

































































































































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







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。



















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。



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。











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。









## 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2019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07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07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07月	買建	60,000	4,770,540	4,779,000	0.01%
		香港・ドル買/円売2019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。

















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。





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. 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。

#### ハ．関係法人との契約の更改

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

#### ニ．公告

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

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

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

#### ホ．運用報告書

- ・委託会社は、毎年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/>)



### 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。



## ( 2 ) 【損益及び剰余金計算書】

( 単位 : 円 )

	第6期	第7期
	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
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



## (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つた場合、当該価額が異なることもあり ます。	同左







## 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。









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





















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	
L I X I L 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	
クラウディ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	
M I N O R I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	
マークラインズ	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	
g u m i	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・テクノロジー	5,000	1,723.00	8,615,000	
P C I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	
P R T I M E S	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	
オーブンドア	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	
U b i c o mホールディングス	2,100	1,576.00	3,309,600	
L I N E	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	
A O I T Y O H O L D I N G S	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
ビオフェルミン製薬	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	
サカタインクス	24,400	919.00	22,423,600	
東洋インキSC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
富士フィ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	
日本軽金属ホールディングス	306,700	224.00	68,700,800	
三井金属鉱業	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	
住友金属鉱山	154,200	2,793.50	430,757,700	
DOWA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	
UACJ	17,100	1,673.00	28,608,300	
CK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	
アピスト	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
ペガサスマシン製造	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・ビー機械	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
日本エアージェック	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
J U K I	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
N T N	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
T H K	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
ベイクレント・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
M S - 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	
トピー工業	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
だいこう証券ビジネス	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
テーオーシー	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
エーアイテイー	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	
アイド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
カプコン	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・ビー	2,200	1,550.00	3,410,000
アゴーラ・ホスピタリティ・グループ	63,100	34.00	2,145,400
日本空港ビルデング	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<DC年金>	12,925,603,346円	13,356,632,266円
D I A Mバランス・ファンド< DC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< DC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< DC年金>3成長型	3,443,368,379円	3,378,940,595円
D I A M DC バランス30 インデックスファンド	1,824,249,179円	1,799,558,835円
D I A M DC バランス50 インデックスファンド	2,020,301,811円	1,981,070,987円
D I A M DC バランス70 インデックスファンド	316,274,220円	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 DC 8資産バラ ンスファンド(新興国10)	3,155,808,249円	3,271,916,153円
D I A M DC 8資産バラ ンスファンド(新興国20)	750,900,239円	809,977,953円
D I A M DC 8資産バラ ンスファンド(新興国30)	161,069,244円	172,992,778円
投資のソムリエ	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<DC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<DC年金>	2,287,748,098円	2,571,810,358円
4資産分散投資・ハイクラス< DC年金>	284,875,237円	299,045,416円
クルーズコントロール<DC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<DC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 ファンド	21,615,360,469円	12,016,509,091円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2045)	2,681,278円	3,752,635円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2055)	2,036,324円	3,196,636円
リスク抑制世界8資産バランス ファンド(DC)	7,412,313円	6,268,355円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2035)	4,276,492円	7,222,922円
4資産分散投資・スタンダード <DC年金>	73,024,177円	97,473,459円
リスクコントロール世界資産分 散ファンド	1,797,723,485円	1,877,163,089円
9資産分散投資・スタンダード <DC年金>	290,676円	351,258,056円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2040)	-円	770,958円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2050)	-円	770,958円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2060)	-円	770,958円
4資産分散投資・ミドルクラス <DC年金>	-円	281,648円
DIAMエマージング債券ファ ンド	9,450,010円	9,450,010円
DIAM国内債券パッシブファ ンド(適格機関投資家向け)	22,703,716,182円	7,854,443,915円
DIAMワールドバランス25 VA(適格機関投資家限定)	435,148,026円	428,617,251円
One収益追求型マルチアセッ ト戦略ファンド(適格機関投資 家限定)	-円	2,650,787,553円
One収益追求型マルチアセッ ト戦略ファンドII(適格機関 投資家限定)	-円	2,646,517,337円
One収益追求型マルチアセッ ト戦略ファンドIII(適格機 関投資家限定)	-円	2,631,578,948円
One収益追求型マルチアセッ ト戦略ファンドIV(適格機関 投資家限定)	-円	2,631,980,470円
DIAMグローバル・バランス ファンド25VA(適格機関投 資家限定)	272,550,779円	257,109,893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)	221,488,876円	211,621,430円
DIAM国際分散バランスファ ンド30VA(適格機関投資家 限定)	68,085,649円	66,638,487円

D I A M国際分散バランスファン ド5 0 V A (適格機関投資家 限定)	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	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	3 9 1 回 利付国庫債券(2年)	1,200,000,000	1,203,756,000	
	3 9 2 回 利付国庫債券(2年)	800,000,000	802,688,000	
	3 9 3 回 利付国庫債券(2年)	1,000,000,000	1,003,580,000	
	3 9 4 回 利付国庫債券(2年)	700,000,000	702,667,000	
	3 9 5 回 利付国庫債券(2年)	900,000,000	903,699,000	
	3 9 6 回 利付国庫債券(2年)	700,000,000	703,045,000	
	3 9 7 回 利付国庫債券(2年)	800,000,000	803,664,000	
	3 9 8 回 利付国庫債券(2年)	1,100,000,000	1,105,368,000	
	1 2 6 回 利付国庫債券(5年)	2,500,000,000	2,510,650,000	
	1 2 7 回 利付国庫債券(5年)	1,820,000,000	1,829,154,600	
	1 2 8 回 利付国庫債券(5年)	2,200,000,000	2,212,628,000	
	1 2 9 回 利付国庫債券(5年)	2,120,000,000	2,133,928,400	
	1 3 0 回 利付国庫債券(5年)	1,300,000,000	1,309,633,000	
	1 3 1 回 利付国庫債券(5年)	2,020,000,000	2,036,725,600	
	1 3 2 回 利付国庫債券(5年)	2,000,000,000	2,018,060,000	
	1 3 3 回 利付国庫債券(5年)	1,180,000,000	1,191,741,000	
	1 3 4 回 利付国庫債券(5年)	2,080,000,000	2,102,276,800	
	1 3 5 回 利付国庫債券(5年)	2,100,000,000	2,124,066,000	
	1 3 6 回 利付国庫債券(5年)	1,700,000,000	1,720,791,000	
	1 3 7 回 利付国庫債券(5年)	1,400,000,000	1,418,186,000	
	1 3 8 回 利付国庫債券(5年)	1,900,000,000	1,926,144,000	
	1 3 9 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	
	1 0 回 利付国庫債券(40年)	990,000,000	1,126,610,100	
	1 1 回 利付国庫債券(40年)	680,000,000	749,931,200	
	3 1 0 回 利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,522,785,000	
	3 1 1 回 利付国庫債券(10年)	1,020,000,000	1,032,841,800	
	3 1 2 回 利付国庫債券(10年)	2,200,000,000	2,246,684,000	
	3 1 3 回 利付国庫債券(10年)	1,790,000,000	1,837,452,900	
	3 1 4 回 利付国庫債券(10年)	800,000,000	818,328,000	
	3 1 5 回 利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,542,450,000	
	3 1 7 回 利付国庫債券(10年)	600,000,000	617,700,000	
	3 1 8 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	
	1 3 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	
	1 4 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	
	4 3 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	15,407,000	16,283,966	
	4 4 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	59,052,000	62,313,441	
	5 1 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	
	2 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	154,605,000	167,042,972	
	3 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	266,456,000	284,271,248	
	1 2 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	281,652,000	285,958,459	
	1 2 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	283,017,000	287,236,783	
	1 3 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	287,001,000	290,878,383	
	1 3 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	287,451,000	291,340,212	
	1 3 7 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 7 8 3 号 利付商工債	300,000,000	300,702,000	
	3 2 5 回 利附信金中金債	400,000,000	399,948,000	
	2 2 0 号 利附商工債（3 年）	300,000,000	300,324,000	
	1 5 回 国際協力機構債	100,000,000	119,566,000	
	5 5 回 鉄道建設運輸施設債	500,000,000	515,580,000	
	<b>特殊債券 合計</b>	<b>16,874,213,000</b>	<b>18,025,183,726</b>	
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	
	3 3 7 回 東京交通債	200,000,000	207,898,000	
	2 2 回 中日本高速道路債券	300,000,000	303,801,000	
	3 4 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	
	1 9 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	
	2 3 回 ジェイ エフ イー ホールディングス社債	100,000,000	99,996,000	
	1 3 回 パナソニック社債	100,000,000	101,255,000	
	1 4 回 トヨタ自動車社債	200,000,000	206,994,000	
	1 6 回 トヨタ自動車社債	200,000,000	205,688,000	
	9 4 回 丸紅社債	100,000,000	103,405,000	
	4 5 回 住友商事社債	100,000,000	102,916,000	
	4 7 回 住友商事社債	100,000,000	103,127,000	
	4 8 回 クレディセゾン社債	100,000,000	103,500,000	
	5 7 回 東京三菱銀行社債	200,000,000	214,512,000	
	2 5 回 三菱東京 U F J 銀行劣後社債	200,000,000	203,486,000	
	2 8 回 三菱東京 U F J 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 balan スファ ンドN<DC年金>	80,069,705円	85,884,495円
投資のソムリエ<DC年金>リ スク抑制型	40,449,553円	75,166,538円
ダイナミック・ナビゲーション	483,569円	461,525円
リスク抑制世界8資産 balan スファンド	730,352,236円	1,068,643,157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 balan 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	(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）
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
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	
	アクティブ・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	9,925円	9,925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
特殊債証券	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> <p>同期中追加設定元本額</p> <p>同期中一部解約元本額</p> <p>元本の内訳</p> <p>ファンド名</p>	<p>89,020,294,172円</p> <p>19,871,696,913円</p> <p>14,432,445,594円</p>	<p>94,459,545,491円</p> <p>19,249,972,035円</p> <p>12,067,413,407円</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-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-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2 5 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5 0 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3 0 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 5 5 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 3 5 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4 0 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2 5 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3 0 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5 0 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7 0 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2 0 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4 0 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	
ENTERGY 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・債券 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	
BRENTAG 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	
FINECOBANK 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・ボンド	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・ボンド 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	119,775,375,247円	108,890,668,306円
同期中追加設定元本額	9,938,872,204円	9,832,584,756円
同期中一部解約元本額	20,823,579,145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25VA(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	<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）
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	(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)
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・シュケル	REIT 1 LTD	63,655.000	1,080,225.350	
	イスラエル・シュケル 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・シュケル	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
D I A M D C 8資産バラン スファンド(新興国10)	323,578,911円	346,828,288円
D I A M D C 8資産バラン スファンド(新興国20)	282,922,262円	316,007,413円
D I A M D C 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
D I A M 8資産バランスマ ンD<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
D I A Mコア資産設計ファンド (堅実型)	7,991,023円	5,932,519円
D I A M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・債券	POLYMETAL INTERNATIONAL PLC	23,613	8.500	200,710.500	
イギリス・債券 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	
CRRG 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	
INVESTECH 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 投資証券 1銘柄	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-2045)	2,512,518円	3,883,963円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤ-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-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-2040)	-円	795,968円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤ-2050)	-円	795,968円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤ-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	1.8146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。

## 第三部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

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

## (2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

(千円)

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

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

(千円)

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

## (4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(千円)

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

(注) 特別損失に計上しております。

## (5) 数理計算上の計算基礎に関する事項

## 主要な数理計算上の計算基礎

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

## 3. 簡便法を適用した確定給付制度

## (1) 簡便法を適用した制度の、退職給付引当金の期首残高と期末残高の調整表

(千円)

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

## (2) 退職給付費用

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

## 4. 確定拠出制度

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

## (税効果会計関係)

## 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

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

## (企業結合等関係)

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

## 1. 結合当事企業

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

## 2. 企業結合日

2016年10月1日

## 3. 企業結合の方法

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

## 4. 結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

## 5. 企業結合の主な目的

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

## 6. 合併比率

「3. 企業結合の方法」の吸収合併における合併比率は以下の通りであります。

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

(\*) 普通株式と種類株式を合算して算定しております。

## 7. 交付した株式数

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

## 8. 経済的持分比率（議決権比率）

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

MHFGが企業結合日に追加取得した当社に対する経済的持分比率 20.00%

MHFGの追加取得後の当社に対する経済的持分比率 70.00%

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

## 9. 取得企業を決定するに至った主な根拠

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

## 10. 会計処理

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

## 11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

## (1) 被取得企業の取得原価及びその内訳

取得の対価 MHAMの普通株式 144,212,500千円

取得原価 144,212,500千円

## (2) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

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

## (3) 企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

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

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

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

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

## 12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

## (1) 貸借対照表項目

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

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

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

## (2) 損益計算書項目

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

(注) 営業利益には、のれん及び顧客関連資産の償却額が含まれております。

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

(資産除去債務関係)

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

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

(セグメント情報等)

1. セグメント情報

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

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

(1) サービスごとの情報

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

(2) 地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

(1) 親会社及び法人主要株主等

第33期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

該当はありません。

第34期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

該当はありません。

(2) 子会社及び関連会社等

第33期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

該当はありません。

第34期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

該当はありません。

## (3) 兄弟会社等

## 第33期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

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

## 第34期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

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

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

## 2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

## (1) 親会社情報

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

## (2) 重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません。

## (1株当たり情報)

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

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

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

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

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

#### 4【利害関係人との取引制限】

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

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

#### 5【その他】

- (1) 定款の変更、事業譲渡又は事業譲受、出資の状況その他の重要事項

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

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

- (2) 訴訟事件その他の重要事項

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

## 第2【その他の関係法人の概況】

### 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

#### (1) 受託会社

##### a. 名称

みずほ信託銀行株式会社

##### b. 資本金の額

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【その他】

(1)目論見書の表紙等にロゴ・マーク、図案を使用し、ファンドの基本的性格を記載する場合があります。また、以下の内容を記載することがあります。

- ・金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書である旨
- ・委託会社の金融商品取引業者登録番号
- ・詳細情報の入手方法  
委託会社のホームページアドレス、電話番号および受付時間など  
請求目論見書の入手方法およびファンドの投資信託約款の全文が請求目論見書に掲載されている旨
- ・目論見書の使用開始日
- ・届出の効力に関する事項について、次に掲げるいずれかの内容を記載することがあります。  
届出をした日および当該届出の効力の発生の有無を確認する方法  
届出をした日、届出が効力を生じている旨および効力発生日
- ・ファンドの内容に関して重大な変更を行う場合には、投資信託及び投資法人に関する法律（昭和26年法律第198号）に基づき事前に受益者の意向を確認する旨
- ・投資信託の財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されている旨
- ・請求目論見書は投資者の請求により販売会社から交付される旨および当該請求を行った場合にはその旨の記録をしておくべきである旨
- ・「ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください」との趣旨を示す記載

(2)有価証券届出書第一部「証券情報」、第二部「ファンド情報」に記載の内容について、投資家の理解を助けるため、その内容を説明した図表等を付加して目論見書のその内容に関する箇所に記載することがあります。また、第二部「ファンド情報」第1「ファンドの状況」5「運用状況」について、有価証券届出書提出後の随時入手可能な直近の情報および同情報についての表での表示に加えて、グラフで表示した情報を目論見書に記載することがあります。

(3)投資信託説明書（請求目論見書）に約款の全文を掲載します。

(4)目論見書は電子媒体等として使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。

(5)目論見書は目論見書の別称として「投資信託説明書」と称して使用することがあります。

(6)投信評価機関、投信評価会社などによる評価を取得・使用することがあります。

## 独立監査人の監査報告書

2019年5月30日

アセットマネジメントOne株式会社  
取締役会 御中

## EY新日本有限責任監査法人

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

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

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

## 監査人の責任

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

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

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

## 監査意見

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

## 利害関係

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

以上

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

(注2) XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。

## 独立監査人の監査報告書

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。