

【表紙】

【提出書類】 有価証券報告書
【提出先】 関東財務局長
【提出日】 2019年9月3日
【計算期間】 第7期(自 2018年12月4日 至 2019年6月3日)
【ファンド名】 ダイナミック・ナビゲーション
【発行者名】 アセットマネジメントOne株式会社
【代表者の役職氏名】 取締役社長 菅野 暁
【本店の所在の場所】 東京都千代田区丸の内一丁目8番2号
【事務連絡者氏名】 酒井 隆
【連絡場所】 東京都千代田区丸の内一丁目8番2号
【電話番号】 03-6774-5100
【縦覧に供する場所】 該当事項はありません。

第一部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

当ファンドは、信託財産の成長を図ることを目的として、運用を行います。

当ファンドの信託金限度額は、5,000億円とします。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 国内外の8資産に分散投資することにより、信託財産の成長を図ることを目的として運用を行います。

●主として、マザーファンドへの投資を通じて、国内株式、国内債券、先進国株式、先進国債券、新興国株式、新興国債券、国内リート、先進国リーートの8資産に実質的に投資します^(*)。マザーファンドのほか有価証券指数等先物取引等、上場投資信託証券(ETF)、短期金融資産等へ投資する場合があります。

●実質的な組入外貨建て資産に対しては、原則として、対円で為替ヘッジを行いません。

(*)一部のマザーファンドへの投資配分比率がゼロとなる場合があります。

2 8資産への投資配分(以下、戦略的資産配分比率といいます。)は、市場環境等の変化に応じて変更します。

●主として統計的手法の活用により、市場環境や運用環境等の短期的な状況変化に応じて、原則として月に1回、戦略的資産配分比率の変更を行います。

3 世界経済の成長トレンドをとらえながらも、市場下落時には現金等^(*)の活用により基準価額の下落リスクを低減させ、安定的に信託財産の成長を図ることをめざします。

●基準価額の水準や市場環境等に応じ、現金等を活用することで、8資産の合計資産比率^(**)を機動的に変更します。

●原則として、基準価額が上昇傾向にある時には、合計資産比率を増加(現金等比率の減少)させ、下落傾向にある時には、合計資産比率を減少(現金等比率の増加)させます。なお、合計資産比率の変更は、信託財産の純資産総額の概ね10%~100%の範囲で行います。

●日次で下値サポートライン^(***)^(****)を設定し、基準価額の下落を下値サポートラインまでに抑えることをめざします。

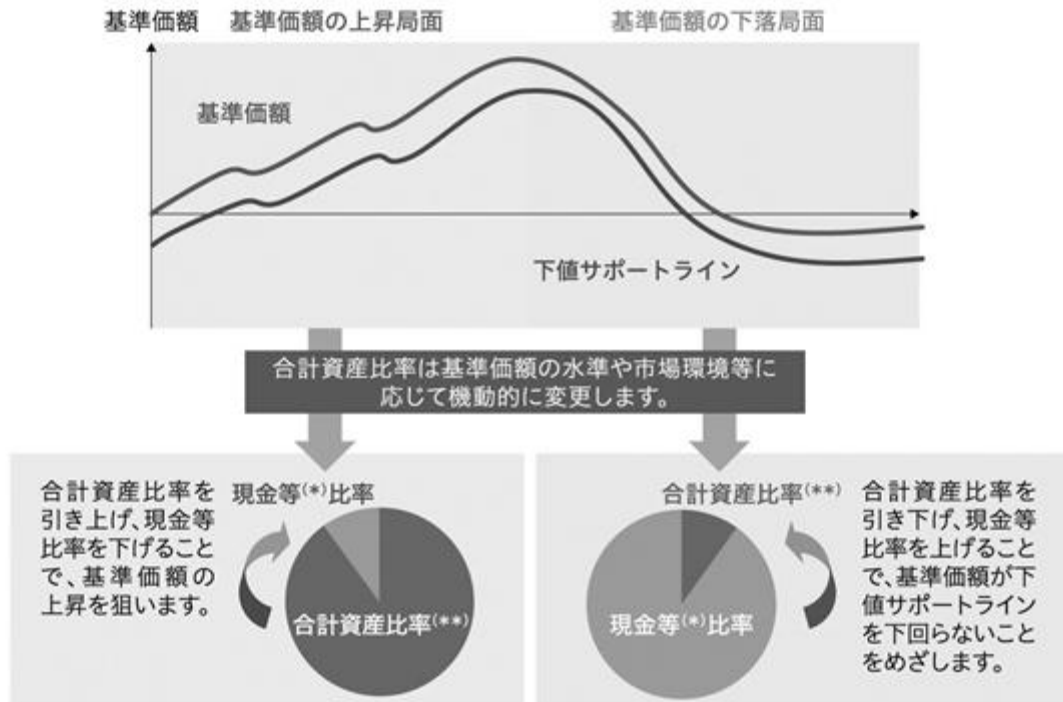
(*)現金等とは、短期国債、コール・ローンなどの短期金融資産等をいい、当該資産へは、「DIAMマネーマザーファンド」を通じてまたは直接投資を行います。

(**)合計資産比率とは、「DIAMマネーマザーファンド」を除く8つのマザーファンドの投資比率の合計をいいます。

(***)下値サポートラインは、過去25営業日の基準価額の平均価額(後方移動平均)から-5%の水準とし、毎日更新します。なお、設定日から24営業日目までについては、25営業日に満たない営業日分の基準価額を10,000円と仮定して平均価額を計算します。

(****)基準価額が下値サポートラインを下回らないことを委託会社が保証等するものではありません。相場急落の場合などには、基準価額が下値サポートラインを下回る場合があります。また、下値サポートラインの水準は、委託会社の判断により今後変更する場合があります。

当ファンドの資産配分の変更(イメージ)



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

(**)合計資産比率とは、「DIAMマネーマザーファンド」を除く8つのマザーファンドの投資比率の合計をいいます。

※下値サポートラインは、基準価額がこれを下回らないように目標とされる水準であり、基準価額が下値サポートラインを下回らないことを委託会社が保証するものではありません。

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

分配方針

年2回の決算時(毎年6月、12月の各2日(休業日の場合は翌営業日))に、経費控除後の配当等収益および売買益(評価益を含みます。)等の全額を対象として、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して、分配金額を決定します。

- ・将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。
- ・分配金額は、分配方針に基づいて委託会社が決定します。あらかじめ一定の額の分配をお約束するものではありません。分配金が支払われない場合もあります。

商品分類表

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 年2回 年4回	グローバル (日本を含む) 日本		
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ()	年6回 (隔月) 年12回 (毎月)	北米 欧州 アジア オセアニア	ファミリー ファンド	あり ()
不動産投信 その他資産 ()	日々 その他 ()	中南米 アフリカ 中近東 (中東)	ファンド・オ ブ・ファンズ	なし
資産複合 (投資信託証 券(債券、株 式、不動産投 信)、先物、 ETF、短期 金融資産) 資産配分固定型 資産配分変更型		エマージング		

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

(注) 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

資産複合(投資信託証券(債券、株式、不動産投信)、先物、ETF、短期金融資産)資産配分変更型	目論見書または投資信託約款において、複数資産(投資信託証券、先物、ETF、短期金融資産)を投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行う旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないものをいいます。
年 2 回	目論見書または投資信託約款において、年2回決算する旨の記載があるものをいいます。
グローバル(日本を含む)	目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本を含む世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
ファミリーファンド	目論見書または投資信託約款において、親投資信託(ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。)を投資対象として投資するものをいいます。
為替ヘッジなし	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。

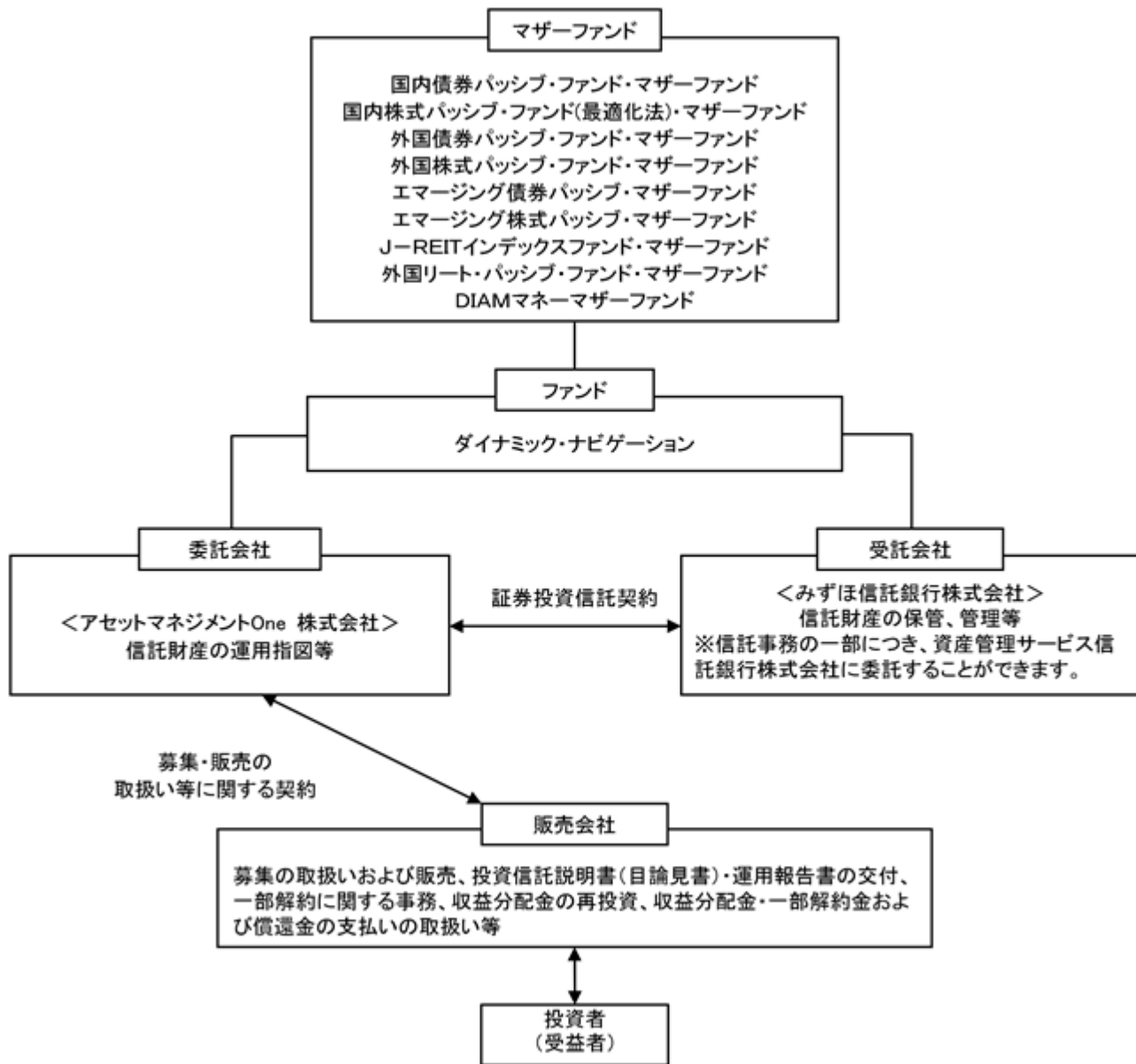
上記の分類は、一般社団法人投資信託協会の商品分類に関する指針に基づき記載しております。

上記以外の商品分類および属性区分の定義については、一般社団法人投資信託協会ホームページ(<https://www.toushin.or.jp/>)でご覧いただけます。

(2)【ファンドの沿革】

2016年2月24日 信託契約締結、ファンドの設定、ファンドの運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】



- ・ 「証券投資信託契約」の概要

委託会社と受託会社との間においては、当ファンドにかかる証券投資信託契約を締結しております。

当該契約の内容は、当ファンドの運用の基本方針、投資対象、投資制限、受益者の権利等を規定したものです。

- ・ 「募集・販売の取扱い等に関する契約」の概要

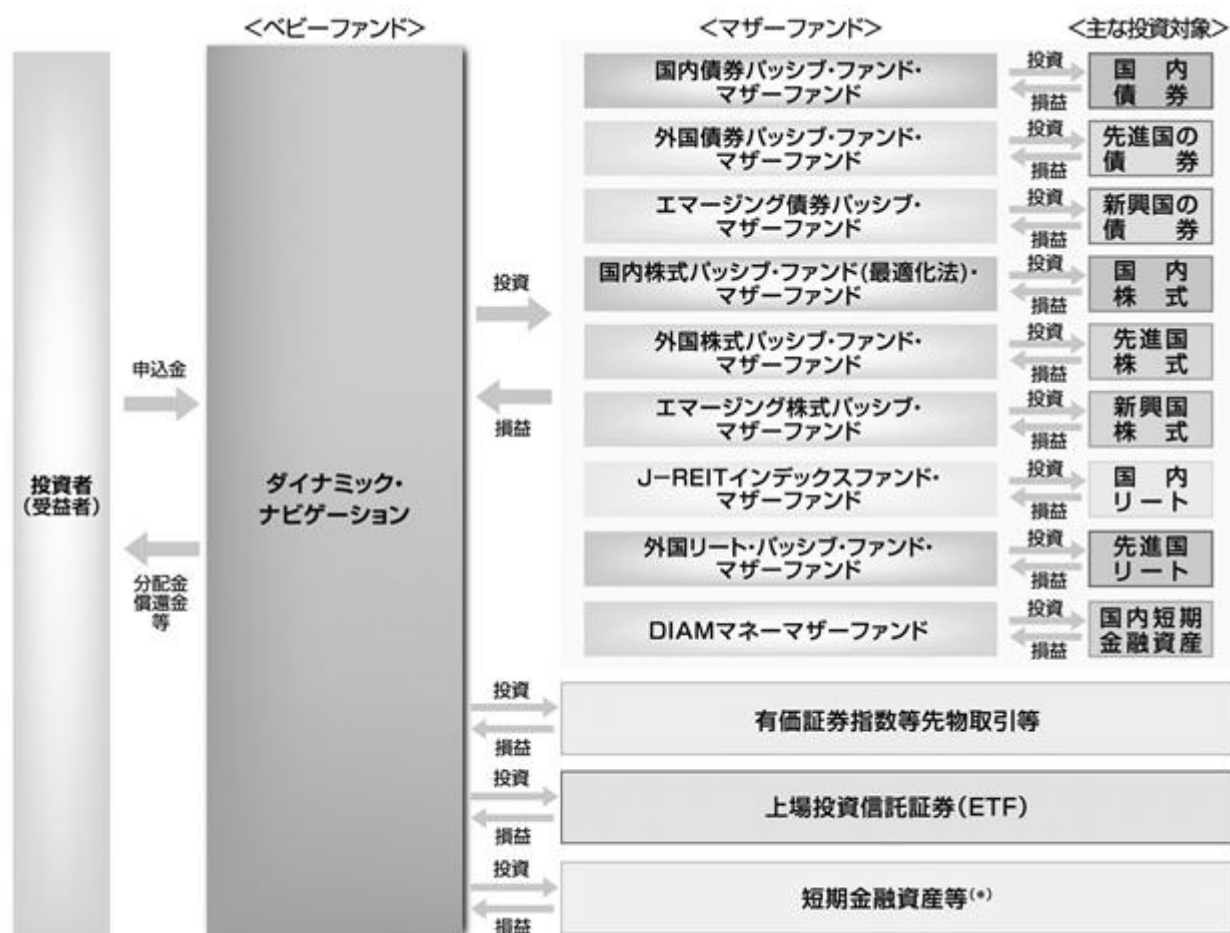
委託会社と販売会社との間においては、募集・販売の取扱い等に関する契約を締結しております。

当該契約の内容は、証券投資信託の募集・販売の取扱い、一部解約に関する事務、収益分配金の再投資、収益分配金・一部解約金および償還金の受益者への支払い等に関する包括的な規則を定めたものです。

「ファミリーファンド方式」とは

当ファンドは「ファミリーファンド方式」により運用を行います。

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



(*)市場環境によっては、残存期間3年以下の債券に投資することがあります。

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（2019年6月28日現在）

委託会社の沿革

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

- 2008年1月1日 「興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社」から「D I A Mア
 セットマネジメント株式会社」に商号変更
- 2016年10月1日 D I A Mアセットマネジメント株式会社、みずほ投信投資顧問株式会社、
 新光投信株式会社、みずほ信託銀行株式会社(資産運用部門)が統合し、
 商号をアセットマネジメントOne株式会社に変更

大株主の状況

(2019年6月28日現在)

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

1：A種種類株式(15,510株)を含みます。

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

<基本方針>

信託財産の成長を図ることを目的として、運用を行います。

<投資対象>

「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド」受益証券、「外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「エマージング債券パッシブ・マザーファンド」受益証券、「エマージング株式パッシブ・マザーファンド」受益証券、「J-REITインデックスファンド・マザーファンド」受益証券、「外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「D I A Mマネーマザーファンド」受益証券(以下、それぞれを「各マザーファンド」、または総称して「マザーファンド」ということがあります。)を主要投資対象とします。なお、有価証券指数等先物取引等、上場投資信託証券(ETF)、短期金融資産等に投資する場合があります。

< 投資態度 >

主として、マザーファンド受益証券への投資を通じて、日本を含む世界各国の株式、債券および不動産投資信託証券（リート）の8資産に実質的に分散投資を行います^(*)。マザーファンドのほか、有価証券指数等先物取引等、上場投資信託証券（ETF）、短期金融資産等^(**)に投資する場合もあります。

(*) 一部のマザーファンドへの投資配分比率がゼロとなる場合があります。

(**) 市場環境によっては、残存期間3年以下の債券に投資することがあります。

8資産への投資配分（戦略的資産配分比率）は、主として統計的手法の活用により、市場環境や運用環境等の短期的な状況変化に応じて、原則として月に1回、変更を行います。

現金等^(*)を活用し、基準価額の水準や市場環境等に応じて、8資産の合計資産比率^(**)を機動的に変更することで、資産価値上昇時には値上がり益の獲得をめざし、資産価値下落時には基準価額の下落を抑制することをめざします。

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

(**) 合計資産比率とは、「DIAMマネーマザーファンド」を除く8つのマザーファンドの投資比率の合計をいいます。

日次で下値サポートライン^(*)を設定し、基準価額の下落を下値サポートラインまでに抑えることをめざします。

(*) 基準価額が下値サポートラインを下回らないことを委託会社が保証等するものではありません。相場急落の場合などには、基準価額が下値サポートラインを下回る場合があります。また、下値サポートラインの水準は、委託会社の判断により変更する場合があります。

実質的な組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジは行いません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

運用プロセス

戦略的資産配分比率の決定

- 市場環境や運用環境等の短期的な状況変化に応じて、現金等を除く8資産への配分比率（戦略的資産配分比率）を原則として月次で決定します。
- 配分比率の決定は、主として統計的手法を活用して行います。

8資産の合計資産比率（推奨値）の決定

- 日次で下値サポートラインを設定し、各資産の上昇益を享受しつつ、基準価額が下値サポートラインを下回らないことを目標として、合計資産比率の推奨値を日次で決定します。
- 合計資産比率の推奨値は、基準価額と下値サポートラインの水準、市況などを基に決定します。

リバランスの実施

- 実際のファンドの合計資産比率と推奨値との乖離が一定以上になった場合等には、リバランスを実施します。

なお各資産への投資比率は、戦略的資産配分比率と合計資産比率を基に決定します。

(2) 【投資対象】

投資の対象とする資産の種類（約款第16条）

この信託において投資の対象とする資産の種類は次に掲げるものとします。

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

イ.有価証券

ロ.デリバティブ取引にかかる権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第22条、第23条および第24条に定めるものに限ります。)

ハ.金銭債権

ニ.約束手形

b.次に掲げる特定資産以外の資産

イ.為替手形

運用の指図範囲等(約款第17条第1項)

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

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

12. 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。)、新株予約権証券および新投資口予約権証券
13. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、上記1.~12.の証券または証書の性質を有するもの
14. 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものを行い、振替受益権を含みます。)
15. 投資証券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものを行います。)
16. 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものを行います。)
17. オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものを行い、有価証券にかかるものに限ります。)
18. 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものを行います。)
19. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
20. 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
21. 抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものを行います。)
22. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
23. 外国の者に対する権利で上記22.の有価証券の性質を有するもの

なお、1.の証券または証書、13.および18.の証券または証書のうち1.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、2.から7.までの証券ならびに13.および18.の証券または証書のうち2.から7.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、14.の証券および15.の証券を以下「投資信託証券」といいます。

運用の指図範囲等(約款第17条第2項)

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

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

(参考)当ファンドが投資対象とするマザーファンドの概要

ファンド名	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、NOMURA - B P I 総合に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主な投資対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	<p>1.主としてわが国の公社債に投資し、「NOMURA - B P I 総合」に連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>2.公社債(債券先物取引等を含みます。)の組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</p> <p>3.公社債の組入比率の調整には、債券先物取引等を活用する場合があります。</p> <p>NOMURA - B P I 総合の知的財産権その他一切の権利は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。</p>

運用プロセス

1.流動性基準等による対象銘柄群設定

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

2.最適化法によるポートフォリオの構築

1) 債券種別・格付けから発生するベンチマーク乖離要因

2) 金利の期間構造、スプレッドの期間構造から発生するベンチマーク乖離要因

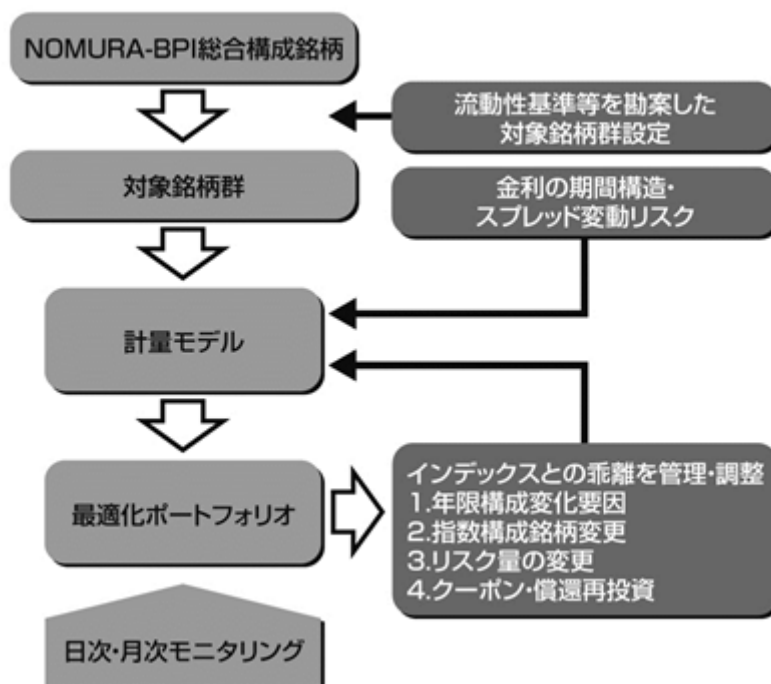
1)、2)が最小になると判断されるポートフォリオを構築します。

3.インデックスとの乖離を管理

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

インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。

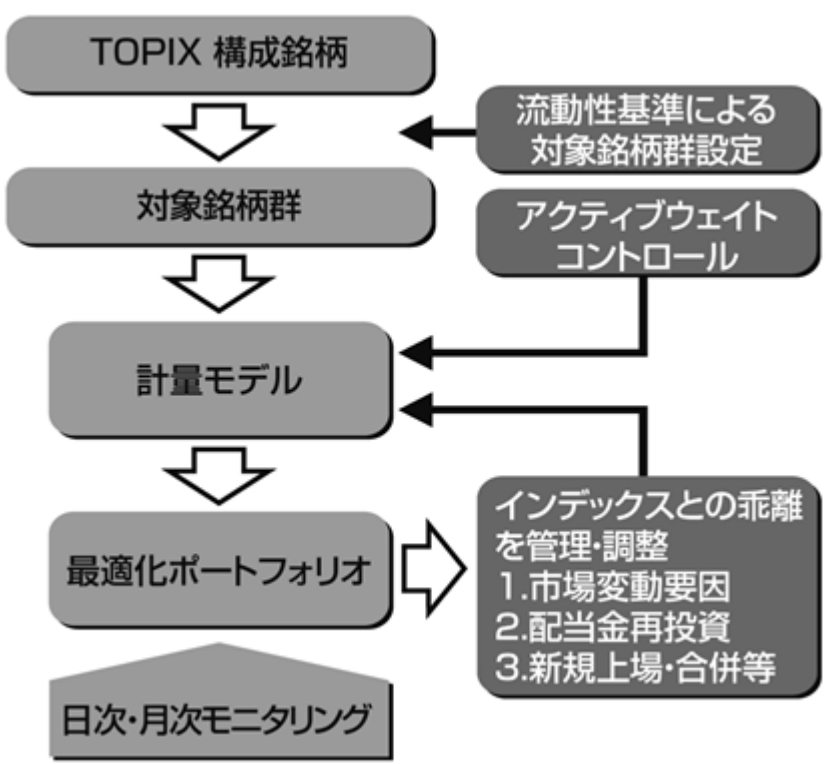
- ・ 年限構成変化要因 ・ 指数構成銘柄変更
- ・ リスク量の変更 ・ クーポン、償還再投資



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

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

投資態度	<ol style="list-style-type: none">1. 主として東京証券取引所第1部に上場されている株式に投資し、「東証株価指数(TOPIX)(配当込み)」に連動する投資成果をめざして運用を行います。2. 最適化法によるポートフォリオ構築を行い、運用コストの最小化と徹底したリスク管理を行います。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。 <div style="border: 1px solid black; padding: 5px;"><p>東証株価指数(TOPIX)の指数値およびTOPIXの商標は、株式会社東京証券取引所(以下「株東京証券取引所」といいます。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など東証株価指数(TOPIX)に関するすべての権利・ノウハウおよびTOPIXの商標に関するすべての権利は株東京証券取引所が有しています。</p><p>株東京証券取引所は、東証株価指数(TOPIX)の指数値の算出もしくは公表の方法の変更、東証株価指数(TOPIX)の指数値の算出もしくは公表の停止またはTOPIXの商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。</p><p>株東京証券取引所は、東証株価指数(TOPIX)の指数値およびTOPIXの商標の使用に関して得られる結果ならびに特定日の東証株価指数(TOPIX)の指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。</p><p>株東京証券取引所は、東証株価指数(TOPIX)の指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、株東京証券取引所は、東証株価指数(TOPIX)の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。</p><p>当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドは、株東京証券取引所により提供、保証または販売されるものではありません。</p><p>株東京証券取引所は、当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドの購入者または公衆に対し、当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を持ちません。</p><p>株東京証券取引所は、委託会社または当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドの購入者のニーズを、東証株価指数(TOPIX)の指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。</p><p>以上の項目に限らず、株東京証券取引所は当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドの発行または売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を負いません。</p></div>
------	---

運用プロセス	<p>1.流動性基準による対象銘柄群設定 マーケットインパクトの低減を図る為、TOPIX採用銘柄のうち、流動性が低い銘柄を除外して投資対象銘柄群を設定します。</p> <p>2.最適化法によるポートフォリオの構築 インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差（アクティブウェイト）を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。</p> <p>3.インデックスとの乖離を管理 日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。</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>1.株式への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>2.デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</p> <p>3.外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。</p> <p>4.一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>

ファンド名	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。
主な投資対象	海外の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	<p>1.主に日本を除く世界主要国の公社債に投資し、「FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）」に連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>2.外国債券への投資は原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</p> <p>3.外貨建資産については原則為替ヘッジは行いませんが、金利・為替状況によってはヘッジを実施する可能性があります。</p> <div style="border: 1px solid black; padding: 5px;"><p>FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。</p><p>このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。</p></div>

運用プロセス

1.流動性基準等による対象銘柄群設定

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

2.最適化法によるポートフォリオの構築

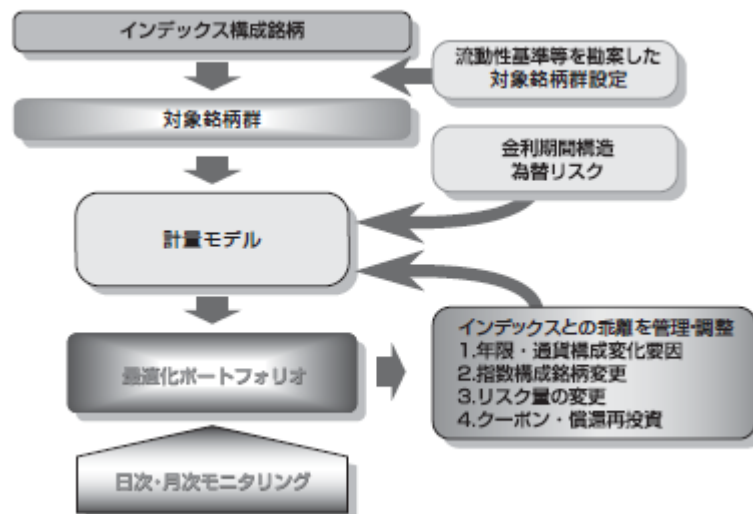
金利の期間構造、通貨エクスポージャーから発生するベンチマーク乖離要因が最小となるポートフォリオを構築します。

3.インデックスとの乖離を管理

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

インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。

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



主な投資制限	<p>1. 株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限り、株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>2. 同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>3. 同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>4. 外貨建資産への投資には、制限を設けません。</p> <p>5. デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます。)は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</p> <p>6. 外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。</p> <p>7. 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>
--------	---

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

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

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

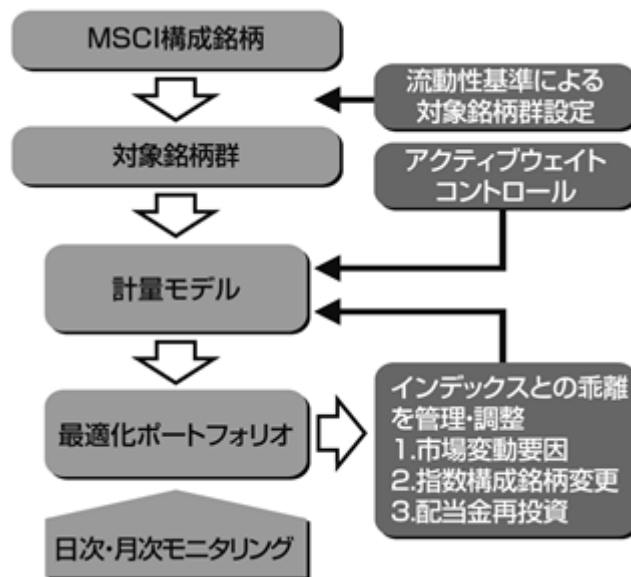
MSCIは、自らが信頼できると考える情報源からMSCI指数の計算に算入または使用するための情報を入手しますが、いかなるMSCI関係者も、MSCI指数またはそれに含まれるデータの独創性、正確性および/または完全性について保証するものではありません。いかなるMSCI関係者も、明示的か黙示的かを問わず、本ファンドの発行会社もしくは所有者、またはその他の者もしくは団体が、MSCI指数またはそれに含まれるデータを使用することにより得られる結果について保証を行いません。いかなるMSCI関係者も、MSCI指数またはそれに含まれるデータの、またはそれらに関連する過誤、脱漏または中断について責任を負いません。ま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

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

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

運用プロセス

- 1.流動性基準による対象銘柄群設定
 取引コスト、マーケットインパクトの低減を図る為、MSCIコクサイ・インデックス構成銘柄のうち、流動性が著しく低くかつ時価総額比率が小さい銘柄を除外して投資銘柄群を設定します。
- 2.最適化法によるポートフォリオの構築
 インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差(アクティブウェイト)を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。
- 3.インデックスとの乖離を管理
 日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理して、必要な場合は速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。
 インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。
 - ・市場変動に伴うもの：推定トラッキングエラーの増加に伴い実施
 - ・ベンチマーク構成銘柄の変更に伴うもの：四半期に一度の銘柄入替、コーポレートアクションおよび指数構築手法の変更に伴い実施
 - ・配当金再投資に伴うもの：キャッシュ比率の上昇に伴い実施



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

ファンド名	エマージング債券パッシブ・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、主として新興国の債券に投資し、JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス(円換算ベース・為替ヘッジなし)の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。
主な投資対象	新興国の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	<ol style="list-style-type: none"> 1. 主として新興国の債券に投資し、JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス(円換算ベース・為替ヘッジなし)の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。 2. 原則として、新興国の債券の組入比率は高位を維持します。 3. 組入債券は、当初組入時において、S&PもしくはMoody'sの外貨建て長期格付がBB-格もしくはBa3格以上を取得している債券とします。但し、両社が格付を付与している場合には、どちらか低い方の格付を基準とします。また、当ファンドが保有する債券の格付が上記基準未滿となった場合は、当該債券を速やかに売却するものとします。 4. 外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。 <div style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin-top: 10px;"> <p>JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラスに関する著作権等の知的財産その他一切の権利はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。</p> </div>

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

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

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

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

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

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

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

<p>ファンド名</p>	<p>J-REITインデックスファンド・マザーファンド</p>
<p>基本方針</p>	<p>この投資信託は、東証REIT指数(配当込み)の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。</p>
<p>主な投資対象</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(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>

投資態度

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

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

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

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

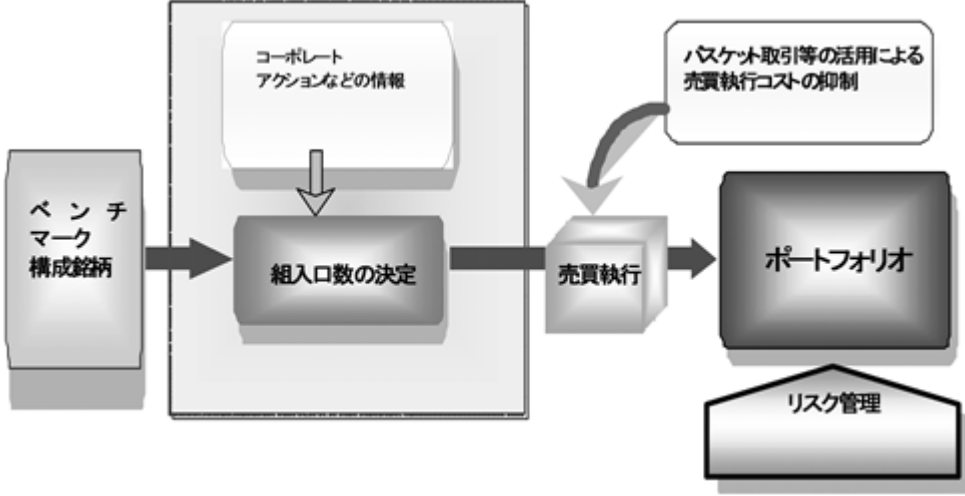
株東京証券取引所は、東証REIT指数の指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、株東京証券取引所は、東証REIT指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。

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

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

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

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

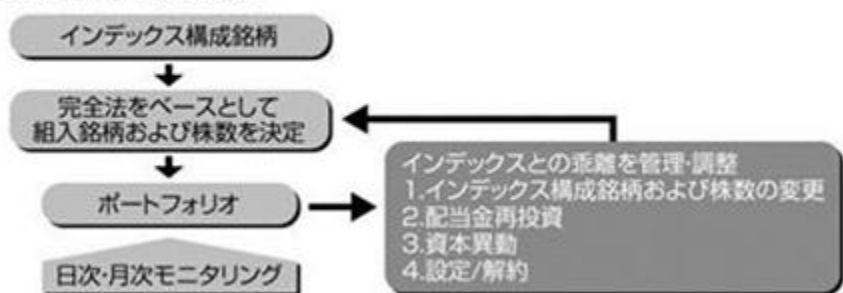
運用プロセス	<ul style="list-style-type: none"> ・原則としてベンチマーク構成全銘柄をその構成比率で保有します。ベンチマーク構成銘柄および採用予定銘柄を投資対象銘柄とします。 ・新規上場、公募増資、第三者割当等ベンチマーク構成の変更情報を事前に取得し、最適な執行方法によりリバランスを実施します。 ・配当金入金等によりキャッシュ比率が上昇した場合にもリバランスを実施します。 
主な投資制限	<p>投資信託証券への投資割合には制限を設けません。</p> <p>同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として信託財産の純資産総額の30%を超えないものとします。ただし、東証REIT指数採用の不動産投資信託証券の上場時価総額の合計額に占める同一銘柄の不動産投資信託証券の時価総額の割合が30%を超えている場合、当該同一銘柄の不動産投資信託証券への投資割合は、原則として当該同一銘柄の不動産投資信託証券の時価総額が東証REIT指数採用の不動産投資信託証券の上場時価総額の合計額に占める割合の範囲で投資することができるものとします。</p> <p>株式への投資は行いません。</p> <p>外貨建資産への投資は行いません。</p> <p>デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動および金利変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>
ファンド名	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、S & P 先進国 REIT インデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）に連動する投資成果をめざして運用を行います。

主な投資対象	<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>
--------	--

投資態度	<ol style="list-style-type: none">1.主に日本を除く世界各国の不動産投資信託証券を主要投資対象とし、S & P先進国REITインデックス(除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)に連動する投資成果をめざして運用を行います。2.不動産投資信託証券への投資割合は、原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。3.外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。ただし、金利・為替状況によってはヘッジを行う場合があります。
------	---

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

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

	<p>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>
運用プロセス	<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] C --> 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み入れることができるものとします。 5. デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます。)は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 6. 外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。 7. 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

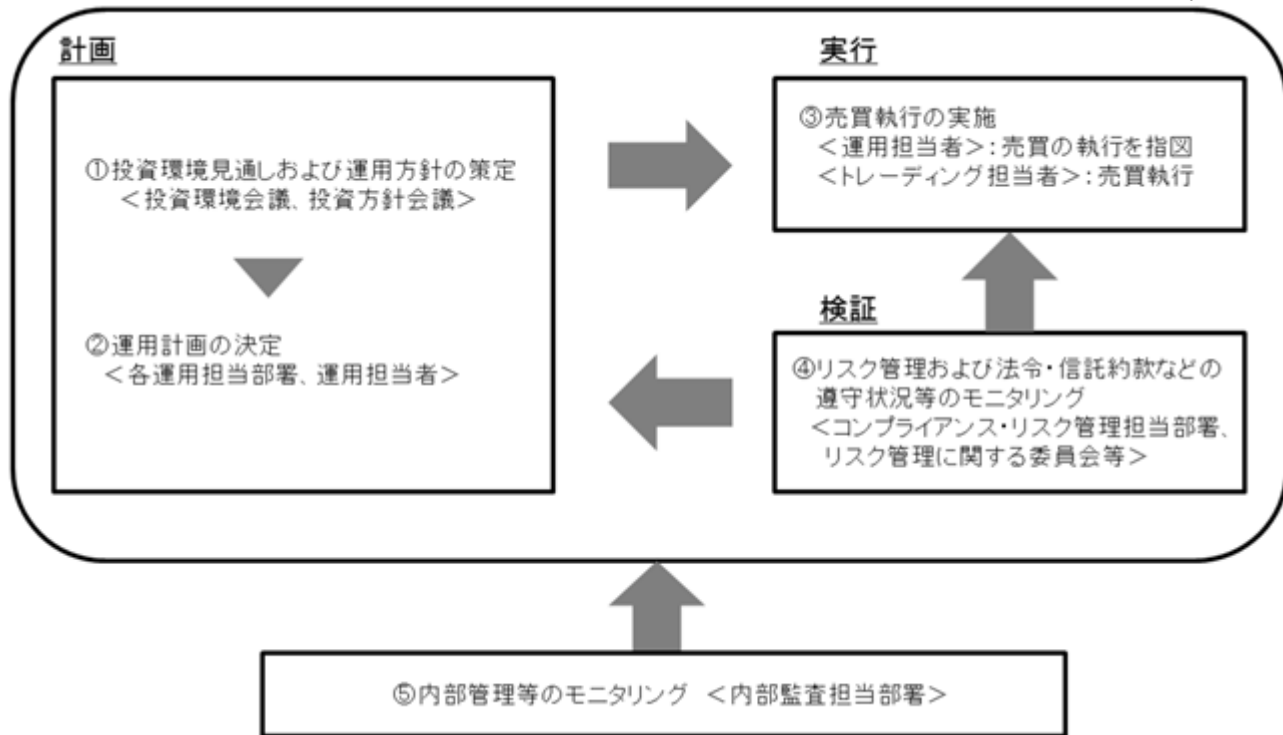
ファンド名	DIAMマネーマザーファンド
基本方針	この投資信託は、安定した収益の確保をめざします。
主な投資対象	国内発行体の公社債、転換社債、ユーロ円債、資産担保証券ならびにCD、CP、コールローン等の国内短期金融資産を主要投資対象とします。

投資態度	<p>国内の国債、政府保証債、政府機関債、地方債等のほか、取得時において主要格付機関^(*)の長期発行体格付(複数の格付機関が付与している場合は高い方の格付)がAA-格相当以上の社債、転換社債、ユーロ円債、資産担保証券、さらに、国内格付機関の短期格付がa-1格相当以上のCD、CPを主要投資対象とします。</p> <p>(*)主要格付機関とは、R&I、JCR、Moody's、S&Pとします。</p> <p>国債および政府保証債を除き、原則として、ファンドの元本総額に対する1発行体当たりの有価証券の額面総額の割合は5%以内とします。</p> <p>ポートフォリオ全体の修正デュレーションは1年未満を基本として運用します。</p>
運用プロセス	<p>マクロ経済分析を主体としたファンダメンタルズ分析、投資家の需給動向等分析および信用リスク市場の分析等に基づき、短期金利の方向性見通し、セクター別のクレジットスプレッドの拡縮等を予測し、ファンドのデュレーションおよびセクター配分を決定します(トップダウンアプローチ)。</p>
主な投資制限	<p>株式への投資割合は、純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の株式への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>新株引受権証券及び新株予約権証券への投資割合は、取得時において、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建て資産への投資は行いません。</p> <p>デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます。)は、価格変動および金利変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>

資金動向、市況動向等によっては、上記の運用ができない場合があります。

(3) 【運用体制】

a. ファンドの運用体制



投資環境見通しおよび運用方針の策定

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

運用計画の決定

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

売買執行の実施

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

モニタリング

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

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

内部管理等のモニタリング

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

b．ファンドの関係法人に関する管理

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

c．運用体制に関する社内規則

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

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

運用体制は2019年6月28日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

上記体制は、マザーファンドを通じた実質的な運用体制を記載しております。

（４）【分配方針】

収益分配方針

毎決算時（原則として毎年6月、12月の各2日（休業日の場合は翌営業日））に、原則として以下の方針に基づき収益分配を行います。

(1) 分配対象額の範囲

経費控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。

(2) 分配対象額についての分配方針

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

(3) 留保益の運用方針

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

収益の分配方式

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

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

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

収益分配金の支払い

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

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

(5) 【投資制限】

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

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

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

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

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

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

投資する株式等の範囲(約款第20条)

- 1) 委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとしてします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。

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

信用取引の指図範囲(約款第21条)

1)委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引き渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

2)上記1)の信用取引の指図は、次の1.~6.に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行うことができるものとし、かつ次の1.~6.に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。

- 1.信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
- 2.株式分割により取得する株券
- 3.有償増資により取得する株券
- 4.売出しにより取得する株券
- 5.信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権(転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限り、)の行使により取得可能な株券
- 6.信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権(5.に定めるものを除きます。)の行使により取得可能な株券

先物取引等の運用指図(約款第22条)

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

スワップ取引の運用指図(約款第23条)

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

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

金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図(約款第24条)

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

ドの信託財産にかかるヘッジ対象外貨建資産の時価総額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

- 7) 金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- 8) 委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供または受入れが必要と認めるときは、担保の提供または受入れの指図を行うものとします。

デリバティブ取引等にかかる投資制限(約款第25条)

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

有価証券の貸付の指図および範囲(約款第26条)

- 1) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の1.~2.の範囲内で貸付の指図をすることができます。
1. 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
 2. 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
- 2) 上記1) 1.~2.に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- 3) 委託会社は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受け入れの指図を行うものとします。

特別な場合の外貨建有価証券への投資制限(約款第27条)

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

外国為替予約取引の指図(約款第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、または為替変動リスクを回避するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。
- 2) 上記1)の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約とマザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約のうち信託財産に属するとみなした額との合計額と、信託財産にかかる売予約とマザーファンドの信託財産にかかる為替の売予約のうち信託財産に属するとみなした額との合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産(マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額を含みます。)の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- 3) 上記2)においてマザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産にかかる為替の売予約のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる為替の売予約の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

4)上記2)の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

資金の借入れ(約款第34条)

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

2)一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は、借入れ指図を行う日の信託財産の純資産総額の10%以内における、当該有価証券等の売却代金または解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。

3)収益分配金の再投資にかかる借入期間は信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。

4)借入金の利息は信託財産中より支弁します。

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

委託会社は、同一の法人の発行する株式について、委託会社が運用の指図を行う全ての委託者指図型投資信託につき、投資信託財産として有する当該株式の議決権(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、当該株式の議決権の総数に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、投資信託財産をもって当該株式を取得することを受託会社に指図してはなりません。

3【投資リスク】

<基準価額の主な変動要因>

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

また、投資信託は預貯金と異なります。

・資産配分リスク

資産配分比率が高い資産の価値が下落した場合等は、基準価額の下落要因となります。

当ファンドの実質資産配分において、収益率の悪い資産への配分比率が大きい場合、基準価額が下がる場合があります。

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

・株価変動リスク

投資する企業の株価の下落は、基準価額の下落要因となります。

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

金利の上昇は、基準価額の下落要因となります。

一般的に金利が上昇すると債券、リートの価格は下落します。当ファンドは、実質的に債券、リートに投資をしますので、金利変動により基準価額が上下します。

・リートの価格変動リスク

リートの価格の下落は、基準価額の下落要因となります。

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

為替相場の円高は、基準価額の下落要因となります。

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基準価額が下がる要因となります。

・信用リスク

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

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

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

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。

・カントリーリスク

投資する国・地域の政治・経済の不安定化等は、基準価額の下落要因となります。

当ファンドの実質的な投資対象国・地域における政治・経済情勢の変化等によっては、運用上の制約を受ける可能性があり、基準価額が下がる要因となります。

基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

<その他の留意点>

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

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

収益分配金に関する留意点として、以下の事項にご留意ください。

収益分配は、計算期間中に発生した運用収益(経費控除後の配当等収益および売買益(評価益を含みます。))を超えて行われる場合があります。したがって、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

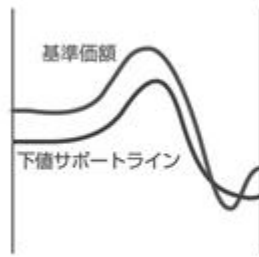
受益者の個別元本の状況によっては、分配金の全額または一部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。個別元本とは、追加型投資信託を保有する受益者毎の取得元本のこと、受益者毎に異なります。

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

当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行います。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、資金変動等が起こり、その結果、当該マザーファンドにおいて売買等が生じた場合等には、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。

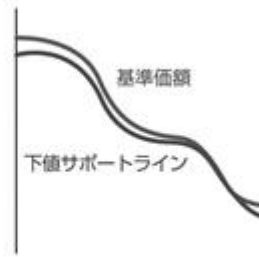
当ファンドは、日次で下値サポートラインを設定し、基準価額の下落を下値サポートラインまでに抑えることをめざします。ただし損失が常に一定範囲に限定されるわけではないことにご留意ください。

基準価額が下値サポートラインを割り込むケース



当ファンドは基準価額の下落を下値サポートラインまでに抑えることを目標としますが、相場急落の場合など市場環境等によっては、基準価額が下値サポートラインを割り込む可能性があります。

基準価額が長期的に下落するケース



市場下落傾向が長期的に継続する局面等には、基準価額が長期的に下落する可能性があります。

※下値サポートラインは、基準価額がこれを下回らないように目標とされる水準であり、基準価額が下値サポートラインを下回らないことを委託会社が保証等するものではありません。

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

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

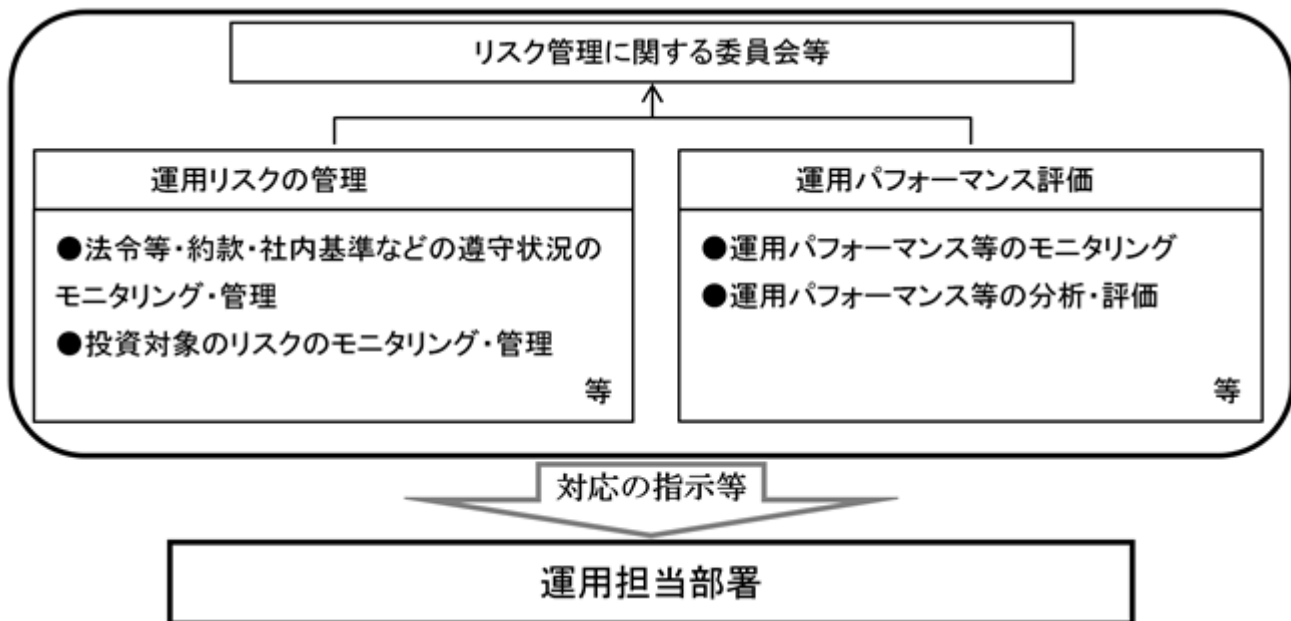
注意事項

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

< リスク管理体制 >

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

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



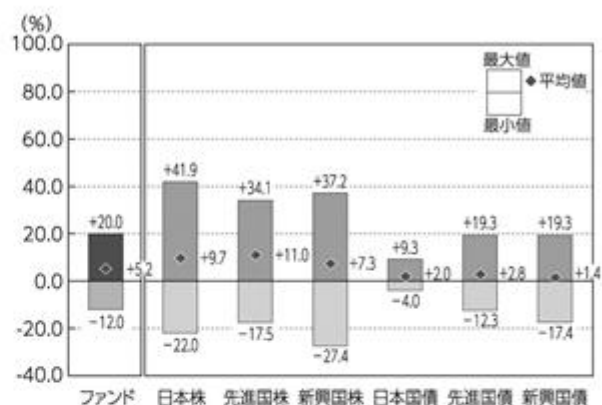
リスク管理体制は2019年6月28日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

＜参考情報＞

ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



ファンド：2017年2月～2019年6月

代表的な資産クラス：2014年7月～2019年6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(株東京証券取引所)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、株東京証券取引所が有しています。
- 「MSCIコクサイ・インデックス」は、MSCI Inc.が開発した株価指数で、日本を除く世界の主要先進国の株価指数を、各国の株式時価総額をベースに合成したものです。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
- 「MSCIエマージング・マーケット・インデックス」は、MSCI Inc.が開発した株価指数で、新興国の株価指数を、各国の株式時価総額をベースに合成したものです。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
- 「NOMURA-BPI国債」は、野村證券株式会社が国内で発行された公募利付国債の市場全体の動向を表すために開発した投資収益指数です。同指数の知的財産権その他一切の権利は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。
- 「FTSE世界国債インデックス(除く日本)」は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。
- 「JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイド」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】

お申込時に、お申込日の翌営業日の基準価額に、3.24%^{*}(税抜3.00%)を上限に各販売会社が定める手数料率を乗じて得た額とします。

*消費税率が10%になった場合は、3.3%となります。

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

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

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

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

(2)【換金(解約)手数料】

ありません。

(3)【信託報酬等】

ファンドの日々の純資産総額に対して年率1.782%^{*}(税抜1.65%)

*消費税率が10%になった場合は、年率1.815%となります。

支払先	内訳(税抜)	主な役務
委託会社	年率0.80%	信託財産の運用、目論見書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価
販売会社	年率0.80%	購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価
受託会社	年率0.05%	運用財産の保管・管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率

信託報酬は、毎日計上(ファンドの基準価額に反映)され、毎計算期末または信託終了のときに信託報酬にかかる消費税等相当額とともに信託財産から支払われます。

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

(4)【その他の手数料等】

1. 信託財産留保額

ありません。

2. その他の費用

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

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

監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用は、受益者の負担とし、毎日計上(ファンドの基準価額に反映)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、2019年6月末現在のものです。税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。

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

個別元本方式について

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

< 個別元本について >

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

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

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

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

< 収益分配金の課税について >

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

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

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

税法が改正された場合等は、上記内容が変更になることがあります。

5【運用状況】

(1)【投資状況】

令和1年6月28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	13,285,720	98.73
内 日本	13,285,720	98.73
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	170,318	1.27
純資産総額	13,456,038	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

令和1年6月28日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	250,639,299,430	97.70
内 日本	250,639,299,430	97.70
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	5,891,377,136	2.30
純資産総額	256,530,676,566	100.00

その他資産の投資状況

令和1年6月28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）	4,870,140,000	1.90
内 日本	4,870,140,000	1.90

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

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

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

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和1年6月28日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	229,393,400,400	80.57
内 日本	229,393,400,400	80.57
地方債証券	21,719,690,624	7.63
内 日本	21,719,690,624	7.63
特殊債券	18,061,030,705	6.34
内 日本	18,061,030,705	6.34
社債券	13,173,908,410	4.63
内 日本	12,767,388,410	4.48
内 フランス	406,520,000	0.14
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	2,363,869,812	0.83
純資産総額	284,711,899,951	100.00

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

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

J-REITインデックスファンド・マザーファンド

令和1年6月28日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
投資証券	32,774,858,560	97.29
内 日本	32,774,858,560	97.29
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	913,822,324	2.71
純資産総額	33,688,680,884	100.00

その他資産の投資状況

令和1年6月28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)	674,271,000	2.00
内 日本	674,271,000	2.00

(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。

(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。

DIAMマネーマザーファンド

令和1年6月28日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	12,426,744,000	76.87
内 日本	12,426,744,000	76.87
地方債証券	115,408,412	0.71
内 日本	115,408,412	0.71
特殊債券	66,827,680	0.41
内 日本	66,827,680	0.41
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	3,556,843,871	22.00
純資産総額	16,165,823,963	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。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和1年6月28日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	330,641,547,343	95.69
内 アメリカ	214,165,358,124	61.98
内 イギリス	20,564,389,820	5.95
内 カナダ	12,917,760,444	3.74
内 フランス	12,787,748,178	3.70
内 スイス	12,671,167,127	3.67
内 ドイツ	10,801,557,285	3.13
内 オーストラリア	8,182,828,531	2.37
内 アイルランド	6,114,149,804	1.77
内 オランダ	6,054,525,247	1.75
内 スペイン	3,720,977,814	1.08
内 香港	3,529,400,437	1.02
内 スウェーデン	3,100,696,455	0.90
内 イタリア	2,375,078,847	0.69
内 デンマーク	2,162,814,491	0.63
内 シンガポール	1,544,325,334	0.45
内 フィンランド	1,457,043,467	0.42
内 バミューダ	1,437,175,641	0.42
内 ベルギー	1,225,267,906	0.35
内 ジャージー	1,217,031,433	0.35
内 ケイマン諸島	869,250,338	0.25
内 ノルウェー	847,539,242	0.25
内 イスラエル	736,120,661	0.21
内 オランダ領キュラソー	476,884,671	0.14
内 ルクセンブルグ	371,894,953	0.11
内 ニュージーランド	306,195,121	0.09
内 オーストリア	285,822,200	0.08
内 リベリア	197,906,492	0.06
内 ポルトガル	182,361,419	0.05
内 パナマ	176,041,627	0.05
内 パプアニューギニア	57,325,898	0.02

	内 イギリス領バージン諸島	44,484,070	0.01
	内 マン島	43,327,855	0.01
	内 モーリシャス	17,096,411	0.00
投資信託受益証券		859,609,699	0.25
	内 オーストラリア	703,426,185	0.20
	内 シンガポール	156,183,514	0.05
投資証券		8,233,196,143	2.38
	内 アメリカ	7,347,567,137	2.13
	内 香港	232,841,392	0.07
	内 イギリス	198,163,154	0.06
	内 フランス	192,010,788	0.06
	内 オランダ	187,993,028	0.05
	内 カナダ	74,620,644	0.02
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		5,802,746,502	1.68
純資産総額		345,537,099,687	100.00

その他資産の投資状況

令和1年6月28日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引(買建)	927,400,050	0.27
-	927,400,050	0.27
為替予約取引(売建)	357,901,300	0.10
-	357,901,300	0.10
株価指数先物取引(買建)	5,242,812,801	1.52
内 アメリカ	3,680,613,508	1.07
内 ドイツ	899,887,483	0.26
内 イギリス	320,753,764	0.09
内 カナダ	192,019,905	0.06
内 オーストラリア	149,538,141	0.04

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

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

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

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

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和1年6月28日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	176,248,699,011	97.47
内 アメリカ	83,273,693,154	46.05
内 フランス	18,007,215,853	9.96
内 イタリア	15,434,797,694	8.54
内 ドイツ	11,705,430,071	6.47
内 イギリス	11,068,365,372	6.12
内 スペイン	10,282,664,534	5.69
内 ベルギー	4,629,745,590	2.56
内 カナダ	3,521,672,462	1.95
内 オランダ	3,475,896,909	1.92
内 オーストラリア	3,383,300,551	1.87
内 オーストリア	2,581,779,693	1.43
内 メキシコ	1,380,845,266	0.76
内 アイルランド	1,353,372,649	0.75
内 フィンランド	1,167,756,741	0.65
内 ポーランド	1,023,728,735	0.57
内 南アフリカ	1,015,390,400	0.56
内 デンマーク	804,056,744	0.44
内 マレーシア	738,542,455	0.41
内 シンガポール	650,448,218	0.36
内 ノルウェー	389,376,501	0.22
内 スウェーデン	360,619,419	0.20
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	4,568,527,799	2.53
純資産総額	180,817,226,810	100.00

その他資産の投資状況

令和1年6月28日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引(売建)	551,568,904	0.31
-	551,568,904	0.31

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

(注2) 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

令和1年6月28日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	5,100,809,390	10.97
内 オーストラリア	3,340,556,309	7.18
内 シンガポール	1,733,850,288	3.73
内 カナダ	26,402,793	0.06
投資証券	41,059,508,547	88.31
内 アメリカ	33,454,516,674	71.95
内 イギリス	2,185,894,204	4.70
内 香港	1,152,664,921	2.48
内 フランス	1,009,305,183	2.17
内 オランダ	886,108,022	1.91
内 カナダ	874,024,613	1.88
内 ベルギー	433,358,814	0.93
内 スペイン	321,172,369	0.69
内 ニュージーランド	229,229,422	0.49
内 ドイツ	127,236,626	0.27
内 アイルランド	120,785,200	0.26
内 シンガポール	113,981,457	0.25
内 ガーンジー	84,389,815	0.18
内 イスラエル	35,121,327	0.08
内 マン島	14,533,320	0.03
内 イタリア	11,345,672	0.02
内 韓国	5,840,908	0.01
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	333,666,647	0.72
純資産総額	46,493,984,584	100.00

その他資産の投資状況

令和1年6月28日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引（買建）	75,001,100	0.16
-	75,001,100	0.16

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

令和1年6月28日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	52,385,159,405	88.83
内 ケイマン諸島	8,682,944,889	14.72
内 韓国	6,592,317,060	11.18
内 中国	5,919,811,303	10.04
内 台湾	5,717,401,363	9.69
内 インド	4,841,059,312	8.21
内 ブラジル	4,072,956,695	6.91
内 南アフリカ	3,091,847,997	5.24
内 ロシア	2,091,711,572	3.55

内 香港	1,786,381,909	3.03
内 タイ	1,589,012,759	2.69
内 インドネシア	1,133,208,946	1.92
内 マレーシア	1,127,314,737	1.91
内 メキシコ	1,075,293,677	1.82
内 フィリピン	601,917,529	1.02
内 ポーランド	594,483,298	1.01
内 バミューダ	552,366,750	0.94
内 カタール	519,924,626	0.88
内 チリ	493,316,872	0.84
内 アラブ首長国連邦	369,884,226	0.63
内 トルコ	263,520,725	0.45
内 コロンビア	230,930,119	0.39
内 アメリカ	194,275,583	0.33
内 ギリシャ	163,370,384	0.28
内 ハンガリー	152,822,186	0.26
内 アルゼンチン	149,381,259	0.25
内 チェコ	81,858,302	0.14
内 エジプト	68,458,642	0.12
内 ルクセンブルグ	50,594,936	0.09
内 オランダ	46,158,600	0.08
内 ペルー	35,213,003	0.06
内 ジャージー	32,170,877	0.05
内 マン島	28,249,884	0.05
内 シンガポール	19,675,365	0.03
内 パキスタン	15,324,020	0.03
新株予約権証券	498,287	0.00
内 タイ	498,287	0.00
投資信託受益証券	996,732,522	1.69
内 アイルランド	752,989,406	1.28
内 メキシコ	243,743,116	0.41
投資証券	36,871,561	0.06
内 メキシコ	36,871,561	0.06
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	5,553,967,299	9.42
純資産総額	58,973,229,074	100.00

その他資産の投資状況

令和1年6月28日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引(買建)	158,252,986	0.27
-	158,252,986	0.27
為替予約取引(売建)	221,698,403	0.38
-	221,698,403	0.38
株価指数先物取引(買建)	5,287,729,532	8.97
内 アメリカ	5,287,729,532	8.97

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

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

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

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

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

令和1年6月28日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	94,213,479,089	95.96
内 メキシコ	14,501,321,228	14.77
内 インドネシア	11,776,324,919	11.99
内 ブラジル	10,875,333,213	11.08
内 ロシア	10,782,832,362	10.98
内 コロンビア	9,932,947,123	10.12
内 フィリピン	9,392,399,457	9.57
内 南アフリカ	6,062,224,284	6.17
内 ハンガリー	4,831,166,770	4.92
内 パナマ	4,770,266,389	4.86
内 ルーマニア	4,480,606,202	4.56
内 ペルー	4,161,092,821	4.24
内 クロアチア	2,646,964,321	2.70
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	3,970,792,518	4.04
純資産総額	98,184,271,607	100.00

その他資産の投資状況

令和1年6月28日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引(売建)	10,020,750,000	10.21
-	10,020,750,000	10.21

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

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

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

(2) 【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

令和1年6月28日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	外国株式パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	1,459,114	3.4273 5,000,888	3.6077 5,264,045	- -	39.12%
2	国内債券パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	1,742,663	1.3219 2,303,733	1.3263 2,311,293	- -	17.18%
3	国内株式パッシブ・ファン ド(最適化法)・マザーファン ド 日本	親投資信託受 益証券	546,021	2.3478 1,281,977	2.4269 1,325,138	- -	9.85%
4	エマージング債券パッシブ・ マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	512,806	1.8939 971,204	1.9439 996,843	- -	7.41%
5	J-REITインデックス ファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	462,781	2.0721 958,953	2.1175 979,938	- -	7.28%
6	外国リート・パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	758,378	1.2749 966,902	1.2817 972,013	- -	7.22%
7	外国債券パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	363,905	1.8203 662,433	1.8486 672,714	- -	5.00%
8	エマージング株式パッシブ・ マザーファンド 日本	親投資信託受 益証券	580,633	1.0842 629,568	1.1437 664,069	- -	4.94%
9	DIAMマネーマザーファン ド 日本	親投資信託受 益証券	98,710	1.0095 99,657	1.0097 99,667	- -	0.74%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

令和1年6月28日現在

種類	投資比率
親投資信託受益証券	98.73%
合計	98.73%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

(参考)

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

令和1年6月28日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	1,256,100	6,571.87 8,254,935,451	6,688.00 8,400,796,800	- -	3.27%
2	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	924,600	4,985.02 4,609,154,265	5,165.00 4,775,559,000	- -	1.86%
3	ソニー 日本	株式 電気機器	756,400	4,726.32 3,574,992,768	5,648.00 4,272,147,200	- -	1.67%
4	三菱UFJフィナンシャル・ グループ 日本	株式 銀行業	7,652,400	576.47 4,411,396,259	512.00 3,918,028,800	- -	1.53%
5	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	756,500	4,641.89 3,511,591,636	5,017.00 3,795,360,500	- -	1.48%
6	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	984,100	4,456.51 4,385,658,368	3,823.00 3,762,214,300	- -	1.47%
7	キーエンス 日本	株式 電気機器	55,300	62,257.85 3,442,859,290	66,130.00 3,656,989,000	- -	1.43%
8	三井住友フィナンシャルグ ループ 日本	株式 銀行業	783,600	3,925.23 3,075,810,283	3,806.00 2,982,381,600	- -	1.16%
9	リクルートホールディングス 日本	株式 サービス業	771,700	2,928.37 2,259,825,114	3,594.00 2,773,489,800	- -	1.08%
10	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	950,800	2,994.94 2,847,596,276	2,785.00 2,647,978,000	- -	1.03%
11	任天堂 日本	株式 その他製品	64,400	29,521.90 1,901,210,570	39,490.00 2,543,156,000	- -	0.99%
12	KDDI 日本	株式 情報・通信業	906,700	2,661.60 2,413,277,170	2,743.50 2,487,531,450	- -	0.97%
13	みずほフィナンシャルグ ループ 日本	株式 銀行業	15,104,200	172.97 2,612,632,958	156.10 2,357,765,620	- -	0.92%
14	花王 日本	株式 化学	273,600	8,061.13 2,205,527,436	8,210.00 2,246,256,000	- -	0.88%
15	三菱商事 日本	株式 卸売業	779,000	3,149.25 2,453,266,225	2,840.00 2,212,360,000	- -	0.86%
16	東海旅客鉄道 日本	株式 陸運業	100,900	23,606.51 2,381,897,790	21,580.00 2,177,422,000	- -	0.85%
17	ダイキン工業 日本	株式 機械	153,800	11,793.76 1,813,881,784	14,065.00 2,163,197,000	- -	0.84%
18	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	397,500	5,344.46 2,124,424,060	5,399.00 2,146,102,500	- -	0.84%
19	ファナック 日本	株式 電気機器	107,100	18,790.96 2,012,512,144	19,930.00 2,134,503,000	- -	0.83%
20	東日本旅客鉄道 日本	株式 陸運業	200,400	10,163.95 2,036,856,900	10,080.00 2,020,032,000	- -	0.79%

21	日立製作所 日本	株式 電気機器	507,500	3,506.87 1,779,741,563	3,949.00 2,004,117,500	- -	0.78%
22	日本電産 日本	株式 電気機器	135,600	13,159.05 1,784,368,330	14,725.00 1,996,710,000	- -	0.78%
23	信越化学工業 日本	株式 化学	194,500	9,241.43 1,797,460,040	10,035.00 1,951,807,500	- -	0.76%
24	キヤノン 日本	株式 電気機器	606,700	3,182.70 1,930,949,530	3,146.00 1,908,678,200	- -	0.74%
25	HOYA 日本	株式 精密機器	226,900	6,612.40 1,500,354,480	8,254.00 1,872,832,600	- -	0.73%
26	資生堂 日本	株式 化学	224,000	7,215.42 1,616,254,534	8,121.00 1,819,104,000	- -	0.71%
27	第一三共 日本	株式 医薬品	322,600	3,642.59 1,175,101,453	5,635.00 1,817,851,000	- -	0.71%
28	NTTドコモ 日本	株式 情報・通信業	700,100	2,553.48 1,787,691,942	2,512.50 1,759,001,250	- -	0.69%
29	村田製作所 日本	株式 電気機器	354,800	5,773.26 2,048,354,560	4,840.00 1,717,232,000	- -	0.67%
30	セブン&アイ・ホールディングス 日本	株式 小売業	465,300	4,744.22 2,207,486,666	3,648.00 1,697,414,400	- -	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

令和1年6月28日現在

種類	投資比率
株式	97.70%
合計	97.70%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

令和1年6月28日現在

業種	国内/外国	投資比率
電気機器	国内	13.28%
情報・通信業		8.70%
輸送用機器		7.66%
化学		7.23%
銀行業		5.72%
医薬品		5.37%
サービス業		5.16%
機械		5.06%
卸売業		4.84%
陸運業		4.62%
小売業		4.44%
食料品		4.02%
建設業		2.74%
不動産業		2.37%
保険業		2.24%
その他製品		2.11%
精密機器		2.08%
電気・ガス業		1.63%
その他金融業		1.10%
鉄鋼		0.89%
ガラス・土石製品		0.84%
ゴム製品		0.76%
非鉄金属		0.76%
証券、商品先物取引業		0.74%
繊維製品		0.64%
石油・石炭製品		0.61%
金属製品		0.54%
空運業		0.53%
パルプ・紙		0.28%
鉱業		0.27%
倉庫・運輸関連業		0.19%
海運業	0.16%	
水産・農林業	0.11%	
合計		97.70%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和1年6月28日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	350回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,800,000,000	101.55 2,843,405,000	102.79 2,878,344,000	0.100000 2028/3/20	1.01%
2	342回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,730,000,000	101.88 2,781,476,000	102.46 2,797,185,300	0.100000 2026/3/20	0.98%
3	341回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,560,000,000	103.19 2,641,741,000	103.68 2,654,336,000	0.300000 2025/12/20	0.93%
4	332回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,460,000,000	103.76 2,552,496,000	103.89 2,555,694,000	0.600000 2023/12/20	0.90%
5	343回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,480,000,000	101.92 2,527,644,000	102.55 2,543,364,000	0.100000 2026/6/20	0.89%
6	126回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	2,500,000,000	100.50 2,512,700,000	100.46 2,511,600,000	0.100000 2020/12/20	0.88%
7	346回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,370,000,000	101.88 2,414,556,000	102.79 2,436,217,800	0.100000 2027/3/20	0.86%
8	349回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,360,000,000	101.64 2,398,744,800	102.85 2,427,283,600	0.100000 2027/12/20	0.85%
9	340回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,300,000,000	103.74 2,386,136,000	104.17 2,395,979,000	0.400000 2025/9/20	0.84%
10	329回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,270,000,000	104.22 2,365,794,000	104.21 2,365,567,000	0.800000 2023/6/20	0.83%
11	347回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,300,000,000	101.85 2,342,697,000	102.84 2,365,458,000	0.100000 2027/6/20	0.83%
12	344回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,280,000,000	101.91 2,323,666,000	102.64 2,340,397,200	0.100000 2026/9/20	0.82%
13	339回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,240,000,000	103.60 2,320,827,000	104.00 2,329,644,800	0.400000 2025/6/20	0.82%
14	348回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,230,000,000	101.73 2,268,645,900	102.85 2,293,577,300	0.100000 2027/9/20	0.81%
15	334回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,170,000,000	104.10 2,259,155,000	104.33 2,263,961,000	0.600000 2024/6/20	0.80%

16	328回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,190,000,000	103.15 2,258,985,000	103.15 2,259,006,900	0.600000 2023/3/20	0.79%
17	312回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,200,000,000	102.53 2,255,726,000	102.08 2,245,936,000	1.200000 2020/12/20	0.79%
18	345回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,160,000,000	101.90 2,201,049,000	102.74 2,219,227,200	0.100000 2026/12/20	0.78%
19	128回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	2,200,000,000	100.63 2,213,948,000	100.63 2,213,926,000	0.100000 2021/6/20	0.78%
20	333回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,100,000,000	103.96 2,183,196,000	104.10 2,186,247,000	0.600000 2024/3/20	0.77%
21	325回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,100,000,000	103.48 2,173,218,000	103.34 2,170,203,000	0.800000 2022/9/20	0.76%
22	351回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,110,000,000	101.40 2,139,626,800	102.74 2,167,814,000	0.100000 2028/6/20	0.76%
23	338回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,080,000,000	103.41 2,150,970,000	103.83 2,159,664,000	0.400000 2025/3/20	0.76%
24	129回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	2,120,000,000	100.70 2,134,850,500	100.72 2,135,370,000	0.100000 2021/9/20	0.75%
25	335回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,050,000,000	103.76 2,127,081,000	104.02 2,132,471,500	0.500000 2024/9/20	0.75%
26	135回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	2,100,000,000	101.11 2,123,352,000	101.29 2,127,174,000	0.100000 2023/3/20	0.75%
27	134回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	2,080,000,000	101.01 2,101,028,000	101.19 2,104,752,000	0.100000 2022/12/20	0.74%
28	353回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,000,000,000	101.40 2,028,064,000	102.64 2,052,960,000	0.100000 2028/12/20	0.72%
29	131回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	2,020,000,000	100.83 2,036,927,600	100.90 2,038,220,400	0.100000 2022/3/20	0.72%
30	352回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	1,970,000,000	101.25 1,994,625,000	102.67 2,022,658,100	0.100000 2028/9/20	0.71%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

令和1年6月28日現在

種類	投資比率
国債証券	80.57%
地方債証券	7.63%
特殊債券	6.34%
社債券	4.63%
合計	99.17%

(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。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

J-REITインデックスファンド・マザーファンド

令和1年6月28日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	日本ビルファンド投資法人 日本	投資証券	3,272	753,114.84 2,464,191,758	738,000.00 2,414,736,000	- -	7.17%
2	ジャパンリアルエステイト投資法人 日本	投資証券	3,379	656,104.00 2,216,975,427	656,000.00 2,216,624,000	- -	6.58%
3	野村不動産マスターファンド投資法人 日本	投資証券	10,512	166,276.23 1,747,895,762	165,700.00 1,741,838,400	- -	5.17%
4	日本リテールファンド投資法人 日本	投資証券	6,385	217,015.40 1,385,643,392	218,000.00 1,391,930,000	- -	4.13%
5	ユナイテッド・アーバン投資法人 日本	投資証券	7,586	177,212.78 1,344,336,183	180,600.00 1,370,031,600	- -	4.07%
6	オリックス不動産投資法人 日本	投資証券	6,732	195,443.87 1,315,728,189	196,600.00 1,323,511,200	- -	3.93%
7	日本プロロジスリート投資法人 日本	投資証券	4,854	231,479.77 1,123,602,810	248,900.00 1,208,160,600	- -	3.59%
8	大和ハウスリート投資法人 日本	投資証券	4,533	256,508.48 1,162,752,940	260,100.00 1,179,033,300	- -	3.50%
9	アドバンス・レジデンス投資法人 日本	投資証券	3,293	313,077.94 1,030,965,674	320,500.00 1,055,406,500	- -	3.13%
10	GLP投資法人 日本	投資証券	8,372	117,972.54 987,666,110	122,800.00 1,028,081,600	- -	3.05%
11	日本プライムリアルティ投資法人 日本	投資証券	2,139	464,829.98 994,271,338	467,000.00 998,913,000	- -	2.97%
12	ジャパン・ホテル・リート投資法人 日本	投資証券	10,875	87,392.85 950,397,337	86,800.00 943,950,000	- -	2.80%

13	アクティビア・プロパティーズ投資法人 日本	投資証券	1,775	471,478.33 836,874,045	469,000.00 832,475,000	- -	2.47%
14	ケネディクス・オフィス投資法人 日本	投資証券	1,045	745,487.56 779,034,508	771,000.00 805,695,000	- -	2.39%
15	積水ハウス・リート投資法人 日本	投資証券	9,879	78,019.41 770,753,783	80,600.00 796,247,400	- -	2.36%
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	1,123	579,364.75 650,626,615	604,000.00 678,292,000	- -	2.01%
17	インヴィンシブル投資法人 日本	投資証券	11,656	58,607.54 683,129,505	55,800.00 650,404,800	- -	1.93%
18	大和証券オフィス投資法人 日本	投資証券	780	748,647.04 583,944,694	773,000.00 602,940,000	- -	1.79%
19	森ヒルズリート投資法人 日本	投資証券	3,875	151,620.00 587,527,526	152,600.00 591,325,000	- -	1.76%
20	産業ファンド投資法人 日本	投資証券	4,146	129,089.01 535,203,072	134,000.00 555,564,000	- -	1.65%
21	日本ロジスティクスファンド投資法人 日本	投資証券	2,207	244,760.72 540,186,922	246,700.00 544,466,900	- -	1.62%
22	フロンティア不動産投資法人 日本	投資証券	1,149	466,126.29 535,579,109	460,000.00 528,540,000	- -	1.57%
23	ヒューリックリート投資法人 日本	投資証券	2,731	181,386.58 495,366,750	187,100.00 510,970,100	- -	1.52%
24	イオンリート投資法人 日本	投資証券	3,468	133,668.14 463,561,129	138,000.00 478,584,000	- -	1.42%
25	ジャパンエクセレント投資法人 日本	投資証券	3,025	159,253.75 481,742,594	158,200.00 478,555,000	- -	1.42%
26	日本リート投資法人 日本	投資証券	1,091	420,105.26 458,334,839	419,000.00 457,129,000	- -	1.36%
27	プレミア投資法人 日本	投資証券	3,212	136,559.52 438,629,179	141,800.00 455,461,600	- -	1.35%
28	コンフォリア・レジデンシャル投資法人 日本	投資証券	1,401	295,212.99 413,593,403	309,500.00 433,609,500	- -	1.29%
29	東急リアル・エステート投資法人 日本	投資証券	2,265	182,783.37 414,004,341	187,200.00 424,008,000	- -	1.26%
30	森トラスト総合リート投資法人 日本	投資証券	2,415	174,021.80 420,262,661	175,200.00 423,108,000	- -	1.26%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

令和1年6月28日現在

種類	投資比率
投資証券	97.29%
合計	97.29%

(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。

DIAMマネーマザーファンド

令和1年6月28日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	123回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	12,000,000,000	100.24 12,029,040,000	100.21 12,025,440,000	0.100000 2020/3/20	74.39%
2	391回 利付国庫債券 (2年) 日本	国債証券	200,000,000	100.33 200,672,000	100.33 200,674,000	0.100000 2020/8/1	1.24%
3	392回 利付国庫債券 (2年) 日本	国債証券	100,000,000	100.35 100,357,000	100.36 100,363,000	0.100000 2020/9/1	0.62%
4	388回 利付国庫債券 (2年) 日本	国債証券	100,000,000	100.28 100,281,000	100.26 100,267,000	0.100000 2020/5/15	0.62%
5	21年度35回 兵庫県公 募公債 日本	地方債証 券	40,000,000	101.14 40,457,200	100.82 40,329,200	1.460000 2020/1/22	0.25%
6	112回政保日本高速道路 保有・債務返済機構 日本	特殊債券	30,000,000	101.51 30,455,700	101.24 30,373,500	1.100000 2020/7/31	0.19%
7	27年度2回 千葉県公募 公債 日本	地方債証 券	14,670,000	100.18 14,697,726	100.14 14,690,978	0.177000 2020/5/25	0.09%
8	27年度 京都府京都みら い債 日本	地方債証 券	13,800,000	99.72 13,762,050	99.81 13,774,608	0.100000 2020/9/2	0.09%
9	43回 川崎市公募公債 5年 日本	地方債証 券	10,850,000	100.12 10,863,128	100.08 10,859,548	0.137000 2020/3/19	0.07%
10	331回 大阪府公募公債 日本	地方債証 券	10,000,000	100.78 10,078,200	100.47 10,047,000	1.410000 2019/10/29	0.06%
11	21年度6回 愛知県公募 公債 日本	地方債証 券	10,000,000	100.45 10,045,500	100.12 10,012,400	1.440000 2019/7/30	0.06%
12	26年度 京都府京都みら い債 日本	地方債証 券	9,200,000	99.94 9,194,848	99.96 9,197,148	0.160000 2019/9/2	0.06%

13	100回政保日本高速道路 保有・債務返済機構 日本	特殊債券	9,000,000	101.30 9,117,630	100.96 9,087,210	1.400000 2020/2/28	0.06%
14	93回政保日本高速道路保 有・債務返済機構 日本	特殊債券	8,000,000	100.94 8,075,600	100.60 8,048,720	1.400000 2019/11/29	0.05%
15	26年度7回 福岡県公募 公債 日本	地方債証 券	6,500,000	99.92 6,495,255	99.96 6,497,530	0.200000 2019/12/25	0.04%
16	117回政保日本高速道路 保有・債務返済機構 日本	特殊債券	6,000,000	101.56 6,093,780	101.31 6,078,960	1.000000 2020/9/30	0.04%
17	133回政保日本高速道路 保有・債務返済機構 日本	特殊債券	5,000,000	102.79 5,139,500	102.49 5,124,650	1.300000 2021/4/30	0.03%
18	137回政保日本高速道路 保有・債務返済機構 日本	特殊債券	4,000,000	102.78 4,111,440	102.52 4,100,800	1.200000 2021/6/30	0.03%
19	89回政保日本高速道路保 有・債務返済機構 日本	特殊債券	4,000,000	100.65 4,026,320	100.34 4,013,840	1.300000 2019/9/30	0.02%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

令和1年6月28日現在

種類	投資比率
国債証券	76.87%
地方債証券	0.71%
特殊債券	0.41%
合計	78.00%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和1年6月28日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフトウェア	608,268	11,577.23 7,042,061,176	14,460.02 8,795,572,615	- -	2.55%
2	APPLE INC アメリカ	株式 コンピュータ・周辺機器	393,335	18,424.11 7,246,851,108	21,529.97 8,468,492,559	- -	2.45%
3	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 インターネット販売・通信販売	34,818	175,592.93 6,113,794,731	205,262.34 7,146,824,195	- -	2.07%
4	FACEBOOK INC アメリカ	株式 インタラクティブ・メディアおよびサービス	198,873	17,709.57 3,521,956,840	20,426.20 4,062,220,666	- -	1.18%
5	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	222,406	14,472.91 3,218,863,947	15,164.97 3,372,781,452	- -	0.98%
6	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	273,080	11,047.37 3,016,816,628	11,731.86 3,203,737,311	- -	0.93%
7	ALPHABET INC-CL C アメリカ	株式 インタラクティブ・メディアおよびサービス	26,469	120,894.67 3,199,961,223	115,983.11 3,069,957,147	- -	0.89%
8	ALPHABET INC-CL A アメリカ	株式 インタラクティブ・メディアおよびサービス	24,910	121,727.62 3,032,235,018	116,049.94 2,890,804,197	- -	0.84%
9	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 石油・ガス・消耗燃料	353,222	8,209.47 2,899,766,803	8,172.63 2,886,755,468	- -	0.84%
10	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	256,413	9,761.35 2,502,939,132	11,106.85 2,847,941,241	- -	0.82%
11	VISA INC アメリカ	株式 情報技術サービス	146,074	15,477.47 2,260,856,629	18,456.88 2,696,070,537	- -	0.78%
12	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 各種金融サービス	108,793	21,843.77 2,376,449,868	22,853.63 2,486,315,599	- -	0.72%
13	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品	208,854	10,632.25 2,220,588,758	11,833.18 2,471,408,270	- -	0.72%
14	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 銀行	764,110	3,059.30 2,337,647,913	3,040.75 2,323,471,990	- -	0.67%
15	THE WALT DISNEY CO アメリカ	株式 娯楽	149,922	12,042.68 1,805,462,791	15,015.14 2,251,100,868	- -	0.65%

16	CISCO SYSTEMS INC アメリカ	株式 通信機器	367,113	5,221.55 1,916,902,389	6,007.13 2,205,297,975	- -	0.64%
17	PFIZER INC アメリカ	株式 医薬品	463,018	4,523.51 2,094,468,955	4,681.31 2,167,535,284	- -	0.63%
18	AT&T INC アメリカ	株式 各種電気通信 サービス	607,366	3,219.30 1,955,294,676	3,554.91 2,159,134,017	- -	0.62%
19	MASTERCARD INC アメリカ	株式 情報技術サー ビス	76,152	23,766.35 1,809,855,443	28,143.96 2,143,219,527	- -	0.62%
20	VERIZON COMM INC アメリカ	株式 各種電気通信 サービス	344,610	5,839.19 2,012,244,455	6,170.97 2,126,580,556	- -	0.62%
21	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	80,026	28,530.18 2,283,156,546	26,552.98 2,124,929,465	- -	0.61%
22	CHEVRON CORP アメリカ	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	158,417	12,736.27 2,017,642,409	13,270.02 2,102,197,851	- -	0.61%
23	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 専門小売り	94,099	20,243.07 1,904,853,505	22,314.68 2,099,789,619	- -	0.61%
24	MERCK & CO. INC. アメリカ	株式 医薬品	215,276	8,510.03 1,832,005,983	9,036.03 1,945,241,621	- -	0.56%
25	INTEL CORP アメリカ	株式 半導体・半導 体製造装置	375,086	5,467.52 2,050,791,541	5,115.71 1,918,832,476	- -	0.56%
26	COCA-COLA CO/THE アメリカ	株式 飲料	339,634	4,922.49 1,671,847,415	5,505.91 1,869,995,323	- -	0.54%
27	WELLS FARGO & CO アメリカ	株式 銀行	360,286	5,225.09 1,882,529,596	4,989.59 1,797,682,701	- -	0.52%
28	NOVARTIS AG-REG SHS スイス	株式 医薬品	181,016	8,682.42 1,571,657,418	9,853.24 1,783,594,906	- -	0.52%
29	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN スイス	株式 医薬品	58,743	29,884.07 1,755,480,371	30,213.59 1,774,837,357	- -	0.51%
30	BOEING CO アメリカ	株式 航空宇宙・防 衛	44,742	44,029.49 1,969,967,789	39,237.71 1,755,573,880	- -	0.51%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

令和1年6月28日現在

種類	投資比率
株式	95.69%
投資信託受益証券	0.25%
投資証券	2.38%
合計	98.32%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

令和1年6月28日現在

業種	国内/外国	投資比率
銀行	外国	7.69%
石油・ガス・消耗燃料		5.63%
医薬品		5.42%
ソフトウェア		5.32%
情報技術サービス		4.15%
保険		3.95%
インタラクティブ・メディアおよびサービス		3.09%
半導体・半導体製造装置		2.83%
資本市場		2.74%
コンピュータ・周辺機器		2.73%
ヘルスケア機器・用品		2.73%
インターネット販売・通信販売		2.59%
化学		2.30%
航空宇宙・防衛		2.30%
各種電気通信サービス		2.07%
飲料		2.04%
電力		2.00%
食品		1.99%
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス		1.88%
ホテル・レストラン・レジャー		1.87%
バイオテクノロジー		1.76%
専門小売り		1.64%
機械		1.61%
金属・鉱業		1.48%
繊維・アパレル・贅沢品		1.47%
食品・生活必需品小売り		1.47%
娯楽		1.44%
コングロマリット		1.35%
家庭用品		1.35%
メディア		1.27%
陸運・鉄道		1.08%
総合公益事業		1.06%
各種金融サービス		0.96%
通信機器		0.95%
タバコ		0.84%
ライフサイエンス・ツール/サービス		0.80%
自動車		0.80%
専門サービス		0.75%

パーソナル用品	0.74%
電気設備	0.71%
不動産管理・開発	0.55%
電子装置・機器・部品	0.53%
消費者金融	0.50%
複合小売り	0.49%
商業サービス・用品	0.49%
航空貨物・物流サービス	0.46%
建設関連製品	0.39%
家庭用耐久財	0.34%
建設・土木	0.33%
エネルギー設備・サービス	0.32%
自動車部品	0.30%
容器・包装	0.30%
建設資材	0.28%
無線通信サービス	0.27%
商社・流通業	0.26%
運送インフラ	0.22%
ガス	0.17%
ヘルスケア・テクノロジー	0.12%
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.10%
旅客航空輸送業	0.09%
水道	0.08%
紙製品・林産品	0.08%
販売	0.06%
海運業	0.06%
レジャー用品	0.05%
各種消費者サービス	0.01%
合計	95.69%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和1年6月28日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	US T N/B 2.625 08/15/20 アメリカ	国債証券	1,569,422,400	100.12 1,571,321,401	100.78 1,581,805,142	2.625000 2020/8/15	0.87%
2	US T N/B 2.0 05/31/21 アメリカ	国債証券	1,293,480,000	98.92 1,279,575,090	100.44 1,299,184,246	2.000000 2021/5/31	0.72%
3	US T N/B 2.0 02/15/22 アメリカ	国債証券	1,191,079,500	98.65 1,175,071,391	100.70 1,199,500,432	2.000000 2022/2/15	0.66%
4	US T N/B 1.375 04/30/21 アメリカ	国債証券	1,208,325,900	97.62 1,179,664,409	99.25 1,199,348,038	1.375000 2021/4/30	0.66%
5	US T N/B 2.125 08/15/21 アメリカ	国債証券	1,185,690,000	99.14 1,175,587,921	100.75 1,194,665,673	2.125000 2021/8/15	0.66%
6	US T N/B 2.0 11/15/21 アメリカ	国債証券	1,121,016,000	98.77 1,107,305,974	100.64 1,128,235,343	2.000000 2021/11/15	0.62%
7	US T N/B 2.125 12/31/21 アメリカ	国債証券	1,113,470,700	99.04 1,102,848,189	100.96 1,124,249,096	2.125000 2021/12/31	0.62%
8	US T N/B 2.125 09/30/21 アメリカ	国債証券	1,077,900,000	99.11 1,068,382,143	100.82 1,086,738,780	2.125000 2021/9/30	0.60%
9	US T N/B 2.5 01/31/21 アメリカ	国債証券	1,057,419,900	99.96 1,057,010,964	101.07 1,068,776,589	2.500000 2021/1/31	0.59%
10	US T N/B 2.25 03/31/21 アメリカ	国債証券	1,052,030,400	99.49 1,046,686,085	100.77 1,060,204,676	2.250000 2021/3/31	0.59%
11	US T N/B 2.75 11/15/23 アメリカ	国債証券	1,009,992,300	101.18 1,021,980,908	104.20 1,052,442,276	2.750000 2023/11/15	0.58%
12	US T N/B 2.0 02/15/23 アメリカ	国債証券	1,024,005,000	98.20 1,005,603,630	100.93 1,033,599,926	2.000000 2023/2/15	0.57%
13	US T N/B 2.625 08/31/20 アメリカ	国債証券	997,057,500	100.13 998,413,498	100.83 1,005,422,812	2.625000 2020/8/31	0.56%
14	US T N/B 2.5 05/15/24 アメリカ	国債証券	970,110,000	100.03 970,410,734	103.42 1,003,297,463	2.500000 2024/5/15	0.55%
15	US T N/B 2.375 08/15/24 アメリカ	国債証券	959,331,000	99.31 952,730,802	102.89 987,132,412	2.375000 2024/8/15	0.55%
16	US T N/B 1.75 12/31/20 アメリカ	国債証券	970,110,000	98.63 956,838,895	99.87 968,897,362	1.750000 2020/12/31	0.54%
17	US T N/B 1.75 03/31/22 アメリカ	国債証券	953,941,500	97.87 933,670,243	100.04 954,380,313	1.750000 2022/3/31	0.53%
18	US T N/B 2.25 11/15/24 アメリカ	国債証券	925,916,100	98.56 912,601,426	102.29 947,175,133	2.250000 2024/11/15	0.52%
19	US T N/B 1.625 11/15/22 アメリカ	国債証券	924,838,200	96.97 896,834,099	99.65 921,693,750	1.625000 2022/11/15	0.51%
20	US T N/B 1.625 11/30/20 アメリカ	国債証券	917,292,900	98.44 903,028,995	99.70 914,632,750	1.625000 2020/11/30	0.51%
21	US T N/B 2.0 02/15/25 アメリカ	国債証券	904,358,100	97.05 877,715,710	100.97 913,184,635	2.000000 2025/2/15	0.51%
22	US T N/B 2.75 02/15/24 アメリカ	国債証券	866,631,600	101.24 877,395,164	104.41 904,884,718	2.750000 2024/2/15	0.50%
23	US T N/B 2.375 12/31/20 アメリカ	国債証券	894,657,000	99.73 892,277,212	100.80 901,885,828	2.375000 2020/12/31	0.50%

24	US T N/B 2.5 08/15/23 アメリカ	国債証券	862,320,000	100.09 863,121,957	103.02 888,387,933	2.500000 2023/8/15	0.49%
25	US T N/B 3.125 05/15/21 アメリカ	国債証券	862,320,000	101.36 874,073,421	102.45 883,507,202	3.125000 2021/5/15	0.49%
26	US T N/B 1.75 05/15/22 アメリカ	国債証券	874,176,900	97.76 854,639,046	100.06 874,718,889	1.750000 2022/5/15	0.48%
27	US T N/B 2.125 12/31/22 アメリカ	国債証券	862,320,000	98.70 851,135,709	101.35 873,969,943	2.125000 2022/12/31	0.48%
28	US T N/B 2.75 11/30/20 アメリカ	国債証券	845,073,600	100.40 848,470,795	101.24 855,603,217	2.750000 2020/11/30	0.47%
29	US T N/B 2.0 11/30/20 アメリカ	国債証券	853,696,800	99.08 845,885,474	100.19 855,361,508	2.000000 2020/11/30	0.47%
30	US T N/B 1.75 09/30/22 アメリカ	国債証券	847,229,400	97.50 826,107,971	100.06 847,754,682	1.750000 2022/9/30	0.47%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

令和1年6月28日現在

種類	投資比率
国債証券	97.47%
合計	97.47%

(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

令和1年6月28日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	PROLOGIS INC アメリカ	投資証券	222,509	8,764.88 1,950,266,378	8,554.21 1,903,389,691	- -	4.09%
2	SIMON PROPERTY GROUP INC アメリカ	投資証券	108,994	17,684.72 1,927,529,215	17,238.85 1,878,931,729	- -	4.04%
3	PUBLIC STORAGE アメリカ	投資証券	52,956	25,919.82 1,372,610,044	25,550.54 1,353,054,480	- -	2.91%
4	WELLTOWER INC アメリカ	投資証券	142,884	9,016.68 1,288,339,432	8,798.89 1,257,221,698	- -	2.70%
5	AVALONBAY COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	49,184	22,398.76 1,101,660,710	21,713.21 1,067,942,894	- -	2.30%
6	EQUITY RESIDENTIAL アメリカ	投資証券	130,740	8,409.26 1,099,427,007	8,150.00 1,065,531,248	- -	2.29%
7	LINK REIT 香港	投資証券	743,520	1,325.35 985,425,993	1,345.90 1,000,706,542	- -	2.15%
8	VENTAS INC アメリカ	投資証券	130,385	7,578.15 988,077,344	7,482.78 975,642,504	- -	2.10%
9	DIGITAL REALTY TRUST INC アメリカ	投資証券	73,516	13,269.59 975,527,881	12,676.10 931,896,461	- -	2.00%
10	REALTY INCOME CORP アメリカ	投資証券	111,136	7,783.48 865,025,455	7,482.78 831,606,438	- -	1.79%
11	UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD オランダ	投資証券	48,595	16,425.93 798,218,348	15,586.85 757,443,097	- -	1.63%
12	BOSTON PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	54,556	14,660.14 799,798,791	13,800.35 752,892,096	- -	1.62%
13	ESSEX PROPERTY TRUST INC アメリカ	投資証券	23,115	32,334.84 747,419,923	31,083.40 718,492,844	- -	1.55%
14	GOODMAN GROUP オーストラリア	投資信託受益 証券	565,996	1,138.46 644,366,781	1,151.22 651,587,330	- -	1.40%
15	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT アメリカ	投資証券	39,532	15,659.73 619,060,493	15,097.06 596,817,268	- -	1.28%
16	HCP INC アメリカ	投資証券	168,099	3,523.95 592,373,944	3,427.72 576,196,640	- -	1.24%
17	SCENTRE GROUP オーストラリア	投資信託受益 証券	1,865,894	290.63 542,296,901	299.69 559,199,662	- -	1.20%
18	WP CAREY INC アメリカ	投資証券	60,124	9,224.66 554,623,950	8,776.26 527,663,964	- -	1.13%
19	EXTRA SPACE STORAGE INC アメリカ	投資証券	45,051	11,613.29 523,190,535	11,383.70 512,847,154	- -	1.10%
20	HOST HOTELS & RESORTS INC アメリカ	投資証券	261,621	1,958.54 512,396,318	1,941.29 507,884,297	- -	1.09%
21	MID AMERICA アメリカ	投資証券	40,303	12,836.71 517,357,967	12,538.13 505,324,366	- -	1.09%
22	UDR INC アメリカ	投資証券	99,581	4,921.32 490,070,780	4,805.27 478,514,408	- -	1.03%

23	SUN COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	31,554	13,994.96 441,597,148	13,646.21 430,592,636	- -	0.93%
24	DUKE REALTY TRUST アメリカ	投資証券	127,358	3,439.57 438,057,889	3,364.12 428,448,346	- -	0.92%
25	VORNADO REALTY TRUST アメリカ	投資証券	61,491	7,197.13 442,559,231	6,864.06 422,078,356	- -	0.91%
26	REGENCY CENTERS CORP アメリカ	投資証券	58,384	7,493.56 437,504,053	7,211.15 421,015,839	- -	0.91%
27	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES アメリカ	投資証券	31,542	13,161.15 415,129,277	12,900.30 406,901,489	- -	0.88%
28	INVITATION HOMES INC アメリカ	投資証券	135,096	2,926.49 395,358,241	2,859.66 386,329,802	- -	0.83%
29	CAMDEN PROPERTY TRUST アメリカ	投資証券	34,249	11,444.06 391,947,758	11,172.43 382,644,674	- -	0.82%
30	DEXUS オーストラリア	投資信託受益 証券	380,078	1,017.60 386,769,349	990.42 376,440,197	- -	0.81%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

令和1年6月28日現在

種類	投資比率
投資信託受益証券	10.97%
投資証券	88.31%
合計	99.28%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

令和1年6月28日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	TENCENT HOLDINGS LTD ケイマン諸島	株式 インタラク ティブ・メ ディアおよび サービス	511,900	5,327.86 2,727,335,120	4,865.11 2,490,450,832	- -	4.22%
2	ALIBABA GROUP HOLDING LTD- ADR ケイマン諸島	株式 インターネッ ト販売・通信 販売	127,273	19,470.95 2,478,126,754	18,421.31 2,344,535,514	- -	3.98%
3	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD 韓国	株式 コンピュー タ・周辺機器	427,247	4,331.05 1,850,428,193	4,338.44 1,853,589,747	- -	3.14%
4	TAIWAN SEMICONDUCTOR 台湾	株式 半導体・半導 体製造装置	2,200,083	893.65 1,966,115,635	834.53 1,836,046,266	- -	3.11%
5	NASPERS LTD 南アフリカ	株式 インターネッ ト販売・通信 販売	39,254	27,095.32 1,063,599,834	25,609.33 1,005,269,032	- -	1.70%
6	CHINA CONSTRUCTION BANK 中国	株式 銀行	8,583,530	97.03 832,918,761	92.11 790,690,749	- -	1.34%
7	ISHARES MSCI SAUDI ARABIA CAPPED UCITS ETF アイルランド	投資信託受益 証券 -	1,435,616	536.59 770,348,292	524.50 752,989,406	- -	1.28%
8	PING AN INSURANCE GROUP CO-H 中国	株式 保険	493,500	1,281.60 632,474,397	1,296.94 640,044,578	- -	1.09%
9	CHINA MOBILE LIMITED 香港	株式 無線通信サー ビス	544,500	1,038.67 565,560,389	984.60 536,117,967	- -	0.91%
10	RELIANCE INDUSTRIES LTD インド	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	254,856	2,104.73 536,405,369	2,000.41 509,817,892	- -	0.86%
11	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP インド	株式 貯蓄・抵当・ 不動産金融	146,019	3,206.72 468,243,330	3,446.85 503,306,539	- -	0.85%
12	IND & COMM BK OF CHINA - H 中国	株式 銀行	5,827,235	83.04 483,945,348	78.32 456,431,001	- -	0.77%
13	ITAU UNIBANCO HOLDING SA ブラジル	株式 銀行	429,647	920.12 395,328,597	1,021.88 439,050,898	- -	0.74%
14	VALE SA ブラジル	株式 金属・鉱業	284,121	1,464.02 415,959,138	1,457.42 414,084,480	- -	0.70%
15	SBERBANK ADR ロシア	株式 銀行	243,502	1,599.98 389,599,093	1,668.58 406,304,807	- -	0.69%

16	BANCO BRADESCO SA PREF ブラジル	株式 銀行	363,650	974.32 354,311,662	1,068.40 388,524,023	- -	0.66%
17	GAZPROM PAO ADR ロシア	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	483,486	560.58 271,034,058	790.10 382,002,627	- -	0.65%
18	INFOSYS LTD インド	株式 情報技術サー ビス	313,352	1,137.86 356,552,264	1,146.96 359,403,306	- -	0.61%
19	LUKOIL SPON ADR ロシア	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	37,740	9,304.70 351,159,404	9,211.73 347,650,818	- -	0.59%
20	SK HYNIX INC 韓国	株式 半導体・半導 体製造装置	49,053	7,383.97 362,206,010	6,549.65 321,280,471	- -	0.54%
21	BANK OF CHINA LTD 中国	株式 銀行	6,952,200	51.77 359,930,767	45.36 315,415,057	- -	0.53%
22	BAIDU INC -SPON ADR ケイマン諸島	株式 インタラク ティブ・メ ディアおよび サービス	24,909	17,537.20 436,834,260	12,507.95 311,560,566	- -	0.53%
23	HON HAI PRECISION INDUSTRY 台湾	株式 電子装置・機 器・部品	1,115,225	313.18 349,272,020	268.57 299,524,900	- -	0.51%
24	CNOOC LTD 香港	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	1,591,000	201.30 320,275,586	185.61 295,310,919	- -	0.50%
25	PETROLEO BRASILEIRO SA ブラジル	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	374,912	753.77 282,597,733	767.61 287,787,587	- -	0.49%
26	TATA CONSULTANCY SERVICES LTD インド	株式 情報技術サー ビス	80,435	3,340.27 268,675,038	3,536.50 284,458,659	- -	0.48%
27	SAMSUNG ELECTRONICS-PFD 韓国	株式 コンピュー タ・周辺機器	73,481	3,488.46 256,335,606	3,545.39 260,519,537	- -	0.44%
28	AMERICA MOVIL SAB DE CV メキシコ	株式 無線通信サー ビス	3,017,678	82.88 250,112,136	79.07 238,618,059	- -	0.40%
29	PETROLEO BRASILEIRO SA ブラジル	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	267,010	846.07 225,909,742	842.59 224,982,385	- -	0.38%
30	QATAR NATIONAL BANK カタール	株式 銀行	398,770	532.54 212,364,450	560.05 223,332,294	- -	0.38%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

令和1年6月28日現在

種類	投資比率
株式	88.83%
新株予約権証券	0.00%
投資信託受益証券	1.69%
投資証券	0.06%
合計	90.58%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

令和1年6月28日現在

業種	国内/外国	投資比率
銀行	外国	15.27%
石油・ガス・消耗燃料		7.13%
インターネット販売・通信販売		6.65%
インタラクティブ・メディアおよびサービス		5.49%
半導体・半導体製造装置		4.55%
コンピュータ・周辺機器		4.40%
保険		3.62%
金属・鉱業		3.05%
無線通信サービス		2.71%
不動産管理・開発		2.44%
化学		1.96%
電子装置・機器・部品		1.79%
自動車		1.67%
食品		1.63%
情報技術サービス		1.59%
食品・生活必需品小売り		1.59%
各種電気通信サービス		1.35%
資本市場		1.31%
コングロマリット		1.20%
医薬品		1.08%
建設資材		1.01%
電力		0.95%
貯蓄・抵当・不動産金融		0.94%
運送インフラ		0.91%
飲料		0.90%
各種金融サービス		0.87%
繊維・アパレル・贅沢品		0.76%
建設・土木		0.74%
ホテル・レストラン・レジャー		0.68%
娯楽		0.66%
パーソナル用品		0.60%
機械		0.57%
独立系発電事業者・エネルギー販売業者		0.57%
ガス		0.54%
各種消費者サービス		0.54%
複合小売り		0.53%
タバコ		0.48%

ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	0.48%
自動車部品	0.48%
専門小売り	0.44%
バイオテクノロジー	0.42%
家庭用品	0.40%
家庭用耐久財	0.34%
紙製品・林産品	0.31%
陸運・鉄道	0.30%
メディア	0.29%
消費者金融	0.26%
水道	0.25%
旅客航空輸送業	0.25%
ライフサイエンス・ツール/サービス	0.23%
電気設備	0.22%
エクイティ不動産投資信託(REITs)	0.18%
航空貨物・物流サービス	0.15%
ソフトウェア	0.15%
航空宇宙・防衛	0.14%
商業サービス・用品	0.13%
ヘルスケア機器・用品	0.09%
海運業	0.09%
エネルギー設備・サービス	0.07%
ヘルスケア・テクノロジー	0.06%
通信機器	0.06%
レジャー用品	0.06%
総合公益事業	0.06%
容器・包装	0.05%
商社・流通業	0.04%
建設関連製品	0.03%
専門サービス	0.02%
合計	88.83%

(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。

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

令和1年6月28日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	RUSSIAN FEDERATION 5.25 06/23/47 ロシア	国債証券	2,479,170,000	102.86 2,550,257,505	110.04 2,728,202,626	5.250000 2047/6/23	2.78%
2	COLOMBIA 5.0 06/15/45 コロンビア	国債証券	1,724,640,000	104.08 1,795,134,660	110.45 1,904,864,880	5.000000 2045/6/15	1.94%
3	PERU 5.625 11/18/50 ペルー	国債証券	1,185,690,000	128.22 1,520,291,718	137.81 1,634,023,102	5.625000 2050/11/18	1.66%
4	ROMANIA 6.75 02/07/22 ルーマニア	国債証券	1,455,165,000	109.18 1,588,817,054	110.11 1,602,325,836	6.750000 2022/2/7	1.63%
5	UNITED MEXICAN STATES 4.75 03/08/44 メキシコ	国債証券	1,444,386,000	97.86 1,413,611,955	104.40 1,507,953,427	4.750000 2044/3/8	1.54%
6	BRAZIL 4.25 01/07/25 ブラジル	国債証券	1,412,049,000	101.24 1,429,578,348	105.47 1,489,358,682	4.250000 2025/1/7	1.52%
7	HUNGARY 6.375 03/29/21 ハンガリー	国債証券	1,293,480,000	106.49 1,377,465,656	106.93 1,383,118,164	6.375000 2021/3/29	1.41%
8	RUSSIAN FEDERATION 03/31/30 ロシア	国債証券	1,164,132,000	111.50 1,298,007,180	112.92 1,314,630,984	7.500000 2030/3/31	1.34%
9	UNITED MEXICAN STATES 5.55 01/21/45 メキシコ	国債証券	1,121,016,000	109.21 1,224,298,653	116.55 1,306,555,358	5.550000 2045/1/21	1.33%
10	UNITED MEXICAN STATES 6.05 01/11/40 メキシコ	国債証券	1,067,121,000	114.09 1,217,548,304	119.25 1,272,552,463	6.050000 2040/1/11	1.30%
11	RUSSIAN FEDERATION 5.625 04/04/42 ロシア	国債証券	1,056,342,000	110.73 1,169,789,681	117.04 1,236,427,184	5.625000 2042/4/4	1.26%
12	PHILIPPINES 6.375 10/23/34 フィリピン	国債証券	862,320,000	132.78 1,144,994,963	139.51 1,203,100,240	6.375000 2034/10/23	1.23%
13	RUSSIAN FEDERATION 4.875 09/16/23 ロシア	国債証券	1,121,016,000	105.69 1,184,873,382	106.98 1,199,285,337	4.875000 2023/9/16	1.22%
14	RUSSIAN FEDERATION 4.75 05/27/26 ロシア	国債証券	1,121,016,000	103.65 1,161,954,642	106.37 1,192,503,190	4.750000 2026/5/27	1.21%
15	UNITED MEXICAN STATES 4.15 03/28/27 メキシコ	国債証券	1,121,016,000	101.60 1,139,016,930	104.72 1,173,984,006	4.150000 2027/3/28	1.20%
16	PANAMA 6.7 01/26/36 パナマ	国債証券	851,541,000	129.95 1,106,624,957	135.02 1,149,835,812	6.700000 2036/1/26	1.17%
17	BRAZIL 5.0 01/27/45 ブラジル	国債証券	1,164,132,000	91.09 1,060,461,302	98.56 1,147,403,423	5.000000 2045/1/27	1.17%
18	COLOMBIA 5.625 02/26/44 コロンビア	国債証券	970,110,000	111.65 1,083,137,516	118.26 1,147,271,488	5.625000 2044/2/26	1.17%

19	PERU 7.35 07/21/25 ペルー	国債証券	894,657,000	124.17 1,110,985,062	127.00 1,136,303,855	7.350000 2025/7/21	1.16%
20	INDONESIA 4.875 05/05/21 インドネシア	国債証券	1,088,679,000	103.51 1,126,989,614	104.00 1,132,226,160	4.875000 2021/5/5	1.15%
21	BRAZIL 4.625 01/13/28 ブラジル	国債証券	1,056,342,000	100.42 1,060,816,147	105.02 1,109,423,185	4.625000 2028/1/13	1.13%
22	BRAZIL 5.625 02/21/47 ブラジル	国債証券	1,034,784,000	98.10 1,015,186,484	106.73 1,104,497,398	5.625000 2047/2/21	1.12%
23	UNITED MEXICAN STATES 4.6 01/23/46 メキシコ	国債証券	1,077,900,000	95.74 1,031,981,460	102.30 1,102,702,479	4.600000 2046/1/23	1.12%
24	PHILIPPINES 9.5 02/02/30 フィリピン	国債証券	689,856,000	153.88 1,061,574,126	159.71 1,101,782,814	9.500000 2030/2/2	1.12%
25	SOUTH AFRICA 5.875 09/16/25 南アフリカ	国債証券	991,668,000	106.26 1,053,819,714	109.57 1,086,610,294	5.875000 2025/9/16	1.11%
26	UNITED MEXICAN STATES 4.0 10/02/23 メキシコ	国債証券	1,024,005,000	103.18 1,056,583,449	104.49 1,070,044,264	4.000000 2023/10/2	1.09%
27	COLOMBIA 6.125 01/18/41 コロンビア	国債証券	862,320,000	117.43 1,012,693,517	123.75 1,067,129,623	6.125000 2041/1/18	1.09%
28	BRAZIL 4.875 01/22/21 ブラジル	国債証券	1,013,226,000	103.38 1,047,524,778	103.95 1,053,248,427	4.875000 2021/1/22	1.07%
29	INDONESIA 7.75 01/17/38 インドネシア	国債証券	700,635,000	137.16 961,054,023	144.17 1,010,133,504	7.750000 2038/1/17	1.03%
30	UNITED MEXICAN STATES 3.75 01/11/28 メキシコ	国債証券	991,668,000	98.53 977,111,176	101.82 1,009,775,857	3.750000 2028/1/11	1.03%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

令和1年6月28日現在

種類	投資比率
国債証券	95.96%
合計	95.96%

(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

令和1年6月28日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
株価指数先物 取引	大阪取引所	TOPIX 先物 0109月	買建	314	4,815,066,736	4,870,140,000	1.90%

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

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

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

J-REITインデックスファンド・マザーファンド

令和1年6月28日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
不動産投信指 数先物取引	大阪取引所	TREIT 先物 0109月	買建	351	668,763,108	674,271,000	2.00%

(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) 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。

DIAMマネーマザーファンド

該当事項はありません。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和1年6月28日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
為替予約取引	-	アメリカ・ドル買/円 売2019年07月	買建	6,070,000	653,556,900	654,042,500	0.19%
		ユーロ買/円売201 9年07月	買建	1,280,000	156,712,960	156,774,400	0.05%
		イギリス・ポンド買/ 円売2019年07月	買建	418,000	57,135,584	57,077,900	0.02%
		カナダ・ドル買/円売 2019年07月	買建	425,000	34,880,175	34,977,500	0.01%
		オーストラリア・ドル 買/円売2019年0 7月	買建	325,000	24,463,725	24,527,750	0.01%
		アメリカ・ドル売/円 買2019年07月	売建	2,532,000	272,714,124	272,797,680	0.08%
		ユーロ売/円買201 9年07月	売建	303,000	37,093,866	37,111,440	0.01%
		イギリス・ポンド売/ 円買2019年07月	売建	172,000	23,479,720	23,484,880	0.01%
		カナダ・ドル売/円買 2019年07月	売建	174,000	14,317,938	14,320,200	0.00%
		オーストラリア・ドル 売/円買2019年0 7月	売建	135,000	10,185,075	10,187,100	0.00%
株価指数先物 取引	シカゴ商品 取引所	S&P500 EMI NI FUT Sep 19	買建	233	3,644,938,252	3,680,613,508	1.07%
	EUREX 取引所	DJ EURO ST OXX 50 Sep 19	買建	214	885,236,454	899,887,483	0.26%
	ICE-E U	FTSE 100 I NDEX FUTUR E Sep19	買建	32	318,757,111	320,753,764	0.09%
	モン トリ オール 取引 所	S&P/TSE 6 0 IX FUT S ep19	買建	12	191,481,467	192,019,905	0.06%
	シド ニー 先 物 取引 所	SPI 200 FU TURES Sep1 9	買建	12	146,952,608	149,538,141	0.04%

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

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

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

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和1年6月28日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
為替予約取引	-	アメリカ・ドル売/円 買2019年07月	売建	3,659,279	394,130,000	394,250,756	0.22%
		ユーロ売/円買201 9年07月	売建	777,066	95,130,000	95,175,069	0.05%
		イギリス・ポンド売/ 円買2019年07月	売建	254,267	34,710,000	34,717,628	0.02%
		オーストラリア・ドル 売/円買2019年0 7月	売建	363,443	27,420,000	27,425,451	0.02%

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

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

為替予約取引の数量は、現地通貨建契約金額です。

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和1年6月28日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
為替予約取引	-	オーストラリア・ドル 買/円売2019年0 7月	買建	420,000	31,614,660	31,697,400	0.07%
		アメリカ・ドル買/円 売2019年07月	買建	200,000	21,546,000	21,550,000	0.05%
		イギリス・ポンド買/ 円売2019年07月	買建	90,000	12,287,295	12,289,500	0.03%
		シンガポール・ドル 買/円売2019年0 7月	買建	60,000	4,770,540	4,779,000	0.01%
		香港・ドル買/円売2 019年07月	買建	340,000	4,687,240	4,685,200	0.01%

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

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

為替予約取引の数量は、現地通貨建契約金額です。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

令和1年6月28日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
為替予約取引	-	アメリカ・ドル買/円 売2019年07月	買建	1,468,705	158,134,294	158,252,986	0.27%
		アメリカ・ドル売/円 買2019年07月	売建	2,054,000	221,258,934	221,297,960	0.38%
		ブラジル・レアル売/ 円買2019年07月	売建	14,205	397,744	400,443	0.00%
株価指数先物 取引	ICE-US	MINI MSCI EMG MKT Sep 19	買建	929	5,067,615,885	5,287,729,532	8.97%

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

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

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

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

令和1年6月28日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
為替予約取引	-	アメリカ・ドル売/ 円買2019年07 月	売建	93,000,000	10,013,310,000	10,020,750,000	10.21%

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

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

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

直近日(令和1年6月末)、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 (分配落) (百万円)	純資産総額 (分配付) (百万円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (平成28年6月2日)	12	12	1.0110	1.0110
第2計算期間末 (平成28年12月2日)	11	11	1.0331	1.0331
第3計算期間末 (平成29年6月2日)	13	13	1.1121	1.1121
第4計算期間末 (平成29年12月4日)	14	14	1.2001	1.2001
第5計算期間末 (平成30年6月4日)	13	13	1.1619	1.1619
第6計算期間末 (平成30年12月3日)	12	12	1.1210	1.1210
第7計算期間末 (令和1年6月3日)	13	13	1.0949	1.0949
平成30年6月末日	13	-	1.1467	-
7月末日	13	-	1.1712	-
8月末日	13	-	1.1754	-
9月末日	13	-	1.1964	-
10月末日	12	-	1.1125	-
11月末日	12	-	1.1180	-
12月末日	12	-	1.0749	-
平成31年1月末日	13	-	1.1027	-
2月末日	13	-	1.1257	-
3月末日	13	-	1.1376	-
4月末日	13	-	1.1637	-
令和1年5月末日	13	-	1.1068	-
6月末日	13	-	1.1309	-

【分配の推移】

	1口当たりの分配金(円)
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	1.1
第2計算期間	2.2
第3計算期間	7.6
第4計算期間	7.9
第5計算期間	3.2
第6計算期間	3.5
第7計算期間	2.3

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

なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数
第1計算期間	12,719,724	379,112
第2計算期間	1,087,252	2,122,213
第3計算期間	546,393	72,171
第4計算期間	964,508	484,425
第5計算期間	298,239	1,087,306
第6計算期間	43,845	92,397
第7計算期間	568,597	96,676

(注1) 本邦外における設定及び解約はございません。

(注2) 第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

<< 参考情報 >>

データの基準日:2019年6月28日

基準価額・純資産の推移

(2016年2月24日～2019年6月28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:2016年2月24日)
 ※設定時から10年以上経過した場合は、直近10年分を記載しています。

分配の推移 (税引前)

第3期	(2017.06.02)	0円
第4期	(2017.12.04)	0円
第5期	(2018.06.04)	0円
第6期	(2018.12.03)	0円
第7期	(2019.06.03)	0円
設定来累計		0円

※分配金は1万口当たりです。

主要な資産の状況

■組入銘柄

※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

順位	銘柄名	比率
1	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	39.12%
2	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	17.18%
3	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	9.85%
4	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	7.41%
5	J-REITインデックスファンド・マザーファンド	7.28%
6	外国リートパッシブ・ファンド・マザーファンド	7.22%
7	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	5.00%
8	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	4.94%
9	DIAMマネー・マザーファンド	0.74%

■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	350回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.100000	2028/3/20	1.01%
2	342回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.100000	2026/3/20	0.98%
3	341回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.300000	2025/12/20	0.93%
4	332回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.600000	2023/12/20	0.90%
5	343回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.100000	2026/6/20	0.89%

■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	3.27%
2	ソフトバンクグループ	株式	日本	情報・通信業	1.86%
3	ソニー	株式	日本	電気機器	1.67%
4	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	日本	銀行業	1.53%
5	日本電信電話	株式	日本	情報・通信業	1.48%

○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:2019年6月28日

■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	0.87%
2	US T N/B 2.0 05/31/21	国債証券	アメリカ	2.000000	2021/5/31	0.72%
3	US T N/B 2.0 02/15/22	国債証券	アメリカ	2.000000	2022/2/15	0.66%
4	US T N/B 1.375 04/30/21	国債証券	アメリカ	1.375000	2021/4/30	0.66%
5	US T N/B 2.125 08/15/21	国債証券	アメリカ	2.125000	2021/8/15	0.66%

■外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	業種	比率
1	MICROSOFT CORP	株式	アメリカ	ソフトウェア	2.55%
2	APPLE INC	株式	アメリカ	コンピュータ・周辺機器	2.45%
3	AMAZON.COM INC	株式	アメリカ	インターネット販売・通信販売	2.07%
4	FACEBOOK INC	株式	アメリカ	インタラクティブ・メディアおよびサービス	1.18%
5	JOHNSON & JOHNSON	株式	アメリカ	医薬品	0.98%

■エマージング債券パッシブ・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還期限	比率
1	RUSSIAN FEDERATION 5.25 06/23/47	国債証券	ロシア	5.250000	2047/6/23	2.78%
2	COLOMBIA 5.0 06/15/45	国債証券	コロンビア	5.000000	2045/6/15	1.94%
3	PERU 5.625 11/18/50	国債証券	ペルー	5.625000	2050/11/18	1.66%
4	ROMANIA 6.75 02/07/22	国債証券	ルーマニア	6.750000	2022/2/7	1.63%
5	UNITED MEXICAN STATES 4.75 03/08/44	国債証券	メキシコ	4.750000	2044/3/8	1.54%

■エマージング株式パッシブ・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	業種	比率
1	TENCENT HOLDINGS LTD	株式	ケイマン諸島	インタラクティブ・メディアおよびサービス	4.22%
2	ALIBABA GROUP HOLDING LTD-ADR	株式	ケイマン諸島	インターネット販売・通信販売	3.98%
3	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	株式	韓国	コンピュータ・周辺機器	3.14%
4	TAIWAN SEMICONDUCTOR	株式	台湾	半導体・半導体製造装置	3.11%
5	NASPERS LTD	株式	南アフリカ	インターネット販売・通信販売	1.70%

○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:2019年6月28日

■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	7.17%
2	ジャパンリアルエステイト投資法人	投資証券	日本	6.58%
3	野村不動産マスターファンド投資法人	投資証券	日本	5.17%
4	日本リートファンド投資法人	投資証券	日本	4.13%
5	ユナイテッド・アーバン投資法人	投資証券	日本	4.07%

■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	PROLOGIS INC	投資証券	アメリカ	4.09%
2	SIMON PROPERTY GROUP INC	投資証券	アメリカ	4.04%
3	PUBLIC STORAGE	投資証券	アメリカ	2.91%
4	WELLTOWER INC	投資証券	アメリカ	2.70%
5	AVALONBAY COMMUNITIES INC	投資証券	アメリカ	2.30%

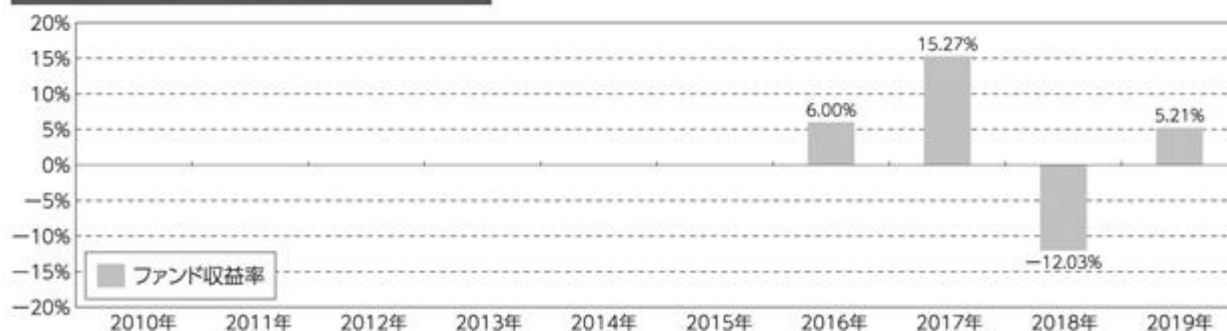
■DIAMマネーマザーファンド

※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	123回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.100000	2020/3/20	74.39%
2	391回 利付国庫債券(2年)	国債証券	日本	0.100000	2020/8/1	1.24%
3	392回 利付国庫債券(2年)	国債証券	日本	0.100000	2020/9/1	0.62%
4	388回 利付国庫債券(2年)	国債証券	日本	0.100000	2020/5/15	0.62%
5	21年度35回 兵庫県公募公債	地方債証券	日本	1.460000	2020/1/22	0.25%

年間収益率の推移(暦年ベース)



※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。

※2016年は設定日から年末までの収益率、および2019年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

※当ファンドにはベンチマークはありません。

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

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

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

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

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

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

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

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

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

・お申込価額

お申込日の翌営業日の基準価額 とします。

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

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

< 基準価額の照会方法等 >

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

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・ 販売会社へのお問い合わせ
- ・ 委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

・ お申込手数料

お申込日の翌営業日の基準価額に、3.24%^{*}（税抜3.00%）を上限に各販売会社が定める手数料率を乗じて得た額とします。

* 消費税率が10%になった場合は、3.3%となります。

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

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

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

・ お申込単位

各販売会社が定める単位とします。

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

取扱コースおよびお申込単位は、販売会社にお問い合わせください。

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

当初元本は1口当たり1円です。

・ 払込期日

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

2【換金（解約）手続等】

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

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

海外休業日には、解約の受付を行いません。

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

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

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

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

・解約価額

解約価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

当ファンドの解約価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

・解約単位

各販売会社が定める単位とします。

解約単位は販売会社にお問い合わせください。

・解約代金の受渡日

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

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

基準価額とは、純資産総額（信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券を除きます。）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
国内の転換社債および 転換社債型新株予約権 付社債	計算日における金融商品取引所等の最終相場
外貨建資産の円換算	計算日の国内における対顧客電信売買相場の仲値
外国為替予約の円換算	計算日の国内における対顧客先物売買相場の仲値

外国で取引されているものについては、計算時に知りうる直近の日

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

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

(2)【保管】

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

信託期間は、2016年2月24日から原則として無期限です。（注）

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

（注）繰上償還（信託終了）が決定した場合には、信託期間は2019年10月21日までとなります。

(4)【計算期間】

- a. 計算期間は、原則として毎年6月3日から12月2日まで、および12月3日から翌年6月2日までとします。
- b. 上記a.の規定にかかわらず、上記a.の原則により各計算期間終了日に該当する日(以下「該当日」といいます。)が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。ただし、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。

(5)【その他】

イ.償還規定

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

た場合、または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は下記「ロ．信託約款の変更等」の規定にしたがい、新受託会社を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託会社を解任することはできないものとします。委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は信託契約を解約し、信託を終了させます。

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

ロ．信託約款の変更等

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

払われることとなる委託者指図型投資信託に該当するため、重大な約款の変更等を行う場合において、投資信託及び投資法人に関する法律第18条第1項に定める反対受益者による受益権買取請求の規定の適用を受けません。

八．関係法人との契約の更改

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

二．公告

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

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

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

ホ．運用報告書

・委託会社は、毎年6月2日、12月2日(休業日の場合は翌営業日とします。)および償還時に交付運用報告書を作成し、販売会社を通じて受益者に対して交付します。

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

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

4【受益者の権利等】

収益分配金請求権

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

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

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

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

償還金請求権

受益者は、持ち分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

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

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ヵ月であるため、財務諸表は6ヵ月ごとに作成しております。
- (3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第7期計算期間(平成30年12月4日から令和1年6月3日まで)の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

1【財務諸表】

【ダイナミック・ナビゲーション】

(1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第6期 平成30年12月3日現在	第7期 令和1年6月3日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	188,858	285,635
親投資信託受益証券	12,666,882	12,855,274
未収入金	66,000	-
流動資産合計	12,921,740	13,140,909
資産合計	12,921,740	13,140,909
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	3,515	3,506
未払委託者報酬	113,567	113,658
その他未払費用	182	182
流動負債合計	117,264	117,346
負債合計	117,264	117,346
純資産の部		
元本等		
元本	11,422,337	11,894,258
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	1,382,139	1,129,305
(分配準備積立金)	2,066,236	2,095,189
元本等合計	12,804,476	13,023,563
純資産合計	12,804,476	13,023,563
負債純資産合計	12,921,740	13,140,909

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第6期 自 平成30年6月5日 至 平成30年12月3日	第7期 自 平成30年12月4日 至 令和1年6月3日
営業収益		
有価証券売買等損益	349,149	169,608
営業収益合計	349,149	169,608
営業費用		
支払利息	113	21
受託者報酬	3,515	3,506
委託者報酬	113,567	113,658
その他費用	182	10,982
営業費用合計	117,377	128,167
営業利益又は営業損失()	466,526	297,775
経常利益又は経常損失()	466,526	297,775
当期純利益又は当期純損失()	466,526	297,775
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()	600	504
期首剰余金又は期首欠損金()	1,857,381	1,382,139
剰余金増加額又は欠損金減少額	6,847	57,053
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	6,847	57,053
剰余金減少額又は欠損金増加額	14,963	11,608
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	14,963	11,608
分配金	1 -	1 -
期末剰余金又は期末欠損金()	1,382,139	1,129,305

(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	計算期間末日の取扱い 当ファンドは、原則として毎年6月2日及び12月2日を計算期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、前計算期間末日を平成30年12月3日、当計算期間末日を令和1年6月3日としております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	第6期 平成30年12月3日現在	第7期 令和1年6月3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	11,470,889円 43,845円 92,397円	11,422,337円 568,597円 96,676円
2. 受益権の総数	11,422,337口	11,894,258口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第6期 自 平成30年6月5日 至 平成30年12月3日	第7期 自 平成30年12月4日 至 令和1年6月3日
1. 1 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(37,292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(187,852円)及び分配準備積立金(2,028,944円)より分配対象収益は2,254,088円(1万口当たり1,973.40円)であります。なお、分配を行っておりません。なお、分配金の計算過程においては、親投資信託の配当等収益及び収益調整金相当額を充当する方法によっております。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(45,699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(298,235円)及び分配準備積立金(2,049,490円)より分配対象収益は2,393,424円(1万口当たり2,012.25円)であります。なお、分配を行っておりません。なお、分配金の計算過程においては、親投資信託の配当等収益及び収益調整金相当額を充当する方法によっております。

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	第6期 自 平成30年6月5日 至 平成30年12月3日	第7期 自 平成30年12月4日 至 令和1年6月3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	第6期 平成30年12月3日現在	第7期 令和1年6月3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	第6期 平成30年12月3日現在	第7期 令和1年6月3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)
親投資信託受益証券	95,392	184,083
合計	95,392	184,083

(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)

	第6期 平成30年12月3日現在	第7期 令和1年6月3日現在
1口当たり純資産額	1.1210円	1.0949円
(1万口当たり純資産額)	(11,210円)	(10,949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

令和1年6月3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	538,219	1,260,401	
	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	496,041	653,484	
	J-REITインデックスファンド・マザーファンド	461,525	955,079	
	DIAMマネーマザーファンド	98,710	99,657	
	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	1,474,038	5,036,787	
	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	1,249,823	2,273,053	
	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	748,494	952,009	
	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	603,795	653,064	
	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	513,795	971,740	
親投資信託受益証券 合計		6,184,440	12,855,274	
合計		6,184,440	12,855,274	

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

同親投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」の状況

貸借対照表

（単位：円）

科 目	注記 番号	平成30年12月3日現在	令和1年6月3日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		6,601,076,898	8,531,246,092
株式	2	275,211,820,320	245,009,417,140
派生商品評価勘定		226,301,792	-
未収入金		220,917,386	-
未収配当金		1,121,907,753	2,600,520,243
前払金		-	111,024,000
流動資産合計		283,382,024,149	256,252,207,475
資産合計		283,382,024,149	256,252,207,475
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		424,860	105,946,340
前受金		122,955,000	-
未払金		9,781,470	5,508,806,084
未払解約金		270,320,000	45,611,000
流動負債合計		403,481,330	5,660,363,424
負債合計		403,481,330	5,660,363,424
純資産の部			
元本等			
元本	1	108,683,534,206	107,008,719,801
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		174,295,008,613	143,583,124,250
元本等合計		282,978,542,819	250,591,844,051
純資産合計		282,978,542,819	250,591,844,051
負債純資産合計		283,382,024,149	256,252,207,475

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	平成30年12月3日現在	令和1年6月3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	110,994,161,661円	108,683,534,206円
同期中追加設定元本額	18,906,731,831円	16,298,716,183円
同期中一部解約元本額	21,217,359,286円	17,973,530,588円
元本の内訳		
ファンド名		
DIAM DC 国内株式インデックスファンド	11,967,117,118円	12,998,867,220円
DIAM国内株式パッシブ・ファンド	2,633,878,883円	2,207,706,610円
MITO ラップ型ファンド(安定型)	3,256,315円	2,759,909円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	7,271,489円	6,321,872円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	12,819,569円	10,742,961円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	23,253,746円	25,181,917円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	19,553,564円	16,042,507円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	15,762,405円	12,773,966円
たわらノーロード TOPIX	343,448,155円	455,451,547円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	79,516,708円	164,919,134円
たわらノーロード バランス(堅実型)	2,054,886円	4,380,981円
たわらノーロード バランス(標準型)	14,734,553円	30,686,355円
たわらノーロード バランス(積極型)	32,813,335円	53,665,717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)	194,436円	365,233円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定型)	7,982,891円	17,211,593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)	26,009,928円	50,261,018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)	19,774,602円	38,734,278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)	50,061,879円	98,308,098円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	46,881円	123,687円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	88,903円	434,330円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	843,173円	1,198,750円

たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	608,483円	824,532円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	2,045,176円	2,437,008円
DIAM国内株式インデックスファンド<DC年金>	38,444,979,066円	37,922,430,024円
DIAMバランス・ファンド<DC年金> 1 安定型	879,890,230円	980,661,308円
DIAMバランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型	2,966,067,486円	3,247,971,944円
DIAMバランス・ファンド<DC年金> 3 成長型	3,094,922,167円	3,345,230,651円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	347,896,961円	371,332,722円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	1,153,022,802円	1,214,321,979円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	1,098,728,473円	1,144,711,140円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	41,166,801円	40,885,253円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	1,086,581,026円	1,118,241,297円
マネックス資産設計ファンドエボリューション	26,126,648円	26,814,455円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	281,319,119円	311,229,788円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	183,994,352円	212,744,605円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	322,635,144円	368,483,543円
投資のソムリエ	446,534,037円	1,787,992,545円
クルーズコントロール	534,475,990円	278,945,492円
投資のソムリエ<DC年金>	39,944,589円	183,172,811円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	202,650,403円	244,640,954円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	259,293,811円	297,666,934円
クルーズコントロール<DC年金>	338,718円	249,589円
DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)	4,001,874円	3,430,634円
DIAMコア資産設計ファンド(積極型)	10,678,841円	8,847,978円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	24,715,473円	82,547,057円
ダイナミック・ナビゲーション	492,754円	538,219円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	446,930,672円	1,178,346,757円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	1,025,258円	812,215円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	774,406円	693,240円

リスク抑制世界8資産バランス ファンド(DC)	154,925円	616,216円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2035)	1,499,177円	1,511,975円
4資産分散投資・スタンダード <DC年金>	14,156,470円	20,539,357円
リスクコントロール世界資産分 散ファンド	126,294,522円	141,055,526円
9資産分散投資・スタンダード <DC年金>	18,666円	25,666,275円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2040)	-円	165,239円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2050)	-円	165,239円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2060)	-円	165,239円
4資産分散投資・ミドルクラス <DC年金>	-円	124,126円
DIAMワールドバランス25 VA(適格機関投資家限定)	67,042,223円	70,023,212円
日米資産配分戦略ファンド(イン カム重視型)(為替ヘッジあり) (適格機関投資家限定)	54,483,445円	272,948,971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)	114,808,331円	111,621,675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)	280,093,344円	276,511,504円
DIAM国際分散バランスファ ンド30VA(適格機関投資家 限定)	14,848,835円	15,104,584円
DIAM国際分散バランスファ ンド50VA(適格機関投資家 限定)	64,068,386円	61,892,229円
DIAM国内重視バランスファ ンド30VA(適格機関投資家 限定)	16,333,666円	16,908,390円
DIAM国内重視バランスファ ンド50VA(適格機関投資家 限定)	14,026,980円	13,859,048円
DIAM世界バランスファンド 40VA(適格機関投資家限 定)	29,692,238円	31,868,250円
DIAM世界バランスファンド 50VA(適格機関投資家限 定)	54,409,906円	61,310,056円
DIAMバランスファンド25 VA(適格機関投資家限定)	1,025,929,891円	978,667,415円
DIAMバランスファンド3 7.5VA(適格機関投資家限 定)	965,804,216円	945,049,142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)	2,688,236,491円	2,655,711,585円
D I A Mグローバル・アセッ ト・バランスV A (適格機関投 資家限定)	189,846,411円	190,191,667円
D I A Mグローバル・アセッ ト・バランスV A 2 (適格機関 投資家限定)	51,637,287円	51,284,088円
D I A M アクサ グローバ ル バランスファンド30V A (適格機関投資家限定)	556,287,813円	532,347,857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)	396,632,057円	293,369,739円
D I A Mグローバル 私募ファ ンド(適格機関投資家向け)	10,313,671円	10,473,598円
D I A M世界バランスファンド 55V A (適格機関投資家限 定)	7,515,147円	3,264,836円
D I A M世界バランスファンド 35V A (適格機関投資家限 定)	53,426,835円	43,332,278円
D I A M世界アセットバランス ファンド2V A (適格機関投資 家限定)	10,173,625,675円	6,203,658,970円
D I A M世界アセットバランス ファンド40V A (適格機関投 資家限定)	263,061,519円	67,064,830円
D I A M世界アセットバランス ファンド25V A (適格機関投 資家限定)	1,754,414,038円	1,324,826,125円
D I A M世界アセットバランス ファンド3V A (適格機関投資 家限定)	10,028,075,180円	9,119,340,643円
D I A Mバランス30V A (適 格機関投資家限定)	4,777,580円	4,787,332円
D I A Mバランス50V A (適 格機関投資家限定)	109,973円	302,200円
D I A Mバランス70V A (適 格機関投資家限定)	3,856,479円	1,034,565円
D I A M世界アセットバランス ファンド4V A (適格機関投資 家限定)	8,967,824,102円	9,172,211,524円
D I A M世界バランス25V A (適格機関投資家限定)	69,206,110円	63,971,723円
D I A M国内バランス30V A (適格機関投資家限定)	28,070,236円	26,027,179円
D I A Mバランス20V A (適 格機関投資家限定)	25,624,221円	26,002,777円
D I A Mバランス40V A (適 格機関投資家限定)	102,630円	107,999円
D I A Mバランス60V A (適 格機関投資家限定)	115,943円	122,524円

	D I A M世界アセットバランス ファンド7 V A (1 2 1 2) (適格機関投資家限定)	405,365,089円	426,124,037円
	D I A M世界アセットバランス ファンド7 V A (1 3 0 3) (適格機関投資家限定)	1,261,532,817円	1,335,152,689円
	D I A M世界アセットバランス ファンド7 V A (1 3 0 6) (適格機関投資家限定)	1,669,062,351円	1,766,916,070円
	D I A M世界アセットバランス ファンド7 V A (1 3 0 9) (適格機関投資家限定)	68,825,151円	72,976,941円
	計	108,683,534,206円	107,008,719,801円
2 .	受益権の総数	108,683,534,206口	107,008,719,801口
3 .	2 差入代用有価証券	株式 3,516,000,000円	株式 3,171,500,000円

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成30年6月5日 至 平成30年12月3日	自 平成30年12月4日 至 令和1年6月3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30年12月3日現在	令和1年6月3日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成30年12月3日現在	令和1年6月3日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
株式	8,837,817,902	11,371,615,957
合計	8,837,817,902	11,371,615,957

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(平成30年2月8日から平成30年12月3日まで及び平成31年2月8日から令和1年6月3日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

株式関連

種類	平成30年12月3日 現在				令和1年6月3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	7,499,560,000	-	7,725,585,000	226,025,000	4,370,879,000	-	4,265,025,000	105,854,000
合計	7,499,560,000	-	7,725,585,000	226,025,000	4,370,879,000	-	4,265,025,000	105,854,000

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成30年12月3日現在	令和1年6月3日現在
1口当たり純資産額	2.6037円	2.3418円
(1万口当たり純資産額)	(26,037円)	(23,418円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

令和1年6月3日現在

銘柄	株式数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
極洋	5,100	2,641.00	13,469,100	
日本水産	154,800	640.00	99,072,000	
マルハニチロ	22,400	3,240.00	72,576,000	
ハウスイ	900	820.00	738,000	
カネコ種苗	4,600	1,330.00	6,118,000	
サカタのタネ	18,800	3,195.00	60,066,000	
ホクト	12,900	1,784.00	23,013,600	
ホクリヨウ	2,100	592.00	1,243,200	
ヒノキヤグループ	4,400	2,001.00	8,804,400	
ショーボンドホールディングス	11,000	7,500.00	82,500,000	
ミライト・ホールディングス	43,600	1,671.00	72,855,600	
タマホーム	7,600	964.00	7,326,400	
サンヨーホームズ	2,400	635.00	1,524,000	
日本アクア	4,000	438.00	1,752,000	
ファーストコーポレーション	4,600	737.00	3,390,200	
ベステラ	3,100	1,253.00	3,884,300	
TATERU	19,400	218.00	4,229,200	
スペースバリューホールディングス	19,200	520.00	9,984,000	
住石ホールディングス	34,900	110.00	3,839,000	
日鉄鉱業	3,600	4,220.00	15,192,000	
三井松島ホールディングス	6,500	1,186.00	7,709,000	
国際石油開発帝石	620,200	862.30	534,798,460	
石油資源開発	22,200	2,181.00	48,418,200	
K&Oエナジーグループ	7,500	1,564.00	11,730,000	
ダイセキ環境ソリューション	3,200	609.00	1,948,800	
第一カッター興業	1,900	1,630.00	3,097,000	
安藤・間	99,300	709.00	70,403,700	
東急建設	45,300	764.00	34,609,200	
コムシスホールディングス	54,800	2,598.00	142,370,400	
ミサワホーム	12,300	959.00	11,795,700	
ピーアールホールディングス	13,100	336.00	4,401,600	
高松コンストラクショングループ	9,600	2,272.00	21,811,200	
東建コーポレーション	4,800	6,420.00	30,816,000	
ソネック	1,700	767.00	1,303,900	
ヤマウラ	6,300	813.00	5,121,900	
大成建設	127,000	4,065.00	516,255,000	
大林組	382,500	1,020.00	390,150,000	
清水建設	390,400	904.00	352,921,600	
飛島建設	10,900	1,246.00	13,581,400	
長谷工コーポレーション	159,500	1,081.00	172,419,500	
松井建設	13,900	608.00	8,451,200	
銭高組	1,500	4,375.00	6,562,500	
鹿島建設	299,100	1,488.00	445,060,800	

不動テトラ	8,900	1,318.00	11,730,200
大末建設	4,700	919.00	4,319,300
鉄建建設	7,800	2,892.00	22,557,600
西松建設	27,400	2,046.00	56,060,400
三井住友建設	92,000	603.00	55,476,000
大豊建設	8,700	2,714.00	23,611,800
前田建設工業	90,900	897.00	81,537,300
佐田建設	8,400	351.00	2,948,400
ナカノフドー建設	10,000	430.00	4,300,000
奥村組	21,000	3,285.00	68,985,000
東鉄工業	15,300	3,010.00	46,053,000
イチケン	2,400	1,654.00	3,969,600
富士ピー・エス	4,300	445.00	1,913,500
浅沼組	4,600	3,535.00	16,261,000
戸田建設	148,200	602.00	89,216,400
熊谷組	18,200	2,896.00	52,707,200
青木あすなろ建設	6,200	797.00	4,941,400
北野建設	2,700	2,630.00	7,101,000
植木組	1,500	2,082.00	3,123,000
矢作建設工業	17,100	708.00	12,106,800
ピーエス三菱	13,700	596.00	8,165,200
日本ハウスホールディングス	24,600	403.00	9,913,800
大東建託	45,500	14,175.00	644,962,500
新日本建設	15,200	875.00	13,300,000
N I P P O	33,700	2,149.00	72,421,300
東亜道路工業	2,400	2,988.00	7,171,200
前田道路	39,900	2,192.00	87,460,800
日本道路	3,500	6,040.00	21,140,000
東亜建設工業	11,100	1,432.00	15,895,200
日本国土開発	21,300	560.00	11,928,000
若築建設	6,500	1,301.00	8,456,500
東洋建設	46,600	404.00	18,826,400
五洋建設	151,900	488.00	74,127,200
世紀東急工業	18,900	615.00	11,623,500
福田組	4,100	4,235.00	17,363,500
日本ドライケミカル	3,300	1,090.00	3,597,000
住友林業	90,200	1,233.00	111,216,600
日本基礎技術	13,600	363.00	4,936,800
バコーボレーション	16,100	331.00	5,329,100
大和ハウス工業	353,300	3,258.00	1,151,051,400
ライト工業	24,600	1,316.00	32,373,600
積水ハウス	390,400	1,734.00	676,953,600
日特建設	11,200	589.00	6,596,800
北陸電気工事	6,200	827.00	5,127,400
ユアテック	20,300	720.00	14,616,000
四電工	1,900	2,642.00	5,019,800
中電工	16,300	2,211.00	36,039,300
関電工	57,900	867.00	50,199,300
きんでん	84,700	1,662.00	140,771,400
東京エネシス	13,100	890.00	11,659,000

トーエネック	3,600	2,947.00	10,609,200
住友電設	8,800	1,650.00	14,520,000
日本電設工業	21,700	2,275.00	49,367,500
協和エクシオ	50,000	2,528.00	126,400,000
新日本空調	10,700	1,700.00	18,190,000
日本工営	7,400	2,363.00	17,486,200
九電工	25,200	3,045.00	76,734,000
三機工業	28,800	1,196.00	34,444,800
日揮	109,900	1,373.00	150,892,700
中外炉工業	3,600	1,563.00	5,626,800
ヤマト	11,600	531.00	6,159,600
太平電業	8,600	2,088.00	17,956,800
高砂熱学工業	30,900	1,660.00	51,294,000
三晃金属工業	1,500	2,420.00	3,630,000
N E C ネットズエスアイ	12,300	2,661.00	32,730,300
朝日工業社	2,700	2,370.00	6,399,000
明星工業	22,900	652.00	14,930,800
大気社	17,400	3,180.00	55,332,000
ダイダン	8,500	2,102.00	17,867,000
日比谷総合設備	11,500	1,838.00	21,137,000
東芝プラントシステム	27,600	1,931.00	53,295,600
日本製粉	36,100	1,778.00	64,185,800
日清製粉グループ本社	129,000	2,519.00	324,951,000
日東富士製粉	800	5,900.00	4,720,000
昭和産業	10,400	3,045.00	31,668,000
鳥越製粉	10,400	736.00	7,654,400
中部飼料	13,900	1,121.00	15,581,900
フィード・ワン	77,400	171.00	13,235,400
東洋精糖	1,800	966.00	1,738,800
日本甜菜製糖	6,400	1,869.00	11,961,600
三井製糖	9,000	2,279.00	20,511,000
塩水港精糖	12,900	201.00	2,592,900
日新製糖	5,300	1,810.00	9,593,000
L I F U L L	38,200	590.00	22,538,000
ジェイエイシーリクルートメント	8,800	2,485.00	21,868,000
日本M&Aセンター	81,200	2,621.00	212,825,200
メンバーズ	3,800	1,790.00	6,802,000
中広	1,100	551.00	606,100
タケエイ	11,700	888.00	10,389,600
E・Jホールディングス	1,400	1,058.00	1,481,200
トラスト・テック	5,600	3,015.00	16,884,000
コシダカホールディングス	26,300	1,406.00	36,977,800
アルトナー	2,100	721.00	1,514,100
パソナグループ	13,300	1,641.00	21,825,300
C D S	2,900	1,263.00	3,662,700
リンクアンドモチベーション	20,300	584.00	11,855,200
G C A	11,300	691.00	7,808,300
エス・エム・エス	40,100	2,605.00	104,460,500
パーソルホールディングス	108,900	2,342.00	255,043,800
リニカル	6,200	1,103.00	6,838,600

クックパッド	35,100	310.00	10,881,000
エスクリ	3,300	719.00	2,372,700
アイ・ケイ・ケイ	5,600	640.00	3,584,000
森永製菓	28,700	4,870.00	139,769,000
中村屋	3,000	4,235.00	12,705,000
江崎グリコ	34,400	5,090.00	175,096,000
名糖産業	5,600	1,408.00	7,884,800
井村屋グループ	4,900	2,113.00	10,353,700
不二家	6,300	1,926.00	12,133,800
山崎製パン	93,500	1,613.00	150,815,500
第一屋製パン	2,000	991.00	1,982,000
モロゾフ	1,900	4,910.00	9,329,000
亀田製菓	7,100	4,770.00	33,867,000
寿スピリッツ	12,200	5,530.00	67,466,000
カルビー	52,000	3,090.00	160,680,000
森永乳業	22,900	3,855.00	88,279,500
六甲バター	8,400	1,959.00	16,455,600
ヤクルト本社	84,700	6,220.00	526,834,000
明治ホールディングス	81,000	7,560.00	612,360,000
雪印メグミルク	27,500	2,145.00	58,987,500
プリマハム	16,100	2,064.00	33,230,400
日本ハム	47,300	4,395.00	207,883,500
林兼産業	3,900	581.00	2,265,900
丸大食品	12,200	1,898.00	23,155,600
S Foods	10,300	3,645.00	37,543,500
伊藤ハム米久ホールディングス	73,200	653.00	47,799,600
学情	4,600	1,085.00	4,991,000
スタジオアリス	5,400	2,012.00	10,864,800
クロスキャット	3,100	970.00	3,007,000
シミックホールディングス	6,100	2,002.00	12,212,200
システナ	40,000	1,588.00	63,520,000
NJS	2,600	1,665.00	4,329,000
デジタルアーツ	6,000	8,580.00	51,480,000
日鉄ソリューションズ	16,800	3,310.00	55,608,000
総合警備保障	43,400	5,240.00	227,416,000
キューブシステム	6,200	852.00	5,282,400
いちご	143,000	317.00	45,331,000
エイジア	2,400	1,028.00	2,467,200
日本駐車場開発	124,400	169.00	21,023,600
コア	4,900	1,457.00	7,139,300
カカクコム	81,600	2,197.00	179,275,200
アイロムグループ	4,200	1,509.00	6,337,800
セントケア・ホールディング	6,300	473.00	2,979,900
サイネックス	1,800	624.00	1,123,200
ルネサンス	6,100	1,847.00	11,266,700
ディップ	17,700	1,618.00	28,638,600
SBSホールディングス	11,300	1,649.00	18,633,700
オプトホールディング	6,700	1,375.00	9,212,500
新日本科学	14,900	689.00	10,266,100
ツクイ	25,800	521.00	13,441,800

キャリアデザインセンター	2,900	1,508.00	4,373,200
ベネフィット・ワン	30,300	2,095.00	63,478,500
エムスリー	229,200	2,010.00	460,692,000
ツカダ・グローバルホールディング	6,600	597.00	3,940,200
プラス	800	610.00	488,000
アウトソーシング	57,600	1,083.00	62,380,800
ウェルネット	10,500	990.00	10,395,000
ワールドホールディングス	3,100	1,499.00	4,646,900
ディー・エヌ・エー	58,800	2,212.00	130,065,600
博報堂DYホールディングス	151,300	1,719.00	260,084,700
ぐるなび	15,500	577.00	8,943,500
タカミヤ	11,700	754.00	8,821,800
ジャパンベストレスキューシステム	7,500	1,167.00	8,752,500
ファンコミュニケーションズ	30,200	516.00	15,583,200
ライク	4,400	1,183.00	5,205,200
ビジネス・ブレークスルー	4,900	345.00	1,690,500
WDBホールディングス	5,000	2,580.00	12,900,000
ティア	5,400	624.00	3,369,600
CDG	1,000	1,256.00	1,256,000
パリュコマース	7,400	2,570.00	19,018,000
インフォーマット	59,700	1,650.00	98,505,000
サッポロホールディングス	41,700	2,242.00	93,491,400
アサヒグループホールディングス	239,400	4,813.00	1,152,232,200
キリンホールディングス	517,000	2,368.00	1,224,256,000
宝ホールディングス	85,700	1,158.00	99,240,600
オエノンホールディングス	32,800	360.00	11,808,000
養命酒製造	3,500	2,008.00	7,028,000
コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールディングス	87,500	2,477.00	216,737,500
サントリー食品インターナショナル	76,500	4,500.00	344,250,000
ダイドーグループホールディングス	6,400	4,520.00	28,928,000
伊藤園	34,800	5,150.00	179,220,000
キーコーヒー	11,200	2,084.00	23,340,800
ユニカフェ	3,300	979.00	3,230,700
ジャパンフーズ	1,700	1,143.00	1,943,100
日清オイリオグループ	14,700	3,170.00	46,599,000
不二製油グループ本社	27,900	3,225.00	89,977,500
かどや製油	1,200	4,110.00	4,932,000
J-オイルミルズ	5,900	3,975.00	23,452,500
ローソン	28,300	4,995.00	141,358,500
サンエー	8,500	4,205.00	35,742,500
カワチ薬品	8,700	1,920.00	16,704,000
エービーシー・マート	17,500	6,740.00	117,950,000
ハードオフコーポレーション	4,600	694.00	3,192,400
高千穂交易	4,500	966.00	4,347,000
アスクル	11,800	2,605.00	30,739,000
ゲオホールディングス	17,100	1,352.00	23,119,200
アダストリア	15,500	2,603.00	40,346,500
ジーフット	6,400	635.00	4,064,000
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	1,500	684.00	1,026,000

伊藤忠食品	2,800	4,265.00	11,942,000
くら寿司	6,600	4,160.00	27,456,000
キャンドウ	5,500	1,649.00	9,069,500
エレマテック	10,400	957.00	9,952,800
パルグループホールディングス	5,700	3,295.00	18,781,500
JALUX	3,300	2,797.00	9,230,100
エディオン	47,500	944.00	44,840,000
あらた	8,300	3,700.00	30,710,000
サーラコーポレーション	22,600	552.00	12,475,200
ワッツ	3,900	681.00	2,655,900
トーメンデバイス	1,700	2,246.00	3,818,200
ハローズ	4,200	2,131.00	8,950,200
J Pホールディングス	31,500	271.00	8,536,500
フジオフードシステム	4,700	2,842.00	13,357,400
あみやき亭	2,500	3,300.00	8,250,000
東京エレクトロン デバイス	4,100	1,816.00	7,445,600
ひらまつ	22,700	332.00	7,536,400
フィールズ	10,000	512.00	5,120,000
双日	619,600	341.00	211,283,600
アルフレッサ ホールディングス	124,500	2,697.00	335,776,500
大黒天物産	2,700	3,385.00	9,139,500
ハニーズホールディングス	10,000	955.00	9,550,000
ファーマライズホールディングス	2,800	517.00	1,447,600
キッコーマン	75,400	4,585.00	345,709,000
味の素	252,400	1,847.00	466,182,800
キュービー	63,600	2,411.00	153,339,600
ハウス食品グループ本社	42,700	4,380.00	187,026,000
カゴメ	45,700	2,505.00	114,478,500
焼津水産化学工業	5,600	1,088.00	6,092,800
アリアケジャパン	10,400	6,810.00	70,824,000
ピエトロ	1,600	1,590.00	2,544,000
エバラ食品工業	2,700	2,068.00	5,583,600
ニチレイ	59,400	2,668.00	158,479,200
横浜冷凍	30,100	925.00	27,842,500
東洋水産	58,800	4,210.00	247,548,000
イートアンド	4,100	1,614.00	6,617,400
大冷	1,300	1,808.00	2,350,400
ヨシムラ・フード・ホールディングス	3,300	834.00	2,752,200
日清食品ホールディングス	48,600	6,490.00	315,414,000
永谷園ホールディングス	6,000	2,105.00	12,630,000
一正蒲鉾	4,600	1,127.00	5,184,200
フジッコ	12,400	2,117.00	26,250,800
ロック・フィールド	12,400	1,574.00	19,517,600
日本たばこ産業	659,700	2,474.00	1,632,097,800
ケンコーマヨネーズ	6,400	2,290.00	14,656,000
わらべや日洋ホールディングス	7,500	1,614.00	12,105,000
なとり	6,400	1,532.00	9,804,800
イフジ産業	2,100	651.00	1,367,100
ピックルスコーポレーション	2,900	1,870.00	5,423,000
北の達人コーポレーション	45,100	601.00	27,105,100

ユーグレナ	49,000	856.00	41,944,000
スター・マイカ・ホールディングス	5,100	1,377.00	7,022,700
片倉工業	13,700	1,179.00	16,152,300
グンゼ	7,500	4,395.00	32,962,500
ヒューリック	234,300	852.00	199,623,600
神栄	1,600	755.00	1,208,000
ラサ商事	6,200	760.00	4,712,000
アルペン	8,500	1,629.00	13,846,500
ハブ	3,700	1,232.00	4,558,400
ラクーンホールディングス	5,600	623.00	3,488,800
クオールホールディングス	16,600	1,418.00	23,538,800
アルコニックス	12,000	1,253.00	15,036,000
神戸物産	17,000	4,970.00	84,490,000
ソリトンシステムズ	6,400	915.00	5,856,000
ジinz	5,900	6,400.00	37,760,000
ビックカメラ	66,500	1,096.00	72,884,000
DCMホールディングス	60,500	1,079.00	65,279,500
ペッパーフードサービス	8,900	1,835.00	16,331,500
MonotaRO	71,000	2,250.00	159,750,000
東京一番フーズ	2,600	596.00	1,549,600
DDホールディングス	2,600	1,875.00	4,875,000
あいホールディングス	16,100	1,625.00	26,162,500
ディービーエックス	4,200	792.00	3,326,400
きちりホールディングス	3,200	726.00	2,323,200
アークランドサービスホールディングス	8,300	1,880.00	15,604,000
J.フロントリテイリング	143,300	1,124.00	161,069,200
ドトール・日レスホールディングス	19,700	2,078.00	40,936,600
マツモトキヨシホールディングス	46,400	3,150.00	146,160,000
ブロンコビリー	5,900	2,157.00	12,726,300
ZOZO	121,300	1,788.00	216,884,400
トレジャー・ファクトリー	3,600	779.00	2,804,400
物語コーポレーション	2,800	8,290.00	23,212,000
ココカラファイン	12,600	4,910.00	61,866,000
三越伊勢丹ホールディングス	209,700	900.00	188,730,000
東洋紡	47,100	1,149.00	54,117,900
ユニチカ	32,800	330.00	10,824,000
富士紡ホールディングス	5,800	2,246.00	13,026,800
日清紡ホールディングス	62,900	735.00	46,231,500
倉敷紡績	10,500	1,876.00	19,698,000
ダイワボウホールディングス	10,200	4,400.00	44,880,000
シキボウ	5,700	927.00	5,283,900
日東紡績	17,000	1,924.00	32,708,000
トヨタ紡織	39,800	1,337.00	53,212,600
マクニカ・富士エレホールディングス	31,100	1,290.00	40,119,000
Hamee	3,200	617.00	1,974,400
ラクト・ジャパン	4,900	4,215.00	20,653,500
ウエルシアホールディングス	29,700	3,870.00	114,939,000
クリエイトSDホールディングス	16,600	2,335.00	38,761,000

バイタルケーエスケー・ホールディングス	21,000	1,047.00	21,987,000
八洲電機	8,900	785.00	6,986,500
メディアスホールディングス	6,600	719.00	4,745,400
レスターホールディングス	12,300	1,423.00	17,502,900
ジューテックホールディングス	2,700	911.00	2,459,700
丸善CHIホールディングス	12,900	373.00	4,811,700
大光	3,100	602.00	1,866,200
OCHIホールディングス	3,400	1,104.00	3,753,600
TOKAIホールディングス	59,200	885.00	52,392,000
黒谷	2,000	436.00	872,000
ミサワ	2,200	401.00	882,200
ティーライフ	1,600	814.00	1,302,400
Cominix	1,900	841.00	1,597,900
エー・ピーカンパニー	2,400	429.00	1,029,600
三洋貿易	5,700	2,216.00	12,631,200
チムニー	3,400	2,461.00	8,367,400
シュッピン	7,800	810.00	6,318,000
ビューティガレージ	1,800	1,204.00	2,167,200
ウイン・パートナーズ	7,300	1,036.00	7,562,800
ネクステージ	17,600	1,124.00	19,782,400
ジョイフル本田	32,600	1,214.00	39,576,400
鳥貴族	3,800	1,875.00	7,125,000
キリン堂ホールディングス	4,500	1,580.00	7,110,000
ホットランド	6,000	1,562.00	9,372,000
すかいらくホールディングス	104,600	1,919.00	200,727,400
SFPホールディングス	4,800	1,821.00	8,740,800
綿半ホールディングス	4,200	2,262.00	9,500,400
日本毛織	36,400	831.00	30,248,400
ダイトウボウ	19,100	80.00	1,528,000
トーア紡コーポレーション	5,000	422.00	2,110,000
ダイドーリミテッド	13,800	309.00	4,264,200
ヨシックス	1,800	2,334.00	4,201,200
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	32,600	925.00	30,155,000
三栄建築設計	4,600	1,433.00	6,591,800
野村不動産ホールディングス	74,800	2,235.00	167,178,000
三重交通グループホールディングス	22,800	593.00	13,520,400
サムティ	15,600	1,415.00	22,074,000
ディア・ライフ	14,900	417.00	6,213,300
コーセーアールイー	3,600	743.00	2,674,800
エー・ディー・ワークス	172,000	33.00	5,676,000
日本商業開発	7,200	1,432.00	10,310,400
プレサンスコーポレーション	18,000	1,352.00	24,336,000
ユニゾホールディングス	17,000	1,819.00	30,923,000
THEグローバル社	5,500	574.00	3,157,000
日本管理センター	7,600	1,075.00	8,170,000
サンセイランディック	3,300	701.00	2,313,300
エストラスト	1,600	692.00	1,107,200
フージャースホールディングス	24,700	595.00	14,696,500

オープンハウス	16,400	4,430.00	72,652,000
東急不動産ホールディングス	302,100	604.00	182,468,400
飯田グループホールディングス	93,600	1,709.00	159,962,400
イーグランド	1,600	632.00	1,011,200
ムゲンエステート	8,100	555.00	4,495,500
帝国繊維	12,600	2,229.00	28,085,400
日本コークス工業	96,800	91.00	8,808,800
ゴルフダイジェスト・オンライン	4,700	663.00	3,116,100
ミタチ産業	3,000	666.00	1,998,000
B E E N O S	2,800	1,938.00	5,426,400
あさひ	9,400	1,295.00	12,173,000
日本調剤	4,000	3,520.00	14,080,000
コスモス薬品	4,900	17,260.00	84,574,000
シップヘルスケアホールディングス	23,400	4,600.00	107,640,000
トーエル	5,700	686.00	3,910,200
ソフトクリエイトホールディングス	5,000	1,555.00	7,775,000
オンリー	2,000	793.00	1,586,000
セブン&アイ・ホールディングス	470,000	3,618.00	1,700,460,000
薬王堂	4,900	2,147.00	10,520,300
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	30,300	1,406.00	42,601,800
明治電機工業	3,600	1,285.00	4,626,000
ツルハホールディングス	24,300	8,650.00	210,195,000
デリカフーズホールディングス	2,100	1,471.00	3,089,100
スターティアホールディングス	2,200	510.00	1,122,000
サンマルクホールディングス	8,800	2,331.00	20,512,800
フェリシモ	2,600	939.00	2,441,400
トリドールホールディングス	13,900	1,848.00	25,687,200
帝人	90,700	1,724.00	156,366,800
東レ	865,000	736.10	636,726,500
クラレ	188,100	1,240.00	233,244,000
旭化成	793,300	1,091.50	865,886,950
サカイオーベックス	2,800	1,641.00	4,594,800
T O K Y O B A S E	10,100	788.00	7,958,800
稲葉製作所	6,300	1,380.00	8,694,000
宮地エンジニアリンググループ	3,500	1,642.00	5,747,000
トーカロ	29,100	683.00	19,875,300
アルファ	4,100	1,159.00	4,751,900
S U M C O	124,500	1,169.00	145,540,500
川田テクノロジーズ	2,600	7,910.00	20,566,000
R S T e c h n o l o g i e s	2,400	2,235.00	5,364,000
信和	6,100	955.00	5,825,500
ビーロッド	1,800	1,836.00	3,304,800
ファーストブラザーズ	3,200	1,010.00	3,232,000
ハウズドゥ	4,500	1,251.00	5,629,500
シーアールイー	3,000	958.00	2,874,000
プロパティエージェント	1,100	851.00	936,100
ケイアイスター不動産	3,200	1,457.00	4,662,400
アグレ都市デザイン	1,500	453.00	679,500
グッドコムアセット	2,000	1,387.00	2,774,000

ジェイ・エス・ビー	400	3,500.00	1,400,000	
住江織物	3,300	2,771.00	9,144,300	
日本フェルト	6,300	455.00	2,866,500	
イチカワ	1,600	1,358.00	2,172,800	
エコナックホールディングス	21,200	122.00	2,586,400	
日東製網	1,400	1,301.00	1,821,400	
芦森工業	2,500	1,521.00	3,802,500	
アツギ	9,200	900.00	8,280,000	
ウイルプラスホールディングス	1,100	752.00	827,200	
ジャパンミート	5,700	1,646.00	9,382,200	
コメダホールディングス	26,100	2,066.00	53,922,600	
サツドラホールディングス	1,700	1,786.00	3,036,200	
デファクトスタンダード	700	336.00	235,200	
アレンザホールディングス	6,100	819.00	4,995,900	
パロックジャパンリミテッド	9,100	893.00	8,126,300	
クスリのアオキホールディングス	11,100	6,930.00	76,923,000	
ダイニック	4,600	711.00	3,270,600	
共和レザー	7,100	763.00	5,417,300	
力の源ホールディングス	3,300	684.00	2,257,200	
スシローグローバルホールディングス	12,400	7,600.00	94,240,000	
LIXILビバ	9,400	1,198.00	11,261,200	
セーレン	27,500	1,338.00	36,795,000	
ソトー	4,500	968.00	4,356,000	
東海染工	1,600	1,126.00	1,801,600	
小松マテーレ	18,300	748.00	13,688,400	
ワコールホールディングス	32,300	2,680.00	86,564,000	
ホギメディカル	13,900	3,420.00	47,538,000	
レナウン	33,400	95.00	3,173,000	
クラウドシアホールディングス	3,000	495.00	1,485,000	
T S Iホールディングス	41,100	631.00	25,934,100	
マツオカコーポレーション	3,600	2,572.00	9,259,200	
ワールド	14,600	2,147.00	31,346,200	
T I S	37,200	5,360.00	199,392,000	
ネオス	4,200	715.00	3,003,000	
電算システム	4,400	3,790.00	16,676,000	
グリー	77,800	486.00	37,810,800	
コーエーテックモホールディングス	22,800	1,992.00	45,417,600	
三菱総合研究所	4,500	3,165.00	14,242,500	
ボルテージ	2,100	530.00	1,113,000	
電算	1,300	1,906.00	2,477,800	
A G S	6,500	646.00	4,199,000	
ファインデックス	9,600	854.00	8,198,400	
ブレインパッド	2,100	7,710.00	16,191,000	
K L a b	20,100	769.00	15,456,900	
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	14,900	1,031.00	15,361,900	
イーブックイニシアティブジャパン	1,800	1,933.00	3,479,400	
ネクソン	285,100	1,641.00	467,849,100	
アイスタイル	28,800	724.00	20,851,200	
エムアップ	3,900	2,070.00	8,073,000	

エイチーム	7,200	1,418.00	10,209,600
エニグモ	4,000	3,070.00	12,280,000
テクノスジャパン	9,800	536.00	5,252,800
e n i s h	4,200	517.00	2,171,400
コロプラ	36,500	841.00	30,696,500
オルトプラス	7,300	223.00	1,627,900
ブロードリーフ	55,600	531.00	29,523,600
クロス・マーケティンググループ	3,400	343.00	1,166,200
デジタルハーツホールディングス	5,300	1,001.00	5,305,300
システム情報	5,800	777.00	4,506,600
メディアドゥホールディングス	3,500	3,175.00	11,112,500
じげん	12,300	707.00	8,696,100
ブイキューブ	6,200	513.00	3,180,600
サイバーリンクス	1,800	1,070.00	1,926,000
ディー・エル・イー	7,500	155.00	1,162,500
フィックスターズ	10,900	1,776.00	19,358,400
C A R T A H O L D I N G S	5,500	1,638.00	9,009,000
オブティム	4,900	2,810.00	13,769,000
セレス	3,700	1,730.00	6,401,000
特種東海製紙	7,100	3,590.00	25,489,000
ティーガイア	11,100	1,750.00	19,425,000
セック	1,800	3,160.00	5,688,000
日本アジアグループ	12,200	334.00	4,074,800
豆蔵ホールディングス	7,800	1,228.00	9,578,400
テクマトリックス	8,000	1,825.00	14,600,000
プロシップ	3,300	1,132.00	3,735,600
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	269,500	330.00	88,935,000
GMOペイメントゲートウェイ	18,400	7,390.00	135,976,000
ザッパラス	5,900	383.00	2,259,700
システムリサーチ	1,500	2,781.00	4,171,500
インターネットイニシアティブ	18,300	2,049.00	37,496,700
さくらインターネット	13,800	486.00	6,706,800
ヴィンクス	3,900	1,279.00	4,988,100
GMOクラウド	2,600	3,055.00	7,943,000
S R Aホールディングス	5,900	2,382.00	14,053,800
MINORIソリューションズ	2,200	1,630.00	3,586,000
システムインテグレータ	3,400	636.00	2,162,400
朝日ネット	9,400	573.00	5,386,200
e B A S E	6,900	1,022.00	7,051,800
アバント	3,300	1,880.00	6,204,000
アドソル日進	4,100	1,605.00	6,580,500
フリービット	6,700	975.00	6,532,500
コムチュア	6,300	4,360.00	27,468,000
サイバーコム	2,000	1,909.00	3,818,000
アステリア	5,800	1,000.00	5,800,000
王子ホールディングス	502,000	561.00	281,622,000
日本製紙	53,500	1,851.00	99,028,500
三菱製紙	18,000	561.00	10,098,000
北越コーポレーション	73,800	528.00	38,966,400

中越パルプ工業	4,800	1,354.00	6,499,200
巴川製紙所	3,900	900.00	3,510,000
大王製紙	54,300	1,235.00	67,060,500
阿波製紙	3,100	419.00	1,298,900
マークライズ	4,000	1,831.00	7,324,000
メディカル・データ・ビジョン	10,000	1,417.00	14,170,000
gumi	13,900	532.00	7,394,800
ショーケース	2,600	517.00	1,344,200
モバイルファクトリー	3,200	1,384.00	4,428,800
テラスカイ	1,400	1,424.00	1,993,600
デジタル・インフォメーション・テクノロジ	5,000	1,723.00	8,615,000
PCIホールディングス	2,000	1,920.00	3,840,000
パイプドHD	1,800	1,048.00	1,886,400
アイビーシー	1,900	1,266.00	2,405,400
ネオジャパン	2,200	896.00	1,971,200
PR TIMES	700	2,793.00	1,955,100
ランドコンピュータ	1,300	1,149.00	1,493,700
ダブルスタンダード	700	4,320.00	3,024,000
オープンドア	5,600	3,060.00	17,136,000
マイネット	3,700	740.00	2,738,000
アカツキ	4,000	5,500.00	22,000,000
ベネフィットジャパン	600	823.00	493,800
Ubicomホールディングス	2,100	1,576.00	3,309,600
LINE	34,200	3,085.00	105,507,000
カナミックネットワーク	1,700	2,086.00	3,546,200
ノムラシステムコーポレーション	900	719.00	647,100
レンゴー	115,100	853.00	98,180,300
トーモク	6,900	1,720.00	11,868,000
ザ・バック	8,500	3,095.00	26,307,500
チェンジ	1,500	2,698.00	4,047,000
シンクロ・フード	5,000	559.00	2,795,000
オークネット	6,000	1,250.00	7,500,000
AOI TYO HOLDINGS	12,300	703.00	8,646,900
マクロミル	19,900	1,183.00	23,541,700
ビーグリー	2,200	823.00	1,810,600
オロ	3,100	2,756.00	8,543,600
昭和電工	74,100	2,944.00	218,150,400
住友化学	877,100	465.00	407,851,500
住友精化	5,400	3,245.00	17,523,000
日産化学	68,500	4,505.00	308,592,500
ラサ工業	4,100	1,235.00	5,063,500
クレハ	10,300	6,640.00	68,392,000
多木化学	3,300	4,150.00	13,695,000
テイカ	9,100	2,225.00	20,247,500
石原産業	21,500	989.00	21,263,500
片倉コープアグリ	3,100	1,089.00	3,375,900
日東エフシー	7,100	1,199.00	8,512,900
日本曹達	17,600	2,600.00	45,760,000
東ソー	172,300	1,341.00	231,054,300

トクヤマ	32,200	2,338.00	75,283,600
セントラル硝子	24,300	2,389.00	58,052,700
東亜合成	69,900	1,175.00	82,132,500
大阪ソーダ	12,100	2,532.00	30,637,200
関東電化工業	26,600	691.00	18,380,600
デンカ	43,800	3,065.00	134,247,000
イビデン	69,700	1,666.00	116,120,200
信越化学工業	196,500	8,979.00	1,764,373,500
日本カーバイド工業	3,900	1,269.00	4,949,100
堺化学工業	7,500	2,399.00	17,992,500
第一稀元素化学工業	12,200	764.00	9,320,800
エア・ウォーター	91,200	1,606.00	146,467,200
大陽日酸	91,900	2,009.00	184,627,100
日本化学工業	3,800	1,651.00	6,273,800
東邦アセチレン	1,700	1,320.00	2,244,000
日本パーカライジング	60,700	1,196.00	72,597,200
高压ガス工業	17,600	796.00	14,009,600
チタン工業	1,400	2,532.00	3,544,800
四国化成工業	18,700	1,004.00	18,774,800
戸田工業	2,500	2,026.00	5,065,000
ステラ ケミファ	6,500	2,621.00	17,036,500
保土谷化学工業	3,900	2,480.00	9,672,000
日本触媒	18,700	6,590.00	123,233,000
大日精化工業	9,200	2,810.00	25,852,000
カネカ	28,800	3,660.00	105,408,000
協和発酵キリン	133,500	2,015.00	269,002,500
三菱瓦斯化学	114,600	1,351.00	154,824,600
三井化学	101,100	2,366.00	239,202,600
J S R	111,900	1,525.00	170,647,500
東京応化工業	19,100	3,065.00	58,541,500
大阪有機化学工業	10,400	921.00	9,578,400
三菱ケミカルホールディングス	745,200	703.70	524,397,240
K H ネオケム	17,000	2,820.00	47,940,000
ダイセル	164,200	920.00	151,064,000
住友ベークライト	19,300	3,615.00	69,769,500
積水化学工業	243,500	1,580.00	384,730,000
日本ゼオン	100,500	1,007.00	101,203,500
アイカ工業	33,400	3,585.00	119,739,000
宇部興産	56,200	2,029.00	114,029,800
積水樹脂	18,400	2,010.00	36,984,000
タキロンシーアイ	24,100	627.00	15,110,700
旭有機材	7,800	1,335.00	10,413,000
日立化成	51,600	2,940.00	151,704,000
ニチバン	5,900	2,255.00	13,304,500
リケンテクノス	30,500	463.00	14,121,500
大倉工業	5,700	1,688.00	9,621,600
積水化成成品工業	16,800	689.00	11,575,200
群栄化学工業	2,900	2,377.00	6,893,300
タイガースポリマー	6,100	569.00	3,470,900
ミライアル	3,400	1,013.00	3,444,200

ダイキアクシス	4,100	810.00	3,321,000
ダイキョーニシカワ	23,500	787.00	18,494,500
竹本容器	4,100	1,043.00	4,276,300
森六ホールディングス	5,900	2,309.00	13,623,100
日本化薬	71,000	1,263.00	89,673,000
カーリットホールディングス	12,200	618.00	7,539,600
E P Sホールディングス	16,500	1,770.00	29,205,000
ソルクシーズ	4,900	729.00	3,572,100
レグス	2,900	1,338.00	3,880,200
プレステージ・インターナショナル	20,400	1,444.00	29,457,600
フェイス	4,200	780.00	3,276,000
プロトコーポレーション	5,100	1,752.00	8,935,200
ハイマックス	1,400	1,744.00	2,441,600
アミューズ	6,600	2,509.00	16,559,400
野村総合研究所	71,100	5,260.00	373,986,000
ドリームインキュベータ	3,400	1,589.00	5,402,600
サイバネットシステム	9,400	646.00	6,072,400
クイック	6,900	1,579.00	10,895,100
T A C	6,600	194.00	1,280,400
C Eホールディングス	3,100	928.00	2,876,800
ケネディクス	95,700	519.00	49,668,300
日本システム技術	1,900	1,428.00	2,713,200
電通	132,600	3,565.00	472,719,000
インテージホールディングス	14,500	1,001.00	14,514,500
テイクアンドギヴ・ニーズ	4,300	1,021.00	4,390,300
東邦システムサイエンス	3,500	905.00	3,167,500
ぴあ	3,100	4,665.00	14,461,500
イオンファンタジー	3,500	2,198.00	7,693,000
ソースネクスト	43,700	435.00	19,009,500
シーティーエス	12,500	654.00	8,175,000
ネクシーズグループ	3,300	2,315.00	7,639,500
インフォコム	12,300	2,336.00	28,732,800
メディカルシステムネットワーク	12,200	491.00	5,990,200
日本精化	9,000	1,220.00	10,980,000
扶桑化学工業	11,300	1,883.00	21,277,900
トリケミカル研究所	2,600	4,525.00	11,765,000
F I G	10,300	294.00	3,028,200
A D E K A	54,900	1,505.00	82,624,500
日油	42,000	3,870.00	162,540,000
ミヨシ油脂	4,500	1,100.00	4,950,000
新日本理化	20,900	188.00	3,929,200
ハリマ化成グループ	9,300	953.00	8,862,900
アルテリア・ネットワークス	12,500	1,098.00	13,725,000
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	2,700	1,591.00	4,295,700
花王	276,400	8,496.00	2,348,294,400
第一工業製薬	4,200	2,795.00	11,739,000
石原ケミカル	2,900	1,434.00	4,158,600
日華化学	3,900	864.00	3,369,600
ニイタカ	1,800	1,380.00	2,484,000

三洋化成工業	7,500	5,550.00	41,625,000
武田薬品工業	994,000	3,572.00	3,550,568,000
アステラス製薬	1,049,700	1,472.00	1,545,158,400
大日本住友製薬	84,500	2,152.00	181,844,000
塩野義製薬	145,600	5,900.00	859,040,000
田辺三菱製薬	118,900	1,263.00	150,170,700
わかもと製薬	14,100	256.00	3,609,600
あすか製薬	14,100	1,118.00	15,763,800
日本新薬	29,900	7,460.00	223,054,000
バイオフェルミン製薬	1,800	2,283.00	4,109,400
中外製薬	118,700	7,180.00	852,266,000
科研製薬	20,600	5,120.00	105,472,000
エーザイ	136,300	6,342.00	864,414,600
理研ビタミン	5,400	3,430.00	18,522,000
ロート製薬	58,400	2,900.00	169,360,000
小野薬品工業	268,800	1,921.50	516,499,200
久光製薬	33,600	4,320.00	145,152,000
有機合成薬品工業	8,300	224.00	1,859,200
持田製薬	17,300	4,845.00	83,818,500
参天製薬	212,000	1,552.00	329,024,000
扶桑薬品工業	4,000	2,000.00	8,000,000
日本ケミファ	1,500	2,836.00	4,254,000
ツムラ	35,300	2,991.00	105,582,300
日医工	30,000	1,204.00	36,120,000
テルモ	322,200	3,050.00	982,710,000
みらかホールディングス	30,400	2,478.00	75,331,200
キッセイ薬品工業	20,000	2,518.00	50,360,000
生化学工業	22,100	1,215.00	26,851,500
栄研化学	20,000	1,839.00	36,780,000
日水製薬	4,800	1,184.00	5,683,200
鳥居薬品	6,100	2,272.00	13,859,200
JCRファーマ	8,100	6,570.00	53,217,000
東和薬品	16,500	2,595.00	42,817,500
富士製薬工業	7,800	1,397.00	10,896,600
沢井製薬	23,400	5,520.00	129,168,000
ゼリア新薬工業	22,600	2,008.00	45,380,800
第一三共	325,900	5,448.00	1,775,503,200
キョーリン製薬ホールディングス	25,100	1,857.00	46,610,700
大幸薬品	5,200	2,026.00	10,535,200
ダイト	6,600	3,500.00	23,100,000
大塚ホールディングス	216,900	3,588.00	778,237,200
大正製薬ホールディングス	25,500	8,790.00	224,145,000
ペプチドリーム	57,100	5,340.00	304,914,000
大日本塗料	12,500	953.00	11,912,500
日本ペイントホールディングス	92,000	4,300.00	395,600,000
関西ペイント	125,400	2,026.00	254,060,400
神東塗料	8,900	165.00	1,468,500
中国塗料	36,700	921.00	33,800,700
日本特殊塗料	8,500	1,116.00	9,486,000
藤倉化成	14,900	555.00	8,269,500

太陽ホールディングス	9,100	3,260.00	29,666,000
D I C	50,400	2,615.00	131,796,000
サカタイクス	24,400	919.00	22,423,600
東洋インキS Cホールディングス	23,400	2,228.00	52,135,200
T & K T O K A	8,600	929.00	7,989,400
アルプス技研	9,600	1,761.00	16,905,600
サニックス	19,700	201.00	3,959,700
ダイオーズ	2,700	1,324.00	3,574,800
日本空調サービス	12,700	665.00	8,445,500
オリエンタルランド	128,500	13,250.00	1,702,625,000
フォーカスシステムズ	7,600	814.00	6,186,400
ダスキン	27,900	2,820.00	78,678,000
パーク24	65,600	2,074.00	136,054,400
明光ネットワークジャパン	12,900	968.00	12,487,200
ファルコホールディングス	6,100	1,622.00	9,894,200
クレスコ	3,400	3,350.00	11,390,000
フジ・メディア・ホールディングス	115,800	1,466.00	169,762,800
秀英予備校	2,600	431.00	1,120,600
田谷	2,100	599.00	1,257,900
ラウンドワン	33,800	1,619.00	54,722,200
リゾートトラスト	46,000	1,676.00	77,096,000
オービック	38,800	13,110.00	508,668,000
ジャストシステム	16,000	3,300.00	52,800,000
T D C ソフト	10,100	760.00	7,676,000
ヤフー	729,500	313.00	228,333,500
ビー・エム・エル	14,100	3,030.00	42,723,000
ワタベウエディング	1,900	535.00	1,016,500
トレンドマイクロ	59,600	4,795.00	285,782,000
りらいあコミュニケーションズ	19,900	1,146.00	22,805,400
I Dホールディングス	3,400	1,034.00	3,515,600
リソー教育	55,600	444.00	24,686,400
日本オラクル	22,600	7,550.00	170,630,000
早稲田アカデミー	3,300	764.00	2,521,200
アルファシステムズ	3,500	2,755.00	9,642,500
フューチャー	15,200	1,856.00	28,211,200
C A C H o l d i n g s	8,200	1,606.00	13,169,200
ソフトバンク・テクノロジー	4,800	2,327.00	11,169,600
トーセ	3,100	793.00	2,458,300
ユー・エス・エス	132,900	2,063.00	274,172,700
オービックビジネスコンサルタント	11,500	4,860.00	55,890,000
伊藤忠テクノソリューションズ	50,900	2,655.00	135,139,500
アイティフォー	13,700	789.00	10,809,300
東京個別指導学院	3,900	901.00	3,513,900
東計電算	1,600	3,005.00	4,808,000
サイバーエージェント	62,700	4,110.00	257,697,000
楽天	507,400	1,113.00	564,736,200
エクスネット	2,200	908.00	1,997,600
クリーク・アンド・リバー社	6,500	1,176.00	7,644,000
テー・オー・ダブリュー	9,900	734.00	7,266,600
大塚商会	60,400	4,150.00	250,660,000

サイボウズ	13,200	1,120.00	14,784,000
ソフトブレーン	9,100	457.00	4,158,700
山田コンサルティンググループ	5,300	1,941.00	10,287,300
セントラルスポーツ	4,100	3,210.00	13,161,000
パラカ	3,000	1,950.00	5,850,000
電通国際情報サービス	7,000	3,260.00	22,820,000
デジタルガレージ	21,800	3,305.00	72,049,000
イーエムシステムズ	9,200	1,473.00	13,551,600
ウェザーニューズ	3,800	3,140.00	11,932,000
C I J	9,000	954.00	8,586,000
東洋ビジネスエンジニアリング	1,100	2,106.00	2,316,600
日本エンタープライズ	12,700	158.00	2,006,600
WOWOW	5,300	2,594.00	13,748,200
スカラ	8,100	851.00	6,893,100
インテリジェント ウェイブ	4,300	767.00	3,298,100
フルキャストホールディングス	10,900	2,003.00	21,832,700
エン・ジャパン	15,800	3,850.00	60,830,000
富士フイルムホールディングス	236,500	5,150.00	1,217,975,000
コニカミノルタ	248,700	946.00	235,270,200
資生堂	226,300	7,787.00	1,762,198,100
ライオン	158,600	2,078.00	329,570,800
高砂香料工業	7,900	3,005.00	23,739,500
マンダム	25,600	2,636.00	67,481,600
ミルボン	14,100	5,090.00	71,769,000
ファンケル	50,700	2,759.00	139,881,300
コーセー	19,300	16,720.00	322,696,000
コタ	6,000	1,150.00	6,900,000
シーボン	1,300	2,349.00	3,053,700
ポーラ・オルビスホールディングス	48,600	2,961.00	143,904,600
ノエビアホールディングス	10,800	5,580.00	60,264,000
アジュバンコスメジャパン	2,700	895.00	2,416,500
エステー	8,200	1,695.00	13,899,000
アグロ カネショウ	4,700	2,024.00	9,512,800
コニシ	20,100	1,488.00	29,908,800
長谷川香料	15,100	1,754.00	26,485,400
星光PMC	7,800	708.00	5,522,400
小林製薬	31,900	7,970.00	254,243,000
荒川化学工業	10,200	1,198.00	12,219,600
メック	8,000	999.00	7,992,000
日本高純度化学	3,300	2,307.00	7,613,100
タカラバイオ	29,900	2,183.00	65,271,700
JCU	14,800	1,962.00	29,037,600
新田ゼラチン	7,400	685.00	5,069,000
OATアグリオ	1,600	1,225.00	1,960,000
デクセリアルズ	29,300	665.00	19,484,500
アース製薬	8,600	4,840.00	41,624,000
北興化学工業	12,100	468.00	5,662,800
大成ラミック	3,700	2,781.00	10,289,700
クミアイ化学工業	47,100	716.00	33,723,600
日本農薬	20,400	399.00	8,139,600

富士興産	4,500	705.00	3,172,500
ニチレキ	14,600	995.00	14,527,000
ユシロ化学工業	5,900	1,243.00	7,333,700
ビーピー・カストロール	4,100	1,426.00	5,846,600
富士石油	28,400	252.00	7,156,800
MORESCO	4,300	1,348.00	5,796,400
出光興産	131,500	2,901.00	381,481,500
JXTGホールディングス	1,914,800	507.20	971,186,560
コスモエネルギーホールディングス	33,000	2,072.00	68,376,000
横浜ゴム	65,900	1,832.00	120,728,800
TOYO TIRE	58,600	1,362.00	79,813,200
ブリヂストン	350,000	4,082.00	1,428,700,000
住友ゴム工業	102,200	1,179.00	120,493,800
藤倉コンポジット	10,300	370.00	3,811,000
オカモト	8,000	4,645.00	37,160,000
アキレス	8,300	1,937.00	16,077,100
フコク	5,200	696.00	3,619,200
ニッタ	12,800	3,020.00	38,656,000
クリエートメディック	3,900	902.00	3,517,800
住友理工	21,900	761.00	16,665,900
三ツ星ベルト	15,000	1,943.00	29,145,000
パンドー化学	21,700	914.00	19,833,800
AGC	112,500	3,380.00	380,250,000
日本板硝子	54,500	680.00	37,060,000
石塚硝子	1,600	2,272.00	3,635,200
有沢製作所	18,000	733.00	13,194,000
日本山村硝子	4,800	1,390.00	6,672,000
日本電気硝子	49,200	2,571.00	126,493,200
オハラ	4,600	1,226.00	5,639,600
住友大阪セメント	23,000	4,160.00	95,680,000
太平洋セメント	71,900	3,160.00	227,204,000
リソルホールディングス	1,200	3,840.00	4,608,000
日本ヒューム	11,300	674.00	7,616,200
日本コンクリート工業	24,800	276.00	6,844,800
三谷セキサン	5,300	2,824.00	14,967,200
アジアパイルホールディングス	16,500	584.00	9,636,000
東海カーボン	103,600	1,052.00	108,987,200
日本カーボン	5,500	3,905.00	21,477,500
東洋炭素	6,700	1,912.00	12,810,400
ノリタケカンパニーリミテド	6,900	4,535.00	31,291,500
TOTO	87,500	3,890.00	340,375,000
日本碍子	138,700	1,443.00	200,144,100
日本特殊陶業	96,100	1,845.00	177,304,500
ダントーホールディングス	9,400	101.00	949,400
MARUWA	4,000	4,695.00	18,780,000
品川リフラクトリーズ	3,100	2,864.00	8,878,400
黒崎播磨	2,200	5,870.00	12,914,000
ヨータイ	10,200	529.00	5,395,800
イソライト工業	6,100	435.00	2,653,500
東京窯業	14,900	281.00	4,186,900

ニッカトー	5,400	647.00	3,493,800
フジインコーポレーテッド	10,100	1,997.00	20,169,700
クニミネ工業	4,000	782.00	3,128,000
エーアンドエーマテリアル	2,400	980.00	2,352,000
ニチアス	31,200	1,778.00	55,473,600
日本製鉄	522,900	1,790.50	936,252,450
神戸製鋼所	205,800	652.00	134,181,600
中山製鋼所	15,400	453.00	6,976,200
合同製鐵	5,500	1,993.00	10,961,500
ジェイ エフ イー ホールディングス	304,000	1,466.50	445,816,000
東京製鐵	60,400	833.00	50,313,200
共英製鋼	12,700	1,754.00	22,275,800
大和工業	23,900	2,927.00	69,955,300
東京鐵鋼	4,700	1,118.00	5,254,600
大阪製鐵	7,500	1,685.00	12,637,500
淀川製鋼所	15,000	1,950.00	29,250,000
丸一鋼管	39,900	2,780.00	110,922,000
モリ工業	3,400	1,807.00	6,143,800
大同特殊鋼	18,400	3,710.00	68,264,000
日本高周波鋼業	4,200	443.00	1,860,600
日本冶金工業	93,800	200.00	18,760,000
山陽特殊製鋼	14,200	1,418.00	20,135,600
愛知製鋼	6,200	3,100.00	19,220,000
日立金属	121,300	1,074.00	130,276,200
日本金属	2,700	808.00	2,181,600
大平洋金属	7,700	2,159.00	16,624,300
新日本電工	68,100	185.00	12,598,500
栗本鐵工所	5,600	1,293.00	7,240,800
虹 技	1,700	1,220.00	2,074,000
日本鑄鉄管	1,200	603.00	723,600
日本製鋼所	34,200	1,605.00	54,891,000
三菱製鋼	8,300	1,090.00	9,047,000
日亜鋼業	17,300	322.00	5,570,600
日本精線	1,600	2,500.00	4,000,000
エンビプロ・ホールディングス	2,600	559.00	1,453,400
大紀アルミニウム工業所	18,700	646.00	12,080,200
日本輕金属ホールディングス	306,700	224.00	68,700,800
三井金属鋁業	30,400	2,269.00	68,977,600
東邦亜鉛	6,200	2,303.00	14,278,600
三菱マテリアル	74,300	2,769.00	205,736,700
住友金属鋁山	154,200	2,793.50	430,757,700
D O W Aホールディングス	26,300	3,300.00	86,790,000
古河機械金属	18,600	1,288.00	23,956,800
エス・サイエンス	51,600	60.00	3,096,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	13,100	1,571.00	20,580,100
東邦チタニウム	20,200	1,067.00	21,553,400
U A C J	17,100	1,673.00	28,608,300
C Kサンエツ	2,100	2,700.00	5,670,000
古河電気工業	32,500	2,847.00	92,527,500

住友電気工業	420,600	1,299.50	546,569,700	
フジクラ	135,900	344.00	46,749,600	
昭和電線ホールディングス	13,200	731.00	9,649,200	
東京特殊電線	1,500	1,549.00	2,323,500	
タツタ電線	22,400	434.00	9,721,600	
カナレ電気	1,900	1,850.00	3,515,000	
平河ヒューテック	4,700	1,119.00	5,259,300	
リョービ	13,900	1,942.00	26,993,800	
アーレスティ	14,200	499.00	7,085,800	
アサヒホールディングス	21,300	2,090.00	44,517,000	
東洋製罐グループホールディングス	71,700	2,045.00	146,626,500	
ホッカンホールディングス	5,700	1,685.00	9,604,500	
コロナ	6,000	983.00	5,898,000	
横河ブリッジホールディングス	21,000	1,533.00	32,193,000	
OSJBホールディングス	57,100	267.00	15,245,700	
駒井ハルテック	2,100	1,585.00	3,328,500	
高田機工	1,000	2,505.00	2,505,000	
三和ホールディングス	116,300	1,044.00	121,417,200	
文化シャッター	33,200	815.00	27,058,000	
三協立山	15,600	1,074.00	16,754,400	
アルインコ	8,800	945.00	8,316,000	
東洋シャッター	3,000	527.00	1,581,000	
LIXILグループ	166,000	1,380.00	229,080,000	
日本フィルコン	8,900	496.00	4,414,400	
ノーリツ	25,100	1,346.00	33,784,600	
長府製作所	11,300	2,111.00	23,854,300	
リンナイ	20,000	6,950.00	139,000,000	
ユニプレス	22,100	1,689.00	37,326,900	
ダイニチ工業	6,100	609.00	3,714,900	
日東精工	15,700	539.00	8,462,300	
三洋工業	1,500	1,731.00	2,596,500	
岡部	22,900	945.00	21,640,500	
ジーテクト	12,500	1,462.00	18,275,000	
中国工業	1,900	506.00	961,400	
東プレ	21,100	1,700.00	35,870,000	
高周波熱錬	21,600	807.00	17,431,200	
東京製綱	7,000	960.00	6,720,000	
サンコール	6,600	495.00	3,267,000	
モリテックスチール	9,000	322.00	2,898,000	
パイオラックス	18,000	1,754.00	31,572,000	
エイチワン	11,100	708.00	7,858,800	
日本発条	112,100	793.00	88,895,300	
中央発條	1,300	2,818.00	3,663,400	
アドバネクス	1,500	1,637.00	2,455,500	
三浦工業	48,800	3,365.00	164,212,000	
タクマ	41,100	1,392.00	57,211,200	
テクノプロ・ホールディングス	21,900	5,340.00	116,946,000	
アトラ	2,400	271.00	650,400	
インターワークス	2,400	584.00	1,401,600	

アイ・アールジャパンホールディングス	3,500	2,562.00	8,967,000	
K e e P e r 技研	4,000	1,356.00	5,424,000	
ファーストロジック	2,400	516.00	1,238,400	
三機サービス	1,900	1,158.00	2,200,200	
G u n o s y	7,200	1,890.00	13,608,000	
デザインワン・ジャパン	2,400	275.00	660,000	
イー・ガーディアン	5,400	1,750.00	9,450,000	
リブセンス	6,300	248.00	1,562,400	
ジャパンマテリアル	29,900	1,280.00	38,272,000	
ベクトル	13,400	1,098.00	14,713,200	
ウチヤマホールディングス	5,700	514.00	2,929,800	
チャーム・ケア・コーポレーション	3,600	1,539.00	5,540,400	
ライクキッズネクスト	2,600	844.00	2,194,400	
キャリアリンク	4,300	422.00	1,814,600	
I B J	7,500	875.00	6,562,500	
アサンテ	4,500	2,067.00	9,301,500	
N・フィールド	7,200	697.00	5,018,400	
バリューHR	2,500	3,075.00	7,687,500	
M&Aキャピタルパートナーズ	3,900	6,160.00	24,024,000	
ライドオンエクスプレスホールディングス	4,600	1,164.00	5,354,400	
E R Iホールディングス	3,300	886.00	2,923,800	
アビスト	1,800	2,401.00	4,321,800	
シグマクシス	5,400	1,259.00	6,798,600	
ウィルグループ	7,300	847.00	6,183,100	
エスクロー・エージェント・ジャパン	15,500	253.00	3,921,500	
日本ビューホテル	3,700	1,063.00	3,933,100	
リクルートホールディングス	779,500	3,497.00	2,725,911,500	
エラン	7,600	1,830.00	13,908,000	
ツガミ	25,500	813.00	20,731,500	
オークマ	14,300	5,090.00	72,787,000	
東芝機械	12,800	2,207.00	28,249,600	
アマダホールディングス	169,000	1,095.00	185,055,000	
アイダエンジニアリング	30,300	711.00	21,543,300	
滝澤鉄工所	3,600	1,376.00	4,953,600	
F U J I	45,000	1,167.00	52,515,000	
牧野フライス製作所	13,200	3,665.00	48,378,000	
オーエスジー	55,400	2,013.00	111,520,200	
ダイジェット工業	1,300	1,200.00	1,560,000	
旭ダイヤモンド工業	29,700	629.00	18,681,300	
D M G 森精機	71,200	1,311.00	93,343,200	
ソディック	24,600	887.00	21,820,200	
ディスコ	15,200	14,960.00	227,392,000	
日東工器	6,100	2,046.00	12,480,600	
日進工具	3,400	2,087.00	7,095,800	
パンチ工業	8,000	451.00	3,608,000	
富士ダイス	5,100	564.00	2,876,400	
土木管理総合試験所	5,000	429.00	2,145,000	
日本郵政	891,500	1,210.00	1,078,715,000	

ベルシステム24ホールディングス	18,300	1,565.00	28,639,500
鎌倉新書	8,100	1,600.00	12,960,000
一蔵	1,300	617.00	802,100
LITALICO	2,600	1,557.00	4,048,200
グローバルキッズCOMPANY	1,400	851.00	1,191,400
エボラブルアジア	4,800	2,180.00	10,464,000
アトラエ	2,900	3,290.00	9,541,000
ストライク	4,200	1,844.00	7,744,800
ソラスト	26,700	905.00	24,163,500
セラク	2,600	571.00	1,484,600
インソース	3,800	2,728.00	10,366,400
豊田自動織機	92,100	5,540.00	510,234,000
豊和工業	6,300	790.00	4,977,000
OKK	4,700	701.00	3,294,700
石川製作所	2,800	1,344.00	3,763,200
東洋機械金属	8,400	562.00	4,720,800
津田駒工業	2,500	1,455.00	3,637,500
エンシュウ	3,100	1,092.00	3,385,200
島精機製作所	15,500	2,898.00	44,919,000
オプトラン	11,000	2,268.00	24,948,000
NCホールディングス	3,900	458.00	1,786,200
イワキ	4,900	991.00	4,855,900
フリー	9,100	1,016.00	9,245,600
ヤマシンフィルタ	19,700	524.00	10,322,800
日阪製作所	13,900	874.00	12,148,600
やまびこ	21,800	891.00	19,423,800
平田機工	5,300	5,020.00	26,606,000
ペガサスミシン製造	10,800	515.00	5,562,000
マルマエ	3,300	675.00	2,227,500
タツモ	3,700	731.00	2,704,700
ナブテスコ	62,000	2,662.00	165,044,000
三井海洋開発	12,000	2,594.00	31,128,000
レオン自動機	11,100	1,516.00	16,827,600
SMC	33,300	35,270.00	1,174,491,000
新川	8,800	332.00	2,921,600
ホソカワミクロン	4,000	4,495.00	17,980,000
ユニオンツール	4,800	2,563.00	12,302,400
オイレス工業	15,700	1,468.00	23,047,600
日精エー・エス・ピー機械	3,400	2,878.00	9,785,200
サトーホールディングス	13,600	2,617.00	35,591,200
技研製作所	9,900	3,180.00	31,482,000
日本エアーテック	3,800	566.00	2,150,800
カワタ	2,400	989.00	2,373,600
日精樹脂工業	9,500	860.00	8,170,000
オカダアイヨン	4,000	1,260.00	5,040,000
ワイエイシイホールディングス	4,700	747.00	3,510,900
小松製作所	515,400	2,373.00	1,223,044,200
住友重機械工業	65,100	3,365.00	219,061,500
日立建機	45,600	2,468.00	112,540,800
日工	3,200	2,582.00	8,262,400

巴工業	4,900	2,168.00	10,623,200
井関農機	11,200	1,408.00	15,769,600
TOWA	10,000	723.00	7,230,000
丸山製作所	2,500	1,075.00	2,687,500
北川鉄工所	5,100	1,999.00	10,194,900
シンニッタン	18,000	341.00	6,138,000
ローツェ	5,100	2,050.00	10,455,000
タカキタ	4,200	512.00	2,150,400
クボタ	610,000	1,656.00	1,010,160,000
荏原実業	3,400	1,887.00	6,415,800
東洋エンジニアリング	15,100	429.00	6,477,900
三菱化工機	4,000	1,460.00	5,840,000
月島機械	22,500	1,287.00	28,957,500
帝国電機製作所	8,100	1,176.00	9,525,600
東京機械製作所	4,700	401.00	1,884,700
新東工業	26,900	891.00	23,967,900
澁谷工業	9,900	2,803.00	27,749,700
アイチコーポレーション	19,600	659.00	12,916,400
小森コーポレーション	30,600	1,111.00	33,996,600
鶴見製作所	8,900	1,899.00	16,901,100
住友精密工業	1,900	2,757.00	5,238,300
酒井重工業	2,100	2,510.00	5,271,000
荏原製作所	50,400	2,741.00	138,146,400
石井鐵工所	1,800	1,943.00	3,497,400
西島製作所	11,700	1,016.00	11,887,200
北越工業	11,800	1,180.00	13,924,000
千代田化工建設	92,400	280.00	25,872,000
ダイキン工業	155,400	13,040.00	2,026,416,000
オルガノ	4,100	3,130.00	12,833,000
トーヨーカネツ	4,300	2,020.00	8,686,000
栗田工業	61,600	2,552.00	157,203,200
椿本チエイン	14,800	3,240.00	47,952,000
大同工業	5,300	810.00	4,293,000
日機装	36,800	1,370.00	50,416,000
木村化工機	9,500	320.00	3,040,000
新興プランテック	22,900	1,197.00	27,411,300
アネスト岩田	17,700	932.00	16,496,400
ダイフク	62,700	5,290.00	331,683,000
サムコ	3,300	755.00	2,491,500
加藤製作所	5,800	1,887.00	10,944,600
油研工業	1,900	1,586.00	3,013,400
タダノ	54,900	1,018.00	55,888,200
フジテック	41,300	1,411.00	58,274,300
C K D	31,800	946.00	30,082,800
キトー	8,700	1,458.00	12,684,600
平和	31,700	2,178.00	69,042,600
理想科学工業	10,000	1,729.00	17,290,000
SANKYO	28,400	4,130.00	117,292,000
日本金銭機械	12,700	1,068.00	13,563,600
マースグループホールディングス	7,200	2,062.00	14,846,400

福島工業	7,100	3,540.00	25,134,000
オーイズミ	5,000	369.00	1,845,000
ダイコク電機	5,300	1,273.00	6,746,900
竹内製作所	19,000	1,718.00	32,642,000
アマノ	32,500	2,814.00	91,455,000
JUKI	15,800	865.00	13,667,000
サンデンホールディングス	14,300	492.00	7,035,600
蛇の目ミシン工業	10,400	416.00	4,326,400
ブラザー工業	148,300	1,809.00	268,274,700
マックス	17,400	1,481.00	25,769,400
モリタホールディングス	19,900	1,842.00	36,655,800
グローリー	31,500	2,700.00	85,050,000
新晃工業	10,600	1,556.00	16,493,600
大和冷機工業	16,500	1,197.00	19,750,500
セガサミーホールディングス	112,900	1,262.00	142,479,800
日本ピストンリング	4,300	1,313.00	5,645,900
リケン	5,300	4,215.00	22,339,500
T P R	15,200	1,789.00	27,192,800
ツバキ・ナカシマ	17,300	1,627.00	28,147,100
ホシザキ	33,300	7,880.00	262,404,000
大豊工業	9,400	792.00	7,444,800
日本精工	233,800	869.00	203,172,200
NTN	244,300	280.00	68,404,000
ジェイテクト	109,100	1,137.00	124,046,700
不二越	10,500	4,000.00	42,000,000
ミネベアミツミ	211,400	1,585.00	335,069,000
日本トムソン	34,000	416.00	14,144,000
THK	71,100	2,150.00	152,865,000
ユーシン精機	8,900	1,022.00	9,095,800
前澤給装工業	4,500	1,937.00	8,716,500
イーグル工業	14,000	1,007.00	14,098,000
前澤工業	7,800	336.00	2,620,800
日本ピラー工業	11,700	1,047.00	12,249,900
キッツ	46,200	736.00	34,003,200
日立製作所	512,600	3,709.00	1,901,233,400
三菱電機	1,138,300	1,341.50	1,527,029,450
富士電機	73,900	3,600.00	266,040,000
東洋電機製造	4,600	1,203.00	5,533,800
安川電機	132,000	3,095.00	408,540,000
シンフォニアテクノロジー	15,800	1,134.00	17,917,200
明電舎	22,500	1,473.00	33,142,500
オリジン	3,200	1,373.00	4,393,600
山洋電気	5,500	3,655.00	20,102,500
デンヨー	10,500	1,310.00	13,755,000
ベイカレント・コンサルティング	7,800	3,645.00	28,431,000
アイモバイル	2,800	792.00	2,217,600
キャリアインデックス	3,900	743.00	2,897,700
MS - J a p a n	4,500	1,553.00	6,988,500
船場	1,800	917.00	1,650,600
グレイステクノロジー	3,100	2,546.00	7,892,600

ジャパンエレベーターサービスホールディングス	8,600	2,171.00	18,670,600	
フルテック	1,200	1,184.00	1,420,800	
グリーンズ	2,700	1,517.00	4,095,900	
ツナググループ・ホールディングス	1,000	511.00	511,000	
ソウルドアウト	1,100	2,400.00	2,640,000	
日総工産	5,500	1,381.00	7,595,500	
キュービーネットホールディングス	6,600	2,225.00	14,685,000	
RPAホールディングス	2,100	5,360.00	11,256,000	
三櫻工業	14,900	377.00	5,617,300	
マキタ	138,500	3,760.00	520,760,000	
東芝テック	14,200	2,636.00	37,431,200	
芝浦メカトロニクス	2,000	2,516.00	5,032,000	
マブチモーター	31,500	3,485.00	109,777,500	
日本電産	137,000	13,315.00	1,824,155,000	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	6,200	1,059.00	6,565,800	
トレックス・セミコンダクター	4,000	1,091.00	4,364,000	
東光高岳	5,700	1,109.00	6,321,300	
ダブル・スコープ	16,700	1,411.00	23,563,700	
宮越ホールディングス	4,300	804.00	3,457,200	
ダイヘン	12,500	2,770.00	34,625,000	
田淵電機	16,600	102.00	1,693,200	
ヤーマン	16,600	912.00	15,139,200	
JVCケンウッド	87,800	222.00	19,491,600	
ミマキエンジニアリング	10,400	559.00	5,813,600	
第一精工	4,800	1,467.00	7,041,600	
日新電機	26,800	1,078.00	28,890,400	
大崎電気工業	22,700	673.00	15,277,100	
オムロン	121,100	5,070.00	613,977,000	
日東工業	18,300	1,815.00	33,214,500	
I D E C	15,300	1,889.00	28,901,700	
不二電機工業	1,300	1,278.00	1,661,400	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	40,900	1,935.00	79,141,500	
サクサホールディングス	2,900	1,709.00	4,956,100	
メルコホールディングス	4,700	2,944.00	13,836,800	
テクノメディカ	2,600	2,125.00	5,525,000	
日本電気	147,300	3,955.00	582,571,500	
富士通	109,700	7,343.00	805,527,100	
沖電気工業	49,300	1,281.00	63,153,300	
岩崎通信機	5,500	774.00	4,257,000	
電気興業	6,000	2,540.00	15,240,000	
サンケン電気	13,400	2,051.00	27,483,400	
ナカヨ	2,100	1,496.00	3,141,600	
アイホン	6,400	1,579.00	10,105,600	
ルネサスエレクトロニクス	118,200	481.00	56,854,200	
セイコーエプソン	141,100	1,587.00	223,925,700	
ワコム	82,500	326.00	26,895,000	
アルバック	22,700	3,030.00	68,781,000	
アクセル	5,000	530.00	2,650,000	
E I Z O	10,400	3,850.00	40,040,000	

ジャパンディスプレイ	270,200	58.00	15,671,600	
日本信号	29,100	1,092.00	31,777,200	
京三製作所	24,400	338.00	8,247,200	
能美防災	15,100	2,037.00	30,758,700	
ホーチキ	7,300	1,093.00	7,978,900	
星和電機	4,200	498.00	2,091,600	
エレコム	10,800	3,490.00	37,692,000	
パナソニック	1,300,500	858.30	1,116,219,150	
シャープ	113,000	958.00	108,254,000	
アンリツ	73,300	1,678.00	122,997,400	
富士通ゼネラル	34,800	1,545.00	53,766,000	
ソニー	764,000	5,168.00	3,948,352,000	
T D K	59,600	7,370.00	439,252,000	
帝国通信工業	5,000	1,133.00	5,665,000	
タムラ製作所	44,000	505.00	22,220,000	
アルプスアルパイン	118,500	1,747.00	207,019,500	
池上通信機	3,700	1,072.00	3,966,400	
日本電波工業	10,500	408.00	4,284,000	
鈴木	6,100	589.00	3,592,900	
日本トリム	2,100	5,060.00	10,626,000	
ローランド ディー . ジー .	5,700	2,310.00	13,167,000	
フォスター電機	12,900	1,465.00	18,898,500	
S M K	3,200	2,526.00	8,083,200	
ヨコオ	8,200	1,998.00	16,383,600	
ティアック	8,600	177.00	1,522,200	
ホシデン	33,600	1,034.00	34,742,400	
ヒロセ電機	16,400	11,750.00	192,700,000	
日本航空電子工業	26,200	1,518.00	39,771,600	
T O A	12,300	1,263.00	15,534,900	
マクセルホールディングス	24,500	1,774.00	43,463,000	
古野電気	14,700	879.00	12,921,300	
ユニデンホールディングス	3,400	1,708.00	5,807,200	
スミダコーポレーション	9,700	1,060.00	10,282,000	
アイコム	6,200	2,174.00	13,478,800	
リオン	5,300	2,053.00	10,880,900	
本多通信工業	10,000	475.00	4,750,000	
船井電機	11,800	691.00	8,153,800	
横河電機	113,900	2,035.00	231,786,500	
新電元工業	4,000	3,350.00	13,400,000	
アズビル	73,500	2,535.00	186,322,500	
東亜ディーケーケー	5,700	802.00	4,571,400	
日本光電工業	50,200	3,070.00	154,114,000	
チノー	4,000	1,110.00	4,440,000	
共和電業	12,100	408.00	4,936,800	
日本電子材料	4,700	480.00	2,256,000	
堀場製作所	22,600	4,875.00	110,175,000	
アドバンテスト	77,700	2,520.00	195,804,000	
小野測器	5,300	561.00	2,973,300	
エスベック	10,100	2,158.00	21,795,800	
キーエンス	55,900	58,920.00	3,293,628,000	

日置電機	5,900	3,400.00	20,060,000
シスメックス	88,700	7,508.00	665,959,600
日本マイクロニクス	18,900	884.00	16,707,600
メガチップス	9,000	1,177.00	10,593,000
OBARA GROUP	5,900	3,500.00	20,650,000
IMAGICA GROUP	9,700	505.00	4,898,500
澤藤電機	1,400	1,581.00	2,213,400
デンソー	250,700	4,157.00	1,042,159,900
原田工業	3,700	703.00	2,601,100
コーセル	14,400	1,019.00	14,673,600
イリソ電子工業	10,400	4,735.00	49,244,000
オブテックスグループ	20,000	1,261.00	25,220,000
千代田インテグレ	4,700	1,986.00	9,334,200
アイ・オー・データ機器	4,300	1,020.00	4,386,000
レーザーテック	23,400	3,850.00	90,090,000
スタンレー電気	80,600	2,471.00	199,162,600
岩崎電気	4,500	1,306.00	5,877,000
ウシオ電機	66,100	1,322.00	87,384,200
岡谷電機産業	8,400	370.00	3,108,000
ヘリオス テクノ ホールディング	10,800	572.00	6,177,600
エノモト	2,500	704.00	1,760,000
日本セラミック	11,600	2,781.00	32,259,600
遠藤照明	5,900	727.00	4,289,300
古河電池	8,400	607.00	5,098,800
双信電機	5,700	413.00	2,354,100
山一電機	8,400	866.00	7,274,400
図研	7,400	1,500.00	11,100,000
日本電子	22,500	2,157.00	48,532,500
カシオ計算機	100,700	1,215.00	122,350,500
ファナック	108,200	17,865.00	1,932,993,000
日本シイエムケイ	29,100	614.00	17,867,400
エンプラス	5,100	2,956.00	15,075,600
大真空	4,200	979.00	4,111,800
ローム	54,500	6,750.00	367,875,000
浜松ホトニクス	81,600	3,870.00	315,792,000
三井ハイテック	12,700	1,000.00	12,700,000
新光電気工業	38,300	822.00	31,482,600
京セラ	173,500	6,600.00	1,145,100,000
協栄産業	1,300	1,462.00	1,900,600
太陽誘電	50,700	1,956.00	99,169,200
村田製作所	358,400	4,531.00	1,623,910,400
双葉電子工業	18,500	1,367.00	25,289,500
日東電工	78,500	4,707.00	369,499,500
北陸電気工業	4,300	912.00	3,921,600
東海理化電機製作所	30,000	1,632.00	48,960,000
ニチコン	35,800	753.00	26,957,400
日本ケミコン	8,100	1,475.00	11,947,500
KOA	17,200	1,198.00	20,605,600
三井E&Sホールディングス	41,200	856.00	35,267,200
日立造船	90,300	348.00	31,424,400

三菱重工業	190,800	4,715.00	899,622,000	
川崎重工業	88,400	2,363.00	208,889,200	
I H I	87,500	2,360.00	206,500,000	
名村造船所	33,900	281.00	9,525,900	
サノヤホールディングス	15,800	195.00	3,081,000	
スプリックス	3,200	1,868.00	5,977,600	
日本車輛製造	4,200	2,441.00	10,252,200	
三菱ロジスネクスト	13,600	1,101.00	14,973,600	
近畿車輛	1,700	1,721.00	2,925,700	
F P G	35,500	850.00	30,175,000	
島根銀行	2,600	701.00	1,822,600	
じもとホールディングス	78,400	94.00	7,369,600	
全国保証	31,700	4,095.00	129,811,500	
めぶきフィナンシャルグループ	582,500	264.00	153,780,000	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	15,100	1,630.00	24,613,000	
九州フィナンシャルグループ	184,100	421.00	77,506,100	
かんぼ生命保険	42,300	2,064.00	87,307,200	
ゆうちょ銀行	317,500	1,094.00	347,345,000	
富山第一銀行	26,600	301.00	8,006,600	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	704,400	406.00	285,986,400	
ジェイリース	2,700	322.00	869,400	
西日本フィナンシャルホールディングス	70,500	783.00	55,201,500	
マーキュリアインベストメント	4,600	646.00	2,971,600	
イントラスト	3,400	447.00	1,519,800	
日本モーゲージサービス	1,600	1,074.00	1,718,400	
C A S A	4,000	1,013.00	4,052,000	
アルヒ	10,300	1,907.00	19,642,100	
プレミアグループ	6,500	1,826.00	11,869,000	
日産自動車	1,342,500	744.80	999,894,000	
いすゞ自動車	360,000	1,221.50	439,740,000	
トヨタ自動車	1,268,800	6,343.00	8,047,998,400	*
日野自動車	142,100	862.00	122,490,200	
三菱自動車工業	421,500	514.00	216,651,000	
エフテック	8,200	705.00	5,781,000	
レシップホールディングス	4,400	727.00	3,198,800	
G M B	2,400	760.00	1,824,000	
ファルテック	2,000	725.00	1,450,000	
武蔵精密工業	27,700	1,301.00	36,037,700	
日産車体	22,200	973.00	21,600,600	
新明和工業	47,700	1,285.00	61,294,500	
極東開発工業	22,600	1,323.00	29,899,800	
日信工業	21,000	1,336.00	28,056,000	
トビー工業	9,400	2,338.00	21,977,200	
ティラド	4,200	1,801.00	7,564,200	
曙ブレーキ工業	64,500	102.00	6,579,000	
タチエス	18,700	1,242.00	23,225,400	
N O K	60,900	1,372.00	83,554,800	
フタバ産業	31,900	523.00	16,683,700	

K Y B	11,900	2,712.00	32,272,800
市光工業	17,200	552.00	9,494,400
大同メタル工業	18,700	637.00	11,911,900
プレス工業	56,600	450.00	25,470,000
ミクニ	14,900	363.00	5,408,700
太平洋工業	23,900	1,395.00	33,340,500
ケーヒン	26,200	1,373.00	35,972,600
河西工業	14,000	716.00	10,024,000
アイシン精機	93,800	3,585.00	336,273,000
マツダ	357,300	1,063.50	379,988,550
今仙電機製作所	10,700	861.00	9,212,700
本田技研工業	960,400	2,659.50	2,554,183,800
スズキ	208,400	5,101.00	1,063,048,400
S U B A R U	353,500	2,539.00	897,536,500
安永	5,600	1,375.00	7,700,000
ヤマハ発動機	160,800	1,826.00	293,620,800
ショーワ	27,000	1,307.00	35,289,000
小糸製作所	68,200	5,030.00	343,046,000
T B K	13,900	376.00	5,226,400
エクセディ	15,400	2,128.00	32,771,200
ミツバ	21,100	529.00	11,161,900
豊田合成	36,800	1,867.00	68,705,600
愛三工業	17,700	661.00	11,699,700
盟和産業	1,800	1,013.00	1,823,400
日本プラスト	9,100	654.00	5,951,400
ヨロズ	10,700	1,280.00	13,696,000
エフ・シー・シー	20,600	2,117.00	43,610,200
新家工業	2,700	1,374.00	3,709,800
シマノ	45,900	16,720.00	767,448,000
テイ・エス テック	26,500	2,632.00	69,748,000
関西みらいフィナンシャルグループ	52,600	687.00	36,136,200
三十三フィナンシャルグループ	9,500	1,423.00	13,518,500
第四北越フィナンシャルグループ	19,400	2,742.00	53,194,800
ジャムコ	5,700	2,058.00	11,730,600
小野建	10,000	1,346.00	13,460,000
はるやまホールディングス	5,300	807.00	4,277,100
南陽	2,400	1,494.00	3,585,600
ノジマ	19,900	1,746.00	34,745,400
佐鳥電機	8,300	836.00	6,938,800
カッパ・クリエイト	15,700	1,360.00	21,352,000
エコートレーディング	2,700	531.00	1,433,700
伯東	7,600	1,116.00	8,481,600
コンドーテック	8,700	914.00	7,951,800
中山福	6,300	514.00	3,238,200
ライトオン	8,400	678.00	5,695,200
ナガイレーベン	16,200	2,334.00	37,810,800
ジーンズメイト	3,800	304.00	1,155,200
三菱食品	12,200	2,861.00	34,904,200
良品計画	15,800	19,240.00	303,992,000
三城ホールディングス	13,900	344.00	4,781,600

松田産業	8,200	1,444.00	11,840,800
第一興商	16,700	4,940.00	82,498,000
メディカルホールディングス	121,000	2,343.00	283,503,000
アドヴァン	17,200	994.00	17,096,800
S P K	2,600	2,372.00	6,167,200
萩原電気ホールディングス	4,200	2,557.00	10,739,400
アルピス	4,300	2,280.00	9,804,000
アズワン	8,100	9,720.00	78,732,000
スズデン	4,000	1,298.00	5,192,000
尾家産業	3,500	1,233.00	4,315,500
シモジマ	6,900	1,020.00	7,038,000
ドウシシャ	10,500	1,674.00	17,577,000
小津産業	2,600	1,658.00	4,310,800
コナカ	13,200	403.00	5,319,600
高速	6,600	1,120.00	7,392,000
ハウス オブ ローゼ	1,500	1,560.00	2,340,000
G - 7ホールディングス	3,400	2,980.00	10,132,000
たけびし	3,900	1,231.00	4,800,900
イオン北海道	10,900	700.00	7,630,000
コジマ	17,200	465.00	7,998,000
ヒマラヤ	3,700	856.00	3,167,200
コーナン商事	14,700	2,196.00	32,281,200
ネットワンシステムズ	39,600	2,813.00	111,394,800
エコス	4,200	1,377.00	5,783,400
ワタミ	14,800	1,417.00	20,971,600
マルシェ	3,300	762.00	2,514,600
リックス	2,700	1,435.00	3,874,500
システムソフト	28,200	95.00	2,679,000
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	67,200	6,730.00	452,256,000
丸文	10,100	524.00	5,292,400
西松屋チェーン	24,500	856.00	20,972,000
ゼンショーホールディングス	53,000	2,221.00	117,713,000
ハビネット	9,400	1,299.00	12,210,600
幸楽苑ホールディングス	7,200	2,915.00	20,988,000
ハークスレイ	2,400	1,000.00	2,400,000
橋本総業ホールディングス	2,400	1,388.00	3,331,200
日本ライフライン	35,200	1,667.00	58,678,400
サイゼリヤ	18,500	2,419.00	44,751,500
タカショー	5,800	453.00	2,627,400
エクセル	4,200	1,633.00	6,858,600
V Tホールディングス	51,000	433.00	22,083,000
マルカ	3,700	1,811.00	6,700,700
アルゴグラフィックス	9,500	2,240.00	21,280,000
魚力	3,200	1,465.00	4,688,000
I D O M	38,100	266.00	10,134,600
日本エム・ディ・エム	6,600	1,401.00	9,246,600
ポブラ	3,100	476.00	1,475,600
フジ・コーポレーション	2,400	2,036.00	4,886,400
ユナイテッドアローズ	12,900	3,555.00	45,859,500

進和	6,600	2,100.00	13,860,000
エスケイジャパン	2,900	500.00	1,450,000
ダイترون	5,200	1,120.00	5,824,000
ハイデイ日高	16,200	2,006.00	32,497,200
シークス	14,200	1,143.00	16,230,600
京都きもの友禅	7,400	344.00	2,545,600
コロワイド	37,300	2,073.00	77,322,900
ピーシーデポコーポレーション	14,900	386.00	5,751,400
田中商事	3,800	572.00	2,173,600
オーハシテクニカ	6,500	1,372.00	8,918,000
壱番屋	7,900	4,490.00	35,471,000
白銅	3,800	1,282.00	4,871,600
トップカルチャー	4,600	337.00	1,550,200
P L A N T	2,700	782.00	2,111,400
スギホールディングス	24,600	4,870.00	119,802,000
島津製作所	146,500	2,633.00	385,734,500
J M S	10,700	626.00	6,698,200
クボテック	2,700	333.00	899,100
長野計器	9,100	655.00	5,960,500
ブイ・テクノロジー	5,300	4,385.00	23,240,500
スター精密	19,400	1,287.00	24,967,800
東京計器	7,400	876.00	6,482,400
愛知時計電機	1,500	3,995.00	5,992,500
インターアクション	5,500	1,281.00	7,045,500
オーバル	11,300	221.00	2,497,300
東京精密	20,700	2,429.00	50,280,300
マニー	15,100	6,710.00	101,321,000
ニコン	198,300	1,470.00	291,501,000
トプコン	61,100	1,347.00	82,301,700
オリンパス	678,500	1,310.00	888,835,000
理研計器	10,000	1,886.00	18,860,000
S C R E E Nホールディングス	19,700	3,595.00	70,821,500
キヤノン電子	10,300	1,742.00	17,942,600
タムロン	10,100	2,103.00	21,240,300
H O Y A	229,200	7,366.00	1,688,287,200
シード	4,900	1,054.00	5,164,600
ノーリツ鋼機	9,000	1,632.00	14,688,000
エー・アンド・デイ	10,500	721.00	7,570,500
朝日インテック	48,300	5,520.00	266,616,000
キヤノン	612,800	3,047.00	1,867,201,600
リコー	342,100	1,046.00	357,836,600
シチズン時計	124,200	499.00	61,975,800
リズム時計工業	3,900	1,201.00	4,683,900
大研医器	9,100	625.00	5,687,500
メニコン	15,600	3,615.00	56,394,000
シンシア	1,800	575.00	1,035,000
中本パックス	3,400	1,420.00	4,828,000
スノーピーク	4,500	1,388.00	6,246,000
パラマウントベッドホールディングス	13,100	4,230.00	55,413,000
トランザクション	6,400	790.00	5,056,000

SHOBI	3,600	364.00	1,310,400
ニホンフラッシュ	4,900	2,435.00	11,931,500
前田工織	12,600	1,917.00	24,154,200
永大産業	15,100	332.00	5,013,200
アートネイチャー	12,000	621.00	7,452,000
バンダイナムコホールディングス	117,700	5,330.00	627,341,000
アイフィスジャパン	2,800	605.00	1,694,000
共立印刷	19,800	170.00	3,366,000
SHOEI	5,500	4,330.00	23,815,000
フランスベッドホールディングス	16,000	978.00	15,648,000
マーベラス	17,100	815.00	13,936,500
パイロットコーポレーション	19,800	4,005.00	79,299,000
萩原工業	6,400	1,297.00	8,300,800
エイベックス	19,100	1,331.00	25,422,100
トッパン・フォームズ	24,300	869.00	21,116,700
フジシールインターナショナル	25,600	3,720.00	95,232,000
タカラトミー	47,700	1,277.00	60,912,900
廣済堂	10,700	630.00	6,741,000
エステールホールディングス	3,000	595.00	1,785,000
アーク	44,600	98.00	4,370,800
レック	12,300	1,175.00	14,452,500
タカノ	4,400	722.00	3,176,800
三光合成	9,500	311.00	2,954,500
プロネクサス	9,800	1,194.00	11,701,200
ホクシン	7,700	124.00	954,800
ウッドワン	3,900	972.00	3,790,800
大建工業	8,700	2,182.00	18,983,400
きもと	19,800	148.00	2,930,400
凸版印刷	160,600	1,567.00	251,660,200
大日本印刷	160,300	2,311.00	370,453,300
図書印刷	10,800	1,254.00	13,543,200
共同印刷	3,600	2,676.00	9,633,600
NISSHA	23,400	994.00	23,259,600
光村印刷	1,000	1,887.00	1,887,000
藤森工業	10,200	2,703.00	27,570,600
ヴィア・ホールディングス	14,000	582.00	8,148,000
宝印刷	5,700	1,576.00	8,983,200
前澤化成工業	7,800	1,041.00	8,119,800
未来工業	6,100	2,069.00	12,620,900
アシックス	107,400	1,194.00	128,235,600
ツツミ	3,600	1,992.00	7,171,200
ウェーブロックホールディングス	2,500	620.00	1,550,000
JSP	6,600	1,969.00	12,995,400
ニチハ	15,800	2,774.00	43,829,200
エフピコ	12,500	6,420.00	80,250,000
小松ウオール工業	3,500	1,786.00	6,251,000
ヤマハ	67,700	4,910.00	332,407,000
河合楽器製作所	3,600	2,610.00	9,396,000
クリナップ	10,500	532.00	5,586,000
ビジョン	68,800	4,075.00	280,360,000

天馬	7,900	1,763.00	13,927,700
兼松サステック	800	1,586.00	1,268,800
キングジム	9,500	857.00	8,141,500
象印マホービン	28,300	1,121.00	31,724,300
リンテック	27,000	2,152.00	58,104,000
信越ポリマー	20,400	734.00	14,973,600
東リ	28,200	247.00	6,965,400
イトーキ	20,800	394.00	8,195,200
任天堂	65,100	38,520.00	2,507,652,000
三菱鉛筆	18,700	1,883.00	35,212,100
松風	5,600	1,259.00	7,050,400
タカラスタンダード	23,400	1,596.00	37,346,400
コクヨ	54,600	1,401.00	76,494,600
ナカバヤシ	11,300	491.00	5,548,300
ニフコ	45,600	2,710.00	123,576,000
立川ブラインド工業	5,000	1,208.00	6,040,000
グロープライド	5,500	3,110.00	17,105,000
オカムラ	39,700	1,037.00	41,168,900
バルカー	9,300	2,024.00	18,823,200
MUTOHホールディングス	1,500	1,642.00	2,463,000
伊藤忠商事	784,300	1,958.00	1,535,659,400
丸紅	1,105,700	672.10	743,140,970
スクロール	17,500	334.00	5,845,000
高島	1,800	1,598.00	2,876,400
ヨンドシーホールディングス	12,500	2,384.00	29,800,000
三陽商会	6,700	1,720.00	11,524,000
長瀬産業	62,900	1,554.00	97,746,600
ナイガイ	4,500	496.00	2,232,000
蝶理	7,100	1,556.00	11,047,600
豊田通商	125,000	3,085.00	385,625,000
オンワードホールディングス	66,700	575.00	38,352,500
三共生興	18,900	501.00	9,468,900
兼松	44,900	1,192.00	53,520,800
美津濃	11,200	2,336.00	26,163,200
ツカモトコーポレーション	2,000	994.00	1,988,000
ユニー・ファミリーマートホールディングス	125,500	2,553.00	320,401,500
ルックホールディングス	4,200	1,298.00	5,451,600
三井物産	923,700	1,665.00	1,537,960,500
日本紙パルプ商事	6,300	3,735.00	23,530,500
東京エレクトロン	76,000	14,485.00	1,100,860,000
日立ハイテクノロジーズ	34,000	4,555.00	154,870,000
カメイ	14,600	1,133.00	16,541,800
東都水産	1,600	2,500.00	4,000,000
OUGホールディングス	1,800	2,518.00	4,532,400
スターゼン	4,200	3,970.00	16,674,000
セイコーホールディングス	17,500	1,998.00	34,965,000
山善	43,800	994.00	43,537,200
椿本興業	2,600	2,900.00	7,540,000
住友商事	663,200	1,561.00	1,035,255,200

日本ユニシス	35,000	3,470.00	121,450,000
内田洋行	4,800	3,475.00	16,680,000
三菱商事	786,900	2,840.00	2,234,796,000
第一実業	5,100	3,155.00	16,090,500
キャノンマーケティングジャパン	32,000	2,273.00	72,736,000
西華産業	6,300	1,202.00	7,572,600
佐藤商事	10,000	878.00	8,780,000
菱洋エレクトロ	11,300	1,645.00	18,588,500
東京産業	11,300	445.00	5,028,500
ユアサ商事	11,500	2,920.00	33,580,000
神鋼商事	2,600	2,218.00	5,766,800
小林産業	7,000	309.00	2,163,000
阪和興業	19,400	2,687.00	52,127,800
正栄食品工業	7,900	3,030.00	23,937,000
カナデン	10,200	1,290.00	13,158,000
菱電商事	8,800	1,509.00	13,279,200
ニプロ	78,700	1,162.00	91,449,400
フルサト工業	6,100	1,480.00	9,028,000
岩谷産業	24,800	3,550.00	88,040,000
すてきナイスグループ	4,800	594.00	2,851,200
昭光通商	4,200	611.00	2,566,200
ニチモウ	1,800	1,696.00	3,052,800
極東貿易	3,500	1,416.00	4,956,000
イワキ	13,700	446.00	6,110,200
兼松エレクトロニクス	6,000	3,035.00	18,210,000
三愛石油	30,000	917.00	27,510,000
稲畑産業	26,900	1,346.00	36,207,400
G S Iクレオス	3,000	1,083.00	3,249,000
明和産業	10,500	347.00	3,643,500
キムラタン	57,300	33.00	1,890,900
ゴールドウイン	10,100	13,720.00	138,572,000
ユニ・チャーム	241,400	3,226.00	778,756,400
デサント	27,200	1,806.00	49,123,200
キング	6,100	604.00	3,684,400
ワキタ	23,800	984.00	23,419,200
ヤマトインターナショナル	7,000	400.00	2,800,000
東邦ホールディングス	33,100	2,409.00	79,737,900
サンゲツ	33,200	2,080.00	69,056,000
ミツウロコグループホールディングス	14,800	737.00	10,907,600
シナネンホールディングス	4,600	1,845.00	8,487,000
伊藤忠エネクス	24,400	842.00	20,544,800
サンリオ	34,700	2,391.00	82,967,700
サンワテクノス	6,900	776.00	5,354,400
リョーサン	12,400	2,506.00	31,074,400
新光商事	10,500	1,830.00	19,215,000
トーヨー	5,100	2,090.00	10,659,000
三信電気	7,700	1,744.00	13,428,800
東陽テクニカ	12,900	893.00	11,519,700
モスフードサービス	14,700	2,349.00	34,530,300
加賀電子	11,100	1,575.00	17,482,500

三益半導体工業	9,500	1,449.00	13,765,500
ソーダニッカ	11,900	497.00	5,914,300
立花エレテック	8,200	1,498.00	12,283,600
木曽路	13,700	2,492.00	34,140,400
S R Sホールディングス	13,400	999.00	13,386,600
千趣会	20,800	258.00	5,366,400
タカキュー	9,200	170.00	1,564,000
ケーヨー	20,700	481.00	9,956,700
上新電機	13,200	2,086.00	27,535,200
日本瓦斯	18,300	2,567.00	46,976,100
ロイヤルホールディングス	19,500	2,649.00	51,655,500
東天紅	800	1,187.00	949,600
いなげや	12,500	1,346.00	16,825,000
島忠	23,600	2,415.00	56,994,000
チヨダ	11,600	1,596.00	18,513,600
ライフコーポレーション	8,500	2,281.00	19,388,500
リンガーハット	13,900	2,324.00	32,303,600
M r M a x H D	15,700	435.00	6,829,500
テンアライド	11,000	408.00	4,488,000
A O K Iホールディングス	22,200	1,020.00	22,644,000
オークワ	16,000	1,057.00	16,912,000
コメリ	17,300	2,093.00	36,208,900
青山商事	19,500	2,038.00	39,741,000
しまむら	13,000	8,230.00	106,990,000
はせがわ	6,100	391.00	2,385,100
高島屋	88,000	1,136.00	99,968,000
松屋	22,700	873.00	19,817,100
エイチ・ツー・オー リテイリング	57,400	1,176.00	67,502,400
近鉄百貨店	4,200	3,210.00	13,482,000
パルコ	10,700	1,046.00	11,192,200
丸井グループ	94,900	2,220.00	210,678,000
クレディセゾン	78,700	1,085.00	85,389,500
アクシアル リテイリング	9,300	3,695.00	34,363,500
井筒屋	5,900	235.00	1,386,500
イオン	431,500	1,854.00	800,001,000
イズミ	22,800	4,590.00	104,652,000
フォーバル	5,000	950.00	4,750,000
平和堂	22,700	1,903.00	43,198,100
フジ	13,500	1,744.00	23,544,000
ヤオコー	12,800	5,190.00	66,432,000
ゼビオホールディングス	13,500	1,189.00	16,051,500
ケーズホールディングス	116,700	1,025.00	119,617,500
P A L T A C	20,200	5,520.00	111,504,000
三谷産業	13,900	274.00	3,808,600
O l y m p i cグループ	6,700	651.00	4,361,700
日産東京販売ホールディングス	17,100	262.00	4,480,200
新生銀行	82,500	1,562.00	128,865,000
あおぞら銀行	62,800	2,602.00	163,405,600
三菱UFJフィナンシャル・グループ	7,729,700	497.00	3,841,660,900
りそなホールディングス	1,232,700	455.10	561,001,770

三井住友トラスト・ホールディングス	220,700	3,986.00	879,710,200
三井住友フィナンシャルグループ	791,500	3,740.00	2,960,210,000
千葉銀行	386,300	518.00	200,103,400
群馬銀行	224,200	376.00	84,299,200
武蔵野銀行	16,700	1,995.00	33,316,500
千葉興業銀行	31,500	266.00	8,379,000
筑波銀行	47,400	175.00	8,295,000
七十七銀行	35,300	1,586.00	55,985,800
青森銀行	8,700	2,793.00	24,299,100
秋田銀行	7,200	2,077.00	14,954,400
山形銀行	12,600	1,618.00	20,386,800
岩手銀行	7,800	2,883.00	22,487,400
東邦銀行	100,000	245.00	24,500,000
東北銀行	6,000	1,080.00	6,480,000
みちのく銀行	7,300	1,658.00	12,103,400
ふくおかフィナンシャルグループ	99,100	1,843.00	182,641,300
静岡銀行	282,600	843.00	238,231,800
十六銀行	14,900	2,268.00	33,793,200
スルガ銀行	115,200	414.00	47,692,800
八十二銀行	271,100	437.00	118,470,700
山梨中央銀行	13,500	1,189.00	16,051,500
大垣共立銀行	23,600	2,370.00	55,932,000
福井銀行	9,600	1,510.00	14,496,000
北國銀行	11,600	3,010.00	34,916,000
清水銀行	4,700	1,708.00	8,027,600
富山銀行	2,200	2,529.00	5,563,800
滋賀銀行	22,500	2,541.00	57,172,500
南都銀行	17,500	2,160.00	37,800,000
百五銀行	100,500	324.00	32,562,000
京都銀行	40,200	4,155.00	167,031,000
紀陽銀行	39,700	1,462.00	58,041,400
ほくほくフィナンシャルグループ	74,600	1,145.00	85,417,000
広島銀行	165,500	545.00	90,197,500
山陰合同銀行	66,500	689.00	45,818,500
中国銀行	96,600	1,007.00	97,276,200
鳥取銀行	4,000	1,344.00	5,376,000
伊予銀行	148,300	556.00	82,454,800
百十四銀行	11,800	2,195.00	25,901,000
四国銀行	16,000	929.00	14,864,000
阿波銀行	17,200	2,606.00	44,823,200
大分銀行	6,900	3,145.00	21,700,500
宮崎銀行	7,500	2,564.00	19,230,000
佐賀銀行	6,900	1,547.00	10,674,300
沖縄銀行	10,200	3,410.00	34,782,000
琉球銀行	26,000	1,138.00	29,588,000
セブン銀行	379,800	276.00	104,824,800
みずほフィナンシャルグループ	15,256,800	151.60	2,312,930,880
高知銀行	4,300	720.00	3,096,000
山口フィナンシャルグループ	140,100	785.00	109,978,500
芙蓉総合リース	12,800	5,160.00	66,048,000

興銀リース	21,100	2,449.00	51,673,900
東京センチュリー	22,600	4,305.00	97,293,000
SBIホールディングス	133,800	2,380.00	318,444,000
日本証券金融	49,700	544.00	27,036,800
アイフル	172,300	203.00	34,976,900
日本アジア投資	9,900	166.00	1,643,400
長野銀行	3,900	1,628.00	6,349,200
名古屋銀行	9,000	3,480.00	31,320,000
北洋銀行	169,000	247.00	41,743,000
愛知銀行	4,100	3,550.00	14,555,000
中京銀行	4,600	2,196.00	10,101,600
大光銀行	4,000	1,563.00	6,252,000
愛媛銀行	15,600	1,068.00	16,660,800
トマト銀行	4,600	1,005.00	4,623,000
京葉銀行	49,500	624.00	30,888,000
栃木銀行	58,400	176.00	10,278,400
北日本銀行	3,700	1,685.00	6,234,500
東和銀行	19,800	710.00	14,058,000
福島銀行	10,100	263.00	2,656,300
大東銀行	5,500	575.00	3,162,500
リコーリース	8,800	3,240.00	28,512,000
イオンフィナンシャルサービス	71,800	1,696.00	121,772,800
アコム	225,900	363.00	82,001,700
ジャックス	12,400	1,882.00	23,336,800
オリエントコーポレーション	304,000	110.00	33,440,000
日立キャピタル	26,500	2,232.00	59,148,000
アプラスフィナンシャル	55,400	70.00	3,878,000
オリックス	749,200	1,510.50	1,131,666,600
三菱UFJリース	253,000	529.00	133,837,000
ジャフコ	18,400	3,785.00	69,644,000
九州リースサービス	5,800	610.00	3,538,000
トモニホールディングス	86,700	345.00	29,911,500
大和証券グループ本社	900,400	460.70	414,814,280
野村ホールディングス	1,974,600	332.30	656,159,580
岡三証券グループ	94,900	382.00	36,251,800
丸三証券	33,400	543.00	18,136,200
東洋証券	40,300	117.00	4,715,100
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	133,700	345.00	46,126,500
光世証券	2,700	646.00	1,744,200
水戸証券	33,500	195.00	6,532,500
いちよし証券	23,500	744.00	17,484,000
松井証券	55,100	1,008.00	55,540,800
SOMPOホールディングス	197,900	4,142.00	819,701,800
だいがく証券ビジネス	4,800	403.00	1,934,400
日本取引所グループ	303,400	1,670.00	506,678,000
マネックスグループ	104,000	317.00	32,968,000
カブドットコム証券	84,400	557.00	47,010,800
極東証券	15,100	906.00	13,680,600
岩井コスモホールディングス	11,600	1,104.00	12,806,400

藍澤證券	20,300	693.00	14,067,900
フィデアホールディングス	110,800	117.00	12,963,600
池田泉州ホールディングス	120,800	206.00	24,884,800
アニコムホールディングス	9,300	3,590.00	33,387,000
MS & A Dインシュアランスグループ ホールディングス	293,500	3,437.00	1,008,759,500
ソニーフィナンシャルホールディング ス	92,300	2,428.00	224,104,400
マネーパートナーズグループ	13,800	278.00	3,836,400
スパークス・グループ	44,900	226.00	10,147,400
小林洋行	3,500	243.00	850,500
第一生命ホールディングス	635,300	1,557.00	989,162,100
東京海上ホールディングス	401,500	5,417.00	2,174,925,500
アドバンテッジリスクマネジメント	4,500	666.00	2,997,000
イー・ギャランティ	10,600	1,305.00	13,833,000
アサックス	4,900	550.00	2,695,000
NECキャピタルソリューション	4,600	1,697.00	7,806,200
T & Dホールディングス	347,300	1,119.00	388,628,700
アドバンスクリエイト	2,800	1,690.00	4,732,000
三井不動産	595,800	2,665.00	1,587,807,000
三菱地所	786,900	2,043.00	1,607,636,700
平和不動産	21,300	2,103.00	44,793,900
東京建物	122,700	1,123.00	137,792,100
ダイビル	33,000	929.00	30,657,000
京阪神ビルディング	20,100	997.00	20,039,700
住友不動産	252,400	4,054.00	1,023,229,600
太平洋興発	4,500	689.00	3,100,500
テオーシー	25,700	601.00	15,445,700
東京楽天地	1,600	5,020.00	8,032,000
レオパレス21	138,800	304.00	42,195,200
スターツコーポレーション	15,200	2,513.00	38,197,600
フジ住宅	14,400	741.00	10,670,400
空港施設	12,800	504.00	6,451,200
明和地所	6,700	522.00	3,497,400
ゴールドクレスト	8,900	1,728.00	15,379,200
リログループ	59,500	2,880.00	171,360,000
日本エスリード	4,500	1,508.00	6,786,000
日神不動産	16,700	424.00	7,080,800
日本エスコン	20,400	670.00	13,668,000
タカラレーベン	51,400	360.00	18,504,000
サンヨーハウジング名古屋	6,400	861.00	5,510,400
イオンモール	56,200	1,563.00	87,840,600
ファースト住建	4,300	1,091.00	4,691,300
ランド	484,300	8.00	3,874,400
カチタス	12,600	4,000.00	50,400,000
東祥	6,900	2,859.00	19,727,100
トーセイ	15,500	876.00	13,578,000
穴吹興産	1,200	2,925.00	3,510,000
サンフロンティア不動産	15,600	983.00	15,334,800
エフ・ジェー・ネクスト	10,000	955.00	9,550,000

インテリックス	3,500	632.00	2,212,000
ランドビジネス	5,100	772.00	3,937,200
グランディハウス	10,300	436.00	4,490,800
東武鉄道	120,000	3,170.00	380,400,000
相鉄ホールディングス	39,000	3,010.00	117,390,000
東京急行電鉄	309,300	1,968.00	608,702,400
京浜急行電鉄	155,900	1,878.00	292,780,200
小田急電鉄	182,400	2,710.00	494,304,000
京王電鉄	63,700	7,290.00	464,373,000
京成電鉄	85,400	4,080.00	348,432,000
富士急行	15,500	3,995.00	61,922,500
新京成電鉄	3,000	2,054.00	6,162,000
東日本旅客鉄道	202,400	10,395.00	2,103,948,000
西日本旅客鉄道	102,000	8,534.00	870,468,000
東海旅客鉄道	101,900	22,890.00	2,332,491,000
西武ホールディングス	141,000	1,834.00	258,594,000
鴻池運輸	18,100	1,641.00	29,702,100
西日本鉄道	31,400	2,392.00	75,108,800
ハマキョウレックス	8,800	3,610.00	31,768,000
サカイ引越センター	6,000	6,410.00	38,460,000
近鉄グループホールディングス	107,900	5,300.00	571,870,000
阪急阪神ホールディングス	143,800	3,965.00	570,167,000
南海電気鉄道	48,100	2,859.00	137,517,900
京阪ホールディングス	48,100	4,735.00	227,753,500
神戸電鉄	2,900	4,005.00	11,614,500
名古屋鉄道	88,400	3,010.00	266,084,000
山陽電気鉄道	8,400	2,210.00	18,564,000
トランコム	3,100	6,420.00	19,902,000
日本通運	41,500	5,800.00	240,700,000
ヤマトホールディングス	189,100	2,191.50	414,412,650
山九	30,000	5,470.00	164,100,000
日新	9,300	1,697.00	15,782,100
丸運	6,200	277.00	1,717,400
丸全昭和運輸	8,800	3,260.00	28,688,000
センコーグループホールディングス	59,500	858.00	51,051,000
トナミホールディングス	2,600	5,390.00	14,014,000
ニッコンホールディングス	40,900	2,456.00	100,450,400
日本石油輸送	1,300	2,753.00	3,578,900
福山通運	13,800	3,870.00	53,406,000
セイノーホールディングス	80,800	1,403.00	113,362,400
エスライン	3,200	927.00	2,966,400
神奈川中央交通	2,700	3,860.00	10,422,000
日立物流	23,800	3,230.00	76,874,000
丸和運輸機関	5,700	4,005.00	22,828,500
C & F ロジホールディングス	10,900	1,324.00	14,431,600
日本郵船	90,100	1,617.00	145,691,700
商船三井	63,900	2,255.00	144,094,500
川崎汽船	33,300	1,201.00	39,993,300
NSユナイテッド海運	5,900	2,206.00	13,015,400
明治海運	11,500	301.00	3,461,500

飯野海運	50,800	339.00	17,221,200
共栄タンカー	800	1,445.00	1,156,000
九州旅客鉄道	90,500	3,205.00	290,052,500
S Gホールディングス	101,900	3,040.00	309,776,000
日本航空	197,300	3,409.00	672,595,700
A N Aホールディングス	197,100	3,655.00	720,400,500
パスコ	2,200	803.00	1,766,600
西本Wismettacホールディングス	2,600	3,875.00	10,075,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	900	1,190.00	1,071,000
Genky DrugStores	4,700	2,486.00	11,684,200
国際紙パルプ商事	20,200	262.00	5,292,400
総合メディカルホールディングス	9,800	1,684.00	16,503,200
ブックオフグループホールディングス	6,000	859.00	5,154,000
三菱倉庫	37,300	2,926.00	109,139,800
三井倉庫ホールディングス	13,300	1,564.00	20,801,200
住友倉庫	39,600	1,371.00	54,291,600
澁澤倉庫	5,900	1,735.00	10,236,500
ヤマタネ	5,700	1,294.00	7,375,800
東陽倉庫	19,900	305.00	6,069,500
乾汽船	9,900	715.00	7,078,500
日本トランスシティ	23,800	436.00	10,376,800
ケイヒン	2,000	1,178.00	2,356,000
中央倉庫	6,600	988.00	6,520,800
川西倉庫	2,200	1,014.00	2,230,800
安田倉庫	8,900	876.00	7,796,400
東洋埠頭	3,400	1,355.00	4,607,000
宇徳	9,500	495.00	4,702,500
上組	66,500	2,559.00	170,173,500
サンリツ	2,700	604.00	1,630,800
キムラユニティー	3,100	1,039.00	3,220,900
キューソー流通システム	2,700	1,967.00	5,310,900
近鉄エクスプレス	20,300	1,384.00	28,095,200
東海運	6,300	242.00	1,524,600
エーアイティー	7,200	952.00	6,854,400
内外トランスライン	3,600	1,160.00	4,176,000
日本コンセプト	3,200	1,170.00	3,744,000
東京放送ホールディングス	74,100	1,778.00	131,749,800
日本テレビホールディングス	102,500	1,546.00	158,465,000
朝日放送グループホールディングス	10,700	705.00	7,543,500
テレビ朝日ホールディングス	30,600	1,720.00	52,632,000
スカパーJ S A Tホールディングス	84,500	410.00	34,645,000
テレビ東京ホールディングス	9,200	2,265.00	20,838,000
日本BS放送	4,000	1,052.00	4,208,000
ビジョン	3,500	5,500.00	19,250,000
スマートバリュー	3,400	756.00	2,570,400
USEN-NEXT HOLDINGS	4,300	719.00	3,091,700
ワイヤレスゲート	5,300	383.00	2,029,900
コネクシオ	7,900	1,269.00	10,025,100

日本通信	97,600	141.00	13,761,600	
クロップス	2,100	602.00	1,264,200	
日本電信電話	764,100	4,895.00	3,740,269,500	
KDDI	984,500	2,789.00	2,745,770,500	
ソフトバンク	1,184,700	1,424.50	1,687,605,150	
光通信	13,200	21,580.00	284,856,000	
NTTドコモ	707,200	2,503.00	1,770,121,600	
エムティーアイ	11,000	642.00	7,062,000	
GMOインターネット	40,800	1,710.00	69,768,000	
アйдママーケティングコミュニケーション	2,600	575.00	1,495,000	
カドカワ	32,700	1,443.00	47,186,100	
学研ホールディングス	3,800	4,425.00	16,815,000	
ゼンリン	22,300	2,020.00	45,046,000	
昭文社	5,400	366.00	1,976,400	
インプレスホールディングス	9,700	125.00	1,212,500	
東京電力ホールディングス	909,100	571.00	519,096,100	
中部電力	348,500	1,527.50	532,333,750	
関西電力	464,600	1,316.00	611,413,600	
中国電力	157,500	1,360.00	214,200,000	
北陸電力	111,600	798.00	89,056,800	
東北電力	266,500	1,120.00	298,480,000	
四国電力	102,500	1,008.00	103,320,000	
九州電力	234,700	1,084.00	254,414,800	
北海道電力	106,800	596.00	63,652,800	
沖縄電力	21,200	1,677.00	35,552,400	
電源開発	90,500	2,413.00	218,376,500	
エフオン	5,600	723.00	4,048,800	
イーレックス	19,800	1,281.00	25,363,800	
レノバ	18,800	881.00	16,562,800	
東京瓦斯	223,300	2,741.00	612,065,300	
大阪瓦斯	220,900	1,961.00	433,184,900	
東邦瓦斯	56,400	4,305.00	242,802,000	
北海道瓦斯	6,000	1,494.00	8,964,000	
広島ガス	23,000	333.00	7,659,000	
西部瓦斯	12,800	2,300.00	29,440,000	
静岡ガス	35,000	837.00	29,295,000	
メタウォーター	5,500	3,215.00	17,682,500	
アイネット	6,300	1,215.00	7,654,500	
松竹	7,400	12,740.00	94,276,000	
東宝	73,500	4,695.00	345,082,500	
エイチ・アイ・エス	19,400	3,145.00	61,013,000	
東映	4,700	14,420.00	67,774,000	
ラックランド	2,200	2,240.00	4,928,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	297,400	1,301.00	386,917,400	
共立メンテナンス	16,700	5,240.00	87,508,000	
イチネンホールディングス	11,300	1,061.00	11,989,300	
建設技術研究所	7,700	1,432.00	11,026,400	
スペース	7,000	1,150.00	8,050,000	
長 大	4,400	695.00	3,058,000	

アインホールディングス	15,000	8,200.00	123,000,000
燦ホールディングス	2,400	2,260.00	5,424,000
ピー・シー・エー	1,500	3,405.00	5,107,500
スバル興業	700	5,260.00	3,682,000
東京テアトル	4,500	1,308.00	5,886,000
タナベ経営	2,200	1,194.00	2,626,800
ビジネスブレイン太田昭和	1,900	1,946.00	3,697,400
ナガワ	3,100	5,640.00	17,484,000
よみうりランド	2,400	4,955.00	11,892,000
東京都競馬	7,200	3,180.00	22,896,000
常磐興産	4,500	1,609.00	7,240,500
カナモト	16,300	2,352.00	38,337,600
東京ドーム	40,700	1,064.00	43,304,800
D T S	12,600	4,400.00	55,440,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	52,000	4,045.00	210,340,000
シーイーシー	12,000	1,872.00	22,464,000
カブコン	47,900	2,203.00	105,523,700
西尾レントオール	11,000	2,817.00	30,987,000
アイ・エス・ピー	2,200	1,550.00	3,410,000
アゴラ・ホスピタリティー・グループ	63,100	34.00	2,145,400
日本空港ビルディング	35,900	4,095.00	147,010,500
トランス・コスモス	12,100	2,340.00	28,314,000
乃村工藝社	50,900	1,328.00	67,595,200
ジャステック	6,500	902.00	5,863,000
S C S K	29,400	5,210.00	153,174,000
藤田観光	4,300	2,566.00	11,033,800
K N T - C Tホールディングス	5,800	1,403.00	8,137,400
日本管財	11,800	1,816.00	21,428,800
トーカイ	10,500	2,312.00	24,276,000
白洋舎	1,200	2,802.00	3,362,400
セコム	115,400	9,196.00	1,061,218,400
日本システムウエア	3,700	2,401.00	8,883,700
セントラル警備保障	5,300	5,460.00	28,938,000
アイネス	14,200	1,124.00	15,960,800
丹青社	20,700	1,087.00	22,500,900
メイテック	13,500	5,200.00	70,200,000
T K C	9,500	4,430.00	42,085,000
富士ソフト	16,800	4,615.00	77,532,000
応用地質	11,800	1,038.00	12,248,400
船井総研ホールディングス	22,500	2,577.00	57,982,500
N S D	18,400	3,015.00	55,476,000
進学会ホールディングス	5,200	607.00	3,156,400
丸紅建材リース	1,100	1,662.00	1,828,200
オオバ	8,900	624.00	5,553,600
コナミホールディングス	45,700	5,180.00	236,726,000
いであ	2,400	1,132.00	2,716,800
学究社	3,800	1,247.00	4,738,600
ベネッセホールディングス	39,800	2,542.00	101,171,600

イオンディライト	13,400	3,150.00	42,210,000
ナック	7,000	925.00	6,475,000
福井コンピュータホールディングス	3,700	2,366.00	8,754,200
ニチイ学館	15,500	1,397.00	21,653,500
ダイセキ	18,300	2,672.00	48,897,600
ステップ	4,000	1,415.00	5,660,000
日鉄物産	8,000	4,140.00	33,120,000
泉州電業	3,700	2,284.00	8,450,800
元気寿司	3,200	3,650.00	11,680,000
トラスコ中山	23,400	2,360.00	55,224,000
ヤマダ電機	341,400	505.00	172,407,000
オートバックスセブン	44,500	1,673.00	74,448,500
モリト	8,200	787.00	6,453,400
アーランドサカモト	18,900	1,288.00	24,343,200
ニトリホールディングス	48,600	13,105.00	636,903,000
グルメ杵屋	8,200	1,140.00	9,348,000
愛眼	9,500	238.00	2,261,000
ケーユーホールディングス	5,900	827.00	4,879,300
吉野家ホールディングス	39,300	1,781.00	69,993,300
加藤産業	17,500	3,360.00	58,800,000
北恵	2,200	770.00	1,694,000
イノテック	6,700	792.00	5,306,400
イエローハット	21,200	1,363.00	28,895,600
松屋フーズホールディングス	5,400	3,300.00	17,820,000
JBCホールディングス	8,900	1,240.00	11,036,000
JKホールディングス	10,100	544.00	5,494,400
サガミホールディングス	15,100	1,312.00	19,811,200
日伝	9,300	1,630.00	15,159,000
関西スーパーマーケット	8,500	1,026.00	8,721,000
ミロク情報サービス	11,100	3,165.00	35,131,500
北沢産業	8,800	281.00	2,472,800
杉本商事	6,100	2,022.00	12,334,200
因幡電機産業	16,000	4,275.00	68,400,000
王将フードサービス	8,300	6,720.00	55,776,000
プレナス	12,500	1,827.00	22,837,500
ミニストップ	8,300	1,600.00	13,280,000
アークス	21,000	2,101.00	44,121,000
バローホールディングス	24,200	2,177.00	52,683,400
東テック	3,800	2,039.00	7,748,200
ミスミグループ本社	140,500	2,444.00	343,382,000
藤久	900	725.00	652,500
アルテック	8,700	201.00	1,748,700
ベルク	5,500	5,070.00	27,885,000
大庄	6,000	1,532.00	9,192,000
タキヒヨー	3,400	1,784.00	6,065,600
ファーストリテイリング	15,000	63,110.00	946,650,000
ソフトバンクグループ	467,000	9,612.00	4,488,804,000
蔵王産業	1,800	1,298.00	2,336,400
スズケン	51,100	6,730.00	343,903,000
サンドラッグ	42,200	2,705.00	114,151,000

サクスパー ホールディングス	9,500	988.00	9,386,000	
ジェコス	7,700	938.00	7,222,600	
ヤマザワ	2,400	1,598.00	3,835,200	
やまや	1,900	1,987.00	3,775,300	
ルネサスイーストン	10,400	426.00	4,430,400	
ベルーナ	27,600	737.00	20,341,200	
合計	133,861,300		245,009,417,140	

*担保として以下の有価証券が差し入れられております。

銘柄	株式数
トヨタ自動車	500,000

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成30年12月3日現在	令和1年6月3日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		5,093,491,693	717,213,004
国債証券		288,711,930,500	230,536,232,800
地方債証券		21,908,328,736	21,709,757,111
特殊債券		18,039,378,362	18,025,183,726
社債券		15,034,982,440	13,560,958,640
未収入金		5,288,730,000	13,201,302,100
未収利息		878,273,077	696,735,905
前払費用		60,467,919	43,310,406
流動資産合計		355,015,582,727	298,490,693,692
資産合計		355,015,582,727	298,490,693,692
負債の部			
流動負債			
未払金		9,231,629,000	405,826,000
未払解約金		62,591,000	243,305,000
流動負債合計		9,294,220,000	649,131,000
負債合計		9,294,220,000	649,131,000
純資産の部			
元本等			
元本	1	268,420,728,827	226,088,858,222
剰余金			
剰余金又は欠損金()		77,300,633,900	71,752,704,470
元本等合計		345,721,362,727	297,841,562,692
純資産合計		345,721,362,727	297,841,562,692
負債純資産合計		355,015,582,727	298,490,693,692

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	平成30年12月3日現在	令和1年6月3日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額 同期中追加設定元本額 同期中一部解約元本額	266,167,563,157円 74,621,284,187円 72,368,118,517円	268,420,728,827円 59,873,533,898円 102,205,404,503円
元本の内訳 ファンド名		
D I A M国内債券パッシブ・ファンド	17,365,278,569円	18,887,134,209円
M I T O ラップ型ファンド（安定型）	112,034,659円	97,457,607円
M I T O ラップ型ファンド（中立型）	90,125,269円	81,160,219円
M I T O ラップ型ファンド（積極型）	28,070,090円	24,354,225円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	800,695,596円	895,926,245円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	242,214,024円	205,878,038円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	34,579,469円	28,990,862円
たわらノーロード 国内債券	5,099,805,619円	7,166,801,716円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	151,825,503円	290,944,034円
たわらノーロード バランス（堅実型）	36,300,526円	70,961,061円
たわらノーロード バランス（標準型）	69,144,512円	132,012,309円
たわらノーロード バランス（積極型）	12,537,222円	18,997,452円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（保守型）	5,126,478円	8,429,357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）	93,800,153円	154,635,314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）	119,678,115円	189,122,376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）	31,103,764円	51,872,920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)	16,466,868円	15,923,978円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(保守型)	1,331,012円	3,193,047円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定型)	753,070円	3,250,913円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定成長型)	3,637,273円	4,040,914円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(成長型)	691,559円	758,377円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(積極型)	17,517円	17,517円
D I A M国内債券インデックス ファンド< D C年金>	12,925,603,346円	13,356,632,266円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 1 安定型	5,926,052,832円	6,180,649,744円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 2 安定・成長型	8,532,413,963円	8,572,957,080円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 3 成長型	3,443,368,379円	3,378,940,595円
D I A M D C バランス3 0 インデックスファンド	1,824,249,179円	1,799,558,835円
D I A M D C バランス5 0 インデックスファンド	2,020,301,811円	1,981,070,987円
D I A M D C バランス7 0 インデックスファンド	316,274,220円	305,828,135円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型>	88,005,645円	86,634,077円
マネックス資産設計ファンド< 育成型>	2,327,753,633円	2,370,479,584円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	2,827,451円	2,490,772円
D I A M D C 8資産バラ ンスファンド(新興国1 0)	3,155,808,249円	3,271,916,153円
D I A M D C 8資産バラ ンスファンド(新興国2 0)	750,900,239円	809,977,953円
D I A M D C 8資産バラ ンスファンド(新興国3 0)	161,069,244円	172,992,778円
投資のソムリエ	11,756,195,244円	10,694,840,115円
クルーズコントロール	1,095,206,382円	529,226,407円
投資のソムリエ< D C年金>	1,055,061,266円	1,095,867,197円
D I A M 8資産バランスファ ンドN< D C年金>	2,287,748,098円	2,571,810,358円
4資産分散投資・ハイクラス< D C年金>	284,875,237円	299,045,416円
クルーズコントロール< D C年 金>	694,058円	475,039円
D I A Mコア資産設計ファンド (堅実型)	2,724,127円	2,155,856円
D I A Mコア資産設計ファンド (積極型)	7,287,339円	5,629,997円
投資のソムリエ< D C年金>リ スク抑制型	1,212,735,818円	843,382,801円

ダイナミック・ナビゲーション	1,929,773円	496,041円
リスク抑制世界8資産バランス	21,615,360,469円	12,016,509,091円
ファンド		
投資のソムリエ(ターゲット・	2,681,278円	3,752,635円
イヤー2045)		
投資のソムリエ(ターゲット・	2,036,324円	3,196,636円
イヤー2055)		
リスク抑制世界8資産バランス	7,412,313円	6,268,355円
ファンド(DC)		
投資のソムリエ(ターゲット・	4,276,492円	7,222,922円
イヤー2035)		
4資産分散投資・スタンダード	73,024,177円	97,473,459円
<DC年金>		
リスクコントロール世界資産分	1,797,723,485円	1,877,163,089円
散ファンド		
9資産分散投資・スタンダード	290,676円	351,258,056円
<DC年金>		
投資のソムリエ(ターゲット・	-円	770,958円
イヤー2040)		
投資のソムリエ(ターゲット・	-円	770,958円
イヤー2050)		
投資のソムリエ(ターゲット・	-円	770,958円
イヤー2060)		
4資産分散投資・ミドルクラス	-円	281,648円
<DC年金>		
DIAMエマージング債券ファ	9,450,010円	9,450,010円
ンド		
DIAM国内債券パッシブファ	22,703,716,182円	7,854,443,915円
ンド(適格機関投資家向け)		
DIAMワールドバランス25	435,148,026円	428,617,251円
VA(適格機関投資家限定)		
One収益追求型マルチアセッ	-円	2,650,787,553円
ト戦略ファンド(適格機関投資		
家限定)		
One収益追求型マルチアセッ	-円	2,646,517,337円
ト戦略ファンドII(適格機関		
投資家限定)		
One収益追求型マルチアセッ	-円	2,631,578,948円
ト戦略ファンドIII(適格機		
関投資家限定)		
One収益追求型マルチアセッ	-円	2,631,980,470円
ト戦略ファンドIV(適格機関		
投資家限定)		
DIAMグローバル・バランス	272,550,779円	257,109,893円
ファンド25VA(適格機関投		
資家限定)		
DIAMグローバル・バランス	221,488,876円	211,621,430円
ファンド50VA(適格機関投		
資家限定)		
DIAM国際分散バランスファ	68,085,649円	66,638,487円
ンド30VA(適格機関投資家		
限定)		

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)	190,006,782円	174,646,497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)	80,749,301円	78,864,193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)	37,044,794円	34,428,787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)	88,615,545円	89,624,543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)	161,363,418円	173,368,987円
D I A Mバランスファンド2 5 V A (適格機関投資家限定)	5,402,408,441円	4,933,337,206円
D I A Mバランスファンド3 7 . 5 V A (適格機関投資家限 定)	2,845,867,814円	2,671,234,824円
D I A Mバランスファンド5 0 V A (適格機関投資家限定)	5,296,455,831円	4,998,685,121円
D I A Mグローバル・アセッ ト・バランスV A (適格機関投 資家限定)	561,415,539円	544,085,264円
D I A Mグローバル・アセッ ト・バランスV A 2 (適格機関 投資家限定)	255,314,018円	244,671,171円
D I A M アクサ グローバ ル バランスファンド3 0 V A (適格機関投資家限定)	3,288,554,074円	3,007,399,923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)	789,029,827円	547,211,180円
D I A Mグローバル 私募ファ ンド (適格機関投資家向け)	194,752,933円	188,050,355円
D I A M世界バランスファンド 5 5 V A (適格機関投資家限 定)	44,566,957円	18,643,915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)	84,087,409円	64,054,784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)	53,817,032,109円	30,473,043,093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)	523,332,853円	125,333,071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)	6,934,137,421円	4,838,542,893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)	26,451,006,817円	22,411,189,677円
D I A Mバランス3 0 V A (適 格機関投資家限定)	76,464,116円	73,645,686円
D I A Mバランス5 0 V A (適 格機関投資家限定)	536,536円	1,368,505円
D I A Mバランス7 0 V A (適 格機関投資家限定)	7,629,980円	1,869,962円
D I A M世界アセットバランス ファンド4 V A (適格機関投資 家限定)	29,496,618,735円	28,968,350,805円
D I A M世界バランス2 5 V A (適格機関投資家限定)	447,867,277円	391,985,778円
D I A M国内バランス3 0 V A (適格機関投資家限定)	129,163,855円	113,781,168円
D I A Mバランス2 0 V A (適 格機関投資家限定)	508,066,309円	501,233,090円
D I A Mバランス4 0 V A (適 格機関投資家限定)	711,790円	717,067円
D I A Mバランス6 0 V A (適 格機関投資家限定)	381,210円	385,742円
計	268,420,728,827円	226,088,858,222円
2 . 受益権の総数	268,420,728,827口	226,088,858,222口

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成30年6月5日 至 平成30年12月3日	自 平成30年12月4日 至 令和1年6月3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30年12月3日現在	令和1年6月3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30年12月3日現在	令和1年6月3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	1,205,598,400	2,042,721,100
地方債証券	95,063,529	38,833,543
特殊債券	91,942,731	41,970,706
社債券	91,825,810	32,600,660
合計	1,484,430,470	2,013,257,603

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(平成30年2月15日から平成30年12月3日まで及び平成31年2月15日から令和1年6月3日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成30年12月3日現在	令和1年6月3日現在
1口当たり純資産額	1.2880円	1.3174円
(1万口当たり純資産額)	(12,880円)	(13,174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

令和1年6月3日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
国債証券	391回 利付国庫債券(2年)	1,200,000,000	1,203,756,000	
	392回 利付国庫債券(2年)	800,000,000	802,688,000	
	393回 利付国庫債券(2年)	1,000,000,000	1,003,580,000	
	394回 利付国庫債券(2年)	700,000,000	702,667,000	
	395回 利付国庫債券(2年)	900,000,000	903,699,000	
	396回 利付国庫債券(2年)	700,000,000	703,045,000	
	397回 利付国庫債券(2年)	800,000,000	803,664,000	
	398回 利付国庫債券(2年)	1,100,000,000	1,105,368,000	
	126回 利付国庫債券(5年)	2,500,000,000	2,510,650,000	
	127回 利付国庫債券(5年)	1,820,000,000	1,829,154,600	
	128回 利付国庫債券(5年)	2,200,000,000	2,212,628,000	
	129回 利付国庫債券(5年)	2,120,000,000	2,133,928,400	
	130回 利付国庫債券(5年)	1,300,000,000	1,309,633,000	
	131回 利付国庫債券(5年)	2,020,000,000	2,036,725,600	
	132回 利付国庫債券(5年)	2,000,000,000	2,018,060,000	
	133回 利付国庫債券(5年)	1,180,000,000	1,191,741,000	
	134回 利付国庫債券(5年)	2,080,000,000	2,102,276,800	
	135回 利付国庫債券(5年)	2,100,000,000	2,124,066,000	
	136回 利付国庫債券(5年)	1,700,000,000	1,720,791,000	
	137回 利付国庫債券(5年)	1,400,000,000	1,418,186,000	
	138回 利付国庫債券(5年)	1,900,000,000	1,926,144,000	
	139回 利付国庫債券(5年)	600,000,000	608,706,000	
	2回 利付国庫債券(40年)	460,000,000	682,226,000	
	3回 利付国庫債券(40年)	380,000,000	569,076,600	
	4回 利付国庫債券(40年)	540,000,000	815,297,400	
	5回 利付国庫債券(40年)	580,000,000	847,791,800	
	6回 利付国庫債券(40年)	580,000,000	836,487,600	
	7回 利付国庫債券(40年)	580,000,000	805,359,000	
	8回 利付国庫債券(40年)	720,000,000	935,172,000	
	9回 利付国庫債券(40年)	1,000,000,000	968,920,000	
	10回 利付国庫債券(40年)	990,000,000	1,126,610,100	
	11回 利付国庫債券(40年)	680,000,000	749,931,200	
	310回 利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,522,785,000	
	311回 利付国庫債券(10年)	1,020,000,000	1,032,841,800	
	312回 利付国庫債券(10年)	2,200,000,000	2,246,684,000	
	313回 利付国庫債券(10年)	1,790,000,000	1,837,452,900	
	314回 利付国庫債券(10年)	800,000,000	818,328,000	
	315回 利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,542,450,000	
	317回 利付国庫債券(10年)	600,000,000	617,700,000	
	318回 利付国庫債券(10年)	600,000,000	616,320,000	

319回	利付国庫債券(10年)	800,000,000	826,288,000
320回	利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,545,450,000
321回	利付国庫債券(10年)	1,600,000,000	1,653,424,000
322回	利付国庫債券(10年)	500,000,000	515,295,000
323回	利付国庫債券(10年)	750,000,000	775,140,000
324回	利付国庫債券(10年)	1,050,000,000	1,081,983,000
325回	利付国庫債券(10年)	2,100,000,000	2,169,657,000
326回	利付国庫債券(10年)	500,000,000	516,065,000
327回	利付国庫債券(10年)	1,450,000,000	1,501,765,000
328回	利付国庫債券(10年)	2,390,000,000	2,463,038,400
329回	利付国庫債券(10年)	2,270,000,000	2,362,525,200
330回	利付国庫債券(10年)	1,450,000,000	1,512,828,500
331回	利付国庫債券(10年)	650,000,000	672,529,000
332回	利付国庫債券(10年)	2,460,000,000	2,550,257,400
333回	利付国庫債券(10年)	2,100,000,000	2,181,270,000
334回	利付国庫債券(10年)	2,170,000,000	2,258,449,200
335回	利付国庫債券(10年)	2,250,000,000	2,334,285,000
336回	利付国庫債券(10年)	850,000,000	883,362,500
337回	利付国庫債券(10年)	1,110,000,000	1,141,113,300
338回	利付国庫債券(10年)	2,080,000,000	2,153,112,000
339回	利付国庫債券(10年)	2,240,000,000	2,322,208,000
340回	利付国庫債券(10年)	2,300,000,000	2,387,975,000
341回	利付国庫債券(10年)	2,710,000,000	2,799,863,600
342回	利付国庫債券(10年)	2,730,000,000	2,786,374,500
343回	利付国庫債券(10年)	2,480,000,000	2,532,228,800
344回	利付国庫債券(10年)	2,280,000,000	2,329,772,400
345回	利付国庫債券(10年)	2,160,000,000	2,207,930,400
346回	利付国庫債券(10年)	2,370,000,000	2,422,424,400
347回	利付国庫債券(10年)	2,300,000,000	2,350,623,000
348回	利付国庫債券(10年)	2,230,000,000	2,278,725,500
349回	利付国庫債券(10年)	2,360,000,000	2,411,070,400
350回	利付国庫債券(10年)	2,800,000,000	2,859,808,000
351回	利付国庫債券(10年)	2,360,000,000	2,409,654,400
352回	利付国庫債券(10年)	2,270,000,000	2,316,943,600
353回	利付国庫債券(10年)	2,000,000,000	2,039,520,000
354回	利付国庫債券(10年)	850,000,000	866,379,500
1回	利付国庫債券(30年)	100,000,000	129,495,000
2回	利付国庫債券(30年)	100,000,000	126,461,000
3回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	251,790,000
4回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	267,404,000
5回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	252,920,000
6回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	259,498,000
7回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	387,906,000
8回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	246,824,000
11回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	245,166,000
12回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	256,920,000
13回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	381,990,000
14回	利付国庫債券(30年)	290,000,000	387,222,500
15回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	270,738,000
16回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	407,244,000

17回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	269,382,000	
18回	利付国庫債券(30年)	420,000,000	560,595,000	
19回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	267,576,000	
20回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	411,816,000	
21回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	403,155,000	
22回	利付国庫債券(30年)	320,000,000	441,721,600	
23回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	276,728,000	
24回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	416,394,000	
25回	利付国庫債券(30年)	400,000,000	542,840,000	
26回	利付国庫債券(30年)	700,000,000	963,746,000	
27回	利付国庫債券(30年)	580,000,000	813,293,400	
28回	利付国庫債券(30年)	680,000,000	958,052,000	
29回	利付国庫債券(30年)	710,000,000	991,905,500	
30回	利付国庫債券(30年)	840,000,000	1,162,551,600	
31回	利付国庫債券(30年)	700,000,000	959,028,000	
32回	利付国庫債券(30年)	960,000,000	1,341,004,800	
33回	利付国庫債券(30年)	1,070,000,000	1,435,544,100	
34回	利付国庫債券(30年)	920,000,000	1,277,539,600	
35回	利付国庫債券(30年)	1,120,000,000	1,514,732,800	
36回	利付国庫債券(30年)	1,000,000,000	1,358,310,000	
37回	利付国庫債券(30年)	1,040,000,000	1,394,723,200	
38回	利付国庫債券(30年)	720,000,000	952,430,400	
39回	利付国庫債券(30年)	630,000,000	849,384,900	
40回	利付国庫債券(30年)	550,000,000	730,207,500	
41回	利付国庫債券(30年)	610,000,000	797,038,200	
42回	利付国庫債券(30年)	710,000,000	928,651,600	
43回	利付国庫債券(30年)	580,000,000	760,287,200	
44回	利付国庫債券(30年)	610,000,000	800,435,900	
45回	利付国庫債券(30年)	700,000,000	885,640,000	
46回	利付国庫債券(30年)	830,000,000	1,052,058,200	
47回	利付国庫債券(30年)	760,000,000	983,227,200	
48回	利付国庫債券(30年)	690,000,000	859,284,600	
49回	利付国庫債券(30年)	760,000,000	948,062,000	
50回	利付国庫債券(30年)	680,000,000	745,817,200	
51回	利付国庫債券(30年)	850,000,000	823,225,000	
52回	利付国庫債券(30年)	730,000,000	744,300,700	
53回	利付国庫債券(30年)	800,000,000	835,552,000	
54回	利付国庫債券(30年)	700,000,000	767,151,000	
55回	利付国庫債券(30年)	740,000,000	811,565,400	
56回	利付国庫債券(30年)	680,000,000	745,348,000	
57回	利付国庫債券(30年)	740,000,000	810,640,400	
58回	利付国庫債券(30年)	1,010,000,000	1,105,737,900	
59回	利付国庫債券(30年)	680,000,000	726,464,400	
60回	利付国庫債券(30年)	650,000,000	729,482,000	
61回	利付国庫債券(30年)	650,000,000	693,277,000	
62回	利付国庫債券(30年)	500,000,000	505,240,000	
47回	利付国庫債券(20年)	250,000,000	257,710,000	
48回	利付国庫債券(20年)	500,000,000	520,760,000	
61回	利付国庫債券(20年)	500,000,000	522,920,000	
64回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	654,450,000	

72回	利付国庫債券(20年)	350,000,000	392,980,000	
73回	利付国庫債券(20年)	340,000,000	381,833,600	
75回	利付国庫債券(20年)	440,000,000	499,149,200	
78回	利付国庫債券(20年)	190,000,000	214,342,800	
81回	利付国庫債券(20年)	240,000,000	273,578,400	
83回	利付国庫債券(20年)	480,000,000	552,849,600	
85回	利付国庫債券(20年)	440,000,000	509,326,400	
88回	利付国庫債券(20年)	750,000,000	883,012,500	
90回	利付国庫債券(20年)	700,000,000	823,466,000	
92回	利付国庫債券(20年)	1,000,000,000	1,174,390,000	
93回	利付国庫債券(20年)	700,000,000	819,945,000	
94回	利付国庫債券(20年)	800,000,000	943,392,000	
95回	利付国庫債券(20年)	350,000,000	420,157,500	
97回	利付国庫債券(20年)	500,000,000	598,700,000	
99回	利付国庫債券(20年)	900,000,000	1,074,357,000	
100回	利付国庫債券(20年)	850,000,000	1,026,128,500	
102回	利付国庫債券(20年)	360,000,000	442,944,000	
105回	利付国庫債券(20年)	700,000,000	845,292,000	
106回	利付国庫債券(20年)	350,000,000	425,932,500	
107回	利付国庫債券(20年)	400,000,000	484,804,000	
108回	利付国庫債券(20年)	750,000,000	894,555,000	
109回	利付国庫債券(20年)	520,000,000	622,221,600	
110回	利付国庫債券(20年)	630,000,000	766,294,200	
111回	利付国庫債券(20年)	290,000,000	357,126,300	
112回	利付国庫債券(20年)	750,000,000	916,005,000	
113回	利付国庫債券(20年)	1,170,000,000	1,434,033,900	
114回	利付国庫債券(20年)	800,000,000	983,896,000	
115回	利付国庫債券(20年)	400,000,000	496,196,000	
116回	利付国庫債券(20年)	450,000,000	560,160,000	
117回	利付国庫債券(20年)	800,000,000	987,160,000	
118回	利付国庫債券(20年)	310,000,000	380,360,700	
119回	利付国庫債券(20年)	300,000,000	361,431,000	
120回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	709,542,000	
121回	利付国庫債券(20年)	730,000,000	890,191,200	
122回	利付国庫債券(20年)	500,000,000	604,050,000	
123回	利付国庫債券(20年)	680,000,000	847,307,200	
124回	利付国庫債券(20年)	500,000,000	617,230,000	
125回	利付国庫債券(20年)	610,000,000	769,606,500	
126回	利付国庫債券(20年)	450,000,000	557,109,000	
127回	利付国庫債券(20年)	450,000,000	551,794,500	
128回	利付国庫債券(20年)	550,000,000	676,263,500	
129回	利付国庫債券(20年)	440,000,000	535,708,800	
130回	利付国庫債券(20年)	530,000,000	646,902,100	
131回	利付国庫債券(20年)	450,000,000	543,726,000	
132回	利付国庫債券(20年)	540,000,000	653,929,200	
133回	利付国庫債券(20年)	720,000,000	880,927,200	
134回	利付国庫債券(20年)	620,000,000	760,324,600	
135回	利付国庫債券(20年)	350,000,000	424,749,500	
136回	利付国庫債券(20年)	500,000,000	600,410,000	
137回	利付国庫債券(20年)	490,000,000	595,933,100	

138回	利付国庫債券(20年)	280,000,000	333,261,600		
139回	利付国庫債券(20年)	430,000,000	517,376,000		
140回	利付国庫債券(20年)	940,000,000	1,145,606,200		
141回	利付国庫債券(20年)	900,000,000	1,099,053,000		
142回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	740,766,000		
143回	利付国庫債券(20年)	760,000,000	919,463,200		
144回	利付国庫債券(20年)	510,000,000	610,036,500		
145回	利付国庫債券(20年)	1,200,000,000	1,470,996,000		
146回	利付国庫債券(20年)	1,100,000,000	1,350,910,000		
147回	利付国庫債券(20年)	1,230,000,000	1,495,581,600		
148回	利付国庫債券(20年)	1,080,000,000	1,299,434,400		
149回	利付国庫債券(20年)	1,050,000,000	1,265,050,500		
150回	利付国庫債券(20年)	1,250,000,000	1,489,200,000		
151回	利付国庫債券(20年)	1,160,000,000	1,348,094,000		
152回	利付国庫債券(20年)	1,140,000,000	1,325,671,800		
153回	利付国庫債券(20年)	1,190,000,000	1,403,295,600		
154回	利付国庫債券(20年)	1,150,000,000	1,338,876,000		
155回	利付国庫債券(20年)	1,180,000,000	1,336,527,000		
156回	利付国庫債券(20年)	1,030,000,000	1,065,195,100		
157回	利付国庫債券(20年)	1,100,000,000	1,099,087,000		
158回	利付国庫債券(20年)	880,000,000	922,592,000		
159回	利付国庫債券(20年)	1,120,000,000	1,192,900,800		
160回	利付国庫債券(20年)	750,000,000	810,937,500		
161回	利付国庫債券(20年)	960,000,000	1,020,652,800		
162回	利付国庫債券(20年)	950,000,000	1,009,935,500		
163回	利付国庫債券(20年)	970,000,000	1,030,169,100		
164回	利付国庫債券(20年)	1,210,000,000	1,262,017,900		
165回	利付国庫債券(20年)	920,000,000	958,318,000		
166回	利付国庫債券(20年)	900,000,000	970,083,000		
167回	利付国庫債券(20年)	1,050,000,000	1,090,782,000		
168回	利付国庫債券(20年)	650,000,000	662,142,000		
国債証券 合計		207,830,000,000	230,536,232,800		
地方債証券	688回	東京都公募公債	200,000,000	202,404,000	
	697回	東京都公募公債	500,000,000	511,225,000	
	701回	東京都公募公債	700,000,000	715,708,000	
	708回	東京都公募公債	500,000,000	513,400,000	
	720回	東京都公募公債	300,000,000	310,434,000	
	726回	東京都公募公債	400,000,000	413,092,000	
	5回	東京都公募公債 20年	100,000,000	112,091,000	
	9回	東京都公募公債 20年	200,000,000	233,804,000	
	10回	東京都公募公債 20年	300,000,000	350,208,000	
	22年度12回	北海道公募公債	200,000,000	204,166,000	
	30年度14回	北海道公募公債	300,000,000	303,249,000	
	194回	神奈川県公募公債	300,000,000	308,310,000	
	208回	神奈川県公募公債	300,000,000	308,031,000	
	345回	大阪府公募公債	300,000,000	305,754,000	
	356回	大阪府公募公債	200,000,000	205,284,000	
	364回	大阪府公募公債	300,000,000	307,557,000	
	374回	大阪府公募公債	300,000,000	311,292,000	
	26年度11回	京都府公募公債	350,000,000	358,837,500	

26年度17回 兵庫県公募公債	200,000,000	204,922,000	
1回 兵庫県公募公債(12年)	300,000,000	316,227,000	
22年度8回 静岡県公募公債	200,000,000	202,574,000	
23年度9回 静岡県公募公債	200,000,000	205,132,000	
8回 静岡県公募公債 15年	200,000,000	215,500,000	
1回 静岡県公募公債 20年	100,000,000	113,582,000	
22年度6回 愛知県公募公債	200,000,000	202,700,000	
23年度20回 愛知県公募公債	500,000,000	515,040,000	
25年度4回 愛知県公募公債	300,000,000	310,119,000	
23年度2回 埼玉県公募公債	200,000,000	204,660,000	
26年度5回 埼玉県公募公債	400,000,000	412,168,000	
14回 埼玉県公募公債 20年	300,000,000	355,938,000	
25年度11回 福岡県公募公債	200,000,000	206,472,000	
24年度2回 福岡県公募公債(20年)	300,000,000	355,809,000	
24年度7回 千葉県公募公債	300,000,000	307,779,000	
25年度5回 千葉県公募公債	200,000,000	207,014,000	
94回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,024,000	
99回 共同発行市場公募地方債	700,000,000	716,730,000	
106回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	307,605,000	
109回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	514,995,000	
111回 共同発行市場公募地方債	700,000,000	718,830,000	
119回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	514,720,000	
121回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	510,895,000	
126回 共同発行市場公募地方債	793,900,000	821,281,611	
127回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	514,715,000	
128回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	308,724,000	
137回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	514,240,000	
139回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	514,115,000	
142回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	509,160,000	
144回 共同発行市場公募地方債	400,000,000	410,440,000	
146回 共同発行市場公募地方債	400,000,000	412,712,000	
148回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	516,350,000	
166回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	505,720,000	
29年度4回 大阪市公募公債	200,000,000	201,904,000	
488回 名古屋市公募公債 10年	450,000,000	463,765,500	
4回 京都市公募公債 20年	100,000,000	118,046,000	
30年度7回 神戸市公募公債 30年	300,000,000	305,664,000	
22年度3回 横浜市公募公債	200,000,000	202,994,000	
22年度5回 横浜市公募公債	200,000,000	203,820,000	
23年度4回 横浜市公募公債	450,000,000	461,380,500	
25年度2回 横浜市公募公債	400,000,000	414,436,000	
25年度4回 札幌市公募公債	200,000,000	206,390,000	
第91回 川崎市公募公債	200,000,000	202,498,000	
23年度1回 千葉市公募公債	200,000,000	205,120,000	
地方債証券 合計	20,943,900,000	21,709,757,111	
特殊債券			
78回 日本政策投資銀行債券	200,000,000	202,244,000	
19回 高速道路機構債	150,000,000	230,460,000	
26回 高速道路機構債	200,000,000	280,510,000	
96回 高速道路機構債	700,000,000	717,906,000	
116回 高速道路機構債	100,000,000	103,015,000	

172回 高速道路機構債	200,000,000	197,232,000	
9回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	103,506,000	
18回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	315,036,000	
121回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	597,255,000	
149回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	400,000,000	410,332,000	
180回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1,000,000,000	1,027,480,000	
189回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	511,250,000	
193回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	518,700,000	
195回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	330,000,000	342,998,700	
239回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	343,407,000	
241回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	513,850,000	
260回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	242,934,000	
309回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	800,000,000	809,672,000	
319回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	210,622,000	
28回 日本道路・機構承継債	400,000,000	545,336,000	
1回 地方公共団体金融機構債券 20年	200,000,000	237,586,000	
15回 政保地方公共団体金融機構債券	200,000,000	202,478,000	
20回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	306,048,000	
24回 地方公共団体金融機構債券	300,000,000	307,095,000	
19回 地方公共団体金融機構債券	200,000,000	240,490,000	
36回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	308,307,000	
24回 地方公共団体金融機構債券 20年	200,000,000	238,648,000	
44回 政保地方公共団体金融機構債券	400,000,000	412,640,000	
50回 政保地方公共団体金融機構債券	500,000,000	519,475,000	
56回 政保地方公共団体金融機構債券	542,000,000	561,652,920	
64回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	309,021,000	
44回 地方公共団体金融機構債券 20年	200,000,000	230,050,000	
83回 地方公共団体金融機構債券 10年	400,000,000	400,212,000	
15回 日本政策金融公庫債券	200,000,000	239,498,000	
39回 住宅金融支援機構債券	200,000,000	241,556,000	
75回 住宅金融支援機構債券	350,000,000	427,980,000	
222回 住宅金融支援機構債券	300,000,000	303,405,000	
230回 住宅金融支援機構債券	300,000,000	305,067,000	
6回 貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	41,385,000	43,232,012	
8回 貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	29,182,000	30,562,016	
9回 貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	43,611,000	45,740,961	

	2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	46,389,000	49,075,386	
	13回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	15,841,000	16,243,836	
	14回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	79,885,000	81,609,717	
	43回貸付債権担保住宅金融公庫債券	15,407,000	16,283,966	
	44回貸付債権担保住宅金融公庫債券	59,052,000	62,313,441	
	51回貸付債権担保住宅金融公庫債券	43,857,000	46,156,422	
	1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	74,070,000	77,349,078	
	29回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	154,605,000	167,042,972	
	36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	266,456,000	284,271,248	
	126回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	281,652,000	285,958,459	
	128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	283,017,000	287,236,783	
	131回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	287,001,000	290,878,383	
	132回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	287,451,000	291,340,212	
	137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	293,352,000	298,814,214	
	い第783号 利付商工債	300,000,000	300,702,000	
	325回 利附信金中金債	400,000,000	399,948,000	
	220号 利附商工債(3年)	300,000,000	300,324,000	
	15回 国際協力機構債	100,000,000	119,566,000	
	55回 鉄道建設運輸施設債	500,000,000	515,580,000	
	特殊債券 合計	16,874,213,000	18,025,183,726	
社債券	1回 B P C E S A円貨社債(ソーシャルボンド)	200,000,000	199,480,000	
	6回 クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	200,000,000	205,668,000	
	337回 東京交通債	200,000,000	207,898,000	
	22回 中日本高速道路債券	300,000,000	303,801,000	
	34回 西日本高速道路債券	200,000,000	203,128,000	
	9回 日本たばこ産業社債	200,000,000	200,394,000	
	19回 三菱ケミカルホールディングス社債	100,000,000	101,289,000	
	6回 J Xホールディングス社債	100,000,000	103,884,000	
	23回 ジェイ エフ イー ホールディングス社債	100,000,000	99,996,000	
	13回 パナソニック社債	100,000,000	101,255,000	
	14回 トヨタ自動車社債	200,000,000	206,994,000	
	16回 トヨタ自動車社債	200,000,000	205,688,000	
	94回 丸紅社債	100,000,000	103,405,000	
	45回 住友商事社債	100,000,000	102,916,000	
	47回 住友商事社債	100,000,000	103,127,000	
	48回 クレディセゾン社債	100,000,000	103,500,000	
	57回 東京三菱銀行社債	200,000,000	214,512,000	
	25回 三菱東京UFJ銀行劣後社債	200,000,000	203,486,000	
	28回 三菱東京UFJ銀行劣後社債	200,000,000	204,624,000	

32回	三菱東京UFJ銀行劣後社債	300,000,000	308,988,000	
9回	三菱UFJ信託銀行劣後債	100,000,000	102,945,000	
12回	住友信託銀行劣後債	100,000,000	101,835,000	
10回	三井住友信託銀行社債	200,000,000	205,032,000	
10回	セブン銀行社債	100,000,000	102,672,000	
22回	三井住友銀行劣後社債	200,000,000	203,486,000	
23回	三井住友銀行劣後社債	400,000,000	409,268,000	
15回	トヨタファイナンス社債	200,000,000	204,266,000	
47回	日立キャピタル社債	200,000,000	205,416,000	
56回	三菱UFJリース社債	200,000,000	203,034,000	
26回	野村ホールディングス社債	100,000,000	101,908,000	
72回	三菱地所社債	100,000,000	111,423,000	
108回	住友不動産社債	200,000,000	201,252,000	
15回	東日本旅客鉄道社債	300,000,000	309,681,000	
19回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	106,378,000	
21回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	106,593,000	
39回	東日本旅客鉄道社債	300,000,000	334,956,000	
42回	東日本旅客鉄道社債	200,000,000	225,010,000	
9回	西日本旅客鉄道社債	200,000,000	212,658,000	
10回	西日本旅客鉄道社債	300,000,000	325,608,000	
6回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	106,397,000	
11回	東海旅客鉄道社債	300,000,000	311,853,000	
13回	東海旅客鉄道社債	200,000,000	217,684,000	
14回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	110,146,000	
4回	東京地下鉄社債	120,000,000	138,945,600	
60回	日本電信電話社債	300,000,000	305,844,000	
496回	中部電力社債	500,000,000	506,615,000	
518回	中部電力社債	200,000,000	200,362,000	
377回	中国電力社債	400,000,000	416,228,000	
379回	中国電力社債	300,000,000	302,730,000	
301回	北陸電力社債	100,000,000	103,833,000	
307回	北陸電力社債	100,000,000	105,587,000	
471回	東北電力社債	400,000,000	417,972,000	
473回	東北電力社債	300,000,000	302,952,000	
253回	四国電力社債	200,000,000	206,892,000	
424回	九州電力社債	200,000,000	209,306,000	
426回	九州電力社債	400,000,000	416,276,000	
320回	北海道電力社債	200,000,000	202,192,000	
321回	北海道電力社債	161,000,000	165,933,040	
340回	北海道電力社債	300,000,000	302,715,000	
13回	電源開発社債	200,000,000	221,034,000	
38回	電源開発社債	300,000,000	310,224,000	
23回	東京瓦斯社債	300,000,000	311,607,000	
18回	大阪ガス社債	100,000,000	105,084,000	
27回	NTTデータ社債	100,000,000	103,349,000	
7回	ファーストリテイリング社債	200,000,000	201,744,000	
社債券 合計		13,081,000,000	13,560,958,640	
合計		258,729,113,000	283,832,132,277	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表
該当事項はありません。

「J-REITインデックスファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位:円)

科 目	注記 番号	平成30年12月3日現在	令和1年6月3日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		623,545,604	5,105,777,208
投資証券		30,713,877,550	31,532,120,960
派生商品評価勘定		28,919,592	21,373,092
未収配当金		230,608,066	204,723,675
差入委託証拠金		10,843,092	10,316,592
流動資産合計		31,607,793,904	36,874,311,527
資産合計		31,607,793,904	36,874,311,527
負債の部			
流動負債			
前受金		29,797,092	26,989,092
未払金		-	4,443,355,924
未払解約金		1,480,000	357,000
流動負債合計		31,277,092	4,470,702,016
負債合計		31,277,092	4,470,702,016
純資産の部			
元本等			
元本	1	16,316,153,753	15,658,379,169
剰余金			
剰余金又は欠損金()		15,260,363,059	16,745,230,342
元本等合計		31,576,516,812	32,403,609,511
純資産合計		31,576,516,812	32,403,609,511
負債純資産合計		31,607,793,904	36,874,311,527

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	平成30年12月3日現在	令和1年6月3日現在
1 . 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	19,400,894,895円	16,316,153,753円
同期中追加設定元本額	9,680,285,626円	11,223,361,304円
同期中一部解約元本額	12,765,026,768円	11,881,135,888円
元本の内訳		
ファンド名		
MITO ラップ型ファンド（安定型）	273,617円	398,750円
MITO ラップ型ファンド（中立型）	1,025,234円	1,019,720円
MITO ラップ型ファンド（積極型）	2,030,344円	1,626,471円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	1,892,813円	3,677,841円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	2,803,635円	2,590,882円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	2,454,496円	1,933,107円
たわらノーロード 国内リート	1,654,941,294円	2,449,688,010円
たわらノーロード 国内リート<ラップ向け>	645,190,250円	623,291,724円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	105,743,156円	189,788,431円
たわらノーロード バランス（堅実型）	1,356,393円	2,500,643円
たわらノーロード バランス（標準型）	28,002,143円	50,079,549円
たわらノーロード バランス（積極型）	43,635,221円	61,840,771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)	12,741,334円	19,692,238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)	43,213,202円	64,005,235円
たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(成長型)	26,291,426円	41,022,564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)	57,681,886円	93,054,368円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定型)	177,317円	747,561円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定成長型)	1,663,484円	1,840,207円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(成長型)	927,722円	1,169,818円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(積極型)	2,847,008円	2,809,199円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型>	13,957,155円	11,988,138円
マネックス資産設計ファンド< 育成型>	368,775,756円	327,794,537円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	2,122,432円	3,869,053円
D I A M D C 8資産 balan スファンド(新興国10)	112,562,702円	110,530,283円
D I A M D C 8資産 balan スファンド(新興国20)	98,264,882円	101,236,265円
D I A M D C 8資産 balan スファンド(新興国30)	193,573,200円	198,350,779円
投資のソムリエ	1,463,573,025円	2,603,304,875円
投資のソムリエ<DC年金>	130,229,281円	266,799,320円
D I A M 8資産バランスマ ンダN<DC年金>	80,069,705円	85,884,495円
投資のソムリエ<DC年金>リ スク抑制型	40,449,553円	75,166,538円
ダイナミック・ナビゲーション リスク抑制世界8資産バラン スファンド	483,569円	461,525円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2045)	787,178円	1,056,349円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2055)	596,149円	899,476円
リスク抑制世界8資産バラン スファンド(DC)	248,411円	559,109円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2035)	1,235,700円	1,928,211円
リスクコントロール世界資産分 散ファンド	255,955,063円	173,871,210円
9資産分散投資・スタンダード <DC年金>	8,057円	8,734,892円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2040)	-円	219,665円

投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2050)	- 円	219,665円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2060)	- 円	219,665円
Jリートインデックスファンド (DC)	7,394,183円	13,031,813円
DIAM J-REITイン デックス私募ファンド2012 12(適格機関投資家限定)	90,717,116円	88,900,881円
DIAM J-REITイン デックス私募ファンド2014 01(適格機関投資家限定)	819,582,376円	803,441,710円
DIAM J-REITイン デックスファンド(適格機関投 資家向け)	8,537,552,836円	4,596,843,832円
日米資産配分戦略ファンド(イン カム重視型)(為替ヘッジあ り)(適格機関投資家限定)	63,083,346円	263,169,069円
DIAMグローバル 私募ファ ンド(適格機関投資家向け)	14,402,370円	15,360,153円
DIAMグローバル・リスク ファクター・パリティ戦略ファ ンド(適格機関投資家限定)	427,313,023円	1,223,117,415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)	227,972,474円	- 円
計	16,316,153,753円	15,658,379,169円
2. 受益権の総数	16,316,153,753口	15,658,379,169口

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成30年6月5日 至 平成30年12月3日	自 平成30年12月4日 至 令和1年6月3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30年12月3日現在	令和1年6月3日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成30年12月3日現在	令和1年6月3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	1,104,256,138	1,493,083,513
合計	1,104,256,138	1,493,083,513

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(平成30年6月7日から平成30年12月3日まで及び平成30年6月7日から令和1年6月3日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

不動産投信関連

種類	平成30年12月3日 現在				令和1年6月3日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
不動産投信指数 先物取引								
買 建	607,932,000	-	636,889,500	28,957,500	645,840,000	-	667,251,000	21,411,000
合計	607,932,000	-	636,889,500	28,957,500	645,840,000	-	667,251,000	21,411,000

(注) 1. 時価の算定方法

不動産投信指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成30年12月3日現在	令和1年6月3日現在
1口当たり純資産額	1.9353円	2.0694円
(1万口当たり純資産額)	(19,353円)	(20,694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

令和1年6月3日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
投資証券	C R E ロジスティクスファンド投資法人	334	38,944,400	
	G L P 投資法人	8,271	980,940,600	
	M C U B S M i d C i t y 投資法人	3,761	383,998,100	
	O n e リート投資法人	486	134,087,400	
	いちごオフィスリート投資法人	2,769	275,515,500	
	いちごホテルリート投資法人	584	72,649,600	
	さくら総合リート投資法人	722	65,990,800	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	1,754	815,610,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人	3,253	1,014,936,000	
	イオンリート投資法人	3,426	457,713,600	
	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	20,344	353,782,160	
	インヴィンシブル投資法人	11,515	666,718,500	
	エスコンジャパンリート投資法人	343	35,569,100	
	オリックス不動産投資法人	6,651	1,290,959,100	
	グローバル・ワン不動産投資法人	2,309	296,937,400	
	ケネディクス・オフィス投資法人	1,033	771,651,000	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	2,063	375,053,400	
	ケネディクス商業リート投資法人	1,223	323,605,800	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	1,384	406,065,600	
	サムティ・レジデンシャル投資法人	668	70,073,200	
	サンケイリアルエステート投資法人	330	35,805,000	
	ザイマックス・リート投資法人	308	37,730,000	
	ジャパン・ホテル・リート投資法人	10,744	935,802,400	
	ジャパンエクセレント投資法人	2,989	475,549,900	
	ジャパンリアルエステイト投資法人	3,338	2,149,672,000	
	スターアジア不動産投資法人	1,036	117,896,800	
	スターツプロシード投資法人	520	91,416,000	
	タカラレーベン不動産投資法人	500	47,550,000	
	トーセイ・リート投資法人	643	75,102,400	
	ヒューリックリート投資法人	2,698	486,989,000	
	フロンティア不動産投資法人	1,135	519,830,000	
	プレミア投資法人	3,173	435,335,600	
	ヘルスケア&メディカル投資法人	699	81,153,900	
	マリモ地方創生リート投資法人	287	33,177,200	
ユナイテッド・アーバン投資法人	7,362	1,313,380,800		
ラサールロジポート投資法人	2,518	310,469,400		
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	516	51,084,000		
阪急阪神リート投資法人	1,502	218,691,200		

三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	810	275,805,000	
三菱地所物流リート投資法人	353	96,263,100	
産業ファンド投資法人	4,096	523,878,400	
森トラスト・ホテルリート投資法人	783	109,228,500	
森トラスト総合リート投資法人	2,386	409,914,800	
森ヒルズリート投資法人	3,828	571,903,200	
星野リゾート・リート投資法人	508	277,876,000	
積水ハウス・リート投資法人	8,612	676,042,000	
大江戸温泉リート投資法人	539	45,006,500	
大和ハウスリート投資法人	4,479	1,130,947,500	
大和証券オフィス投資法人	770	572,880,000	
投資法人みらい	3,596	173,866,600	
東急リアル・エステート投資法人	2,238	401,497,200	
日本アコモデーションファンド投資法人	1,109	634,348,000	
日本ビルファンド投資法人	3,232	2,398,144,000	
日本プライムリアルティ投資法人	2,113	974,093,000	
日本プロロジスリート投資法人	4,477	1,037,320,900	
日本ヘルスケア投資法人	153	26,438,400	
日本リート投資法人	1,077	451,801,500	
日本リテールファンド投資法人	6,308	1,355,589,200	
日本ロジスティクスファンド投資法人	2,181	526,711,500	
日本賃貸住宅投資法人	3,754	322,093,200	
福岡リート投資法人	1,726	299,288,400	
平和不動産リート投資法人	2,079	252,182,700	
野村不動産マスターファンド投資法人	10,385	1,741,564,500	
投資証券 合計	184,783	31,532,120,960	
合計	184,783	31,532,120,960	

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。

「DIAMマネーマザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位:円)

科 目	注記 番号	平成30年12月3日現在	令和1年6月3日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		250,607,567	3,330,692,353
国債証券		502,992,000	12,626,077,000
地方債証券		107,742,365	136,270,963
特殊債券		296,786,620	66,875,780
未収利息		1,462,975	4,028,240
前払費用		947,944	394,512
流動資産合計		1,160,539,471	16,164,338,848
資産合計		1,160,539,471	16,164,338,848
負債の部			
流動負債			
流動負債合計		-	-
負債合計		-	-
純資産の部			
元本等			
元本	1	1,149,413,125	16,010,803,187
剰余金			
剰余金又は欠損金()		11,126,346	153,535,661
元本等合計		1,160,539,471	16,164,338,848
純資産合計		1,160,539,471	16,164,338,848
負債純資産合計		1,160,539,471	16,164,338,848

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	平成30年12月3日現在	令和1年6月3日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額 同期中追加設定元本額 同期中一部解約元本額	1,139,212,074円 15,153,018円 4,951,967円	1,149,413,125円 14,861,390,062円 - 円
元本の内訳		
ファンド名		
クルーズコントロール	990,000,991円	990,000,991円
ダイナミック・ナビゲーション	98,710円	98,710円
D I A M新興国ソブリンオープン通貨選択シリーズ<円コース>	870,000円	870,000円
D I A M新興国ソブリンオープン通貨選択シリーズ<豪ドルコース>	530,000円	530,000円
D I A M新興国ソブリンオープン通貨選択シリーズ<南アフリカランドコース>	70,000円	70,000円
D I A M新興国ソブリンオープン通貨選択シリーズ<ブラジルリアルコース>	10,530,000円	10,530,000円
世界ハイブリッド証券ファンド通貨選択シリーズ（毎月分配型）<円コース>	1,281,836円	1,281,836円
世界ハイブリッド証券ファンド通貨選択シリーズ（毎月分配型）<豪ドルコース>	246,797円	246,797円
世界ハイブリッド証券ファンド通貨選択シリーズ（毎月分配型）<ブラジルリアルコース>	1,689,581円	1,689,581円
世界ハイブリッド証券ファンド通貨選択シリーズ（毎月分配型）<中国元コース>	654,944円	654,944円
D I A M新興国ソブリンオープン通貨選択シリーズ<中国元コース>	149,716円	149,716円
ネット証券専用ファンドシリーズ 新興市場日本株 レアル型	103,986円	103,986円

DIAM グローバル・ハイ イールド・ボンド・ファンド・ 通貨選択シリーズ 資源国通貨 バスケットコース	4,486,988円	4,486,988円
DIAM グローバル・ハイ イールド・ボンド・ファンド・ 通貨選択シリーズ ブラジルレ アルコース	4,586,699円	4,586,699円
DIAM グローバル・ハイ イールド・ボンド・ファンド・ 通貨選択シリーズ 円コース	997,109円	997,109円
DIAM新興国ソブリンオープ ン通貨選択シリーズ<米ドル コース>	5,972円	5,972円
DIAM 米国リート・インカ ムプラス	994,728円	994,728円
USストラテジック・インカ ム・ファンドAコース(為替 ヘッジあり)	993,740円	993,740円
USストラテジック・インカ ム・ファンドBコース(為替 ヘッジなし)	1,987,479円	1,987,479円
DIAM - ジャナス グローバ ル債券コアプラス・ファンド< DC年金>	9,935円	9,935円
みずほジャパン・アクティブ・ ストラテジー(通貨選択型)円 コース	9,925円	9,925円
みずほジャパン・アクティブ・ ストラテジー(通貨選択型)米 ドルコース	9,925円	9,925円
みずほジャパン・アクティブ・ ストラテジー(通貨選択型)豪 ドルコース	9,925円	9,925円
みずほジャパン・アクティブ・ ストラテジー(通貨選択型)メ キシコペソコース	9,925円	9,925円
みずほジャパン・アクティブ・ ストラテジー(通貨選択型)ト ルコリラコース	9,925円	9,925円
みずほジャパン・アクティブ・ ストラテジー(通貨選択型)ブ ラジルリアルコース	9,924円	9,924円
USストラテジック・インカ ム・ファンド(年1回決算型) 為替ヘッジあり	9,924円	9,924円
USストラテジック・インカ ム・ファンド(年1回決算型) 為替ヘッジなし	9,924円	9,924円
米国株式リスクコントロール戦 略ファンド<為替ヘッジあり>	9,909円	9,909円
米国株式リスクコントロール戦 略ファンド<為替ヘッジなし>	9,909円	9,909円

マシューズ・アジア株式ファン ド	99,019,705円	99,019,705円
One世界分散セレクト(A コース)	99,040円	99,040円
One世界分散セレクト(B コース)	99,040円	99,040円
One世界分散セレクト(C コース)	99,040円	99,040円
リスクコントロール型ETF分 散投資ファンド(適格機関投資 家限定)	29,707,873円	39,612,786円
USD/JPYダイナミック ヘッジ戦略ファンド-2019 (適格機関投資家限定)	-円	14,851,485,149円
計	1,149,413,125円	16,010,803,187円
2. 受益権の総数	1,149,413,125口	16,010,803,187口

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成30年6月5日 至 平成30年12月3日	自 平成30年12月4日 至 令和1年6月3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30年12月3日現在	令和1年6月3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 該当事項はありませぬ。 (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。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成30年12月3日現在	令和1年6月3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	665,000	4,931,000
地方債証券	169,763	138,680
特殊債券	2,622,760	144,190
合計	3,457,523	5,213,870

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(平成30年4月6日から平成30年12月3日まで及び平成31年4月6日から令和1年6月3日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成30年12月3日現在	令和1年6月3日現在
1口当たり純資産額	1.0097円	1.0096円
(1万口当たり純資産額)	(10,097円)	(10,096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

令和1年6月3日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
国債証券	388回 利付国庫債券(2年)	100,000,000	100,251,000	
	391回 利付国庫債券(2年)	200,000,000	200,626,000	
	392回 利付国庫債券(2年)	100,000,000	100,336,000	
	123回 利付国庫債券(5年)	12,000,000,000	12,024,720,000	
	301回 利付国庫債券(10年)	200,000,000	200,144,000	
国債証券 合計		12,600,000,000	12,626,077,000	
地方債証券	331回 大阪府公募公債	10,000,000	10,055,900	
	26年度 京都府京都みらい債	9,200,000	9,196,872	
	27年度 京都府京都みらい債	13,800,000	13,768,122	
	21年度35回 兵庫県公募公債	40,000,000	40,365,200	
	26年度4回 静岡県公募公債	14,810,000	14,811,629	
	21年度6回 愛知県公募公債	10,000,000	10,022,300	
	26年度7回 福岡県公募公債	6,500,000	6,496,490	
	27年度2回 千葉県公募公債	14,670,000	14,693,912	
	26年度1回 大阪市みおつくし債	6,000,000	5,999,580	
43回 川崎市公募公債 5年	10,850,000	10,860,958		
地方債証券 合計		135,830,000	136,270,963	
特殊債券	89回政保日本高速道路保有・債務返済機構	4,000,000	4,017,400	
	93回政保日本高速道路保有・債務返済機構	8,000,000	8,056,240	
	100回政保日本高速道路保有・債務返済機構	9,000,000	9,095,490	
	112回政保日本高速道路保有・債務返済機構	30,000,000	30,394,500	
	117回政保日本高速道路保有・債務返済機構	6,000,000	6,082,320	
	133回政保日本高速道路保有・債務返済機構	5,000,000	5,127,350	
	137回政保日本高速道路保有・債務返済機構	4,000,000	4,102,480	
特殊債券 合計		66,000,000	66,875,780	
合計		12,801,830,000	12,829,223,743	

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。

「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成30年12月3日現在	令和1年6月3日現在
資産の部			
流動資産			
預金		2,465,172,929	4,068,481,927
コール・ローン		186,725,837	144,035,107
株式		312,229,011,578	323,369,184,670
投資信託受益証券		769,363,268	819,413,705
投資証券		7,455,493,958	8,455,388,711
派生商品評価勘定		34,869,631	1,610,925
未収入金		8,165,611,732	7,885,050,415
未収配当金		640,547,042	825,982,458
差入委託証拠金		2,130,517,864	2,323,494,957
流動資産合計		334,077,313,839	347,892,642,875
資産合計		334,077,313,839	347,892,642,875
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		20,520,270	145,413,840
未払金		575,778,614	343,719,838
未払解約金		1,678,995,000	95,060,000
流動負債合計		2,275,293,884	584,193,678
負債合計		2,275,293,884	584,193,678
純資産の部			
元本等			
元本	1	94,459,545,491	101,642,104,119
剰余金			
剰余金又は欠損金()		237,342,474,464	245,666,345,078
元本等合計		331,802,019,955	347,308,449,197
純資産合計		331,802,019,955	347,308,449,197
負債純資産合計		334,077,313,839	347,892,642,875

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	平成30年12月3日現在	令和1年6月3日現在
<p>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</p>	89,020,294,172円	94,459,545,491円
<p>同期中追加設定元本額</p>	19,871,696,913円	19,249,972,035円
<p>同期中一部解約元本額</p>	14,432,445,594円	12,067,413,407円
<p>元本の内訳 ファンド名</p>		

DIAM外国株式パッシブ・ ファンド	2,715,302,172円	2,503,282,726円
MITO ラップ型ファンド (安定型)	2,795,385円	2,965,928円
MITO ラップ型ファンド (中立型)	8,567,971円	7,532,394円
MITO ラップ型ファンド (積極型)	16,971,755円	12,129,414円
グローバル8資産ラップファン ド(安定型)	19,953,276円	27,307,668円
グローバル8資産ラップファン ド(中立型)	23,048,530円	19,121,521円
グローバル8資産ラップファン ド(積極型)	20,870,949円	14,417,276円
たわらノーロード 先進国株式	8,257,953,374円	9,490,032,078円
たわらノーロード 先進国株式 <ラップ向け>	424,170円	43,107,320円
たわらノーロード 先進国株式 <為替ヘッジあり>	1,016,656,045円	1,182,244,625円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	58,883,698円	112,866,329円
たわらノーロード バランス (堅実型)	4,576,969円	8,817,996円
たわらノーロード バランス (標準型)	42,019,636円	79,768,632円
たわらノーロード バランス (積極型)	74,394,157円	112,268,856円
たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(保守型)	230,259円	338,089円
たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(安定型)	18,889,360円	26,704,921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)	53,951,934円	74,583,829円
たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(成長型)	38,009,847円	57,804,764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)	96,173,503円	140,260,532円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(保守型)	17,562円	42,129円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定型)	77,027円	297,204円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定成長型)	863,280円	912,057円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(成長型)	627,305円	738,921円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(積極型)	2,312,188円	2,319,439円
DIAM外国株式インデックス ファンド<DC年金>	40,326,772,954円	40,816,697,531円
One DC 先進国株式イン デックスファンド	- 円	269,041円

D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 1 安定型	172,217,541円	176,678,943円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 2 安定・成長型	872,997,281円	889,284,165円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 3 成長型	1,083,643,475円	1,087,618,406円
D I A M D C バランス3 0 インデックスファンド	126,952,113円	125,553,828円
D I A M D C バランス5 0 インデックスファンド	360,021,829円	356,194,178円
D I A M D C バランス7 0 インデックスファンド	323,498,598円	313,598,203円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型>	30,305,396円	28,967,247円
マネックス資産設計ファンド< 育成型>	800,195,148円	791,904,539円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	213,664,955円	199,603,769円
D I A M D C 8資産バラン スファンド(新興国1 0)	206,253,165円	212,995,364円
D I A M D C 8資産バラン スファンド(新興国2 0)	137,192,830円	145,596,590円
D I A M D C 8資産バラン スファンド(新興国3 0)	239,193,315円	252,182,793円
投資のソムリエ	1,669,346,069円	2,799,619,201円
クルーズコントロール	198,959,152円	95,795,914円
投資のソムリエ< D C年金>	148,678,699円	286,687,583円
D I A M 8資産バランスマ ンドN< D C年金>	149,922,743円	167,464,903円
4資産分散投資・ハイクラス< D C年金>	90,197,158円	96,746,358円
クルーズコントロール< D C年 金>	126,208円	85,891円
D I A Mコア資産設計ファンド (堅実型)	980,420円	794,546円
D I A Mコア資産設計ファンド (積極型)	2,664,315円	2,030,059円
投資のソムリエ< D C年金>リ スク抑制型	18,331,933円	124,649,426円
ダイナミック・ナビゲーション	633,910円	1,474,038円
リスク抑制世界8資産バラン スファンド	333,071,018円	1,775,124,563円
ワールドアセットバランス(基 本コース)	595,681,660円	532,822,267円
ワールドアセットバランス(リ スク抑制コース)	1,450,991,635円	2,069,512,513円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2 0 4 5)	1,754,051円	1,951,237円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2 0 5 5)	1,327,678円	1,661,834円
リスク抑制世界8資産バラン スファンド(D C)	115,335円	926,507円

投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2035)	2,782,967円	2,590,113円
4資産分散投資・スタンダード <DC年金>	5,195,858円	7,028,528円
リスクコントロール世界資産分 散ファンド	93,812,225円	259,000,377円
9資産分散投資・スタンダード <DC年金>	13,989円	17,566,717円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2040)	-円	390,160円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2050)	-円	390,160円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2060)	-円	390,160円
4資産分散投資・ミドルクラス <DC年金>	-円	42,426円
DIAM外国株式インデックス ファンドVA(適格機関投資家 専用)	91,039,943円	87,664,892円
DIAM外国株式パッシブ私募 ファンド(適格機関投資家向 け)	2,497,009,560円	2,357,479,610円
DIAM先進国株式パッシブ ファンド(適格機関投資家限 定)	5,982,475,520円	12,300,553,181円
外国株式パッシブ・ファンド2 (適格機関投資家限定)	206,206,395円	206,107,035円
DIAMワールドバランス25 VA(適格機関投資家限定)	21,277,711円	20,159,510円
DIAMグローバル・バランス ファンド25VA(適格機関投 資家限定)	85,202,905円	76,394,678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)	207,905,560円	189,246,372円
DIAM国際分散バランスファ ンド30VA(適格機関投資家 限定)	11,080,060円	10,337,977円
DIAM国際分散バランスファ ンド50VA(適格機関投資家 限定)	71,339,508円	63,922,907円
DIAM国内重視バランスファ ンド30VA(適格機関投資家 限定)	6,051,680円	5,703,990円
DIAM国内重視バランスファ ンド50VA(適格機関投資家 限定)	6,938,772円	6,290,692円
DIAM世界バランスファンド 40VA(適格機関投資家限 定)	21,756,628円	21,811,271円
DIAM世界バランスファンド 50VA(適格機関投資家限 定)	60,585,194円	63,348,220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)	504,816,775円	440,840,169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)	623,972,390円	564,373,294円
D I A Mバランスファンド50 V A (適格機関投資家限定)	1,991,172,324円	1,817,590,220円
D I A Mグローバル・アセッ ト・バランスV A (適格機関投 資家限定)	704,915,603円	648,489,393円
D I A Mグローバル・アセッ ト・バランスV A 2 (適格機関 投資家限定)	115,089,594円	104,803,234円
D I A M アクサ グローバ ル バランスファンド30 V A (適格機関投資家限定)	826,292,348円	738,351,333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)	95,970,424円	65,168,600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 55 V A (適格機関投資家限 定)	25,236,110円	10,058,683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)	15,773,016円	11,746,417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)	4,972,446,858円	2,825,788,598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)	192,761,366円	45,900,448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)	1,302,362,793円	906,637,016円
D I A M世界アセットバランス ファンド3 V A (適格機関投資 家限定)	4,960,243,457円	4,137,518,173円
D I A Mバランス30 V A (適 格機関投資家限定)	17,489,143円	16,979,943円
D I A Mバランス50 V A (適 格機関投資家限定)	325,738円	814,885円
D I A Mバランス70 V A (適 格機関投資家限定)	10,354,542円	2,556,441円
D I A M世界アセットバランス ファンド4 V A (適格機関投資 家限定)	6,641,492,877円	6,277,665,238円
D I A Mバランス20 V A (適 格機関投資家限定)	55,662,387円	52,822,607円
D I A Mバランス40 V A (適 格機関投資家限定)	223,728円	219,415円

	D I A Mバランス60VA(適 格機関投資家限定)	253,632円	249,976円
計		94,459,545,491円	101,642,104,119円
2.	受益権の総数	94,459,545,491口	101,642,104,119口

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成30年6月5日 至 平成30年12月3日	自 平成30年12月4日 至 令和1年6月3日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。</p> <p>また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。</p>	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成30年12月3日現在	令和1年6月3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	493,521,581	1,365,006,592
投資信託受益証券	28,697,788	36,700,637
投資証券	575,983,182	312,313,676
合計	111,159,389	1,714,020,905

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(平成30年2月16日から平成30年12月3日まで及び平成31年2月16日から令和1年6月3日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	平成30年12月3日 現在				令和1年6月3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	5,229,325,380	-	5,230,684,440	1,359,060	8,992,236,850	-	8,992,104,340	132,510
アメリカ・ドル	4,030,679,767	-	4,032,260,180	1,580,413	6,157,450,400	-	6,157,450,400	-
イギリス・ポンド	444,421,127	-	444,433,200	12,073	586,826,604	-	586,865,160	38,556
オーストラリア・ドル	37,213,120	-	37,421,440	208,320	258,524,266	-	258,531,140	6,874
カナダ・ドル	289,273,258	-	289,442,670	169,412	369,073,143	-	369,068,540	4,603
シンガポール・ドル	-	-	-	-	23,652,000	-	23,658,000	6,000
スイス・フラン	-	-	-	-	314,441,200	-	314,476,000	34,800
スウェーデン・クローナ	-	-	-	-	49,105,570	-	49,106,000	430
ノルウェー・クローネ	-	-	-	-	33,439,500	-	33,426,000	13,500
ユーロ	395,800,268	-	395,182,950	617,318	1,116,822,167	-	1,116,663,100	159,067
香港・ドル	31,937,840	-	31,944,000	6,160	82,902,000	-	82,860,000	42,000
買 建	36,500,993	-	36,502,610	1,617	38,698,000	-	38,359,020	338,980
アメリカ・ドル	-	-	-	-	34,326,480	-	34,015,620	310,860
イギリス・ポンド	-	-	-	-	2,755,960	-	2,739,800	16,160
オーストラリア・ドル	36,500,993	-	36,502,610	1,617	-	-	-	-
カナダ・ドル	-	-	-	-	1,615,560	-	1,603,600	11,960
合計	5,265,826,373	-	5,267,187,050	1,357,443	9,030,934,850	-	9,030,463,360	206,470

(注) 時価の算定方法

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

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

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

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

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

株式関連

種類	平成30年12月3日 現在				令和1年6月3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	6,953,999,137	-	6,969,705,941	15,706,804	5,807,639,026	-	5,664,042,581	143,596,445
合計	6,953,999,137	-	6,969,705,941	15,706,804	5,807,639,026	-	5,664,042,581	143,596,445

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成30年12月3日現在	令和1年6月3日現在
1口当たり純資産額	3.5126円	3.4170円
(1万口当たり純資産額)	(35,126円)	(34,170円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

令和1年6月3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	35,961	1,775.070	63,833,292.270	
	ABBOTT LABORATORIES	150,797	76.130	11,480,175.610	
	AES CORP	55,631	15.800	878,969.800	
	ABIOMED INC	4,179	261.920	1,094,563.680	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	76,701	126.990	9,740,259.990	
	ADVANCED MICRO DEVICES	83,961	27.410	2,301,371.010	
	ADOBE INC	41,834	270.900	11,332,830.600	
	CHUBB LTD	39,369	146.070	5,750,629.830	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	18,860	203.590	3,839,707.400	
	ALLEGHANY CORP	1,325	663.300	878,872.500	
	RALPH LAUREN CORP	4,893	105.130	514,401.090	
	ALLSTATE CORP	28,984	95.510	2,768,261.840	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	62,772	164.310	10,314,067.320	
	AMGEN INC	53,250	166.700	8,876,775.000	
	HESS CORP	23,734	55.860	1,325,781.240	
	AMERICAN EXPRESS CO	61,330	114.710	7,035,164.300	
	AMERICAN ELECTRIC POWER	42,628	86.120	3,671,123.360	
	AFLAC INC	63,655	51.300	3,265,501.500	
	AMERICAN INTL GROUP	74,625	51.070	3,811,098.750	
	AMERCO	996	368.220	366,747.120	
	ANALOG DEVICES	31,028	96.620	2,997,925.360	
	ANADARKO PETROLEUM CORP	42,877	70.370	3,017,254.490	
	ALEXION PHARMACEUTICALS INC	19,482	113.680	2,214,713.760	
	JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	76,989	38.520	2,965,616.280	
	JONES LANG LASALLE INC	4,087	124.450	508,627.150	
	VALERO ENERGY CORP	35,152	70.400	2,474,700.800	
	APACHE CORP	31,470	26.070	820,422.900	
	ANSYS INC	6,770	179.500	1,215,215.000	
	APPLE INC	406,240	175.070	71,120,436.800	
	APPLIED MATERIALS INC	82,169	38.690	3,179,118.610	
	ALBEMARLE CORP	9,826	63.300	621,985.800	
	ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	49,679	38.320	1,903,699.280	
	PINNACLE WEST CAPITAL CORP	9,600	93.910	901,536.000	
AMEREN CORP	22,070	73.340	1,618,613.800		
ARROW ELECTRONICS INC	8,346	62.660	522,960.360		
AUTOLIV INC	8,154	61.570	502,041.780		

AUTODESK INC	18,337	160.910	2,950,606.670	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	37,472	160.120	6,000,016.640	
AUTOZONE INC	2,231	1,027.110	2,291,482.410	
AVERY DENNISON CORP	8,042	104.060	836,850.520	
BALL CORP	27,803	61.390	1,706,826.170	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	112,301	197.420	22,170,463.420	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	75,423	42.690	3,219,807.870	
BAXTER INTERNATIONAL INC	42,244	73.440	3,102,399.360	
BECTON DICKINSON & CO	23,046	233.440	5,379,858.240	
AMETEK INC	19,925	81.890	1,631,658.250	
VERIZON COMM INC	355,901	54.350	19,343,219.350	
WR BERKLEY CORP	12,201	62.200	758,902.200	
BEST BUY CO INC	20,918	62.670	1,310,931.060	
YUM! BRANDS INC	26,257	102.350	2,687,403.950	
FIRSTENERGY CORP	43,584	41.240	1,797,404.160	
H&R BLOCK INC	16,114	26.250	422,992.500	
BOEING CO	46,237	341.610	15,795,021.570	
ROBERT HALF INTL INC	10,827	53.660	580,976.820	
BORGWARNER INC	17,210	35.480	610,610.800	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	119,820	38.410	4,602,286.200	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	11,755	79.630	936,050.650	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	10,153	108.150	1,098,046.950	
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	2,142	723.090	1,548,858.780	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	142,627	45.370	6,470,986.990	
AFFILIATED MANAGERS GROUP INC	5,215	83.820	437,121.300	
INGREDION INC	5,305	76.160	404,028.800	
ONEOK INC	35,019	63.620	2,227,908.780	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	5,900	98.200	579,380.000	
UNITED RENTALS INC	6,505	110.100	716,200.500	
SEMPRA ENERGY	24,187	131.450	3,179,381.150	
FEDEX CORP	21,525	154.280	3,320,877.000	
VERISIGN INC	8,852	194.980	1,725,962.960	
AMPHENOL CORP	25,265	87.000	2,198,055.000	
BROWN-FORMAN CORP	27,200	49.980	1,359,456.000	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	153,241	5.310	813,709.710	
CSX CORP	66,458	74.470	4,949,127.260	
CABOT OIL & GAS CORP	38,255	25.020	957,140.100	
CAMPBELL SOUP CO	14,050	36.310	510,155.500	
SEAGATE TECHNOLOGY	20,798	41.850	870,396.300	
CONSTELLATION BRANDS INC	14,553	176.450	2,567,876.850	
CARDINAL HEALTH INC	26,919	42.070	1,132,482.330	

CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	35,566	51.190	1,820,623.540	
CATERPILLAR INC	49,465	119.810	5,926,401.650	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	11,232	110.280	1,238,664.960	
CELGENE CORP	60,871	93.790	5,709,091.090	
CITRIX SYSTEMS INC	10,886	94.120	1,024,590.320	
CENTURYLINK INC	80,424	10.450	840,430.800	
CERNER CORP	27,382	69.970	1,915,918.540	
JPMORGAN CHASE & CO	281,840	105.960	29,863,766.400	
CHURCH & DWIGHT CO INC	22,243	74.410	1,655,101.630	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	12,715	98.240	1,249,121.600	
CINTAS CORP	7,247	221.830	1,607,602.010	
CISCO SYSTEMS INC	378,983	52.030	19,718,485.490	
CLOROX COMPANY	10,885	148.810	1,619,796.850	
COCA-COLA CO/THE	350,142	49.130	17,202,476.460	
COPART INC	16,749	71.480	1,197,218.520	
COGNEX CORP	15,291	40.600	620,814.600	
COLGATE-PALMOLIVE CO	71,000	69.620	4,943,020.000	
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	24,804	124.840	3,096,531.360	
COMERICA INC	12,770	68.820	878,831.400	
NRG ENERGY, INC.	25,631	34.040	872,479.240	
COMCAST CORP-CL A	387,229	41.000	15,876,389.000	
CONAGRA BRANDS INC	40,573	26.770	1,086,139.210	
CONSOLIDATED EDISON INC	27,005	86.300	2,330,531.500	
CMS ENERGY CORP	22,937	56.110	1,286,995.070	
COOPER COS INC	4,484	297.790	1,335,290.360	
MOLSON COORS BREWING CO	16,200	54.980	890,676.000	
CORNING INC	68,691	28.840	1,981,048.440	
SEALED AIR CORP	13,870	41.900	581,153.000	
HEICO CORP-CL A	6,718	98.260	660,110.680	
CUMMINS INC	13,193	150.760	1,988,976.680	
DR HORTON INC	32,152	42.760	1,374,819.520	
DANAHER CORP	53,933	132.010	7,119,695.330	
MOODY'S CORP	14,550	182.880	2,660,904.000	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	50,331	61.930	3,116,998.830	
TARGET CORP	44,547	80.450	3,583,806.150	
DEERE & CO	26,237	140.170	3,677,640.290	
MORGAN STANLEY	108,882	40.690	4,430,408.580	
REPUBLIC SERVICES INC	19,891	84.590	1,682,579.690	
COSTAR GROUP INC	3,044	509.640	1,551,344.160	
THE WALT DISNEY CO	154,803	132.040	20,440,188.120	
DOLLAR TREE INC	20,078	101.590	2,039,724.020	
DOVER CORP	12,635	89.410	1,129,695.350	
OMNICOM GROUP	19,325	77.360	1,494,982.000	
DTE ENERGY CO	16,034	125.470	2,011,785.980	
DUKE ENERGY CORP	63,786	85.610	5,460,719.460	

FLOWERVE CORP	9,882	46.450	459,018.900	
DARDEN RESTAURANTS INC	10,990	116.320	1,278,356.800	
EBAY INC	74,334	35.930	2,670,820.620	
BANK OF AMERICA CORP	789,297	26.600	20,995,300.200	
CITIGROUP INC	201,884	62.150	12,547,090.600	
EASTMAN CHEMICAL CO	13,009	64.920	844,544.280	
E*TRADE FINANCIAL CORP	21,624	44.800	968,755.200	
EATON CORP PLC	36,362	74.490	2,708,605.380	
EATON VANCE CORP	9,184	38.220	351,012.480	
CADENCE DESIGN SYS INC	24,922	63.570	1,584,291.540	
DISH NETWORK CORP	21,762	36.110	785,825.820	
ECOLAB INC	22,339	184.090	4,112,386.510	
PERKINELMER INC	9,986	86.340	862,191.240	
ELECTRONIC ARTS INC	25,565	93.080	2,379,590.200	
SALESFORCE.COM INC	65,512	151.410	9,919,171.920	
ERIE INDEMNITY CO	2,243	212.670	477,018.810	
EMERSON ELECTRIC CO	54,324	60.240	3,272,477.760	
ATMOS ENERGY CORP	10,220	101.800	1,040,396.000	
ENERGY CORP	16,259	97.070	1,578,261.130	
EOG RESOURCES INC	50,726	81.880	4,153,444.880	
EQUIFAX INC	10,231	120.900	1,236,927.900	
ESTEE LAUDER COS INC/THE	18,554	161.030	2,987,750.620	
EXPEDITORS INTERNATIONAL	14,792	69.590	1,029,375.280	
EXXON MOBIL CORP	364,827	70.770	25,818,806.790	
FMC CORP	12,634	73.450	927,967.300	
NEXTERA ENERGY INC	40,919	198.210	8,110,554.990	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	3,418	278.200	950,887.600	
ASSURANT INC	5,949	99.960	594,662.040	
FASTENAL CO	50,836	30.590	1,555,073.240	
FIFTH THIRD BANCORP	69,325	26.500	1,837,112.500	
M&T BANK CORP	11,572	159.600	1,846,891.200	
FISERV INC	33,890	85.860	2,909,795.400	
FLIR SYSTEMS INC	11,623	48.330	561,739.590	
MACY'S INC	24,741	20.570	508,922.370	
FORD MOTOR CO	334,331	9.520	3,182,831.120	
FRANKLIN RESOURCES INC	28,548	31.820	908,397.360	
FREEMPORT-MCMORAN INC	120,727	9.710	1,172,259.170	
FLEX LTD	50,680	8.940	453,079.200	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	16,478	84.200	1,387,447.600	
GAP INC/THE	18,295	18.680	341,750.600	
DENTSPLY SIRONA INC	18,386	53.870	990,453.820	
GENERAL DYNAMICS CORP	21,078	160.820	3,389,763.960	
GENERAL MILLS INC	52,709	49.440	2,605,932.960	
GENUINE PARTS CO	13,432	98.900	1,328,424.800	
GILEAD SCIENCES INC	109,182	62.250	6,796,579.500	
GARTNER INC	7,384	151.300	1,117,199.200	
MCKESSON CORP	16,848	122.140	2,057,814.720	
NVIDIA CORP	49,359	135.460	6,686,170.140	

GENERAL ELECTRIC CO	748,896	9.440	7,069,578.240	
WW GRAINGER INC	4,331	261.690	1,133,379.390	
HALLIBURTON CO	74,684	21.290	1,590,022.360	
MONSTER BEVERAGE CORP	36,373	61.860	2,250,033.780	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	28,350	182.490	5,173,591.500	
HARLEY-DAVIDSON INC	12,901	32.720	422,120.720	
HARRIS CORP	10,033	187.190	1,878,077.270	
HASBRO INC	10,927	95.140	1,039,594.780	
HENRY SCHEIN INC	13,800	64.460	889,548.000	
HEICO CORP	4,111	121.590	499,856.490	
HELMERICH & PAYNE INC	10,055	48.910	491,790.050	
HERSHEY FOODS CORP	12,265	131.960	1,618,489.400	
HP INC	129,509	18.680	2,419,228.120	
F5 NETWORKS INC	4,874	132.080	643,757.920	
CROWN HOLDINGS INC NPR	10,472	55.430	580,462.960	
JUNIPER NETWORKS INC	27,939	24.610	687,578.790	
HOLLYFRONTIER CORP	15,339	37.980	582,575.220	
HOLOGIC INC	23,212	44.010	1,021,560.120	
UNUM GROUP	20,720	31.490	652,472.800	
HOME DEPOT INC	97,204	189.850	18,454,179.400	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	15,079	82.240	1,240,096.960	
HORMEL FOODS CORP	24,161	39.490	954,117.890	
CENTERPOINT ENERGY INC	43,020	28.440	1,223,488.800	
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,913	264.110	769,352.430	
HUMANA INC	11,962	244.860	2,929,015.320	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	7,359	85.140	626,545.260	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	93,648	12.650	1,184,647.200	
RED HAT INC	15,007	184.300	2,765,790.100	
NEKTAR THERAPEUTICS	15,689	31.320	491,379.480	
BIOGEN INC	16,704	219.290	3,663,020.160	
IDEX CORP	6,154	152.710	939,777.340	
ILLINOIS TOOL WORKS	28,507	139.640	3,980,717.480	
INTUIT INC	22,602	244.850	5,534,099.700	
IDEXX LABORATORIES INC	7,402	249.770	1,848,797.540	
IONIS PHARMACEUTICALS INC	11,699	65.600	767,454.400	
INGERSOLL-RAND PLC	20,682	118.340	2,447,507.880	
INTEL CORP	387,118	44.040	17,048,676.720	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	9,033	135.420	1,223,248.860	
INTERNATIONAL PAPER CO	32,983	41.470	1,367,805.010	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	35,849	21.220	760,715.780	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	11,766	75.290	885,862.140	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	7,247	131.220	950,951.340	
INCYTE CORP	15,601	78.630	1,226,706.630	
JOHNSON & JOHNSON	229,476	131.150	30,095,777.400	

HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	29,441	52.660	1,550,363.060	
KLA-TENCOR CORP	13,639	103.070	1,405,771.730	
DEVON ENERGY CORP	39,119	25.160	984,234.040	
KELLOGG CO	21,564	52.560	1,133,403.840	
EAST WEST BANCORP INC	11,560	42.720	493,843.200	
KEYCORP	88,511	15.970	1,413,520.670	
KIMBERLY-CLARK CORP	30,175	127.890	3,859,080.750	
BLACKROCK INC/NEW YORK	10,326	415.560	4,291,072.560	
KOHL'S CORP	14,910	49.320	735,361.200	
KROGER CO	66,610	22.810	1,519,374.100	
LAM RESEARCH CORP	12,854	174.610	2,244,436.940	
PACKAGING CORP OF AMERICA	8,982	89.080	800,116.560	
AKAMAI TECHNOLOGIES	13,254	75.360	998,821.440	
LEGGETT & PLATT INC	10,928	35.510	388,053.280	
LENNAR CORP	26,065	49.660	1,294,387.900	
JEFFERIES FINANCIAL GROUP INC	20,795	17.670	367,447.650	
ELI LILLY & CO	76,780	115.940	8,901,873.200	
L BRANDS INC	21,698	22.460	487,337.080	
LINCOLN NATIONAL CORP	16,387	59.450	974,207.150	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	60,555	92.920	5,626,770.600	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	28,167	67.050	1,888,597.350	
LOCKHEED MARTIN CORP	22,006	338.540	7,449,911.240	
LOEWS CORP	24,656	51.360	1,266,332.160	
LOWE'S COS INC	68,812	93.280	6,418,783.360	
DOMINION ENERGY INC	70,288	75.180	5,284,251.840	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	46,414	24.820	1,151,995.480	
MCCORMICK & CO INC	10,952	156.040	1,708,950.080	
MCDONALD'S CORPORATION	65,985	198.270	13,082,845.950	
S&P GLOBAL INC	21,599	213.880	4,619,594.120	
EVEREST RE GROUP LTD	3,751	247.660	928,972.660	
MANPOWERGROUP INC	4,555	85.520	389,543.600	
MARKEL CORPORATION	1,222	1,058.870	1,293,939.140	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	17,601	170.700	3,004,490.700	
MARSH & MCLENNAN COS	43,593	95.600	4,167,490.800	
MASCO CORP	24,537	34.920	856,832.040	
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	5,382	210.500	1,132,911.000	
METLIFE INC	69,898	46.210	3,229,986.580	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	24,323	52.590	1,279,146.570	
MEDTRONIC PLC	115,225	92.580	10,667,530.500	
ACTIVISION BLIZZARD INC	67,123	43.370	2,911,124.510	
CVS HEALTH CORP	111,424	52.370	5,835,274.880	
MERCK & CO. INC.	222,204	79.210	17,600,778.840	
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	32,686	17.760	580,503.360	

LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	8,049	162.610	1,308,847.890	
MICROSOFT CORP	627,967	123.680	77,666,958.560	
MICRON TECH INC	97,353	32.610	3,174,681.330	
MIDDLEBY CORP	5,373	130.470	701,015.310	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	20,269	80.030	1,622,128.070	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	55,242	22.300	1,231,896.600	
3M CO	49,562	159.750	7,917,529.500	
MOHAWK INDUSTRIES INC	4,976	135.550	674,496.800	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	13,643	149.950	2,045,767.850	
KANSAS CITY SOUTHERN	8,856	113.280	1,003,207.680	
MYLAN NV	43,574	16.800	732,043.200	
ILLUMINA INC	12,690	306.910	3,894,687.900	
XCEL ENERGY INC	44,702	57.340	2,563,212.680	
NATIONAL OILWELL VARCO INC	33,468	20.850	697,807.800	
NETAPP INC	20,797	59.200	1,231,182.400	
NEWELL BRANDS INC	43,380	13.420	582,159.600	
NEWMONT GOLDCORP CORP	72,428	33.090	2,396,642.520	
NVR INC	307	3,201.570	982,881.990	
NIKE INC-CL B	108,219	77.140	8,348,013.660	
NOBLE ENERGY INC	39,436	21.400	843,930.400	
NORDSTROM INC	9,487	31.300	296,943.100	
NORFOLK SOUTHERN CORP	23,435	195.140	4,573,105.900	
EVERSOURCE ENERGY	27,088	73.840	2,000,177.920	
NISOURCE INC	31,548	27.850	878,611.800	
TAPESTRY INC	26,818	28.560	765,922.080	
NORTHERN TRUST CORP	17,867	85.520	1,527,985.840	
NORTHROP GRUMMAN CORP	13,505	303.250	4,095,391.250	
WELLS FARGO & CO	372,161	44.370	16,512,783.570	
NUCOR CORP	25,192	48.000	1,209,216.000	
CHENIERE ENERGY INC	19,175	63.180	1,211,476.500	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	40,053	85.870	3,439,351.110	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	65,907	49.770	3,280,191.390	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	5,209	132.440	689,879.960	
OGE ENERGY CORP	16,028	41.560	666,123.680	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	6,592	371.370	2,448,071.040	
ORACLE CORP	216,498	50.600	10,954,798.800	
PACCAR INC	29,661	65.820	1,952,287.020	
PTC INC	10,028	84.060	842,953.680	
EXELON CORP	82,356	48.080	3,959,676.480	
PARKER HANNIFIN CORP	11,023	152.320	1,679,023.360	
PAYCHEX INC	27,544	85.790	2,362,999.760	
ALIGN TECHNOLOGY INC	6,375	284.350	1,812,731.250	
PPL CORPORATION	63,229	29.760	1,881,695.040	
PEPSICO INC	121,011	128.000	15,489,408.000	
PENTAIR PLC	12,511	34.820	435,633.020	

PFIZER INC	477,998	41.520	19,846,476.960	
CONOCOPHILLIPS	97,144	58.960	5,727,610.240	
PVH CORP	6,862	85.190	584,573.780	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	14,369	141.960	2,039,823.240	
ALTRIA GROUP INC	161,289	49.060	7,912,838.340	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	39,730	127.260	5,056,039.800	
POLARIS INDUSTRIES INC	5,726	79.880	457,392.880	
GARMIN LTD	10,774	76.480	823,995.520	
FLUOR CORP (NEW)	9,821	27.720	272,238.120	
PPG INDUSTRIES INC	20,371	104.650	2,131,825.150	
IPG PHOTONICS CORP	3,652	125.170	457,120.840	
COSTCO WHOLESALE CORP	37,904	239.580	9,081,040.320	
T ROWE PRICE GROUP INC	20,133	101.140	2,036,251.620	
QUEST DIAGNOSTICS	10,883	95.910	1,043,788.530	
PROCTER & GAMBLE CO	215,423	102.910	22,169,180.930	
PROGRESSIVE CORP	50,598	79.280	4,011,409.440	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	43,956	58.760	2,582,854.560	
PULTE GROUP INC	21,209	31.000	657,479.000	
GLOBAL PAYMENTS INC	13,406	154.040	2,065,060.240	
QUALCOMM INC	104,030	66.820	6,951,284.600	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	10,388	82.580	857,841.040	
EXACT SCIENCES CORP	11,101	103.630	1,150,396.630	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	3,948	174.440	688,689.120	
REGENERON PHARMACEUTICALS	7,045	301.720	2,125,617.400	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA INC	5,042	148.060	746,518.520	
RESMED INC	12,271	114.120	1,400,366.520	
US BANCORP	130,836	50.200	6,567,967.200	
SEATTLE GENETICS INC /WA	10,269	65.070	668,203.830	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	37,125	34.430	1,278,213.750	
ROSS STORES INC	32,858	92.990	3,055,465.420	
ROLLINS INC	12,378	37.570	465,041.460	
ROPER TECHNOLOGIES INC	8,871	343.920	3,050,914.320	
ROCKWELL AUTOMATION INC	10,439	148.850	1,553,845.150	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	15,403	121.760	1,875,469.280	
RAYTHEON COMPANY	24,616	174.500	4,295,492.000	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	3,848	137.500	529,100.000	
ACCENTURE PLC-CL A	54,893	178.070	9,774,796.510	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	125,693	50.850	6,391,489.050	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	11,016	175.500	1,933,308.000	

THE TRAVELERS COMPANIES INC	23,127	145.570	3,366,597.390	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	27,850	120.300	3,350,355.000	
BOOKING HOLDINGS INC	3,866	1,656.220	6,402,946.520	
SCHLUMBERGER LTD	121,122	34.690	4,201,722.180	
SCHWAB (CHARLES) CORP	101,646	41.610	4,229,490.060	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	18,138	113.930	2,066,462.340	
BUNGE LTD	13,404	52.290	700,895.160	
SEI INVESTMENTS CO	12,294	50.250	617,773.500	
ANTHEM INC	22,158	277.980	6,159,480.840	
AMERISOURCEBERGEN CORP	12,749	77.860	992,637.140	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	23,125	51.570	1,192,556.250	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	7,134	419.450	2,992,356.300	
CENTENE CORP	36,707	57.750	2,119,829.250	
SVB FINANCIAL GROUP	4,852	201.400	977,192.800	
IAC INTERACTIVE CORP	6,938	220.850	1,532,257.300	
SMITH (A.O.) CORP	11,351	40.500	459,715.500	
ACUITY BRANDS INC	3,087	123.670	381,769.290	
SNAP-ON INC	4,935	155.920	769,465.200	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	35,083	92.380	3,240,967.540	
ADVANCE AUTO PARTS	6,330	155.000	981,150.000	
EDISON INTERNATIONAL	29,504	59.370	1,751,652.480	
SOUTHERN CO	90,935	53.500	4,865,022.500	
BB&T CORP	64,534	46.750	3,016,964.500	
SOUTHWEST AIRLINES	11,352	47.600	540,355.200	
AT&T INC	627,285	30.580	19,182,375.300	
CHEVRON CORP	163,511	113.850	18,615,727.350	
STANLEY BLACK & DECKER INC	13,077	127.220	1,663,655.940	
STATE STREET CORP	33,680	55.250	1,860,820.000	
STARBUCKS CORP	107,031	76.060	8,140,777.860	
STEEL DYNAMICS INC	19,030	25.150	478,604.500	
STRYKER CORP	28,663	183.240	5,252,208.120	
NETFLIX INC	37,506	343.280	12,875,059.680	
SUNTRUST BANKS INC	38,341	60.010	2,300,843.410	
SYMANTEC CORP	55,368	18.730	1,037,042.640	
KNIGHT SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	9,793	27.640	270,678.520	
SYNOPSIS INC	13,239	116.440	1,541,549.160	
SYSCO CORP	43,043	68.820	2,962,219.260	
INTUITIVE SURGICAL INC	9,901	464.850	4,602,479.850	
TELEFLEX INC	3,905	288.300	1,125,811.500	
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	96,274	8.650	832,770.100	
TEXAS INSTRUMENTS INC	80,361	104.310	8,382,455.910	
TEXTRON INC	19,312	45.300	874,833.600	

THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	34,238	266.980	9,140,861.240	
TIFFANY & CO	8,733	89.110	778,197.630	
TORCHMARK CORP	8,807	85.510	753,086.570	
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	14,384	123.530	1,776,855.520	
DAVITA INC	10,878	43.420	472,322.760	
TRACTOR SUPPLY CO	11,088	100.780	1,117,448.640	
TRIMBLE INC	20,073	39.900	800,912.700	
TYSON FOODS INC	24,553	75.890	1,863,327.170	
UGI CORP	14,725	51.610	759,957.250	
MARATHON OIL CORP	71,846	13.150	944,774.900	
UNION PACIFIC CORP	62,208	166.780	10,375,050.240	
UNITED TECHNOLOGIES CORP	70,594	126.300	8,916,022.200	
UNITEDHEALTH GROUP INC	82,549	241.800	19,960,348.200	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	7,743	119.550	925,675.650	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	8,438	126.260	1,065,381.880	
VF CORP	28,494	81.880	2,333,088.720	
CBS CORP	27,306	48.280	1,318,333.680	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	22,369	166.180	3,717,280.420	
VULCAN MATERIALS CO	10,913	124.910	1,363,142.830	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	68,895	49.340	3,399,279.300	
WALMART INC	125,174	101.440	12,697,650.560	
WASTE MANAGEMENT INC	36,986	109.350	4,044,419.100	
WATERS CORP	6,203	200.710	1,245,004.130	
ALLERGAN PLC	28,389	121.910	3,460,902.990	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	10,459	121.560	1,271,396.040	
VAIL RESORTS INC	3,773	215.110	811,610.030	
WESTERN DIGITAL CORP	26,076	37.220	970,548.720	
WABTEC CORP	14,029	62.380	875,129.020	
WHIRLPOOL CORP	5,553	114.880	637,928.640	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	16,296	66.630	1,085,802.480	
WYNN RESORTS LTD	7,970	107.330	855,420.100	
NASDAQ INC	10,920	90.640	989,788.800	
CME GROUP INC	30,714	192.120	5,900,773.680	
WILLIAMS COS INC	106,174	26.380	2,800,870.120	
LKQ CORP	26,690	25.650	684,598.500	
ALLIANT ENERGY CORP	19,910	47.460	944,928.600	
WEC ENERGY GROUP INC	28,063	80.550	2,260,474.650	
TD AMERITRADE HOLDING CORP	25,664	49.750	1,276,784.000	
CARMAX INC	13,973	78.280	1,093,806.440	
XEROX CORP	17,455	30.610	534,297.550	
XILINX INC	22,388	102.310	2,290,516.280	
CIMAREX ENERGY CO	9,253	57.190	529,179.070	
TJX COMPANIES INC	107,399	50.290	5,401,095.710	

ZEBRA TECHNOLOGIES CORP	4,664	171.440	799,596.160	
ZIONS BANCORP NA	16,584	43.070	714,272.880	
DAIRY FARM INTERNATIONAL HLDNGS	27,400	7.650	209,610.000	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	76,400	6.520	498,128.000	
JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	15,700	64.180	1,007,626.000	
JARDINE STRATEGIC HOLDINGS LTD	17,100	37.340	638,514.000	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	8,192	67.520	553,123.840	
SIGNATURE BANK	4,171	114.550	477,788.050	
CBRE GROUP INC	26,222	45.700	1,198,345.400	
LIBERTY GLOBAL PLC	19,835	24.600	487,941.000	
WELLCARE HEALTH PLANS INC	4,350	276.190	1,201,426.500	
REGIONS FINANCIAL CORP	92,992	13.830	1,286,079.360	
DOMINO'S PIZZA INC	3,256	279.500	910,052.000	
WESTLAKE CHEMICAL CORP	3,000	57.290	171,870.000	
T-MOBILE US INC	30,213	73.440	2,218,842.720	
LAS VEGAS SANDS CORP	30,531	55.000	1,679,205.000	
MOSAIC CO/THE	31,433	21.470	674,866.510	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	3,334	297.820	992,931.880	
CELANESE CORP	10,326	94.930	980,247.180	
DEXCOM INC	7,665	121.300	929,764.500	
DISCOVERY INC-A	10,423	27.260	284,130.980	
EXPEDIA GROUP INC	10,373	115.000	1,192,895.000	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	18,475	40.240	743,434.000	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	11,363	138.230	1,570,707.490	
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	41,818	24.240	1,013,668.320	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	49,425	82.210	4,063,229.250	
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	14,696	22.800	335,068.800	
VIACOM INC-CLASS B	30,282	29.030	879,086.460	
LIVE NATION	13,682	60.820	832,139.240	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,224	659.970	1,467,773.280	
UNITED CONTINENTAL HOLIDINGS INC	6,191	77.650	480,731.150	
TRANSDIGM GROUP INC	3,972	440.950	1,751,453.400	
MASTERCARD INC	78,530	251.490	19,749,509.700	
QURATE RETAIL INC	35,733	12.530	447,734.490	
HANESBRANDS INC	27,619	14.850	410,142.150	
WESTERN UNION CO	35,222	19.400	683,306.800	
OWENS CORNING	10,591	48.470	513,345.770	
LEIDOS HOLDINGS INC	11,113	75.330	837,142.290	
AERCAP HOLDINGS NV	11,586	44.820	519,284.520	

SPIRIT AEROSYSTEMS HOLDINGS INC	9,175	81.040	743,542.000	
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT-ADR	17,350	19.300	334,855.000	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	10,519	124.870	1,313,507.530	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	31,119	15.370	478,299.030	
DELTA AIR LINES INC	13,898	51.500	715,747.000	
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	6,038	35.000	211,330.000	
DISCOVER FINANCIAL	29,057	74.550	2,166,199.350	
TE CONNECTIVITY LTD	29,610	84.230	2,494,050.300	
CONCHO RESOURCES INC/MIDLAND TX	17,807	98.010	1,745,264.070	
WABCO HOLDING INC	4,076	130.910	533,589.160	
LULULEMON ATHLETICA INC	9,812	165.590	1,624,769.080	
VMWARE INC	7,461	176.980	1,320,447.780	
MERCADOLIBRE INC	3,750	570.520	2,139,450.000	
ULTA BEAUTY INC	5,020	333.380	1,673,567.600	
INVESCO LTD	33,443	19.540	653,476.220	
MSCI INC	7,537	220.010	1,658,215.370	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	133,849	77.130	10,323,773.370	
VISA INC	150,661	161.330	24,306,139.130	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	15,933	113.020	1,800,747.660	
DISCOVERY INC-C	37,135	25.640	952,141.400	
MARATHON PETROLEUM CORP	56,770	45.990	2,610,852.300	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	11,624	48.060	558,649.440	
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	180,546	19.950	3,601,892.700	
XYLEM INC	15,111	74.220	1,121,538.420	
ALKERMES PLC	12,053	21.540	259,621.620	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	25,797	74.250	1,915,427.250	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,479	205.120	713,612.480	
SPLUNK INC	12,240	113.990	1,395,237.600	
EPAM SYSTEMS INC	4,879	172.590	842,066.610	
HCA HEALTHCARE INC	22,908	120.960	2,770,951.680	
VERISK ANALYTICS INC	13,405	140.000	1,876,700.000	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	5,474	125.550	687,260.700	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	7,443	258.210	1,921,857.030	
FIRST REPUBLIC BANK/SAN FRANCISCO CA	13,805	97.020	1,339,361.100	
CIT GROUP INC	9,287	47.540	441,503.980	
NXP SEMICONDUCTOR NV	25,841	88.160	2,278,142.560	

TARGA RESOURCES CORP	19,038	38.460	732,201.480	
LEAR CORP	4,681	119.030	557,179.430	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	10,084	108.540	1,094,517.360	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	20,223	55.650	1,125,409.950	
DOLLAR GENERAL CORP	22,307	127.280	2,839,234.960	
FORTINET INC	13,230	72.480	958,910.400	
AON PLC	20,942	180.070	3,771,025.940	
TESLA INC	10,991	185.160	2,035,093.560	
GENERAL MOTORS CO	110,050	33.340	3,669,067.000	
WORLDPAY INC	25,307	121.640	3,078,343.480	
XPO LOGISTICS INC	10,273	52.090	535,120.570	
TRIPADVISOR INC	9,263	42.270	391,547.010	
ALLY FINANCIAL INC	33,215	28.870	958,917.050	
CAPRI HOLDINGS LTD	12,138	32.480	394,242.240	
VOYA FINANCIAL INC	13,525	50.930	688,828.250	
APTIV PLC	22,571	64.040	1,445,446.840	
PHILLIPS 66	38,945	80.800	3,146,756.000	
FACEBOOK INC	205,406	177.470	36,453,402.820	
IQVIA HOLDINGS INC	14,935	135.850	2,028,919.750	
DIAMONDBACK ENERGY INC	13,109	98.060	1,285,468.540	
SERVICENOW INC	15,292	261.930	4,005,433.560	
PALO ALTO NETWORKS INC	7,935	200.140	1,588,110.900	
TABLEAU SOFTWARE INC	6,429	112.470	723,069.630	
WORKDAY INC	13,192	204.120	2,692,751.040	
ABBVIE INC	126,840	76.710	9,729,896.400	
ZOETIS INC	40,949	101.050	4,137,896.450	
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDINGS LTD	19,821	54.710	1,084,406.910	
COTY INC	23,813	12.340	293,852.420	
NEWS CORP/NEW-CL A	30,263	11.390	344,695.570	
HD SUPPLY HOLDINGS INC	14,075	41.490	583,971.750	
CDW CORP	13,040	98.440	1,283,657.600	
SPRINT CORP	63,882	6.870	438,869.340	
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	10,199	27.230	277,718.770	
ARCONIC INC	36,761	21.900	805,065.900	
TWILIO INC	8,333	131.990	1,099,872.670	
SNAP INC	60,570	11.890	720,177.300	
LIBERTY MEDIA CORP- LIBERTY-C	17,852	37.330	666,415.160	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	5,006	36.020	180,316.120	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-C	17,931	36.140	648,026.340	
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	15,410	20.230	311,744.300	
OKTA INC	8,982	113.220	1,016,942.040	
BAKER HUGHES A GE CO	43,404	21.410	929,279.640	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	12,611	59.250	747,201.750	
ALTICE USA INC-A	13,887	23.490	326,205.630	
TECHNIPFMC LTD	38,724	20.800	805,459.200	

BROADCOM INC	34,019	251.640	8,560,541.160	
MONGODB INC	2,869	140.340	402,635.460	
BURLINGTON STORES INC	6,007	156.580	940,576.060	
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	9,985	35.490	354,367.650	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	24,000	31.280	750,720.000	
VEEVA SYSTEMS INC	10,852	154.290	1,674,355.080	
TWITTER INC	61,369	36.440	2,236,286.360	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING PLC	13,214	42.690	564,105.660	
EVERGY INC	21,366	58.140	1,242,219.240	
PLAINS GP HOLDINGS LP	14,935	22.520	336,336.200	
COMMSCOPE HOLDING CO INC	19,592	16.150	316,410.800	
ALLEGION PLC	7,469	97.050	724,866.450	
STERIS PLC	6,658	133.680	890,041.440	
DOCUSIGN INC	9,325	56.060	522,759.500	
WIX.COM LTD	4,000	137.340	549,360.000	
DROPBOX INC	17,573	22.560	396,446.880	
KKR & CO INC	43,616	22.280	971,764.480	
PERRIGO CO PLC	10,553	42.020	443,437.060	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	23,927	89.440	2,140,030.880	
ARAMARK	21,772	34.790	757,447.880	
CIGNA CORP	32,831	148.020	4,859,644.620	
DELL TECHNOLOGIES INC	12,960	59.550	771,768.000	
DOW INC	66,176	46.760	3,094,389.760	
FOX CORP-A	30,595	35.230	1,077,861.850	
FOX CORP-B	13,009	34.710	451,542.390	
UBER TECHNOLOGIES INC	17,038	40.410	688,505.580	
GRUBHUB INC	8,158	65.150	531,493.700	
PAYCOM SOFTWARE INC	4,486	212.100	951,480.600	
SABRE CORP	25,826	20.280	523,751.280	
PARSLEY ENERGY INC	25,677	17.830	457,820.910	
ARISTA NETWORKS INC	4,441	244.590	1,086,224.190	
IHS MARKIT LTD	31,980	57.390	1,835,332.200	
FNF GROUP	25,311	38.550	975,739.050	
SYNCHRONY FINANCIAL	55,311	33.630	1,860,108.930	
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	40,320	32.580	1,313,625.600	
CYBERARK SOFTWARE LTD	3,457	132.050	456,496.850	
CDK GLOBAL INC	9,969	48.400	482,499.600	
WAYFAIR INC	5,091	144.010	733,154.910	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	15,515	75.130	1,165,641.950	
QORVO INC	10,887	61.180	666,066.660	
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	21,407	32.700	700,008.900	
LIBERTY BROADBAND CORP-C W/I	8,307	98.150	815,332.050	
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	17,018	23.510	400,093.180	
GODADDY INC	14,641	74.400	1,089,290.400	

NIELSEN HOLDINGS PLC	32,827	22.730	746,157.710	
TRANSUNION	15,000	65.540	983,100.000	
SQUARE INC	29,333	61.950	1,817,179.350	
DOWDUPONT INC	193,552	30.520	5,907,207.040	
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS PLC	19,321	55.400	1,070,383.400	
WESTROCK CO	22,394	32.600	730,044.400	
KRAFT HEINZ CO	56,277	27.650	1,556,059.050	
FORTIVE CORP	26,779	76.150	2,039,220.850	
WASTE CONNECTIONS INC	22,523	94.640	2,131,576.720	
ALPHABET INC-CL A	25,710	1,106.500	28,448,115.000	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	114,656	13.720	1,573,080.320	
PAYPAL HOLDINGS INC	95,773	109.750	10,511,086.750	
AXA EQUITABLE HOLDINGS INC	23,220	20.550	477,171.000	
FIRST DATA CORP	51,302	25.420	1,304,096.840	
DXC TECHNOLOGY CO	23,734	47.540	1,128,314.360	
ZILLOW GROUP INC-C	11,723	43.020	504,323.460	
ALPHABET INC-CL C	27,149	1,103.630	29,962,450.870	
BEIGENE LTD ADR	3,159	117.930	372,540.870	
L3 TECHNOLOGIES INC	6,752	242.060	1,634,389.120	
CHEMOURS CO	12,723	21.090	268,328.070	
LINDE PLC	47,374	180.550	8,553,375.700	
ATHENE HOLDING LTD	15,551	40.650	632,148.150	
CHARTER COMMUNICATIONS INC	13,690	376.800	5,158,392.000	
VISTRA ENERGY CORP	30,000	23.560	706,800.000	
アメリカ・ドル 小計	26,097,741		2,025,980,735.700 (219,494,752,906)	
イギリス・ポンド				
ANTOFAGASTA PLC	31,798	7.828	248,914.740	
ASHTED GROUP	42,154	18.650	786,172.100	
SEVERN TRENT PLC	18,217	19.900	362,518.300	
BHP GROUP PLC	181,913	17.846	3,246,419.390	
BARCLAYS PLC	1,506,906	1.493	2,249,810.650	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	82,283	5.580	459,139.140	
BT GROUP PLC	760,443	1.937	1,472,978.090	
BUNZL PLC	27,838	21.150	588,773.700	
EASYJET PLC	13,628	8.712	118,727.130	
AVIVA PLC	350,451	4.046	1,417,924.740	
CRODA INTERNATIONAL	10,391	50.700	526,823.700	
DIAGEO PLC	208,421	33.255	6,931,040.350	
SCHRODERS PLC	10,932	29.190	319,105.080	
DCC PLC	7,898	66.500	525,217.000	
NATIONAL GRID PLC	293,141	7.928	2,324,021.840	
KINGFISHER PLC	165,680	2.139	354,389.520	
BAE SYSTEMS PLC	270,106	4.524	1,221,959.540	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	197,368	27.600	5,447,356.800	

HALMA PLC	33,930	18.160	616,168.800	
NEXT PLC	12,064	57.620	695,127.680	
IMPERIAL BRANDS PLC	84,312	19.150	1,614,574.800	
JOHNSON MATTHEY PLC	15,017	30.940	464,625.980	
ANGLO AMERICAN PLC	90,106	18.950	1,707,508.700	
COMPASS GROUP PLC	139,409	17.905	2,496,118.140	
HSBC HOLDINGS PLC	1,728,211	6.451	11,148,689.160	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	508,463	2.566	1,304,716.050	
CENTRICA PLC	471,340	0.935	440,702.900	
UNILEVER PLC	95,493	48.370	4,618,996.410	
MEGGITT PLC	62,181	4.906	305,059.980	
MORRISON <WM.> SUPERMARKETS	230,551	1.968	453,724.360	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	54,487	7.974	434,479.330	
RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	80,864	5.526	446,854.460	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	30,240	24.680	746,323.200	
PEARSON PLC	65,009	7.870	511,620.830	
PERSIMMON PLC	26,085	19.670	513,091.950	
PRUDENTIAL PLC	222,713	15.775	3,513,297.570	
RIO TINTO PLC	98,968	45.365	4,489,683.320	
VODAFONE GROUP PLC	2,332,041	1.294	3,017,661.050	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	62,253	63.480	3,951,820.440	
RELX PLC	166,897	18.425	3,075,077.220	
RENTOKIL INITIAL PLC	172,170	3.750	645,637.500	
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	152,877	8.600	1,314,742.200	
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	397,434	2.137	849,316.450	
ST JAMES'S PLACE PLC	48,466	10.465	507,196.690	
SSE PLC	95,257	10.785	1,027,346.740	
BP PLC	1,741,447	5.401	9,405,555.240	
SAGE GROUP PLC(THE)	87,111	7.470	650,719.170	
SMITHS GROUP PLC	31,720	14.405	456,926.600	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	6,836	83.600	571,489.600	
STANDARD CHARTERED PLC	238,009	6.870	1,635,121.830	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	6,123,708	0.572	3,502,760.970	
TAYLOR WIMPLEY PLC	252,287	1.652	416,778.120	
TESCO PLC	877,157	2.264	1,985,883.440	
3I GROUP PLC	88,662	10.510	931,837.620	
SMITH & NEPHEW PLC	74,903	16.640	1,246,385.920	
GLAXOSMITHKLINE PLC	427,036	15.270	6,520,839.720	
WEIR GROUP	19,161	14.700	281,666.700	
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	26,266	52.840	1,387,895.440	
WPP PLC	107,494	9.412	1,011,733.520	
ASTRAZENECA PLC	108,818	58.330	6,347,353.940	

WHITBREAD PLC	15,639	46.300	724,085.700	
CARNIVAL PLC	13,350	39.100	521,985.000	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	120,290	2.252	270,893.080	
JOHN WOOD GROUP PLC	48,988	3.912	191,641.050	
INTERTEK GROUP PLC	14,335	52.960	759,181.600	
BURBERRY GROUP PLC	38,727	16.950	656,422.650	
INVESTEC PLC	50,655	4.611	233,570.200	
INTERCONTINENTAL HOTELS	15,125	51.050	772,131.250	
ITV PLC	370,908	1.072	397,613.370	
SAINSBURY (J) PLC	137,215	2.001	274,567.210	
G4S PLC	122,250	2.093	255,869.250	
ADMIRAL GROUP PLC	15,893	20.620	327,713.660	
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	10,726	34.960	374,980.960	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	382,231	24.610	9,406,704.910	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	321,528	24.735	7,952,995.080	
TUI AG-DI	45,043	7.300	328,813.900	
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	214,715	2.673	573,933.190	
EXPERIAN PLC	80,395	23.870	1,919,028.650	
MONDI PLC	28,318	16.400	464,415.200	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	27,429	22.660	621,541.140	
FRESNILLO PLC NPR	15,639	7.680	120,107.520	
OCADO GROUP PLC	40,627	11.945	485,289.510	
INFORMA PLC	102,475	7.766	795,820.850	
GLENCORE PLC	982,806	2.546	2,502,224.070	
GVC HOLDINGS PLC	49,618	5.994	297,410.290	
EVRAZ PLC	48,765	5.880	286,738.200	
NMC HEALTH PLC	8,149	22.530	183,596.970	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP PLC	112,694	3.165	356,676.510	
COCA-COLA HBC AG	19,447	28.520	554,628.440	
MERLIN ENTERTAINMENTS PLC	50,037	3.791	189,690.260	
MARKS & SPENCER GROUP PLC NIL-RTS	24,058	0.390	9,382.620	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC-C	10,854,267	0.001	10,854.260	
FERGUSON PLC	21,079	51.240	1,080,087.960	
MICRO FOCUS INTERNATIONAL PLC	32,244	19.168	618,052.990	
AUTO TRADER GROUP PLC	76,348	5.994	457,629.910	
MELROSE INDUSTRIES PLC	417,620	1.639	684,479.180	
イギリス・ボンド 小計	36,796,654		151,525,158.140 (20,758,946,665)	
イスラエル・シュケル				
BANK HAPOLIM BM	102,044	26.250	2,678,655.000	
BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	128,049	24.460	3,132,078.540	

	ELBIT SYSTEMS LTD	1,760	511.100	899,536.000	
	ISRAEL DISCOUNT BANK LTD	102,134	14.000	1,429,876.000	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	49,411	18.110	894,833.210	
	NICE LTD	6,065	505.500	3,065,857.500	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	10,444	78.800	822,987.200	
	AZRIELI GROUP	4,428	215.500	954,234.000	
イスラエル・シュケル 小計		404,335		13,878,057.450 (414,676,356)	
オーストラリア・ドル	RAMSAY HEALTH CARE LTD	11,115	69.830	776,160.450	
	AUST AND NZ BANKING GROUP LT	251,648	27.880	7,015,946.240	
	AMCOR LTD	93,873	16.480	1,547,027.040	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	295,361	27.440	8,104,705.840	
	BANK OF QUEENSLAND LTD	30,569	9.260	283,068.940	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	115,662	8.050	931,079.100	
	TELSTRA CORP LTD	360,654	3.650	1,316,387.100	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD	39,014	11.230	438,127.220	
	AMP LTD	302,414	2.170	656,238.380	
	ASX LTD	15,573	75.750	1,179,654.750	
	BHP GROUP LTD	254,063	37.760	9,593,418.880	
	CALTEX AUSTRALIA LTD	20,946	26.390	552,764.940	
	HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	22,182	4.160	92,277.120	
	COMPUTERSHARE LT	38,040	16.680	634,507.200	
	CSL LIMITED	38,766	205.490	7,966,025.340	
	REA GROUP LTD	4,119	88.980	366,508.620	
	TRANSURBAN GROUP	224,755	13.930	3,130,837.150	
	COCA-COLA AMATIL LTD	48,601	9.530	463,167.530	
	COCHLEAR LTD	5,374	200.130	1,075,498.620	
	ORIGIN ENERGY LTD	163,057	7.180	1,170,749.260	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	152,457	78.510	11,969,399.070	
	BORAL LIMITED	86,101	5.430	467,528.430	
	RIO TINTO LIMITED	32,562	100.300	3,265,968.600	
	APA GROUP	94,106	10.140	954,234.840	
	ARISTOCRAT LEISU	53,168	29.120	1,548,252.160	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	206,789	7.650	1,581,935.850	
	TPG TELECOM LTD	28,719	6.290	180,642.510	
	FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	3,275	43.590	142,757.250	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	33,926	18.340	622,202.840	
	ORICA LTD	37,821	20.660	781,381.860	
CIMIC GROUP LTD	8,709	45.160	393,298.440		

BLUESCOPE STEEL LTD	36,941	10.540	389,358.140	
SYDNEY AIRPORT	85,130	7.410	630,813.300	
MACQUARIE GROUP LTD	28,250	120.310	3,398,757.500	
WORLEYPARSONS LTD	35,828	13.180	472,213.040	
SUNCORP GROUP LTD	107,913	13.030	1,406,106.390	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	237,873	26.490	6,301,255.770	
NEWCREST MINING LTD	69,638	27.210	1,894,849.980	
OIL SEARCH LTD	105,470	7.050	743,563.500	
INCITEC PIVOT LTD	136,426	3.280	447,477.280	
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	107,820	11.670	1,258,259.400	
CHALLENGER FINANCIAL SERVICES	45,707	8.070	368,855.490	
SANTOS LTD	165,637	6.740	1,116,393.380	
SONIC HEALTHCARE	43,041	26.150	1,125,522.150	
WASHINGTON H SOUL PATTINSON & CO LTD	5,000	22.320	111,600.000	
TABCORP HOLDINGS LTD	194,274	4.510	876,175.740	
WESFARMERS LTD	97,627	37.050	3,617,080.350	
ALUMINA LIMITED	184,613	2.390	441,225.070	
WOODSIDE PETROLEUM LTD	79,115	35.420	2,802,253.300	
WOOLWORTHS GROUP LTD	108,605	31.370	3,406,938.850	
SEEK LTD	25,899	20.900	541,289.100	
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES LTD	4,581	39.110	179,162.910	
AUSNET SERVICES	165,066	1.780	293,817.480	
AGL ENERGY LTD	60,649	20.550	1,246,336.950	
BRAMBLES LTD	144,062	12.110	1,744,590.820	
CROWN RESORTS LTD	32,861	12.530	411,748.330	
AURIZON HOLDINGS LTD	190,969	5.180	989,219.420	
TREASURY WINE ESTATES LTD	69,179	15.050	1,041,143.950	
MEDIBANK PVT LTD	273,424	3.310	905,033.440	
SOUTH32 LTD(AUD)	443,160	3.320	1,471,291.200	
COLES GROUP LTD	96,821	12.450	1,205,421.450	
オーストラリア・ドル 小計	6,454,998		110,039,505.250 (8,278,271,980)	
カナダ・ドル				
AGNICO EAGLE MINES LTD	20,281	58.950	1,195,564.950	
ALIMENTATION COUCHE TARD INC	37,169	82.950	3,083,168.550	
BARRICK GOLD CORP	150,726	16.810	2,533,704.060	
ATCO LTD	7,193	46.490	334,402.570	
BANK OF MONTREAL	55,083	98.120	5,404,743.960	
BANK OF NOVA SCOTIA	107,663	68.560	7,381,375.280	
NATIONAL BANK OF CANADA	28,553	60.710	1,733,452.630	
BCE INC	15,167	60.860	923,063.620	
BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT	74,072	62.000	4,592,464.000	
BAUSCH HEALTH COS INC	25,819	28.060	724,481.140	

BOMBARDIER INC 'B'	151,615	2.030	307,778.450	
SAPUTO INC	18,601	44.980	836,672.980	
BLACKBERRY LTD	39,652	10.610	420,707.720	
CGI INC	20,610	98.520	2,030,497.200	
CCL INDUSTRIES INC	11,340	61.570	698,203.800	
CAE INC	23,000	34.470	792,810.000	
CAMECO CORP	32,627	13.640	445,032.280	
ROGERS COMM-CL B	30,739	71.110	2,185,850.290	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	38,586	102.490	3,954,679.140	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	102,443	36.510	3,740,193.930	
CANADIAN TIRE CORP-CL A	4,862	135.200	657,342.400	
CANADIAN UTILITIES LTD	9,119	38.100	347,433.900	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	62,047	119.820	7,434,471.540	
FIRST CAPITAL REALTY INC	11,417	20.790	237,359.430	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	15,911	48.770	775,979.470	
OPEN TEXT CORP	21,795	53.740	1,171,263.300	
EMPIRE CO LTD	15,093	31.160	470,297.880	
KINROSS GOLD CORP	99,741	4.420	440,855.220	
FORTIS INC	36,000	51.050	1,837,800.000	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	55,296	9.840	544,112.640	
TELUS CORP	15,945	49.920	795,974.400	
GREAT WEST LIFECO INC	27,766	30.600	849,639.600	
IMPERIAL OIL LTD	21,542	36.130	778,312.460	
ENBRIDGE INC	173,278	49.760	8,622,313.280	
IGM FINANCIAL INC	8,426	36.680	309,065.680	
MANULIFE FINANCIAL CORP	164,593	22.680	3,732,969.240	
LOBLAW CO LTD	15,354	69.360	1,064,953.440	
MAGNA INTERNATIONAL INC	28,590	57.890	1,655,075.100	
SUN LIFE FINANCIAL INC	52,457	52.460	2,751,894.220	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,419	620.000	1,499,780.000	
METRO INC	24,146	49.330	1,191,122.180	
HUSKY ENERGY INC	28,749	12.690	364,824.810	
EMERA INC	6,509	52.040	338,728.360	
METHANEX CORP	5,281	56.260	297,109.060	
ONEX CORP	6,646	77.090	512,340.140	
POWER CORP OF CANADA	23,792	28.490	677,834.080	
POWER FINANCIAL CORP	21,676	29.840	646,811.840	
QUEBECOR INC-B	18,078	31.900	576,688.200	
ROYAL BANK OF CANADA	123,554	101.580	12,550,615.320	
SNC-LAVALIN GROUP INC	13,134	24.090	316,398.060	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	12,107	296.260	3,586,819.820	
SHAW COMM INC-B	43,461	27.450	1,193,004.450	
SUNCOR ENERGY INC	137,353	41.650	5,720,752.450	
LUNDIN MINING CORP	71,805	6.040	433,702.200	

ENCANA CORP	127,517	7.130	909,196.210	
TECK RESOURCES LTD-CL B	41,016	27.470	1,126,709.520	
THOMSON REUTERS CORP	16,394	85.900	1,408,244.600	
TORONTO DOMINION BANK (THE) C\$	157,556	73.900	11,643,388.400	
TC ENERGY CORP	80,543	65.890	5,306,978.270	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	5,696	52.690	300,122.240	
WESTON (GEORGE) LTD	6,184	100.970	624,398.480	
INTACT FINANCIAL CORP	12,716	116.210	1,477,726.360	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	34,963	29.890	1,045,044.070	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,729	1,170.360	2,023,552.440	
FRANCO-NEVADA CORP NPR	16,887	104.360	1,762,327.320	
CI FINANCIAL CORP	20,695	20.290	419,901.550	
TOURMALINE OIL CORP	27,410	17.200	471,452.000	
KEYERA CORP	16,668	32.560	542,710.080	
ALTAGAS LTD	23,944	19.510	467,147.440	
PEMBINA PIPELINE CORP	43,784	48.220	2,111,264.480	
DOLLARAMA INC	28,295	42.690	1,207,913.550	
STARS GROUP INC	18,529	22.390	414,864.310	
CENOVUS ENERGY INC W/I	98,471	11.080	1,091,058.680	
VERMILION ENERGY INC	12,923	28.340	366,237.820	
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	17,317	46.750	809,569.750	
INTER PIPELINE LTD	38,609	20.600	795,345.400	
NUTRIEN LTD	51,035	65.920	3,364,227.200	
CRONOS GROUP INC	16,000	19.100	305,600.000	
WSP GLOBAL INC	8,400	71.290	598,836.000	
IA FINANCIAL CORP INC	8,104	50.720	411,034.880	
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	14,961	17.840	266,904.240	
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	20,664	88.960	1,838,269.440	
AURORA CANNABIS INC	66,562	10.270	683,591.740	
SHOPIFY INC	8,616	371.840	3,203,773.440	
CANOPY GROWTH CORP	18,634	54.480	1,015,180.320	
HYDRO ONE LTD	27,340	22.900	626,086.000	
カナダ・ドル 小計	3,457,043		156,341,146.950 (12,536,996,574)	
シンガポール・ドル				
SINGAPORE TECH ENG	125,000	3.910	488,750.000	
SEMBICORP INDUSTRIES	81,400	2.410	196,174.000	
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	123,700	2.340	289,458.000	
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	692,140	0.265	183,417.100	
DBS GROUP HOLDINGS LTD	158,100	24.290	3,840,249.000	
CITY DEVELOPMENTS LTD	36,400	8.220	299,208.000	
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	5,944	33.770	200,728.880	

	SINGAPORE AIRPORT TERMINAL SERVICES LTD	47,800	5.070	242,346.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	68,900	7.380	508,482.000	
	CAPITALAND LTD	204,515	3.220	658,538.300	
	GENTING SINGAPORE LTD	416,400	0.870	362,268.000	
	KEPPEL CORP LTD	134,600	6.030	811,638.000	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	177,900	2.460	437,634.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	289,553	10.570	3,060,575.210	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	734,322	3.200	2,349,830.400	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	47,500	9.110	432,725.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	111,600	23.500	2,622,600.000	
	UOL GROUP LIMITED	40,500	6.760	273,780.000	
	VENTURE CORP LTD	21,000	15.110	317,310.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	142,300	3.290	468,167.000	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	188,800	1.370	258,656.000	
	シンガポール・ドル 小計	3,848,374		18,302,534.890 (1,443,703,952)	
スイス・フラン	CREDIT SUISSE GROUP AG	214,364	11.390	2,441,605.960	
	NESTLE SA-REGISTERED	264,164	99.550	26,297,526.200	
	CIE FINANC RICHEMONT	46,056	73.740	3,396,169.440	
	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN	60,564	263.100	15,934,388.400	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,607	211.200	761,798.400	
	SIKA INHABER	11,291	148.900	1,681,229.900	
	SGS SA-REG	484	2,535.000	1,226,940.000	
	NOVARTIS AG-REG SHS	186,738	86.100	16,078,141.800	
	BALOISE HOLDING AG -R	4,127	166.600	687,558.200	
	BARRY CALLEBAUT AG	157	1,967.000	308,819.000	
	CLARIANT AG-REG	19,496	18.245	355,704.520	
	SWISSCOM AG-REG	2,280	479.600	1,093,488.000	
	ABB LTD	162,358	18.375	2,983,328.250	
	ADECCO GROUP AG-REG	12,944	53.980	698,717.120	
	GEBERIT AG	3,243	441.900	1,433,081.700	
	LONZA GROUP AG-REG	6,237	308.400	1,923,490.800	
	LINDT & SPRUENGLI PART	79	6,560.000	518,240.000	
	LINDT & SPRUENGLI NAMEN	9	75,000.000	675,000.000	
	GIVAUDAN-REG	796	2,651.000	2,110,196.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	13,046	324.800	4,237,340.800	
	LAFARGEHOLCIM LTD	41,122	48.070	1,976,734.540	
	TEMENOS GROUP	5,640	174.400	983,616.000	
	SONOVA HOLDING AG	4,584	223.100	1,022,690.400	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG	5,105	133.150	679,730.750	
	STRAUMANN HOLDING AG	976	824.400	804,614.400	
	THE SWATCH GROUP AG-B	2,691	251.700	677,324.700	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	4,592	48.360	222,069.120	

	SCHINDLER NAMEN	1,663	205.800	342,245.400	
	SWISS LIFE HOLDING AG	2,774	455.700	1,264,111.800	
	VIFOR PHARMA AG	3,465	138.400	479,556.000	
	EMS-CHEMIE HOLDING	633	600.000	379,800.000	
	SWISS PRIME SITE AG	5,990	81.600	488,784.000	
	PARGESA HOLDING PORTEUR	3,000	74.150	222,450.000	
	DUFREY GROUP	3,138	82.020	257,378.760	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,505	703.000	1,058,015.000	
	JULIUS BAER GROUP LTD	17,849	39.670	708,069.830	
	SWISS RE LTD	27,157	95.000	2,579,915.000	
	ALCON INC	37,547	58.230	2,186,361.810	
	UBS GROUP AG	336,464	11.550	3,886,159.200	
スイス・フラン 小計		1,517,935		105,062,391.200 (11,392,965,701)	
スウェーデン・ク ローナ	ATLAS COPCO AB-A SHS	57,191	255.900	14,635,176.900	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	33,303	230.300	7,669,680.900	
	ERICSSON LM-B SHS	271,783	91.480	24,862,708.840	
	LUNDBERGS B	7,382	312.000	2,303,184.000	
	SKF AB-B SHS	37,198	147.500	5,486,705.000	
	SANDVIK AB	96,746	146.550	14,178,126.300	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	147,588	84.260	12,435,764.880	
	SKANSKA AB-B SHS	32,547	155.500	5,061,058.500	
	SWEDBANK AB	82,410	135.900	11,199,519.000	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	126,705	93.520	11,849,451.600	
	VOLVO AB-B SHS	129,676	132.750	17,214,489.000	
	SWEDISH MATCH AB	16,488	429.200	7,076,649.600	
	TELE2 AB-B SHS	44,876	131.100	5,883,243.600	
	INDUSTRIVARDEN C	11,403	191.700	2,185,955.100	
	ELECTROLUX AB-SER B	19,191	206.300	3,959,103.300	
	SECURITAS AB-B SHS	24,098	157.250	3,789,410.500	
	INVESTOR AB-B SHS	38,298	410.300	15,713,669.400	
	HENNES&MAURITZ AB-B SHS	67,565	142.000	9,594,230.000	
	ASSA ABLOY AB-B	88,327	185.200	16,358,160.400	
	TELIA CO AB	231,855	39.740	9,213,917.700	
	LUNDIN PETROLEUM AB	16,790	258.800	4,345,252.000	
	BOLIDEN AB	21,855	216.300	4,727,236.500	
	ALFA LAVAL AB	23,343	194.950	4,550,717.850	
	KINNEVIK AB-B	18,310	242.000	4,431,020.000	
	MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR SA	5,332	532.500	2,839,290.000	
	ICA GRUPPEN AB	5,920	378.300	2,239,536.000	
	HUSQVARNA AB-B SHS	33,692	79.320	2,672,449.440	
HEXAGON AB	22,037	441.300	9,724,928.100		
EPIROC AB-A	63,358	88.460	5,604,648.680		
EPIROC AB-B	30,899	86.000	2,657,314.000		
ESSITY AB-B	52,522	278.500	14,627,377.000		

	BOLIDEN AB-REDEMPTION SHARES	21,855	4.242	92,708.910	
	NORDEA BANK ABP	267,838	66.990	17,942,467.620	
スウェーデン・クローナ 小計		2,148,381		277,125,150.620 (3,164,769,220)	
デンマーク・ク ローネ	CARLSBERG AS-B	9,644	880.600	8,492,506.400	
	A P MOLLER A/S	604	7,180.000	4,336,720.000	
	AP MOLLER MAERSK A	273	6,825.000	1,863,225.000	
	DANSKE BANK A/S	61,114	110.000	6,722,540.000	
	GENMAB A/S	5,622	1,147.500	6,451,245.000	
	NOVOZYMES-B SHS	19,111	314.600	6,012,320.600	
	NOVO NORDISK A/S-B	150,011	314.700	47,208,461.700	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	17,720	548.000	9,710,560.000	
	COLOPLAST-B	9,729	712.600	6,932,885.400	
	DSV A/S	15,349	597.400	9,169,492.600	
	DEMANT A/S	12,042	223.900	2,696,203.800	
	H LUNDBECK A/S	4,840	268.400	1,299,056.000	
	TRYG A/S	11,107	209.400	2,325,805.800	
	PANDORA A/S	8,251	248.300	2,048,723.300	
	CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S	9,283	697.800	6,477,677.400	
	ISS A/S	16,240	188.150	3,055,556.000	
ORSTED A/S	17,249	532.800	9,190,267.200		
デンマーク・クローネ 小計		368,189		133,993,246.200 (2,173,370,454)	
ニュージーラン ド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	85,245	8.765	747,172.420	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	29,894	11.580	346,172.520	
	A2 MILK CO LTD	55,091	15.800	870,437.800	
	FISHER & PAYKEL	57,274	15.400	882,019.600	
	FLETCHER BUILDING LTD	64,104	5.250	336,546.000	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	159,623	3.815	608,961.740	
	MERIDIAN ENERGY LTD	90,173	4.240	382,333.520	
ニュージーランド・ドル 小計		541,404		4,173,643.600 (295,953,067)	
ノルウェー・ク ローネ	MOWI ASA	35,183	203.000	7,142,149.000	
	DNB ASA	79,858	148.400	11,850,927.200	
	NORSK HYDRO ASA	137,190	30.620	4,200,757.800	
	TELENOR ASA	62,076	180.000	11,173,680.000	
	ORKLA ASA	64,938	75.760	4,919,702.880	
	EQUINOR ASA	89,942	167.700	15,083,273.400	
	YARA INTERNATIONAL ASA	16,000	375.900	6,014,400.000	
	AKER BP ASA	8,552	236.400	2,021,692.800	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	16,683	170.450	2,843,617.350	
	SCHIBSTED ASA	7,445	221.000	1,645,345.000	
ノルウェー・クローネ 小計		517,867		66,895,545.430 (828,835,808)	
ユーロ	CRH PLC	71,394	27.990	1,998,318.060	

FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	6,246	63.700	397,870.200
KERRY GROUP PLC-A	13,865	103.500	1,435,027.500
KINGSPAN GROUP PLC	14,756	46.660	688,514.960
UMICORE	19,109	26.700	510,210.300
AIR LIQUIDE	37,092	111.500	4,135,758.000
AIRBUS SE	50,178	114.860	5,763,445.080
AXA	166,040	22.080	3,666,163.200
VEOLIA ENVIRONNEMENT	44,449	20.710	920,538.790
ADIDAS AG	15,601	256.200	3,996,976.200
ASSICURAZIONI GENERALI	95,191	15.715	1,495,926.560
DASSAULT AVIATION SA	274	1,117.000	306,058.000
DANONE	52,967	71.400	3,781,843.800
SAFRAN SA	28,082	117.700	3,305,251.400
INTESA SANPAOLO	1,249,933	1.833	2,291,127.180
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	30,304	62.020	1,879,454.080
ACCOR SA	16,000	33.040	528,640.000
BOUYGUES	17,572	31.330	550,530.760
BNP PARIBAS	96,099	40.875	3,928,046.620
THALES SA	9,883	98.560	974,068.480
CAPGEMINI SA	13,759	100.100	1,377,275.900
CASINO GUICHARD PERRACHON	4,264	34.070	145,274.480
INGENICO GROUP	4,334	71.580	310,227.720
UNICREDIT SPA	170,144	10.188	1,733,427.070
NATIXIS	70,166	4.109	288,312.090
KONINKLIJKE DSM NV	15,111	100.800	1,523,188.800
COMMERZBANK AG	83,118	6.302	523,809.630
EIFFAGE	6,461	85.580	552,932.380
FRESENIUS SE & CO KGAA	37,562	45.410	1,705,690.420
UNITED INTERNET	9,882	32.050	316,718.100
FUCHS PETROLUB SE PREF	5,546	34.940	193,777.240
PUBLICIS GROUPE	18,222	48.900	891,055.800
FAURECIA	6,117	33.070	202,289.190
IBERDROLA SA	498,442	8.314	4,144,046.780
ENI SPA	223,985	13.580	3,041,716.300
IMERYS SA	2,256	38.840	87,623.040
JERONIMO MARTINS	19,517	13.625	265,919.120
KBC GROUPE	20,803	58.860	1,224,464.580
HANNOVER RUECK SE	4,868	134.200	653,285.600
WARTSILA OYJ	34,935	13.085	457,124.470
L'OREAL	21,627	240.400	5,199,130.800
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	23,881	338.600	8,086,106.600
GEA GROUP AG	11,838	24.480	289,794.240
BOLLORE	71,347	4.042	288,384.570
MEDIOBANCA SPA	62,022	8.272	513,045.980
MICHELIN(CGDE)-B	15,018	102.950	1,546,103.100
CONTINENTAL AG	9,528	121.800	1,160,510.400
DEUTSCHE POST AG-REG	86,663	26.380	2,286,169.940

SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	24,847	13.950	346,615.650	
NOKIAN RENKAAT OYJ	9,399	25.590	240,520.410	
AXEL SPRINGER SE	4,978	55.550	276,527.900	
OMV AG	12,817	42.090	539,467.530	
VERBUND AG	6,778	44.800	303,654.400	
PERNOD-RICARD	18,479	157.800	2,915,986.200	
PEUGEOT SA	50,087	19.970	1,000,237.390	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	13,249	55.780	739,029.220	
RENAULT SA	17,786	53.920	959,021.120	
REPSOL SA	116,954	14.460	1,691,154.840	
REMY COINTREAU	1,860	123.000	228,780.000	
MERCK KGAA	11,193	86.460	967,746.780	
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	44,331	32.415	1,436,989.360	
RWE AG	45,905	22.360	1,026,435.800	
SEB SA	2,420	146.300	354,046.000	
SOCIETE GENERALE-A	64,277	22.460	1,443,661.420	
VINCI S.A.	43,950	88.460	3,887,817.000	
SODEXO	7,075	103.000	728,725.000	
SOLVAY SA	7,086	84.080	595,790.880	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	48,032	70.800	3,400,665.600	
VIVENDI SA	80,942	24.130	1,953,130.460	
SAP SE	84,466	110.420	9,326,735.720	
TELEFONICA S.A	390,910	7.178	2,805,951.980	
TOTAL SA	204,575	46.640	9,541,378.000	
VALEO	19,653	23.680	465,383.040	
E.ON SE	197,427	9.349	1,845,745.020	
VOEST-ALPINE AG	9,875	23.370	230,778.750	
HENKEL AG & CO KGAA	9,300	77.600	721,680.000	
SIEMENS AG-REG	65,679	101.440	6,662,477.760	
UPM-KYMMENE OYJ	44,548	22.420	998,766.160	
ING GROEP NV-CVA	341,295	9.695	3,308,855.020	
PUMA AG	600	520.500	312,300.000	
BAYER AG	81,767	52.820	4,318,932.940	
STORA ENSO OYJ-R SHS	54,186	9.462	512,707.930	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	15,350	81.780	1,255,323.000	
DAIMLER AG	79,476	46.435	3,690,468.060	
BASF SE	78,681	59.060	4,646,899.860	
BEIERSDORF AG	8,371	103.050	862,631.550	
HOCHTIEF AG	1,707	106.600	181,966.200	
HEIDELBERGCEMENT AG	12,031	66.560	800,783.360	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	18,494	65.280	1,207,288.320	
ORANGE	172,654	14.040	2,424,062.160	
SAMPO OYJ-A SHS	39,403	38.760	1,527,260.280	
RANDSTAD NV	9,074	46.200	419,218.800	
ALLIANZ SE	36,464	198.860	7,251,231.040	

ENERGIAS DE PORTUGAL SA	242,094	3.259	788,984.340	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	103,511	20.135	2,084,193.980	
HERMES INTL	2,703	594.800	1,607,744.400	
ENDESA S.A.	29,314	22.310	653,995.340	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	24,926	17.050	424,988.300	
ERSTE GROUP BANK AG	25,117	31.750	797,464.750	
MUENCHENER RUECKVER AG- REG	12,966	216.100	2,801,952.600	
ARCELOR MITTAL (NL)	58,189	13.260	771,586.140	
SOCIETE BIC SA	2,478	69.900	173,212.200	
DASSAULT SYSTEMES SA	10,913	132.850	1,449,792.050	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	23,521	36.900	867,924.900	
HEINEKEN NV	23,051	94.020	2,167,255.020	
AKZO NOBEL	19,142	75.520	1,445,603.840	
ASML HOLDING NV	36,588	169.300	6,194,348.400	
AEGON NV	150,349	4.096	615,829.500	
BANKINTER S.A.	57,960	6.478	375,464.880	
VOLKSWAGEN AG	3,545	142.100	503,744.500	
VOLKSWAGEN AG PFD	15,382	139.500	2,145,789.000	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	561,745	4.867	2,734,012.910	
KERING	6,609	465.950	3,079,463.550	
CNP ASSURANCES	13,987	19.190	268,410.530	
FORTUM OYJ	37,452	19.130	716,456.760	
AGEAS	14,365	43.680	627,463.200	
UCB SA	11,267	68.480	771,564.160	
THYSSENKRUPP AG	37,894	11.335	429,528.490	
UNILEVER NV-CVA	125,330	54.000	6,767,820.000	
CARREFOUR SA	51,094	16.840	860,422.960	
NATURGY ENERGY GROUP SA	23,612	25.530	602,814.360	
ATOS SE	8,816	68.220	601,427.520	
NOKIA OYJ	495,975	4.480	2,221,968.000	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	79,194	35.450	2,807,427.300	
WOLTERS KLUWER-CVA	25,051	62.540	1,566,689.540	
SANOFI	96,686	72.240	6,984,596.640	
STMICROELECTRONICS NV	55,611	13.695	761,592.640	
ELISA OYJ	14,176	39.920	565,905.920	
BANCO SANTANDER SA	1,411,232	3.952	5,577,188.860	
METSO OYJ	8,585	28.950	248,535.750	
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	34,596	19.030	658,361.880	
QIAGEN N.V.	21,897	34.160	748,001.520	
1&1 DRILLISCH AG	3,149	27.360	86,156.640	
DEUTSCHE BANK AG-REG	171,985	6.087	1,046,872.690	
BMW VORZUG	4,116	53.000	218,148.000	
ENEL SPA	695,271	5.570	3,872,659.470	
COLRUYT NV	4,673	66.520	310,847.960	

VOPAK (KON.)	5,364	36.700	196,858.800	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	285,788	15.110	4,318,256.680	
SARTORIUS AG	2,712	170.000	461,040.000	
LEONARDO SPA	40,409	9.942	401,746.270	
UBISOFT ENTERTAINMENT	7,786	73.360	571,180.960	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	99,068	16.084	1,593,409.710	
CARL ZEISS MEDITEC AG	3,771	84.250	317,706.750	
KONINKLIJKE KPN NV	291,029	2.738	796,837.400	
EUROFINS SCIENTIFIC	794	407.200	323,316.800	
TELEPERFORMANCE	5,363	172.000	922,436.000	
DEUTSCHE BOERSE AG	16,913	123.750	2,092,983.750	
EURAZEO	2,748	62.650	172,162.200	
BANCO SABADELL	563,371	0.993	559,427.400	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	6,689	83.460	558,263.940	
FRAPORT AG	3,149	70.500	222,004.500	
HEINEKEN HOLDING NV-A	9,791	88.600	867,482.600	
INDITEX	96,734	24.050	2,326,452.700	
JC DECAUX SA	6,058	25.000	151,450.000	
ANDRITZ AG	6,265	32.200	201,733.000	
MAPFRE SA	84,474	2.628	221,997.670	
ESSILORLUXOTTICA	24,186	103.150	2,494,785.900	
SNAM SPA	169,163	4.504	761,910.150	
CREDIT AGRICOLE SA	99,973	10.230	1,022,723.790	
ENAGAS	18,095	24.500	443,327.500	
WENDEL	2,220	114.000	253,080.000	
WIRECARD AG	9,891	140.100	1,385,729.100	
TENARIS SA	36,959	10.550	389,917.450	
TELECOM ITALIA SPA	762,675	0.439	334,814.320	
TELECOM ITALIA-RNC	497,596	0.418	207,995.120	
ATLANTIA SPA	43,688	22.460	981,232.480	
ILIAD SA	2,102	103.450	217,451.900	
PROXIMUS	14,283	25.950	370,643.850	
SES FDR	34,268	13.520	463,303.360	
TERNA SPA	113,654	5.466	621,232.760	
BIOMERIEUX	3,248	73.150	237,591.200	
GRIFOLS SA	23,518	22.980	540,443.640	
FERROVIAL SA	45,253	21.390	967,961.670	
LANXESS AG	6,856	44.870	307,628.720	
NESTE OYJ	37,454	30.260	1,133,358.040	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	9,641	20.820	200,725.620	
RECORDATI SPA	6,859	37.000	253,783.000	
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	55,725	8.745	487,315.120	
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	4,859	193.600	940,702.400	
KONE OYJ	29,124	48.810	1,421,542.440	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	2,881	124.100	357,532.100	
ENGIE	159,735	12.450	1,988,700.750	

ALSTOM	12,046	40.880	492,440.480	
TELENET GROUP HOLDING NV	3,634	48.240	175,304.160	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	12,542	15.775	197,850.050	
ELECTRICITE DE FRANCE	53,800	12.560	675,728.000	
IPSEN SA	3,646	106.900	389,757.400	
DEUTSCHE WOHNEN	30,689	42.250	1,296,610.250	
ARKEMA SA	5,033	75.120	378,078.960	
LEGRAND SA	23,308	60.140	1,401,743.120	
ADP	2,313	153.200	354,351.600	
ORION OYJ	8,051	29.280	235,733.280	
RTL GROUP SA	3,446	42.880	147,764.480	
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	40,088	13.480	540,386.240	
SYMRISE AG	11,548	83.860	968,415.280	
SCOR SE	13,875	36.830	511,016.250	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	17,397	24.800	431,445.600	
PRYSMIAN SPA	21,452	14.930	320,278.360	
CAIXABANK	297,224	2.758	819,743.790	
BUREAU VERITAS SA	23,179	21.110	489,308.690	
GETLINK	37,646	13.810	519,891.260	
SUEZ SA	26,620	11.975	318,774.500	
AMADEUS IT GROUP SA	38,492	68.360	2,631,313.120	
BRENNTAG AG	12,353	41.580	513,637.740	
EVONIK INDUSTRIES AG	17,116	23.520	402,568.320	
EDENRED	19,188	40.900	784,789.200	
BANKIA SA	100,675	2.264	227,928.200	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	61,541	2.511	154,529.450	
HUGO BOSS AG -ORD	5,218	52.100	271,857.800	
KION GROUP AG	4,567	48.840	223,052.280	
VONOVIA SE	41,371	46.960	1,942,782.160	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	82,256	4.802	394,993.310	
KNORR-BREMSE AG	4,492	98.550	442,686.600	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	15,254	34.850	531,601.900	
FERRARI NV	10,895	127.600	1,390,202.000	
METRO AG	10,774	14.110	152,021.140	
CNH INDUSTRIAL NV	94,317	7.798	735,483.960	
AROUNDTOWN SA	71,783	7.602	545,694.360	
AIB GROUP PLC	86,464	3.682	318,360.440	
INNOGY SE-TEMPORARY	9,769	37.150	362,918.350	
MONCLER SPA	14,353	33.000	473,649.000	
WORLDLINE SA	7,758	53.900	418,156.200	
NN GROUP NV	28,528	34.020	970,522.560	
FINCOBANK SPA	45,048	9.276	417,865.240	
ZALANDO SE	9,414	35.540	334,573.560	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	89,977	11.438	1,029,156.920	
AENA SME SA	6,175	164.900	1,018,257.500	
CELLNEX TELECOM SAU	18,226	31.450	573,207.700	

	ABN AMRO GROUP NV	34,251	18.940	648,713.940	
	EXOR NV	10,237	56.220	575,524.140	
	COVESTRO AG	15,802	39.230	619,912.460	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	65,229	72.610	4,736,277.690	
	POSTE ITALIANE SPA	40,015	8.700	348,130.500	
	AMUNDI SA	6,409	58.100	372,362.900	
	ADYEN NV	929	720.800	669,623.200	
	PIRELLI & C SPA	34,086	5.106	174,043.110	
	UNIPER SE	19,366	25.110	486,280.260	
	DELIVERY HERO SE	11,128	38.550	428,984.400	
ユーロ 小計		16,594,174		315,968,675.680 (38,263,806,625)	
香港・ドル	ASM PACIFIC TECH	32,700	76.050	2,486,835.000	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	164,000	16.500	2,706,000.000	
	BANK OF EAST ASIA	103,860	24.400	2,534,184.000	
	CLP HOLDINGS LTD	149,500	88.650	13,253,175.000	
	PCCW LTD	331,000	4.460	1,476,260.000	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	49,000	60.550	2,966,950.000	
	HONG KONG EXCHANGES &CLEAR	100,940	249.400	25,174,436.000	
	MTR CORP	150,000	47.950	7,192,500.000	
	HANG SENG BANK LTD	65,400	196.500	12,851,100.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	145,450	40.500	5,890,725.000	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	123,000	54.200	6,666,600.000	
	(THE) WHARF HOLDINGS LTD	95,750	20.050	1,919,787.500	
	HONG KONG & CHINA GAS	920,755	17.320	15,947,476.600	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	50,000	40.800	2,040,000.000	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	178,000	47.400	8,437,200.000	
	KERRY PROPERTIES LTD	73,500	29.750	2,186,625.000	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	324,000	30.100	9,752,400.000	
	NWS HOLDINGS LTD	135,000	15.460	2,087,100.000	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HOLDINGS	50,500	21.950	1,108,475.000	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	588,266	11.560	6,800,354.960	
	SHANGRI-LA ASIA LTD	104,000	10.000	1,040,000.000	
	SINO LAND CO	255,400	12.540	3,202,716.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	135,000	124.100	16,753,500.000	
	SWIRE PACIFIC LTD A	47,500	92.800	4,408,000.000	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	113,500	50.000	5,675,000.000	
	VITASOY INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	70,000	42.050	2,943,500.000	
WHEELLOCK & CO LTD	86,000	51.900	4,463,400.000		
SJM HOLDINGS LTD	156,000	8.680	1,354,080.000		
WYNN MACAU LTD	124,400	16.740	2,082,456.000		

MGM CHINA HOLDINGS LTD	64,800	12.100	784,080.000	
AIA GROUP LTD	1,038,827	73.650	76,509,608.550	
HKT TRUST / HKT LTD	386,000	12.360	4,770,960.000	
SANDS CHINA LTD	199,200	35.500	7,071,600.000	
SWIRE PROPERTIES LTD	104,200	32.300	3,365,660.000	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT CO LTD	117,750	53.550	6,305,512.500	
HK ELECTRIC INVESTMENTS & HK ELECTRIC INVESTMENTS LTD	230,000	7.670	1,764,100.000	
WH GROUP LTD	872,000	7.060	6,156,320.000	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	242,832	74.050	17,981,709.600	
CK ASSET HOLDINGS LTD	222,832	56.700	12,634,574.400	
香港・ドル 小計	8,400,862		312,744,961.110 (4,322,135,362)	
合計	107,147,957		323,369,184,670 (323,369,184,670)	

(2) 株式以外の有価証券

令和1年6月3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	100,909.000	1,299,707.920	
		GOODMAN GROUP	147,572.000	1,977,464.800	
		GPT GROUP	144,955.000	834,940.800	
		LENLEASE GROUP	42,974.000	612,379.500	
		MIRVAC GROUP	295,783.000	896,222.490	
		SCENTRE GROUP	476,956.000	1,812,432.800	
		STOCKLAND	194,018.000	859,499.740	
		VICINITY CENTRES	270,443.000	697,742.940	
	オーストラリア・ドル 小計		1,673,610.000	8,990,390.990 (676,347,115)	
	シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	200,806.000	586,353.520	
		CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	206,300.000	398,159.000	
		CAPITALAND MALL TRUST	199,000.000	479,590.000	
		SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	192,100.000	349,622.000	
	シンガポール・ドル 小計		798,206.000	1,813,724.520 (143,066,590)	
投資信託受益証券 合計			2,471,816	819,413,705 (819,413,705)	
投資証券	アメリカ・ドル	AGNC INVESTMENT CORP	44,741.000	733,752.400	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	9,644.000	1,411,978.040	
		AMERICAN TOWER CORP	37,853.000	7,902,570.810	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	125,554.000	1,106,130.740	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	12,353.000	2,507,782.530	

BOSTON PROPERTIES INC	13,309.000	1,741,216.470	
CAMDEN PROPERTY TRUST	8,062.000	833,288.320	
CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	35,379.000	4,599,623.790	
DIGITAL REALTY TRUST INC	18,388.000	2,164,635.360	
DUKE REALTY TRUST	32,954.000	991,585.860	
EQUINIX INC	6,964.000	3,383,041.560	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	6,813.000	828,869.580	
EQUITY RESIDENTIAL	31,567.000	2,417,085.190	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	5,653.000	1,649,206.220	
EXTRA SPACE STORAGE INC	10,754.000	1,152,398.640	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	6,000.000	784,380.000	
HCP INC	41,301.000	1,309,654.710	
HOST HOTELS & RESORTS INC	64,001.000	1,159,058.110	
INVITATION HOMES INC	30,427.000	779,844.010	
IRON MOUNTAIN INC	23,977.000	734,895.050	
KIMCO REALTY	32,980.000	573,852.000	
LIBERTY PROPERTY TRUST	11,649.000	552,978.030	
MID AMERICA	10,258.000	1,171,258.440	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	13,649.000	730,630.970	
PROLOGIS INC	55,164.000	4,063,931.880	
PUBLIC STORAGE	13,721.000	3,263,951.480	
REALTY INCOME CORP	26,616.000	1,865,249.280	
REGENCY CENTERS CORP	14,358.000	947,053.680	
SBA COMMUNICATIONS CORP	9,447.000	2,044,425.270	
SIMON PROPERTY GROUP INC	26,483.000	4,292,629.470	
SL GREEN	7,097.000	610,342.000	
SUN COMMUNITIES INC	6,979.000	881,238.330	
THE MACERICH COMPANY	9,014.000	327,478.620	
UDR INC	22,345.000	1,000,609.100	
VENTAS INC	30,244.000	1,944,689.200	
VEREIT INC	93,429.000	829,649.520	
VORNADO REALTY TRUST	15,346.000	1,016,365.580	
WELLTOWER INC	33,309.000	2,705,356.980	
WEYERHAEUSER CO	63,699.000	1,452,337.200	
WP CAREY INC	15,148.000	1,257,435.480	
アメリカ・ドル 小計	1,076,629.000	69,722,459.900 (7,553,731,306)	
イギリス・ポンド	BRITISH LAND CO PLC	69,819.000	372,833.460
	LAND SECURITIES GROUP PLC	55,843.000	462,715.090
	SEGRO PLC	87,247.000	608,635.070
イギリス・ポンド 小計	212,909.000	1,444,183.620 (197,853,156)	

カナダ・ドル	H & R REAL ESTATE INVESTMENT	10,748.000	245,054.400	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	13,467.000	351,219.360	
	SMARTCENTRES REIT	9,288.000	303,346.080	
カナダ・ドル 小計		33,503.000	899,619.840 (72,140,515)	
ユーロ	COVIVIO	4,675.000	438,982.500	
	GECINA SA	3,670.000	469,760.000	
	ICADE	2,234.000	169,895.700	
	KLEPIERRE	17,042.000	519,269.740	
	UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	12,061.000	1,632,456.350	
ユーロ 小計		39,682.000	3,230,364.290 (391,197,115)	
香港・ドル	LINK REIT	185,500.000	17,399,900.000	
香港・ドル 小計		185,500.000	17,399,900.000 (240,466,619)	
投資証券 合計		1,548,223	8,455,388,711 (8,455,388,711)	
合計			9,274,802,416 (9,274,802,416)	

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 614銘柄	63.20%	-%	-%	68.26%
	投資証券 40銘柄	-%	-%	2.17%	
イギリス・ポンド	株式 96銘柄	5.98%	-%	-%	6.30%
	投資証券 3銘柄	-%	-%	0.06%	
イスラエル・シケル	株式 8銘柄	0.12%	-%	-%	0.12%
オーストラリア・ドル	株式 61銘柄	2.38%	-%	-%	2.69%
	投資信託 受益証券 8銘柄	-%	0.19%	-%	
カナダ・ドル	株式 86銘柄	3.61%	-%	-%	3.79%
	投資証券 3銘柄	-%	-%	0.02%	
シンガポール・ドル	株式 21銘柄	0.42%	-%	-%	0.48%
	投資信託 受益証券 4銘柄	-%	0.04%	-%	
スイス・フラン	株式 39銘柄	3.28%	-%	-%	3.42%
スウェーデン・クローナ	株式 33銘柄	0.91%	-%	-%	0.95%
デンマーク・クローネ	株式 17銘柄	0.63%	-%	-%	0.65%
ニュージーランド・ドル	株式 7銘柄	0.09%	-%	-%	0.09%
ノルウェー・クローネ	株式 10銘柄	0.24%	-%	-%	0.25%
ユーロ	株式 239銘柄	11.02%	-%	-%	11.62%
	投資証券 5銘柄	-%	-%	0.11%	
香港・ドル	株式 39銘柄	1.24%	-%	-%	1.37%
	投資証券 1銘柄	-%	-%	0.07%	

(注) 「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

「外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位:円)

科 目	注記 番号	平成30年12月3日現在	令和1年6月3日現在
資産の部			
流動資産			
預金		2,767,770,851	1,905,242,095
コール・ローン		431,960,812	302,760,986
国債証券		194,446,748,914	178,510,535,848
派生商品評価勘定		551,287	13,896
未収入金		2,924,955,010	2,220,977,621
未収利息		1,504,183,554	1,297,389,472
前払費用		17,209,750	25,144,163
流動資産合計		202,093,380,178	184,262,064,081
資産合計		202,093,380,178	184,262,064,081
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		1,150,919	4,396
未払金		3,452,256,707	629,709,720
未払解約金		610,003,000	69,974,000
流動負債合計		4,063,410,626	699,688,116
負債合計		4,063,410,626	699,688,116
純資産の部			
元本等			
元本	1	108,890,668,306	100,931,674,209
剰余金			
剰余金又は欠損金()		89,139,301,246	82,630,701,756
元本等合計		198,029,969,552	183,562,375,965
純資産合計		198,029,969,552	183,562,375,965
負債純資産合計		202,093,380,178	184,262,064,081

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	平成30年12月3日現在	令和1年6月3日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額 同期中追加設定元本額 同期中一部解約元本額	119,775,375,247円 9,938,872,204円 20,823,579,145円	108,890,668,306円 9,832,584,756円 17,791,578,853円
元本の内訳		
ファンド名		
D I A M外国債券パッシブ・ファンド	7,896,183,948円	8,003,262,345円
M I T O ラップ型ファンド（安定型）	11,646,595円	8,170,445円
M I T O ラップ型ファンド（中立型）	32,122,507円	27,152,723円
M I T O ラップ型ファンド（積極型）	40,079,067円	34,750,950円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	83,143,222円	74,979,498円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	86,584,078円	68,877,506円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	49,368,545円	41,318,282円
たわらノーロード 先進国債券	3,071,439,405円	4,260,602,295円
たわらノーロード 先進国債券<ラップ向け>	606,412円	75,941,559円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	112,446,755円	217,964,077円
たわらノーロード バランス（堅実型）	2,168,124円	4,323,692円

たわらノーロード バランス (標準型)	11,896,141円	23,075,744円
たわらノーロード バランス (積極型)	3,556,078円	5,464,342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)	272,161円	721,100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)	20,331,918円	37,749,490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)	32,148,761円	66,154,151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)	9,273,590円	19,631,176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)	4,664,686円	22,899,846円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定型)	146,533円	858,289円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定成長型)	1,179,535円	1,760,847円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(成長型)	458,696円	671,199円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(積極型)	843,866円	1,075,429円
D I A M外国債券インデックス ファンド< D C年金>	5,184,244,877円	5,548,945,465円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 1 安定型	515,972,986円	547,542,510円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 2 安定・成長型	1,667,058,039円	1,722,695,859円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 3 成長型	1,750,349,034円	1,774,080,724円
D I A M D C バランス3 0 インデックスファンド	373,728,992円	370,473,721円
D I A M D C バランス5 0 インデックスファンド	812,438,672円	801,947,983円
D I A M D C バランス7 0 インデックスファンド	636,132,490円	616,171,695円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型>	22,700,841円	22,209,042円
マネックス資産設計ファンド< 育成型>	600,385,040円	607,959,889円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	11,297,386円	10,065,174円
D I A M D C 8 資産バラ ンスファンド(新興国1 0)	116,671,618円	123,025,457円
D I A M D C 8 資産バラ ンスファンド(新興国2 0)	67,978,539円	75,358,004円
D I A M D C 8 資産バラ ンスファンド(新興国3 0)	112,931,528円	123,236,202円
クルーズコントロール	1,178,339,320円	564,358,224円
D I A M 8 資産バランスファ ンドN< D C年金>	85,525,941円	97,176,619円

4資産分散投資・ハイクラス< DC年金>	146,553,632円	156,894,273円
クルーズコントロール<DC年 金>	746,755円	506,248円
DIAMコア資産設計ファンド (堅実型)	2,914,083円	2,344,328円
DIAMコア資産設計ファンド (積極型)	7,872,710円	6,023,530円
ダイナミック・ナビゲーション	1,711,839円	1,249,823円
4資産分散投資・スタンダード <DC年金>	14,975,776円	20,270,787円
9資産分散投資・スタンダード <DC年金>	11,075円	13,510,212円
4資産分散投資・ミドルクラス <DC年金>	-円	82,111円
DIAMパッシブ資産分散ファ ンド	1,282,311,699円	1,282,866,932円
DIAM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)	6,901,704,703円	6,843,240,638円
DIAM外国債券パッシブファ ンド(適格機関投資家向け)	3,916,053,736円	3,778,996,271円
外国債券パッシブファンド(適 格機関投資家限定)	3,093,632,320円	2,487,091,451円
先進国債券パッシブファンド (適格機関投資家限定)	6,086,346,283円	6,081,035,510円
DIAMワールドバランス25 VA(適格機関投資家限定)	94,362,170円	93,665,410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)	775,838,063円	729,296,394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)	629,989,899円	596,042,190円
DIAM国際分散バランスファ ンド30VA(適格機関投資家 限定)	48,399,031円	47,935,167円
DIAM国際分散バランスファ ンド50VA(適格機関投資家 限定)	90,162,565円	84,153,565円
DIAM国内重視バランスファ ンド30VA(適格機関投資家 限定)	22,987,258円	22,701,388円
DIAM国内重視バランスファ ンド50VA(適格機関投資家 限定)	6,578,358円	6,239,351円
DIAM世界バランスファンド 40VA(適格機関投資家限 定)	62,995,630円	64,470,054円
DIAM世界バランスファンド 50VA(適格機関投資家限 定)	76,570,991円	83,537,774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)	3,366,217,342円	3,107,859,811円
D I A Mバランスファンド3 7.5 V A (適格機関投資家限 定)	2,197,555,424円	2,081,882,920円
D I A Mバランスファンド50 V A (適格機関投資家限定)	3,775,649,618円	3,598,789,320円
D I A Mグローバル・アセッ ト・バランスV A (適格機関投 資家限定)	664,717,772円	648,051,064円
D I A Mグローバル・アセッ ト・バランスV A 2 (適格機関 投資家限定)	254,267,305円	245,626,602円
D I A M アクサ グローバ ル バランスファンド30 V A (適格機関投資家限定)	3,118,897,480円	2,881,291,223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)	2,086,372,678円	1,429,528,598円
D I A Mグローバル 私募ファ ンド(適格機関投資家向け)	13,975,529円	14,665,687円
D I A M世界バランスファンド 55 V A (適格機関投資家限 定)	15,876,290円	6,712,819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)	134,532,939円	103,421,279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)	9,554,912,111円	5,490,666,620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)	18,802,554,433円	16,111,618,063円
D I A Mバランス30 V A (適 格機関投資家限定)	20,354,827円	19,744,962円
D I A Mバランス50 V A (適 格機関投資家限定)	381,763円	985,718円
D I A Mバランス70 V A (適 格機関投資家限定)	5,427,237円	1,346,753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)	16,804,342,256円	16,591,593,136円
D I A M世界バランス25 V A (適格機関投資家限定)	96,798,524円	85,360,418円
D I A Mバランス20 V A (適 格機関投資家限定)	108,275,368円	107,189,126円
D I A Mバランス40 V A (適 格機関投資家限定)	361,861円	368,352円
D I A Mバランス60 V A (適 格機関投資家限定)	163,047円	166,778円
計	108,890,668,306円	100,931,674,209円
2. 受益権の総数	108,890,668,306口	100,931,674,209口

--	--	--

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成30年6月5日 至 平成30年12月3日	自 平成30年12月4日 至 令和1年6月3日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成30年12月3日現在	令和1年6月3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	1,891,107,535	4,565,513,319
合計	1,891,107,535	4,565,513,319

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(平成30年2月22日から平成30年12月3日まで及び平成31年2月22日から令和1年6月3日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	平成30年12月3日 現在				令和1年6月3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	611,986,225	-	612,230,136	243,911	1,559,970,000	-	1,559,960,500	9,500
アメリカ・ドル	357,090,000	-	357,688,141	598,141	606,710,000	-	606,709,999	1
イギリス・ポンド	61,380,000	-	61,407,094	27,094	44,380,000	-	44,382,916	2,916
オーストラリア・ドル	-	-	-	-	55,670,000	-	55,671,480	1,480
カナダ・ドル	28,808,956	-	28,903,390	94,434	48,580,000	-	48,579,394	606
デンマーク・クローネ	164,707,269	-	164,231,511	475,758	-	-	-	-
ユーロ	-	-	-	-	804,630,000	-	804,616,711	13,289
買 建	616,936,225	-	616,580,504	355,721	-	-	-	-
ユーロ	616,936,225	-	616,580,504	355,721	-	-	-	-
合計	1,228,922,450	-	1,228,810,640	599,632	1,559,970,000	-	1,559,960,500	9,500

(注) 時価の算定方法

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

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

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

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

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

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成30年12月3日現在	令和1年6月3日現在
1口当たり純資産額	1.8186円	1.8187円
(1万口当たり純資産額)	(18,186円)	(18,187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

令和1年6月3日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	US T N/B 1.125 02/28/21	3,680,000.000	3,625,057.600	
		US T N/B 1.375 01/31/21	2,750,000.000	2,721,207.500	
		US T N/B 1.375 04/30/21	11,210,000.000	11,086,465.800	
		US T N/B 1.375 05/31/20	3,500,000.000	3,471,405.000	
		US T N/B 1.375 06/30/23	7,000,000.000	6,847,960.000	
		US T N/B 1.375 09/30/23	5,900,000.000	5,763,061.000	
		US T N/B 1.5 08/15/26	7,000,000.000	6,747,300.000	
		US T N/B 1.625 02/15/26	5,500,000.000	5,363,765.000	
		US T N/B 1.625 05/15/26	6,130,000.000	5,969,087.500	
		US T N/B 1.625 05/31/23	5,300,000.000	5,241,594.000	
		US T N/B 1.625 08/15/22	7,270,000.000	7,206,387.500	
		US T N/B 1.625 11/15/22	9,420,000.000	9,330,886.800	
		US T N/B 1.625 11/30/20	8,510,000.000	8,455,450.900	
		US T N/B 1.75 01/31/23	8,570,000.000	8,519,779.800	
		US T N/B 1.75 03/31/22	8,850,000.000	8,812,653.000	
		US T N/B 1.75 05/15/22	8,110,000.000	8,074,153.800	
		US T N/B 1.75 05/15/23	7,000,000.000	6,955,130.000	
		US T N/B 1.75 09/30/22	8,740,000.000	8,696,300.000	
		US T N/B 1.75 10/31/20	6,000,000.000	5,974,680.000	
		US T N/B 1.75 12/31/20	9,000,000.000	8,962,020.000	
		US T N/B 1.875 02/28/22	1,680,000.000	1,678,420.800	
		US T N/B 1.875 06/30/20	11,000,000.000	10,962,160.000	
		US T N/B 1.875 08/31/22	8,450,000.000	8,442,057.000	
		US T N/B 1.875 08/31/24	5,760,000.000	5,737,939.200	
		US T N/B 2.0 02/15/22	11,050,000.000	11,077,956.500	
		US T N/B 2.0 02/15/23	9,500,000.000	9,528,120.000	
		US T N/B 2.0 02/15/25	8,390,000.000	8,399,145.100	
		US T N/B 2.0 05/31/21	12,000,000.000	12,010,680.000	
		US T N/B 2.0 05/31/24	4,770,000.000	4,785,979.500	
		US T N/B 2.0 08/15/25	6,920,000.000	6,918,892.800	
		US T N/B 2.0 09/30/20	6,000,000.000	5,990,580.000	
		US T N/B 2.0 11/15/21	10,400,000.000	10,423,504.000	
		US T N/B 2.0 11/15/26	7,000,000.000	6,974,800.000	
		US T N/B 2.0 11/30/20	7,920,000.000	7,915,010.400	
		US T N/B 2.0 11/30/22	6,590,000.000	6,609,506.400	
		US T N/B 2.125 01/31/21	5,000,000.000	5,009,350.000	
US T N/B 2.125 02/29/24	1,300,000.000	1,310,764.000			
US T N/B 2.125 03/31/24	4,080,000.000	4,114,068.000			
US T N/B 2.125 05/15/25	6,250,000.000	6,292,437.500			
US T N/B 2.125 06/30/22	8,620,000.000	8,677,840.200			

US T N/B 2.125 08/15/21	11,000,000.000	11,045,100.000	
US T N/B 2.125 08/31/20	3,000,000.000	3,000,210.000	
US T N/B 2.125 09/30/21	10,000,000.000	10,046,000.000	
US T N/B 2.125 09/30/24	5,710,000.000	5,756,822.000	
US T N/B 2.125 12/31/21	10,330,000.000	10,386,401.800	
US T N/B 2.125 12/31/22	8,000,000.000	8,060,560.000	
US T N/B 2.25 01/31/24	350,000.000	354,812.500	
US T N/B 2.25 02/15/27	7,040,000.000	7,138,982.400	
US T N/B 2.25 03/31/21	9,760,000.000	9,806,067.200	
US T N/B 2.25 03/31/26	3,090,000.000	3,133,908.900	
US T N/B 2.25 08/15/27	6,750,000.000	6,831,202.500	
US T N/B 2.25 08/15/46	4,070,000.000	3,804,473.200	
US T N/B 2.25 11/15/24	8,590,000.000	8,712,751.100	
US T N/B 2.25 11/15/25	7,000,000.000	7,098,420.000	
US T N/B 2.25 11/15/27	6,620,000.000	6,694,938.400	
US T N/B 2.25 12/31/23	5,860,000.000	5,939,637.400	
US T N/B 2.375 04/30/26	1,760,000.000	1,799,459.200	
US T N/B 2.375 05/15/27	6,330,000.000	6,470,399.400	
US T N/B 2.375 05/15/29	1,800,000.000	1,837,116.000	
US T N/B 2.375 08/15/24	8,900,000.000	9,082,094.000	
US T N/B 2.375 12/31/20	8,300,000.000	8,344,073.000	
US T N/B 2.5 01/15/22	3,850,000.000	3,906,980.000	
US T N/B 2.5 01/31/21	9,810,000.000	9,886,223.700	
US T N/B 2.5 01/31/24	3,890,000.000	3,988,767.100	
US T N/B 2.5 02/15/22	1,070,000.000	1,086,756.200	
US T N/B 2.5 02/15/45	4,500,000.000	4,436,325.000	
US T N/B 2.5 02/15/46	2,970,000.000	2,926,816.200	
US T N/B 2.5 02/28/26	2,550,000.000	2,626,296.000	
US T N/B 2.5 03/31/23	1,020,000.000	1,041,991.200	
US T N/B 2.5 05/15/24	9,000,000.000	9,234,090.000	
US T N/B 2.5 05/15/46	3,940,000.000	3,877,787.400	
US T N/B 2.5 08/15/23	8,000,000.000	8,184,320.000	
US T N/B 2.625 01/31/26	2,180,000.000	2,261,575.600	
US T N/B 2.625 02/15/29	5,580,000.000	5,815,364.400	
US T N/B 2.625 03/31/25	4,080,000.000	4,223,412.000	
US T N/B 2.625 06/30/23	1,820,000.000	1,870,050.000	
US T N/B 2.625 08/15/20	16,500,000.000	16,596,030.000	
US T N/B 2.625 08/31/20	9,250,000.000	9,304,482.500	
US T N/B 2.625 11/15/20	6,000,000.000	6,048,480.000	
US T N/B 2.625 12/15/21	3,770,000.000	3,837,860.000	
US T N/B 2.625 12/31/23	3,060,000.000	3,151,555.200	
US T N/B 2.625 12/31/25	2,290,000.000	2,375,142.200	
US T N/B 2.75 02/15/24	8,040,000.000	8,332,656.000	
US T N/B 2.75 02/15/28	5,950,000.000	6,251,189.000	
US T N/B 2.75 02/28/25	3,510,000.000	3,656,682.900	
US T N/B 2.75 04/30/23	2,490,000.000	2,567,812.500	
US T N/B 2.75 05/31/23	3,270,000.000	3,373,462.800	
US T N/B 2.75 06/30/25	790,000.000	824,064.800	
US T N/B 2.75 07/31/23	6,500,000.000	6,712,745.000	

US T N/B 2.75 08/15/42	1,800,000.000	1,869,606.000	
US T N/B 2.75 08/15/47	3,930,000.000	4,068,139.500	
US T N/B 2.75 08/31/23	2,170,000.000	2,242,369.500	
US T N/B 2.75 08/31/25	1,640,000.000	1,711,487.600	
US T N/B 2.75 11/15/23	9,370,000.000	9,692,796.500	
US T N/B 2.75 11/15/42	3,190,000.000	3,309,114.600	
US T N/B 2.75 11/15/47	3,360,000.000	3,470,241.600	
US T N/B 2.75 11/30/20	7,840,000.000	7,918,635.200	
US T N/B 2.875 05/15/28	7,120,000.000	7,556,598.400	
US T N/B 2.875 05/15/43	3,880,000.000	4,107,018.800	
US T N/B 2.875 05/15/49	1,300,000.000	1,379,105.000	
US T N/B 2.875 05/31/25	2,530,000.000	2,655,892.800	
US T N/B 2.875 07/31/25	3,390,000.000	3,561,330.600	
US T N/B 2.875 08/15/28	5,730,000.000	6,085,833.000	
US T N/B 2.875 08/15/45	4,400,000.000	4,657,444.000	
US T N/B 2.875 09/30/23	840,000.000	872,743.200	
US T N/B 2.875 10/31/23	6,010,000.000	6,247,575.300	
US T N/B 2.875 11/15/21	4,880,000.000	4,990,727.200	
US T N/B 2.875 11/15/46	3,420,000.000	3,625,439.400	
US T N/B 2.875 11/30/23	5,640,000.000	5,869,096.800	
US T N/B 2.875 11/30/25	3,480,000.000	3,661,586.400	
US T N/B 3.0 02/15/47	3,480,000.000	3,776,322.000	
US T N/B 3.0 02/15/48	4,020,000.000	4,354,142.400	
US T N/B 3.0 02/15/49	4,660,000.000	5,062,251.200	
US T N/B 3.0 05/15/42	980,000.000	1,061,536.000	
US T N/B 3.0 05/15/45	4,440,000.000	4,809,052.800	
US T N/B 3.0 05/15/47	3,380,000.000	3,673,079.800	
US T N/B 3.0 08/15/48	4,770,000.000	5,172,444.900	
US T N/B 3.0 09/30/25	1,410,000.000	1,492,724.700	
US T N/B 3.0 10/31/25	1,920,000.000	2,033,683.200	
US T N/B 3.0 11/15/44	3,760,000.000	4,066,665.600	
US T N/B 3.0 11/15/45	3,900,000.000	4,229,043.000	
US T N/B 3.125 02/15/42	1,800,000.000	1,990,818.000	
US T N/B 3.125 02/15/43	2,600,000.000	2,870,348.000	
US T N/B 3.125 05/15/21	8,000,000.000	8,174,640.000	
US T N/B 3.125 05/15/48	4,350,000.000	4,826,455.500	
US T N/B 3.125 08/15/44	3,470,000.000	3,832,719.100	
US T N/B 3.125 11/15/28	5,830,000.000	6,321,410.700	
US T N/B 3.125 11/15/41	760,000.000	841,517.600	
US T N/B 3.375 05/15/44	3,910,000.000	4,498,611.400	
US T N/B 3.375 11/15/48	4,420,000.000	5,146,161.800	
US T N/B 3.5 02/15/39	1,300,000.000	1,525,563.000	
US T N/B 3.625 02/15/21	5,500,000.000	5,644,155.000	
US T N/B 3.625 02/15/44	4,110,000.000	4,917,532.800	
US T N/B 3.625 08/15/43	2,720,000.000	3,249,964.800	
US T N/B 3.75 08/15/41	1,500,000.000	1,822,605.000	
US T N/B 3.75 11/15/43	4,120,000.000	5,022,197.600	
US T N/B 3.875 08/15/40	1,430,000.000	1,766,607.700	
US T N/B 4.25 05/15/39	810,000.000	1,047,807.900	

	US T N/B 4.25 11/15/40	1,470,000.000	1,909,265.400	
	US T N/B 4.375 02/15/38	750,000.000	980,092.500	
	US T N/B 4.375 05/15/40	2,000,000.000	2,635,780.000	
	US T N/B 4.375 05/15/41	1,700,000.000	2,247,451.000	
	US T N/B 4.375 11/15/39	1,470,000.000	1,934,534.700	
	US T N/B 4.5 02/15/36	1,230,000.000	1,604,854.800	
	US T N/B 4.5 05/15/38	800,000.000	1,062,496.000	
	US T N/B 4.5 08/15/39	1,400,000.000	1,870,302.000	
	US T N/B 4.625 02/15/40	2,300,000.000	3,124,757.000	
	US T N/B 4.75 02/15/41	1,800,000.000	2,493,126.000	
	US T N/B 5.0 05/15/37	800,000.000	1,115,248.000	
	US T N/B 5.25 02/15/29	1,000,000.000	1,271,170.000	
	US T N/B 5.25 11/15/28	1,500,000.000	1,897,845.000	
	US T N/B 5.375 02/15/31	1,500,000.000	1,993,230.000	
	US T N/B 5.5 08/15/28	1,100,000.000	1,408,429.000	
	US T N/B 6.0 02/15/26	840,000.000	1,048,320.000	
	US T N/B 6.125 11/15/27	1,400,000.000	1,833,552.000	
	US T N/B 6.25 05/15/30	710,000.000	991,834.500	
	US T N/B 6.25 08/15/23	1,000,000.000	1,174,140.000	
	US T N/B 8.0 11/15/21	6,000,000.000	6,866,220.000	
	アメリカ・ドル 小計	762,100,000.000 (82,565,914,000)	786,671,394.100 (85,227,978,837)	
イギリス・ポンド	UK TREASURY 0.5 07/22/22	2,350,000.000	2,344,971.000	
	UK TREASURY 0.75 07/22/23	1,560,000.000	1,568,798.400	
	UK TREASURY 1.0 04/22/24	580,000.000	590,103.600	
	UK TREASURY 1.25 07/22/27	1,680,000.000	1,739,908.800	
	UK TREASURY 1.5 01/22/21	2,700,000.000	2,739,420.000	
	UK TREASURY 1.5 07/22/26	1,970,000.000	2,076,636.100	
	UK TREASURY 1.5 07/22/47	1,960,000.000	1,969,408.000	
	UK TREASURY 1.625 10/22/28	1,790,000.000	1,908,891.800	
	UK TREASURY 1.625 10/22/71	1,010,000.000	1,110,272.800	
	UK TREASURY 1.75 01/22/49	460,000.000	489,946.000	
	UK TREASURY 1.75 07/22/57	1,540,000.000	1,698,158.000	
	UK TREASURY 1.75 09/07/22	3,000,000.000	3,113,910.000	
	UK TREASURY 1.75 09/07/37	1,900,000.000	2,015,710.000	
	UK TREASURY 2.0 09/07/25	1,110,000.000	1,201,386.300	

UK TREASURY 2.25 09/07/23	2,590,000.000	2,769,642.400	
UK TREASURY 2.5 07/22/65	1,720,000.000	2,377,745.200	
UK TREASURY 2.75 09/07/24	1,700,000.000	1,885,725.000	
UK TREASURY 3.25 01/22/44	2,280,000.000	3,113,568.000	
UK TREASURY 3.5 01/22/45	2,170,000.000	3,102,883.000	
UK TREASURY 3.5 07/22/68	1,580,000.000	2,765,158.000	
UK TREASURY 3.75 07/22/52	1,630,000.000	2,624,463.000	
UK TREASURY 3.75 09/07/21	1,850,000.000	1,981,627.500	
UK TREASURY 4.0 01/22/60	1,440,000.000	2,602,368.000	
UK TREASURY 4.0 03/07/22	1,040,000.000	1,138,165.600	
UK TREASURY 4.25 03/07/36	2,100,000.000	3,034,710.000	
UK TREASURY 4.25 06/07/32	1,440,000.000	1,988,064.000	
UK TREASURY 4.25 09/07/39	1,400,000.000	2,107,140.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/27	1,360,000.000	1,748,796.800	
UK TREASURY 4.25 12/07/40	1,560,000.000	2,379,936.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/46	1,510,000.000	2,453,599.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/49	1,430,000.000	2,410,265.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/55	1,670,000.000	3,019,360.000	
UK TREASURY 4.5 09/07/34	1,490,000.000	2,169,291.000	
UK TREASURY 4.5 12/07/42	1,820,000.000	2,931,110.000	
UK TREASURY 4.75 12/07/30	1,500,000.000	2,112,750.000	
UK TREASURY 4.75 12/07/38	1,450,000.000	2,294,770.000	
UK TREASURY 5.0 03/07/25	2,030,000.000	2,527,309.400	
UK TREASURY 6.0 12/07/28	1,050,000.000	1,542,345.000	
UK TREASURY 8.0 06/07/21	1,700,000.000	1,953,028.000	
イギリス・ボンド 小計	65,120,000.000	83,601,340.700	

		(8,921,440,000)	(11,453,383,676)	
オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN 2.0 12/21/21	1,770,000.000	1,810,161.300	
	AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	2,570,000.000	2,742,190.000	
	AUSTRALIAN 2.25 11/21/22	890,000.000	924,389.600	
	AUSTRALIAN 2.5 05/21/30	830,000.000	914,386.100	
	AUSTRALIAN 2.75 04/21/24	3,100,000.000	3,333,244.000	
	AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	900,000.000	1,028,862.000	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	2,900,000.000	3,204,210.000	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/28	2,700,000.000	3,008,718.000	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/29	1,560,000.000	1,751,677.200	
	AUSTRALIAN 3.0 03/21/47	1,250,000.000	1,482,062.500	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	3,100,000.000	3,452,501.000	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	3,100,000.000	3,609,826.000	
	AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	900,000.000	1,099,071.000	
	AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	1,200,000.000	1,553,964.000	
	AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	2,480,000.000	2,958,987.200	
	AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	1,500,000.000	2,039,670.000	
	AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	2,950,000.000	3,693,754.000	
	AUSTRALIAN 5.5 04/21/23	3,000,000.000	3,498,390.000	
	AUSTRALIAN 5.75 07/15/22	3,500,000.000	3,996,860.000	
	オーストラリア・ドル 小計		40,200,000.000 (3,024,246,000)	46,102,923.900 (3,468,322,965)
カナダ・ドル	CANADA 8.0 06/01/27	430,000.000	642,230.800	
	CANADA 0.75 03/01/21	2,300,000.000	2,272,377.000	
	CANADA 0.75 09/01/20	2,400,000.000	2,375,928.000	
	CANADA 0.75 09/01/21	600,000.000	591,378.000	
	CANADA 1.0 06/01/27	800,000.000	773,120.000	
	CANADA 1.0 09/01/22	800,000.000	790,064.000	
	CANADA 1.5 06/01/23	2,300,000.000	2,311,270.000	
	CANADA 1.5 06/01/26	1,700,000.000	1,707,973.000	
	CANADA 1.75 03/01/23	1,160,000.000	1,175,706.400	
	CANADA 2.0 06/01/28	1,020,000.000	1,065,502.200	
	CANADA 2.0 09/01/23	740,000.000	759,232.600	
	CANADA 2.0 12/01/51	250,000.000	264,840.000	
	CANADA 2.25 03/01/24	530,000.000	549,435.100	
	CANADA 2.25 06/01/25	1,500,000.000	1,574,340.000	

	CANADA 2.25 06/01/29	610,000.000	652,992.800	
	CANADA 2.5 06/01/24	1,600,000.000	1,687,456.000	
	CANADA 2.75 06/01/22	3,230,000.000	3,358,198.700	
	CANADA 2.75 12/01/48	1,450,000.000	1,777,120.000	
	CANADA 2.75 12/01/64	590,000.000	779,926.900	
	CANADA 3.25 06/01/21	4,700,000.000	4,868,307.000	
	CANADA 3.5 06/01/20	2,800,000.000	2,851,576.000	
	CANADA 3.5 12/01/45	1,720,000.000	2,331,305.200	
	CANADA 4.0 06/01/41	1,400,000.000	1,967,616.000	
	CANADA 5.0 06/01/37	1,180,000.000	1,779,133.200	
	CANADA 5.75 06/01/29	1,600,000.000	2,225,024.000	
	CANADA 5.75 06/01/33	1,260,000.000	1,911,785.400	
カナダ・ドル 小計		38,670,000.000 (3,100,947,300)	43,043,838.300 (3,451,685,393)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE 1.25 10/01/21	1,000,000.000	985,000.000	
	SINGAPORE 2.125 06/01/26	210,000.000	212,100.000	
	SINGAPORE 2.25 08/01/36	200,000.000	196,014.000	
	SINGAPORE 2.375 06/01/25	500,000.000	512,750.000	
	SINGAPORE 2.75 03/01/46	660,000.000	682,539.000	
	SINGAPORE 2.75 04/01/42	550,000.000	574,750.000	
	SINGAPORE 2.875 07/01/29	400,000.000	427,600.000	
	SINGAPORE 2.875 09/01/30	460,000.000	491,372.000	
	SINGAPORE 3.0 09/01/24	810,000.000	853,335.000	
	SINGAPORE 3.125 09/01/22	1,600,000.000	1,660,800.000	
	SINGAPORE 3.375 09/01/33	480,000.000	541,584.000	
	SINGAPORE 3.5 03/01/27	900,000.000	996,300.000	
	シンガポール・ドル 小計		7,770,000.000 (612,897,600)	8,134,144.000 (641,621,279)
スウェーデン・クローナ	SWEDEN 0.75 05/12/28	4,970,000.000	5,320,683.200	
	SWEDEN 0.75 11/12/29	2,170,000.000	2,315,889.100	
	SWEDEN 1.0 11/12/26	7,000,000.000	7,598,360.000	
	SWEDEN 2.5 05/12/25	7,300,000.000	8,523,334.000	
	SWEDEN 3.5 03/30/39	4,600,000.000	7,095,684.000	
スウェーデン・クローナ 小計		26,040,000.000 (297,376,800)	30,853,950.300 (352,352,112)	
デンマーク・クローネ	DENMARK 0.5 11/15/27	7,130,000.000	7,614,198.300	
	DENMARK 1.5 11/15/23	5,500,000.000	6,014,525.000	
	DENMARK 1.75 11/15/25	9,470,000.000	10,834,911.100	
	DENMARK 3.0 11/15/21	8,870,000.000	9,674,952.500	
	DENMARK 4.5 11/15/39	12,750,000.000	23,643,217.500	
デンマーク・クローネ 小計		43,720,000.000 (709,138,400)	57,781,804.400 (937,220,867)	
ノルウェー・クローネ	NORWAY 1.5 02/19/26	6,000,000.000	6,050,220.000	

	NORWAY 1.75 02/17/27	3,970,000.000	4,063,096.500	
	NORWAY 1.75 03/13/25	3,800,000.000	3,890,136.000	
	NORWAY 2.0 04/26/28	2,070,000.000	2,154,207.600	
	NORWAY 2.0 05/24/23	7,600,000.000	7,806,416.000	
	NORWAY 3.0 03/14/24	6,200,000.000	6,685,832.000	
ノルウェー・クローネ 小計		29,640,000.000 (367,239,600)	30,649,908.100 (379,752,361)	
ポーランド・ズロチ	POLAND 1.75 07/25/21	2,200,000.000	2,206,072.000	
	POLAND 2.0 04/25/21	1,130,000.000	1,139,153.000	
	POLAND 2.25 04/25/22	4,000,000.000	4,053,840.000	
	POLAND 2.5 01/25/23	1,350,000.000	1,375,920.000	
	POLAND 2.5 04/25/24	1,050,000.000	1,069,750.500	
	POLAND 2.5 07/25/26	4,200,000.000	4,205,796.000	
	POLAND 2.5 07/25/27	3,000,000.000	2,997,300.000	
	POLAND 2.75 04/25/28	1,900,000.000	1,926,885.000	
	POLAND 3.25 07/25/25	3,300,000.000	3,483,315.000	
	POLAND 4.0 10/25/23	3,100,000.000	3,357,641.000	
	POLAND 5.25 10/25/20	2,970,000.000	3,123,875.700	
	POLAND 5.75 04/25/29	1,440,000.000	1,841,990.400	
	POLAND 5.75 09/23/22	3,200,000.000	3,595,040.000	
	POLAND 5.75 10/25/21	3,680,000.000	4,034,494.400	
ポーランド・ズロチ 小計		36,520,000.000 (1,032,785,600)	38,411,073.000 (1,086,265,144)	
マレーシア・リングgit	MALAYSIA 3.418 08/15/22	3,000,000.000	2,993,010.000	
	MALAYSIA 3.48 03/15/23	1,220,000.000	1,217,743.000	
	MALAYSIA 3.502 05/31/27	2,570,000.000	2,516,801.000	
	MALAYSIA 3.733 06/15/28	2,000,000.000	1,984,520.000	
	MALAYSIA 3.844 04/15/33	1,210,000.000	1,178,370.600	
	MALAYSIA 3.892 03/15/27	800,000.000	805,088.000	
	MALAYSIA 4.127 04/15/32	1,850,000.000	1,864,282.000	
	MALAYSIA 4.16 07/15/21	4,000,000.000	4,065,960.000	
	MALAYSIA 4.181 07/15/24	2,430,000.000	2,492,378.100	
	MALAYSIA 4.392 04/15/26	3,070,000.000	3,181,410.300	
	MALAYSIA 4.498 04/15/30	1,800,000.000	1,889,460.000	
	MALAYSIA 4.935 09/30/43	2,000,000.000	2,124,500.000	
	MALAYSIA 5.248 09/15/28	1,600,000.000	1,771,312.000	
	マレーシア・リングgit 小計		27,550,000.000 (712,718,500)	28,084,835.000 (726,554,681)
メキシコ・ペソ	MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	13,000,000.000	15,024,100.000	
	MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	35,000,000.000	38,350,550.000	
	MEXICAN BONDS 5.75 03/05/26	14,859,000.000	13,192,414.560	
	MEXICAN BONDS 6.5 06/09/22	26,000,000.000	25,071,280.000	
	MEXICAN BONDS 6.5 06/10/21	38,000,000.000	37,020,360.000	

	MEXICAN BONDS 7.25 12/09/21	10,880,000.000	10,724,198.400	
	MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	10,000,000.000	9,721,100.000	
	MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	10,000,000.000	9,720,700.000	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	22,000,000.000	20,527,320.000	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	7,000,000.000	6,701,730.000	
	MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47	5,000,000.000	4,763,150.000	
	MEXICAN BONDS 8.0 12/07/23	14,000,000.000	14,099,400.000	
	MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	31,000,000.000	31,970,920.000	
	MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	15,000,000.000	15,190,650.000	
	メキシコ・ペソ 小計	251,739,000.000 (1,389,599,280)	252,077,872.960 (1,391,469,859)	
ユーロ	AUSTRIA 0.5 02/20/29	340,000.000	352,525.600	
	AUSTRIA 0.5 04/20/27	520,000.000	544,284.000	
	AUSTRIA 0.75 02/20/28	450,000.000	479,187.000	
	AUSTRIA 0.75 10/20/26	1,300,000.000	1,386,138.000	
	AUSTRIA 07/15/23	350,000.000	356,877.500	
	AUSTRIA 09/20/22	470,000.000	478,460.000	
	AUSTRIA 1.2 10/20/25	1,000,000.000	1,094,560.000	
	AUSTRIA 1.5 02/20/47	300,000.000	344,874.000	
	AUSTRIA 1.5 11/02/86	290,000.000	322,581.500	
	AUSTRIA 1.65 10/21/24	1,250,000.000	1,386,387.500	
	AUSTRIA 1.75 10/20/23	1,400,000.000	1,537,480.000	
	AUSTRIA 2.1 09/20/17	220,000.000	312,921.400	
	AUSTRIA 2.4 05/23/34	780,000.000	994,383.000	
	AUSTRIA 3.15 06/20/44	720,000.000	1,105,668.000	
	AUSTRIA 3.4 11/22/22	740,000.000	842,290.200	
	AUSTRIA 3.5 09/15/21	1,900,000.000	2,079,360.000	
	AUSTRIA 3.65 04/20/22	1,200,000.000	1,346,820.000	
	AUSTRIA 3.8 01/26/62	690,000.000	1,348,770.600	
	AUSTRIA 4.15 03/15/37	1,310,000.000	2,099,668.000	
	AUSTRIA 4.85 03/15/26	790,000.000	1,065,164.900	
	AUSTRIA 6.25 07/15/27	1,150,000.000	1,745,366.500	
	BELGIUM 0.2 10/22/23	660,000.000	677,292.000	
	BELGIUM 0.5 10/22/24	1,070,000.000	1,114,993.500	
	BELGIUM 0.8 06/22/25	1,570,000.000	1,666,178.200	
	BELGIUM 0.8 06/22/27	1,100,000.000	1,166,275.000	
	BELGIUM 0.8 06/22/28	1,560,000.000	1,647,937.200	
	BELGIUM 0.9 06/22/29	500,000.000	530,125.000	
	BELGIUM 1.0 06/22/26	1,500,000.000	1,614,255.000	
	BELGIUM 1.0 06/22/31	1,140,000.000	1,209,973.200	

BELGIUM 1.25 04/22/33	510,000.000	552,534.000	
BELGIUM 1.45 06/22/37	440,000.000	478,473.600	
BELGIUM 1.6 06/22/47	1,000,000.000	1,083,560.000	
BELGIUM 1.7 06/22/50	210,000.000	229,137.300	
BELGIUM 1.9 06/22/38	590,000.000	686,394.200	
BELGIUM 2.15 06/22/66	610,000.000	714,676.000	
BELGIUM 2.25 06/22/23	1,230,000.000	1,368,153.600	
BELGIUM 2.25 06/22/57	380,000.000	462,406.800	
BELGIUM 2.6 06/22/24	1,510,000.000	1,735,971.500	
BELGIUM 3.0 06/22/34	720,000.000	957,412.800	
BELGIUM 3.75 06/22/45	940,000.000	1,486,892.000	
BELGIUM 3.75 09/28/20	2,200,000.000	2,326,082.000	
BELGIUM 4.0 03/28/22	1,500,000.000	1,695,180.000	
BELGIUM 4.0 03/28/32	920,000.000	1,318,774.000	
BELGIUM 4.25 03/28/41	1,560,000.000	2,530,288.800	
BELGIUM 4.25 09/28/21	1,870,000.000	2,082,058.000	
BELGIUM 4.25 09/28/22	1,190,000.000	1,381,637.600	
BELGIUM 4.5 03/28/26	790,000.000	1,040,390.500	
BELGIUM 5.0 03/28/35	1,830,000.000	2,989,579.500	
BELGIUM 5.5 03/28/28	2,010,000.000	2,956,549.200	
BUNDESABL 0.25 10/16/20	1,500,000.000	1,518,855.000	
BUNDESABL 04/05/24	630,000.000	647,980.200	
BUNDESABL 04/08/22	2,010,000.000	2,049,999.000	
BUNDESABL 04/09/21	2,200,000.000	2,227,852.000	
BUNDESABL 04/14/23	1,130,000.000	1,159,120.100	
BUNDESABL 10/07/22	2,090,000.000	2,138,320.800	
BUNDESABL 10/13/23	1,280,000.000	1,315,520.000	
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27	2,680,000.000	2,814,482.400	
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/29	750,000.000	783,082.500	
DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28	1,780,000.000	1,863,446.400	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25	2,200,000.000	2,333,276.000	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26	2,480,000.000	2,644,597.600	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28	2,210,000.000	2,367,683.500	
DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27	2,060,000.000	2,205,765.600	
DEUTSCHLAND 08/15/26	2,370,000.000	2,444,631.300	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/24	1,340,000.000	1,451,273.600	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25	1,880,000.000	2,059,258.000	
DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48	1,300,000.000	1,591,785.000	

DEUTSCHLAND 1.5 02/15/23	2,100,000.000	2,271,192.000	
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/23	1,650,000.000	1,792,675.500	
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/24	2,000,000.000	2,209,820.000	
DEUTSCHLAND 1.5 09/04/22	1,650,000.000	1,768,882.500	
DEUTSCHLAND 1.75 02/15/24	1,500,000.000	1,669,950.000	
DEUTSCHLAND 1.75 07/04/22	2,700,000.000	2,904,876.000	
DEUTSCHLAND 2.0 01/04/22	2,700,000.000	2,889,810.000	
DEUTSCHLAND 2.0 08/15/23	1,500,000.000	1,669,095.000	
DEUTSCHLAND 2.25 09/04/20	4,200,000.000	4,353,468.000	
DEUTSCHLAND 2.25 09/04/21	1,070,000.000	1,141,476.000	
DEUTSCHLAND 2.5 01/04/21	2,200,000.000	2,313,894.000	
DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	2,510,000.000	3,796,500.500	
DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	2,600,000.000	4,009,330.000	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/21	3,150,000.000	3,410,190.000	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	1,500,000.000	2,487,030.000	
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	2,100,000.000	3,505,761.000	
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	1,390,000.000	2,487,835.900	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	1,120,000.000	1,642,009.600	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	1,900,000.000	3,247,195.000	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	1,430,000.000	2,755,938.900	
DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	1,500,000.000	2,492,010.000	
DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	1,600,000.000	2,434,768.000	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/24	1,700,000.000	2,243,830.000	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	1,100,000.000	1,863,290.000	
DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	1,120,000.000	1,753,875.200	

FINLAND 0.375 09/15/20	500,000.000	506,180.000	
FINLAND 0.5 04/15/26	600,000.000	629,142.000	
FINLAND 0.5 09/15/27	300,000.000	313,812.000	
FINLAND 0.5 09/15/28	450,000.000	469,120.500	
FINLAND 0.5 09/15/29	270,000.000	280,346.400	
FINLAND 0.75 04/15/31	450,000.000	476,005.500	
FINLAND 0.875 09/15/25	300,000.000	321,777.000	
FINLAND 04/15/22	320,000.000	325,145.600	
FINLAND 09/15/23	230,000.000	234,471.200	
FINLAND 1.125 04/15/34	420,000.000	462,415.800	
FINLAND 1.375 04/15/47	40,000.000	46,570.800	
FINLAND 1.5 04/15/23	950,000.000	1,024,195.000	
FINLAND 1.625 09/15/22	400,000.000	428,620.000	
FINLAND 2.0 04/15/24	680,000.000	760,852.000	
FINLAND 2.625 07/04/42	500,000.000	719,665.000	
FINLAND 2.75 07/04/28	630,000.000	787,733.100	
FINLAND 3.5 04/15/21	700,000.000	753,830.000	
FINLAND 4.0 07/04/25	800,000.000	1,012,728.000	
FRANCE BTAN 8.5 04/25/23	1,700,000.000	2,303,772.000	
FRANCE OAT 0.25 11/25/20	1,100,000.000	1,114,190.000	
FRANCE OAT 0.25 11/25/26	3,000,000.000	3,077,880.000	
FRANCE OAT 0.5 05/25/25	3,700,000.000	3,871,865.000	
FRANCE OAT 0.5 05/25/26	2,920,000.000	3,053,794.400	
FRANCE OAT 0.5 05/25/29	1,490,000.000	1,532,539.500	
FRANCE OAT 0.75 05/25/28	2,610,000.000	2,764,851.300	
FRANCE OAT 0.75 11/25/28	2,940,000.000	3,106,257.000	
FRANCE OAT 02/25/21	1,370,000.000	1,384,604.200	
FRANCE OAT 03/25/23	1,900,000.000	1,937,506.000	
FRANCE OAT 03/25/24	1,390,000.000	1,416,229.300	
FRANCE OAT 05/25/21	2,510,000.000	2,540,873.000	
FRANCE OAT 05/25/22	3,000,000.000	3,052,560.000	
FRANCE OAT 1.0 05/25/27	3,350,000.000	3,626,844.000	
FRANCE OAT 1.0 11/25/25	3,000,000.000	3,239,460.000	
FRANCE OAT 1.25 05/25/34	1,740,000.000	1,896,339.000	
FRANCE OAT 1.25 05/25/36	2,840,000.000	3,058,112.000	
FRANCE OAT 1.5 05/25/31	4,560,000.000	5,152,845.600	
FRANCE OAT 1.5 05/25/50	730,000.000	775,712.600	
FRANCE OAT 1.75 05/25/23	3,670,000.000	4,001,804.700	
FRANCE OAT 1.75 05/25/66	1,050,000.000	1,158,580.500	

FRANCE OAT 1.75 06/25/39	1,440,000.000	1,669,248.000	
FRANCE OAT 1.75 11/25/24	3,630,000.000	4,049,991.000	
FRANCE OAT 2.0 05/25/48	2,500,000.000	2,995,175.000	
FRANCE OAT 2.25 05/25/24	4,000,000.000	4,532,400.000	
FRANCE OAT 2.25 10/25/22	3,400,000.000	3,727,352.000	
FRANCE OAT 2.5 05/25/30	3,490,000.000	4,323,481.800	
FRANCE OAT 2.5 10/25/20	6,330,000.000	6,605,608.200	
FRANCE OAT 2.75 10/25/27	3,580,000.000	4,414,140.000	
FRANCE OAT 3.0 04/25/22	4,790,000.000	5,293,285.300	
FRANCE OAT 3.25 05/25/45	2,470,000.000	3,683,708.600	
FRANCE OAT 3.25 10/25/21	4,190,000.000	4,582,225.900	
FRANCE OAT 3.5 04/25/26	3,360,000.000	4,224,528.000	
FRANCE OAT 3.75 04/25/21	4,640,000.000	5,027,254.400	
FRANCE OAT 4.0 04/25/55	1,440,000.000	2,546,496.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/60	1,240,000.000	2,265,876.800	
FRANCE OAT 4.0 10/25/38	2,430,000.000	3,827,687.400	
FRANCE OAT 4.25 10/25/23	4,510,000.000	5,459,896.200	
FRANCE OAT 4.5 04/25/41	3,370,000.000	5,771,731.600	
FRANCE OAT 4.75 04/25/35	2,500,000.000	4,068,100.000	
FRANCE OAT 5.5 04/25/29	3,650,000.000	5,570,593.500	
FRANCE OAT 5.75 10/25/32	2,890,000.000	4,887,279.000	
FRANCE OAT 6.0 10/25/25	2,900,000.000	4,064,466.000	
IRISH 0.8 03/15/22	370,000.000	382,872.300	
IRISH 0.9 05/15/28	580,000.000	611,279.400	
IRISH 1.0 05/15/26	840,000.000	896,271.600	
IRISH 1.1 05/15/29	340,000.000	362,239.400	
IRISH 1.3 05/15/33	450,000.000	478,264.500	
IRISH 1.35 03/18/31	210,000.000	227,514.000	
IRISH 1.5 05/15/50	270,000.000	274,371.300	
IRISH 1.7 05/15/37	570,000.000	630,876.000	
IRISH 10/18/22	220,000.000	222,939.200	
IRISH 2.0 02/18/45	870,000.000	1,014,254.700	
IRISH 2.4 05/15/30	1,100,000.000	1,318,988.000	
IRISH 3.4 03/18/24	930,000.000	1,093,763.700	
IRISH 3.9 03/20/23	700,000.000	814,191.000	
IRISH 5.0 10/18/20	850,000.000	914,889.000	
IRISH 5.4 03/13/25	1,260,000.000	1,660,566.600	

ITALY BTPS 0.35 11/01/21	1,700,000.000	1,677,917.000	
ITALY BTPS 0.45 06/01/21	910,000.000	905,058.700	
ITALY BTPS 0.65 10/15/23	2,100,000.000	2,017,932.000	
ITALY BTPS 0.65 11/01/20	3,600,000.000	3,610,440.000	
ITALY BTPS 0.9 08/01/22	980,000.000	966,877.800	
ITALY BTPS 0.95 03/01/23	2,420,000.000	2,371,527.400	
ITALY BTPS 0.95 03/15/23	2,040,000.000	1,999,404.000	
ITALY BTPS 1.2 04/01/22	770,000.000	770,308.000	
ITALY BTPS 1.25 12/01/26	2,000,000.000	1,881,600.000	
ITALY BTPS 1.35 04/15/22	2,500,000.000	2,508,975.000	
ITALY BTPS 1.45 05/15/25	1,540,000.000	1,492,398.600	
ITALY BTPS 1.45 09/15/22	1,500,000.000	1,505,415.000	
ITALY BTPS 1.45 11/15/24	2,020,000.000	1,970,732.200	
ITALY BTPS 1.5 06/01/25	2,500,000.000	2,426,925.000	
ITALY BTPS 1.6 06/01/26	1,500,000.000	1,449,900.000	
ITALY BTPS 1.65 03/01/32	2,260,000.000	2,004,077.600	
ITALY BTPS 1.85 05/15/24	2,100,000.000	2,104,200.000	
ITALY BTPS 2.0 02/01/28	2,090,000.000	2,037,415.600	
ITALY BTPS 2.0 12/01/25	2,010,000.000	1,998,502.800	
ITALY BTPS 2.05 08/01/27	1,870,000.000	1,833,385.400	
ITALY BTPS 2.15 12/15/21	2,200,000.000	2,260,500.000	
ITALY BTPS 2.2 06/01/27	2,040,000.000	2,028,168.000	
ITALY BTPS 2.25 09/01/36	1,500,000.000	1,364,250.000	
ITALY BTPS 2.45 09/01/33	1,100,000.000	1,049,664.000	
ITALY BTPS 2.5 11/15/25	550,000.000	562,237.500	
ITALY BTPS 2.5 12/01/24	970,000.000	997,829.300	
ITALY BTPS 2.7 03/01/47	1,650,000.000	1,492,095.000	
ITALY BTPS 2.8 03/01/67	660,000.000	567,666.000	
ITALY BTPS 2.8 12/01/28	1,400,000.000	1,436,176.000	
ITALY BTPS 2.95 09/01/38	1,270,000.000	1,229,956.900	
ITALY BTPS 3.0 08/01/29	570,000.000	589,152.000	

ITALY BTPS 3.25 09/01/46	1,250,000.000	1,244,725.000	
ITALY BTPS 3.35 03/01/35	1,100,000.000	1,147,102.000	
ITALY BTPS 3.45 03/01/48	1,430,000.000	1,457,284.400	
ITALY BTPS 3.5 03/01/30	2,570,000.000	2,760,205.700	
ITALY BTPS 3.75 03/01/21	3,300,000.000	3,478,266.000	
ITALY BTPS 3.75 05/01/21	2,300,000.000	2,430,801.000	
ITALY BTPS 3.75 08/01/21	3,200,000.000	3,396,800.000	
ITALY BTPS 3.75 09/01/24	1,900,000.000	2,070,544.000	
ITALY BTPS 3.85 09/01/49	890,000.000	951,160.800	
ITALY BTPS 4.0 02/01/37	2,830,000.000	3,180,071.000	
ITALY BTPS 4.0 09/01/20	3,700,000.000	3,868,128.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/24	2,390,000.000	2,681,078.100	
ITALY BTPS 4.5 03/01/26	2,110,000.000	2,419,959.000	
ITALY BTPS 4.5 05/01/23	1,400,000.000	1,555,792.000	
ITALY BTPS 4.75 08/01/23	1,900,000.000	2,139,780.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/21	2,470,000.000	2,677,974.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/28	2,400,000.000	2,867,232.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/44	1,700,000.000	2,085,883.000	
ITALY BTPS 5.0 03/01/22	2,590,000.000	2,856,252.000	
ITALY BTPS 5.0 03/01/25	2,400,000.000	2,784,216.000	
ITALY BTPS 5.0 08/01/34	2,250,000.000	2,796,525.000	
ITALY BTPS 5.0 08/01/39	1,820,000.000	2,285,010.000	
ITALY BTPS 5.0 09/01/40	2,250,000.000	2,813,850.000	
ITALY BTPS 5.25 11/01/29	2,900,000.000	3,578,890.000	
ITALY BTPS 5.5 09/01/22	2,480,000.000	2,803,466.400	
ITALY BTPS 5.5 11/01/22	2,500,000.000	2,836,050.000	
ITALY BTPS 5.75 02/01/33	1,970,000.000	2,589,565.000	
ITALY BTPS 6.0 05/01/31	2,710,000.000	3,583,975.000	
ITALY BTPS 6.5 11/01/27	2,330,000.000	3,056,028.000	
ITALY BTPS 7.25 11/01/26	1,080,000.000	1,444,716.000	
ITALY BTPS 9.0 11/01/23	1,510,000.000	1,978,402.000	
NETHERLANDS 0.25 07/15/25	1,020,000.000	1,060,137.000	
NETHERLANDS 0.25 07/15/29	400,000.000	410,600.000	

NETHERLANDS 0.5 01/15/40	430,000.000	435,310.500	
NETHERLANDS 0.5 07/15/26	1,410,000.000	1,490,652.000	
NETHERLANDS 0.75 07/15/27	1,450,000.000	1,561,592.000	
NETHERLANDS 0.75 07/15/28	1,260,000.000	1,359,086.400	
NETHERLANDS 01/15/22	1,750,000.000	1,779,260.000	
NETHERLANDS 01/15/24	1,680,000.000	1,718,606.400	
NETHERLANDS 1.75 07/15/23	1,670,000.000	1,829,952.600	
NETHERLANDS 2.0 07/15/24	1,560,000.000	1,759,258.800	
NETHERLANDS 2.25 07/15/22	1,550,000.000	1,690,926.000	
NETHERLANDS 2.5 01/15/33	1,300,000.000	1,710,007.000	
NETHERLANDS 2.75 01/15/47	1,320,000.000	2,095,104.000	
NETHERLANDS 3.25 07/15/21	1,860,000.000	2,015,179.800	
NETHERLANDS 3.75 01/15/23	590,000.000	685,049.000	
NETHERLANDS 3.75 01/15/42	1,520,000.000	2,626,012.800	
NETHERLANDS 4.0 01/15/37	1,480,000.000	2,425,720.000	
NETHERLANDS 5.5 01/15/28	1,350,000.000	2,015,685.000	
SPAIN 0.05 01/31/21	400,000.000	402,712.000	
SPAIN 0.35 07/30/23	1,460,000.000	1,489,667.200	
SPAIN 0.4 04/30/22	2,200,000.000	2,243,362.000	
SPAIN 0.45 10/31/22	1,340,000.000	1,372,548.600	
SPAIN 0.75 07/30/21	1,700,000.000	1,741,242.000	
SPAIN 1.3 10/31/26	2,120,000.000	2,269,417.600	
SPAIN 1.4 04/30/28	2,230,000.000	2,396,491.800	
SPAIN 1.4 07/30/28	1,950,000.000	2,087,592.000	
SPAIN 1.45 04/30/29	1,130,000.000	1,209,563.300	
SPAIN 1.45 10/31/27	2,200,000.000	2,375,054.000	
SPAIN 1.5 04/30/27	1,650,000.000	1,786,950.000	
SPAIN 1.6 04/30/25	2,160,000.000	2,351,440.800	
SPAIN 1.95 04/30/26	1,790,000.000	1,996,315.400	
SPAIN 1.95 07/30/30	2,240,000.000	2,506,403.200	
SPAIN 2.15 10/31/25	2,100,000.000	2,364,054.000	
SPAIN 2.35 07/30/33	1,620,000.000	1,873,368.000	
SPAIN 2.7 10/31/48	950,000.000	1,128,267.500	
SPAIN 2.75 10/31/24	2,390,000.000	2,742,716.200	
SPAIN 2.9 10/31/46	1,590,000.000	1,966,432.500	
SPAIN 3.45 07/30/66	1,000,000.000	1,358,150.000	

	SPAIN 3.8 04/30/24	1,720,000.000	2,045,045.600	
	SPAIN 4.2 01/31/37	1,960,000.000	2,847,840.800	
	SPAIN 4.4 10/31/23	2,300,000.000	2,758,275.000	
	SPAIN 4.65 07/30/25	2,360,000.000	3,014,876.400	
	SPAIN 4.7 07/30/41	2,000,000.000	3,166,420.000	
	SPAIN 4.8 01/31/24	1,130,000.000	1,387,504.400	
	SPAIN 4.85 10/31/20	2,900,000.000	3,114,310.000	
	SPAIN 4.9 07/30/40	1,840,000.000	2,956,880.000	
	SPAIN 5.15 10/31/28	1,900,000.000	2,678,240.000	
	SPAIN 5.15 10/31/44	1,330,000.000	2,269,950.900	
	SPAIN 5.4 01/31/23	2,470,000.000	2,980,474.900	
	SPAIN 5.5 04/30/21	3,600,000.000	4,003,020.000	
	SPAIN 5.75 07/30/32	2,190,000.000	3,482,866.500	
	SPAIN 5.85 01/31/22	2,300,000.000	2,679,224.000	
	SPAIN 5.9 07/30/26	2,040,000.000	2,848,778.400	
	SPAIN 6.0 01/31/29	2,410,000.000	3,626,182.400	
	ユーロ 小計	481,800,000.000 (58,345,980,000)	564,891,810.600 (68,408,398,264)	
南アフリカ・ランド	SOUTH AFRICA 10.5 12/21/26	25,000,000.000	27,780,750.000	
	SOUTH AFRICA 6.25 03/31/36	7,460,000.000	5,397,832.200	
	SOUTH AFRICA 6.5 02/28/41	11,760,000.000	8,295,739.200	
	SOUTH AFRICA 7.0 02/28/31	11,600,000.000	9,750,960.000	
	SOUTH AFRICA 7.75 02/28/23	3,600,000.000	3,617,748.000	
	SOUTH AFRICA 8.0 01/31/30	13,110,000.000	12,143,399.700	
	SOUTH AFRICA 8.25 03/31/32	10,000,000.000	9,189,700.000	
	SOUTH AFRICA 8.5 01/31/37	10,910,000.000	9,826,746.100	
	SOUTH AFRICA 8.75 01/31/44	10,000,000.000	9,021,800.000	
	SOUTH AFRICA 8.75 02/28/48	20,280,000.000	18,254,636.400	
	SOUTH AFRICA 8.875 02/28/35	12,510,000.000	11,756,772.900	
	SOUTH AFRICA 9.0 01/31/40	8,000,000.000	7,427,680.000	
	南アフリカ・ランド 小計	144,230,000.000 (1,073,071,200)	132,463,764.500 (985,530,408)	
国債証券 合計		162,153,354,280 (162,153,354,280)	178,510,535,848 (178,510,535,848)	
合計		162,153,354,280 (162,153,354,280)	178,510,535,848 (178,510,535,848)	

- (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 158銘柄	46.43%	47.74%
イギリス・ポンド	国債証券 39銘柄	6.24%	6.42%
オーストラリア・ドル	国債証券 19銘柄	1.89%	1.94%
カナダ・ドル	国債証券 26銘柄	1.88%	1.93%
シンガポール・ドル	国債証券 12銘柄	0.35%	0.36%
スウェーデン・クローナ	国債証券 5銘柄	0.19%	0.20%
デンマーク・クローネ	国債証券 5銘柄	0.51%	0.53%
ノルウェー・クローネ	国債証券 6銘柄	0.21%	0.21%
ポーランド・ズロチ	国債証券 14銘柄	0.59%	0.61%
マレーシア・リングgit	国債証券 13銘柄	0.40%	0.41%
メキシコ・ペソ	国債証券 14銘柄	0.76%	0.78%
ユーロ	国債証券 284銘柄	37.27%	38.32%
南アフリカ・ランド	国債証券 12銘柄	0.54%	0.55%

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

「外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位:円)

科 目	注記 番号	平成30年12月3日現在	令和1年6月3日現在
資産の部			
流動資産			
預金		71,268,926	1,032,206,096
コール・ローン		89,609,455	125,737,123
投資信託受益証券		4,011,072,459	4,936,031,209
投資証券		35,311,970,055	41,108,599,834
派生商品評価勘定		10,897	19,559
未収入金		140,787,439	1,157,467,320
未収配当金		85,578,261	71,695,736
流動資産合計		39,710,297,492	48,431,756,877
資産合計		39,710,297,492	48,431,756,877
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		472	377,410
未払金		6,011,152	1,024,855,084
未払解約金		66,931,000	276,000
流動負債合計		72,942,624	1,025,508,494
負債合計		72,942,624	1,025,508,494
純資産の部			
元本等			
元本	1	31,610,800,394	37,271,300,890
剰余金			
剰余金又は欠損金()		8,026,554,474	10,134,947,493
元本等合計		39,637,354,868	47,406,248,383
純資産合計		39,637,354,868	47,406,248,383
負債純資産合計		39,710,297,492	48,431,756,877

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	平成30年12月3日現在	令和1年6月3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	41,590,703,974円	31,610,800,394円
同期中追加設定元本額	23,611,260,458円	27,628,489,663円
同期中一部解約元本額	33,591,164,038円	21,967,989,167円
元本の内訳		
ファンド名		
DIAM先進国REITインデックスファンド<為替ヘッジなし>（ファンドラップ）	246,160,223円	160,562,074円
DIAM先進国REITインデックスファンド<為替ヘッジあり>（ファンドラップ）	86,362,915円	90,682,827円
MITO ラップ型ファンド（安定型）	4,172,228円	5,820,644円
MITO ラップ型ファンド（中立型）	16,225,550円	14,791,750円
MITO ラップ型ファンド（積極型）	32,145,399円	23,783,857円

グローバル8資産ラップファンド(安定型)	29,811,430円	53,567,046円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	43,636,068円	37,551,964円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	39,542,249円	28,280,765円
たわらノーロード 先進国リート	2,977,513,729円	3,820,877,936円
たわらノーロード 先進国リート<ラップ向け>	592,635,840円	591,751,168円
たわらノーロード 先進国リート<為替ヘッジあり>	141,856,723円	141,255,195円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	163,064,954円	305,974,164円
たわらノーロード バランス(堅実型)	1,053,925円	2,032,089円
たわらノーロード バランス(標準型)	21,544,144円	40,667,640円
たわらノーロード バランス(積極型)	61,969,670円	91,872,184円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定型)	6,528,522円	15,966,782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)	46,631,281円	82,889,705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)	40,578,475円	71,864,586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)	116,103,860円	193,121,222円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	121,341円	671,000円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	1,724,814円	1,975,681円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	1,247,116円	1,648,354円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	4,684,169円	4,773,676円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	22,970,248円	19,026,187円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	606,005,036円	520,077,807円
マネックス資産設計ファンドエボリューション	39,383,601円	53,216,299円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	172,886,995円	175,540,190円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	150,229,482円	158,001,161円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	297,341,673円	310,718,534円
投資のソムリエ	4,572,549,857円	7,555,788,879円
投資のソムリエ<DC年金>	406,193,584円	774,112,715円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	124,725,828円	135,569,125円

投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	139,056,927円	336,558,620円
ダイナミック・ナビゲーション	751,308円	748,494円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	2,505,682,512円	4,793,075,346円
ワールドアセットバランス(基本コース)	1,200,908,193円	951,671,015円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	2,914,300,230円	3,735,792,629円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	2,437,415円	3,016,837円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	1,844,573円	2,565,231円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	855,098円	2,500,713円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	3,861,903円	5,935,325円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	856,495,571円	732,328,596円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	12,333円	14,286,871円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	-円	612,994円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	-円	612,994円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	-円	612,994円
DIAMパッシブ資産分散ファンド	1,063,616,864円	857,628,570円
DIAM外国リートインデックスファンド<DC年金>	32,027,618円	38,830,914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)	539,659,063円	365,880,085円
DIAMグローバル 私募ファンド(適格機関投資家向け)	11,580,328円	12,032,969円
DIAM世界アセットバランスファンド2VA(適格機関投資家限定)	6,952,311,699円	3,840,446,754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)	244,659,017円	2,072,429,781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)	127,978,667円	-円
P-Oneマルチアセット戦略ファンド(適格機関投資家限定)	3,386,407,330円	3,461,256,521円
DIAM海外リートインデックスファンド(適格機関投資家限定)	558,752,816円	558,043,431円
計	31,610,800,394円	37,271,300,890円

2 . 受益権の総数	31,610,800,394口	37,271,300,890口
------------	-----------------	-----------------

（金融商品に関する注記）

1．金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成30年6月5日 至 平成30年12月3日	自 平成30年12月4日 至 令和1年6月3日
1． 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2． 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
3． 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成30年12月3日現在	令和1年6月3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	47,655,612	359,068,187
投資証券	155,933,997	1,594,480,969
合計	108,278,385	1,953,549,156

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成30年6月23日から平成30年12月3日まで及び平成30年6月23日から令和1年6月3日まで）に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	平成30年12月3日 現在				令和1年6月3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	159,717,985	-	159,707,560	10,425	1,293,187,209	-	1,293,189,700	2,491
アメリカ・ドル	130,671,740	-	130,663,000	8,740	953,289,040	-	953,304,000	14,960
イギリス・ポンド	6,237,674	-	6,237,150	524	67,122,650	-	67,125,100	2,450
オーストラリア・ドル	2,505,660	-	2,505,600	60	90,261,600	-	90,264,000	2,400
カナダ・ドル	1,371,520	-	1,371,360	160	24,055,620	-	24,054,000	1,620
シンガポール・ドル	7,464,213	-	7,462,800	1,413	44,159,360	-	44,161,600	2,240
ユーロ	11,467,178	-	11,467,650	472	81,138,139	-	81,137,000	1,139
香港・ドル	-	-	-	-	33,160,800	-	33,144,000	16,800
買 建	-	-	-	-	68,037,560	-	67,682,200	355,360
オーストラリア・ドル	-	-	-	-	39,264,160	-	39,114,400	149,760
シンガポール・ドル	-	-	-	-	3,170,080	-	3,154,800	15,280
ニュージーランド・ドル	-	-	-	-	21,421,620	-	21,270,000	151,620
香港・ドル	-	-	-	-	4,181,700	-	4,143,000	38,700
合計	159,717,985	-	159,707,560	10,425	1,361,224,769	-	1,360,871,900	357,851

(注) 時価の算定方法

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

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

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

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

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成30年12月3日現在	令和1年6月3日現在
1口当たり純資産額	1.2539円	1.2719円
(1万口当たり純資産額)	(12,539円)	(12,719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

令和1年6月3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	120,666.000	462,150.780	
		APN INDUSTRIA REIT	38,914.000	109,348.340	
		ARENA REIT	106,906.000	293,991.500	
		BWP TRUST	180,465.000	649,674.000	
		CHARTER HALL EDUCATION TRUST	95,978.000	348,400.140	
		CHARTER HALL GROUP	168,979.000	1,747,242.860	
		CHARTER HALL LONG WALE REIT	77,550.000	380,770.500	
		CHARTER HALL RETAIL REIT	133,357.000	589,437.940	
		CROMWELL PROPERTY GROUP	608,982.000	703,374.210	
		DEXUS	393,283.000	5,065,485.040	
		GDI PROPERTY GROUP	160,100.000	212,132.500	
		GOODMAN GROUP	585,056.000	7,839,750.400	
		GPT GROUP	652,078.000	3,755,969.280	
		GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA	99,748.000	418,941.600	
		HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD	52,264.000	181,356.080	
		INGENIA COMMUNITIES GROUP	79,545.000	253,748.550	
		MIRVAC GROUP	1,354,924.000	4,105,419.720	
		NATIONAL STORAGE REIT	243,475.000	406,603.250	
		RURAL FUNDS GROUP	105,905.000	236,168.150	
		SCENTRE GROUP	1,938,354.000	7,365,745.200	
		SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	325,352.000	823,140.560	
		STOCKLAND	884,408.000	3,917,927.440	
		VICINITY CENTRES	1,168,675.000	3,015,181.500	
VIVA ENERGY REIT	156,535.000	405,425.650			
	オーストラリア・ドル 小計		9,731,499.000	43,287,385.190 (3,256,509,988)	
	カナダ・ドル	KILLAM APARTMENT REIT	16,959.000	321,712.230	
	カナダ・ドル 小計		16,959.000	321,712.230 (25,798,103)	
	シンガポール・ドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	217,695.000	302,596.050	
		ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	283,500.000	255,150.000	

	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	927,960.000	2,709,643.200	
	ASCOTT RESIDENCE TRUST	438,715.000	544,006.600	
	CACHE LOGISTICS TRUST	410,780.000	297,815.500	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	1,010,379.000	1,950,031.470	
	CAPITALAND MALL TRUST	1,020,060.000	2,458,344.600	
	CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST	233,380.000	350,070.000	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	257,600.000	414,736.000	
	ESR REIT	727,530.000	389,228.550	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	355,600.000	225,806.000	
	FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	198,500.000	198,500.000	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	200,100.000	484,242.000	
	FRASERS COMMERCIAL TRUST	256,780.000	385,170.000	
	FRASERS HOSPITALITY TRUST	273,000.000	193,830.000	
	FRASERS LOGISTICS & INDUSTRIAL TRUST	591,650.000	674,481.000	
	KEPPEL DC REIT	354,200.000	552,552.000	
	KEPPEL REIT	665,300.000	798,360.000	
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST	571,800.000	120,078.000	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	687,300.000	1,312,743.000	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	485,520.000	1,024,447.200	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	855,120.000	1,248,475.200	
	MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL TRUST	780,500.000	1,030,260.000	
	QUE HOSPITALITY TRUST	445,320.000	300,591.000	
	PARKWAY LIFE REIT	131,600.000	393,484.000	
	SABANA SHARIAH COMP IND REIT	218,600.000	91,812.000	
	SOILBUILD BUSINESS SPACE REIT	256,400.000	152,558.000	
	SPH REIT	224,900.000	233,896.000	
	STARHILL GLOBAL REIT	509,500.000	374,482.500	
	SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	822,890.000	1,497,659.800	
	シンガポール・ドル 小計	14,412,179.000	20,965,049.670 (1,653,723,118)	
	投資信託受益証券 合計	24,160,637	4,936,031,209 (4,936,031,209)	
投資証券	アメリカ・ドル	ACADIA REALTY TRUST	29,898.000	817,710.300

AGREE REALTY CORP	13,141.000	879,789.950	
ALEXANDER'S INC.	1,406.000	517,408.000	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	39,826.000	5,830,924.660	
AMERICAN ASSETS TRUST INC	14,036.000	637,094.040	
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	48,270.000	2,235,866.400	
AMERICAN FINANCE TRUST INC	20,602.000	215,496.920	
AMERICAN HOMES 4 RENT	90,713.000	2,214,304.330	
AMERICOLD REALTY TRUST	65,012.000	2,034,875.600	
APARTMENT INVT & MGMT CO-A	54,802.000	2,737,359.900	
APPLE HOSPITALITY REIT INC	75,452.000	1,164,978.880	
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	25,699.000	114,617.540	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	48,971.000	9,941,602.710	
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH REIT INC	6,509.000	74,462.960	
BOSTON PROPERTIES INC	54,605.000	7,143,972.150	
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	8,936.000	93,291.840	
BRANDYWINE REALTY TRUST	61,895.000	935,233.450	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	105,086.000	1,802,224.900	
BROOKFIELD PROPERTY REIT INC	34,260.000	631,754.400	
BRT APARTMENTS CORP	2,813.000	35,500.060	
CAMDEN PROPERTY TRUST	34,099.000	3,524,472.640	
CARETRUST REIT INC	34,676.000	842,973.560	
CBL & ASSOCIATES	47,062.000	38,308.460	
CEDAR REALTY TRUST INC	27,397.000	77,533.510	
CHATHAM LODGING TRUST	17,398.000	331,257.920	
CHESAPEAKE LODGING TRUST	22,511.000	647,641.470	
CITY OFFICE REIT INC	15,324.000	180,669.960	
CLIPPER REALTY INC	5,169.000	66,008.130	
COLONY CAPITAL INC	171,468.000	889,918.920	
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	40,874.000	873,886.120	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	6,760.000	264,518.800	
CORECIVIC INC	41,521.000	909,309.900	
CORESITE REALTY CORP	12,902.000	1,505,921.440	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	38,643.000	1,075,821.120	
COUSINS PROPERTIES INC	147,621.000	1,335,970.050	

CUBESMART	65,624.000	2,212,841.280	
CYRUSONE INC	38,140.000	2,251,785.600	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	73,922.000	732,567.020	
DIGITAL REALTY TRUST INC	73,466.000	8,648,417.520	
DOUGLAS EMMETT INC	56,973.000	2,295,442.170	
DUKE REALTY TRUST	126,797.000	3,815,321.730	
EAST GROUP	12,816.000	1,422,576.000	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	25,372.000	467,098.520	
EMPIRE STATE REALTY TRUST INC	51,396.000	789,442.560	
EPR PROPERTIES	26,376.000	2,059,965.600	
EQUITY COMMONWEALTH	42,702.000	1,390,804.140	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	31,737.000	3,861,123.420	
EQUITY RESIDENTIAL	130,793.000	10,014,820.010	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY TRUST INC	17,735.000	377,046.100	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	23,214.000	6,772,452.360	
EXTRA SPACE STORAGE INC	44,956.000	4,817,484.960	
FARMLAND PARTNERS INC	9,630.000	59,609.700	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	26,240.000	3,430,355.200	
FIRST INDUSTRIAL RT	44,501.000	1,544,629.710	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST INC	25,108.000	722,106.080	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	40,560.000	293,654.400	
FRONT YARD RESIDENTIAL CORP	18,755.000	214,557.200	
GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	71,145.000	2,809,516.050	
GEO GROUP INC	42,240.000	926,323.200	
GETTY REALTY CORP	12,616.000	390,591.360	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	11,234.000	236,700.380	
GLADSTONE LAND CORP	4,129.000	51,199.600	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	7,336.000	78,201.760	
GLOBAL NET LEASE INC	31,135.000	573,195.350	
HCP INC	168,764.000	5,351,506.440	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	44,016.000	1,419,075.840	
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA INC	72,282.000	2,080,998.780	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	13,759.000	234,590.950	

HIGHWOODS PROPERTIES INC	36,411.000	1,596,986.460	
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	57,784.000	1,437,088.080	
HOST HOTELS & RESORTS INC	261,506.000	4,735,873.660	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	54,303.000	1,814,263.230	
INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	33,291.000	365,535.180	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES TRUST	24,280.000	457,920.800	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES INC	3,694.000	310,406.820	
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	4,546.000	263,167.940	
INVITATION HOMES INC	119,364.000	3,059,299.320	
IRON MOUNTAIN INC	101,012.000	3,096,017.800	
JBG SMITH PROPERTIES	41,967.000	1,657,276.830	
KILROY REALTY CORP	35,592.000	2,623,486.320	
KIMCO REALTY	148,540.000	2,584,596.000	
KITE REALTY GROUP TRUST	31,031.000	471,671.200	
LEXINGTON REALTY TRUST	76,871.000	704,907.070	
LIBERTY PROPERTY TRUST	52,142.000	2,475,180.740	
LIFE STORAGE INC	16,395.000	1,578,510.600	
LTC PROPERTIES INC	14,610.000	653,797.500	
MACK CALI	33,171.000	753,645.120	
MANULIFE US REIT	495,300.000	423,481.500	
MEDICAL PROPERTIES TRUST	134,283.000	2,387,551.740	
MID AMERICA	40,216.000	4,591,862.880	
MONMOUTH RE INVEST CP -CL A	34,320.000	478,420.800	
NATIONAL HEALTH INVS INC	14,991.000	1,177,543.050	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	57,002.000	3,051,317.060	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUST	21,028.000	626,424.120	
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP INC	31,630.000	208,441.700	
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	8,002.000	320,720.160	
NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP	18,806.000	309,734.820	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST	17,851.000	426,817.410	
OMEGA HEALTHCARE INVS INC	74,635.000	2,658,498.700	

ONE LIBERTY PROPERTIES INC	4,255.000	121,437.700	
PARAMOUNT GROUP INC	70,246.000	1,001,005.500	
PARK HOTELS & RESORTS INC	70,840.000	1,956,600.800	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	45,820.000	1,275,170.600	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	17,505.000	112,207.050	
PHYSICIANS REALTY TRUST	63,958.000	1,171,070.980	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC	43,929.000	893,076.570	
PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES INC	16,360.000	256,852.000	
PROLOGIS INC	222,959.000	16,425,389.530	
PS BUSINESS PARKS	7,004.000	1,127,083.680	
PUBLIC STORAGE	53,069.000	12,624,053.720	
QTS REALTY TRUST INC	19,246.000	888,587.820	
REALTY INCOME CORP	107,370.000	7,524,489.600	
REGENCY CENTERS CORP	59,125.000	3,899,885.000	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	41,878.000	701,037.720	
RETAIL PROPERTIES OF AMERICA INC	74,671.000	887,838.190	
RETAIL VALUE INC	5,916.000	188,838.720	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	36,539.000	1,381,174.200	
RLJ LODGING TRUST	61,408.000	1,054,375.360	
RPT REALTY	29,871.000	363,530.070	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	18,038.000	1,442,138.100	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	62,571.000	1,206,994.590	
SAFEHOLD INC	2,744.000	74,883.760	
SAUL CENTERS INC	4,421.000	237,363.490	
SENIOR HOUSING PPTYS TRUST	87,422.000	688,885.360	
SERITAGE GROWTH PROPERTIES	10,320.000	431,582.400	
SIMON PROPERTY GROUP INC	109,287.000	17,714,329.830	
SITE CENTERS CORP	52,739.000	673,477.030	
SL GREEN	29,496.000	2,536,656.000	
SPIRIT MTA REIT	13,946.000	98,040.380	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	30,159.000	1,286,582.940	
STAG INDUSTRIAL INC	43,588.000	1,271,897.840	
STORE CAPITAL CORP	69,495.000	2,378,118.900	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	38,836.000	443,895.480	
SUN COMMUNITIES INC	30,488.000	3,849,719.760	

	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	80,002.000	1,073,626.840	
	TANGER FACTORY OUTLET	34,607.000	586,934.720	
	TAUBMAN CENTERS INC	21,393.000	948,993.480	
	TERRENO REALTY CORP	21,401.000	978,239.710	
	THE MACERICH COMPANY	37,186.000	1,350,967.380	
	TIER REIT INC	20,073.000	540,365.160	
	UDR INC	97,310.000	4,357,541.800	
	UMH PROPERTIES INC	13,433.000	178,793.230	
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	4,708.000	385,914.760	
	URBAN EDGE PROPERTIES	44,064.000	760,104.000	
	URSTADT BIDDLE PROPERTIES	11,393.000	249,278.840	
	VENTAS INC	125,902.000	8,095,498.600	
	VEREIT INC	341,312.000	3,030,850.560	
	VICI PROPERTIES INC	127,019.000	2,817,281.420	
	VORNADO REALTY TRUST	61,209.000	4,053,872.070	
	WASHINGTON PRIME GROUP INC	70,292.000	288,197.200	
	WASHINGTON REIT	29,333.000	780,551.130	
	WEINGARTEN REALTY INVST	41,968.000	1,183,497.600	
	WELLTOWER INC	136,616.000	11,095,951.520	
	WHITESTONE REIT	15,361.000	194,623.870	
	WP CAREY INC	59,994.000	4,980,101.940	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	39,522.000	826,405.020	
	アメリカ・ドル 小計	8,135,017.000	309,214,988.110 (33,500,351,812)	
イギリス・ボンド	ASSURA PLC	854,448.000	547,701.160	
	BIG YELLOW GROUP PLC	54,616.000	555,990.880	
	BRITISH LAND CO PLC	339,997.000	1,815,583.980	
	CAPITAL & REGIONAL PLC	135,437.000	25,191.280	
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	235,420.000	198,459.060	
	DERWENT LONDON PLC	38,959.000	1,252,921.440	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	196,113.000	179,247.280	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	95,824.000	688,974.560	
	HAMMERSON PLC	269,495.000	730,061.950	
	HANSTEEN HOLDINGS PLC	159,520.000	148,513.120	
	INTU PROPERTIES PLC	320,999.000	297,566.070	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	264,890.000	2,194,878.540	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	257,540.000	525,896.680	
	LXI REIT PLC	134,197.000	169,625.000	
	NEWRIVER REIT PLC	103,999.000	218,397.900	

	PICTON PROPERTY INCOME LTD	194,275.000	186,115.450	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC	395,499.000	541,042.630	
	RDI REIT PLC	77,641.000	83,541.710	
	REGIONAL REIT LTD	110,888.000	121,089.690	
	SAFESTORE HOLDINGS LTD	77,102.000	489,212.190	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT TRUST LTD	204,861.000	117,385.350	
	SEGRO PLC	382,636.000	2,669,268.730	
	SHAFTESBURY PLC	80,557.000	662,984.110	
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING REIT PLC	104,772.000	91,361.180	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	598,461.000	886,919.200	
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT LTD	253,882.000	232,048.140	
	UNITE GROUP PLC	92,217.000	875,600.410	
	WORKSPACE GROUP PLC	48,221.000	425,309.220	
	イギリス・ポンド 小計	6,082,466.000	16,930,886.910 (2,319,531,507)	
イスラエル・シケル	REIT 1 LTD	63,655.000	1,080,225.350	
	イスラエル・シケル 小計	63,655.000	1,080,225.350 (32,277,133)	
カナダ・ドル	ALLIED PROPERTIES REIT	18,469.000	897,778.090	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	24,488.000	288,468.640	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	7,736.000	314,700.480	
	CANADIAN APT PPTYS REIT	26,047.000	1,275,782.060	
	CHOICE PROPERTIES REIT	53,304.000	718,537.920	
	COMINAR REAL ESTATE INVT TR	30,322.000	372,050.940	
	CROMBIE REAL ESTATE INV	16,860.000	250,033.800	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	16,489.000	227,548.200	
	DREAM GLOBAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	33,203.000	448,904.560	
	DREAM INDUSTRIAL REIT	22,370.000	259,044.600	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV TRUST	11,152.000	262,629.600	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	8,978.000	542,360.980	
	H & R REAL ESTATE INVESTMENT	48,916.000	1,115,284.800	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	19,862.000	281,047.300	
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	2,860.000	56,370.600	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT	4,494.000	81,161.640	

	NORTHVIEW APARTMENT REIT	10,523.000	280,332.720	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	22,017.000	265,525.020	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	52,282.000	1,363,514.560	
	SLATE OFFICE REIT	12,079.000	71,145.310	
	SLATE RETAIL REIT	6,406.000	79,946.880	
	SMARTCENTRES REIT	24,167.000	789,294.220	
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	33,755.000	430,038.700	
	TRUE NORTH COMMERCIAL REIT	10,465.000	67,603.900	
カナダ・ドル 小計		517,244.000	10,739,105.520 (861,168,871)	
ニュージーランド・ドル	ARGOSY PROPERTY LTD	282,830.000	373,335.600	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	361,871.000	671,270.700	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	529,101.000	833,334.070	
	PRECINCT PROPERTIES	404,852.000	655,860.240	
	STRIDE STAPLED GROUP	140,039.000	298,283.070	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	127,868.000	297,932.440	
ニュージーランド・ドル 小計		1,846,561.000	3,130,016.120 (221,949,442)	
ユーロ	AEDIFICA	8,684.000	715,561.600	
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	56,116.000	785,062.840	
	ALTAREA	1,209.000	209,157.000	
	BEFIMMO	8,176.000	410,435.200	
	COFINIMMO SA	7,418.000	838,234.000	
	COVIVIO	21,906.000	2,056,973.400	
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	14,114.000	329,985.320	
	GECINA SA	19,335.000	2,474,880.000	
	GREEN REIT PLC	240,878.000	417,682.450	
	HAMBORNER REIT AG	27,782.000	253,927.480	
	HIBERNIA REIT PLC	242,240.000	330,899.840	
	ICADE	16,442.000	1,250,414.100	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE	15,915.000	97,877.250	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA	97,764.000	968,841.240	
	INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	8,307.000	205,598.250	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES REIT PLC	124,155.000	197,903.070	
	KLEPIERRE	73,120.000	2,227,966.400	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA	25,183.000	172,503.550	
MERCIALYS	20,654.000	228,639.780		

	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	128,895.000	1,535,139.450	
	MONTEA SCA	3,819.000	297,500.100	
	NSI NV	6,338.000	230,069.400	
	RETAIL ESTATES	2,609.000	205,589.200	
	UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	48,644.000	6,583,965.400	
	VASTNED RETAIL	6,326.000	185,984.400	
	WAREHOUSES DE PAUW	6,053.000	842,577.600	
	WERELDHAVE NV	14,313.000	312,882.180	
ユーロ 小計		1,246,395.000	24,366,250.500 (2,950,752,935)	
韓国・ウォン	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	9,316.000	59,715,560.000	
韓国・ウォン 小計		9,316.000	59,715,560.000 (5,452,031)	
香港・ドル	CHAMPION REIT	732,070.000	4,670,606.600	
	FORTUNE REAL ESTATE (HK)	477,000.000	4,922,640.000	
	LINK REIT	769,020.000	72,134,076.000	
	PROSPERITY REIT	462,000.000	1,529,220.000	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	384,000.000	2,192,640.000	
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	500,000.000	2,620,000.000	
香港・ドル 小計		3,324,090.000	88,069,182.600 (1,217,116,103)	
投資証券 合計		21,224,744	41,108,599,834 (41,108,599,834)	
合計			46,044,631,043 (46,044,631,043)	

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

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

通貨	銘柄数	組入 投資信託受益証券 時価比率	組入 投資証券 時価比率	有価証券の 合計金額 に対する比率
アメリカ・ドル	投資証券 156銘柄	-%	70.67%	72.76%
イギリス・ポンド	投資証券 28銘柄	-%	4.89%	5.04%
イスラエル・シケル	投資証券 1銘柄	-%	0.07%	0.07%
オーストラリア・ドル	投資信託受益証券 24銘柄	6.87%	-%	7.07%
カナダ・ドル	投資信託受益証券 1銘柄 投資証券 24銘柄	0.05% -%	-% 1.82%	1.93%
シンガポール・ドル	投資信託受益証券 30銘柄	3.49%	-%	3.59%
ニュージーランド・ドル	投資証券 6銘柄	-%	0.47%	0.48%
ユーロ	投資証券 27銘柄	-%	6.22%	6.41%
韓国・ウォン	投資証券 1銘柄	-%	0.01%	0.01%
香港・ドル	投資証券 6銘柄	-%	2.57%	2.64%

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

「エマージング株式パッシブ・マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成30年12月3日現在	令和1年6月3日現在
資産の部			
流動資産			
預金		1,068,876,516	3,775,205,306
コール・ローン		54,923,514	94,587,049
株式		46,283,066,480	49,742,660,133
新株予約権証券		-	171,609
投資信託受益証券		226,785,899	255,591,546
投資証券		70,208,348	35,873,156
派生商品評価勘定		23,967,533	21,554,000
未収入金		2,377,487,834	17,169,417
未収配当金		23,085,476	111,118,576
差入委託証拠金		290,279,576	1,970,338,372
流動資産合計		50,418,681,176	56,024,269,164
資産合計		50,418,681,176	56,024,269,164
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		1,019,958	206,888,314
未払金		325,561,241	502,124,154
未払解約金		149,673,000	195,000
流動負債合計		476,254,199	709,207,468
負債合計		476,254,199	709,207,468
純資産の部			
元本等			
元本	1	44,413,524,549	51,142,699,293
剰余金			
剰余金又は欠損金()		5,528,902,428	4,172,362,403
元本等合計		49,942,426,977	55,315,061,696
純資産合計		49,942,426,977	55,315,061,696
負債純資産合計		50,418,681,176	56,024,269,164

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	平成30年12月3日現在	令和1年6月3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	51,856,324,726円	44,413,524,549円
同期中追加設定元本額	17,744,126,345円	25,217,176,123円
同期中一部解約元本額	25,186,926,522円	18,488,001,379円
元本の内訳		
ファンド名		
D I A M新興国株式インデック スファンド< D C 年金 >	4,136,727,242円	4,657,872,290円
D I A M新興国株式インデック スファンド< 為替ヘッジなし > (ファンドラップ)	531,074,071円	500,536,869円
M I T O ラップ型ファンド (安定型)	3,828,134円	3,298,513円
M I T O ラップ型ファンド (中立型)	10,610,747円	10,973,833円
M I T O ラップ型ファンド (積極型)	13,230,020円	14,404,320円
グローバル8資産ラップファン ド(安定型)	27,299,293円	30,467,853円
グローバル8資産ラップファン ド(中立型)	28,537,703円	27,724,347円
グローバル8資産ラップファン ド(積極型)	16,073,343円	16,600,746円
たわらノーロード 新興国株式	4,358,464,290円	4,882,942,497円
たわらノーロード 新興国株式 <ラップ向け>	1,896,138,324円	1,816,215,348円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	183,119,546円	367,680,381円
たわらノーロード バランス (堅実型)	1,183,744円	2,438,713円
たわらノーロード バランス (標準型)	4,838,686円	9,761,776円
たわらノーロード バランス (積極型)	11,552,601円	18,436,090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)	106,411円	202,792円
たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(安定型)	7,338,803円	12,775,306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)	22,466,730円	37,308,938円
たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(成長型)	15,189,087円	26,540,385円
たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(積極型)	45,843,989円	64,390,176円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定型)	33,616円	160,410円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定成長型)	485,996円	593,715円

たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	323,745円	424,167円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	830,968円	1,209,357円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	447,212,307円	453,215,866円
DIAM DC 8資産バランス ファンド(新興国10)	323,578,911円	346,828,288円
DIAM DC 8資産バランス ファンド(新興国20)	282,922,262円	316,007,413円
DIAM DC 8資産バランス ファンド(新興国30)	556,636,033円	613,434,574円
投資のソムリエ	1,295,451,886円	8,510,966,128円
クルーズコントロール	640,687,707円	285,779,318円
投資のソムリエ<DC年金>	115,257,276円	871,342,513円
DIAM 8資産バランス ファンドN<DC年金>	233,487,274円	273,481,850円
クルーズコントロール<DC 年金>	406,162円	256,087円
DIAMコア資産設計ファンド (堅実型)	7,991,023円	5,932,519円
DIAMコア資産設計ファンド (積極型)	21,370,401円	15,251,422円
投資のソムリエ<DC年金> リスク抑制型	56,713,787円	330,552,654円
ダイナミック・ナビゲーション リスク抑制世界8資産 バランス ファンド	572,764円	603,795円
ワールドアセットバランス(基 本コース)	1,030,481,740円	4,713,616,524円
ワールドアセットバランス(リ スク抑制コース)	1,853,672,739円	1,617,423,148円
ワールドアセットバランス(リ スク抑制コース)	4,569,034,230円	6,277,274,398円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2045)	1,627,999円	4,095,188円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2055)	1,232,777円	3,490,422円
リスク抑制世界8資産 バランス ファンド(DC)	351,578円	2,460,371円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2035)	2,172,412円	7,147,093円
リスクコントロール世界 資産分 散ファンド	303,188,905円	652,907,289円
9資産分散投資・スタン ダード <DC年金>	20,870円	28,575,591円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2040)	-円	778,843円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2050)	-円	778,843円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2060)	-円	778,843円
エマージング株式バッシ ブ ファンドVA(適格機関投 資家 専用)	3,620,934,458円	2,470,918,808円

	エマージング株式パッシブファンド(適格機関投資家限定)	2,125,669,236円	-円
	D I A M世界アセットバランスファンド2 V A (適格機関投資家限定)	7,765,160,454円	4,397,133,058円
	D I A M世界アセットバランスファンド3 V A (適格機関投資家限定)	7,842,392,269円	6,438,709,625円
	計	44,413,524,549円	51,142,699,293円
2 .	受益権の総数	44,413,524,549口	51,142,699,293口

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成30年6月5日 至 平成30年12月3日	自 平成30年12月4日 至 令和1年6月3日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。</p> <p>また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。</p>	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成30年12月3日現在	令和1年6月3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	4,574,498,406	3,364,140,649
新株予約権証券	-	60,568
投資信託受益証券	16,040,432	7,341,949
投資証券	20,102,663	3,032,483
合計	4,610,641,501	3,374,575,649

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成30年4月19日から平成30年12月3日まで及び平成31年4月19日から令和1年6月3日まで）に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	平成30年12月3日 現在				令和1年6月3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	782,421,144	-	782,306,323	114,821	343,226,550	-	342,032,335	1,194,215
アメリカ・ドル	346,521,144	-	346,706,323	185,179	341,324,953	-	340,119,653	1,205,300
ブラジル・リアル	-	-	-	-	1,901,597	-	1,912,682	11,085
香港・ドル	435,900,000	-	435,600,000	300,000	-	-	-	-
買 建	476,634,833	-	476,517,421	117,412	160,667,190	-	159,875,132	792,058
アメリカ・ドル	435,900,000	-	435,757,421	142,579	44,539,517	-	44,158,978	380,539
インドネシア・ルピア	-	-	-	-	89,558,702	-	89,593,097	34,395
コロンビア・ペソ	-	-	-	-	26,568,971	-	26,123,057	445,914
韓国・ウォン	40,734,833	-	40,760,000	25,167	-	-	-	-
合計	1,259,055,977	-	1,258,823,744	2,591	503,893,740	-	501,907,467	402,157

(注) 時価の算定方法

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

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

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

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

株式関連

種類	平成30年12月3日 現在				令和1年6月3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	3,140,657,884	-	3,163,608,050	22,950,166	5,148,700,865	-	4,962,964,394	185,736,471
合計	3,140,657,884	-	3,163,608,050	22,950,166	5,148,700,865	-	4,962,964,394	185,736,471

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成30年12月3日現在	令和1年6月3日現在
1口当たり純資産額	1.1245円	1.0816円
(1万口当たり純資産額)	(11,245円)	(10,816円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

令和1年6月3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	BBVA BANCO FRANCES SA ADR	6,180	8.960	55,372.800	
	CTRIP.COM INTERNATIONAL LTD ADR	37,132	34.560	1,283,281.920	
	CIA DE MINAS BUENAVENTURA SA ADR	19,751	15.170	299,622.670	
	SURGUTNEFTEGAZ SP ADR PREF	69,900	6.290	439,671.000	
	CREDICORP LTD	6,030	223.800	1,349,514.000	
	SINA CORP	6,514	40.260	262,253.640	
	MOBILE TELESYSTEMS PJSC ADR	50,770	7.820	397,021.400	
	NETEASE INC-ADR	6,369	248.610	1,583,397.090	
	GRUPO FINANCIERO GALICIA SA ADR	11,420	25.610	292,466.200	
	SOUTHERN COPPER CORP	8,161	33.730	275,270.530	
	TELECOM ARGENTINA SA SP ADR	7,366	14.830	109,237.780	
	TRANSPORTADORA DE GAS DEL SUR SP ADR	6,243	13.090	81,720.870	
	YPF SA ADR	13,657	14.830	202,533.310	
	LUKOIL SPON ADR	37,740	80.560	3,040,334.400	
	GAZPROM PAO ADR	483,486	6.570	3,176,503.020	
	COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK SP GDR	148,738	4.050	602,388.900	
	INNER MONGOLIA YITAI COAL CO	66,800	1.095	73,146.000	
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRADE	86,736	1.163	100,873.960	
	SURGUTNEFTEGAZ ADR	64,929	3.766	244,522.610	
	51JOB INC ADR	1,814	70.350	127,614.900	
	X5 RETAIL GROUP NV GDR	12,169	29.420	358,011.980	
	NOVATEK PJSC GDR	8,417	205.000	1,725,485.000	
	BAIDU INC -SPON ADR	24,909	110.000	2,739,990.000	
	NOVOLIPETSK STEEL GDR	12,150	26.300	319,545.000	
	BANCO MACRO SA ADR	3,717	49.880	185,403.960	
	MMC NORILSK NICKEL ADR	59,570	20.880	1,243,821.600	
ROSNEFT OIL CO GDR	110,942	6.664	739,317.480		
NEW ORIENTAL EDUCATION & TECH	12,816	85.650	1,097,690.400		
SEVERSTAL GDR	21,951	15.770	346,167.270		
TATNEFT ADR	23,549	68.120	1,604,157.880		

MAGNITOGORSK IRON & STEEL SPON GDR	25,801	8.800	227,048.800	
VTB BANK OJSC GDR	172,000	1.154	198,488.000	
DP WORLD PLC	12,841	17.110	219,709.510	
MAGNIT PJSC GDR	34,762	13.985	486,146.570	
VIPSHOP HOLDINGS LTD ADR	34,821	7.540	262,550.340	
PAMPA ENERGIA SA ADR	5,773	25.280	145,941.440	
TAL EDUCATION GROUP-ADR	32,149	34.410	1,106,247.090	
NOAH HOLDINGS LTD ADR	2,700	38.250	103,275.000	
SBERBANK ADR	243,502	14.450	3,518,603.900	
PHOSAGRO PJSC GDR	13,784	12.870	177,400.080	
HUAZHU GROUP LTD ADR	12,147	30.600	371,698.200	
YY INC-ADR	3,748	68.450	256,550.600	
GDS HOLDINGS LTD ADR	4,404	32.490	143,085.960	
NIO INC ADR	57,194	3.050	174,441.700	
TENCENT MUSIC ENTERTAINMENT GROUP ADR	8,115	13.240	107,442.600	
58.COM INC ADR	8,736	57.030	498,214.080	
AUTOHOME INC ADR	5,418	85.900	465,406.200	
WEIBO CORP ADR	4,093	41.520	169,941.360	
JD.COM INC ADR	66,311	25.760	1,708,171.360	
GLOBANT SA	2,914	92.840	270,535.760	
ALIBABA GROUP HOLDING LTD-ADR	127,273	149.260	18,996,767.980	
MOMO INC SPON ADR	13,537	27.570	373,215.090	
BAOZUN INC-SPN ADR	3,400	39.230	133,382.000	
PINDUODUO INC ADR	17,775	19.420	345,190.500	
YUM CHINA HOLDINGS INC	32,210	40.010	1,288,722.100	
IQIYI INC ADR	9,440	18.230	172,091.200	
POLYUS PJSC GDR	4,556	39.700	180,873.200	
HUTCHISON CHINA MEDITECH LTD ADR	4,746	27.610	131,037.060	
ZTO EXPRESS CAYMAN INC ADR	29,576	18.040	533,551.040	
アメリカ・ドル 小計	2,423,652		57,122,066.290 (6,188,604,662)	
アラブ首長国連邦・ディルハム				
DUBAI ISLAMIC BANK PJSC	136,145	5.040	686,170.800	
EMIRATES TELECOMMUNICATIONS GROUP CO PJSC	158,220	16.300	2,578,986.000	
ABU DHABI COMMERCIAL BANK PJSC	263,921	8.980	2,370,010.580	
FIRST ABU DHABI BANK PJSC	251,692	14.860	3,740,143.120	
EMAAR PROPERTIES PJSC	283,990	4.470	1,269,435.300	
ALDAR PROPERTIES PJSC	356,142	1.820	648,178.440	
EMAAR DEVELOPMENT PJSC	77,463	3.920	303,654.960	
EMAAR MALLS PJSC	178,166	1.940	345,642.040	

	DAMAC PROPERTIES DUBAI CO PJSC	127,534	0.860	109,679.240	
アラブ首長国連邦・ディルハム 小計		1,833,273		12,051,900.480 (356,254,178)	
イギリス・ポンド	POLYMETAL INTERNATIONAL PLC	23,613	8.500	200,710.500	
イギリス・ポンド 小計		23,613		200,710.500 (27,497,338)	
インド・ルピー	RELIANCE INDUSTRIES LTD	254,856	1,330.150	338,996,708.400	
	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	58,246	409.350	23,843,000.100	
	ASIAN PAINTS LTD	26,857	1,407.300	37,795,856.100	
	EICHER MOTORS LTD	1,291	19,947.750	25,752,545.250	
	GRASIM INDUSTRIES LTD	25,384	886.100	22,492,762.400	
	MAHINDRA & MAHINDRA LTD	64,106	647.050	41,479,787.300	
	SHREE CEMENT LTD	702	21,618.750	15,176,362.500	
	ICICI BANK LTD	213,313	423.700	90,380,718.100	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP LTD	46,395	324.250	15,043,578.750	
	STATE BANK OF INDIA LTD	160,842	352.500	56,696,805.000	
	CONTAINER CORP OF INDIA LTD	21,881	530.050	11,598,024.050	
	LIC HOUSING FINANCE LTD	26,242	558.600	14,658,781.200	
	TATA STEEL LTD	30,106	488.300	14,700,759.800	
	TATA MOTORS LTD	148,744	172.600	25,673,214.400	
	JSW STEEL LTD	71,572	271.700	19,446,112.400	
	TATA POWER CO LTD	100,483	68.800	6,913,230.400	
	BRITANNIA INDUSTRIES LTD	4,334	2,921.950	12,663,731.300	
	NESTLE INDIA LTD	2,230	11,498.100	25,640,763.000	
	GAIL INDIA LTD	75,347	361.000	27,200,267.000	
	VEDANTA LTD	153,887	160.550	24,706,557.850	
	AXIS BANK LTD	170,862	808.300	138,107,754.600	
	TITAN COMPANY LTD	28,852	1,235.750	35,653,859.000	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	226,935	171.950	39,021,473.250	
	LUPIN LTD	18,852	745.550	14,055,108.600	
	BAJAJ FINANCE LTD	15,773	3,467.100	54,686,568.300	
	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP	146,019	2,182.650	318,708,370.350	
	ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISES LTD	48,770	357.450	17,432,836.500	
	INFOSYS LTD	313,352	737.750	231,175,438.000	
	WIPRO LTD	103,325	286.400	29,592,280.000	
	INDIAN OIL CORP LTD	174,628	165.550	28,909,665.400	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	57,560	1,788.500	102,946,060.000		
HCL TECHNOLOGIES LTD	49,458	1,092.550	54,035,337.900		
DABUR INDIA LTD	52,173	395.950	20,657,899.350		
HERO MOTOCORP LTD	4,509	2,680.250	12,085,247.250		

DR REDDYS LABORATORIES LTD	10,980	2,678.350	29,408,283.000	
BHARTI AIRTEL LTD	201,436	348.800	70,260,876.800	
UNITED SPIRITS LTD	24,162	554.050	13,386,956.100	
SUN PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD	80,560	409.850	33,017,516.000	
DIVI'S LABORATORIES LTD	5,865	1,592.300	9,338,839.500	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	9,533	6,869.850	65,490,280.050	
GLENMARK PHARMACEUTICALS LTD	9,463	545.350	5,160,647.050	
AUROBINDO PHARMA LTD	22,361	672.400	15,035,536.400	
HAVELLS INDIA LTD	26,377	747.950	19,728,677.150	
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	99,877	115.350	11,520,811.950	
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE CO LTD	11,319	1,164.300	13,178,711.700	
PETRONET LNG LTD	59,517	247.050	14,703,674.850	
CIPLA LTD/INDIA	26,157	558.850	14,617,839.450	
LARSEN & TOUBRO LTD	43,142	1,557.550	67,195,822.100	
ULTRATECH CEMENT LTD	8,252	4,760.100	39,280,345.200	
ASHOK LEYLAND LTD	110,886	88.850	9,852,221.100	
BOSCH LTD	529	17,722.850	9,375,387.650	
TATA CONSULTANCY SERVICES LTD	80,435	2,196.550	176,679,499.250	
NTPC LTD	210,066	133.250	27,991,294.500	
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	7,493	2,222.950	16,656,564.350	
YES BANK LTD	133,947	147.800	19,797,366.600	
AMBUJA CEMENTS LTD	60,245	230.600	13,892,497.000	
BHARAT FORGE LTD	18,421	467.350	8,609,054.350	
HINDALCO INDUSTRIES LTD	100,088	197.000	19,717,336.000	
ITC LTD	309,493	278.550	86,209,275.150	
PIDILITE INDUSTRIES LTD	9,127	1,289.650	11,770,635.550	
UNITED PHOSPHORUS LTD	32,903	998.950	32,868,451.850	
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	33,093	688.050	22,769,638.650	
TECH MAHINDRA LTD	43,799	760.350	33,302,569.650	
VODAFONE IDEA LTD	714,690	13.950	9,969,925.500	
MARICO LTD	37,213	371.950	13,841,375.350	
PAGE INDUSTRIES LTD	581	19,757.300	11,478,991.300	
POWER GRID CORP OF INDIA LTD	145,077	189.300	27,463,076.100	
ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	54,822	416.400	22,827,880.800	
REC LTD	55,173	144.550	7,975,257.150	
BAJAJ FINSERV LTD	3,559	8,187.950	29,140,914.050	
BAJAJ AUTO LTD	6,471	2,925.900	18,933,498.900	
COAL INDIA LTD	114,340	253.500	28,985,190.000	
MAHINDRA & MAHINDRA FINANCIAL SERVICES LTD	31,084	421.650	13,106,568.600	

	BHARTI INFRATEL LTD	32,296	269.000	8,687,624.000	
	INDIABULLS HOUSING FINANCE LTD	26,467	786.550	20,817,618.850	
	TATA STEEL LTD-PARTLY PAID	2,333	64.800	151,178.400	
	AVENUE SUPERMARTS LTD	11,216	1,323.100	14,839,889.600	
	ICICI LOMBARD GENERAL INSURANCE CO LTD	12,372	1,176.500	14,555,658.000	
	INTERGLOBE AVIATION LTD	8,300	1,676.300	13,913,290.000	
インド・ルピー 小計		5,943,406		3,115,432,009.350 (4,891,228,254)	
インドネシア・ル ピア	BARITO PACIFIC TBK PT	507,200	3,300.000	1,673,760,000.000	
	UNITED TRACTORS TBK PT	143,901	25,350.000	3,647,890,350.000	
	INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK PT	347,600	6,600.000	2,294,160,000.000	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	133,200	44,500.000	5,927,400,000.000	
	PT ASTRA INTERNATIONAL TBK	1,854,400	7,450.000	13,815,280,000.000	
	TELEKOMUNIKASI INDONESIA PERSERO TBK	4,476,600	3,900.000	17,458,740,000.000	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA TBK PT	549,000	4,900.000	2,690,100,000.000	
	GUDANG GARAM TBK PT	48,900	80,475.000	3,935,227,500.000	
	HANJAYA MANDALA SAMPOERNA TBK	795,500	3,380.000	2,688,790,000.000	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA TBK PT	183,300	21,200.000	3,885,960,000.000	
	INDAH KIAT PULP AND PAPER CORP TBK PT	262,000	7,750.000	2,030,500,000.000	
	BUKIT ASAM TBK PT	256,700	3,060.000	785,502,000.000	
	BANK MANDIRI	1,698,700	7,675.000	13,037,522,500.000	
	PABRIK KERTAS TJIWI KIMIA TBK PT	98,000	10,200.000	999,600,000.000	
	BANK RAKYAT INDONESIA	4,988,800	4,100.000	20,454,080,000.000	
	PERUSAHAAN GAS NEGARA TBK PT	806,800	2,060.000	1,662,008,000.000	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSERO TBK PT	709,200	8,400.000	5,957,280,000.000	
	KALBE FARMA TBK PT	2,100,200	1,405.000	2,950,781,000.000	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK PT	219,900	11,550.000	2,539,845,000.000	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	883,800	29,100.000	25,718,580,000.000	
JASA MARGA PERSERO TBK PT	200,125	5,700.000	1,140,712,500.000		
BUMI SERPONG DAMAI PT	746,500	1,350.000	1,007,775,000.000		
ADARO ENERGY PT	1,016,200	1,295.000	1,315,979,000.000		
PAKUWON JATI TBK	1,659,900	705.000	1,170,229,500.000		

	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR TBK PT	165,800	9,800.000	1,624,840,000.000	
	BANK TABUNGAN NEGARA TBK PT	480,300	2,470.000	1,186,341,000.000	
	PT SURYA CITRA MEDIA TBK	511,300	1,650.000	843,645,000.000	
インドネシア・ルピア	小計	25,843,826		142,442,528,350.000 (1,082,563,216)	
オフショア・人民 元	LUXSHARE PRECISION INDUSTRY CO LTD	34,500	21.460	740,370.000	
	FOCUS MEDIA INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD	131,100	5.560	728,916.000	
	IFLYTEK CO LTD	22,200	29.080	645,576.000	
	YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD	2,300	77.690	178,687.000	
	JIANGSU YANGHE BREWERY JOINT-STOCK CO LTD	8,200	114.360	937,752.000	
	WULIANGYE YIBIN CO LTD	15,100	101.250	1,528,875.000	
	SUNING.COM CO LTD	69,400	10.840	752,296.000	
	BOE TECHNOLOGY GROUP CO LTD	232,600	3.440	800,144.000	
	CHINA MERCHANTS SHEKOU INDUSTRIAL ZONE HOLDINGS CO LTD	39,700	21.720	862,284.000	
	GREE ELECTRIC APPLIANCES INC OF ZHUHAI	16,900	52.310	884,039.000	
	MIDEA GROUP CO LTD	18,800	49.600	932,480.000	
	HANGZHOU HIKVISION DIGITAL TECHNOLOGY CO LTD	44,500	24.840	1,105,380.000	
	PING AN BANK CO LTD	84,900	12.180	1,034,082.000	
	WENS FOODSTUFFS GROUP CO LTD	28,400	39.400	1,118,960.000	
	CHINA VANKE CO LTD	43,900	26.700	1,172,130.000	
	WEICHAJ POWER CO LTD	29,900	11.700	349,830.000	
	BANK OF SHANGHAI CO LTD	71,300	11.260	802,838.000	
	PETROCHINA CO LTD	32,800	7.150	234,520.000	
	INDUSTRIAL & COMMERCIAL BANK OF CHINA LTD	75,500	5.610	423,555.000	
	AGRICULTURAL BANK OF CHINA LTD	82,500	3.680	303,600.000	
	BANK OF CHINA LTD	74,500	3.880	289,060.000	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL CORP	51,300	5.430	278,559.000	
	CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	69,600	34.210	2,381,016.000	
	PING AN INSURANCE GROUP CO OF CHINA LTD	35,300	79.000	2,788,700.000	
	INDUSTRIAL BANK CO LTD	82,000	17.570	1,440,740.000	
	SHANGHAI PUDONG DEVELOPMENT BANK CO LTD	121,700	11.130	1,354,521.000	

CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	173,700	6.110	1,061,307.000	
SAIC MOTOR CORP LTD	41,300	23.950	989,135.000	
KWEICHOW MOUTAI CO LTD	3,800	890.000	3,382,000.000	
BANK OF COMMUNICATIONS CO LTD	182,200	5.960	1,085,912.000	
CITIC SECURITIES CO LTD	50,200	20.130	1,010,526.000	
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	31,400	34.420	1,080,788.000	
CHINA YANGTZE POWER CO LTD	26,500	17.710	469,315.000	
DAQIN RAILWAY CO LTD	30,100	8.360	251,636.000	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD	60,800	3.840	233,472.000	
CHINA STATE CONSTRUCTION ENGINEERING CORP LTD	199,700	5.610	1,120,317.000	
HUAXIA BANK CO LTD	98,400	7.500	738,000.000	
INNER MONGOLIA YILI INDUSTRIAL GROUP CO LTD	32,300	30.010	969,323.000	
BANK OF BEIJING CO LTD	42,800	5.800	248,240.000	
BAOSHAN IRON & STEEL CO LTD	121,700	6.300	766,710.000	
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	22,900	39.550	905,695.000	
CHINA MERCHANTS SECURITIES CO LTD	22,800	15.460	352,488.000	
POLY DEVELOPMENTS AND HOLDINGS GROUP CO LTD	70,000	12.160	851,200.000	
CRRC CORP LTD	126,800	7.910	1,002,988.000	
JIANGSU HENGRUI MEDICINE CO LTD	19,800	62.160	1,230,768.000	
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION CORP LTD	81,900	9.400	769,860.000	
HUATAI SECURITIES CO LTD	43,200	18.630	804,816.000	
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD	60,700	12.070	732,649.000	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	11,000	24.740	272,140.000	
FOUNDER SECURITIES CO LTD	84,500	7.170	605,865.000	
CHINA INTERNATIONAL TRAVEL SERVICE CORP LTD	11,600	77.390	897,724.000	
AVIC CAPITAL CO LTD	49,800	5.430	270,414.000	
POWER CONSTRUCTION CORP OF CHINA LTD	132,100	4.920	649,932.000	
SICHUAN CHUANTOU ENERGY CO LTD	23,700	9.010	213,537.000	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD	9,900	18.400	182,160.000	

	AECC AVIATION POWER CO LTD	9,500	23.360	221,920.000	
	JOINTOWN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	16,000	13.050	208,800.000	
	INDUSTRIAL SECURITIES CO LTD	53,200	6.180	328,776.000	
	BEIJING TONGRENTANG CO LTD	19,900	29.220	581,478.000	
	SHANDONG GOLD MINING CO LTD	8,000	31.090	248,720.000	
	YONGHUI SUPERSTORES CO LTD	74,000	9.800	725,200.000	
	AISINO CORP	26,300	22.950	603,585.000	
	ZHANGZHOU PIENZHEHUANG PHARMACEUTICAL CO LTD	6,100	107.500	655,750.000	
	HENGTONG OPTIC-ELECTRIC CO LTD	35,900	15.850	569,015.000	
	GUOTAI JUNAN SECURITIES CO LTD	49,500	16.070	795,465.000	
	CHINA NATIONAL NUCLEAR POWER CO LTD	51,300	5.520	283,176.000	
	BANK OF JIANGSU CO LTD	96,200	7.260	698,412.000	
	ORIENT SECURITIES CO LTD/CHINA	24,800	10.250	254,200.000	
	EVERBRIGHT SECURITIES CO LTD	24,000	11.150	267,600.000	
オフショア・人民元	小計	3,879,200		53,659,924.000 (838,168,013)	
カタール・リアル	QATAR INSURANCE CO SAQ	14,417	34.970	504,162.490	
	QATAR NATIONAL BANK	39,877	183.000	7,297,491.000	
	COMMERCIAL BANK OF QATAR QSC	18,202	45.490	828,008.980	
	OOREDOO QSC	6,760	64.100	433,316.000	
	QATAR FUEL QSC	4,133	203.250	840,032.250	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	5,050	165.500	835,775.000	
	INDUSTRIES QATAR QSC	16,297	113.560	1,850,687.320	
	QATAR ISLAMIC BANK SAQ	10,503	166.330	1,746,963.990	
	MASRAF AL RAYAN	36,535	35.980	1,314,529.300	
	BARWA REAL ESTATE CO	16,763	35.480	594,751.240	
MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDING CO	37,645	25.490	959,571.050		
カタール・リアル	小計	206,182		17,205,288.620 (511,169,124)	
コロンビア・ペソ	INTERCONEXION ELECTRICA SA ESP	49,106	16,200.000	795,517,200.000	
	ECOPETROL SA	397,193	2,765.000	1,098,238,645.000	
	GRUPO DE INVERSIONES SURAMERICANA SA-PREF	10,138	30,300.000	307,181,400.000	

	GRUPO AVAL ACCIONES Y VALORES SA-PREF	341,831	1,175.000	401,651,425.000	
	CEMENTOS ARGOS SA	37,720	7,290.000	274,978,800.000	
	GRUPO ARGOS SA	36,619	17,320.000	634,241,080.000	
	BANCOLOMBIA SA	17,386	37,400.000	650,236,400.000	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	38,573	39,500.000	1,523,633,500.000	
	GRUPO DE INVERSIONES SURAMERICANA SA	26,465	33,260.000	880,225,900.000	
コロンビア・ペソ	小計	955,031		6,565,904,350.000 (210,765,530)	
タイ・パーツ	BANGKOK BANK PCL	38,300	196.500	7,525,950.000	
	BERLI JUCKER PCL NVDR	88,100	44.750	3,942,475.000	
	KRUNG THAI BANK PCL NVDR	286,500	19.100	5,472,150.000	
	RATCHABURI ELECTRICITY GENERATING HOLDING PCL NVDR	78,600	61.500	4,833,900.000	
	ROBINSON PCL-NVDR	38,800	54.500	2,114,600.000	
	SIAM COMMERCIAL BANK PCL NVDR	68,700	129.500	8,896,650.000	
	TRUE CORP PCL NVDR	1,079,055	4.920	5,308,950.600	
	KASIKORNBANK PCL NVDR	74,600	186.500	13,912,900.000	
	TMB BANK PCL -NVDR	1,010,000	1.890	1,908,900.000	
	IRPC PCL NVDR	1,300,500	4.740	6,164,370.000	
	BANPU PCL PUBLIC CO LTD NVDR	384,200	14.900	5,724,580.000	
	ELECTRICITY GENERATING PCL NVDR	26,600	297.000	7,900,200.000	
	SHIN CORP PCL	187,000	57.750	10,799,250.000	
	CHAROEN POKPHAND FOODS PCL	325,800	27.750	9,040,950.000	
	ADVANCED INFO SERVICE PCL	98,800	193.000	19,068,400.000	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	510,820	16.900	8,632,858.000	
	PTT PCL	1,005,300	46.250	46,495,125.000	
	THAI UNION GROUP PCL-NVDR	315,400	18.100	5,708,740.000	
	LAND AND HOUSES PCL NVDR	604,500	10.600	6,407,700.000	
	SIAM CEMENT PCL NVDR	69,250	452.000	31,301,000.000	
	AIRPORTS OF THAILAND PCL-NVDR	384,400	63.750	24,505,500.000	
	KASIKORNBANK PCL - FOREIGN	106,600	187.500	19,987,500.000	
	CENTRAL PATTANA PCL NVDR	192,100	71.250	13,687,125.000	
	BANGKOK DUSIT MEDICAL SERVICES NVDR	837,800	25.500	21,363,900.000	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR	47,900	167.500	8,023,250.000	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	239,010	38.750	9,261,637.500	

	THAI OIL PCL NVDR	116,500	59.250	6,902,625.000	
	CP ALL PCL NVDR	516,600	79.750	41,198,850.000	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL	531,300	11.400	6,056,820.000	
	PTT EXPLORATION & PRODUCTION PCL NVDR	125,845	125.500	15,793,547.500	
	TOTAL ACCESS COMMUNICATION PCL	66,700	49.000	3,268,300.000	
	INDORAMA VENTURES PCL NVDR	166,322	46.000	7,650,812.000	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL- NVDR	210,208	60.750	12,770,136.000	
	ENERGY ABSOLUTE PCL NVDR	164,800	53.750	8,858,000.000	
	BANGKOK EXPRESSWAY & METRO PCL NVDR	612,500	11.300	6,921,250.000	
	GULF ENERGY DEVELOPMENT PCL NVDR	61,800	103.000	6,365,400.000	
	MUANGTHAI CAPITAL PCL NVDR	59,400	53.750	3,192,750.000	
タイ・パーツ 小計		12,030,610		426,967,051.600 (1,460,227,316)	
チェコ・コルナ	KOMERCNI BANKA AS	5,669	873.000	4,949,037.000	
	CEZ	13,157	538.500	7,085,044.500	
	MONETA MONEY BANK AS	62,868	75.500	4,746,534.000	
チェコ・コルナ 小計		81,694		16,780,615.500 (78,701,087)	
チリ・ペソ	BANCO SANTANDER CHILE	5,043,748	49.960	251,985,650.080	
	BANCO DE CREDITO E INVERSIONES	4,816	45,500.000	219,128,000.000	
	BANCO DE CHILE	2,670,286	101.860	271,995,331.960	
	EMPRESAS CMPC SA	93,978	1,885.000	177,148,530.000	
	EMPRESAS COPEC SA	37,352	7,340.200	274,171,150.400	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	13,024	9,599.700	125,026,492.800	
	ENTEL CHILE SA	13,572	6,769.000	91,868,868.000	
	ENEL AMERICAS SA	2,742,103	113.000	309,857,639.000	
	COLBUN SA	554,294	133.500	73,998,249.000	
	AGUAS ANDINAS SA	224,014	391.500	87,701,481.000	
	EMBOTELLADORA ANDINA SA	35,748	2,359.800	84,358,130.400	
	LATAM AIRLINES GROUP SA	30,315	6,220.000	188,559,300.000	
	SOCIEDAD QUIMICA Y MINERA DE CHILE SA	9,147	21,402.000	195,764,094.000	
	SACI FALABELLA	69,528	4,280.000	297,579,840.000	
	ITAU CORPBANCA	13,236,977	5.523	73,107,823.970	
	CENCOSUD SA	122,212	1,290.000	157,653,480.000	
ENEL CHILE SA	2,872,558	64.980	186,658,818.840		
チリ・ペソ 小計		27,773,672		3,066,562,879.450 (467,650,839)	
トルコ・リラ	AKBANK TAS	289,930	5.980	1,733,781.400	
	ANADOLU EFES BIRACILIK VE MALT SANAYII AS	19,724	19.250	379,687.000	

	ARCELIK	18,902	17.420	329,272.840	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	31,766	18.280	580,682.480	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIKALARI TAS	91,528	7.250	663,578.000	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	5,919	55.050	325,840.950	
	KOC HOLDING AS	49,560	16.230	804,358.800	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI AS	54,397	5.200	282,864.400	
	TURK HAVA YOLLARI	49,081	12.490	613,021.690	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	93,118	11.640	1,083,893.520	
	TURKIYE GARANTI BANKASI AS	230,296	7.930	1,826,247.280	
	TURKIYE IS BANKASI	151,063	5.120	773,442.560	
	TUPRAS TURKIYE PETROL RAFINE	10,681	131.000	1,399,211.000	
	HACI OMER SABANCI HOLDING AS	77,665	7.750	601,903.750	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	20,916	79.700	1,667,005.200	
	TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	13,735	25.440	349,418.400	
	トルコ・リラ 小計	1,208,281		13,414,209.270 (248,431,156)	
ハンガリー・フォ ロント	RICHTER GEDEON NYRT	10,134	5,230.000	53,000,820.000	
	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NYRT	40,691	3,276.000	133,303,716.000	
	OTP BANK NYRT	19,509	12,150.000	237,034,350.000	
	ハンガリー・フォロント 小計	70,334		423,338,886.000 (157,736,069)	
パキスタン・ル ビー	MCB BANK LTD	39,000	176.900	6,899,100.000	
	OIL & GAS DEVELOPMENT CO LTD	74,500	136.740	10,187,130.000	
	HABIB BANK LTD	54,400	123.510	6,718,944.000	
	パキスタン・ルビー 小計	167,900		23,805,174.000 (17,615,829)	
フィリピン・ペソ	AYALA LAND INC	678,800	49.500	33,600,600.000	
	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	179,890	55.900	10,055,851.000	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAND	89,510	80.800	7,232,408.000	
	AYALA CORP	24,123	919.000	22,169,037.000	
	ALLIANCE GLOBAL GROUP INC	307,700	15.600	4,800,120.000	
	DMCI HOLDINGS INC	351,850	10.580	3,722,573.000	
	GLOBE TELECOM INC	2,785	2,170.000	6,043,450.000	

	INTERNATIONAL CONTAINER TERM SERVICES INC	91,810	136.000	12,486,160.000	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	245,040	62.600	15,339,504.000	
	JOLLIBEE FOODS CORP	36,330	288.000	10,463,040.000	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	143,447	71.750	10,292,322.250	
	BDO UNIBANK INC	188,813	138.000	26,056,194.000	
	MEGAWORLD CORP	962,000	5.900	5,675,800.000	
	PLDT INC	6,525	1,350.000	8,808,750.000	
	ROBINSONS LAND CORP	218,722	26.000	5,686,772.000	
	SECURITY BANK CORP	23,420	175.000	4,098,500.000	
	SM PRIME HOLDINGS INC	927,675	39.800	36,921,465.000	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	79,130	167.000	13,214,710.000	
	SM INVESTMENTS CORP	23,468	942.000	22,106,856.000	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CORP	1,148,900	4.500	5,170,050.000	
	ABOITIZ POWER CORP	153,700	36.500	5,610,050.000	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	23,430	385.000	9,020,550.000	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	5,927	863.000	5,115,001.000	
フィリピン・ペソ	小計	5,912,995		283,689,763.250 (590,074,708)	
ブラジル・リアル	BRF SA	48,492	27.700	1,343,228.400	
	VALE SA	284,121	49.000	13,921,929.000	
	RAIA DROGASIL SA	21,900	69.420	1,520,298.000	
	TIM PARTICIPACOES SA	76,300	11.000	839,300.000	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	19,250	35.670	686,647.500	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	16,400	34.410	564,324.000	
	BANCO DO BRASIL SA	77,600	51.850	4,023,560.000	
	INVESTIMENTOS ITAU SA	397,460	12.390	4,924,529.400	
	LOJAS AMERICANAS SA	63,874	16.140	1,030,926.360	
	GERDAU SA	104,330	13.870	1,447,057.100	
	CIA BRASILEIRA DE DISTRIBUICAO GRUPO PAO DE ACUCAR	12,306	87.210	1,073,206.260	
	PETROLEO BRASILEIRO SA	267,010	28.230	7,537,692.300	
	PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	26,100	25.550	666,855.000	
	PETROLEO BRASILEIRO SA	374,912	25.550	9,579,001.600	
	KROTON EDUCACIONAL SA	141,468	10.340	1,462,779.120	
	CCR SA	115,620	13.370	1,545,839.400	
	WEG SA	73,972	19.050	1,409,166.600	
	BANCO BRADESCO SA PREF	363,650	37.000	13,455,050.000	
	BANCO BRADESCO SA	100,441	32.650	3,279,398.650	
	NATURA COSMETICOS SA	19,000	59.980	1,139,620.000	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	47,606	16.540	787,403.240	
	SUZANO SA	50,475	32.080	1,619,238.000	

	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	429,647	35.000	15,037,645.000	
	PORTO SEGURO SA	8,800	53.000	466,400.000	
	B2W CIA DIGITAL	16,200	31.400	508,680.000	
	BRASKEM SA	15,730	42.780	672,929.400	
	ENGIE BRASIL SA	15,487	46.320	717,357.840	
	LOCALIZA RENT A CAR	50,980	38.040	1,939,279.200	
	TELEFONICA BRASIL S.A.	40,528	48.050	1,947,370.400	
	LOJAS RENNER SA	74,737	44.040	3,291,417.480	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	71,504	20.680	1,478,702.720	
	COSAN SA	12,000	47.140	565,680.000	
	EQUATORIAL ENERGIA SA	17,100	86.150	1,473,165.000	
	EMBRAER SA	69,460	18.950	1,316,267.000	
	M DIAS BRANCO SA	10,400	38.690	402,376.000	
	BR MALLS PARTICIPACOES SA	88,965	12.810	1,139,641.650	
	JBS SA	89,900	21.860	1,965,214.000	
	CIA ENERGETICA DE MINAS GERAIS	90,649	14.760	1,337,979.240	
	CIA DE SANEAMENTO BASICO DO ESTADO DE SAO PAULO	32,798	44.210	1,449,999.580	
	MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS IMOBILIARIOS SA	23,340	24.840	579,765.600	
	SUL AMERICA SA	17,869	34.910	623,806.790	
	HYPERA SA	29,600	30.220	894,512.000	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BAICAO	188,116	36.570	6,879,402.120	
	MAGAZINE LUIZA SA	6,200	196.000	1,215,200.000	
	BANCO SANTANDER BRASIL SA	37,500	45.700	1,713,750.000	
	ENERGISA SA	18,800	45.010	846,188.000	
	CIELO SA	111,307	6.700	745,756.900	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	65,000	29.840	1,939,600.000	
	NOTRE DAME INTERMEDICA PARTICIPACOES SA	27,500	41.000	1,127,500.000	
	ATACADAO DISTRIBUICAO COMERCIO E INDUSTRIA LTDA	27,000	23.150	625,050.000	
	AMBEV SA	419,695	17.550	7,365,647.250	
	KLABIN SA	67,600	15.550	1,051,180.000	
	RUMO SA	103,300	19.360	1,999,888.000	
	IRB BRASIL RESSEGUROS S/A	13,500	101.880	1,375,380.000	
	BANCO BTG PACTUAL SA	16,700	46.730	780,391.000	
ブラジル・リアル	小計	5,010,199		139,330,172.100 (3,846,906,051)	
ポーランド・ズロチ	BANK MILLENNIUM SA	49,782	9.570	476,413.740	

	MBANK	1,644	402.600	661,874.400	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	12,732	95.000	1,209,540.000	
	BANK PEKAO SA	15,704	106.250	1,668,550.000	
	ORANGE POLSKA SA	58,600	5.150	301,790.000	
	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	27,274	96.780	2,639,577.720	
	LPP SA	110	7,335.000	806,850.000	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	3,375	365.200	1,232,550.000	
	CD PROJEKT RED SA	6,332	207.800	1,315,789.600	
	POWSZECHNA KASA OSZCZEDNOSCI BANK POLSKI SA	75,449	39.300	2,965,145.700	
	CCC SA	2,763	156.700	432,962.100	
	GRUPA LOTOS SA	6,865	87.820	602,884.300	
	POLSKIE GORNICtwo NAFTOWE I GAZOWNICTWO SA	140,134	5.600	784,750.400	
	CYFROWY POLSAT SA	23,495	26.100	613,219.500	
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	70,529	9.230	650,982.670	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZEN SA	54,011	41.430	2,237,675.730	
	JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA SA	5,380	50.200	270,076.000	
	ALIOR BANK SA	11,052	52.800	583,545.600	
	DINO POLSKA SA	3,444	124.400	428,433.600	
	ポーランド・ズロチ 小計	568,675		19,882,611.060 (562,280,241)	
マレーシア・リン ギット	AMMB HOLDINGS BHD	134,500	4.430	595,835.000	
	GENTING PLANTATIONS BHD	13,100	10.360	135,716.000	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	422,100	5.270	2,224,467.000	
	DIGI.COM BHD	286,300	4.970	1,422,911.000	
	MALAYSIA AIRPORTS HOLDINGS BHD	115,020	7.340	844,246.800	
	RHB BANK BHD	77,780	5.830	453,457.400	
	HAP SENG CONSOLIDATED BHD	41,300	9.900	408,870.000	
	TOP GLOVE CORP BHD	170,700	5.050	862,035.000	
	GAMUDA BHD	124,000	3.490	432,760.000	
	GENTING BHD	188,000	6.390	1,201,320.000	
	YTL CORP BHD	283,710	1.140	323,429.400	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP BHD	20,256	18.980	384,458.880	
	HONG LEONG BANK BHD	50,408	19.000	957,752.000	
	IJM CORP BHD	230,360	2.220	511,399.200	
	IOI CORP BHD	219,613	4.310	946,532.030	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	35,400	24.800	877,920.000	
	FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	12,800	34.200	437,760.000	

	MALAYAN BANKING BHD	315,575	9.020	2,846,486.500	
	ALLIANCE BANK MALAYSIA BHD	88,400	3.850	340,340.000	
	MISC BHD	90,280	6.950	627,446.000	
	NESTLE MALAYSIA BHD	6,800	147.000	999,600.000	
	PPB GROUP BHD	47,560	18.780	893,176.800	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	19,600	25.760	504,896.000	
	PETRONAS GAS BHD	60,400	17.660	1,066,664.000	
	GENTING MALAYSIA BHD	294,200	3.140	923,788.000	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD	14,700	30.000	441,000.000	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	103,400	3.610	373,274.000	
	SP SETIA BHD	136,700	2.190	299,373.000	
	TENAGA NASIONAL BHD	284,250	12.700	3,609,975.000	
	QL RESOURCES BHD	53,800	6.840	367,992.000	
	DIALOG GROUP BHD	336,644	3.320	1,117,658.080	
	PUBLIC BANK BHD(LLOCAL)	272,230	23.600	6,424,628.000	
	AIRASIA GROUP BHD	147,900	2.890	427,431.000	
	SIME DARBY BERHAD	259,100	2.320	601,112.000	
	HARTALEGA HOLDINGS BHD	117,100	5.200	608,920.000	
	AXIATA GROUP BERHAD	246,200	4.690	1,154,678.000	
	MAXIS BHD	201,200	5.540	1,114,648.000	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	213,400	8.320	1,775,488.000	
	IHH HEALTHCARE BHD	238,500	5.500	1,311,750.000	
	WESTPORTS HOLDINGS BHD	64,500	3.880	250,260.000	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDINGS BHD	124,000	4.480	555,520.000	
	SIME DARBY PROPERTY BHD	232,700	1.060	246,662.000	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	178,300	4.660	830,878.000	
	マレーシア・リンギット 小計	6,572,786		42,734,514.090 (1,105,541,879)	
メキシコ・ペソ	ALFA SAB DE CV	264,100	17.890	4,724,749.000	
	EL PUERTO DE LIVERPOOL SAB DE CV	13,600	109.720	1,492,192.000	
	GRUPO TELEVISA SAB	233,900	36.500	8,537,350.000	
	GRUPO BIMBO SAB DE CV	124,900	39.550	4,939,795.000	
	GRUMA SAB DE CV	21,340	186.910	3,988,659.400	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INFRAESTRUCTURA	20,260	190.810	3,865,810.600	
	GRUPO CARSO SAB DE CV	37,600	72.130	2,712,088.000	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE SAB DE CV	236,200	106.590	25,176,558.000	
	MEXICHEM SAB DE CV	94,025	41.010	3,855,965.250	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	14,295	219.310	3,135,036.450	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO SAB DE CV	134,300	35.350	4,747,505.000	

	ALSEA SAB DE CV	43,700	38.290	1,673,273.000	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL SURESTE SAB DE CV	21,020	309.430	6,504,218.600	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV	322,652	48.910	15,780,909.320	
	AMERICA MOVIL SAB DE CV	3,017,678	13.790	41,613,779.620	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA SA	176,800	26.000	4,596,800.000	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	31,600	104.750	3,310,100.000	
	WAL-MART DE MEXICO SAB DE CV	468,500	55.310	25,912,735.000	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL PACIFICO SAB DE CV	35,600	191.790	6,827,724.000	
	MEGACABLE HOLDINGS SAB DE CV	27,400	80.910	2,216,934.000	
	INFRAESTRUCTURA ENERGETICA NOVA SAB DE CV	53,000	79.800	4,229,400.000	
	BANCO SANTANDER MEXICO SA	154,590	28.700	4,436,733.000	
	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	39,700	122.220	4,852,134.000	
メキシコ・ペソ 小計		5,586,760		189,130,449.240 (1,044,000,079)	
ユーロ	ALPHA BANK A.E.	99,133	1.690	167,534.770	
	NATIONAL BANK OF GREECE	48,905	2.368	115,807.040	
	TITAN CEMENT CO. S.A.	4,089	18.200	74,419.800	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	24,457	12.250	299,598.250	
	FF GROUP	3,130	2.400	7,512.000	
	EUROBANK ERGASIAS	221,515	0.875	193,825.620	
	MOTOR OIL HELLAS CORINTH REFIN	5,847	22.800	133,311.600	
	OPAP SA	19,846	9.375	186,056.250	
	JUMBO SA	8,952	15.900	142,336.800	
ユーロ 小計		435,874		1,320,402.130 (159,900,698)	
韓国・ウォン	CHEIL WORLDWIDE INC	5,553	26,400.000	146,599,200.000	
	HANMI SCIENCE CO LTD	1,187	68,900.000	81,784,300.000	
	HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	3,124	85,700.000	267,726,800.000	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANC	2,645	271,000.000	716,795,000.000	
	DB INSURANCE CO LTD	5,027	61,500.000	309,160,500.000	
	WOONGJIN COWAY CO LTD	4,918	80,100.000	393,931,800.000	
	KT&G CORP	10,002	101,000.000	1,010,202,000.000	
	S-1 CORPORATION	1,444	96,000.000	138,624,000.000	
	KOREA GAS CORP	2,469	41,300.000	101,969,700.000	
	CJ CORP	1,188	101,500.000	120,582,000.000	
	KAKAO CORP	4,647	124,500.000	578,551,500.000	

CJ ENM CO LTD	791	191,600.000	151,555,600.000	
DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE	2,634	29,800.000	78,493,200.000	
SK TELECOM CO LTD	1,876	250,500.000	469,938,000.000	
DAELIM INDUSTRIAL CO	2,948	103,500.000	305,118,000.000	
MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD	33,940	7,460.000	253,192,400.000	
NCSOFT CORPORATION	1,419	477,000.000	676,863,000.000	
LG UPLUS CORP	9,656	13,950.000	134,701,200.000	
DAEWOO ENGINEERING & CONSTRUCT	13,540	4,805.000	65,059,700.000	
POSCO INTERNATIONAL CORP	3,600	17,200.000	61,920,000.000	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD	848	1,278,000.000	1,083,744,000.000	
LG CHEM LTD	4,129	333,000.000	1,374,957,000.000	
LG CHEM LTD	726	194,000.000	140,844,000.000	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD	201	729,000.000	146,529,000.000	
SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD	40,328	44,450.000	1,792,579,600.000	
S-OIL CORP	4,486	83,500.000	374,581,000.000	
HANWHA CHEMICAL CORPORATION	8,289	20,650.000	171,167,850.000	
MERITZ SECURITIES CO LTD	33,835	4,700.000	159,024,500.000	
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	4,354	35,350.000	153,913,900.000	
POSCO CHEMICAL CO LTD	2,126	54,400.000	115,654,400.000	
LOTTE CHEMICAL CORPORATION	1,654	258,000.000	426,732,000.000	
HOTEL SHILLA CO LTD	2,355	94,600.000	222,783,000.000	
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	3,478	117,500.000	408,665,000.000	
HYUNDAI MOBIS	6,157	217,000.000	1,336,069,000.000	
SK HYNIX INC	49,053	65,300.000	3,203,160,900.000	
HYUNDAI ENGINEERING & CONSTRUCTION CO LTD	6,166	51,400.000	316,932,400.000	
HYUNDAI MOTOR CO	1,954	78,400.000	153,193,600.000	
HYUNDAI MOTOR CO	13,518	134,500.000	1,818,171,000.000	
HYUNDAI STEEL CO	7,953	40,800.000	324,482,400.000	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	23,732	13,850.000	328,688,200.000	
KCC CORP	700	258,000.000	180,600,000.000	
KIA MOTORS CORP	23,760	39,350.000	934,956,000.000	
KOREA ZINC CO LTD	733	437,000.000	320,321,000.000	
KOREA ELECTRIC POWER CORP	24,243	26,000.000	630,318,000.000	
HANWHA CORP	3,785	25,550.000	96,706,750.000	
KOREAN AIR CO LTD	4,387	31,550.000	138,409,850.000	
OCI COMPANY LTD	1,315	90,300.000	118,744,500.000	
CJ LOGISTICS	985	159,500.000	157,107,500.000	

KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	1,509	95,800.000	144,562,200.000	
HLB INC	2,994	70,200.000	210,178,800.000	
LG ELECTRONICS INC	8,648	78,600.000	679,732,800.000	
LOTTE CORP	2,810	42,200.000	118,582,000.000	
LG CORP	8,976	73,300.000	657,940,800.000	
NH INVESTMENT & SECURITIES CO LTD	13,362	13,500.000	180,387,000.000	
GS ENGINEERING & CONSTRUCTION	4,436	40,150.000	178,105,400.000	
NAVER CORP	12,715	111,500.000	1,417,722,500.000	
HYUNDAI DEPARTMENT STORE CO LTD	1,249	84,600.000	105,665,400.000	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO LTD	3,607	72,400.000	261,146,800.000	
OTTOGI CORP	112	711,000.000	79,632,000.000	
AMOREPACIFIC GROUP	2,018	64,800.000	130,766,400.000	
KANGWON LAND INC	11,398	31,050.000	353,907,900.000	
POSCO	7,052	237,500.000	1,674,850,000.000	
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	11,773	16,700.000	196,609,100.000	
SAMSUNG SDI CO LTD	4,974	218,500.000	1,086,819,000.000	
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO LTD	5,188	95,200.000	493,897,600.000	
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	427,247	42,500.000	18,157,997,500.000	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES CO LTD	43,514	7,850.000	341,584,900.000	
SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	73,481	34,800.000	2,557,138,800.000	
SHINSEGAE CO LTD	646	298,000.000	192,508,000.000	
YUHAN CORP	750	247,500.000	185,625,000.000	
HANON SYSTEMS	13,526	11,600.000	156,901,600.000	
HYUNDAI MARINE & FIRE INSURANCE CO LTD	5,667	30,750.000	174,260,250.000	
GS HOLDINGS CORP	5,020	50,100.000	251,502,000.000	
LG DISPLAY CO LTD	22,144	17,100.000	378,662,400.000	
CELLTRION INC	8,093	190,000.000	1,537,670,000.000	
HELIXMITH CO LTD	1,190	194,800.000	231,812,000.000	
HANA FINANCIAL GROUP	27,193	36,300.000	987,105,900.000	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	1,420	162,500.000	230,750,000.000	
CELLTRION PHARM INC	1,457	51,100.000	74,452,700.000	
LOTTE SHOPPING CO	1,003	160,000.000	160,480,000.000	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LTD	6,537	80,800.000	528,189,600.000	
AMOREPACIFIC CORP	2,810	179,000.000	502,990,000.000	
AMOREPACIFIC CORP-PREF	1,184	99,600.000	117,926,400.000	
SAMSUNG CARD CO	2,877	36,800.000	105,873,600.000	
SK INNOVATION CO LTD	4,940	165,000.000	815,100,000.000	
CJ CHEILJEDANG CORP	705	280,500.000	197,752,500.000	

	STX PAN OCEAN CO LTD	18,395	4,335.000	79,742,325.000	
	LG INNOTEK CO LTD	999	94,700.000	94,605,300.000	
	SK HOLDINGS CO LTD	3,262	231,500.000	755,153,000.000	
	KB FINANCIAL GROUP INC	35,738	43,800.000	1,565,324,400.000	
	MEDY-TOX INC	320	448,200.000	143,424,000.000	
	KOREA AEROSPACE INDUSTRIES LTD	6,602	33,150.000	218,856,300.000	
	BNK FINANCIAL GROUP INC	28,752	6,900.000	198,388,800.000	
	HANMI PHARM CO LTD	695	408,500.000	283,907,500.000	
	HANWHA LIFE INSURANCE CO LTD	11,369	3,210.000	36,494,490.000	
	FILA KOREA LTD	4,708	78,000.000	367,224,000.000	
	E-MART CO LTD	2,077	144,000.000	299,088,000.000	
	GS RETAIL CO LTD	2,482	34,000.000	84,388,000.000	
	HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO LTD	6,590	35,000.000	230,650,000.000	
	HDC HYUNDAI DEVELOPMENT CO-ENGINEERING & CONSTRUCTION	2,482	42,850.000	106,353,700.000	
	HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOLDINGS CO LTD	863	316,000.000	272,708,000.000	
	BGF RETAIL CO LTD	631	186,500.000	117,681,500.000	
	ORION CORP REPUBLIC OF KOREA	2,506	86,000.000	215,516,000.000	
	ORANGE LIFE INSURANCE LTD	2,763	36,300.000	100,296,900.000	
	NETMARBLE CORP	2,531	114,500.000	289,799,500.000	
	WOORI FINANCIAL GROUP INC	43,879	13,900.000	609,918,100.000	
	SAMSUNG SDS CO LTD	3,225	207,000.000	667,575,000.000	
	SAMSUNG C&T CORP	7,422	92,300.000	685,050,600.000	
	SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	1,301	300,000.000	390,300,000.000	
	PEARL ABYSS CORP	534	197,700.000	105,571,800.000	
	DOOSAN BOBCAT INC	3,636	33,700.000	122,533,200.000	
	SILLAJEN INC	5,857	55,000.000	322,135,000.000	
	CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	3,789	56,900.000	215,594,100.000	
	韓国・ウォン 小計	1,345,491		67,126,872,615.000 (6,128,683,470)	
香港・ドル	JIANGXI COPPER CO LTD	124,000	9.790	1,213,960.000	
	JIANGSU EXPRESS	124,000	10.920	1,354,080.000	
	CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD	220,000	5.040	1,108,800.000	
	ANGANG STEEL CO LTD-H	135,200	3.530	477,256.000	
	CHINA MOBILE LIMITED	544,500	68.450	37,271,025.000	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	102,000	45.800	4,671,600.000	
	DATANG INTERNATIONAL POWER GEN	430,000	1.960	842,800.000	

BEIJING ENTERPRISES	43,000	39.400	1,694,200.000	
HUANENG POWER INTERNATIONAL IN	328,000	4.940	1,620,320.000	
ALIBABA HEALTH INFORMATION TECHNOLOGY	356,000	7.430	2,645,080.000	
YANZHOU COAL MINING CO LTD	172,000	7.370	1,267,640.000	
HENGAN INTERNATIONAL GROUP	66,500	57.500	3,823,750.000	
HUADIAN POWER INTL CORP- H	144,000	3.250	468,000.000	
CHINA EASTERN AIRLINES CORP LT	124,000	4.310	534,440.000	
CNOOC LTD	1,591,000	12.780	20,332,980.000	
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	298,000	7.980	2,378,040.000	
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LTD	438,000	12.640	5,536,320.000	
CHINA OVERSEAS LAND & INVESTME	345,120	27.200	9,387,264.000	
CHINA RESOURCES LAND LTD	252,888	31.900	8,067,127.200	
CITIC LTD	508,000	10.640	5,405,120.000	
BEIJING CAPITAL INTERNATIONAL	162,000	6.630	1,074,060.000	
LENOVO GROUP LTD	666,000	5.450	3,629,700.000	
PETRO CHINA CO LTD	1,844,000	4.380	8,076,720.000	
CHINA UNICOM HONG KONG LTD	564,742	8.270	4,670,416.340	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS CO LTD	148,990	20.150	3,002,148.500	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL COR	2,251,200	5.220	11,751,264.000	
TONG REN TANG TECHNOLOGIES CO	86,000	10.040	863,440.000	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	72,000	16.240	1,169,280.000	
KINGDEE INTERNATIONAL SOFTWARE GROUP CO LTD	185,000	8.730	1,615,050.000	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	73,000	70.500	5,146,500.000	
KUNLUN ENERGY COMPANY LTD	312,000	7.220	2,252,640.000	
TOWNGAS CHINA CO LTD	91,000	5.910	537,810.000	
COSCO SHIPPING PORTS LTD	152,000	7.620	1,158,240.000	
YUEXIU PROPERTY CO LTD	634,000	1.780	1,128,520.000	
CHINA MERCHANTS PORT HOLDINGS CO LTD	130,000	13.720	1,783,600.000	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	374,000	2.820	1,054,680.000	
CHINA DING YI FENG HOLDINGS LTD	80,000	23.100	1,848,000.000	

SHENZHEN INTERNATIONAL HOLDING	81,000	13.780	1,116,180.000	
CHINA EVERBRIGHT LTD	78,000	12.540	978,120.000	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	167,400	25.200	4,218,480.000	
KINGBOARD HOLDINGS LTD	63,500	20.600	1,308,100.000	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LTD	431,000	12.860	5,542,660.000	
SHENZHEN INVESTMENT LTD	414,000	2.890	1,196,460.000	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LTD	70,000	37.550	2,628,500.000	
BYD CO LTD	65,500	45.900	3,006,450.000	
CHINA TELECOM CORP LTD	1,234,000	3.940	4,861,960.000	
CHINA OILFIELD SERVICES LTD	134,000	7.010	939,340.000	
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	1,470,000	1.630	2,396,100.000	
SINOTRANS LTD	190,000	2.880	547,200.000	
MAANSHAN IRON & STEEL	172,000	3.340	574,480.000	
CHINA EVERBRIGHT INTERNATIONAL	337,592	7.420	2,504,932.640	
MMG LTD	220,000	2.390	525,800.000	
LEE & MAN PAPER MANUFACTURING LTD	136,000	5.100	693,600.000	
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	623,788	8.470	5,283,484.360	
AVICHINA INDUSTRY & TECHNOLOGY	189,000	4.450	841,050.000	
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS	159,200	11.420	1,818,064.000	
GREAT WALL MOTOR COMPANY LTD	246,000	5.700	1,402,200.000	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	679,000	18.200	12,357,800.000	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD	547,000	2.770	1,515,190.000	
CHINA ORIENTAL GROUP CO LTD	70,000	4.550	318,500.000	
SHANDONG WEIGAO GROUP MEDICAL-H	176,000	6.820	1,200,320.000	
SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	296,200	9.430	2,793,166.000	
WEICHAJ POWER CO LTD	137,440	11.920	1,638,284.800	
CHINA SHIPPING DEVELOPMENT CO	100,000	4.100	410,000.000	
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEMICAL	287,000	3.420	981,540.000	
SHANGHAI INDUSTRIAL	58,000	16.340	947,720.000	
TINGYI HOLDING CORP	194,000	12.740	2,471,560.000	
TSINGTAO BREWERY CO LTD	40,000	47.650	1,906,000.000	

GUANGDONG INVESTMENTS LTD	266,000	15.420	4,101,720.000	
CHINA TRADITIONAL CHINESE MEDICINE HOLDINGS CO LTD	208,000	4.140	861,120.000	
CHINA RESOURCES BEER HOLDINGS	137,333	34.300	4,710,521.900	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO LTD	166,000	8.190	1,359,540.000	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	652,500	7.910	5,161,275.000	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	254,000	28.650	7,277,100.000	
TENCENT HOLDINGS LTD	511,900	326.000	166,879,400.000	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	493,500	86.600	42,737,100.000	
LI NING CO LTD	177,000	12.980	2,297,460.000	
BEIJING ENTERPRISES WATER GROUP LTD	554,000	4.170	2,310,180.000	
GOME RETAIL HOLDINGS LTD	970,240	0.770	747,084.800	
CHINA POWER INTERNATIONAL	350,000	2.030	710,500.000	
AIR CHINA / HONG KONG	164,000	7.270	1,192,280.000	
ZTE CORP	57,288	18.860	1,080,451.680	
SHANGHAI ELECTRIC GROUP CO LTD	250,000	2.770	692,500.000	
CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD	322,000	16.100	5,184,200.000	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO LTD	248,500	2.890	718,165.000	
BANK OF COMMUNICATIONS	704,205	6.140	4,323,818.700	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT HOLDINGS LTD	150,250	8.030	1,206,507.500	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	70,500	41.700	2,939,850.000	
CHINA CONSTRUCTION BANK	8,583,530	6.200	53,217,886.000	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP HOLDINGS LTD	69,800	92.450	6,453,010.000	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	232,000	6.460	1,498,720.000	
AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	120,000	9.930	1,191,600.000	
SSY GROUP LTD	104,000	6.230	647,920.000	
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS LTD	180,000	6.250	1,125,000.000	
CHINA NATIONAL BLDG MATERIAL	382,000	6.030	2,303,460.000	
BANK OF CHINA LTD	6,952,200	3.250	22,594,650.000	
SHUI ON LAND LTD	335,500	1.780	597,190.000	
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	111,000	22.450	2,491,950.000	

GUANGZHOU R&F PROPERTIES CO LTD	80,000	14.840	1,187,200.000	
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	335,470	37.750	12,663,992.500	
IND & COMM BK OF CHINA - H	5,827,235	5.600	32,632,516.000	
ZHAOJIN MINING INDUSTRY CO LTD	96,000	7.200	691,200.000	
KINGBOARD LAMINATES HOLDING	104,000	6.690	695,760.000	
CHINA COMMUNICATIONS SERVICES	179,600	5.870	1,054,252.000	
CHINA COMMUNICATIONS CONSTRUCTION CO LTD	427,000	6.970	2,976,190.000	
CHINA COAL ENERGY CO	178,000	3.200	569,600.000	
HAITIAN INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	54,000	15.500	837,000.000	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC CO LTD	61,100	42.200	2,578,420.000	
HAIER ELECTRONICS GROUP CO LTD	130,000	19.980	2,597,400.000	
CHINA AGRI-INDUSTRIES HOLDINGS LTD	191,000	2.370	452,670.000	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD	697,142	10.600	7,389,705.200	
CHINA MOLYBDENUM CO LTD	369,000	2.460	907,740.000	
CHINA CITIC BANK-H	793,800	4.450	3,532,410.000	
KWG GROUP HOLDINGS LTD	121,000	7.870	952,270.000	
SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	66,900	66.850	4,472,265.000	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	92,000	48.000	4,416,000.000	
FOSUN INTERNATIONAL	243,028	10.120	2,459,443.360	
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP LTD	522,000	4.530	2,364,660.000	
CHINA AOYUAN PROPERTY GROUP LTD	111,000	8.470	940,170.000	
SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD	253,500	3.130	793,455.000	
SOHO CHINA LTD	172,500	2.450	422,625.000	
KINGSOFT CORP LTD	61,000	21.600	1,317,600.000	
SINOTRUK HONG KONG LTD	64,500	14.860	958,470.000	
CHINA RAILWAY GROUP LTD	288,000	5.860	1,687,680.000	
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS LTD	122,000	8.330	1,016,260.000	
BYD ELECTRONIC INTERNATIONAL CO LTD	52,500	10.320	541,800.000	
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION CORP	165,000	9.170	1,513,050.000	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	478,000	5.590	2,672,020.000	

CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	223,200	29.000	6,472,800.000	
CHINA EVERGRANDE GROUP	153,000	20.850	3,190,050.000	
CRRG CORP LTD - H	342,450	6.720	2,301,264.000	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDINGS LTD	126,000	6.900	869,400.000	
SUN ART RETAIL GROUP LTD	211,500	6.840	1,446,660.000	
BBMG CORP	222,000	2.370	526,140.000	
CHINA ZHONGWANG HOLDINGS LTD	145,200	3.740	543,048.000	
SINOPHARM GROUP CO	115,600	29.450	3,404,420.000	
CHINA RESOURCES CEMENT	190,000	6.800	1,292,000.000	
METALLURGICAL CORP OF CHINA LTD	489,000	2.090	1,022,010.000	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD	294,527	7.560	2,226,624.120	
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	199,500	5.670	1,131,165.000	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL BANK	181,000	4.010	725,810.000	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP CORP	272,000	4.950	1,346,400.000	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD	48,200	15.480	746,136.000	
HUANENG RENEWABLES CORP LTD	330,000	2.120	699,600.000	
SIHUAN PHARMACEUTICAL HOLDINGS GROUP LTD	244,000	1.760	429,440.000	
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	225,000	33.800	7,605,000.000	
YUZHOU PROPERTIES CO LTD	166,000	3.570	592,620.000	
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	149,000	28.750	4,283,750.000	
NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	80,000	36.400	2,912,000.000	
CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	555,656	5.700	3,167,239.200	
KAISA GROUP HOLDINGS LTD	203,000	3.260	661,780.000	
XINJIANG GOLDWIND SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	55,200	8.250	455,400.000	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD	322,000	3.540	1,139,880.000	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA	2,567,000	3.360	8,625,120.000	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS LTD	39,500	19.740	779,730.000	
FAR EAST HORIZON LTD	229,000	8.350	1,912,150.000	
CITIC SECURITIES CO LTD	201,500	14.280	2,877,420.000	
FUTURE LAND DEVELOPMENT HOLDINGS LTD	132,000	8.550	1,128,600.000	

HAITONG SECURITIES CO LTD	325,200	8.040	2,614,608.000	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROUP OF CHINA LTD	629,000	3.080	1,937,320.000	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	31,000	23.050	714,550.000	
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	262,000	4.690	1,228,780.000	
SINOPEC ENGINEERING GROUP CO LTD	121,500	6.380	775,170.000	
CHINA GALAXY SECURITIES CO LTD	392,000	4.210	1,650,320.000	
HANERGY THIN FILM POWER GROUP	986,000	0.000	0.000	
NEXTEER AUTOMOTIVE GROUP LTD	85,000	9.600	816,000.000	
CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS CO LTD	323,000	0.000	0.000	
GREENTOWN SERVICE GROUP CO LTD	96,000	6.170	592,320.000	
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO LTD	59,800	13.380	800,124.000	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA CO LTD	634,000	4.690	2,973,460.000	
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING LTD	35,000	38.750	1,356,250.000	
GENSCRIPT BIOTECH CORP	74,000	16.940	1,253,560.000	
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLDINGS CO LTD	93,000	16.080	1,495,440.000	
CHINA FIRST CAPITAL GROUP LTD	308,000	2.400	739,200.000	
CHINA EDUCATION GROUP HOLDINGS LTD	65,000	12.080	785,200.000	
CHINA TOWER CORP LTD	3,836,000	1.760	6,751,360.000	
XIAOMI CORP	330,200	9.580	3,163,316.000	
WUXI APPTTEC CO LTD	11,500	85.850	987,275.000	
MEITUAN DIANPING	92,200	60.550	5,582,710.000	
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	276,000	4.300	1,186,800.000	
CHINA CINDA ASSET MANAGEMENT CO LTD	796,000	1.820	1,448,720.000	
LOGAN PROPERTY HOLDINGS CO LTD	102,000	11.580	1,181,160.000	
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS LTD	159,000	25.450	4,046,550.000	
CHINA VANKE CO LTD-H	121,061	27.750	3,359,442.750	
LUYE PHARMA GROUP LTD	108,000	5.900	637,200.000	
HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	39,000	16.480	642,720.000	
CGN POWER CO LTD	749,000	2.160	1,617,840.000	

	FULLSHARE HOLDINGS LTD	490,000	0.730	357,700.000	
	BAIC MOTOR CORP LTD	163,500	4.850	792,975.000	
	GF SECURITIES CO LTD	112,000	8.940	1,001,280.000	
	FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD	60,400	23.400	1,413,360.000	
	HUATAI SECURITIES CO LTD	124,800	12.420	1,550,016.000	
	3SBIO INC	109,500	12.780	1,399,410.000	
	LEGEND HOLDINGS CORP	31,500	18.920	595,980.000	
	CHINA RESOURCES PHARMACEUTICAL GROUP LTD	133,000	10.240	1,361,920.000	
	CHINA HUARONG ASSET MANAGEMENT CO LTD	904,000	1.330	1,202,320.000	
	CHINA LITERATURE LTD	24,000	30.200	724,800.000	
	DALI FOODS GROUP CO LTD	188,000	5.610	1,054,680.000	
	CHINA RAILWAY SIGNAL & COMMUNICATION CORP LTD	141,000	5.160	727,560.000	
	CHINA REINSURANCE GROUP CORP	525,000	1.430	750,750.000	
	MEITU INC	152,500	2.650	404,125.000	
	BOC AVIATION LTD	21,900	65.350	1,431,165.000	
	ZHONGAN ONLINE P&C INSURANCE CO LTD	23,000	22.400	515,200.000	
	CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CORP LTD	96,000	14.240	1,367,040.000	
	WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	48,500	74.100	3,593,850.000	
	HENGTEN NETWORKS GROUP LTD	2,096,000	0.194	406,624.000	
	香港・ドル 小計	84,648,375		811,192,904.550 (11,210,685,941)	
台湾・ドル	ACER INC	220,532	19.050	4,201,134.600	
	ASUSTEK COMPUTER INC	64,554	217.000	14,008,218.000	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	46,616	200.000	9,323,200.000	
	ASIA CEMENT CORP	164,928	45.100	7,438,252.800	
	WALSIN TECHNOLOGY CORP	24,000	159.000	3,816,000.000	
	TAIWAN BUSINESS BANK	286,457	12.950	3,709,618.150	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMICONDUCTOR CORP	66,000	60.300	3,979,800.000	
	MICRO-STAR INTERNATIONAL CO LTD	51,000	82.600	4,212,600.000	
	CHICONY ELECTRONICS CO LTD	54,975	74.900	4,117,627.500	
	QUANTA COMPUTER INC	245,858	58.900	14,481,036.200	
	HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	58,070	48.800	2,833,816.000	
	EVA AIRWAYS CORP	196,269	15.050	2,953,848.450	
	CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	61,760	192.000	11,857,920.000	

CHANG HWA COMMERCIAL BANK	571,345	19.950	11,398,332.750	
CHINA AIRLINES	232,156	9.740	2,261,199.440	
CHENG SHIN RUBBER INDUSTRY CO	161,169	40.100	6,462,876.900	
CHINA STEEL CORP	1,074,058	24.300	26,099,609.400	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD/TAIWAN	278,994	24.400	6,807,453.600	
ADVANTECH CO LTD	29,889	265.000	7,920,585.000	
COMPAL ELECTRONICS INC	423,304	19.650	8,317,923.600	
DELTA ELECTRONICS INC	176,663	142.500	25,174,477.500	
NANYA TECHNOLOGY CORP	114,000	61.600	7,022,400.000	
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	324,327	112.500	36,486,787.500	
AU OPTRONICS CORP	742,194	9.300	6,902,404.200	
TAIWAN MOBILE CO LTD	140,800	118.000	16,614,400.000	
EVERGREEN MARINE CORP	198,276	12.100	2,399,139.600	
FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	319,824	32.800	10,490,227.200	
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	24,825	239.000	5,933,175.000	
ECLAT TEXTILE CO LTD	15,322	410.500	6,289,681.000	
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	56,285	167.500	9,427,737.500	
FORMOSA PLASTICS CORP	401,633	110.500	44,380,446.500	
FORMOSA TAFFETA CO LTD	60,000	38.900	2,334,000.000	
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE CO	318,594	107.500	34,248,855.000	
GIANT MANUFACTURING	24,151	224.500	5,421,899.500	
MEDIATEK INC	136,507	311.000	42,453,677.000	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD	601,936	43.250	26,033,732.000	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	720,232	20.950	15,088,860.400	
HOTAI MOTOR CO LTD	26,000	506.000	13,156,000.000	
FAR EASTONE TELECOMMUNICATIONS CO LTD	155,000	78.500	12,167,500.000	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	953,141	17.750	16,918,252.750	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	652,920	40.800	26,639,136.000	
CHINA DEPT FINANCIAL HOLDING	1,301,403	9.300	12,103,047.900	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO LTD	849,168	27.400	23,267,203.200	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	1,115,225	73.900	82,415,127.500	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LTD	924,495	31.000	28,659,345.000	
LARGAN PRECISION CO LTD	8,220	3,770.000	30,989,400.000	

TAISHIN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	769,589	14.100	10,851,204.900	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING CO	1,071,061	8.780	9,403,915.580	
INVENTEC CO LTD	206,005	23.800	4,902,919.000	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	184,845	45.100	8,336,509.500	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	1,013,443	12.250	12,414,676.750	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,667,048	20.950	34,924,655.600	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO LTD	908,220	22.600	20,525,772.000	
POWERTECH TECHNOLOGY INC	61,560	74.300	4,573,908.000	
NAN YA PLASTICS CORP	466,828	78.500	36,645,998.000	
WISTRON CORP	213,916	22.500	4,813,110.000	
POU CHEN CORP	180,990	35.850	6,488,491.500	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CORP	443,297	81.300	36,040,046.100	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	52,392	301.000	15,769,992.000	
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	113,480	116.000	13,163,680.000	
PHISON ELECTRONICS CORP	12,658	286.000	3,620,188.000	
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	73,393	40.900	3,001,773.700	
RUENTEX INDUSTRIES LTD	33,829	69.200	2,340,966.800	
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	103,588	61.500	6,370,662.000	
STANDARD FOODS CORP	34,639	60.600	2,099,123.400	
SYNNEX TECHNOLOGY INTERNATIONAL CORP	116,899	38.250	4,471,386.750	
TAIWAN CEMENT CORP	421,561	42.900	18,084,966.900	
TATUNG CO LTD	164,000	21.750	3,567,000.000	
TAIWAN SEMICONDUCTOR	2,200,083	235.500	518,119,546.500	
UNITED MICROELECTRONICS CORP	1,118,525	12.900	14,428,972.500	
WINBOND ELECTRONICS CORP	219,000	14.250	3,120,750.000	
YAGEO CORP	20,160	261.000	5,261,760.000	
TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	163,000	43.500	7,090,500.000	
INNOLUX CORPORATION	666,345	7.490	4,990,924.050	
WPG HOLDINGS CO LTD	109,203	39.500	4,313,518.500	
HIWIN TECHNOLOGIES CORP	19,073	238.500	4,548,910.500	
TAIMED BIOLOGICS INC	18,000	139.000	2,502,000.000	
PEGATRON CORP	186,554	51.500	9,607,531.000	
AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	9,000	326.000	2,934,000.000	
WIN SEMICONDUCTORS CORP	31,000	174.500	5,409,500.000	
CHAILEASE HOLDING CO LTD	109,737	116.500	12,784,360.500	

	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING LTD	31,385	92.600	2,906,251.000	
	TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL HOLDING	828,412	20.550	17,023,866.600	
	SHANGHAI COMMERCIAL & SAVINGS BANK LTD	290,000	58.100	16,849,000.000	
	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	320,903	59.800	19,189,999.400	
	GLOBALWAFERS CO LTD	19,000	305.000	5,795,000.000	
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	15,000	230.500	3,457,500.000	
台湾・ドル 小計		29,360,696		1,621,962,801.670 (5,563,332,410)	
南アフリカ・ランド	BIDVEST GROUP LTD	26,406	207.100	5,468,682.600	
	CLICKS GROUP LTD	23,124	190.670	4,409,053.080	
	TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	37,135	71.650	2,660,722.750	
	DISCOVERY LTD	35,409	138.730	4,912,290.570	
	REDEFINE PROPERTIES LTD	554,792	9.070	5,031,963.440	
	GOLD FIELDS LTD	69,936	65.440	4,576,611.840	
	REMGRO LTD	49,611	185.160	9,185,972.760	
	THE FOSCHINI GROUP LTD	23,348	176.100	4,111,582.800	
	MMI HOLDINGS LTD	80,877	18.750	1,516,443.750	
	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	258,736	24.190	6,258,823.840	
	EXXARO RESOURCES LTD	19,729	169.880	3,351,562.520	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	3,983	1,319.210	5,254,413.430	
	LIBERTY HOLDINGS LTD	11,438	108.870	1,245,255.060	
	MTN GROUP LTD	153,349	102.640	15,739,741.360	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	40,450	194.680	7,874,806.000	
	TELKOM SA SOC LTD	22,080	91.720	2,025,177.600	
	FIRSTRAND LTD	301,650	66.900	20,180,385.000	
	PSG GROUP LTD	11,126	243.050	2,704,174.300	
	NASPERS LTD	39,254	3,275.610	128,580,794.940	
	NEDBANK GROUP LTD	31,059	262.060	8,139,321.540	
	NETCARE LTD	85,575	18.600	1,591,695.000	
	PICK'N PAY STORES LTD	31,255	70.970	2,218,167.350	
	RMB HOLDINGS LTD	75,870	82.370	6,249,411.900	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	5,042	732.780	3,694,676.760	
	SAPPI LTD	45,640	55.100	2,514,764.000	
	SASOL LTD	51,184	366.590	18,763,542.560	
SHOPRITE HOLDINGS LTD	40,773	172.000	7,012,956.000		
MR PRICE GROUP LTD	24,787	197.150	4,886,757.050		
STANDARD BANK GROUP LTD	115,773	198.750	23,009,883.750		
SPAR GROUP LTD/THE	18,051	191.490	3,456,585.990		
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	102,426	45.750	4,685,989.500		

ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LTD	28,788	97.940	2,819,496.720	
ABSA GROUP LTD	66,088	169.000	11,168,872.000	
TIGER BRANDS LTD	15,965	219.990	3,512,140.350	
SANLAM LTD	162,753	76.160	12,395,268.480	
INVESTEC LTD	21,242	85.690	1,820,226.980	
KUMBA IRON ORE LTD	5,327	442.040	2,354,747.080	
MONDI LTD	12,308	299.550	3,686,861.400	
LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDINGS LTD	110,531	23.150	2,558,792.650	
RMI HOLDINGS	55,570	32.920	1,829,364.400	
VODACOM GROUP PTY LTD	59,032	118.800	7,013,001.600	
NEPI ROCKCASTLE PLC	28,593	123.060	3,518,654.580	
OLD MUTUAL LTD	452,416	21.040	9,518,832.640	
REINET INVESTMENTS SCA	11,346	231.000	2,620,926.000	
MULTICHOICE GROUP LTD	35,091	121.890	4,277,241.990	
FORTRESS REIT LTD-A	135,465	19.950	2,702,526.750	
BID CORP LTD	30,877	304.320	9,396,488.640	
南アフリカ・ランド 小計	3,621,260		402,505,651.300 (2,994,642,045)	
合計	225,503,785		49,742,660,133 (49,742,660,133)	

(2) 株式以外の有価証券

令和1年6月3日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
新株予約権証券	タイ・パーツ	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	59,033.000	50,178.050	
	タイ・パーツ 小計		59,033.000	50,178.050 (171,609)	
新株予約権証券 合計			59,033	171,609 (171,609)	
投資信託受益証券	アメリカ・ドル	ISHARES MSCI SAUDI ARABIA CAPPED UCITS ETF	35,616.000	167,395.200	
	アメリカ・ドル 小計		35,616.000	167,395.200 (18,135,596)	
	メキシコ・ペソ	CEMEX SAB DE CV	1,429,775.000	11,423,902.250	
		FOMENTO ECONOMICO MEXICANO SAB DE CV	173,400.000	31,593,480.000	
メキシコ・ペソ 小計		1,603,175.000	43,017,382.250 (237,455,950)		
投資信託受益証券 合計			1,638,791	255,591,546 (255,591,546)	
投資証券	メキシコ・ペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	258,400.000	6,498,760.000	
	メキシコ・ペソ 小計		258,400.000	6,498,760.000 (35,873,156)	
投資証券 合計			258,400	35,873,156 (35,873,156)	
合計				291,636,311 (291,636,311)	

新株予約権証券、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	組入新株 予約権証券 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 59銘柄 投資信託 1銘柄 受益証券	11.19% -%	-% -%	-% 0.03%	-% -%	12.40%
アラブ首長国連邦・ディ ルハム	株式 9銘柄	0.64%	-%	-%	-%	0.71%
イギリス・ポンド	株式 1銘柄	0.05%	-%	-%	-%	0.05%
インド・ルピー	株式 79銘柄	8.84%	-%	-%	-%	9.78%
インドネシア・ルピア	株式 27銘柄	1.96%	-%	-%	-%	2.16%
オフショア・人民元	株式 69銘柄	1.52%	-%	-%	-%	1.68%
カタール・リアル	株式 11銘柄	0.92%	-%	-%	-%	1.02%
コロンビア・ペソ	株式 9銘柄	0.38%	-%	-%	-%	0.42%
タイ・バーツ	株式 37銘柄 新株予約 権証券 1銘柄	2.64% -%	-% 0.00%	-% -%	-% -%	2.92%
チェコ・コルナ	株式 3銘柄	0.14%	-%	-%	-%	0.16%
チリ・ペソ	株式 17銘柄	0.85%	-%	-%	-%	0.93%
トルコ・リラ	株式 16銘柄	0.45%	-%	-%	-%	0.50%
ハンガリー・フォリント	株式 3銘柄	0.29%	-%	-%	-%	0.32%
パキスタン・ルピー	株式 3銘柄	0.03%	-%	-%	-%	0.04%
フィリピン・ペソ	株式 23銘柄	1.07%	-%	-%	-%	1.18%
ブラジル・レアル	株式 55銘柄	6.95%	-%	-%	-%	7.69%
ポーランド・ズロチ	株式 19銘柄	1.02%	-%	-%	-%	1.12%
マレーシア・リンギット	株式 43銘柄	2.00%	-%	-%	-%	2.21%
メキシコ・ペソ	株式 23銘柄 投資信託 2銘柄 受益証券 1銘柄 投資証券	1.89% -% -%	-% -% -%	-% 0.43% -%	-% -% 0.06%	2.63%
ユーロ	株式 9銘柄	0.29%	-%	-%	-%	0.32%
韓国・ウォン	株式 113銘柄	11.08%	-%	-%	-%	12.25%
香港・ドル	株式 206銘柄	20.27%	-%	-%	-%	22.41%
台湾・ドル	株式 87銘柄	10.06%	-%	-%	-%	11.12%
南アフリカ・ランド	株式 47銘柄	5.41%	-%	-%	-%	5.99%

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

「エマージング債券パッシブ・マザーファンド」の状況

貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成30年12月3日現在	令和1年6月3日現在
資産の部			
流動資産			
預金		1,782,072,986	11,436,667,449
コール・ローン		24,876,404	182,332,445
国債証券		72,264,398,920	102,334,631,245
派生商品評価勘定		460,000	-
未収入金		6,655,294,894	2,564,992,836
未収利息		703,348,790	1,047,916,659
前払費用		444,143,423	277,169,302
流動資産合計		81,874,595,417	117,843,709,936
資産合計		81,874,595,417	117,843,709,936
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		841,500	-
未払金		-	9,023,909,450
未払解約金		14,957,000	190,000
流動負債合計		15,798,500	9,024,099,450
負債合計		15,798,500	9,024,099,450
純資産の部			
元本等			
元本	1	45,110,161,276	57,537,376,901
剰余金			
剰余金又は欠損金()		36,748,635,641	51,282,233,585
元本等合計		81,858,796,917	108,819,610,486
純資産合計		81,858,796,917	108,819,610,486
負債純資産合計		81,874,595,417	117,843,709,936

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	平成30年12月3日現在	令和1年6月3日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額 同期中追加設定元本額 同期中一部解約元本額	60,229,482,969円 35,838,363,767円 50,957,685,460円	45,110,161,276円 45,508,953,658円 33,081,738,033円
元本の内訳		
ファンド名		
D I A M新興国債券インデックスファンド<為替ヘッジなし>（ファンドラップ）	280,365,231円	246,097,261円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	112,677,103円	209,225,701円
たわらノーロード バランス（堅実型）	5,827,344円	11,062,861円
たわらノーロード バランス（標準型）	17,885,505円	33,210,281円
たわらノーロード バランス（積極型）	10,714,686円	15,735,329円
たわらノーロード 最適化バランス（保守型）	98,967円	234,192円
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	168,288円	732,386円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	1,039,300円	1,182,977円
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	329,397円	402,733円
たわらノーロード 最適化バランス（積極型）	509,743円	515,790円

マネックス資産設計ファンド エボリューション	58,646,088円	65,031,717円
DIAM DC 8資産バラン スファンド(新興国10)	196,510,788円	197,354,708円
DIAM DC 8資産バラン スファンド(新興国20)	172,561,704円	180,100,588円
DIAM DC 8資産バラン スファンド(新興国30)	342,502,487円	353,583,507円
投資のソムリエ	4,685,529,373円	9,655,592,324円
クルーズコントロール	387,038,886円	183,260,238円
投資のソムリエ<DC年金>	416,258,576円	988,748,795円
DIAM 8資産バランスファ ンドN<DC年金>	143,653,316円	155,584,393円
クルーズコントロール<DC年 金>	245,131円	164,135円
DIAMコア資産設計ファンド (堅実型)	1,903,366円	1,500,541円
DIAMコア資産設計ファンド (積極型)	5,166,112円	3,860,130円
投資のソムリエ<DC年金>リ スク抑制型	215,347,563円	479,519,776円
ダイナミック・ナビゲーション	516,298円	513,795円
リスク抑制世界8資産バラン スファンド	3,890,916,893円	6,829,303,789円
ワールドアセットバランス(基 本コース)	802,579,470円	997,317,442円
ワールドアセットバランス(リ スク抑制コース)	1,948,638,194円	3,865,039,534円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2045)	2,512,518円	3,883,963円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2055)	1,902,111円	3,311,787円
リスク抑制世界8資産バラン スファンド(DC)	1,335,205円	3,559,672円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2035)	3,986,516円	7,119,187円
リスクコントロール世界資産分 散ファンド	999,638,917円	1,047,318,821円
9資産分散投資・スタンダード <DC年金>	13,655円	16,201,049円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2040)	-円	795,968円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2050)	-円	795,968円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2060)	-円	795,968円
エマージング債券リスク抑制型 (適格機関投資家限定)	12,056,800,976円	15,642,433,804円
エマージング債券パッシブファ ンドVA(適格機関投資家専 用)	2,217,409,633円	1,419,474,331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)	4,813,252,034円	2,644,023,179円
	D I A M世界アセットバランス ファンド3 V A (適格機関投資 家限定)	4,677,542,756円	3,894,735,257円
	D I A Mグローバル・リスク ファクター・パリティ戦略ファ ンド(適格機関投資家限定)	1,865,962,941円	4,146,061,343円
	D I A Mグローバル・リスク ファクター・パリティ戦略ファ ンドI I (適格機関投資家限 定)	989,876,997円	- 円
	P - O n eマルチアセット戦略 ファンド(適格機関投資家限 定)	3,782,297,208円	4,231,991,681円
	計	45,110,161,276円	57,537,376,901円
2 .	受益権の総数	45,110,161,276口	57,537,376,901口

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成30年6月5日 至 平成30年12月3日	自 平成30年12月4日 至 令和1年6月3日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	平成30年12月3日現在	令和1年6月3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	1,806,795,272	1,056,132,122
合計	1,806,795,272	1,056,132,122

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(平成30年4月19日から平成30年12月3日まで及び平成31年4月19日から令和1年6月3日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	平成30年12月3日 現在				令和1年6月3日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	6,963,911,500	-	6,964,293,000	381,500	3,303,760,000	-	3,303,760,000	-
アメリカ・ドル	6,963,911,500	-	6,964,293,000	381,500	3,303,760,000	-	3,303,760,000	-
合計	6,963,911,500	-	6,964,293,000	381,500	3,303,760,000	-	3,303,760,000	-

(注)時価の算定方法

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

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成30年12月3日現在	令和1年6月3日現在
1口当たり純資産額	1.8146円	1.8913円
(1万口当たり純資産額)	(18,146円)	(18,913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

令和1年6月3日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	BRAZIL 2.625 01/05/23	7,800,000.000	7,620,600.000	
		BRAZIL 4.25 01/07/25	15,100,000.000	15,488,372.000	
		BRAZIL 4.625 01/13/28	11,800,000.000	11,997,650.000	
		BRAZIL 4.875 01/22/21	11,400,000.000	11,782,014.000	
		BRAZIL 5.0 01/27/45	12,800,000.000	11,864,064.000	
		BRAZIL 5.625 01/07/41	10,100,000.000	10,296,950.000	
		BRAZIL 5.625 02/21/47	9,600,000.000	9,668,448.000	
		BRAZIL 6.0 04/07/26	7,800,000.000	8,712,678.000	
		BRAZIL 7.125 01/20/37	7,300,000.000	8,650,573.000	
		BRAZIL 8.25 01/20/34	6,200,000.000	7,919,880.000	
		BRAZIL 8.75 02/04/25	4,800,000.000	5,964,480.000	
		COLOMBIA 2.625 03/15/23	5,700,000.000	5,586,057.000	
		COLOMBIA 3.875 04/25/27	9,600,000.000	9,726,912.000	
		COLOMBIA 4.0 02/26/24	8,100,000.000	8,361,225.000	
		COLOMBIA 4.375 07/12/21	8,200,000.000	8,439,932.000	
		COLOMBIA 4.5 01/28/26	6,000,000.000	6,329,220.000	
		COLOMBIA 5.0 06/15/45	18,000,000.000	18,810,000.000	
		COLOMBIA 5.625 02/26/44	9,000,000.000	10,069,830.000	
		COLOMBIA 6.125 01/18/41	10,000,000.000	11,737,600.000	
		COLOMBIA 7.375 09/18/37	6,400,000.000	8,344,000.000	
		COLOMBIA 8.125 05/21/24	3,900,000.000	4,708,470.000	
		CROATIA 5.5 04/04/23	7,400,000.000	8,034,254.000	
		CROATIA 6.0 01/26/24	7,400,000.000	8,318,710.000	
		CROATIA 6.375 03/24/21	7,400,000.000	7,807,000.000	
		HUNGARY 5.375 02/21/23	9,600,000.000	10,429,536.000	
		HUNGARY 5.375 03/25/24	9,600,000.000	10,635,840.000	
		HUNGARY 5.75 11/22/23	9,000,000.000	10,049,130.000	
		HUNGARY 6.375 03/29/21	14,000,000.000	14,913,220.000	
		HUNGARY 7.625 03/29/41	6,400,000.000	9,812,096.000	
		INDONESIA 2.95 01/11/23	3,800,000.000	3,777,352.000	
		INDONESIA 3.375 04/15/23	4,700,000.000	4,720,868.000	
		INDONESIA 3.5 01/11/28	3,200,000.000	3,159,616.000	
		INDONESIA 3.75 04/25/22	6,000,000.000	6,090,180.000	
		INDONESIA 3.85 07/18/27	4,600,000.000	4,641,032.000	
		INDONESIA 4.1 04/24/28	3,000,000.000	3,081,090.000	
		INDONESIA 4.125 01/15/25	6,800,000.000	7,034,940.000	
INDONESIA 4.35 01/08/27	5,000,000.000	5,195,850.000			
INDONESIA 4.35 01/11/48	5,400,000.000	5,444,712.000			
INDONESIA 4.625 04/15/43	5,400,000.000	5,501,682.000			
INDONESIA 4.75 01/08/26	6,800,000.000	7,242,612.000			

INDONESIA 4.875 05/05/21	10,100,000.000	10,468,347.000	
INDONESIA 5.125 01/15/45	6,400,000.000	6,949,056.000	
INDONESIA 5.25 01/08/47	4,400,000.000	4,849,240.000	
INDONESIA 5.25 01/17/42	7,300,000.000	7,996,785.000	
INDONESIA 5.875 01/15/24	6,200,000.000	6,866,066.000	
INDONESIA 5.95 01/08/46	4,200,000.000	5,072,340.000	
INDONESIA 6.75 01/15/44	6,500,000.000	8,506,745.000	
INDONESIA 7.75 01/17/38	6,500,000.000	9,086,870.000	
PANAMA 3.75 03/16/25	6,200,000.000	6,454,262.000	
PANAMA 3.875 03/17/28	6,100,000.000	6,398,107.000	
PANAMA 4.5 04/16/50	8,300,000.000	8,883,241.000	
PANAMA 4.5 05/15/47	5,000,000.000	5,385,550.000	
PANAMA 6.7 01/26/36	9,900,000.000	13,039,290.000	
PANAMA 7.125 01/29/26	3,800,000.000	4,664,310.000	
PANAMA 9.375 04/01/29	4,900,000.000	7,219,660.000	
PERU 4.125 08/25/27	5,300,000.000	5,830,000.000	
PERU 5.625 11/18/50	11,000,000.000	14,396,250.000	
PERU 6.55 03/14/37	5,000,000.000	6,779,000.000	
PERU 7.35 07/21/25	8,300,000.000	10,363,795.000	
PHILIPPINES 3.0 02/01/28	8,000,000.000	8,060,320.000	
PHILIPPINES 3.7 02/02/42	8,400,000.000	8,715,252.000	
PHILIPPINES 3.7 03/01/41	8,600,000.000	8,959,222.000	
PHILIPPINES 3.95 01/20/40	7,800,000.000	8,372,364.000	
PHILIPPINES 4.0 01/15/21	7,400,000.000	7,551,034.000	
PHILIPPINES 4.2 01/21/24	5,800,000.000	6,159,368.000	
PHILIPPINES 5.0 01/13/37	5,800,000.000	6,953,852.000	
PHILIPPINES 5.5 03/30/26	3,600,000.000	4,190,616.000	
PHILIPPINES 6.375 01/15/32	3,600,000.000	4,771,440.000	
PHILIPPINES 6.375 10/23/34	8,000,000.000	10,781,760.000	
PHILIPPINES 7.75 01/14/31	6,100,000.000	8,726,416.000	
PHILIPPINES 9.5 02/02/30	8,400,000.000	13,150,872.000	
ROMANIA 4.375 08/22/23	9,000,000.000	9,375,030.000	
ROMANIA 4.875 01/22/24	6,600,000.000	7,016,790.000	
ROMANIA 5.125 06/15/48	7,600,000.000	7,868,964.000	
ROMANIA 6.125 01/22/44	6,400,000.000	7,598,144.000	
ROMANIA 6.75 02/07/22	13,500,000.000	14,750,235.000	
RUSSIAN FEDERATION 03/31/30	10,800,000.000	12,098,484.000	
RUSSIAN FEDERATION 4.25 06/23/27	8,400,000.000	8,505,168.000	
RUSSIAN FEDERATION 4.375 03/21/29	5,400,000.000	5,482,404.000	
RUSSIAN FEDERATION 4.5 04/04/22	10,800,000.000	11,230,380.000	

RUSSIAN FEDERATION 4.75 05/27/26	10,400,000.000	10,907,624.000	
RUSSIAN FEDERATION 4.875 09/16/23	12,400,000.000	13,177,480.000	
RUSSIAN FEDERATION 5.25 06/23/47	25,000,000.000	26,192,500.000	
RUSSIAN FEDERATION 5.625 04/04/42	11,800,000.000	13,170,570.000	
RUSSIAN FEDERATION 5.875 09/16/43	6,200,000.000	7,168,874.000	
SOUTH AFRICA 4.3 10/12/28	9,200,000.000	8,676,704.000	
SOUTH AFRICA 4.665 01/17/24	6,100,000.000	6,210,471.000	
SOUTH AFRICA 4.875 04/14/26	4,400,000.000	4,417,028.000	
SOUTH AFRICA 5.0 10/12/46	3,800,000.000	3,432,654.000	
SOUTH AFRICA 5.375 07/24/44	3,800,000.000	3,582,944.000	
SOUTH AFRICA 5.65 09/27/47	6,200,000.000	5,964,028.000	
SOUTH AFRICA 5.875 05/30/22	4,000,000.000	4,257,320.000	
SOUTH AFRICA 5.875 06/22/30	5,400,000.000	5,584,896.000	
SOUTH AFRICA 5.875 09/16/25	9,200,000.000	9,784,660.000	
SOUTH AFRICA 6.3 06/22/48	2,000,000.000	2,066,700.000	
UNITED MEXICAN STATES 3.5 01/21/21	6,400,000.000	6,479,168.000	
UNITED MEXICAN STATES 3.6 01/30/25	9,200,000.000	9,269,000.000	
UNITED MEXICAN STATES 3.625 03/15/22	8,900,000.000	9,069,100.000	
UNITED MEXICAN STATES 3.75 01/11/28	9,200,000.000	9,119,500.000	
UNITED MEXICAN STATES 4.0 10/02/23	11,500,000.000	11,899,855.000	
UNITED MEXICAN STATES 4.125 01/21/26	10,000,000.000	10,266,200.000	
UNITED MEXICAN STATES 4.15 03/28/27	12,400,000.000	12,658,664.000	
UNITED MEXICAN STATES 4.35 01/15/47	7,000,000.000	6,588,820.000	
UNITED MEXICAN STATES 4.6 01/23/46	10,000,000.000	9,740,000.000	
UNITED MEXICAN STATES 4.6 02/10/48	10,400,000.000	10,219,248.000	

	UNITED MEXICAN STATES 4.75 03/08/44	15,400,000.000	15,269,100.000	
	UNITED MEXICAN STATES 5.55 01/21/45	10,400,000.000	11,531,104.000	
	UNITED MEXICAN STATES 5.75 10/12/2110	8,800,000.000	9,086,088.000	
	UNITED MEXICAN STATES 6.05 01/11/40	11,900,000.000	13,640,494.000	
	UNITED MEXICAN STATES 6.75 09/27/34	6,200,000.000	7,642,740.000	
	アメリカ・ドル 小計	868,100,000.000 (94,049,954,000)	944,569,238.000 (102,334,631,245)	
国債証券 合計		94,049,954,000 (94,049,954,000)	102,334,631,245 (102,334,631,245)	
合計		94,049,954,000 (94,049,954,000)	102,334,631,245 (102,334,631,245)	

- (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 110銘柄	94.04%	100%

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

令和1年6月28日現在

資産総額	13,472,303円
負債総額	16,265円
純資産総額（ - ）	13,456,038円
発行済数量	11,898,097口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1309円

（参考）

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

令和1年6月28日現在

資産総額	256,827,535,354円
負債総額	296,858,788円
純資産総額（ - ）	256,530,676,566円
発行済数量	105,702,428,082口
1口当たり純資産額（ / ）	2.4269円

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和1年6月28日現在

資産総額	285,804,838,951円
負債総額	1,092,939,000円
純資産総額（ - ）	284,711,899,951円
発行済数量	214,673,327,750口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3263円

J-REITインデックスファンド・マザーファンド

令和1年6月28日現在

資産総額	34,343,424,475円
負債総額	654,743,591円
純資産総額（ - ）	33,688,680,884円
発行済数量	15,909,957,539口
1口当たり純資産額（ / ）	2.1175円

DIAMマネーマザーファンド

令和1年6月28日現在

資産総額	16,165,823,963円
負債総額	0円
純資産総額（ - ）	16,165,823,963円
発行済数量	16,010,783,369口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0097円

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和1年6月28日現在

資産総額	345,831,327,623円
負債総額	294,227,936円
純資産総額(-)	345,537,099,687円
発行済数量	95,777,853,306口
1口当たり純資産額(/)	3.6077円

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和1年6月28日現在

資産総額	181,397,981,714円
負債総額	580,754,904円
純資産総額(-)	180,817,226,810円
発行済数量	97,810,818,572口
1口当たり純資産額(/)	1.8486円

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和1年6月28日現在

資産総額	46,696,711,994円
負債総額	202,727,410円
純資産総額(-)	46,493,984,584円
発行済数量	36,276,144,290口
1口当たり純資産額(/)	1.2817円

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

令和1年6月28日現在

資産総額	59,062,220,239円
負債総額	88,991,165円
純資産総額(-)	58,973,229,074円
発行済数量	51,563,425,089口
1口当たり純資産額(/)	1.1437円

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

令和1年6月28日現在

資産総額	108,119,622,607円
負債総額	9,935,351,000円
純資産総額(-)	98,184,271,607円
発行済数量	50,509,591,959口
1口当たり純資産額(/)	1.9439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。

第二部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額(2019年6月28日現在)

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

直近5カ年の資本金の増減：該当事項はありません。

(2) 会社の機構(2019年6月28日現在)

会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。

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

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

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

また、取締役会の決議によって、取締役社長を定めることができます。

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

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

投資運用の意思決定機構

1. 投資環境見直しおよび運用方針の策定

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

2.運用計画、売買計画の決定

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

2【事業の内容及び営業の概況】

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

2019年6月28日現在、委託会社の運用する投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除く）

基本的性格	本数	純資産総額（単位：円）
追加型公社債投資信託	26	1,148,126,943,859
追加型株式投資信託	868	13,507,046,429,619
単位型公社債投資信託	45	133,655,540,124
単位型株式投資信託	164	1,255,969,173,901
合計	1,103	16,044,798,087,503

3【委託会社等の経理状況】

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

(1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

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

(単位:千円)

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

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

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

(単位:千円)

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

(3)【株主資本等変動計算書】

第33期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

(単位:千円)

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

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

第34期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

(単位:千円)

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

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

注記事項

重要な会計方針

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

表示方法の変更

第34期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

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

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

注記事項

(貸借対照表関係)

1. 有形固定資産の減価償却累計額

(千円)

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

(損益計算書関係)

1. 関係会社に対する事項

(千円)

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

2. 固定資産除却損の内訳

(千円)

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

(株主資本等変動計算書関係)

第33期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

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

第34期（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

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

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

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

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

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

（2）金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

営業債務である未払手数料は、1年以内の支払期日であります。

（3）金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

（4）金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

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

第33期(2018年3月31日現在)

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

第34期(2019年3月31日現在)

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

(注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3) 未収委託者報酬及び(4) 未収運用受託報酬

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

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

負 債

(1) 未払手数料

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

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(千円)

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

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

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

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第33期(2018年3月31日現在)

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

第34期(2019年3月31日現在)

	1年以内 (千円)	1年超5年以内 (千円)	5年超10年以内 (千円)	10年超 (千円)
(1) 現金・預金	41,087,475	-	-	-
(2) 金銭の信託	18,773,228	-	-	-
(3) 未収委託者報酬	12,438,085	-	-	-
(4) 未収運用受託報酬	3,295,109	-	-	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券(投資信託)	153,518	1,995	996	-

(有価証券関係)

1. 子会社株式及び関連会社株式

関係会社株式(第33期の貸借対照表計上額3,229,196千円、第34期の貸借対照表計上額4,499,196千円)は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

2. その他有価証券

第33期(2018年3月31日現在)

(千円)

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

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

第34期(2019年3月31日現在)

(千円)

区分	貸借対照表日における 貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの			
株式	1,326,372	111,223	1,215,148
投資信託	158,321	153,000	5,321
小計	1,484,694	264,223	1,220,470
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
株式	-	-	-
投資信託	3,990	4,000	9
小計	3,990	4,000	9
合計	1,488,684	268,223	1,220,460

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

3. 当該事業年度中に売却したその他有価証券

第33期(自2017年4月1日至2018年3月31日)

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

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

第34期(自2018年4月1日至2019年3月31日)

区分	売却額 (千円)	売却益の合計額 (千円)	売却損の合計額 (千円)
株式	394,222	353,644	-
投資信託	-	-	-

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

なお、当社は2017年10月1日付で、確定給付企業年金制度を確定拠出年金制度等に移行するとともに、退職一時金制度を改定しました。

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(千円)

	第33期 (自2017年4月1日 至2018年3月31日)	第34期 (自2018年4月1日 至2019年3月31日)
退職給付債務の期首残高	2,718,372	2,154,607
勤務費用	269,128	300,245
利息費用	7,523	1,918
数理計算上の差異の発生額	61,792	10,147
退職給付の支払額	111,758	158,018
確定拠出制度への移行に伴う減少額	1,316,796	-
退職一時金制度改定に伴う増加額	526,345	-
その他	-	438
退職給付債務の期末残高	2,154,607	2,289,044

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

(千円)

	第33期 (自2017年4月1日 至2018年3月31日)	第34期 (自2018年4月1日 至2019年3月31日)
年金資産の期首残高	1,363,437	-
期待運用収益	17,042	-
事業主からの拠出額	36,672	-
確定拠出制度への移行に伴う減少額	1,417,152	-
年金資産の期末残高	-	-

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

(千円)

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

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(千円)

	第33期 (自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日)	第34期 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)
勤務費用	269,128	300,245
利息費用	7,523	1,918
期待運用収益	17,042	-
数理計算上の差異の費用処理額	88,417	43,920
過去勤務費用の費用処理額	39,611	69,519
退職一時金制度改定に伴う費用処理額	70,560	-
その他	1,620	3,640
確定給付制度に係る退職給付費用	456,577	411,963
制度移行に伴う損失(注)	690,899	-

(注) 特別損失に計上しております。

(5) 数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎

	第33期 (2018年3月31日現在)	第34期 (2019年3月31日現在)
割引率	0.09%	0.09%
予想昇給率	1.00% ~ 4.42%	1.00% ~ 4.42%

3. 簡便法を適用した確定給付制度

(1) 簡便法を適用した制度の、退職給付引当金の期首残高と期末残高の調整表

(千円)

	第33期 (自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日)	第34期 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)
退職給付引当金の期首残高	300,927	-
退職給付費用	53,156	-
制度への拠出額	35,640	-
確定拠出制度への移行に伴う減少額	391,600	-
退職一時金制度改定に伴う振替額	108,189	-
退職給付引当金の期末残高	-	-

(2) 退職給付費用

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

4. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度86,141千円、当事業年度104,720千円であります。

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

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

(企業結合等関係)

当社(以下「AMOne」という)は、2016年7月13日付で締結した、DIAMアセットマネジメント株式会社(以下「DIAM」という)、みずほ投信投資顧問株式会社(以下「MHAM」という)、みずほ信託銀行株式会社(以下「TB」という)及び新光投信株式会社(以下「新光投信」という)(以下総称して「統合4社」という)間の「統合契約書」に基づき、2016年10月1日付で統合いたしました。

1. 結合当事企業

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

2. 企業結合日

2016年10月1日

3. 企業結合の方法

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

4. 結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

5. 企業結合の主な目的

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

6. 合併比率

「3. 企業結合の方法」の吸収合併における合併比率は以下の通りであります。

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

(*) 普通株式と種類株式を合算して算定しております。

7. 交付した株式数

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

8. 経済的持分比率（議決権比率）

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

MHFGが企業結合日に追加取得した当社に対する経済的持分比率 20.00%

MHFGの追加取得後の当社に対する経済的持分比率 70.00%

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

9. 取得企業を決定するに至った主な根拠

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

10. 会計処理

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

11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

(1) 被取得企業の取得原価及びその内訳

取得の対価 MHAMの普通株式 144,212,500千円

取得原価 144,212,500千円

(2) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

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

(3) 企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

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

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

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

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

12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

(1) 貸借対照表項目

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

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

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

(2) 損益計算書項目

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

(注) 営業利益には、のれん及び顧客関連資産の償却額が含まれております。

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

(資産除去債務関係)

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

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

(セグメント情報等)

1. セグメント情報

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

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

(1) サービスごとの情報

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

(2) 地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

(1) 親会社及び法人主要株主等

第33期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

該当はありません。

第34期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

該当はありません。

(2) 子会社及び関連会社等

第33期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

該当はありません。

第34期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

該当はありません。

(3) 兄弟会社等

第33期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

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

第34期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は 出資金	事業の 内容又 は職業	議決権 等の所 有(被 所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員の 兼任等	事業上 の関係				
親会社 の子会社	株式会社 みずほ銀行	東京都 千代田 区	14,040 億円	銀行業	-	-	当社設定 投資信託 の販売	投資信託の 販売代行手 数料	6,048,352	未払 手数料	915,980
								子会社株式 の取得	1,270,000	-	-
	みずほ証 券株式会 社	東京都 千代田 区	1,251 億円	証券業	-	-	当社設定 投資信託 の販売	投資信託の 販売代行手 数料	10,215,017	未払 手数料	1,670,194

取引条件及び取引条件の決定方針等

- (注1) 投資信託の販売代行手数料は、一般的取引条件を勘案した個別契約により決定しております。
- (注2) 子会社株式の取得は、独立した第三者機関により算定された価格を基礎として協議の上、合理的に決定しております。
- (注3) 上記の取引金額には消費税等が含まれておりません。期末残高には、消費税等が含まれております。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

株式会社みずほフィナンシャルグループ
(東京証券取引所及びニューヨーク証券取引所に上場)

(2) 重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません。

(1株当たり情報)

	第33期 (自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日)	第34期 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)
1株当たり純資産額	1,667,445円37銭	1,708,727円13銭
1株当たり当期純利益金額	391,255円29銭	352,987円92銭

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

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

	第33期 (自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日)	第34期 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)
当期純利益金額	15,650,211千円	14,119,516千円
普通株主及び普通株主と同等の株主に帰属しない金額	-	-
普通株式及び普通株式と同等の株式に係る当期純利益金額	15,650,211千円	14,119,516千円
普通株式及び普通株式と同等の株式の期中平均株式数	40,000株	40,000株
(うち普通株式)	(24,490株)	(24,490株)
(うちA種種類株式)	(15,510株)	(15,510株)

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

4【利害関係人との取引制限】

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

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

5【その他】

- (1) 定款の変更、事業譲渡又は事業譲受、出資の状況その他の重要事項

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

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

- (2) 訴訟事件その他の重要事項

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

a. 名称

みずほ信託銀行株式会社

b. 資本金の額

2019年3月末現在 247,369百万円

c. 事業の内容

日本において銀行業務および信託業務を営んでいます。

(2) 販売会社

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

名 称	資本金の額 (単位:百万円)	事 業 の 内 容
株式会社SBI証券	48,323	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
楽天証券株式会社	7,495	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。

(注) 資本金の額は2019年3月末現在

2【関係業務の概要】

「受託会社」は、以下の業務を行います。

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

「販売会社」は、以下の業務を行います。

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

3【資本関係】

該当事項はありません。

持株比率5%以上を記載します。

第3【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

書類名	提出年月日
有価証券報告書	2019年3月1日
有価証券届出書	2019年3月1日

独立監査人の監査報告書

2019年5月30日

アセットマネジメントOne株式会社
取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているアセットマネジメントOne株式会社の2018年4月1日から2019年3月31日までの第34期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、アセットマネジメントOne株式会社の2019年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

(注2) XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

令和1年7月19日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 丘本 正彦 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイナミック・ナビゲーションの平成30年12月4日から令和1年6月3日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイナミック・ナビゲーションの令和1年6月3日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

（注2）XBRLデータは監査の対象には含まれておりません。