

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	平成30年8月10日
【発行者名】	アセットマネジメントOne株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 菅野 暁
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目8番2号
【事務連絡者氏名】	三木谷 正直
【電話番号】	03-6774-5100
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】	3,000億円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>

（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】

3,000億円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

お申込日の翌営業日の基準価額 とします。

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

<基準価額の照会方法等>

基準価額は、当ファンドの委託会社の毎営業日において、委託会社により計算され、公表されません。

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】

ありません。

(6) 【申込単位】

各販売会社が定める単位とします。

お申込単位は販売会社にお問い合わせください。

当初元本は1口当たり1円です。

(7) 【申込期間】

継続申込期間：平成30年8月11日から平成31年2月12日まで

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。

ニューヨークの銀行、ロンドンの銀行、フランクフルトの銀行、オランダの銀行、フランスの銀行、ニューヨーク証券取引所、ロンドン証券取引所、オーストラリア証券取引所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、お申込みの受付は行いません。

(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っております。

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、販売会社所定の方法により、販売会社に買付代金を支払うものとし、

払込取扱場所についてご不明な点は、以下の方法でご確認ください。

・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

(11) 【振替機関に関する事項】

振替機関は下記の通りです。

・株式会社証券保管振替機構

(12)【その他】

お申込みには、販売会社所定の方法でお申込みください。

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は行いません。

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、お申込み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販売会社に、取得申込みと同時にまたは予め、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、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、追加信託により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとします。振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行います。委託会社は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権にかかる信託を設定した旨の通知を行います。

振替受益権について

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

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

(参考)**投資信託振替制度**

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

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

（1）【ファンドの目的及び基本的性格】

当ファンドは、マザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に国内外の株式、債券および不動産投資信託証券に投資を行い、信託財産の成長と安定した収益の確保をめざします。

当ファンドの信託金の限度額は、3,000億円とします。ただし、委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

<ファンドの特色>

1 世界の6資産（国内外の株式・債券・リート）に分散投資を行うことにより、信託財産の成長と安定した収益の確保をめざします。



●各資産への投資は各資産の市場を代表する指数に連動する投資成果をめざすファンド（マザーファンド）を通じて行います。

投資対象のマザーファンド	ベンチマーク
国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	東証株価指数(TOPIX) (配当込み)
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	MSCIコクサイ・インデックス(円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	NOMURA-BPI総合
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース、為替ヘッジなし)
J-REITインデックスファンド・マザーファンド	東証REIT指数(配当込み)
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	S&P 先進国 REITインデックス(除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)

※リート(REIT)はReal Estate Investment Trustの略であり、不動産を中心に運用を行っている投資法人あるいは投資信託を一般的に総称するものです。

※パッシブ・ファンドとは市場(インデックス)そのものに連動する投資成果をめざすファンドです。インデックス・ファンドとも呼ばれます。

※当ファンドはファミリーファンド方式により運用します。また、上記マザーファンドには運用管理費用(信託報酬)はかかりません。

2 基本資産配分比率は、各資産のリターン、リスク等を推計し、証券投資理論に基づいて決定します。なお、基本資産配分比率は原則として年1回見直します。

●基本資産配分比率は、イボットソン・アソシエイツ・ジャパンの投資助言を受けます。

※基本資産配分比率決定のプロセスは、期待リターン(期待収益率)、リスク(標準偏差)、相関係数を推計し、代表的な証券投資理論の1つである平均分散アプローチにより効率的フロンティアを描き、一定のリスク水準から導きます。

※分散投資の観点から各資産の基本配分比率は一定の範囲内とします。また、為替リスクの観点から外貨建資産への基本配分比率は50%以下にしております。*

※時価変動による基本資産配分比率からの乖離分については、原則としてリバランスを行いません。

※ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに純資産総額が運用に支障をきたす水準となった時等、やむを得ない事情が発生した場合には、随時基本資産配分比率を見直すこととします。

*2018年5月末時点

3 購入時手数料、換金手数料がかからないノーロードファンドです。運用管理費用(信託報酬)は信託財産の純資産総額に対して年率1.026%(税抜0.95%)と、低水準に設定しました。

●換金価額は、基準価額から信託財産留保額(換金申込日の翌営業日の基準価額の0.3%)を差し引いた価額となります。

4 「隔月分配型」(分配金受取専用)のファンドです。

決算ごとに分配することを重視します。隔月(奇数月)に利子・配当等収益を中心とした分配と、さらに5月・11月に売買益(評価益を含みます。)等を加えた分配をめざします。

※決算は原則として年6回(毎年1月、3月、5月、7月、9月、11月の各11日。休業日の場合は翌営業日。)です。

- ・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。

収益分配金に関する留意事項

投資信託の分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。なお、分配金の有無や金額は確定したものではありません。

投資信託から分配金が支払われるイメージ



分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、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。また、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。

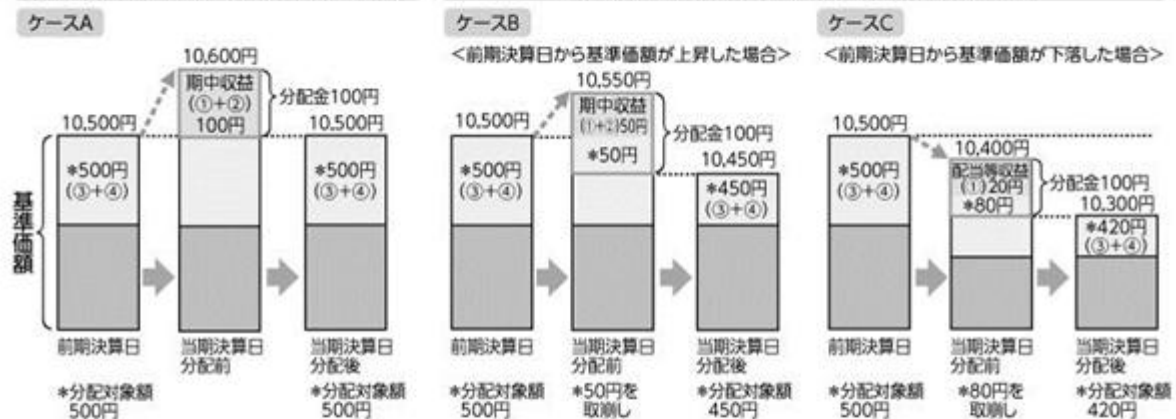
分配金額と基準価額の関係（イメージ）

分配金は、分配方針に基づき、以下の分配対象額から支払われます。

①配当等収益（経費控除後）、②有価証券売買益・評価益（経費控除後）、③分配準備積立金、④収益調整金

計算期間中に発生した収益の中から支払われる場合

計算期間中に発生した収益を超えて支払われる場合



上記のそれぞれのケースにおいて、前期決算日から当期決算日まで保有した場合の損益を見ると、次の通りとなります。

ケースA：分配金受取額100円+当期決算日と前期決算日との基準価額の差0円=100円

ケースB：分配金受取額100円+当期決算日と前期決算日との基準価額の差▲50円=50円

ケースC：分配金受取額100円+当期決算日と前期決算日との基準価額の差▲200円=▲100円

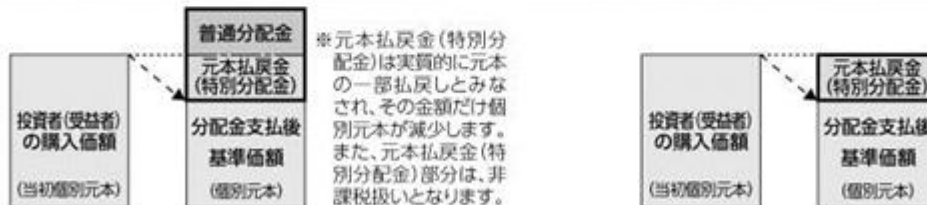
★A、B、Cのケースにおいては、分配金受取額はすべて同額ですが、基準価額の増減により、投資信託の損益状況はそれぞれ異なった結果となっています。このように、投資信託の収益については、分配金だけに注目するのではなく、「分配金の受取額」と「投資信託の基準価額の増減額」の合計額でご判断ください。

※上記はイメージであり、実際の分配金額や基準価額を示唆するものではありません。

投資者（受益者）のファンドの購入価額によっては、分配金の一部ないし全部が、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。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がり率が小さかった場合も同様です。

分配金の一部が元本の一部払戻しに相当する場合

分配金の全部が元本の一部払戻しに相当する場合



普通分配金：個別元本（投資者（受益者）のファンドの購入価額）を上回る部分からの分配金です。

元本払戻金（特別分配金）：個別元本を下回る部分からの分配金です。分配後の投資者（受益者）の個別元本は、元本払戻金（特別分配金）の額だけ減少します。

⑤ 実質組入外貨建資産の為替リスクに対しては、原則として対円での為替ヘッジを行いません。

商品分類表

単位型投信 追加型投信	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)
単位型投信	国内	株式 債券
追加型投信	海外	不動産投信
	内外	その他資産 () 資産複合

(注) 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

追加型投信	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいいます。
内外	目論見書または投資信託約款において、国内及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います。
資産複合	目論見書または投資信託約款において、株式、債券、不動産投信およびその他資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ
株式 一般 大型株 中小型株	年1回	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 ()
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ()	年6回 (隔月)	欧州		
	年12回 (毎月)	アジア オセアニア		
	日々	中南米		なし
不動産投信	その他 ()	アフリカ	ファンド・オブ・ ファンズ	
その他資産 (投資信託証券 (資産複合(株 式、債券、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				

属性区分に記載している「為替ヘッジ」は、対円での為替リスクに対するヘッジの有無を記載しております。

(注) 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

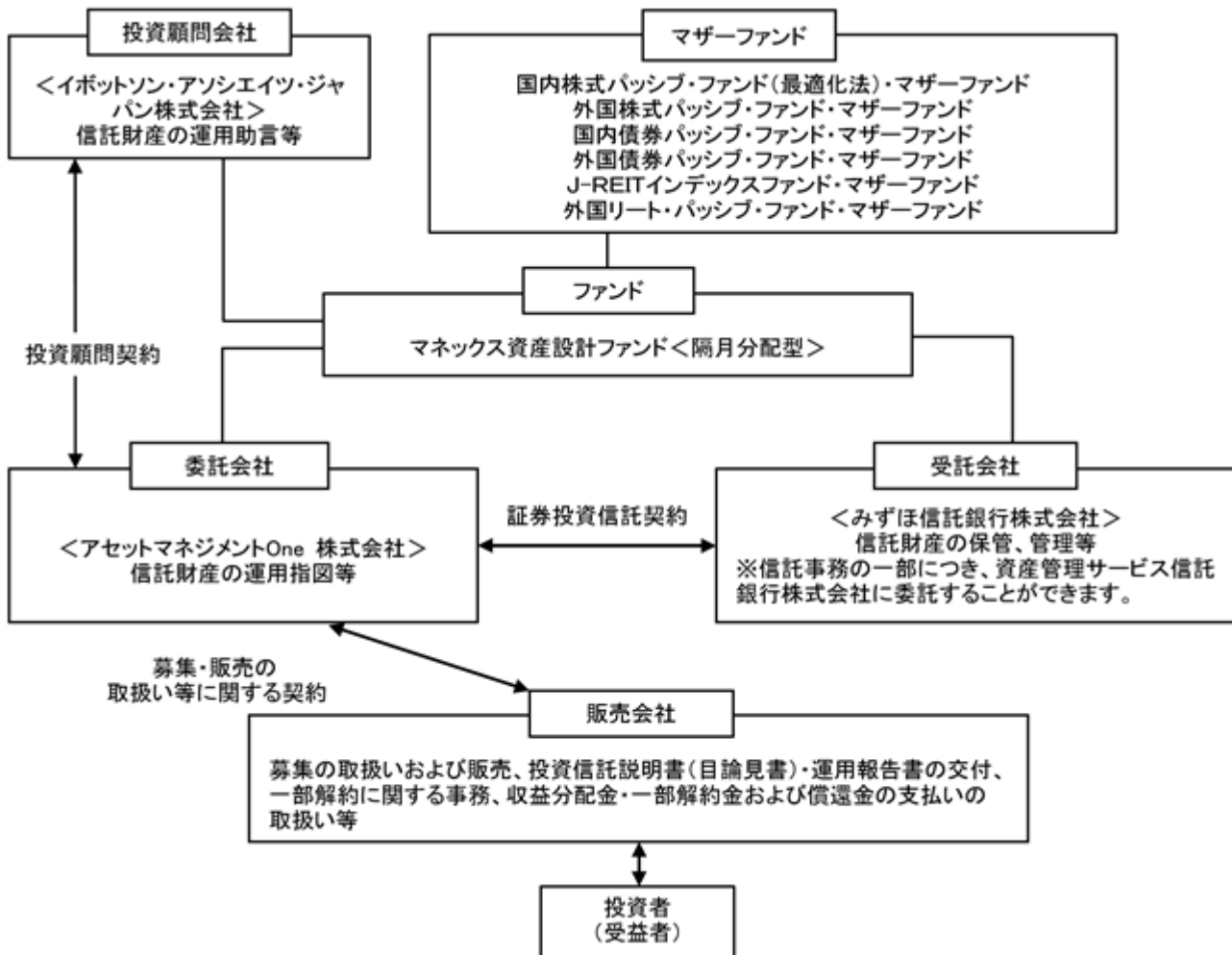
<p>その他資産 （投資信託証券 （資産複合（株式、 債券、不動産投信） 資産配分変更型））</p>	<p>目論見書または投資信託約款において、投資信託証券への投資を通じて、主として複数の資産（株式、債券、不動産投信）を実質的な投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行う旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないものをいいます。</p> <p>（注）商品分類表の投資対象資産は資産複合に分類され、属性区分表の投資対象資産はその他資産（投資信託証券（資産複合（株式、債券、不動産投信）資産配分変更型））に分類されます。</p>
<p>年6回（隔月）</p>	<p>目論見書または投資信託約款において、年6回決算する旨の記載があるものをいいます。</p>
<p>グローバル （日本を含む）</p>	<p>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います。</p>
<p>ファミリー ファンド</p>	<p>目論見書または投資信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。）を投資対象として投資するものをいいます。</p>
<p>為替ヘッジなし</p>	<p>目論見書または投資信託約款において、対円での為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは対円での為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいいます。</p>

上記の分類は、一般社団法人投資信託協会の商品分類に関する指針に基づき記載しております。上記以外の商品分類および属性区分の定義については、一般社団法人投資信託協会ホームページ（<http://www.toushin.or.jp/>）をご覧ください。

（２）【ファンドの沿革】

- 平成19年1月26日 信託契約締結、ファンドの設定、ファンドの運用開始
- 平成28年4月13日 外国リートの投資対象マザーファンドを「グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンド」から「外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド」へ変更

(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、当ファンドの設定時に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、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・一部解約金および償還金の受益者への支払い等に関する包括的な規則を定めたものです。

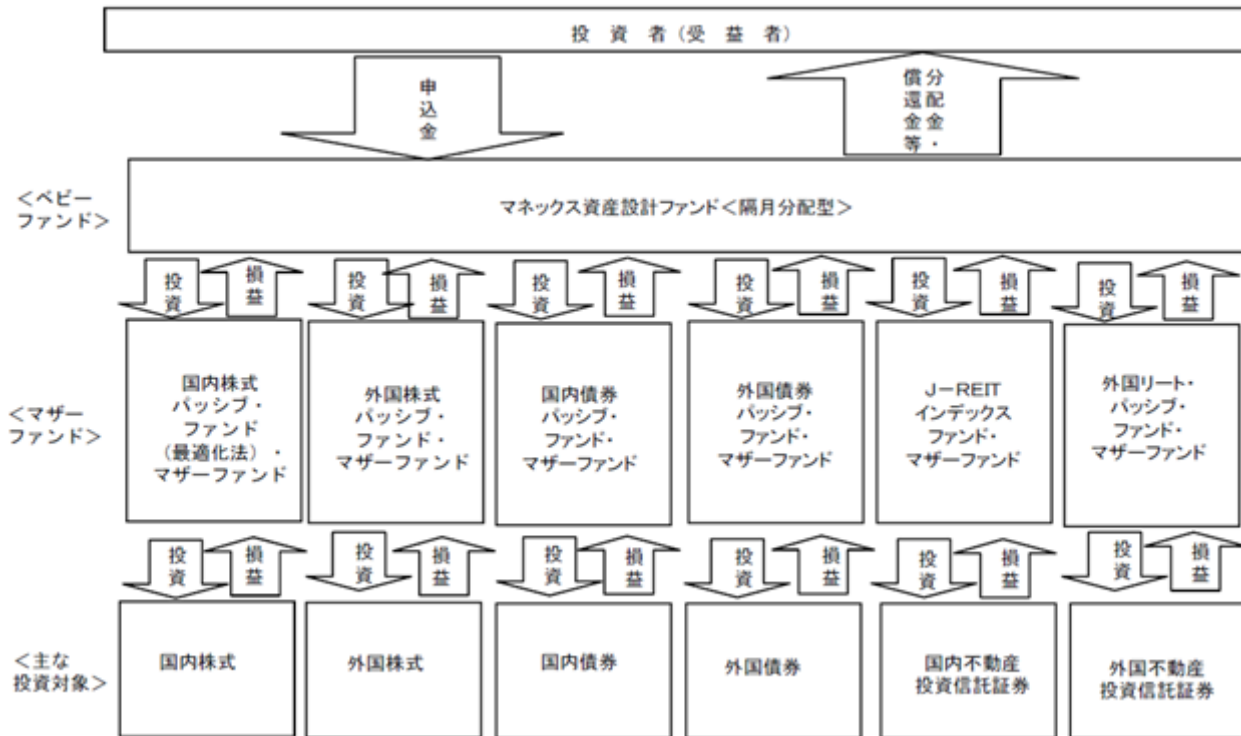
- ・「投資顧問契約」の概要

委託会社と投資顧問会社（イボットソン・アソシエイツ・ジャパン株式会社）との間においては、当ファンドの運用にかかる助言契約が締結されております。当該契約の内容は、投資顧問サービスの内容、助言の基本方針、運用の責任等について規定したものです。

ファミリーファンド方式とは

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います。



委託会社の概況

名称：アセットマネジメントOne株式会社

本店の所在の場所：東京都千代田区丸の内一丁目8番2号

資本金の額

20億円（平成30年5月31日現在）

委託会社の沿革

昭和60年7月 1日	会社設立
平成10年3月 31日	「証券投資信託法」に基づく証券投資信託の委託会社の免許取得
平成10年12月 1日	証券投資信託法の改正に伴う証券投資信託委託業のみなし認可
平成11年10月 1日	第一ライフ投信投資顧問株式会社を存続会社として興銀エヌダブルユ・アセットマネジメント株式会社及び日本興業投信株式会社と合併し、社名を興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社とする。
平成20年1月 1日	「興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社」から「DIAMアセットマネジメント株式会社」に商号変更

平成28年10月 1日

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

大株主の状況

(平成30年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、マザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に国内外の株式、債券および不動産投資信託証券に投資を行い、信託財産の成長と安定した収益の確保をめざします。

<投資対象>

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド受益証券、外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券、国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券、外国債券パッシブ・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および外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。

<投資態度>

主として国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・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、国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド、外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド、J-REITインデックスファンド・マザーファンドおよび外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンドの各受益証券への投資を通じ、国内外の株式、債券、不動産投資信託証券(不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券をいいます。以下同じ。)の計6資産への分散投資を行います。

基本資産配分比率は原則として年1回見直すこととします。また、この期間において時価変動による基本資産配分からの乖離分については、原則として見直しを行いません。ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった時等、やむを得ない事情が発生した場合には、随時基本資産配分を見直すこととします。

基本資産配分比率の決定については、イボットソン・アソシエイツ・ジャパン株式会社の投資助言を受けます。

分散投資の観点から、各資産への配分は一定の範囲内に制限します。

実質組入外貨建資産の為替変動リスクに対しては、原則として為替ヘッジを行いません。

リート(REIT)とは

- ・リート(REIT)とは、不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券をいいます。(以下同じ。)
- ・REIT(リート)とは、Real Estate Investment Trustの略であり、不動産を中心に運用を行っている投資法人あるいは投資信託を一般的に総称するものです。なお、主に豪州市場に上場するリートについては、LPT(Listed Property Trust)と呼ばれる場合があります。
- ・リート(REIT)は、不特定多数の投資家から集めた資金などで不動産等を購入し、当該不動産をテナントに賃貸し、主にそのテナントから得る賃料から収入を得ます。多くのリート(REIT)は、一定の適格要件を満たすことにより、法人税の課税が免除されています。このため、リート(REIT)は、不動産の維持・管理費用や金利などを支払った後に残った収益について、そのほとんどをリート(REIT)に投資する投資家が、配当金(もしくは分配金)として享受する仕組みになっています。

投資対象の詳細は、約款をご覧ください。

<運用プロセス>

- ・基本資産配分比率決定のプロセスは、期待リターン(期待収益率)、リスク(標準偏差)、相関係数を推計し、代表的な証券投資理論の1つである平均分散アプローチにより効率的フロンティアを描き、一定のリスク水準から導きます。
- ・分散投資の観点から各資産の基本配分比率は一定の範囲内とします。
- ・決定した基本資産配分比率に基づき、6つのマザーファンドへ投資を行いポートフォリオを構築します。
- ・時価変動による基本資産配分比率からの乖離分については、原則としてリバランスを行いません。
- ・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに純資産総額が運用に支障をきたす水準となった時等、やむを得ない事情が発生した場合には、随時基本資産配分比率を見直すこととします。

(2)【投資対象】

1.投資の対象とする資産(約款第15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項で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係る権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第23条、第24条および第25条に定めるものに限りません。)

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

2.有価証券の指図範囲(約款第16条第1項)

委託会社は、信託金を、主として次に掲げる1)から6)までの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の受益証券ならびに7)から28)までの有価証券(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) 国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド
- 2) 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
- 3) 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
- 4) 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
- 5) J-REITインデックスファンド・マザーファンド
- 6) 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド
- 7) 株券または新株引受権証券
- 8) 国債証券
- 9) 地方債証券
- 10) 特別の法律により法人の発行する債券
- 11) 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。)
- 12) 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。)
- 13) 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。)
- 14) 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。)
- 15) 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。)
- 16) コマーシャル・ペーパー
- 17) 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
- 18) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、7)から17)までの証券または証書の性質を有するもの
- 19) 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいい、振替投資信託受益権を含みます。)
- 20) 投資証券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
- 21) 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。)
- 22) 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、有価証券に係るものに限りません。)
- 23) 預託証券(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。)
- 24) 外国法人が発行する譲渡性預金証券

25)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。)

26)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。)

27)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

28)外国の者に対する権利で上記27)の有価証券の性質を有するもの

なお、7)の証券または証書、18)ならびに23)の証券または証書のうち7)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、8)から12)までの証券および18)ならびに23)の証券または証書のうち8)から12)までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、19)の証券および20)の証券を以下「投資信託証券」といいます。

3. 金融商品の指図範囲(約款第16条第2項)

委託会社は、信託金を、上記2. 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を指図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上記5)の権利の性質を有するもの

4. 上記2. の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときは、委託会社は信託金を上記3. の1)から4)までに掲げる金融商品により運用することの指図ができます。(約款第16条第3項)

(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	<p>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）^{（注）}に連動する投資成果を目標として運用を行います。</p> <p>（注） 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>
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。

<p>投資態度</p>	<ol style="list-style-type: none"> 1. 主として東京証券取引所第一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。 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的なリスク管理を行います。 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。 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。 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>運用プロセス</p>	<p>流動性基準による対象銘柄群設定</p> <p>マーケットインパクトの低減を図る為、TOPIX採用銘柄のうち、流動性が低い銘柄を除外して投資対象銘柄群を設定します。</p> <p>最適化法によるポートフォリオの構築</p> <p>インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差(アクティブウェイト)を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。</p> <p>インデックスとの乖離を管理</p> <p>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> <p>インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・市場変動に伴うもの：推定トラッキングエラーの増加に伴い実施 ・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	<p>株式への投資割合には、制限を設けません。</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、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</p> <p>外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。</p> <p>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がた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	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) ^(注) に連動する投資成果をめざして運用を行います。
------	--

(注)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。

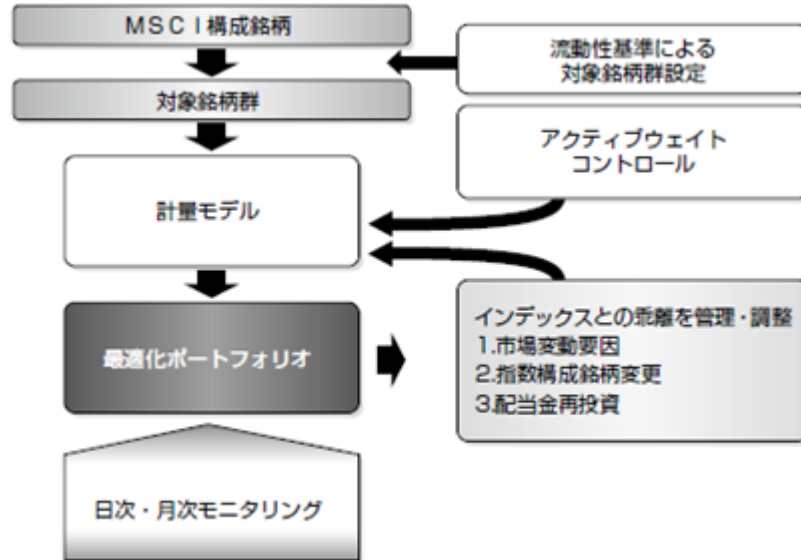
本証券、本商品もしくは本ファンドの購入者、販売者もしくは所有者、またはその他いかなる者もしくは団体も、MSCIの承認が必要か否かの確認を事前にMSCIに求めることなく、本証券を保証、推奨、販売、または宣伝す

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。

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。

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。

運用プロセス



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。

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。

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。

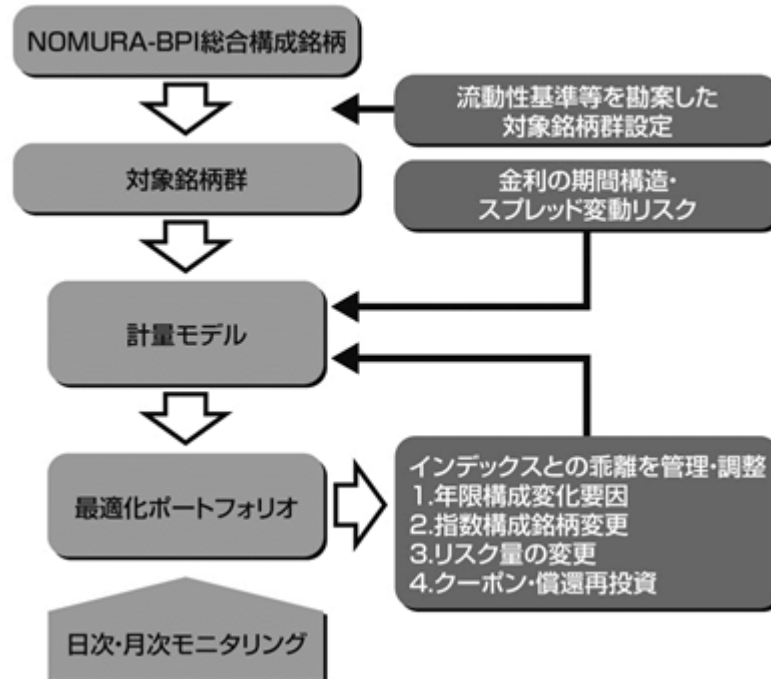
インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。

- ・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

<p>主な投資制限</p>	<p>株式への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>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。</p> <p>同一銘柄の転換社債、ならびに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（以下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含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）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。</p> <p>外貨建資産への投資には、制限を設けません。</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、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</p> <p>外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。</p> <p>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>
---------------	---

<p>ファンド名</p>	<p>国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド</p>
<p>基本方針</p>	<p>この投資信託は、NOMURA - B P I 総合^(注)に連動する投資成果を目標として運用を行います。</p> <div style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin: 5px 0;"> <p>(注) 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>
<p>主な投資対象</p>	<p>わが国の公社債を主要投資対象とします。</p>
<p>投資態度</p>	<p>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>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>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>

運用プロセス



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。

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。

インデックスとの乖離を管理

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

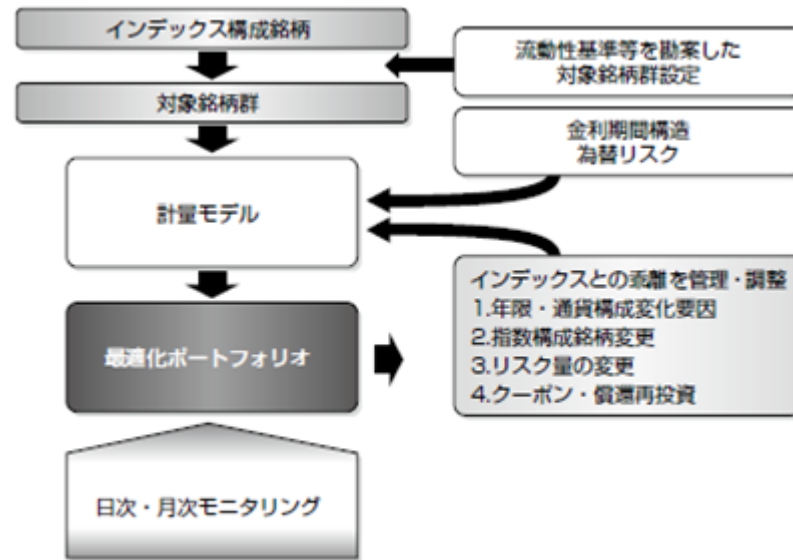
インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。

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

主な投資制限	<p>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。</p> <p>株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>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。</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、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</p> <p>外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。</p> <p>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がい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>
--------	---

ファンド名	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。
主な投資対象	海外の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	<p>主に日本を除く世界主要国の公社債に投資し、「FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）^(注)」に連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <div data-bbox="351 1411 1380 1803" style="border: 1px solid black; padding: 5px;"> <p>（注）FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。</p> </div> <p>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>外貨建資産については原則為替ヘッジは行いませんが、金利・為替状況によってはヘッジを実施する可能性があります。</p>

運用プロセス



流動性基準等による対象銘柄群設定

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

最適化法によるポートフォリオの構築

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

インデックスとの乖離を管理

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。

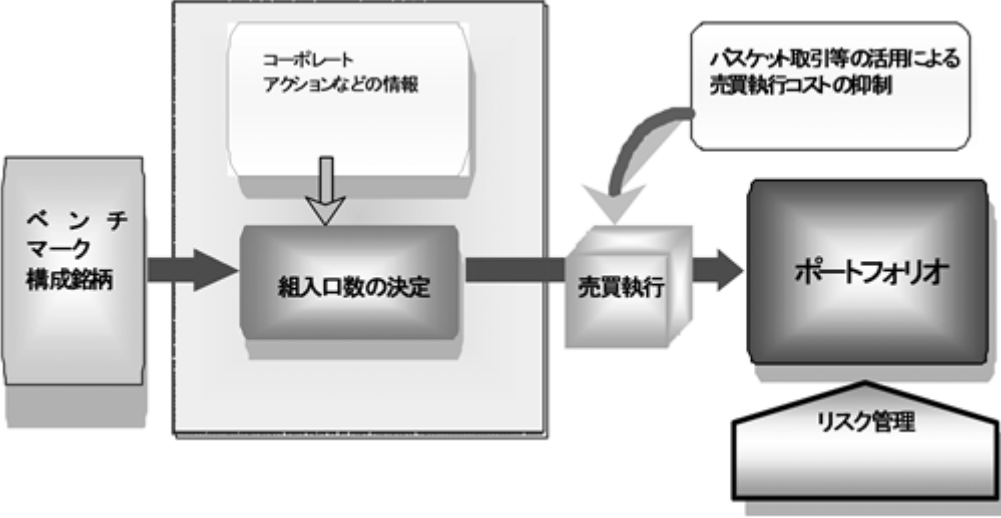
インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。

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

主な投資制限	<p>株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限りません。</p> <p>株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資には、制限を設けません。</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、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</p> <p>外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。</p> <p>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	J-REITインデックスファンド・マザーファンド
-------	--------------------------

基本方針	<p>この投資信託は、東証REIT指数(配当込み)^(注)の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>(注) 東証REIT指数の指数値および東証REIT指数の商標は、株式会社東京証券取引所(以下「株東京証券取引所」といいます。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など東証REIT指数に関するすべての権利・ノウハウおよび東証REIT指数の商標に関するすべての権利は株東京証券取引所が有しています。</p> <p>株東京証券取引所は、東証REIT指数の指数値の算出もしくは公表の方法の変更、東証REIT指数の指数値の算出もしくは公表の停止または東証REIT指数の商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。</p> <p>株東京証券取引所は、東証REIT指数の指数値および東証REIT指数の商標の使用に関して得られる結果ならびに特定日の東証REIT指数の指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。</p> <p>株東京証券取引所は、東証REIT指数の指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、株東京証券取引所は、東証REIT指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。</p> <p>当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドは、株東京証券取引所により提供、保証または販売されるものではありません。</p> <p>株東京証券取引所は、当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドの購入者または公衆に対し、当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を持ちません。</p> <p>株東京証券取引所は、委託会社または当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドの購入者のニーズを、東証REIT指数の指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。</p> <p>以上の項目に限らず、株東京証券取引所は当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドの発行または売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を負いません。</p>
主な投資対象	<p>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(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。</p>

<p>投資態度</p>	<p>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せん。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
<p>運用プロセス</p>	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>  <pre> graph LR A[ベンチマーク構成銘柄] --> B[組入口数の決定] C[コーポレートアクションなどの情報] --> B B --> D[売買執行] D --> E[ポートフォリオ] E --- F[リスク管理] G[バケット取引等の活用による 売買執行コストの抑制] -.-> D </pre>

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) ^(注) に連動する投資成果をめざして運用を行います。
------	--

(注) 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(「SPDJ」)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、SPDJ、Dow Jones、S&P、それらの各関連会社(総称して「S&P Dow Jones Indices」)によってスポンサー、保証、販売、または販売促進されているものではありません。S&P Dow Jones Indicesは、本商品の所有者またはいかなる一般人に対して、有価証券全般または具体的な商品への投資の妥当性、あるいは全般的な市場のパフォーマンスを追跡するS & P 先進国 R E I T インデックスの能力に関して、明示または黙示を問わず、いかなる表明または保証もしません。指数の過去のパフォーマンスは、将来の成績を示唆または保証するものでもありません。S & P 先進国 R E I T インデックスに関して、S&P Dow Jones Indicesと委託会社との間にある唯一の関係は、当指数とS&P Dow Jones Indicesおよび/または特定の商標、サービスマーク、および/または商標名のライセンス供与です。S & P 先進国 R E I T インデックスは委託会社または本商品に関係なく、S&P Dow Jones Indicesによって決定、構成、計算されます。S&P Dow Jones Indicesは、S & P 先進国 R E I T インデックスの決定、構成または計算において委託会社または本商品の所有者のニーズを考慮する義務を負いません。S&P Dow Jones Indicesは、本商品の価格および数量、または本商品の発行または販売のタイミングの決定、もしくは場合によっては本商品が将来換金、譲渡、または償還される計算式の決定または計算に関して、責任を負わず、またこれに関与したこともありません。S&P Dow Jones Indicesは、本商品の管理、マーケティング、または取引に関して、いかなる義務または責任も負いません。S & P 先進国 R E I T インデックスに基づく投資商品が、指数のパフォーマンスを正確に追跡する、またはプラスの投資収益率を提供する保証はありません。S&P Dow Jones Indices LLCは投資または税務の顧問会社ではありません。免税証券のポートフォリオへの影響や特定の投資決断の税効果の評価は、税務顧問会社に相談してください。指数に証券が含まれることは、S&P Dow Jones Indicesがかかる証券の売り、買い、またはホールドの推奨を意味するものではなく、投資アドバイスとして見なしてはなりません。

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

	<p>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。</p>
<p>主な投資対象</p>	<p>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。</p> <p>海外の証券取引所に上場(これに準ずるものを含みます。)されている不動産投資信託証券(一般社団法人投資信託協会規則に定める不動産投資信託の受益証券(振替投資信託受益権を含みます。))および不動産投資法人の投資証券。以下同じ。)とします。</p>
<p>投資態度</p>	<ol style="list-style-type: none"> 1.主に日本を除く世界各国の不動産投資信託証券を主要投資対象とし、S & P 先進国 REITインデックス(除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)に連動する投資成果をめざして運用を行います。 2.不動産投資信託証券への投資割合は、原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。 3.外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。ただし、金利・為替状況によってはヘッジを行う場合があります。
<p>運用プロセス</p>	<p>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。</p> <pre> graph TD A[インデックス構成銘柄] --> B[完全法をベースとして 組入銘柄および株数を決定] B --> C[ポートフォリオ] C --> D[日々・月次モニタリング] D --> E[インデックスとの乖離を管理・調整 1.インデックス構成銘柄および株数の変更 2.配当金再投資 3.資本異動 4.設定/解約] E --> B </pre>

主な投資制限	<ol style="list-style-type: none">1. 投資信託証券への投資割合には制限を設けません。2. 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。3. 株式への直接投資は行いません。4. 同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として信託財産の純資産総額の30%以内とします。ただし、S & P 先進国 REIT インデックス(除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)における時価の構成割合が30%を超える不動産投資信託証券がある場合には、指数との連動性を維持するために当該不動産投資信託証券をS & P 先進国 REIT インデックス(除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)の構成割合の範囲で組入れることができるものとします。5. デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます。)は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。6. 外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。7. 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
--------	---

資金動向、市況動向等によっては、上記の運用ができない場合があります。

(3) 【運用体制】

a. ファンドの運用体制



投資環境見通しおよび運用方針の策定

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

運用計画の決定

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

売買執行の実施

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

モニタリング

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

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

内部管理等のモニタリング

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

b．ファンドの関係法人に関する管理

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

c．運用体制に関する社内規則

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

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

運用体制は平成30年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（原則として奇数月の各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分配を行います。

1)分配対象額の範囲

経費控除後の利子、配当等収入および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。

2)分配対象額についての分配方針

原則として、利子配当等収益を中心に安定した収益分配を継続的に行うことをめざします。また、毎年5月および11月の決算時には、利子配当等収益に売買益（評価益を含みます。）等を加えた額から分配を行います。分配金額については、基準価額水準および市況動向等を勘案し委託会社の判断により決定します。ただし、分配対象額が少額の場合は分配を行わないことがあります。

3)留保益の運用方針

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

収益の分配方式

a. 信託財産から生じる毎計算期末における利益は、次の方法により処理するものとします。

1) 信託財産に属する配当等収益（利子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。）と各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等に相当する金額、監査報酬および当該監査報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除した後、その残金を受益者に分配することができます。

なお、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。

2) 売買損益に評価損益を加減した額からみなし配当等収益を控除して得た利益金額(以下「売買益」といいます。)は、諸経費、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、監査報酬および当該監査報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のある時はその全額を売買益をもって補填した後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。

b. 上記1)および2)におけるみなし配当等収益とは、各マザーファンドの信託財産にかかる配当等収益の額に、各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各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。

c. 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、毎計算期間の末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計算期間の末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。

(5) 【投資制限】

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は、信託財産の純資産総額の70%未満とします。(約款「運用の基本方針」2.運用方法(3)投資制限)

新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%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)

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)

同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券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)

同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、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)

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19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者が投資することを指図することができるものとします。

信用取引の指図および範囲(約款第22条)

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

先物取引等の運用指図・目的・範囲(約款第23条)

- 1)委託会社は、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。以下同じ。)、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。以下同じ。)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。以下同じ。)ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を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。)
- 2)委託会社は、わが国の取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の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行うことの指図をすることができます。
- 3)委託会社は、わが国の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取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

スワップ取引の運用指図・目的・範囲(約款第24条)

- 1)委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、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行うものとしします。

4)委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとしします。

金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図・目的・範囲（約款第25条）

1)委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、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します。

4)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あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとしします。

デリバティブ取引等にかかる投資制限（約款第25条の2）

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します。

有価証券の貸付の指図および範囲（約款第26条）

1)委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の1. 2.の範囲内で貸付けの指図をすることができます。

1.株式の貸付けは、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します。

2.公社債の貸付けは、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します。

3)委託会社は、有価証券の貸付け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します。

公社債の空売りの指図および範囲（約款第27条）

1)委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売り付けの決済については、公社債（信託財産により借り入れた公社債を含みます。）の引き渡しまたは買い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します。

2)上記1)の売り付けの指図は、当該売り付けに係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)の売り付けに係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り付けの一部を決済するための指図をするものとしします。

公社債の借入れ（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、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します。

- 2)上記1)の指図は、当該借入れに係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)の借入れに係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)の借入れに係る品借料は信託財産中から支弁します。

特別の場合の外貨建有価証券への投資制限（約款第29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、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、信託財産に係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、信託財産に係る売予約とマザーファンドの信託財産に係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が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- 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係る為替の買予約の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産に係る為替の売予約のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる為替の売予約の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- 4)上記2)の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

資金の借入れ（約款第37条）

- 1)委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資す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、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、資金借入れ額は借入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)借入金の利息は信託財産中より支弁します。

8.2 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

各資産(国内債券、外国債券、国内株式、外国株式、国内リートおよび外国リート)への資産配分は、基本資産配分比率に準じ、一定範囲内の変動に抑えます。

この資産配分が当ファンドの収益の源泉となる場合もありますが、収益率の悪い資産への配分が大きい場合、複数または全ての資産価値が下落する場合には、各資産の投資成果が各資産のベンチマークと同等あるいはそれ以上のものであったとしても、当ファンドの基準価額が下がる要因となる可能性があります。

株価変動リスク

当ファンドは、実質的に株式に投資をしますので、株式市場の変動により基準価額が上下します。

金利リスク

金利リスクとは、金利変動により債券およびリートの価格が変動するリスクをいいます。金利が上昇した場合には、債券およびリートの価格は下落し、当ファンドの基準価額が下がる場合があります。

リートの価格変動リスク

リートの価格は、リートが投資対象とする不動産等の価値、当該不動産等による賃貸収入の増減、不動産市況の変動、景気や株式市況等の動向などによって変動します。

当ファンドは、実質的にリートに投資をしますので、これらの影響を受け、基準価額が上下します。

為替リスク

当ファンドは、実質組入外貨建資産について原則として対円で為替ヘッジを行わないため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、当ファンドの基準価額が下がる要因となります。

また外貨建資産への投資は、その国の政治経済情勢、通貨規制、資本規制等の要因による影響を受けて損失を被る可能性もあります。

信用リスク

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、基準価額が下がる要因となります。

流動性リスク

当ファンドにおいて有価証券等を実質的に売却または取得する際に、市場規模、取引量、取引規制等により十分な流動性の下での取引を行えない場合には、市場実勢から期待できる価格どおりに取引できないことや、値動きが大きくなることがあり、基準価額に影響をおよぼす可能性があります。

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で、受益者毎に異なります。

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

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。そのため、当ファンドが投資対象とするマザーファンドを投資対象とする他のベビーファンドに追加設定・解約等があった場合、資金変動が起こり、その結果、当該マザーファンドにおいて売買等が生じた場合等には、当ファンドの基準価額に影響をおよぼす場合があります。

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

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、お申込み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、信託財産の純資産総額が10億円を下回ることとなった場合、受益者のため有利と認める場合、その他やむを得ない事情が発生した場合は、当初定められていた信託期間の途中で信託を終了（繰上償還）する場合があります。

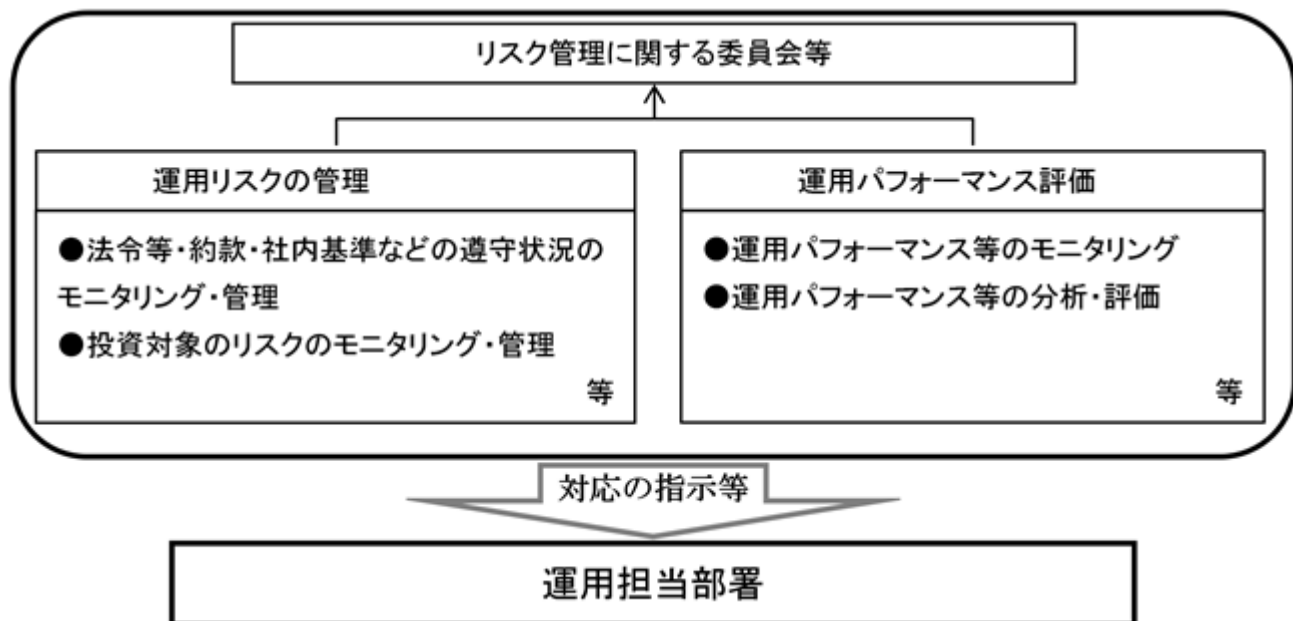
注意事項

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

<リスク管理体制>

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

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



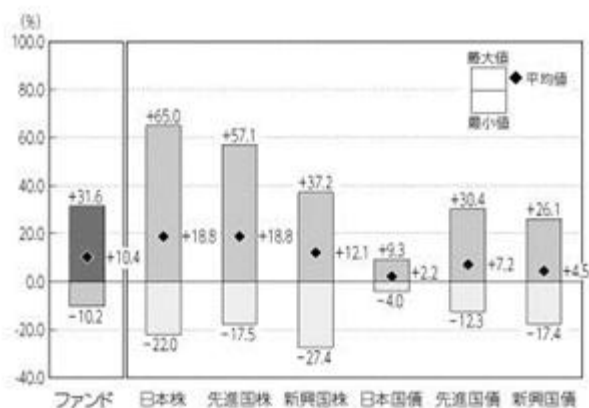
上記体制は平成30年5月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

<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



2013年6月～2018年5月

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

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

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

*全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

*各資産クラスの指数

- 日本株…東証株価指数(TOPIX) (配当込み)
 - 先進国株…MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、円ベース)
 - 新興国株…MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込み、円ベース)
 - 日本国債…NOMURA-BPI国債
 - 先進国債…FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)
 - 新興国債…JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイド (円ベース)
- (注) 海外の指数は為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

ありません。

(2)【換金（解約）手数料】

ありません。

(3)【信託報酬等】

ファンドの日々の純資産総額に対して年率1.026%（税抜0.95%）

信託報酬の配分は、販売会社の取扱純資産額に応じて、以下の通りとします。

信託報酬の配分（税抜）			
販売会社の 取扱純資産額	委託会社	販売会社	受託会社
100億円以下の部分	年率0.52%	年率0.36%	年率0.07%
100億円超 300億円以下の部分	年率0.47%	年率0.41%	年率0.07%
300億円超の部分	年率0.42%	年率0.46%	年率0.07%
主な役務	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	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	運用財産の保管・管 理、委託会社からの 運用指図の実行等の 対価

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率

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

委託会社の信託報酬には、当ファンドの投資顧問会社（イボットソン・アソシエイツ・ジャパン）に対する投資顧問報酬が含まれます。

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

(4)【その他の手数料等】

1. 信託財産留保額

解約時に、解約請求受付日の翌営業日の基準価額に0.3%の率を乗じて得た額とします。

2. その他の費用

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

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

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

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

マザーファンドで負担する有価証券の売買時の売買委託手数料および有価証券取引にかかる手数料・税金、先物・オプション取引に要する費用、当該手数料にかかる消費税等相当額および外貨建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、運用状況等により変動するものであり、事前に料率、上限額等を示すことができません。

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

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

(5)【課税上の取扱い】

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、平成30年5月末現在のものです。税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。

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

個別元本方式について

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

< 個別元本について >

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

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

ただし、同一ファンドの受益権を複数の販売会社で取得する場合には販売会社毎に個別元本の算出が行われます。また、同一販売会社であっても複数支店等で同一ファンドの受益権を取得する場合は当該支店等毎に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】

平成30年5月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	435,161,966	98.48
内 日本	435,161,966	98.48
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	6,708,786	1.52
純資産総額	441,870,752	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。

(参考)

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

平成30年5月31日現在

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

その他資産の投資状況

平成30年5月31日現在

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

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

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

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

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年5月31日現在

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

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

J - R E I Tインデックスファンド・マザーファンド

平成30年5月31日現在

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

その他資産の投資状況

平成30年5月31日現在

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

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年5月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	289,771,018,104	95.16
内 アメリカ	183,481,337,625	60.26
内 イギリス	19,941,131,732	6.55
内 フランス	11,580,329,485	3.80
内 カナダ	11,370,241,448	3.73
内 ドイツ	11,311,072,347	3.71
内 スイス	9,785,036,474	3.21
内 オーストラリア	7,254,513,769	2.38
内 オランダ	5,799,695,899	1.90
内 アイルランド	4,153,367,817	1.36

内	スペイン	3,490,016,449	1.15
内	スウェーデン	3,002,663,347	0.99
内	香港	2,939,069,188	0.97
内	イタリア	2,209,379,002	0.73
内	デンマーク	1,988,285,265	0.65
内	ジャージー	1,673,724,945	0.55
内	シンガポール	1,427,424,185	0.47
内	バミューダ	1,311,039,228	0.43
内	フィンランド	1,224,802,627	0.40
内	ベルギー	1,208,000,141	0.40
内	ケイマン諸島	856,730,697	0.28
内	ノルウェー	796,260,605	0.26
内	オランダ領キュラソー	789,981,437	0.26
内	イスラエル	573,277,276	0.19
内	ルクセンブルグ	382,643,160	0.13
内	オーストリア	279,254,002	0.09
内	ニュージーランド	200,626,948	0.07
内	ポルトガル	174,736,727	0.06
内	パナマ	170,302,255	0.06
内	リベリア	141,709,217	0.05
内	マン島	95,034,782	0.03
内	イギリス領バージン諸島	79,704,990	0.03
内	パプアニューギニア	62,202,487	0.02
内	モーリシャス	17,422,548	0.01
投資信託受益証券		755,367,870	0.25
	内 オーストラリア	597,816,823	0.20
	内 シンガポール	157,551,047	0.05
投資証券		6,242,401,697	2.05
	内 アメリカ	5,369,771,453	1.76
	内 フランス	361,401,778	0.12
	内 イギリス	310,925,693	0.10
	内 香港	156,135,551	0.05
	内 カナダ	44,167,222	0.01
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		7,735,485,239	2.54
純資産総額		304,504,272,910	100.00

その他資産の投資状況

平成30年5月31日現在

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

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

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

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年5月31日現在

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

その他資産の投資状況

平成30年5月31日現在

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

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年5月31日現在

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

その他資産の投資状況

平成30年5月31日現在

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

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

(2) 【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

平成30年5月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	国内債券パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	91,445,749	1.2901 117,974,161	1.2919 118,138,763	- -	26.74%
2	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	42,726,996	2.7386 117,012,152	2.6665 113,931,534	- -	25.78%
3	外国株式パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	31,471,673	3.4632 108,995,845	3.4109 107,346,729	- -	24.29%
4	外国債券パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	23,582,221	1.7993 42,431,491	1.7660 41,646,202	- -	9.42%
5	外国リート・パッシブ・ファ ンド・マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	23,851,883	1.1701 27,909,089	1.1656 27,801,754	- -	6.29%
6	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	14,493,488	1.8166 26,330,319	1.8144 26,296,984	- -	5.95%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成30年5月31日現在

種類	投資比率
親投資信託受益証券	98.48%
合計	98.48%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

(参考)

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

平成30年5月31日現在

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

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

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成30年5月31日現在

種類	投資比率
株式	97.43%
合計	97.43%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

平成30年5月31日現在

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

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年5月31日現在

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

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

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成30年5月31日現在

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

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

J-REITインデックスファンド・マザーファンド

平成30年5月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	日本ビルファンド投資法人 日本	投資証券	4,097	589,312.28 2,414,412,423	610,000.00 2,499,170,000	- -	7.10%
2	ジャパンリアルエステイト投資法人 日本	投資証券	4,210	566,446.16 2,384,738,345	571,000.00 2,403,910,000	- -	6.83%
3	野村不動産マスターファンド投資法人 日本	投資証券	12,521	155,592.20 1,948,169,969	152,400.00 1,908,200,400	- -	5.42%
4	日本リテールファンド投資法人 日本	投資証券	7,989	210,860.98 1,684,568,426	197,400.00 1,577,028,600	- -	4.48%
5	ユナイテッド・アーバン投資法人 日本	投資証券	9,331	165,930.68 1,548,299,209	166,800.00 1,556,410,800	- -	4.42%
6	オリックス不動産投資法人 日本	投資証券	8,395	169,226.95 1,420,660,280	171,900.00 1,443,100,500	- -	4.10%
7	日本プロロジスリート投資法人 日本	投資証券	5,639	237,970.33 1,341,914,727	227,000.00 1,280,053,000	- -	3.64%
8	大和ハウスリート投資法人 日本	投資証券	4,923	269,512.54 1,326,810,262	256,600.00 1,263,241,800	- -	3.59%
9	アドバンス・レジデンス投資法人 日本	投資証券	3,917	283,072.22 1,108,793,914	284,900.00 1,115,953,300	- -	3.17%
10	GLP投資法人 日本	投資証券	8,783	120,357.01 1,057,095,629	121,600.00 1,068,012,800	- -	3.04%
11	日本プライムリアルティ投資法人 日本	投資証券	2,671	402,826.42 1,075,949,393	395,500.00 1,056,380,500	- -	3.00%
12	ジャパン・ホテル・リート投資法人 日本	投資証券	12,211	78,827.74 962,565,535	81,200.00 991,533,200	- -	2.82%

13	アクティビア・プロパティーズ投資法人 日本	投資証券	1,914	489,231.59 936,389,278	484,500.00 927,333,000	- -	2.64%
14	ケネディクス・オフィス投資法人 日本	投資証券	1,305	633,914.49 827,258,412	675,000.00 880,875,000	- -	2.50%
15	積水ハウス・リート投資法人 日本	投資証券	10,600	70,622.62 748,603,371	71,400.00 756,843,570	- -	2.15%
16	日本アコモデーションファンド投資法人 日本	投資証券	1,406	474,729.10 667,469,123	490,500.00 689,643,000	- -	1.96%
17	フロンティア不動産投資法人 日本	投資証券	1,439	470,658.50 677,277,592	449,000.00 646,111,000	- -	1.84%
18	森ヒルズリート投資法人 日本	投資証券	4,545	140,466.24 638,419,067	140,000.00 636,300,000	- -	1.81%
19	日本ロジスティクスファンド投資法人 日本	投資証券	2,819	225,801.44 636,534,280	224,600.00 633,147,400	- -	1.80%
20	産業ファンド投資法人 日本	投資証券	4,914	122,681.93 602,859,043	121,600.00 597,542,400	- -	1.70%
21	大和証券オフィス投資法人 日本	投資証券	912	578,242.78 527,357,418	637,000.00 580,944,000	- -	1.65%
22	インヴィンシブル投資法人 日本	投資証券	11,604	49,697.44 576,689,137	50,000.00 580,200,000	- -	1.65%
23	ジャパンエクセレント投資法人 日本	投資証券	3,789	134,698.86 510,374,011	145,000.00 549,405,000	- -	1.56%
24	イオンリート投資法人 日本	投資証券	4,018	119,985.27 482,100,854	123,000.00 494,214,000	- -	1.40%
25	ヒューリックリート投資法人 日本	投資証券	2,873	174,068.94 500,100,070	171,100.00 491,570,300	- -	1.40%
26	森トラスト総合リート投資法人 日本	投資証券	3,024	171,942.83 519,955,141	161,700.00 488,980,800	- -	1.39%
27	東急リアル・エステート投資法人 日本	投資証券	2,837	139,258.44 395,076,215	149,300.00 423,564,100	- -	1.20%
28	日本賃貸住宅投資法人 日本	投資証券	4,759	83,179.21 395,849,901	87,400.00 415,936,600	- -	1.18%
29	コンフォリア・レジデンシャル投資法人 日本	投資証券	1,604	243,193.09 390,081,731	258,500.00 414,634,000	- -	1.18%
30	プレミア投資法人 日本	投資証券	3,821	114,874.22 438,934,426	107,700.00 411,521,700	- -	1.17%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成30年5月31日現在

種類	投資比率
投資証券	97.83%
合計	97.83%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年5月31日現在

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

13	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 各種金融サービス	93,679	21,840.66 2,046,011,546	21,098.66 1,976,502,306	- -	0.65%
14	CHEVRON CORP アメリカ	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	141,261	12,348.85 1,744,412,250	13,604.89 1,921,840,648	- -	0.63%
15	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	231,295	8,497.67 1,965,470,493	8,282.36 1,915,669,150	- -	0.63%
16	UNITEDHEALTH GROUP INC アメリカ	株式 ヘルスケア・ プロバイ ダー/ヘルス ケア・サービ ス	71,700	24,887.26 1,784,417,154	26,624.97 1,909,010,922	- -	0.63%
17	VISA INC アメリカ	株式 情報技術サー ビス	134,179	13,142.83 1,763,492,141	14,200.56 1,905,418,013	- -	0.63%
18	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 専門小売り	86,514	20,076.95 1,736,937,330	20,336.68 1,759,407,793	- -	0.58%
19	PFIZER INC アメリカ	株式 医薬品	446,210	3,834.37 1,710,935,177	3,918.63 1,748,534,123	- -	0.57%
20	CISCO SYSTEMS INC アメリカ	株式 通信機器	364,860	4,584.28 1,672,621,536	4,657.79 1,699,443,083	- -	0.56%
21	BOEING CO アメリカ	株式 航空宇宙・防 衛	41,769	37,599.76 1,570,504,691	38,935.25 1,626,286,582	- -	0.53%
22	VERIZON COMM INC アメリカ	株式 各種電気通信 サービス	306,879	5,372.13 1,648,596,181	5,282.81 1,621,186,518	- -	0.53%
23	AT&T INC アメリカ	株式 各種電気通信 サービス	456,680	3,959.82 1,808,370,828	3,540.35 1,616,811,148	- -	0.53%
24	HSBC HOLDINGS PLC イギリス	株式 銀行	1,488,734	1,082.17 1,611,065,214	1,049.21 1,562,004,246	- -	0.51%
25	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品	186,535	8,769.39 1,635,798,703	8,140.54 1,518,496,188	- -	0.50%
26	MASTERCARD INC アメリカ	株式 情報技術サー ビス	69,652	18,766.98 1,307,158,128	20,844.31 1,451,848,019	- -	0.48%
27	CITIGROUP INC アメリカ	株式 銀行	196,708	8,332.93 1,639,154,230	7,248.11 1,425,762,402	- -	0.47%
28	COCA-COLA CO/THE アメリカ	株式 飲料	298,559	4,791.52 1,430,553,733	4,688.23 1,399,713,559	- -	0.46%
29	NOVARTIS AG-REG SHS スイス	株式 医薬品	166,499	8,729.96 1,453,530,491	8,200.92 1,365,445,978	- -	0.45%
30	ABBVIE INC アメリカ	株式 バイオテクノ ロジー	118,243	12,320.12 1,456,768,755	11,197.18 1,323,988,982	- -	0.43%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成30年5月31日現在

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

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

平成30年5月31日現在

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

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

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年5月31日現在

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

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

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成30年5月31日現在

種類	投資比率
国債証券	97.41%
合計	97.41%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年5月31日現在

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

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

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成30年5月31日現在

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

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【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】

該当事項はありません。

(参考)

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

平成30年5月31日現在

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

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

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

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

J-REITインデックスファンド・マザーファンド

平成30年5月31日現在

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

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

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

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年5月31日現在

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

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

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

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

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年5月31日現在

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

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

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

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年5月31日現在

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

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

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

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

直近日(平成30年5月末)、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	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4特定期間末 (平成20年11月11日)	964	968	0.6215	0.6240
第5特定期間末 (平成21年5月11日)	972	976	0.6435	0.6460
第6特定期間末 (平成21年11月11日)	966	970	0.6528	0.6553
第7特定期間末 (平成22年5月11日)	927	930	0.6634	0.6659
第8特定期間末 (平成22年11月11日)	861	863	0.6399	0.6414
第9特定期間末 (平成23年5月11日)	823	825	0.6487	0.6502
第10特定期間末 (平成23年11月11日)	712	714	0.5956	0.5971
第11特定期間末 (平成24年5月11日)	692	694	0.6202	0.6217
第12特定期間末 (平成24年11月12日)	652	653	0.6218	0.6233
第13特定期間末 (平成25年5月13日)	824	825	0.8225	0.8240
第14特定期間末 (平成25年11月11日)	736	738	0.8118	0.8133
第15特定期間末 (平成26年5月12日)	712	713	0.8414	0.8429
第16特定期間末 (平成26年11月11日)	684	685	0.9368	0.9383
第17特定期間末 (平成27年5月11日)	622	623	1.0095	1.0110
第18特定期間末 (平成27年11月11日)	534	535	0.9947	0.9962
第19特定期間末 (平成28年5月11日)	498	499	0.9354	0.9369
第20特定期間末 (平成28年11月11日)	482	483	0.9205	0.9220
第21特定期間末 (平成29年5月11日)	492	493	1.0090	1.0105
第22特定期間末 (平成29年11月13日)	477	478	1.0570	1.0585
第23特定期間末 (平成30年5月11日)	448	449	1.0565	1.0580
平成29年5月末日	482	-	0.9984	-

6月末日	482	-	1.0102	-
7月末日	475	-	1.0115	-
8月末日	476	-	1.0115	-
9月末日	475	-	1.0330	-
10月末日	478	-	1.0524	-
11月末日	471	-	1.0596	-
12月末日	465	-	1.0744	-
平成30年1月末日	461	-	1.0731	-
2月末日	446	-	1.0422	-
3月末日	436	-	1.0236	-
4月末日	446	-	1.0476	-
5月末日	441	-	1.0430	-

【分配の推移】

	1口当たりの分配金(円)
第4特定期間	0.0075
第5特定期間	0.0075
第6特定期間	0.0075
第7特定期間	0.0075
第8特定期間	0.0065
第9特定期間	0.0045
第10特定期間	0.0045
第11特定期間	0.0045
第12特定期間	0.0045
第13特定期間	0.0045
第14特定期間	0.0045
第15特定期間	0.0045
第16特定期間	0.0045
第17特定期間	0.0045
第18特定期間	0.0045
第19特定期間	0.0045
第20特定期間	0.0045
第21特定期間	0.0045
第22特定期間	0.0045
第23特定期間	0.0045

【収益率の推移】

	収益率(%)
第4特定期間	25.6
第5特定期間	4.7
第6特定期間	2.6
第7特定期間	2.8
第8特定期間	2.6
第9特定期間	2.1
第10特定期間	7.5
第11特定期間	4.9
第12特定期間	1.0
第13特定期間	33.0
第14特定期間	0.8
第15特定期間	4.2
第16特定期間	11.9
第17特定期間	8.2
第18特定期間	1.0
第19特定期間	5.5
第20特定期間	1.1
第21特定期間	10.1
第22特定期間	5.2
第23特定期間	0.4

(注) 各特定期間の収益率は、特定期間末の基準価額（分配落の額）に当該特定期間の分配金を加算し、当該特定期間の直前の特定期間末の基準価額（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。

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】

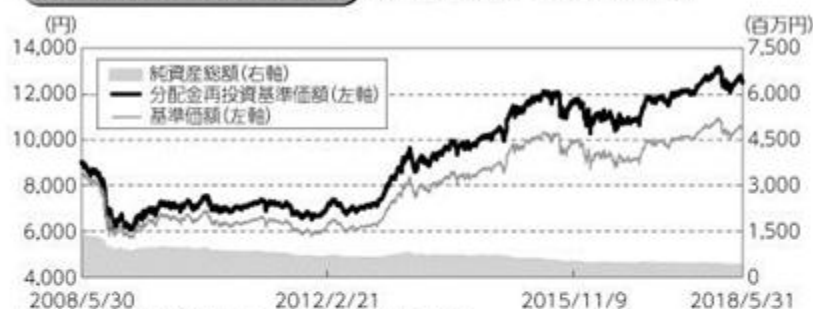
	設定口数	解約口数
第4特定期間	35,080,000	169,720,000
第5特定期間	21,260,000	61,570,000
第6特定期間	31,970,000	63,550,000
第7特定期間	16,430,000	99,520,000
第8特定期間	12,120,000	62,800,000
第9特定期間	21,210,000	98,740,000
第10特定期間	7,120,000	79,920,000
第11特定期間	10,800,000	90,460,000
第12特定期間	3,810,000	71,430,000
第13特定期間	22,800,000	69,530,000
第14特定期間	13,700,000	108,500,000
第15特定期間	52,399,738	112,932,769
第16特定期間	31,449,359	147,724,782
第17特定期間	44,688,338	158,989,550
第18特定期間	22,117,058	100,883,651
第19特定期間	21,980,050	26,586,206
第20特定期間	10,137,344	18,761,221
第21特定期間	9,179,637	45,104,386
第22特定期間	6,636,994	43,222,568
第23特定期間	4,576,025	31,482,595

(注) 本邦外における設定及び解約はございません。

<< 参考情報 >>

データの基準日：2018年5月31日

基準価額・純資産の推移 (2008年5月30日～2018年5月31日)



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。
 ※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額とは異なります。(設定日:2007年1月26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63期	(2017.09.11)	15円
第64期	(2017.11.13)	15円
第65期	(2018.01.11)	15円
第66期	(2018.03.12)	15円
第67期	(2018.05.11)	15円
直近1年間累計		90円
設定来累計		1,515円

※分配金は1万口当たりです。

主要な資産の状況

組入銘柄

※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

順位	銘柄名	比率
1	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	26.74%
2	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	25.78%
3	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	24.29%
4	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	9.42%
5	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	6.29%
6	J-REITインデックスファンド・マザーファンド	5.95%

■国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	業種	比率
1	トヨタ自動車	株式	日本	輸送用機器	3.28%
2	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	日本	銀行業	1.77%
3	日本電信電話	株式	日本	情報・通信業	1.40%
4	ソニー	株式	日本	電気機器	1.35%
5	ソフトバンクグループ	株式	日本	情報・通信業	1.35%

■外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	業種	比率
1	APPLE INC	株式	アメリカ	コンピュータ・周辺機器	2.55%
2	MICROSOFT CORP	株式	アメリカ	ソフトウェア	1.92%
3	AMAZON.COM INC	株式	アメリカ	インターネット販売・通信販売	1.77%
4	FACEBOOK INC	株式	アメリカ	インターネットソフトウェア・サービス	1.19%
5	JPMORGAN CHASE & CO	株式	アメリカ	銀行	1.00%

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

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

データの基準日：2018年5月31日

主要な資産の状況

■国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還期限	比率
1	124回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.100000	2020/6/20	1.16%
2	122回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.100000	2019/12/20	1.16%
3	118回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.200000	2019/6/20	1.07%
4	344回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.100000	2026/9/20	1.02%
5	345回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.100000	2026/12/20	1.02%

■外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還期限	比率
1	US T N/B 2.625 08/15/20	国債証券	アメリカ	2.625000	2020/8/15	0.84%
2	US T N/B 3.625 02/15/20	国債証券	アメリカ	3.625000	2020/2/15	0.80%
3	US T N/B 2.0 02/15/22	国債証券	アメリカ	2.000000	2022/2/15	0.77%
4	US T N/B 1.25 10/31/19	国債証券	アメリカ	1.250000	2019/10/31	0.75%
5	US T N/B 0.875 07/31/19	国債証券	アメリカ	0.875000	2019/7/31	0.75%

■J-REITインデックスファンド・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

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

■外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

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

年間収益率の推移(暦年ベース)



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

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

第2【管理及び運営】

1【申込(販売)手続等】

・お申込みの方法

お申込みには、販売会社所定の方法でお申込みください。

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。なお、ニューヨークの銀行、ロンドンの銀行、Frankfurtの銀行、オランダの銀行、フランスの銀行、ニューヨーク証券取引所、ロンドン証券取引所、オーストラリア証券取引所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、お申込みの受付は行いません。

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、お申込み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販売会社に、取得申込みと同時にまたは予め、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係る口数の増加の記載または記録が行われます。なお、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、追加信託により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(発行価格)

お申込日の翌営業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。)

・お申込手数料

ありません。

・お申込単位

各販売会社が定める単位とします。

お申込単位は、販売会社にお問い合わせください。

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、委託会社に各販売会社の定める単位をもって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、この信託契約の一部を解約します。解約の受付は、原則として販売会社の営業日の午後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解約を委託会社が行うのと引き換えに、当該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、解約の請求を受益者がするとき、販売会社に対し振替受益権をもって行うものとします。

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

・ 解約価額

解約価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額から、信託財産留保額として当該基準価額に0.3%の率を乗じて得た額を控除した価額とします。

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）

- ・ 解約代金は、原則として解約請求受付日より起算して6営業日目から販売会社の営業所等において支払います。

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

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

<主な投資対象の時価評価方法の原則>

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

外国で取引されているものについては、計算時に知りうる直近の日

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

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社への問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

(2)【保管】

ファンドの受益権の帰属は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されることにより定まり、受益証券を発行しませんので、受益証券の保管に関する該当事項はありません。

(3)【信託期間】

信託期間は平成19年1月26日から無期限です。

ただし、下記(5)イ.の場合には信託終了前に信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

(4)【計算期間】

a. 計算期間は原則として毎奇数月の12日から翌奇数月の11日までとします。

- b.上記a.の規定にかかわらず、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。

(5)【その他】

イ.償還規定

- a.委託会社は、信託財産の純資産総額が10億円を下回ることとなった場合には、受託会社と合意のうえ、この信託契約を解約し、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出ます。
- b.委託会社は、信託期間中においてこの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、この信託契約を解約し、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出ます。
- c.委託会社は、上記a.およびb.の事項について、あらかじめ解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
- d.委託会社は上記c.の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- e.上記d.に定める一定期間内に異議を述べた受益者の受益権口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは信託契約の解約をしません。
- f.委託会社は、上記e.の規定により、信託契約を解約しないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの内容を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
- g.上記d.からf.の規定は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d.の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行うことが困難な場合には適用しません。
- h.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。
- i.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、この信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が、この信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、下記「ロ.信託約款の変更d.」に該当する場合を除き、その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。
- j.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背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を請求することができます。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」の規定に従い、新受託会社を選任します。委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。

k. 上記d.に規定する一定の期間内に、委託会社に対し異議を述べた受益者は、受託会社に対し自己に帰属する受益権を信託財産をもって買い取るべき旨を請求することができます。当該買取請求権の内容および手続きは、公告または書面に付記します。

ロ. 信託約款の変更

- 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、この信託約款を変更することができるものとし、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届出ます。
- b. 委託会社は、上記a.の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託約款にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託約款にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- c. 委託会社は上記b.の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に異議を述べる旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- d. 上記c.に定める一定期間内に異議を述べた受益者の受益権口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは信託約款の変更をしません。
- e. 委託会社は信託約款の変更しないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの内容を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
- f. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、上記a.～e.の規定に従います。
- g. 上記c.に規定する一定の期間内に、委託会社に対し異議を述べた受益者は、受託会社に対し自己に帰属する受益権を信託財産をもって買い取るべき旨を請求することができます。当該買取請求権の内容および手続きは、公告または書面に付記します。

ハ. 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。

当ファンドの投資顧問契約について、委託会社とイボットソン・アソシエイツ・ジャパン株式会社(投資顧問会社)との間の当該契約は、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。

ニ. 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5月11日、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】

収益分配金請求権

受益者は、委託会社の決定した収益分配金を、持ち分に応じて請求する権利を有します。受益者が収益分配金支払開始日から5年間支払いを請求しないときは、その権利を失い、委託会社が受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。

収益分配金は、決算日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者(当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため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。

償還金請求権

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

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

一部解約請求権

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

帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドの計算期間は6ヵ月未満であるため、財務諸表は6ヵ月ごとに作成しております。
- (3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当特定期間(平成29年11月14日から平成30年5月11日まで)の財務諸表について、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】

【マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>】

(1)【貸借対照表】

(単位:円)

	前 期 平成29年11月13日現在	当 期 平成30年5月11日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	8,842,408	4,952,108
親投資信託受益証券	473,528,649	447,488,569
流動資産合計	482,371,057	452,440,677
資産合計	482,371,057	452,440,677
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	677,780	637,420
未払解約金	3,247,936	2,112,108
未払受託者報酬	62,471	54,768
未払委託者報酬	785,519	688,628
その他未払費用	3,980	3,093
流動負債合計	4,777,686	3,496,017
負債合計	4,777,686	3,496,017
純資産の部		
元本等		
元本	1,451,853,385	1,424,946,815
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	25,739,986	23,997,845
(分配準備積立金)	48,801,672	57,279,208
元本等合計	477,593,371	448,944,660
純資産合計	477,593,371	448,944,660
負債純資産合計	482,371,057	452,440,677

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	前 期 自 平成29年5月12日 至 平成29年11月13日	当 期 自 平成29年11月14日 至 平成30年5月11日
営業収益		
受取利息	2	-
有価証券売買等損益	26,664,168	4,010,920
その他収益	431	1,949
営業収益合計	26,664,601	4,012,869
営業費用		
支払利息	1,974	2,169
受託者報酬	184,652	168,482
委託者報酬	2,321,911	2,118,612
その他費用	11,776	9,543
営業費用合計	2,520,313	2,298,806
営業利益又は営業損失()	24,144,288	1,714,063
経常利益又は経常損失()	24,144,288	1,714,063
当期純利益又は当期純損失()	24,144,288	1,714,063
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()	459,299	113,958
期首剰余金又は期首欠損金()	4,418,506	25,739,986
剰余金増加額又は欠損金減少額	108,293	228,459
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	108,293	228,459
剰余金減少額又は欠損金増加額	379,008	1,871,080
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	379,008	1,871,080
分配金	1 2,092,794	1 1,927,541
期末剰余金又は期末欠損金()	25,739,986	23,997,845

(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. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	特定期間末日の取扱い 当ファンドは、原則として毎年5月11日及び11月11日を特定期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、前特定期間末日を平成29年11月13日としております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	前 期 平成29年11月13日現在	当 期 平成30年5月11日現在
1. 1 期首元本額 期中追加設定元本額 期中一部解約元本額	488,438,959円 6,636,994円 43,222,568円	451,853,385円 4,576,025円 31,482,595円
2. 受益権の総数	451,853,385口	424,946,815口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	前 期 自 平成29年5月12日 至 平成29年11月13日	当 期 自 平成29年11月14日 至 平成30年5月11日
1. 1 分配金の計算過程	(自平成29年5月12日 至平成29年7月11日) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(1,260,569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(6,561,517円)及び分配準備積立金(31,978,801円)より分配対象収益は39,800,887円(1万口当たり838.02円)であり、うち712,409円(1万口当たり15円)を分配金額としております。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。(以下、各期間において同じ。)	(自平成29年11月14日 至平成30年1月11日) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(1,191,380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(10,458,239円)、信託約款に規定される収益調整金(6,412,938円)及び分配準備積立金(46,574,750円)より分配対象収益は64,637,307円(1万口当たり1,495.56円)であり、うち648,290円(1万口当たり15円)を分配金額としております。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。(以下、各期間において同じ。)

<p>(自平成29年7月12日 至平成29年9月11日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(369,809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(6,697,903円)及び分配準備積立金(31,855,415円)より分配対象収益は38,923,127円(1万口当たり830.97円)であり、うち702,605円(1万口当たり15円)を分配金額としております。</p> <p>(自平成29年9月12日 至平成29年11月13日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(1,936,509円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(17,267,143円)、信託約款に規定される収益調整金(6,595,571円)及び分配準備積立金(30,275,800円)より分配対象収益は56,075,023円(1万口当たり1,241円)であり、うち677,780円(1万口当たり15円)を分配金額としております。</p>	<p>(自平成30年1月12日 至平成30年3月12日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(329,450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(6,633,735円)及び分配準備積立金(56,719,442円)より分配対象収益は63,682,627円(1万口当たり1,488.30円)であり、うち641,831円(1万口当たり15円)を分配金額としております。</p> <p>(自平成30年3月13日 至平成30年5月11日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(2,089,516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(6,781,976円)及び分配準備積立金(55,827,112円)より分配対象収益は64,698,604円(1万口当たり1,522.51円)であり、うち637,420円(1万口当たり15円)を分配金額としております。</p>
--	---

（金融商品に関する注記）

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	前 期 自 平成29年5月12日 至 平成29年11月13日	当 期 自 平成29年11月14日 至 平成30年5月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、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。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	前 期 平成29年11月13日現在	当 期 平成30年5月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 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)

売買目的有価証券

種類	前期 平成29年11月13日現在	当期 平成30年5月11日現在
	最終計算期間の 損益に含まれた 評価差額(円)	最終計算期間の 損益に含まれた 評価差額(円)
親投資信託受益証券	24,709,183	10,203,144
合計	24,709,183	10,203,144

(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)

	前期 平成29年11月13日現在	当期 平成30年5月11日現在
1口当たり純資産額	1.0570円	1.0565円
(1万口当たり純資産額)	(10,570円)	(10,565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5月11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	43,373,703	118,783,223	
	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	92,933,808	119,893,905	
	J-REITインデックスファンド・マザーファンド	14,719,897	26,741,636	
	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	31,943,791	110,630,931	
	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	23,962,825	43,116,311	
	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	24,205,250	28,322,563	
親投資信託受益証券 合計		231,139,274	447,488,569	
合計		231,139,274	447,488,569	

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

該当事項はありません。

(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、「外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券及び「外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、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29年11月13日現在	平成30年5月11日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		7,322,441,531	3,558,479,567
株式	2	304,521,276,700	301,312,473,020
派生商品評価勘定		228,559,908	189,609,700
未収入金		10,225,368	1,064,352
未収配当金		2,388,236,942	2,735,872,149
流動資産合計		314,470,740,449	307,797,498,788
資産合計		314,470,740,449	307,797,498,788
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		6,829,256	-
前受金		301,911,400	138,615,000
未払解約金		980,956,000	438,619,000
流動負債合計		1,289,696,656	577,234,000
負債合計		1,289,696,656	577,234,000
純資産の部			
元本等			
元本	1	116,418,560,169	112,182,048,425
剰余金			
剰余金又は欠損金()		196,762,483,624	195,038,216,363
元本等合計		313,181,043,793	307,220,264,788
純資産合計		313,181,043,793	307,220,264,788
負債純資産合計		314,470,740,449	307,797,498,788

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29年11月13日現在	平成30年5月11日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	126,632,533,134円	116,418,560,169円
同期中追加設定元本額	8,915,561,612円	13,486,063,682円
同期中一部解約元本額	19,129,534,577円	17,722,575,426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	7,562,337,336円	9,657,902,450円
DIAM国内株式バッシブ・ファンド	2,169,887,056円	1,965,437,104円
MITO ラップ型ファンド(安定型)	5,092,097円	3,825,859円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	11,630,217円	8,909,366円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	21,811,098円	15,123,068円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	14,736,753円	23,066,842円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	13,283,716円	18,934,862円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	15,082,354円	15,039,866円
たわらノーロード TOPIX	90,335,684円	187,878,652円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	6,947,736円	23,722,900円
たわらノーロード バランス(堅実型)	14,625円	556,113円
たわらノーロード バランス(標準型)	25,594円	3,468,740円
たわらノーロード バランス(積極型)	47,531円	10,271,455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)	- 円	58,648円
たわらノーロード スマートグローバル バランス(安定型)	- 円	2,302,843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)	- 円	4,748,704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)	- 円	3,145,468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)	- 円	8,434,606円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	- 円	41,292円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	- 円	59,943円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	- 円	405,305円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	- 円	438,090円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	- 円	1,295,960円
DIAM国内株式インデックスファンド <DC年金>	35,717,139,716円	37,330,513,771円
DIAMバランス・ファンド<DC年金 >1安定型	773,625,664円	783,614,103円

DIAMバランス・ファンド<DC年金 >2安定・成長型	2,716,001,987円	2,743,165,976円
DIAMバランス・ファンド<DC年金 >3成長型	2,817,001,095円	2,861,320,138円
DIAM DC バランス30インデッ クスファンド	342,573,374円	332,719,355円
DIAM DC バランス50インデッ クスファンド	1,164,898,792円	1,126,397,139円
DIAM DC バランス70インデッ クスファンド	1,068,564,833円	1,058,878,824円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配 型>	49,943,152円	43,373,703円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	1,178,288,624円	1,084,829,283円
マネックス資産設計ファンド エボ リューション	25,856,596円	25,558,900円
DIAM DC 8資産バランスファン ド(新興国10)	37,266,677円	41,290,133円
DIAM DC 8資産バランスファン ド(新興国20)	90,850,948円	107,171,507円
DIAM DC 8資産バランスファン ド(新興国30)	174,325,383円	209,525,959円
投資のソムリエ	3,809,619,334円	2,487,274,484円
クルーズコントロール	1,927,900,853円	1,390,704,355円
投資のソムリエ<DC年金>	224,820,369円	180,556,941円
DIAM 8資産バランスファンドN< DC年金>	144,401,188円	166,392,070円
DIAM DC バランス・F(成長 型)	170,990,054円	220,096,858円
クルーズコントロール<DC年金>	700,299円	547,151円
DIAMコア資産設計ファンド(堅実 型)	10,546,670円	7,534,669円
DIAMコア資産設計ファンド(積極 型)	27,115,492円	23,605,451円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制 型	67,206,239円	34,252,346円
ダイナミック・ナビゲーション	2,226,304円	1,941,778円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	838,945,826円	612,669,204円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2 045)	500,001円	718,845円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2 055)	500,001円	533,560円
リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC)	238,390円	164,969円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2 035)	- 円	1,380,023円
4資産分散投資・スタンダード<DC年 金>	- 円	4,810,802円
DIAMワールドバランス25VA(適 格機関投資家限定)	73,460,550円	70,249,658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)	147,437,468円	126,818,456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)	319,239,176円	289,627,075円

D I A M国際分散バランスファンド30 V A (適格機関投資家限定)	18,869,107円	15,997,852円
D I A M国際分散バランスファンド50 V A (適格機関投資家限定)	85,498,607円	70,553,486円
D I A M国内重視バランスファンド30 V A (適格機関投資家限定)	20,709,475円	17,154,020円
D I A M国内重視バランスファンド50 V A (適格機関投資家限定)	26,304,845円	19,390,655円
D I A M世界バランスファンド40 V A (適格機関投資家限定)	37,383,172円	30,249,893円
D I A M世界バランスファンド50 V A (適格機関投資家限定)	62,882,774円	55,224,133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)	1,158,558,243円	1,046,361,232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)	1,097,843,912円	991,925,273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)	2,968,635,955円	2,729,403,081円
D I A Mグローバル・アセット・ balan ス V A (適格機関投資家限定)	217,874,870円	195,748,564円
D I A Mグローバル・アセット・ balan ス V A 2 (適格機関投資家限定)	126,931,790円	76,069,383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)	645,324,529円	572,608,185円
D I A M世界アセットバランスファンド V A (適格機関投資家向け)	2,466,795,275円	1,105,386,217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	10,313,671円
D I A M世界バランスファンド55 V A (適格機関投資家限定)	121,625,180円	14,110,884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)	1,835,604,897円	469,455,076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)	15,938,626,540円	14,963,847,137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)	569,142,649円	537,621,021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)	1,817,614,358円	1,704,844,971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)	10,356,243,292円	9,813,096,875円
D I A Mバランス30 V A (適格機関投 資家限定)	3,286,219円	4,723,516円
D I A Mバランス50 V A (適格機関投 資家限定)	4,973,840円	386,824円
D I A Mバランス70 V A (適格機関投 資家限定)	3,915,190円	3,682,782円
D I A M世界アセットバランスファンド 4 V A (適格機関投資家限定)	9,217,413,156円	8,737,439,675円
D I A M世界バランス25 V A (適格機 関投資家限定)	74,635,944円	70,184,843円
D I A M国内バランス30 V A (適格機 関投資家限定)	28,851,997円	27,636,505円

	D I A Mバランス20VA(適格機関投資家限定)	27,642,890円	25,211,890円
	D I A Mバランス40VA(適格機関投資家限定)	66,908円	97,482円
	D I A Mバランス60VA(適格機関投資家限定)	111,051円	110,015円
	D I A M世界アセットバランスファンド7VA(1212)(適格機関投資家限定)	477,777,807円	426,902,115円
	D I A M世界アセットバランスファンド7VA(1303)(適格機関投資家限定)	1,323,021,834円	1,311,785,878円
	D I A M世界アセットバランスファンド7VA(1306)(適格機関投資家限定)	1,764,382,103円	1,737,262,933円
	D I A M世界アセットバランスファンド7VA(1309)(適格機関投資家限定)	76,281,237円	73,956,736円
	計	116,418,560,169円	112,182,048,425円
2.	受益権の総数	116,418,560,169口	112,182,048,425口
3.	2 差入代用有価証券	株式 3,566,000,000円	株式 3,771,500,000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29年5月12日 至 平成29年11月13日	自 平成29年11月14日 至 平成30年5月11日
1． 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2． 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、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。	同左
3． 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成29年11月13日現在	平成30年5月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成29年11月13日現在	平成30年5月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
株式	44,943,921,358	7,683,990,238
合計	44,943,921,358	7,683,990,238

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成29年2月8日から平成29年11月13日まで及び平成30年2月8日から平成30年5月11日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

株式関連

種類	平成29年11月13日 現在				平成30年5月11日 現在			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引								
先物取引								
買 建	8,252,019,800	-	8,473,905,000	221,885,200	5,642,410,000	-	5,832,125,000	189,715,000
合計	8,252,019,800	-	8,473,905,000	221,885,200	5,642,410,000	-	5,832,125,000	189,715,000

（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29年11月13日現在	平成30年5月11日現在
1口当たり純資産額	2.6901円	2.7386円
（1万口当たり純資産額）	（26,901円）	（27,386円）

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

平成30年5月11日現在

銘柄	株式数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
極洋	5,200	3,805.00	19,786,000	
日本水産	148,100	606.00	89,748,600	
マルハニチロ	25,000	4,100.00	102,500,000	
ハウスイ	900	1,194.00	1,074,600	
カネコ種苗	4,400	1,664.00	7,321,600	
サカタのタネ	19,400	4,025.00	78,085,000	
ホクト	13,400	1,941.00	26,009,400	
ホクリヨウ	1,900	1,220.00	2,318,000	
ヒノキヤグループ	3,300	3,185.00	10,510,500	
ショーボンドホールディングス	12,400	8,160.00	101,184,000	
ミライト・ホールディングス	40,500	1,800.00	72,900,000	
タマホーム	9,900	1,270.00	12,573,000	
サンヨーホームズ	2,300	1,187.00	2,730,100	
ファーストコーポレーション	4,400	1,286.00	5,658,400	
ベステラ	1,800	1,631.00	2,935,800	
TATERU	11,500	1,928.00	22,172,000	
住石ホールディングス	33,700	171.00	5,762,700	
日鉄鉱業	3,700	6,370.00	23,569,000	
三井松島産業	6,700	1,629.00	10,914,300	
国際石油開発帝石	639,800	1,384.00	885,483,200	
日本海洋掘削	4,600	1,904.00	8,758,400	
石油資源開発	20,800	2,854.00	59,363,200	
K&Oエナジーグループ	7,800	1,863.00	14,531,400	
ダイセキ環境ソリューション	3,100	1,090.00	3,379,000	
第一カッター興業	1,300	2,440.00	3,172,000	
安藤・間	102,300	855.00	87,466,500	
東急建設	50,600	1,163.00	58,847,800	
コムシスホールディングス	46,300	3,115.00	144,224,500	
ミサワホーム	11,000	975.00	10,725,000	
ビーアールホールディングス	13,100	406.00	5,318,600	
高松コンストラクショングループ	8,500	3,015.00	25,627,500	
東建コーポレーション	4,900	10,850.00	53,165,000	
ソネック	1,600	849.00	1,358,400	
ヤマウラ	6,200	898.00	5,567,600	
大成建設	131,000	6,060.00	793,860,000	
大林組	394,600	1,254.00	494,828,400	
清水建設	402,500	1,106.00	445,165,000	
飛鳥建設	119,800	185.00	22,163,000	
長谷工コーポレーション	153,500	1,715.00	263,252,500	
松井建設	14,600	891.00	13,008,600	
銭高組	1,800	5,630.00	10,134,000	
鹿島建設	578,000	1,052.00	608,056,000	
不動テトラ	99,600	183.00	18,226,800	

大末建設	4,300	1,028.00	4,420,400
鉄建建設	8,000	3,310.00	26,480,000
西松建設	30,400	3,125.00	95,000,000
三井住友建設	94,900	645.00	61,210,500
大豊建設	48,000	653.00	31,344,000
前田建設工業	93,800	1,297.00	121,658,600
佐田建設	8,700	473.00	4,115,100
ナカノフドー建設	10,100	648.00	6,544,800
奥村組	21,600	4,530.00	97,848,000
東鉄工業	15,800	3,645.00	57,591,000
イチケン	2,400	2,501.00	6,002,400
浅沼組	47,000	444.00	20,868,000
戸田建設	153,000	942.00	144,126,000
熊谷組	20,600	3,670.00	75,602,000
青木あすなろ建設	8,700	1,022.00	8,891,400
北野建設	27,000	404.00	10,908,000
植木組	1,600	2,691.00	4,305,600
三井ホーム	16,000	744.00	11,904,000
矢作建設工業	18,000	911.00	16,398,000
ピーエス三菱	15,600	701.00	10,935,600
日本ハウスホールディングス	25,100	587.00	14,733,700
大東建託	46,900	18,685.00	876,326,500
新日本建設	15,700	1,342.00	21,069,400
N I P P O	30,500	2,515.00	76,707,500
東亜道路工業	2,700	3,885.00	10,489,500
前田道路	41,200	2,378.00	97,973,600
日本道路	3,600	5,370.00	19,332,000
東亜建設工業	10,700	2,905.00	31,083,500
若築建設	7,100	1,732.00	12,297,200
東洋建設	41,300	530.00	21,889,000
五洋建設	156,400	824.00	128,873,600
世紀東急工業	17,700	735.00	13,009,500
福田組	4,300	6,560.00	28,208,000
日本ドライケミカル	1,500	2,497.00	3,745,500
住友林業	84,100	1,842.00	154,912,200
日本基礎技術	14,700	403.00	5,924,100
日成ビルド工業	19,500	1,341.00	26,149,500
ヤマダ・エスバイエルホーム	60,000	71.00	4,260,000
巴コーポレーション	16,400	589.00	9,659,600
大和ハウス工業	388,700	4,164.00	1,618,546,800
ライト工業	25,300	1,129.00	28,563,700
積水ハウス	428,100	2,005.00	858,340,500
日特建設	11,300	634.00	7,164,200
北陸電気工事	7,300	1,292.00	9,431,600
ユアテック	20,800	997.00	20,737,600
西部電気工業	2,100	3,730.00	7,833,000
四電工	1,900	2,866.00	5,445,400
中電工	17,000	3,025.00	51,425,000
関電工	52,400	1,272.00	66,652,800
きんでん	87,500	1,874.00	163,975,000

東京エネシス	15,000	1,284.00	19,260,000
トーエネック	3,600	3,245.00	11,682,000
住友電設	10,400	1,991.00	20,706,400
日本電設工業	20,200	2,498.00	50,459,600
協和エクシオ	47,200	2,919.00	137,776,800
新日本空調	10,200	1,638.00	16,707,600
日本工営	7,500	3,305.00	24,787,500
N D S	2,000	6,290.00	12,580,000
九電工	25,900	5,230.00	135,457,000
三機工業	27,900	1,207.00	33,675,300
日揮	113,300	2,638.00	298,885,400
中外炉工業	4,000	2,998.00	11,992,000
ヤマト	10,800	725.00	7,830,000
太平電業	8,900	2,868.00	25,525,200
高砂熱学工業	36,200	2,028.00	73,413,600
三晃金属工業	1,500	3,620.00	5,430,000
N E C ネットズエスアイ	12,700	2,758.00	35,026,600
朝日工業社	2,600	3,495.00	9,087,000
明星工業	23,900	849.00	20,291,100
大気社	16,600	3,895.00	64,657,000
ダイダン	8,800	2,587.00	22,765,600
日比谷総合設備	14,700	2,236.00	32,869,200
東芝プラントシステム	28,500	2,225.00	63,412,500
日本製粉	39,200	1,840.00	72,128,000
日清製粉グループ本社	144,300	2,447.00	353,102,100
日東富士製粉	800	5,490.00	4,392,000
昭和産業	10,900	2,939.00	32,035,100
鳥越製粉	10,600	968.00	10,260,800
中部飼料	14,400	2,138.00	30,787,200
フィード・ワン	79,300	244.00	19,349,200
東洋精糖	2,000	1,216.00	2,432,000
日本甜菜製糖	6,700	2,393.00	16,033,100
三井製糖	9,300	4,280.00	39,804,000
塩水港精糖	14,500	264.00	3,828,000
日新製糖	5,600	2,118.00	11,860,800
L I F U L L	39,000	801.00	31,239,000
ジェイエイシーリクルートメント	9,000	2,096.00	18,864,000
日本M&Aセンター	77,600	3,380.00	262,288,000
メンバーズ	2,800	1,082.00	3,029,600
中広	1,200	754.00	904,800
タケエイ	11,600	1,353.00	15,694,800
トラスト・テック	5,100	3,640.00	18,564,000
コシダカホールディングス	7,500	6,810.00	51,075,000
パソナグループ	10,600	1,781.00	18,878,600
C D S	3,000	1,507.00	4,521,000
リンクアンドモチベーション	20,600	1,176.00	24,225,600
G C A	12,800	1,033.00	13,222,400
エス・エム・エス	22,200	3,815.00	84,693,000
パーソルホールディングス	103,500	2,639.00	273,136,500
リニカル	7,200	1,795.00	12,924,000

クックパッド	35,200	556.00	19,571,200
エスクリ	4,000	923.00	3,692,000
アイ・ケイ・ケイ	6,600	800.00	5,280,000
森永製菓	27,700	5,340.00	147,918,000
中村屋	2,900	4,830.00	14,007,000
江崎グリコ	32,900	5,850.00	192,465,000
名糖産業	5,800	1,741.00	10,097,800
井村屋グループ	4,700	3,650.00	17,155,000
不二家	7,500	2,723.00	20,422,500
山崎製パン	96,400	2,323.00	223,937,200
第一屋製パン	2,000	1,190.00	2,380,000
モロゾフ	1,900	6,660.00	12,654,000
亀田製菓	7,300	5,680.00	41,464,000
寿スピリッツ	11,300	5,090.00	57,517,000
カルビー	53,700	3,810.00	204,597,000
森永乳業	23,600	4,580.00	108,088,000
六甲バター	7,800	2,515.00	19,617,000
ヤクルト本社	68,600	7,860.00	539,196,000
明治ホールディングス	77,900	8,650.00	673,835,000
雪印メグミルク	28,400	3,025.00	85,910,000
プリマハム	83,000	678.00	56,274,000
日本ハム	51,000	4,470.00	227,970,000
林兼産業	4,100	840.00	3,444,000
丸大食品	63,000	536.00	33,768,000
S Foods	8,200	4,465.00	36,613,000
伊藤ハム米久ホールディングス	75,900	1,035.00	78,556,500
学情	5,100	1,379.00	7,032,900
スタジオアリス	5,600	2,446.00	13,697,600
シミックホールディングス	6,200	2,336.00	14,483,200
システナ	9,200	5,050.00	46,460,000
NJS	2,700	1,780.00	4,806,000
デジタルアーツ	5,700	5,450.00	31,065,000
新日鉄住金ソリューションズ	17,300	3,050.00	52,765,000
総合警備保障	44,600	5,490.00	244,854,000
キューブシステム	6,700	844.00	5,654,800
いちご	165,500	486.00	80,433,000
エイジア	1,700	1,573.00	2,674,100
日本駐車場開発	139,800	183.00	25,583,400
コア	4,900	1,502.00	7,359,800
カカクコム	84,500	2,196.00	185,562,000
アイロムグループ	3,800	2,644.00	10,047,200
セントケア・ホールディング	4,800	789.00	3,787,200
サイネックス	1,600	862.00	1,379,200
ルネサンス	5,500	2,017.00	11,093,500
ディップ	15,800	2,644.00	41,775,200
SBSホールディングス	11,600	1,411.00	16,367,600
オプトホールディング	7,800	1,745.00	13,611,000
新日本科学	13,700	541.00	7,411,700
ツクイ	26,400	856.00	22,598,400
キャリアデザインセンター	2,600	2,168.00	5,636,800

エムスリー	118,100	4,395.00	519,049,500
ツカダ・グローバルホールディング	9,000	647.00	5,823,000
プラス	600	906.00	543,600
アウトソーシング	33,500	2,103.00	70,450,500
ウェルネット	11,300	1,235.00	13,955,500
ワールドホールディングス	3,700	3,765.00	13,930,500
ディー・エヌ・エー	60,500	2,104.00	127,292,000
博報堂DYホールディングス	155,900	1,554.00	242,268,600
ぐるなび	17,700	961.00	17,009,700
エスアールジータカミヤ	13,300	660.00	8,778,000
ジャパンベストレスキューシステム	8,800	848.00	7,462,400
ファンコミュニケーションズ	31,200	721.00	22,495,200
ライク	4,400	2,067.00	9,094,800
ビジネス・ブレークスルー	5,200	482.00	2,506,400
WDBホールディングス	5,100	3,635.00	18,538,500
ティア	5,900	1,068.00	6,301,200
CDG	1,000	1,967.00	1,967,000
パリュコマース	10,100	1,632.00	16,483,200
インフォマート	56,700	1,071.00	60,725,700
サッポロホールディングス	43,100	2,920.00	125,852,000
アサヒグループホールディングス	246,900	6,044.00	1,492,263,600
麒麟ホールディングス	566,500	3,060.00	1,733,490,000
宝ホールディングス	88,300	1,295.00	114,348,500
オエノンホールディングス	33,500	487.00	16,314,500
養命酒製造	3,500	2,485.00	8,697,500
コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールディングス	82,700	4,430.00	366,361,000
サントリー食品インターナショナル	90,100	5,060.00	455,906,000
ダイドーグループホールディングス	6,000	6,390.00	38,340,000
伊藤園	39,000	4,410.00	171,990,000
キーコーヒー	11,600	2,149.00	24,928,400
ユニカフェ	3,500	1,119.00	3,916,500
ジャパンフーズ	1,800	1,473.00	2,651,400
日清オイリオグループ	13,900	3,310.00	46,009,000
不二製油グループ本社	31,900	3,705.00	118,189,500
かどや製油	1,200	6,290.00	7,548,000
J・オイルミルズ	6,100	3,780.00	23,058,000
ローソン	29,300	7,080.00	207,444,000
サンエー	8,800	5,670.00	49,896,000
カワチ薬品	9,000	2,673.00	24,057,000
エービーシー・マート	21,100	7,280.00	153,608,000
ハードオフコーポレーション	5,100	1,086.00	5,538,600
高千穂交易	4,500	1,316.00	5,922,000
アスクル	10,100	3,405.00	34,390,500
ゲオホールディングス	21,200	1,681.00	35,637,200
アダストリア	17,800	1,682.00	29,939,600
ジーフット	7,100	800.00	5,680,000
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	1,500	782.00	1,173,000
伊藤忠食品	2,900	6,200.00	17,980,000
くらコーポレーション	6,800	7,840.00	53,312,000

キャンドウ	5,500	1,839.00	10,114,500
エレマテック	5,400	2,581.00	13,937,400
パルグループホールディングス	5,900	2,947.00	17,387,300
JALUX	3,300	2,938.00	9,695,400
エディオン	44,900	1,125.00	50,512,500
あらた	5,700	7,570.00	43,149,000
サーラコーポレーション	19,900	707.00	14,069,300
ワッツ	4,600	1,182.00	5,437,200
トーメンデバイス	1,700	2,952.00	5,018,400
ハローズ	4,200	2,749.00	11,545,800
J Pホールディングス	35,200	347.00	12,214,400
あみやき亭	2,500	5,420.00	13,550,000
東京エレクトロン デバイス	4,200	2,107.00	8,849,400
ひらまつ	16,000	502.00	8,032,000
フィールズ	8,900	1,080.00	9,612,000
双日	684,300	420.00	287,406,000
アルフレッサ ホールディングス	128,500	2,485.00	319,322,500
大黒天物産	2,700	5,930.00	16,011,000
ハニーズホールディングス	11,200	1,051.00	11,771,200
ファーマライズホールディングス	2,600	721.00	1,874,600
キッコーマン	92,100	5,010.00	461,421,000
味の素	271,100	2,011.00	545,182,100
キューピー	65,600	2,648.00	173,708,800
ハウス食品グループ本社	45,000	3,870.00	174,150,000
カゴメ	47,200	3,800.00	179,360,000
焼津水産化学工業	5,800	1,247.00	7,232,600
アリアケジャパン	10,800	9,530.00	102,924,000
ピエトロ	1,500	1,648.00	2,472,000
エバラ食品工業	2,500	2,149.00	5,372,500
ニチレイ	56,100	2,969.00	166,560,900
横浜冷凍	28,900	1,095.00	31,645,500
東洋水産	64,700	4,020.00	260,094,000
イトアンド	3,200	2,087.00	6,678,400
大冷	1,300	1,996.00	2,594,800
ヨシムラ・フード・ホールディングス	1,800	966.00	1,738,800
日清食品ホールディングス	51,400	8,020.00	412,228,000
永谷園ホールディングス	12,000	1,535.00	18,420,000
一正蒲鉾	4,400	1,378.00	6,063,200
フジッコ	12,800	2,541.00	32,524,800
ロック・フィールド	12,700	2,029.00	25,768,300
日本たばこ産業	729,200	3,006.00	2,191,975,200
ケンコーマヨネーズ	7,800	3,735.00	29,133,000
わらべや日洋ホールディングス	7,700	2,767.00	21,305,900
なとり	6,600	2,014.00	13,292,400
イフジ産業	2,000	801.00	1,602,000
ピックルスコーポレーション	1,800	2,143.00	3,857,400
北の達人コーポレーション	33,900	762.00	25,831,800
ユーグレナ	45,500	981.00	44,635,500
片倉工業	14,100	1,400.00	19,740,000
グンゼ	9,200	6,890.00	63,388,000

ヒューリック	241,800	1,200.00	290,160,000
神栄	1,500	1,446.00	2,169,000
ラサ商事	5,000	986.00	4,930,000
アルペン	8,900	2,337.00	20,799,300
ハブ	2,200	1,137.00	2,501,400
ラクーン	6,800	670.00	4,556,000
クオール	12,800	2,110.00	27,008,000
アルコニックス	12,300	2,083.00	25,620,900
神戸物産	7,500	5,220.00	39,150,000
ソリトンシステムズ	3,800	1,546.00	5,874,800
ジンズ	7,900	5,850.00	46,215,000
ビックカメラ	61,500	1,774.00	109,101,000
DCMホールディングス	62,300	1,074.00	66,910,200
ペッパーフードサービス	8,300	6,280.00	52,124,000
MonotaRO	41,100	4,200.00	172,620,000
東京一番フーズ	2,400	666.00	1,598,400
DDホールディングス	2,600	2,817.00	7,324,200
あいホールディングス	18,600	2,972.00	55,279,200
ディーブイエックス	4,100	1,383.00	5,670,300
きちり	3,100	726.00	2,250,600
アークランドサービスホールディングス	9,700	2,425.00	23,522,500
J.フロントリテイリング	138,100	1,792.00	247,475,200
ドトール・日レスホールディングス	20,300	2,353.00	47,765,900
マツモトキヨシホールディングス	47,800	5,300.00	253,340,000
ブロンコビリー	6,000	4,420.00	26,520,000
スタートトゥデイ	113,600	3,810.00	432,816,000
トレジャー・ファクトリー	3,300	790.00	2,607,000
物語コーポレーション	3,300	12,640.00	41,712,000
ココカラファイン	12,100	8,530.00	103,213,000
三越伊勢丹ホールディングス	216,200	1,319.00	285,167,800
東洋紡	45,500	1,983.00	90,226,500
ユニチカ	35,800	691.00	24,737,800
富士紡ホールディングス	6,800	4,135.00	28,118,000
日清紡ホールディングス	71,700	1,495.00	107,191,500
倉敷紡績	124,000	365.00	45,260,000
ダイワボウホールディングス	9,800	5,560.00	54,488,000
シキボウ	6,200	1,348.00	8,357,600
日東紡績	17,500	2,316.00	40,530,000
トヨタ紡織	34,200	2,263.00	77,394,600
マクニカ・富士エレホールディングス	22,100	1,979.00	43,735,900
Hamee	2,900	1,603.00	4,648,700
ラクト・ジャパン	1,600	5,330.00	8,528,000
ウエルシアホールディングス	30,600	5,910.00	180,846,000
クリエイトSDホールディングス	17,100	3,310.00	56,601,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	21,800	1,094.00	23,849,200
八洲電機	9,000	955.00	8,595,000
メディアスホールディングス	6,400	1,016.00	6,502,400
UKCホールディングス	7,400	2,338.00	17,301,200

ジューテックホールディングス	2,700	1,124.00	3,034,800
丸善CHIホールディングス	13,000	356.00	4,628,000
大光	2,900	893.00	2,589,700
OCHIホールディングス	3,400	1,604.00	5,453,600
TOKAIホールディングス	61,100	1,198.00	73,197,800
ミサワ	1,800	429.00	772,200
ティーライフ	1,600	1,348.00	2,156,800
Cominix	1,700	999.00	1,698,300
エー・ピーカンパニー	2,200	793.00	1,744,600
三洋貿易	6,400	2,331.00	14,918,400
チムニー	3,600	2,867.00	10,321,200
シュッピン	7,000	1,504.00	10,528,000
ビューティガレージ	1,500	2,329.00	3,493,500
ウイン・パートナーズ	8,400	1,528.00	12,835,200
ネクステージ	12,200	1,200.00	14,640,000
ジョイフル本田	16,900	4,000.00	67,600,000
鳥貴族	4,200	2,777.00	11,663,400
キリン堂ホールディングス	4,100	3,065.00	12,566,500
ホットランド	6,700	1,362.00	9,125,400
すかいらーく	71,800	1,562.00	112,151,600
綿半ホールディングス	4,300	3,990.00	17,157,000
日本毛織	34,700	1,143.00	39,662,100
ダイトウボウ	18,800	102.00	1,917,600
トーア紡コーポレーション	5,100	576.00	2,937,600
ダイドーリミテッド	14,100	463.00	6,528,300
ヨシックス	1,900	3,460.00	6,574,000
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	38,500	1,447.00	55,709,500
三栄建築設計	4,600	1,930.00	8,878,000
スター・マイカ	5,600	2,576.00	14,425,600
野村不動産ホールディングス	77,000	2,789.00	214,753,000
三重交通グループホールディングス	23,500	545.00	12,807,500
サムティ	9,800	2,109.00	20,668,200
ディア・ライフ	11,700	591.00	6,914,700
コーセーアールイー	1,900	972.00	1,846,800
エー・ディー・ワークス	153,500	41.00	6,293,500
日本商業開発	6,500	1,811.00	11,771,500
プレサンスコーポレーション	15,900	1,782.00	28,333,800
ユニゾホールディングス	13,500	2,280.00	30,780,000
THEグローバル社	5,300	820.00	4,346,000
日本管理センター	7,600	1,609.00	12,228,400
サンセイランディック	3,400	1,338.00	4,549,200
エストラスト	1,600	1,008.00	1,612,800
フージャースホールディングス	28,100	800.00	22,480,000
オープンハウス	18,900	6,200.00	117,180,000
東急不動産ホールディングス	280,400	860.00	241,144,000
飯田グループホールディングス	96,600	2,127.00	205,468,200
イーランド	1,400	1,273.00	1,782,200
ムゲンエステート	7,100	1,195.00	8,484,500
帝国繊維	12,900	2,384.00	30,753,600

ブックオフコーポレーション	6,800	811.00	5,514,800
日本コークス工業	99,200	118.00	11,705,600
ゴルフダイジェスト・オンライン	4,700	1,303.00	6,124,100
ミタチ産業	2,700	1,153.00	3,113,100
B E E N O S	1,800	1,612.00	2,901,600
あさひ	8,600	1,311.00	11,274,600
日本調剤	4,100	3,290.00	13,489,000
コスモス薬品	5,800	25,110.00	145,638,000
シップヘルスケアホールディングス	24,100	3,750.00	90,375,000
トーエル	5,600	1,047.00	5,863,200
一六堂	2,500	419.00	1,047,500
ソフトクリエイイトホールディングス	5,500	1,720.00	9,460,000
オンリー	1,700	989.00	1,681,300
セブン&アイ・ホールディングス	484,800	4,806.00	2,329,948,800
薬王堂	5,000	3,965.00	19,825,000
クリエイイト・レストランツ・ホールディングス	31,100	1,343.00	41,767,300
明治電機工業	4,000	2,116.00	8,464,000
ツルハホールディングス	25,000	16,340.00	408,500,000
デリカフーズホールディングス	2,300	1,610.00	3,703,000
スターティアホールディングス	2,500	923.00	2,307,500
サンマルクホールディングス	8,300	3,090.00	25,647,000
フェリシモ	2,900	1,357.00	3,935,300
トリドールホールディングス	14,300	3,730.00	53,339,000
帝人	101,000	2,162.00	218,362,000
東レ	892,300	933.80	833,229,740
クラレ	207,000	1,812.00	375,084,000
旭化成	767,100	1,469.50	1,127,253,450
サカイオーベックス	3,200	2,420.00	7,744,000
T O K Y O B A S E	7,700	1,059.00	8,154,300
稲葉製作所	6,600	1,411.00	9,312,600
宮地エンジニアリンググループ	3,300	2,041.00	6,735,300
トーカロ	32,200	1,411.00	45,434,200
アルファ	4,100	1,814.00	7,437,400
S U M C O	106,900	2,855.00	305,199,500
川田テクノロジーズ	2,400	6,320.00	15,168,000
R S T e c h n o l o g i e s	1,800	7,100.00	12,780,000
ビーロット	1,800	2,118.00	3,812,400
ファーストブラザーズ	3,200	1,464.00	4,684,800
ハウズドゥ	1,900	6,020.00	11,438,000
シーアールイー	1,900	1,823.00	3,463,700
ケイアイスター不動産	4,200	2,983.00	12,528,600
住江織物	3,100	2,894.00	8,971,400
日本フェルト	6,400	521.00	3,334,400
イチカワ	8,000	372.00	2,976,000
エコナックホールディングス	21,700	125.00	2,712,500
日東製網	1,400	1,741.00	2,437,400
芦森工業	2,400	2,523.00	6,055,200
アツギ	8,200	1,214.00	9,954,800
ウイルプラスホールディングス	1,100	1,175.00	1,292,500

コメダホールディングス	21,400	2,136.00	45,710,400
サツドラホールディングス	1,900	2,326.00	4,419,400
ダイユー・リックホールディングス	5,400	1,111.00	5,999,400
パロックジャパンリミテッド	9,300	1,117.00	10,388,100
クスリのアオキホールディングス	9,200	7,730.00	71,116,000
ダイニック	4,600	1,037.00	4,770,200
共和レザー	7,200	1,022.00	7,358,400
力の源ホールディングス	2,500	1,911.00	4,777,500
スシローグローバルホールディングス	12,700	5,760.00	73,152,000
LIXILピバ	14,700	1,938.00	28,488,600
セーレン	28,300	1,942.00	54,958,600
ソトー	4,400	1,044.00	4,593,600
東海染工	1,700	1,454.00	2,471,800
小松精練	18,900	1,063.00	20,090,700
ワコールホールディングス	34,000	3,315.00	112,710,000
ホギメディカル	15,500	4,620.00	71,610,000
レナウン	33,200	163.00	5,411,600
クラウドシアホールディングス	2,900	571.00	1,655,900
T S Iホールディングス	42,400	851.00	36,082,400
マツオカコーポレーション	2,200	3,280.00	7,216,000
T I S	38,400	4,865.00	186,816,000
ネオス	3,400	407.00	1,383,800
電算システム	4,100	1,994.00	8,175,400
グリー	61,700	635.00	39,179,500
コーエーテクモホールディングス	19,600	2,230.00	43,708,000
三菱総合研究所	5,000	4,520.00	22,600,000
ボルテージ	2,300	909.00	2,090,700
電算	1,300	2,372.00	3,083,600
A G S	6,500	906.00	5,889,000
ファインデックス	9,500	820.00	7,790,000
ヒト・コミュニケーションズ	2,600	2,090.00	5,434,000
ブレインパッド	2,500	2,806.00	7,015,000
K L a b	22,300	1,838.00	40,987,400
ポルトゥウィン・ビットクルーホールディングス	8,300	2,002.00	16,616,600
イーブックイニシアティブジャパン	1,800	1,276.00	2,296,800
ネクソン	257,400	1,501.00	386,357,400
アイスタイル	29,200	1,205.00	35,186,000
エムアップ	3,800	1,430.00	5,434,000
エイチーム	7,900	2,257.00	17,830,300
テクノスジャパン	10,400	986.00	10,254,400
e n i s h	3,900	1,077.00	4,200,300
コロプラ	32,900	840.00	27,636,000
モバイルクリエイト	9,300	367.00	3,413,100
オルトプラス	5,600	876.00	4,905,600
ブロードリーフ	57,100	541.00	30,891,100
ハーツユナイテッドグループ	6,100	1,807.00	11,022,700
メディアドゥホールディングス	3,700	2,055.00	7,603,500
ブイキューブ	7,100	591.00	4,196,100
サイバーリンクス	1,800	1,198.00	2,156,400

ディー・エル・イー	7,400	445.00	3,293,000
フィックスターズ	9,800	1,530.00	14,994,000
VOYAGE GROUP	5,700	1,162.00	6,623,400
オブティム	2,000	2,616.00	5,232,000
セレス	3,500	2,090.00	7,315,000
特種東海製紙	6,800	4,365.00	29,682,000
ベリサーブ	1,500	3,265.00	4,897,500
ティーガイア	11,500	2,968.00	34,132,000
セック	1,100	2,840.00	3,124,000
日本アジアグループ	12,100	562.00	6,800,200
豆蔵ホールディングス	8,500	1,317.00	11,194,500
テクマトリックス	6,300	2,130.00	13,419,000
プロシップ	1,700	2,698.00	4,586,600
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	312,400	292.00	91,220,800
GMOペイメントゲートウェイ	9,500	11,260.00	106,970,000
ザッパラス	5,500	380.00	2,090,000
システムリサーチ	1,200	2,650.00	3,180,000
インターネットイニシアティブ	18,700	2,021.00	37,792,700
さくらインターネット	13,700	862.00	11,809,400
ヴィンクス	2,400	1,470.00	3,528,000
GMOクラウド	2,600	2,669.00	6,939,400
SRAホールディングス	6,100	3,220.00	19,642,000
MINORIソリューションズ	2,200	1,709.00	3,759,800
システムインテグレータ	1,600	1,129.00	1,806,400
朝日ネット	10,600	534.00	5,660,400
eBASE	2,300	1,443.00	3,318,900
アドソル日進	4,400	1,331.00	5,856,400
フリービット	7,700	1,190.00	9,163,000
コムチュア	5,900	3,775.00	22,272,500
サイバーコム	2,000	2,398.00	4,796,000
インフォテリア	5,700	1,360.00	7,752,000
王子ホールディングス	518,000	767.00	397,306,000
日本製紙	55,100	2,101.00	115,765,100
三菱製紙	17,600	675.00	11,880,000
北越紀州製紙	68,700	655.00	44,998,500
中越パルプ工業	4,900	1,966.00	9,633,400
巴川製紙所	18,000	287.00	5,166,000
大王製紙	49,000	1,570.00	76,930,000
阿波製紙	2,900	657.00	1,905,300
メディカル・データ・ビジョン	8,800	1,530.00	13,464,000
gumi	13,200	997.00	13,160,400
ショーケース・ティービー	2,200	1,435.00	3,157,000
モバイルファクトリー	2,100	1,407.00	2,954,700
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	3,800	1,253.00	4,761,400
PCIホールディングス	1,900	3,135.00	5,956,500
パイブドHD	1,800	1,009.00	1,816,200
アイビーシー	1,200	1,345.00	1,614,000
ネオジャパン	2,000	1,393.00	2,786,000

オープンドア	4,600	2,088.00	9,604,800
マイネット	2,300	1,260.00	2,898,000
アカツキ	3,000	4,915.00	14,745,000
Ubicomホールディングス	1,200	907.00	1,088,400
LINE	34,800	4,020.00	139,896,000
レンゴー	118,600	963.00	114,211,800
トーモク	7,100	2,190.00	15,549,000
ザ・バック	8,700	3,760.00	32,712,000
シンクロ・フード	2,900	947.00	2,746,300
オークネット	3,700	1,424.00	5,268,800
AOITYO HOLDINGS	9,400	1,573.00	14,786,200
マクロミル	14,400	2,685.00	38,664,000
ビーグリー	2,600	1,743.00	4,531,800
昭和電工	81,900	4,260.00	348,894,000
住友化学	905,000	632.00	571,960,000
住友精化	5,100	5,340.00	27,234,000
日産化学工業	71,600	5,000.00	358,000,000
ラサ工業	4,400	2,325.00	10,230,000
クレハ	10,600	7,550.00	80,030,000
多木化学	1,600	4,615.00	7,384,000
テイカ	9,400	3,180.00	29,892,000
石原産業	22,100	1,252.00	27,669,200
片倉コープアグリ	3,000	1,251.00	3,753,000
日東エフシー	7,300	749.00	5,467,700
日本曹達	85,000	631.00	53,635,000
東ソー	177,800	2,011.00	357,555,800
トクヤマ	35,700	3,910.00	139,587,000
セントラル硝子	25,100	2,527.00	63,427,700
東亜合成	72,200	1,269.00	91,621,800
大阪ソーダ	11,300	3,120.00	35,256,000
関東電化工業	29,400	1,037.00	30,487,800
デンカ	45,200	4,345.00	196,394,000
イビデン	71,900	1,685.00	121,151,500
信越化学工業	204,800	11,510.00	2,357,248,000
日本カーバイド工業	3,900	2,166.00	8,447,400
堺化学工業	8,400	3,065.00	25,746,000
エア・ウォーター	101,400	2,126.00	215,576,400
大陽日酸	94,800	1,654.00	156,799,200
日本化学工業	4,600	3,260.00	14,996,000
東邦アセチレン	1,700	1,449.00	2,463,300
日本パーライジング	62,900	1,778.00	111,836,200
高压ガス工業	18,300	999.00	18,281,700
チタン工業	1,300	2,754.00	3,580,200
四国化成工業	17,800	1,620.00	28,836,000
戸田工業	2,400	3,810.00	9,144,000
ステラ ケミファ	6,300	3,695.00	23,278,500
保土谷化学工業	4,000	4,605.00	18,420,000
日本触媒	19,300	7,660.00	147,838,000
大日精化工業	9,500	4,550.00	43,225,000
カネカ	166,000	1,080.00	179,280,000

協和発酵キリン	147,100	2,205.00	324,355,500
三菱瓦斯化学	101,400	2,885.00	292,539,000
三井化学	111,800	3,200.00	357,760,000
J S R	123,700	2,128.00	263,233,600
東京応化工業	21,400	4,130.00	88,382,000
大阪有機化学工業	10,600	1,470.00	15,582,000
三菱ケミカルホールディングス	823,800	1,019.50	839,864,100
K Hネオケム	18,800	3,200.00	60,160,000
ダイセル	165,900	1,222.00	202,729,800
住友ベークライト	99,000	997.00	98,703,000
積水化学工業	255,500	1,851.00	472,930,500
日本ゼオン	103,700	1,413.00	146,528,100
アイカ工業	34,500	4,105.00	141,622,500
宇部興産	61,900	3,315.00	205,198,500
積水樹脂	19,000	2,313.00	43,947,000
タキロンシーアイ	24,900	677.00	16,857,300
旭有機材	7,200	1,822.00	13,118,400
日立化成	60,800	2,464.00	149,811,200
ニチバン	6,100	3,415.00	20,831,500
リケンテクノス	26,600	568.00	15,108,800
大倉工業	29,000	626.00	18,154,000
積水化成品工業	15,400	1,337.00	20,589,800
群栄化学工業	2,800	3,695.00	10,346,000
タイガースポリマー	6,100	840.00	5,124,000
ミライアル	4,100	1,667.00	6,834,700
ダイキアクシス	4,100	1,524.00	6,248,400
ダイキョーニシカワ	24,300	1,810.00	43,983,000
竹本容器	1,400	3,305.00	4,627,000
森六ホールディングス	6,200	3,115.00	19,313,000
日本化薬	79,800	1,311.00	104,617,800
カーリットホールディングス	11,400	1,098.00	12,517,200
E P Sホールディングス	16,900	2,068.00	34,949,200
ソルクシーズ	4,400	1,289.00	5,671,600
レグス	2,800	993.00	2,780,400
プレステージ・インターナショナル	23,300	1,292.00	30,103,600
フェイス	3,900	1,126.00	4,391,400
ハイマックス	1,500	1,802.00	2,703,000
アミューズ	7,500	3,090.00	23,175,000
野村総合研究所	73,200	5,730.00	419,436,000
ドリームインキュベータ	3,700	2,567.00	9,497,900
サイバネットシステム	9,400	881.00	8,281,400
クイック	7,000	1,703.00	11,921,000
T A C	6,700	312.00	2,090,400
C Eホールディングス	3,200	920.00	2,944,000
ケネディクス	148,600	651.00	96,738,600
日本システム技術	1,400	1,376.00	1,926,400
電通	136,700	5,200.00	710,840,000
インテージホールディングス	13,500	1,226.00	16,551,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	5,200	1,169.00	6,078,800
東邦システムサイエンス	3,800	896.00	3,404,800

ぴあ	3,700	6,100.00	22,570,000
イオンファンタジー	3,600	6,460.00	23,256,000
ソースネクスト	16,200	842.00	13,640,400
シーティーエス	11,100	845.00	9,379,500
ネクシィーズグループ	4,400	1,698.00	7,471,200
メディカルシステムネットワーク	13,300	475.00	6,317,500
日本精化	10,200	1,208.00	12,321,600
扶桑化学工業	11,600	2,720.00	31,552,000
トリケミカル研究所	2,800	4,640.00	12,992,000
ADEKA	52,900	2,054.00	108,656,600
日油	47,500	3,340.00	158,650,000
ミヨシ油脂	4,600	1,414.00	6,504,400
新日本理化	19,400	272.00	5,276,800
ハリマ化成グループ	9,600	932.00	8,947,200
花王	288,800	7,641.00	2,206,720,800
第一工業製薬	23,000	784.00	18,032,000
石原ケミカル	2,900	2,080.00	6,032,000
日華化学	3,900	1,224.00	4,773,600
ニイタカ	1,700	1,844.00	3,134,800
三洋化成工業	7,700	5,350.00	41,195,000
武田薬品工業	432,700	4,654.00	2,013,785,800
アステラス製薬	1,206,900	1,665.00	2,009,488,500
大日本住友製薬	87,100	1,837.00	160,002,700
塩野義製薬	165,400	5,740.00	949,396,000
田辺三菱製薬	143,300	1,925.00	275,852,500
わかもと製薬	14,000	295.00	4,130,000
あすか製薬	13,400	1,643.00	22,016,200
日本新薬	30,700	8,280.00	254,196,000
バイオフェルミン製薬	1,900	2,966.00	5,635,400
中外製薬	122,400	5,880.00	719,712,000
科研製薬	21,200	6,270.00	132,924,000
エーザイ	140,600	7,437.00	1,045,642,200
理研ピタミン	4,500	4,050.00	18,225,000
ロート製薬	64,500	3,175.00	204,787,500
小野薬品工業	277,400	2,572.00	713,472,800
久光製薬	34,700	8,650.00	300,155,000
有機合成薬品工業	8,000	306.00	2,448,000
持田製薬	8,200	7,700.00	63,140,000
参天製薬	222,500	1,885.00	419,412,500
扶桑薬品工業	4,000	3,000.00	12,000,000
日本ケミファ	1,500	4,780.00	7,170,000
ツムラ	42,000	3,870.00	162,540,000
日医工	31,000	1,732.00	53,692,000
テルモ	180,000	6,210.00	1,117,800,000
みらかホールディングス	33,400	3,485.00	116,399,000
キッセイ薬品工業	20,800	3,015.00	62,712,000
生化学工業	22,800	1,799.00	41,017,200
栄研化学	19,100	2,386.00	45,572,600
日水製薬	5,000	1,417.00	7,085,000
鳥居薬品	7,400	2,864.00	21,193,600

JCRファーマ	8,300	5,690.00	47,227,000
東和薬品	5,600	6,720.00	37,632,000
富士製薬工業	4,000	4,525.00	18,100,000
沢井製薬	23,600	4,635.00	109,386,000
ゼリア新薬工業	25,200	2,348.00	59,169,600
第一三共	336,100	3,917.00	1,316,503,700
キョーリン製薬ホールディングス	32,800	2,209.00	72,455,200
大幸薬品	6,200	2,138.00	13,255,600
ダイト	6,800	3,685.00	25,058,000
大塚ホールディングス	244,100	5,256.00	1,282,989,600
大正製薬ホールディングス	26,300	10,390.00	273,257,000
ペプチドリーム	53,700	4,345.00	233,326,500
大日本塗料	14,100	1,644.00	23,180,400
日本ペイントホールディングス	94,900	4,910.00	465,959,000
関西ペイント	129,200	2,440.00	315,248,000
神東塗料	9,000	233.00	2,097,000
中国塗料	35,300	1,100.00	38,830,000
日本特殊塗料	7,800	2,159.00	16,840,200
藤倉化成	15,600	695.00	10,842,000
太陽ホールディングス	9,500	4,655.00	44,222,500
DIC	48,600	3,700.00	179,820,000
サカティンクス	25,100	1,627.00	40,837,700
東洋インキSCホールディングス	122,000	705.00	86,010,000
T&K TOKA	8,300	1,255.00	10,416,500
アルプス技研	9,800	2,315.00	22,687,000
サニックス	17,800	284.00	5,055,200
ダイオーズ	2,300	1,404.00	3,229,200
日本空調サービス	11,800	825.00	9,735,000
オリエンタルランド	132,600	11,375.00	1,508,325,000
フォーカスシステムズ	6,500	945.00	6,142,500
ダスキン	30,200	2,859.00	86,341,800
パーク24	64,200	3,065.00	196,773,000
明光ネットワークジャパン	14,200	1,240.00	17,608,000
ファルコホールディングス	5,800	1,842.00	10,683,600
クレスコ	2,600	3,785.00	9,841,000
フジ・メディア・ホールディングス	120,700	1,940.00	234,158,000
秀英予備校	2,400	495.00	1,188,000
田谷	2,000	674.00	1,348,000
ラウンドワン	34,800	1,938.00	67,442,400
リゾートトラスト	47,500	2,297.00	109,107,500
オービック	36,300	9,390.00	340,857,000
ジャストシステム	18,700	2,565.00	47,965,500
TDCソフト	5,100	1,457.00	7,430,700
ヤフー	830,900	405.00	336,514,500
ビー・エム・エル	14,400	2,585.00	37,224,000
ワタベウェディング	1,800	538.00	968,400
トレンドマイクロ	56,300	6,430.00	362,009,000
りらいあコミュニケーションズ	17,700	1,409.00	24,939,300
インフォメーション・ディベロプメン ト	3,600	1,412.00	5,083,200

リソー教育	19,000	841.00	15,979,000
日本オラクル	18,700	9,040.00	169,048,000
早稲田アカデミー	1,600	1,949.00	3,118,400
アルファシステムズ	3,700	2,469.00	9,135,300
フューチャー	15,600	1,444.00	22,526,400
CAC Holdings	8,700	1,093.00	9,509,100
ソフトバンク・テクノロジー	4,800	1,664.00	7,987,200
トーセ	3,100	1,201.00	3,723,100
ユー・エス・エス	137,000	2,302.00	315,374,000
オービックビジネスコンサルタント	5,900	7,760.00	45,784,000
伊藤忠テクノソリューションズ	52,500	2,064.00	108,360,000
アイティフォー	13,900	1,228.00	17,069,200
東京個別指導学院	4,000	1,283.00	5,132,000
東計電算	2,000	3,155.00	6,310,000
サイバーエージェント	69,100	6,040.00	417,364,000
楽天	575,400	778.20	447,776,280
エクスネット	1,800	889.00	1,600,200
クリーク・アンド・リバー社	5,800	1,178.00	6,832,400
テー・オー・ダブリュー	10,700	890.00	9,523,000
大塚商会	69,300	4,440.00	307,692,000
総合メディカル	10,100	2,455.00	24,795,500
サイボウズ	15,400	559.00	8,608,600
ソフトブレーン	8,900	526.00	4,681,400
セントラルスポーツ	4,200	3,930.00	16,506,000
パラカ	3,700	2,394.00	8,857,800
電通国際情報サービス	7,100	3,320.00	23,572,000
デジタルガレージ	20,700	3,880.00	80,316,000
イーエムシステムズ	8,000	1,038.00	8,304,000
ウェザーニューズ	3,900	3,530.00	13,767,000
C I J	9,000	757.00	6,813,000
東洋ビジネスエンジニアリング	1,100	1,889.00	2,077,900
日本エンタープライズ	11,700	228.00	2,667,600
WOWOW	5,500	3,500.00	19,250,000
スカラ	9,200	808.00	7,433,600
フルキャストホールディングス	9,800	2,475.00	24,255,000
富士フイルムホールディングス	243,900	4,242.00	1,034,623,800
コニカミノルタ	274,900	964.00	265,003,600
資生堂	218,800	7,208.00	1,577,110,400
ライオン	163,600	2,128.00	348,140,800
高砂香料工業	7,400	3,510.00	25,974,000
マンダム	22,900	3,615.00	82,783,500
ミルボン	15,700	5,150.00	80,855,000
ファンケル	28,500	4,510.00	128,535,000
コーセー	19,900	20,700.00	411,930,000
コタ	5,500	1,619.00	8,904,500
シーズ・ホールディングス	14,200	5,660.00	80,372,000
シーボン	1,400	3,225.00	4,515,000
ポーラ・オルビスホールディングス	50,100	5,030.00	252,003,000
ノエビアホールディングス	7,500	7,650.00	57,375,000
アジュバンコスメジャパン	2,700	986.00	2,662,200

エステー	8,400	2,664.00	22,377,600
アグロ カネショウ	4,800	2,715.00	13,032,000
コニシ	19,300	1,861.00	35,917,300
長谷川香料	14,000	2,401.00	33,614,000
星光PMC	6,700	1,195.00	8,006,500
小林製薬	32,900	9,700.00	319,130,000
荒川化学工業	10,600	1,927.00	20,426,200
メック	8,000	1,919.00	15,352,000
日本高純度化学	3,100	2,551.00	7,908,100
タカラバイオ	30,700	2,182.00	66,987,400
JCU	14,400	2,657.00	38,260,800
新田ゼラチン	8,100	845.00	6,844,500
OATアグリオ	1,800	3,825.00	6,885,000
デクセリアルズ	30,100	1,124.00	33,832,400
アース製薬	8,800	5,470.00	48,136,000
北興化学工業	12,100	680.00	8,228,000
大成ラミック	3,500	3,180.00	11,130,000
クミアイ化学工業	53,400	704.00	37,593,600
日本農薬	30,600	687.00	21,022,200
昭和シェル石油	109,900	1,618.00	177,818,200
富士興産	4,500	660.00	2,970,000
ニチレキ	15,000	1,253.00	18,795,000
ユシロ化学工業	6,600	1,868.00	12,328,800
ビービー・カストロール	5,000	1,700.00	8,500,000
富士石油	28,500	411.00	11,713,500
MORESCO	4,300	1,988.00	8,548,400
出光興産	98,600	4,025.00	396,865,000
JXTGホールディングス	1,874,200	705.20	1,321,685,840
コスモエネルギーホールディングス	34,000	3,790.00	128,860,000
横浜ゴム	68,000	2,575.00	175,100,000
東洋ゴム工業	69,500	1,736.00	120,652,000
ブリヂストン	388,700	4,469.00	1,737,100,300
住友ゴム工業	120,900	1,895.00	229,105,500
藤倉ゴム工業	10,300	782.00	8,054,600
オカモト	41,000	1,151.00	47,191,000
アキレス	8,900	2,237.00	19,909,300
フコク	5,200	1,005.00	5,226,000
ニッタ	12,100	4,360.00	52,756,000
クリエートメディック	3,800	1,388.00	5,274,400
住友理工	22,800	1,232.00	28,089,600
三ツ星ベルト	29,000	1,211.00	35,119,000
バンドー化学	22,500	1,337.00	30,082,500
旭硝子	118,400	4,795.00	567,728,000
日本板硝子	59,400	933.00	55,420,200
石塚硝子	1,600	2,560.00	4,096,000
有沢製作所	19,700	1,240.00	24,428,000
日本山村硝子	49,000	190.00	9,310,000
日本電気硝子	50,800	3,195.00	162,306,000
オハラ	4,600	2,541.00	11,688,600
住友大阪セメント	228,000	499.00	113,772,000

太平洋セメント	74,200	3,990.00	296,058,000
リソルホールディングス	1,200	4,400.00	5,280,000
日本ヒューム	11,800	865.00	10,207,000
日本コンクリート工業	25,300	448.00	11,334,400
三谷セキサン	6,200	2,543.00	15,766,600
アジアパイルホールディングス	15,100	651.00	9,830,100
東海カーボン	106,600	1,741.00	185,590,600
日本カーボン	6,000	5,710.00	34,260,000
東洋炭素	7,600	3,860.00	29,336,000
ノリタケカンパニーリミテド	6,900	5,020.00	34,638,000
TOTO	90,300	5,850.00	528,255,000
日本碍子	143,300	2,088.00	299,210,400
日本特殊陶業	100,700	2,987.00	300,790,900
ダントーホールディングス	9,000	140.00	1,260,000
MARUWA	4,100	9,410.00	38,581,000
品川リフラクトリーズ	3,100	3,640.00	11,284,000
黒崎播磨	2,300	5,260.00	12,098,000
ヨータイ	7,000	768.00	5,376,000
イソライト工業	6,000	889.00	5,334,000
東京窯業	14,900	473.00	7,047,700
ニッカトー	3,900	1,124.00	4,383,600
フジインコーポレーテッド	10,500	2,338.00	24,549,000
クニミネ工業	3,200	1,047.00	3,350,400
エーアンドエーマテリアル	2,600	1,301.00	3,382,600
ニチアス	64,000	1,485.00	95,040,000
新日鐵住金	519,800	2,471.00	1,284,425,800
神戸製鋼所	212,500	1,185.00	251,812,500
中山製鋼所	16,100	745.00	11,994,500
合同製鐵	6,200	2,430.00	15,066,000
ジェイ エフ イー ホールディングス	313,600	2,364.50	741,507,200
日新製鋼	32,000	1,479.00	47,328,000
東京製鐵	62,200	898.00	55,855,600
共英製鋼	13,100	2,213.00	28,990,300
大和工業	24,700	3,690.00	91,143,000
東京鐵鋼	4,800	1,764.00	8,467,200
大阪製鐵	7,700	2,353.00	18,118,100
淀川製鋼所	17,000	3,130.00	53,210,000
東洋鋼鈹	29,400	718.00	21,109,200
丸一鋼管	41,100	3,940.00	161,934,000
モリ工業	3,800	3,435.00	13,053,000
大同特殊鋼	20,600	6,000.00	123,600,000
日本高周波鋼業	4,200	834.00	3,502,800
日本冶金工業	96,000	338.00	32,448,000
山陽特殊製鋼	13,400	2,782.00	37,278,800
愛知製鋼	6,500	4,685.00	30,452,500
日立金属	125,100	1,347.00	168,509,700
日本金属	2,900	2,147.00	6,226,300
大平洋金属	7,100	3,660.00	25,986,000
新日本電工	69,500	339.00	23,560,500

栗本鐵工所	5,900	2,048.00	12,083,200
虹 技	1,700	2,122.00	3,607,400
日本鑄鉄管	12,000	170.00	2,040,000
日本製鋼所	37,900	3,565.00	135,113,500
三菱製鋼	8,600	2,551.00	21,938,600
日亜鋼業	17,200	358.00	6,157,600
日本精線	1,900	4,800.00	9,120,000
大紀アルミニウム工業所	19,100	751.00	14,344,100
日本軽金属ホールディングス	339,000	301.00	102,039,000
三井金属鉱業	31,300	5,020.00	157,126,000
東邦亜鉛	6,400	4,695.00	30,048,000
三菱マテリアル	76,700	3,200.00	245,440,000
住友金属鉱山	148,400	4,646.00	689,466,400
D O W Aホールディングス	29,400	4,130.00	121,422,000
古河機械金属	19,200	1,809.00	34,732,800
エス・サイエンス	55,000	80.00	4,400,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	12,100	2,062.00	24,950,200
東邦チタニウム	20,800	1,262.00	26,249,600
U A C J	17,600	2,709.00	47,678,400
C Kサンエツ	2,200	4,400.00	9,680,000
古河電気工業	38,600	4,805.00	185,473,000
住友電気工業	434,200	1,695.00	735,969,000
フジクラ	140,200	743.00	104,168,600
昭和電線ホールディングス	14,600	915.00	13,359,000
東京特殊電線	1,500	2,928.00	4,392,000
タツタ電線	23,000	681.00	15,663,000
カナレ電気	1,900	2,399.00	4,558,100
平河ヒューテック	5,800	1,475.00	8,555,000
リョービ	14,300	2,917.00	41,713,100
アーレスティ	14,200	1,057.00	15,009,400
アサヒホールディングス	19,900	2,018.00	40,158,200
東洋製罐グループホールディングス	79,400	1,717.00	136,329,800
ホッカンホールディングス	28,000	395.00	11,060,000
コロナ	6,500	1,272.00	8,268,000
横河ブリッジホールディングス	21,600	2,445.00	52,812,000
O S J Bホールディングス	58,100	311.00	18,069,100
駒井ハルテック	2,500	2,411.00	6,027,500
高田機工	1,100	3,290.00	3,619,000
三和ホールディングス	111,400	1,425.00	158,745,000
文化シャッター	34,200	1,084.00	37,072,800
三協立山	16,100	1,662.00	26,758,200
アルインコ	8,500	1,090.00	9,265,000
東洋シャッター	2,900	630.00	1,827,000
L I X I Lグループ	171,200	2,509.00	429,540,800
日本ファイルコン	9,000	633.00	5,697,000
ノーリツ	25,900	2,031.00	52,602,900
長府製作所	13,100	2,572.00	33,693,200
リンナイ	20,700	10,820.00	223,974,000
ユニプレス	22,700	2,653.00	60,223,100
ダイニチ工業	6,400	840.00	5,376,000

日東精工	16,100	777.00	12,509,700
三洋工業	1,400	2,192.00	3,068,800
岡部	23,500	1,025.00	24,087,500
ジーテクト	12,800	2,450.00	31,360,000
中国工業	1,700	739.00	1,256,300
東ブレ	21,700	3,515.00	76,275,500
高周波熱錬	22,400	1,081.00	24,214,400
東京製綱	8,300	2,188.00	18,160,400
サンコール	6,600	735.00	4,851,000
モリテックスチール	6,800	721.00	4,902,800
パイオラックス	17,200	3,100.00	53,320,000
エイチワン	11,400	1,304.00	14,865,600
日本発条	115,700	1,207.00	139,649,900
中央発條	1,300	3,600.00	4,680,000
アドバネクス	1,800	2,229.00	4,012,200
三浦工業	50,200	3,275.00	164,405,000
タクマ	39,300	1,250.00	49,125,000
テクノプロ・ホールディングス	21,100	6,760.00	142,636,000
アトラ	1,900	1,046.00	1,987,400
インターワークス	2,500	1,052.00	2,630,000
Keep Per 技研	3,600	1,305.00	4,698,000
ファーストロジック	1,700	864.00	1,468,800
三機サービス	1,300	1,800.00	2,340,000
Gunosy	5,000	1,688.00	8,440,000
デザインワン・ジャパン	2,200	1,356.00	2,983,200
イー・ガーディアン	5,700	3,150.00	17,955,000
リブセンス	7,100	489.00	3,471,900
ジャパンマテリアル	30,700	1,557.00	47,799,900
ベクトル	13,500	2,201.00	29,713,500
ウチヤマホールディングス	5,600	647.00	3,623,200
ライクキッズネクスト	2,300	1,033.00	2,375,900
キャリアリンク	3,700	569.00	2,105,300
I B J	9,000	984.00	8,856,000
アサンテ	4,100	2,041.00	8,368,100
N・フィールド	6,300	1,755.00	11,056,500
バリューHR	2,500	1,976.00	4,940,000
M&Aキャピタルパートナーズ	2,800	9,330.00	26,124,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	4,600	1,049.00	4,825,400
E R Iホールディングス	3,200	1,106.00	3,539,200
アビスト	1,600	5,130.00	8,208,000
シグマクシス	4,500	1,720.00	7,740,000
ウィルグループ	4,800	1,405.00	6,744,000
エスクロー・エージェント・ジャパン	15,400	443.00	6,822,200
日本ビューホテル	3,600	1,500.00	5,400,000
リクルートホールディングス	865,700	2,801.00	2,424,825,700
エラン	2,700	2,195.00	5,926,500
ツガミ	31,000	1,354.00	41,974,000
オークマ	13,500	6,880.00	92,880,000
東芝機械	66,000	618.00	40,788,000

アマダホールディングス	179,200	1,322.00	236,902,400
アイダエンジニアリング	29,500	1,291.00	38,084,500
滝澤鉄工所	3,600	2,082.00	7,495,200
F U J I	34,800	2,198.00	76,490,400
牧野フライス製作所	59,000	1,034.00	61,006,000
オーエスジー	53,500	2,555.00	136,692,500
ダイジェット工業	1,400	1,968.00	2,755,200
旭ダイヤモンド工業	34,500	1,075.00	37,087,500
D M G 森精機	64,300	2,151.00	138,309,300
ソディック	25,300	1,309.00	33,117,700
ディスコ	15,700	21,580.00	338,806,000
日東工器	7,200	2,920.00	21,024,000
日進工具	3,100	2,988.00	9,262,800
パンチ工業	9,700	1,219.00	11,824,300
富士ダイス	4,300	962.00	4,136,600
土木管理総合試験所	3,600	596.00	2,145,600
日本郵政	636,800	1,324.00	843,123,200
ベルシステム24ホールディングス	18,800	1,687.00	31,715,600
鎌倉新書	1,500	3,775.00	5,662,500
一蔵	1,400	896.00	1,254,400
L I T A L I C O	1,900	1,624.00	3,085,600
グローバルグループ	1,200	1,244.00	1,492,800
エボラブルアジア	2,300	2,009.00	4,620,700
ストライク	1,100	7,080.00	7,788,000
ソラスト	6,800	3,175.00	21,590,000
セラク	1,900	825.00	1,567,500
インソース	2,800	2,154.00	6,031,200
豊田自動織機	95,000	7,040.00	668,800,000
豊和工業	6,400	1,095.00	7,008,000
O K K	4,500	1,161.00	5,224,500
石川製作所	3,000	2,072.00	6,216,000
東洋機械金属	9,100	780.00	7,098,000
津田駒工業	27,000	248.00	6,696,000
エンシュウ	30,000	160.00	4,800,000
島精機製作所	14,700	6,040.00	88,788,000
オプトラン	11,300	3,050.00	34,465,000
N C ホールディングス	3,600	831.00	2,991,600
フリー	8,300	974.00	8,084,200
ヤマシンフィルタ	17,700	1,218.00	21,558,600
日阪製作所	16,700	1,200.00	20,040,000
やまびこ	22,500	1,571.00	35,347,500
平田機工	4,300	9,080.00	39,044,000
ペガサスミシン製造	10,900	777.00	8,469,300
ナプテスコ	63,900	3,675.00	234,832,500
三井海洋開発	12,300	3,065.00	37,699,500
レオン自動機	10,400	2,234.00	23,233,600
S M C	36,800	43,040.00	1,583,872,000
新川	9,500	1,060.00	10,070,000
ホソカワミクロン	4,400	7,550.00	33,220,000
ユニオンツール	5,300	4,260.00	22,578,000

オイレス工業	15,000	2,548.00	38,220,000
日精エー・エス・ビー機械	3,400	5,490.00	18,666,000
サトーホールディングス	15,300	3,160.00	48,348,000
技研製作所	8,000	2,506.00	20,048,000
日本エアーテック	3,900	925.00	3,607,500
カワタ	2,400	1,670.00	4,008,000
日精樹脂工業	9,700	1,328.00	12,881,600
オカダアイヨン	3,900	1,580.00	6,162,000
ワイエイシイホールディングス	3,800	1,083.00	4,115,400
小松製作所	567,000	3,603.00	2,042,901,000
住友重機械工業	67,200	4,170.00	280,224,000
日立建機	54,900	4,025.00	220,972,500
日工	3,200	2,518.00	8,057,600
巴工業	5,000	2,105.00	10,525,000
井関農機	11,700	2,205.00	25,798,500
TOWA	9,100	1,318.00	11,993,800
丸山製作所	2,500	1,961.00	4,902,500
北川鉄工所	5,600	2,852.00	15,971,200
シンニッタン	18,100	494.00	8,941,400
ローツェ	5,800	2,603.00	15,097,400
タカキタ	4,100	784.00	3,214,400
クボタ	629,900	1,873.50	1,180,117,650
荏原実業	3,400	2,431.00	8,265,400
東洋エンジニアリング	15,500	1,044.00	16,182,000
三菱化工機	4,100	2,282.00	9,356,200
月島機械	23,300	1,624.00	37,839,200
帝国電機製作所	8,200	1,644.00	13,480,800
東京機械製作所	4,500	499.00	2,245,500
新東工業	27,900	1,181.00	32,949,900
澁谷工業	10,300	3,785.00	38,985,500
アイチコーポレーション	20,300	757.00	15,367,100
小森コーポレーション	29,500	1,404.00	41,418,000
鶴見製作所	9,900	2,100.00	20,790,000
住友精密工業	19,000	382.00	7,258,000
酒井重工業	2,200	4,535.00	9,977,000
荏原製作所	48,200	4,285.00	206,537,000
石井鐵工所	1,800	2,128.00	3,830,400
西島製作所	12,000	1,090.00	13,080,000
北越工業	13,200	1,111.00	14,665,200
千代田化工建設	85,400	1,120.00	95,648,000
ダイキン工業	160,300	13,470.00	2,159,241,000
オルガノ	4,200	3,685.00	15,477,000
トーヨーカネツ	5,000	3,280.00	16,400,000
栗田工業	63,500	3,205.00	203,517,500
椿本チエイン	70,000	896.00	62,720,000
大同工業	4,500	1,485.00	6,682,500
日機装	40,600	1,176.00	47,745,600
木村化工機	9,600	517.00	4,963,200
新興プランテック	25,300	1,069.00	27,045,700
アネスト岩田	19,800	1,156.00	22,888,800

ダイフク	59,800	6,130.00	366,574,000
サムコ	3,200	1,300.00	4,160,000
加藤製作所	5,600	2,566.00	14,369,600
油研工業	2,300	2,973.00	6,837,900
タダノ	56,600	1,515.00	85,749,000
フジテック	37,600	1,462.00	54,971,200
CKD	32,700	2,265.00	74,065,500
キトー	8,900	2,148.00	19,117,200
平和	36,400	2,461.00	89,580,400
理想科学工業	11,700	2,367.00	27,693,900
SANKYO	29,400	4,230.00	124,362,000
日本金銭機械	10,800	1,151.00	12,430,800
マースエンジニアリング	7,500	2,533.00	18,997,500
福島工業	7,200	5,020.00	36,144,000
オーイズミ	4,800	567.00	2,721,600
ダイコク電機	5,400	1,774.00	9,579,600
竹内製作所	19,600	2,512.00	49,235,200
アマノ	36,300	2,788.00	101,204,400
JUKI	17,400	1,229.00	21,384,600
サンデンホールディングス	14,300	1,611.00	23,037,300
蛇の目マシン工業	10,700	746.00	7,982,200
ブラザー工業	143,400	2,478.00	355,345,200
マックス	18,100	1,505.00	27,240,500
モリタホールディングス	18,800	2,254.00	42,375,200
グローリー	35,000	3,615.00	126,525,000
新晃工業	11,900	1,773.00	21,098,700
大和冷機工業	18,900	1,291.00	24,399,900
セガサミーホールディングス	116,500	1,881.00	219,136,500
日本ピストンリング	4,300	2,351.00	10,109,300
リケン	5,400	6,220.00	33,588,000
TPR	13,200	3,290.00	43,428,000
ツバキ・ナカシマ	11,800	2,615.00	30,857,000
ホシザキ	37,000	10,330.00	382,210,000
大豊工業	9,600	1,508.00	14,476,800
日本精工	241,200	1,452.00	350,222,400
NTN	271,800	480.00	130,464,000
ジェイテクト	125,200	1,731.00	216,721,200
不二越	109,000	576.00	62,784,000
ミネベアミツミ	218,000	2,256.00	491,808,000
日本トムソン	37,500	809.00	30,337,500
THK	73,200	3,930.00	287,676,000
ユーシン精機	10,400	1,429.00	14,861,600
前澤給装工業	4,600	1,947.00	8,956,200
イーグル工業	14,500	2,060.00	29,870,000
前澤工業	8,600	483.00	4,153,800
日本ピラー工業	11,900	1,690.00	20,111,000
キッツ	47,600	1,050.00	49,980,000
日立製作所	2,820,000	872.60	2,460,732,000
三菱電機	1,174,300	1,649.50	1,937,007,850
富士電機	354,000	790.00	279,660,000

東洋電機製造	4,600	1,855.00	8,533,000
安川電機	136,100	4,595.00	625,379,500
シンフォニアテクノロジー	76,000	433.00	32,908,000
明電舎	100,000	425.00	42,500,000
オリジン電気	3,400	2,215.00	7,531,000
山洋電気	5,700	10,100.00	57,570,000
デンヨー	10,800	1,929.00	20,833,200
キャリアインデックス	1,100	2,326.00	2,558,600
MS-Japan	800	7,270.00	5,816,000
船場	1,700	1,299.00	2,208,300
グリーンズ	2,400	1,661.00	3,986,400
日総工産	1,800	4,565.00	8,217,000
キュービーネットホールディングス	5,600	1,947.00	10,903,200
三櫻工業	14,900	781.00	11,636,900
マキタ	153,100	5,020.00	768,562,000
東芝テック	84,000	646.00	54,264,000
芝浦メカトロニクス	17,000	432.00	7,344,000
マブチモーター	32,800	5,380.00	176,464,000
日本電産	141,300	17,340.00	2,450,142,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	4,300	3,395.00	14,598,500
トレックス・セミコンダクター	3,300	1,411.00	4,656,300
東光高岳	5,900	1,921.00	11,333,900
ダブル・スコープ	17,100	1,747.00	29,873,700
宮越ホールディングス	4,300	1,027.00	4,416,100
ダイヘン	64,000	798.00	51,072,000
田淵電機	16,300	290.00	4,727,000
ヤーマン	17,000	2,523.00	42,891,000
JVCケンウッド	86,100	356.00	30,651,600
ミマキエンジニアリング	10,500	893.00	9,376,500
第一精工	5,500	2,277.00	12,523,500
日新電機	27,500	1,131.00	31,102,500
大崎電気工業	25,100	829.00	20,807,900
オムロン	124,800	6,090.00	760,032,000
日東工業	18,800	1,927.00	36,227,600
IDEC	14,500	2,678.00	38,831,000
不二電機工業	1,300	1,396.00	1,814,800
ジーエス・ユアサコーポレーション	211,000	558.00	117,738,000
サクサホールディングス	3,000	2,140.00	6,420,000
メルコホールディングス	5,700	4,235.00	24,139,500
テクノメディカ	2,700	2,055.00	5,548,500
日本電気	152,000	3,050.00	463,600,000
富士通	1,208,000	678.90	820,111,200
沖電気工業	47,700	1,347.00	64,251,900
岩崎通信機	5,200	838.00	4,357,600
電気興業	6,700	3,335.00	22,344,500
サンケン電気	69,000	711.00	49,059,000
ナカヨ	2,200	1,952.00	4,294,400
アイホン	6,700	1,917.00	12,843,900
ルネサスエレクトロニクス	60,800	1,098.00	66,758,400
セイコーエプソン	174,900	2,079.00	363,617,100

ワコム	91,100	565.00	51,471,500
アルバック	27,000	6,350.00	171,450,000
アクセル	4,900	840.00	4,116,000
E I Z O	10,800	4,955.00	53,514,000
ジャパンディスプレイ	241,100	138.00	33,271,800
日本信号	32,400	1,091.00	35,348,400
京三製作所	27,500	773.00	21,257,500
能美防災	15,500	2,607.00	40,408,500
ホーチキ	8,500	2,217.00	18,844,500
エレコム	10,200	3,010.00	30,702,000
パナソニック	1,341,600	1,638.00	2,197,540,800
シャープ	109,000	3,225.00	351,525,000
アンリツ	85,600	1,446.00	123,777,600
富士通ゼネラル	35,900	1,724.00	61,891,600
ソニー	784,900	5,177.00	4,063,427,300
T D K	61,400	10,290.00	631,806,000
帝国通信工業	5,200	1,284.00	6,676,800
タムラ製作所	45,300	815.00	36,919,500
アルプス電気	101,200	2,716.00	274,859,200
池上通信機	37,000	163.00	6,031,000
パイオニア	195,600	177.00	34,621,200
日本電波工業	10,600	696.00	7,377,600
鈴木	5,000	1,087.00	5,435,000
日本トリム	2,500	4,570.00	11,425,000
ローランド ディー・ジー・	6,000	2,622.00	15,732,000
フォスター電機	13,700	2,006.00	27,482,200
クラリオン	62,000	303.00	18,786,000
S M K	30,000	387.00	11,610,000
ヨコオ	7,600	2,125.00	16,150,000
ティアック	84,000	43.00	3,612,000
ホシデン	29,600	1,330.00	39,368,000
ヒロセ電機	19,900	14,790.00	294,321,000
日本航空電子工業	30,000	1,871.00	56,130,000
T O A	12,600	1,291.00	16,266,600
マクセルホールディングス	23,300	1,723.00	40,145,900
古野電気	14,000	957.00	13,398,000
ユニデンホールディングス	32,000	278.00	8,896,000
アルパイン	28,000	2,257.00	63,196,000
スミダコーポレーション	12,000	1,405.00	16,860,000
アイコム	6,500	2,798.00	18,187,000
リオン	4,900	2,327.00	11,402,300
本多通信工業	9,100	1,018.00	9,263,800
船井電機	11,900	752.00	8,948,800
横河電機	117,500	2,069.00	243,107,500
新電元工業	4,100	6,860.00	28,126,000
アズビル	35,200	5,070.00	178,464,000
東亜ディーケーケー	5,800	1,433.00	8,311,400
日本光電工業	49,100	2,919.00	143,322,900
チノー	4,100	1,752.00	7,183,200
共和電業	13,500	450.00	6,075,000

日本電子材料	4,700	878.00	4,126,600
堀場製作所	23,300	9,450.00	220,185,000
アドバンテスト	65,500	2,783.00	182,286,500
小野測器	5,100	842.00	4,294,200
エスベック	10,400	2,731.00	28,402,400
キーエンス	57,600	68,400.00	3,939,840,000
日置電機	6,100	4,330.00	26,413,000
シスメックス	91,400	9,470.00	865,558,000
日本マイクロニクス	20,400	1,313.00	26,785,200
メガチップス	9,200	3,590.00	33,028,000
OBARA GROUP	6,800	6,250.00	42,500,000
イマジカ・ロボットホールディングス	9,700	1,005.00	9,748,500
澤藤電機	1,200	2,007.00	2,408,400
デンソー	260,600	5,691.00	1,483,074,600
コーセル	16,300	1,488.00	24,254,400
イリソ電子工業	9,900	6,950.00	68,805,000
新日本無線	7,100	962.00	6,830,200
オブテックスグループ	19,100	2,890.00	55,199,000
千代田インテグレ	5,500	2,477.00	13,623,500
アイ・オー・データ機器	4,900	1,246.00	6,105,400
レーザーテック	24,100	3,820.00	92,062,000
スタンレー電気	89,800	3,955.00	355,159,000
岩崎電気	4,600	1,730.00	7,958,000
ウシオ電機	71,300	1,561.00	111,299,300
岡谷電機産業	6,300	596.00	3,754,800
ヘリオス テクノホールディング	10,000	781.00	7,810,000
日本セラミック	11,900	2,924.00	34,795,600
遠藤照明	6,000	1,007.00	6,042,000
古河電池	8,400	1,000.00	8,400,000
双信電機	5,000	612.00	3,060,000
山一電機	8,500	1,975.00	16,787,500
図研	7,700	1,803.00	13,883,100
日本電子	43,000	991.00	42,613,000
カシオ計算機	94,400	1,714.00	161,801,600
ファナック	111,600	23,600.00	2,633,760,000
日本シイエムケイ	20,700	864.00	17,884,800
エンプラス	5,300	3,380.00	17,914,000
大真空	4,300	1,366.00	5,873,800
ローム	52,700	10,910.00	574,957,000
浜松ホトニクス	85,500	4,470.00	382,185,000
三井ハイテック	15,500	1,605.00	24,877,500
新光電気工業	44,400	941.00	41,780,400
京セラ	192,800	6,787.00	1,308,533,600
協栄産業	1,400	2,075.00	2,905,000
太陽誘電	52,700	2,288.00	120,577,600
村田製作所	123,200	15,110.00	1,861,552,000
ユーシン	17,700	739.00	13,080,300
双葉電子工業	19,200	2,290.00	43,968,000
日東電工	88,700	8,431.00	747,829,700

北陸電気工業	4,700	1,359.00	6,387,300	
東海理化電機製作所	30,900	2,241.00	69,246,900	
ニチコン	37,000	1,383.00	51,171,000	
日本ケミコン	9,500	3,205.00	30,447,500	
K O A	16,200	2,442.00	39,560,400	
三井E & S ホールディングス	42,400	1,710.00	72,504,000	
日立造船	93,000	588.00	54,684,000	
三菱重工業	196,800	4,159.00	818,491,200	
川崎重工業	91,400	3,525.00	322,185,000	
I H I	90,200	3,965.00	357,643,000	
名村造船所	35,200	646.00	22,739,200	
サノヤスホールディングス	14,300	262.00	3,746,600	
日本車輛製造	43,000	294.00	12,642,000	
三菱ロジスネクスト	14,000	1,189.00	16,646,000	
近畿車輛	1,800	2,776.00	4,996,800	
F P G	37,000	1,458.00	53,946,000	
島根銀行	2,400	1,327.00	3,184,800	
じもとホールディングス	78,600	191.00	15,012,600	
全国保証	32,600	5,100.00	166,260,000	
めぶきフィナンシャルグループ	601,800	432.00	259,977,600	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	15,600	2,936.00	45,801,600	
九州フィナンシャルグループ	190,100	560.00	106,456,000	
かんぼ生命保険	43,800	2,607.00	114,186,600	
ゆうちょ銀行	328,300	1,509.00	495,404,700	
富山第一銀行	29,600	503.00	14,888,800	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	691,400	633.00	437,656,200	
西日本フィナンシャルホールディングス	74,200	1,372.00	101,802,400	
マーキュリアインベストメント	2,400	1,097.00	2,632,800	
イントラスト	1,800	717.00	1,290,600	
アルヒ	13,100	1,510.00	19,781,000	
日産自動車	1,385,100	1,111.00	1,538,846,100	
いすゞ自動車	340,300	1,672.50	569,151,750	
トヨタ自動車	1,427,200	7,543.00	10,765,369,600	*
日野自動車	167,600	1,292.00	216,539,200	
三菱自動車工業	434,700	859.00	373,407,300	
エフテック	7,500	1,448.00	10,860,000	
レシップホールディングス	4,300	841.00	3,616,300	
G M B	1,900	1,543.00	2,931,700	
ファルテック	2,100	1,344.00	2,822,400	
武蔵精密工業	12,500	4,155.00	51,937,500	
日産車体	45,900	1,117.00	51,270,300	
新明和工業	51,000	1,254.00	63,954,000	
極東開発工業	21,800	1,761.00	38,389,800	
日信工業	23,900	2,128.00	50,859,200	
トビー工業	9,700	3,565.00	34,580,500	
ティラド	4,300	3,950.00	16,985,000	
曙ブレーキ工業	54,500	255.00	13,897,500	
タチエス	19,900	2,073.00	41,252,700	

N O K	63,100	2,209.00	139,387,900
フタバ産業	35,900	869.00	31,197,100
K Y B	12,200	5,290.00	64,538,000
市光工業	17,500	1,516.00	26,530,000
大同メタル工業	14,800	1,340.00	19,832,000
プレス工業	62,400	642.00	40,060,800
ミクニ	14,900	597.00	8,895,300
太平洋工業	24,600	1,590.00	39,114,000
ケーヒン	27,000	2,267.00	61,209,000
河西工業	14,400	1,524.00	21,945,600
アイシン精機	96,700	6,030.00	583,101,000
マツダ	368,600	1,463.50	539,446,100
今仙電機製作所	10,900	1,235.00	13,461,500
本田技研工業	1,056,800	3,623.00	3,828,786,400
スズキ	232,700	6,143.00	1,429,476,100
S U B A R U	364,600	3,607.00	1,315,112,200
安永	5,700	2,479.00	14,130,300
ヤマハ発動機	165,900	3,405.00	564,889,500
ショーワ	30,500	1,972.00	60,146,000
小糸製作所	70,300	7,670.00	539,201,000
T B K	14,100	549.00	7,740,900
エクセディ	14,200	3,750.00	53,250,000
ミツバ	21,600	1,332.00	28,771,200
豊田合成	42,700	2,930.00	125,111,000
愛三工業	20,700	1,192.00	24,674,400
盟和産業	1,700	1,296.00	2,203,200
日本プラスト	4,800	1,001.00	4,804,800
ヨロズ	11,900	2,064.00	24,561,600
エフ・シー・シー	19,200	3,045.00	58,464,000
新家工業	2,700	2,173.00	5,867,100
シマノ	47,300	14,920.00	705,716,000
テイ・エス テック	27,300	5,080.00	138,684,000
関西みらいフィナンシャルグループ	50,700	883.00	44,768,100
三十三フィナンシャルグループ	9,800	2,278.00	22,324,400
ジャムコ	5,900	2,231.00	13,162,900
小野建	10,100	1,895.00	19,139,500
はるやまホールディングス	5,500	1,088.00	5,984,000
ノジマ	20,300	2,689.00	54,586,700
佐鳥電機	8,500	1,136.00	9,656,000
カッパ・クリエイト	14,400	1,463.00	21,067,200
エコートレーディング	2,500	730.00	1,825,000
伯東	7,000	1,873.00	13,111,000
コンドーテック	9,200	935.00	8,602,000
中山福	6,400	738.00	4,723,200
ライトオン	9,800	1,017.00	9,966,600
ナガイレーベン	16,700	2,905.00	48,513,500
ジーンズメイト	3,400	838.00	2,849,200
三菱食品	12,800	3,085.00	39,488,000
良品計画	15,400	38,300.00	589,820,000
三城ホールディングス	14,500	519.00	7,525,500

松田産業	8,400	1,916.00	16,094,400
第一興商	17,200	5,760.00	99,072,000
メディカルホールディングス	115,900	2,384.00	276,305,600
アドヴァン	11,800	1,006.00	11,870,800
S P K	2,400	2,805.00	6,732,000
萩原電気ホールディングス	4,100	3,175.00	13,017,500
アルピス	3,700	3,900.00	14,430,000
アズワン	9,100	7,140.00	64,974,000
スズデン	4,000	1,730.00	6,920,000
尾家産業	3,300	1,395.00	4,603,500
シモジマ	7,100	1,133.00	8,044,300
ドウシシャ	12,300	2,535.00	31,180,500
小津産業	2,500	2,319.00	5,797,500
コナカ	14,900	577.00	8,597,300
高速	6,900	1,359.00	9,377,100
ハウス オブ ローゼ	1,500	1,822.00	2,733,000
G - 7ホールディングス	3,400	2,466.00	8,384,400
たけびし	4,100	1,728.00	7,084,800
イオン北海道	11,800	810.00	9,558,000
コジマ	19,900	446.00	8,875,400
ヒマラヤ	3,200	1,163.00	3,721,600
コーナン商事	16,400	2,762.00	45,296,800
ネットワンシステムズ	47,000	1,812.00	85,164,000
エコス	4,700	1,901.00	8,934,700
ワタミ	13,700	1,510.00	20,687,000
マルシェ	3,200	815.00	2,608,000
リックス	2,600	2,115.00	5,499,000
システムソフト	27,300	142.00	3,876,600
ドンキホーテホールディングス	75,000	5,530.00	414,750,000
丸文	10,200	949.00	9,679,800
西松屋チェーン	25,400	1,270.00	32,258,000
ゼンショーホールディングス	60,000	2,693.00	161,580,000
ハビネット	7,900	1,570.00	12,403,000
幸楽苑ホールディングス	7,300	1,786.00	13,037,800
ハークスレイ	2,700	1,156.00	3,121,200
橋本総業ホールディングス	2,300	1,780.00	4,094,000
日本ライフライン	33,000	2,642.00	87,186,000
サイゼリヤ	19,000	2,524.00	47,956,000
エクセル	4,600	2,880.00	13,248,000
V Tホールディングス	39,200	500.00	19,600,000
マルカキカイ	3,800	2,063.00	7,839,400
アルゴグラフィックス	5,300	3,870.00	20,511,000
魚力	3,300	1,427.00	4,709,100
I D O M	35,100	794.00	27,869,400
日本エム・ディ・エム	7,700	1,111.00	8,554,700
ポブラ	3,000	917.00	2,751,000
フジ・コーポレーション	2,000	2,560.00	5,120,000
ユナイテッドアローズ	14,300	4,010.00	57,343,000
進和	6,900	2,627.00	18,126,300
エスケイジャパン	2,800	564.00	1,579,200

ダイترون	5,300	2,411.00	12,778,300
ハイデイ日高	15,200	2,773.00	42,149,600
シークス	14,700	2,318.00	34,074,600
京都きもの友禅	7,300	698.00	5,095,400
コロワイド	38,400	3,010.00	115,584,000
ピーシーデボコーポレーション	17,300	717.00	12,404,100
田中商事	3,700	738.00	2,730,600
オーハシテクニカ	6,600	1,820.00	12,012,000
壺番屋	8,200	4,520.00	37,064,000
白銅	4,200	2,333.00	9,798,600
トップカルチャー	4,100	493.00	2,021,300
P L A N T	2,600	1,345.00	3,497,000
スギホールディングス	25,400	6,590.00	167,386,000
島津製作所	140,300	3,150.00	441,945,000
J M S	10,500	649.00	6,814,500
クボテック	2,500	544.00	1,360,000
長野計器	9,200	1,296.00	11,923,200
ブイ・テクノロジー	2,700	27,820.00	75,114,000
スター精密	18,800	1,947.00	36,603,600
東京計器	7,500	1,224.00	9,180,000
愛知時計電機	1,500	4,125.00	6,187,500
インターアクション	4,700	1,158.00	5,442,600
オーバル	11,200	309.00	3,460,800
東京精密	21,200	4,425.00	93,810,000
マニー	14,300	4,600.00	65,780,000
ニコン	204,600	1,811.00	370,530,600
トプコン	63,100	2,038.00	128,597,800
オリンパス	174,900	4,025.00	703,972,500
理研計器	11,200	2,638.00	29,545,600
S C R E E Nホールディングス	22,200	9,920.00	220,224,000
キヤノン電子	10,800	2,540.00	27,432,000
タムロン	9,500	2,292.00	21,774,000
H O Y A	236,400	6,212.00	1,468,516,800
シード	1,700	6,460.00	10,982,000
ノーリツ鋼機	11,900	2,900.00	34,510,000
エー・アンド・デイ	10,700	741.00	7,928,700
キヤノン	632,200	3,796.00	2,399,831,200
リコー	353,100	1,048.00	370,048,800
シチズン時計	140,100	855.00	119,785,500
リズム時計工業	4,300	2,410.00	10,363,000
大研医器	10,600	746.00	7,907,600
メニコン	16,100	2,957.00	47,607,700
シンシア	900	722.00	649,800
中本パックス	2,200	1,820.00	4,004,000
スノーピーク	3,600	1,405.00	5,058,000
パラマウントベッドホールディングス	12,400	5,260.00	65,224,000
トランザクション	5,300	1,001.00	5,305,300
S H O B I	3,900	437.00	1,704,300
ニホンフラッシュ	5,500	2,960.00	16,280,000
前田工織	11,800	1,829.00	21,582,200

永大産業	15,600	556.00	8,673,600
アートネイチャー	12,600	724.00	9,122,400
バンダイナムコホールディングス	121,400	4,170.00	506,238,000
アイフィスジャパン	2,400	774.00	1,857,600
共立印刷	19,800	369.00	7,306,200
S H O E I	5,300	4,345.00	23,028,500
フランスベッドホールディングス	14,000	986.00	13,804,000
マーベラス	19,500	966.00	18,837,000
パイロットコーポレーション	20,500	6,230.00	127,715,000
萩原工業	6,500	2,000.00	13,000,000
エイベックス	21,400	1,460.00	31,244,000
トッパン・フォームズ	25,200	1,213.00	30,567,600
フジシールインターナショナル	26,300	4,285.00	112,695,500
タカラトミー	49,100	1,125.00	55,237,500
廣済堂	10,900	538.00	5,864,200
A s - m e エステール	3,400	825.00	2,805,000
アーク	59,800	119.00	7,116,200
レック	7,000	4,060.00	28,420,000
タカノ	5,200	1,012.00	5,262,400
プロネクサス	11,000	1,361.00	14,971,000
ホクシン	8,200	175.00	1,435,000
ウッドワン	3,800	1,516.00	5,760,800
大建工業	9,200	2,788.00	25,649,600
きもと	20,000	318.00	6,360,000
凸版印刷	331,000	908.00	300,548,000
大日本印刷	153,700	2,354.00	361,809,800
図書印刷	7,900	1,039.00	8,208,100
共同印刷	3,600	3,400.00	12,240,000
N I S S H A	24,100	2,697.00	64,997,700
光村印刷	1,000	2,420.00	2,420,000
藤森工業	9,800	3,960.00	38,808,000
ヴィア・ホールディングス	10,400	699.00	7,269,600
宝印刷	6,200	2,020.00	12,524,000
前澤化成工業	8,100	1,229.00	9,954,900
アシックス	116,600	1,819.00	212,095,400
ツツミ	3,700	2,085.00	7,714,500
J S P	6,900	3,415.00	23,563,500
ニチハ	17,700	4,465.00	79,030,500
エフピコ	9,700	6,770.00	65,669,000
小松ウオール工業	4,000	2,440.00	9,760,000
ヤマハ	79,100	5,790.00	457,989,000
河合楽器製作所	3,900	4,615.00	17,998,500
クリナップ	11,000	834.00	9,174,000
ピジョン	71,000	5,220.00	370,620,000
天馬	9,200	2,116.00	19,467,200
兼松サステック	900	2,182.00	1,963,800
キングジム	9,800	1,084.00	10,623,200
象印マホービン	21,800	1,609.00	35,076,200
リンテック	27,900	3,300.00	92,070,000
信越ポリマー	24,100	1,117.00	26,919,700

東リ	29,400	369.00	10,848,600
イトーキ	24,700	689.00	17,018,300
任天堂	72,300	46,100.00	3,333,030,000
三菱鉛筆	19,300	2,270.00	43,811,000
松風	5,800	1,431.00	8,299,800
タカラスタANDARD	24,300	1,880.00	45,684,000
コクヨ	56,300	2,052.00	115,527,600
ナカバヤシ	11,600	656.00	7,609,600
ニフコ	43,100	3,920.00	168,952,000
立川ブラインド工業	5,100	1,494.00	7,619,400
グロープライド	5,300	3,360.00	17,808,000
オカムラ	41,000	1,729.00	70,889,000
日本バルカー工業	9,500	3,185.00	30,257,500
MUTOHホールディングス	1,600	2,486.00	3,977,600
伊藤忠商事	848,800	2,029.00	1,722,215,200
丸紅	950,500	879.30	835,774,650
スクロール	17,800	562.00	10,003,600
高島	1,900	2,262.00	4,297,800
ヨンドシーホールディングス	11,800	2,751.00	32,461,800
三陽商会	6,400	2,383.00	15,251,200
長瀬産業	69,700	1,988.00	138,563,600
ナイガイ	4,400	586.00	2,578,400
蝶理	7,400	2,119.00	15,680,600
豊田通商	129,100	4,085.00	527,373,500
オンワードホールディングス	73,500	910.00	66,885,000
三共生興	19,800	497.00	9,840,600
兼松	49,300	1,751.00	86,324,300
美津濃	11,600	4,115.00	47,734,000
ツカモトコーポレーション	2,100	1,275.00	2,677,500
ユニー・ファミリーマートホールディングス	37,000	11,010.00	407,370,000
ルックホールディングス	21,000	312.00	6,552,000
三井物産	982,600	1,971.00	1,936,704,600
日本紙パルプ商事	6,000	4,550.00	27,300,000
東京エレクトロン	78,300	21,770.00	1,704,591,000
日立ハイテクノロジーズ	40,200	5,120.00	205,824,000
カメイ	15,100	1,647.00	24,869,700
東都水産	1,700	1,864.00	3,168,800
OUGホールディングス	1,800	2,690.00	4,842,000
スターゼン	4,500	5,650.00	25,425,000
セイコーホールディングス	18,100	2,978.00	53,901,800
山善	45,200	1,146.00	51,799,200
椿本興業	2,600	4,130.00	10,738,000
住友商事	729,600	1,926.50	1,405,574,400
日本ユニシス	32,000	2,590.00	82,880,000
内田洋行	5,300	3,065.00	16,244,500
三菱商事	811,700	3,197.00	2,595,004,900
第一実業	5,300	3,310.00	17,543,000
キヤノンマーケティングジャパン	33,100	2,507.00	82,981,700
西華産業	7,200	2,903.00	20,901,600

佐藤商事	10,400	1,199.00	12,469,600
菱洋エレクトロ	10,800	1,905.00	20,574,000
東京産業	11,600	564.00	6,542,400
ユアサ商事	11,000	3,725.00	40,975,000
神鋼商事	2,600	3,425.00	8,905,000
小林産業	7,600	361.00	2,743,600
阪和興業	21,600	5,070.00	109,512,000
正栄食品工業	6,400	4,440.00	28,416,000
カナデン	11,100	1,400.00	15,540,000
菱電商事	8,300	1,804.00	14,973,200
ニプロ	81,300	1,285.00	104,470,500
フルサト工業	6,400	1,864.00	11,929,600
岩谷産業	25,700	4,080.00	104,856,000
すてきナイスグループ	4,800	1,427.00	6,849,600
昭光通商	41,000	108.00	4,428,000
ニチモウ	1,700	1,805.00	3,068,500
極東貿易	17,000	506.00	8,602,000
イワキ	16,300	409.00	6,666,700
兼松エレクトロニクス	7,300	3,670.00	26,791,000
三愛石油	31,100	1,609.00	50,039,900
稲畑産業	27,800	1,612.00	44,813,600
G S Iクレオス	3,100	1,670.00	5,177,000
明和産業	10,700	536.00	5,735,200
キムラタン	55,500	41.00	2,275,500
ゴールドウイン	6,900	7,340.00	50,646,000
ユニ・チャーム	249,000	3,286.00	818,214,000
デサント	28,100	1,961.00	55,104,100
キング	6,200	566.00	3,509,200
ワキタ	24,700	1,220.00	30,134,000
ヤマトインターナショナル	8,100	667.00	5,402,700
東邦ホールディングス	34,300	2,793.00	95,799,900
サンゲツ	38,500	2,250.00	86,625,000
ミツウロコグループホールディングス	16,800	952.00	15,993,600
シナネンホールディングス	4,800	2,776.00	13,324,800
伊藤忠エネクス	25,600	1,102.00	28,211,200
サンリオ	32,500	2,041.00	66,332,500
サンワテクノス	6,800	1,677.00	11,403,600
リョーサン	14,600	4,305.00	62,853,000
新光商事	12,700	1,929.00	24,498,300
トーヨー	5,300	2,633.00	13,954,900
三信電気	10,700	2,234.00	23,903,800
東陽テクニカ	13,400	965.00	12,931,000
モスフードサービス	15,200	3,270.00	49,704,000
加賀電子	10,500	2,709.00	28,444,500
三益半導体工業	9,100	1,957.00	17,808,700
ソーダニッカ	12,000	807.00	9,684,000
立花エレテック	7,800	2,216.00	17,284,800
木曽路	14,200	2,939.00	41,733,800
S R Sホールディングス	13,700	976.00	13,371,200
千趣会	21,000	589.00	12,369,000

タカキュー	9,000	218.00	1,962,000
ケーヨー	21,400	571.00	12,219,400
上新電機	13,600	4,545.00	61,812,000
日本瓦斯	21,200	5,480.00	116,176,000
ロイヤルホールディングス	20,500	2,839.00	58,199,500
東天紅	800	1,939.00	1,551,200
いなげや	12,900	1,784.00	23,013,600
島忠	26,200	3,500.00	91,700,000
チヨダ	13,700	2,672.00	36,606,400
ライフコーポレーション	8,800	2,827.00	24,877,600
リンガーハット	14,300	2,638.00	37,723,400
さが美グループホールディングス	11,000	149.00	1,639,000
MrMaxHD	14,500	714.00	10,353,000
テンアライド	10,900	483.00	5,264,700
AOKIホールディングス	23,200	1,711.00	39,695,200
オークワ	16,000	1,165.00	18,640,000
コメリ	17,900	2,911.00	52,106,900
青山商事	22,200	4,230.00	93,906,000
しまむら	13,500	12,580.00	169,830,000
はせがわ	5,900	494.00	2,914,600
高島屋	181,000	927.00	167,787,000
松屋	23,300	1,418.00	33,039,400
エイチ・ツー・オー リテイリング	54,800	2,109.00	115,573,200
近鉄百貨店	4,500	3,965.00	17,842,500
パルコ	11,100	1,370.00	15,207,000
丸井グループ	110,700	2,369.00	262,248,300
クレディセゾン	87,900	1,931.00	169,734,900
アクシアル リテイリング	9,600	4,160.00	39,936,000
井筒屋	6,300	355.00	2,236,500
イオン	445,100	2,152.00	957,855,200
イズミ	20,900	6,880.00	143,792,000
東武ストア	1,300	3,035.00	3,945,500
フォーバル	5,100	888.00	4,528,800
平和堂	23,500	2,627.00	61,734,500
フジ	13,800	2,323.00	32,057,400
ヤオコー	13,100	6,380.00	83,578,000
ゼビオホールディングス	15,700	2,034.00	31,933,800
ケーズホールディングス	101,400	1,326.00	134,456,400
PALTAC	16,200	6,430.00	104,166,000
三谷産業	12,700	423.00	5,372,100
Olympicグループ	6,600	563.00	3,715,800
日産東京販売ホールディングス	17,100	402.00	6,874,200
新生銀行	100,300	1,822.00	182,746,600
あおぞら銀行	69,000	4,450.00	307,050,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	8,108,900	723.00	5,862,734,700
りそなホールディングス	1,271,000	622.40	791,070,400
三井住友トラスト・ホールディングス	227,700	4,692.00	1,068,368,400
三井住友フィナンシャルグループ	876,700	4,520.00	3,962,684,000
第四銀行	14,200	4,970.00	70,574,000
北越銀行	11,600	2,461.00	28,547,600

千葉銀行	410,200	851.00	349,080,200
群馬銀行	235,200	661.00	155,467,200
武蔵野銀行	18,500	3,690.00	68,265,000
千葉興業銀行	31,800	501.00	15,931,800
筑波銀行	48,200	394.00	18,990,800
七十七銀行	36,300	2,712.00	98,445,600
青森銀行	9,000	3,410.00	30,690,000
秋田銀行	7,400	3,140.00	23,236,000
山形銀行	13,000	2,471.00	32,123,000
岩手銀行	8,100	4,330.00	35,073,000
東邦銀行	103,600	428.00	44,340,800
東北銀行	6,000	1,498.00	8,988,000
みちのく銀行	7,500	1,784.00	13,380,000
ふくおかフィナンシャルグループ	470,000	594.00	279,180,000
静岡銀行	305,700	1,130.00	345,441,000
十六銀行	15,600	2,853.00	44,506,800
スルガ銀行	118,500	1,487.00	176,209,500
八十二銀行	209,600	549.00	115,070,400
山梨中央銀行	72,000	492.00	35,424,000
大垣共立銀行	18,300	2,825.00	51,697,500
福井銀行	9,900	2,449.00	24,245,100
北國銀行	13,100	4,495.00	58,884,500
清水銀行	3,800	3,240.00	12,312,000
富山銀行	2,200	4,170.00	9,174,000
滋賀銀行	109,000	563.00	61,367,000
南都銀行	13,600	2,946.00	40,065,600
百五銀行	111,200	510.00	56,712,000
京都銀行	44,200	6,450.00	285,090,000
紀陽銀行	43,600	1,830.00	79,788,000
ほくほくフィナンシャルグループ	77,100	1,641.00	126,521,100
広島銀行	171,000	847.00	144,837,000
山陰合同銀行	68,700	1,058.00	72,684,600
中国銀行	80,100	1,298.00	103,969,800
鳥取銀行	3,600	1,738.00	6,256,800
伊予銀行	165,200	859.00	141,906,800
百十四銀行	123,000	367.00	45,141,000
四国銀行	17,800	1,552.00	27,625,600
阿波銀行	93,000	732.00	68,076,000
大分銀行	6,700	4,100.00	27,470,000
宮崎銀行	7,700	3,640.00	28,028,000
佐賀銀行	7,100	2,544.00	18,062,400
十八銀行	71,000	301.00	21,371,000
沖縄銀行	11,300	4,515.00	51,019,500
琉球銀行	22,500	1,721.00	38,722,500
セブン銀行	434,400	367.00	159,424,800
みずほフィナンシャルグループ	15,737,400	199.20	3,134,890,080
高知銀行	4,100	1,303.00	5,342,300
山口フィナンシャルグループ	145,000	1,412.00	204,740,000
アクリーティブ	6,300	335.00	2,110,500
芙蓉総合リース	13,300	8,230.00	109,459,000

興銀リース	21,800	3,105.00	67,689,000
東京センチュリー	23,300	7,410.00	172,653,000
SBIホールディングス	131,000	2,921.00	382,651,000
日本証券金融	47,400	683.00	32,374,200
アイフル	194,200	374.00	72,630,800
日本アジア投資	10,400	369.00	3,837,600
長野銀行	3,900	1,808.00	7,051,200
名古屋銀行	9,400	4,155.00	39,057,000
北洋銀行	174,500	400.00	69,800,000
愛知銀行	3,900	5,240.00	20,436,000
中京銀行	4,800	2,338.00	11,222,400
大光銀行	3,800	2,428.00	9,226,400
愛媛銀行	16,200	1,294.00	20,962,800
トマト銀行	4,300	1,529.00	6,574,700
京葉銀行	102,000	511.00	52,122,000
栃木銀行	60,000	419.00	25,140,000
北日本銀行	3,600	2,971.00	10,695,600
東和銀行	20,300	1,406.00	28,541,800
福島銀行	11,000	798.00	8,778,000
大東銀行	5,600	1,372.00	7,683,200
リコーリース	9,100	3,820.00	34,762,000
イオンフィナンシャルサービス	82,200	2,745.00	225,639,000
アコム	232,800	470.00	109,416,000
ジャックス	14,100	2,480.00	34,968,000
オリエントコーポレーション	250,600	160.00	40,096,000
日立キャピタル	31,900	3,000.00	95,700,000
アプラスフィナンシャル	55,800	116.00	6,472,800
オリックス	772,700	1,971.50	1,523,378,050
三菱UFJリース	294,000	744.00	218,736,000
ジャフコ	16,600	4,835.00	80,261,000
九州リースサービス	5,000	796.00	3,980,000
トモニホールディングス	95,500	503.00	48,036,500
大和証券グループ本社	991,000	661.30	655,348,300
野村ホールディングス	1,992,700	611.40	1,218,336,780
岡三証券グループ	99,000	598.00	59,202,000
丸三証券	36,800	1,025.00	37,720,000
東洋証券	41,000	287.00	11,767,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	128,200	759.00	97,303,800
光世証券	2,800	1,423.00	3,984,400
水戸証券	34,700	410.00	14,227,000
いちよし証券	24,300	1,310.00	31,833,000
松井証券	56,700	1,052.00	59,648,400
SOMPOホールディングス	227,200	4,723.00	1,073,065,600
だいこう証券ビジネス	5,700	599.00	3,414,300
日本取引所グループ	332,400	2,085.00	693,054,000
マネックスグループ	122,700	705.00	86,503,500
カブドットコム証券	74,000	405.00	29,970,000
極東証券	15,500	1,534.00	23,777,000
岩井コスモホールディングス	11,800	1,554.00	18,337,200

藍澤證券	21,700	797.00	17,294,900
フィデアホールディングス	112,700	195.00	21,976,500
池田泉州ホールディングス	123,000	433.00	53,259,000
アニコムホールディングス	7,900	3,765.00	29,743,500
MS & A Dインシュアランスグループホールディングス	302,800	3,740.00	1,132,472,000
ソニーフィナンシャルホールディングス	95,100	2,060.00	195,906,000
マネーパートナーズグループ	14,800	454.00	6,719,200
小林洋行	3,300	290.00	957,000
第一生命ホールディングス	655,200	2,138.00	1,400,817,600
東京海上ホールディングス	436,400	5,307.00	2,315,974,800
アドバンテッジリスクマネジメント	2,800	1,393.00	3,900,400
イー・ギャランティ	6,100	2,364.00	14,420,400
アサックス	1,600	1,876.00	3,001,600
NECキャピタルソリューション	4,700	2,023.00	9,508,100
T & Dホールディングス	358,200	1,816.00	650,491,200
アドバンスクリエイト	2,700	2,034.00	5,491,800
三井不動産	578,400	2,807.00	1,623,568,800
三菱地所	862,100	2,028.50	1,748,769,850
平和不動産	20,400	2,391.00	48,776,400
東京建物	126,500	1,653.00	209,104,500
ダイビル	29,800	1,230.00	36,654,000
京阪神ビルディング	19,200	936.00	17,971,200
住友不動産	278,000	4,443.00	1,235,154,000
太平洋興発	4,900	1,050.00	5,145,000
大京	18,500	2,554.00	47,249,000
テーオーシー	40,000	978.00	39,120,000
東京楽天地	1,800	5,610.00	10,098,000
レオパレス21	138,200	940.00	129,908,000
スターツコーポレーション	15,800	3,085.00	48,743,000
フジ住宅	14,800	954.00	14,119,200
空港施設	11,700	663.00	7,757,100
明和地所	6,400	766.00	4,902,400
ゴールドクレスト	9,100	2,115.00	19,246,500
リログループ	61,300	2,575.00	157,847,500
日本エスリード	4,500	2,085.00	9,382,500
日神不動産	15,400	846.00	13,028,400
日本エスコン	20,900	814.00	17,012,600
タカラレーベン	54,200	452.00	24,498,400
サンヨーハウジング名古屋	6,000	1,228.00	7,368,000
イオンモール	74,600	2,182.00	162,777,200
ファースト住建	4,400	1,617.00	7,114,800
ランド	254,500	15.00	3,817,500
カチタス	15,800	3,555.00	56,169,000
東祥	7,000	3,870.00	27,090,000
トーセイ	14,100	1,371.00	19,331,100
穴吹興産	1,200	3,340.00	4,008,000
エヌ・ティ・ティ都市開発	72,000	1,225.00	88,200,000
サンフロンティア不動産	14,000	1,406.00	19,684,000

エフ・ジェー・ネクスト	8,900	980.00	8,722,000
インテリックス	3,300	1,099.00	3,626,700
ランドビジネス	6,900	340.00	2,346,000
グランディハウス	10,200	511.00	5,212,200
東武鉄道	123,800	3,400.00	420,920,000
相鉄ホールディングス	37,600	3,185.00	119,756,000
東京急行電鉄	319,000	1,844.00	588,236,000
京浜急行電鉄	160,900	1,834.00	295,090,600
小田急電鉄	174,700	2,362.00	412,641,400
京王電鉄	65,600	4,875.00	319,800,000
京成電鉄	81,700	3,625.00	296,162,500
富士急行	16,000	3,230.00	51,680,000
新京成電鉄	3,100	2,289.00	7,095,900
東日本旅客鉄道	210,900	10,765.00	2,270,338,500
西日本旅客鉄道	106,000	8,012.00	849,272,000
東海旅客鉄道	105,200	21,615.00	2,273,898,000
西武ホールディングス	149,700	1,821.00	272,603,700
鴻池運輸	16,600	1,961.00	32,552,600
西日本鉄道	32,600	3,010.00	98,126,000
ハマキョウレックス	8,300	3,965.00	32,909,500
サカイ引越センター	6,200	6,100.00	37,820,000
近鉄グループホールディングス	111,200	4,440.00	493,728,000
阪急阪神ホールディングス	148,300	4,295.00	636,948,500
南海電気鉄道	52,700	3,075.00	162,052,500
京阪ホールディングス	49,500	3,670.00	181,665,000
神戸電鉄	2,600	4,000.00	10,400,000
名古屋鉄道	87,900	2,788.00	245,065,200
山陽電気鉄道	8,600	2,756.00	23,701,600
トランコム	3,100	8,440.00	26,164,000
日本通運	43,700	8,290.00	362,273,000
ヤマトホールディングス	195,000	2,932.50	571,837,500
山九	28,500	5,700.00	162,450,000
日新	9,600	2,826.00	27,129,600
丸運	6,000	356.00	2,136,000
丸全昭和運輸	40,000	514.00	20,560,000
センコーグループホールディングス	66,900	918.00	61,414,200
トナミホールディングス	2,700	7,540.00	20,358,000
ニッコンホールディングス	42,300	3,085.00	130,495,500
日本石油輸送	1,300	3,340.00	4,342,000
福山通運	16,300	5,570.00	90,791,000
セイノーホールディングス	83,300	2,031.00	169,182,300
エスライン	3,000	1,224.00	3,672,000
神奈川中央交通	2,800	3,740.00	10,472,000
日立物流	24,500	3,130.00	76,685,000
丸和運輸機関	5,900	4,425.00	26,107,500
C & F ロジホールディングス	12,200	1,475.00	17,995,000
日本郵船	93,000	2,458.00	228,594,000
商船三井	70,400	3,280.00	230,912,000
川崎汽船	51,400	2,444.00	125,621,600
NSユナイテッド海運	5,200	2,264.00	11,772,800

明治海運	12,000	439.00	5,268,000
飯野海運	56,700	526.00	29,824,200
共栄タンカー	800	1,940.00	1,552,000
九州旅客鉄道	93,300	3,435.00	320,485,500
S Gホールディングス	105,000	2,405.00	252,525,000
日本航空	206,300	4,007.00	826,644,100
A N Aホールディングス	215,900	4,174.00	901,166,600
パスコ	11,000	334.00	3,674,000
西本W i s m e t t a cホールディングス	3,100	4,810.00	14,911,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	900	1,569.00	1,412,100
Genky DrugStores	4,500	4,390.00	19,755,000
三菱倉庫	38,500	2,525.00	97,212,500
三井倉庫ホールディングス	64,000	371.00	23,744,000
住友倉庫	77,000	751.00	57,827,000
澁澤倉庫	6,200	1,863.00	11,550,600
ヤマタネ	5,800	1,969.00	11,420,200
東陽倉庫	20,200	378.00	7,635,600
乾汽船	8,600	859.00	7,387,400
日本トランスシティ	27,000	529.00	14,283,000
ケイヒン	2,100	1,647.00	3,458,700
中央倉庫	6,900	1,166.00	8,045,400
川西倉庫	2,200	2,037.00	4,481,400
安田倉庫	10,000	1,000.00	10,000,000
東洋埠頭	3,200	1,731.00	5,539,200
宇徳	9,400	519.00	4,878,600
上組	68,600	2,480.00	170,128,000
サンリツ	2,800	812.00	2,273,600
キムラユニティー	3,100	1,163.00	3,605,300
キューソー流通システム	3,300	2,771.00	9,144,300
近鉄エクスプレス	21,000	2,090.00	43,890,000
東海運	6,100	402.00	2,452,200
エーアイティー	8,000	1,250.00	10,000,000
内外トランスライン	3,900	1,763.00	6,875,700
日本コンセプト	2,200	1,529.00	3,363,800
東京放送ホールディングス	63,700	2,381.00	151,669,700
日本テレビホールディングス	105,800	1,917.00	202,818,600
朝日放送グループホールディングス	11,500	840.00	9,660,000
テレビ朝日ホールディングス	31,600	2,400.00	75,840,000
スカパーJ S A Tホールディングス	87,900	502.00	44,125,800
テレビ東京ホールディングス	9,400	2,957.00	27,795,800
日本B S放送	3,900	1,506.00	5,873,400
ビジョン	3,000	3,655.00	10,965,000
USEN-NEXT HOLDINGS	2,900	1,035.00	3,001,500
ワイヤレスゲート	5,400	1,756.00	9,482,400
コネクシオ	8,200	2,150.00	17,630,000
日本通信	103,800	115.00	11,937,000
クロップス	2,400	917.00	2,200,800
日本電信電話	827,000	5,311.00	4,392,197,000

KDDI	1,037,600	2,979.50	3,091,529,200	
光通信	13,900	17,790.00	247,281,000	
NTTドコモ	827,200	2,810.50	2,324,845,600	
エムティーアイ	15,600	682.00	10,639,200	
GMOインターネット	42,000	2,472.00	103,824,000	
アйдママーケティングコミュニケーション	1,800	669.00	1,204,200	
カドカワ	33,600	1,243.00	41,764,800	
学研ホールディングス	3,900	5,020.00	19,578,000	
ゼンリン	20,800	2,505.00	52,104,000	
昭文社	5,400	844.00	4,557,600	
インプレスホールディングス	9,500	207.00	1,966,500	
東京電力ホールディングス	937,400	562.00	526,818,800	
中部電力	359,300	1,741.50	625,720,950	
関西電力	479,200	1,590.00	761,928,000	
中国電力	162,300	1,413.00	229,329,900	
北陸電力	115,000	1,104.00	126,960,000	
東北電力	275,000	1,443.00	396,825,000	
四国電力	105,700	1,384.00	146,288,800	
九州電力	259,300	1,297.00	336,312,100	
北海道電力	117,700	775.00	91,217,500	
沖縄電力	19,000	3,285.00	62,415,000	
電源開発	93,400	3,020.00	282,068,000	
エフオン	5,900	1,526.00	9,003,400	
イーレックス	18,500	1,014.00	18,759,000	
レノバ	6,000	1,112.00	6,672,000	
東京瓦斯	250,500	2,920.00	731,460,000	
大阪瓦斯	227,900	2,380.00	542,402,000	
東邦瓦斯	58,200	3,440.00	200,208,000	
北海道瓦斯	32,000	302.00	9,664,000	
広島ガス	24,400	378.00	9,223,200	
西部瓦斯	14,300	2,945.00	42,113,500	
静岡ガス	33,300	997.00	33,200,100	
メタウォーター	6,600	3,035.00	20,031,000	
アイネット	6,500	1,683.00	10,939,500	
松竹	7,600	16,090.00	122,284,000	
東宝	75,800	3,845.00	291,451,000	
エイチ・アイ・エス	17,500	3,705.00	64,837,500	
東映	4,300	12,320.00	52,976,000	
ラックランド	2,200	2,578.00	5,671,600	
エヌ・ティ・ティ・データ	358,000	1,195.00	427,810,000	
共立メンテナンス	20,000	5,240.00	104,800,000	
イチネンホールディングス	12,600	1,467.00	18,484,200	
建設技術研究所	7,800	1,450.00	11,310,000	
スペース	7,300	1,481.00	10,811,300	
長 大	3,300	794.00	2,620,200	
アインホールディングス	15,500	7,190.00	111,445,000	
燦ホールディングス	2,600	2,843.00	7,391,800	
ピー・シー・エー	1,700	1,766.00	3,002,200	
スバル興業	800	6,990.00	5,592,000	

東京テアトル	4,700	1,451.00	6,819,700
タナベ経営	2,100	2,094.00	4,397,400
ビジネスブレイン太田昭和	2,000	2,153.00	4,306,000
ナガワ	2,200	4,585.00	10,087,000
よみうりランド	2,400	4,985.00	11,964,000
東京都競馬	8,400	4,730.00	39,732,000
常磐興産	4,500	1,892.00	8,514,000
カナモト	17,100	3,715.00	63,526,500
東京ドーム	45,400	1,068.00	48,487,200
D T S	12,000	4,160.00	49,920,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	53,600	4,960.00	265,856,000
シーイーシー	6,900	3,515.00	24,253,500
カプコン	49,400	2,545.00	125,723,000
西尾レントオール	11,400	3,405.00	38,817,000
アイ・エス・ビー	2,200	2,170.00	4,774,000
アゴーラ・ホスピタリティー・グループ	62,000	36.00	2,232,000
日本空港ビルデング	33,900	4,820.00	163,398,000
トランス・コスモス	12,500	2,551.00	31,887,500
乃村工藝社	26,200	2,210.00	57,902,000
ジャステック	6,700	1,223.00	8,194,100
S C S K	26,600	5,070.00	134,862,000
藤田観光	4,500	3,240.00	14,580,000
K N T - C Tホールディングス	7,000	1,747.00	12,229,000
日本管財	12,000	2,128.00	25,536,000
トーカイ	10,800	2,425.00	26,190,000
白洋舎	1,200	3,300.00	3,960,000
セコム	119,100	8,290.00	987,339,000
日本システムウエア	3,800	2,792.00	10,609,600
セントラル警備保障	5,400	3,895.00	21,033,000
アイネス	14,600	1,162.00	16,965,200
丹青社	22,900	1,308.00	29,953,200
メイテック	13,100	5,500.00	72,050,000
T K C	9,700	4,355.00	42,243,500
富士ソフト	16,000	4,520.00	72,320,000
応用地質	12,200	1,596.00	19,471,200
船井総研ホールディングス	23,300	2,688.00	62,630,400
N S D	18,900	2,211.00	41,787,900
進学会ホールディングス	5,000	619.00	3,095,000
丸紅建材リース	11,000	244.00	2,684,000
オオバ	8,800	656.00	5,772,800
コナミホールディングス	47,100	5,460.00	257,166,000
いであ	2,200	1,134.00	2,494,800
学究社	3,100	1,794.00	5,561,400
ベネッセホールディングス	41,100	4,010.00	164,811,000
イオンディライト	13,800	3,900.00	53,820,000
ナック	7,600	934.00	7,098,400
福井コンピュータホールディングス	3,400	2,174.00	7,391,600
ニチイ学館	21,300	1,197.00	25,496,100

ダイセキ	18,800	3,430.00	64,484,000
ステップ	4,100	1,724.00	7,068,400
日鉄住金物産	9,000	6,480.00	58,320,000
泉州電業	3,800	3,135.00	11,913,000
元気寿司	2,900	3,070.00	8,903,000
トラスコ中山	24,100	2,836.00	68,347,600
ヤマダ電機	387,600	567.00	219,769,200
オートバックスセブン	46,000	2,055.00	94,530,000
モリト	9,300	1,027.00	9,551,100
アークランドサカモト	19,600	1,744.00	34,182,400
ニトリホールディングス	45,900	18,605.00	853,969,500
グルメ杵屋	8,000	1,183.00	9,464,000
愛眼	9,100	519.00	4,722,900
ケーユーホールディングス	6,100	1,079.00	6,581,900
吉野家ホールディングス	38,000	2,029.00	77,102,000
加藤産業	18,100	3,990.00	72,219,000
イノテック	10,000	1,379.00	13,790,000
イエローハット	10,900	3,370.00	36,733,000
松屋フーズ	5,600	3,820.00	21,392,000
JBC Cホールディングス	9,100	1,087.00	9,891,700
J Kホールディングス	11,700	911.00	10,658,700
サガミチェーン	15,500	1,421.00	22,025,500
日伝	9,600	2,105.00	20,208,000
関西スーパーマーケット	8,800	1,180.00	10,384,000
ミロク情報サービス	10,200	3,065.00	31,263,000
北沢産業	9,500	295.00	2,802,500
杉本商事	6,300	2,036.00	12,826,800
因幡電機産業	15,300	4,820.00	73,746,000
王将フードサービス	8,500	5,520.00	46,920,000
プレナス	12,900	1,894.00	24,432,600
ミニストップ	8,600	2,254.00	19,384,400
アークス	21,700	3,075.00	66,727,500
パローホールディングス	26,900	2,850.00	76,665,000
バイテックホールディングス	5,200	2,705.00	14,066,000
東テック	3,800	2,718.00	10,328,400
ミスミグループ本社	134,300	2,994.00	402,094,200
藤久	900	1,536.00	1,382,400
アルテック	9,900	361.00	3,573,900
ベルク	5,100	5,870.00	29,937,000
大 庄	6,200	1,743.00	10,806,600
タキヒヨー	3,700	2,371.00	8,772,700
ファーストリテイリング	15,500	49,030.00	759,965,000
ソフトバンクグループ	521,700	8,525.00	4,447,492,500
蔵王産業	1,800	1,770.00	3,186,000
スズケン	52,800	4,900.00	258,720,000
サンドラッグ	49,000	5,570.00	272,930,000
サクスパー ホールディングス	10,900	1,163.00	12,676,700
ジェコス	8,000	1,160.00	9,280,000
ヤマザワ	2,300	1,794.00	4,126,200
やまや	2,400	4,125.00	9,900,000

ルネサスイーストン	10,700	699.00	7,479,300	
ペルーナ	28,400	1,310.00	37,204,000	
合計	142,822,700		301,312,473,020	

*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29年11月13日現在	平成30年5月11日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		2,313,111,095	1,988,775,800
国債証券		301,041,126,500	290,627,546,700
地方債証券		22,954,411,775	22,658,063,076
特殊債券		16,334,116,258	15,516,434,818
社債券		16,917,704,390	16,026,105,180
未収入金		2,883,206,000	-
未収利息		904,146,836	809,938,365
前払費用		8,471,568	24,892,827
流動資産合計		363,356,294,422	347,651,756,766
資産合計		363,356,294,422	347,651,756,766
負債の部			
流動負債			
未払解約金		515,123,000	373,616,000
流動負債合計		515,123,000	373,616,000
負債合計		515,123,000	373,616,000
純資産の部			
元本等			
元本	1	282,771,174,063	269,185,605,606
剰余金			
剰余金又は欠損金()		80,069,997,359	78,092,535,160
元本等合計		362,841,171,422	347,278,140,766
純資産合計		362,841,171,422	347,278,140,766
負債純資産合計		363,356,294,422	347,651,756,766

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29年11月13日現在	平成30年5月11日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	291,419,816,577円	282,771,174,063円
同期中追加設定元本額	31,212,825,157円	27,550,963,484円
同期中一部解約元本額	39,861,467,671円	41,136,531,941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	13,582,461,476円	15,598,860,674円
M I T O ラップ型ファンド（安定型）	137,392,721円	124,116,436円
M I T O ラップ型ファンド（中立型）	113,383,186円	102,006,320円
M I T O ラップ型ファンド（積極型）	37,379,884円	30,584,053円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	399,553,382円	733,362,875円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	130,264,867円	216,723,104円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	25,863,953円	30,402,668円
たわらノーロード 国内債券	2,492,228,054円	3,595,522,441円
たわらノーロード 国内債券<ラップ向け>	754,493円	- 円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	14,185,082円	47,742,844円
たわらノーロード バランス（堅実型）	276,265円	10,353,709円
たわらノーロード バランス（標準型）	128,405円	17,145,514円
たわらノーロード バランス（積極型）	19,456円	4,141,838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）	- 円	1,658,790円
たわらノーロード スマートグローバル バランス（安定型）	- 円	29,546,022円
たわらノーロード スマートグローバル バランス（安定成長型）	- 円	25,592,861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）	- 円	6,916,307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）	- 円	2,956,119円
たわらノーロード 最適化バランス（保守型）	- 円	1,016,630円
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	- 円	579,598円

たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	- 円	1,753,827円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	- 円	559,116円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	- 円	79,435円
D I A M国内債券インデックスファンド < D C年金>	12,455,964,838円	12,607,384,154円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金 > 1 安定型	5,414,558,254円	5,598,395,303円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金 > 2 安定・成長型	7,718,191,994円	8,135,597,016円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金 > 3 成長型	3,112,094,582円	3,289,762,067円
D I A M D C バランス30インデックス ファンド	1,791,334,838円	1,808,465,812円
D I A M D C バランス50インデックス ファンド	1,956,668,822円	1,996,377,001円
D I A M D C バランス70インデックス ファンド	289,853,764円	306,027,282円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配 型>	94,481,065円	92,933,808円
マネックス資産設計ファンド< 育成型>	2,247,561,238円	2,325,174,416円
マネックス資産設計ファンド エボ リューション	3,002,910円	4,808,536円
D I A M D C 8資産バランスファン ド(新興国10)	452,104,533円	490,583,551円
D I A M D C 8資産バランスファン ド(新興国20)	398,357,572円	464,876,624円
D I A M D C 8資産バランスファン ド(新興国30)	92,377,260円	110,016,730円
投資のソムリエ	3,657,776,875円	3,656,031,803円
クルーズコントロール	3,854,894,075円	2,834,062,140円
投資のソムリエ< D C年金>	220,685,529円	268,031,454円
D I A M 8資産バランスファンドN< D C年金>	1,692,091,176円	1,980,355,404円
D I A M D C バランス・F(成長 型)	199,963,893円	253,806,585円
クルーズコントロール< D C年金>	1,400,231円	1,114,497円
D I A Mコア資産設計ファンド(堅実 型)	8,453,236円	6,154,733円
D I A Mコア資産設計ファンド(積極 型)	21,666,572円	19,225,839円
投資のソムリエ< D C年金>リスク抑制 型	282,200,625円	176,425,685円
ダイナミック・ナビゲーション	573,960円	1,755,737円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	3,562,552,048円	3,221,779,389円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2 045)	393,977円	627,563円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2 055)	393,982円	456,439円
リスク抑制世界8資産バランスファンド (D C)	985,340円	855,190円

投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	- 円	1,175,568円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	- 円	26,234,067円
DIAM高金利通貨ファンド	9,608,918円	9,608,918円
DIAMエマージング債券ファンド	9,450,010円	9,450,010円
DIAM国内債券バッシブファンド(適格機関投資家向け)	24,583,143,279円	22,723,464,052円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	502,069,944円	485,649,448円
DIAMグローバル・バランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	367,871,895円	320,103,315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)	265,361,361円	243,509,098円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	91,582,484円	78,509,133円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	266,715,409円	222,528,168円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	107,677,627円	90,211,759円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	72,926,294円	54,372,232円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	116,619,575円	95,409,492円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	196,166,577円	174,179,313円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	6,426,874,390円	5,870,917,190円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	3,424,808,621円	3,129,834,212円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	6,172,821,396円	5,740,432,872円
DIAMグローバル・アセット・バランスVA(適格機関投資家限定)	674,156,441円	618,042,639円
DIAMグローバル・アセット・バランスVA2(適格機関投資家限定)	659,232,074円	399,653,062円
DIAM 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)	4,010,392,272円	3,619,290,870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)	5,129,027,145円	2,324,817,852円
DIAMグローバル 私募ファンド(適格機関投資家向け)	194,752,933円	194,752,933円
DIAM世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	759,080,771円	89,083,194円
DIAM世界バランスファンド35VA(適格機関投資家限定)	3,132,896,738円	787,267,774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)	88,398,213,822円	83,941,520,860円
DIAM世界アセットバランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	1,183,446,263円	1,130,706,610円
DIAM世界アセットバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	7,561,862,650円	7,174,047,118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)	28,714,751,865円	27,520,466,627円
D I A Mバランス30 V A (適格機関投 資家限定)	54,951,317円	79,617,622円
D I A Mバランス50 V A (適格機関投 資家限定)	25,881,509円	2,035,295円
D I A Mバランス70 V A (適格機関投 資家限定)	8,099,036円	7,738,785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)	31,952,181,043円	30,635,457,140円
D I A M世界バランス25 V A (適格機 関投資家限定)	509,077,340円	484,884,038円
D I A M国内バランス30 V A (適格機 関投資家限定)	140,005,568円	135,640,228円
D I A Mバランス20 V A (適格機関投 資家限定)	584,126,633円	531,188,226円
D I A Mバランス40 V A (適格機関投 資家限定)	484,523円	715,639円
D I A Mバランス60 V A (適格機関投 資家限定)	381,927円	384,308円
計	282,771,174,063円	269,185,605,606円
2 . 受益権の総数	282,771,174,063口	269,185,605,606口

（金融商品に関する注記）

1．金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成29年5月12日 至 平成29年11月13日	自 平成29年11月14日 至 平成30年5月11日
1． 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2． 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、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。	同左
3． 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成29年11月13日現在	平成30年5月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 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）

売買目的有価証券

種類	平成29年11月13日現在	平成30年5月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
国債証券	511,829,800	518,639,900
地方債証券	95,946,058	27,977,979
特殊債証券	87,651,133	22,865,043
社債証券	94,571,080	30,471,070
合計	233,661,529	437,325,808

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成29年2月15日から平成29年11月13日まで及び平成30年2月15日から平成30年5月11日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

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29年11月13日現在	平成30年5月11日現在
1口当たり純資産額	1.2832円	1.2901円
（1万口当たり純資産額）	(12,832円)	(12,901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5月11日現在

種 類	銘 柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
国債証券	378回 利付国庫債券(2年)	1,000,000,000	1,002,810,000	
	379回 利付国庫債券(2年)	1,500,000,000	1,504,515,000	
	381回 利付国庫債券(2年)	1,000,000,000	1,003,410,000	
	386回 利付国庫債券(2年)	1,000,000,000	1,004,410,000	
	118回 利付国庫債券(5年)	3,700,000,000	3,713,875,000	
	120回 利付国庫債券(5年)	1,500,000,000	1,506,810,000	
	121回 利付国庫債券(5年)	2,000,000,000	2,006,360,000	
	122回 利付国庫債券(5年)	4,000,000,000	4,014,760,000	
	123回 利付国庫債券(5年)	3,000,000,000	3,012,510,000	
	124回 利付国庫債券(5年)	4,000,000,000	4,018,960,000	
	125回 利付国庫債券(5年)	3,000,000,000	3,015,930,000	
	126回 利付国庫債券(5年)	2,500,000,000	2,514,675,000	
	127回 利付国庫債券(5年)	3,000,000,000	3,019,290,000	
	128回 利付国庫債券(5年)	3,000,000,000	3,021,000,000	
	129回 利付国庫債券(5年)	2,070,000,000	2,085,669,900	
	130回 利付国庫債券(5年)	3,000,000,000	3,023,880,000	
	131回 利付国庫債券(5年)	2,020,000,000	2,036,786,200	
	132回 利付国庫債券(5年)	2,000,000,000	2,017,300,000	
	133回 利付国庫債券(5年)	2,860,000,000	2,886,254,800	
	134回 利付国庫債券(5年)	1,790,000,000	1,807,380,900	
	2回 利付国庫債券(40年)	600,000,000	837,900,000	
	3回 利付国庫債券(40年)	600,000,000	842,058,000	
	4回 利付国庫債券(40年)	670,000,000	944,720,100	
	5回 利付国庫債券(40年)	700,000,000	949,018,000	
	6回 利付国庫債券(40年)	700,000,000	930,111,000	
	7回 利付国庫債券(40年)	800,000,000	1,014,720,000	
	8回 利付国庫債券(40年)	900,000,000	1,058,193,000	
	9回 利付国庫債券(40年)	1,210,000,000	1,031,900,100	
	10回 利付国庫債券(40年)	1,140,000,000	1,149,929,400	
	301回 利付国庫債券(10年)	2,300,000,000	2,341,607,000	
	303回 利付国庫債券(10年)	1,300,000,000	1,327,144,000	
	305回 利付国庫債券(10年)	2,500,000,000	2,557,600,000	
	306回 利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,542,540,000	
	308回 利付国庫債券(10年)	800,000,000	824,104,000	
	309回 利付国庫債券(10年)	1,000,000,000	1,025,910,000	
	310回 利付国庫債券(10年)	2,300,000,000	2,361,065,000	
	311回 利付国庫債券(10年)	2,020,000,000	2,064,096,600	
	312回 利付国庫債券(10年)	2,200,000,000	2,276,098,000	
	313回 利付国庫債券(10年)	1,790,000,000	1,862,924,600	
	315回 利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,562,115,000	

316回	利付国庫債券(10年)	500,000,000	519,150,000
317回	利付国庫債券(10年)	1,000,000,000	1,041,250,000
318回	利付国庫債券(10年)	1,000,000,000	1,037,880,000
319回	利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,566,210,000
320回	利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,560,780,000
321回	利付国庫債券(10年)	2,500,000,000	2,607,775,000
324回	利付国庫債券(10年)	2,000,000,000	2,074,980,000
325回	利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,559,025,000
326回	利付国庫債券(10年)	500,000,000	518,495,000
327回	利付国庫債券(10年)	1,450,000,000	1,510,334,500
328回	利付国庫債券(10年)	1,890,000,000	1,954,940,400
329回	利付国庫債券(10年)	2,270,000,000	2,374,124,900
330回	利付国庫債券(10年)	1,200,000,000	1,257,444,000
332回	利付国庫債券(10年)	2,210,000,000	2,295,217,600
333回	利付国庫債券(10年)	2,000,000,000	2,079,920,000
334回	利付国庫債券(10年)	2,100,000,000	2,186,205,000
335回	利付国庫債券(10年)	2,000,000,000	2,072,080,000
336回	利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,555,680,000
337回	利付国庫債券(10年)	1,300,000,000	1,331,018,000
338回	利付国庫債券(10年)	2,400,000,000	2,475,072,000
339回	利付国庫債券(10年)	2,250,000,000	2,322,157,500
340回	利付国庫債券(10年)	2,500,000,000	2,582,075,000
341回	利付国庫債券(10年)	3,060,000,000	3,139,315,200
342回	利付国庫債券(10年)	3,000,000,000	3,030,660,000
343回	利付国庫債券(10年)	3,000,000,000	3,029,190,000
344回	利付国庫債券(10年)	3,500,000,000	3,532,165,000
345回	利付国庫債券(10年)	3,500,000,000	3,530,100,000
346回	利付国庫債券(10年)	3,000,000,000	3,023,850,000
347回	利付国庫債券(10年)	3,500,000,000	3,527,020,000
348回	利付国庫債券(10年)	3,360,000,000	3,385,065,600
349回	利付国庫債券(10年)	1,910,000,000	1,922,797,000
350回	利付国庫債券(10年)	450,000,000	452,646,000
1回	利付国庫債券(30年)	100,000,000	130,383,000
2回	利付国庫債券(30年)	100,000,000	126,541,000
3回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	251,496,000
4回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	267,758,000
5回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	252,022,000
6回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	258,604,000
7回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	385,368,000
8回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	243,964,000
11回	利付国庫債券(30年)	400,000,000	483,696,000
12回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	380,934,000
13回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	376,857,000
14回	利付国庫債券(30年)	500,000,000	659,860,000
15回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	267,580,000
16回	利付国庫債券(30年)	400,000,000	536,340,000
17回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	265,582,000
18回	利付国庫債券(30年)	820,000,000	1,076,979,800
19回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	263,352,000
20回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	405,519,000

21回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	396,012,000	
22回	利付国庫債券(30年)	470,000,000	637,616,100	
23回	利付国庫債券(30年)	600,000,000	815,430,000	
24回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	408,414,000	
25回	利付国庫債券(30年)	400,000,000	530,668,000	
26回	利付国庫債券(30年)	700,000,000	942,907,000	
27回	利付国庫債券(30年)	700,000,000	958,027,000	
28回	利付国庫債券(30年)	900,000,000	1,235,061,000	
29回	利付国庫債券(30年)	900,000,000	1,222,668,000	
30回	利付国庫債券(30年)	900,000,000	1,209,294,000	
31回	利付国庫債券(30年)	900,000,000	1,195,182,000	
32回	利付国庫債券(30年)	1,100,000,000	1,488,542,000	
33回	利付国庫債券(30年)	1,300,000,000	1,683,604,000	
34回	利付国庫債券(30年)	1,200,000,000	1,610,076,000	
35回	利付国庫債券(30年)	1,300,000,000	1,693,601,000	
36回	利付国庫債券(30年)	1,300,000,000	1,697,423,000	
37回	利付国庫債券(30年)	1,400,000,000	1,800,106,000	
38回	利付国庫債券(30年)	900,000,000	1,139,706,000	
39回	利付国庫債券(30年)	800,000,000	1,031,376,000	
40回	利付国庫債券(30年)	610,000,000	772,778,500	
41回	利付国庫債券(30年)	610,000,000	758,913,200	
42回	利付国庫債券(30年)	800,000,000	995,816,000	
43回	利付国庫債券(30年)	800,000,000	996,336,000	
44回	利付国庫債券(30年)	800,000,000	997,976,000	
45回	利付国庫債券(30年)	870,000,000	1,043,634,600	
46回	利付国庫債券(30年)	900,000,000	1,079,811,000	
47回	利付国庫債券(30年)	1,000,000,000	1,224,540,000	
48回	利付国庫債券(30年)	690,000,000	811,122,600	
49回	利付国庫債券(30年)	990,000,000	1,163,764,800	
50回	利付国庫債券(30年)	1,000,000,000	1,024,490,000	
51回	利付国庫債券(30年)	1,100,000,000	985,105,000	
52回	利付国庫債券(30年)	1,100,000,000	1,039,346,000	
53回	利付国庫債券(30年)	820,000,000	794,768,600	
54回	利付国庫債券(30年)	900,000,000	918,288,000	
55回	利付国庫債券(30年)	980,000,000	998,855,200	
56回	利付国庫債券(30年)	900,000,000	916,335,000	
57回	利付国庫債券(30年)	930,000,000	945,837,900	
58回	利付国庫債券(30年)	430,000,000	436,841,300	
43回	利付国庫債券(20年)	860,000,000	895,389,000	
45回	利付国庫債券(20年)	900,000,000	942,210,000	
46回	利付国庫債券(20年)	500,000,000	524,610,000	
47回	利付国庫債券(20年)	950,000,000	1,002,193,000	
48回	利付国庫債券(20年)	500,000,000	534,305,000	
50回	利付国庫債券(20年)	780,000,000	825,247,800	
51回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	639,726,000	
52回	利付国庫債券(20年)	550,000,000	591,239,000	
54回	利付国庫債券(20年)	700,000,000	758,625,000	
55回	利付国庫債券(20年)	810,000,000	876,282,300	
57回	利付国庫債券(20年)	1,130,000,000	1,223,575,300	
58回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	652,608,000	

60回	利付国庫債券(20年)	590,000,000	630,922,400
61回	利付国庫債券(20年)	800,000,000	842,672,000
62回	利付国庫債券(20年)	800,000,000	836,696,000
64回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	664,050,000
65回	利付国庫債券(20年)	1,100,000,000	1,222,573,000
67回	利付国庫債券(20年)	870,000,000	970,946,100
70回	利付国庫債券(20年)	750,000,000	863,242,500
72回	利付国庫債券(20年)	1,250,000,000	1,421,737,500
73回	利付国庫債券(20年)	790,000,000	897,282,000
75回	利付国庫債券(20年)	440,000,000	504,842,800
78回	利付国庫債券(20年)	890,000,000	1,013,318,400
81回	利付国庫債券(20年)	240,000,000	276,108,000
83回	利付国庫債券(20年)	780,000,000	906,945,000
85回	利付国庫債券(20年)	1,040,000,000	1,213,804,800
88回	利付国庫債券(20年)	1,200,000,000	1,425,900,000
90回	利付国庫債券(20年)	1,200,000,000	1,421,712,000
92回	利付国庫債券(20年)	1,300,000,000	1,534,182,000
93回	利付国庫債券(20年)	700,000,000	823,158,000
94回	利付国庫債券(20年)	800,000,000	947,824,000
95回	利付国庫債券(20年)	1,200,000,000	1,449,216,000
97回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,684,928,000
99回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,677,480,000
100回	利付国庫債券(20年)	1,300,000,000	1,575,483,000
102回	利付国庫債券(20年)	1,060,000,000	1,310,350,800
105回	利付国庫債券(20年)	1,300,000,000	1,572,870,000
107回	利付国庫債券(20年)	1,500,000,000	1,820,460,000
109回	利付国庫債券(20年)	1,320,000,000	1,578,390,000
111回	利付国庫債券(20年)	1,170,000,000	1,441,346,400
112回	利付国庫債券(20年)	400,000,000	488,372,000
113回	利付国庫債券(20年)	1,500,000,000	1,836,765,000
114回	利付国庫債券(20年)	1,500,000,000	1,841,970,000
116回	利付国庫債券(20年)	1,140,000,000	1,417,031,400
117回	利付国庫債券(20年)	550,000,000	677,226,000
118回	利付国庫債券(20年)	1,000,000,000	1,222,790,000
119回	利付国庫債券(20年)	900,000,000	1,079,064,000
121回	利付国庫債券(20年)	1,500,000,000	1,820,580,000
123回	利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	2,111,332,000
125回	利付国庫債券(20年)	970,000,000	1,219,134,800
128回	利付国庫債券(20年)	700,000,000	855,197,000
129回	利付国庫債券(20年)	700,000,000	846,223,000
130回	利付国庫債券(20年)	1,500,000,000	1,816,860,000
132回	利付国庫債券(20年)	1,260,000,000	1,511,281,800
133回	利付国庫債券(20年)	510,000,000	618,874,800
134回	利付国庫債券(20年)	900,000,000	1,094,049,000
135回	利付国庫債券(20年)	800,000,000	961,064,000
137回	利付国庫債券(20年)	690,000,000	830,235,600
138回	利付国庫債券(20年)	340,000,000	399,795,800
139回	利付国庫債券(20年)	100,000,000	118,955,000
140回	利付国庫債券(20年)	1,600,000,000	1,928,128,000
141回	利付国庫債券(20年)	1,100,000,000	1,326,578,000

142回	利付国庫債券(20年)	250,000,000	305,237,500	
143回	利付国庫債券(20年)	1,270,000,000	1,515,478,300	
144回	利付国庫債券(20年)	260,000,000	306,532,200	
145回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,692,936,000	
146回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,693,888,000	
147回	利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	2,032,418,000	
148回	利付国庫債券(20年)	1,300,000,000	1,534,858,000	
149回	利付国庫債券(20年)	1,670,000,000	1,973,255,300	
150回	利付国庫債券(20年)	1,500,000,000	1,750,380,000	
151回	利付国庫債券(20年)	1,560,000,000	1,770,834,000	
152回	利付国庫債券(20年)	1,300,000,000	1,474,642,000	
153回	利付国庫債券(20年)	1,700,000,000	1,955,850,000	
154回	利付国庫債券(20年)	1,500,000,000	1,700,235,000	
155回	利付国庫債券(20年)	1,600,000,000	1,759,312,000	
156回	利付国庫債券(20年)	1,500,000,000	1,493,775,000	
157回	利付国庫債券(20年)	1,300,000,000	1,246,635,000	
158回	利付国庫債券(20年)	1,500,000,000	1,513,995,000	
159回	利付国庫債券(20年)	1,420,000,000	1,455,301,200	
160回	利付国庫債券(20年)	1,300,000,000	1,352,936,000	
161回	利付国庫債券(20年)	1,140,000,000	1,163,928,600	
162回	利付国庫債券(20年)	1,200,000,000	1,222,248,000	
163回	利付国庫債券(20年)	1,210,000,000	1,230,497,400	
164回	利付国庫債券(20年)	460,000,000	458,344,000	
国債証券 合計		265,010,000,000	290,627,546,700	
地方債証券	680回	東京都公募公債	200,000,000	205,044,000
	685回	東京都公募公債	500,000,000	511,580,000
	688回	東京都公募公債	200,000,000	204,286,000
	697回	東京都公募公債	500,000,000	516,830,000
	701回	東京都公募公債	700,000,000	722,638,000
	708回	東京都公募公債	500,000,000	517,750,000
	720回	東京都公募公債	300,000,000	312,777,000
	726回	東京都公募公債	400,000,000	415,332,000
	5回	東京都公募公債 20年	100,000,000	113,917,000
	9回	東京都公募公債 20年	200,000,000	237,522,000
	10回	東京都公募公債 20年	300,000,000	354,996,000
	21年度6回	北海道公募公債	200,000,000	204,076,000
	22年度12回	北海道公募公債	200,000,000	206,842,000
	166回	神奈川県公募公債	300,000,000	305,430,000
	194回	神奈川県公募公債	300,000,000	310,440,000
	208回	神奈川県公募公債	300,000,000	308,778,000
	336回	大阪府公募公債	200,000,000	205,388,000
	345回	大阪府公募公債	300,000,000	309,675,000
	356回	大阪府公募公債	200,000,000	207,472,000
	364回	大阪府公募公債	300,000,000	309,771,000
	374回	大阪府公募公債	300,000,000	313,770,000
	26年度11回	京都府公募公債	350,000,000	359,107,000
	26年度17回	兵庫県公募公債	200,000,000	204,930,000
	1回	兵庫県公募公債(12年)	300,000,000	318,651,000
	21年度5回	静岡県公募公債	197,000,000	200,737,090
	22年度8回	静岡県公募公債	200,000,000	204,712,000

23年度9回 静岡県公募公債	200,000,000	207,222,000	
1回 静岡県公募公債 20年	100,000,000	115,194,000	
22年度6回 愛知県公募公債	200,000,000	205,092,000	
23年度20回 愛知県公募公債	500,000,000	520,505,000	
25年度4回 愛知県公募公債	300,000,000	312,279,000	
22年度1回 広島県公募公債	200,000,000	205,474,000	
23年度2回 埼玉県公募公債	200,000,000	207,066,000	
26年度5回 埼玉県公募公債	400,000,000	413,380,000	
21年度3回 福岡県公募公債	200,000,000	203,936,000	
25年度11回 福岡県公募公債	200,000,000	207,324,000	
21年度6回 千葉県公募公債	200,000,000	203,794,000	
24年度7回 千葉県公募公債	300,000,000	309,747,000	
25年度5回 千葉県公募公債	200,000,000	208,336,000	
80回 共同発行市場公募地方債	200,000,000	204,656,000	
94回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,276,000	
99回 共同発行市場公募地方債	700,000,000	725,018,000	
106回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	310,512,000	
109回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	520,260,000	
111回 共同発行市場公募地方債	700,000,000	724,913,000	
119回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	518,260,000	
121回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	513,180,000	
126回 共同発行市場公募地方債	793,900,000	826,243,486	
127回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	517,140,000	
128回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	310,023,000	
137回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	515,330,000	
139回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	515,045,000	
142回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	508,665,000	
144回 共同発行市場公募地方債	400,000,000	410,516,000	
146回 共同発行市場公募地方債	400,000,000	412,940,000	
148回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	516,200,000	
166回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	501,070,000	
488回 名古屋市公募公債 10年	450,000,000	464,868,000	
4回 京都市公募公債 20年	100,000,000	119,624,000	
22年度3回 横浜市公募公債	200,000,000	205,360,000	
22年度5回 横浜市公募公債	200,000,000	206,382,000	
23年度4回 横浜市公募公債	450,000,000	466,087,500	
25年度2回 横浜市公募公債	400,000,000	417,408,000	
25年度4回 札幌市公募公債	200,000,000	207,696,000	
2回 川崎市公募公債 15年	100,000,000	103,382,000	
21年度2回 北九州市公募公債	200,000,000	204,312,000	
23年度1回 千葉市公募公債	200,000,000	207,896,000	
地方債証券 合計	21,840,900,000	22,658,063,076	
特殊債券			
26回 高速道路機構債	200,000,000	272,506,000	
96回 高速道路機構債	700,000,000	722,568,000	
116回 高速道路機構債	100,000,000	103,372,000	
9回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	105,552,000	
18回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	322,179,000	

8 2 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	101,731,000	
8 9 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	305,541,000	
1 2 1 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	593,060,000	
1 4 9 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	400,000,000	414,744,000	
1 8 0 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	1,000,000,000	1,034,980,000	
1 8 9 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	513,750,000	
1 9 3 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	522,915,000	
1 9 5 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	330,000,000	345,876,300	
2 4 1 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	514,255,000	
3 0 9 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	800,000,000	802,640,000	
2 8 回 日本道路・機構承継債	400,000,000	538,468,000	
3 回 政保地方公共団体金融機構債券	101,000,000	102,955,360	
5 回 地方公共団体金融機構債券	500,000,000	509,960,000	
8 回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	306,768,000	
1 0 回 政保地方公共団体金融機構債券	500,000,000	512,230,000	
1 5 回 政保地方公共団体金融機構債券	200,000,000	204,660,000	
2 0 回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	309,954,000	
2 4 回 地方公共団体金融機構債券	300,000,000	310,653,000	
1 9 回 政保地方公共団体金融機構債券	200,000,000	237,832,000	
3 6 回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	311,253,000	
4 4 回 政保地方公共団体金融機構債券	400,000,000	416,084,000	
5 0 回 政保地方公共団体金融機構債券	500,000,000	523,700,000	
5 6 回 政保地方公共団体金融機構債券	542,000,000	564,894,080	
6 4 回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	309,840,000	
3 7 回 住宅金融支援機構債券	300,000,000	305,595,000	
3 9 回 住宅金融支援機構債券	200,000,000	241,064,000	
7 5 回 住宅金融支援機構債券	350,000,000	424,893,000	
6 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	46,809,000	49,479,453	
8 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	32,974,000	34,875,280	
9 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	49,452,000	52,354,832	
2 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	52,164,000	55,524,926	
1 3 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	20,067,000	20,749,478	
1 4 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	100,940,000	103,812,752	
4 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	30,879,000	31,059,024	
4 3 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	17,647,000	18,750,819	
4 4 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	67,260,000	71,381,692	
5 1 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	49,917,000	52,746,794	
1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,940,000	89,294,024	

	29回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	173,650,000	186,470,579	
	36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	305,104,000	323,660,425	
	い第769号 利付商工債	200,000,000	200,348,000	
	い第779号 利付商工債	200,000,000	200,470,000	
	302回 利附信金中金債	300,000,000	300,822,000	
	325回 利附信金中金債	400,000,000	399,352,000	
	55回 鉄道建設運輸施設債	500,000,000	518,810,000	
特殊債券 合計		14,654,803,000	15,516,434,818	
社債券	337回 東京交通債	200,000,000	212,398,000	
	27回 ラボバンク・ネダーランド円貨社債	200,000,000	200,922,000	
	22回 中日本高速道路債券	300,000,000	306,999,000	
	7回 キリンホールディングス社債	100,000,000	102,265,000	
	9回 日本たばこ産業社債	200,000,000	200,552,000	
	41回 住友化学社債	100,000,000	102,192,000	
	19回 三菱ケミカルホールディングス社債	100,000,000	101,367,000	
	6回 JXホールディングス社債	100,000,000	104,403,000	
	8回 プリヂストン社債	200,000,000	200,524,000	
	23回 ジェイ エフ イー ホールディングス社債	100,000,000	99,723,000	
	30回 豊田自動織機社債	200,000,000	199,746,000	
	12回 パナソニック社債	200,000,000	201,066,000	
	13回 パナソニック社債	100,000,000	101,566,000	
	56回 日産自動車社債	100,000,000	100,805,000	
	14回 トヨタ自動車社債	200,000,000	208,090,000	
	16回 トヨタ自動車社債	200,000,000	205,626,000	
	94回 丸紅社債	100,000,000	104,028,000	
	45回 住友商事社債	100,000,000	103,368,000	
	47回 住友商事社債	100,000,000	103,109,000	
	48回 クレディセゾン社債	100,000,000	103,653,000	
	57回 東京三菱銀行社債	200,000,000	218,742,000	
	7回 東京三菱銀行劣後社債	200,000,000	206,398,000	
	25回 三菱東京UFJ銀行劣後社債	200,000,000	205,718,000	
	28回 三菱東京UFJ銀行劣後社債	200,000,000	207,488,000	
	32回 三菱東京UFJ銀行劣後社債	300,000,000	312,891,000	
	6回 りそな銀行劣後社債	100,000,000	103,491,000	
	7回 三菱UFJ信託銀行劣後債	200,000,000	205,902,000	
	9回 三菱UFJ信託銀行劣後債	100,000,000	104,303,000	
	12回 住友信託銀行劣後債	100,000,000	102,989,000	
	10回 三井住友信託銀行社債	200,000,000	204,602,000	
	10回 セブン銀行社債	100,000,000	103,303,000	
	20回 三井住友銀行劣後社債	200,000,000	205,024,000	
	22回 三井住友銀行劣後社債	200,000,000	206,010,000	
	23回 三井住友銀行劣後社債	400,000,000	414,988,000	
	14回 みずほ銀行劣後特約付社債	200,000,000	205,560,000	
	15回 トヨタファイナンス社債	200,000,000	207,592,000	
	47回 日立キャピタル社債	200,000,000	205,654,000	
	164回 オリックス社債	100,000,000	101,248,000	
	14回 大和証券グループ本社社債	100,000,000	102,164,000	

26回	野村ホールディングス社債	100,000,000	103,378,000	
42回	野村ホールディングス社債	200,000,000	204,602,000	
46回	野村ホールディングス社債	200,000,000	200,802,000	
38回	三井不動産社債	200,000,000	205,024,000	
72回	三菱地所社債	100,000,000	112,825,000	
96回	三菱地所社債	200,000,000	203,548,000	
87回	住友不動産社債	100,000,000	101,159,000	
15回	東日本旅客鉄道社債	300,000,000	317,991,000	
19回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	108,667,000	
21回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	108,408,000	
39回	東日本旅客鉄道社債	300,000,000	340,095,000	
42回	東日本旅客鉄道社債	200,000,000	228,448,000	
9回	西日本旅客鉄道社債	200,000,000	217,066,000	
10回	西日本旅客鉄道社債	300,000,000	330,771,000	
5回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	104,413,000	
6回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	108,718,000	
11回	東海旅客鉄道社債	300,000,000	314,529,000	
13回	東海旅客鉄道社債	200,000,000	221,122,000	
14回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	112,060,000	
4回	東京地下鉄社債	120,000,000	141,084,000	
60回	日本電信電話社債	300,000,000	309,111,000	
496回	中部電力社債	500,000,000	513,060,000	
518回	中部電力社債	200,000,000	200,018,000	
377回	中国電力社債	400,000,000	418,956,000	
379回	中国電力社債	300,000,000	304,452,000	
260回	北陸電力社債	100,000,000	104,600,000	
301回	北陸電力社債	100,000,000	104,668,000	
307回	北陸電力社債	100,000,000	105,769,000	
471回	東北電力社債	400,000,000	420,132,000	
473回	東北電力社債	300,000,000	304,314,000	
253回	四国電力社債	200,000,000	208,104,000	
423回	九州電力社債	200,000,000	202,526,000	
424回	九州電力社債	200,000,000	210,512,000	
426回	九州電力社債	400,000,000	417,744,000	
320回	北海道電力社債	200,000,000	202,844,000	
321回	北海道電力社債	161,000,000	166,857,180	
340回	北海道電力社債	300,000,000	301,470,000	
13回	電源開発社債	200,000,000	224,318,000	
38回	電源開発社債	300,000,000	312,102,000	
23回	東京瓦斯社債	300,000,000	313,566,000	
18回	大阪ガス社債	100,000,000	106,263,000	
27回	NTTデータ社債	100,000,000	103,540,000	
社債券	合計	15,381,000,000	16,026,105,180	
合計		316,886,703,000	344,828,149,774	

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29年11月13日現在	平成30年5月11日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		282,091,256	546,669,355
投資証券		34,418,139,900	34,917,908,695
派生商品評価勘定		-	29,819,992
未収入金		-	679,730
未収配当金		255,322,949	299,234,506
前払金		15,161,344	-
差入委託証拠金		6,189,056	10,316,592
流動資産合計		34,976,904,505	35,804,628,870
資産合計		34,976,904,505	35,804,628,870
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		14,905,344	-
前受金		-	28,415,992
未払金		-	75,926,386
未払解約金		659,500	3,932,600
流動負債合計		15,564,844	108,274,978
負債合計		15,564,844	108,274,978
純資産の部			
元本等			
元本	1	21,317,986,006	19,649,416,832
剰余金			
剰余金又は欠損金()		13,643,353,655	16,046,937,060
元本等合計		34,961,339,661	35,696,353,892
純資産合計		34,961,339,661	35,696,353,892
負債純資産合計		34,976,904,505	35,804,628,870

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29年11月13日現在	平成30年5月11日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	16,539,891,882円	21,317,986,006円
同期中追加設定元本額	8,656,355,492円	7,818,240,858円
同期中一部解約元本額	3,878,261,368円	9,486,810,032円
元本の内訳		
ファンド名		
MITO ラップ型ファンド(安定型)	378,730円	336,199円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	969,763円	878,816円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	2,693,309円	2,268,214円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	1,061,683円	1,960,395円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	1,097,470円	2,801,841円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	1,846,629円	2,493,917円
たわらノーロード 国内リート	964,490,504円	1,209,652,777円
たわらノーロード 国内リート<ラップ向け>	235,471,745円	337,646,675円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	11,498,818円	35,636,566円
たわらノーロード バランス(堅実型)	12,102円	417,541円
たわらノーロード バランス(標準型)	60,508円	7,444,866円
たわらノーロード バランス(積極型)	78,660円	15,427,431円
たわらノーロード スマートグローバル バランス(安定型)	- 円	4,154,979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)	- 円	8,924,445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)	- 円	5,589,764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)	- 円	11,835,060円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	- 円	135,622円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	- 円	813,152円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	- 円	752,690円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	- 円	2,177,723円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	14,624,253円	14,719,897円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	344,988,477円	368,359,319円
マネックス資産設計ファンド エボ リューション	3,270,978円	3,505,986円
DIAM DC 8資産バランスファン ド(新興国10)	18,468,906円	18,269,982円
DIAM DC 8資産バランスファン ド(新興国20)	59,636,827円	64,395,954円

DIAM DC 8資産バランスファン ド(新興国30)	129,641,641円	141,346,196円
投資のソムリエ	2,343,948,244円	2,670,186,923円
投資のソムリエ<DC年金>	142,133,205円	193,635,682円
DIAM 8資産バランスファンドN< DC年金>	67,587,218円	74,022,355円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制 型	72,760,933円	76,829,494円
ダイナミック・ナビゲーション	220,134円	546,439円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	919,683,847円	1,372,205,075円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2 045)	301,976円	452,782円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2 055)	301,976円	333,150円
リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC)	251,186円	369,640円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2 035)	-円	862,712円
Jリートインデックスファンド(DC)	6,077,940円	7,449,119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)	94,456,085円	92,454,450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)	1,832,200,868円	835,168,534円
DIAM J-REITインデックス ファンド(適格機関投資家向け)	10,426,662,824円	9,926,407,294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	14,402,370円
DIAMグローバル・リスクファク ター・パリテ戦略ファンド(適格機関 投資家限定)	1,723,496,991円	1,187,943,032円
DIAMグローバル・リスクファク ター・パリテ戦略ファンドII(適格 機関投資家限定)	1,883,209,206円	934,201,774円
計	21,317,986,006円	19,649,416,832円
2. 受益権の総数	21,317,986,006口	19,649,416,832口

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成29年5月12日 至 平成29年11月13日	自 平成29年11月14日 至 平成30年5月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、不動産投信指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、不動産投資信託証券の価格の変動によるリスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成29年11月13日現在	平成30年5月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成29年11月13日現在	平成30年5月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
投資証券	2,485,925,740	489,722,335
合計	2,485,925,740	489,722,335

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成29年6月7日から平成29年11月13日まで及び平成29年6月7日から平成30年5月11日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

不動産投信関連

種類	平成29年11月13日 現在				平成30年5月11日 現在			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引								
不動産投信指数先物取引								
買 建	424,550,400	-	409,728,000	14,822,400	579,127,100	-	608,985,000	29,857,900
合計	424,550,400	-	409,728,000	14,822,400	579,127,100	-	608,985,000	29,857,900

（注）1．時価の算定方法

不動産投信指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2．先物取引の残高表示は、契約額によっております。

3．契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	平成29年11月13日現在	平成30年5月11日現在
1口当たり純資産額	1.6400円	1.8167円
（1万口当たり純資産額）	（16,400円）	（18,167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5月11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	429	49,592,400	
	GLP 投資法人	8,889	1,054,235,400	
	MCUBS MidCity 投資法人	4,778	399,918,600	
	One リート投資法人	468	115,689,600	
	いちごオフィスリート投資法人	3,316	277,217,600	
	いちごホテルリート投資法人	670	89,512,000	
	さくら総合リート投資法人	1,029	95,902,800	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	1,937	948,161,500	
	アドバンス・レジデンス投資法人	3,964	1,119,433,600	
	イオンリート投資法人	4,066	477,348,400	
	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	25,230	354,733,800	
	インヴィンシブル投資法人	11,744	587,200,000	
	オリックス不動産投資法人	8,496	1,463,011,200	
	グローバル・ワン不動産投資法人	2,719	293,108,200	
	ケネディクス・オフィス投資法人	1,252	855,116,000	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	2,178	346,302,000	
	ケネディクス商業リート投資法人	1,557	358,888,500	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	1,623	407,048,400	
	サムティ・レジデンシャル投資法人	744	72,168,000	
	ザイマックス・リート投資法人	395	45,938,500	
	ジャパン・ホテル・リート投資法人	12,359	1,009,730,300	
	ジャパンエクセレント投資法人	3,834	549,028,800	
	ジャパンリアルエステイト投資法人	4,261	2,420,248,000	
	スターアジア不動産投資法人	1,004	106,424,000	
	スターツプロシード投資法人	675	109,552,500	
	トーセイ・リート投資法人	688	77,537,600	
	ヒューリックリート投資法人	2,908	485,345,200	
	フロンティア不動産投資法人	1,457	659,292,500	
	プレミア投資法人	3,868	417,744,000	
	ヘルスケア&メディカル投資法人	528	56,337,600	
	マリモ地方創生リート投資法人	343	40,439,700	
	ユナイテッド・アーバン投資法人	9,444	1,642,311,600	
	ラサールロジポート投資法人	3,230	357,561,000	
	阪急リート投資法人	1,869	262,594,500	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	810	283,095,000		
三菱地所物流リート投資法人	397	107,666,400		
産業ファンド投資法人	4,973	603,722,200		
森トラスト・ホテルリート投資法人	927	133,488,000		
森トラスト総合リート投資法人	3,060	494,802,000		

森ヒルズリート投資法人	4,600	643,080,000	
星野リゾート・リート投資法人	677	366,934,000	
積水ハウス・リート投資法人	10,728	749,890,695	
大江戸温泉リート投資法人	719	65,357,100	
大和ハウスリート投資法人	4,982	1,292,330,800	
大和証券オフィス投資法人	923	581,490,000	
投資法人みらい	545	99,844,000	
東急リアル・エステート投資法人	2,871	420,027,300	
日本アコモデーションファンド投資法人	1,423	685,174,500	
日本ビルファンド投資法人	4,147	2,596,022,000	
日本プライムリアルティ投資法人	2,703	1,098,769,500	
日本プロロジスリート投資法人	5,707	1,317,746,300	
日本ヘルスケア投資法人	208	36,420,800	
日本リート投資法人	1,150	378,350,000	
日本リテールファンド投資法人	8,086	1,651,969,800	
日本ロジスティクスファンド投資法人	2,852	645,122,400	
日本賃貸住宅投資法人	4,816	416,102,400	
福岡リート投資法人	2,215	385,853,000	
平和不動産リート投資法人	2,667	289,636,200	
野村不動産マスターファンド投資法人	12,671	1,970,340,500	
投資証券 合計	216,809	34,917,908,695	
合計	216,809	34,917,908,695	

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29年11月13日現在	平成30年5月11日現在
資産の部			
流動資産			
預金		3,375,882,958	3,401,236,841
コール・ローン		137,090,312	269,384,127
株式		285,243,188,263	295,190,008,471
投資信託受益証券		829,228,930	854,838,833
投資証券		6,780,325,098	6,319,053,365
派生商品評価勘定		67,255,557	179,300,225
未収入金		1,569,181	12,573,545
未収配当金		343,008,643	503,986,367
差入委託証拠金		1,826,242,108	2,345,484,087
流動資産合計		298,603,791,050	309,075,865,861
資産合計		298,603,791,050	309,075,865,861
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		8,697,275	316,706
未払金		43,136,313	-
未払解約金		250,928,000	194,297,000
流動負債合計		302,761,588	194,613,706
負債合計		302,761,588	194,613,706
純資産の部			
元本等			
元本	1	87,684,015,440	89,187,362,436
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		210,617,014,022	219,693,889,719
元本等合計		298,301,029,462	308,881,252,155
純資産合計		298,301,029,462	308,881,252,155
負債純資産合計		298,603,791,050	309,075,865,861

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 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>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<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>
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 外貨建資産及び負債は、決算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

項目	平成29年11月13日現在	平成30年5月11日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	89,992,817,567円	87,684,015,440円
同期中追加設定元本額	10,307,846,735円	14,438,554,232円
同期中一部解約元本額	12,616,648,862円	12,935,207,236円
元本の内訳 ファンド名		
D I A M 外国株式パッシブ・ファンド	1,756,057,903円	2,243,257,241円
M I T O ラップ型ファンド（安定型）	2,861,225円	2,658,946円

MITO ラップ型ファンド(中立型)	6,605,497円	8,253,521円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	18,394,221円	15,893,239円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	8,347,809円	15,705,207円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	7,605,219円	17,780,776円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	12,727,987円	15,817,157円
たわらノーロード 先進国株式	4,860,358,024円	6,456,673,722円
たわらノーロード 先進国株式<ラップ向け>	425,029円	424,449円
たわらノーロード 先進国株式<為替ヘッジあり>	374,767,361円	663,110,499円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	5,533,716円	18,864,250円
たわらノーロード バランス(堅実型)	34,963円	1,319,614円
たわらノーロード バランス(標準型)	78,667円	10,557,940円
たわらノーロード バランス(積極型)	116,544円	25,055,924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)	- 円	56,458円
たわらノーロード スマートグローバル バランス(安定型)	- 円	5,779,872円
たわらノーロード スマートグローバル バランス(安定成長型)	- 円	10,915,519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)	- 円	7,112,866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)	- 円	17,833,120円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	- 円	6,504円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	- 円	55,936円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	- 円	395,874円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	- 円	424,921円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	- 円	1,461,166円
DIAM外国株式インデックスファンド <DC年金>	36,524,285,345円	38,235,165,998円
DIAMバランス・ファンド<DC年金> >1安定型	163,816,147円	165,489,803円
DIAMバランス・ファンド<DC年金> >2安定・成長型	857,026,223円	868,941,508円
DIAMバランス・ファンド<DC年金> >3成長型	1,040,064,596円	1,083,993,923円
DIAM DC バランス30インデックス ファンド	135,530,066円	131,919,721円
DIAM DC バランス50インデックス ファンド	389,058,681円	384,231,018円
DIAM DC バランス70インデックス ファンド	330,441,705円	337,185,434円

マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	34,878,508円	31,943,791円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	822,539,638円	799,032,499円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	195,901,776円	206,676,091円
D I A M D C 8 資産バランスファンド(新興国10)	29,682,754円	32,905,240円
D I A M D C 8 資産バランスファンド(新興国20)	72,204,969円	85,724,709円
D I A M D C 8 資産バランスファンド(新興国30)	139,080,636円	167,600,179円
投資のソムリエ	2,304,311,444円	572,789,502円
クルーズコントロール	737,903,333円	551,917,471円
投資のソムリエ<DC年金>	137,867,277円	41,349,986円
D I A M 8 資産バランスファンドN<DC年金>	112,210,396円	132,990,486円
D I A M D C バランス・F(成長型)	64,828,354円	83,137,087円
クルーズコントロール<DC年金>	267,913円	217,111円
D I A Mコア資産設計ファンド(堅実型)	3,220,015円	2,390,859円
D I A Mコア資産設計ファンド(積極型)	8,318,622円	7,484,466円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	21,960,626円	27,919,504円
ダイナミック・ナビゲーション	1,188,947円	382,109円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	278,707,489円	489,994,110円
ワールドアセットバランス(基本コース)	370,759,947円	679,300,871円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	1,219,908,098円	2,746,193,982円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤーズ2045)	507,684円	289,507円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤーズ2055)	507,707円	214,563円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	76,674円	132,362円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤーズ2035)	- 円	186,396円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	- 円	1,910,005円
D I A M外国株式インデックスファンドV A(適格機関投資家専用)	102,351,629円	91,850,900円
D I A M外国株式パッシブ私募ファンド(適格機関投資家向け)	2,959,537,722円	2,888,682,718円
D I A M先進国株式パッシブファンド(適格機関投資家限定)	161,259,516円	161,094,460円
外国株式パッシブ・ファンド2(適格機関投資家限定)	208,823,629円	208,717,363円
D I A Mワールドバランス25V A(適格機関投資家限定)	24,762,742円	24,032,692円
D I A Mグローバル・バランスファンド25V A(適格機関投資家限定)	116,041,634円	101,302,777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)	251,260,768円	231,366,539円
D I A M国際分散バランスファンド3 0 V A (適格機関投資家限定)	14,851,249円	12,774,196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)	100,952,255円	84,522,643円
D I A M国内重視バランスファンド3 0 V A (適格機関投資家限定)	8,146,073円	6,847,227円
D I A M国内重視バランスファンド5 0 V A (適格機関投資家限定)	13,799,965円	10,322,970円
D I A M世界バランスファンド4 0 V A (適格機関投資家限定)	29,422,766円	24,154,580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)	74,303,190円	66,158,499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)	607,694,386円	557,068,787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)	756,006,567円	693,307,462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)	2,336,497,566円	2,180,387,090円
D I A Mグローバル・アセット・ balan スV A (適格機関投資家限定)	858,081,509円	785,015,691円
D I A Mグローバル・アセット・ balan スV A 2 (適格機関投資家限定)	296,636,708円	181,769,680円
D I A M アクサ グローバル バラン スファンド3 0 V A (適格機関投資家限 定)	1,014,088,997円	916,000,032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)	643,413,009円	293,981,445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)	428,152,467円	50,770,727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)	588,153,794円	149,315,466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)	8,361,691,868円	7,967,904,412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)	447,951,568円	429,484,114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)	1,430,562,181円	1,361,926,844円
D I A M世界アセットバランスファンド 3 V A (適格機関投資家限定)	5,433,107,462円	5,225,242,038円
D I A Mバランス3 0 V A (適格機関投 資家限定)	12,953,009円	18,843,968円
D I A Mバランス5 0 V A (適格機関投 資家限定)	15,428,009円	1,236,246円
D I A Mバランス7 0 V A (適格機関投 資家限定)	11,295,771円	10,773,604円
D I A M世界アセットバランスファンド 4 V A (適格機関投資家限定)	7,254,637,480円	6,979,894,530円
D I A Mバランス2 0 V A (適格機関投 資家限定)	68,005,252円	60,336,899円

	D I A Mバランス40VA(適格機関投資家限定)	158,094円	233,071円
	D I A Mバランス60VA(適格機関投資家限定)	261,895円	262,779円
計		87,684,015,440円	89,187,362,436円
2 .	受益権の総数	87,684,015,440口	89,187,362,436口

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成29年5月12日 至 平成29年11月13日	自 平成29年11月14日 至 平成30年5月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成29年11月13日現在	平成30年5月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成29年11月13日現在	平成30年5月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
株式	23,510,519,297	6,221,708,919
投資信託受益証券	30,011,107	52,750,239
投資証券	441,922,713	280,138,908
合計	23,982,453,117	6,554,598,066

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成29年2月16日から平成29年11月13日まで及び平成30年2月16日から平成30年5月11日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	平成29年11月13日 現在				平成30年5月11日 現在			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	167,601,950	-	167,883,100	281,150	-	-	-	-
アメリカ・ドル	79,359,700	-	79,569,000	209,300	-	-	-	-
イギリス・ポンド	28,325,390	-	28,334,700	9,310	-	-	-	-
オーストラリア・ドル	6,965,760	-	6,954,400	11,360	-	-	-	-
カナダ・ドル	5,367,360	-	5,371,800	4,440	-	-	-	-
ユーロ	47,583,740	-	47,653,200	69,460	-	-	-	-
買 建	-	-	-	-	94,611,279	-	94,385,540	225,739
アメリカ・ドル	-	-	-	-	76,824,300	-	76,622,000	202,300
イギリス・ポンド	-	-	-	-	8,612,739	-	8,586,050	26,689
オーストラリア・ドル	-	-	-	-	824,030	-	823,900	130
カナダ・ドル	-	-	-	-	2,485,851	-	2,485,590	261
ユーロ	-	-	-	-	5,864,359	-	5,868,000	3,641
合計	167,601,950	-	167,883,100	281,150	94,611,279	-	94,385,540	225,739

（注）時価の算定方法

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

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

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

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

株式関連

種類	平成29年11月13日 現在				平成30年5月11日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								
先物取引								
買 建	5,217,360,323	-	5,276,199,755	58,839,432	6,140,064,901	-	6,319,274,159	179,209,258
合計	5,217,360,323	-	5,276,199,755	58,839,432	6,140,064,901	-	6,319,274,159	179,209,258

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成29年11月13日現在	平成30年5月11日現在
1口当たり純資産額	3.4020円	3.4633円
(1万口当たり純資産額)	(34,020円)	(34,633円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

平成30年5月11日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	AMAZON.COM INC	30,466	1,609.080	49,022,231.280	
	ABBOTT LABORATORIES	129,962	60.560	7,870,498.720	
	AES CORP	45,579	12.310	561,077.490	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	64,775	144.240	9,343,146.000	
	ADVANCED MICRO DEVICES	59,529	12.130	722,086.770	
	ADOBE SYSTEMS INC	37,176	241.150	8,964,992.400	
	CHUBB LTD	34,634	135.540	4,694,292.360	
	AGCO CORP	5,610	64.510	361,901.100	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	17,580	165.590	2,911,072.200	
	ALLEGHANY CORP	1,054	579.760	611,067.040	
	RALPH LAUREN CORP	3,497	108.960	381,033.120	
	ALLSTATE CORP	25,754	96.100	2,474,959.400	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	53,723	147.300	7,913,397.900	
	AMGEN INC	51,600	170.770	8,811,732.000	
	HESS CORP	20,421	63.300	1,292,649.300	
	AMERICAN EXPRESS CO	53,581	101.380	5,432,041.780	
	AMERICAN ELECTRIC POWER	34,859	67.020	2,336,250.180	
	AFLAC INC	56,436	45.350	2,559,372.600	
	AMERICAN INTL GROUP	66,725	52.750	3,519,743.750	
	AMERCO	551	340.850	187,808.350	
	ANALOG DEVICES	27,711	93.340	2,586,544.740	
	ANADARKO PETROLEUM CORP	41,993	68.390	2,871,901.270	
	ALEXION PHARMACEUTICALS INC	16,015	116.130	1,859,821.950	
	JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	69,855	36.720	2,565,075.600	
	TIME WARNER	58,404	92.540	5,404,706.160	
	JONES LANG LASALLE INC	2,818	172.420	485,879.560	
	VALERO ENERGY CORP	32,105	114.490	3,675,701.450	
	APACHE CORP	30,595	41.640	1,273,975.800	
	ANSYS INC	5,619	172.310	968,209.890	
	APPLE INC	381,669	190.040	72,532,376.760	
APPLIED MATERIALS INC	80,070	55.530	4,446,287.100		
ALBEMARLE CORP	7,904	98.390	777,674.560		
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	42,401	43.900	1,861,403.900		
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	7,831	78.130	611,836.030		
AMEREN CORP	17,312	56.340	975,358.080		

ARROW ELECTRONICS INC	5,756	76.570	440,736.920	
AUTOLIV INC	6,197	141.670	877,928.990	
AUTODESK INC	14,259	136.470	1,945,925.730	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	33,092	127.390	4,215,589.880	
AUTOZONE INC	2,015	658.520	1,326,917.800	
AVERY DENNISON CORP	6,262	107.720	674,542.640	
AVNET INC	10,288	40.700	418,721.600	
BALL CORP	24,324	38.810	944,014.440	
BERKSHIRE HATHAWAY INC- CL B	93,679	201.200	18,848,214.800	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	73,749	57.270	4,223,605.230	
BAXTER INTERNATIONAL INC	34,876	70.600	2,462,245.600	
BECTON DICKINSON & CO	20,449	225.490	4,611,045.010	
AMETEK INC	16,775	74.690	1,252,924.750	
VERIZON COMM INC	306,879	47.200	14,484,688.800	
WR BERKLEY CORP	8,134	76.130	619,241.420	
BEST BUY CO INC	19,210	76.830	1,475,904.300	
YUM! BRANDS INC	23,738	84.680	2,010,133.840	
FIRSTENERGY CORP	30,796	33.910	1,044,292.360	
H&R BLOCK INC	16,114	27.780	447,646.920	
BOEING CO	41,769	344.070	14,371,459.830	
ROBERT HALF INTL INC	8,158	63.060	514,443.480	
BORGWARNER INC	14,648	50.480	739,431.040	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	97,541	30.280	2,953,541.480	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	9,894	84.580	836,834.520	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	8,731	117.060	1,022,050.860	
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	1,838	563.250	1,035,253.500	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	121,395	51.150	6,209,354.250	
AFFILIATED MANAGERS GROUP INC	3,788	164.700	623,883.600	
INGREDION INC	5,305	111.330	590,605.650	
ONEOK INC	28,887	65.300	1,886,321.100	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	8,000	111.710	893,680.000	
UNITED RENTALS INC	6,332	166.360	1,053,391.520	
SEMPRA ENERGY	16,912	106.390	1,799,267.680	
FEDEX CORP	18,964	247.700	4,697,382.800	
VERISIGN INC	6,321	124.590	787,533.390	
AMPHENOL CORP	24,700	87.270	2,155,569.000	
BROWN-FORMAN CORP	19,683	57.430	1,130,394.690	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	127,092	6.820	866,767.440	
CSX CORP	63,992	62.810	4,019,337.520	
CABOT OIL & GAS CORP	32,261	22.960	740,712.560	
CAMPBELL SOUP CO	14,050	41.190	578,719.500	

SEAGATE TECHNOLOGY	20,613	57.270	1,180,506.510	
CONSTELLATION BRANDS INC	12,969	220.390	2,858,237.910	
CARDINAL HEALTH INC	22,125	54.740	1,211,122.500	
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	24,916	64.060	1,596,118.960	
CATERPILLAR INC	44,558	153.970	6,860,595.260	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	9,832	100.210	985,264.720	
CELGENE CORP	59,186	82.380	4,875,742.680	
CITRIX SYSTEMS INC	10,896	108.190	1,178,838.240	
CENTURYLINK INC	73,540	19.400	1,426,676.000	
CERNER CORP	22,947	60.270	1,383,015.690	
JPMORGAN CHASE & CO	258,225	114.290	29,512,535.250	
CHURCH & DWIGHT CO INC	18,822	47.770	899,126.940	
CIGNA CORP	18,609	171.060	3,183,255.540	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	10,982	71.890	789,495.980	
CINTAS CORP	6,282	181.960	1,143,072.720	
CISCO SYSTEMS INC	364,860	46.300	16,893,018.000	
CLOROX COMPANY	9,331	120.310	1,122,612.610	
COCA-COLA CO/THE	298,559	42.180	12,593,218.620	
COGNEX CORP	11,508	48.470	557,792.760	
COLGATE-PALMOLIVE CO	62,296	62.480	3,892,254.080	
MARRIOTT INTERNATIONAL- CL A	23,444	138.570	3,248,635.080	
COMERICA INC	12,068	97.910	1,181,577.880	
COMCAST CORP-CL A	345,846	31.560	10,914,899.760	
CA INC	22,732	35.100	797,893.200	
CONAGRA BRANDS INC	28,323	37.760	1,069,476.480	
CONSOLIDATED EDISON INC	21,750	76.570	1,665,397.500	
CMS ENERGY CORP	19,291	45.210	872,146.110	
COOPER COS INC	3,794	231.420	878,007.480	
MOLSON COORS BREWING CO	13,855	61.400	850,697.000	
CORNING INC	65,641	27.360	1,795,937.760	
WR GRACE & CO	3,314	71.820	238,011.480	
SEALED AIR CORP	13,870	44.300	614,441.000	
CUMMINS INC	11,239	146.120	1,642,242.680	
DR HORTON INC	24,498	43.870	1,074,727.260	
DANAHER CORP	47,175	101.170	4,772,694.750	
MOODY'S CORP	12,963	173.780	2,252,710.140	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	43,966	75.950	3,339,217.700	
TARGET CORP	37,486	70.240	2,633,016.640	
DEERE & CO	20,401	146.610	2,990,990.610	
MORGAN STANLEY	102,643	55.040	5,649,470.720	
REPUBLIC SERVICES INC	17,375	68.040	1,182,195.000	
COSTAR GROUP INC	2,786	393.450	1,096,151.700	
THE WALT DISNEY CO	112,062	101.680	11,394,464.160	
DOLLAR TREE INC	17,493	92.620	1,620,201.660	

DOVER CORP	10,736	76.680	823,236.480	
OMNICOM GROUP	16,993	74.620	1,268,017.660	
DTE ENERGY CO	13,122	101.330	1,329,652.260	
DUKE ENERGY CORP	52,625	78.160	4,113,170.000	
FLOWSERVE CORP	8,406	47.880	402,479.280	
DARDEN RESTAURANTS INC	9,436	91.340	861,884.240	
EBAY INC	74,364	38.500	2,863,014.000	
BANK OF AMERICA CORP	737,237	30.890	22,773,250.930	
CITIGROUP INC	196,708	72.570	14,275,099.560	
EASTMAN CHEMICAL CO	10,193	107.700	1,097,786.100	
E*TRADE FINANCIAL CORP	18,740	64.100	1,201,234.000	
EATON CORP PLC	32,234	76.450	2,464,289.300	
EATON VANCE CORP	9,184	56.870	522,294.080	
CADENCE DESIGN SYS INC	20,877	42.230	881,635.710	
DISH NETWORK CORP	16,150	31.780	513,247.000	
ECOLAB INC	19,009	147.660	2,806,868.940	
ELECTRONIC ARTS INC	23,050	133.760	3,083,168.000	
SALESFORCE.COM INC	52,227	130.620	6,821,890.740	
EMERSON ELECTRIC CO	47,931	71.970	3,449,594.070	
ATMOS ENERGY CORP	8,221	88.600	728,380.600	
ENERGY CORP	12,199	78.960	963,233.040	
EOG RESOURCES INC	45,000	118.950	5,352,750.000	
EQUIFAX INC	8,495	114.820	975,395.900	
EQT CORP	17,149	51.650	885,745.850	
ESTEE LAUDER COS INC/THE	16,134	138.500	2,234,559.000	
EXPEDITORS INTERNATIONAL	12,550	71.680	899,584.000	
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	43,633	70.960	3,096,197.680	
EXXON MOBIL CORP	315,280	81.720	25,764,681.600	
FMC CORP	8,970	87.430	784,247.100	
NEXTERA ENERGY INC	35,113	160.230	5,626,155.990	
ASSURANT INC	4,089	87.560	358,032.840	
FASTENAL CO	21,654	51.330	1,111,499.820	
FIFTH THIRD BANCORP	52,173	33.940	1,770,751.620	
M&T BANK CORP	9,799	185.730	1,819,968.270	
FISERV INC	33,804	72.410	2,447,747.640	
FLIR SYSTEMS INC	11,623	55.300	642,751.900	
MACY'S INC	24,741	29.420	727,880.220	
FORD MOTOR CO	278,818	11.210	3,125,549.780	
FRANKLIN RESOURCES INC	22,314	33.200	740,824.800	
FREEMPORT-MCMORAN INC	96,812	16.220	1,570,290.640	
FLEX LTD	35,913	14.550	522,534.150	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	12,176	69.260	843,309.760	
GAP INC/THE	18,295	28.800	526,896.000	
DENTSPLY SIRONA INC	17,477	46.540	813,379.580	
GENERAL DYNAMICS CORP	19,047	201.670	3,841,208.490	
GENERAL MILLS INC	44,775	42.620	1,908,310.500	
GENUINE PARTS CO	11,759	90.570	1,065,012.630	
GILEAD SCIENCES INC	97,302	65.370	6,360,631.740	

GARTNER INC	7,153	134.370	961,148.610	
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	18,097	25.730	465,635.810	
MCKESSON CORP	15,054	147.260	2,216,852.040	
NVIDIA CORP	44,765	260.130	11,644,719.450	
GENERAL ELECTRIC CO	641,549	14.690	9,424,354.810	
WW GRAINGER INC	3,832	300.170	1,150,251.440	
HALLIBURTON CO	68,865	52.710	3,629,874.150	
MONSTER BEVERAGE CORP	29,522	50.060	1,477,871.320	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	26,624	243.440	6,481,346.560	
HARLEY-DAVIDSON INC	12,901	40.630	524,167.630	
HARRIS CORP	8,954	156.710	1,403,181.340	
HASBRO INC	7,736	86.970	672,799.920	
HENRY SCHEIN INC	11,426	72.620	829,756.120	
HELMERICH & PAYNE INC	7,213	69.020	497,841.260	
HERSHEY FOODS CORP	10,132	92.890	941,161.480	
HP INC	122,725	22.750	2,791,993.750	
F5 NETWORKS INC	4,874	172.760	842,032.240	
CROWN HOLDINGS INC NPR	14,572	45.090	657,051.480	
UNITED THERAPEUTICS CORP	3,447	101.140	348,629.580	
JUNIPER NETWORKS INC	27,740	26.340	730,671.600	
HOLLYFRONTIER CORP	11,051	67.450	745,389.950	
HOLOGIC INC	19,133	38.190	730,689.270	
UNUM GROUP	16,000	38.010	608,160.000	
HOME DEPOT INC	86,514	187.160	16,191,960.240	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	12,887	89.400	1,152,097.800	
HORMEL FOODS CORP	19,345	36.170	699,708.650	
CENTERPOINT ENERGY INC	31,952	26.640	851,201.280	
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,337	204.260	477,355.620	
HUMANA INC	10,468	281.900	2,950,929.200	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	5,927	122.900	728,428.300	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	75,161	15.140	1,137,937.540	
RED HAT INC	14,447	171.480	2,477,371.560	
BIOGEN INC	15,971	274.000	4,376,054.000	
IDEX CORP	7,724	137.850	1,064,753.400	
ILLINOIS TOOL WORKS	22,895	145.820	3,338,548.900	
INTUIT INC	18,126	194.300	3,521,881.800	
IDEXX LABORATORIES INC	6,255	209.100	1,307,920.500	
INGERSOLL-RAND PLC	18,874	88.730	1,674,690.020	
INTEL CORP	348,219	54.980	19,145,080.620	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	5,578	127.440	710,860.320	
INTERNATIONAL PAPER CO	28,375	52.840	1,499,335.000	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	29,157	24.210	705,890.970	

JACOBS ENGINEERING GROUP INC	7,931	63.760	505,680.560	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	7,919	123.040	974,353.760	
INCYTE CORP	12,360	65.270	806,737.200	
JOHNSON & JOHNSON	200,134	125.350	25,086,796.900	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	25,530	52.810	1,348,239.300	
KLA-TENCOR CORP	11,724	111.060	1,302,067.440	
DEVON ENERGY CORP	34,184	40.890	1,397,783.760	
WESTAR ENERGY INC	9,911	53.380	529,049.180	
KELLOGG CO	18,922	61.040	1,154,998.880	
EAST WEST BANCORP INC	15,000	69.540	1,043,100.000	
KEYCORP	90,776	20.280	1,840,937.280	
KIMBERLY-CLARK CORP	27,356	103.830	2,840,373.480	
BLACKROCK INC/NEW YORK	8,949	536.260	4,798,990.740	
KOHL'S CORP	11,357	60.530	687,439.210	
KROGER CO	67,450	24.360	1,643,082.000	
LAM RESEARCH CORP	11,522	204.010	2,350,603.220	
PACKAGING CORP OF AMERICA	6,157	116.210	715,504.970	
AKAMA I TECHNOLOGIES	12,622	76.360	963,815.920	
LEGGETT & PLATT INC	9,588	41.850	401,257.800	
LENNAR CORP	24,033	54.190	1,302,348.270	
LEUCADIA NATIONAL CORP	21,462	24.790	532,042.980	
ELI LILLY & CO	74,839	80.860	6,051,481.540	
L BRANDS INC	16,262	31.680	515,180.160	
LINCOLN NATIONAL CORP	19,262	67.680	1,303,652.160	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	51,308	113.990	5,848,598.920	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	25,175	68.860	1,733,550.500	
LOCKHEED MARTIN CORP	19,173	324.490	6,221,446.770	
LOEWS CORP	21,346	51.860	1,107,003.560	
RANGE RESOURCES CORP	13,697	14.760	202,167.720	
LOWE'S COS INC	62,509	85.070	5,317,640.630	
DOMINION ENERGY INC	48,002	64.060	3,075,008.120	
SCANA CORP	10,902	35.670	388,874.340	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	32,198	33.370	1,074,447.260	
MCCORMICK & CO INC	11,107	107.400	1,192,891.800	
MCDONALD'S CORPORATION	59,447	165.070	9,812,916.290	
S&P GLOBAL INC	18,409	200.630	3,693,397.670	
EVEREST RE GROUP LTD	2,855	228.190	651,482.450	
MANPOWERGROUP INC	4,257	95.680	407,309.760	
MARKEL CORPORATION	989	1,153.150	1,140,465.350	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	16,081	136.780	2,199,559.180	
MARSH & MCLENNAN COS	39,653	81.770	3,242,425.810	
MASCO CORP	23,043	37.860	872,407.980	

MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	4,387	210.720	924,428.640	
MATTEL INC	24,003	14.510	348,283.530	
METLIFE INC	64,937	46.890	3,044,895.930	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	20,342	57.970	1,179,225.740	
MEDTRONIC PLC	100,647	85.680	8,623,434.960	
ACTIVISION BLIZZARD INC	54,568	72.900	3,978,007.200	
CVS HEALTH CORP	75,876	62.440	4,737,697.440	
MERCK & CO. INC.	201,289	58.060	11,686,839.340	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	7,176	174.000	1,248,624.000	
MICROSOFT CORP	544,500	97.910	53,311,995.000	
MICRON TECH INC	86,870	52.660	4,574,574.200	
MIDDLEBY CORP	4,100	107.020	438,782.000	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	19,829	93.160	1,847,269.640	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	26,463	21.440	567,366.720	
3M CO	44,134	205.030	9,048,794.020	
MOHAWK INDUSTRIES INC	5,573	211.530	1,178,856.690	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	13,562	108.750	1,474,867.500	
KANSAS CITY SOUTHERN	7,247	109.790	795,648.130	
MYLAN NV	31,344	37.900	1,187,937.600	
ILLUMINA INC	11,065	264.980	2,932,003.700	
XCEL ENERGY INC	37,554	45.250	1,699,318.500	
NATIONAL OILWELL VARCO INC	26,938	40.610	1,093,952.180	
NETAPP INC	18,387	71.830	1,320,738.210	
NEWFIELD EXPLORATION CO	13,740	28.090	385,956.600	
NEWELL BRANDS INC	36,206	27.420	992,768.520	
NEWMONT MINING CORP	38,093	40.420	1,539,719.060	
NVR INC	236	3,022.000	713,192.000	
NIKE INC-CL B	98,317	67.920	6,677,690.640	
NOBLE ENERGY INC	36,582	35.250	1,289,515.500	
NORDSTROM INC	9,487	48.580	460,878.460	
NORFOLK SOUTHERN CORP	22,159	151.760	3,362,849.840	
EVERSOURCE ENERGY	23,085	57.950	1,337,775.750	
NISOURCE INC	22,198	24.910	552,952.180	
TAPESTRY INC	22,269	45.950	1,023,260.550	
NORTHERN TRUST CORP	16,090	107.900	1,736,111.000	
NORTHROP GRUMMAN CORP	12,588	326.410	4,108,849.080	
WELLS FARGO & CO	348,201	54.650	19,029,184.650	
NUCOR CORP	23,780	63.850	1,518,353.000	
MONSANTO CO	32,713	124.890	4,085,526.570	
CHENIERE ENERGY INC	15,927	61.970	986,996.190	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	37,524	92.670	3,477,349.080	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	59,976	83.860	5,029,587.360	

OLD DOMINION FREIGHT LINE	4,917	145.070	713,309.190	
OGE ENERGY CORP	16,028	34.240	548,798.720	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	6,375	265.200	1,690,650.000	
ORACLE CORP	230,824	46.930	10,832,570.320	
PACCAR INC	26,537	63.760	1,691,999.120	
EXELON CORP	69,910	40.600	2,838,346.000	
PARKER HANNIFIN CORP	10,985	174.250	1,914,136.250	
PAYCHEX INC	23,141	62.990	1,457,651.590	
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	6,526	57.570	375,701.820	
ALIGN TECHNOLOGY INC	5,854	277.730	1,625,831.420	
PPL CORPORATION	57,183	28.180	1,611,416.940	
PEPSICO INC	104,692	97.270	10,183,390.840	
PENTAIR PLC	11,775	44.390	522,692.250	
PFIZER INC	446,210	35.040	15,635,198.400	
CONOCOPHILLIPS	89,973	69.340	6,238,727.820	
PVH CORP	5,387	153.000	824,211.000	
PG&E CORP	42,795	43.380	1,856,447.100	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	12,158	203.190	2,470,384.020	
ALTRIA GROUP INC	141,336	56.040	7,920,469.440	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	35,408	150.840	5,340,942.720	
POLARIS INDUSTRIES INC	3,845	106.870	410,915.150	
GARMIN LTD	7,795	59.190	461,386.050	
AETNA INC	23,744	170.590	4,050,488.960	
FLUOR CORP (NEW)	9,821	46.360	455,301.560	
PPG INDUSTRIES INC	19,079	106.110	2,024,472.690	
IPG PHOTONICS CORP	2,441	251.100	612,935.100	
PRAXAIR INC	20,519	157.050	3,222,508.950	
COSTCO WHOLESALE CORP	32,871	195.450	6,424,636.950	
T ROWE PRICE GROUP INC	19,663	117.590	2,312,172.170	
QUEST DIAGNOSTICS	10,378	101.690	1,055,338.820	
PROCTER & GAMBLE CO	186,535	73.150	13,645,035.250	
PROGRESSIVE CORP	43,996	62.370	2,744,030.520	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	37,115	51.130	1,897,689.950	
PULTE GROUP INC	21,209	31.050	658,539.450	
NEW YORK COMMUNITY BANCORP INC	30,388	11.720	356,147.360	
GLOBAL PAYMENTS INC	10,769	116.000	1,249,204.000	
QUALCOMM INC	109,843	54.970	6,038,069.710	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	10,187	93.120	948,613.440	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	2,550	127.890	326,119.500	
REGENERON PHARMACEUTICALS	5,659	288.900	1,634,885.100	

REINSURANCE GROUP OF AMERICA INC	4,642	150.550	698,853.100	
AUTONATION INC	5,772	45.950	265,223.400	
RESMED INC	9,394	101.070	949,451.580	
US BANCORP	123,678	51.170	6,328,603.260	
SEATTLE GENETICS INC /WA	7,317	55.600	406,825.200	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	8,674	79.570	690,190.180	
ROSS STORES INC	28,189	81.310	2,292,047.590	
ROLLINS INC	8,252	49.720	410,289.440	
ROPER TECHNOLOGIES INC	8,523	279.230	2,379,877.290	
ROCKWELL AUTOMATION INC	8,867	178.020	1,578,503.340	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	12,293	107.270	1,318,670.110	
RAYTHEON COMPANY	21,817	212.610	4,638,512.370	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	3,848	206.670	795,266.160	
ACCENTURE PLC-CL A	45,610	156.540	7,139,789.400	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	111,556	39.100	4,361,839.600	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	8,849	155.620	1,377,081.380	
ROCKWELL COLLINS INC	12,086	134.330	1,623,512.380	
THE TRAVELERS COMPANIES INC	19,755	130.880	2,585,534.400	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	26,562	104.910	2,786,619.420	
BOOKING HOLDINGS INC	3,645	2,080.020	7,581,672.900	
SCHLUMBERGER LTD	104,599	71.120	7,439,080.880	
SCHWAB (CHARLES) CORP	92,005	59.000	5,428,295.000	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	14,175	117.300	1,662,727.500	
BUNGE LTD	10,334	70.750	731,130.500	
SEI INVESTMENTS CO	9,315	64.140	597,464.100	
ANTHEM INC	19,325	225.670	4,361,072.750	
AMERISOURCEBERGEN CORP	12,257	85.530	1,048,341.210	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	21,442	58.750	1,259,717.500	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	6,319	380.450	2,404,063.550	
CENTENE CORP	12,713	113.060	1,437,331.780	
SVB FINANCIAL GROUP	4,107	320.280	1,315,389.960	
IAC INTERACTIVE CORP	5,050	142.460	719,423.000	
SMITH (A.O.) CORP	9,565	64.080	612,925.200	
ACUITY BRANDS INC	3,087	113.520	350,436.240	
SNAP-ON INC	3,932	147.750	580,953.000	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	31,808	100.840	3,207,518.720	
ADVANCE AUTO PARTS	5,273	118.230	623,426.790	
EDISON INTERNATIONAL	29,000	61.710	1,789,590.000	
SOUTHERN CO	75,642	44.710	3,381,953.820	
BB&T CORP	59,388	55.040	3,268,715.520	
SOUTHWEST AIRLINES	11,352	51.940	589,622.880	

AT&T INC	456,680	31.880	14,558,958.400	
CHEVRON CORP	141,261	128.820	18,197,242.020	
STANLEY BLACK & DECKER INC	12,829	143.140	1,836,343.060	
STATE STREET CORP	27,099	101.780	2,758,136.220	
STARBUCKS CORP	106,412	57.650	6,134,651.800	
STEEL DYNAMICS INC	19,030	47.780	909,253.400	
STRYKER CORP	25,320	168.970	4,278,320.400	
NETFLIX INC	32,015	329.600	10,552,144.000	
STERICYCLE INC	6,853	64.060	439,003.180	
SUNTRUST BANKS INC	34,756	69.340	2,409,981.040	
SYMANTEC CORP	47,004	29.180	1,371,576.720	
KNIGHT SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	9,793	40.140	393,091.020	
SYNOPSIS INC	10,656	91.190	971,720.640	
SYSCO CORP	35,926	62.740	2,253,997.240	
INTUITIVE SURGICAL INC	8,708	468.400	4,078,827.200	
TELEFLEX INC	3,203	268.550	860,165.650	
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	63,853	19.240	1,228,531.720	
ANDEAVOR	11,500	140.670	1,617,705.000	
TEXAS INSTRUMENTS INC	73,391	109.970	8,070,808.270	
TEXTRON INC	19,076	65.640	1,252,148.640	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	30,141	213.820	6,444,748.620	
TIFFANY & CO	8,733	103.580	904,564.140	
TOLL BROTHERS INC	9,526	42.530	405,140.780	
TORCHMARK CORP	7,699	85.380	657,340.620	
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	11,279	88.720	1,000,672.880	
DAVITA INC	10,878	65.770	715,446.060	
TRACTOR SUPPLY CO	9,276	67.800	628,912.800	
TRIMBLE INC	20,073	34.350	689,507.550	
TYSON FOODS INC	21,621	67.720	1,464,174.120	
UGI CORP	12,068	49.690	599,658.920	
MARATHON OIL CORP	58,747	21.140	1,241,911.580	
UNION PACIFIC CORP	58,589	141.260	8,276,282.140	
UNITED TECHNOLOGIES CORP	56,111	124.100	6,963,375.100	
UNITEDHEALTH GROUP INC	71,700	233.710	16,757,007.000	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	6,351	117.770	747,957.270	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	6,848	118.180	809,296.640	
VF CORP	24,309	77.970	1,895,372.730	
CBS CORP	27,376	52.320	1,432,312.320	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	19,280	151.010	2,911,472.800	
VULCAN MATERIALS CO	10,136	125.690	1,273,993.840	

WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	63,286	63.810	4,038,279.660	
WALMART INC	111,062	82.690	9,183,716.780	
WASTE MANAGEMENT INC	32,216	83.320	2,684,237.120	
WATERS CORP	5,963	196.170	1,169,761.710	
ALLERGAN PLC	25,196	151.910	3,827,524.360	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	8,855	114.160	1,010,886.800	
VAIL RESORTS INC	2,598	233.690	607,126.620	
WESTERN DIGITAL CORP	22,254	79.040	1,758,956.160	
WABTEC CORP	5,497	93.830	515,783.510	
WHIRLPOOL CORP	5,553	155.620	864,157.860	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	13,529	97.070	1,313,260.030	
WYNN RESORTS LTD	6,279	201.510	1,265,281.290	
NASDAQ INC	9,132	90.370	825,258.840	
CME GROUP INC	25,415	159.960	4,065,383.400	
WILLIAMS COS INC	61,081	26.690	1,630,251.890	
LKQ CORP	22,948	30.280	694,865.440	
ALLIANT ENERGY CORP	16,383	41.740	683,826.420	
WEC ENERGY GROUP INC	23,117	62.190	1,437,646.230	
TD AMERITRADE HOLDING CORP	21,581	61.350	1,323,994.350	
CARMAX INC	13,513	63.280	855,102.640	
XEROX CORP	17,455	29.330	511,955.150	
XILINX INC	19,197	69.720	1,338,414.840	
CIMAREX ENERGY CO	7,003	97.820	685,033.460	
TJX COMPANIES INC	49,771	83.270	4,144,431.170	
ZIONS BANCORP	16,584	57.780	958,223.520	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	76,400	7.260	554,664.000	
JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	15,700	61.330	962,881.000	
JARDINE STRATEGIC HOLDINGS LTD	17,100	36.930	631,503.000	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	6,051	98.280	594,692.280	
SIGNATURE BANK	4,171	130.370	543,773.270	
CBRE GROUP INC	20,976	47.240	990,906.240	
LIBERTY GLOBAL PLC	12,435	30.800	382,998.000	
REGIONS FINANCIAL CORP	84,486	19.330	1,633,114.380	
DOMINO'S PIZZA INC	3,256	249.720	813,088.320	
T-MOBILE US INC	21,188	56.850	1,204,537.800	
LAS VEGAS SANDS CORP	30,271	79.000	2,391,409.000	
MOSAIC CO/THE	26,525	26.380	699,729.500	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX NEWS	38,915	37.460	1,457,755.900	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC	75,340	37.920	2,856,892.800	
MACQUARIE INFRASTRUCTURE CORP	5,473	39.040	213,665.920	

CELANESE CORP	9,491	109.600	1,040,213.600	
DISCOVERY INC-A	10,423	23.820	248,275.860	
EXPEDIA GROUP INC	8,709	113.930	992,216.370	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	18,475	39.410	728,099.750	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	10,578	135.510	1,433,424.780	
LIBERTY GLOBAL PLC- SERIES C	41,818	29.975	1,253,494.550	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	42,085	71.380	3,004,027.300	
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	14,696	18.560	272,757.760	
VIACOM INC-CLASS B	24,612	30.540	751,650.480	
LIVE NATION	8,864	42.800	379,379.200	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,807	422.670	763,764.690	
UNITED CONTINENTAL HOLIDINGS INC	6,191	66.020	408,729.820	
TRANSDIGM GROUP INC	3,812	335.710	1,279,726.520	
MASTERCARD INC	69,652	193.050	13,446,318.600	
QURATE RETAIL INC	35,733	21.890	782,195.370	
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	7,436	112.350	835,434.600	
HANESBRANDS INC	27,619	16.580	457,923.020	
WESTERN UNION CO	35,222	20.060	706,553.320	
OWENS CORNING	7,333	67.210	492,850.930	
LEIDOS HOLDINGS INC	9,322	63.080	588,031.760	
AERCAP HOLDINGS NV	11,586	55.540	643,486.440	
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLDINGS INC	9,175	84.150	772,076.250	
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT-ADR	18,099	32.140	581,701.860	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	8,330	117.270	976,859.100	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	22,746	18.670	424,667.820	
DELTA AIR LINES INC	13,898	52.060	723,529.880	
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	6,354	68.180	433,215.720	
DISCOVER FINANCIAL	27,177	74.880	2,035,013.760	
TE CONNECTIVITY LTD	27,804	94.280	2,621,361.120	
CONCHO RESOURCES INC/MIDLAND TX	10,552	156.010	1,646,217.520	
WABCO HOLDING INC	3,176	129.730	412,022.480	
LULULEMON ATHLETICA INC	6,683	97.910	654,332.530	
VMWARE INC	5,491	143.900	790,154.900	
MERCADOLIBRE INC	3,215	316.630	1,017,965.450	
ULTA BEAUTY INC	4,332	247.500	1,072,170.000	
INVESCO LTD	29,824	28.140	839,247.360	
MSCI INC	6,462	159.850	1,032,950.700	

PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	114,627	83.000	9,514,041.000	
VISA INC	134,179	131.000	17,577,449.000	
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	15,000	119.610	1,794,150.000	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	11,992	83.740	1,004,210.080	
DISCOVERY INC-C	23,054	22.570	520,328.780	
MARATHON PETROLEUM CORP	36,673	77.540	2,843,624.420	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	11,624	55.810	648,735.440	
SPECTRUM BRANDS HOLDINGS INC	1,826	73.730	134,630.980	
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	155,757	16.500	2,569,990.500	
XYLEM INC	12,873	72.610	934,708.530	
ALKERMES PLC	12,053	45.790	551,906.870	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	26,384	112.420	2,966,089.280	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,479	222.400	773,729.600	
SPLUNK INC	10,674	116.840	1,247,150.160	
HCA HEALTHCARE INC	21,696	101.470	2,201,493.120	
VERISK ANALYTICS INC	14,159	105.900	1,499,438.100	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	3,987	161.080	642,225.960	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	6,544	204.240	1,336,546.560	
FIRST REPUBLIC BANK/SAN FRANCISCO CA	10,668	97.550	1,040,663.400	
CIT GROUP INC	9,287	53.820	499,826.340	
NXP SEMICONDUCTOR NV	22,652	99.290	2,249,117.080	
TARGA RESOURCES CORP	16,445	48.070	790,511.150	
HUTCHISON PORT HOLDINGS TRUST	405,600	0.345	139,932.000	
LEAR CORP	5,132	194.350	997,404.200	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	7,040	105.410	742,086.400	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	17,000	49.040	833,680.000	
DOLLAR GENERAL CORP	21,402	92.940	1,989,101.880	
FORTINET INC	11,399	60.160	685,763.840	
AON PLC	18,487	144.240	2,666,564.880	
TESLA INC	10,063	305.020	3,069,416.260	
GENERAL MOTORS CO	95,770	37.160	3,558,813.200	
WORLDPAY INC	10,448	81.740	854,019.520	
TRIPADVISOR INC	9,263	48.510	449,348.130	
ALLY FINANCIAL INC	31,409	27.340	858,722.060	
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	12,138	62.900	763,480.200	
VOYA FINANCIAL INC	13,525	52.650	712,091.250	

APTIV PLC	19,069	96.060	1,831,768.140	
PHILLIPS 66	30,976	117.960	3,653,928.960	
FACEBOOK INC	177,316	185.530	32,897,437.480	
IQVIA HOLDINGS INC	10,051	100.930	1,014,447.430	
DIAMONDBACK ENERGY INC	7,054	129.790	915,538.660	
SERVICENOW INC	12,206	178.980	2,184,629.880	
PALO ALTO NETWORKS INC	7,006	205.890	1,442,465.340	
TESARO INC	2,646	46.100	121,980.600	
WORKDAY INC	10,417	138.010	1,437,650.170	
ABBVIE INC	118,243	102.850	12,161,292.550	
ZOETIS INC	36,976	83.460	3,086,016.960	
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDINGS LTD	16,470	51.400	846,558.000	
COTY INC	38,541	14.500	558,844.500	
NEWS CORP/NEW-CL A	30,263	16.590	502,063.170	
HD SUPPLY HOLDINGS INC	12,891	39.660	511,257.060	
CDW CORP	10,824	78.210	846,545.040	
SPRINT CORP	63,882	5.180	330,908.760	
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	10,199	42.040	428,765.960	
ARCONIC INC	27,513	18.140	499,085.820	
ENVISION HEALTHCARE CORP	8,692	42.740	371,496.080	
LIBERTY MEDIA CORP- LIBERTY-C	13,175	30.010	395,381.750	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	5,006	43.800	219,262.800	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-C	13,368	43.870	586,454.160	
XL GROUP LTD	17,166	54.830	941,211.780	
DELL TECHNOLOGIES INC	15,074	74.690	1,125,877.060	
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	15,410	16.640	256,422.400	
BAKER HUGHES A GE CO	28,404	36.180	1,027,656.720	
TECHNIPFMC LTD	32,556	31.650	1,030,397.400	
BROADCOM INC	30,394	243.510	7,401,242.940	
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	6,291	48.670	306,182.970	
ANTERO RESOURCES CORP	13,163	18.970	249,702.110	
VEEVA SYSTEMS INC	9,087	77.000	699,699.000	
TWITTER INC	47,998	32.870	1,577,694.260	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING PLC	11,392	52.040	592,839.680	
PLAINS GP HOLDINGS LP	7,837	24.640	193,103.680	
COMMSCOPE HOLDING CO INC	12,920	29.500	381,140.000	
ALLEGION PLC	9,825	77.310	759,570.750	
APERGY CORP	5,368	38.630	207,365.840	
PERRIGO CO PLC	8,553	75.540	646,093.620	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	20,000	82.760	1,655,200.000	
ARAMARK	17,307	37.960	656,973.720	
SABRE CORP	17,624	23.180	408,524.320	
PARSLEY ENERGY INC	17,454	32.840	573,189.360	

ARISTA NETWORKS INC	3,748	260.660	976,953.680	
IHS MARKIT LTD	34,553	51.810	1,790,190.930	
FNF GROUP	17,760	37.980	674,524.800	
SYNCHRONY FINANCIAL	57,485	33.900	1,948,741.500	
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	34,845	42.360	1,476,034.200	
CDK GLOBAL INC	8,309	64.910	539,337.190	
QORVO INC	8,784	81.990	720,200.160	
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	11,389	34.460	392,464.940	
LIBERTY BROADBAND CORP-C W/I	7,818	71.750	560,941.500	
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	14,710	31.710	466,454.100	
NIELSEN HOLDINGS PLC	26,840	30.300	813,252.000	
TRANSUNION	10,341	69.130	714,873.330	
SQUARE INC	20,423	54.650	1,116,116.950	
DOWDUPONT INC	173,668	66.950	11,627,072.600	
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS PLC	14,000	39.000	546,000.000	
WESTROCK CO	17,744	60.550	1,074,399.200	
KRAFT HEINZ CO	43,818	59.040	2,587,014.720	
FORTIVE CORP	23,630	75.540	1,785,010.200	
WASTE CONNECTIONS INC	18,879	76.020	1,435,181.580	
ALPHABET INC-CL A	22,200	1,105.470	24,541,434.000	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	113,242	17.650	1,998,721.300	
PAYPAL HOLDINGS INC	85,540	79.190	6,773,912.600	
FIRST DATA CORP	35,404	19.700	697,458.800	
DXC TECHNOLOGY CO	21,351	104.270	2,226,268.770	
ZILLOW GROUP INC-C	8,134	55.330	450,054.220	
ALPHABET INC-CL C	23,400	1,097.570	25,683,138.000	
L3 TECHNOLOGIES INC	5,892	195.570	1,152,298.440	
CHEMOURS CO	12,723	50.850	646,964.550	
ATHENE HOLDING LTD	8,984	46.620	418,834.080	
CHARTER COMMUNICATIONS INC	14,006	272.830	3,821,256.980	
VISTRA ENERGY CORP	30,000	22.910	687,300.000	
アメリカ・ドル 小計	23,086,832		1,768,527,080.260 (193,636,030,018)	
イギリス・ポンド				
ANTOFAGASTA PLC	25,905	10.400	269,412.000	
ASHTED GROUP	35,233	22.320	786,400.560	
SEVERN TRENT PLC	14,897	20.200	300,919.400	
BHP BILLITON PLC	153,323	16.694	2,559,574.160	
BARCLAYS PLC	1,292,957	2.138	2,764,342.060	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	64,682	5.584	361,184.280	
BT GROUP PLC	638,910	2.210	1,411,991.100	
SKY PLC	72,210	13.505	975,196.050	
BUNZL PLC	22,241	22.420	498,643.220	
EASYJET PLC	13,628	16.895	230,245.060	

AVIVA PLC	277,861	5.416	1,504,895.170	
CRODA INTERNATIONAL	8,407	46.410	390,168.870	
DIAGEO PLC	186,366	26.700	4,975,972.200	
SCHRODERS PLC	14,000	34.220	479,080.000	
DCC PLC	5,936	74.600	442,825.600	
NATIONAL GRID PLC	266,520	8.439	2,249,162.280	
KINGFISHER PLC	165,680	2.973	492,566.640	
BAE SYSTEMS PLC	225,176	6.190	1,393,839.440	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	169,676	39.150	6,642,815.400	
COBHAM PLC	142,739	1.172	167,290.100	
NEXT PLC	9,731	55.680	541,822.080	
IMPERIAL BRANDS PLC	72,328	27.955	2,021,929.240	
IMI PLC	21,218	10.900	231,276.200	
JOHNSON MATTHEY PLC	12,527	34.460	431,680.420	
ANGLO AMERICAN PLC	100,380	18.002	1,807,040.760	
COMPASS GROUP PLC	115,111	15.160	1,745,082.760	
HSBC HOLDINGS PLC	1,488,734	7.317	10,893,066.670	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	423,649	2.800	1,186,217.200	
CENTRICA PLC	392,766	1.465	575,402.190	
UNILEVER PLC	89,305	41.400	3,697,227.000	
MEGGITT PLC	62,181	4.847	301,391.300	
MORRISON <WM.> SUPERMARKETS	155,682	2.516	391,695.910	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	72,363	7.812	565,299.750	
RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	80,864	6.552	529,820.920	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	25,308	27.950	707,358.600	
PEARSON PLC	65,009	9.204	598,342.830	
PERSIMMON PLC	23,150	27.570	638,245.500	
PRUDENTIAL PLC	197,581	19.320	3,817,264.920	
RIO TINTO PLC	92,130	41.965	3,866,235.450	
VODAFONE GROUP PLC	1,993,578	2.101	4,188,507.370	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	50,208	57.320	2,877,922.560	
RELX PLC	82,464	16.055	1,323,959.520	
OLD MUTUAL PLC	339,296	2.609	885,223.260	
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	116,966	8.246	964,501.630	
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	246,107	2.865	705,096.550	
ST JAMES'S PLACE PLC	40,884	11.790	482,022.360	
TRAVIS PERKINS PLC	20,357	13.065	265,964.200	
SSE PLC	73,043	14.015	1,023,697.640	
BP PLC	1,455,889	5.640	8,211,213.960	
SHIRE PLC	69,636	40.615	2,828,266.140	
SAGE GROUP PLC(THE)	85,271	6.728	573,703.280	

SMITHS GROUP PLC	31,720	16.720	530,358.400	
STANDARD CHARTERED PLC	237,533	7.646	1,816,177.310	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	5,397,548	0.668	3,605,562.060	
TAYLOR WIMPLEY PLC	253,022	1.927	487,573.390	
TESCO PLC	740,567	2.442	1,808,464.610	
3I GROUP PLC	66,784	9.746	650,876.860	
SMITH & NEPHEW PLC	66,155	13.080	865,307.400	
GLAXOSMITHKLINE PLC	369,384	14.770	5,455,801.680	
WEIR GROUP	18,336	22.770	417,510.720	
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	21,888	44.710	978,612.480	
BABCOCK INT'L GROUP	21,302	7.658	163,130.710	
WPP PLC	90,628	13.060	1,183,601.680	
FERGUSON PLC	18,238	56.600	1,032,270.800	
ASTRAZENECA PLC	94,694	52.520	4,973,328.880	
WHITBREAD PLC	12,159	42.160	512,623.440	
CARNIVAL PLC	13,153	48.580	638,972.740	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	120,290	2.938	353,412.020	
JOHN WOOD GROUP PLC	48,988	5.874	287,755.510	
INTERTEK GROUP PLC	11,273	51.000	574,923.000	
BURBERRY GROUP PLC	29,893	17.920	535,682.560	
INVESTEC PLC	50,655	5.860	296,838.300	
INTERCONTINENTAL HOTELS	12,362	48.240	596,342.880	
ITV PLC	247,210	1.603	396,277.630	
SAINSBURY (J) PLC	109,410	3.049	333,591.090	
RANDGOLD RESOURCES LTD NPR	6,998	56.740	397,066.520	
G4S PLC	122,250	2.605	318,461.250	
ADMIRAL GROUP PLC	15,893	19.720	313,409.960	
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	10,726	41.450	444,592.700	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	341,563	26.335	8,995,061.600	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	275,246	26.930	7,412,374.780	
TUI AG-DI	30,153	17.385	524,209.900	
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	184,183	3.675	676,872.520	
EXPERIAN PLC	71,068	17.580	1,249,375.440	
MONDI PLC	24,061	20.070	482,904.270	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	21,290	18.815	400,571.350	
FRESNILLO PLC NPR	15,639	12.945	202,446.850	
GLENCORE PLC	923,290	3.762	3,473,416.980	
GVC HOLDINGS PLC	36,000	8.725	314,100.000	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP PLC	112,694	3.735	420,912.090	
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	30,616	6.940	212,475.040	

	COCA-COLA HBC AG	13,406	25.400	340,512.400	
	CONVATEC GROUP PLC	118,400	2.338	276,819.200	
	ROYAL MAIL PLC	55,060	6.114	336,636.840	
	MERLIN ENTERTAINMENTS PLC	50,037	3.713	185,787.380	
	WORLDPAY INC	10,775	61.560	663,309.000	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC-C	8,304,586	0.001	8,304.580	
	MICRO FOCUS INTERNATIONAL PLC	32,342	12.720	411,390.240	
	AUTO TRADER GROUP PLC	76,348	3.707	283,022.030	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	335,000	2.326	779,210.000	
イギリス・ボンド	小計	31,170,879		145,391,240.830 (21,525,173,206)	
イスラエル・シュケル	BANK HAPOLIM BM	78,428	25.580	2,006,188.240	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	103,061	21.770	2,243,637.970	
	BEZEQ ISRAELI TELECOMMUNICATION CORP LTD	188,230	4.160	783,036.800	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,760	406.900	716,144.000	
	FRUTAROM INDUSTRIES LTD	2,600	346.500	900,900.000	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	49,411	16.550	817,752.050	
	NICE LTD	4,035	348.200	1,404,987.000	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	10,444	66.910	698,808.040	
	AZRIELI GROUP	4,428	166.300	736,376.400	
イスラエル・シュケル	小計	442,397		10,307,830.500 (316,347,318)	
オーストラリア・ドル	RAMSAY HEALTH CARE LTD	11,115	64.550	717,473.250	
	AUST AND NZ BANKING GROUP LT	218,921	28.080	6,147,301.680	
	AMCOR LTD	80,741	13.760	1,110,996.160	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	253,113	29.850	7,555,423.050	
	BANK OF QUEENSLAND LTD	30,569	10.140	309,969.660	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	114,125	4.840	552,365.000	
	TELSTRA CORP LTD	272,919	3.170	865,153.230	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD	39,014	10.770	420,180.780	
	AMP LTD	200,498	3.960	793,972.080	
	ASX LTD	19,891	61.960	1,232,446.360	
	BHP BILLITON LTD	239,570	32.750	7,845,917.500	
	CALTEX AUSTRALIA LTD	20,946	29.880	625,866.480	
	HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	22,182	3.500	77,637.000	
	COMPUTERSHARE LT	38,040	17.620	670,264.800	
	CSL LIMITED	34,057	176.080	5,996,756.560	
	REA GROUP LTD	4,119	84.300	347,231.700	

TRANSURBAN GROUP	186,946	11.950	2,234,004.700	
COCA-COLA AMATIL LTD	48,601	9.080	441,297.080	
COCHLEAR LTD	3,992	194.000	774,448.000	
ORIGIN ENERGY LTD	121,721	9.950	1,211,123.950	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	129,233	70.980	9,172,958.340	
BORAL LIMITED	86,101	6.650	572,571.650	
RIO TINTO LIMITED	32,815	82.950	2,722,004.250	
APA GROUP	77,562	8.390	650,745.180	
ARISTOCRAT LEISU	37,393	28.060	1,049,247.580	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	171,471	8.170	1,400,918.070	
TPG TELECOM LTD	28,719	5.790	166,283.010	
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	3,275	59.710	195,550.250	
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	28,489	23.740	676,328.860	
ORICA LTD	25,308	18.520	468,704.160	
CIMIC GROUP LTD	8,709	44.310	385,895.790	
BLUESCOPE STEEL LTD	36,941	17.470	645,359.270	
SYDNEY AIRPORT	85,130	7.150	608,679.500	
MACQUARIE GROUP LTD	25,799	113.990	2,940,828.010	
SUNCORP GROUP LTD	93,181	13.970	1,301,738.570	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	192,882	28.580	5,512,567.560	
NEWCREST MINING LTD	59,818	22.130	1,323,772.340	
OIL SEARCH LTD	93,715	8.480	794,703.200	
INCITEC PIVOT LTD	136,426	3.570	487,040.820	
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	95,390	10.140	967,254.600	
CHALLENGER FINANCIAL SERVICES	45,707	12.710	580,935.970	
SANTOS LTD	133,862	6.260	837,976.120	
SONIC HEALTHCARE	26,192	23.670	619,964.640	
TABCORP HOLDINGS LTD	126,348	4.400	555,931.200	
WESFARMERS LTD	81,021	43.820	3,550,340.220	
ALUMINA LIMITED	184,613	2.790	515,070.270	
WOODSIDE PETROLEUM LTD	78,576	34.000	2,671,584.000	
WOOLWORTHS GROUP LTD	99,142	28.670	2,842,401.140	
SEEK LTD	25,899	20.640	534,555.360	
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES LTD	4,581	42.800	196,066.800	
AUSNET SERVICES	165,066	1.735	286,389.510	
AGL ENERGY LTD	46,315	22.130	1,024,950.950	
BRAMBLES LTD	115,255	9.920	1,143,329.600	
CROWN RESORTS LTD	32,861	13.320	437,708.520	
AURIZON HOLDINGS LTD	139,184	4.430	616,585.120	
TREASURY WINE ESTATES LTD	50,789	19.160	973,117.240	

	HEALTHSCOPE LTD	149,047	2.490	371,127.030	
	MEDIBANK PVT LTD	177,176	3.000	531,528.000	
	SOUTH32 LTD(AUD)	367,057	3.900	1,431,522.300	
オーストラリア・ドル 小計		5,458,128		91,694,064.020 (7,557,424,757)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	16,141	57.010	920,198.410	
	ALIMENTATION COUCHE TARD INC	30,728	54.040	1,660,541.120	
	BARRICK GOLD CORP	83,648	17.250	1,442,928.000	
	ATCO LTD	7,193	39.100	281,246.300	
	BANK OF MONTREAL	47,406	100.340	4,756,718.040	
	BANK OF NOVA SCOTIA	87,876	79.950	7,025,686.200	
	NATIONAL BANK OF CANADA	23,756	62.990	1,496,390.440	
	BCE INC	11,568	53.260	616,111.680	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT	66,737	51.610	3,444,296.570	
	VALEANT PHARMACEUTICALS INTERN	25,819	25.550	659,675.450	
	BOMBARDIER INC 'B'	151,615	4.170	632,234.550	
	SAPUTO INC	14,101	42.720	602,394.720	
	BLACKBERRY LTD	39,652	15.160	601,124.320	
	CGI GROUP INC	21,767	77.600	1,689,119.200	
	CCL INDUSTRIES INC	11,340	61.870	701,605.800	
	CAE INC	23,000	24.430	561,890.000	
	CAMECO CORP	32,627	14.620	477,006.740	
	ROGERS COMM-CL B	25,967	61.330	1,592,556.110	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	33,880	114.730	3,887,052.400	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	79,420	46.460	3,689,853.200	
	CANADIAN TIRE CORP-CL A	4,862	165.870	806,459.940	
	CANADIAN UTILITIES LTD	9,119	32.120	292,902.280	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	54,813	102.500	5,618,332.500	
	FIRST CAPITAL REALTY INC	11,417	20.590	235,076.030	
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	13,930	36.840	513,181.200	
	OPEN TEXT CORP	19,756	44.300	875,190.800	
	EMPIRE CO LTD	15,093	25.090	378,683.370	
	KINROSS GOLD CORP	99,741	4.770	475,764.570	
	FINNING INTERNATIONAL INC	9,892	33.830	334,646.360	
	FORTIS INC	29,002	42.360	1,228,524.720	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	55,296	20.420	1,129,144.320	
	TELUS CORP	15,945	45.740	729,324.300	
GREAT WEST LIFECO INC	19,248	33.330	641,535.840		
IMPERIAL OIL LTD	21,542	41.350	890,761.700		
ENBRIDGE INC	125,330	42.250	5,295,192.500		
IGM FINANCIAL INC	8,426	38.940	328,108.440		

TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	87,995	3.790	333,501.050	
MANULIFE FINANCIAL CORP	145,162	24.740	3,591,307.880	
LINAMAR CORP	3,827	74.790	286,221.330	
LOBLAW CO LTD	15,354	66.320	1,018,277.280	
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANCE AND FINANCIAL SERVICES INC	6,524	52.990	345,706.760	
MAGNA INTERNATIONAL INC	25,339	80.240	2,033,201.360	
SUN LIFE FINANCIAL INC	50,376	53.330	2,686,552.080	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,985	716.470	1,422,192.950	
METRO INC	24,226	40.950	992,054.700	
HUSKY ENERGY INC	28,749	18.120	520,931.880	
CRESCENT POINT ENERGY CORP	39,992	10.350	413,917.200	
EMERA INC	15,709	40.000	628,360.000	
METHANEX CORP	7,381	87.900	648,789.900	
ONEX CORP	6,646	92.340	613,691.640	
GOLDCORP INC	75,202	17.540	1,319,043.080	
POWER CORP OF CANADA	25,052	29.420	737,029.840	
POWER FINANCIAL CORP	17,484	32.100	561,236.400	
ROYAL BANK OF CANADA	106,200	99.960	10,615,752.000	
SNC-LAVALIN GROUP INC	13,134	56.470	741,676.980	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	10,607	239.130	2,536,451.910	
SHAW COMM INC-B	27,548	26.130	719,829.240	
SUNCOR ENERGY INC	122,908	50.370	6,190,875.960	
LUNDIN MINING CORP	35,268	8.610	303,657.480	
ENCANA CORP	69,257	16.840	1,166,287.880	
TECK RESOURCES LTD-CL B	41,016	34.870	1,430,227.920	
THOMSON REUTERS CORP	20,469	49.990	1,023,245.310	
TORONTO DOMINION BANK (THE) C\$	136,076	74.280	10,107,725.280	
TRANSCANADA CORP	62,895	55.850	3,512,685.750	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	5,696	89.020	507,057.920	
WESTON (GEORGE) LTD	3,105	104.260	323,727.300	
INTACT FINANCIAL CORP	10,785	96.400	1,039,674.000	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	33,943	27.250	924,946.750	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,494	973.120	1,453,841.280	
FRANCO-NEVADA CORP NPR	12,787	94.500	1,208,371.500	
CI FINANCIAL CORP	20,695	25.930	536,621.350	
TOURMALINE OIL CORP	15,779	23.640	373,015.560	
KEYERA CORP	13,728	35.500	487,344.000	
ALTAGAS LTD	12,538	25.360	317,963.680	
PEMBINA PIPELINE CORP	43,197	43.990	1,900,236.030	

	DOLLARAMA INC	7,504	147.550	1,107,215.200	
	CENOVUS ENERGY INC W/I	80,545	14.070	1,133,268.150	
	VERMILION ENERGY INC	8,291	44.570	369,529.870	
	ARC RESOURCES LTD	22,997	13.380	307,699.860	
	ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP	30,631	4.810	147,335.110	
	INTER PIPELINE LTD	24,083	23.530	566,672.990	
	NUTRIEN LTD	45,351	62.790	2,847,589.290	
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	14,961	26.950	403,198.950	
	SEVEN GENERATIONS ENERGY LTD	17,231	15.980	275,351.380	
	RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	15,353	72.280	1,109,714.840	
	SHOPIFY INC	6,500	186.400	1,211,600.000	
	HYDRO ONE LTD	38,140	20.000	762,800.000	
カナダ・ドル 小計		3,055,368		132,326,664.170 (11,344,364,919)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE TECH ENG	125,000	3.460	432,500.000	
	SEMBICORP INDUSTRIES	81,400	3.090	251,526.000	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	123,700	2.760	341,412.000	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	692,140	0.365	252,631.100	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	134,800	28.840	3,887,632.000	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	29,000	12.550	363,950.000	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	5,944	32.910	195,617.040	
	SINGAPORE AIRPORT TERMINAL SERVICES LTD	42,300	5.500	232,650.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	68,900	7.670	528,463.000	
	CAPITALAND LTD	192,415	3.640	700,390.600	
	GENTING SINGAPORE PLC	416,400	1.160	483,024.000	
	KEPPEL CORP LTD	98,400	8.200	806,880.000	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	177,900	2.340	416,286.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	225,453	13.130	2,960,197.890	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	591,922	3.520	2,083,565.440	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	47,500	11.010	522,975.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	94,500	29.000	2,740,500.000	
	UOL GROUP LIMITED	40,500	8.600	348,300.000	
WILMAR INTERNATIONAL LTD	92,000	3.210	295,320.000		
YANGZIJIANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	188,800	1.190	224,672.000		
シンガポール・ドル 小計		3,468,974		18,068,492.070 (1,478,544,706)	
スイス・フラン	CREDIT SUISSE GROUP AG	187,381	16.800	3,148,000.800	
	NESTLE SA-REGISTERED	231,295	77.400	17,902,233.000	
	CIE FINANC RICHEMONT	39,186	96.380	3,776,746.680	

ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN	52,431	226.000	11,849,406.000	
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2,835	214.800	608,958.000	
SIKA INHABER	151	7,505.000	1,133,255.000	
SGS SA-REG	405	2,506.000	1,014,930.000	
NOVARTIS AG-REG SHS	166,499	77.700	12,936,972.300	
BALOISE HOLDING AG -R	4,127	155.700	642,573.900	
BARRY CALLEBAUT AG	144	1,842.000	265,248.000	
CLARIANT AG-REG	19,496	24.040	468,683.840	
SWISSCOM AG-REG	1,795	458.900	823,725.500	
ABB LTD	139,628	23.920	3,339,901.760	
ADECCO GROUP AG-REG	12,341	64.120	791,304.920	
GEBERIT AG	2,801	445.600	1,248,125.600	
LONZA GROUP AG-REG	5,389	263.200	1,418,384.800	
LINDT & SPRUENGLI PART	75	6,340.000	475,500.000	
LINDT & SPRUENGLI NAMEN	9	74,200.000	667,800.000	
GIVAUDAN-REG	692	2,266.000	1,568,072.000	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	10,843	318.300	3,451,326.900	
LAFARGEHOLCIM LTD	32,676	55.020	1,797,833.520	
SONOVA HOLDING AG	3,168	165.900	525,571.200	
KUEHNE & NAGEL INTL AG	3,687	156.550	577,199.850	
STRAUMANN HOLDING AG	1,072	686.000	735,392.000	
THE SWATCH GROUP AG-B	2,311	476.100	1,100,267.100	
THE SWATCH GROUP AG-REG	4,592	88.400	405,932.800	
SCHINDLER NAMEN	1,663	208.000	345,904.000	
SWISS LIFE HOLDING AG	2,225	357.900	796,327.500	
VIFOR PHARMA AG	3,050	157.000	478,850.000	
EMS-CHEMIE HOLDING	553	629.000	347,837.000	
SWISS PRIME SITE AG	5,990	94.100	563,659.000	
PARGESA HOLDING PORTEUR	3,000	93.550	280,650.000	
DUFREY GROUP	2,390	147.000	351,330.000	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,272	744.000	946,368.000	
JULIUS BAER GROUP LTD	15,227	61.580	937,678.660	
SWISS RE LTD	24,162	94.640	2,286,691.680	
UBS GROUP AG	272,409	16.215	4,417,111.930	
スイス・フラン 小計	1,256,970		84,425,753.240 (9,213,382,451)	
スウェーデン・ク ローナ				
ATLAS COPCO AB-A SHS	48,377	352.700	17,062,567.900	
ATLAS COPCO AB-B SHS	30,899	318.200	9,832,061.800	
ERICSSON LM-B SHS	221,748	70.400	15,611,059.200	
GETINGE AB-B SHS	13,153	87.380	1,149,309.140	
LUNDBERGS B	3,691	605.500	2,234,900.500	
SKF AB-B SHS	24,866	186.650	4,641,238.900	
SANDVIK AB	76,781	159.700	12,261,925.700	

	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	128,935	86.140	11,106,460.900	
	SKANSKA AB-B SHS	21,179	166.450	3,525,244.550	
	SWEDBANK AB	66,507	195.700	13,015,419.900	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	108,388	100.500	10,892,994.000	
	VOLVO AB-B SHS	113,672	157.900	17,948,808.800	
	SWEDISH MATCH AB	11,481	412.600	4,737,060.600	
	TELE2 AB-B SHS	26,976	113.950	3,073,915.200	
	NORDEA AB	218,620	90.640	19,815,716.800	
	INDUSTRIVARDEN C	11,403	197.200	2,248,671.600	
	ELECTROLUX AB-SER B	19,191	231.800	4,448,473.800	
	SECURITAS AB-B SHS	24,098	141.400	3,407,457.200	
	INVESTOR AB-B SHS	33,412	386.000	12,897,032.000	
	HENNES&MAURITZ AB-B SHS	66,448	145.240	9,650,907.520	
	ASSA ABLOY AB-B	77,223	191.050	14,753,454.150	
	TELIA CO AB	184,927	43.800	8,099,802.600	
	LUNDIN PETROLEUM AB	16,790	264.600	4,442,634.000	
	BOLIDEN AB	21,855	318.200	6,954,261.000	
	ALFA LAVAL AB	30,655	229.200	7,026,126.000	
	KINNEVIK AB-B	18,310	320.300	5,864,693.000	
	MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR SA	5,332	563.000	3,001,916.000	
	ICA GRUPPEN AB	5,920	273.800	1,620,896.000	
	HUSQVARNA AB-B SHS	33,692	86.500	2,914,358.000	
	HEXAGON AB	18,360	479.700	8,807,292.000	
	ESSITY AB-B	51,357	233.500	11,991,859.500	
	スウェーデン・クローナ 小計	1,734,246		255,038,518.260 (3,228,787,642)	
デンマーク・クローネ	CARLSBERG AS-B	7,330	713.200	5,227,756.000	
	A P MOLLER A/S	481	10,535.000	5,067,335.000	
	AP MOLLER MAERSK A	273	9,930.000	2,710,890.000	
	DANSKE BANK A/S	59,087	215.200	12,715,522.400	
	GENMAB A/S	4,613	1,244.000	5,738,572.000	
	NOVOZYMES-B SHS	15,904	316.900	5,039,977.600	
	NOVO NORDISK A/S-B	139,017	300.200	41,732,903.400	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	15,808	440.100	6,957,100.800	
	COLOPLAST-B	8,286	594.600	4,926,855.600	
	DSV A/S	13,040	514.400	6,707,776.000	
	WILLIAM DEMANT	6,537	237.600	1,553,191.200	
	H LUNDBECK A/S	4,840	411.300	1,990,692.000	
	TRYG A/S	11,107	146.500	1,627,175.500	
	PANDORA A/S	8,251	692.800	5,716,292.800	
	CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S	7,708	578.200	4,456,765.600	
	ISS A/S	11,125	220.900	2,457,512.500	
	ORSTED A/S	15,020	400.800	6,020,016.000	
	デンマーク・クローネ 小計	328,427		120,646,334.400	

(2,111,310,852)

ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	97,992	6.550	641,847.600	
	FISHER & PAYKEL	60,000	12.750	765,000.000	
	FLETCHER BUILDING LTD	75,281	6.400	481,798.400	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	159,623	3.545	565,863.530	
ニュージーランド・ドル 小計		392,896		2,454,509.530 (187,082,716)	
ノルウェー・クローネ	MARINE HARVEST	33,000	175.500	5,791,500.000	
	DNB ASA	70,426	155.750	10,968,849.500	
	NORSK HYDRO ASA	91,879	48.640	4,468,994.560	
	TELENOR ASA	53,178	174.500	9,279,561.000	
	ORKLA ASA	61,421	74.120	4,552,524.520	
	STATOIL ASA	87,000	214.600	18,670,200.000	
	YARA INTERNATIONAL ASA	16,000	341.600	5,465,600.000	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	16,683	128.000	2,135,424.000	
ノルウェー・クローネ 小計		429,587		61,332,653.580 (838,417,374)	
ユーロ	CRH PLC	65,287	30.920	2,018,674.040	
	PADDY POWER BETFAIR PLC	6,246	82.000	512,172.000	
	KERRY GROUP PLC-A	11,576	89.000	1,030,264.000	
	UMICORE	15,320	47.900	733,828.000	
	AIR LIQUIDE	32,310	108.600	3,508,866.000	
	AIRBUS SE	43,659	99.630	4,349,746.170	
	AXA	146,116	22.370	3,268,614.920	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	34,622	20.660	715,290.520	
	ADIDAS AG	14,139	190.600	2,694,893.400	
	ASSICURAZIONI GENERALI	95,795	16.405	1,571,516.970	
	ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA	57,216	18.200	1,041,331.200	
	DASSAULT AVIATION SA	157	1,708.000	268,156.000	
	DANONE	43,686	65.220	2,849,200.920	
	SAFRAN SA	25,571	99.740	2,550,451.540	
	INTESA SANPAOLO	1,052,513	3.131	3,295,418.200	
	INTESA SANPAOLO-RNC	51,178	3.279	167,812.660	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	24,725	92.360	2,283,601.000	
	ACCOR SA	16,000	47.370	757,920.000	
	BOSKALIS WESTMINSTER CT	7,563	24.640	186,352.320	
	BOUYGUES	13,996	42.870	600,008.520	
	BNP PARIBAS	82,934	62.750	5,204,108.500	
	RELX NV	70,826	18.145	1,285,137.770	
	THALES SA	8,128	110.950	901,801.600	
CAPGEMINI SA	11,481	115.650	1,327,777.650		
CASINO GUICHARD PERRACHON	4,264	41.370	176,401.680		
INGENICO GROUP	4,334	75.480	327,130.320		

UNICREDIT SPA	142,664	17.860	2,547,979.040	
NATIXIS	70,166	6.910	484,847.060	
KONINKLIJKE DSM NV	13,216	86.160	1,138,690.560	
COMMERZBANK AG	83,118	10.870	903,492.660	
EIFFAGE	4,777	100.400	479,610.800	
FRESENIUS SE & CO KGAA	32,777	67.360	2,207,858.720	
UNITED INTERNET	9,882	57.080	564,064.560	
FUCHS PETROLUB SE PREF	5,546	45.420	251,899.320	
PUBLICIS GROUPE	15,068	62.360	939,640.480	
MAN SE	3,396	97.700	331,789.200	
FAURECIA	8,000	70.380	563,040.000	
IBERDROLA SA	416,818	6.518	2,716,819.720	
ENI SPA	200,300	16.408	3,286,522.400	
IMERYSA SA	2,256	75.350	169,989.600	
JERONIMO MARTINS	19,517	13.515	263,772.250	
KBC GROUPE	18,378	71.980	1,322,848.440	
HANNOVER RUECK SE	4,868	113.800	553,978.400	
WARTSILA OYJ	34,935	18.010	629,179.350	
L'OREAL	19,036	201.400	3,833,850.400	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	20,764	292.350	6,070,355.400	
LAGARDERE S.C.A.	9,600	23.050	221,280.000	
GEA GROUP AG	11,838	33.080	391,601.040	
BOLLORE	71,347	4.338	309,503.280	
MEDIOBANCA SPA	42,404	9.870	418,527.480	
MICHELIN(CGDE)-B	12,118	118.750	1,439,012.500	
CONTINENTAL AG	7,776	224.400	1,744,934.400	
DEUTSCHE POST AG-REG	69,944	34.020	2,379,494.880	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	14,426	14.100	203,406.600	
NOKIAN RENKAAT OYJ	9,399	31.570	296,726.430	
AXEL SPRINGER SE	3,067	67.000	205,489.000	
OMV AG	9,766	54.500	532,247.000	
PERNOD-RICARD	15,401	138.700	2,136,118.700	
PEUGEOT SA	42,232	20.050	846,751.600	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG- PFD	10,591	70.340	744,970.940	
RENAULT SA	15,632	88.400	1,381,868.800	
REPSOL SA	93,766	16.470	1,544,326.020	
REMY COINTREAU	1,860	117.500	218,550.000	
MERCK KGAA	9,551	83.360	796,171.360	
COMPAGNIE DE SAINT- GOBAIN	35,706	44.075	1,573,741.950	
RWE AG	39,183	20.260	793,847.580	
SEB SA	1,405	160.200	225,081.000	
LUXOTTICA GROUP SPA	11,602	52.500	609,105.000	
SOCIETE GENERALE-A	58,110	42.545	2,472,289.950	
VINCI S.A.	38,902	85.580	3,329,233.160	
SODEXO	6,286	83.240	523,246.640	

SOLVAY SA	5,036	115.900	583,672.400	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	42,631	76.420	3,257,861.020	
VIVENDI SA	79,680	23.100	1,840,608.000	
SAP SE	73,011	97.540	7,121,492.940	
TELEFONICA S.A	358,674	8.340	2,991,341.160	
TOTAL SA	177,111	52.710	9,335,520.810	
VALEO	17,731	57.380	1,017,404.780	
E.ON SE	164,012	9.476	1,554,177.710	
VOEST-ALPINE AG	9,875	45.980	454,052.500	
HENKEL AG & CO KGAA	9,142	97.700	893,173.400	
SIEMENS AG-REG	56,716	115.900	6,573,384.400	
UPM-KYMMENE OYJ	41,197	30.620	1,261,452.140	
ING GROEP NV-CVA	294,820	13.412	3,954,125.840	
BAYER AG	61,526	102.640	6,315,028.640	
STORA ENSO OYJ-R SHS	42,303	16.750	708,575.250	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	12,178	104.350	1,270,774.300	
DAIMLER AG	72,949	67.190	4,901,443.310	
BASF SE	69,380	87.380	6,062,424.400	
BEIERSDORF AG	6,780	97.520	661,185.600	
HOCHTIEF AG	1,707	149.500	255,196.500	
HEIDELBERGCEMENT AG	11,009	81.080	892,609.720	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	15,048	85.440	1,285,701.120	
ORANGE	141,819	15.145	2,147,848.750	
SAMPO OYJ-A SHS	36,533	44.000	1,607,452.000	
RANDSTAD NV	7,794	53.580	417,602.520	
ALLIANZ SE	32,994	192.040	6,336,167.760	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	152,374	3.087	470,378.530	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	100,000	19.392	1,939,200.000	
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	17,602	28.720	505,529.440	
HERMES INTL	2,285	580.200	1,325,757.000	
ENDESA S.A.	21,037	19.460	409,380.020	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	15,963	24.290	387,741.270	
ERSTE GROUP BANK AG	20,754	38.170	792,180.180	
MUENCHENER RUECKVER AG- REG	11,602	191.100	2,217,142.200	
ARCELOR MITTAL (NL)	47,245	29.560	1,396,562.200	
SOCIETE BIC SA	2,478	85.250	211,249.500	
DASSAULT SYSTEMES SA	8,961	111.350	997,807.350	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	15,249	36.120	550,793.880	
HEINEKEN NV	20,425	87.620	1,789,638.500	
AKZO NOBEL	18,209	75.640	1,377,328.760	
ASML HOLDING NV	29,667	167.300	4,963,289.100	
AEGON NV	120,404	5.784	696,416.730	
BANKINTER S.A.	57,960	9.114	528,247.440	
VOLKSWAGEN AG	3,204	169.200	542,116.800	

VOLKSWAGEN AG PFD	13,134	171.600	2,253,794.400	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	504,414	6.852	3,456,244.720	
KERING	5,479	488.100	2,674,299.900	
CNP ASSURANCES	13,987	20.920	292,608.040	
FORTUM OYJ	29,739	19.730	586,750.470	
AGEAS	12,993	44.620	579,747.660	
UCB SA	8,747	63.260	553,335.220	
THYSSENKRUPP AG	29,903	22.890	684,479.670	
UNILEVER NV-CVA	121,914	47.735	5,819,564.790	
CARREFOUR SA	39,144	16.470	644,701.680	
GAS NATURAL SDG SA	29,010	21.540	624,875.400	
ATOS SE	7,050	111.600	786,780.000	
NOKIA OYJ	417,248	5.300	2,211,414.400	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	73,000	35.520	2,592,960.000	
WOLTERS KLUWER-CVA	20,558	46.550	956,974.900	
SANOFI	84,037	66.130	5,557,366.810	
STMICROELECTRONICS NV	45,866	19.955	915,256.030	
ELISA OYJ	9,517	36.710	349,369.070	
BANCO SANTANDER SA	1,201,199	5.486	6,589,777.710	
METSO OYJ	8,585	30.120	258,580.200	
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	34,596	17.210	595,397.160	
QIAGEN N.V.	13,642	29.330	400,119.860	
1&1 DRILLISCH AG	3,149	63.200	199,016.800	
DEUTSCHE BANK AG-REG	149,244	11.604	1,731,827.370	
BMW VORZUG	4,116	80.050	329,485.800	
K & S	14,982	24.420	365,860.440	
ENEL SPA	579,218	5.074	2,938,952.130	
COLRUYT NV	4,673	47.340	221,219.820	
VOPAK (KON.)	5,364	41.250	221,265.000	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	257,485	14.310	3,684,610.350	
LEONARDO SPA	26,269	9.612	252,497.620	
UBISOFT ENTERTAINMENT	3,930	85.960	337,822.800	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	81,774	23.910	1,955,216.340	
KONINKLIJKE KPN NV	228,967	2.573	589,132.090	
EUROFINS SCIENTIFIC	794	448.400	356,029.600	
UNIPOLSAI SPA	91,992	2.177	200,266.580	
TELEPERFORMANCE	3,607	135.700	489,469.900	
DEUTSCHE BOERSE AG	13,844	116.050	1,606,596.200	
EURAZEO	4,725	70.000	330,750.000	
BANCO SABADELL	367,753	1.721	632,902.910	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	5,814	92.800	539,539.200	
FRAPORT AG	3,149	82.960	261,241.040	
HEINEKEN HOLDING NV-A	8,014	84.600	677,984.400	
INDITEX	82,035	26.970	2,212,483.950	
JC DECAUX SA	6,058	29.460	178,468.680	
ANDRITZ AG	6,265	43.760	274,156.400	

MAPFRE SA	84,474	2.903	245,228.020	
ESSILOR INTL	14,632	115.000	1,682,680.000	
SNAM SPA	158,419	3.825	605,952.670	
CREDIT AGRICOLE SA	85,585	13.425	1,148,978.620	
ENAGAS	18,095	24.410	441,698.950	
WENDEL	2,220	127.500	283,050.000	
WIRECARD AG	7,990	121.500	970,785.000	
TENARIS SA	30,372	16.270	494,152.440	
TELECOM ITALIA SPA	792,163	0.797	631,353.910	
TELECOM ITALIA-RNC	497,596	0.698	347,322.000	
ATLANTIA SPA	34,969	28.110	982,978.590	
ILIAD SA	2,102	169.650	356,604.300	
PROXIMUS	14,283	24.250	346,362.750	
SES FDR	24,585	13.330	327,718.050	
TERNA SPA	142,206	4.869	692,401.010	
BIOMERIEUX	4,702	69.500	326,789.000	
GRIFOLS SA	18,800	24.900	468,120.000	
FERROVIAL SA	36,997	18.120	670,385.640	
LANXESS AG	6,856	68.360	468,676.160	
NESTE OYJ	8,839	66.660	589,207.740	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	9,641	28.530	275,057.730	
RECORDATI SPA	6,859	30.380	208,376.420	
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	35,583	6.250	222,393.750	
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	5,059	155.000	784,145.000	
KONE OYJ	23,717	42.100	998,485.700	
ENGIE	139,590	14.600	2,038,014.000	
ALSTOM	12,046	38.710	466,300.660	
TELENET GROUP HOLDING NV	3,634	49.620	180,319.080	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	12,542	18.005	225,818.710	
ELECTRICITE DE FRANCE	34,756	12.220	424,718.320	
IPSEN SA	2,487	130.050	323,434.350	
DEUTSCHE WOHNEN	26,714	39.480	1,054,668.720	
ARKEMA SA	6,507	108.650	706,985.550	
LEGRAND SA	19,920	66.660	1,327,867.200	
ADP	2,313	184.100	425,823.300	
ORION OYJ	8,051	25.180	202,724.180	
RTL GROUP SA	3,446	70.950	244,493.700	
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	37,921	16.740	634,797.540	
SYMRISE AG	12,199	71.240	869,056.760	
SCOR SE	13,875	33.230	461,066.250	
REXEL SA	23,245	13.000	302,185.000	
PRYSMIAN SPA	14,925	25.970	387,602.250	
CAIXABANK	262,372	4.268	1,119,803.690	
BUREAU VERITAS SA	21,480	21.890	470,197.200	
GETLINK	37,646	11.800	444,222.800	

SUEZ SA	25,406	11.890	302,077.340	
AMADEUS IT GROUP SA	32,520	64.000	2,081,280.000	
BRENNTAG AG	12,353	50.740	626,791.220	
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GROUP SA	44,747	7.858	351,621.920	
EVONIK INDUSTRIES AG	11,575	31.450	364,033.750	
EDENRED	18,306	28.870	528,494.220	
BANKIA SA	100,675	3.706	373,101.550	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	61,541	4.137	254,595.110	
HUGO BOSS AG -ORD	5,218	75.280	392,811.040	
OSRAM LICHT AG	7,017	52.320	367,129.440	
KION GROUP AG	4,686	71.820	336,548.520	
VONOVIA SE	35,308	39.440	1,392,547.520	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	73,287	7.540	552,583.980	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	10,000	33.220	332,200.000	
FERRARI NV	9,503	113.600	1,079,540.800	
METRO AG	10,774	11.650	125,517.100	
INNOGY SE	9,769	36.300	354,614.700	
CNH INDUSTRIAL NV	78,645	10.300	810,043.500	
AIB GROUP PLC	52,322	5.010	262,133.220	
LINDE AG-TENDER	13,375	193.600	2,589,400.000	
NN GROUP NV	21,965	39.070	858,172.550	
ZALANDO SE	6,674	43.420	289,785.080	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	76,719	18.770	1,440,015.630	
AENA SME SA	5,256	178.100	936,093.600	
ABN AMRO GROUP NV	29,129	26.290	765,801.410	
EXOR NV	7,726	64.740	500,181.240	
ALTICE NV-A	43,403	7.600	329,862.800	
COVESTRO AG	12,239	77.680	950,725.520	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	57,180	79.860	4,566,394.800	
POSTE ITALIANE SPA	40,015	8.116	324,761.740	
AMUNDI SA	3,894	71.880	279,900.720	
SCHAEFFLER AG	12,644	13.315	168,354.860	
UNIPER SE	13,897	27.380	380,499.860	
ユーロ 小計	14,601,275		305,143,076.400 (39,790,657,163)	
香港・ドル				
ASM PACIFIC TECH	16,600	102.400	1,699,840.000	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	164,000	18.500	3,034,000.000	
BANK OF EAST ASIA	76,260	33.850	2,581,401.000	
CLP HOLDINGS LTD	119,500	81.950	9,793,025.000	
PCCW LTD	331,000	4.920	1,628,520.000	
LI & FUNG LTD	532,400	4.230	2,252,052.000	
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	49,000	62.600	3,067,400.000	

HONG KONG EXCHANGES &CLEAR	94,340	258.200	24,358,588.000	
MTR CORP	118,500	45.700	5,415,450.000	
HANG LUNG GROUP LTD	63,000	24.150	1,521,450.000	
HANG SENG BANK LTD	56,000	200.400	11,222,400.000	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	83,844	49.800	4,175,431.200	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	96,500	58.850	5,679,025.000	
(THE) WHARF HOLDINGS LTD	95,750	25.250	2,417,687.500	
HONG KONG & CHINA GAS	610,046	16.680	10,175,567.280	
HYSAN DEVELOPMENT CO	50,000	44.150	2,207,500.000	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	186,000	68.450	12,731,700.000	
KERRY PROPERTIES LTD	33,000	38.300	1,263,900.000	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	262,000	40.850	10,702,700.000	
YUE YUEN INDUSTRIAL HOLDINGS	50,500	22.750	1,148,875.000	
NEW WORLD DEVELOPMENT	441,266	11.440	5,048,083.040	
SHANGRI-LA ASIA LTD	172,000	14.660	2,521,520.000	
SINO LAND CO	255,400	13.200	3,371,280.000	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	114,000	125.600	14,318,400.000	
SWIRE PACIFIC LTD A	30,000	76.850	2,305,500.000	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	113,500	46.900	5,323,150.000	
WHEELLOCK & CO LTD	56,000	56.000	3,136,000.000	
KINGSTON FINANCIAL GROUP LTD	258,000	3.870	998,460.000	
MINTH GROUP LTD	44,000	37.950	1,669,800.000	
SJM HOLDINGS LTD	156,000	8.790	1,371,240.000	
WYNN MACAU LTD	124,400	29.800	3,707,120.000	
MGM CHINA HOLDINGS LTD	64,800	23.100	1,496,880.000	
AIA GROUP LTD	904,027	71.100	64,276,319.700	
HKT TRUST / HKT LTD	282,000	10.440	2,944,080.000	
SANDS CHINA LTD	169,200	46.350	7,842,420.000	
SWIRE PROPERTIES LTD	104,200	28.700	2,990,540.000	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT CO LTD	95,750	60.650	5,807,237.500	
HK ELECTRIC INVESTMENTS & HK ELECTRIC INVESTMENTS LTD	230,000	7.290	1,676,700.000	
WH GROUP LTD	701,500	7.910	5,548,865.000	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	199,332	91.650	18,268,777.800	
CK ASSET HOLDINGS LTD	184,332	67.000	12,350,244.000	
香港・ドル 小計	7,787,947		284,049,129.020 (3,962,485,349)	
合計	93,213,926		295,190,008,471 (295,190,008,471)	

(2) 株式以外の有価証券

平成30年5月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	オーストラリア・ドル	DEXUS	63,819.000	619,044.300	
		GOODMAN GROUP	121,619.000	1,109,165.280	
		GPT GROUP	144,955.000	703,031.750	
		LENDLEASE GROUP	37,363.000	677,017.560	
		MIRVAC GROUP	295,783.000	677,343.070	
		SCENTRE GROUP	383,688.000	1,584,631.440	
		STOCKLAND	249,006.000	1,055,785.440	
		VICINITY CENTRES	270,443.000	692,334.080	
	WESTFIELD CORP	140,035.000	1,281,320.250		
	オーストラリア・ドル	小計	1,706,711.000	8,399,673.170 (692,301,063)	
	シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	200,806.000	530,127.840	
		CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	384,800.000	677,248.000	
		CAPITALAND MALL TRUST	199,000.000	413,920.000	
		SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	192,100.000	364,990.000	
	シンガポール・ドル	小計	976,706.000	1,986,285.840 (162,537,770)	
投資信託受益証券	合計	2,683,417	854,838,833 (854,838,833)		
投資証券	アメリカ・ドル	AGNC INVESTMENT CORP	25,741.000	489,336.410	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	7,304.000	944,845.440	
		AMERICAN TOWER CORP	31,949.000	4,469,345.610	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	77,528.000	804,740.640	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	9,642.000	1,616,963.400	
		BOSTON PROPERTIES INC	11,168.000	1,394,548.160	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	21,975.000	322,593.000	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	6,285.000	553,080.000	
		COLONY NORTHSTAR INC	39,311.000	237,045.330	
		CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	30,388.000	3,188,308.960	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	15,118.000	1,638,035.300	
		DUKE REALTY TRUST	24,470.000	706,693.600	
		EQUINIX INC	5,887.000	2,346,911.420	
		EQUITY RESIDENTIAL	27,070.000	1,702,973.700	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	4,524.000	1,103,448.840	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	8,141.000	774,697.560	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	8,000.000	952,320.000	
		GGP INC	43,463.000	887,514.460	
		HCP INC	34,130.000	821,167.800	

	HOST HOTELS & RESORTS INC	51,147.000	1,069,995.240	
	INVITATION HOMES INC	22,567.000	534,612.230	
	IRON MOUNTAIN INC	19,265.000	649,615.800	
	KIMCO REALTY	32,980.000	480,188.800	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	11,649.000	510,342.690	
	MID AMERICA	8,123.000	755,520.230	
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	10,544.000	427,770.080	
	PROLOGIS INC	38,966.000	2,555,779.940	
	PUBLIC STORAGE	11,151.000	2,362,339.350	
	REALTY INCOME CORP	18,985.000	1,016,077.200	
	REGENCY CENTERS CORP	11,294.000	662,280.160	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	8,169.000	1,322,969.550	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	23,209.000	3,741,754.980	
	SL GREEN	9,397.000	951,164.340	
	THE MACERICH COMPANY	9,014.000	518,935.980	
	UDR INC	17,458.000	638,613.640	
	VENTAS INC	25,041.000	1,345,703.340	
	VEREIT INC	72,429.000	514,970.190	
	VORNADO REALTY TRUST	12,211.000	858,066.970	
	WELLTOWER INC	26,516.000	1,488,608.240	
	WEYERHAEUSER CO	56,867.000	2,091,568.260	
アメリカ・ドル 小計		929,076.000	49,451,446.840 (5,414,438,915)	
イギリス・ボンド	BRITISH LAND CO PLC	71,871.000	495,478.670	
	HAMMERSON PLC	58,616.000	323,091.390	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	71,358.000	696,525.430	
	SEGRO PLC	104,000.000	676,208.000	
イギリス・ボンド 小計		305,845.000	2,191,303.490 (324,422,481)	
カナダ・ドル	H & R REAL ESTATE INVESTMENT	10,748.000	224,525.720	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	9,675.000	228,910.500	
	SMARTCENTRES REIT	2,582.000	73,664.460	
カナダ・ドル 小計		23,005.000	527,100.680 (45,188,341)	
ユーロ	FONCIERE DES REGIONS	2,343.000	225,279.450	
	GECINA SA	3,670.000	530,682.000	
	ICADE	2,234.000	177,491.300	
	KLEPIERRE	17,042.000	580,109.680	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	7,221.000	1,418,204.400	
ユーロ 小計		32,510.000	2,931,766.830 (382,302,394)	
香港・ドル	LINK REIT	163,500.000	10,946,325.000	
香港・ドル 小計		163,500.000	10,946,325.000 (152,701,234)	

投資証券 合計	1,453,936	6,319,053,365 (6,319,053,365)	
合計		7,173,892,198 (7,173,892,198)	

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 602銘柄	62.69%	-%	-%	65.83%
	投資証券 40銘柄	-%	-%	1.75%	
イギリス・ポンド	株式 100銘柄	6.97%	-%	-%	7.23%
	投資証券 4銘柄	-%	-%	0.11%	
イスラエル・シケル	株式 9銘柄	0.10%	-%	-%	0.10%
オーストラリア・ドル	株式 59銘柄	2.45%	-%	-%	2.73%
	投資信託 受益証券 9銘柄	-%	0.22%	-%	
カナダ・ドル	株式 87銘柄	3.67%	-%	-%	3.77%
	投資証券 3銘柄	-%	-%	0.01%	
シンガポール・ドル	株式 20銘柄	0.48%	-%	-%	0.54%
	投資信託 受益証券 4銘柄	-%	0.05%	-%	
スイス・フラン	株式 37銘柄	2.98%	-%	-%	3.05%
スウェーデン・クローナ	株式 31銘柄	1.05%	-%	-%	1.07%
デンマーク・クローネ	株式 17銘柄	0.68%	-%	-%	0.70%
ニュージーランド・ドル	株式 4銘柄	0.06%	-%	-%	0.06%
ノルウェー・クローネ	株式 8銘柄	0.27%	-%	-%	0.28%
ユーロ	株式 239銘柄	12.88%	-%	-%	13.29%
	投資証券 5銘柄	-%	-%	0.12%	
香港・ドル	株式 41銘柄	1.28%	-%	-%	1.36%
	投資証券 1銘柄	-%	-%	0.05%	

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

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

「外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成29年11月13日現在	平成30年5月11日現在
資産の部			
流動資産			
預金		3,315,867,160	1,336,391,650
コール・ローン		390,745,286	624,002,470
国債証券		237,551,932,252	216,308,803,059
派生商品評価勘定		3,562	-
未収利息		2,099,736,012	1,887,079,130
前払費用		56,173,969	91,755,725
流動資産合計		243,414,458,241	220,248,032,034
資産合計		243,414,458,241	220,248,032,034
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		550,199	-
未払解約金		500,492,000	560,760,000
流動負債合計		501,042,199	560,760,000
負債合計		501,042,199	560,760,000
純資産の部			
元本等			
元本	1	131,078,230,921	122,096,555,373
剰余金			
剰余金又は欠損金()		111,835,185,121	97,590,716,661
元本等合計		242,913,416,042	219,687,272,034
純資産合計		242,913,416,042	219,687,272,034
負債純資産合計		243,414,458,241	220,248,032,034

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. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建資産及び負債は、決算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

項目	平成29年11月13日現在	平成30年5月11日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	144,018,643,828円	131,078,230,921円
同期中追加設定元本額	9,805,011,406円	16,729,345,383円
同期中一部解約元本額	22,745,424,313円	25,711,020,931円
元本の内訳		
ファンド名		
D I A M外国債券パッシブ・ファンド	6,886,276,770円	7,050,049,463円
M I T O ラップ型ファンド（安定型）	17,135,901円	13,305,363円
M I T O ラップ型ファンド（中立型）	44,601,624円	37,652,944円
M I T O ラップ型ファンド（積極型）	53,962,111円	45,093,101円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	49,851,313円	78,626,946円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	51,161,831円	80,011,315円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	37,338,175円	44,833,056円
たわらノーロード 先進国債券	1,145,428,809円	1,833,616,270円
たわらノーロード 先進国債券<ラップ向け>	606,412円	606,412円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	10,175,406円	35,774,529円
たわらノーロード バランス（堅実型）	16,078円	628,907円
たわらノーロード バランス（標準型）	21,437円	2,988,578円
たわらノーロード バランス（積極型）	5,360円	1,191,077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）	- 円	109,755円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（安定型）	- 円	5,502,203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）	- 円	4,431,872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）	- 円	853,361円

たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	- 円	89,471円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	- 円	403,528円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	- 円	233,604円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	- 円	341,495円
D I A M外国債券インデックスファンド < D C年金>	4,940,244,735円	5,073,038,689円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金 > 1 安定型	455,372,807円	491,188,985円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金 > 2 安定・成長型	1,489,280,019円	1,595,478,359円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金 > 3 成長型	1,560,312,468円	1,699,272,358円
D I A M D C バランス30インデックス ファンド	358,729,368円	373,223,365円
D I A M D C バランス50インデックス ファンド	765,153,538円	800,088,859円
D I A M D C バランス70インデックス ファンド	592,891,809円	626,109,377円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配 型>	25,097,551円	23,962,825円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	593,494,938円	599,670,192円
マネックス資産設計ファンド エボ リューション	8,668,156円	17,303,931円
D I A M D C 8資産バランスファン ド(新興国10)	16,354,194円	18,007,015円
D I A M D C 8資産バランスファン ド(新興国20)	35,233,383円	42,422,763円
D I A M D C 8資産バランスファン ド(新興国30)	63,699,968円	78,399,336円
クルーズコントロール	4,024,051,331円	3,040,183,986円
D I A M 8資産バランスファンドN< D C年金>	61,102,641円	73,287,083円
D I A M D C バランス・F(成長 型)	100,188,551円	132,754,072円
クルーズコントロール< D C年金>	1,364,429円	1,195,657円
D I A Mコア資産設計ファンド(堅実 型)	11,762,343円	8,793,931円
D I A Mコア資産設計ファンド(積極 型)	30,164,786円	27,540,877円
ダイナミック・ナビゲーション	395,271円	358,265円
4資産分散投資・スタンダード< D C年 金>	- 円	5,440,115円
D I A Mパッシブ資産分散ファンド	1,454,195,815円	1,370,643,849円
D I A M為替フルヘッジ型外国債券パ ッシブ私募ファンド(適格機関投資家向 け)	6,982,990,609円	6,972,143,836円
D I A M外国債券パッシブファンド(適 格機関投資家向け)	5,194,722,760円	4,074,076,473円

外国債券パッシブファンド(適格機関投資家限定)	3,982,588,056円	3,312,147,806円
先進国債券パッシブファンド(適格機関投資家限定)	576,382,992円	6,092,071,090円
D I A Mワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	105,893,834円	105,057,530円
D I A Mグローバル・バランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	1,021,028,101円	910,853,702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)	736,483,367円	693,145,902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)	63,495,319円	55,826,267円
D I A M国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	123,258,321円	105,474,980円
D I A M国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	29,850,876円	25,650,246円
D I A M国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	12,627,935円	9,657,991円
D I A M世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	80,853,577円	67,846,160円
D I A M世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	90,781,729円	82,558,475円
D I A Mバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	3,898,675,319円	3,652,549,269円
D I A Mバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	2,572,366,460円	2,411,074,987円
D I A Mバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	4,279,645,478円	4,082,018,848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)	780,829,260円	732,897,527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)	639,704,110円	397,770,899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)	3,689,236,645円	3,434,426,589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)	12,983,252,881円	6,067,800,616円
D I A Mグローバル 私募ファンド(適格機関投資家向け)	13,975,529円	13,975,529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)	262,996,270円	31,623,028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)	4,862,190,022円	1,274,515,171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)	15,315,781,751円	14,916,192,755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)	19,908,059,568円	19,568,622,784円
D I A Mバランス30VA(適格機関投資家限定)	14,282,938円	21,219,239円
D I A Mバランス50VA(適格機関投資家限定)	17,950,118円	1,447,528円
D I A Mバランス70VA(適格機関投資家限定)	5,615,626円	5,503,464円

D I A M世界アセットバランスファンド 4 V A (適格機関投資家限定)	17,720,241,476円	17,425,048,455円
D I A M世界バランス25 V A (適格機 関投資家限定)	106,981,803円	104,877,846円
D I A Mバランス20 V A (適格機関投 資家限定)	120,750,510円	113,246,173円
D I A Mバランス40 V A (適格機関投 資家限定)	239,641円	363,474円
D I A Mバランス60 V A (適格機関投 資家限定)	158,712円	163,595円
計	131,078,230,921円	122,096,555,373円
2 . 受益権の総数	131,078,230,921口	122,096,555,373口

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成29年5月12日 至 平成29年11月13日	自 平成29年11月14日 至 平成30年5月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成29年11月13日現在	平成30年5月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 該当事項はありません。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	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29年11月13日現在	平成30年5月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
国債証券	25,350,057	659,526,735
合計	25,350,057	659,526,735

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成29年2月22日から平成29年11月13日まで及び平成30年2月22日から平成30年5月11日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	平成29年11月13日 現在				平成30年5月11日 現在			
	契約額等		時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等		時価 （円）	評価損益 （円）
	（円）	うち 1年超			（円）	うち 1年超		
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	374,558,983	-	375,105,620	546,637	-	-	-	-
アメリカ・ドル	109,176,273	-	109,464,210	287,937	-	-	-	-
イギリス・ポンド	84,964,861	-	85,004,100	39,239	-	-	-	-
カナダ・ドル	30,531,230	-	30,529,730	1,500	-	-	-	-
ユーロ	149,886,619	-	150,107,580	220,961	-	-	-	-
合計	374,558,983	-	375,105,620	546,637	-	-	-	-

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

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成29年11月13日現在	平成30年5月11日現在
1口当たり純資産額	1.8532円	1.7993円
(1万口当たり純資産額)	(18,532円)	(17,993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5月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	US T N/B 0.875 07/31/19	15,000,000.000	14,728,650.000	
		US T N/B 1.0 08/31/19	13,500,000.000	13,256,865.000	
		US T N/B 1.0 09/30/19	15,000,000.000	14,707,500.000	
		US T N/B 1.0 11/30/19	6,500,000.000	6,355,245.000	
		US T N/B 1.125 05/31/19	11,000,000.000	10,865,030.000	
		US T N/B 1.25 01/31/20	10,800,000.000	10,573,848.000	
		US T N/B 1.25 10/31/19	15,000,000.000	14,737,950.000	
		US T N/B 1.375 01/31/20	8,600,000.000	8,438,062.000	
		US T N/B 1.375 03/31/20	6,300,000.000	6,166,566.000	
		US T N/B 1.375 04/30/20	12,000,000.000	11,730,000.000	
		US T N/B 1.375 04/30/21	11,210,000.000	10,791,306.500	
		US T N/B 1.375 05/31/20	3,500,000.000	3,416,315.000	
		US T N/B 1.375 06/30/23	7,000,000.000	6,508,880.000	
		US T N/B 1.375 09/30/23	11,000,000.000	10,186,110.000	
		US T N/B 1.5 08/15/26	7,000,000.000	6,249,670.000	
		US T N/B 1.5 10/31/19	5,180,000.000	5,108,153.400	
		US T N/B 1.625 02/15/26	5,500,000.000	4,991,635.000	
		US T N/B 1.625 05/15/26	8,500,000.000	7,690,460.000	
		US T N/B 1.625 08/15/22	9,500,000.000	9,054,640.000	
		US T N/B 1.625 11/15/22	13,500,000.000	12,822,840.000	
		US T N/B 1.625 11/30/20	8,510,000.000	8,296,569.200	
		US T N/B 1.75 01/31/23	10,000,000.000	9,528,100.000	
		US T N/B 1.75 03/31/22	11,700,000.000	11,259,378.000	
		US T N/B 1.75 05/15/22	11,600,000.000	11,147,252.000	
		US T N/B 1.75 05/15/23	7,000,000.000	6,645,590.000	
		US T N/B 1.75 09/30/22	12,500,000.000	11,956,000.000	
		US T N/B 1.75 10/31/20	6,000,000.000	5,873,400.000	
		US T N/B 1.75 12/31/20	9,000,000.000	8,793,900.000	
		US T N/B 1.875 06/30/20	11,000,000.000	10,838,410.000	
		US T N/B 1.875 08/31/22	12,000,000.000	11,550,840.000	
		US T N/B 1.875 08/31/24	8,000,000.000	7,528,080.000	
		US T N/B 2.0 02/15/22	17,500,000.000	17,026,100.000	
		US T N/B 2.0 02/15/23	9,500,000.000	9,151,825.000	
		US T N/B 2.0 02/15/25	9,500,000.000	8,957,455.000	
US T N/B 2.0 05/31/21	12,000,000.000	11,753,400.000			
US T N/B 2.0 05/31/24	10,000,000.000	9,503,100.000			
US T N/B 2.0 08/15/25	9,000,000.000	8,444,520.000			
US T N/B 2.0 09/30/20	6,000,000.000	5,913,240.000			
US T N/B 2.0 11/15/21	10,400,000.000	10,143,640.000			
US T N/B 2.0 11/15/26	7,000,000.000	6,488,090.000			

US T N/B 2.0 11/30/20	10,500,000.000	10,334,205.000	
US T N/B 2.0 11/30/22	6,590,000.000	6,362,381.400	
US T N/B 2.125 01/31/21	5,000,000.000	4,930,050.000	
US T N/B 2.125 05/15/25	5,000,000.000	4,742,950.000	
US T N/B 2.125 06/30/22	9,500,000.000	9,253,570.000	
US T N/B 2.125 08/15/21	11,000,000.000	10,792,870.000	
US T N/B 2.125 08/31/20	3,000,000.000	2,967,630.000	
US T N/B 2.125 09/30/21	10,000,000.000	9,800,700.000	
US T N/B 2.125 09/30/24	8,000,000.000	7,631,840.000	
US T N/B 2.125 12/31/21	15,700,000.000	15,358,996.000	
US T N/B 2.125 12/31/22	8,000,000.000	7,758,720.000	
US T N/B 2.25 02/15/27	8,000,000.000	7,554,960.000	
US T N/B 2.25 03/31/21	11,500,000.000	11,364,300.000	
US T N/B 2.25 08/15/27	8,000,000.000	7,528,080.000	
US T N/B 2.25 08/15/46	4,500,000.000	3,767,310.000	
US T N/B 2.25 11/15/24	10,600,000.000	10,178,438.000	
US T N/B 2.25 11/15/25	7,000,000.000	6,669,110.000	
US T N/B 2.25 11/15/27	8,100,000.000	7,610,760.000	
US T N/B 2.25 12/31/23	8,000,000.000	7,741,200.000	
US T N/B 2.375 05/15/27	9,000,000.000	8,573,130.000	
US T N/B 2.375 08/15/24	8,900,000.000	8,630,152.000	
US T N/B 2.375 12/31/20	8,300,000.000	8,241,568.000	
US T N/B 2.5 02/15/45	4,500,000.000	3,997,260.000	
US T N/B 2.5 02/15/46	5,000,000.000	4,425,000.000	
US T N/B 2.5 05/15/24	9,000,000.000	8,805,870.000	
US T N/B 2.5 05/15/46	4,400,000.000	3,891,580.000	
US T N/B 2.5 08/15/23	8,000,000.000	7,863,120.000	
US T N/B 2.625 03/31/25	4,080,000.000	4,000,276.800	
US T N/B 2.625 08/15/20	16,500,000.000	16,510,890.000	
US T N/B 2.625 11/15/20	6,000,000.000	5,998,560.000	
US T N/B 2.75 02/15/24	9,400,000.000	9,337,490.000	
US T N/B 2.75 02/15/28	4,230,000.000	4,148,022.600	
US T N/B 2.75 02/28/25	5,810,000.000	5,744,637.500	
US T N/B 2.75 08/15/42	2,800,000.000	2,634,380.000	
US T N/B 2.75 08/15/47	6,100,000.000	5,678,673.000	
US T N/B 2.75 11/15/23	10,000,000.000	9,942,900.000	
US T N/B 2.75 11/15/42	3,400,000.000	3,196,510.000	
US T N/B 2.75 11/15/47	3,230,000.000	2,999,345.700	
US T N/B 2.875 05/15/43	5,610,000.000	5,386,890.300	
US T N/B 2.875 08/15/45	4,900,000.000	4,681,754.000	
US T N/B 2.875 11/15/46	4,400,000.000	4,197,160.000	
US T N/B 3.0 02/15/47	5,200,000.000	5,085,808.000	
US T N/B 3.0 02/15/48	3,130,000.000	3,057,352.700	
US T N/B 3.0 05/15/42	2,270,000.000	2,234,883.100	
US T N/B 3.0 05/15/45	5,000,000.000	4,896,050.000	
US T N/B 3.0 05/15/47	6,900,000.000	6,757,653.000	
US T N/B 3.0 11/15/44	5,100,000.000	4,999,173.000	
US T N/B 3.0 11/15/45	3,900,000.000	3,817,710.000	
US T N/B 3.125 02/15/42	1,800,000.000	1,810,818.000	

US T N/B 3.125 02/15/43	2,600,000.000	2,610,348.000	
US T N/B 3.125 05/15/19	13,000,000.000	13,104,520.000	
US T N/B 3.125 05/15/21	8,000,000.000	8,097,760.000	
US T N/B 3.125 08/15/44	4,600,000.000	4,613,616.000	
US T N/B 3.125 11/15/41	1,800,000.000	1,811,106.000	
US T N/B 3.375 05/15/44	5,200,000.000	5,446,584.000	
US T N/B 3.375 11/15/19	4,000,000.000	4,053,560.000	
US T N/B 3.5 02/15/39	1,300,000.000	1,391,091.000	
US T N/B 3.5 05/15/20	14,000,000.000	14,255,920.000	
US T N/B 3.625 02/15/20	15,300,000.000	15,589,782.000	
US T N/B 3.625 02/15/21	5,500,000.000	5,640,690.000	
US T N/B 3.625 02/15/44	5,000,000.000	5,457,400.000	
US T N/B 3.625 08/15/19	5,000,000.000	5,075,950.000	
US T N/B 3.625 08/15/43	4,200,000.000	4,580,604.000	
US T N/B 3.75 08/15/41	2,000,000.000	2,220,300.000	
US T N/B 3.75 11/15/43	4,900,000.000	5,453,161.000	
US T N/B 3.875 08/15/40	2,100,000.000	2,370,039.000	
US T N/B 4.25 05/15/39	1,630,000.000	1,932,185.700	
US T N/B 4.25 11/15/40	2,000,000.000	2,381,400.000	
US T N/B 4.375 02/15/38	750,000.000	898,357.500	
US T N/B 4.375 05/15/40	2,000,000.000	2,417,640.000	
US T N/B 4.375 05/15/41	2,000,000.000	2,426,000.000	
US T N/B 4.375 11/15/39	1,660,000.000	2,003,271.400	
US T N/B 4.5 02/15/36	2,000,000.000	2,409,520.000	
US T N/B 4.5 05/15/38	1,100,000.000	1,340,537.000	
US T N/B 4.5 08/15/39	1,400,000.000	1,715,000.000	
US T N/B 4.625 02/15/40	2,300,000.000	2,868,882.000	
US T N/B 4.75 02/15/41	1,800,000.000	2,291,616.000	
US T N/B 5.0 05/15/37	800,000.000	1,027,496.000	
US T N/B 5.25 02/15/29	1,000,000.000	1,207,260.000	
US T N/B 5.25 11/15/28	1,500,000.000	1,805,025.000	
US T N/B 5.375 02/15/31	1,500,000.000	1,877,220.000	
US T N/B 5.5 08/15/28	1,100,000.000	1,343,023.000	
US T N/B 6.0 02/15/26	3,200,000.000	3,878,240.000	
US T N/B 6.125 11/15/27	1,400,000.000	1,763,342.000	
US T N/B 6.25 05/15/30	1,400,000.000	1,857,184.000	
US T N/B 6.25 08/15/23	1,000,000.000	1,166,250.000	
US T N/B 8.0 11/15/21	6,000,000.000	7,052,760.000	
US T N/B 8.125 08/15/19	4,000,000.000	4,285,760.000	
アメリカ・ドル 小計	868,690,000.000 (95,112,868,100)	854,791,703.800 (93,591,143,649)	
イギリス・ボンド	UK TREASURY 0.5 07/22/22	2,350,000.000	2,302,718.000
	UK TREASURY 0.75 07/22/23	1,360,000.000	1,335,506.400
	UK TREASURY 1.25 07/22/27	2,730,000.000	2,681,597.100
	UK TREASURY 1.5 01/22/21	2,700,000.000	2,749,626.000

UK TREASURY 1.5 07/22/26	2,400,000.000	2,429,616.000	
UK TREASURY 1.5 07/22/47	2,400,000.000	2,211,600.000	
UK TREASURY 1.75 07/22/19	1,700,000.000	1,721,692.000	
UK TREASURY 1.75 07/22/57	1,530,000.000	1,554,327.000	
UK TREASURY 1.75 09/07/22	3,000,000.000	3,095,910.000	
UK TREASURY 1.75 09/07/37	1,250,000.000	1,231,375.000	
UK TREASURY 2.0 07/22/20	1,700,000.000	1,745,577.000	
UK TREASURY 2.0 09/07/25	2,400,000.000	2,527,320.000	
UK TREASURY 2.25 09/07/23	2,800,000.000	2,965,900.000	
UK TREASURY 2.5 07/22/65	2,360,000.000	3,022,900.400	
UK TREASURY 2.75 09/07/24	2,000,000.000	2,190,940.000	
UK TREASURY 3.25 01/22/44	2,600,000.000	3,326,180.000	
UK TREASURY 3.5 01/22/45	2,520,000.000	3,377,052.000	
UK TREASURY 3.5 07/22/68	1,900,000.000	3,099,090.000	
UK TREASURY 3.75 07/22/52	2,100,000.000	3,161,550.000	
UK TREASURY 3.75 09/07/19	2,200,000.000	2,289,320.000	
UK TREASURY 3.75 09/07/20	2,900,000.000	3,100,303.000	
UK TREASURY 3.75 09/07/21	1,850,000.000	2,025,287.500	
UK TREASURY 4.0 01/22/60	1,600,000.000	2,717,280.000	
UK TREASURY 4.0 03/07/22	2,000,000.000	2,232,040.000	
UK TREASURY 4.25 03/07/36	2,450,000.000	3,368,750.000	
UK TREASURY 4.25 06/07/32	1,850,000.000	2,439,780.000	
UK TREASURY 4.25 09/07/39	1,550,000.000	2,207,355.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/27	1,700,000.000	2,129,284.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/40	1,980,000.000	2,857,536.000	

	UK TREASURY 4.25 12/07/46	1,930,000.000	2,948,268.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/49	1,970,000.000	3,117,919.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/55	1,940,000.000	3,295,866.000	
	UK TREASURY 4.5 09/07/34	2,350,000.000	3,259,685.000	
	UK TREASURY 4.5 12/07/42	2,760,000.000	4,196,304.000	
	UK TREASURY 4.75 03/07/20	1,850,000.000	1,985,586.500	
	UK TREASURY 4.75 12/07/30	1,500,000.000	2,031,900.000	
	UK TREASURY 4.75 12/07/38	1,900,000.000	2,851,520.000	
	UK TREASURY 5.0 03/07/25	2,030,000.000	2,531,166.400	
	UK TREASURY 6.0 12/07/28	1,350,000.000	1,944,135.000	
	UK TREASURY 8.0 06/07/21	1,700,000.000	2,070,974.000	
	イギリス・ポンド 小計	83,160,000.000 (12,311,838,000)	102,330,736.300 (15,150,065,509)	
オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN 4.5 04/15/20	3,800,000.000	3,977,536.000	
	AUSTRALIAN 5.75 05/15/21	3,700,000.000	4,084,023.000	
	AUSTRALIAN 1.75 11/21/20	2,400,000.000	2,378,928.000	
	AUSTRALIAN 2.0 12/21/21	1,770,000.000	1,755,344.400	
	AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	2,400,000.000	2,291,040.000	
	AUSTRALIAN 2.25 11/21/22	890,000.000	885,478.800	
	AUSTRALIAN 2.75 04/21/24	3,100,000.000	3,139,401.000	
	AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	900,000.000	864,927.000	
	AUSTRALIAN 2.75 10/21/19	1,500,000.000	1,517,070.000	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	2,900,000.000	2,892,895.000	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/28	2,700,000.000	2,690,955.000	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/29	1,560,000.000	1,547,660.400	
	AUSTRALIAN 3.0 03/21/47	1,250,000.000	1,186,612.500	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	3,100,000.000	3,224,310.000	

	AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	3,100,000.000	3,231,502.000	
	AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	900,000.000	914,769.000	
	AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	1,200,000.000	1,314,156.000	
	AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	3,600,000.000	4,000,284.000	
	AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	1,500,000.000	1,779,630.000	
	AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	3,600,000.000	4,170,744.000	
	AUSTRALIAN 5.5 04/21/23	3,000,000.000	3,431,250.000	
	AUSTRALIAN 5.75 07/15/22	3,500,000.000	3,979,010.000	
オーストラリア・ドル 小計		52,370,000.000 (4,316,335,400)	55,257,526.100 (4,554,325,301)	
カナダ・ドル	CANADA 8.0 06/01/27	1,000,000.000	1,455,190.000	
	CANADA 0.75 03/01/21	1,090,000.000	1,051,217.800	
	CANADA 0.75 08/01/19	6,500,000.000	6,418,165.000	
	CANADA 0.75 09/01/20	2,400,000.000	2,333,040.000	
	CANADA 0.75 09/01/21	600,000.000	573,720.000	
	CANADA 1.0 06/01/27	800,000.000	710,552.000	
	CANADA 1.0 09/01/22	800,000.000	761,240.000	
	CANADA 1.5 03/01/20	2,300,000.000	2,281,646.000	
	CANADA 1.5 06/01/23	2,300,000.000	2,219,339.000	
	CANADA 1.5 06/01/26	1,700,000.000	1,593,801.000	
	CANADA 1.75 03/01/23	1,160,000.000	1,135,698.000	
	CANADA 1.75 05/01/20	2,770,000.000	2,758,643.000	
	CANADA 2.0 06/01/28	1,020,000.000	984,034.800	
	CANADA 2.25 06/01/25	1,500,000.000	1,492,320.000	
	CANADA 2.5 06/01/24	1,600,000.000	1,618,656.000	
	CANADA 2.75 06/01/22	3,900,000.000	3,987,867.000	
	CANADA 2.75 12/01/48	1,450,000.000	1,548,020.000	
	CANADA 2.75 12/01/64	750,000.000	823,012.500	
	CANADA 3.25 06/01/21	4,700,000.000	4,859,753.000	
	CANADA 3.5 06/01/20	2,800,000.000	2,885,092.000	
CANADA 3.5 12/01/45	1,900,000.000	2,299,038.000		
CANADA 4.0 06/01/41	1,800,000.000	2,287,746.000		
CANADA 5.0 06/01/37	1,400,000.000	1,943,256.000		
CANADA 5.75 06/01/29	1,600,000.000	2,116,224.000		
CANADA 5.75 06/01/33	1,550,000.000	2,194,691.500		
カナダ・ドル 小計		49,390,000.000 (4,234,204,700)	52,331,962.600 (4,486,419,154)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE 1.25 10/01/21	1,000,000.000	972,000.000	
	SINGAPORE 2.0 07/01/20	800,000.000	800,656.000	
	SINGAPORE 2.25 08/01/36	200,000.000	182,360.000	
	SINGAPORE 2.375 06/01/25	500,000.000	496,750.000	
	SINGAPORE 2.75 03/01/46	660,000.000	636,279.600	

	SINGAPORE 2.75 04/01/42	550,000.000	532,950.000	
	SINGAPORE 2.875 07/01/29	400,000.000	408,000.000	
	SINGAPORE 2.875 09/01/30	460,000.000	465,980.000	
	SINGAPORE 3.0 09/01/24	810,000.000	837,135.000	
	SINGAPORE 3.125 09/01/22	1,600,000.000	1,665,760.000	
	SINGAPORE 3.25 09/01/20	1,340,000.000	1,377,788.000	
	SINGAPORE 3.375 09/01/33	480,000.000	510,916.800	
	SINGAPORE 3.5 03/01/27	900,000.000	965,700.000	
シンガポール・ドル 小計		9,700,000.000 (793,751,000)	9,852,275.400 (806,211,696)	
スウェーデン・クローナ	SWEDEN 0.75 05/12/28	4,970,000.000	4,986,053.100	
	SWEDEN 1.0 11/12/26	7,000,000.000	7,258,720.000	
	SWEDEN 1.5 11/13/23	9,700,000.000	10,438,946.000	
	SWEDEN 2.5 05/12/25	7,300,000.000	8,397,190.000	
	SWEDEN 3.5 03/30/39	6,200,000.000	8,579,436.000	
	SWEDEN 3.5 06/01/22	12,870,000.000	14,785,956.900	
スウェーデン・クローナ 小計		48,040,000.000 (608,186,400)	54,446,302.000 (689,290,183)	
デンマーク・クローネ	DENMARK 0.5 11/15/27	7,130,000.000	7,094,849.100	
	DENMARK 1.5 11/15/23	5,500,000.000	5,940,825.000	
	DENMARK 1.75 11/15/25	9,470,000.000	10,499,957.200	
	DENMARK 3.0 11/15/21	13,000,000.000	14,512,550.000	
	DENMARK 4.0 11/15/19	7,900,000.000	8,452,210.000	
	DENMARK 4.5 11/15/39	15,240,000.000	25,445,923.200	
デンマーク・クローネ 小計		58,240,000.000 (1,019,200,000)	71,946,314.500 (1,259,060,504)	
ノルウェー・クローネ	NORWAY 1.5 02/19/26	6,000,000.000	5,905,260.000	
	NORWAY 1.75 02/17/27	3,970,000.000	3,950,586.700	
	NORWAY 1.75 03/13/25	3,800,000.000	3,820,900.000	
	NORWAY 2.0 05/24/23	7,600,000.000	7,795,168.000	
	NORWAY 3.0 03/14/24	6,200,000.000	6,690,358.000	
	NORWAY 3.75 05/25/21	8,800,000.000	9,478,040.000	
	NORWAY 4.5 05/22/19	6,560,000.000	6,808,296.000	
ノルウェー・クローネ 小計		42,930,000.000 (586,853,100)	44,448,608.700 (607,612,481)	
ポーランド・ズロチ	POLAND 1.5 04/25/20	3,000,000.000	3,002,100.000	
	POLAND 1.75 07/25/21	2,200,000.000	2,189,440.000	
	POLAND 2.25 04/25/22	4,000,000.000	4,004,800.000	
	POLAND 2.5 01/25/23	1,350,000.000	1,352,700.000	
	POLAND 2.5 07/25/26	4,200,000.000	4,018,350.000	
	POLAND 2.5 07/25/27	3,000,000.000	2,837,550.000	
	POLAND 2.75 04/25/28	960,000.000	921,072.000	
	POLAND 3.25 07/25/19	2,500,000.000	2,557,400.000	
	POLAND 3.25 07/25/25	3,300,000.000	3,353,823.000	
	POLAND 4.0 10/25/23	3,100,000.000	3,316,225.000	

	POLAND 5.25 10/25/20	4,900,000.000	5,324,340.000	
	POLAND 5.5 10/25/19	2,690,000.000	2,847,634.000	
	POLAND 5.75 04/25/29	1,440,000.000	1,780,848.000	
	POLAND 5.75 09/23/22	3,200,000.000	3,652,000.000	
	POLAND 5.75 10/25/21	3,680,000.000	4,136,136.000	
ポーランド・ズロチ 小計		43,520,000.000 (1,335,628,800)	45,294,418.000 (1,390,085,688)	
マレーシア・リンギット	MALAYSIA 3.418 08/15/22	3,000,000.000	2,937,600.000	
	MALAYSIA 3.48 03/15/23	1,220,000.000	1,192,672.000	
	MALAYSIA 3.492 03/31/20	2,200,000.000	2,191,200.000	
	MALAYSIA 3.502 05/31/27	2,570,000.000	2,420,220.400	
	MALAYSIA 3.733 06/15/28	2,000,000.000	1,933,860.000	
	MALAYSIA 3.844 04/15/33	1,210,000.000	1,110,925.200	
	MALAYSIA 3.892 03/15/27	800,000.000	776,968.000	
	MALAYSIA 4.127 04/15/32	1,850,000.000	1,770,672.000	
	MALAYSIA 4.16 07/15/21	4,000,000.000	4,041,640.000	
	MALAYSIA 4.181 07/15/24	2,430,000.000	2,439,963.000	
	MALAYSIA 4.378 11/29/19	3,680,000.000	3,721,142.400	
	MALAYSIA 4.392 04/15/26	3,070,000.000	3,109,265.300	
	MALAYSIA 4.498 04/15/30	1,800,000.000	1,804,104.000	
	MALAYSIA 4.935 09/30/43	2,000,000.000	2,014,720.000	
	MALAYSIA 5.248 09/15/28	1,600,000.000	1,707,360.000	
マレーシア・リンギット 小計		33,430,000.000 (927,013,900)	33,172,312.300 (919,868,220)	
メキシコ・ペソ	MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	13,000,000.000	15,910,440.000	
	MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	35,000,000.000	39,519,900.000	
	MEXICAN BONDS 5.0 12/11/19	26,000,000.000	25,073,620.000	
	MEXICAN BONDS 5.75 03/05/26	5,000,000.000	4,467,750.000	
	MEXICAN BONDS 6.5 06/09/22	26,000,000.000	25,065,300.000	
	MEXICAN BONDS 6.5 06/10/21	38,000,000.000	36,939,800.000	
	MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	10,000,000.000	9,939,900.000	
	MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	10,000,000.000	10,058,400.000	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	22,000,000.000	21,994,720.000	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	7,000,000.000	7,019,040.000	
	MEXICAN BONDS 8.0 06/11/20	30,000,000.000	30,353,400.000	
	MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47	5,000,000.000	5,138,900.000	
	MEXICAN BONDS 8.0 12/07/23	14,000,000.000	14,301,840.000	

	MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	31,000,000.000	33,015,930.000	
	MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	15,000,000.000	16,148,400.000	
	メキシコ・ペソ 小計	287,000,000.000 (1,633,030,000)	294,947,340.000 (1,678,250,365)	
ユーロ	AUSTRIA 0.25 10/18/19	250,000.000	252,757.500	
	AUSTRIA 0.5 04/20/27	500,000.000	493,820.000	
	AUSTRIA 0.75 10/20/26	1,300,000.000	1,318,538.000	
	AUSTRIA 07/15/23	350,000.000	348,372.500	
	AUSTRIA 09/20/22	4,010,000.000	4,024,476.100	
	AUSTRIA 1.2 10/20/25	1,000,000.000	1,056,290.000	
	AUSTRIA 1.5 02/20/47	230,000.000	231,352.400	
	AUSTRIA 1.5 11/02/86	290,000.000	257,696.900	
	AUSTRIA 1.65 10/21/24	1,250,000.000	1,359,887.500	
	AUSTRIA 1.75 10/20/23	1,400,000.000	1,525,020.000	
	AUSTRIA 1.95 06/18/19	830,000.000	852,692.200	
	AUSTRIA 2.1 09/20/17	100,000.000	109,410.000	
	AUSTRIA 2.4 05/23/34	900,000.000	1,066,860.000	
	AUSTRIA 3.15 06/20/44	810,000.000	1,125,511.200	
	AUSTRIA 3.4 11/22/22	1,500,000.000	1,736,610.000	
	AUSTRIA 3.5 09/15/21	1,900,000.000	2,141,300.000	
	AUSTRIA 3.65 04/20/22	1,200,000.000	1,380,540.000	
	AUSTRIA 3.8 01/26/62	820,000.000	1,386,431.400	
	AUSTRIA 3.9 07/15/20	1,700,000.000	1,861,925.000	
	AUSTRIA 4.15 03/15/37	1,650,000.000	2,474,175.000	
	AUSTRIA 4.85 03/15/26	1,100,000.000	1,475,386.000	
	AUSTRIA 6.25 07/15/27	1,150,000.000	1,727,748.500	
	BELGIUM 0.2 10/22/23	150,000.000	150,585.000	
	BELGIUM 0.5 10/22/24	1,070,000.000	1,080,614.400	
	BELGIUM 0.8 06/22/25	2,000,000.000	2,052,840.000	
	BELGIUM 0.8 06/22/27	1,100,000.000	1,109,229.000	
	BELGIUM 0.8 06/22/28	440,000.000	438,666.800	
	BELGIUM 1.0 06/22/26	1,500,000.000	1,551,870.000	
	BELGIUM 1.0 06/22/31	1,300,000.000	1,290,900.000	
	BELGIUM 1.25 04/22/33	1,130,000.000	1,137,661.400	
	BELGIUM 1.45 06/22/37	750,000.000	756,427.500	
	BELGIUM 1.6 06/22/47	900,000.000	891,936.000	
	BELGIUM 1.9 06/22/38	800,000.000	867,912.000	
	BELGIUM 2.15 06/22/66	700,000.000	756,560.000	
	BELGIUM 2.25 06/22/23	1,700,000.000	1,892,763.000	
	BELGIUM 2.6 06/22/24	2,300,000.000	2,628,808.000	
	BELGIUM 3.0 06/22/34	850,000.000	1,069,019.500	
	BELGIUM 3.0 09/28/19	1,890,000.000	1,982,099.700	
	BELGIUM 3.75 06/22/45	1,130,000.000	1,672,445.200	
	BELGIUM 3.75 09/28/20	2,200,000.000	2,421,166.000	
	BELGIUM 4.0 03/28/22	1,500,000.000	1,746,645.000	
	BELGIUM 4.0 03/28/32	950,000.000	1,311,655.500	
	BELGIUM 4.25 03/28/41	2,000,000.000	3,092,040.000	

BELGIUM 4.25 09/28/21	1,870,000.000	2,158,971.100	
BELGIUM 4.25 09/28/22	1,950,000.000	2,323,893.000	
BELGIUM 4.5 03/28/26	1,200,000.000	1,574,712.000	
BELGIUM 5.0 03/28/35	2,200,000.000	3,472,612.000	
BELGIUM 5.5 03/28/28	2,500,000.000	3,646,425.000	
BUNDESABL 0.25 10/16/20	1,500,000.000	1,528,230.000	
BUNDESABL 04/08/22	3,000,000.000	3,031,800.000	
BUNDESABL 04/09/21	2,200,000.000	2,228,622.000	
BUNDESABL 10/07/22	2,730,000.000	2,751,266.700	
BUNDESSCHAT 12/13/19	800,000.000	807,984.000	
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27	3,500,000.000	3,452,015.000	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25	2,200,000.000	2,248,334.000	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26	3,200,000.000	3,251,296.000	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28	3,780,000.000	3,759,588.000	
DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27	2,700,000.000	2,705,427.000	
DEUTSCHLAND 08/15/26	2,800,000.000	2,718,296.000	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/24	2,600,000.000	2,743,754.000	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25	2,500,000.000	2,639,150.000	
DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48	530,000.000	532,469.800	
DEUTSCHLAND 1.5 02/15/23	2,100,000.000	2,264,178.000	
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/23	2,500,000.000	2,698,475.000	
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/24	2,000,000.000	2,170,440.000	
DEUTSCHLAND 1.5 09/04/22	3,400,000.000	3,652,008.000	
DEUTSCHLAND 1.75 02/15/24	1,500,000.000	1,647,435.000	
DEUTSCHLAND 1.75 07/04/22	2,700,000.000	2,924,343.000	
DEUTSCHLAND 2.0 01/04/22	2,700,000.000	2,929,662.000	
DEUTSCHLAND 2.0 08/15/23	1,500,000.000	1,660,695.000	
DEUTSCHLAND 2.25 09/04/20	4,200,000.000	4,472,244.000	
DEUTSCHLAND 2.25 09/04/21	3,100,000.000	3,371,653.000	
DEUTSCHLAND 2.5 01/04/21	2,200,000.000	2,375,538.000	

DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	2,700,000.000	3,514,887.000	
DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	2,700,000.000	3,547,908.000	
DEUTSCHLAND 3.0 07/04/20	3,000,000.000	3,229,680.000	
DEUTSCHLAND 3.25 01/04/20	3,600,000.000	3,832,272.000	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/21	3,150,000.000	3,515,368.500	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	1,650,000.000	2,402,119.500	
DEUTSCHLAND 3.5 07/04/19	4,400,000.000	4,609,968.000	
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	2,600,000.000	3,943,680.000	
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	1,660,000.000	2,676,916.000	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	1,420,000.000	2,012,480.800	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	2,200,000.000	3,483,436.000	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	1,900,000.000	3,292,605.000	
DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	2,050,000.000	3,243,612.500	
DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	1,600,000.000	2,376,448.000	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/24	1,700,000.000	2,297,652.000	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	1,100,000.000	1,796,971.000	
DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	1,750,000.000	2,704,765.000	
FINLAND 0.375 09/15/20	500,000.000	509,620.000	
FINLAND 0.5 04/15/26	600,000.000	601,524.000	
FINLAND 0.5 09/15/27	300,000.000	295,884.000	
FINLAND 0.75 04/15/31	450,000.000	439,798.500	
FINLAND 0.875 09/15/25	300,000.000	310,488.000	
FINLAND 04/15/22	320,000.000	321,859.200	
FINLAND 09/15/23	230,000.000	228,808.600	
FINLAND 1.125 04/15/34	420,000.000	422,154.600	
FINLAND 1.5 04/15/23	950,000.000	1,018,922.500	
FINLAND 1.625 09/15/22	400,000.000	430,172.000	
FINLAND 2.0 04/15/24	680,000.000	752,583.200	
FINLAND 2.625 07/04/42	660,000.000	857,861.400	
FINLAND 2.75 07/04/28	630,000.000	756,516.600	
FINLAND 3.375 04/15/20	980,000.000	1,053,676.400	
FINLAND 3.5 04/15/21	700,000.000	779,268.000	
FINLAND 4.0 07/04/25	800,000.000	1,005,688.000	

FINLAND 4.375 07/04/19	370,000.000	391,097.400	
FRANCE BTAN 8.5 04/25/23	1,700,000.000	2,415,496.000	
FRANCE OAT 0.25 11/25/26	3,000,000.000	2,918,550.000	
FRANCE OAT 0.5 05/25/25	3,700,000.000	3,736,778.000	
FRANCE OAT 0.5 05/25/26	5,840,000.000	5,836,320.800	
FRANCE OAT 0.5 11/25/19	500,000.000	507,945.000	
FRANCE OAT 0.75 05/25/28	2,200,000.000	2,192,410.000	
FRANCE OAT 03/25/23	1,900,000.000	1,896,960.000	
FRANCE OAT 05/25/21	2,510,000.000	2,534,849.000	
FRANCE OAT 05/25/22	3,000,000.000	3,015,840.000	
FRANCE OAT 1.0 05/25/19	1,700,000.000	1,727,353.000	
FRANCE OAT 1.0 05/25/27	4,000,000.000	4,120,480.000	
FRANCE OAT 1.0 11/25/25	3,700,000.000	3,854,771.000	
FRANCE OAT 1.25 05/25/34	400,000.000	403,188.000	
FRANCE OAT 1.25 05/25/36	2,900,000.000	2,881,150.000	
FRANCE OAT 1.5 05/25/31	4,200,000.000	4,440,870.000	
FRANCE OAT 1.75 05/25/23	4,400,000.000	4,780,072.000	
FRANCE OAT 1.75 05/25/66	1,250,000.000	1,226,475.000	
FRANCE OAT 1.75 06/25/39	1,200,000.000	1,274,388.000	
FRANCE OAT 1.75 11/25/24	4,500,000.000	4,923,450.000	
FRANCE OAT 2.0 05/25/48	940,000.000	1,013,282.400	
FRANCE OAT 2.25 05/25/24	4,000,000.000	4,490,240.000	
FRANCE OAT 2.25 10/25/22	3,400,000.000	3,752,886.000	
FRANCE OAT 2.5 05/25/30	3,900,000.000	4,586,478.000	
FRANCE OAT 2.5 10/25/20	7,800,000.000	8,365,968.000	
FRANCE OAT 2.75 10/25/27	4,000,000.000	4,760,560.000	
FRANCE OAT 3.0 04/25/22	5,300,000.000	5,968,118.000	
FRANCE OAT 3.25 05/25/45	2,700,000.000	3,704,130.000	
FRANCE OAT 3.25 10/25/21	5,200,000.000	5,833,204.000	
FRANCE OAT 3.5 04/25/20	6,500,000.000	7,009,600.000	
FRANCE OAT 3.5 04/25/26	4,840,000.000	6,000,632.000	
FRANCE OAT 3.75 04/25/21	6,300,000.000	7,068,537.000	
FRANCE OAT 3.75 10/25/19	6,600,000.000	7,013,622.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/55	2,400,000.000	3,895,200.000	

FRANCE OAT 4.0 04/25/60	1,940,000.000	3,231,458.000	
FRANCE OAT 4.0 10/25/38	3,100,000.000	4,587,194.000	
FRANCE OAT 4.25 10/25/23	5,000,000.000	6,132,450.000	
FRANCE OAT 4.5 04/25/41	3,880,000.000	6,228,641.600	
FRANCE OAT 4.75 04/25/35	3,100,000.000	4,808,038.000	
FRANCE OAT 5.5 04/25/29	3,650,000.000	5,441,493.000	
FRANCE OAT 5.75 10/25/32	3,800,000.000	6,201,676.000	
FRANCE OAT 6.0 10/25/25	2,900,000.000	4,106,516.000	
FRANCE OAT 8.5 10/25/19	4,200,000.000	4,755,912.000	
IRISH 0.8 03/15/22	950,000.000	983,212.000	
IRISH 0.9 05/15/28	340,000.000	337,555.400	
IRISH 1.0 05/15/26	1,200,000.000	1,230,840.000	
IRISH 1.3 05/15/33	450,000.000	446,548.500	
IRISH 1.7 05/15/37	750,000.000	772,432.500	
IRISH 2.0 02/18/45	1,200,000.000	1,276,644.000	
IRISH 2.4 05/15/30	1,100,000.000	1,257,850.000	
IRISH 3.4 03/18/24	930,000.000	1,098,636.900	
IRISH 3.9 03/20/23	700,000.000	829,486.000	
IRISH 4.4 06/18/19	480,000.000	505,752.000	
IRISH 4.5 04/18/20	1,130,000.000	1,239,361.400	
IRISH 5.0 10/18/20	850,000.000	962,455.000	
IRISH 5.4 03/13/25	1,260,000.000	1,677,828.600	
IRISH 5.9 10/18/19	950,000.000	1,037,514.000	
ITALY BTPS 0.35 11/01/21	1,700,000.000	1,704,488.000	
ITALY BTPS 0.65 10/15/23	2,100,000.000	2,072,385.000	
ITALY BTPS 0.65 11/01/20	3,600,000.000	3,660,120.000	
ITALY BTPS 0.9 08/01/22	980,000.000	993,631.800	
ITALY BTPS 0.95 03/15/23	2,500,000.000	2,524,750.000	
ITALY BTPS 1.05 12/01/19	2,000,000.000	2,040,080.000	
ITALY BTPS 1.25 12/01/26	2,000,000.000	1,934,340.000	
ITALY BTPS 1.35 04/15/22	2,500,000.000	2,585,000.000	
ITALY BTPS 1.45 09/15/22	1,500,000.000	1,555,050.000	
ITALY BTPS 1.5 06/01/25	2,500,000.000	2,517,975.000	
ITALY BTPS 1.6 06/01/26	1,500,000.000	1,500,300.000	
ITALY BTPS 1.65 03/01/32	2,800,000.000	2,596,804.000	
ITALY BTPS 1.85 05/15/24	2,100,000.000	2,191,980.000	
ITALY BTPS 2.0 02/01/28	1,130,000.000	1,138,068.200	

ITALY BTPS 2.0 12/01/25	2,700,000.000	2,795,256.000	
ITALY BTPS 2.05 08/01/27	1,300,000.000	1,323,257.000	
ITALY BTPS 2.15 12/15/21	2,200,000.000	2,342,560.000	
ITALY BTPS 2.2 06/01/27	2,800,000.000	2,893,520.000	
ITALY BTPS 2.25 09/01/36	1,500,000.000	1,437,150.000	
ITALY BTPS 2.45 09/01/33	1,100,000.000	1,104,389.000	
ITALY BTPS 2.5 12/01/24	4,000,000.000	4,313,400.000	
ITALY BTPS 2.7 03/01/47	1,650,000.000	1,586,475.000	
ITALY BTPS 2.8 03/01/67	1,200,000.000	1,099,560.000	
ITALY BTPS 2.95 09/01/38	800,000.000	829,680.000	
ITALY BTPS 3.25 09/01/46	2,000,000.000	2,134,180.000	
ITALY BTPS 3.45 03/01/48	2,180,000.000	2,371,643.800	
ITALY BTPS 3.5 03/01/30	2,950,000.000	3,349,843.000	
ITALY BTPS 3.75 03/01/21	3,300,000.000	3,639,273.000	
ITALY BTPS 3.75 05/01/21	2,300,000.000	2,545,180.000	
ITALY BTPS 3.75 08/01/21	3,200,000.000	3,565,120.000	
ITALY BTPS 3.75 09/01/24	1,900,000.000	2,196,153.000	
ITALY BTPS 4.0 02/01/37	3,500,000.000	4,238,150.000	
ITALY BTPS 4.0 09/01/20	3,700,000.000	4,045,950.000	
ITALY BTPS 4.25 03/01/20	4,600,000.000	4,968,138.000	
ITALY BTPS 4.25 09/01/19	5,500,000.000	5,825,820.000	
ITALY BTPS 4.5 02/01/20	4,500,000.000	4,863,375.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/24	3,700,000.000	4,416,986.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/26	2,900,000.000	3,535,680.000	
ITALY BTPS 4.5 05/01/23	1,400,000.000	1,653,344.000	
ITALY BTPS 4.75 08/01/23	1,900,000.000	2,281,520.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/21	3,900,000.000	4,481,100.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/28	2,400,000.000	3,014,496.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/44	2,050,000.000	2,738,082.500	
ITALY BTPS 5.0 03/01/22	3,600,000.000	4,226,040.000	
ITALY BTPS 5.0 03/01/25	2,400,000.000	2,977,704.000	
ITALY BTPS 5.0 08/01/34	2,800,000.000	3,752,280.000	
ITALY BTPS 5.0 08/01/39	3,000,000.000	4,091,700.000	

ITALY BTPS 5.0 09/01/40	2,750,000.000	3,741,100.000	
ITALY BTPS 5.25 11/01/29	2,900,000.000	3,827,710.000	
ITALY BTPS 5.5 09/01/22	3,900,000.000	4,718,142.000	
ITALY BTPS 5.5 11/01/22	2,500,000.000	3,035,875.000	
ITALY BTPS 5.75 02/01/33	2,400,000.000	3,398,160.000	
ITALY BTPS 6.0 05/01/31	3,100,000.000	4,403,550.000	
ITALY BTPS 6.5 11/01/27	3,300,000.000	4,638,810.000	
ITALY BTPS 7.25 11/01/26	1,800,000.000	2,596,320.000	
ITALY BTPS 9.0 11/01/23	1,900,000.000	2,718,330.000	
NETHERLANDS 0.25 01/15/20	2,150,000.000	2,181,261.000	
NETHERLANDS 0.25 07/15/25	1,700,000.000	1,690,684.000	
NETHERLANDS 0.5 07/15/26	1,700,000.000	1,707,820.000	
NETHERLANDS 0.75 07/15/27	1,450,000.000	1,472,823.000	
NETHERLANDS 0.75 07/15/28	950,000.000	955,842.500	
NETHERLANDS 01/15/22	1,900,000.000	1,917,442.000	
NETHERLANDS 01/15/24	1,680,000.000	1,668,525.600	
NETHERLANDS 1.75 07/15/23	2,000,000.000	2,180,560.000	
NETHERLANDS 2.0 07/15/24	2,000,000.000	2,224,220.000	
NETHERLANDS 2.25 07/15/22	1,550,000.000	1,708,177.500	
NETHERLANDS 2.5 01/15/33	1,480,000.000	1,798,377.600	
NETHERLANDS 2.75 01/15/47	1,540,000.000	2,109,307.200	
NETHERLANDS 3.25 07/15/21	1,860,000.000	2,075,425.200	
NETHERLANDS 3.5 07/15/20	1,670,000.000	1,817,795.000	
NETHERLANDS 3.75 01/15/23	1,700,000.000	2,003,620.000	
NETHERLANDS 3.75 01/15/42	1,830,000.000	2,830,717.200	
NETHERLANDS 4.0 01/15/37	1,700,000.000	2,564,620.000	
NETHERLANDS 4.0 07/15/19	1,000,000.000	1,054,580.000	
NETHERLANDS 5.5 01/15/28	1,600,000.000	2,338,400.000	
SPAIN 0.05 01/31/21	400,000.000	402,104.000	
SPAIN 0.4 04/30/22	2,200,000.000	2,229,238.000	

	SPAIN 0.45 10/31/22	800,000.000	808,832.000	
	SPAIN 0.75 07/30/21	1,700,000.000	1,746,648.000	
	SPAIN 1.15 07/30/20	2,100,000.000	2,166,885.000	
	SPAIN 1.3 10/31/26	2,000,000.000	2,037,540.000	
	SPAIN 1.4 01/31/20	5,460,000.000	5,622,380.400	
	SPAIN 1.4 04/30/28	2,810,000.000	2,833,913.100	
	SPAIN 1.45 10/31/27	1,800,000.000	1,835,028.000	
	SPAIN 1.5 04/30/27	2,600,000.000	2,673,060.000	
	SPAIN 1.6 04/30/25	2,500,000.000	2,642,675.000	
	SPAIN 1.95 04/30/26	2,500,000.000	2,681,600.000	
	SPAIN 1.95 07/30/30	2,700,000.000	2,817,909.000	
	SPAIN 2.15 10/31/25	2,100,000.000	2,291,247.000	
	SPAIN 2.35 07/30/33	1,350,000.000	1,441,800.000	
	SPAIN 2.7 10/31/48	120,000.000	126,786.000	
	SPAIN 2.75 10/31/24	2,700,000.000	3,059,451.000	
	SPAIN 2.9 10/31/46	1,800,000.000	2,003,652.000	
	SPAIN 3.45 07/30/66	1,400,000.000	1,685,362.000	
	SPAIN 3.8 04/30/24	2,700,000.000	3,212,136.000	
	SPAIN 4.0 04/30/20	2,400,000.000	2,602,536.000	
	SPAIN 4.2 01/31/37	2,280,000.000	3,079,117.200	
	SPAIN 4.3 10/31/19	4,200,000.000	4,488,918.000	
	SPAIN 4.4 10/31/23	2,300,000.000	2,792,959.000	
	SPAIN 4.6 07/30/19	3,200,000.000	3,395,744.000	
	SPAIN 4.65 07/30/25	2,600,000.000	3,300,336.000	
	SPAIN 4.7 07/30/41	2,100,000.000	3,067,554.000	
	SPAIN 4.8 01/31/24	2,200,000.000	2,734,600.000	
	SPAIN 4.85 10/31/20	2,900,000.000	3,263,341.000	
	SPAIN 4.9 07/30/40	2,000,000.000	2,970,000.000	
	SPAIN 5.15 10/31/28	2,850,000.000	3,907,635.000	
	SPAIN 5.15 10/31/44	1,500,000.000	2,353,035.000	
	SPAIN 5.4 01/31/23	2,800,000.000	3,476,564.000	
	SPAIN 5.5 04/30/21	3,600,000.000	4,202,064.000	
	SPAIN 5.75 07/30/32	2,400,000.000	3,639,792.000	
	SPAIN 5.85 01/31/22	2,300,000.000	2,800,365.000	
	SPAIN 5.9 07/30/26	2,500,000.000	3,461,625.000	
	SPAIN 6.0 01/31/29	3,000,000.000	4,389,540.000	
	ユーロ 小計	593,790,000.000 (77,430,216,000)	689,080,294.400 (89,856,070,390)	
南アフリカ・ランド	SOUTH AFRICA 10.5 12/21/26	25,000,000.000	28,201,500.000	
	SOUTH AFRICA 6.25 03/31/36	14,700,000.000	10,990,308.000	
	SOUTH AFRICA 6.5 02/28/41	11,760,000.000	8,683,584.000	
	SOUTH AFRICA 7.0 02/28/31	11,600,000.000	9,926,120.000	
	SOUTH AFRICA 7.75 02/28/23	10,000,000.000	9,987,000.000	

	SOUTH AFRICA 8.0 01/31/30	13,110,000.000	12,350,931.000	
	SOUTH AFRICA 8.25 03/31/32	10,000,000.000	9,445,000.000	
	SOUTH AFRICA 8.5 01/31/37	10,910,000.000	10,207,505.100	
	SOUTH AFRICA 8.75 01/31/44	10,000,000.000	9,413,200.000	
	SOUTH AFRICA 8.75 02/28/48	20,280,000.000	19,123,634.400	
	SOUTH AFRICA 8.875 02/28/35	12,510,000.000	12,246,039.000	
	SOUTH AFRICA 9.0 01/31/40	8,000,000.000	7,784,720.000	
	南アフリカ・ランド 小計	157,870,000.000 (1,405,043,000)	148,359,541.500 (1,320,399,919)	
国債証券 合計		201,714,168,400 (201,714,168,400)	216,308,803,059 (216,308,803,059)	
合計		201,714,168,400 (201,714,168,400)	216,308,803,059 (216,308,803,059)	

- (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 128銘柄	42.60%	43.27%
イギリス・ポンド	国債証券 40銘柄	6.90%	7.00%
オーストラリア・ドル	国債証券 22銘柄	2.07%	2.11%
カナダ・ドル	国債証券 25銘柄	2.04%	2.07%
シンガポール・ドル	国債証券 13銘柄	0.37%	0.37%
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 6銘柄	0.57%	0.58%
ノルウェー・クローネ	国債証券 7銘柄	0.28%	0.28%
ポーランド・ズロチ	国債証券 15銘柄	0.63%	0.64%
マレーシア・リンギット	国債証券 15銘柄	0.42%	0.43%
メキシコ・ペソ	国債証券 15銘柄	0.76%	0.78%
ユーロ	国債証券 276銘柄	40.90%	41.54%
南アフリカ・ランド	国債証券 12銘柄	0.60%	0.61%

(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

該当事項はありません。

「外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成29年11月13日現在	平成30年5月11日現在
資産の部			
流動資産			
預金		41,639,037	123,936,938
コール・ローン		33,152,319	92,287,989
投資信託受益証券		5,952,252,786	5,690,828,513
投資証券		46,917,819,656	44,253,670,488
派生商品評価勘定		4,260	74,190
未収入金		6,587,923	58,294,875
未収配当金		98,765,742	105,456,379
流動資産合計		53,050,221,723	50,324,549,372
資産合計		53,050,221,723	50,324,549,372
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		77,134	56,680
未払金		-	8,038,801
未払解約金		44,162,000	119,023,000
流動負債合計		44,239,134	127,118,481
負債合計		44,239,134	127,118,481
純資産の部			
元本等			
元本	1	42,851,516,844	42,901,256,046
剰余金			
剰余金又は欠損金()		10,154,465,745	7,296,174,845
元本等合計		53,005,982,589	50,197,430,891
純資産合計		53,005,982,589	50,197,430,891
負債純資産合計		53,050,221,723	50,324,549,372

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29年11月13日現在	平成30年5月11日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	34,758,433,445円	42,851,516,844円
同期中追加設定元本額	16,322,674,035円	20,322,961,835円
同期中一部解約元本額	8,229,590,636円	20,273,222,633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）	225,619,565円	238,155,660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）	65,849,182円	89,866,857円
M I T O ラップ型ファンド（安定型）	6,065,732円	5,363,831円
M I T O ラップ型ファンド（中立型）	15,812,591円	21,023,866円
M I T O ラップ型ファンド（積極型）	43,832,039円	40,191,198円
グローバル8資産ラップファンド（安定 型）	17,442,378円	31,704,050円

グローバル8資産ラップファンド(中立型)	18,003,753円	45,211,021円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	30,321,034円	40,331,527円
たわらノーロード 先進国リート	1,573,371,282円	2,067,601,336円
たわらノーロード 先進国リート<ラップ向け>	329,093,796円	505,888,442円
たわらノーロード 先進国リート<為替ヘッジあり>	120,079,722円	132,333,674円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	15,396,579円	55,607,742円
たわらノーロード バランス(堅実型)	8,087円	326,068円
たわらノーロード バランス(標準型)	40,431円	5,808,254円
たわらノーロード バランス(積極型)	97,033円	22,217,548円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定型)	- 円	2,223,990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)	- 円	10,033,896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)	- 円	8,287,317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)	- 円	21,724,009円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	- 円	96,698円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	- 円	873,434円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	- 円	982,411円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	- 円	3,497,985円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	23,271,815円	24,205,250円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	542,859,210円	605,308,573円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	66,236,552円	64,548,816円
D I A M D C 8資産バランスファンド(新興国10)	25,145,570円	29,745,247円
D I A M D C 8資産バランスファンド(新興国20)	81,000,883円	101,335,190円
D I A M D C 8資産バランスファンド(新興国30)	174,680,672円	222,447,083円
投資のソムリエ	5,202,906,910円	6,884,778,621円
投資のソムリエ<DC年金>	310,346,717円	497,965,893円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	93,561,615円	119,939,477円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	75,062,432円	83,037,311円
ダイナミック・ナビゲーション	303,037円	295,228円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	939,703,712円	1,442,057,323円
ワールドアセットバランス(基本コース)	1,048,086,732円	1,433,453,250円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	3,449,376,557円	5,456,447,773円

投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	685,003円	1,464,452円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	685,003円	1,078,542円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	265,802円	399,887円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	-円	2,821,622円
DIAMパッシブ資産分散ファンド	1,154,217,638円	1,192,999,535円
DIAM外国リートインデックスファンド<DC年金>	20,078,350円	27,686,808円
DIAM世界アセットバランスファンドVA(適格機関投資家向け)	3,655,392,348円	1,779,213,080円
DIAMグローバル 私募ファンド(適格機関投資家向け)	11,580,328円	11,580,328円
DIAM世界アセットバランスファンド2VA(適格機関投資家限定)	11,816,688,922円	12,039,870,878円
DIAMグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンド(適格機関投資家限定)	3,338,053,007円	1,856,690,775円
DIAMグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンドII(適格機関投資家限定)	3,638,666,946円	1,465,670,521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)	4,161,300,139円	3,647,231,593円
DIAM海外リートインデックスファンド(適格機関投資家限定)	560,327,740円	559,632,176円
計	42,851,516,844円	42,901,256,046円
2. 受益権の総数	42,851,516,844口	42,901,256,046口

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成29年5月12日 至 平成29年11月13日	自 平成29年11月14日 至 平成30年5月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成29年11月13日現在	平成30年5月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成29年11月13日現在	平成30年5月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
投資信託受益証券	171,504,369	75,293,346
投資証券	226,690,942	663,140,016
合計	398,195,311	587,846,670

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成29年6月23日から平成29年11月13日まで及び平成29年6月23日から平成30年5月11日まで）に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	平成29年11月13日 現在				平成30年5月11日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
	市場取引以外の取引							
為替予約取引								
売 建	35,666,686	-	35,739,560	72,874	78,150,960	-	78,130,200	20,760
アメリカ・ドル	27,775,895	-	27,849,150	73,255	16,490,550	-	16,419,000	71,550
イギリス・ポンド	2,831,361	-	2,833,470	2,109	-	-	-	-
オーストラリア・ドル	2,612,160	-	2,607,900	4,260	-	-	-	-
カナダ・ドル	-	-	-	-	61,660,410	-	61,711,200	50,790
シンガポール・ドル	1,502,352	-	1,502,640	288	-	-	-	-
香港・ドル	944,918	-	946,400	1,482	-	-	-	-
買 建	-	-	-	-	27,368,250	-	27,365,000	3,250
アメリカ・ドル	-	-	-	-	27,368,250	-	27,365,000	3,250
合計	35,666,686	-	35,739,560	72,874	105,519,210	-	105,495,200	17,510

(注) 時価の算定方法

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

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

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

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成29年11月13日現在	平成30年5月11日現在
1口当たり純資産額	1.2370円	1.1701円
(1万口当たり純資産額)	(12,370円)	(11,701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5月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	オーストラリア・ドル	ABACUS PROPERTY GROUP	129,980.000	488,724.800	
		ARENA REIT	108,676.000	239,087.200	
		BWP TRUST	192,124.000	612,875.560	
		CHARTER HALL GROUP	185,742.000	1,155,315.240	
		CHARTER HALL LONG WALE REIT	68,380.000	287,196.000	
		CHARTER HALL RETAIL REIT	130,511.000	537,705.320	
		CROMWELL PROPERTY GROUP	631,877.000	698,224.080	
		DEXUS	411,301.000	3,989,619.700	
		FOLKESTONE EDUCATION TRUST	88,555.000	246,182.900	
		GDI PROPERTY GROUP	208,566.000	261,750.330	
		GOODMAN GROUP	649,413.000	5,922,646.560	
		GPT GROUP	731,157.000	3,546,111.450	
		GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA	104,165.000	358,327.600	
		HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD	55,859.000	177,073.030	
		INDUSTRIA REIT	42,579.000	108,150.660	
		INGENIA COMMUNITIES GROUP	85,235.000	230,134.500	
		INVESTA OFFICE FUND	200,086.000	882,379.260	
		MIRVAC GROUP	1,509,099.000	3,455,836.710	
		NATIONAL STORAGE REIT	223,901.000	354,883.080	
		PROPERTYLINK GROUP	151,222.000	158,026.990	
		RURAL FUNDS GROUP	104,894.000	215,032.700	
		SCENTRE GROUP	2,158,727.000	8,915,542.510	
		SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	287,473.000	692,809.930	
		STOCKLAND	992,282.000	4,207,275.680	
		VICINITY CENTRES	1,308,566.000	3,349,928.960	
		VIVA ENERGY REIT	170,608.000	349,746.400	
WESTFIELD CORP	774,799.000	7,089,410.850			
	オーストラリア・ドル 小計		11,705,777.000	48,529,998.000 (3,999,842,436)	
	カナダ・ドル	KILLAM APARTMENT REIT	17,170.000	254,116.000	
	カナダ・ドル 小計		17,170.000	254,116.000 (21,785,365)	

シンガポール・ドル	AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL REIT	235,095.000	326,782.050	
	ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	317,200.000	253,760.000	
	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	976,960.000	2,579,174.400	
	ASCOTT RESIDENCE TRUST	505,915.000	566,624.800	
	CACHE LOGISTICS TRUST	435,780.000	348,624.000	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	1,054,579.000	1,856,059.040	
	CAPITALAND MALL TRUST	1,095,660.000	2,278,972.800	
	CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST	234,580.000	365,944.800	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	299,900.000	512,829.000	
	ESR REIT	539,430.000	285,897.900	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	359,600.000	246,326.000	
	FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	236,600.000	319,410.000	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	227,500.000	502,775.000	
	FRASERS COMMERCIAL TRUST	270,880.000	371,105.600	
	FRASERS LOGISTICS & INDUSTRIAL TRUST	475,500.000	518,295.000	
	KEPPEL DC REIT	301,000.000	421,400.000	
	KEPPEL REIT	723,000.000	860,370.000	
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST	798,300.000	251,464.500	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	768,500.000	1,229,600.000	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	494,020.000	978,159.600	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	826,520.000	1,016,619.600	
	MAPLETREE GREATER CHINA COMMERCIAL TRUST	719,500.000	827,425.000	
	QUE HOSPITALITY TRUST	441,520.000	353,216.000	
	PARKWAY LIFE REIT	153,100.000	421,025.000	
	SABANA SHARIAH COMP IND REIT	373,100.000	160,433.000	
	SOILBUILD BUSINESS SPACE REIT	276,100.000	182,226.000	
	SPH REIT	265,400.000	264,073.000	
STARHILL GLOBAL REIT	550,500.000	377,092.500		
SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	906,690.000	1,722,711.000		
シンガポール・ドル 小計	14,862,429.000	20,398,395.590 (1,669,200,712)		
投資信託受益証券 合計	26,585,376	5,690,828,513		

				(5,690,828,513)	
投資証券	アメリカ・ドル	ACADIA REALTY TRUST	33,622.000	820,040.580	
		AGREE REALTY CORP	12,861.000	657,454.320	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	27,081.000	611,759.790	
		ALEXANDER'S INC.	1,568.000	612,162.880	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	41,038.000	5,308,675.680	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	17,207.000	606,546.750	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	55,458.000	2,236,066.560	
		AMERICAN HOMES 4 RENT	102,277.000	2,136,566.530	
		AMERICOLD REALTY TRUST	19,756.000	423,371.080	
		APARTMENT INVT & MGMT CO-A	63,979.000	2,628,257.320	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	85,023.000	1,578,026.880	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC	19,187.000	266,891.170	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	35,805.000	257,437.950	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	56,015.000	9,393,715.500	
		BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH REIT INC	11,112.000	98,452.320	
		BOSTON PROPERTIES INC	62,598.000	7,816,612.260	
		BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	13,902.000	148,195.320	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	70,566.000	1,181,980.500	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	123,665.000	1,815,402.200	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	37,717.000	3,319,096.000	
		CARETRUST REIT INC	31,638.000	484,377.780	
		CBL & ASSOCIATES	67,937.000	303,678.390	
		CEDAR REALTY TRUST INC	33,531.000	135,800.550	
		CHATHAM LODGING TRUST	18,166.000	361,503.400	
		CHESAPEAKE LODGING TRUST	24,101.000	757,012.410	
		CITY OFFICE REIT INC	14,463.000	171,241.920	
		CLIPPER REALTY INC	5,169.000	43,678.050	
		COLONY NORTHSTAR INC	206,237.000	1,243,609.110	
		COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	48,268.000	1,094,235.560	
		COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	6,974.000	188,019.040	
		CORECIVIC INC	47,569.000	988,959.510	
		CORESITE REALTY CORP	13,882.000	1,483,708.160	
		CORPORATE OFFICE PROPERTIES	40,803.000	1,145,748.240	
COUSINS PROPERTIES INC	170,242.000	1,569,631.240			

CUBESMART	74,051.000	2,283,732.840	
CYRUSONE INC	39,047.000	2,154,613.460	
DCT INDUSTRIAL TRUST INC	38,081.000	2,516,392.480	
DDR CORP	123,090.000	919,482.300	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	80,636.000	958,762.040	
DIGITAL REALTY TRUST INC	83,337.000	9,029,563.950	
DOUGLAS EMMETT INC	64,800.000	2,519,424.000	
DUKE REALTY TRUST	144,528.000	4,173,968.640	
EAST GROUP	14,006.000	1,304,939.020	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	18,694.000	391,639.300	
EDUCATION REALTY TRUST INC	30,498.000	1,058,890.560	
EMPIRE STATE REALTY TRUST INC	51,665.000	896,904.400	
EPR PROPERTIES	26,205.000	1,586,450.700	
EQUITY COMMONWEALTH	50,463.000	1,591,098.390	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	36,055.000	3,244,228.900	
EQUITY RESIDENTIAL	149,354.000	9,395,860.140	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	26,778.000	6,531,421.980	
EXTRA SPACE STORAGE INC	51,079.000	4,860,677.640	
FARMLAND PARTNERS INC	14,523.000	116,764.920	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	29,796.000	3,546,915.840	
FIRST INDUSTRIAL RT	48,710.000	1,573,333.000	
FOREST CITY REALTY TRUST INC	108,392.000	2,168,923.920	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST INC	25,398.000	588,471.660	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	42,337.000	329,381.860	
GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	81,253.000	2,853,605.360	
GEO GROUP INC	49,965.000	1,201,158.600	
GETTY REALTY CORP	13,326.000	342,478.200	
GGP INC	256,032.000	5,228,173.440	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	11,218.000	207,757.360	
GLADSTONE LAND CORP	5,526.000	70,622.280	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	6,498.000	54,258.300	
GLOBAL NET LEASE INC	27,965.000	537,766.950	
GOVERNMENT PROPERTIES INCOME TRUST	41,156.000	567,952.800	
GRAMERCY PROPERTY TRSUT	65,137.000	1,791,918.870	
HCP INC	190,228.000	4,576,885.680	

HEALTHCARE REALTY TRUST INC	50,598.000	1,416,744.000	
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA INC	83,230.000	2,182,290.600	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	14,731.000	290,495.320	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	41,930.000	1,955,615.200	
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	66,688.000	1,857,927.680	
HOST HOTELS & RESORTS INC	297,642.000	6,226,670.640	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	63,084.000	2,209,832.520	
INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	34,580.000	328,510.000	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES TRUST	8,484.000	182,830.200	
INFREIT INC	16,132.000	341,675.760	
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	50,011.000	269,559.290	
INVITATION HOMES INC	115,999.000	2,748,016.310	
IRON MOUNTAIN INC	114,621.000	3,865,020.120	
ISTAR INC	28,395.000	305,246.250	
JBG SMITH PROPERTIES	37,834.000	1,383,211.040	
KILROY REALTY CORP	40,163.000	3,002,184.250	
KIMCO REALTY	172,939.000	2,517,991.840	
KITE REALTY GROUP TRUST	34,706.000	523,019.420	
LASALLE HOTEL PROPERTIES	45,878.000	1,441,945.540	
LEXINGTON REALTY TRUST	86,755.000	725,271.800	
LIBERTY PROPERTY TRUST	59,953.000	2,626,540.930	
LIFE STORAGE INC	18,871.000	1,753,115.900	
LTC PROPERTIES INC	16,445.000	645,137.350	
MACK CALI	37,405.000	689,000.100	
MANULIFE US REIT	385,600.000	362,464.000	
MEDEQUITIES REALTY TRUST INC	13,143.000	140,104.380	
MEDICAL PROPERTIES TRUST	148,063.000	1,989,966.720	
MID AMERICA	46,007.000	4,279,111.070	
MONMOUTH RE INVEST CP -CL A	32,265.000	510,432.300	
NATIONAL HEALTH INVS INC	16,733.000	1,188,544.990	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	62,562.000	2,538,140.340	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUST	20,532.000	569,763.000	

NEW SENIOR INVESTMENT GROUP INC	34,578.000	263,138.580	
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	7,762.000	218,810.780	
NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP	23,399.000	334,839.690	
OMEGA HEALTHCARE INVS INC	80,680.000	2,309,061.600	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	6,553.000	162,907.580	
PARAMOUNT GROUP INC	82,562.000	1,252,465.540	
PARK HOTELS & RESORTS INC	81,767.000	2,502,070.200	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	27,746.000	1,051,573.400	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	27,655.000	279,038.950	
PHYSICIANS REALTY TRUST	72,171.000	1,114,320.240	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC	54,348.000	1,021,198.920	
PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES INC	16,134.000	231,361.560	
PROLOGIS INC	216,317.000	14,188,232.030	
PS BUSINESS PARKS	8,004.000	952,796.160	
PUBLIC STORAGE	60,794.000	12,879,208.900	
QTS REALTY TRUST INC	20,912.000	743,839.840	
QUALITY CARE PROPERTIES INC	37,687.000	797,080.050	
RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES	31,486.000	371,219.940	
REALTY INCOME CORP	115,233.000	6,167,270.160	
REGENCY CENTERS CORP	60,138.000	3,526,492.320	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	45,127.000	786,563.610	
RETAIL PROPERTIES OF AMERICA INC	91,438.000	1,074,396.500	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	31,574.000	1,025,839.260	
RLJ LODGING TRUST	70,838.000	1,565,519.800	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	20,769.000	1,715,311.710	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	72,165.000	1,452,681.450	
SAUL CENTERS INC	5,042.000	251,142.020	
SELECT INCOME REIT	26,722.000	554,214.280	
SENIOR HOUSING PPTYS TRUST	96,331.000	1,577,901.780	
SERITAGE GROWTH PROPERTIES	10,261.000	388,173.630	
SIMON PROPERTY GROUP INC	126,292.000	20,360,796.240	

	SL GREEN	36,588.000	3,703,437.360	
	SPIRIT REALTY CAPITAL INC	184,813.000	1,569,062.370	
	STAG INDUSTRIAL INC	37,836.000	995,843.520	
	STORE CAPITAL CORP	67,069.000	1,764,585.390	
	SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	43,258.000	645,409.360	
	SUN COMMUNITIES INC	32,286.000	3,048,444.120	
	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	91,338.000	1,520,777.700	
	TANGER FACTORY OUTLET	37,986.000	804,543.480	
	TAUBMAN CENTERS INC	24,570.000	1,381,079.700	
	TERRENO REALTY CORP	22,279.000	861,306.140	
	THE MACERICH COMPANY	43,882.000	2,526,286.740	
	TIER REIT INC	18,916.000	395,155.240	
	UDR INC	108,560.000	3,971,124.800	
	UMH PROPERTIES INC	13,007.000	186,650.450	
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	5,259.000	327,162.390	
	URBAN EDGE PROPERTIES	42,550.000	899,932.500	
	URSTADT BIDDLE PROPERTIES	12,432.000	262,190.880	
	VENTAS INC	144,447.000	7,762,581.780	
	VEREIT INC	396,230.000	2,817,195.300	
	VORNADO REALTY TRUST	70,068.000	4,923,678.360	
	WASHINGTON PRIME GROUP INC	77,094.000	542,741.760	
	WASHINGTON REIT	31,552.000	918,163.200	
	WEINGARTEN REALTY INVST	48,180.000	1,334,104.200	
	WELLTOWER INC	150,210.000	8,432,789.400	
	WHEELER REIT INC	2,961.000	12,436.200	
	WHITESTONE REIT	15,579.000	187,571.160	
	WP CAREY INC	43,488.000	2,877,600.960	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	42,907.000	989,006.350	
	アメリカ・ドル 小計	9,509,053.000	320,909,041.120 (35,136,330,913)	
イギリス・ボンド	AEW UK LONG LEASE REIT PLC	37,060.000	34,910.520	
	ASSURA PLC	955,011.000	563,456.490	
	BIG YELLOW GROUP PLC	59,619.000	573,236.680	
	BRITISH LAND CO PLC	404,717.000	2,790,118.990	
	CAPITAL & REGIONAL PLC	229,731.000	124,284.470	
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	81,480.000	85,146.600	
	DERWENT LONDON PLC	45,004.000	1,412,225.520	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	228,600.000	202,311.000	

	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	113,878.000	804,775.820	
	HAMMERSON PLC	322,499.000	1,777,614.480	
	HANSTEEN HOLDINGS PLC	163,211.000	169,413.010	
	INTU PROPERTIES PLC	353,021.000	701,099.700	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	306,024.000	2,987,100.260	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	278,561.000	540,408.340	
	LXI REIT PLC	90,981.000	95,075.140	
	NEWRIVER REIT PLC	122,388.000	342,686.400	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC	293,786.000	336,678.750	
	RDI REIT PLC	528,881.000	195,685.970	
	REGIONAL REIT LTD	118,301.000	118,064.390	
	SAFESTORE HOLDINGS LTD	85,035.000	461,314.870	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT TRUST LTD	221,364.000	134,367.940	
	SEGRE PLC	404,815.000	2,632,107.130	
	SHAFTESBURY PLC	99,604.000	1,007,992.480	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	596,117.000	895,963.850	
	UNITE GROUP PLC	106,455.000	903,802.950	
	WORKSPACE GROUP PLC	47,830.000	532,347.900	
イギリス・ポンド	小計	6,293,973.000	20,422,189.650 (3,023,505,178)	
イスラエル・シュケル	REIT 1 LTD	70,287.000	1,018,458.630	
イスラエル・シュケル	小計	70,287.000	1,018,458.630 (31,256,495)	
カナダ・ドル	AGELLAN COMMERCIAL REIT	7,030.000	86,398.700	
	ALLIED PROPERTIES REIT	18,254.000	787,477.560	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	30,141.000	412,027.470	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	8,988.000	420,099.120	
	CANADIAN APT PPTYS REIT	27,247.000	1,096,146.810	
	CHOICE PROPERTIES REIT	54,339.000	634,136.130	
	COMINAR REAL ESTATE INVT TR	35,289.000	440,759.610	
	CROMBIE REAL ESTATE INV	18,049.000	224,710.050	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	12,724.000	169,992.640	
	DREAM GLOBAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	34,249.000	480,513.470	
	DREAM INDUSTRIAL REIT	13,662.000	147,686.220	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV TRUST	15,434.000	369,798.640	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	9,154.000	471,614.080	
	H & R REAL ESTATE INVESTMENT	57,318.000	1,197,373.020	

	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	19,922.000	210,575.540	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT	7,446.000	110,722.020	
	MORGUARD REAL ESTATE INV T R	10,016.000	131,910.720	
	NORTHVIEW APARTMENT REIT	10,096.000	263,505.600	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	21,137.000	238,848.100	
	PURE INDUSTRIAL REAL ESTATE TRUST	60,506.000	485,863.180	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	63,970.000	1,513,530.200	
	SLATE OFFICE REIT	12,079.000	92,887.510	
	SLATE RETAIL REIT	9,433.000	119,610.440	
	SMARTCENTRES REIT	26,041.000	742,949.730	
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	13,569.000	117,643.230	
カナダ・ドル 小計		596,093.000	10,966,779.790 (940,182,032)	
ニュージーランド・ドル	ARGOSY PROPERTY LTD	351,491.000	355,005.910	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	414,618.000	563,880.480	
	INVESTORE PROPERTY LTD	88,877.000	127,094.110	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	569,435.000	774,431.600	
	PRECINCT PROPERTIES	388,435.000	487,485.920	
	STRIDE STAPLED GROUP	149,101.000	259,435.740	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	129,943.000	265,733.430	
ニュージーランド・ドル 小計		2,091,900.000	2,833,067.190 (215,936,381)	
ユーロ	AEDIFICA	7,198.000	570,801.400	
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	56,232.000	706,273.920	
	ALTAREA	1,463.000	317,471.000	
	BEFIMMO	9,649.000	514,291.700	
	BENI STABILI SPA	414,618.000	323,402.040	
	COFINIMMO SA	7,935.000	887,926.500	
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	19,981.000	707,727.020	
	FONCIERE DES REGIONS	21,803.000	2,096,358.450	
	GECINA SA	19,597.000	2,833,726.200	
	GREEN REIT PLC	282,535.000	445,275.160	
	HAMBORNER REIT AG	33,175.000	308,195.750	
	HIBERNIA REIT PLC	276,689.000	427,207.810	
	HISPANIA ACTIVOS INMOBILIARIOS SOCIMI SA	43,585.000	781,043.200	
	ICADE	18,302.000	1,454,093.900	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE	20,030.000	158,757.780	

	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA	131,474.000	1,330,516.880	
	INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	6,068.000	139,260.600	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES REIT PLC	149,001.000	210,091.410	
	KLEPIERRE	84,478.000	2,875,631.120	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA	38,694.000	371,849.340	
	MERCIALYS	22,547.000	360,752.000	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	135,508.000	1,754,828.600	
	NSI NV	7,625.000	274,118.750	
	RETAIL ESTATES	3,100.000	230,950.000	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	40,290.000	7,912,956.000	
	VASTNED RETAIL	6,275.000	266,060.000	
	WAREHOUSES DE PAUW	6,506.000	680,527.600	
	WERELDHAVE NV	16,336.000	557,057.600	
	ユーロ 小計	1,880,694.000	29,497,151.730 (3,846,428,585)	
	香港・ドル			
	CHAMPION REIT	823,070.000	4,461,039.400	
	FORTUNE REAL ESTATE (HK)	555,000.000	5,111,550.000	
	LINK REIT	880,020.000	58,917,339.000	
	PROSPERITY REIT	462,000.000	1,483,020.000	
	SPRING REIT	351,000.000	1,158,300.000	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	433,000.000	2,320,880.000	
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	483,000.000	2,535,750.000	
	香港・ドル 小計	3,987,090.000	75,987,878.400 (1,060,030,904)	
投資証券 合計		24,429,090	44,253,670,488 (44,253,670,488)	
合計			49,944,499,001 (49,944,499,001)	

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 160銘柄	-%	70.00%	70.35%
イギリス・ポンド	投資証券 26銘柄	-%	6.02%	6.05%
イスラエル・シケル	投資証券 1銘柄	-%	0.06%	0.06%
オーストラリア・ドル	投資信託受益証券 27銘柄	7.97%	-%	8.01%
カナダ・ドル	投資信託受益証券 1銘柄 投資証券 25銘柄	0.04% -%	-% 1.87%	1.93%

シンガポール・ドル	投資信託受益証券	29銘柄	3.33%	-%	3.34%
ニュージーランド・ドル	投資証券	7銘柄	-%	0.43%	0.43%
ユーロ	投資証券	28銘柄	-%	7.66%	7.70%
香港・ドル	投資証券	7銘柄	-%	2.11%	2.12%

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

平成30年5月31日現在

資産総額	442,228,409円
負債総額	357,657円
純資産総額(-)	441,870,752円
発行済数量	423,666,267口
1口当たり純資産額(/)	1.0430円

(参考)

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

平成30年5月31日現在

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

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年5月31日現在

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

J-REITインデックスファンド・マザーファンド

平成30年5月31日現在

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

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年5月31日現在

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

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年5月31日現在

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

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

平成30年5月31日現在

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

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 受益証券の名義書換

該当事項はありません。

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

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

(2) 受益者等名簿

該当事項はありません。

(3) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

(4) 受益権の譲渡制限

譲渡制限はありません。

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

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

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

(5) 受益権の譲渡の対抗要件

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

(6) 受益権の再分割

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

(7)質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額(平成30年5月31日現在)

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

直近5カ年の資本金の増減：該当事項はありません。

(2) 会社の機構(平成30年5月31日現在)

会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。

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

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

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

また、取締役会の決議によって、取締役社長を定めることができます。

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

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

投資運用の意思決定機構

1. 投資環境見直しおよび運用方針の策定

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

2.運用計画、売買計画の決定

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

2【事業の内容及び営業の概況】

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

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

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

3【委託会社等の経理状況】

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

(1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

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

(単位:千円)

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

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

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

（単位：千円）

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

（３）【株主資本等変動計算書】

第32期（自平成28年4月1日至平成29年3月31日）

（単位：千円）

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

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

第33期（自平成29年4月1日至平成30年3月31日）

（単位：千円）

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

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

重要な会計方針

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

会計上の見積りの変更

第33期 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)

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

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

追加情報

第33期 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)

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

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

注記事項

(貸借対照表関係)

1. 有形固定資産の減価償却累計額

(千円)

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

(損益計算書関係)

1. 関係会社に対する事項

(千円)

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

2. 固定資産売却益の内訳

(千円)

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

3. 固定資産除却損の内訳

(千円)

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

4. 固定資産売却損の内訳

(千円)

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

5. 本社移転費用の内訳

(千円)

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

(株主資本等変動計算書関係)

第32期(自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

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

第33期(自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

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

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

営業債務である未払手数料は、1年以内の支払期日であります。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

(4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

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

第32期（平成29年3月31日現在）

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

第33期(平成30年3月31日現在)

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

(注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3) 未収委託者報酬及び(4) 未収運用受託報酬

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

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

負 債

(1) 未払手数料

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

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(千円)

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

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

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

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第32期(平成29年3月31日現在)

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

第33期(平成30年3月31日現在)

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

(有価証券関係)

1. 子会社株式及び関連会社株式

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

2. その他有価証券

第32期(平成29年3月31日現在)

(千円)

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

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

第33期(平成30年3月31日現在)

(千円)

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

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

3. 当該事業年度中に売却したその他有価証券

第32期(自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)

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

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

第33期(自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)

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

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

4. 減損処理を行った有価証券

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

第33期において、該当事項はありません。

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

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

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

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(千円)

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

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

(千円)

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

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

(千円)

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

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(千円)

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

(注) 特別損失に計上しております。

(5) 年金資産に関する事項

年金資産の主な内訳

年金資産合計に対する主な分類ごとの比率は、次のとおりであります。

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

長期期待運用収益率の設定方法

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

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎

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

3. 簡便法を適用した確定給付制度

(1) 簡便法を適用した制度の、退職給付引当金の期首残高と期末残高の調整表

(千円)

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

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

(千円)

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

(3) 退職給付費用

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

4. 確定拠出制度

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

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

繰延税金資産の純額

1,571,992

1,699,533

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

(企業結合等関係)

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

1. 結合当事企業

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

2. 企業結合日

平成28年10月1日

3. 企業結合の方法

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

4. 結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

5. 企業結合の主な目的

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

6. 合併比率

「3. 企業結合の方法」の吸収合併における合併比率は以下の通りであります。

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

(*) 普通株式と種類株式を合算して算定しております。

7. 交付した株式数

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

8. 経済的持分比率(議決権比率)

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

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

9. 取得企業を決定するに至った主な根拠

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

10. 会計処理

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

11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

(1) 財務諸表に含まれる被取得企業の業績の期間

平成29年4月1日から平成30年3月31日まで

(2) 被取得企業の取得原価及びその内訳

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

(3) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

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

(4) 企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

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

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

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

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

12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

(1) 貸借対照表項目

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

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

(2) 損益計算書項目

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

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

(資産除去債務関係)

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

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

(セグメント情報等)

1. セグメント情報

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

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

(1) サービスごとの情報

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

(2) 地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

(1) 親会社及び法人主要株主等

第32期(自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)

該当はありません。

第33期(自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)

該当はありません。

(2) 子会社及び関連会社等

第32期(自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)

該当はありません。

第33期(自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)

該当はありません。

(3) 兄弟会社等

第32期(自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)

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

第33期(自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

株式会社みずほフィナンシャルグループ

(東京証券取引所及びニューヨーク証券取引所に上場)

(2) 重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません。

(1株当たり情報)

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

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

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

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

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

4【利害関係人との取引制限】

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

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

5【その他】

- (1) 定款の変更、事業譲渡又は事業譲受、出資の状況その他の重要事項
平成30年6月20日付で、総則の「目的」に関する事項の定款の変更を行いました。
- (2) 訴訟事件その他の重要事項
委託会社およびファンドに重要な影響を与えた事実、または与えると予想される事実はありません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

a. 名称

みずほ信託銀行株式会社

b. 資本金の額

平成30年3月末日現在 247,369百万円

c. 事業の内容

日本において銀行業務および信託業務を営んでいます。

(2) 販売会社

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

名 称	資本金の額 (単位:百万円)	事 業 の 内 容
マネックス証券株式会社	12,200	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。

(注) 資本金の額は平成30年3月末日現在

(3) 投資顧問会社

a. 名称

イボットソン・アソシエイツ・ジャパン株式会社

b. 資本金の額

平成30年3月末日現在 9,557.5万円

c. 事業の内容

日本において投資顧問業務を営んでいます。

2【関係業務の概要】

「受託会社」は、以下の業務を行います。

- (1) 委託会社の指図に基づく信託財産の管理、保管、処分
- (2) 信託財産の計算
- (3) 信託財産に関する報告書の作成
- (4) その他上記に付帯する業務

「販売会社」は、以下の業務を行います。

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

「投資顧問会社」は、以下の業務を行います。

イボットソン・アソシエイツ・ジャパン株式会社は、委託会社との投資顧問契約に基づき、当ファンドの信託財産の運用助言等を行います。

3【資本関係】

該当事項はありません。

持株比率5%以上を記載します。

第3【その他】

- (1)目論見書の表紙等にロゴ・マークや図案を使用し、ファンドの基本的性格を記載することがあります。また目論見書には「目論見書の使用開始日」、「委託会社の金融商品取引業者登録番号」、「金融商品取引法の規定に基づく目論見書である旨」、「投資信託の取引はクーリングオフ適用外である旨」、「請求目論見書の内容やその照会先と請求方法」、「信託財産の管理方法」、「投資信託運用による損益は全て投資家に帰属する旨」、「投資信託の元本は保証されていない旨」等を記載することがあります。
- (2)目論見書には有価証券届出書の第一部「証券情報」、第二部「ファンド情報」の主要内容を要約し記載することがあります。第二部「ファンド情報」第1 ファンドの状況 5 運用状況には、参考情報として 基準価額・純資産の推移 分配の推移 主要な資産の状況 年間収益率の推移等（ベンチマークを含む）を記載することがあります。（表示されるデータは適宜更新されます。）
- (3)請求目論見書の巻末に用語説明を掲載する場合があります。
なお、請求目論見書の巻末に信託約款を掲載し参照することで、有価証券届出書の内容の記載とすることがあります。
- (4)ファンドの特色やリスク等について投資者に開示すべき情報のあるファンドは、交付目論見書に「追加的記載事項」と明記して当該情報の内容等を有価証券届出書の記載に従い記載することがあります。
- (5)交付目論見書の「お申込みメモ」に以下の内容を記載することがあります。
基準価額は、販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。
もしくは、計算日の翌日付の日本経済新聞朝刊の「オープン基準価格」の欄をご参照ください。

独立監査人の監査報告書

平成30年5月30日

アセットマネジメントOne株式会社
取締役会 御中

新日本有限責任監査法人

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

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

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

利害関係

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

以上

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

(注2) XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

平成30年6月29日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 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」に掲げられているマネックス資産設計ファンド<隔月分配型>の平成29年11月14日から平成30年5月11日までの特定期間の財務諸表、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、マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>の平成30年5月11日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

その他の事項

ファンドの平成29年11月13日をもって終了した前特定期間の財務諸表は、前任監査人によって監査されている。前任監査人は、当該財務諸表に対して平成29年12月20日付けで無限定適正意見を表明している。

利害関係

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

以上

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

(注2) XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。

