)	1,100,000,000	1,304,809,000	
1 4 2 回	利付国庫債券(20年)	750,000,000	899,760,000	
1 4 3 回	利付国庫債券(20年)	970,000,000	1,137,974,900	
1 4 4 回	利付国庫債券(20年)	460,000,000	533,360,800	
1 4 5 回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,663,676,000	
1 4 6 回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,664,474,000	
1 4 7 回	利付国庫債券(20年)	1,500,000,000	1,762,605,000	
1 4 8 回	利付国庫債券(20年)	1,300,000,000	1,508,962,000	
1 4 9 回	利付国庫債券(20年)	1,520,000,000	1,765,510,400	
1 5 0 回	利付国庫債券(20年)	1,500,000,000	1,719,750,000	
1 5 1 回	利付国庫債券(20年)	1,410,000,000	1,572,305,100	
1 5 2 回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,559,880,000	
1 5 3 回	利付国庫債券(20年)	1,360,000,000	1,536,174,400	
1 5 4 回	利付国庫債券(20年)	1,150,000,000	1,280,088,000	
1 5 5 回	利付国庫債券(20年)	1,250,000,000	1,349,525,000	
1 5 6 回	利付国庫債券(20年)	1,370,000,000	1,340,627,200	
1 5 7 回	利付国庫債券(20年)	1,300,000,000	1,225,016,000	
1 5 8 回	利付国庫債券(20年)	1,330,000,000	1,317,045,800	
1 5 9 回	利付国庫債券(20年)	1,420,000,000	1,428,150,800	
1 6 0 回	利付国庫債券(20年)	1,300,000,000	1,326,962,000	
1 6 1 回	利付国庫債券(20年)	1,200,000,000	1,200,996,000	
1 6 2 回	利付国庫債券(20年)	1,200,000,000	1,197,960,000	
1 6 3 回	利付国庫債券(20年)	1,210,000,000	1,205,861,800	
1 6 4 回	利付国庫債券(20年)	1,460,000,000	1,424,799,400	
1 6 5 回	利付国庫債券(20年)	1,220,000,000	1,187,145,400	
1 6 6 回	利付国庫債券(20年)	400,000,000	403,160,000	
国債証券 合計		260,890,000,000	281,418,097,000	
地方債証券	6 8 0 回 東京都公募公債	200,000,000	203,692,000	
	6 8 5 回 東京都公募公債	500,000,000	508,875,000	
	6 8 8 回 東京都公募公債	200,000,000	203,400,000	
	6 9 7 回 東京都公募公債	500,000,000	514,145,000	
	7 0 1 回 東京都公募公債	700,000,000	719,313,000	
	7 0 8 回 東京都公募公債	500,000,000	515,660,000	

720回 東京都公募公債	300,000,000	311,655,000	
726回 東京都公募公債	400,000,000	414,164,000	
5回 東京都公募公債 20年	100,000,000	112,926,000	
9回 東京都公募公債 20年	200,000,000	235,188,000	
10回 東京都公募公債 20年	300,000,000	351,546,000	
22年度12回 北海道公募公債	200,000,000	205,616,000	
194回 神奈川県公募公債	300,000,000	309,420,000	
208回 神奈川県公募公債	300,000,000	308,208,000	
336回 大阪府公募公債	200,000,000	203,968,000	
345回 大阪府公募公債	300,000,000	307,881,000	
356回 大阪府公募公債	200,000,000	206,428,000	
364回 大阪府公募公債	300,000,000	308,700,000	
374回 大阪府公募公債	300,000,000	312,435,000	
26年度11回 京都府公募公債	350,000,000	358,627,500	
26年度17回 兵庫県公募公債	200,000,000	204,564,000	
1回 兵庫県公募公債(12年)	300,000,000	317,100,000	
22年度8回 静岡県公募公債	200,000,000	203,704,000	
23年度9回 静岡県公募公債	200,000,000	206,220,000	
1回 静岡県公募公債 20年	100,000,000	114,230,000	
22年度6回 愛知県公募公債	200,000,000	203,964,000	
23年度20回 愛知県公募公債	500,000,000	517,910,000	
25年度4回 愛知県公募公債	300,000,000	311,175,000	
22年度1回 広島県公募公債	200,000,000	204,148,000	
23年度2回 埼玉県公募公債	200,000,000	205,920,000	
26年度5回 埼玉県公募公債	400,000,000	412,408,000	
25年度11回 福岡県公募公債	200,000,000	206,796,000	
24年度2回 福岡県公募公債(20年)	300,000,000	345,603,000	
24年度7回 千葉県公募公債	300,000,000	308,805,000	
25年度5回 千葉県公募公債	200,000,000	207,638,000	
94回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,687,000	
99回 共同発行市場公募地方債	700,000,000	721,049,000	
106回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	309,123,000	
109回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	517,750,000	
111回 共同発行市場公募地方債	700,000,000	721,987,000	
119回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	516,475,000	
121回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	511,880,000	
126回 共同発行市場公募地方債	793,900,000	823,599,799	
127回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	515,680,000	
128回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	309,264,000	
137回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	514,410,000	
139回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	514,100,000	
142回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	508,330,000	
144回 共同発行市場公募地方債	400,000,000	410,004,000	
146回 共同発行市場公募地方債	400,000,000	412,148,000	
148回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	515,580,000	
166回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	501,010,000	
29年度4回 大阪市公募公債	200,000,000	199,302,000	
488回 名古屋市公募公債 10年	450,000,000	463,986,000	
4回 京都市公募公債 20年	100,000,000	118,489,000	
22年度3回 横浜市公募公債	200,000,000	204,244,000	

	2 2年度 5回 横浜市公募公債	200,000,000	205,180,000	
	2 3年度 4回 横浜市公募公債	450,000,000	463,828,500	
	2 5年度 2回 横浜市公募公債	400,000,000	415,900,000	
	2 5年度 4回 札幌市公募公債	200,000,000	207,030,000	
	2回 川崎市公募公債 15年	100,000,000	102,589,000	
	2 1年度 2回 北九州市公募公債	200,000,000	202,990,000	
	2 3年度 1回 千葉市公募公債	200,000,000	206,580,000	
地方債証券 合計		21,043,900,000	21,797,227,799	
特殊債券	7 8回 日本政策投資銀行債券	200,000,000	200,580,000	
	1 9回 高速道路機構債	150,000,000	212,382,000	
	2 6回 高速道路機構債	200,000,000	267,822,000	
	9 6回 高速道路機構債	700,000,000	720,363,000	
	1 1 6回 高速道路機構債	100,000,000	103,254,000	
	1 7 2回 高速道路機構債	200,000,000	186,774,000	
	9回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	104,583,000	
	1 8回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	318,771,000	
	1 2 1回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	584,935,000	
	1 4 9回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	400,000,000	412,636,000	
	1 8 0回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1,000,000,000	1,031,130,000	
	1 8 9回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	512,395,000	
	1 9 3回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	520,775,000	
	1 9 5回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	330,000,000	344,335,200	
	2 4 1回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	513,205,000	
	2 6 0回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	221,518,000	
	3 0 9回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	800,000,000	801,336,000	
	3 1 9回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	198,184,000	
	2 8回 日本道路・機構承継債	400,000,000	530,548,000	
	1回 地方公共団体金融機構債券 20年	200,000,000	234,708,000	
	8回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	304,764,000	
	1 0回 政保地方公共団体金融機構債券	500,000,000	508,890,000	
	1 5回 政保地方公共団体金融機構債券	200,000,000	203,630,000	
	2 0回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	308,118,000	
	2 4回 地方公共団体金融機構債券	300,000,000	309,126,000	
	1 9回 政保地方公共団体金融機構債券	200,000,000	235,164,000	
	3 6回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	309,888,000	
	4 4回 政保地方公共団体金融機構債券	400,000,000	414,320,000	
	5 0回 政保地方公共団体金融機構債券	500,000,000	521,505,000	
	5 6回 政保地方公共団体金融機構債券	542,000,000	562,856,160	
	6 4回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	309,159,000	
	4 4回 地方公共団体金融機構債券 20年	200,000,000	220,602,000	

15回	日本政策金融公庫債券	200,000,000	235,160,000		
39回	住宅金融支援機構債券	200,000,000	238,284,000		
75回	住宅金融支援機構債券	350,000,000	419,615,000		
222回	住宅金融支援機構債券	300,000,000	299,469,000		
6回	貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	44,022,000	46,301,459		
8回	貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	30,982,000	32,653,788		
9回	貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	46,317,000	48,847,297		
2回	貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	49,185,000	52,271,850		
13回	貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	17,843,000	18,368,833		
14回	貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	89,755,000	91,968,358		
43回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	16,495,000	17,457,483		
44回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	62,068,000	65,500,360		
51回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	46,674,000	49,204,664		
1回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	78,795,000	82,522,791		
29回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	164,180,000	175,872,899		
36回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	285,800,000	303,393,848		
126回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	288,057,000	288,290,326		
128回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	289,179,000	289,262,861		
131回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	293,238,000	292,701,374		
132回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	293,553,000	292,986,442		
137回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	299,337,000	299,977,581		
い第779号	利付商工債	200,000,000	200,464,000		
い第783号	利付商工債	300,000,000	300,963,000		
302回	利附信金中金債	300,000,000	300,615,000		
325回	利附信金中金債	400,000,000	399,748,000		
220号	利附商工債(3年)	300,000,000	300,000,000		
55回	鉄道建設運輸施設債	500,000,000	517,190,000		
特殊債券 合計		16,967,480,000	17,887,346,574		
社債券	1回	B P C E S A 円貨社債(ソーシャル ボンド)	200,000,000	199,198,000	
	6回	クレディ・アグリコル・エス・エー円 貨社債	200,000,000	204,982,000	
	337回	東京交通債	200,000,000	210,274,000	
	27回	ラボバンク・ネダーランド円貨社債	200,000,000	200,756,000	
	22回	中日本高速道路債券	300,000,000	305,691,000	
	34回	政保西日本高速道路債券	200,000,000	201,784,000	
	9回	日本たばこ産業社債	200,000,000	200,540,000	
	19回	三菱ケミカルホールディングス社債	100,000,000	101,372,000	
	6回	J Xホールディングス社債	100,000,000	104,234,000	
	23回	ジェイ エフ イー ホールディ ングス社債	100,000,000	99,767,000	
	30回	豊田自動織機社債	200,000,000	199,880,000	
	12回	パナソニック社債	200,000,000	200,840,000	
	13回	パナソニック社債	100,000,000	101,470,000	
	56回	日産自動車社債	100,000,000	100,618,000	
	14回	トヨタ自動車社債	200,000,000	207,342,000	
	16回	トヨタ自動車社債	200,000,000	205,306,000	
94回	丸紅社債	100,000,000	103,764,000		

4 5 回	住友商事社債	100,000,000	103,176,000	
4 7 回	住友商事社債	100,000,000	103,016,000	
4 8 回	クレディセゾン社債	100,000,000	103,485,000	
5 7 回	東京三菱銀行社債	200,000,000	216,536,000	
7 回	東京三菱銀行劣後社債	200,000,000	204,480,000	
2 5 回	三菱東京U F J 銀行劣後社債	200,000,000	204,832,000	
2 8 回	三菱東京U F J 銀行劣後社債	200,000,000	206,244,000	
3 2 回	三菱東京U F J 銀行劣後社債	300,000,000	311,460,000	
6 回	りそな銀行劣後社債	100,000,000	102,616,000	
7 回	三菱U F J 信託銀行劣後債	200,000,000	204,736,000	
9 回	三菱U F J 信託銀行劣後債	100,000,000	103,802,000	
1 2 回	住友信託銀行劣後債	100,000,000	102,539,000	
1 0 回	三井住友信託銀行社債	200,000,000	204,164,000	
1 0 回	セブン銀行社債	100,000,000	102,974,000	
2 2 回	三井住友銀行劣後社債	200,000,000	204,986,000	
2 3 回	三井住友銀行劣後社債	400,000,000	412,644,000	
1 5 回	トヨタファイナンス社債	200,000,000	206,144,000	
4 7 回	日立キャピタル社債	200,000,000	205,364,000	
1 4 回	大和証券グループ本社社債	100,000,000	101,659,000	
2 6 回	野村ホールディングス社債	100,000,000	102,725,000	
4 2 回	野村ホールディングス社債	200,000,000	203,626,000	
4 6 回	野村ホールディングス社債	200,000,000	200,628,000	
3 8 回	三井不動産社債	200,000,000	203,830,000	
7 2 回	三菱地所社債	100,000,000	112,128,000	
8 7 回	住友不動産社債	100,000,000	100,985,000	
1 5 回	東日本旅客鉄道社債	300,000,000	314,097,000	
1 9 回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	107,493,000	
2 1 回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	107,434,000	
3 9 回	東日本旅客鉄道社債	300,000,000	336,930,000	
4 2 回	東日本旅客鉄道社債	200,000,000	226,198,000	
9 回	西日本旅客鉄道社債	200,000,000	214,762,000	
1 0 回	西日本旅客鉄道社債	300,000,000	327,801,000	
5 回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	103,153,000	
6 回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	107,529,000	
1 1 回	東海旅客鉄道社債	300,000,000	312,873,000	
1 3 回	東海旅客鉄道社債	200,000,000	219,170,000	
1 4 回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	110,993,000	
4 回	東京地下鉄社債	120,000,000	139,622,400	
6 0 回	日本電信電話社債	300,000,000	307,737,000	
4 9 6 回	中部電力社債	500,000,000	510,230,000	
5 1 8 回	中部電力社債	200,000,000	200,458,000	
3 7 7 回	中国電力社債	400,000,000	417,060,000	
3 7 9 回	中国電力社債	300,000,000	303,657,000	
2 6 0 回	北陸電力社債	100,000,000	103,489,000	
3 0 1 回	北陸電力社債	100,000,000	104,142,000	
3 0 7 回	北陸電力社債	100,000,000	105,300,000	
4 7 1 回	東北電力社債	400,000,000	418,236,000	
4 7 3 回	東北電力社債	300,000,000	303,597,000	
2 5 3 回	四国電力社債	200,000,000	207,214,000	
4 2 4 回	九州電力社債	200,000,000	210,136,000	

4 2 6 回 九州電力社債	400,000,000	417,192,000	
3 2 0 回 北海道電力社債	200,000,000	202,602,000	
3 2 1 回 北海道電力社債	161,000,000	166,467,560	
3 4 0 回 北海道電力社債	300,000,000	300,978,000	
1 3 回 電源開発社債	200,000,000	222,446,000	
3 8 回 電源開発社債	300,000,000	310,995,000	
2 3 回 東京瓦斯社債	300,000,000	312,282,000	
1 8 回 大阪ガス社債	100,000,000	105,556,000	
2 7 回 NTTデータ社債	100,000,000	103,381,000	
社債券 合計	14,681,000,000	15,237,807,960	
合計	313,582,380,000	336,340,479,333	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

「J-REITインデックスファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位:円)

科 目	注記 番号	平成30年11月12日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		1,701,032,743
投資証券		31,472,460,490
派生商品評価勘定		16,985,592
未収配当金		298,443,790
差入委託証拠金		10,492,092
流動資産合計		33,499,414,707
資産合計		33,499,414,707
負債の部		
流動負債		
前受金		9,263,592
未払金		914,711,606
未払解約金		370,110,400
流動負債合計		1,294,085,598
負債合計		1,294,085,598
純資産の部		
元本等		
元本	1	16,951,549,055
剰余金		
剰余金又は欠損金()		15,253,780,054
元本等合計		32,205,329,109
純資産合計		32,205,329,109
負債純資産合計		33,499,414,707

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11月12日現在
1 . 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	19,741,077,965円
同期中追加設定元本額	7,430,580,484円
同期中一部解約元本額	10,220,109,394円
元本の内訳	
ファンド名	
MITO ラップ型ファンド（安定型）	280,843円
MITO ラップ型ファンド（中立型）	1,025,234円
MITO ラップ型ファンド（積極型）	2,030,344円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	1,911,261円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	2,803,635円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	2,454,496円
たわらノーロード 国内リート	1,598,347,549円
たわらノーロード 国内リート<ラップ向け>	637,901,090円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	97,030,025円
たわらノーロード バランス（堅実型）	1,229,846円
たわらノーロード バランス（標準型）	25,399,955円
たわらノーロード バランス（積極型）	41,185,845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)	11,498,642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)	41,640,627円
たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(成長型)	25,341,445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)	53,823,143円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定型)	167,960円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定成長型)	1,644,501円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(成長型)	937,935円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(積極型)	2,888,276円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型>	14,015,062円
マネックス資産設計ファンド< 育成型>	368,084,557円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	2,122,432円
D I A M D C 8資産 balan スファンド(新興国10)	113,081,002円
D I A M D C 8資産 balan スファンド(新興国20)	98,264,882円
D I A M D C 8資産 balan スファンド(新興国30)	196,760,052円
投資のソムリエ	1,496,921,002円
投資のソムリエ<DC年金>	132,450,424円
D I A M 8資産 balan スファ ンドN<DC年金>	80,069,705円
投資のソムリエ<DC年金>リ スク抑制型	41,057,145円
ダイナミック・ナビゲーション リスク抑制世界8資産 balan スファンド	449,217円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2045)	751,303,077円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2055)	766,234円
リスク抑制世界8資産 balan スファンド(DC)	559,491円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2035)	235,489円
リスクコントロール世界資産分 散ファンド	1,105,464円
9資産分散投資・スタンダード <DC年金>	255,955,063円
Jリートインデックスファンド (DC)	8,057円
	6,756,162円

DIAM J-REITイン デックス私募ファンド2012 12(適格機関投資家限定)	90,731,870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)	819,808,744円
DIAM J-REITイン デックスファンド(適格機関投 資家向け)	8,539,147,794円
日米資産配分戦略ファンド(イ ンカム重視型)(為替ヘッジあ り)(適格機関投資家限定)	63,083,346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)	856,564,973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)	458,302,789円
計	16,951,549,055円
2. 受益権の総数	16,951,549,055口

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成30年5月25日 至 平成30年11月12日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。</p> <p>また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、不動産投信指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、不動産投資信託証券の価格の変動によるリスクを有しております。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成30年11月12日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
投資証券	744,410,468
合計	744,410,468

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(平成30年6月7日から平成30年11月12日まで)に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

不動産投信関連

種類	平成30年11月12日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引 不動産投信指数先 物取引 買 建	607,932,000	-	624,955,500	17,023,500
合計	607,932,000	-	624,955,500	17,023,500

（注）1．時価の算定方法

不動産投信指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2．先物取引の残高表示は、契約額によっております。

3．契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	平成30年11月12日現在
1口当たり純資産額	1.8998円
（1万口当たり純資産額）	（18,998円）

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

平成30年11月12日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
投資証券	CRE ロジスティクスファンド投資法人	362	38,444,400	
	GLP 投資法人	8,962	1,009,121,200	
	MCUBS MidCity 投資法人	4,076	355,427,200	
	One リート投資法人	527	133,172,900	
	いちごオフィスリート投資法人	3,001	280,893,600	
	いちごホテルリート投資法人	632	85,636,000	
	さくら総合リート投資法人	783	69,217,200	
	アクティブ・プロパティーズ投資法人	1,733	840,505,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人	3,525	1,048,335,000	
	イオンリート投資法人	3,712	469,196,800	
	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	21,439	347,526,190	
	インヴィンシブル投資法人	12,657	587,284,800	
	オリックス不動産投資法人	7,206	1,278,344,400	
	グローバル・ワン不動産投資法人	2,312	266,804,800	
	ケネディクス・オフィス投資法人	1,119	811,275,000	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	2,146	370,399,600	
	ケネディクス商業リート投資法人	1,326	320,759,400	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	1,379	378,121,800	
	サムティ・レジデンシャル投資法人	724	65,304,800	
	ザイマックス・リート投資法人	334	38,176,200	
	ジャパン・ホテル・リート投資法人	10,472	841,948,800	
	ジャパンエクセレント投資法人	3,239	481,639,300	
	ジャパンリアルエステイト投資法人	3,617	2,202,753,000	
	スターアジア不動産投資法人	1,123	119,487,200	
	スターツプロシード投資法人	570	96,159,000	
	タカラレーベン不動産投資法人	541	48,581,800	
	トーセイ・リート投資法人	696	76,003,200	
	ヒューリックリート投資法人	2,924	480,705,600	
	フロンティア不動産投資法人	1,230	543,660,000	
	プレミア投資法人	3,439	422,309,200	
	ヘルスケア&メディカル投資法人	479	53,791,700	
	マリモ地方創生リート投資法人	311	33,899,000	
	ユナイテッド・アーバン投資法人	7,977	1,415,119,800	
	ラサールロジポート投資法人	2,728	291,896,000	
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	559	51,260,300		
阪急阪神リート投資法人	1,500	218,250,000		
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	617	206,386,500		
三菱地所物流リート投資法人	383	97,090,500		

産業ファンド投資法人	4,214	476,603,400	
森トラスト・ホテルリート投資法人	849	118,605,300	
森トラスト総合リート投資法人	2,585	420,062,500	
森ヒルズリート投資法人	4,148	577,816,400	
星野リゾート・リート投資法人	550	295,350,000	
積水ハウス・リート投資法人	9,332	660,705,600	
大江戸温泉リート投資法人	584	50,749,600	
大和ハウスリート投資法人	4,528	1,121,585,600	
大和証券オフィス投資法人	835	602,035,000	
投資法人みらい	974	179,021,200	
東急リアル・エステート投資法人	2,425	391,395,000	
日本アコモデーションファンド投資法人	1,202	629,848,000	
日本ビルファンド投資法人	3,502	2,377,858,000	
日本プライムリアルティ投資法人	2,289	951,079,500	
日本プロロジスリート投資法人	4,851	1,160,359,200	
日本ヘルスケア投資法人	166	28,684,800	
日本リート投資法人	1,167	430,623,000	
日本リテールファンド投資法人	6,836	1,467,005,600	
日本ロジスティクスファンド投資法人	2,386	544,962,400	
日本賃貸住宅投資法人	4,068	366,120,000	
福岡リート投資法人	1,870	317,526,000	
平和不動産リート投資法人	2,252	256,953,200	
野村不動産マスターファンド投資法人	10,720	1,572,624,000	
投資証券 合計	192,693	31,472,460,490	
合計	192,693	31,472,460,490	

投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位:円)

科 目	注記 番号	平成30年11月12日現在
資産の部		
流動資産		
預金		14,071,421,661
コール・ローン		315,010,360
株式		324,188,852,487
投資信託受益証券		769,657,882
投資証券		7,506,660,447
派生商品評価勘定		231,402,417
未収入金		216,152,318
未収配当金		384,803,080
差入委託証拠金		2,179,103,470
流動資産合計		349,863,064,122
資産合計		349,863,064,122
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		15,095,019
未払金		14,030,089,521
未払解約金		99,795,000
流動負債合計		14,144,979,540
負債合計		14,144,979,540
純資産の部		
元本等		
元本	1	94,537,119,407
剰余金		
剰余金又は欠損金()		241,180,965,175
元本等合計		335,718,084,582
純資産合計		335,718,084,582
負債純資産合計		349,863,064,122

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項目		平成30年11月12日現在
1 .	1 本報告書における開示対象ファ ンドの期首における当該親投資 信託の元本額	89,251,976,018円
	同期中追加設定元本額	17,840,637,737円
	同期中一部解約元本額	12,555,494,348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	2,720,697,179円
	M I T O ラップ型ファンド (安定型)	2,913,395円
	M I T O ラップ型ファンド (中立型)	8,567,971円
	M I T O ラップ型ファンド (積極型)	16,971,755円
	グローバル8資産ラップファン ド(安定型)	20,140,771円
	グローバル8資産ラップファン ド(中立型)	23,048,530円
	グローバル8資産ラップファン ド(積極型)	20,870,949円
	たわらノーロード 先進国株式	8,051,172,132円
	たわらノーロード 先進国株式 <ラップ向け>	424,170円
	たわらノーロード 先進国株式 <為替ヘッジあり>	995,586,600円
	たわらノーロード バランス (8資産均等型)	51,785,996円
	たわらノーロード バランス (堅実型)	4,032,356円
	たわらノーロード バランス (標準型)	37,015,213円
	たわらノーロード バランス (積極型)	68,064,714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)	230,259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)	16,659,542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)	50,346,140円
	たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(成長型)	35,591,158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)	87,681,588円
	たわらノーロード 最適化バラ ンス(保守型)	16,688円
	たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定型)	70,914円

たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	818,607円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	611,066円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	2,265,459円
DIAM外国株式インデックスファンド<DC年金>	39,988,448,170円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	163,973,370円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	847,268,707円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	1,064,743,402円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	123,860,732円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	357,317,417円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	319,991,400円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	30,441,363円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	798,569,617円
マネックス資産設計ファンドエボリューション	213,664,955円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	202,174,693円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	131,242,647円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	229,321,951円
投資のソムリエ	1,605,577,084円
クルーズコントロール	312,816,573円
投資のソムリエ<DC年金>	141,994,003円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	145,968,090円
DIAM DC バランス・F(成長型)	87,368,398円
クルーズコントロール<DC年金>	209,742円
DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)	1,695,605円
DIAMコア資産設計ファンド(積極型)	4,809,870円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	17,837,126円
ダイナミック・ナビゲーション	1,324,764円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	330,369,754円
ワールドアセットバランス(基本コース)	595,681,660円

ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	1,450,991,635円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	1,657,234円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	1,210,777円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	101,888円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	2,371,748円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	5,289,055円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	93,812,225円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	13,989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)	91,075,475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)	2,860,923,249円
DIAM先進国株式パッシブファンド(適格機関投資家限定)	5,982,967,603円
外国株式パッシブ・ファンド2(適格機関投資家限定)	206,217,109円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	21,401,209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)	85,262,542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)	209,233,430円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	11,291,903円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	71,339,508円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	6,051,680円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	7,734,968円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	22,311,659円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	60,585,194円

D I A Mバランスファンド25 V A (適格機関投資家限定)	510,360,381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)	629,658,009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)	2,003,920,518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)	709,013,146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)	117,150,494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)	826,292,348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)	102,616,266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)	25,236,110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)	16,249,487円
D I A M世界アセットバランス ファンド2 V A (適格機関投資 家限定)	5,206,864,752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)	236,507,098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)	1,304,871,608円
D I A M世界アセットバランス ファンド3 V A (適格機関投資 家限定)	4,967,324,311円
D I A Mバランス30 V A (適 格機関投資家限定)	17,489,143円
D I A Mバランス50 V A (適 格機関投資家限定)	840,169円
D I A Mバランス70 V A (適 格機関投資家限定)	10,354,542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)	6,669,377,978円
D I A Mバランス20 V A (適 格機関投資家限定)	55,662,387円
D I A Mバランス40 V A (適 格機関投資家限定)	223,728円

D I A Mバランス60VA(適 格機関投資家限定)	253,632円
計	94,537,119,407円
2. 受益権の総数	94,537,119,407口

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成30年5月25日 至 平成30年11月12日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成30年11月12日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
株式	2,668,156,337
投資信託受益証券	38,589,778
投資証券	488,316,437
合計	3,195,062,552

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(平成30年2月16日から平成30年11月12日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	平成30年11月12日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買 建	7,185,086,580	-	7,184,340,480	746,100
アメリカ・ドル	4,917,194,450	-	4,916,688,210	506,240
イギリス・ポンド	451,741,155	-	451,719,700	21,455
オーストラリア・ドル	153,583,050	-	153,534,480	48,570
カナダ・ドル	248,927,730	-	248,889,390	38,340
シンガポール・ドル	74,367,000	-	74,349,000	18,000
スイス・フラン	433,788,481	-	433,824,100	35,619
スウェーデン・クローナ	155,446,400	-	155,496,000	49,600
デンマーク・クローネ	82,127,025	-	82,127,500	475
ノルウェー・クローネ	65,497,795	-	65,426,500	71,295
ユーロ	436,549,194	-	436,529,600	19,594
香港・ドル	165,864,300	-	165,756,000	108,300
合計	7,185,086,580	-	7,184,340,480	746,100

(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11月12日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引				
先物取引				
買 建	9,979,170,440	-	10,196,223,940	217,053,500
合計	9,979,170,440	-	10,196,223,940	217,053,500

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成30年11月12日現在
1口当たり純資産額	3.5512円
(1万口当たり純資産額)	(35,512円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

平成30年11月12日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	AMAZON.COM INC	33,435	1,712.430	57,255,097.050	
	ABBOTT LABORATORIES	142,085	72.790	10,342,367.150	
	AES CORP	55,631	15.520	863,393.120	
	ABIOMED INC	3,560	405.170	1,442,405.200	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	74,396	123.540	9,190,881.840	
	ADVANCED MICRO DEVICES	76,385	21.030	1,606,376.550	
	ADOBE INC	39,997	244.840	9,792,865.480	
	CHUBB LTD	37,075	131.170	4,863,127.750	
	AGCO CORP	5,610	55.780	312,925.800	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	17,682	159.900	2,827,351.800	
	ALLEGHANY CORP	1,325	628.990	833,411.750	
	RALPH LAUREN CORP	4,893	123.930	606,389.490	
	ALLSTATE CORP	28,558	93.720	2,676,455.760	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	60,042	150.320	9,025,513.440	
	AMGEN INC	53,734	193.160	10,379,259.440	
	HESS CORP	23,734	59.150	1,403,866.100	
	AMERICAN EXPRESS CO	59,108	108.280	6,400,214.240	
	AMERICAN ELECTRIC POWER	39,528	75.320	2,977,248.960	
	AFLAC INC	62,351	45.040	2,808,289.040	
	AMERICAN INTL GROUP	73,452	43.820	3,218,666.640	
	AMERCO	551	335.540	184,882.540	
	ANALOG DEVICES	30,662	87.590	2,685,684.580	
	ANADARKO PETROLEUM CORP	42,877	58.210	2,495,870.170	
	ALEXION PHARMACEUTICALS INC	17,964	123.440	2,217,476.160	
	JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	76,484	34.350	2,627,225.400	
	JONES LANG LASALLE INC	4,087	140.020	572,261.740	
	VALERO ENERGY CORP	35,375	87.580	3,098,142.500	
	APACHE CORP	30,595	37.080	1,134,462.600	
	ANSYS INC	6,519	165.860	1,081,241.340	
	APPLE INC	398,277	204.470	81,435,698.190	
	APPLIED MATERIALS INC	82,917	34.280	2,842,394.760	
	ALBEMARLE CORP	7,904	102.380	809,211.520	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	45,485	48.260	2,195,106.100		
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	9,600	88.470	849,312.000		
AMEREN CORP	22,239	67.320	1,497,129.480		

ARROW ELECTRONICS INC	8,346	74.330	620,358.180	
AUTOLIV INC	6,197	81.750	506,604.750	
AUTODESK INC	18,045	135.550	2,445,999.750	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	35,703	147.190	5,255,124.570	
AUTOZONE INC	2,231	793.870	1,771,123.970	
AVERY DENNISON CORP	6,262	92.000	576,104.000	
AVNET INC	10,288	43.660	449,174.080	
BALL CORP	27,803	48.680	1,353,450.040	
BERKSHIRE HATHAWAY INC- CL B	103,466	219.630	22,724,237.580	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	80,602	48.500	3,909,197.000	
BAXTER INTERNATIONAL INC	42,327	63.480	2,686,917.960	
BECTON DICKINSON & CO	21,205	243.260	5,158,328.300	
AMETEK INC	20,976	74.450	1,561,663.200	
VERIZON COMM INC	334,688	58.460	19,565,860.480	
WR BERKLEY CORP	8,134	78.410	637,786.940	
BEST BUY CO INC	19,210	67.790	1,302,245.900	
YUM! BRANDS INC	26,223	90.720	2,378,950.560	
FIRSTENERGY CORP	35,496	38.000	1,348,848.000	
H&R BLOCK INC	16,114	28.730	462,955.220	
BOEING CO	44,865	369.340	16,570,439.100	
ROBERT HALF INTL INC	10,827	62.840	680,368.680	
BORGWARNER INC	14,648	38.790	568,195.920	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	111,108	38.600	4,288,768.800	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	11,755	89.610	1,053,365.550	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	8,731	113.050	987,039.550	
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	2,142	608.030	1,302,400.260	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	132,989	53.390	7,100,282.710	
AFFILIATED MANAGERS GROUP INC	3,788	115.240	436,529.120	
INGREDION INC	5,305	104.750	555,698.750	
ONEOK INC	34,002	63.090	2,145,186.180	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	5,900	106.490	628,291.000	
UNITED RENTALS INC	6,332	126.670	802,074.440	
SEMPRA ENERGY	20,552	116.700	2,398,418.400	
FEDEX CORP	20,262	224.400	4,546,792.800	
VERISIGN INC	9,648	160.100	1,544,644.800	
AMPHENOL CORP	23,100	91.140	2,105,334.000	
BROWN-FORMAN CORP	19,683	48.920	962,892.360	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	127,092	6.210	789,241.320	
CSX CORP	67,600	70.660	4,776,616.000	
CABOT OIL & GAS CORP	38,255	25.610	979,710.550	
CAMPBELL SOUP CO	14,050	38.970	547,528.500	

SEAGATE TECHNOLOGY	20,613	43.030	886,977.390	
CONSTELLATION BRANDS INC	13,698	203.130	2,782,474.740	
CARDINAL HEALTH INC	26,919	55.310	1,488,889.890	
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	35,448	58.540	2,075,125.920	
CATERPILLAR INC	48,596	126.910	6,167,318.360	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	9,832	112.640	1,107,476.480	
CELGENE CORP	59,464	74.020	4,401,525.280	
CITRIX SYSTEMS INC	10,896	107.010	1,165,980.960	
CENTURYLINK INC	80,424	18.910	1,520,817.840	
CERNER CORP	22,947	57.570	1,321,058.790	
JPMORGAN CHASE & CO	275,151	111.290	30,621,554.790	
CHURCH & DWIGHT CO INC	18,822	65.550	1,233,782.100	
CIGNA CORP	19,268	217.650	4,193,680.200	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	14,286	81.320	1,161,737.520	
CINTAS CORP	7,944	179.220	1,423,723.680	
CISCO SYSTEMS INC	380,766	47.110	17,937,886.260	
CLOROX COMPANY	10,885	158.770	1,728,211.450	
COCA-COLA CO/THE	325,562	49.680	16,173,920.160	
COPART INC	15,900	50.270	799,293.000	
COGNEX CORP	15,291	45.060	689,012.460	
COLGATE-PALMOLIVE CO	67,691	63.800	4,318,685.800	
MARRIOTT INTERNATIONAL- CL A	24,763	117.040	2,898,261.520	
COMERICA INC	15,393	84.690	1,303,633.170	
COMCAST CORP-CL A	373,074	38.340	14,303,657.160	
CONAGRA BRANDS INC	40,573	34.390	1,395,305.470	
CONSOLIDATED EDISON INC	23,350	79.000	1,844,650.000	
CMS ENERGY CORP	23,616	50.140	1,184,106.240	
COOPER COS INC	3,794	267.800	1,016,033.200	
MOLSON COORS BREWING CO	16,200	64.500	1,044,900.000	
CORNING INC	68,691	33.560	2,305,269.960	
SEALED AIR CORP	13,870	35.100	486,837.000	
CUMMINS INC	13,193	143.070	1,887,522.510	
DR HORTON INC	32,152	34.400	1,106,028.800	
DANAHER CORP	51,071	104.390	5,331,301.690	
MOODY'S CORP	14,293	153.500	2,193,975.500	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	47,741	70.340	3,358,101.940	
TARGET CORP	40,408	86.940	3,513,071.520	
DEERE & CO	24,482	144.810	3,545,238.420	
MORGAN STANLEY	107,976	45.730	4,937,742.480	
REPUBLIC SERVICES INC	17,375	74.740	1,298,607.500	
COSTAR GROUP INC	2,786	365.010	1,016,917.860	
THE WALT DISNEY CO	120,445	118.000	14,212,510.000	
DOLLAR TREE INC	20,078	86.380	1,734,337.640	
DOVER CORP	12,635	86.420	1,091,916.700	

OMNICOM GROUP	19,325	75.570	1,460,390.250	
DTE ENERGY CO	14,643	118.140	1,729,924.020	
DUKE ENERGY CORP	56,007	85.580	4,793,079.060	
FLOWSERVE CORP	8,406	50.220	422,149.320	
DARDEN RESTAURANTS INC	9,436	112.440	1,060,983.840	
EBAY INC	78,355	29.630	2,321,658.650	
BANK OF AMERICA CORP	779,252	28.520	22,224,267.040	
CITIGROUP INC	205,990	65.760	13,545,902.400	
EASTMAN CHEMICAL CO	13,358	82.820	1,106,309.560	
E*TRADE FINANCIAL CORP	23,829	52.940	1,261,507.260	
EATON CORP PLC	35,649	73.430	2,617,706.070	
EATON VANCE CORP	9,184	44.180	405,749.120	
CADENCE DESIGN SYS INC	20,877	46.260	965,770.020	
DISH NETWORK CORP	16,150	31.730	512,439.500	
ECOLAB INC	20,640	159.330	3,288,571.200	
ELECTRONIC ARTS INC	25,240	88.890	2,243,583.600	
SALESFORCE.COM INC	57,341	136.920	7,851,129.720	
EMERSON ELECTRIC CO	51,077	68.490	3,498,263.730	
ATMOS ENERGY CORP	8,221	96.690	794,888.490	
ENERGY CORP	13,599	85.560	1,163,530.440	
EOG RESOURCES INC	46,971	105.510	4,955,910.210	
EQUIFAX INC	10,231	102.120	1,044,789.720	
EQT CORP	20,049	35.900	719,759.100	
ESTEE LAUDER COS INC/THE	18,295	140.230	2,565,507.850	
EXPEDITORS INTERNATIONAL	14,792	71.730	1,061,030.160	
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	44,474	98.480	4,379,799.520	
EXXON MOBIL CORP	342,659	80.870	27,710,833.330	
FMC CORP	10,614	83.570	887,011.980	
NEXTERA ENERGY INC	37,752	176.560	6,665,493.120	
ASSURANT INC	4,089	104.780	428,445.420	
FASTENAL CO	21,654	54.760	1,185,773.040	
FIFTH THIRD BANCORP	52,173	27.960	1,458,757.080	
M&T BANK CORP	10,399	166.720	1,733,721.280	
FISERV INC	33,307	80.240	2,672,553.680	
FLIR SYSTEMS INC	11,623	48.400	562,553.200	
MACY'S INC	24,741	37.780	934,714.980	
FORD MOTOR CO	304,939	9.380	2,860,327.820	
FRANKLIN RESOURCES INC	32,330	30.870	998,027.100	
FREEMPORT-MCMORAN INC	117,269	11.350	1,331,003.150	
FLEX LTD	35,913	8.220	295,204.860	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	16,478	78.050	1,286,107.900	
GAP INC/THE	18,295	27.480	502,746.600	
DENTSPLY SIRONA INC	17,477	36.060	630,220.620	
GENERAL DYNAMICS CORP	20,649	184.500	3,809,740.500	
GENERAL MILLS INC	48,902	45.310	2,215,749.620	
GENUINE PARTS CO	11,759	100.610	1,183,072.990	
GILEAD SCIENCES INC	105,995	71.180	7,544,724.100	
GARTNER INC	7,153	147.640	1,056,068.920	

GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	18,097	21.990	397,953.030	
MCKESSON CORP	16,848	130.810	2,203,886.880	
NVIDIA CORP	46,836	205.670	9,632,760.120	
GENERAL ELECTRIC CO	707,684	8.580	6,071,928.720	
WW GRAINGER INC	3,832	293.750	1,125,650.000	
HALLIBURTON CO	73,763	34.980	2,580,229.740	
MONSTER BEVERAGE CORP	32,522	56.840	1,848,550.480	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	29,090	222.650	6,476,888.500	
HARLEY-DAVIDSON INC	12,901	40.730	525,457.730	
HARRIS CORP	10,033	153.140	1,536,453.620	
HASBRO INC	9,136	97.320	889,115.520	
HENRY SCHEIN INC	11,426	85.430	976,123.180	
HELMERICH & PAYNE INC	10,055	62.590	629,342.450	
HERSHEY FOODS CORP	12,522	108.580	1,359,638.760	
HP INC	133,588	25.000	3,339,700.000	
F5 NETWORKS INC	4,874	183.240	893,111.760	
CROWN HOLDINGS INC NPR	10,472	45.790	479,512.880	
UNITED THERAPEUTICS CORP	3,447	114.390	394,302.330	
JUNIPER NETWORKS INC	27,740	29.120	807,788.800	
HOLLYFRONTIER CORP	12,551	64.700	812,049.700	
HOLOGIC INC	23,377	41.780	976,691.060	
UNUM GROUP	16,000	37.710	603,360.000	
HOME DEPOT INC	93,569	185.990	17,402,898.310	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	15,079	95.670	1,442,607.930	
HORMEL FOODS CORP	24,161	45.020	1,087,728.220	
CENTERPOINT ENERGY INC	44,790	28.130	1,259,942.700	
LENNOX INTERNATIONAL INC	3,569	211.750	755,735.750	
HUMANA INC	11,262	338.950	3,817,254.900	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	7,359	106.720	785,352.480	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	93,648	14.670	1,373,816.160	
RED HAT INC	14,824	173.750	2,575,670.000	
NEKTAR THERAPEUTICS	12,000	34.020	408,240.000	
BIOGEN INC	17,276	325.200	5,618,155.200	
IDEX CORP	5,924	135.530	802,879.720	
ILLINOIS TOOL WORKS	24,911	132.560	3,302,202.160	
INTUIT INC	19,317	222.170	4,291,657.890	
IDEXX LABORATORIES INC	7,402	207.170	1,533,472.340	
INGERSOLL-RAND PLC	20,370	102.860	2,095,258.200	
INTEL CORP	377,745	48.110	18,173,311.950	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	7,446	145.850	1,085,999.100	
INTERNATIONAL PAPER CO	32,983	46.220	1,524,474.260	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	29,157	23.840	695,102.880	

JACOBS ENGINEERING GROUP INC	9,631	77.250	743,994.750	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	5,919	141.500	837,538.500	
INCYTE CORP	15,601	66.030	1,030,134.030	
JOHNSON & JOHNSON	217,173	145.340	31,563,923.820	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	29,441	46.590	1,371,656.190	
KLA-TENCOR CORP	11,724	95.280	1,117,062.720	
DEVON ENERGY CORP	44,878	33.010	1,481,422.780	
KELLOGG CO	21,564	65.010	1,401,875.640	
EAST WEST BANCORP INC	11,000	54.000	594,000.000	
KEYCORP	88,511	18.890	1,671,972.790	
KIMBERLY-CLARK CORP	28,662	109.450	3,137,055.900	
BLACKROCK INC/NEW YORK	9,584	413.950	3,967,296.800	
KOHL'S CORP	14,910	81.970	1,222,172.700	
KROGER CO	66,610	31.390	2,090,887.900	
LAM RESEARCH CORP	13,737	147.850	2,031,015.450	
PACKAGING CORP OF AMERICA	7,057	96.000	677,472.000	
AKAMAI TECHNOLOGIES	12,622	70.940	895,404.680	
LEGGETT & PLATT INC	9,588	37.570	360,221.160	
LENNAR CORP	21,933	41.900	918,992.700	
JEFFERIES FINANCIAL GROUP INC	21,462	21.990	471,949.380	
ELI LILLY & CO	79,368	112.210	8,905,883.280	
L BRANDS INC	16,262	36.500	593,563.000	
LINCOLN NATIONAL CORP	18,890	65.080	1,229,361.200	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	55,869	109.510	6,118,214.190	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	25,175	67.270	1,693,522.250	
LOCKHEED MARTIN CORP	20,887	313.120	6,540,137.440	
LOEWS CORP	21,346	49.590	1,058,548.140	
LOWE'S COS INC	66,935	96.820	6,480,646.700	
DOMINION ENERGY INC	52,247	72.250	3,774,845.750	
SCANA CORP	10,902	40.180	438,042.360	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	40,298	25.540	1,029,210.920	
MCCORMICK & CO INC	9,307	150.400	1,399,772.800	
MCDONALD'S CORPORATION	63,614	185.940	11,828,387.160	
S&P GLOBAL INC	20,081	186.270	3,740,487.870	
EVEREST RE GROUP LTD	2,855	221.220	631,583.100	
MANPOWERGROUP INC	6,265	79.610	498,756.650	
MARKEL CORPORATION	1,258	1,121.990	1,411,463.420	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	17,378	153.180	2,661,962.040	
MARSH & MCLENNAN COS	41,255	87.760	3,620,538.800	
MASCO CORP	23,043	31.030	715,024.290	

MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	5,382	184.290	991,848.780	
MATTEL INC	24,003	13.550	325,240.650	
METLIFE INC	70,638	45.190	3,192,131.220	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	25,490	52.090	1,327,774.100	
MEDTRONIC PLC	109,722	94.360	10,353,367.920	
ACTIVISION BLIZZARD INC	59,081	55.010	3,250,045.810	
CVS HEALTH CORP	82,940	79.830	6,621,100.200	
MERCK & CO. INC.	217,964	74.860	16,316,785.040	
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	31,900	17.880	570,372.000	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	8,999	170.150	1,531,179.850	
MICROSOFT CORP	591,025	109.570	64,758,609.250	
MICRON TECH INC	94,810	39.110	3,708,019.100	
MIDDLEBY CORP	4,100	117.690	482,529.000	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	17,529	72.130	1,264,366.770	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	45,086	16.390	738,959.540	
3M CO	48,086	201.100	9,670,094.600	
MOHAWK INDUSTRIES INC	4,873	125.650	612,292.450	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	13,480	129.650	1,747,682.000	
KANSAS CITY SOUTHERN	8,856	102.420	907,031.520	
MYLAN NV	43,574	36.950	1,610,059.300	
ILLUMINA INC	12,036	329.250	3,962,853.000	
XCEL ENERGY INC	41,218	50.340	2,074,914.120	
NATIONAL OILWELL VARCO INC	33,468	35.260	1,180,081.680	
NETAPP INC	20,587	81.660	1,681,134.420	
NEWFIELD EXPLORATION CO	13,740	21.830	299,944.200	
NEWELL BRANDS INC	36,206	19.900	720,499.400	
NEWMONT MINING CORP	48,693	32.020	1,559,149.860	
NVR INC	307	2,315.050	710,720.350	
NIKE INC-CL B	104,293	76.360	7,963,813.480	
NOBLE ENERGY INC	36,582	26.520	970,154.640	
NORDSTROM INC	9,487	65.460	621,019.020	
NORFOLK SOUTHERN CORP	23,077	170.320	3,930,474.640	
EVERSOURCE ENERGY	27,088	65.140	1,764,512.320	
NISOURCE INC	31,548	26.160	825,295.680	
TAPESTRY INC	22,269	42.000	935,298.000	
NORTHERN TRUST CORP	17,867	97.940	1,749,893.980	
NORTHROP GRUMMAN CORP	13,299	285.730	3,799,923.270	
WELLS FARGO & CO	374,611	53.040	19,869,367.440	
NUCOR CORP	23,780	62.780	1,492,908.400	
CHENIERE ENERGY INC	15,927	62.350	993,048.450	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	39,049	90.400	3,530,029.600	

OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	61,379	73.550	4,514,425.450	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	4,917	134.990	663,745.830	
OGE ENERGY CORP	16,028	38.230	612,750.440	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	6,375	354.740	2,261,467.500	
ORACLE CORP	247,559	50.610	12,528,960.990	
PACCAR INC	26,537	58.360	1,548,699.320	
EXELON CORP	76,576	45.040	3,448,983.040	
PARKER HANNIFIN CORP	11,023	167.330	1,844,478.590	
PAYCHEX INC	26,670	69.020	1,840,763.400	
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	6,526	56.950	371,655.700	
ALIGN TECHNOLOGY INC	5,854	235.960	1,381,309.840	
PPL CORPORATION	57,297	31.690	1,815,741.930	
PEPSICO INC	114,458	117.480	13,446,525.840	
PENTAIR PLC	11,775	42.530	500,790.750	
PFIZER INC	473,775	44.280	20,978,757.000	
CONOCOPHILLIPS	95,634	66.730	6,381,656.820	
PVH CORP	6,862	121.410	833,115.420	
PG&E CORP	42,378	39.920	1,691,729.760	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	14,308	159.820	2,286,704.560	
ALTRIA GROUP INC	153,240	63.420	9,718,480.800	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	38,072	134.230	5,110,404.560	
POLARIS INDUSTRIES INC	3,845	90.960	349,741.200	
GARMIN LTD	7,795	66.110	515,327.450	
AETNA INC	26,607	209.360	5,570,441.520	
FLUOR CORP (NEW)	9,821	46.600	457,658.600	
PPG INDUSTRIES INC	20,578	107.710	2,216,456.380	
IPG PHOTONICS CORP	2,441	137.790	336,345.390	
COSTCO WHOLESALE CORP	35,482	237.740	8,435,490.680	
T ROWE PRICE GROUP INC	19,916	98.480	1,961,327.680	
QUEST DIAGNOSTICS	10,378	97.330	1,010,090.740	
PROCTER & GAMBLE CO	203,795	92.410	18,832,695.950	
PROGRESSIVE CORP	47,422	73.190	3,470,816.180	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	41,013	53.790	2,206,089.270	
PULTE GROUP INC	21,209	24.440	518,347.960	
NEW YORK COMMUNITY BANCORP INC	55,214	9.600	530,054.400	
GLOBAL PAYMENTS INC	13,406	112.170	1,503,751.020	
QUALCOMM INC	114,098	56.720	6,471,638.560	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	10,187	79.500	809,866.500	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	2,550	124.920	318,546.000	

REGENERON PHARMACEUTICALS	6,415	356.660	2,287,973.900	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA INC	4,642	148.760	690,543.920	
RESMED INC	12,271	106.940	1,312,260.740	
US BANCORP	124,839	53.150	6,635,192.850	
SEATTLE GENETICS INC /WA	7,317	58.060	424,825.020	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	31,422	28.350	890,813.700	
ROSS STORES INC	30,914	102.760	3,176,722.640	
ROLLINS INC	8,252	61.370	506,425.240	
ROPER TECHNOLOGIES INC	8,632	296.810	2,562,063.920	
ROCKWELL AUTOMATION INC	10,439	169.270	1,767,009.530	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	14,121	107.170	1,513,347.570	
RAYTHEON COMPANY	22,940	188.020	4,313,178.800	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	3,848	208.260	801,384.480	
ACCENTURE PLC-CL A	51,767	165.150	8,549,320.050	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	118,933	44.300	5,268,731.900	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	11,016	159.930	1,761,788.880	
ROCKWELL COLLINS INC	13,469	133.220	1,794,340.180	
THE TRAVELERS COMPANIES INC	21,930	131.030	2,873,487.900	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	26,890	107.470	2,889,868.300	
BOOKING HOLDINGS INC	3,914	1,937.640	7,583,922.960	
SCHLUMBERGER LTD	111,419	50.400	5,615,517.600	
SCHWAB (CHARLES) CORP	96,501	47.640	4,597,307.640	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	16,874	117.620	1,984,719.880	
BUNGE LTD	10,334	63.270	653,832.180	
SEI INVESTMENTS CO	12,294	54.770	673,342.380	
ANTHEM INC	20,799	287.060	5,970,560.940	
AMERISOURCEBERGEN CORP	12,257	88.860	1,089,157.020	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	21,442	49.300	1,057,090.600	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	6,882	414.840	2,854,928.880	
CENTENE CORP	17,128	142.310	2,437,485.680	
SVB FINANCIAL GROUP	4,107	247.360	1,015,907.520	
IAC INTERACTIVE CORP	5,766	186.550	1,075,647.300	
SMITH (A.O.) CORP	15,481	45.760	708,410.560	
ACUITY BRANDS INC	3,087	126.940	391,863.780	
SNAP-ON INC	4,935	161.490	796,953.150	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	34,477	95.850	3,304,620.450	
ADVANCE AUTO PARTS	6,330	171.180	1,083,569.400	
EDISON INTERNATIONAL	26,721	61.000	1,629,981.000	
SOUTHERN CO	81,919	46.810	3,834,628.390	
BB&T CORP	63,542	50.760	3,225,391.920	

SOUTHWEST AIRLINES	11,352	52.490	595,866.480	
AT&T INC	588,509	30.690	18,061,341.210	
CHEVRON CORP	154,746	119.510	18,493,694.460	
STANLEY BLACK & DECKER INC	13,077	125.740	1,644,301.980	
STATE STREET CORP	30,346	72.250	2,192,498.500	
STARBUCKS CORP	112,039	68.600	7,685,875.400	
STEEL DYNAMICS INC	19,030	40.280	766,528.400	
STRYKER CORP	27,381	171.250	4,688,996.250	
NETFLIX INC	35,335	303.470	10,723,112.450	
STERICYCLE INC	6,853	47.660	326,613.980	
SUNTRUST BANKS INC	38,038	63.530	2,416,554.140	
SYMANTEC CORP	47,004	22.250	1,045,839.000	
KNIGHT SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	9,793	33.480	327,869.640	
SYNOPSIS INC	13,239	93.350	1,235,860.650	
SYSCO CORP	39,953	66.810	2,669,259.930	
INTUITIVE SURGICAL INC	9,036	532.560	4,812,212.160	
TELEFLEX INC	3,905	265.880	1,038,261.400	
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	80,553	23.450	1,888,967.850	
TEXAS INSTRUMENTS INC	79,219	96.100	7,612,945.900	
TEXTRON INC	19,076	56.880	1,085,042.880	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	32,661	243.450	7,951,320.450	
TIFFANY & CO	8,733	110.360	963,773.880	
TOLL BROTHERS INC	9,526	32.380	308,451.880	
TORCHMARK CORP	7,699	86.920	669,197.080	
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	14,384	91.970	1,322,896.480	
DAVITA INC	10,878	69.700	758,196.600	
TRACTOR SUPPLY CO	9,276	97.130	900,977.880	
TRIMBLE INC	20,073	36.810	738,887.130	
TYSON FOODS INC	24,607	62.080	1,527,602.560	
UGI CORP	14,725	56.030	825,041.750	
MARATHON OIL CORP	64,347	17.840	1,147,950.480	
UNION PACIFIC CORP	62,785	150.250	9,433,446.250	
UNITED TECHNOLOGIES CORP	61,400	130.710	8,025,594.000	
UNITEDHEALTH GROUP INC	77,838	276.550	21,526,098.900	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	6,351	131.490	835,092.990	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	6,848	119.370	817,445.760	
VF CORP	27,791	84.160	2,338,890.560	
CBS CORP	27,376	57.550	1,575,488.800	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	20,994	180.550	3,790,466.700	
VULCAN MATERIALS CO	10,136	105.760	1,071,983.360	

WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	68,404	82.390	5,635,805.560	
WALMART INC	119,677	105.560	12,633,104.120	
WASTE MANAGEMENT INC	35,106	90.460	3,175,688.760	
WATERS CORP	5,963	199.440	1,189,260.720	
ALLERGAN PLC	26,766	165.520	4,430,308.320	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	8,855	112.880	999,552.400	
VAIL RESORTS INC	3,098	265.370	822,116.260	
WESTERN DIGITAL CORP	22,254	45.730	1,017,675.420	
WABTEC CORP	7,530	87.050	655,486.500	
WHIRLPOOL CORP	5,553	116.360	646,147.080	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	13,529	76.660	1,037,133.140	
WYNN RESORTS LTD	7,179	98.320	705,839.280	
NASDAQ INC	9,132	90.400	825,532.800	
CME GROUP INC	28,996	189.740	5,501,701.040	
WILLIAMS COS INC	99,653	25.330	2,524,210.490	
LKQ CORP	22,948	27.730	636,348.040	
ALLIANT ENERGY CORP	19,910	44.610	888,185.100	
WEC ENERGY GROUP INC	27,657	70.000	1,935,990.000	
TD AMERITRADE HOLDING CORP	21,581	52.500	1,133,002.500	
CARMAX INC	13,513	65.720	888,074.360	
XEROX CORP	17,455	28.430	496,245.650	
XILINX INC	21,093	85.640	1,806,404.520	
CIMAREX ENERGY CO	7,003	90.320	632,510.960	
TJX COMPANIES INC	102,627	55.640	5,710,166.280	
ZIONS BANCORP NA	16,584	50.160	831,853.440	
DAIRY FARM INTERNATIONAL HLDNGS	27,400	8.720	238,928.000	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	76,400	6.170	471,388.000	
JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	15,700	60.300	946,710.000	
JARDINE STRATEGIC HOLDINGS LTD	17,100	35.210	602,091.000	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	6,051	72.410	438,152.910	
SIGNATURE BANK	4,171	115.740	482,751.540	
CBRE GROUP INC	24,276	42.990	1,043,625.240	
LIBERTY GLOBAL PLC	19,835	25.120	498,255.200	
REGIONS FINANCIAL CORP	92,992	17.240	1,603,182.080	
DOMINO'S PIZZA INC	3,256	274.350	893,283.600	
WESTLAKE CHEMICAL CORP	3,000	75.900	227,700.000	
T-MOBILE US INC	27,739	68.680	1,905,114.520	
LAS VEGAS SANDS CORP	33,332	52.090	1,736,263.880	
MOSAIC CO/THE	31,433	36.630	1,151,390.790	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX NEWS	35,913	47.710	1,713,409.230	

TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC	85,706	48.160	4,127,600.960	
CELANESE CORP	11,880	102.760	1,220,788.800	
DISCOVERY INC-A	10,423	32.980	343,750.540	
EXPEDIA GROUP INC	10,373	124.040	1,286,666.920	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	18,475	52.220	964,764.500	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	12,434	127.660	1,587,324.440	
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	41,818	24.510	1,024,959.180	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	47,227	79.080	3,734,711.160	
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	14,696	22.750	334,334.000	
VIACOM INC-CLASS B	30,282	32.100	972,052.200	
LIVE NATION	13,682	56.400	771,664.800	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,807	490.760	886,803.320	
UNITED CONTINENTAL HOLIDINGS INC	6,191	92.350	571,738.850	
TRANSDIGM GROUP INC	3,812	357.460	1,362,637.520	
MASTERCARD INC	75,044	205.620	15,430,547.280	
QURATE RETAIL INC	35,733	24.520	876,173.160	
HANESBRANDS INC	27,619	16.560	457,370.640	
WESTERN UNION CO	35,222	18.820	662,878.040	
OWENS CORNING	7,333	47.370	347,364.210	
LEIDOS HOLDINGS INC	13,182	65.230	859,861.860	
AERCAP HOLDINGS NV	11,586	52.250	605,368.500	
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLDINGS INC	9,175	89.240	818,777.000	
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT-ADR	18,099	15.600	282,344.400	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	10,519	107.210	1,127,741.990	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	29,653	15.700	465,552.100	
DELTA AIR LINES INC	13,898	56.650	787,321.700	
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	6,354	50.730	322,338.420	
DISCOVER FINANCIAL	29,057	70.560	2,050,261.920	
TE CONNECTIVITY LTD	29,105	79.130	2,303,078.650	
CONCHO RESOURCES INC/MIDLAND TX	16,507	136.520	2,253,535.640	
WABCO HOLDING INC	4,076	111.170	453,128.920	
LULULEMON ATHLETICA INC	7,883	137.560	1,084,385.480	
VMWARE INC	5,491	150.820	828,152.620	
MERCADOLIBRE INC	3,215	325.690	1,047,093.350	
ULTA BEAUTY INC	4,332	308.120	1,334,775.840	
INVESCO LTD	29,824	20.880	622,725.120	
MSCI INC	7,537	149.790	1,128,967.230	

PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	125,890	89.180	11,226,870.200	
VISA INC	144,332	143.930	20,773,704.760	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	13,492	89.610	1,209,018.120	
DISCOVERY INC-C	23,054	29.710	684,934.340	
MARATHON PETROLEUM CORP	56,609	67.180	3,802,992.620	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	11,624	43.490	505,527.760	
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	164,092	17.530	2,876,532.760	
XYLEM INC	15,111	70.880	1,071,067.680	
ALKERMES PLC	12,053	37.670	454,036.510	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	27,218	96.060	2,614,561.080	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,479	223.650	778,078.350	
SPLUNK INC	12,240	98.540	1,206,129.600	
HCA HEALTHCARE INC	22,931	143.950	3,300,917.450	
VERISK ANALYTICS INC	11,859	123.380	1,463,163.420	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	5,474	145.570	796,850.180	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	7,443	199.820	1,487,260.260	
FIRST REPUBLIC BANK/SAN FRANCISCO CA	13,676	92.900	1,270,500.400	
CIT GROUP INC	9,287	46.710	433,795.770	
NXP SEMICONDUCTOR NV	28,555	83.690	2,389,767.950	
TARGA RESOURCES CORP	16,445	50.550	831,294.750	
LEAR CORP	5,132	138.010	708,267.320	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	8,640	108.900	940,896.000	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	17,000	49.940	848,980.000	
DOLLAR GENERAL CORP	22,291	116.100	2,587,985.100	
FORTINET INC	11,399	74.730	851,847.270	
AON PLC	19,838	164.540	3,264,144.520	
TESLA INC	10,430	350.510	3,655,819.300	
GENERAL MOTORS CO	103,588	35.700	3,698,091.600	
WORLDPAY INC	24,088	90.110	2,170,569.680	
XPO LOGISTICS INC	9,000	81.030	729,270.000	
TRIPADVISOR INC	9,263	63.300	586,347.900	
ALLY FINANCIAL INC	31,409	25.760	809,095.840	
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	12,138	47.780	579,953.640	
VOYA FINANCIAL INC	13,525	45.630	617,145.750	
APTIV PLC	22,571	75.620	1,706,819.020	
PHILLIPS 66	35,506	99.740	3,541,368.440	
FACEBOOK INC	194,641	144.960	28,215,159.360	
IQVIA HOLDINGS INC	13,426	124.170	1,667,106.420	
DIAMONDBACK ENERGY INC	8,609	113.850	980,134.650	

SERVICENOW INC	14,659	177.590	2,603,291.810	
PALO ALTO NETWORKS INC	7,006	183.090	1,282,728.540	
WORKDAY INC	12,376	139.930	1,731,773.680	
ABBVIE INC	123,298	88.790	10,947,629.420	
ZOETIS INC	39,459	95.270	3,759,258.930	
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDINGS LTD	16,470	48.750	802,912.500	
COTY INC	38,541	8.490	327,213.090	
NEWS CORP/NEW-CL A	30,263	14.240	430,945.120	
HD SUPPLY HOLDINGS INC	12,891	38.750	499,526.250	
CDW CORP	13,040	91.080	1,187,683.200	
SPRINT CORP	63,882	6.190	395,429.580	
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	10,199	36.220	369,407.780	
ARCONIC INC	36,761	20.770	763,525.970	
LIBERTY MEDIA CORP- LIBERTY-C	17,852	32.660	583,046.320	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	5,006	40.630	203,393.780	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-C	17,931	40.740	730,508.940	
DELL TECHNOLOGIES INC	16,584	98.050	1,626,061.200	
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	15,410	20.740	319,603.400	
BAKER HUGHES A GE CO	31,904	25.510	813,871.040	
TECHNIPFMC LTD	32,556	25.650	835,061.400	
BROADCOM INC	33,381	238.990	7,977,725.190	
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	9,985	41.570	415,076.450	
ANTERO RESOURCES CORP	13,163	15.700	206,659.100	
VEEVA SYSTEMS INC	9,087	93.600	850,543.200	
TWITTER INC	56,256	34.080	1,917,204.480	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING PLC	17,181	46.760	803,383.560	
EVERGY INC	21,000	58.350	1,225,350.000	
PLAINS GP HOLDINGS LP	7,837	22.050	172,805.850	
COMMSCOPE HOLDING CO INC	12,920	19.390	250,518.800	
ALLEGION PLC	7,325	89.390	654,781.750	
PERRIGO CO PLC	10,553	64.070	676,130.710	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	22,612	71.160	1,609,069.920	
ARAMARK	21,772	35.600	775,083.200	
SABRE CORP	17,624	25.570	450,645.680	
PARSLEY ENERGY INC	17,454	24.470	427,099.380	
ARISTA NETWORKS INC	4,441	244.430	1,085,513.630	
IHS MARKIT LTD	30,253	52.910	1,600,686.230	
FNF GROUP	20,660	33.660	695,415.600	
SYNCHRONY FINANCIAL	60,568	27.620	1,672,888.160	
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	40,320	38.060	1,534,579.200	
CDK GLOBAL INC	8,309	50.770	421,847.930	

KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	14,300	59.190	846,417.000	
QORVO INC	10,887	68.150	741,949.050	
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	16,089	23.260	374,230.140	
LIBERTY BROADBAND CORP-C W/I	7,818	82.170	642,405.060	
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	14,710	25.340	372,751.400	
GODADDY INC	14,641	64.460	943,758.860	
NIELSEN HOLDINGS PLC	26,840	26.460	710,186.400	
TRANSUNION	13,841	66.440	919,596.040	
SQUARE INC	23,565	73.270	1,726,607.550	
DOWDUPONT INC	188,426	58.680	11,056,837.680	
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS PLC	17,100	47.950	819,945.000	
WESTROCK CO	24,042	45.810	1,101,364.020	
KRAFT HEINZ CO	50,303	53.990	2,715,858.970	
FORTIVE CORP	23,630	75.220	1,777,448.600	
WASTE CONNECTIONS INC	23,491	76.960	1,807,867.360	
ALPHABET INC-CL A	24,209	1,077.020	26,073,577.180	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	125,608	15.720	1,974,557.760	
PAYPAL HOLDINGS INC	91,645	86.760	7,951,120.200	
FIRST DATA CORP	44,487	18.650	829,682.550	
DXC TECHNOLOGY CO	23,734	62.000	1,471,508.000	
ZILLOW GROUP INC-C	8,134	30.250	246,053.500	
ALPHABET INC-CL C	25,453	1,066.150	27,136,715.950	
L3 TECHNOLOGIES INC	6,752	195.380	1,319,205.760	
CHEMOURS CO	12,723	32.090	408,281.070	
LINDE PLC	23,235	161.520	3,752,917.200	
ATHENE HOLDING LTD	11,784	47.490	559,622.160	
CHARTER COMMUNICATIONS INC	13,415	321.110	4,307,690.650	
VISTRA ENERGY CORP	30,000	24.080	722,400.000	
アメリカ・ドル 小計	24,756,189		1,943,429,215.910 (221,434,324,862)	
イギリス・ポンド				
ANTOFAGASTA PLC	25,905	7.782	201,592.710	
ASHTED GROUP	42,154	19.000	800,926.000	
SEVERN TRENT PLC	25,530	19.805	505,621.650	
BHP BILLITON PLC	173,514	15.856	2,751,237.980	
BARCLAYS PLC	1,386,487	1.768	2,451,309.010	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	103,764	5.440	564,476.160	
BT GROUP PLC	696,796	2.541	1,770,558.630	
BUNZL PLC	26,515	22.320	591,814.800	
EASYJET PLC	13,628	12.540	170,895.120	
AVIVA PLC	303,368	4.337	1,315,707.010	
CRODA INTERNATIONAL	10,645	48.020	511,172.900	
DIAGEO PLC	198,910	27.465	5,463,063.150	
SCHRODERS PLC	10,932	26.070	284,997.240	

DCC PLC	9,753	63.600	620,290.800	
NATIONAL GRID PLC	273,118	8.557	2,337,070.720	
KINGFISHER PLC	165,680	2.551	422,649.680	
BAE SYSTEMS PLC	268,920	5.292	1,423,124.640	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	186,589	33.145	6,184,492.400	
NEXT PLC	12,064	54.240	654,351.360	
IMPERIAL BRANDS PLC	78,173	27.500	2,149,757.500	
JOHNSON MATTHEY PLC	15,017	29.470	442,550.990	
ANGLO AMERICAN PLC	88,044	16.878	1,486,006.630	
COMPASS GROUP PLC	129,886	15.375	1,996,997.250	
HSBC HOLDINGS PLC	1,621,805	6.338	10,279,000.090	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	491,194	2.616	1,284,963.500	
CENTRICA PLC	471,340	1.543	727,277.620	
UNILEVER PLC	99,387	41.465	4,121,081.950	
MEGGITT PLC	62,181	5.072	315,382.030	
MORRISON <WM.> SUPERMARKETS	155,682	2.513	391,228.860	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	54,487	7.720	420,639.640	
RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	80,864	5.458	441,355.710	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	30,240	26.380	797,731.200	
PEARSON PLC	65,009	9.218	599,252.960	
PERSIMMON PLC	23,150	23.860	552,359.000	
PRUDENTIAL PLC	208,962	16.040	3,351,750.480	
RIO TINTO PLC	96,815	38.495	3,726,893.420	
VODAFONE GROUP PLC	2,120,291	1.439	3,051,098.740	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	53,007	62.550	3,315,587.850	
RELX PLC	161,945	15.585	2,523,912.820	
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	138,993	8.144	1,131,958.990	
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	389,955	2.519	982,296.640	
ST JAMES'S PLACE PLC	40,884	10.625	434,392.500	
TRAVIS PERKINS PLC	20,357	10.705	217,921.680	
SSE PLC	84,479	11.525	973,620.470	
BP PLC	1,619,051	5.239	8,482,208.180	
SHIRE PLC	72,222	46.125	3,331,239.750	
SAGE GROUP PLC(THE)	85,271	5.514	470,184.290	
SMITHS GROUP PLC	31,720	13.550	429,806.000	
STANDARD CHARTERED PLC	234,243	5.693	1,333,545.390	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	5,810,675	0.599	3,480,594.320	
TAYLOR WIMPLEY PLC	253,022	1.680	425,076.960	
TESCO PLC	804,334	2.187	1,759,078.450	
3I GROUP PLC	89,718	8.652	776,240.130	
SMITH & NEPHEW PLC	66,155	13.950	922,862.250	

GLAXOSMITHKLINE PLC	403,297	15.704	6,333,376.080	
WEIR GROUP	18,336	15.505	284,299.680	
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	26,266	42.130	1,106,586.580	
BABCOCK INT'L GROUP	21,302	6.004	127,897.200	
WPP PLC	107,494	8.570	921,223.580	
FERGUSON PLC	17,278	51.800	895,000.400	
ASTRAZENECA PLC	103,035	61.720	6,359,320.200	
WHITBREAD PLC	15,639	45.930	718,299.270	
CARNIVAL PLC	13,153	43.710	574,917.630	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	120,290	3.127	376,146.830	
JOHN WOOD GROUP PLC	48,988	6.650	325,770.200	
INTERTEK GROUP PLC	14,335	46.090	660,700.150	
BURBERRY GROUP PLC	29,893	17.735	530,152.350	
INVESTEC PLC	50,655	4.971	251,806.000	
INTERCONTINENTAL HOTELS	15,922	40.590	646,273.980	
ITV PLC	247,210	1.506	372,298.260	
SAINSBURY (J) PLC	137,215	3.220	441,832.300	
RANDGOLD RESOURCES LTD NPR	6,998	61.960	433,596.080	
G4S PLC	122,250	1.831	223,839.750	
ADMIRAL GROUP PLC	15,893	20.540	326,442.220	
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	10,726	36.400	390,426.400	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	370,576	24.180	8,960,527.680	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	305,905	24.625	7,532,910.620	
TUI AG-DI	45,043	12.835	578,126.900	
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	214,715	2.701	579,945.210	
EXPERIAN PLC	71,068	18.150	1,289,884.200	
MONDI PLC	28,318	17.505	495,706.590	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	21,290	19.160	407,916.400	
FRESNILLO PLC NPR	15,639	8.610	134,651.790	
INFORMA PLC	102,475	7.106	728,187.350	
GLENCORE PLC	929,853	3.039	2,825,823.260	
GVC HOLDINGS PLC	49,618	8.380	415,798.840	
NMC HEALTH PLC	8,149	35.300	287,659.700	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP PLC	112,694	3.252	366,480.880	
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	30,616	3.581	109,635.890	
COCA-COLA HBC AG	13,406	23.720	317,990.320	
CONVATEC GROUP PLC	118,400	1.565	185,296.000	
ROYAL MAIL PLC	55,060	3.458	190,397.480	
MERLIN ENTERTAINMENTS PLC	50,037	3.302	165,222.170	

	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC-C	5,380,436	0.001	5,380.430	
	MICRO FOCUS INTERNATIONAL PLC	32,342	12.845	415,432.990	
	AUTO TRADER GROUP PLC	76,348	4.470	341,275.560	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	417,620	1.706	712,459.720	
イギリス・ボンド	小計	29,778,613		145,498,121.320 (21,444,968,102)	
イスラエル・シュケル	BANK HAPOALIM BM	78,428	26.420	2,072,067.760	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	103,061	24.680	2,543,545.480	
	BEZEQ ISRAELI TELECOMMUNICATION CORP LTD	188,230	4.427	833,294.210	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,760	459.600	808,896.000	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	49,411	23.620	1,167,087.820	
	NICE LTD	4,035	418.200	1,687,437.000	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	10,444	66.770	697,345.880	
	AZRIELI GROUP	4,428	189.900	840,877.200	
イスラエル・シュケル	小計	439,797		10,650,551.350 (329,847,575)	
オーストラリア・ドル	RAMSAY HEALTH CARE LTD	11,115	56.680	629,998.200	
	AUST AND NZ BANKING GROUP LT	239,374	27.130	6,494,216.620	
	AMCOR LTD	110,142	13.650	1,503,438.300	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	270,531	27.700	7,493,708.700	
	BANK OF QUEENSLAND LTD	30,569	9.920	303,244.480	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	114,125	4.250	485,031.250	
	TELSTRA CORP LTD	272,919	3.040	829,673.760	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD	39,014	10.550	411,597.700	
	AMP LTD	200,498	2.670	535,329.660	
	ASX LTD	15,573	61.180	952,756.140	
	BHP BILLITON LTD	255,718	33.410	8,543,538.380	
	CALTEX AUSTRALIA LTD	20,946	27.110	567,846.060	
	HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	22,182	3.260	72,313.320	
	COMPUTERSHARE LT	38,040	20.430	777,157.200	
	CSL LIMITED	35,919	190.580	6,845,443.020	
	REA GROUP LTD	4,119	80.500	331,579.500	
	TRANSURBAN GROUP	223,354	11.450	2,557,403.300	
	COCA-COLA AMATIL LTD	48,601	10.180	494,758.180	
	COCHLEAR LTD	6,524	176.130	1,149,072.120	
	ORIGIN ENERGY LTD	121,721	7.060	859,350.260	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	138,412	70.950	9,820,331.400		
BORAL LIMITED	86,101	5.550	477,860.550		

	RIO TINTO LIMITED	36,396	81.230	2,956,447.080	
	APA GROUP	116,193	8.880	1,031,793.840	
	ARISTOCRAT LEISU	43,933	27.130	1,191,902.290	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	167,355	7.220	1,208,303.100	
	TPG TELECOM LTD	28,719	7.480	214,818.120	
	FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	3,275	45.620	149,405.500	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	28,489	16.900	481,464.100	
	ORICA LTD	25,308	18.470	467,438.760	
	CIMIC GROUP LTD	8,709	46.580	405,665.220	
	BLUESCOPE STEEL LTD	36,941	13.730	507,199.930	
	SYDNEY AIRPORT	85,130	6.570	559,304.100	
	MACQUARIE GROUP LTD	28,250	123.640	3,492,830.000	
	SUNCORP GROUP LTD	124,185	14.080	1,748,524.800	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	217,098	24.900	5,405,740.200	
	NEWCREST MINING LTD	59,818	20.880	1,248,999.840	
	OIL SEARCH LTD	138,806	7.700	1,068,806.200	
	INCITEC PIVOT LTD	136,426	4.240	578,446.240	
	QBE INSURANCE GROUP LIMITED	129,436	11.490	1,487,219.640	
	CHALLENGER FINANCIAL SERVICES	45,707	9.840	449,756.880	
	SANTOS LTD	133,862	6.420	859,394.040	
	SONIC HEALTHCARE	43,041	22.490	967,992.090	
	TABCORP HOLDINGS LTD	126,348	4.630	584,991.240	
	WESFARMERS LTD	96,821	47.420	4,591,251.820	
	ALUMINA LIMITED	184,613	2.490	459,686.370	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	79,115	33.770	2,671,713.550	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	99,142	29.420	2,916,757.640	
	SEEK LTD	25,899	17.810	461,261.190	
	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES LTD	4,581	49.120	225,018.720	
	AUSNET SERVICES	165,066	1.710	282,262.860	
	AGL ENERGY LTD	46,315	17.900	829,038.500	
	BRAMBLES LTD	115,255	10.560	1,217,092.800	
	CROWN RESORTS LTD	32,861	11.770	386,773.970	
	AURIZON HOLDINGS LTD	139,184	4.270	594,315.680	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	50,789	15.340	779,103.260	
	HEALTHSCOPE LTD	149,047	2.080	310,017.760	
	MEDIBANK PVT LTD	177,176	2.820	499,636.320	
	SOUTH32 LTD(AUD)	367,057	3.540	1,299,381.780	
オーストラリア・ドル	小計	5,801,843		96,725,403.530 (7,959,533,457)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	20,281	45.250	917,715.250	

ALIMENTATION COUCHE TARD INC	36,030	66.660	2,401,759.800	
BARRICK GOLD CORP	96,442	17.090	1,648,193.780	
ATCO LTD	7,193	39.520	284,267.360	
BANK OF MONTREAL	51,533	98.870	5,095,067.710	
BANK OF NOVA SCOTIA	96,922	70.790	6,861,108.380	
NATIONAL BANK OF CANADA	26,741	60.450	1,616,493.450	
BCE INC	11,568	54.100	625,828.800	
BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT	70,084	57.180	4,007,403.120	
BAUSCH HEALTH COS INC	25,819	35.950	928,193.050	
BOMBARDIER INC 'B'	151,615	2.650	401,779.750	
SAPUTO INC	18,601	38.840	722,462.840	
BLACKBERRY LTD	39,652	12.280	486,926.560	
CGI GROUP INC	19,367	81.680	1,581,896.560	
CCL INDUSTRIES INC	11,340	52.770	598,411.800	
CAE INC	23,000	24.380	560,740.000	
CAMECO CORP	32,627	15.770	514,527.790	
ROGERS COMM-CL B	30,822	67.540	2,081,717.880	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	35,771	115.230	4,121,892.330	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	101,994	37.160	3,790,097.040	
CANADIAN TIRE CORP-CL A	4,862	162.640	790,755.680	
CANADIAN UTILITIES LTD	9,119	31.430	286,610.170	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	58,464	113.170	6,616,370.880	
FIRST CAPITAL REALTY INC	11,417	19.620	224,001.540	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	22,472	41.780	938,880.160	
OPEN TEXT CORP	19,756	43.580	860,966.480	
EMPIRE CO LTD	15,093	24.310	366,910.830	
KINROSS GOLD CORP	99,741	3.420	341,114.220	
FINNING INTERNATIONAL INC	9,892	27.700	274,008.400	
FORTIS INC	33,302	45.600	1,518,571.200	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	55,296	11.970	661,893.120	
TELUS CORP	15,945	45.880	731,556.600	
GREAT WEST LIFECO INC	19,248	30.540	587,833.920	
IMPERIAL OIL LTD	21,542	40.880	880,636.960	
ENBRIDGE INC	135,898	43.490	5,910,204.020	
IGM FINANCIAL INC	8,426	34.210	288,253.460	
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	87,995	2.370	208,548.150	
MANULIFE FINANCIAL CORP	163,105	22.330	3,642,134.650	
LINAMAR CORP	3,827	48.210	184,499.670	
LOBLAW CO LTD	15,354	58.330	895,598.820	
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANCE AND FINANCIAL SERVICES INC	13,994	48.570	679,688.580	

MAGNA INTERNATIONAL INC	28,590	65.360	1,868,642.400	
SUN LIFE FINANCIAL INC	51,387	48.450	2,489,700.150	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,419	626.210	1,514,801.990	
METRO INC	19,226	43.630	838,830.380	
HUSKY ENERGY INC	28,749	18.260	524,956.740	
CRESCENT POINT ENERGY CORP	39,992	5.640	225,554.880	
EMERA INC	6,509	43.080	280,407.720	
METHANEX CORP	5,281	85.130	449,571.530	
ONEX CORP	6,646	86.280	573,416.880	
GOLDCORP INC	66,602	12.160	809,880.320	
POWER CORP OF CANADA	25,052	26.890	673,648.280	
POWER FINANCIAL CORP	17,484	28.450	497,419.800	
ROYAL BANK OF CANADA	115,983	95.950	11,128,568.850	
SNC-LAVALIN GROUP INC	13,134	46.570	611,650.380	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	11,916	275.650	3,284,645.400	
SHAW COMM INC-B	35,748	24.640	880,830.720	
SUNCOR ENERGY INC	130,238	44.410	5,783,869.580	
LUNDIN MINING CORP	35,268	5.340	188,331.120	
ENCANA CORP	87,517	11.670	1,021,323.390	
TECK RESOURCES LTD-CL B	41,016	27.520	1,128,760.320	
THOMSON REUTERS CORP	17,373	63.500	1,103,185.500	
TORONTO DOMINION BANK (THE) C\$	148,499	73.240	10,876,066.760	
TRANSCANADA CORP	74,445	51.320	3,820,517.400	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	5,696	65.370	372,347.520	
WESTON (GEORGE) LTD	9,372	93.770	878,812.440	
INTACT FINANCIAL CORP	10,785	105.040	1,132,856.400	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	33,943	21.540	731,132.220	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,729	893.660	1,545,138.140	
FRANCO-NEVADA CORP NPR	14,687	85.690	1,258,529.030	
CI FINANCIAL CORP	20,695	20.120	416,383.400	
TOURMALINE OIL CORP	15,779	19.750	311,635.250	
KEYERA CORP	13,728	29.530	405,387.840	
ALTAGAS LTD	23,944	15.750	377,118.000	
PEMBINA PIPELINE CORP	43,784	45.320	1,984,290.880	
DOLLARAMA INC	28,295	36.980	1,046,349.100	
CENOVUS ENERGY INC W/I	80,545	11.820	952,041.900	
VERMILION ENERGY INC	12,923	31.620	408,625.260	
ARC RESOURCES LTD	22,997	10.490	241,238.530	
INTER PIPELINE LTD	41,866	23.340	977,152.440	
NUTRIEN LTD	50,076	74.080	3,709,630.080	
WSP GLOBAL INC	8,400	67.470	566,748.000	
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	14,961	19.350	289,495.350	

	SEVEN GENERATIONS ENERGY LTD	17,231	12.450	214,525.950	
	RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	20,664	75.040	1,550,626.560	
	AURORA CANNABIS INC	50,000	9.360	468,000.000	
	SHOPIFY INC	6,500	186.230	1,210,495.000	
	CANOPY GROWTH CORP	15,000	51.490	772,350.000	
	HYDRO ONE LTD	27,340	19.300	527,662.000	
カナダ・ドル 小計		3,332,164		139,058,672.540 (12,006,325,787)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE TECH ENG	125,000	3.470	433,750.000	
	SEMBICORP INDUSTRIES	81,400	2.630	214,082.000	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	123,700	2.650	327,805.000	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	692,140	0.250	173,035.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	134,800	23.740	3,200,152.000	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	29,000	8.450	245,050.000	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	5,944	34.300	203,879.200	
	SINGAPORE AIRPORT TERMINAL SERVICES LTD	42,300	4.880	206,424.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	68,900	7.190	495,391.000	
	CAPITALAND LTD	192,415	3.130	602,258.950	
	GENTING SINGAPORE LTD	416,400	0.950	395,580.000	
	KEPPEL CORP LTD	168,400	6.200	1,044,080.000	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	177,900	2.180	387,822.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	267,053	11.460	3,060,427.380	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	591,922	3.100	1,834,958.200	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	47,500	9.520	452,200.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	110,800	24.660	2,732,328.000	
	UOL GROUP LIMITED	40,500	6.280	254,340.000	
	VENTURE CORP LTD	21,000	14.700	308,700.000	
WILMAR INTERNATIONAL LTD	142,300	3.150	448,245.000		
YANGZIJANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	188,800	1.300	245,440.000		
シンガポール・ドル 小計		3,668,174		17,265,947.730 (1,426,512,602)	
スイス・フラン	CREDIT SUISSE GROUP AG	211,414	12.985	2,745,210.790	
	NESTLE SA-REGISTERED	251,407	85.400	21,470,157.800	
	CIE FINANC RICHEMONT	42,886	69.100	2,963,422.600	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	56,955	251.350	14,315,639.250	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,607	210.400	758,912.800	
	SIKA INHABER	11,291	129.700	1,464,442.700	
	SGS SA-REG	405	2,312.000	936,360.000	

NOVARTIS AG-REG SHS	175,788	89.720	15,771,699.360	
BALOISE HOLDING AG -R	4,127	149.000	614,923.000	
BARRY CALLEBAUT AG	144	1,988.000	286,272.000	
CLARIANT AG-REG	19,496	21.900	426,962.400	
SWISSCOM AG-REG	2,320	462.800	1,073,696.000	
ABB LTD	150,930	20.270	3,059,351.100	
ADECCO GROUP AG-REG	12,341	50.060	617,790.460	
GEBERIT AG	3,243	385.500	1,250,176.500	
LONZA GROUP AG-REG	6,228	327.300	2,038,424.400	
LINDT & SPRUENGLI PART	75	7,095.000	532,125.000	
LINDT & SPRUENGLI NAMEN	9	81,400.000	732,600.000	
GIVAUDAN-REG	771	2,406.000	1,855,026.000	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	12,237	314.400	3,847,312.800	
LAFARGEHOLCIM LTD	40,615	46.880	1,904,031.200	
TEMENOS GROUP	4,521	136.400	616,664.400	
SONOVA HOLDING AG	4,142	163.400	676,802.800	
KUEHNE & NAGEL INTL AG	5,105	137.850	703,724.250	
STRAUMANN HOLDING AG	782	689.000	538,798.000	
THE SWATCH GROUP AG-B	2,311	322.400	745,066.400	
THE SWATCH GROUP AG-REG	4,592	63.050	289,525.600	
SCHINDLER NAMEN	1,663	205.200	341,247.600	
SWISS LIFE HOLDING AG	2,614	391.000	1,022,074.000	
VIFOR PHARMA AG	3,050	139.000	423,950.000	
EMS-CHEMIE HOLDING	553	558.500	308,850.500	
SWISS PRIME SITE AG	5,990	83.000	497,170.000	
PARGESA HOLDING PORTEUR	3,000	73.450	220,350.000	
DUFREY GROUP	2,390	106.300	254,057.000	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,505	708.000	1,065,540.000	
JULIUS BAER GROUP LTD	17,849	45.480	811,772.520	
SWISS RE LTD	25,796	92.400	2,383,550.400	
UBS GROUP AG	307,020	14.120	4,335,122.400	
スイス・フラン 小計	1,399,172		93,898,802.030 (10,635,917,307)	
スウェーデン・ク ローナ				
ATLAS COPCO AB-A SHS	57,191	217.900	12,461,918.900	
ATLAS COPCO AB-B SHS	30,899	203.050	6,274,041.950	
ERICSSON LM-B SHS	251,529	81.840	20,585,133.360	
LUNDBERGS B	7,382	284.600	2,100,917.200	
SKF AB-B SHS	24,866	142.150	3,534,701.900	
SANDVIK AB	85,032	138.650	11,789,686.800	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	128,935	95.060	12,256,561.100	
SKANSKA AB-B SHS	32,547	147.200	4,790,918.400	
SWEDBANK AB	74,223	208.100	15,445,806.300	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	133,024	100.650	13,388,865.600	
VOLVO AB-B SHS	129,013	135.200	17,442,557.600	

	SWEDISH MATCH AB	16,488	478.400	7,887,859.200	
	TELE2 AB-B SHS	44,876	102.800	4,613,252.800	
	INDUSTRIVARDEN C	11,403	189.700	2,163,149.100	
	ELECTROLUX AB-SER B	19,191	193.450	3,712,498.950	
	SECURITAS AB-B SHS	24,098	155.300	3,742,419.400	
	INVESTOR AB-B SHS	37,657	393.000	14,799,201.000	
	HENNES&MAURITZ AB-B SHS	66,448	159.040	10,567,889.920	
	ASSA ABLOY AB-B	77,223	177.250	13,687,776.750	
	TELIA CO AB	216,239	42.090	9,101,499.510	
	LUNDIN PETROLEUM AB	16,790	264.000	4,432,560.000	
	BOLIDEN AB	21,855	201.000	4,392,855.000	
	ALFA LAVAL AB	23,343	218.800	5,107,448.400	
	KINNEVIK AB-B	18,310	240.400	4,401,724.000	
	MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR SA	5,332	533.500	2,844,622.000	
	ICA GRUPPEN AB	5,920	322.200	1,907,424.000	
	HUSQVARNA AB-B SHS	33,692	69.040	2,326,095.680	
	HEXAGON AB	22,037	458.200	10,097,353.400	
	EPIROC AB-A	48,377	75.460	3,650,528.420	
	EPIROC AB-B	30,899	72.190	2,230,598.810	
	ESSITY AB-B	46,071	212.600	9,794,694.600	
	NORDEA BANK ABP	247,034	80.700	19,935,643.800	
	スウェーデン・クローナ 小計	1,987,924		261,468,203.850 (3,278,811,277)	
デンマーク・ク ローネ	CARLSBERG AS-B	9,644	731.400	7,053,621.600	
	A P MOLLER A/S	604	8,662.000	5,231,848.000	
	AP MOLLER MAERSK A	273	8,100.000	2,211,300.000	
	DANSKE BANK A/S	61,114	144.150	8,809,583.100	
	GENMAB A/S	4,613	992.400	4,577,941.200	
	NOVOZYMES-B SHS	19,111	331.300	6,331,474.300	
	NOVO NORDISK A/S-B	148,352	295.500	43,838,016.000	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	15,808	484.500	7,658,976.000	
	COLOPLAST-B	9,195	633.400	5,824,113.000	
	DSV A/S	14,452	525.400	7,593,080.800	
	WILLIAM DEMANT	6,537	212.000	1,385,844.000	
	H LUNDBECK A/S	4,840	285.200	1,380,368.000	
	TRYG A/S	11,107	167.600	1,861,533.200	
	PANDORA A/S	8,251	349.400	2,882,899.400	
	CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S	7,708	643.000	4,956,244.000	
	ISS A/S	16,240	224.300	3,642,632.000	
	ORSTED A/S	15,020	455.300	6,838,606.000	
	デンマーク・クローネ 小計	352,869		122,078,080.600 (2,110,730,014)	
ニュージーラン ド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	71,110	7.200	511,992.000	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	29,894	12.320	368,294.080	
	A2 MILK CO LTD	55,091	10.420	574,048.220	

	FISHER & PAYKEL	42,678	13.900	593,224.200	
	FLETCHER BUILDING LTD	64,104	6.100	391,034.400	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	159,623	4.065	648,867.490	
	MERIDIAN ENERGY LTD	90,173	3.240	292,160.520	
ニュージーランド・ドル 小計		512,673		3,379,620.910 (259,352,109)	
ノルウェー・クローネ	MARINE HARVEST	33,000	203.500	6,715,500.000	
	DNB ASA	79,783	156.700	12,501,996.100	
	NORSK HYDRO ASA	91,879	42.380	3,893,832.020	
	TELENOR ASA	62,076	158.450	9,835,942.200	
	ORKLA ASA	61,421	72.400	4,446,880.400	
	EQUINOR ASA	96,460	208.200	20,082,972.000	
	YARA INTERNATIONAL ASA	16,000	380.000	6,080,000.000	
	AKER BP ASA	8,552	250.200	2,139,710.400	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	16,683	137.400	2,292,244.200	
SCHIBSTED ASA	7,445	284.000	2,114,380.000		
ノルウェー・クローネ 小計		473,299		70,103,457.320 (946,396,673)	
ユーロ	CRH PLC	71,394	25.800	1,841,965.200	
	PADDY POWER BETFAIR PLC	6,246	75.200	469,699.200	
	KERRY GROUP PLC-A	13,865	94.100	1,304,696.500	
	UMICORE	15,320	42.610	652,785.200	
	AIR LIQUIDE	35,105	106.650	3,743,948.250	
	AIRBUS SE	47,562	94.680	4,503,170.160	
	AXA	158,512	22.305	3,535,610.160	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	39,913	18.890	753,956.570	
	ADIDAS AG	15,468	203.900	3,153,925.200	
	ASSICURAZIONI GENERALI	88,233	14.435	1,273,643.350	
	DASSAULT AVIATION SA	157	1,400.000	219,800.000	
	DANONE	50,307	65.610	3,300,642.270	
	SAFRAN SA	27,473	112.450	3,089,338.850	
	INTESA SANPAOLO	1,276,073	2.005	2,558,526.360	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	27,431	73.360	2,012,338.160	
	ACCOR SA	16,000	39.800	636,800.000	
	BOUYGUES	16,412	33.060	542,580.720	
	BNP PARIBAS	89,099	46.365	4,131,075.130	
	THALES SA	8,128	113.600	923,340.800	
	CAPGEMINI SA	13,759	109.600	1,507,986.400	
	CASINO GUICHARD PERRACHON	4,264	38.040	162,202.560	
	INGENICO GROUP	4,334	66.020	286,130.680	
	UNICREDIT SPA	170,144	11.230	1,910,717.120	
	NATIXIS	70,166	5.282	370,616.810	
KONINKLIJKE DSM NV	15,111	79.100	1,195,280.100		
COMMERZBANK AG	83,118	8.714	724,290.250		
EIFFAGE	5,949	89.020	529,579.980		

FRESENIUS SE & CO KGAA	34,640	52.820	1,829,684.800	
UNITED INTERNET	9,882	36.490	360,594.180	
FUCHS PETROLUB SE PREF	5,546	40.820	226,387.720	
PUBLICIS GROUPE	18,222	52.340	953,739.480	
FAURECIA	6,117	40.980	250,674.660	
IBERDROLA SA	483,541	6.570	3,176,864.370	
ENI SPA	208,385	15.456	3,220,798.560	
IMERYS SA	2,256	52.150	117,650.400	
JERONIMO MARTINS	19,517	10.760	210,002.920	
KBC GROUPE	20,803	61.840	1,286,457.520	
HANNOVER RUECK SE	4,868	125.300	609,960.400	
WARTSILA OYJ	34,935	15.515	542,016.520	
L'OREAL	20,735	205.600	4,263,116.000	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	22,721	266.000	6,043,786.000	
GEA GROUP AG	11,838	26.450	313,115.100	
BOLLORE	71,347	3.784	269,977.040	
MEDIOBANCA SPA	42,404	7.862	333,380.240	
MICHELIN(CGDE)-B	15,018	89.660	1,346,513.880	
CONTINENTAL AG	9,528	138.050	1,315,340.400	
DEUTSCHE POST AG-REG	81,561	28.570	2,330,197.770	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	14,426	12.240	176,574.240	
NOKIAN RENKAAT OYJ	9,399	27.350	257,062.650	
AXEL SPRINGER SE	3,067	58.100	178,192.700	
OMV AG	12,817	48.830	625,854.110	
PERNOD-RICARD	17,210	142.400	2,450,704.000	
PEUGEOT SA	50,087	20.680	1,035,799.160	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG- PFD	13,249	56.560	749,363.440	
RENAULT SA	14,378	64.940	933,707.320	
REPSOL SA	113,583	15.850	1,800,290.550	
REMY COINTREAU	1,860	107.900	200,694.000	
MERCK KGAA	11,193	94.860	1,061,767.980	
COMPAGNIE DE SAINT- GOBAIN	43,206	31.890	1,377,839.340	
RWE AG	39,183	18.565	727,432.390	
SEB SA	1,405	125.700	176,608.500	
LUXOTTICA GROUP SPA	11,602	55.440	643,214.880	
SOCIETE GENERALE-A	63,145	33.690	2,127,355.050	
VINCI S.A.	40,569	78.840	3,198,459.960	
SODEXO	8,639	93.700	809,474.300	
SOLVAY SA	7,479	101.950	762,484.050	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	44,923	63.880	2,869,681.240	
VIVENDI SA	86,200	21.410	1,845,542.000	
SAP SE	79,870	95.170	7,601,227.900	
TELEFONICA S.A	381,954	7.469	2,852,814.420	
TOTAL SA	194,657	50.490	9,828,231.930	
VALEO	17,731	26.030	461,537.930	

E.ON SE	181,272	8.741	1,584,498.550	
VOEST-ALPINE AG	9,875	31.130	307,408.750	
HENKEL AG & CO KGAA	7,858	87.000	683,646.000	
SIEMENS AG-REG	62,131	102.340	6,358,486.540	
UPM-KYMMENE OYJ	41,197	26.790	1,103,667.630	
ING GROEP NV-CVA	317,283	11.314	3,589,739.860	
PUMA AG	600	447.000	268,200.000	
BAYER AG	76,137	71.000	5,405,727.000	
STORA ENSO OYJ-R SHS	42,303	12.880	544,862.640	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	15,350	96.960	1,488,336.000	
DAIMLER AG	74,460	50.760	3,779,589.600	
BASF SE	74,943	68.850	5,159,825.550	
BEIERSDORF AG	8,371	91.780	768,290.380	
HOCHTIEF AG	1,707	133.700	228,225.900	
HEIDELBERGCEMENT AG	11,009	60.100	661,640.900	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	18,494	70.820	1,309,745.080	
ORANGE	160,420	14.630	2,346,944.600	
SAMPO OYJ-A SHS	36,209	41.360	1,497,604.240	
RANDSTAD NV	7,794	43.720	340,753.680	
ALLIANZ SE	35,615	192.000	6,838,080.000	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	189,631	3.110	589,752.410	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	102,303	22.600	2,312,047.800	
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	17,602	16.970	298,705.940	
HERMES INTL	2,703	495.200	1,338,525.600	
ENDESA S.A.	21,037	19.850	417,584.450	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	15,963	20.240	323,091.120	
ERSTE GROUP BANK AG	25,117	36.680	921,291.560	
MUENCHENER RUECKVER AG- REG	12,314	192.750	2,373,523.500	
ARCELOR MITTAL (NL)	58,189	22.260	1,295,287.140	
SOCIETE BIC SA	2,478	89.050	220,665.900	
DASSAULT SYSTEMES SA	10,913	111.800	1,220,073.400	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	19,033	34.740	661,206.420	
HEINEKEN NV	20,425	79.500	1,623,787.500	
AKZO NOBEL	21,135	74.460	1,573,712.100	
ASML HOLDING NV	33,271	152.220	5,064,511.620	
AEGON NV	150,349	5.562	836,241.130	
BANKINTER S.A.	57,960	7.548	437,482.080	
VOLKSWAGEN AG	2,329	143.200	333,512.800	
VOLKSWAGEN AG PFD	15,382	146.060	2,246,694.920	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	546,038	4.911	2,681,592.610	
KERING	6,164	393.200	2,423,684.800	
CNP ASSURANCES	13,987	20.320	284,215.840	
FORTUM OYJ	37,452	19.320	723,572.640	

AGEAS	12,993	45.190	587,153.670	
UCB SA	11,267	75.880	854,939.960	
THYSSENKRUPP AG	37,894	17.330	656,703.020	
UNILEVER NV-CVA	125,123	48.545	6,074,096.030	
CARREFOUR SA	51,094	17.575	897,977.050	
NATURGY ENERGY GROUP SA	29,010	23.160	671,871.600	
ATOS SE	7,050	77.360	545,388.000	
NOKIA OYJ	464,181	5.172	2,400,744.130	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	77,543	33.605	2,605,832.510	
WOLTERS KLUWER-CVA	26,097	52.140	1,360,697.580	
SANOFI	91,601	80.200	7,346,400.200	
STMICROELECTRONICS NV	50,879	12.995	661,172.600	
ELISA OYJ	9,517	37.370	355,650.290	
BANCO SANTANDER SA	1,317,818	4.239	5,586,230.500	
METSO OYJ	8,585	26.810	230,163.850	
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	34,596	19.280	667,010.880	
QIAGEN N.V.	17,387	31.770	552,384.990	
1&1 DRILLISCH AG	3,149	39.060	122,999.940	
DEUTSCHE BANK AG-REG	163,922	8.958	1,468,413.270	
BMW VORZUG	4,116	64.750	266,511.000	
K & S	14,982	17.280	258,888.960	
ENEL SPA	674,493	4.483	3,023,752.110	
COLRUYT NV	4,673	55.300	258,416.900	
VOPAK (KON.)	5,364	40.550	217,510.200	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	263,620	14.695	3,873,895.900	
SARTORIUS AG	2,712	132.700	359,882.400	
LEONARDO SPA	26,269	8.862	232,795.870	
UBISOFT ENTERTAINMENT	5,911	72.620	429,256.820	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	99,068	18.190	1,802,046.920	
KONINKLIJKE KPN NV	291,029	2.385	694,104.160	
EUROFINS SCIENTIFIC	794	437.600	347,454.400	
TELEPERFORMANCE	4,436	150.900	669,392.400	
DEUTSCHE BOERSE AG	15,641	111.150	1,738,497.150	
EURAZEO	4,725	66.000	311,850.000	
BANCO SABADELL	563,371	1.186	668,158.000	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	5,814	81.500	473,841.000	
FRAPORT AG	3,149	71.020	223,641.980	
HEINEKEN HOLDING NV-A	9,791	76.800	751,948.800	
INDITEX	90,509	26.420	2,391,247.780	
JC DECAUX SA	6,058	29.120	176,408.960	
ANDRITZ AG	6,265	43.080	269,896.200	
MAPFRE SA	84,474	2.548	215,239.750	
ESSILORLUXOTTICA	17,293	120.200	2,078,618.600	
SNAM SPA	158,419	3.878	614,348.880	
CREDIT AGRICOLE SA	85,585	11.358	972,074.430	
ENAGAS	18,095	24.600	445,137.000	
WENDEL	2,220	111.200	246,864.000	

WIRECARD AG	9,891	157.400	1,556,843.400	
TENARIS SA	36,959	12.945	478,434.250	
TELECOM ITALIA SPA	792,163	0.516	408,756.100	
TELECOM ITALIA-RNC	497,596	0.443	220,435.020	
ATLANTIA SPA	34,969	18.470	645,877.430	
ILIAD SA	2,102	100.150	210,515.300	
PROXIMUS	14,283	22.850	326,366.550	
SES FDR	24,585	18.695	459,616.570	
TERNA SPA	112,686	4.808	541,794.280	
BIOMERIEUX	3,248	68.400	222,163.200	
GRIFOLS SA	23,518	26.100	613,819.800	
FERROVIAL SA	37,657	17.795	670,106.310	
LANXESS AG	6,856	56.020	384,073.120	
NESTE OYJ	10,840	71.060	770,290.400	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	9,641	24.950	240,542.950	
RECORDATI SPA	6,859	30.230	207,347.570	
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	35,583	7.435	264,559.600	
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	3,960	182.600	723,096.000	
KONE OYJ	30,060	43.410	1,304,904.600	
ENGIE	149,944	12.575	1,885,545.800	
ALSTOM	12,046	38.020	457,988.920	
TELENET GROUP HOLDING NV	3,634	43.260	157,206.840	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	12,542	18.380	230,521.960	
ELECTRICITE DE FRANCE	43,198	15.630	675,184.740	
IPSEN SA	2,487	127.500	317,092.500	
DEUTSCHE WOHNEN	26,714	41.330	1,104,089.620	
ARKEMA SA	5,230	94.960	496,640.800	
LEGRAND SA	23,308	55.180	1,286,135.440	
ADP	2,313	185.100	428,136.300	
ORION OYJ	8,051	30.000	241,530.000	
RTL GROUP SA	3,446	52.150	179,708.900	
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	37,921	14.775	560,282.770	
SYMRISE AG	9,628	72.020	693,408.560	
SCOR SE	13,875	43.570	604,533.750	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	17,397	26.860	467,283.420	
REXEL SA	23,245	10.565	245,583.420	
PRYSMIAN SPA	29,418	17.820	524,228.760	
CAIXABANK	297,224	3.670	1,090,812.080	
BUREAU VERITAS SA	21,480	19.630	421,652.400	
GETLINK	37,646	11.535	434,246.610	
SUEZ SA	25,406	13.555	344,378.330	
AMADEUS IT GROUP SA	36,055	69.860	2,518,802.300	
BRENTAG AG	12,353	43.200	533,649.600	

	INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GROUP SA	44,747	7.380	330,232.860	
	EVONIK INDUSTRIES AG	11,575	26.720	309,284.000	
	EDENRED	18,306	34.300	627,895.800	
	BANKIA SA	100,675	2.904	292,360.200	
	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	61,541	3.434	211,331.790	
	HUGO BOSS AG -ORD	5,218	62.220	324,663.960	
	OSRAM LICHT AG	7,017	34.420	241,525.140	
	KION GROUP AG	4,686	50.520	236,736.720	
	VONOVIA SE	40,775	41.960	1,710,919.000	
	BANK OF IRELAND GROUP PLC	73,287	6.345	465,006.010	
	SIEMENS HEALTHINEERS AG	10,000	38.860	388,600.000	
	FERROVIAL SA-RTS	37,657	0.412	15,514.680	
	FERRARI NV	9,503	97.920	930,533.760	
	METRO AG	10,774	13.820	148,896.680	
	CNH INDUSTRIAL NV	78,645	8.796	691,761.420	
	AIB GROUP PLC	52,322	3.942	206,253.320	
	INNOGY SE-TEMPORARY	9,769	37.050	361,941.450	
	MONCLER SPA	14,353	30.320	435,182.960	
	NN GROUP NV	21,965	38.550	846,750.750	
	ZALANDO SE	6,674	31.400	209,563.600	
	FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	89,977	14.290	1,285,771.330	
	AENA SME SA	5,256	139.400	732,686.400	
	ABN AMRO GROUP NV	34,251	23.080	790,513.080	
	EXOR NV	7,726	51.160	395,262.160	
	COVESTRO AG	14,459	57.500	831,392.500	
	LINDE PLC	21,335	143.500	3,061,572.500	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	60,448	65.680	3,970,224.640	
	POSTE ITALIANE SPA	40,015	6.870	274,903.050	
	AMUNDI SA	3,894	51.960	202,332.240	
	SCHAEFFLER AG	12,644	8.342	105,476.240	
	PIRELLI & C SPA	34,086	6.190	210,992.340	
	UNIPER SE	13,897	26.160	363,545.520	
	DELIVERY HERO SE	7,238	36.860	266,792.680	
ユーロ	小計	15,861,356		298,834,969.850 (38,537,757,712)	
香港・ドル	ASM PACIFIC TECH	16,600	74.950	1,244,170.000	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	164,000	14.680	2,407,520.000	
	BANK OF EAST ASIA	153,660	25.650	3,941,379.000	
	CLP HOLDINGS LTD	149,500	85.700	12,812,150.000	
	PCCW LTD	331,000	4.310	1,426,610.000	
	LI & FUNG LTD	532,400	1.650	878,460.000	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	49,000	57.450	2,815,050.000	

HONG KONG EXCHANGES &CLEAR	105,040	221.400	23,255,856.000	
MTR CORP	118,500	38.300	4,538,550.000	
HANG LUNG GROUP LTD	63,000	19.740	1,243,620.000	
HANG SENG BANK LTD	56,000	177.900	9,962,400.000	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	92,228	37.350	3,444,715.800	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	96,500	52.300	5,046,950.000	
(THE) WHARF HOLDINGS LTD	95,750	20.600	1,972,450.000	
HONG KONG & CHINA GAS	837,050	14.820	12,405,081.000	
HYSAN DEVELOPMENT CO	50,000	37.450	1,872,500.000	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	186,000	42.900	7,979,400.000	
KERRY PROPERTIES LTD	33,000	25.150	829,950.000	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	262,000	29.050	7,611,100.000	
NWS HOLDINGS LTD	135,000	15.540	2,097,900.000	
YUE YUEN INDUSTRIAL HOLDINGS	50,500	22.900	1,156,450.000	
NEW WORLD DEVELOPMENT	441,266	10.240	4,518,563.840	
SHANGRI-LA ASIA LTD	104,000	11.060	1,150,240.000	
SINO LAND CO	255,400	12.400	3,166,960.000	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	135,000	106.000	14,310,000.000	
SWIRE PACIFIC LTD A	30,000	83.250	2,497,500.000	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	113,500	41.000	4,653,500.000	
WHEELLOCK & CO LTD	56,000	43.000	2,408,000.000	
MINTH GROUP LTD	44,000	25.450	1,119,800.000	
SJM HOLDINGS LTD	156,000	6.490	1,012,440.000	
WYNN MACAU LTD	124,400	16.160	2,010,304.000	
MGM CHINA HOLDINGS LTD	64,800	11.680	756,864.000	
AIA GROUP LTD	996,027	62.650	62,401,091.550	
HKT TRUST / HKT LTD	282,000	10.760	3,034,320.000	
SANDS CHINA LTD	232,800	31.700	7,379,760.000	
SWIRE PROPERTIES LTD	104,200	28.050	2,922,810.000	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT CO LTD	95,750	47.300	4,528,975.000	
HK ELECTRIC INVESTMENTS & HK ELECTRIC INVESTMENTS LTD	230,000	7.440	1,711,200.000	
WH GROUP LTD	701,500	6.100	4,279,150.000	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	224,832	79.000	17,761,728.000	
CK ASSET HOLDINGS LTD	222,832	53.250	11,865,804.000	
香港・ドル 小計	8,191,035		262,431,272.190 (3,818,375,010)	
合計	96,555,108		324,188,852,487 (324,188,852,487)	

(2) 株式以外の有価証券

平成30年11月12日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	オーストラリア・ドル	DEXUS	80,596.000	811,601.720	
		GOODMAN GROUP	121,619.000	1,270,918.550	
		GPT GROUP	144,955.000	765,362.400	
		LENDLEASE GROUP	60,871.000	867,411.750	
		MIRVAC GROUP	295,783.000	650,722.600	
		SCENTRE GROUP	476,956.000	1,922,132.680	
		STOCKLAND	194,018.000	710,105.880	
		VICINITY CENTRES	270,443.000	727,491.670	
	オーストラリア・ドル	小計	1,645,241.000	7,725,747.250 (635,751,741)	
	シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	200,806.000	512,055.300	
		CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	206,300.000	348,647.000	
		CAPITALAND MALL TRUST	199,000.000	423,870.000	
		SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	192,100.000	336,175.000	
	シンガポール・ドル	小計	798,206.000	1,620,747.300 (133,906,141)	
	投資信託受益証券	合計		2,443,447	769,657,882 (769,657,882)
投資証券	アメリカ・ドル	AGNC INVESTMENT CORP	32,741.000	591,957.280	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	9,664.000	1,202,781.440	
		AMERICAN TOWER CORP	35,796.000	5,732,371.440	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	110,918.000	1,115,835.080	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	11,353.000	2,072,263.090	
		BOSTON PROPERTIES INC	13,674.000	1,699,131.240	
		BROOKFIELD PROPERTY REIT INC	19,124.000	368,328.240	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	8,062.000	746,057.480	
		CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	32,818.000	3,638,531.660	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	17,035.000	1,884,411.700	
		DUKE REALTY TRUST	33,801.000	966,032.580	
		EQUINIX INC	6,510.000	2,505,959.400	
		EQUITY RESIDENTIAL	29,876.000	2,016,032.480	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	5,024.000	1,275,744.320	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	9,741.000	883,995.750	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	6,000.000	771,960.000	
		HCP INC	39,277.000	1,131,963.140	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	64,001.000	1,209,618.900	
INVITATION HOMES INC	22,567.000	489,929.570			

	IRON MOUNTAIN INC	19,265.000	631,314.050	
	KIMCO REALTY	32,980.000	536,914.400	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	11,649.000	513,021.960	
	MID AMERICA	10,258.000	1,031,134.160	
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	13,649.000	670,848.350	
	PROLOGIS INC	49,313.000	3,332,079.410	
	PUBLIC STORAGE	12,755.000	2,631,994.250	
	REALTY INCOME CORP	22,285.000	1,398,606.600	
	REGENCY CENTERS CORP	11,294.000	736,933.500	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	9,444.000	1,619,740.440	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	25,000.000	4,717,250.000	
	SL GREEN	7,097.000	674,285.970	
	THE MACERICH COMPANY	9,014.000	460,795.680	
	UDR INC	21,658.000	884,512.720	
	VENTAS INC	30,244.000	1,816,757.080	
	VEREIT INC	72,429.000	556,979.010	
	VORNADO REALTY TRUST	12,211.000	855,502.660	
	WELLTOWER INC	31,178.000	2,166,247.440	
	WEYERHAEUSER CO	63,699.000	1,709,044.170	
	WP CAREY INC	12,000.000	774,840.000	
アメリカ・ドル 小計		985,404.000	58,021,706.640 (6,610,993,254)	
イギリス・ボンド	BRITISH LAND CO PLC	71,871.000	449,050.000	
	HAMMERSON PLC	58,616.000	260,665.350	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	59,062.000	509,232.560	
	SEGRO PLC	82,914.000	524,182.300	
イギリス・ボンド 小計		272,463.000	1,743,130.210 (256,919,962)	
カナダ・ドル	H & R REAL ESTATE INVESTMENT	10,748.000	223,128.480	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	9,675.000	238,682.250	
	SMARTCENTRES REIT	2,582.000	80,532.580	
カナダ・ドル 小計		23,005.000	542,343.310 (46,825,921)	
ユーロ	COVIVIO	2,343.000	209,932.800	
	GECINA SA	3,670.000	482,972.000	
	ICADE	2,234.000	168,220.200	
	KLEPIERRE	17,042.000	528,302.000	
	UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	11,572.000	1,872,349.600	
ユーロ 小計		36,861.000	3,261,776.600 (420,638,710)	
香港・ドル	LINK REIT	163,500.000	11,772,000.000	
香港・ドル 小計		163,500.000	11,772,000.000 (171,282,600)	
投資証券 合計		1,481,233	7,506,660,447 (7,506,660,447)	

合計		8,276,318,329 (8,276,318,329)	
----	--	----------------------------------	--

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

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入 投資信託 受益証券 時価比率	組入 投資証券 時価比率	有価証券の 合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	株式 595銘柄	65.96%	-%	-%	68.59%
	投資証券 39銘柄	-%	-%	1.97%	
イギリス・ポンド	株式 97銘柄	6.39%	-%	-%	6.53%
	投資証券 4銘柄	-%	-%	0.08%	
イスラエル・シケル	株式 8銘柄	0.10%	-%	-%	0.10%
オーストラリア・ドル	株式 59銘柄	2.37%	-%	-%	2.59%
	投資信託 受益証券 8銘柄	-%	0.19%	-%	
カナダ・ドル	株式 89銘柄	3.58%	-%	-%	3.63%
	投資証券 3銘柄	-%	-%	0.01%	
シンガポール・ドル	株式 21銘柄	0.42%	-%	-%	0.47%
	投資信託 受益証券 4銘柄	-%	0.04%	-%	
スイス・フラン	株式 38銘柄	3.17%	-%	-%	3.20%
スウェーデン・クローナ	株式 32銘柄	0.98%	-%	-%	0.99%
デンマーク・クローネ	株式 17銘柄	0.63%	-%	-%	0.63%
ニュージーランド・ドル	株式 7銘柄	0.08%	-%	-%	0.08%
ノルウェー・クローネ	株式 10銘柄	0.28%	-%	-%	0.28%
ユーロ	株式 238銘柄	11.48%	-%	-%	11.72%
	投資証券 5銘柄	-%	-%	0.13%	
香港・ドル	株式 41銘柄	1.14%	-%	-%	1.20%
	投資証券 1銘柄	-%	-%	0.05%	

(注) 「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

「外国リート・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11月12日現在
資産の部		
流動資産		
預金		110,595,617
コール・ローン		55,860,454
投資信託受益証券		4,098,263,934
投資証券		43,679,115,631
派生商品評価勘定		15,774
未収入金		751,182
未収配当金		79,358,762
流動資産合計		48,023,961,354
資産合計		48,023,961,354
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		767,919
未払金		7,555,692,774
未払解約金		26,529,000
流動負債合計		7,582,989,693
負債合計		7,582,989,693
純資産の部		
元本等		
元本	1	32,380,716,641
剰余金		
剰余金又は欠損金()		8,060,255,020
元本等合計		40,440,971,661
純資産合計		40,440,971,661
負債純資産合計		48,023,961,354

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11月12日現在
1.	1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	42,701,671,349円
	同期中追加設定元本額	16,781,477,659円
	同期中一部解約元本額	27,102,432,367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)	247,018,095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)	95,000,203円
	M I T O ラップ型ファンド (安定型)	4,347,931円
	M I T O ラップ型ファンド (中立型)	16,225,550円
	M I T O ラップ型ファンド (積極型)	32,145,399円
	グローバル8資産ラップファン ド(安定型)	30,075,924円
	グローバル8資産ラップファン ド(中立型)	43,636,068円
	グローバル8資産ラップファン ド(積極型)	39,542,249円
	たわらノーロード 先進国リー ト	2,919,089,293円
	たわらノーロード 先進国リー ト<ラップ向け>	587,949,809円
	たわらノーロード 先進国リー ト<為替ヘッジあり>	139,841,355円
	たわらノーロード バランス (8資産均等型)	148,527,894円
	たわらノーロード バランス (堅実型)	948,570円
	たわらノーロード バランス (標準型)	19,742,724円
	たわらノーロード バランス (積極型)	58,616,516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)	5,826,881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)	44,302,872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)	38,523,910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)	106,999,993円
	たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定型)	113,261円

たわらノーロード 最適化バ ランス(安定成長型)	1,666,588円
たわらノーロード 最適化バ ランス(成長型)	1,235,067円
たわらノーロード 最適化バ ランス(積極型)	4,635,030円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型>	23,065,104円
マネックス資産設計ファンド< 育成型>	604,869,987円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	39,383,601円
D I A M D C 8資産バラン スファンド(新興国10)	172,886,995円
D I A M D C 8資産バラン スファンド(新興国20)	150,229,482円
D I A M D C 8資産バラン スファンド(新興国30)	302,213,922円
投資のソムリエ	4,628,532,859円
投資のソムリエ<DC年金>	409,145,240円
D I A M 8資産バランスマ ンドN<DC年金>	121,087,214円
投資のソムリエ<DC年金>リ スク抑制型	137,923,789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	696,990円 2,531,096,042円
ワールドアセットバランス(基 本コース)	1,200,908,193円
ワールドアセットバランス(リ スク抑制コース)	2,914,300,230円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2045)	2,396,757円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2055)	1,747,160円
リスク抑制世界8資産バラン スファンド(DC)	800,629円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2035)	3,412,895円
リスクコントロール世界資産分 散ファンド	856,495,571円
9資産分散投資・スタンダード <DC年金>	12,333円
D I A Mパッシブ資産分散ファ ンド	1,103,861,552円
D I A M外国リートインデック スファンド<DC年金>	30,245,832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)	575,447,932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2 V A (適格機関投資 家限定)	7,280,385,124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)	488,601,122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)	258,081,123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)	3,386,407,330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)	558,890,123円
	計	32,380,716,641円
2 .	受益権の総数	32,380,716,641口

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成30年5月25日 至 平成30年11月12日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成30年11月12日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	
投資信託受益証券	53,631,819	
投資証券	25,045,557	
合計	78,677,376	

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

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	平成30年11月12日 現在				
	契約額等 (円)	うち		時価 (円)	評価損益 (円)
		1年超			
市場取引以外の取引					
為替予約取引					
買 建	8,621,642,505	-	8,620,890,360	752,145	
アメリカ・ドル	6,266,150,000	-	6,265,600,000	550,000	
イギリス・ポンド	482,975,729	-	482,964,260	11,469	
オーストラリア・ドル	588,302,000	-	588,302,000	-	
カナダ・ドル	160,573,800	-	160,573,800	-	
シンガポール・ドル	280,928,740	-	280,840,000	88,740	
ニュージーランド・ドル	37,598,680	-	37,597,700	980	
ユーロ	616,413,026	-	616,428,800	15,774	
香港・ドル	188,700,530	-	188,583,800	116,730	
合計	8,621,642,505	-	8,620,890,360	752,145	

(注)時価の算定方法

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成30年11月12日現在
1口当たり純資産額	1,2489円
(1万口当たり純資産額)	(12,489円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

平成30年11月12日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	オーストラリア・ドル	ABACUS PROPERTY GROUP	107,540.000	357,032.800	
		ARENA REIT	76,763.000	172,716.750	
		BWP TRUST	156,735.000	542,303.100	
		CHARTER HALL GROUP	145,219.000	1,029,602.710	
		CHARTER HALL LONG WALE REIT	57,142.000	238,282.140	
		CHARTER HALL RETAIL REIT	101,709.000	441,417.060	
		CROMWELL PROPERTY GROUP	463,689.000	477,599.670	
		DEXUS	320,834.000	3,230,798.380	
		FOLKESTONE EDUCATION TRUST	72,764.000	211,743.240	
		GDI PROPERTY GROUP	150,067.000	188,334.080	
		GOODMAN GROUP	508,766.000	5,316,604.700	
		GPT GROUP	570,742.000	3,013,517.760	
		GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA	75,592.000	273,643.040	
		HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD	45,873.000	142,665.030	
		INDUSTRIA REIT	28,737.000	73,854.090	
		INGENIA COMMUNITIES GROUP	60,012.000	177,035.400	
		INVESTA OFFICE FUND	159,118.000	887,878.440	
		MIRVAC GROUP	1,179,001.000	2,593,802.200	
		NATIONAL STORAGE REIT	214,122.000	370,431.060	
		PROPERTYLINK GROUP	137,268.000	161,976.240	
		RURAL FUNDS GROUP	96,422.000	216,949.500	
		SCENTRE GROUP	1,689,285.000	6,807,818.550	
		SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	263,194.000	689,568.280	
STOCKLAND	764,217.000	2,797,034.220			
VICINITY CENTRES	1,008,966.000	2,714,118.540			
VIVA ENERGY REIT	141,043.000	313,115.460			
	オーストラリア・ドル 小計		8,594,820.000	33,439,842.440 (2,751,764,634)	
	カナダ・ドル	KILLAM APARTMENT REIT	16,836.000	279,982.680	
	カナダ・ドル 小計		16,836.000	279,982.680 (24,173,705)	
	シンガポール・ドル	AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL REIT	169,995.000	220,993.500	

	ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	216,200.000	167,555.000	
	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	801,360.000	2,043,468.000	
	ASCOTT RESIDENCE TRUST	389,615.000	416,888.050	
	CACHE LOGISTICS TRUST	320,180.000	217,722.400	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	884,479.000	1,494,769.510	
	CAPITALAND MALL TRUST	848,560.000	1,807,432.800	
	CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST	183,480.000	253,202.400	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	245,300.000	363,044.000	
	ESR REIT	635,030.000	311,164.700	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	304,300.000	185,623.000	
	FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	167,700.000	196,209.000	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	184,900.000	399,384.000	
	FRASERS COMMERCIAL TRUST	217,980.000	296,452.800	
	FRASERS LOGISTICS & INDUSTRIAL TRUST	485,750.000	510,037.500	
	KEPPEL DC REIT	304,500.000	411,075.000	
	KEPPEL REIT	575,100.000	649,863.000	
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST	579,900.000	139,176.000	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	601,700.000	980,771.000	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	400,820.000	745,525.200	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	743,520.000	907,094.400	
	MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL TRUST	672,000.000	745,920.000	
	QUE HOSPITALITY TRUST	356,620.000	247,850.900	
	PARKWAY LIFE REIT	125,500.000	327,555.000	
	SABANA SHARIAH COMP IND REIT	246,100.000	98,440.000	
	SOILBUILD BUSINESS SPACE REIT	206,400.000	118,680.000	
	SPH REIT	189,900.000	188,950.500	
	STARHILL GLOBAL REIT	450,300.000	306,204.000	
	SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	716,490.000	1,253,857.500	
	シンガポール・ドル 小計	12,223,679.000	16,004,909.160 (1,322,325,595)	
投資信託受益証券	合計	20,835,335	4,098,263.934 (4,098,263,934)	
投資証券	アメリカ・ドル	ACADIA REALTY TRUST	31,690.000	913,939.600

AGREE REALTY CORP	13,435.000	791,590.200	
ALEXANDER'S INC.	1,486.000	473,305.860	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	40,727.000	5,068,882.420	
AMERICAN ASSETS TRUST INC	14,793.000	582,548.340	
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	52,920.000	2,187,712.800	
AMERICAN HOMES 4 RENT	99,280.000	2,037,225.600	
AMERICOLD REALTY TRUST	22,483.000	592,651.880	
APARTMENT INVT & MGMT CO-A	60,704.000	2,770,530.560	
APPLE HOSPITALITY REIT INC	83,869.000	1,357,839.110	
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	28,982.000	149,836.940	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	53,175.000	9,706,032.750	
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH REIT INC	6,494.000	59,355.160	
BOSTON PROPERTIES INC	59,428.000	7,384,523.280	
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	8,778.000	86,287.740	
BRANDYWINE REALTY TRUST	69,375.000	999,000.000	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	116,961.000	1,887,750.540	
BRT APARTMENTS CORP	2,089.000	24,190.620	
CAMDEN PROPERTY TRUST	35,779.000	3,310,988.660	
CARETRUST REIT INC	31,666.000	613,687.080	
CBL & ASSOCIATES	51,866.000	158,709.960	
CEDAR REALTY TRUST INC	24,781.000	94,415.610	
CHATHAM LODGING TRUST	18,160.000	362,110.400	
CHESAPEAKE LODGING TRUST	23,567.000	699,468.560	
CITY OFFICE REIT INC	10,610.000	118,619.800	
CLIPPER REALTY INC	5,169.000	72,779.520	
COLONY CAPITAL INC	189,966.000	1,164,491.580	
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	45,812.000	1,035,809.320	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	5,814.000	174,187.440	
CORECIVIC INC	46,048.000	1,006,148.800	
CORESITE REALTY CORP	14,215.000	1,364,497.850	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	40,092.000	1,049,608.560	
COUSINS PROPERTIES INC	162,798.000	1,396,806.840	
CUBESMART	71,803.000	2,098,801.690	
CYRUSONE INC	40,397.000	2,214,563.540	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	80,884.000	846,046.640	

DIGITAL REALTY TRUST INC	79,297.000	8,771,834.140	
DOUGLAS EMMETT INC	62,329.000	2,253,193.350	
DUKE REALTY TRUST	137,671.000	3,934,637.180	
EAST GROUP	13,842.000	1,368,558.540	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	19,704.000	355,854.240	
EMPIRE STATE REALTY TRUST INC	52,652.000	841,905.480	
EPR PROPERTIES	28,723.000	2,047,662.670	
EQUITY COMMONWEALTH	47,034.000	1,450,528.560	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	34,350.000	3,350,842.500	
EQUITY RESIDENTIAL	141,686.000	9,560,971.280	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	25,425.000	6,456,170.250	
EXTRA SPACE STORAGE INC	48,732.000	4,422,429.000	
FARMLAND PARTNERS INC	8,421.000	62,989.080	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	28,326.000	3,644,423.160	
FIRST INDUSTRIAL RT	48,750.000	1,545,862.500	
FOREST CITY REALTY TRUST INC	103,106.000	2,596,209.080	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST INC	26,081.000	704,708.620	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	42,540.000	329,259.600	
FRONT YARD RESIDENTIAL CORP	16,441.000	135,145.020	
GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	77,536.000	2,596,680.640	
GEO GROUP INC	47,285.000	1,037,432.900	
GETTY REALTY CORP	13,265.000	372,481.200	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	8,531.000	165,416.090	
GLADSTONE LAND CORP	3,683.000	48,247.300	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	5,145.000	47,745.600	
GLOBAL NET LEASE INC	27,903.000	590,985.540	
GOVERNMENT PROPERTIES INCOME TRUST	32,807.000	305,433.170	
HCP INC	180,925.000	5,214,258.500	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	48,496.000	1,404,444.160	
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA INC	80,160.000	2,110,612.800	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	10,951.000	198,541.630	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	40,001.000	1,755,643.890	

HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	63,566.000	1,683,227.680	
HOST HOTELS & RESORTS INC	285,583.000	5,397,518.700	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	60,565.000	1,885,994.100	
INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	29,107.000	290,778.930	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES TRUST	6,888.000	153,051.360	
INFREIT INC	13,160.000	280,044.800	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES INC	2,926.000	130,236.260	
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	39,714.000	215,647.020	
INVITATION HOMES INC	114,517.000	2,486,164.070	
IRON MOUNTAIN INC	110,295.000	3,614,367.150	
JBG SMITH PROPERTIES	41,891.000	1,635,424.640	
KILROY REALTY CORP	38,831.000	2,746,904.940	
KIMCO REALTY	162,592.000	2,646,997.760	
KITE REALTY GROUP TRUST	32,807.000	533,113.750	
LASALLE HOTEL PROPERTIES	42,745.000	1,430,675.150	
LEXINGTON REALTY TRUST	83,317.000	700,695.970	
LIBERTY PROPERTY TRUST	57,044.000	2,512,217.760	
LIFE STORAGE INC	18,020.000	1,732,983.400	
LTC PROPERTIES INC	15,466.000	705,404.260	
MACK CALI	35,218.000	725,490.800	
MANULIFE US REIT	394,200.000	307,476.000	
MEDEQUITIES REALTY TRUST INC	8,766.000	76,527.180	
MEDICAL PROPERTIES TRUST	140,858.000	2,355,145.760	
MID AMERICA	43,843.000	4,407,098.360	
MONMOUTH RE INVEST CP -CL A	35,110.000	524,543.400	
NATIONAL HEALTH INVS INC	16,349.000	1,242,197.020	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	60,549.000	2,975,983.350	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUST	22,125.000	598,038.750	
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP INC	27,744.000	152,592.000	
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	5,608.000	190,615.920	
NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP	19,801.000	326,716.500	
OMEGA HEALTHCARE INVS INC	77,292.000	2,719,132.560	

ONE LIBERTY PROPERTIES INC	4,207.000	109,424.070	
PARAMOUNT GROUP INC	80,222.000	1,161,614.560	
PARK HOTELS & RESORTS INC	77,658.000	2,395,749.300	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	26,846.000	917,596.280	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	20,315.000	185,882.250	
PHYSICIANS REALTY TRUST	70,596.000	1,206,485.640	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC	49,905.000	925,238.700	
PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES INC	13,325.000	206,804.000	
PROLOGIS INC	242,077.000	16,357,142.890	
PS BUSINESS PARKS	7,745.000	1,062,614.000	
PUBLIC STORAGE	57,637.000	11,893,394.950	
QTS REALTY TRUST INC	19,871.000	804,974.210	
REALTY INCOME CORP	111,632.000	7,006,024.320	
REGENCY CENTERS CORP	65,278.000	4,259,389.500	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	43,935.000	787,754.550	
RETAIL PROPERTIES OF AMERICA INC	85,242.000	1,048,476.600	
RETAIL VALUE INC	5,243.000	148,272.040	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	35,405.000	1,167,656.900	
RLJ LODGING TRUST	67,898.000	1,360,675.920	
RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES	30,438.000	410,608.620	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	19,863.000	1,504,423.620	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	69,015.000	1,468,639.200	
SAFETY INCOME & GROWTH INC	2,130.000	39,255.900	
SAUL CENTERS INC	3,831.000	192,967.470	
SELECT INCOME REIT	34,935.000	693,110.400	
SENIOR HOUSING PPTYS TRUST	91,984.000	1,496,579.680	
SERITAGE GROWTH PROPERTIES	9,047.000	344,690.700	
SIMON PROPERTY GROUP INC	118,883.000	22,432,033.270	
SITE CENTERS CORP	56,946.000	683,921.460	
SL GREEN	33,379.000	3,171,338.790	
SPIRIT MTA REIT	14,648.000	158,051.920	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	165,993.000	1,359,482.670	
STAG INDUSTRIAL INC	40,544.000	1,070,767.040	
STORE CAPITAL CORP	70,662.000	2,117,033.520	

	SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	41,171.000	480,465.570	
	SUN COMMUNITIES INC	33,289.000	3,418,114.520	
	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	88,420.000	1,329,836.800	
	TANGER FACTORY OUTLET	36,541.000	863,463.830	
	TAUBMAN CENTERS INC	23,632.000	1,299,996.320	
	TERRENO REALTY CORP	22,725.000	885,820.500	
	THE MACERICH COMPANY	40,865.000	2,089,018.800	
	TIER REIT INC	19,976.000	459,847.520	
	UDR INC	103,126.000	4,211,665.840	
	UMH PROPERTIES INC	10,131.000	134,235.750	
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	4,194.000	280,998.000	
	URBAN EDGE PROPERTIES	44,331.000	925,631.280	
	URSTADT BIDDLE PROPERTIES	8,927.000	182,200.070	
	VENTAS INC	137,156.000	8,238,960.920	
	VEREIT INC	373,201.000	2,869,915.690	
	VICI PROPERTIES INC	27,519.000	597,162.300	
	VORNADO REALTY TRUST	66,680.000	4,671,600.800	
	WASHINGTON PRIME GROUP INC	73,078.000	497,661.180	
	WASHINGTON REIT	30,601.000	876,106.630	
	WEINGARTEN REALTY INVST	46,146.000	1,337,311.080	
	WELLTOWER INC	143,123.000	9,944,186.040	
	WHITESTONE REIT	11,820.000	164,298.000	
	WP CAREY INC	41,366.000	2,671,002.620	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	43,537.000	892,508.500	
	アメリカ・ドル 小計	8,633,281.000	311,389,141.720 (35,479,678,808)	
	イギリス・ポンド			
	ASSURA PLC	927,458.000	528,651.060	
	BIG YELLOW GROUP PLC	61,088.000	568,118.400	
	BRITISH LAND CO PLC	383,239.000	2,394,477.270	
	CAPITAL & REGIONAL PLC	169,910.000	67,964.000	
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	53,786.000	57,282.090	
	DERWENT LONDON PLC	42,848.000	1,332,144.320	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	212,472.000	202,698.280	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	109,345.000	814,620.250	
	HAMMERSON PLC	306,650.000	1,363,672.550	
	HANSTEEN HOLDINGS PLC	167,124.000	162,110.280	
	INTU PROPERTIES PLC	334,884.000	654,698.220	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	289,651.000	2,497,370.920	

	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	270,497.000	510,698.330	
	LXI REIT PLC	118,335.000	142,002.000	
	NEWRIVER REIT PLC	121,042.000	290,500.800	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC	288,249.000	317,650.390	
	RDI REIT PLC	531,663.000	181,297.080	
	REGIONAL REIT LTD	105,299.000	106,562.580	
	SAFESTORE HOLDINGS LTD	81,935.000	458,836.000	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT TRUST LTD	152,503.000	91,196.790	
	SEGRE PLC	389,171.000	2,460,339.060	
	SHAFTESBURY PLC	89,450.000	830,543.250	
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING REIT PLC	114,944.000	119,541.760	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	572,098.000	804,369.780	
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT LTD	225,559.000	197,138.560	
	UNITE GROUP PLC	102,046.000	881,677.440	
	WORKSPACE GROUP PLC	50,654.000	504,767.110	
イギリス・ボンド 小計		6,271,900.000	18,540,928.570 (2,732,747,462)	
イスラエル・シュケル	REIT 1 LTD	54,949.000	809,948.260	
イスラエル・シュケル 小計		54,949.000	809,948.260 (25,084,098)	
カナダ・ドル	AGELLAN COMMERCIAL REIT	5,891.000	79,881.960	
	ALLIED PROPERTIES REIT	19,205.000	842,139.250	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	24,536.000	251,494.000	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	8,982.000	442,992.240	
	CANADIAN APT PPTYS REIT	27,614.000	1,312,217.280	
	CHOICE PROPERTIES REIT	53,361.000	657,407.520	
	COMINAR REAL ESTATE INVT TR	35,511.000	405,535.620	
	CROMBIE REAL ESTATE INV	17,914.000	240,585.020	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	9,279.000	117,379.350	
	DREAM GLOBAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	37,098.000	503,790.840	
	DREAM INDUSTRIAL REIT	13,629.000	136,835.160	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV TRUST	11,923.000	283,528.940	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	8,863.000	498,543.750	
	H & R REAL ESTATE INVESTMENT	54,476.000	1,130,921.760	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	17,040.000	218,793.600	

	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT	5,590.000	96,986.500	
	NORTHVIEW APARTMENT REIT	11,122.000	288,059.800	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	20,731.000	227,211.760	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	59,303.000	1,463,005.010	
	SLATE OFFICE REIT	12,079.000	90,592.500	
	SLATE RETAIL REIT	7,739.000	98,130.520	
	SMARTCENTRES REIT	25,628.000	799,337.320	
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	11,161.000	103,797.300	
	TRUE NORTH COMMERCIAL REIT	10,465.000	66,766.700	
カナダ・ドル 小計		509,140.000	10,355,933.700 (894,131,315)	
ニュージーランド・ドル	ARGOSY PROPERTY LTD	265,480.000	297,337.600	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	318,045.000	483,428.400	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	451,452.000	609,460.200	
	PRECINCT PROPERTIES	327,125.000	461,246.250	
	STRIDE STAPLED GROUP	112,511.000	210,395.570	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	108,788.000	227,366.920	
ニュージーランド・ドル 小計		1,583,401.000	2,289,234.940 (175,675,889)	
ユーロ	AEDIFICA	7,117.000	543,738.800	
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	61,371.000	767,137.500	
	ALTAREA	1,319.000	259,843.000	
	BEFIMMO	9,037.000	449,138.900	
	BENI STABILI SPA	404,511.000	305,810.310	
	COFINIMMO SA	8,232.000	880,824.000	
	COVIVIO	20,819.000	1,865,382.400	
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	15,926.000	487,972.640	
	GECINA SA	21,144.000	2,782,550.400	
	GREEN REIT PLC	258,537.000	371,776.200	
	HAMBORNER REIT AG	29,596.000	268,731.680	
	HIBERNIA REIT PLC	272,871.000	367,830.100	
	ICADE	17,452.000	1,314,135.600	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE	16,157.000	100,480.380	
	IMMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA	114,607.000	1,021,148.370	
	INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	5,418.000	125,155.800	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES REIT PLC	126,018.000	182,726.100	
	KLEPIERRE	80,038.000	2,481,178.000	

	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA	25,122.000	214,541.880	
	MERCIALYS	17,917.000	239,908.630	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	141,645.000	1,616,877.670	
	NSI NV	6,065.000	222,282.250	
	RETAIL ESTATES	2,767.000	200,607.500	
	UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	52,951.000	8,567,471.800	
	VASTNED RETAIL	6,633.000	232,486.650	
	WAREHOUSES DE PAUW	6,571.000	745,151.400	
	WERELDHAVE NV	15,784.000	477,466.000	
	ユーロ 小計	1,745,625.000	27,092,353.960 (3,493,829,967)	
	香港・ドル			
	CHAMPION REIT	612,070.000	3,231,729.600	
	FORTUNE REAL ESTATE (HK)	435,000.000	3,801,900.000	
	LINK REIT	675,020.000	48,601,440.000	
	PROSPERITY REIT	390,000.000	1,092,000.000	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	307,000.000	1,485,880.000	
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	430,000.000	2,128,500.000	
	香港・ドル 小計	2,849,090.000	60,341,449.600 (877,968,092)	
投資証券 合計		21,647,386	43,679,115,631 (43,679,115,631)	
合計			47,777,379,565 (47,777,379,565)	

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

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

通貨	銘柄数	組入 投資信託受益証券 時価比率	組入 投資証券 時価比率	有価証券の 合計金額 に対する比率
アメリカ・ドル	投資証券 158銘柄	-%	87.73%	74.26%
イギリス・ポンド	投資証券 27銘柄	-%	6.76%	5.72%
イスラエル・シケル	投資証券 1銘柄	-%	0.06%	0.05%
オーストラリア・ドル	投資信託受益証券 26銘柄	6.80%	-%	5.76%
カナダ・ドル	投資信託受益証券 1銘柄 投資証券 24銘柄	0.06% -%	-% 2.21%	1.92%
シンガポール・ドル	投資信託受益証券 29銘柄	3.27%	-%	2.77%
ニュージーランド・ドル	投資証券 6銘柄	-%	0.43%	0.37%
ユーロ	投資証券 27銘柄	-%	8.64%	7.31%
香港・ドル	投資証券 6銘柄	-%	2.17%	1.84%

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

「為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成30年11月12日現在
資産の部		
流動資産		
預金		3,781,337,330
コール・ローン		5,447,568,050
国債証券		276,679,398,399
派生商品評価勘定		107,084,438
未収入金		29,752,639,862
未収利息		1,902,228,541
前払費用		555,679,405
流動資産合計		318,225,936,025
資産合計		318,225,936,025
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		3,103,844,583
未払金		392,463,069
未払解約金		33,130,248,000
流動負債合計		36,626,555,652
負債合計		36,626,555,652
純資産の部		
元本等		
元本	1	215,528,334,101
剰余金		
剰余金又は欠損金()		66,071,046,272
元本等合計		281,599,380,373
純資産合計		281,599,380,373
負債純資産合計		318,225,936,025

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11月12日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額 同期中追加設定元本額 同期中一部解約元本額	225,184,908,433円 116,971,740,609円 126,628,314,941円
元本の内訳 ファンド名 たわらノーロード 先進国債券 <為替ヘッジあり> たわらノーロード バランス （堅実型） たわらノーロード バランス （標準型） たわらノーロード バランス （積極型） たわらノーロード スマートグ ローバルバランス（保守型） たわらノーロード スマートグ ローバルバランス（安定型） たわらノーロード スマートグ ローバルバランス（安定成長 型） たわらノーロード スマートグ ローバルバランス（成長型） たわらノーロード スマートグ ローバルバランス（積極型） たわらノーロード 最適化バラ ンス（保守型）	2,324,842,913円 29,341,696円 85,041,805円 59,471,335円 3,207,291円 81,449,431円 135,661,003円 44,874,141円 35,191,666円 661,162円

たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	848,368円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	5,049,798円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	1,594,228円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	1,908,762円
投資のソムリエ	37,595,981,529円
投資のソムリエ<DC年金>	3,326,395,750円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	2,347,355,110円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	43,017,391,075円
ワールドアセットバランス(基本コース)	5,467,871,663円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	14,035,146,179円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	4,857,279円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	3,545,626円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	13,514,378円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	7,573,955円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	6,589,414,795円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	283,833円
外国債券パッシブファンド2(為替フルヘッジ)(適格機関投資家限定)	8,816,175,202円
DIAM世界アセットバランスファンド2VA(適格機関投資家限定)	13,572,080,988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)	616,376,316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)	6,806,656,067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)	32,386,120,083円
DIAMバランス30VA(適格機関投資家限定)	27,402,148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)	28,982,284,010円
DIAMバランス20VA(適格機関投資家限定)	149,003,556円

D I A M世界アセットバランス ファンド7 V A (1 2 1 2) (適格機関投資家限定)	2,501,377,202円
D I A M世界アセットバランス ファンド7 V A (1 3 0 3) (適格機関投資家限定)	2,597,230,650円
D I A M世界アセットバランス ファンド7 V A (1 3 0 6) (適格機関投資家限定)	3,430,389,721円
D I A M世界アセットバランス ファンド7 V A (1 3 0 9) (適格機関投資家限定)	424,763,387円
計	215,528,334,101円
2 . 受益権の総数	215,528,334,101口

(金融商品に関する注記)

1 . 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成30年5月25日 至 平成30年11月12日
1 . 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2 . 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。
3 . 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成30年11月12日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
国債証券	4,039,294,768
合計	4,039,294,768

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

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	平成30年11月12日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売 建	310,072,365,528	-	313,069,125,673	2,996,760,145
アメリカ・ドル	143,481,325,639	-	144,846,546,005	1,365,220,366
イギリス・ポンド	20,903,222,878	-	21,303,270,478	400,047,600
オーストラリア・ドル	6,458,079,946	-	6,627,781,238	169,701,292
カナダ・ドル	6,406,348,492	-	6,434,848,879	28,500,387
シンガポール・ドル	974,634,041	-	988,750,665	14,116,624
スウェーデン・クローナ	885,630,611	-	899,248,416	13,617,805
デンマーク・クローネ	1,492,161,655	-	1,505,027,069	12,865,414
ノルウェー・クローネ	580,855,383	-	584,303,162	3,447,779
ポーランド・ズロチ	1,603,070,102	-	1,637,037,402	33,967,300
マレーシア・リンギット	1,152,033,597	-	1,156,626,900	4,593,303
メキシコ・ペソ	2,535,333,113	-	2,575,735,681	40,402,568
ユーロ	122,301,108,235	-	123,158,421,728	857,313,493
南アフリカ・ランド	1,298,561,836	-	1,351,528,050	52,966,214
合計	310,072,365,528	-	313,069,125,673	2,996,760,145

(注) 時価の算定方法

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

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

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

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

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

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成30年11月12日現在
1口当たり純資産額	1.3066円
(1万口当たり純資産額)	(13,066円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

平成30年11月12日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	US T N/B 1.125 03/31/20	11,000,000.000	10,739,520.000	
		US T N/B 1.125 06/30/21	10,000,000.000	9,535,900.000	
		US T N/B 1.125 07/31/21	13,900,000.000	13,229,881.000	
		US T N/B 1.125 08/31/21	11,000,000.000	10,452,530.000	
		US T N/B 1.125 09/30/21	430,000.000	408,027.000	
		US T N/B 1.125 12/31/19	14,500,000.000	14,229,720.000	
		US T N/B 1.25 01/31/20	4,490,000.000	4,405,632.900	
		US T N/B 1.25 02/29/20	4,200,000.000	4,114,824.000	
		US T N/B 1.25 07/31/23	8,400,000.000	7,741,104.000	
		US T N/B 1.25 10/31/21	10,500,000.000	9,983,190.000	
		US T N/B 1.375 02/29/20	6,420,000.000	6,300,074.400	
		US T N/B 1.375 03/31/20	7,620,000.000	7,466,990.400	
		US T N/B 1.375 04/30/20	11,510,000.000	11,264,491.700	
		US T N/B 1.375 04/30/21	10,000,000.000	9,624,200.000	
		US T N/B 1.375 05/31/20	12,010,000.000	11,735,931.800	
		US T N/B 1.375 05/31/21	12,350,000.000	11,868,473.500	
		US T N/B 1.375 06/30/23	550,000.000	510,554.000	
		US T N/B 1.375 08/31/23	9,500,000.000	8,794,150.000	
		US T N/B 1.375 09/30/20	21,520,000.000	20,914,642.400	
		US T N/B 1.375 09/30/23	9,000,000.000	8,320,770.000	
		US T N/B 1.375 10/31/20	10,000,000.000	9,703,900.000	
		US T N/B 1.5 06/15/20	13,000,000.000	12,721,150.000	
		US T N/B 1.5 08/15/26	9,800,000.000	8,692,894.000	
		US T N/B 1.625 02/15/26	7,080,000.000	6,388,000.800	
		US T N/B 1.625 04/30/23	9,800,000.000	9,222,682.000	
		US T N/B 1.625 05/15/26	9,000,000.000	8,091,540.000	
		US T N/B 1.625 05/31/23	1,460,000.000	1,372,283.200	
		US T N/B 1.625 07/31/20	19,250,000.000	18,836,317.500	
		US T N/B 1.625 08/31/22	3,280,000.000	3,116,000.000	
		US T N/B 1.625 11/15/22	1,120,000.000	1,060,796.800	
		US T N/B 1.625 11/30/20	10,000,000.000	9,739,800.000	
		US T N/B 1.625 12/31/19	18,850,000.000	18,602,499.500	
		US T N/B 1.75 02/28/22	10,500,000.000	10,088,925.000	
		US T N/B 1.75 05/15/22	1,250,000.000	1,197,600.000	
		US T N/B 1.75 05/15/23	5,000,000.000	4,730,050.000	
		US T N/B 1.75 05/31/22	9,490,000.000	9,088,098.500	
		US T N/B 1.75 06/30/22	15,000,000.000	14,348,400.000	
		US T N/B 1.75 09/30/22	15,600,000.000	14,871,168.000	
		US T N/B 1.75 11/30/21	1,380,000.000	1,330,182.000	
		US T N/B 1.75 12/31/20	12,590,000.000	12,283,055.800	

US T N/B 1.875 01/31/22	6,840,000.000	6,604,293.600	
US T N/B 1.875 02/28/22	2,440,000.000	2,353,624.000	
US T N/B 1.875 03/31/22	13,300,000.000	12,814,683.000	
US T N/B 1.875 09/30/22	14,770,000.000	14,149,069.200	
US T N/B 1.875 12/31/19	20,000.000	19,791.400	
US T N/B 2.0 02/15/22	10,000,000.000	9,691,400.000	
US T N/B 2.0 02/15/23	14,000,000.000	13,423,480.000	
US T N/B 2.0 02/15/25	8,600,000.000	8,062,500.000	
US T N/B 2.0 05/31/21	11,560,000.000	11,285,450.000	
US T N/B 2.0 06/30/24	210,000.000	198,382.800	
US T N/B 2.0 07/31/20	12,600,000.000	12,406,968.000	
US T N/B 2.0 08/15/25	11,600,000.000	10,809,692.000	
US T N/B 2.0 08/31/21	7,060,000.000	6,873,263.000	
US T N/B 2.0 09/30/20	12,660,000.000	12,446,299.200	
US T N/B 2.0 10/31/22	4,280,000.000	4,116,118.800	
US T N/B 2.0 11/15/21	7,900,000.000	7,676,193.000	
US T N/B 2.0 11/15/26	8,900,000.000	8,174,027.000	
US T N/B 2.0 11/30/22	12,020,000.000	11,551,340.200	
US T N/B 2.0 12/31/21	14,720,000.000	14,282,963.200	
US T N/B 2.125 03/31/24	10,500,000.000	10,012,695.000	
US T N/B 2.125 05/15/25	8,400,000.000	7,913,052.000	
US T N/B 2.125 07/31/24	2,100,000.000	1,995,315.000	
US T N/B 2.125 08/15/21	9,590,000.000	9,373,074.200	
US T N/B 2.125 08/31/20	11,660,000.000	11,497,809.400	
US T N/B 2.125 09/30/21	9,800,000.000	9,566,466.000	
US T N/B 2.125 09/30/24	2,720,000.000	2,579,947.200	
US T N/B 2.125 11/30/23	10,290,000.000	9,844,545.900	
US T N/B 2.125 11/30/24	3,970,000.000	3,758,438.700	
US T N/B 2.125 12/31/21	7,000,000.000	6,818,420.000	
US T N/B 2.125 12/31/22	13,500,000.000	13,024,260.000	
US T N/B 2.25 01/31/24	3,780,000.000	3,632,617.800	
US T N/B 2.25 02/15/27	10,300,000.000	9,620,818.000	
US T N/B 2.25 03/31/21	11,920,000.000	11,726,300.000	
US T N/B 2.25 08/15/27	10,030,000.000	9,320,778.700	
US T N/B 2.25 08/15/46	6,000,000.000	4,765,260.000	
US T N/B 2.25 10/31/24	4,560,000.000	4,351,927.200	
US T N/B 2.25 11/15/24	12,600,000.000	12,016,242.000	
US T N/B 2.25 11/15/25	10,800,000.000	10,206,000.000	
US T N/B 2.25 11/15/27	7,610,000.000	7,057,666.200	
US T N/B 2.25 12/31/23	9,550,000.000	9,185,094.500	
US T N/B 2.25 12/31/24	4,530,000.000	4,315,504.500	
US T N/B 2.375 01/31/23	2,760,000.000	2,688,184.800	
US T N/B 2.375 05/15/27	9,600,000.000	9,036,672.000	
US T N/B 2.375 08/15/24	12,610,000.000	12,139,016.500	
US T N/B 2.5 01/31/25	2,980,000.000	2,879,872.000	
US T N/B 2.5 02/15/45	4,960,000.000	4,190,803.200	
US T N/B 2.5 02/15/46	5,600,000.000	4,709,656.000	
US T N/B 2.5 03/31/23	6,720,000.000	6,571,891.200	
US T N/B 2.5 05/15/24	10,790,000.000	10,478,924.300	

US T N/B 2.5 05/15/46	4,870,000.000	4,090,800.000	
US T N/B 2.5 08/15/23	6,700,000.000	6,537,726.000	
US T N/B 2.625 02/28/23	1,190,000.000	1,170,567.300	
US T N/B 2.625 03/31/25	2,400,000.000	2,333,616.000	
US T N/B 2.625 06/30/23	2,650,000.000	2,602,565.000	
US T N/B 2.625 08/15/20	13,350,000.000	13,282,182.000	
US T N/B 2.625 08/31/20	12,790,000.000	12,724,515.200	
US T N/B 2.625 11/15/20	11,860,000.000	11,785,875.000	
US T N/B 2.75 02/15/24	11,930,000.000	11,752,839.500	
US T N/B 2.75 02/15/28	10,150,000.000	9,796,272.500	
US T N/B 2.75 02/28/25	6,290,000.000	6,164,640.300	
US T N/B 2.75 04/30/23	10,670,000.000	10,541,533.200	
US T N/B 2.75 05/31/23	3,880,000.000	3,833,905.600	
US T N/B 2.75 06/30/25	8,100,000.000	7,923,420.000	
US T N/B 2.75 07/31/23	2,100,000.000	2,073,078.000	
US T N/B 2.75 08/15/42	3,220,000.000	2,885,667.400	
US T N/B 2.75 08/15/47	5,850,000.000	5,162,625.000	
US T N/B 2.75 08/31/23	7,030,000.000	6,941,000.200	
US T N/B 2.75 08/31/25	9,040,000.000	8,835,876.800	
US T N/B 2.75 09/15/21	2,960,000.000	2,940,227.200	
US T N/B 2.75 11/15/23	7,000,000.000	6,904,800.000	
US T N/B 2.75 11/15/42	4,500,000.000	4,027,500.000	
US T N/B 2.75 11/15/47	6,690,000.000	5,894,492.100	
US T N/B 2.875 04/30/25	4,220,000.000	4,163,283.200	
US T N/B 2.875 05/15/28	8,420,000.000	8,205,542.600	
US T N/B 2.875 05/15/43	5,150,000.000	4,707,409.000	
US T N/B 2.875 05/31/25	4,550,000.000	4,486,345.500	
US T N/B 2.875 07/31/25	2,720,000.000	2,680,260.800	
US T N/B 2.875 08/15/28	11,120,000.000	10,826,320.800	
US T N/B 2.875 08/15/45	5,230,000.000	4,752,762.500	
US T N/B 2.875 11/15/46	6,200,000.000	5,619,184.000	
US T N/B 3.0 02/15/47	6,000,000.000	5,574,840.000	
US T N/B 3.0 02/15/48	6,450,000.000	5,975,796.000	
US T N/B 3.0 05/15/42	2,310,000.000	2,167,426.800	
US T N/B 3.0 05/15/45	6,200,000.000	5,777,594.000	
US T N/B 3.0 05/15/47	5,920,000.000	5,500,035.200	
US T N/B 3.0 08/15/48	5,650,000.000	5,235,064.000	
US T N/B 3.0 10/31/25	6,560,000.000	6,510,800.000	
US T N/B 3.0 11/15/44	6,500,000.000	6,063,785.000	
US T N/B 3.0 11/15/45	8,640,000.000	8,043,235.200	
US T N/B 3.125 02/15/42	2,760,000.000	2,648,082.000	
US T N/B 3.125 02/15/43	3,680,000.000	3,518,116.800	
US T N/B 3.125 05/15/21	100,000.000	100,363.000	
US T N/B 3.125 05/15/48	5,860,000.000	5,565,593.600	
US T N/B 3.125 08/15/44	6,260,000.000	5,975,796.000	
US T N/B 3.125 11/15/41	2,350,000.000	2,256,352.500	
US T N/B 3.375 05/15/44	6,300,000.000	6,287,652.000	
US T N/B 3.5 02/15/39	2,150,000.000	2,207,598.500	
US T N/B 3.625 02/15/20	19,500,000.000	19,686,615.000	

US T N/B 3.625 02/15/21	2,010,000.000	2,039,285.700	
US T N/B 3.625 02/15/44	7,940,000.000	8,256,329.600	
US T N/B 3.625 08/15/43	4,100,000.000	4,260,146.000	
US T N/B 3.75 08/15/41	1,730,000.000	1,835,149.400	
US T N/B 3.75 11/15/43	7,740,000.000	8,209,198.800	
US T N/B 3.875 08/15/40	2,450,000.000	2,645,804.000	
US T N/B 4.25 05/15/39	1,790,000.000	2,034,997.300	
US T N/B 4.25 11/15/40	3,650,000.000	4,153,846.000	
US T N/B 4.375 02/15/38	1,210,000.000	1,395,747.100	
US T N/B 4.375 05/15/40	2,320,000.000	2,682,314.400	
US T N/B 4.375 05/15/41	2,100,000.000	2,434,677.000	
US T N/B 4.375 11/15/39	2,000,000.000	2,311,700.000	
US T N/B 4.5 02/15/36	2,180,000.000	2,534,250.000	
US T N/B 4.5 05/15/38	840,000.000	984,832.800	
US T N/B 4.5 08/15/39	2,000,000.000	2,348,120.000	
US T N/B 4.625 02/15/40	3,370,000.000	4,023,173.400	
US T N/B 4.75 02/15/41	2,600,000.000	3,166,514.000	
US T N/B 5.0 05/15/37	890,000.000	1,101,855.600	
US T N/B 5.25 02/15/29	830,000.000	977,325.000	
US T N/B 5.25 11/15/28	1,700,000.000	1,996,429.000	
US T N/B 5.375 02/15/31	2,300,000.000	2,800,779.000	
US T N/B 5.5 08/15/28	930,000.000	1,109,090.100	
US T N/B 6.0 02/15/26	800,000.000	949,744.000	
US T N/B 6.125 11/15/27	2,050,000.000	2,521,008.000	
US T N/B 6.25 05/15/30	1,200,000.000	1,549,020.000	
US T N/B 6.25 08/15/23	1,200,000.000	1,369,968.000	
US T N/B 6.5 11/15/26	500,000.000	618,905.000	
US T N/B 8.0 11/15/21	2,100,000.000	2,401,791.000	
アメリカ・ドル 小計	1,153,610,000.000 (131,442,323,400)	1,116,796,319.400 (127,247,772,632)	
イギリス・ポンド			
UK TREASURY 0.5 07/22/22	6,750,000.000	6,640,110.000	
UK TREASURY 0.75 07/22/23	4,080,000.000	4,018,759.200	
UK TREASURY 1.25 07/22/27	2,200,000.000	2,172,720.000	
UK TREASURY 1.5 01/22/21	4,310,000.000	4,374,520.700	
UK TREASURY 1.5 07/22/26	2,850,000.000	2,893,149.000	
UK TREASURY 1.5 07/22/47	3,310,000.000	2,996,212.000	
UK TREASURY 1.625 10/22/28	3,000,000.000	3,035,190.000	
UK TREASURY 1.625 10/22/71	1,450,000.000	1,350,022.500	
UK TREASURY 1.75 07/22/57	1,960,000.000	1,901,788.000	

UK TREASURY 1.75 09/07/22	3,840,000.000	3,951,744.000	
UK TREASURY 1.75 09/07/37	2,060,000.000	2,013,444.000	
UK TREASURY 2.0 07/22/20	2,030,000.000	2,071,412.000	
UK TREASURY 2.0 09/07/25	3,130,000.000	3,291,914.900	
UK TREASURY 2.25 09/07/23	1,970,000.000	2,079,532.000	
UK TREASURY 2.5 07/22/65	2,580,000.000	3,120,535.800	
UK TREASURY 2.75 09/07/24	2,500,000.000	2,724,950.000	
UK TREASURY 3.25 01/22/44	3,150,000.000	3,957,660.000	
UK TREASURY 3.5 01/22/45	4,560,000.000	5,995,944.000	
UK TREASURY 3.5 07/22/68	2,930,000.000	4,506,047.000	
UK TREASURY 3.75 07/22/52	2,170,000.000	3,176,446.000	
UK TREASURY 3.75 09/07/20	3,050,000.000	3,212,839.500	
UK TREASURY 3.75 09/07/21	2,200,000.000	2,376,990.000	
UK TREASURY 4.0 01/22/60	2,170,000.000	3,515,183.000	
UK TREASURY 4.0 03/07/22	2,350,000.000	2,588,078.500	
UK TREASURY 4.25 03/07/36	2,470,000.000	3,356,236.000	
UK TREASURY 4.25 06/07/32	2,440,000.000	3,196,888.000	
UK TREASURY 4.25 09/07/39	2,250,000.000	3,158,325.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/27	2,050,000.000	2,553,377.500	
UK TREASURY 4.25 12/07/40	2,820,000.000	4,006,092.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/46	2,690,000.000	4,026,392.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/49	2,130,000.000	3,292,554.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/55	3,050,000.000	4,984,615.000	
UK TREASURY 4.5 09/07/34	2,850,000.000	3,915,615.000	
UK TREASURY 4.5 12/07/42	1,970,000.000	2,944,953.000	

	UK TREASURY 4.75 12/07/30	2,320,000.000	3,123,880.000	
	UK TREASURY 4.75 12/07/38	2,530,000.000	3,747,183.000	
	UK TREASURY 5.0 03/07/25	2,200,000.000	2,710,422.000	
	UK TREASURY 6.0 12/07/28	1,450,000.000	2,070,165.000	
	UK TREASURY 8.0 06/07/21	1,520,000.000	1,797,156.800	
イギリス・ポンド 小計		105,340,000.000 (15,526,062,600)	126,849,046.400 (18,696,280,949)	
オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN 5.75 05/15/21	5,340,000.000	5,811,895.800	
	AUSTRALIAN 1.75 11/21/20	4,500,000.000	4,470,120.000	
	AUSTRALIAN 2.0 12/21/21	2,700,000.000	2,685,744.000	
	AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	4,120,000.000	3,952,728.000	
	AUSTRALIAN 2.25 11/21/22	2,190,000.000	2,188,335.600	
	AUSTRALIAN 2.75 04/21/24	4,000,000.000	4,063,640.000	
	AUSTRALIAN 2.75 05/21/41	590,000.000	545,856.200	
	AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	1,100,000.000	1,059,520.000	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	4,610,000.000	4,608,109.900	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/28	3,590,000.000	3,587,451.100	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/29	1,420,000.000	1,414,987.400	
	AUSTRALIAN 3.0 03/21/47	2,040,000.000	1,941,590.400	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	2,750,000.000	2,865,555.000	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	4,560,000.000	4,761,369.600	
	AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	1,330,000.000	1,350,601.700	
	AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	2,010,000.000	2,196,930.000	
	AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	5,250,000.000	5,827,080.000	
	AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	2,220,000.000	2,630,700.000	
	AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	4,750,000.000	5,487,105.000	
	AUSTRALIAN 5.5 04/21/23	3,820,000.000	4,331,918.200	
AUSTRALIAN 5.75 07/15/22	3,890,000.000	4,373,643.700		

オーストラリア・ドル 小計		66,780,000.000 (5,495,326,200)	70,154,881.600 (5,773,045,207)	
カナダ・ドル	CANADA 8.0 06/01/27	900,000.000	1,279,017.000	
	CANADA 0.5 03/01/22	2,280,000.000	2,144,203.200	
	CANADA 0.75 03/01/21	5,890,000.000	5,681,140.600	
	CANADA 0.75 09/01/20	4,600,000.000	4,474,006.000	
	CANADA 0.75 09/01/21	2,790,000.000	2,668,328.100	
	CANADA 1.0 06/01/27	2,160,000.000	1,913,004.000	
	CANADA 1.0 09/01/22	2,300,000.000	2,183,091.000	
	CANADA 1.5 06/01/23	2,200,000.000	2,113,342.000	
	CANADA 1.5 06/01/26	2,060,000.000	1,921,341.400	
	CANADA 1.75 03/01/23	1,910,000.000	1,858,143.500	
	CANADA 1.75 05/01/20	1,520,000.000	1,508,569.600	
	CANADA 1.75 08/01/20	1,940,000.000	1,921,589.400	
	CANADA 2.0 06/01/28	2,220,000.000	2,125,405.800	
	CANADA 2.0 09/01/23	2,820,000.000	2,765,433.000	
	CANADA 2.0 12/01/51	540,000.000	477,138.600	
	CANADA 2.25 06/01/25	2,190,000.000	2,160,040.800	
	CANADA 2.25 06/01/29	810,000.000	790,495.200	
	CANADA 2.5 06/01/24	2,250,000.000	2,255,197.500	
	CANADA 2.75 06/01/22	1,850,000.000	1,871,737.500	
	CANADA 2.75 12/01/48	1,840,000.000	1,926,664.000	
	CANADA 2.75 12/01/64	770,000.000	824,747.000	
	CANADA 3.25 06/01/21	2,400,000.000	2,452,512.000	
	CANADA 3.5 06/01/20	2,000,000.000	2,036,960.000	
CANADA 3.5 12/01/45	2,820,000.000	3,345,760.800		
CANADA 4.0 06/01/41	2,480,000.000	3,097,073.600		
CANADA 5.0 06/01/37	1,510,000.000	2,057,541.100		
CANADA 5.75 06/01/29	1,700,000.000	2,206,260.000		
CANADA 5.75 06/01/33	1,850,000.000	2,570,612.000		
カナダ・ドル 小計		60,600,000.000 (5,232,204,000)	62,629,354.700 (5,407,418,485)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE 1.25 10/01/21	800,000.000	780,080.000	
	SINGAPORE 1.75 02/01/23	270,000.000	264,789.000	
	SINGAPORE 1.75 04/01/22	300,000.000	295,560.000	
	SINGAPORE 2.125 06/01/26	500,000.000	489,250.000	
	SINGAPORE 2.25 06/01/21	800,000.000	801,520.000	
	SINGAPORE 2.25 08/01/36	420,000.000	387,072.000	
	SINGAPORE 2.375 06/01/25	500,000.000	499,400.000	
	SINGAPORE 2.625 05/01/28	500,000.000	504,950.000	
	SINGAPORE 2.75 03/01/46	900,000.000	873,000.000	
	SINGAPORE 2.75 04/01/42	760,000.000	742,140.000	
	SINGAPORE 2.75 07/01/23	1,280,000.000	1,305,024.000	
	SINGAPORE 2.875 07/01/29	200,000.000	205,300.000	

	SINGAPORE 2.875 09/01/30	610,000.000	624,030.000	
	SINGAPORE 3.0 09/01/24	570,000.000	589,950.000	
	SINGAPORE 3.125 09/01/22	1,200,000.000	1,239,240.000	
	SINGAPORE 3.375 09/01/33	680,000.000	729,232.000	
	SINGAPORE 3.5 03/01/27	1,260,000.000	1,358,028.000	
シンガポール・ドル 小計		11,550,000.000 (954,261,000)	11,688,565.000 (965,709,240)	
スウェーデン・クローナ	SWEDEN 0.75 05/12/28	8,540,000.000	8,620,276.000	
	SWEDEN 1.0 11/12/26	9,290,000.000	9,664,479.900	
	SWEDEN 1.5 11/13/23	12,920,000.000	13,822,203.600	
	SWEDEN 2.5 05/12/25	6,740,000.000	7,693,844.800	
	SWEDEN 3.5 03/30/39	7,610,000.000	10,532,240.000	
	SWEDEN 3.5 06/01/22	17,760,000.000	20,048,020.800	
スウェーデン・クローナ 小計		62,860,000.000 (788,264,400)	70,381,065.100 (882,578,556)	
デンマーク・クローネ	DENMARK 0.5 11/15/27	14,860,000.000	15,052,139.800	
	DENMARK 1.5 11/15/23	8,570,000.000	9,280,453.000	
	DENMARK 1.75 11/15/25	10,420,000.000	11,611,006.000	
	DENMARK 4.5 11/15/39	21,610,000.000	36,952,667.800	
デンマーク・クローネ 小計		55,460,000.000 (958,903,400)	72,896,266.600 (1,260,376,450)	
ノルウェー・クローネ	NORWAY 1.5 02/19/26	5,610,000.000	5,484,336.000	
	NORWAY 1.75 02/17/27	7,030,000.000	6,946,413.300	
	NORWAY 1.75 03/13/25	5,990,000.000	5,985,447.600	
	NORWAY 2.0 04/26/28	2,820,000.000	2,821,889.400	
	NORWAY 2.0 05/24/23	9,380,000.000	9,555,312.200	
	NORWAY 3.0 03/14/24	9,430,000.000	10,067,185.100	
ノルウェー・クローネ 小計		40,260,000.000 (543,510,000)	40,860,583.600 (551,617,879)	
ポーランド・ズロチ	POLAND 07/25/20	1,500,000.000	1,464,825.000	
	POLAND 1.75 07/25/21	4,500,000.000	4,504,050.000	
	POLAND 2.0 04/25/21	4,000,000.000	4,029,200.000	
	POLAND 2.25 04/25/22	2,350,000.000	2,365,275.000	
	POLAND 2.5 01/25/23	2,640,000.000	2,656,632.000	
	POLAND 2.5 07/25/26	5,520,000.000	5,327,628.000	
	POLAND 2.5 07/25/27	4,890,000.000	4,654,644.300	
	POLAND 2.75 04/25/28	3,010,000.000	2,900,887.500	
	POLAND 3.25 07/25/25	4,790,000.000	4,903,762.500	
	POLAND 4.0 10/25/23	4,070,000.000	4,362,429.500	
	POLAND 5.25 10/25/20	2,880,000.000	3,084,768.000	
	POLAND 5.75 04/25/29	1,800,000.000	2,204,640.000	
	POLAND 5.75 09/23/22	3,380,000.000	3,821,495.600	
	POLAND 5.75 10/25/21	2,690,000.000	2,993,028.500	
ポーランド・ズロチ 小計		48,020,000.000 (1,443,961,400)	49,273,265.900 (1,481,647,106)	
マレーシア・リングギット	MALAYSIA 3.418 08/15/22	5,000,000.000	4,929,200.000	

	MALAYSIA 3.48 03/15/23	3,910,000.000	3,856,980.400	
	MALAYSIA 3.502 05/31/27	4,580,000.000	4,347,336.000	
	MALAYSIA 3.844 04/15/33	1,340,000.000	1,233,443.200	
	MALAYSIA 3.9 11/30/26	1,500,000.000	1,472,040.000	
	MALAYSIA 4.127 04/15/32	1,180,000.000	1,129,448.800	
	MALAYSIA 4.16 07/15/21	6,460,000.000	6,544,496.800	
	MALAYSIA 4.181 07/15/24	2,190,000.000	2,211,549.600	
	MALAYSIA 4.232 06/30/31	2,000,000.000	1,944,940.000	
	MALAYSIA 4.378 11/29/19	5,160,000.000	5,206,698.000	
	MALAYSIA 4.392 04/15/26	1,480,000.000	1,504,775.200	
	MALAYSIA 4.498 04/15/30	2,820,000.000	2,829,024.000	
	MALAYSIA 4.935 09/30/43	3,470,000.000	3,470,902.200	
	MALAYSIA 5.248 09/15/28	1,480,000.000	1,588,380.400	
マレーシア・リンギット 小計		42,570,000.000 (1,159,606,800)	42,269,214.600 (1,151,413,406)	
メキシコ・ペソ	MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	13,880,000.000	15,086,033.200	
	MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	66,505,000.000	70,446,086.300	
	MEXICAN BONDS 5.75 03/05/26	24,224,000.000	20,316,184.320	
	MEXICAN BONDS 6.5 06/09/22	42,000,000.000	39,264,960.000	
	MEXICAN BONDS 6.5 06/10/21	47,648,000.000	45,320,395.200	
	MEXICAN BONDS 7.25 12/09/21	11,110,000.000	10,690,708.600	
	MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	37,069,000.000	34,063,445.480	
	MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	21,054,000.000	19,111,979.040	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	38,302,000.000	33,330,783.420	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	16,399,000.000	14,628,891.940	
	MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47	11,366,000.000	10,102,100.800	
	MEXICAN BONDS 8.0 12/07/23	22,730,000.000	22,124,018.200	
	MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	16,000,000.000	15,559,360.000	
	MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	17,526,000.000	16,616,225.340	
メキシコ・ペソ 小計		385,813,000.000 (2,187,559,710)	366,661,171.840 (2,078,968,844)	
ユーロ	AUSTRIA 0.5 04/20/27	2,300,000.000	2,296,895.000	
	AUSTRIA 0.75 02/20/28	760,000.000	769,355.600	
	AUSTRIA 0.75 10/20/26	1,700,000.000	1,743,214.000	
	AUSTRIA 07/15/23	2,330,000.000	2,336,640.500	
	AUSTRIA 09/20/22	800,000.000	806,984.000	

AUSTRIA 1.2 10/20/25	1,100,000.000	1,170,763.000	
AUSTRIA 1.5 02/20/47	760,000.000	774,212.000	
AUSTRIA 1.5 11/02/86	340,000.000	310,573.000	
AUSTRIA 1.65 10/21/24	1,580,000.000	1,725,170.400	
AUSTRIA 1.75 10/20/23	1,820,000.000	1,983,436.000	
AUSTRIA 2.1 09/20/17	730,000.000	816,797.000	
AUSTRIA 2.4 05/23/34	1,190,000.000	1,416,504.600	
AUSTRIA 3.15 06/20/44	1,460,000.000	2,041,664.000	
AUSTRIA 3.65 04/20/22	1,270,000.000	1,444,244.000	
AUSTRIA 3.8 01/26/62	540,000.000	926,035.200	
AUSTRIA 3.9 07/15/20	2,450,000.000	2,633,995.000	
AUSTRIA 4.15 03/15/37	1,730,000.000	2,587,388.000	
AUSTRIA 4.85 03/15/26	1,400,000.000	1,863,512.000	
AUSTRIA 6.25 07/15/27	1,160,000.000	1,726,926.800	
BELGIUM 0.2 10/22/23	1,070,000.000	1,076,955.000	
BELGIUM 0.5 10/22/24	1,500,000.000	1,521,660.000	
BELGIUM 0.8 06/22/25	2,430,000.000	2,498,671.800	
BELGIUM 0.8 06/22/27	2,050,000.000	2,068,593.500	
BELGIUM 0.8 06/22/28	1,370,000.000	1,367,095.600	
BELGIUM 1.0 06/22/26	2,050,000.000	2,120,971.000	
BELGIUM 1.0 06/22/31	1,500,000.000	1,485,150.000	
BELGIUM 1.25 04/22/33	700,000.000	702,065.000	
BELGIUM 1.45 06/22/37	600,000.000	596,646.000	
BELGIUM 1.6 06/22/47	1,570,000.000	1,515,489.600	
BELGIUM 1.9 06/22/38	1,220,000.000	1,303,021.000	
BELGIUM 2.15 06/22/66	640,000.000	655,040.000	
BELGIUM 2.25 06/22/23	1,850,000.000	2,047,524.500	
BELGIUM 2.25 06/22/57	810,000.000	869,429.700	
BELGIUM 2.6 06/22/24	2,260,000.000	2,565,439.000	
BELGIUM 3.0 06/22/34	1,200,000.000	1,488,756.000	
BELGIUM 3.75 06/22/45	1,480,000.000	2,135,536.400	
BELGIUM 3.75 09/28/20	2,500,000.000	2,701,550.000	
BELGIUM 4.0 03/28/22	2,130,000.000	2,439,787.200	
BELGIUM 4.0 03/28/32	1,550,000.000	2,107,457.500	
BELGIUM 4.25 03/28/41	1,240,000.000	1,866,621.600	
BELGIUM 4.25 09/28/21	2,400,000.000	2,721,504.000	
BELGIUM 4.25 09/28/22	2,300,000.000	2,698,153.000	
BELGIUM 4.5 03/28/26	1,500,000.000	1,938,975.000	
BELGIUM 5.0 03/28/35	3,960,000.000	6,108,498.000	
BELGIUM 5.5 03/28/28	3,370,000.000	4,827,255.400	
BUNDESABL 0.25 10/16/20	3,000,000.000	3,050,250.000	
BUNDESABL 04/08/22	2,500,000.000	2,535,750.000	
BUNDESABL 04/09/21	2,850,000.000	2,888,190.000	
BUNDESABL 04/14/23	2,960,000.000	2,994,720.800	
BUNDESABL 04/17/20	2,950,000.000	2,978,969.000	
BUNDESABL 10/07/22	3,000,000.000	3,040,680.000	
BUNDESABL 10/08/21	3,400,000.000	3,448,926.000	
BUNDESSCHAT 06/12/20	4,950,000.000	5,000,638.500	
BUNDESSCHAT 12/13/19	4,000,000.000	4,029,160.000	

DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27	3,800,000.000	3,805,966.000	
DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28	760,000.000	748,638.000	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25	3,440,000.000	3,548,807.200	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26	4,000,000.000	4,113,320.000	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28	3,330,000.000	3,376,786.500	
DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27	4,490,000.000	4,573,648.700	
DEUTSCHLAND 08/15/26	3,770,000.000	3,721,027.700	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/24	3,100,000.000	3,292,045.000	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25	1,820,000.000	1,937,208.000	
DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48	1,530,000.000	1,610,799.300	
DEUTSCHLAND 1.5 02/15/23	3,100,000.000	3,339,382.000	
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/23	3,070,000.000	3,315,630.700	
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/24	2,600,000.000	2,831,140.000	
DEUTSCHLAND 1.5 09/04/22	3,300,000.000	3,536,775.000	
DEUTSCHLAND 1.75 02/15/24	2,090,000.000	2,299,000.000	
DEUTSCHLAND 1.75 07/04/22	3,350,000.000	3,613,712.000	
DEUTSCHLAND 2.0 01/04/22	2,700,000.000	2,910,627.000	
DEUTSCHLAND 2.0 08/15/23	2,900,000.000	3,208,850.000	
DEUTSCHLAND 2.25 09/04/20	3,000,000.000	3,157,860.000	
DEUTSCHLAND 2.25 09/04/21	2,700,000.000	2,911,113.000	
DEUTSCHLAND 2.5 01/04/21	2,200,000.000	2,347,400.000	
DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	4,250,000.000	5,713,402.500	
DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	3,880,000.000	5,279,593.600	
DEUTSCHLAND 3.0 07/04/20	3,200,000.000	3,393,280.000	
DEUTSCHLAND 3.25 01/04/20	2,300,000.000	2,405,731.000	

DEUTSCHLAND 3.25 07/04/21	2,490,000.000	2,740,643.400	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	2,330,000.000	3,483,186.900	
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	2,380,000.000	3,674,505.800	
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	2,100,000.000	3,452,820.000	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	1,800,000.000	2,552,220.000	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	3,040,000.000	4,869,684.800	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	2,400,000.000	4,246,224.000	
DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	2,600,000.000	4,129,606.000	
DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	3,660,000.000	5,421,960.600	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/24	1,180,000.000	1,571,016.600	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	1,400,000.000	2,285,444.000	
DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	1,670,000.000	2,566,656.400	
FINLAND 0.375 09/15/20	1,150,000.000	1,169,515.500	
FINLAND 0.5 04/15/26	730,000.000	736,708.700	
FINLAND 0.5 09/15/27	600,000.000	597,108.000	
FINLAND 0.75 04/15/31	750,000.000	739,507.500	
FINLAND 0.875 09/15/25	450,000.000	468,517.500	
FINLAND 04/15/22	770,000.000	777,615.300	
FINLAND 09/15/23	750,000.000	751,905.000	
FINLAND 1.125 04/15/34	480,000.000	487,761.600	
FINLAND 1.5 04/15/23	830,000.000	889,967.500	
FINLAND 2.0 04/15/24	700,000.000	774,466.000	
FINLAND 2.625 07/04/42	780,000.000	1,020,318.000	
FINLAND 2.75 07/04/28	700,000.000	839,083.000	
FINLAND 3.375 04/15/20	8,020,000.000	8,474,493.400	
FINLAND 3.5 04/15/21	340,000.000	372,796.400	
FINLAND 4.0 07/04/25	740,000.000	923,771.600	
FRANCE BTAN 8.5 04/25/23	1,480,000.000	2,047,432.000	
FRANCE OAT 0.25 11/25/20	4,300,000.000	4,363,511.000	
FRANCE OAT 0.25 11/25/26	4,400,000.000	4,311,032.000	
FRANCE OAT 0.5 05/25/25	5,500,000.000	5,580,685.000	
FRANCE OAT 0.5 05/25/26	5,000,000.000	5,025,050.000	
FRANCE OAT 0.75 05/25/28	5,470,000.000	5,483,128.000	

FRANCE OAT 0.75 11/25/28	940,000.000	936,681.800	
FRANCE OAT 02/25/20	4,210,000.000	4,241,238.200	
FRANCE OAT 02/25/21	2,400,000.000	2,422,248.000	
FRANCE OAT 03/25/23	2,800,000.000	2,808,176.000	
FRANCE OAT 03/25/24	950,000.000	943,597.000	
FRANCE OAT 05/25/20	5,400,000.000	5,445,900.000	
FRANCE OAT 05/25/21	4,160,000.000	4,201,808.000	
FRANCE OAT 05/25/22	5,500,000.000	5,544,825.000	
FRANCE OAT 1.0 05/25/27	5,000,000.000	5,171,250.000	
FRANCE OAT 1.0 11/25/25	5,200,000.000	5,433,376.000	
FRANCE OAT 1.25 05/25/34	500,000.000	504,340.000	
FRANCE OAT 1.25 05/25/36	3,600,000.000	3,569,760.000	
FRANCE OAT 1.5 05/25/31	4,920,000.000	5,209,050.000	
FRANCE OAT 1.75 05/25/23	3,920,000.000	4,243,478.400	
FRANCE OAT 1.75 05/25/66	1,450,000.000	1,399,003.500	
FRANCE OAT 1.75 06/25/39	1,500,000.000	1,591,185.000	
FRANCE OAT 1.75 11/25/24	5,600,000.000	6,126,288.000	
FRANCE OAT 2.0 05/25/48	3,510,000.000	3,780,199.800	
FRANCE OAT 2.25 05/25/24	5,400,000.000	6,038,550.000	
FRANCE OAT 2.25 10/25/22	4,900,000.000	5,369,518.000	
FRANCE OAT 2.5 05/25/30	4,850,000.000	5,697,392.000	
FRANCE OAT 2.5 10/25/20	4,300,000.000	4,552,797.000	
FRANCE OAT 2.75 10/25/27	8,030,000.000	9,526,792.000	
FRANCE OAT 3.0 04/25/22	6,220,000.000	6,922,611.200	
FRANCE OAT 3.25 05/25/45	3,850,000.000	5,256,482.000	
FRANCE OAT 3.25 10/25/21	6,000,000.000	6,640,020.000	
FRANCE OAT 3.5 04/25/20	3,020,000.000	3,197,727.000	
FRANCE OAT 3.5 04/25/26	4,240,000.000	5,216,896.000	
FRANCE OAT 3.75 04/25/21	5,510,000.000	6,074,664.800	
FRANCE OAT 4.0 04/25/55	2,250,000.000	3,608,550.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/60	2,440,000.000	4,010,042.400	
FRANCE OAT 4.0 10/25/38	4,510,000.000	6,626,452.800	
FRANCE OAT 4.25 10/25/23	6,320,000.000	7,656,174.400	
FRANCE OAT 4.5 04/25/41	5,850,000.000	9,305,770.500	
FRANCE OAT 4.75 04/25/35	5,400,000.000	8,298,558.000	

FRANCE OAT 5.5 04/25/29	5,620,000.000	8,294,839.000	
FRANCE OAT 5.75 10/25/32	5,000,000.000	8,071,450.000	
FRANCE OAT 6.0 10/25/25	2,220,000.000	3,088,619.400	
IRISH 0.8 03/15/22	720,000.000	742,903.200	
IRISH 0.9 05/15/28	860,000.000	854,074.600	
IRISH 1.0 05/15/26	1,090,000.000	1,114,307.000	
IRISH 1.3 05/15/33	740,000.000	725,999.200	
IRISH 1.7 05/15/37	930,000.000	940,629.900	
IRISH 2.0 02/18/45	1,350,000.000	1,412,451.000	
IRISH 2.4 05/15/30	1,490,000.000	1,681,837.500	
IRISH 3.4 03/18/24	1,120,000.000	1,307,376.000	
IRISH 3.9 03/20/23	950,000.000	1,109,742.500	
IRISH 4.5 04/18/20	1,570,000.000	1,683,040.000	
IRISH 5.0 10/18/20	2,710,000.000	2,998,886.000	
IRISH 5.4 03/13/25	2,460,000.000	3,213,325.800	
ITALY BTPS 0.05 04/15/21	950,000.000	917,434.000	
ITALY BTPS 0.2 10/15/20	2,500,000.000	2,453,350.000	
ITALY BTPS 0.35 06/15/20	3,600,000.000	3,566,520.000	
ITALY BTPS 0.35 11/01/21	10,200,000.000	9,795,978.000	
ITALY BTPS 0.45 06/01/21	3,750,000.000	3,648,750.000	
ITALY BTPS 0.65 10/15/23	1,870,000.000	1,714,640.400	
ITALY BTPS 0.65 11/01/20	2,000,000.000	1,979,660.000	
ITALY BTPS 0.7 05/01/20	3,800,000.000	3,787,308.000	
ITALY BTPS 0.9 08/01/22	3,000,000.000	2,863,320.000	
ITALY BTPS 0.95 03/01/23	2,000,000.000	1,885,000.000	
ITALY BTPS 0.95 03/15/23	2,700,000.000	2,546,910.000	
ITALY BTPS 1.2 04/01/22	2,700,000.000	2,626,560.000	
ITALY BTPS 1.25 12/01/26	3,500,000.000	3,066,910.000	
ITALY BTPS 1.35 04/15/22	3,000,000.000	2,929,050.000	
ITALY BTPS 1.45 05/15/25	1,360,000.000	1,242,006.400	
ITALY BTPS 1.45 11/15/24	2,800,000.000	2,589,972.000	
ITALY BTPS 1.5 06/01/25	7,430,000.000	6,812,641.300	
ITALY BTPS 1.6 06/01/26	3,300,000.000	2,994,090.000	
ITALY BTPS 1.65 03/01/32	3,300,000.000	2,683,989.000	
ITALY BTPS 1.85 05/15/24	2,800,000.000	2,677,640.000	

ITALY BTPS 2.0 02/01/28	6,190,000.000	5,605,230.700	
ITALY BTPS 2.0 12/01/25	2,900,000.000	2,720,258.000	
ITALY BTPS 2.05 08/01/27	1,550,000.000	1,415,816.500	
ITALY BTPS 2.15 12/15/21	2,000,000.000	2,018,200.000	
ITALY BTPS 2.2 06/01/27	2,500,000.000	2,319,750.000	
ITALY BTPS 2.25 09/01/36	2,400,000.000	1,985,760.000	
ITALY BTPS 2.45 09/01/33	1,800,000.000	1,573,182.000	
ITALY BTPS 2.7 03/01/47	2,650,000.000	2,173,530.000	
ITALY BTPS 2.8 03/01/67	1,100,000.000	880,550.000	
ITALY BTPS 2.8 12/01/28	740,000.000	704,317.200	
ITALY BTPS 2.95 09/01/38	1,450,000.000	1,280,495.000	
ITALY BTPS 3.25 09/01/46	2,200,000.000	1,988,228.000	
ITALY BTPS 3.45 03/01/48	1,430,000.000	1,313,683.800	
ITALY BTPS 3.5 03/01/30	3,980,000.000	3,995,323.000	
ITALY BTPS 3.75 03/01/21	2,950,000.000	3,100,892.500	
ITALY BTPS 3.75 05/01/21	3,000,000.000	3,151,500.000	
ITALY BTPS 3.75 08/01/21	3,500,000.000	3,676,400.000	
ITALY BTPS 3.75 09/01/24	2,500,000.000	2,622,675.000	
ITALY BTPS 4.0 02/01/37	4,570,000.000	4,760,112.000	
ITALY BTPS 4.0 09/01/20	4,220,000.000	4,427,159.800	
ITALY BTPS 4.25 03/01/20	2,110,000.000	2,200,265.800	
ITALY BTPS 4.5 02/01/20	2,420,000.000	2,525,705.600	
ITALY BTPS 4.5 03/01/24	3,500,000.000	3,800,895.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/26	2,850,000.000	3,119,040.000	
ITALY BTPS 4.5 05/01/23	2,600,000.000	2,822,742.000	
ITALY BTPS 4.75 08/01/23	4,010,000.000	4,410,198.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/21	3,810,000.000	4,108,323.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/28	3,100,000.000	3,474,170.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/44	2,600,000.000	2,920,424.000	
ITALY BTPS 5.0 03/01/22	2,500,000.000	2,732,500.000	
ITALY BTPS 5.0 03/01/25	3,860,000.000	4,319,803.200	
ITALY BTPS 5.0 08/01/34	3,670,000.000	4,249,126.000	
ITALY BTPS 5.0 08/01/39	2,590,000.000	2,985,752.000	
ITALY BTPS 5.0 09/01/40	3,450,000.000	3,967,845.000	

ITALY BTPS 5.25 11/01/29	3,820,000.000	4,447,626.000	
ITALY BTPS 5.5 09/01/22	2,960,000.000	3,305,668.800	
ITALY BTPS 5.5 11/01/22	3,200,000.000	3,576,800.000	
ITALY BTPS 5.75 02/01/33	3,440,000.000	4,232,576.000	
ITALY BTPS 6.0 05/01/31	4,300,000.000	5,359,090.000	
ITALY BTPS 6.5 11/01/27	3,400,000.000	4,234,020.000	
ITALY BTPS 7.25 11/01/26	2,150,000.000	2,768,555.000	
ITALY BTPS 9.0 11/01/23	1,700,000.000	2,205,750.000	
NETHERLANDS 0.25 01/15/20	2,150,000.000	2,174,488.500	
NETHERLANDS 0.25 07/15/25	2,400,000.000	2,413,752.000	
NETHERLANDS 0.5 07/15/26	3,140,000.000	3,189,298.000	
NETHERLANDS 0.75 07/15/27	2,390,000.000	2,454,171.500	
NETHERLANDS 0.75 07/15/28	2,340,000.000	2,386,566.000	
NETHERLANDS 01/15/22	2,800,000.000	2,834,608.000	
NETHERLANDS 01/15/24	1,640,000.000	1,642,640.400	
NETHERLANDS 1.75 07/15/23	3,350,000.000	3,649,356.000	
NETHERLANDS 2.0 07/15/24	2,030,000.000	2,258,090.800	
NETHERLANDS 2.25 07/15/22	2,280,000.000	2,497,466.400	
NETHERLANDS 2.5 01/15/33	2,110,000.000	2,593,401.000	
NETHERLANDS 2.75 01/15/47	1,920,000.000	2,690,323.200	
NETHERLANDS 3.25 07/15/21	2,760,000.000	3,039,339.600	
NETHERLANDS 3.5 07/15/20	1,090,000.000	1,166,060.200	
NETHERLANDS 3.75 01/15/42	2,130,000.000	3,350,447.400	
NETHERLANDS 4.0 01/15/37	2,310,000.000	3,514,665.000	
NETHERLANDS 5.5 01/15/28	2,070,000.000	3,011,022.000	
NETHERLANDS 7.5 01/15/23	590,000.000	781,750.000	
SPAIN 0.05 01/31/21	2,500,000.000	2,506,325.000	
SPAIN 0.35 07/30/23	1,000,000.000	990,150.000	
SPAIN 0.4 04/30/22	3,300,000.000	3,322,011.000	
SPAIN 0.45 10/31/22	2,600,000.000	2,612,870.000	
SPAIN 0.75 07/30/21	2,650,000.000	2,706,100.500	

	SPAIN 1.15 07/30/20	4,500,000.000	4,607,505.000	
	SPAIN 1.3 10/31/26	3,500,000.000	3,502,520.000	
	SPAIN 1.4 01/31/20	3,600,000.000	3,677,796.000	
	SPAIN 1.4 04/30/28	3,760,000.000	3,717,587.200	
	SPAIN 1.4 07/30/28	2,080,000.000	2,043,038.400	
	SPAIN 1.45 10/31/27	3,300,000.000	3,296,832.000	
	SPAIN 1.5 04/30/27	2,700,000.000	2,718,900.000	
	SPAIN 1.6 04/30/25	3,100,000.000	3,223,256.000	
	SPAIN 1.95 04/30/26	3,000,000.000	3,157,800.000	
	SPAIN 1.95 07/30/30	3,050,000.000	3,092,090.000	
	SPAIN 2.15 10/31/25	4,650,000.000	4,978,197.000	
	SPAIN 2.35 07/30/33	2,380,000.000	2,456,160.000	
	SPAIN 2.7 10/31/48	1,080,000.000	1,076,284.800	
	SPAIN 2.75 10/31/24	3,800,000.000	4,217,810.000	
	SPAIN 2.9 10/31/46	2,500,000.000	2,626,575.000	
	SPAIN 3.45 07/30/66	1,200,000.000	1,336,116.000	
	SPAIN 3.8 04/30/24	2,980,000.000	3,460,137.600	
	SPAIN 4.0 04/30/20	2,890,000.000	3,073,023.700	
	SPAIN 4.2 01/31/37	3,000,000.000	3,883,050.000	
	SPAIN 4.4 10/31/23	6,590,000.000	7,798,078.800	
	SPAIN 4.65 07/30/25	3,380,000.000	4,172,508.600	
	SPAIN 4.7 07/30/41	3,060,000.000	4,259,734.200	
	SPAIN 4.8 01/31/24	3,000,000.000	3,627,360.000	
	SPAIN 4.85 10/31/20	2,630,000.000	2,888,713.100	
	SPAIN 4.9 07/30/40	2,970,000.000	4,219,479.000	
	SPAIN 5.15 10/31/28	1,900,000.000	2,517,120.000	
	SPAIN 5.15 10/31/44	2,000,000.000	2,974,000.000	
	SPAIN 5.4 01/31/23	3,000,000.000	3,625,530.000	
	SPAIN 5.5 04/30/21	3,700,000.000	4,206,123.000	
	SPAIN 5.75 07/30/32	2,410,000.000	3,517,370.900	
	SPAIN 5.85 01/31/22	4,160,000.000	4,920,323.200	
	SPAIN 5.9 07/30/26	2,350,000.000	3,151,749.500	
	SPAIN 6.0 01/31/29	3,500,000.000	4,945,290.000	
ユーロ	小計	760,930,000.000 (98,129,532,800)	852,415,038.300 (109,927,443,339)	
南アフリカ・ランド	SOUTH AFRICA 6.25 03/31/36	17,630,000.000	12,390,892.900	
	SOUTH AFRICA 6.5 02/28/41	13,680,000.000	9,411,156.000	
	SOUTH AFRICA 7.0 02/28/31	17,190,000.000	13,879,206.000	
	SOUTH AFRICA 8.0 01/31/30	15,820,000.000	14,081,065.600	
	SOUTH AFRICA 8.25 03/31/32	13,000,000.000	11,523,460.000	
	SOUTH AFRICA 8.5 01/31/37	16,500,000.000	14,482,710.000	
	SOUTH AFRICA 8.75 01/31/44	15,000,000.000	13,233,000.000	

	SOUTH AFRICA 8.75 02/28/48	58,790,000.000	51,732,260.500	
	SOUTH AFRICA 8.875 02/28/35	10,000,000.000	9,162,600.000	
	SOUTH AFRICA 9.0 01/31/40	9,000,000.000	8,180,010.000	
	南アフリカ・ランド 小計	186,610,000.000 (1,481,683,400)	158,076,361.000 (1,255,126,306)	
国債証券 合計		265,343,199,110 (265,343,199,110)	276,679,398,399 (276,679,398,399)	
合計		265,343,199,110 (265,343,199,110)	276,679,398,399 (276,679,398,399)	

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	有価証券の合計金額 に対する比率
アメリカ・ドル	国債証券 166銘柄	45.19%	45.99%
イギリス・ポンド	国債証券 39銘柄	6.64%	6.76%
オーストラリア・ドル	国債証券 21銘柄	2.05%	2.09%
カナダ・ドル	国債証券 28銘柄	1.92%	1.95%
シンガポール・ドル	国債証券 17銘柄	0.34%	0.35%
スウェーデン・クローナ	国債証券 6銘柄	0.31%	0.32%
デンマーク・クローネ	国債証券 4銘柄	0.45%	0.46%
ノルウェー・クローネ	国債証券 6銘柄	0.20%	0.20%
ポーランド・ズロチ	国債証券 14銘柄	0.53%	0.54%
マレーシア・リンギット	国債証券 14銘柄	0.41%	0.42%
メキシコ・ペソ	国債証券 14銘柄	0.74%	0.75%
ユーロ	国債証券 280銘柄	39.04%	39.73%
南アフリカ・ランド	国債証券 10銘柄	0.45%	0.45%

(注) 「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

「エマージング株式パッシブ・マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成30年11月12日現在
資産の部		
流動資産		
預金		2,603,693,015
コール・ローン		284,895,788
株式		49,280,562,825
投資信託受益証券		266,549,922
投資証券		86,164,660
派生商品評価勘定		10,291,730
未収入金		503,510
未収配当金		51,137,281
差入委託証拠金		569,312,892
流動資産合計		53,153,111,623
資産合計		53,153,111,623
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		84,346,475
未払金		2,637,891,220
未払解約金		26,145,000
流動負債合計		2,748,382,695
負債合計		2,748,382,695
純資産の部		
元本等		
元本	1	45,635,552,863
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）		4,769,176,065
元本等合計		50,404,728,928
純資産合計		50,404,728,928
負債純資産合計		53,153,111,623

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11月12日現在
1.	1 本報告書における開示対象ファ ンドの期首における当該親投資 信託の元本額	52,614,064,516円
	同期中追加設定元本額	16,369,364,139円
	同期中一部解約元本額	23,347,875,792円
	元本の内訳	
	ファンド名	
	DIAM新興国株式インデック スファンド<DC年金>	4,043,265,955円
	DIAM新興国株式インデック スファンド<為替ヘッジなし> (ファンドラップ)	531,501,492円
	MITO ラップ型ファンド (安定型)	3,985,301円
	MITO ラップ型ファンド (中立型)	10,610,747円
	MITO ラップ型ファンド (積極型)	13,230,020円
	グローバル8資産ラップファン ド(安定型)	27,572,726円
	グローバル8資産ラップファン ド(中立型)	28,537,703円
	グローバル8資産ラップファン ド(積極型)	16,073,343円
	たわらノーロード 新興国株式	4,270,414,885円
	たわらノーロード 新興国株式 <ラップ向け>	1,864,799,568円
	たわらノーロード バランス (8資産均等型)	165,894,398円
	たわらノーロード バランス (堅実型)	1,046,237円
	たわらノーロード バランス (標準型)	4,400,314円
	たわらノーロード バランス (積極型)	10,954,194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)	124,610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)	6,747,967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)	21,991,660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)	14,871,549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)	43,735,750円
	たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定型)	32,706円
	たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定成長型)	482,325円

たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	330,077円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	842,763円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	447,212,307円
DIAM DC 8資産バランス ファンド(新興国10)	314,889,588円
DIAM DC 8資産バランス ファンド(新興国20)	279,977,928円
DIAM DC 8資産バランス ファンド(新興国30)	549,014,807円
投資のソムリエ	1,343,407,172円
クルーズコントロール	1,008,045,836円
投資のソムリエ<DC年金>	119,033,250円
DIAM 8資産バランスファ ンドN<DC年金>	232,065,447円
クルーズコントロール<DC年 金>	676,655円
DIAMコア資産設計ファンド (堅実型)	13,748,128円
DIAMコア資産設計ファンド (積極型)	38,733,099円
投資のソムリエ<DC年金>リ スク抑制型	57,463,793円
ダイナミック・ナビゲーション	522,062円
リスク抑制世界8資産バランス ファンド	1,057,494,705円
ワールドアセットバランス(基 本コース)	1,853,672,739円
ワールドアセットバランス(リ スク抑制コース)	4,569,034,230円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2045)	1,545,738円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2055)	1,123,549円
リスク抑制世界8資産バランス ファンド(DC)	326,631円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2035)	1,893,933円
リスクコントロール世界資産分 散ファンド	303,188,905円
9資産分散投資・スタンダード <DC年金>	20,870円
エマージング株式パッシブファ ンドVA(適格機関投資家専 用)	3,768,205,899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)	2,125,986,466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)	8,428,760,810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)	8,038,062,026円
計		45,635,552,863円
2 .	受益権の総数	45,635,552,863口

(金融商品に関する注記)

1 . 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成30年5月25日 至 平成30年11月12日
1 . 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2 . 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有していません。
3 . 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成30年11月12日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
株式	5,889,999,739
投資信託受益証券	10,682,125
投資証券	17,236,392
合計	5,917,918,256

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(平成30年4月19日から平成30年11月12日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	平成30年11月12日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売 建	1,560,926,008	-	1,560,165,693	760,315
アメリカ・ドル	1,560,926,008	-	1,560,165,693	760,315
買 建	4,259,145,810	-	4,259,592,108	446,298
アメリカ・ドル	1,656,198,917	-	1,655,972,550	226,367
インド・ルピー	344,832,989	-	347,600,000	2,767,011
インドネシア・ルピア	80,750,274	-	81,260,758	510,484
タイ・バーツ	78,310,346	-	77,861,000	449,346
トルコ・リラ	8,344,840	-	8,352,000	7,160
ポーランド・ズロチ	33,116,600	-	33,066,000	50,600
マレーシア・リンギット	79,853,048	-	79,783,900	69,148
メキシコ・ペソ	90,790,400	-	90,560,000	230,400
ユーロ	6,451,477	-	6,448,000	3,477
韓国・ウォン	497,537,900	-	497,537,900	-
香港・ドル	771,112,368	-	770,620,000	492,368
台湾・ドル	444,980,651	-	444,000,000	980,651
南アフリカ・ランド	166,866,000	-	166,530,000	336,000
合計	5,820,071,818	-	5,819,757,801	1,206,613

(注) 時価の算定方法

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

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

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

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。
上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

株式関連

種類	平成30年11月12日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引				
先物取引				
買 建	3,260,258,081	-	3,184,996,723	75,261,358
合計	3,260,258,081	-	3,184,996,723	75,261,358

(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。

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成30年11月12日現在
1口当たり純資産額	1.1045円
(1万口当たり純資産額)	(11,045円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

平成30年11月12日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	CTRI.P.COM INTERNATIONAL LTD ADR	37,600	26.130	982,488.000	
	CIA DE MINAS BUENAVENTURA SA ADR	17,000	13.860	235,620.000	
	SURGUTNEFTEGAZ SP ADR PREF	69,900	5.670	396,333.000	
	CREDICORP LTD	6,149	224.230	1,378,790.270	
	SINA CORP	6,100	61.820	377,102.000	
	MOBILE TELESYSTEMS PJSC ADR	48,925	8.240	403,142.000	
	NETEASE INC-ADR	7,200	221.910	1,597,752.000	
	SOUTHERN COPPER CORP	7,580	37.930	287,509.400	
	LUKOIL SPON ADR	45,496	75.400	3,430,398.400	
	GAZPROM PAO ADR	506,230	4.510	2,283,097.300	
	COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK SP GDR	103,943	4.590	477,098.370	
	INNER MONGOLIA YITAI COAL CO	105,800	1.163	123,045.400	
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRADE	96,280	1.279	123,142.120	
	SURGUTNEFTEGAZ ADR	74,317	3.974	295,335.750	
	51JOB INC ADR	2,300	63.300	145,590.000	
	X5 RETAIL GROUP NV GDR	12,426	23.820	295,987.320	
	NOVATEK PJSC GDR	8,546	168.700	1,441,710.200	
	BAIDU INC -SPON ADR	25,300	183.750	4,648,875.000	
	NOVOLIPETSK STEEL GDR	13,480	23.810	320,958.800	
	MMC NORILSK NICKEL ADR	61,881	17.270	1,068,684.870	
	ROSNEFT OIL CO GDR	111,650	6.970	778,200.500	
	NEW ORIENTAL EDUCATION & TECH	13,100	57.400	751,940.000	
	SEVERSTAL GDR	21,907	15.210	333,205.470	
	TATNEFT ADR	23,910	72.000	1,721,520.000	
	MAGNITOGORSK IRON & STEEL SPON GDR	19,500	9.070	176,865.000	
	VTB BANK OJSC GDR	192,000	1.262	242,304.000	
	DP WORLD LTD	12,034	18.660	224,554.440	
	MAGNIT PJSC GDR	33,117	13.600	450,391.200	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD ADR	32,600	5.060	164,956.000	
	FANG HOLDINGS LTD ADR	19,300	1.780	34,354.000	
RUSHYDRO PJSC ADR	141,960	0.764	108,457.440		
TAL EDUCATION GROUP-ADR	32,600	27.270	889,002.000		
NOAH HOLDINGS LTD ADR	2,700	43.380	117,126.000		

	SBERBANK ADR	249,580	12.000	2,994,960.000	
	PHOSAGRO PJSC GDR	13,784	13.000	179,192.000	
	HUAZHU GROUP LTD ADR	11,800	25.850	305,030.000	
	YY INC-ADR	3,900	64.730	252,447.000	
	GDS HOLDINGS LTD ADR	5,600	23.800	133,280.000	
	58.COM INC ADR	8,400	60.500	508,200.000	
	AUTOHOME INC ADR	5,400	68.660	370,764.000	
	WEIBO CORP ADR	4,700	57.160	268,652.000	
	JD.COM INC ADR	66,400	21.700	1,440,880.000	
	ALIBABA GROUP HOLDING LTD-ADR	105,780	144.850	15,322,233.000	
	MOMO INC SPON ADR	13,100	32.650	427,715.000	
	BAOZUN INC-SPN ADR	3,400	40.190	136,646.000	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	33,700	36.500	1,230,050.000	
	POLYUS PJSC GDR	6,012	32.050	192,684.600	
アメリカ・ドル 小計		2,444,387		50,068,269.850 (5,704,778,667)	
アラブ首長国連邦・ディルハム	DUBAI ISLAMIC BANK PJSC	168,000	5.320	893,760.000	
	EMIRATES TELECOMMUNICATIONS GROUP CO PJSC	156,450	17.220	2,694,069.000	
	DUBAI INVESTMENTS PJSC	169,895	1.610	273,530.950	
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK PJSC	154,723	8.230	1,273,370.290	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	127,622	14.340	1,830,099.480	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	264,256	5.160	1,363,560.960	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	356,142	1.750	623,248.500	
	EMAAR DEVELOPMENT PJSC	77,463	4.920	381,117.960	
	EMAAR MALLS PJSC	178,166	1.920	342,078.720	
	DAMAC PROPERTIES DUBAI CO PJSC	190,235	2.100	399,493.500	
アラブ首長国連邦・ディルハム 小計		1,842,952		10,074,329.360 (312,001,980)	
インド・ルピー	RELIANCE INDUSTRIES LTD	241,368	1,093.450	263,923,839.600	
	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	66,548	296.850	19,754,773.800	
	ASIAN PAINTS LTD	26,486	1,295.600	34,315,261.600	
	EICHER MOTORS LTD	1,197	22,495.250	26,926,814.250	
	GRASIM INDUSTRIES LTD	28,851	868.000	25,042,668.000	
	MAHINDRA & MAHINDRA LTD	60,473	795.250	48,091,153.250	
	SHREE CEMENT LTD	522	15,389.350	8,033,240.700	
	ICICI BANK LTD	196,847	356.850	70,244,851.950	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP LTD	58,463	241.300	14,107,121.900	
	STATE BANK OF INDIA LTD	144,329	283.250	40,881,189.250	
	CONTAINER CORP OF INDIA LTD	15,148	669.950	10,148,402.600	

LIC HOUSING FINANCE LTD	26,242	436.250	11,448,072.500	
TATA STEEL LTD	22,890	572.200	13,097,658.000	
TATA MOTORS LTD	138,820	195.250	27,104,605.000	
JSW STEEL LTD	76,971	347.500	26,747,422.500	
TATA POWER CO LTD	114,770	75.900	8,711,043.000	
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	2,743	5,746.450	15,762,512.350	
NESTLE INDIA LTD	1,703	10,226.000	17,414,878.000	
BHARAT HEAVY ELECTRICALS LTD	92,082	70.000	6,445,740.000	
GAIL INDIA LTD	70,027	367.350	25,724,418.450	
VEDANTA LTD	110,581	209.050	23,116,958.050	
AXIS BANK LTD	149,931	613.200	91,937,689.200	
TITAN COMPANY LTD	27,648	847.650	23,435,827.200	
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	122,655	156.400	19,183,242.000	
LUPIN LTD	16,617	854.900	14,205,873.300	
BAJAJ FINANCE LTD	15,656	2,375.350	37,188,479.600	
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP	135,245	1,816.100	245,618,444.500	
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISES LTD	43,870	450.150	19,748,080.500	
INFOSYS LTD	295,401	659.500	194,816,959.500	
WIPRO LTD	100,958	324.850	32,796,206.300	
INDIAN OIL CORP LTD	139,469	141.650	19,755,783.850	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	54,030	1,672.600	90,370,578.000	
HCL TECHNOLOGIES LTD	45,897	1,027.900	47,177,526.300	
DABUR INDIA LTD	37,192	377.200	14,028,822.400	
HERO MOTOCORP LTD	4,509	2,956.700	13,331,760.300	
DR REDDYS LABORATORIES LTD	10,085	2,400.000	24,204,000.000	
BHARTI AIRTEL LTD	125,025	299.750	37,476,243.750	
UNITED SPIRITS LTD	28,139	625.450	17,599,537.550	
SUN PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD	67,952	597.450	40,597,922.400	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	8,731	7,283.500	63,592,238.500	
GLENMARK PHARMACEUTICALS LTD	13,988	676.150	9,457,986.200	
AUROBINDO PHARMA LTD	23,572	815.300	19,218,251.600	
HAVELLS INDIA LTD	16,843	646.550	10,889,841.650	
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	60,186	170.650	10,270,740.900	
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE CO LTD	10,474	1,229.850	12,881,448.900	
PETRONET LNG LTD	52,875	225.400	11,918,025.000	
CIPLA LTD/INDIA	31,870	526.950	16,793,896.500	
LARSEN & TOUBRO LTD	42,451	1,368.600	58,098,438.600	
ULTRATECH CEMENT LTD	7,504	3,817.850	28,649,146.400	
ASHOK LEYLAND LTD	110,886	118.250	13,112,269.500	
BOSCH LTD	496	19,846.200	9,843,715.200	

	TATA CONSULTANCY SERVICES LTD	77,574	1,909.200	148,104,280.800	
	NTPC LTD	175,055	154.450	27,037,244.750	
	PIRAMAL ENTERPRISES LTD	7,474	2,290.800	17,121,439.200	
	YES BANK LTD	153,758	227.900	35,041,448.200	
	AMBUJA CEMENTS LTD	54,635	205.300	11,216,565.500	
	BHARAT FORGE LTD	18,421	583.500	10,748,653.500	
	HINDALCO INDUSTRIES LTD	99,935	238.800	23,864,478.000	
	ITC LTD	287,913	277.250	79,823,879.250	
	PIDILITE INDUSTRIES LTD	11,666	1,042.000	12,155,972.000	
	UNITED PHOSPHORUS LTD	32,882	740.000	24,332,680.000	
	SIEMENS INDIA LTD	7,396	949.950	7,025,830.200	
	GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	32,823	694.850	22,807,061.550	
	TECH MAHINDRA LTD	42,065	707.200	29,748,368.000	
	VODAFONE IDEA LTD	196,527	42.250	8,303,265.750	
	MARICO LTD	28,051	340.450	9,549,962.950	
	PAGE INDUSTRIES LTD	528	30,197.250	15,944,148.000	
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	122,771	191.700	23,535,200.700	
	ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	35,005	337.600	11,817,688.000	
	REC LTD	55,173	123.800	6,830,417.400	
	BAJAJ FINSERV LTD	3,603	5,701.400	20,542,144.200	
	BAJAJ AUTO LTD	8,027	2,693.050	21,617,112.350	
	COAL INDIA LTD	62,457	268.450	16,766,581.650	
	MAHINDRA & MAHINDRA FINANCIAL SERVICES LTD	18,297	429.350	7,855,816.950	
	BHARTI INFRA TEL LTD	32,296	265.850	8,585,891.600	
	INDIABULLS HOUSING FINANCE LTD	25,466	862.150	21,955,511.900	
	TATA STEEL LTD-PARTLY PAID	2,333	119.050	277,743.650	
	CADILA HEALTHCARE LTD	16,962	360.250	6,110,560.500	
	AVENUE SUPERMARTS LTD	11,937	1,396.750	16,673,004.750	
	INTERGLOBE AVIATION LTD	8,300	991.950	8,233,185.000	
	インド・ルピー 小計	4,926,546		2,638,867,736.650 (4,169,411,024)	
インドネシア・ルピア	UNITED TRACTORS TBK PT	156,501	34,900.000	5,461,884,900.000	
	INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK PT	359,200	5,775.000	2,074,380,000.000	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	137,500	40,325.000	5,544,687,500.000	
	PT ASTRA INTERNATIONAL TBK	1,857,200	8,175.000	15,182,610,000.000	
	TELEKOMUNIKASI INDONESIA PERSERO TBK	4,634,700	3,920.000	18,168,024,000.000	

	CHAROEN POKPHAND INDONESIA TBK PT	675,600	5,325.000	3,597,570,000.000	
	GUDANG GARAM TBK PT	44,800	77,500.000	3,472,000,000.000	
	HANJAYA MANDALA SAMPOERNA TBK	655,400	3,400.000	2,228,360,000.000	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA TBK PT	185,600	17,650.000	3,275,840,000.000	
	INDAH KIAT PULP AND PAPER CORP TBK PT	262,000	11,275.000	2,954,050,000.000	
	BANK DANAMON INDONESIA TBK PT	261,316	7,450.000	1,946,804,200.000	
	BANK MANDIRI	1,694,000	7,225.000	12,239,150,000.000	
	MATAHARI DEPARTMENT STORE TBK	276,500	5,275.000	1,458,537,500.000	
	BANK RAKYAT INDONESIA	5,048,100	3,340.000	16,860,654,000.000	
	PERUSAHAAN GAS NEGARA PT	1,064,100	2,110.000	2,245,251,000.000	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSERO TBK PT	669,100	8,000.000	5,352,800,000.000	
	KALBE FARMA TBK PT	1,822,200	1,420.000	2,587,524,000.000	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK PT	276,500	9,725.000	2,688,962,500.000	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	892,700	24,000.000	21,424,800,000.000	
	JASA MARGA PERSERO TBK PT	200,125	3,990.000	798,498,750.000	
	BUMI SERPONG DAMAI PT	851,700	1,200.000	1,022,040,000.000	
	ADARO ENERGY PT	1,434,500	1,580.000	2,266,510,000.000	
	PAKUWON JATI TBK	1,912,800	545.000	1,042,476,000.000	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR TBK PT	239,000	8,575.000	2,049,425,000.000	
	TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE TBK PT	180,800	4,190.000	757,552,000.000	
	BANK TABUNGAN NEGARA TBK PT	480,300	2,350.000	1,128,705,000.000	
	WASKITA KARYA PERSERO TBK PT	392,000	1,575.000	617,400,000.000	
	PT SURYA CITRA MEDIA TBK	511,300	1,730.000	884,549,000.000	
	インドネシア・ルピア 小計	27,175,542		139,331,045,350.000 (1,086,782,154)	
オフショア・人民 元	LUXSHARE PRECISION INDUSTRY CO LTD	9,600	15.150	145,440.000	
	FOCUS MEDIA INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD	26,300	5.720	150,436.000	
	IFLYTEK CO LTD	6,400	23.740	151,936.000	
	YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD	2,300	70.230	161,529.000	
	JIANGSU YANGHE BREWERY JOINT-STOCK CO LTD	2,500	94.940	237,350.000	
	WULIANGYE YIBIN CO LTD	4,500	50.010	225,045.000	
	SUNING.COM CO LTD	29,500	11.430	337,185.000	

BOE TECHNOLOGY GROUP CO LTD	79,900	2.790	222,921.000	
CHINA MERCHANTS SHEKOU INDUSTRIAL ZONE HOLDINGS CO LTD	12,300	17.730	218,079.000	
GREE ELECTRIC APPLIANCES INC OF ZHUHAI	5,700	38.640	220,248.000	
MIDEA GROUP CO LTD	8,000	39.770	318,160.000	
HANGZHOU HIKVISION DIGITAL TECHNOLOGY CO LTD	12,000	26.350	316,200.000	
PING AN BANK CO LTD	27,200	10.550	286,960.000	
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO LTD	79,000	4.400	347,600.000	
CHINA VANKE CO LTD	13,700	23.550	322,635.000	
WEICHAJ POWER CO LTD	29,900	7.410	221,559.000	
GF SECURITIES CO LTD	22,700	12.600	286,020.000	
BYD CO LTD	7,500	50.000	375,000.000	
BANK OF SHANGHAI CO LTD	20,900	11.520	240,768.000	
PETROCHINA CO LTD	32,800	8.090	265,352.000	
INDUSTRIAL & COMMERCIAL BANK OF CHINA LTD	75,500	5.350	403,925.000	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA LTD	82,500	3.650	301,125.000	
BANK OF CHINA LTD	74,500	3.590	267,455.000	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL CORP	51,300	6.140	314,982.000	
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	32,300	28.600	923,780.000	
PING AN INSURANCE GROUP CO OF CHINA LTD	14,000	64.620	904,680.000	
INDUSTRIAL BANK CO LTD	27,400	15.680	429,632.000	
SHANGHAI PUDONG DEVELOPMENT BANK CO LTD	36,700	10.750	394,525.000	
CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	73,320	6.180	453,117.600	
SAIC MOTOR CORP LTD	10,900	27.220	296,698.000	
KWEICHOW MOUTAI CO LTD	1,800	562.000	1,011,600.000	
BANK OF COMMUNICATIONS CO LTD	79,200	5.800	459,360.000	
CITIC SECURITIES CO LTD	33,200	16.920	561,744.000	
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	10,900	33.000	359,700.000	
CHINA YANGTZE POWER CO LTD	26,500	14.650	388,225.000	
DAQIN RAILWAY CO LTD	30,100	8.060	242,606.000	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD	60,800	3.840	233,472.000	
CHINA STATE CONSTRUCTION ENGINEERING CORP LTD	61,600	5.290	325,864.000	

HAITONG SECURITIES CO LTD	36,000	9.270	333,720.000	
HUAXIA BANK CO LTD	23,200	7.750	179,800.000	
INNER MONGOLIA YILI INDUSTRIAL GROUP CO LTD	10,400	22.870	237,848.000	
BANK OF BEIJING CO LTD	42,800	6.000	256,800.000	
BAOSHAN IRON & STEEL CO LTD	29,200	7.470	218,124.000	
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	4,200	33.350	140,070.000	
CHINA MERCHANTS SECURITIES CO LTD	22,800	13.740	313,272.000	
POLY DEVELOPMENTS AND HOLDINGS GROUP CO LTD	20,400	12.180	248,472.000	
CRRG CORP LTD	38,600	8.460	326,556.000	
JIANGSU HENGRUI MEDICINE CO LTD	4,900	64.470	315,903.000	
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION CORP LTD	27,400	10.640	291,536.000	
HUATAI SECURITIES CO LTD	30,600	16.730	511,938.000	
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD	21,100	8.020	169,222.000	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	11,000	27.510	302,610.000	
FOUNDER SECURITIES CO LTD	31,000	5.360	166,160.000	
KANGMEI PHARMACEUTICAL CO LTD	14,300	12.000	171,600.000	
CHINA INTERNATIONAL TRAVEL SERVICE CORP LTD	3,900	56.700	221,130.000	
AVIC CAPITAL CO LTD	49,800	4.490	223,602.000	
METALLURGICAL CORP OF CHINA LTD	54,400	3.140	170,816.000	
POWER CONSTRUCTION CORP OF CHINA LTD	36,100	4.630	167,143.000	
SICHUAN CHUANTOU ENERGY CO LTD	23,700	7.940	188,178.000	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD	9,900	20.060	198,594.000	
AECC AVIATION POWER CO LTD	9,500	23.870	226,765.000	
JOINTOWN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	16,000	15.500	248,000.000	
INDUSTRIAL SECURITIES CO LTD	53,200	4.760	253,232.000	
BEIJING TONGRENTANG CO LTD	6,400	29.330	187,712.000	
SHANDONG GOLD MINING CO LTD	8,000	25.350	202,800.000	

	YONGHUI SUPERSTORES CO LTD	24,000	7.300	175,200.000	
	AISINO CORP	6,400	25.740	164,736.000	
	CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD	28,600	6.540	187,044.000	
	ZHANGZHOU PIENZHEHUANG PHARMACEUTICAL CO LTD	1,800	78.920	142,056.000	
	HENGTONG OPTIC-ELECTRIC CO LTD	8,100	17.670	143,127.000	
	FOSHAN HAITIAN FLAVOURING & FOOD CO LTD	6,200	65.670	407,154.000	
	GUOTAI JUNAN SECURITIES CO LTD	33,800	14.990	506,662.000	
	CHINA NATIONAL NUCLEAR POWER CO LTD	51,300	5.480	281,124.000	
	BANK OF JIANGSU CO LTD	32,400	6.390	207,036.000	
	ORIENT SECURITIES CO LTD/CHINA	24,800	9.220	228,656.000	
	EVERBRIGHT SECURITIES CO LTD	24,000	9.790	234,960.000	
オフショア・人民元 小計		2,095,420		22,472,271.600 (368,545,254)	
カタール・リアル	QATAR INSURANCE CO SAQ	14,417	35.950	518,291.150	
	QATAR NATIONAL BANK	37,758	191.980	7,248,780.840	
	COMMERCIAL BANK OF QATAR QSC	18,202	41.700	759,023.400	
	OOREDOO QSC	8,410	72.890	613,004.900	
	DOHA BANK QSC	4,731	21.810	103,183.110	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	4,887	184.970	903,948.390	
	INDUSTRIES QATAR QSC	16,138	140.300	2,264,161.400	
	QATAR ISLAMIC BANK SAQ	10,281	152.110	1,563,842.910	
	MASRAF AL RAYAN	32,079	39.150	1,255,892.850	
	BARWA REAL ESTATE CO	9,376	39.200	367,539.200	
	EZDAN HOLDING GROUP QSC	59,601	11.270	671,703.270	
カタール・リアル 小計		215,880		16,269,371.420 (510,044,794)	
コロンビア・ペソ	INTERCONEXION ELECTRICA SA ESP	44,439	13,200.000	586,594,800.000	
	ECOPETROL SA	412,135	3,440.000	1,417,744,400.000	
	GRUPO DE INVERSIONES SURAMERICANA SA-PREF	10,138	30,000.000	304,140,000.000	
	GRUPO AVAL ACCIONES Y VALORES SA-PREF	341,831	1,175.000	401,651,425.000	
	CEMENTOS ARGOS SA	37,720	6,910.000	260,645,200.000	
	GRUPO ARGOS SA	28,217	15,620.000	440,749,540.000	
	BANCOLOMBIA SA	20,855	31,320.000	653,178,600.000	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	42,495	32,100.000	1,364,089,500.000	
	GRUPO DE INVERSIONES SURAMERICANA SA	23,543	31,560.000	743,017,080.000	

コロンビア・ペソ	小計	961,373		6,171,810,545.000 (220,950,818)	
タイ・パーツ	BANGKOK BANK PCL	15,900	220.000	3,498,000.000	
	BERLI JUCKER PCL NVDR	119,900	55.500	6,654,450.000	
	KRUNG THAI BANK PCL NVDR	348,000	20.300	7,064,400.000	
	ROBINSON PCL-NVDR	38,800	67.750	2,628,700.000	
	SIAM COMMERCIAL BANK PCL NVDR	162,900	139.500	22,724,550.000	
	TRUE CORP PCL NVDR	1,030,755	5.850	6,029,916.750	
	KASIKORNBANK PCL NVDR	60,200	207.000	12,461,400.000	
	TMB BANK PCL -NVDR	1,010,000	2.320	2,343,200.000	
	IRPC PCL NVDR	1,030,900	5.900	6,082,310.000	
	BANPU PCL PUBLIC CO LTD NVDR	172,000	17.900	3,078,800.000	
	ELECTRICITY GENERATING PCL NVDR	13,100	230.000	3,013,000.000	
	CHAROEN POKPHAND FOODS PCL	311,500	25.000	7,787,500.000	
	ADVANCED INFO SERVICE PCL	92,800	182.000	16,889,600.000	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	380,520	14.900	5,669,748.000	
	DELTA ELECTRONICS THAI PCL NVDR	44,200	69.000	3,049,800.000	
	PTT PCL	970,800	49.750	48,297,300.000	
	THAI UNION GROUP PCL-NVDR	162,600	18.000	2,926,800.000	
	LAND AND HOUSES PCL NVDR	263,900	10.800	2,850,120.000	
	SIAM CEMENT PCL NVDR	33,850	432.000	14,623,200.000	
	AIRPORTS OF THAILAND PCL-NVDR	387,600	65.000	25,194,000.000	
	KASIKORNBANK PCL - FOREIGN	109,600	209.000	22,906,400.000	
	CENTRAL PATTANA PCL NVDR	119,200	78.250	9,327,400.000	
	BANGKOK DUSIT MEDICAL SERVICES NVDR	375,600	24.800	9,314,880.000	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR	25,800	187.500	4,837,500.000	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	221,810	36.750	8,151,517.500	
	THAI OIL PCL NVDR	98,500	81.000	7,978,500.000	
	GLOW ENERGY PCL NVDR	54,000	86.500	4,671,000.000	
CP ALL PCL NVDR	466,900	68.250	31,865,925.000		
BTS GROUP HOLDINGS PCL	531,300	9.450	5,020,785.000		
PTT EXPLORATION & PRODUCTION PCL NVDR	120,745	138.000	16,662,810.000		
INDORAMA VENTURES PCL NVDR	167,222	55.250	9,239,015.500		
PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	196,708	79.000	15,539,932.000		

	ENERGY ABSOLUTE PCL NVDR	118,000	49.750	5,870,500.000	
	BANGKOK EXPRESSWAY & METRO PCL NVDR	740,700	8.700	6,444,090.000	
タイ・パーツ 小計		9,996,310		360,697,049.750 (1,240,797,850)	
チェコ・コルナ	KOMERCNI BANKA AS	7,067	913.000	6,452,171.000	
	O2 CZECH REPUBLIC AS	5,677	245.500	1,393,703.500	
	CEZ	15,014	556.500	8,355,291.000	
	MONETA MONEY BANK AS	48,362	77.400	3,743,218.800	
チェコ・コルナ 小計		76,120		19,944,384.300 (99,123,589)	
チリ・ペソ	BANCO SANTANDER CHILE	5,959,453	51.790	308,640,070.870	
	BANCO DE CREDITO E INVERSIONES	3,020	43,882.000	132,523,640.000	
	BANCO DE CHILE	2,321,052	98.840	229,412,779.680	
	EMPRESAS CMPC SA	96,802	2,479.700	240,039,919.400	
	EMPRESAS COPEC SA	34,981	9,870.800	345,290,454.800	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	10,642	8,651.500	92,069,263.000	
	ENTEL CHILE SA	6,390	5,515.800	35,245,962.000	
	ENEL AMERICAS SA	2,523,913	107.700	271,825,430.100	
	COLBUN SA	780,648	135.740	105,965,159.520	
	AGUAS ANDINAS SA	224,014	370.040	82,894,140.560	
	EMBOTELLADORA ANDINA SA	27,270	2,445.300	66,683,331.000	
	LATAM AIRLINES GROUP SA	26,485	6,353.300	168,267,150.500	
	SOCIEDAD QUIMICA Y MINERA DE CHILE SA	10,624	30,680.000	325,944,320.000	
	SACI FALABELLA	58,629	5,282.200	309,690,103.800	
	ITAU CORPBANCA	13,236,977	6.456	85,457,923.510	
	CENCOSUD SA	125,078	1,434.700	179,449,406.600	
	SACI FALABELLA-RTS	2,031	57.310	116,396.610	
	BANCO DE CREDITO E INVERSIONES-RTS	231	2,230.000	515,130.000	
ENEL CHILE SA	2,764,879	62.640	173,192,020.560		
チリ・ペソ 小計		28,213,119		3,153,222,602.510 (524,696,241)	
トルコ・リラ	AKBANK TAS	185,577	7.230	1,341,721.710	
	ANADOLU EFES BIRACILIK VE MALT SANAYII AS	21,520	20.120	432,982.400	
	ARCELIK	30,429	16.200	492,949.800	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	31,766	27.720	880,553.520	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIKALARI TAS	125,960	9.100	1,146,236.000	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	5,919	56.650	335,311.350	
	KOC HOLDING AS	67,325	15.380	1,035,458.500	
	PETKIM PETROKIMYA HOLDING	88,174	4.950	436,461.300	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI AS	79,624	4.970	395,731.280	

	TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKASI AS	7,797	18.540	144,556.380	
	TURK HAVA YOLLARI	57,827	15.170	877,235.590	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	98,512	11.650	1,147,664.800	
	TURKIYE GARANTI BANKASI AS	201,717	7.820	1,577,426.940	
	TURKIYE IS BANKASI	151,063	4.030	608,783.890	
	TUPRAS TURKIYE PETROL RAFINE	11,716	120.700	1,414,121.200	
	ULKER BISKUVI SANAYI AS	13,121	16.380	214,921.980	
	YAPI VE KREDI BANKASI AS	143,015	1.680	240,265.200	
	HACI OMER SABANCI HOLDING AS	88,752	7.600	674,515.200	
	COCA-COLA ICECEK AS	6,451	28.760	185,530.760	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	19,011	77.000	1,463,847.000	
	TURKIYE VAKIFLAR BANKASI TAO	90,731	3.690	334,797.390	
	TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	13,735	22.580	310,136.300	
	TURKIYE HALK BANKASI AS	61,970	7.260	449,902.200	
トルコ・リラ 小計		1,601,712		16,141,110.690 (337,349,213)	
ハンガリー・フォロント	RICHTER GEDEON NYRT	14,114	5,400.000	76,215,600.000	
	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NYRT	30,013	3,078.000	92,380,014.000	
	OTP BANK NYRT	20,222	11,100.000	224,464,200.000	
ハンガリー・フォロント 小計		64,349		393,059,814.000 (157,656,291)	
パキスタン・ルピー	LUCKY CEMENT LTD	9,900	488.030	4,831,497.000	
	MCB BANK LTD	39,000	198.510	7,741,890.000	
	OIL & GAS DEVELOPMENT CO LTD	74,500	152.520	11,362,740.000	
	UNITED BANK LTD	51,400	140.080	7,200,112.000	
	HABIB BANK LTD	54,400	139.100	7,567,040.000	
パキスタン・ルピー 小計		229,200		38,703,279.000 (33,284,820)	
フィリピン・ペソ	AYALA LAND INC	641,100	38.000	24,361,800.000	
	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	188,940	47.000	8,880,180.000	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAND	88,540	80.000	7,083,200.000	
	AYALA CORP	21,583	902.000	19,467,866.000	
	ALLIANCE GLOBAL GROUP INC	307,700	11.120	3,421,624.000	
	DMCI HOLDINGS INC	351,850	12.500	4,398,125.000	
	GLOBE TELECOM INC	2,785	1,728.000	4,812,480.000	

	INTERNATIONAL CONTAINER TERM SERVICES INC	40,680	92.150	3,748,662.000	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	280,350	46.450	13,022,257.500	
	JOLLIBEE FOODS CORP	44,130	278.000	12,268,140.000	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	82,037	65.050	5,336,506.850	
	BDO UNIBANK INC	172,483	118.000	20,352,994.000	
	MEGAWORLD CORP	962,000	4.500	4,329,000.000	
	PLDT INC	8,600	1,220.000	10,492,000.000	
	ROBINSONS LAND CORP	218,722	20.350	4,450,992.700	
	SECURITY BANK CORP	23,420	145.000	3,395,900.000	
	SM PRIME HOLDINGS INC	900,475	32.700	29,445,532.500	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	63,330	125.000	7,916,250.000	
	SM INVESTMENTS CORP	23,168	888.000	20,573,184.000	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CORP	1,148,900	4.750	5,457,275.000	
	ABOITIZ POWER CORP	128,200	32.500	4,166,500.000	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	24,200	380.800	9,215,360.000	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	9,387	728.000	6,833,736.000	
フィリピン・ペソ	小計	5,732,580		233,429,565.550 (501,873,566)	
ブラジル・リアル	BRF SA	47,492	20.570	976,910.440	
	VALE SA	290,221	54.650	15,860,577.650	
	RAIA DROGASIL SA	20,600	66.000	1,359,600.000	
	TIM PARTICIPACOES SA	76,300	12.070	920,941.000	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	19,450	26.100	507,645.000	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	23,000	23.640	543,720.000	
	BANCO DO BRASIL SA	78,600	41.500	3,261,900.000	
	INVESTIMENTOS ITAU SA	414,560	11.550	4,788,168.000	
	LOJAS AMERICANAS SA	68,374	17.260	1,180,135.240	
	GERDAU SA	90,630	16.120	1,460,955.600	
	CIA BRASILEIRA DE DISTRIBUICAO GRUPO PAO DE ACUCAR	14,606	80.800	1,180,164.800	
	PETROLEO BRASILEIRO SA	269,210	28.130	7,572,877.300	
	PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	32,800	22.130	725,864.000	
	PETROLEO BRASILEIRO SA	360,512	25.460	9,178,635.520	
	KROTON EDUCACIONAL SA	122,968	10.350	1,272,718.800	
	CCR SA	113,920	10.450	1,190,464.000	
	WEG SA	74,072	18.600	1,377,739.200	
	BANCO BRADESCO SA PREF	308,425	35.680	11,004,604.000	
	BANCO BRADESCO SA	90,918	31.800	2,891,192.400	
	NATURA COSMETICOS SA	19,400	35.800	694,520.000	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	61,606	9.580	590,185.480	

SUZANO PAPEL E CELULOSE SA	39,900	34.400	1,372,560.000	
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	295,498	50.780	15,005,388.440	
PORTO SEGURO SA	8,800	53.030	466,664.000	
FIBRIA CELULOSE SA	22,490	69.700	1,567,553.000	
BRASKEM SA	12,930	52.790	682,574.700	
ENGIE BRASIL SA	17,370	40.960	711,475.200	
LOCALIZA RENT A CAR	45,880	26.960	1,236,924.800	
TELEFONICA BRASIL S.A.	39,428	43.500	1,715,118.000	
LOJAS RENNER SA	62,870	36.790	2,312,987.300	
EDP - ENERGIAS DO BRASIL SA	31,864	13.880	442,272.320	
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	32,152	40.490	1,301,834.480	
COSAN SA	16,200	34.310	555,822.000	
EQUATORIAL ENERGIA SA	16,700	69.250	1,156,475.000	
EMBRAER SA	63,360	20.380	1,291,276.800	
M DIAS BRANCO SA	10,400	43.330	450,632.000	
ODONTOPREV SA	27,800	13.380	371,964.000	
BR MALLS PARTICIPACOES SA	79,865	11.680	932,823.200	
JBS SA	89,900	9.960	895,404.000	
CIA ENERGETICA DE MINAS GERAIS	68,649	11.290	775,047.210	
CIA DE SANEAMENTO BASICO DO ESTADO DE SAO PAULO	25,798	27.060	698,093.880	
MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS IMOBILIARIOS SA	29,240	22.460	656,730.400	
SUL AMERICA SA	17,869	25.850	461,913.650	
HYPERA SA	33,800	30.000	1,014,000.000	
B3 SA-BRASIL BOLSA BAICAO	190,416	25.690	4,891,787.040	
MAGAZINE LUIZA SA	7,300	146.400	1,068,720.000	
BANCO SANTANDER BRASIL SA	37,100	41.650	1,545,215.000	
CIELO SA	111,307	10.600	1,179,854.200	
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	62,400	26.610	1,660,464.000	
ATACADAO DISTRIBUICAO COMERCIO E INDUSTRIA LTDA	37,300	15.630	582,999.000	
AMBEV SA	433,195	16.080	6,965,775.600	
KLABIN SA	64,800	18.100	1,172,880.000	
RUMO SA	97,800	16.480	1,611,744.000	
IRB BRASIL RESSEGUROS S/A	10,500	67.730	711,165.000	
ブラジル・リアル 小計	4,738,545		126,005,656.650 (3,848,212,754)	

ポーランド・ズロチ	BANK MILLENNIUM SA	49,782	9.500	472,929.000	
	MBANK	1,486	416.800	619,364.800	
	BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA	2,596	71.700	186,133.200	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	11,899	89.300	1,062,580.700	
	BANK PEKAO SA	16,338	111.000	1,813,518.000	
	ORANGE POLSKA SA	58,600	4.660	273,076.000	
	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	26,492	96.440	2,554,888.480	
	LPP SA	125	7,830.000	978,750.000	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	3,142	353.600	1,111,011.200	
	CD PROJEKT RED SA	6,015	149.800	901,047.000	
	POWSZECHNA KASA OSZCZEDNOSCI BANK POLSKI SA	77,884	41.720	3,249,320.480	
	CCC SA	2,763	189.000	522,207.000	
	GRUPA LOTOS SA	9,480	74.000	701,520.000	
	POLSKIE GORNICtwo NAFTOWE I GAZOWNICTWO SA	163,488	6.300	1,029,974.400	
	CYFROWY POLSAT SA	23,495	22.720	533,806.400	
	GRUPA AZOTY SA	3,853	26.160	100,794.480	
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	70,529	10.660	751,839.140	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZEN SA	53,451	41.640	2,225,699.640	
	JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA SA	5,380	75.900	408,342.000	
	ALIOR BANK SA	9,007	56.200	506,193.400	
DINO POLSKA SA	4,709	79.500	374,365.500		
PLAY COMMUNICATIONS SA	15,228	16.210	246,845.880		
ポーランド・ズロチ 小計	615,742		20,624,206.700 (620,169,895)		
マレーシア・リンギット	AMMB HOLDINGS BHD	170,200	4.040	687,608.000	
	GENTING PLANTATIONS BHD	18,800	9.780	183,864.000	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	419,200	5.570	2,334,944.000	
	DIGI.COM BHD	288,700	4.450	1,284,715.000	
	MALAYSIA AIRPORTS HOLDINGS BHD	91,320	8.030	733,299.600	
	RHB BANK BHD	106,380	5.260	559,558.800	
	HAP SENG CONSOLIDATED BHD	63,200	9.850	622,520.000	
	TOP GLOVE CORP BHD	133,800	5.780	773,364.000	
	GAMUDA BHD	194,600	2.400	467,040.000	
	GENTING BHD	202,500	6.780	1,372,950.000	
	YTL CORP BHD	283,710	1.080	306,406.800	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP BHD	20,256	18.800	380,812.800	
	HONG LEONG BANK BHD	62,508	20.620	1,288,914.960	

IJM CORP BHD	230,360	1.710	393,915.600		
IOI CORP BHD	187,213	4.560	853,691.280		
KUALA LUMPUR KEPONG BHD	43,200	24.880	1,074,816.000		
FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	12,800	33.840	433,152.000		
MALAYAN BANKING BHD	343,775	9.290	3,193,669.750		
ALLIANCE BANK MALAYSIA BHD	88,400	3.900	344,760.000		
MISC BHD	90,280	6.450	582,306.000		
NESTLE MALAYSIA BHD	5,800	143.700	833,460.000		
PPB GROUP BHD	57,360	16.980	973,972.800		
PETRONAS DAGANGAN BHD	19,600	27.000	529,200.000		
PETRONAS GAS BHD	60,400	18.760	1,133,104.000		
GENTING MALAYSIA BHD	288,700	3.580	1,033,546.000		
BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD	14,700	37.900	557,130.000		
TELEKOM MALAYSIA BHD	49,100	2.360	115,876.000		
SP SETIA BHD	66,300	2.100	139,230.000		
TENAGA NASIONAL BHD	281,150	15.000	4,217,250.000		
UMW HOLDINGS BHD	39,000	4.650	181,350.000		
DIALOG GROUP BHD	320,544	3.340	1,070,616.960		
PUBLIC BANK BHD(LOCAL)	270,230	24.700	6,674,681.000		
AIRASIA GROUP BHD	147,900	2.680	396,372.000		
MY EG SERVICES BHD	165,800	1.260	208,908.000		
SIME DARBY BERHAD	232,700	2.450	570,115.000		
HARTALEGA HOLDINGS BHD	95,900	6.300	604,170.000		
AXIATA GROUP BERHAD	265,500	3.580	950,490.000		
MAXIS BHD	203,300	5.450	1,107,985.000		
PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	233,700	9.590	2,241,183.000		
ASTRO MALAYSIA HOLDINGS BHD	140,500	1.250	175,625.000		
IHH HEALTHCARE BHD	220,400	4.850	1,068,940.000		
FGV HOLDINGS BHD	126,400	1.360	171,904.000		
WESTPORTS HOLDINGS BHD	109,200	3.770	411,684.000		
PRESS METAL ALUMINIUM HOLDINGS BHD	92,900	4.860	451,494.000		
SIME DARBY PROPERTY BHD	232,700	1.010	235,027.000		
SIME DARBY PLANTATION BHD	216,100	5.250	1,134,525.000		
IOI PROPERTIES GROUP SDN BHD	174,548	1.490	260,076.520		
マレーシア・リンギット 小計	7,181,634		45,320,223.870 (1,234,522,898)		
メキシコ・ペソ	ALFA SAB DE CV	264,100	22.990	6,071,659.000	
	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	51,400	123.660	6,356,124.000	
	EL PUERTO DE LIVERPOOL SAB DE CV	19,100	135.530	2,588,623.000	

	GRUPO TELEVISIA SAB	225,700	61.100	13,790,270.000	
	GRUPO BIMBO SAB DE CV	149,100	40.660	6,062,406.000	
	GRUMA SAB DE CV	19,445	235.330	4,575,991.850	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INFRAESTRUCTURA	20,260	191.480	3,879,384.800	
	GRUPO CARSO SAB DE CV	37,600	60.030	2,257,128.000	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE SAB DE CV	239,200	105.410	25,214,072.000	
	MEXICHEM SAB DE CV	81,325	54.110	4,400,495.750	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	14,695	272.280	4,001,154.600	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO SAB DE CV	115,200	30.290	3,489,408.000	
	ALSEA SAB DE CV	43,700	52.470	2,292,939.000	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL SURESTE SAB DE CV	17,990	307.160	5,525,808.400	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV	326,452	46.940	15,323,656.880	
	AMERICA MOVIL SAB DE CV	3,089,678	14.570	45,016,608.460	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA SA	198,800	26.920	5,351,696.000	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	42,600	106.070	4,518,582.000	
	WAL-MART DE MEXICO SAB DE CV	481,400	50.050	24,094,070.000	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL PACIFICO SAB DE CV	31,200	154.270	4,813,224.000	
	INFRAESTRUCTURA ENERGETICA NOVA SAB DE CV	54,500	75.290	4,103,305.000	
	BANCO SANTANDER MEXICO SA-B	174,090	26.410	4,597,716.900	
メキシコ・ペソ 小計		5,697,535		198,324,323.640 (1,124,498,916)	
ユーロ	PIRAEUS BANK S.A	25,000	1.168	29,200.000	
	ALPHA BANK A.E.	125,732	1.278	160,685.490	
	NATIONAL BANK OF GREECE	46,501	1.394	64,822.390	
	TITAN CEMENT CO. S.A.	4,089	19.380	79,244.820	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	22,051	10.430	229,991.930	
	FF GROUP	3,130	4.800	15,024.000	
	EUROBANK ERGASIAS	194,100	0.593	115,101.300	
	MOTOR OIL HELLAS CORINTH REFIN	5,847	19.380	113,314.860	
	OPAP SA	19,846	8.400	166,706.400	
	JUMBO SA	10,420	12.820	133,584.400	
ユーロ 小計		456,716		1,107,675.590 (142,845,845)	
韓国・ウォン	CHEIL WORLDWIDE INC	7,097	22,650.000	160,747,050.000	
	HANMI SCIENCE CO LTD	1,164	68,000.000	79,152,000.000	

HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	3,477	70,800.000	246,171,600.000	
SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANC	2,890	280,000.000	809,200,000.000	
DB INSURANCE CO LTD	4,763	70,200.000	334,362,600.000	
COWAY CO LTD	4,439	69,700.000	309,398,300.000	
KT&G CORP	10,886	100,500.000	1,094,043,000.000	
S-1 CORPORATION	1,444	93,600.000	135,158,400.000	
KOREA GAS CORP	1,727	53,600.000	92,567,200.000	
CJ CORP	1,597	119,000.000	190,043,000.000	
KAKAO CORP	4,755	100,500.000	477,877,500.000	
CJ ENM CO LTD	987	227,000.000	224,049,000.000	
SK TELECOM CO LTD	1,859	266,000.000	494,494,000.000	
DAELIM INDUSTRIAL CO	2,649	78,500.000	207,946,500.000	
MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD	39,704	7,160.000	284,280,640.000	
NCSOFT CORPORATION	1,574	440,500.000	693,347,000.000	
LG UPLUS CORP	16,563	15,550.000	257,554,650.000	
DOOSAN HEAVY INDUSTRIES AND CONSTRUCTION CO LTD	7,766	11,450.000	88,920,700.000	
DAEWOO ENGINEERING & CONSTRUCT	13,540	4,710.000	63,773,400.000	
POSCO DAEWOO CORP	3,600	19,150.000	68,940,000.000	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD	870	1,110,000.000	965,700,000.000	
LG CHEM LTD	4,230	327,500.000	1,385,325,000.000	
LG CHEM LTD	726	190,000.000	137,940,000.000	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD	201	675,000.000	135,675,000.000	
SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD	39,324	43,350.000	1,704,695,400.000	
S-OIL CORP	4,228	115,000.000	486,220,000.000	
HANWHA CHEMICAL CORPORATION	10,493	17,700.000	185,726,100.000	
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	5,997	29,450.000	176,611,650.000	
LOTTE CHEMICAL CORPORATION	1,576	281,500.000	443,644,000.000	
HOTEL SHILLA CO LTD	2,826	72,700.000	205,450,200.000	
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	3,537	129,000.000	456,273,000.000	
HYUNDAI MOBIS	6,310	193,000.000	1,217,830,000.000	
SK HYNIX INC	53,446	72,900.000	3,896,213,400.000	
HYUNDAI ENGINEERING & CONSTRUCTION CO LTD	7,570	50,900.000	385,313,000.000	
HYUNDAI MOTOR CO	2,642	65,800.000	173,843,600.000	
HYUNDAI MOTOR CO	14,048	105,000.000	1,475,040,000.000	
HYUNDAI STEEL CO	6,150	43,900.000	269,985,000.000	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	22,788	15,100.000	344,098,800.000	
KCC CORP	554	267,000.000	147,918,000.000	

KIA MOTORS CORP	22,988	28,850.000	663,203,800.000	
KOREA ZINC CO LTD	818	404,500.000	330,881,000.000	
KOREA ELECTRIC POWER CORP	22,108	28,150.000	622,340,200.000	
HANWHA CORP	3,785	29,300.000	110,900,500.000	
KOREAN AIR CO LTD	5,175	30,000.000	155,250,000.000	
OCI COMPANY LTD	1,829	96,800.000	177,047,200.000	
CJ LOGISTICS	860	155,500.000	133,730,000.000	
KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	1,930	87,400.000	168,682,000.000	
KT CORP	2,048	29,600.000	60,620,800.000	
HLB INC	2,994	88,200.000	264,070,800.000	
LG ELECTRONICS INC	9,919	71,400.000	708,216,600.000	
LOTTE CORP	1,940	51,600.000	100,104,000.000	
HANSSEM CO LTD	1,100	51,700.000	56,870,000.000	
LG CORP	9,120	67,900.000	619,248,000.000	
NH INVESTMENT & SECURITIES CO LTD	13,362	13,250.000	177,046,500.000	
GS ENGINEERING & CONSTRUCTION	4,872	41,350.000	201,457,200.000	
NAVER CORP	12,994	115,000.000	1,494,310,000.000	
HYUNDAI DEPARTMENT STORE CO LTD	1,249	87,400.000	109,162,600.000	
DONGSUH CO INC	3,149	18,100.000	56,996,900.000	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO LTD	4,153	64,700.000	268,699,100.000	
OTTOGI CORP	112	661,000.000	74,032,000.000	
AMOREPACIFIC GROUP	2,818	60,400.000	170,207,200.000	
KANGWON LAND INC	10,655	30,100.000	320,715,500.000	
POSCO	7,223	265,500.000	1,917,706,500.000	
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	11,910	18,150.000	216,166,500.000	
SAMSUNG SDI CO LTD	5,099	216,500.000	1,103,933,500.000	
SAMSUNG ELECTRO- MECHANICS CO LTD	4,863	120,000.000	583,560,000.000	
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	440,760	44,300.000	19,525,668,000.000	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES CO LTD	42,202	7,190.000	303,432,380.000	
SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	78,685	37,150.000	2,923,147,750.000	
SHINSEGAE CO LTD	646	264,000.000	170,544,000.000	
YUHAN CORP	836	235,000.000	196,460,000.000	
HANON SYSTEMS	13,644	10,800.000	147,355,200.000	
HYUNDAI MARINE & FIRE INSURANCE CO LTD	4,648	42,850.000	199,166,800.000	
GS HOLDINGS CORP	4,842	50,900.000	246,457,800.000	
LG DISPLAY CO LTD	18,262	17,950.000	327,802,900.000	
CELLTRION INC	7,527	229,500.000	1,727,446,500.000	
VIROMED CO LTD	1,302	193,600.000	252,067,200.000	

HANA FINANCIAL GROUP	27,700	38,300.000	1,060,910,000.000	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	1,800	120,500.000	216,900,000.000	
CELLTRION PHARM INC	1,457	53,900.000	78,532,300.000	
LOTTE SHOPPING CO	839	218,000.000	182,902,000.000	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LTD	6,614	92,300.000	610,472,200.000	
AMOREPACIFIC CORP	3,024	157,000.000	474,768,000.000	
AMOREPACIFIC CORP-PREF	848	87,800.000	74,454,400.000	
SAMSUNG CARD CO	2,877	33,550.000	96,523,350.000	
SK INNOVATION CO LTD	6,038	200,000.000	1,207,600,000.000	
CJ CHEILJEDANG CORP	830	343,000.000	284,690,000.000	
STX PAN OCEAN CO LTD	18,395	4,750.000	87,376,250.000	
KEPCO PLANT SERVICE & ENGINEERING CO LTD	2,170	28,500.000	61,845,000.000	
LG INNOTEK CO LTD	1,440	110,500.000	159,120,000.000	
SK HOLDINGS CO LTD	2,981	262,000.000	781,022,000.000	
KB FINANCIAL GROUP INC	36,634	47,800.000	1,751,105,200.000	
MEDY-TOX INC	409	544,000.000	222,496,000.000	
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES LTD	6,602	31,800.000	209,943,600.000	
BNK FINANCIAL GROUP INC	25,264	7,740.000	195,543,360.000	
HANMI PHARM CO LTD	623	418,500.000	260,725,500.000	
HANWHA LIFE INSURANCE CO LTD	27,836	4,580.000	127,488,880.000	
E-MART CO LTD	1,699	202,500.000	344,047,500.000	
DGB FINANCIAL GROUP INC	10,752	9,010.000	96,875,520.000	
GS RETAIL CO LTD	2,482	35,900.000	89,103,800.000	
HANKOOK TIRE CO LTD NEW	6,590	41,250.000	271,837,500.000	
HDC HYUNDAI DEVELOPMENT CO-ENGINEERING & CONSTRUCTION	1,688	41,600.000	70,220,800.000	
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOLDINGS CO LTD	773	376,500.000	291,034,500.000	
BGF RETAIL CO LTD	854	170,500.000	145,607,000.000	
ORION CORP REPUBLIC OF KOREA	2,071	92,000.000	190,532,000.000	
ORANGE LIFE INSURANCE LTD	3,735	32,200.000	120,267,000.000	
NETMARBLE CORP	2,446	118,500.000	289,851,000.000	
SAMSUNG SDS CO LTD	3,043	191,000.000	581,213,000.000	
WOORI BANK	41,071	15,800.000	648,921,800.000	
SAMSUNG C&T CORP	6,626	105,000.000	695,730,000.000	
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	1,432	368,000.000	526,976,000.000	
PEARL ABYSS CORP	534	207,500.000	110,805,000.000	
DOOSAN BOBCAT INC	4,778	35,750.000	170,813,500.000	
SILLAJEN INC	4,787	72,200.000	345,621,400.000	
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	2,735	67,000.000	183,245,000.000	
韓国・ウォン 小計	1,374,901		70,707,355,980.000	

(7,134,372,218)

香港・ドル	JIANGXI COPPER CO LTD	125,000	9.210	1,151,250.000	
	JIANGSU EXPRESS	124,000	10.500	1,302,000.000	
	CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD	156,000	4.690	731,640.000	
	ANGANG STEEL CO LTD-H	104,000	6.790	706,160.000	
	CHINA MOBILE LIMITED	563,000	72.900	41,042,700.000	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	116,000	41.500	4,814,000.000	
	DATANG INTERNATIONAL POWER GEN	288,000	1.800	518,400.000	
	BEIJING ENTERPRISES	49,000	45.050	2,207,450.000	
	HUANENG POWER INTERNATIONAL IN	400,000	4.580	1,832,000.000	
	ALIBABA HEALTH INFORMATION TECHNOLOGY	322,000	7.230	2,328,060.000	
	YANZHOU COAL MINING CO LTD	136,000	7.520	1,022,720.000	
	HENGAN INTERNATIONAL GROUP	65,000	62.850	4,085,250.000	
	HUADIAN POWER INTL CORP- H	144,000	3.100	446,400.000	
	CHONGQING CHANGAN AUTOMOBILE	63,600	4.910	312,276.000	
	CHINA EASTERN AIRLINES CORP LT	124,000	4.770	591,480.000	
	CNOOC LTD	1,636,000	13.540	22,151,440.000	
	BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	270,000	6.780	1,830,600.000	
	CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LTD	434,000	18.300	7,942,200.000	
	CHINA OVERSEAS LAND & INVESTME	353,120	25.200	8,898,624.000	
	CHINA RESOURCES LAND LTD	256,888	27.150	6,974,509.200	
	CITIC LTD	535,000	12.120	6,484,200.000	
	CHINA TRAVEL INTERNATIONAL INV	198,000	2.190	433,620.000	
	BEIJING CAPITAL INTERNATIONAL	162,000	8.800	1,425,600.000	
	LENOVO GROUP LTD	642,000	5.800	3,723,600.000	
	PETRO CHINA CO LTD	1,918,000	5.910	11,335,380.000	
	SKYWORTH DIGITAL HOLDINGS LTD	162,000	1.870	302,940.000	
	CHINA UNICOM HONG KONG LTD	566,742	8.410	4,766,300.220	
	CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS CO LTD	145,390	26.550	3,860,104.500	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL COR	2,329,200	6.710	15,628,932.000	

TONG REN TANG TECHNOLOGIES CO	54,000	11.020	595,080.000	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	90,000	18.920	1,702,800.000	
KINGDEE INTERNATIONAL SOFTWARE GROUP CO LTD	220,000	7.120	1,566,400.000	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	71,000	68.750	4,881,250.000	
KUNLUN ENERGY COMPANY LTD	288,000	9.940	2,862,720.000	
TOWNGAS CHINA CO LTD	91,000	5.600	509,600.000	
COSCO SHIPPING PORTS LTD	162,000	7.660	1,240,920.000	
YUEXIU PROPERTY CO LTD	742,000	1.320	979,440.000	
CHINA MERCHANTS PORT HOLDINGS CO LTD	128,000	13.900	1,779,200.000	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	374,000	2.990	1,118,260.000	
SHENZHEN INTERNATIONAL HOLDING	84,500	14.980	1,265,810.000	
CHINA EVERBRIGHT LTD	82,000	14.060	1,152,920.000	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	157,400	25.900	4,076,660.000	
KINGBOARD HOLDINGS LTD	63,500	21.500	1,365,250.000	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LTD	457,000	14.560	6,653,920.000	
SHENZHEN INVESTMENT LTD	306,000	2.420	740,520.000	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LTD	82,000	30.300	2,484,600.000	
BYD CO LTD	55,500	53.300	2,958,150.000	
CHINA TELECOM CORP LTD	1,244,000	3.830	4,764,520.000	
CHINA OILFIELD SERVICES LTD	172,000	7.550	1,298,600.000	
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	1,220,000	1.060	1,293,200.000	
SINOTRANS LTD	190,000	3.020	573,800.000	
CHINA EVERBRIGHT INTERNATIONAL	321,592	6.800	2,186,825.600	
MMG LTD	220,000	3.430	754,600.000	
LEE & MAN PAPER MANUFACTURING LTD	97,000	6.540	634,380.000	
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	625,788	8.030	5,025,077.640	
AVICHINA INDUSTRY & TECHNOLOGY	126,000	5.430	684,180.000	
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS	189,200	13.860	2,622,312.000	
GREAT WALL MOTOR COMPANY LTD	300,500	4.630	1,391,315.000	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	692,000	16.280	11,265,760.000	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD	561,000	2.930	1,643,730.000	

SHANDONG WEIGAO GROUP MEDICAL-H	176,000	7.440	1,309,440.000	
SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	274,700	6.350	1,744,345.000	
WEICHA I POWER CO LTD	176,440	8.250	1,455,630.000	
CHINA SHIPPING DEVELOPMENT CO	100,000	4.240	424,000.000	
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEMICAL	215,000	3.550	763,250.000	
SHANGHAI INDUSTRIAL	46,000	16.560	761,760.000	
TINGYI HOLDING CORP	178,000	12.500	2,225,000.000	
TSINGTAO BREWERY CO LTD	26,000	31.650	822,900.000	
GUANGDONG INVESTMENTS LTD	280,000	14.200	3,976,000.000	
CHINA TRADITIONAL CHINESE MEDICINE HOLDINGS CO LTD	208,000	5.100	1,060,800.000	
CHINA RESOURCES BEER HOLDINGS	135,333	27.300	3,694,590.900	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO LTD	146,000	6.120	893,520.000	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	644,500	7.890	5,085,105.000	
CHINA SHIPPING CONTAINER LINES	247,000	0.850	209,950.000	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	254,000	24.500	6,223,000.000	
TENCENT HOLDINGS LTD	522,200	279.200	145,798,240.000	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	479,000	77.150	36,954,850.000	
BEIJING ENTERPRISES WATER GROUP LTD	550,000	4.230	2,326,500.000	
GOME RETAIL HOLDINGS LTD	970,240	0.770	747,084.800	
CHINA POWER INTERNATIONAL	350,000	1.600	560,000.000	
AIR CHINA / HONG KONG	132,000	7.140	942,480.000	
ZTE CORP	71,288	15.200	1,083,577.600	
SHANGHAI ELECTRIC GROUP CO LTD	250,000	2.680	670,000.000	
CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD	306,500	18.600	5,700,900.000	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO LTD	248,500	2.910	723,135.000	
BANK OF COMMUNICATIONS	752,205	5.950	4,475,619.750	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT HOLDINGS LTD	142,250	5.630	800,867.500	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	67,500	54.900	3,705,750.000	
CHINA CONSTRUCTION BANK	8,820,530	6.430	56,716,007.900	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP HOLDINGS LTD	70,000	92.150	6,450,500.000	

DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	258,000	7.670	1,978,860.000	
AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	152,000	9.110	1,384,720.000	
SSY GROUP LTD	144,000	7.750	1,116,000.000	
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS LTD	168,000	7.490	1,258,320.000	
CHINA NATIONAL BLDG MATERIAL	364,000	6.130	2,231,320.000	
BANK OF CHINA LTD	7,259,200	3.350	24,318,320.000	
SHUI ON LAND LTD	335,500	1.700	570,350.000	
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	113,500	17.060	1,936,310.000	
GREENTOWN CHINA HOLDINGS LTD	82,000	5.750	471,500.000	
GUANGZHOU R&F PROPERTIES CO LTD	62,000	11.640	721,680.000	
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	355,470	31.750	11,286,172.500	
IND & COMM BK OF CHINA - H	6,359,235	5.340	33,958,314.900	
ZHAOJIN MINING INDUSTRY CO LTD	96,000	6.830	655,680.000	
KINGBOARD LAMINATES HOLDING	104,000	6.500	676,000.000	
CHINA COMMUNICATIONS SERVICES	227,600	6.270	1,427,052.000	
CHINA COMMUNICATIONS CONSTRUCTION CO LTD	397,000	7.440	2,953,680.000	
CHINA COAL ENERGY CO	178,000	3.500	623,000.000	
HAITIAN INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	64,000	16.140	1,032,960.000	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC CO LTD	51,000	42.450	2,164,950.000	
HAIER ELECTRONICS GROUP CO LTD	120,000	17.160	2,059,200.000	
CHINA AGRI-INDUSTRIES HOLDINGS LTD	191,000	2.670	509,970.000	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD	704,142	8.690	6,118,993.980	
CHINA MOLYBDENUM CO LTD	369,000	3.280	1,210,320.000	
CHINA CITIC BANK-H	811,800	4.850	3,937,230.000	
KWG GROUP HOLDINGS LTD	121,000	6.080	735,680.000	
SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	65,900	72.300	4,764,570.000	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	97,000	34.450	3,341,650.000	
FOSUN INTERNATIONAL	230,028	11.980	2,755,735.440	
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP LTD	502,000	3.400	1,706,800.000	

SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD	308,500	3.250	1,002,625.000	
SOHO CHINA LTD	172,500	2.780	479,550.000	
KINGSOFT CORP LTD	76,000	11.760	893,760.000	
GCL POLY ENERGY HOLDINGS LTD	1,362,000	0.560	762,720.000	
SINOTRUK HONG KONG LTD	64,500	11.900	767,550.000	
CHINA RAILWAY GROUP LTD	338,000	7.390	2,497,820.000	
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS LTD	122,000	7.300	890,600.000	
BYD ELECTRONIC INTERNATIONAL CO LTD	79,000	10.320	815,280.000	
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION CORP	178,000	10.320	1,836,960.000	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	450,000	5.530	2,488,500.000	
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	232,000	30.500	7,076,000.000	
CHINA EVERGRANDE GROUP	237,000	18.680	4,427,160.000	
CRRC CORP LTD - H	384,450	7.090	2,725,750.500	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDINGS LTD	126,000	10.000	1,260,000.000	
CHONG SING HOLDINGS FINTECH GROUP LTD	1,656,000	0.355	587,880.000	
SUN ART RETAIL GROUP LTD	179,000	9.470	1,695,130.000	
BBMG CORP	222,000	2.250	499,500.000	
CHINA ZHONGWANG HOLDINGS LTD	145,200	3.440	499,488.000	
SINOPHARM GROUP CO	107,600	39.150	4,212,540.000	
CHINA RESOURCES CEMENT	236,000	7.200	1,699,200.000	
METALLURGICAL CORP OF CHINA LTD	276,000	1.930	532,680.000	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD	274,527	7.920	2,174,253.840	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL BANK	256,000	4.370	1,118,720.000	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP CORP	242,000	6.220	1,505,240.000	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD	59,100	18.480	1,092,168.000	
HUANENG RENEWABLES CORP LTD	472,000	2.350	1,109,200.000	
SIHUA PHARMACEUTICAL HOLDINGS GROUP LTD	325,000	1.670	542,750.000	
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	218,000	21.650	4,719,700.000	
YUZHOU PROPERTIES CO LTD	166,000	2.850	473,100.000	
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	128,500	20.350	2,614,975.000	
NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	75,800	36.750	2,785,650.000	

CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	563,156	5.700	3,209,989.200	
KAISA GROUP HOLDINGS LTD	203,000	2.020	410,060.000	
XINJIANG GOLDWIND SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	60,000	7.010	420,600.000	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD	257,000	3.400	873,800.000	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA	2,705,000	3.500	9,467,500.000	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS LTD	55,000	14.920	820,600.000	
FAR EAST HORIZON LTD	199,000	7.460	1,484,540.000	
CITIC SECURITIES CO LTD	184,000	14.260	2,623,840.000	
FUTURE LAND DEVELOPMENT HOLDINGS LTD	172,000	4.560	784,320.000	
HAITONG SECURITIES CO LTD	288,000	7.990	2,301,120.000	
CHINA INTERNATIONAL MARINE CONTAINERS GROUP CO LTD	39,400	7.190	283,286.000	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROUP OF CHINA LTD	705,000	3.400	2,397,000.000	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	46,000	26.450	1,216,700.000	
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	334,000	3.320	1,108,880.000	
SINOPEC ENGINEERING GROUP CO LTD	121,500	7.390	897,885.000	
CHINA GALAXY SECURITIES CO LTD	328,500	3.960	1,300,860.000	
HANERGY THIN FILM POWER GROUP	986,000	0.000	0.000	
NEXTEER AUTOMOTIVE GROUP LTD	85,000	11.560	982,600.000	
CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS CO LTD	323,000	0.000	0.000	
GREENTOWN SERVICE GROUP CO LTD	96,000	5.440	522,240.000	
JIAYUAN INTERNATIONAL GROUP LTD	94,000	14.720	1,383,680.000	
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO LTD	42,400	15.500	657,200.000	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA CO LTD	267,000	4.780	1,276,260.000	
GENSCRIPT BIOTECH CORP	74,000	12.840	950,160.000	
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLDINGS CO LTD	95,000	11.000	1,045,000.000	

	CHINA FIRST CAPITAL GROUP LTD	308,000	3.030	933,240.000	
	CHINA TOWER CORP LTD	3,224,000	1.160	3,739,840.000	
	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	276,000	2.900	800,400.000	
	CHINA CINDA ASSET MANAGEMENT CO LTD	796,000	1.960	1,560,160.000	
	LOGAN PROPERTY HOLDINGS CO LTD	134,000	7.860	1,053,240.000	
	CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS LTD	154,000	24.050	3,703,700.000	
	CHINA VANKE CO LTD-H	113,761	25.250	2,872,465.250	
	LUYE PHARMA GROUP LTD	108,000	6.090	657,720.000	
	CAR INC	68,000	6.080	413,440.000	
	HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	39,000	16.360	638,040.000	
	CGN POWER CO LTD	981,000	1.930	1,893,330.000	
	FULLSHARE HOLDINGS LTD	517,500	3.070	1,588,725.000	
	BAIC MOTOR CORP LTD	163,500	4.400	719,400.000	
	GF SECURITIES CO LTD	127,400	10.780	1,373,372.000	
	FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD	51,200	24.550	1,256,960.000	
	HUATAI SECURITIES CO LTD	112,600	13.000	1,463,800.000	
	3SBIO INC	122,500	12.920	1,582,700.000	
	LEGEND HOLDINGS CORP	31,500	22.100	696,150.000	
	CHINA RESOURCES PHARMACEUTICAL GROUP LTD	146,000	11.900	1,737,400.000	
	CHINA HUARONG ASSET MANAGEMENT CO LTD	904,000	1.440	1,301,760.000	
	CHINA LITERATURE LTD	17,200	42.800	736,160.000	
	DALI FOODS GROUP CO LTD	188,000	5.520	1,037,760.000	
	CHINA RAILWAY SIGNAL & COMMUNICATION CORP LTD	141,000	5.260	741,660.000	
	CHINA REINSURANCE GROUP CORP	525,000	1.470	771,750.000	
	MEITU INC	152,500	4.190	638,975.000	
	BOC AVIATION LTD	20,300	59.850	1,214,955.000	
	ZHONGAN ONLINE P&C INSURANCE CO LTD	15,500	29.000	449,500.000	
	CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CORP LTD	101,200	13.800	1,396,560.000	
	WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	44,500	63.550	2,827,975.000	
	HENG TEN NETWORKS GROUP LTD	2,096,000	0.275	576,400.000	
香港・ドル	小計	87,847,275		779,713,886.220 (11,344,837,045)	
台湾・ドル	ACER INC	278,532	21.300	5,932,731.600	
	ASUSTEK COMPUTER INC	57,554	229.500	13,208,643.000	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	46,616	124.000	5,780,384.000	

ASIA CEMENT CORP	160,928	33.050	5,318,670.400	
WALSIN TECHNOLOGY CORP	31,000	162.000	5,022,000.000	
TAIWAN BUSINESS BANK	371,457	10.550	3,918,871.350	
VANGUARD INTERNATIONAL SEMICONDUCTOR CORP	85,000	59.900	5,091,500.000	
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO LTD	65,000	73.500	4,777,500.000	
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	54,975	60.700	3,336,982.500	
QUANTA COMPUTER INC	235,858	49.400	11,651,385.200	
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	48,070	46.200	2,220,834.000	
EVA AIRWAYS CORP	149,269	14.400	2,149,473.600	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	54,760	268.500	14,703,060.000	
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	509,345	17.850	9,091,808.250	
CHINA AIRLINES	232,156	9.650	2,240,305.400	
CHENG SHIN RUBBER INDUSTRY CO	138,169	41.500	5,734,013.500	
CHINA STEEL CORP	1,122,058	24.250	27,209,906.500	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD/TAIWAN	195,994	29.850	5,850,420.900	
ADVANTECH CO LTD	29,889	231.000	6,904,359.000	
COMPAL ELECTRONICS INC	360,304	17.450	6,287,304.800	
DELTA ELECTRONICS INC	170,663	128.000	21,844,864.000	
NANYA TECHNOLOGY CORP	73,000	54.200	3,956,600.000	
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	337,327	107.000	36,093,989.000	
AU OPTRONICS CORP	810,194	12.200	9,884,366.800	
TAIWAN MOBILE CO LTD	146,800	109.000	16,001,200.000	
EVERGREEN MARINE CORP	187,590	11.250	2,110,387.500	
FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	275,824	30.950	8,536,752.800	
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	29,825	191.000	5,696,575.000	
ECLAT TEXTILE CO LTD	13,322	383.500	5,108,987.000	
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	51,285	133.500	6,846,547.500	
FORMOSA PLASTICS CORP	373,633	101.000	37,736,933.000	
FORMOSA TAFFETA CO LTD	61,000	34.250	2,089,250.000	
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE CO	292,594	107.500	31,453,855.000	
GIANT MANUFACTURING	30,151	122.500	3,693,497.500	
MEDIATEK INC	124,507	228.500	28,449,849.500	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD	561,936	51.100	28,714,929.600	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	701,232	17.700	12,411,806.400	
HOTAI MOTOR CO LTD	25,000	217.500	5,437,500.000	

FAR EASTONE TELECOMMUNICATIONS CO LTD	144,000	73.200	10,540,800.000	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	876,141	15.550	13,623,992.550	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	691,920	51.000	35,287,920.000	
CHINA DEPT FINANCIAL HOLDING	1,183,403	10.100	11,952,370.300	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO LTD	790,168	21.200	16,751,561.600	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	1,117,225	76.100	85,020,822.500	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LTD	908,495	26.450	24,029,692.750	
LARGAN PRECISION CO LTD	9,220	3,080.000	28,397,600.000	
TAISHIN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	956,589	13.950	13,344,416.550	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING CO	831,061	10.300	8,559,928.300	
INVENTEC CO LTD	174,005	26.300	4,576,331.500	
HTC CORPORATION	79,832	38.500	3,073,532.000	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	159,845	38.000	6,074,110.000	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	792,443	10.700	8,479,140.100	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,460,048	21.150	30,880,015.200	
MACRONIX INTERNATIONAL	196,861	18.650	3,671,457.650	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO LTD	915,220	20.250	18,533,205.000	
POWERTECH TECHNOLOGY INC	61,560	69.100	4,253,796.000	
NAN YA PLASTICS CORP	437,828	76.600	33,537,624.800	
WISTRON CORP	266,916	18.650	4,977,983.400	
POU CHEN CORP	183,990	31.500	5,795,685.000	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CORP	397,297	72.100	28,645,113.700	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	45,392	317.500	14,411,960.000	
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	108,480	117.000	12,692,160.000	
PHISON ELECTRONICS CORP	7,658	210.000	1,608,180.000	
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	54,393	43.850	2,385,133.050	
RUENTEX INDUSTRIES LTD	20,829	78.200	1,628,827.800	
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	63,588	67.200	4,273,113.600	
STANDARD FOODS CORP	34,639	47.000	1,628,033.000	
SYNNEX TECHNOLOGY INTERNATIONAL CORP	85,899	34.000	2,920,566.000	
TAIWAN CEMENT CORP	406,561	34.900	14,188,978.900	

	TECO ELECTRIC AND MACHINERY CO LTD	161,000	17.950	2,889,950.000	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR	2,099,083	231.000	484,888,173.000	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	1,073,525	10.600	11,379,365.000	
	WINBOND ELECTRONICS CORP	324,000	13.650	4,422,600.000	
	YAGEO CORP	23,160	329.000	7,619,640.000	
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	118,000	31.100	3,669,800.000	
	INNOLUX CORPORATION	820,345	10.100	8,285,484.500	
	WPG HOLDINGS CO LTD	130,203	35.800	4,661,267.400	
	HIWIN TECHNOLOGIES CORP	23,073	215.500	4,972,231.500	
	TAIMED BIOLOGICS INC	18,000	158.000	2,844,000.000	
	PEGATRON CORP	178,554	52.200	9,320,518.800	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	13,000	261.000	3,393,000.000	
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	38,000	113.500	4,313,000.000	
	CHAILEASE HOLDING CO LTD	101,737	92.100	9,369,977.700	
	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING LTD	48,385	69.200	3,348,242.000	
	TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL HOLDING	687,412	17.900	12,304,674.800	
	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	280,903	60.600	17,022,721.800	
	GLOBALWAFERS CO LTD	21,000	294.000	6,174,000.000	
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	15,000	214.500	3,217,500.000	
	GENERAL INTERFACE SOLUTION HOLDING LTD	18,000	98.800	1,778,400.000	
	台湾・ドル 小計	28,146,703		1,474,116,642.350 (5,454,231,576)	
南アフリカ・ランド	BIDVEST GROUP LTD	29,572	195.590	5,783,987.480	
	CLICKS GROUP LTD	22,975	194.500	4,468,637.500	
	TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	42,993	83.990	3,610,982.070	
	DISCOVERY LTD	31,052	163.950	5,090,975.400	
	REDEFINE PROPERTIES LTD	469,360	10.350	4,857,876.000	
	GOLD FIELDS LTD	81,159	38.860	3,153,838.740	
	REMGRO LTD	46,304	203.940	9,443,237.760	
	THE FOSCHINI GROUP LTD	19,873	171.520	3,408,616.960	
	MMI HOLDINGS LTD	100,343	18.700	1,876,414.100	
	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	260,960	24.700	6,445,712.000	
	EXXARO RESOURCES LTD	19,195	148.520	2,850,841.400	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	3,704	1,094.050	4,052,361.200	
	LIBERTY HOLDINGS LTD	7,234	112.750	815,633.500	
	MTN GROUP LTD	156,894	85.000	13,335,990.000	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	38,047	137.820	5,243,637.540	

TELKOM SA SOC LTD	31,588	56.940	1,798,620.720	
FIRSTRAND LTD	310,663	69.350	21,544,479.050	
PSG GROUP LTD	14,638	230.870	3,379,475.060	
NASPERS LTD	40,195	2,744.920	110,332,059.400	
CORONATION FUND MANAGERS LTD	26,700	48.980	1,307,766.000	
NEDBANK GROUP LTD	37,625	262.300	9,869,037.500	
NETCARE LTD	105,465	25.500	2,689,357.500	
PICK'N PAY STORES LTD	31,255	73.000	2,281,615.000	
RMB HOLDINGS LTD	61,174	80.930	4,950,811.820	
ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	6,200	515.940	3,198,828.000	
SAPPI LTD	48,883	83.480	4,080,752.840	
SASOL LTD	50,637	472.960	23,949,275.520	
SHOPRITE HOLDINGS LTD	41,381	194.260	8,038,673.060	
MR PRICE GROUP LTD	23,411	247.470	5,793,520.170	
STANDARD BANK GROUP LTD	119,169	174.710	20,820,015.990	
SPAR GROUP LTD/THE	16,512	183.890	3,036,391.680	
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	88,009	55.630	4,895,940.670	
IMPERIAL HOLDINGS LTD	16,088	163.570	2,631,514.160	
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LTD	34,576	162.200	5,608,227.200	
ABSA GROUP LTD	64,032	158.190	10,129,222.080	
TIGER BRANDS LTD	15,245	280.860	4,281,710.700	
SANLAM LTD	166,835	77.020	12,849,631.700	
INVESTEC LTD	19,077	93.000	1,774,161.000	
KUMBA IRON ORE LTD	5,327	285.890	1,522,936.030	
PIONEER FOODS LTD	15,500	86.760	1,344,780.000	
MONDI LTD	10,866	329.910	3,584,802.060	
LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDINGS LTD	133,101	25.840	3,439,329.840	
RMI HOLDINGS	55,278	37.170	2,054,683.260	
VODACOM GROUP PTY LTD	57,212	130.320	7,455,867.840	
NEPI ROCKCASTLE PLC	32,983	124.990	4,122,545.170	
OLD MUTUAL LTD	443,070	23.650	10,478,605.500	
REINET INVESTMENTS SCA	13,993	248.030	3,470,683.790	
FORTRESS REIT LTD-A	102,950	17.250	1,775,887.500	
BID CORP LTD	29,931	290.810	8,704,234.110	
南アフリカ・ランド 小計	3,599,234		391,634,183.570 (3,109,575,417)	
合計	225,233,775		49,280,562,825 (49,280,562,825)	

(2) 株式以外の有価証券

平成30年11月12日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	メキシコ・ペソ	CEMEX SAB DE CV	1,348,675.000	14,444,309.250	
		FOMENTO ECONOMICO MEXICANO SAB DE CV	179,300.000	32,566,259.000	
	メキシコ・ペソ	小計	1,527,975.000	47,010,568.250 (266,549,922)	
投資信託受益証券 合計			1,527,975	266,549,922 (266,549,922)	
投資証券	トルコ・リラ	EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATIRIM	81,071.000	135,388.570	
	トルコ・リラ	小計	81,071.000	135,388.570 (2,829,621)	
	メキシコ・ペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	316,200.000	6,997,506.000	
	メキシコ・ペソ	小計	316,200.000	6,997,506.000 (39,675,859)	
	南アフリカ・ランド	FORTRESS REIT LTD-B	95,302.000	1,506,724.620	
		HYPROP INVESTMENTS LTD	22,174.000	2,104,312.600	
		RESILIENT REIT LTD	28,600.000	1,887,600.000	
南アフリカ・ランド	小計	146,076.000	5,498,637.220 (43,659,180)		
投資証券 合計			543,347	86,164,660 (86,164,660)	
合計				352,714,582 (352,714,582)	

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

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

3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入 投資信託 受益証券 時価比率	組入 投資証券 時価比率	有価証券の 合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	株式 47銘柄	11.32%	-%	-%	11.49%
アラブ首長国連邦・ディ ルハム	株式 10銘柄	0.62%	-%	-%	0.63%
インド・ルピー	株式 80銘柄	8.27%	-%	-%	8.40%
インドネシア・ルピア	株式 28銘柄	2.16%	-%	-%	2.19%
オフショア・人民元	株式 76銘柄	0.73%	-%	-%	0.74%
カタール・リアル	株式 11銘柄	1.01%	-%	-%	1.03%
コロンビア・ペソ	株式 9銘柄	0.44%	-%	-%	0.45%
タイ・バーツ	株式 34銘柄	2.46%	-%	-%	2.50%
チェコ・コルナ	株式 4銘柄	0.20%	-%	-%	0.20%
チリ・ペソ	株式 19銘柄	1.04%	-%	-%	1.06%
トルコ・リラ	株式 23銘柄 投資証券 1銘柄	0.67% -%	-% -%	-% 0.01%	0.69%
ハンガリー・フォリント	株式 3銘柄	0.31%	-%	-%	0.32%
パキスタン・ルピー	株式 5銘柄	0.07%	-%	-%	0.07%
フィリピン・ペソ	株式 23銘柄	1.00%	-%	-%	1.01%
ブラジル・レアル	株式 54銘柄	7.63%	-%	-%	7.75%
ポーランド・ズロチ	株式 22銘柄	1.23%	-%	-%	1.25%
マレーシア・リンギット	株式 47銘柄	2.45%	-%	-%	2.49%
メキシコ・ペソ	株式 22銘柄 投資信託 受益証券 2銘柄 投資証券 1銘柄	2.23% -% -%	-% 0.53% -%	-% -% 0.08%	2.88%
ユーロ	株式 10銘柄	0.28%	-%	-%	0.29%
韓国・ウォン	株式 115銘柄	14.15%	-%	-%	14.37%
香港・ドル	株式 205銘柄	22.51%	-%	-%	22.86%
台湾・ドル	株式 89銘柄	10.82%	-%	-%	10.99%
南アフリカ・ランド	株式 49銘柄 投資証券 3銘柄	6.17% -%	-% -%	-% 0.09%	6.35%

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

「エマージング債券パッシブ・マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位:円)

科 目	注記 番号	平成30年11月12日現在
資産の部		
流動資産		
預金		1,613,215,186
コール・ローン		5,359,158,381
国債証券		97,977,153,832
派生商品評価勘定		15,232,000
未収利息		769,425,417
前払費用		177,292,927
流動資産合計		105,911,477,743
資産合計		105,911,477,743
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		1,983,000
未払金		25,864,582,130
未払解約金		23,244,000
流動負債合計		25,889,809,130
負債合計		25,889,809,130
純資産の部		
元本等		
元本	1	44,101,164,374
剰余金		
剰余金又は欠損金()		35,920,504,239
元本等合計		80,021,668,613
純資産合計		80,021,668,613
負債純資産合計		105,911,477,743

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11月12日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額 同期中追加設定元本額 同期中一部解約元本額	63,604,054,491円 23,833,945,866円 43,336,835,983円
元本の内訳	
ファンド名 D I A M新興国債券インデックスファンド<為替ヘッジなし>（ファンドラップ） たわらノーロード バランス（8資産均等型） たわらノーロード バランス（堅実型） 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 最適化バランス（保守型） たわらノーロード 最適化バランス（安定型） たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型） たわらノーロード 最適化バランス（成長型） たわらノーロード 最適化バランス（積極型）	280,921,552円 100,885,788円 5,099,547円 15,783,421円 9,873,707円 96,195円 154,401円 988,734円 322,201円 495,875円

マネックス資産設計ファンド エボリューション	58,646,088円
DIAM DC 8資産バラン スファンド(新興国10)	195,394,626円
DIAM DC 8資産バラン スファンド(新興国20)	168,433,969円
DIAM DC 8資産バラン スファンド(新興国30)	335,742,291円
投資のソムリエ	4,639,045,809円
クルーズコントロール	609,518,736円
投資のソムリエ<DC年金>	410,029,279円
DIAM 8資産バラン スファンドN<DC年金>	136,881,733円
クルーズコントロール<DC年 金>	409,093円
DIAMコア資産設計ファンド (堅実型)	3,338,720円
DIAMコア資産設計ファンド (積極型)	9,361,762円
投資のソムリエ<DC年金>リ スク抑制型	209,652,500円
ダイナミック・ナビゲーション	155,255円
リスク抑制世界8資産バラン ス ファンド	3,846,484,840円
ワールドアセットバランス(基 本コース)	802,579,470円
ワールドアセットバランス(リ スク抑制コース)	1,948,638,194円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤ-2045)	2,390,210円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤ-2055)	1,746,182円
リスク抑制世界8資産バラン ス ファンド(DC)	1,208,112円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤ-2035)	3,427,188円
リスクコントロール世界資産分 散ファンド	999,638,917円
9資産分散投資・スタンダード <DC年金>	13,655円
エマージング債券リスク抑制型 (適格機関投資家限定)	8,022,732,877円
エマージング債券パッシブファ ンドVA(適格機関投資家専 用)	2,274,682,942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)	4,909,635,061円
DIAM世界アセットバランス ファンド3VA(適格機関投資 家限定)	4,683,472,017円

D I A Mグローバル・リスク ファクター・パリティ戦略ファ ンド（適格機関投資家限定）	3,677,052,381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II（適格機関投資家限 定）	1,953,933,838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）	3,782,297,208円
計	44,101,164,374円
2 . 受益権の総数	44,101,164,374口

(金融商品に関する注記)

1 . 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成30年5月25日 至 平成30年11月12日
1 . 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2 . 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。
3 . 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成30年11月12日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
国債証券	3,144,581,945
合計	3,144,581,945

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(平成30年4月19日から平成30年11月12日まで)に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	平成30年11月12日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買 建	26,598,930,000	-	26,612,179,000	13,249,000
アメリカ・ドル	26,598,930,000	-	26,612,179,000	13,249,000
合計	26,598,930,000	-	26,612,179,000	13,249,000

（注）時価の算定方法

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

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	平成30年11月12日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.8145円 (18,145円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

平成30年11月12日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	BRAZIL 2.625 01/05/23	7,400,000.000	6,869,050.000	
		BRAZIL 4.25 01/07/25	13,100,000.000	12,646,609.000	
		BRAZIL 4.625 01/13/28	10,600,000.000	9,961,456.000	
		BRAZIL 4.875 01/22/21	13,400,000.000	13,654,600.000	
		BRAZIL 5.0 01/27/45	12,000,000.000	10,045,440.000	
		BRAZIL 5.625 01/07/41	9,300,000.000	8,590,875.000	
		BRAZIL 5.625 02/21/47	9,600,000.000	8,708,352.000	
		BRAZIL 6.0 04/07/26	7,800,000.000	8,164,416.000	
		BRAZIL 7.125 01/20/37	7,500,000.000	8,296,875.000	
		BRAZIL 8.25 01/20/34	6,600,000.000	7,978,080.000	
		BRAZIL 8.75 02/04/25	3,800,000.000	4,587,550.000	
		COLOMBIA 2.625 03/15/23	4,700,000.000	4,403,289.000	
		COLOMBIA 3.875 04/25/27	9,600,000.000	9,064,704.000	
		COLOMBIA 4.0 02/26/24	9,500,000.000	9,340,875.000	
		COLOMBIA 4.375 07/12/21	9,600,000.000	9,703,200.000	
		COLOMBIA 4.5 01/28/26	5,600,000.000	5,579,672.000	
		COLOMBIA 5.0 06/15/45	17,000,000.000	15,963,170.000	
		COLOMBIA 5.625 02/26/44	8,600,000.000	8,741,986.000	
		COLOMBIA 6.125 01/18/41	9,400,000.000	10,048,694.000	
		COLOMBIA 7.375 09/18/37	6,600,000.000	7,911,750.000	
		COLOMBIA 8.125 05/21/24	2,500,000.000	2,932,750.000	
		CROATIA 5.5 04/04/23	8,600,000.000	9,023,464.000	
		CROATIA 6.0 01/26/24	5,600,000.000	6,033,216.000	
		CROATIA 6.375 03/24/21	8,500,000.000	8,902,050.000	
		CROATIA 6.625 07/14/20	9,800,000.000	10,225,320.000	
		HUNGARY 5.375 02/21/23	8,700,000.000	9,131,520.000	
		HUNGARY 5.375 03/25/24	8,000,000.000	8,471,680.000	
		HUNGARY 5.75 11/22/23	9,800,000.000	10,473,946.000	
		HUNGARY 6.25 01/29/20	10,300,000.000	10,641,136.000	
		HUNGARY 6.375 03/29/21	12,200,000.000	12,917,848.000	
		HUNGARY 7.625 03/29/41	4,800,000.000	6,495,216.000	
		INDONESIA 2.95 01/11/23	3,800,000.000	3,604,794.000	
		INDONESIA 3.375 04/15/23	4,500,000.000	4,319,550.000	
		INDONESIA 3.5 01/11/28	2,600,000.000	2,359,656.000	
INDONESIA 3.75 04/25/22	6,600,000.000	6,497,964.000			
INDONESIA 3.85 07/18/27	2,000,000.000	1,859,800.000			
INDONESIA 4.1 04/24/28	4,400,000.000	4,173,576.000			
INDONESIA 4.125 01/15/25	8,600,000.000	8,355,330.000			
INDONESIA 4.35 01/08/27	5,800,000.000	5,609,644.000			
INDONESIA 4.35 01/11/48	5,200,000.000	4,501,952.000			

INDONESIA 4.625 04/15/43	4,200,000.000	3,750,600.000	
INDONESIA 4.75 01/08/26	8,200,000.000	8,207,790.000	
INDONESIA 4.875 05/05/21	10,500,000.000	10,743,810.000	
INDONESIA 5.125 01/15/45	5,800,000.000	5,472,706.000	
INDONESIA 5.25 01/08/47	4,000,000.000	3,833,080.000	
INDONESIA 5.25 01/17/42	6,900,000.000	6,668,505.000	
INDONESIA 5.875 01/15/24	6,400,000.000	6,754,560.000	
INDONESIA 5.95 01/08/46	3,200,000.000	3,368,800.000	
INDONESIA 6.75 01/15/44	6,500,000.000	7,498,205.000	
INDONESIA 7.75 01/17/38	6,100,000.000	7,628,355.000	
PANAMA 3.75 03/16/25	7,000,000.000	6,842,500.000	
PANAMA 3.875 03/17/28	6,800,000.000	6,538,268.000	
PANAMA 4.5 05/15/47	4,800,000.000	4,478,496.000	
PANAMA 5.2 01/30/20	6,800,000.000	6,958,984.000	
PANAMA 6.7 01/26/36	10,800,000.000	12,933,000.000	
PANAMA 7.125 01/29/26	5,000,000.000	5,840,250.000	
PANAMA 9.375 04/01/29	4,900,000.000	6,780,620.000	
PERU 4.125 08/25/27	7,600,000.000	7,676,000.000	
PERU 5.625 11/18/50	13,600,000.000	15,251,312.000	
PERU 6.55 03/14/37	6,800,000.000	8,252,480.000	
PERU 7.35 07/21/25	11,200,000.000	13,448,400.000	
PHILIPPINES 3.0 02/01/28	5,600,000.000	5,136,432.000	
PHILIPPINES 3.7 02/02/42	5,200,000.000	4,666,584.000	
PHILIPPINES 3.7 03/01/41	6,000,000.000	5,400,960.000	
PHILIPPINES 3.95 01/20/40	6,200,000.000	5,783,236.000	
PHILIPPINES 4.0 01/15/21	5,400,000.000	5,453,406.000	
PHILIPPINES 4.2 01/21/24	4,400,000.000	4,471,984.000	
PHILIPPINES 5.0 01/13/37	4,200,000.000	4,500,972.000	
PHILIPPINES 5.5 03/30/26	3,400,000.000	3,701,784.000	
PHILIPPINES 6.375 01/15/32	3,200,000.000	3,858,848.000	
PHILIPPINES 6.375 10/23/34	5,800,000.000	7,100,476.000	
PHILIPPINES 6.5 01/20/20	3,800,000.000	3,952,114.000	
PHILIPPINES 7.75 01/14/31	5,700,000.000	7,507,356.000	
PHILIPPINES 9.5 02/02/30	6,200,000.000	8,964,828.000	
ROMANIA 4.375 08/22/23	8,400,000.000	8,406,972.000	
ROMANIA 4.875 01/22/24	5,000,000.000	5,105,200.000	
ROMANIA 6.125 01/22/44	4,200,000.000	4,540,536.000	
ROMANIA 6.75 02/07/22	10,100,000.000	10,899,516.000	
RUSSIA FOREIGN BOND 5.0 04/29/20	16,000,000.000	16,264,480.000	
RUSSIAN FEDERATION 03/31/30	10,831,500.000	11,736,688.450	
RUSSIAN FEDERATION 4.25 06/23/27	8,600,000.000	8,039,968.000	

RUSSIAN FEDERATION 4.375 03/21/29	5,000,000.000	4,678,050.000	
RUSSIAN FEDERATION 4.5 04/04/22	8,400,000.000	8,461,488.000	
RUSSIAN FEDERATION 4.75 05/27/26	11,600,000.000	11,356,284.000	
RUSSIAN FEDERATION 4.875 09/16/23	10,400,000.000	10,579,504.000	
RUSSIAN FEDERATION 5.25 06/23/47	22,600,000.000	20,344,520.000	
RUSSIAN FEDERATION 5.625 04/04/42	10,200,000.000	10,226,316.000	
RUSSIAN FEDERATION 5.875 09/16/43	5,600,000.000	5,784,968.000	
SOUTH AFRICA 4.3 10/12/28	8,200,000.000	7,100,052.000	
SOUTH AFRICA 4.665 01/17/24	5,900,000.000	5,702,232.000	
SOUTH AFRICA 4.875 04/14/26	5,400,000.000	5,053,860.000	
SOUTH AFRICA 5.0 10/12/46	4,000,000.000	3,258,080.000	
SOUTH AFRICA 5.375 07/24/44	4,000,000.000	3,377,640.000	
SOUTH AFRICA 5.5 03/09/20	7,800,000.000	7,899,918.000	
SOUTH AFRICA 5.65 09/27/47	4,600,000.000	3,953,654.000	
SOUTH AFRICA 5.875 05/30/22	3,800,000.000	3,901,688.000	
SOUTH AFRICA 5.875 09/16/25	8,200,000.000	8,173,678.000	
UNITED MEXICAN STATES 3.5 01/21/21	6,800,000.000	6,763,280.000	
UNITED MEXICAN STATES 3.6 01/30/25	9,400,000.000	8,854,800.000	
UNITED MEXICAN STATES 3.625 03/15/22	6,900,000.000	6,786,150.000	
UNITED MEXICAN STATES 3.75 01/11/28	9,200,000.000	8,457,100.000	
UNITED MEXICAN STATES 4.0 10/02/23	10,300,000.000	10,137,981.000	
UNITED MEXICAN STATES 4.125 01/21/26	8,400,000.000	8,090,208.000	
UNITED MEXICAN STATES 4.15 03/28/27	11,600,000.000	11,022,204.000	
UNITED MEXICAN STATES 4.35 01/15/47	6,400,000.000	5,358,400.000	
UNITED MEXICAN STATES 4.6 01/23/46	10,400,000.000	8,967,400.000	

	UNITED MEXICAN STATES 4.6 02/10/48	8,600,000.000	7,476,582.000	
	UNITED MEXICAN STATES 4.75 03/08/44	14,800,000.000	13,098,000.000	
	UNITED MEXICAN STATES 5.55 01/21/45	9,400,000.000	9,280,244.000	
	UNITED MEXICAN STATES 5.75 10/12/2110	7,800,000.000	7,234,500.000	
	UNITED MEXICAN STATES 6.05 01/11/40	10,500,000.000	10,920,000.000	
	UNITED MEXICAN STATES 6.75 09/27/34	5,600,000.000	6,392,400.000	
	アメリカ・ドル 小計	851,131,500.000 (96,977,923,110)	859,901,297.450 (97,977,153,831)	
国債証券 合計		96,977,923,110 (96,977,923,110)	97,977,153,832 (97,977,153,832)	
合計		96,977,923,110 (96,977,923,110)	97,977,153,832 (97,977,153,832)	

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	有価証券の合計金額 に対する比率
アメリカ・ドル	国債証券 112銘柄	122.44%	100%

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

- (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) 当ファンドは当中間計算期間より中間財務諸表を作成しているため、中間損益及び剰余金計算書に係る比較情報は記載しておりません。
- (3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間(平成30年11月13日から令和1年5月12日まで)の中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による中間監査を受けております。

【中間財務諸表】

【リスクコントロール世界資産分散ファンド】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第1期 平成30年11月12日現在	第2期中間計算期間末 令和1年5月12日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	892,499,865	918,884,178
親投資信託受益証券	15,277,997,195	15,195,424,498
派生商品評価勘定	-	21,219,402
未収入金	-	10,637,145
流動資産合計	16,170,497,060	16,146,165,223
資産合計	16,170,497,060	16,146,165,223
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	36,190,431	-
未払金	-	2,252,919
未払解約金	15,147,911	16,773,760
未払受託者報酬	1,913,786	2,541,426
未払委託者報酬	61,242,669	81,327,009
その他未払費用	250,846	321,834
流動負債合計	114,745,643	103,216,948
負債合計	114,745,643	103,216,948
純資産の部		
元本等		
元本	1 16,326,185,927	1 15,940,050,600
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金 ()	2 270,434,510	2 102,897,675
(分配準備積立金)	98,696,164	84,086,702
元本等合計	16,055,751,417	16,042,948,275
純資産合計	16,055,751,417	16,042,948,275
負債純資産合計	16,170,497,060	16,146,165,223

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位 : 円)

	第2期中間計算期間 自 平成30年11月13日 至 令和1年5月12日
営業収益	
有価証券売買等損益	385,427,303
為替差損益	71,818,859
営業収益合計	457,246,162
営業費用	
支払利息	314,777
受託者報酬	2,541,426
委託者報酬	81,327,009
その他費用	332,634
営業費用合計	84,515,846
営業利益又は営業損失()	372,730,316
経常利益又は経常損失()	372,730,316
中間純利益又は中間純損失()	372,730,316
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()	45,924,458
期首剰余金又は期首欠損金()	270,434,510
剰余金増加額又は欠損金減少額	46,526,327
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	40,598,939
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	5,927,388
剰余金減少額又は欠損金増加額	-
分配金	-
中間剰余金又は中間欠損金()	102,897,675

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における中間計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第1期 平成30年11月12日現在	第2期中間計算期間末 令和1年5月12日現在
1. 1 期首元本額	5,541,516,151円	16,326,185,927円
期中追加設定元本額	11,699,564,143円	2,148,675,803円
期中一部解約元本額	914,894,367円	2,534,811,130円
2. 受益権の総数	16,326,185,927口	15,940,050,600口
3. 2 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は270,434,510円であります。	

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	第1期 平成30年11月12日現在	第2期中間計算期間末 令和1年5月12日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	第1期 平成30年11月12日現在				第2期中間計算期間末 令和1年5月12日現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	2,572,930,069	-	2,609,120,500	36,190,431	2,470,585,702	-	2,449,366,300	21,219,402
アメリカ・ドル	159,741,054	-	161,510,800	1,769,746	397,535,760	-	394,596,000	2,939,760
イギリス・ポンド	1,129,067,940	-	1,148,784,000	19,716,060	558,161,450	-	549,433,500	8,727,950
オーストラリア・ドル	160,841,808	-	165,141,600	4,299,792	318,333,448	-	316,210,000	2,123,448
カナダ・ドル	319,893,420	-	322,462,800	2,569,380	318,951,520	-	316,375,200	2,576,320
ユーロ	803,385,847	-	811,221,300	7,835,453	877,603,524	-	872,751,600	4,851,924
合計	2,572,930,069	-	2,609,120,500	36,190,431	2,470,585,702	-	2,449,366,300	21,219,402

(注) 時価の算定方法

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

(1口当たり情報に関する注記)

	第1期 平成30年11月12日現在	第2期中間計算期間末 令和1年5月12日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9834円 (9,834円)	1.0065円 (10,065円)

（参考）

当ファンドは、「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、「外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「エマージング株式パッシブ・マザーファンド」受益証券及び「エマージング債券パッシブ・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同親投資信託の受益証券であります。

同親投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」の状況

貸借対照表

（単位：円）

科 目	注記 番号	平成30年11月12日現在	令和1年5月12日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		5,155,250,321	2,730,751,598
株式	2	272,635,488,350	250,098,682,370
派生商品評価勘定		125,473,720	-
未収入金		2,490,000	3,450,069,252
未収配当金		2,490,276,626	3,084,235,269
前払金		-	202,658,000
流動資産合計		280,408,979,017	259,566,396,489
資産合計		280,408,979,017	259,566,396,489
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		36,093,260	162,165,104
前受金		96,415,000	-
未払金		-	38,081,656
未払解約金		100,079,000	2,739,623,000
流動負債合計		232,587,260	2,939,869,760
負債合計		232,587,260	2,939,869,760
純資産の部			
元本等			
元本	1	108,734,086,652	106,043,562,064
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		171,442,305,105	150,582,964,665
元本等合計		280,176,391,757	256,626,526,729
純資産合計		280,176,391,757	256,626,526,729
負債純資産合計		280,408,979,017	259,566,396,489

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11月12日現在	令和1年5月12日現在
1 . 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	112,039,446,703円	108,734,086,652円
同期中追加設定元本額	17,951,318,450円	15,079,647,719円
同期中一部解約元本額	21,256,678,501円	17,770,172,307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	11,697,020,513円	12,705,971,247円
DIAM国内株式パッシブ・ファンド	2,636,340,260円	2,209,708,663円
MITO ラップ型ファンド（安定型）	3,392,166円	2,776,822円
MITO ラップ型ファンド（中立型）	7,271,489円	6,407,379円
MITO ラップ型ファンド（積極型）	12,819,569円	10,742,961円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	23,465,281円	24,757,834円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	19,553,564円	17,148,451円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	15,762,405円	13,336,583円
たわらノーロード TOPIX	329,917,368円	434,493,296円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	71,295,544円	150,637,603円
たわらノーロード バランス（堅実型）	1,824,425円	3,968,202円
たわらノーロード バランス（標準型）	13,158,737円	27,667,408円

たわらノーロード バランス(積極型)	30,484,387円	50,305,629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)	207,028円	333,213円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定型)	7,013,112円	15,538,315円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定成長型)	24,379,741円	46,430,552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)	18,546,921円	35,720,390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)	45,453,081円	92,184,414円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	45,290円	112,058円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	81,801円	371,941円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	802,595円	1,093,732円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	594,633円	781,357円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	1,996,341円	2,306,377円
DIAM国内株式インデックスファンド<DC年金>	38,157,146,657円	37,802,432,532円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	866,672,184円	940,891,344円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	2,921,011,264円	3,154,126,509円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	3,056,587,421円	3,279,459,479円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	343,429,890円	362,680,254円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	1,146,466,084円	1,203,137,370円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	1,093,778,761円	1,136,448,601円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	41,354,593円	40,885,253円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	1,084,339,387円	1,118,241,297円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	26,126,648円	26,814,455円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	278,344,409円	301,951,492円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	179,762,429円	206,415,620円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	314,461,765円	361,762,945円
投資のソムリエ	435,971,927円	1,012,613,774円
クルーズコントロール	842,058,816円	595,681,946円
投資のソムリエ<DC年金>	38,585,097円	102,090,612円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	198,688,170円	235,662,888円

D I A M D C バランス・F (成長型)	253,355,924円	288,895,928円
クルーズコントロール< D C 年金 >	564,859円	457,292円
D I A M コア資産設計ファンド (堅実型)	6,887,934円	5,341,489円
D I A M コア資産設計ファンド (積極型)	19,416,091円	14,082,058円
投資のソムリエ< D C 年金> リス ク抑制型	23,826,329円	55,887,859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	449,675円	537,967円
投資のソムリエ(ターゲット・イ ヤー 2 0 4 5)	436,641,186円	832,904,380円
投資のソムリエ(ターゲット・イ ヤー 2 0 5 5)	957,696円	770,660円
リスク抑制世界 8 資産バランス ファンド(D C)	698,794円	660,054円
投資のソムリエ(ターゲット・イ ヤー 2 0 3 5)	137,950円	398,130円
4 資産分散投資・スタンダード< D C 年金>	1,294,784円	1,304,168円
リスクコントロール世界資産分散 ファンド	14,501,814円	17,827,736円
9 資産分散投資・スタンダード< D C 年金>	126,294,522円	127,640,253円
投資のソムリエ(ターゲット・イ ヤー 2 0 4 0)	18,666円	11,522,716円
投資のソムリエ(ターゲット・イ ヤー 2 0 5 0)	- 円	165,239円
投資のソムリエ(ターゲット・イ ヤー 2 0 6 0)	- 円	165,239円
D I A M ワールドバランス 2 5 V A (適格機関投資家限定)	- 円	165,239円
日米資産配分戦略ファンド(イン カム重視型)(為替ヘッジあり) (適格機関投資家限定)	67,427,854円	68,260,865円
D I A M グローバル・バランス ファンド 2 5 V A (適格機関投資 家限定)	54,483,445円	170,735,594円
D I A M グローバル・バランス ファンド 5 0 V A (適格機関投資 家限定)	114,888,153円	111,818,273円
D I A M 国際分散バランスファン ド 3 0 V A (適格機関投資家限 定)	281,866,607円	276,518,648円
D I A M 国際分散バランスファン ド 5 0 V A (適格機関投資家限 定)	15,210,643円	14,966,287円
D I A M 国内重視バランスファン ド 3 0 V A (適格機関投資家限 定)	64,068,386円	62,244,920円
D I A M 国内重視バランスファン ド 3 0 V A (適格機関投資家限 定)	16,333,666円	16,544,054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)	15,639,738円	13,651,393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)	30,068,459円	24,826,443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)	54,409,906円	52,022,479円
D I A Mバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	1,031,544,058円	975,171,149円
D I A Mバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	969,394,849円	941,659,932円
D I A Mバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	2,699,937,775円	2,652,461,896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)	190,097,600円	191,211,915円
D I A Mグローバル・アセット・バランスVA2(適格機関投資家限定)	52,061,278円	51,284,088円
D I A M アクサ グローバルバランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	556,287,813円	535,887,060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)	415,622,156円	294,344,031円
D I A Mグローバル 私募ファンド(適格機関投資家向け)	10,313,671円	10,473,598円
D I A M世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	7,515,147円	3,260,240円
D I A M世界バランスファンド35VA(適格機関投資家限定)	54,862,660円	44,003,211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)	10,522,058,392円	6,545,722,787円
D I A M世界アセットバランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	318,492,171円	68,320,118円
D I A M世界アセットバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	1,757,785,389円	1,474,320,222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)	10,040,664,400円	9,543,130,643円
D I A Mバランス30VA(適格機関投資家限定)	4,713,385円	4,787,332円
D I A Mバランス50VA(適格機関投資家限定)	283,368円	422,354円
D I A Mバランス70VA(適格機関投資家限定)	3,856,479円	3,462,578円
D I A M世界アセットバランスファンド4VA(適格機関投資家限定)	8,983,887,646円	9,083,209,948円

	D I A M世界バランス25VA (適格機関投資家限定)	70,355,143円	63,081,431円
	D I A M国内バランス30VA (適格機関投資家限定)	28,070,236円	25,540,005円
	D I A Mバランス20VA(適格 機関投資家限定)	25,624,221円	26,002,777円
	D I A Mバランス40VA(適格 機関投資家限定)	102,630円	107,163円
	D I A Mバランス60VA(適格 機関投資家限定)	115,943円	121,688円
	D I A M世界アセットバランス ファンド7VA(1212)(適 格機関投資家限定)	405,365,089円	426,124,037円
	D I A M世界アセットバランス ファンド7VA(1303)(適 格機関投資家限定)	1,261,532,817円	1,335,152,689円
	D I A M世界アセットバランス ファンド7VA(1306)(適 格機関投資家限定)	1,669,062,351円	1,766,916,070円
	D I A M世界アセットバランス ファンド7VA(1309)(適 格機関投資家限定)	68,825,151円	72,976,941円
	計	108,734,086,652円	106,043,562,064円
2 .	受益権の総数	108,734,086,652口	106,043,562,064口
3 .	2 差入代用有価証券	株式 3,354,500,000円	株式 3,268,500,000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11月12日現在	令和1年5月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

株式関連

種類	平成30年11月12日 現在				令和1年5月12日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
先物取引								
買 建	9,685,780,000	-	9,775,350,000	89,570,000	5,518,133,000	-	5,356,080,000	162,053,000
合計	9,685,780,000	-	9,775,350,000	89,570,000	5,518,133,000	-	5,356,080,000	162,053,000

(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はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成30年11月12日現在	令和1年5月12日現在
1口当たり純資産額	2.5767円	2.4200円
(1万口当たり純資産額)	(25,767円)	(24,200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11月12日現在	令和1年5月12日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		10,671,441,201	3,332,498,449
国債証券		281,418,097,000	245,739,145,800
地方債証券		21,797,227,799	22,120,443,914
特殊債券		17,887,346,574	18,000,412,398
社債券		15,237,807,960	13,759,301,940
未収利息		736,262,657	597,974,056
前払費用		49,723,823	27,264,807
流動資産合計		347,797,907,014	303,577,041,364
資産合計		347,797,907,014	303,577,041,364
負債の部			
流動負債			
未払解約金		9,655,308,000	2,045,428,000
流動負債合計		9,655,308,000	2,045,428,000
負債合計		9,655,308,000	2,045,428,000
純資産の部			
元本等			
元本	1	263,721,851,914	229,960,133,494
剰余金			
剰余金又は欠損金()		74,420,747,100	71,571,479,870
元本等合計		338,142,599,014	301,531,613,364
純資産合計		338,142,599,014	301,531,613,364
負債純資産合計		347,797,907,014	303,577,041,364

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11月12日現在	令和1年5月12日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額 同期中追加設定元本額 同期中一部解約元本額	269,142,481,010円 68,401,864,960円 73,822,494,056円	263,721,851,914円 55,261,250,870円 89,022,969,290円
元本の内訳 ファンド名		
D I A M国内債券パッシブ・ファンド	17,408,404,294円	18,902,513,598円
M I T O ラップ型ファンド（安定型）	116,744,280円	98,053,779円
M I T O ラップ型ファンド（中立型）	90,125,269円	82,246,467円
M I T O ラップ型ファンド（積極型）	28,070,090円	24,354,225円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	808,008,087円	880,944,106円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	242,214,024円	220,149,406円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	34,579,469円	30,264,961円
たわらノーロード 国内債券	4,989,236,046円	6,947,929,059円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	137,544,608円	275,392,714円
たわらノーロード バランス（堅実型）	32,166,405円	66,039,285円
たわらノーロード バランス（標準型）	62,077,910円	124,161,272円
たわらノーロード バランス（積極型）	11,623,832円	18,420,856円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（保守型）	5,379,624円	8,120,673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）	81,880,890円	147,319,678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）	111,554,132円	184,040,245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）	29,055,116円	50,325,957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)	15,002,139円	15,683,586円
たわらノーロード 最適化バラン ス(保守型)	1,295,989円	3,058,234円
たわらノーロード 最適化バラン ス(安定型)	690,905円	2,930,581円
たわらノーロード 最適化バラン ス(安定成長型)	3,474,718円	3,867,176円
たわらノーロード 最適化バラン ス(成長型)	679,107円	753,039円
たわらノーロード 最適化バラン ス(積極型)	17,517円	17,517円
D I A M国内債券インデックス ファンド<DC年金>	12,888,678,854円	13,291,485,772円
D I A Mバランス・ファンド<D C年金>1安定型	5,907,177,396円	6,179,052,430円
D I A Mバランス・ファンド<D C年金>2安定・成長型	8,536,682,088円	8,666,930,599円
D I A Mバランス・ファンド<D C年金>3成長型	3,449,028,586円	3,451,342,667円
D I A M DC バランス30イ ンデックスファンド	1,826,821,087円	1,807,954,378円
D I A M DC バランス50イ ンデックスファンド	2,023,278,584円	1,990,233,226円
D I A M DC バランス70イ ンデックスファンド	316,274,220円	308,704,546円
マネックス資産設計ファンド<隔 月分配型>	88,374,891円	86,634,077円
マネックス資産設計ファンド<育 成型>	2,323,339,829円	2,370,479,584円
マネックス資産設計ファンド エ ボリューション	2,827,451円	2,490,772円
D I A M DC 8資産バランス ファンド(新興国10)	3,170,586,023円	3,277,101,062円
D I A M DC 8資産バランス ファンド(新興国20)	749,121,254円	817,166,619円
D I A M DC 8資産バランス ファンド(新興国30)	161,069,244円	172,992,778円
投資のソムリエ	8,284,268,559円	10,459,196,481円
クルーズコントロール	1,724,636,935円	1,143,789,884円
投資のソムリエ<DC年金>	733,113,467円	1,066,611,254円
D I A M 8資産バランスファン ドN<DC年金>	2,256,116,469円	2,559,168,033円
D I A M DC バランス・F (成長型)	286,051,968円	302,651,515円
クルーズコントロール<DC年金 >	1,156,783円	876,869円
D I A Mコア資産設計ファンド (堅実型)	4,671,623円	3,452,774円
D I A Mコア資産設計ファンド (積極型)	13,207,726円	9,063,016円
投資のソムリエ<DC年金>リス ク抑制型	996,404,083円	808,865,228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	1,733,391円 18,251,393,459円	520,335円 11,911,955,294円
投資のソムリエ(ターゲット・イ ヤー2045)	2,587,926円	3,600,682円
投資のソムリエ(ターゲット・イ ヤー2055)	1,888,453円	3,090,147円
リスク抑制世界8資産バランス ファンド(DC)	5,733,648円	5,664,744円
投資のソムリエ(ターゲット・イ ヤー2035)	3,709,153円	6,409,341円
4資産分散投資・スタンダード< DC年金>	75,826,070円	88,808,598円
リスクコントロール世界資産分散 ファンド	1,797,723,485円	1,696,259,921円
9資産分散投資・スタンダード< DC年金>	290,676円	161,651,507円
投資のソムリエ(ターゲット・イ ヤー2040)	-円	770,958円
投資のソムリエ(ターゲット・イ ヤー2050)	-円	770,958円
投資のソムリエ(ターゲット・イ ヤー2060)	-円	770,958円
DIAMエマージング債券ファン ド	9,450,010円	9,450,010円
DIAM国内債券パッシブファン ド(適格機関投資家向け)	22,705,000,385円	7,854,443,915円
DIAMワールドバランス25V A(適格機関投資家限定)	438,328,491円	432,674,494円
One収益追求型マルチアセット 戦略ファンド(適格機関投資家限 定)	-円	2,650,787,553円
One収益追求型マルチアセット 戦略ファンドII(適格機関投資 家限定)	-円	2,646,517,337円
One収益追求型マルチアセット 戦略ファンドIII(適格機関投 資家限定)	-円	2,631,578,948円
DIAMグローバル・バランス ファンド25VA(適格機関投資 家限定)	272,739,106円	258,919,345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)	222,896,584円	213,163,558円
DIAM国際分散バランスファン ド30VA(適格機関投資家限 定)	70,267,221円	67,366,203円
DIAM国際分散バランスファン ド50VA(適格機関投資家限 定)	190,121,761円	180,364,957円
DIAM国内重視バランスファン ド30VA(適格機関投資家限 定)	80,778,823円	79,782,211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)	41,245,185円	35,103,218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)	89,222,117円	71,864,140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)	161,461,305円	150,560,465円
D I A Mバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	5,444,421,012円	5,016,994,510円
D I A Mバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	2,877,336,317円	2,724,303,533円
D I A Mバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	5,340,448,902円	5,114,987,353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)	564,247,587円	552,640,864円
D I A Mグローバル・アセット・バランスVA2(適格機関投資家限定)	258,167,248円	246,895,424円
D I A M アクサ グローバルバランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	3,303,558,731円	3,097,407,617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)	822,350,080円	567,569,589円
D I A Mグローバル 私募ファンド(適格機関投資家向け)	194,752,933円	188,050,355円
D I A M世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	44,645,422円	18,873,801円
D I A M世界バランスファンド35VA(適格機関投資家限定)	88,242,707円	68,195,527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)	55,525,240,297円	33,667,426,804円
D I A M世界アセットバランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	630,206,232円	131,768,687円
D I A M世界アセットバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	6,958,172,222円	5,688,983,764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)	26,484,173,718円	24,547,598,614円
D I A Mバランス30VA(適格機関投資家限定)	74,743,861円	74,059,784円
D I A Mバランス50VA(適格機関投資家限定)	1,402,145円	2,039,477円
D I A Mバランス70VA(適格機関投資家限定)	7,629,980円	6,671,737円
D I A M世界アセットバランスファンド4VA(適格機関投資家限定)	29,631,100,239円	29,200,921,409円

D I A M世界バランス25VA (適格機関投資家限定)	457,580,297円	400,898,007円
D I A M国内バランス30VA (適格機関投資家限定)	129,163,855円	114,693,716円
D I A Mバランス20VA(適格 機関投資家限定)	508,066,309円	502,356,635円
D I A Mバランス40VA(適格 機関投資家限定)	711,790円	724,680円
D I A Mバランス60VA(適格 機関投資家限定)	381,210円	391,832円
計	263,721,851,914円	229,960,133,494円
2. 受益権の総数	263,721,851,914口	229,960,133,494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11月12日現在	令和1年5月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	平成30年11月12日現在	令和1年5月12日現在
1口当たり純資産額	1,282円	1,311円
（1万口当たり純資産額）	（12,822円）	（13,112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11月12日現在	令和1年5月12日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		1,701,032,743	572,944,624
投資証券		31,472,460,490	25,544,545,750
派生商品評価勘定		16,985,592	15,406,092
未収入金		-	5,382,059,134
未収配当金		298,443,790	317,829,449
差入委託証拠金		10,492,092	10,141,092
流動資産合計		33,499,414,707	31,842,926,141
資産合計		33,499,414,707	31,842,926,141
負債の部			
流動負債			
前受金		9,263,592	12,071,592
未払金		914,711,606	-
未払解約金		370,110,400	3,351,291,000
流動負債合計		1,294,085,598	3,363,362,592
負債合計		1,294,085,598	3,363,362,592
純資産の部			
元本等			
元本	1	16,951,549,055	13,884,496,370
剰余金			
剰余金又は欠損金()		15,253,780,054	14,595,067,179
元本等合計		32,205,329,109	28,479,563,549
純資産合計		32,205,329,109	28,479,563,549
負債純資産合計		33,499,414,707	31,842,926,141

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11月12日現在	令和1年5月12日現在
1 . 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	19,741,077,965円	16,951,549,055円
同期中追加設定元本額	7,430,580,484円	10,810,762,421円
同期中一部解約元本額	10,220,109,394円	13,877,815,106円
元本の内訳		
ファンド名		
MITO ラップ型ファンド（安定型）	280,843円	401,306円
MITO ラップ型ファンド（中立型）	1,025,234円	1,033,619円
MITO ラップ型ファンド（積極型）	2,030,344円	1,626,471円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	1,911,261円	3,615,887円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	2,803,635円	2,767,037円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	2,454,496円	2,018,402円
たわらノーロード 国内リート	1,598,347,549円	2,292,578,555円
たわらノーロード 国内リート<ラップ向け>	637,901,090円	691,659,608円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	97,030,025円	180,045,841円
たわらノーロード バランス（堅実型）	1,229,846円	2,374,980円
たわらノーロード バランス（標準型）	25,399,955円	48,058,302円
たわらノーロード バランス（積極型）	41,185,845円	61,174,871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)	11,498,642円	19,145,858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)	41,640,627円	63,566,471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)	25,341,445円	40,621,256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)	53,823,143円	93,538,090円
たわらノーロード 最適化バラン ス(安定型)	167,960円	687,704円
たわらノーロード 最適化バラン ス(安定成長型)	1,644,501円	1,796,889円
たわらノーロード 最適化バラン ス(成長型)	937,935円	1,185,044円
たわらノーロード 最適化バラン ス(積極型)	2,888,276円	2,841,873円
マネックス資産設計ファンド<隔 月分配型>	14,015,062円	11,988,138円
マネックス資産設計ファンド<育 成型>	368,084,557円	327,794,537円
マネックス資産設計ファンド エ ボリューション	2,122,432円	3,869,053円
D I A M D C 8資産バランス ファンド(新興国10)	113,081,002円	110,530,283円
D I A M D C 8資産バランス ファンド(新興国20)	98,264,882円	101,236,265円
D I A M D C 8資産バランス ファンド(新興国30)	196,760,052円	198,900,701円
投資のソムリエ	1,496,921,002円	1,964,883,938円
投資のソムリエ<DC年金>	132,450,424円	197,225,041円
D I A M 8資産バランスファン ドN<DC年金>	80,069,705円	85,884,495円
投資のソムリエ<DC年金>リス ク抑制型	41,057,145円	55,434,510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	449,217円	499,988円
投資のソムリエ(ターゲット・イ ヤー2045)	751,303,077円	817,363,009円
投資のソムリエ(ターゲット・イ ヤー2055)	766,234円	1,038,216円
リスク抑制世界8資産バランス ファンド(DC)	559,491円	890,043円
投資のソムリエ(ターゲット・イ ヤー2035)	235,489円	388,226円
リスクコントロール世界資産分散 ファンド	1,105,464円	1,763,471円
9資産分散投資・スタンダード< DC年金>	255,955,063円	157,140,920円
投資のソムリエ(ターゲット・イ ヤー2040)	8,057円	4,141,811円
投資のソムリエ(ターゲット・イ ヤー2050)	-円	219,665円
	-円	219,665円

投資のソムリエ(ターゲット・イ ヤー2060)	- 円	219,665円
Jリートインデックスファンド (DC)	6,756,162円	12,016,129円
DIAM J-REITインデッ クス私募ファンド201212 (適格機関投資家限定)	90,731,870円	88,926,711円
DIAM J-REITインデッ クス私募ファンド201401 (適格機関投資家限定)	819,808,744円	803,653,174円
DIAM J-REITインデッ クスファンド(適格機関投資家向 け)	8,539,147,794円	4,598,041,996円
日米資産配分戦略ファンド(イン カム重視型)(為替ヘッジあり) (適格機関投資家限定)	63,083,346円	191,001,640円
DIAMグローバル 私募ファン ド(適格機関投資家向け)	14,402,370円	15,360,153円
DIAMグローバル・リスクファ クター・パリティ戦略ファンド (適格機関投資家限定)	856,564,973円	623,126,863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I I(適格機関投資家限定)	458,302,789円	- 円
計	16,951,549,055円	13,884,496,370円
2. 受益権の総数	16,951,549,055口	13,884,496,370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11月12日現在	令和1年5月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

不動産投信関連

種類	平成30年11月12日 現在				令和1年5月12日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
不動産投信指数 先物取引								
買 建	607,932,000	-	624,955,500	17,023,500	645,840,000	-	661,284,000	15,444,000
合計	607,932,000	-	624,955,500	17,023,500	645,840,000	-	661,284,000	15,444,000

(注) 1. 時価の算定方法

不動産投信指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成30年11月12日現在	令和1年5月12日現在
1口当たり純資産額	1.8998円	2.0512円
(1万口当たり純資産額)	(18,998円)	(20,512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11月12日現在	令和1年5月12日現在
資産の部			
流動資産			
預金		14,071,421,661	1,504,407,455
コール・ローン		315,010,360	2,151,695,116
株式		324,188,852,487	339,535,230,003
投資信託受益証券		769,657,882	787,164,606
投資証券		7,506,660,447	8,298,115,449
派生商品評価勘定		231,402,417	1,936,164
未収入金		216,152,318	3,540,334,447
未収配当金		384,803,080	578,007,555
差入委託証拠金		2,179,103,470	885,232,858
流動資産合計		349,863,064,122	357,282,123,653
資産合計		349,863,064,122	357,282,123,653
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		15,095,019	13,588,458
未払金		14,030,089,521	90,914,190
未払解約金		99,795,000	2,397,774,000
流動負債合計		14,144,979,540	2,502,276,648
負債合計		14,144,979,540	2,502,276,648
純資産の部			
元本等			
元本	1	94,537,119,407	99,073,758,630
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		241,180,965,175	255,706,088,375
元本等合計		335,718,084,582	354,779,847,005
純資産合計		335,718,084,582	354,779,847,005
負債純資産合計		349,863,064,122	357,282,123,653

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11月12日現在	令和1年5月12日現在
1.	1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	89,251,976,018円	94,537,119,407円
	同期中追加設定元本額	17,840,637,737円	18,203,065,534円
	同期中一部解約元本額	12,555,494,348円	13,666,426,311円
	元本の内訳		
	ファンド名		
	DIAM外国株式パッシブ・ファンド	2,720,697,179円	2,507,909,836円
	MITO ラップ型ファンド（安定型）	2,913,395円	2,983,123円
	MITO ラップ型ファンド（中立型）	8,567,971円	7,633,761円
	MITO ラップ型ファンド（積極型）	16,971,755円	12,129,414円
	グローバル8資産ラップファンド（安定型）	20,140,771円	26,845,568円
	グローバル8資産ラップファンド（中立型）	23,048,530円	20,430,934円
	グローバル8資産ラップファンド（積極型）	20,870,949円	15,049,883円
	たわらノーロード 先進国株式	8,051,172,132円	9,232,196,161円
	たわらノーロード 先進国株式<ラップ向け>	424,170円	423,588円
	たわらノーロード 先進国株式<為替ヘッジあり>	995,586,600円	1,164,791,066円
	たわらノーロード バランス（8資産均等型）	51,785,996円	102,246,297円
	たわらノーロード バランス（堅実型）	4,032,356円	8,059,910円
	たわらノーロード バランス（標準型）	37,015,213円	72,614,044円
	たわらノーロード バランス（積極型）	68,064,714円	105,100,152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）	230,259円	338,089円
	たわらノーロード スマートグローバルバランス（安定型）	16,659,542円	24,157,151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）	50,346,140円	69,258,854円
	たわらノーロード スマートグローバルバランス（成長型）	35,591,158円	53,227,945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）	87,681,588円	131,726,723円
	たわらノーロード 最適化バランス（保守型）	16,688円	38,158円
	たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	70,914円	252,755円
	たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	818,607円	825,961円

たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	611,066円	694,540円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	2,265,459円	2,177,009円
DIAM外国株式インデックスファンド<DC年金>	39,988,448,170円	40,476,700,820円
One DC 先進国株式インデックスファンド	- 円	269,041円
DIAMバランス・ファンド<DC年金> 1 安定型	163,973,370円	169,155,394円
DIAMバランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型	847,268,707円	871,608,618円
DIAMバランス・ファンド<DC年金> 3 成長型	1,064,743,402円	1,072,286,742円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	123,860,732円	125,329,885円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	357,317,417円	356,194,178円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	319,991,400円	315,130,768円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	30,441,363円	29,147,086円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	798,569,617円	791,904,539円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	213,664,955円	199,603,769円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	202,174,693円	209,858,090円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	131,242,647円	139,957,357円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	229,321,951円	246,943,036円
投資のソムリエ	1,605,577,084円	1,548,940,345円
クルーズコントロール	312,816,573円	204,829,302円
投資のソムリエ<DC年金>	141,994,003円	156,741,516円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	145,968,090円	160,449,615円
DIAM DC バランス・F(成長型)	87,368,398円	93,041,165円
クルーズコントロール<DC年金>	209,742円	157,074円
DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)	1,695,605円	1,240,142円
DIAMコア資産設計ファンド(積極型)	4,809,870円	3,227,598円
投資のソムリエ<DC年金> リスク抑制型	17,837,126円	64,423,806円
ダイナミック・ナビゲーション	1,324,764円	1,464,362円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	330,369,754円	966,037,903円
ワールドアセットバランス(基本コース)	595,681,660円	532,822,267円

ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	1,450,991,635円	2,069,512,513円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	1,657,234円	1,831,488円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	1,210,777円	1,568,750円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	101,888円	456,503円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	2,371,748円	2,218,473円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	5,289,055円	6,028,298円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	93,812,225円	234,118,210円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	13,989円	7,823,516円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	-円	390,160円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	-円	390,160円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	-円	390,160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)	91,075,475円	87,697,096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)	2,860,923,249円	2,361,586,128円
DIAM先進国株式パッシブファンド(適格機関投資家限定)	5,982,967,603円	12,394,190,608円
外国株式パッシブ・ファンド2(適格機関投資家限定)	206,217,109円	206,116,010円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	21,401,209円	19,865,603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)	85,262,542円	75,988,980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)	209,233,430円	187,918,228円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	11,291,903円	10,170,932円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	71,339,508円	63,530,074円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	6,051,680円	5,618,745円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	7,734,968円	6,184,782円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	22,311,659円	16,879,589円

D I A M世界バランスファンド5 0 V A (適格機関投資家限定)	60,585,194円	53,041,679円
D I A Mバランスファンド25V A (適格機関投資家限定)	510,360,381円	441,681,524円
D I A Mバランスファンド37. 5 V A (適格機関投資家限定)	629,658,009円	559,920,806円
D I A Mバランスファンド50V A (適格機関投資家限定)	2,003,920,518円	1,802,616,803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)	709,013,146円	645,957,697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)	117,150,494円	103,766,652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)	826,292,348円	727,697,822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)	102,616,266円	66,754,131円
D I A Mグローバル 私募ファン ド(適格機関投資家向け)	2,754,975円	2,754,975円
D I A M世界バランスファンド5 5 V A (適格機関投資家限定)	25,236,110円	9,933,857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)	16,249,487円	12,015,781円
D I A M世界アセットバランス ファンド2 V A (適格機関投資家 限定)	5,206,864,752円	2,965,140,336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)	236,507,098円	46,436,060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)	1,304,871,608円	1,002,024,372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)	4,967,324,311円	4,322,748,012円
D I A Mバランス30V A (適格 機関投資家限定)	17,489,143円	16,233,331円
D I A Mバランス50V A (適格 機関投資家限定)	840,169円	1,147,411円
D I A Mバランス70V A (適格 機関投資家限定)	10,354,542円	8,655,470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)	6,669,377,978円	6,172,892,152円
D I A Mバランス20V A (適格 機関投資家限定)	55,662,387円	52,822,607円
D I A Mバランス40V A (適格 機関投資家限定)	223,728円	218,553円
D I A Mバランス60V A (適格 機関投資家限定)	253,632円	248,253円

計	94,537,119,407円	99,073,758,630円
2. 受益権の総数	94,537,119,407口	99,073,758,630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11月12日現在	令和1年5月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	平成30年11月12日 現在				令和1年5月12日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	-	-	-	-	1,687,281,988	-	1,687,194,920	87,068
アメリカ・ドル	-	-	-	-	1,046,787,100	-	1,046,598,100	189,000
イギリス・ポンド	-	-	-	-	173,357,986	-	173,371,340	13,354
オーストラリア・ドル	-	-	-	-	43,729,357	-	43,733,340	3,983
カナダ・ドル	-	-	-	-	160,070,991	-	160,115,650	44,659
スイス・フラン	-	-	-	-	153,428,620	-	153,516,200	87,580
スウェーデン・クローナ	-	-	-	-	51,258,500	-	51,210,000	48,500
ニュージーランド・ドル	-	-	-	-	5,788,800	-	5,794,400	5,600
ノルウェー・クローネ	-	-	-	-	15,019,200	-	15,012,000	7,200
ユーロ	-	-	-	-	37,841,434	-	37,843,890	2,456
買 建	7,185,086,580	-	7,184,340,480	746,100	-	-	-	-
アメリカ・ドル	4,917,194,450	-	4,916,688,210	506,240	-	-	-	-
イギリス・ポンド	451,741,155	-	451,719,700	21,455	-	-	-	-
オーストラリア・ドル	153,583,050	-	153,534,480	48,570	-	-	-	-
カナダ・ドル	248,927,730	-	248,889,390	38,340	-	-	-	-
シンガポール・ドル	74,367,000	-	74,349,000	18,000	-	-	-	-
スイス・フラン	433,788,481	-	433,824,100	35,619	-	-	-	-
スウェーデン・クローナ	155,446,400	-	155,496,000	49,600	-	-	-	-
デンマーク・クローネ	82,127,025	-	82,127,500	475	-	-	-	-
ノルウェー・クローネ	65,497,795	-	65,426,500	71,295	-	-	-	-
ユーロ	436,549,194	-	436,529,600	19,594	-	-	-	-
香港・ドル	165,864,300	-	165,756,000	108,300	-	-	-	-
合計	7,185,086,580	-	7,184,340,480	746,100	1,687,281,988	-	1,687,194,920	87,068

(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11月12日 現在				令和1年5月12日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								
先物取引								
買 建	9,979,170,440	-	10,196,223,940	217,053,500	4,398,712,835	-	4,386,973,473	11,739,362
合計	9,979,170,440	-	10,196,223,940	217,053,500	4,398,712,835	-	4,386,973,473	11,739,362

(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11月12日現在	令和1年5月12日現在
1口当たり純資産額	3.5512円	3.5810円
(1万口当たり純資産額)	(35,512円)	(35,810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11月12日現在	令和1年5月12日現在
資産の部			
流動資産			
預金		110,595,617	-
コール・ローン		55,860,454	5,037,503,312
投資信託受益証券		4,098,263,934	4,228,856,138
投資証券		43,679,115,631	33,745,234,021
派生商品評価勘定		15,774	623,599
未収入金		751,182	9,250,568,009
未収配当金		79,358,762	84,138,628
流動資産合計		48,023,961,354	52,346,923,707
資産合計		48,023,961,354	52,346,923,707
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		767,919	478,530
前受金		-	4,746,691,585
未払金		7,555,692,774	51,681,480
未払解約金		26,529,000	5,685,807,000
流動負債合計		7,582,989,693	10,484,658,595
負債合計		7,582,989,693	10,484,658,595
純資産の部			
元本等			
元本	1	32,380,716,641	32,544,163,455
剰余金			
剰余金又は欠損金()		8,060,255,020	9,318,101,657
元本等合計		40,440,971,661	41,862,265,112
純資産合計		40,440,971,661	41,862,265,112
負債純資産合計		48,023,961,354	52,346,923,707

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	平成30年11月12日現在	令和1年5月12日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額 同期中追加設定元本額 同期中一部解約元本額	42,701,671,349円 16,781,477,659円 27,102,432,367円	32,380,716,641円 26,763,941,979円 26,600,495,165円
元本の内訳		
ファンド名		
D I A M先進国 R E 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）	247,018,095円	161,392,134円
D I A M先進国 R E 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）	95,000,203円	87,521,232円
M I T O ラップ型ファンド（安定型）	4,347,931円	5,855,648円
M I T O ラップ型ファンド（中立型）	16,225,550円	14,992,063円
M I T O ラップ型ファンド（積極型）	32,145,399円	23,783,857円

グローバル8資産ラップファンド (安定型)	30,075,924円	52,651,289円
グローバル8資産ラップファンド (中立型)	43,636,068円	40,127,788円
グローバル8資産ラップファンド (積極型)	39,542,249円	29,523,643円
たわらノーロード 先進国リート	2,919,089,293円	3,689,543,935円
たわらノーロード 先進国リート <ラップ向け>	587,949,809円	585,838,645円
たわらノーロード 先進国リート <為替ヘッジあり>	139,841,355円	137,204,397円
たわらノーロード バランス(8 資産均等型)	148,527,894円	281,088,171円
たわらノーロード バランス(堅 実型)	948,570円	1,877,579円
たわらノーロード バランス(標 準型)	19,742,724円	37,548,327円
たわらノーロード バランス(積 極型)	58,616,516円	88,312,734円
たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(安定型)	5,826,881円	14,977,957円
たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(安定成長型)	44,302,872円	79,307,189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)	38,523,910円	68,632,202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)	106,999,993円	187,556,235円
たわらノーロード 最適化 balan ス(安定型)	113,261円	595,576円
たわらノーロード 最適化 balan ス(安定成長型)	1,666,588円	1,868,332円
たわらノーロード 最適化 balan ス(成長型)	1,235,067円	1,616,920円
たわらノーロード 最適化 balan ス(積極型)	4,635,030円	4,678,270円
マネックス資産設計ファンド<隔 月分配型>	23,065,104円	19,145,911円
マネックス資産設計ファンド<育 成型>	604,869,987円	520,077,807円
マネックス資産設計ファンド エ ボリューション	39,383,601円	53,216,299円
D I A M D C 8資産バランス ファンド(新興国10)	172,886,995円	175,540,190円
D I A M D C 8資産バランス ファンド(新興国20)	150,229,482円	158,001,161円
D I A M D C 8資産バランス ファンド(新興国30)	302,213,922円	310,718,534円
投資のソムリエ	4,628,532,859円	5,426,170,773円
投資のソムリエ<DC年金>	409,145,240円	553,306,444円
D I A M 8資産バランスファン ドN<DC年金>	121,087,214円	134,128,623円
投資のソムリエ<DC年金>リス ク抑制型	137,923,789円	236,797,514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	696,990円 2,531,096,042円	778,490円 3,492,210,128円
ワールドアセットバランス(基本 コース)	1,200,908,193円	951,671,015円
ワールドアセットバランス(リス ク抑制コース)	2,914,300,230円	3,735,792,629円
投資のソムリエ(ターゲット・イ ヤー2045)	2,396,757円	2,885,783円
投資のソムリエ(ターゲット・イ ヤー2055)	1,747,160円	2,473,339円
リスク抑制世界8資産バランス ファンド(DC)	800,629円	1,671,086円
投資のソムリエ(ターゲット・イ ヤー2035)	3,412,895円	5,196,570円
リスクコントロール世界資産分散 ファンド	856,495,571円	661,274,577円
9資産分散投資・スタンダード< DC年金>	12,333円	6,572,642円
投資のソムリエ(ターゲット・イ ヤー2040)	-円	612,994円
投資のソムリエ(ターゲット・イ ヤー2050)	-円	612,994円
投資のソムリエ(ターゲット・イ ヤー2060)	-円	612,994円
DIAMパッシブ資産分散ファン ド	1,103,861,552円	857,628,570円
DIAM外国リートインデックス ファンド<DC年金>	30,245,832円	36,980,930円
DIAM世界アセットバランス ファンドVA(適格機関投資家向 け)	575,447,932円	377,169,506円
DIAMグローバル 私募ファン ド(適格機関投資家向け)	11,580,328円	12,032,969円
DIAM世界アセットバランス ファンド2VA(適格機関投資家 限定)	7,280,385,124円	4,189,995,282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)	488,601,122円	1,005,031,183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I I(適格機関投資家限定)	258,081,123円	-円
P-Oneマルチアセット戦略 ファンド(適格機関投資家限定)	3,386,407,330円	3,461,256,521円
DIAM海外リートインデックス ファンド(適格機関投資家限定)	558,890,123円	558,105,874円
計	32,380,716,641円	32,544,163,455円
2. 受益権の総数	32,380,716,641口	32,544,163,455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11月12日現在	令和1年5月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	平成30年11月12日 現在				令和1年5月12日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	-	-	-	-	4,768,470,069	-	4,768,325,000	145,069
アメリカ・ドル	-	-	-	-	3,009,281,720	-	3,009,342,000	60,280
イギリス・ボンド	-	-	-	-	207,063,190	-	207,074,500	11,310
オーストラリア・ドル	-	-	-	-	622,209,300	-	622,566,000	356,700
カナダ・ドル	-	-	-	-	66,138,039	-	66,136,500	1,539
シンガポール・ドル	-	-	-	-	341,108,460	-	340,710,000	398,460
ニュージーランド・ドル	-	-	-	-	43,431,840	-	43,458,000	26,160
ユーロ	-	-	-	-	234,195,520	-	234,213,000	17,480
香港・ドル	-	-	-	-	245,042,000	-	244,825,000	217,000
買 建	8,621,642,505	-	8,620,890,360	752,145	-	-	-	-
アメリカ・ドル	6,266,150,000	-	6,265,600,000	550,000	-	-	-	-
イギリス・ボンド	482,975,729	-	482,964,260	11,469	-	-	-	-
オーストラリア・ドル	588,302,000	-	588,302,000	-	-	-	-	-
カナダ・ドル	160,573,800	-	160,573,800	-	-	-	-	-
シンガポール・ドル	280,928,740	-	280,840,000	88,740	-	-	-	-
ニュージーランド・ドル	37,598,680	-	37,597,700	980	-	-	-	-
ユーロ	616,413,026	-	616,428,800	15,774	-	-	-	-
香港・ドル	188,700,530	-	188,583,800	116,730	-	-	-	-
合計	8,621,642,505	-	8,620,890,360	752,145	4,768,470,069	-	4,768,325,000	145,069

(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11月12日現在	令和1年5月12日現在
1口当たり純資産額	1,2489円	1,2863円
(1万口当たり純資産額)	(12,489円)	(12,863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11月12日現在	令和1年5月12日現在
資産の部			
流動資産			
預金		3,781,337,330	3,441,872,282
コール・ローン		5,447,568,050	5,200,305,541
国債証券		276,679,398,399	357,199,289,459
派生商品評価勘定		107,084,438	5,046,765,585
未収入金		29,752,639,862	-
未収利息		1,902,228,541	2,294,294,710
前払費用		555,679,405	521,732,250
流動資産合計		318,225,936,025	373,704,259,827
資産合計		318,225,936,025	373,704,259,827
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		3,103,844,583	-
未払金		392,463,069	-
未払解約金		33,130,248,000	380,855,000
流動負債合計		36,626,555,652	380,855,000
負債合計		36,626,555,652	380,855,000
純資産の部			
元本等			
元本	1	215,528,334,101	275,280,099,699
剰余金			
剰余金又は欠損金()		66,071,046,272	98,043,305,128
元本等合計		281,599,380,373	373,323,404,827
純資産合計		281,599,380,373	373,323,404,827
負債純資産合計		318,225,936,025	373,704,259,827

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11月12日現在	令和1年5月12日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額 同期中追加設定元本額 同期中一部解約元本額	225,184,908,433円 116,971,740,609円 126,628,314,941円	215,528,334,101円 120,496,796,641円 60,745,031,043円
元本の内訳		
ファンド名		
たわらノーロード 先進国債券<為替ヘッジあり>	2,324,842,913円	2,956,865,506円
たわらノーロード バランス（堅実型）	29,341,696円	59,458,020円
たわらノーロード バランス（標準型）	85,041,805円	167,692,464円
たわらノーロード バランス（積極型）	59,471,335円	92,814,115円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（保守型）	3,207,291円	4,990,038円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（安定型）	81,449,431円	140,463,105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）	135,661,003円	212,270,877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）	44,874,141円	71,932,976円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（積極型）	35,191,666円	50,706,781円
たわらノーロード 最適化バランス（保守型）	661,162円	1,627,413円

たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	848,368円	3,596,539円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	5,049,798円	5,682,600円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	1,594,228円	1,911,578円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	1,908,762円	1,533,954円
投資のソムリエ	37,595,981,529円	35,290,311,826円
投資のソムリエ<DC年金>	3,326,395,750円	3,595,702,480円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	2,347,355,110円	2,884,165,471円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	43,017,391,075円	42,542,913,677円
ワールドアセットバランス(基本コース)	5,467,871,663円	4,185,978,240円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	14,035,146,179円	16,092,225,458円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	4,857,279円	11,696,525円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	3,545,626円	10,030,622円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	13,514,378円	20,246,357円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	7,573,955円	21,898,707円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	6,589,414,795円	6,037,988,191円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	283,833円	156,285,937円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	-円	2,495,901円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	-円	2,495,901円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	-円	2,495,901円
外国債券パッシブファンド2(為替フルヘッジ)(適格機関投資家限定)	8,816,175,202円	20,019,532,205円
先進国債券パッシブファンド(為替ヘッジあり)(適格機関投資家限定)	-円	60,101,071,894円
DIAM世界アセットバランスファンド2VA(適格機関投資家限定)	13,572,080,988円	8,160,410,256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)	616,376,316円	127,801,194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)	6,806,656,067円	5,517,686,759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)	32,386,120,083円	29,755,479,872円
D I A Mバランス3 0 V A (適格 機関投資家限定)	27,402,148円	26,913,347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)	28,982,284,010円	28,321,847,623円
D I A Mバランス2 0 V A (適格 機関投資家限定)	149,003,556円	146,102,927円
D I A M世界アセットバランス ファンド7 V A (1 2 1 2) (適 格機関投資家限定)	2,501,377,202円	2,343,618,618円
D I A M世界アセットバランス ファンド7 V A (1 3 0 3) (適 格機関投資家限定)	2,597,230,650円	2,463,946,681円
D I A M世界アセットバランス ファンド7 V A (1 3 0 6) (適 格機関投資家限定)	3,430,389,721円	3,267,487,092円
D I A M世界アセットバランス ファンド7 V A (1 3 0 9) (適 格機関投資家限定)	424,763,387円	399,724,071円
計	215,528,334,101円	275,280,099,699円
2 . 受益権の総数	215,528,334,101口	275,280,099,699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11月12日現在	令和1年5月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	平成30年11月12日 現在				令和1年5月12日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	310,072,365,528	-	313,069,125,673	2,996,760,145	366,180,682,960	-	361,133,917,375	5,046,765,585
アメリカ・ドル	143,481,325,639	-	144,846,546,005	1,365,220,366	172,057,755,969	-	169,738,721,208	2,319,034,761
イギリス・ポ ンド	20,903,222,878	-	21,303,270,478	400,047,600	24,308,958,987	-	23,903,910,729	405,048,258
オーストラリ ア・ドル	6,458,079,946	-	6,627,781,238	169,701,292	7,495,583,015	-	7,349,388,125	146,194,890
カナダ・ドル	6,406,348,492	-	6,434,848,879	28,500,387	7,235,995,721	-	7,136,592,804	99,402,917
シンガポール・ ドル	974,634,041	-	988,750,665	14,116,624	1,200,548,526	-	1,182,214,210	18,334,316
スウェーデン・ クローナ	885,630,611	-	899,248,416	13,617,805	1,257,298,694	-	1,221,324,360	35,974,334
デンマーク・ク ローネ	1,492,161,655	-	1,505,027,069	12,865,414	1,868,201,978	-	1,844,204,973	23,997,005
ノルウェー・ク ローネ	580,855,383	-	584,303,162	3,447,779	565,047,183	-	549,082,500	15,964,683
ポーランド・ズ ロチ	1,603,070,102	-	1,637,037,402	33,967,300	2,162,685,292	-	2,133,682,546	29,002,746
マレーシア・リ ンギット	1,152,033,597	-	1,156,626,900	4,593,303	1,115,759,178	-	1,105,957,800	9,801,378
メキシコ・ペソ	2,535,333,113	-	2,575,735,681	40,402,568	2,897,992,709	-	2,827,290,501	70,702,208
ユーロ	122,301,108,235	-	123,158,421,728	857,313,493	141,888,049,078	-	140,041,931,295	1,846,117,783
南アフリカ・ラ ンド	1,298,561,836	-	1,351,528,050	52,966,214	2,126,806,630	-	2,099,616,324	27,190,306
合計	310,072,365,528	-	313,069,125,673	2,996,760,145	366,180,682,960	-	361,133,917,375	5,046,765,585

(注) 時価の算定方法

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

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

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

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

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

(1口当たり情報に関する注記)

	平成30年11月12日現在	令和1年5月12日現在
1口当たり純資産額	1.3066円	1.3562円
(1万口当たり純資産額)	(13,066円)	(13,562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11月12日現在	令和1年5月12日現在
資産の部			
流動資産			
預金		2,603,693,015	2,951,397,690
コール・ローン		284,895,788	912,461,140
株式		49,280,562,825	44,178,366,699
新株予約権証券		-	223,280
投資信託受益証券		266,549,922	219,176,745
投資証券		86,164,660	67,221,888
派生商品評価勘定		10,291,730	7,780,773
未収入金		503,510	6,073,633,892
未収配当金		51,137,281	76,994,254
差入委託証拠金		569,312,892	1,165,731,891
流動資産合計		53,153,111,623	55,652,988,252
資産合計		53,153,111,623	55,652,988,252
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		84,346,475	235,680,825
未払金		2,637,891,220	27,152,401
未払解約金		26,145,000	3,519,360,000
流動負債合計		2,748,382,695	3,782,193,226
負債合計		2,748,382,695	3,782,193,226
純資産の部			
元本等			
元本	1	45,635,552,863	45,994,581,238
剰余金			
剰余金又は欠損金()		4,769,176,065	5,876,213,788
元本等合計		50,404,728,928	51,870,795,026
純資産合計		50,404,728,928	51,870,795,026
負債純資産合計		53,153,111,623	55,652,988,252

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項目		平成30年11月12日現在	令和1年5月12日現在
1.	1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	52,614,064,516円	45,635,552,863円
	同期中追加設定元本額	16,369,364,139円	19,267,649,786円
	同期中一部解約元本額	23,347,875,792円	18,908,621,411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 >	4,043,265,955円	4,515,470,006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)	531,501,492円	502,653,275円
	M I T O ラップ型ファンド(安 定型)	3,985,301円	3,316,467円
	M I T O ラップ型ファンド(中 立型)	10,610,747円	11,116,546円
	M I T O ラップ型ファンド(積 極型)	13,230,020円	14,404,320円
	グローバル8資産ラップファンド (安定型)	27,572,726円	29,972,474円
	グローバル8資産ラップファンド (中立型)	28,537,703円	29,625,542円
	グローバル8資産ラップファンド (積極型)	16,073,343円	17,313,088円
	たわらノーロード 新興国株式	4,270,414,885円	4,766,676,930円
	たわらノーロード 新興国株式< ラップ向け>	1,864,799,568円	1,742,058,602円
	たわらノーロード バランス(8 資産均等型)	165,894,398円	320,456,448円
	たわらノーロード バランス(堅 実型)	1,046,237円	2,082,850円
	たわらノーロード バランス(標 準型)	4,400,314円	8,407,172円
	たわらノーロード バランス(積 極型)	10,954,194円	16,463,240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)	124,610円	175,035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)	6,747,967円	10,889,157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)	21,991,660円	32,537,012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)	14,871,549円	23,104,711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)	43,735,750円	56,998,846円
	たわらノーロード 最適化 balan ス(安定型)	32,706円	130,162円
	たわらノーロード 最適化 balan ス(安定成長型)	482,325円	510,892円

たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	330,077円	378,892円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	842,763円	1,077,102円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	447,212,307円	453,215,866円
D I A M D C 8資産バランスファンド(新興国10)	314,889,588円	322,361,801円
D I A M D C 8資産バランスファンド(新興国20)	279,977,928円	292,211,948円
D I A M D C 8資産バランスファンド(新興国30)	549,014,807円	576,808,973円
投資のソムリエ	1,343,407,172円	5,640,627,850円
クルーズコントロール	1,008,045,836円	614,993,714円
投資のソムリエ<DC年金>	119,033,250円	574,868,113円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	232,065,447円	250,473,605円
クルーズコントロール<DC年金>	676,655円	471,655円
D I A Mコア資産設計ファンド(堅実型)	13,748,128円	9,203,382円
D I A Mコア資産設計ファンド(積極型)	38,733,099円	24,179,994円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	57,463,793円	166,482,009円
ダイナミック・ナビゲーション	522,062円	1,662,768円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	1,057,494,705円	2,497,124,779円
ワールドアセットバランス(基本コース)	1,853,672,739円	1,617,423,148円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	4,569,034,230円	6,277,274,398円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	1,545,738円	3,663,278円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	1,123,549円	3,142,810円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	326,631円	1,170,422円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	1,893,933円	5,862,477円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	303,188,905円	592,511,369円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	20,870円	12,158,402円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	-円	778,843円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	-円	778,843円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	-円	778,843円
エマージング株式パッシブファンドV A(適格機関投資家専用)	3,768,205,899円	2,681,905,387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)	2,125,986,466円	-円
D I A M世界アセットバランス ファンド2 V A (適格機関投資家 限定)	8,428,760,810円	4,583,749,435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)	8,038,062,026円	6,682,878,357円
計	45,635,552,863円	45,994,581,238円
2 . 受益権の総数	45,635,552,863口	45,994,581,238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11月12日現在	令和1年5月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	平成30年11月12日 現在				令和1年5月12日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	1,560,926,008	-	1,560,165,693	760,315	6,821,750,100	-	6,816,760,320	4,989,780
アメリカ・ドル	1,560,926,008	-	1,560,165,693	760,315	5,298,559,600	-	5,295,210,520	3,349,080
オフショア・人民元	-	-	-	-	80,400,000	-	80,350,000	50,000
チェコ・コルナ	-	-	-	-	11,496,000	-	11,472,000	24,000
トルコ・リラ	-	-	-	-	47,659,500	-	47,472,600	186,900
ハンガリー・フォリ ント	-	-	-	-	20,161,200	-	20,155,900	5,300
ポーランド・ズロチ	-	-	-	-	67,468,500	-	67,445,000	23,500
メキシコ・ペソ	-	-	-	-	185,900,000	-	185,575,000	325,000
ユーロ	-	-	-	-	11,094,300	-	11,094,300	-
香港・ドル	-	-	-	-	690,200,000	-	689,707,000	493,000
南アフリカ・ランド	-	-	-	-	408,811,000	-	408,278,000	533,000
買 建	4,259,145,810	-	4,259,592,108	446,298	1,523,190,500	-	1,521,774,040	1,416,460
アメリカ・ドル	1,656,198,917	-	1,655,972,550	226,367	1,523,190,500	-	1,521,774,040	1,416,460
インド・ルピー	344,832,989	-	347,600,000	2,767,011	-	-	-	-
インドネシア・ルピ ア	80,750,274	-	81,260,758	510,484	-	-	-	-
タイ・バーツ	78,310,346	-	77,861,000	449,346	-	-	-	-
トルコ・リラ	8,344,840	-	8,352,000	7,160	-	-	-	-
ポーランド・ズロチ	33,116,600	-	33,066,000	50,600	-	-	-	-
マレーシア・リン ギット	79,853,048	-	79,783,900	69,148	-	-	-	-
メキシコ・ペソ	90,790,400	-	90,560,000	230,400	-	-	-	-
ユーロ	6,451,477	-	6,448,000	3,477	-	-	-	-
韓国・ウォン	497,537,900	-	497,537,900	-	-	-	-	-
香港・ドル	771,112,368	-	770,620,000	492,368	-	-	-	-
台湾・ドル	444,980,651	-	444,000,000	980,651	-	-	-	-
南アフリカ・ランド	166,866,000	-	166,530,000	336,000	-	-	-	-
合計	5,820,071,818	-	5,819,757,801	1,206,613	8,344,940,600	-	8,338,534,360	3,573,320

(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11月12日 現在				令和1年5月12日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								
先物取引								
買 建	3,260,258,081	-	3,184,996,723	75,261,358	4,946,923,841	-	4,715,450,469	231,473,372
合計	3,260,258,081	-	3,184,996,723	75,261,358	4,946,923,841	-	4,715,450,469	231,473,372

(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11月12日現在	令和1年5月12日現在
1口当たり純資産額	1.1045円	1.1278円
(1万口当たり純資産額)	(11,045円)	(11,278円)

「エマージング債券パッシブ・マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成30年11月12日現在	令和1年5月12日現在
資産の部			
流動資産			
預金		1,613,215,186	1,162,890,691
コール・ローン		5,359,158,381	947,936,459
国債証券		97,977,153,832	80,273,951,876
派生商品評価勘定		15,232,000	12,012,000
未収入金		-	16,025,915,388
未収利息		769,425,417	1,063,981,014
前払費用		177,292,927	76,777,030
流動資産合計		105,911,477,743	99,563,464,458
資産合計		105,911,477,743	99,563,464,458
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		1,983,000	-
未払金		25,864,582,130	-
未払解約金		23,244,000	10,325,044,000
流動負債合計		25,889,809,130	10,325,044,000
負債合計		25,889,809,130	10,325,044,000
純資産の部			
元本等			
元本	1	44,101,164,374	47,095,733,850
剰余金			
剰余金又は欠損金()		35,920,504,239	42,142,686,608
元本等合計		80,021,668,613	89,238,420,458
純資産合計		80,021,668,613	89,238,420,458
負債純資産合計		105,911,477,743	99,563,464,458

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11月12日現在	令和1年5月12日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額 同期中追加設定元本額 同期中一部解約元本額	63,604,054,491円 23,833,945,866円 43,336,835,983円	44,101,164,374円 44,268,758,173円 41,274,188,697円
元本の内訳 ファンド名 D I A M新興国債券インデックス ファンド<為替ヘッジなし> （ファンドラップ） たわらノーロード バランス（8 資産均等型） たわらノーロード バランス（堅 実型） 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 最適化バラン ス（保守型） たわらノーロード 最適化バラン ス（安定型） たわらノーロード 最適化バラン ス（安定成長型） たわらノーロード 最適化バラン ス（成長型） たわらノーロード 最適化バラン ス（積極型）	280,921,552円 100,885,788円 5,099,547円 15,783,421円 9,873,707円 96,195円 154,401円 988,734円 322,201円 495,875円	246,986,757円 196,677,687円 10,254,372円 30,956,981円 15,155,681円 221,578円 653,298円 1,120,483円 395,936円 506,299円

マネックス資産設計ファンド エ ボリューション	58,646,088円	65,031,717円
D I A M D C 8資産バランス ファンド(新興国10)	195,394,626円	196,851,738円
D I A M D C 8資産バランス ファンド(新興国20)	168,433,969円	180,100,588円
D I A M D C 8資産バランス ファンド(新興国30)	335,742,291円	354,542,976円
投資のソムリエ	4,639,045,809円	6,684,216,169円
クルーズコントロール	609,518,736円	393,508,522円
投資のソムリエ<DC年金>	410,029,279円	674,279,254円
D I A M 8資産バランスファン ドN<DC年金>	136,881,733円	153,772,231円
クルーズコントロール<DC年金 >	409,093円	302,012円
D I A Mコア資産設計ファンド (堅実型)	3,338,720円	2,345,047円
D I A Mコア資産設計ファンド (積極型)	9,361,762円	6,235,302円
投資のソムリエ<DC年金>リス ク抑制型	209,652,500円	279,785,872円
ダイナミック・ナビゲーション	155,255円	529,793円
リスク抑制世界8資産バランス ファンド	3,846,484,840円	4,191,955,331円
ワールドアセットバランス(基本 コース)	802,579,470円	997,317,442円
ワールドアセットバランス(リス ク抑制コース)	1,948,638,194円	3,865,039,534円
投資のソムリエ(ターゲット・イ ヤー2045)	2,390,210円	3,726,963円
投資のソムリエ(ターゲット・イ ヤー2055)	1,746,182円	3,191,049円
リスク抑制世界8資産バランス ファンド(DC)	1,208,112円	1,988,496円
投資のソムリエ(ターゲット・イ ヤー2035)	3,427,188円	6,315,686円
リスクコントロール世界資産分散 ファンド	999,638,917円	946,877,201円
9資産分散投資・スタンダード< DC年金>	13,655円	7,431,363円
投資のソムリエ(ターゲット・イ ヤー2040)	-円	795,968円
投資のソムリエ(ターゲット・イ ヤー2050)	-円	795,968円
投資のソムリエ(ターゲット・イ ヤー2060)	-円	795,968円
エマージング債券リスク抑制型 (適格機関投資家限定)	8,022,732,877円	12,699,525,592円
エマージング債券パッシブファン ドVA(適格機関投資家専用)	2,274,682,942円	1,533,085,634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)	4,909,635,061円	2,872,359,816円

D I A M世界アセットバランス ファンド3 V A (適格機関投資家 限定)	4,683,472,017円	4,188,013,398円
D I A Mグローバル・リスクファ クター・パリティ戦略ファンド (適格機関投資家限定)	3,677,052,381円	2,050,096,467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)	1,953,933,838円	- 円
P - O n eマルチアセット戦略 ファンド(適格機関投資家限定)	3,782,297,208円	4,231,991,681円
計	44,101,164,374円	47,095,733,850円
2 . 受益権の総数	44,101,164,374口	47,095,733,850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11月12日現在	令和1年5月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	平成30年11月12日 現在				令和1年5月12日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	-	-	-	-	15,277,850,000	-	15,265,838,000	12,012,000
アメリカ・ドル	-	-	-	-	15,277,850,000	-	15,265,838,000	12,012,000
買 建	26,598,930,000	-	26,612,179,000	13,249,000	-	-	-	-
アメリカ・ドル	26,598,930,000	-	26,612,179,000	13,249,000	-	-	-	-
合計	26,598,930,000	-	26,612,179,000	13,249,000	15,277,850,000	-	15,265,838,000	12,012,000

(注) 時価の算定方法

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

(1口当たり情報に関する注記)

	平成30年11月12日現在	令和1年5月12日現在
1口当たり純資産額	1.8145円	1.8948円
(1万口当たり純資産額)	(18,145円)	(18,948円)

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

令和1年5月31日現在

資産総額	17,777,577,286円
負債総額	31,390,229円
純資産総額(-)	17,746,187,057円
発行済数量	17,539,760,554口
1口当たり純資産額(/)	1.0118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

令和1年5月31日現在

資産総額	258,796,548,155円
負債総額	5,994,920,388円
純資産総額(-)	252,801,627,767円
発行済数量	107,008,832,821口
1口当たり純資産額(/)	2.3624円

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和1年5月31日現在

資産総額	301,106,010,830円
負債総額	3,198,258,500円
純資産総額(-)	297,907,752,330円
発行済数量	225,976,424,786口
1口当たり純資産額(/)	1.3183円

J-REITインデックスファンド・マザーファンド

令和1年5月31日現在

資産総額	37,083,255,902円
負債総額	4,444,598,924円
純資産総額(-)	32,638,656,978円
発行済数量	15,643,062,130口
1口当たり純資産額(/)	2.0865円

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和1年5月31日現在

資産総額	359,615,677,684円
負債総額	5,654,808,110円
純資産総額(-)	353,960,869,574円
発行済数量	101,642,407,359口
1口当たり純資産額(/)	3.4824円

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和1年5月31日現在

資産総額	53,008,844,748円
負債総額	5,440,262,678円
純資産総額(-)	47,568,582,070円
発行済数量	37,222,449,558口
1口当たり純資産額(/)	1.2780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

令和1年5月31日現在

資産総額	374,704,799,674円
負債総額	1,177,595,375円
純資産総額(-)	373,527,204,299円
発行済数量	272,483,005,338口
1口当たり純資産額(/)	1.3708円

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

令和1年5月31日現在

資産総額	60,348,440,035円
負債総額	4,847,153,268円
純資産総額(-)	55,501,286,767円
発行済数量	51,102,567,629口
1口当たり純資産額(/)	1.0861円

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

令和1年5月31日現在

資産総額	126,851,581,788円
負債総額	17,231,480,280円
純資産総額(-)	109,620,101,508円
発行済数量	57,481,370,399口
1口当たり純資産額(/)	1.9071円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 受益証券の名義書換

該当事項はありません。

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

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

(2) 受益者等名簿

該当事項はありません。

(3) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

(4) 受益権の譲渡制限

譲渡制限はありません。

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

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

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

(5) 受益権の譲渡の対抗要件

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

(6) 受益権の再分割

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

(7) 質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額（2019年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（2019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. 投資環境見直しおよび運用方針の策定

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

2.運用計画、売買計画の決定

各ファンドの運用は「投資環境会議」および「投資方針会議」における協議の内容を踏まえて、ファンド毎に個別に任命された運用担当者が行います。運用担当者は月次で運用計画書を作成し、運用本部長の承認を受けます。運用担当者は承認を受けた運用計画に基づき、運用を行います。

2【事業の内容及び営業の概況】

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

2019年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	26	1,159,472,215,197
追加型株式投資信託	867	13,227,040,773,887
単位型公社債投資信託	46	144,006,217,757
単位型株式投資信託	163	1,238,345,394,320
合計	1,102	15,768,864,601,161

3【委託会社等の経理状況】

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

(1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

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

(単位:千円)

	第33期 (2018年3月31日現在)	第34期 (2019年3月31日現在)
(負債の部)		
流動負債		
預り金	1,003,550	2,183,889
未払金	5,081,728	5,697,942
未払収益分配金	1,031	1,053
未払償還金	57,275	48,968
未払手数料	4,629,133	4,883,723
その他未払金	394,288	764,196
未払費用	7,711,038	6,724,986
未払法人税等	5,153,972	3,341,238
未払消費税等	1,660,259	576,632
賞与引当金	1,393,911	1,344,466
役員賞与引当金	49,986	48,609
本社移転費用引当金	156,587	-
流動負債計	22,211,034	19,917,766
固定負債		
退職給付引当金	1,637,133	1,895,158
時効後支払損引当金	199,026	177,851
固定負債計	1,836,160	2,073,009
負債合計	24,047,195	21,990,776
(純資産の部)		
株主資本		
資本金	2,000,000	2,000,000
資本剰余金	19,552,957	19,552,957
資本準備金	2,428,478	2,428,478
その他資本剰余金	17,124,479	17,124,479
利益剰余金	44,349,855	45,949,372
利益準備金	123,293	123,293
その他利益剰余金	44,226,562	45,826,079
別途積立金	24,580,000	31,680,000
研究開発積立金	300,000	-
運用責任準備積立金	200,000	-
繰越利益剰余金	19,146,562	14,146,079
株主資本計	65,902,812	67,502,329
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	795,002	846,755
評価・換算差額等計	795,002	846,755
純資産合計	66,697,815	68,349,085
負債・純資産合計	90,745,010	90,339,861

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

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

(単位:千円)

	第33期 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)		第34期 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	
営業外収益				
受取利息		1,430		1,749
受取配当金		74,278		73,517
時効成立分配金・償還金		256		8,582
為替差益		8,530		-
投資信託解約益		236,398		-
投資信託償還益		93,177		-
受取負担金		-		177,066
雑収入		10,306		24,919
時効後支払損引当金戻入額		17,429		19,797
営業外収益計		441,807		305,633
営業外費用				
為替差損		-		17,542
投資信託解約損		4,138		-
投資信託償還損		17,065		-
金銭の信託運用損		99,303		175,164
雑損失		-		5,659
営業外費用計		120,507		198,365
経常利益		21,045,676		20,100,019
特別利益				
固定資産売却益		1		-
投資有価証券売却益		479,323		353,644
関係会社株式売却益	1	1,492,680	1	-
本社移転費用引当金戻入額		138,294		-
その他特別利益		350		-
特別利益計		2,110,649		353,644
特別損失				
固定資産除却損	2	36,992	2	19,121
固定資産売却損		134		-
退職給付制度終了損		690,899		-
システム移行損失		76,007		-
その他特別損失		50		-
特別損失計		804,083		19,121
税引前当期純利益		22,352,243		20,434,543
法人税、住民税及び事業税		6,951,863		6,386,793
法人税等調整額		249,832		71,767
法人税等合計		6,702,031		6,315,026
当期純利益		15,650,211		14,119,516

(3) 【株主資本等変動計算書】

第33期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

(単位:千円)

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

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

第34期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

(単位:千円)

	株主資本								
	資本金	資本剰余金			利益剰余金				
		資本準備金	その他 資本剰余金	資本剰余金 合計	利益 準備金	その他利益剰余金			
						別途 積立金	研究開発 積立金	運用責 任準備 積立金	繰越利益 剰余金
当期首残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	24,580,000	300,000	200,000	19,146,562
当期変動額									
剰余金の配当									12,520,000
当期純利益									14,119,516
別途積立金の積立						7,100,000			
研究開発積立金の取崩							300,000		
運用責任準備積立金の取崩								200,000	
繰越利益剰余金の取崩									6,600,000
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)									
当期変動額合計	-	-	-	-	-	7,100,000	300,000	200,000	5,000,483
当期末残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	31,680,000	-	-	14,146,079

	株主資本		評価・換算差額等		純資産 合計
	利益剰余金	株主資本 合計	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
	利益剰余金 合計				
当期首残高	44,349,855	65,902,812	795,002	795,002	66,697,815
当期変動額					
剰余金の配当	12,520,000	12,520,000			12,520,000
当期純利益	14,119,516	14,119,516			14,119,516
別途積立金の積立	7,100,000	7,100,000			7,100,000
研究開発積立金の取崩	300,000	300,000			300,000
運用責任準備積立金の取崩	200,000	200,000			200,000
繰越利益剰余金の取崩	6,600,000	6,600,000			6,600,000
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)		-	51,753	51,753	51,753
当期変動額合計	1,599,516	1,599,516	51,753	51,753	1,651,270
当期末残高	45,949,372	67,502,329	846,755	846,755	68,349,085

重要な会計方針

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

表示方法の変更

第34期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」(企業会計基準第28号 平成30年2月16日)を当事業年度から適用し、繰延税金資産は投資その他の資産の区分に表示し、繰延税金負債は固定負債の区分に表示する方法に変更しました。

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

注記事項

(貸借対照表関係)

1. 有形固定資産の減価償却累計額

(千円)

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

(損益計算書関係)

1. 関係会社に対する事項

(千円)

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

2. 固定資産除却損の内訳

(千円)

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

(株主資本等変動計算書関係)

第33期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額（千円）	1株当たり配当額（円）	基準日	効力発生日
2017年6月21日 定時株主総会	普通株式	3,200,000	80,000	2017年3月31日	2017年6月22日
	A種種類株式				

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

決議	株式の種類	配当の原資	配当金の総額（千円）	1株当たり配当額（円）	基準日	効力発生日
2018年6月20日 定時株主総会	普通株式	利益 剰余金	12,520,000	313,000	2018年3月31日	2018年6月21日
	A種種類株式					

第34期（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額（千円）	1株当たり配当額（円）	基準日	効力発生日
2018年6月20日 定時株主総会	普通株式	12,520,000	313,000	2018年3月31日	2018年6月21日
	A種種類株式				

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

2019年6月20日開催予定の定時株主総会において、以下のとおり決議を予定しております。

決議	株式の種類	配当の原資	配当金の総額（千円）	1株当たり配当額（円）	基準日	効力発生日
2019年6月20日 定時株主総会	普通株式	利益 剰余金	11,280,000	282,000	2019年3月31日	2019年6月21日
	A種種類株式					

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

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

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

（2）金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

営業債務である未払手数料は、1年以内の支払期日であります。

（3）金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

（4）金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

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

第33期(2018年3月31日現在)

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

第34期(2019年3月31日現在)

	貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1) 現金・預金	41,087,475	41,087,475	-
(2) 金銭の信託	18,773,228	18,773,228	-
(3) 未収委託者報酬	12,438,085	12,438,085	-
(4) 未収運用受託報酬	3,295,109	3,295,109	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	1,488,684	1,488,684	-
資産計	77,082,582	77,082,582	-
(1) 未払手数料	4,883,723	4,883,723	-
負債計	4,883,723	4,883,723	-

(注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3) 未収委託者報酬及び(4) 未収運用受託報酬

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

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

負 債

(1) 未払手数料

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

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(千円)

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

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

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

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第33期(2018年3月31日現在)

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

第34期(2019年3月31日現在)

	1年以内 (千円)	1年超5年以内 (千円)	5年超10年以内 (千円)	10年超 (千円)
(1) 現金・預金	41,087,475	-	-	-
(2) 金銭の信託	18,773,228	-	-	-
(3) 未収委託者報酬	12,438,085	-	-	-
(4) 未収運用受託報酬	3,295,109	-	-	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券(投資信託)	153,518	1,995	996	-

(有価証券関係)

1. 子会社株式及び関連会社株式

関係会社株式(第33期の貸借対照表計上額3,229,196千円、第34期の貸借対照表計上額4,499,196千円)は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

2. その他有価証券

第33期(2018年3月31日現在)

(千円)

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

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

第34期(2019年3月31日現在)

(千円)

区分	貸借対照表日における 貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの			
株式	1,326,372	111,223	1,215,148
投資信託	158,321	153,000	5,321
小計	1,484,694	264,223	1,220,470
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
株式	-	-	-
投資信託	3,990	4,000	9
小計	3,990	4,000	9
合計	1,488,684	268,223	1,220,460

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

3. 当該事業年度中に売却したその他有価証券

第33期(自2017年4月1日至2018年3月31日)

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

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

第34期(自2018年4月1日至2019年3月31日)

区分	売却額 (千円)	売却益の合計額 (千円)	売却損の合計額 (千円)
株式	394,222	353,644	-
投資信託	-	-	-

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

なお、当社は2017年10月1日付で、確定給付企業年金制度を確定拠出年金制度等に移行するとともに、退職一時金制度を改定しました。

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(千円)

	第33期 (自2017年4月1日 至2018年3月31日)	第34期 (自2018年4月1日 至2019年3月31日)
退職給付債務の期首残高	2,718,372	2,154,607
勤務費用	269,128	300,245
利息費用	7,523	1,918
数理計算上の差異の発生額	61,792	10,147
退職給付の支払額	111,758	158,018
確定拠出制度への移行に伴う減少額	1,316,796	-
退職一時金制度改定に伴う増加額	526,345	-
その他	-	438
退職給付債務の期末残高	2,154,607	2,289,044

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

(千円)

	第33期 (自2017年4月1日 至2018年3月31日)	第34期 (自2018年4月1日 至2019年3月31日)
年金資産の期首残高	1,363,437	-
期待運用収益	17,042	-
事業主からの拠出額	36,672	-
確定拠出制度への移行に伴う減少額	1,417,152	-
年金資産の期末残高	-	-

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

(千円)

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

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(千円)

	第33期 (自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日)	第34期 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)
勤務費用	269,128	300,245
利息費用	7,523	1,918
期待運用収益	17,042	-
数理計算上の差異の費用処理額	88,417	43,920
過去勤務費用の費用処理額	39,611	69,519
退職一時金制度改定に伴う費用処理額	70,560	-
その他	1,620	3,640
確定給付制度に係る退職給付費用	456,577	411,963
制度移行に伴う損失(注)	690,899	-

(注) 特別損失に計上しております。

(5) 数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎

	第33期 (2018年3月31日現在)	第34期 (2019年3月31日現在)
割引率	0.09%	0.09%
予想昇給率	1.00% ~ 4.42%	1.00% ~ 4.42%

3. 簡便法を適用した確定給付制度

(1) 簡便法を適用した制度の、退職給付引当金の期首残高と期末残高の調整表

(千円)

	第33期 (自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日)	第34期 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)
退職給付引当金の期首残高	300,927	-
退職給付費用	53,156	-
制度への拠出額	35,640	-
確定拠出制度への移行に伴う減少額	391,600	-
退職一時金制度改定に伴う振替額	108,189	-
退職給付引当金の期末残高	-	-

(2) 退職給付費用

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

4. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度86,141千円、当事業年度104,720千円であります。

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

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

(企業結合等関係)

当社(以下「AMOne」という)は、2016年7月13日付で締結した、DIAMアセットマネジメント株式会社(以下「DIAM」という)、みずほ投信投資顧問株式会社(以下「MHAM」という)、みずほ信託銀行株式会社(以下「TB」という)及び新光投信株式会社(以下「新光投信」という)(以下総称して「統合4社」という)間の「統合契約書」に基づき、2016年10月1日付で統合いたしました。

1. 結合当事企業

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

2. 企業結合日

2016年10月1日

3. 企業結合の方法

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

4. 結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

5. 企業結合の主な目的

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

6. 合併比率

「3. 企業結合の方法」の吸収合併における合併比率は以下の通りであります。

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

(*) 普通株式と種類株式を合算して算定しております。

7. 交付した株式数

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

8. 経済的持分比率（議決権比率）

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

MHFGが企業結合日に追加取得した当社に対する経済的持分比率 20.00%

MHFGの追加取得後の当社に対する経済的持分比率 70.00%

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

9. 取得企業を決定するに至った主な根拠

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

10. 会計処理

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

11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

(1) 被取得企業の取得原価及びその内訳

取得の対価 MHAMの普通株式 144,212,500千円

取得原価 144,212,500千円

(2) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

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

(3) 企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

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

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

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

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

12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

(1) 貸借対照表項目

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

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

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

(2) 損益計算書項目

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

(注) 営業利益には、のれん及び顧客関連資産の償却額が含まれております。

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

(資産除去債務関係)

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

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

(セグメント情報等)

1. セグメント情報

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

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

(1) サービスごとの情報

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

(2) 地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

(1) 親会社及び法人主要株主等

第33期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

該当はありません。

第34期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

該当はありません。

(2) 子会社及び関連会社等

第33期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

該当はありません。

第34期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

該当はありません。

(3) 兄弟会社等

第33期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

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

第34期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は 出資金	事業の 内容又 は職業	議決権 等の所 有(被 所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員の 兼任等	事業上 の関係				
親会社 の子会社	株式会社 みずほ銀行	東京都 千代田 区	14,040 億円	銀行業	-	-	当社設定 投資信託 の販売	投資信託の 販売代行手 数料	6,048,352	未払 手数料	915,980
	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	子会社株式 の取得	1,270,000	-	-
	みずほ証 券株式会 社	東京都 千代田 区	1,251 億円	証券業	-	-	当社設定 投資信託 の販売	投資信託の 販売代行手 数料	10,215,017	未払 手数料	1,670,194

取引条件及び取引条件の決定方針等

- (注1) 投資信託の販売代行手数料は、一般的取引条件を勘案した個別契約により決定しております。
- (注2) 子会社株式の取得は、独立した第三者機関により算定された価格を基礎として協議の上、合理的に決定しております。
- (注3) 上記の取引金額には消費税等が含まれておりません。期末残高には、消費税等が含まれております。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

株式会社みずほフィナンシャルグループ
(東京証券取引所及びニューヨーク証券取引所に上場)

(2) 重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません。

(1株当たり情報)

	第33期 (自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日)	第34期 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)
1株当たり純資産額	1,667,445円37銭	1,708,727円13銭
1株当たり当期純利益金額	391,255円29銭	352,987円92銭

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

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

	第33期 (自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日)	第34期 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)
当期純利益金額	15,650,211千円	14,119,516千円
普通株主及び普通株主と同等の株主に帰属しない金額	-	-
普通株式及び普通株式と同等の株式に係る当期純利益金額	15,650,211千円	14,119,516千円
普通株式及び普通株式と同等の株式の期中平均株式数	40,000株	40,000株
(うち普通株式)	(24,490株)	(24,490株)
(うちA種種類株式)	(15,510株)	(15,510株)

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

4【利害関係人との取引制限】

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

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

5【その他】

- (1) 定款の変更、事業譲渡又は事業譲受、出資の状況その他の重要事項

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

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

- (2) 訴訟事件その他の重要事項

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託会社

a. 名称

みずほ信託銀行株式会社

b. 資本金の額

2019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2019年3月末日現在

2【関係業務の概要】

「受託会社」は、以下の業務を行います。

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

「販売会社」は、以下の業務を行います。

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

3【資本関係】

該当事項はありません。

持株比率5%以上を記載します。

第3【その他】

(1)目論見書の表紙等にロゴ・マーク、図案を使用し、ファンドの基本的性格を記載する場合があります。また、以下の内容を記載することがあります。

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

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

(3)投資信託説明書（請求目論見書）に約款の全文を掲載します。

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

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

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

独立監査人の監査報告書

2019年5月30日

アセットマネジメントOne株式会社
取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているアセットマネジメントOne株式会社の2018年4月1日から2019年3月31日までの第34期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、アセットマネジメントOne株式会社の2019年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

(注2) XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

平成30年12月21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」に掲げられているリスクコントロール世界資産分散ファンドの平成30年5月25日から平成30年11月12日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、リスクコントロール世界資産分散ファンドの平成30年11月12日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

(注2) XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の中間監査報告書

令和1年6月28日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 丘本 正彦 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているリスクコントロール世界資産分散ファンドの平成30年11月13日から令和1年5月12日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、リスクコントロール世界資産分散ファンドの令和1年5月12日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成30年11月13日から令和1年5月12日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

(注2) XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。