

**【表紙】**

<b>【提出書類】</b>	有価証券届出書
<b>【提出先】</b>	関東財務局長
<b>【提出日】</b>	2019年10月11日
<b>【発行者名】</b>	アセットマネジメントOne株式会社
<b>【代表者の役職氏名】</b>	取締役社長 菅野 暁
<b>【本店の所在の場所】</b>	東京都千代田区丸の内一丁目8番2号
<b>【事務連絡者氏名】</b>	酒井 隆
<b>【電話番号】</b>	03-6774-5100
<b>【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】</b>	投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045) 投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)
<b>【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】</b>	投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045) 5,000億円を上限とします。 投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055) 5,000億円を上限とします。
<b>【縦覧に供する場所】</b>	該当事項はありません。

## 第一部【証券情報】

### （１）【ファンドの名称】

投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）

投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）

（以下、総称して「ファンド」という場合、あるいは個別に「各ファンド」という場合があります。また、「投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）」は「ターゲット・イヤー２０４５」、「投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）」は「ターゲット・イヤー２０５５」という場合があります。）

### （２）【内国投資信託受益証券の形態等】

契約型の追加型証券投資信託の受益権（以下「受益権」といいます。）

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

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

### （３）【発行（売出）価額の総額】

各ファンドにつき、5,000億円を上限とします。

### （４）【発行（売出）価格】

お申込日の翌営業日の基準価額 とします。

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

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

#### < 基準価額の照会方法等 >

基準価額は、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。

各ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

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

(5) 【申込手数料】

お申込日の翌営業日の基準価額に各販売会社が定める手数料率を乗じて得た額としますが、2019年10月11日現在の各販売会社における申込手数料は無手数料です。なお、申込手数料は変更になる場合があります。

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

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

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

(6) 【申込単位】

各販売会社が定める単位とします。

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

取扱コースおよびお申込単位は、販売会社にお問い合わせください。

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

確定拠出年金制度によるお申込みの場合は、1円以上1円単位となります。

当初元本は1口当たり1円です。

(7) 【申込期間】

継続申込期間：2019年10月12日から2020年4月14日まで

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

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

(8) 【申込取扱場所】

各ファンドのお申込みにかかる取扱い等は販売会社が行います。

販売会社は、以下の方法でご確認ください。

・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

(9) 【払込期日】

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

(10) 【払込取扱場所】

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

払込取扱場所についてご不明な点は、以下の方法でご確認ください。

・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

（11）【振替機関に関する事項】

ファンドの受益権にかかる振替機関は以下の通りです。

株式会社証券保管振替機構

（12）【その他】

お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

確定拠出年金制度のご利用によるお申込みの場合には、確定拠出年金制度にかかる手続きが必要となります。この場合、「分配金自動けいぞく投資コース」でのお申込みとなります。

確定拠出年金制度によるお申込みの場合は、取扱いが一部異なる場合があります。

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

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

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

ただし、海外休業日にはお申込みの受付を行いません。

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

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

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

### 振替受益権について

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

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

#### (参考)

##### 投資信託振替制度

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

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### （1）【ファンドの目的及び基本的性格】

各ファンドは、信託財産の成長を図ることを目的として、運用を行います。

各ファンドの信託金限度額は、各々5,000億円とします。ただし、委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

#### <ファンドの特色>

## 1 投資環境の変化を速やかに察知し、中長期的に安定的なリターンをめざします。

- 主に国内外の公社債、株式および不動産投資信託証券(リート)にマザーファンド\*を通じて実質的に投資し、それぞれの配分比率を適宜変更します。

\*マザーファンドについては、後掲の「マザーファンドの概要」をご覧ください。



※各ファンドでは、主要投資対象資産のうち国内債券、為替ヘッジ先進国債券を「安定資産」、それ以外の資産を「リスク性資産」とします。

- 外貨建資産は投資環境に応じて弾力的に対円での為替ヘッジ\*を行い、一部または全部の為替リスクの軽減をめざします。

\*一部の外貨建資産の通貨については、委託会社はその通貨との相関が高いと判断する通貨を用いて、円に対する為替ヘッジを行う「代替ヘッジ」を行うことがあります。

## 2 信託期間を3つの期間（資産育成期、資産形成期、資産安定期）に分け、それぞれの期間に応じて、基準価額の目標変動リスク\*を変更しつつ、安定的な基準価額の上昇をめざします。

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

・ターゲットイヤーが異なる2つのファンドから選択できます。

	ターゲット・イヤー2045	ターゲット・イヤー2055	目標変動リスク
資産育成期	設定日以降 2025年の決算日まで	設定日以降 2035年の決算日まで	6%程度
資産形成期	2025年の決算日翌日以降 2045年の決算日まで	2035年の決算日翌日以降 2055年の決算日まで	6%程度から2%程度へ 月次で逡減
資産安定期	2045年の決算日翌日以降	2055年の決算日翌日以降	2%程度

※目標変動リスクは、常にリスク水準が一定であること、あるいは目標値が達成されることのいずれを約束するものではありません。また、上記数値は各ファンドの長期的なリスク水準の目標を表すものであり、各ファンドの収益目標を意味するものではありません。上記数値が達成されるかどうかを問わず、実際の運用成績がマイナスとなる可能性があります。

### 運用プロセス

- 資産育成期および資産形成期においては、「基本配分戦略」に基づき、各資産への投資比率(0%~100%)を決定します。
  - 基本配分戦略では、統計的手法を用い、ファンドに含まれる複数のリスク要因を抽出し、その時点のファンドの目標変動リスクを考慮したうえで、これらの各リスク要因からファンドが受ける影響が均等になるように資産配分比率、および通貨配分比率を決定し、各マザーファンド、および為替ヘッジ比率を決定します。
  - 基本配分戦略は月次で行います。
- 資産安定期においては、「基本配分戦略」に加え、「機動的配分戦略」に基づき、急な投資環境の変化に対応することをめざします。
  - 機動的配分戦略では、市場リスクの高まりに対し、リスクが比較的低い資産の組入比率を増やす等、機動的に各資産への投資比率(0%~100%)を変更します。
  - 機動的配分戦略は日次で行います。

# 基本配分戦略

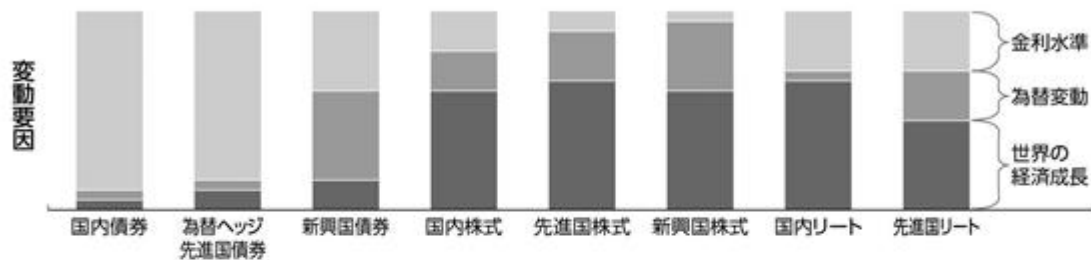
## (月次戦略)

資産価格はさまざまな要因により変動し、またその要因も刻々と変化していきます。

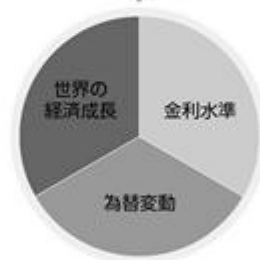
各ファンドは、資産価格に影響を与える「変動要因」に着目し、この比率を均等に配分することで、各時点においてもっとも分散効果が期待できる資産配分率を決定します。

### 基本配分比率決定のイメージ

各資産における変動要因と要因の比率(例)

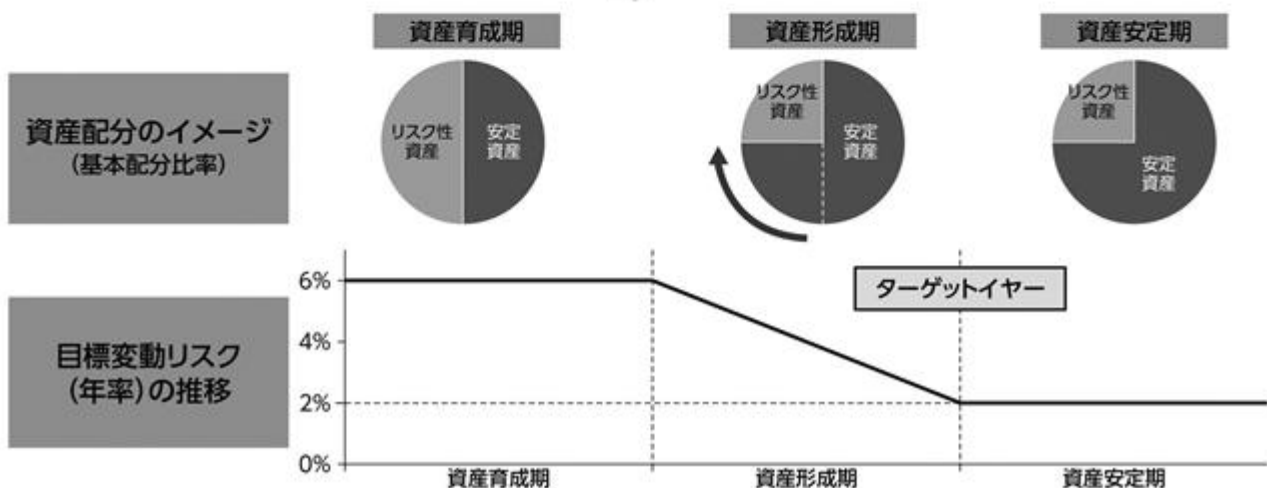


変動要因の比率を均等に配分



着目する変動要因は各時点において適宜変更します。

変動要因の配分から目標変動リスクになるように最適と判断される資産配分の比率を決定



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



# 機動的配分戦略

(日次戦略)

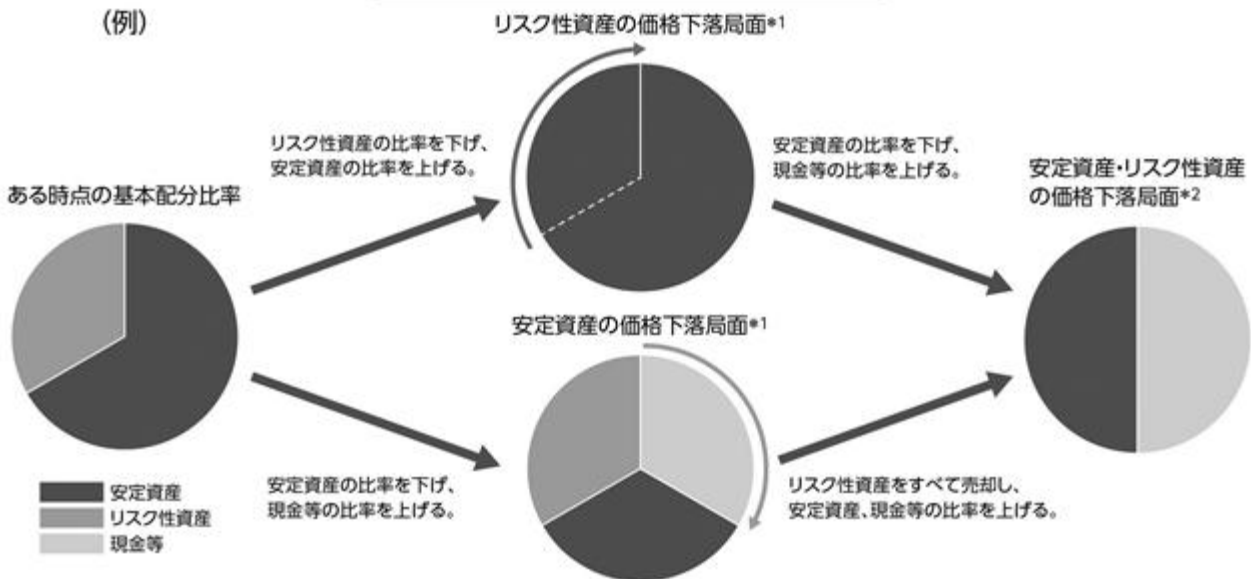
市場環境に応じて、組入資産を安定資産や現金等\*に入れ替えます。

資産安定期において、リスク性資産と安定資産のそれぞれに対して相場環境を日々判定し、下落の危険性が高まったと判定した場合は、組入資産を安定資産や現金等に入れ替えることで基準価額の下落の抑制をめざします。

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

※基準価額の下落を完全に抑制できるものではありません。

## 価格下落局面における配分比率変更のイメージ



\*1 上記は各資産価格の下落の危険性が最も高まった「危機局面」をイメージしたものです。当該局面に至る以前の局面では、リスク状況に応じて各資産を段階的に売却します。

\*2 両資産価格についての下落の危険性が最も高まった場合は、速やかにリスク性資産をすべて売却し、基本配分比率の8資産の合計額のうち半分を現金等に入れ替えます。

※相場環境によっては、リスク性資産と安定資産のうち、片方の下落の危険性が高まったとの判定を経ずに、両方の下落の危険性が高まったと判定する場合もあります。

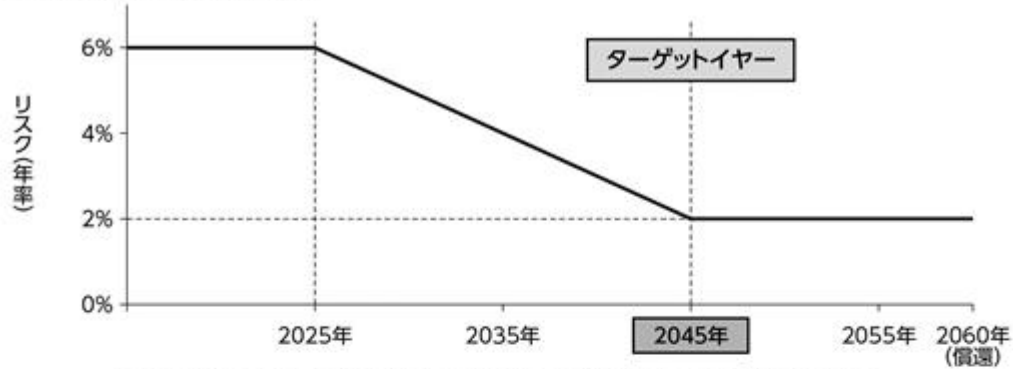
※上記は投資環境および配分比率の一例を示したものであり、すべての要因や変動を説明したものではありません。また、今後の景気や市場の展望を示唆・保証するものではありません。

※上記はイメージであり、実際にはこれと異なる場合があります。

## 運用期間中のポートフォリオ変化のイメージ

## ターゲット・イヤー2045

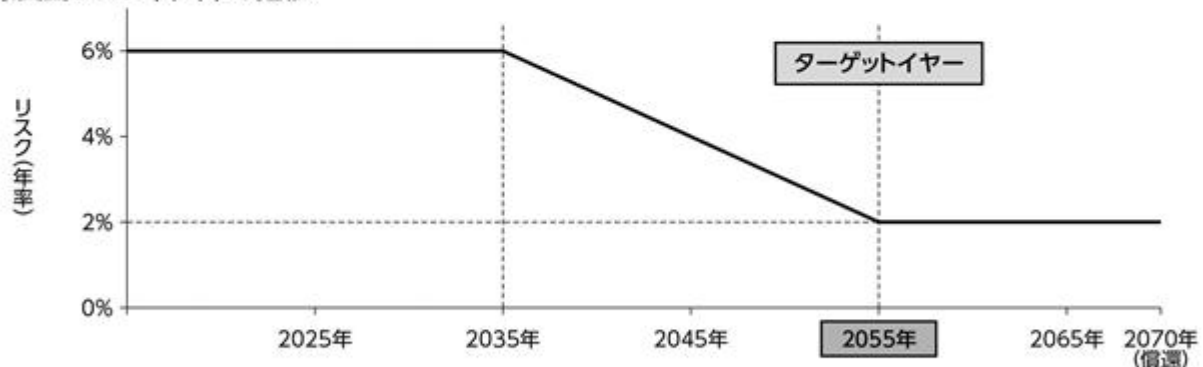
## 目標変動リスク(年率)の推移



	設定日～2025年決算日	2025年決算日翌日～2045年決算日	2045年決算日翌日～
投資局面	資産育成期	資産形成期	資産安定期
運用戦略	基本配分戦略	基本配分戦略	基本配分戦略／機動的配分戦略
基準価額の変動リスクの目標値	年率6%程度	年率6%程度から年率2%程度へ月次で逡減	年率2%程度
資産配分のイメージ(基本配分比率)			

## ターゲット・イヤー2055

## 目標変動リスク(年率)の推移



	設定日～2035年決算日	2035年決算日翌日～2055年決算日	2055年決算日翌日～
投資局面	資産育成期	資産形成期	資産安定期
運用戦略	基本配分戦略	基本配分戦略	基本配分戦略／機動的配分戦略
基準価額の変動リスクの目標値	年率6%程度	年率6%程度から年率2%程度へ月次で逡減	年率2%程度
資産配分のイメージ(基本配分比率)			

※上記はイメージであり、実際にはこれと異なる場合があります。

## ■ 分配方針

年1回の決算時(毎年1月11日(休業日の場合は翌営業日))に、繰越分を含めた経費控除後の配当等収益および売買益(評価益を含みます。)等の全額を対象として、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して、分配金額を決定します。

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

### < 商品分類 >

- ・商品分類表  
各ファンド

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

(注) 各ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

- ・商品分類定義

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

## &lt; 属性区分 &gt;

## ・ 属性区分表

## 各ファンド

投資対象資産 ( 実際の組入資産 )	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ
株式 一般 大型株 中小型株	年1回  年2回  年4回	グローバル (日本を含む)  日本		
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ( )	年6回 ( 隔月 )  年12回 ( 毎月 )	北米  欧州  アジア  オセアニア	ファミリー ファンド	あり (一部ヘッジ)
不動産投信  その他資産 ( 投資信託証券 ( 資産複合 ( 債券、 株式、不動産投信 ) 資産配分変更型 ) )	日々  その他 ( )	中南米  アフリカ  中近東 ( 中東 )  エマージング	ファンド・オブ・ ファンズ	なし
資産複合 ( ) 資産配分固定型 資産配分変更型				

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

(注2) 各ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

## ・ 属性区分定義

その他資産（投資信託証券（資産複合（債券、株式、不動産投信）資産配分変更型））	目論見書または投資信託約款において、投資信託証券への投資を通じて、主として複数資産（債券、株式、不動産投信）を実質的な投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行う旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないものをいいます。
年1回	目論見書または投資信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいう。
グローバル（日本を含む）	目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本を含む世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
ファミリーファンド	目論見書または投資信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。）を投資対象として投資するものをいう。
為替ヘッジあり	目論見書または投資信託約款において、対円での為替のフルヘッジまたは一部の資産に対円での為替のヘッジを行う旨の記載があるものをいう。

（注1）商品分類および属性区分は、委託会社が目論見書または約款の記載内容等に基づいて分類しています。

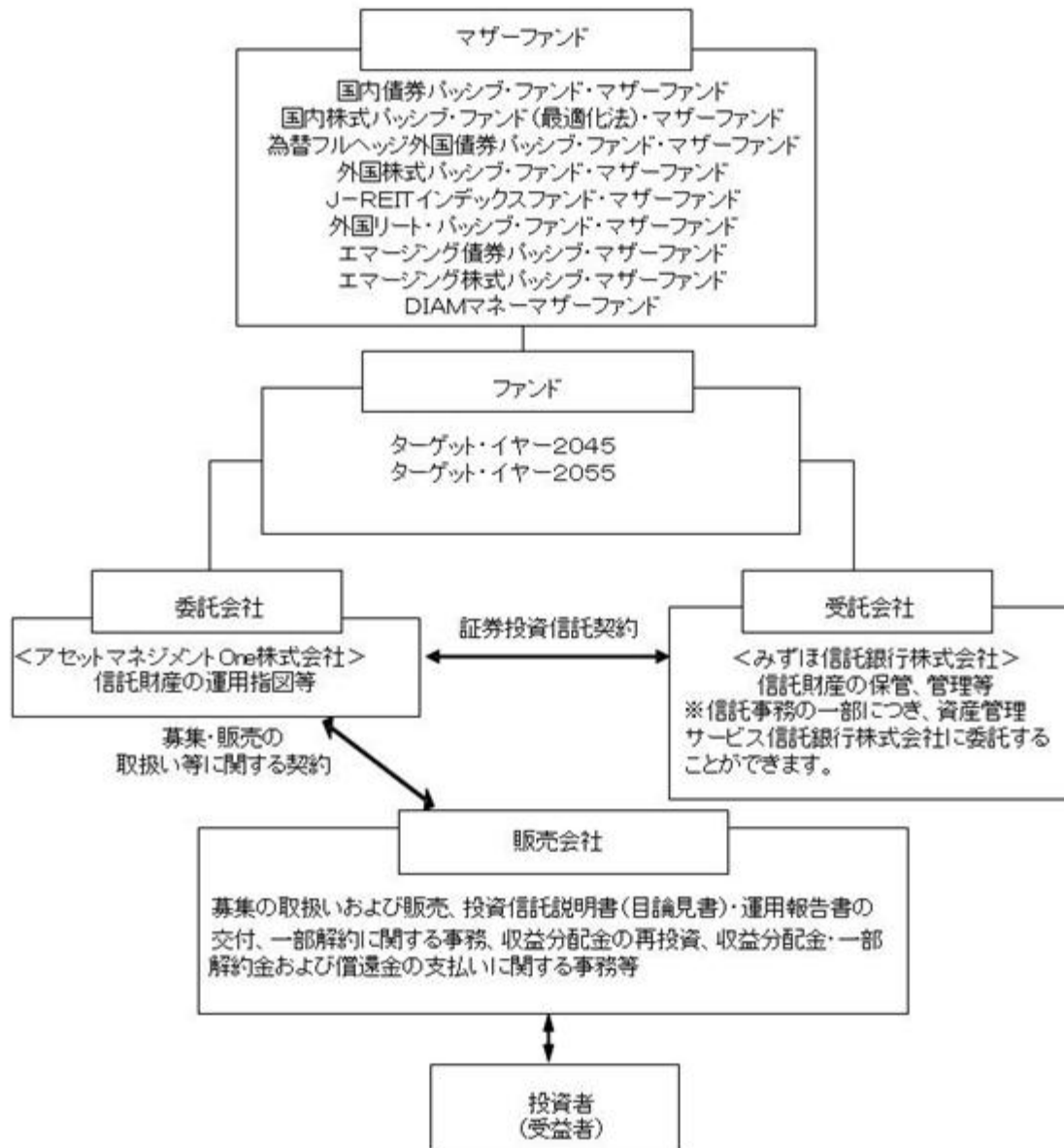
（注2）各ファンドが該当しない商品分類および属性区分の定義につきましては、一般社団法人投資信託協会のホームページ（<https://www.toushin.or.jp/>）をご覧ください。

（注3）各ファンドはマザーファンド受益証券（投資信託証券）への投資を通じて、債券、株式、不動産投信を主要投資対象とします。したがって、「商品分類」における投資対象資産と、「属性区分」における投資対象資産の分類・区分は異なります。

## （2）【ファンドの沿革】

2017年6月23日 信託契約締結、ファンドの設定、ファンドの運用開始

## (3) 【ファンドの仕組み】



- ・ 「証券投資信託契約」の概要

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

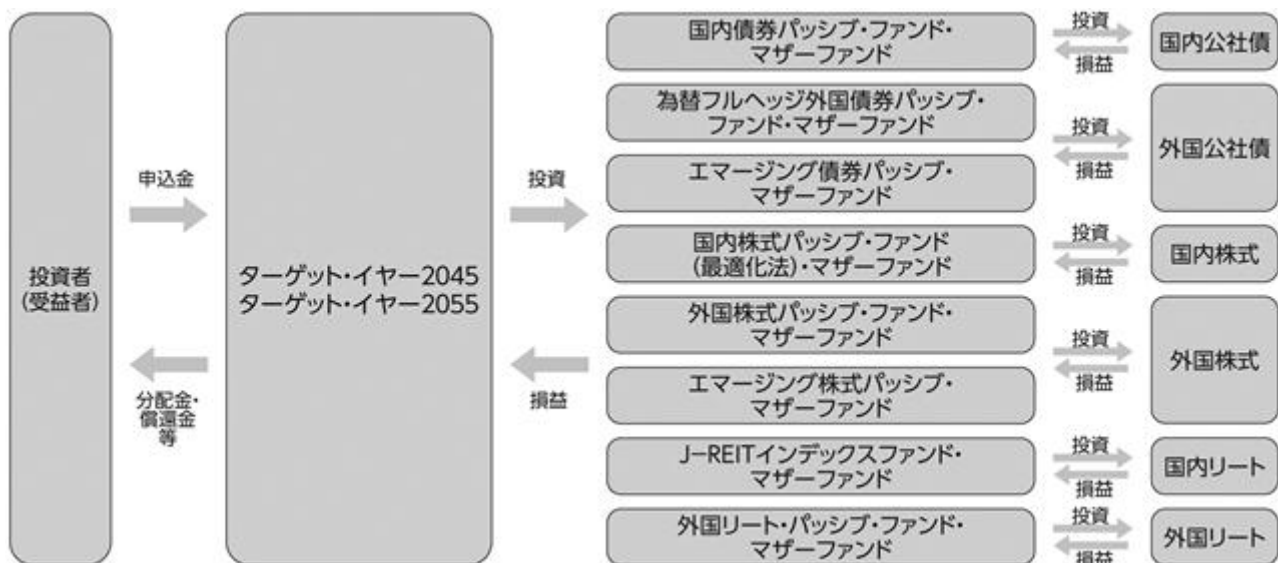
- ・ 「募集・販売の取扱い等に関する契約」の概要

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

ファミリーファンド方式とは

各ファンドは「ファミリーファンド方式」により運用を行います。

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



各ファンドは、有価証券指数等先物取引等、指数に連動する投資成果をめざす上場している投資信託証券（ETF）、D I A Mマネーマザーファンドおよび短期金融資産等に直接投資する場合があります。

投資対象とする資産については、将来の市況動向等によって見直す場合があります。

#### 委託会社の概況

名称：アセットマネジメントOne株式会社

本店の所在の場所：東京都千代田区丸の内一丁目8番2号

#### 資本金の額

20億円（2019年7月31日現在）

#### 委託会社の沿革

1985年7月1日	会社設立
1998年3月31日	「証券投資信託法」に基づく証券投資信託の委託会社の免許取得
1998年12月1日	証券投資信託法の改正に伴う証券投資信託委託業のみなし認可
1999年10月1日	第一ライフ投信投資顧問株式会社を存続会社として興銀エヌダブリュ・アセットマネジメント株式会社および日本興業投信株式会社と合併し、社名を興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社とする。
2008年1月1日	「興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社」から「D I A Mアセットマネジメント株式会社」に商号変更
2016年10月1日	D I A Mアセットマネジメント株式会社、みずほ投信投資顧問株式会社、新光投信株式会社、みずほ信託銀行株式会社（資産運用部門）が統合し、商号をアセットマネジメントOne株式会社に変更

#### 大株主の状況

（2019年7月31日現在）

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

1：A種種類株式（15,510株）を含みます。

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

## 2【投資方針】

### (1)【投資方針】

#### <基本方針>

この投資信託は、信託財産の成長を図ることを目的として、運用を行います。

#### <投資対象>

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

#### <投資態度>

投資環境の変化を速やかに察知し、中長期的に安定的なリターンをめざします。

・主に国内外の公社債、株式および不動産投資信託証券（リート）に、以下のマザーファンドを通じて実質的に投資し、それぞれの配分比率を適宜変更します。

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

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

・外貨建資産は投資環境に応じて弾力的に対円での為替ヘッジ<sup>\*</sup>を行い、一部または全部の為替リスクの軽減をめざします。



\*一部の外貨建資産の通貨については、委託会社はその通貨との相関が高いと判断される通貨を用いて、円に対する為替ヘッジを行う「代替ヘッジ」を行うことがあります。為替ヘッジにより、外貨建資産の為替リスクの軽減をめざします。

・上記のほか、有価証券指数等先物取引等、指数に連動する投資成果をめざす上場している投資信託証券(ETF)、「DIAMマネーマザーファンド」受益証券および短期金融資産等へ直接投資する場合があります。

・投資対象とする資産については、将来の市況動向等によって見直す場合があります。

信託期間中、次に掲げる各期(資産育成期、資産形成期、資産安定期)に応じて、基準価額の目標変動リスク\*を変更しつつ、安定的な基準価額の上昇をめざします。

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

	ターゲット・イヤー2045	ターゲット・イヤー2055	目標変動リスク
	期間		
資産育成期	設定日以降 2025年の決算日まで	設定日以降 2035年の決算日まで	6%程度
資産形成期	2025年の決算日翌日以降 2045年の決算日まで	2035年の決算日翌日以降 2055年の決算日まで	6%程度から2%程度 へ月次で逡減
資産安定期	2045年の決算日翌日以降	2055年の決算日翌日以降	2%程度

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

資産育成期および資産形成期においては、基本配分戦略に基づき、各資産への投資比率(0%~100%)を決定します。

・基本配分戦略では、統計的手法を用い、ファンドに含まれる複数のリスク要因を抽出し、ファンドの目標変動リスクを考慮したうえで、これらの各リスク要因からファンドが受ける影響が均等になるように資産配分比率、および通貨配分比率を決定し、各マザーファンド受益証券、および為替ヘッジ比率を決定します。

・基本配分戦略は月次で行います。

資産安定期においては、基本配分戦略に加え、機動的配分戦略に基づき、急な投資環境の変化に対応することをめざします。

・機動的配分戦略では、市場リスクの高まりに対し、リスクが比較的低い資産の組入比率を増やす等、機動的に各資産への投資比率(0%~100%)を変更します。

・機動的配分戦略は日次で行います。

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

## (2)【投資対象】

投資の対象とする資産の種類(約款第16条)

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

## イ.有価証券

ロ.デリバティブ取引にかかる権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第23条、第24条および第25条に定めるものに限ります。)

## 八.金銭債権

## 二.約束手形

## 2.次に掲げる特定資産以外の資産

## イ.為替手形

## 運用の指図範囲等(約款第17条第1項)

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

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

13. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、上記1.～12.の証券または証書の性質を有するもの
  14. 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
  15. 投資証券、新投資口予約権証券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいい、7.で定めるものを除きます。)
  16. 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
  17. オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限ります。)
  18. 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
  19. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
  20. 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
  21. 抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)
  22. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
  23. 外国の者に対する権利で上記22.の有価証券の性質を有するもの
- なお、1.の証券または証書、13.および18.の証券または証書のうち1.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、2.から7.までの証券ならびに13.および18.の証券または証書のうち2.から7.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、14.の証券および15.の証券を以下「投資信託証券」といいます。

#### 運用の指図範囲等(約款第17条第2項)

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

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

#### (参考)各ファンドが投資対象とするマザーファンドの概要

ファンド名	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、NOMURA - B P I 総合に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主な投資対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。

<p>投資態度</p>	<p>1.主としてわが国の公社債に投資し、「NOMURA - B P I 総合」 に連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>2.公社債（債券先物取引等を含みます。）の組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</p> <p>3.公社債の組入比率の調整には、債券先物取引等を活用する場合があります。</p> <div style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin-top: 10px;"> <p>NOMURA - B P I 総合の知的財産権その他一切の権利は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。</p> </div>
<p>運用プロセス</p>	<p>1.流動性基準等による対象銘柄群設定 NOMURA - B P I 総合構成銘柄のうち、流動性基準等を勘案して投資対象銘柄群を設定します。</p> <p>2.最適化法によるポートフォリオの構築</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1) 債券種別・格付けから発生するベンチマーク乖離要因</li> <li>2) 金利の期間構造、スプレッドの期間構造から発生するベンチマーク乖離要因</li> </ol> <p>1)、2) が最小になると判断されるポートフォリオを構築します。</p> <p>3.インデックスとの乖離を管理 日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。 インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>・年限構成変化要因 ・指数構成銘柄変更</li> <li>・リスク量の変更 ・クーポン、償還再投資</li> </ul> <div style="text-align: center; margin-top: 20px;"> <pre> graph TD     A[NOMURA-BPI総合構成銘柄] --&gt; B[対象銘柄群]     C[流動性基準等を勘案した対象銘柄群設定] --&gt; B     B --&gt; D[計量モデル]     E[金利の期間構造・スプレッド変動リスク] --&gt; D     D --&gt; F[最適化ポートフォリオ]     G[インデックスとの乖離を管理・調整 1. 年限構成変化要因 2. 指数構成銘柄変更 3. リスク量の変更 4. クーポン・償還再投資] --&gt; F     F --&gt; H[日次・月次モニタリング]     </pre> </div>

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

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

投資態度	<p>1.主として東京証券取引所第1部に上場されている株式に投資し、「東証株価指数(TOPIX)(配当込み)」に連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>2.最適化法によるポートフォリオ構築を行い、運用コストの最小化と徹底したリスク管理を行います。</p> <p>3.株式(株価指数先物取引を含みます。)の組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</p> <p>4.株式の組入比率の調整には、株価指数先物取引等を活用します。</p> <p>5.非株式割合は原則として信託財産総額の50%以下とします。また、外貨建資産割合は原則として信託財産総額の10%以下とします。</p> <p>東証株価指数(TOPIX)の指数値およびTOPIXの商標は、株式会社東京証券取引所(以下「株東京証券取引所」といいます。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など東証株価指数(TOPIX)に関するすべての権利・ノウハウおよびTOPIXの商標に関するすべての権利は株東京証券取引所が有しています。</p> <p>株東京証券取引所は、東証株価指数(TOPIX)の指数値の算出もしくは公表の方法の変更、東証株価指数(TOPIX)の指数値の算出もしくは公表の停止またはTOPIXの商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。</p> <p>株東京証券取引所は、東証株価指数(TOPIX)の指数値およびTOPIXの商標の使用に関して得られる結果ならびに特定日の東証株価指数(TOPIX)の指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。</p> <p>株東京証券取引所は、東証株価指数(TOPIX)の指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、株東京証券取引所は、東証株価指数(TOPIX)の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。</p> <p>当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドは、株東京証券取引所により提供、保証または販売されるものではありません。</p> <p>株東京証券取引所は、当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドの購入者または公衆に対し、当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を持ちません。</p> <p>株東京証券取引所は、委託会社または当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドの購入者のニーズを、東証株価指数(TOPIX)の指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。</p> <p>以上の項目に限らず、株東京証券取引所は当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドの発行または売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を負いません。</p>
------	--

## 運用プロセス

## 1.流動性基準による対象銘柄群設定

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

## 2.最適化法によるポートフォリオの構築

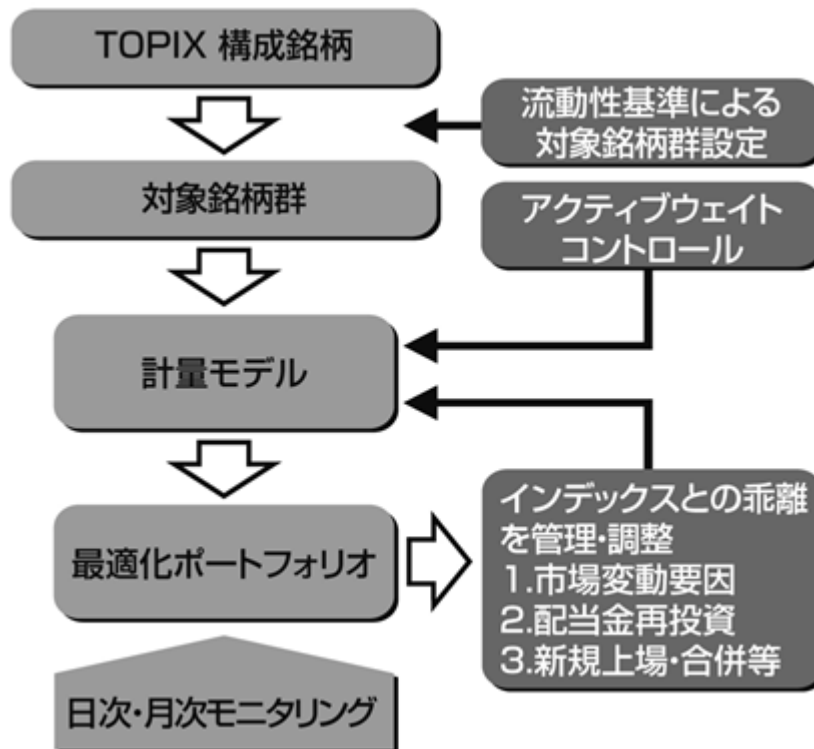
インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差（アクティブウェイト）を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。

## 3.インデックスとの乖離を管理

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

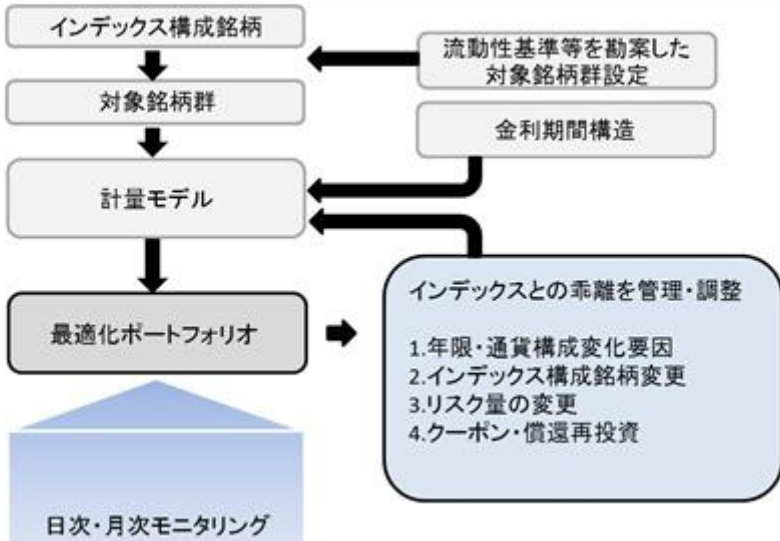
インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。

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



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



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

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

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

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

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

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

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

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

### 運用プロセス

#### 1.流動性基準による対象銘柄群設定

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

#### 2.最適化法によるポートフォリオの構築

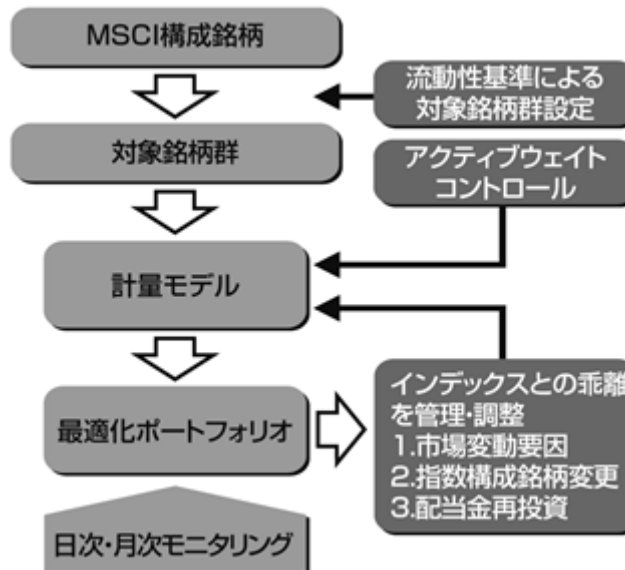
インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差(アクティブウェイト)を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。

#### 3.インデックスとの乖離を管理

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

インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。

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



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

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

## 投資態度

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

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

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

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

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

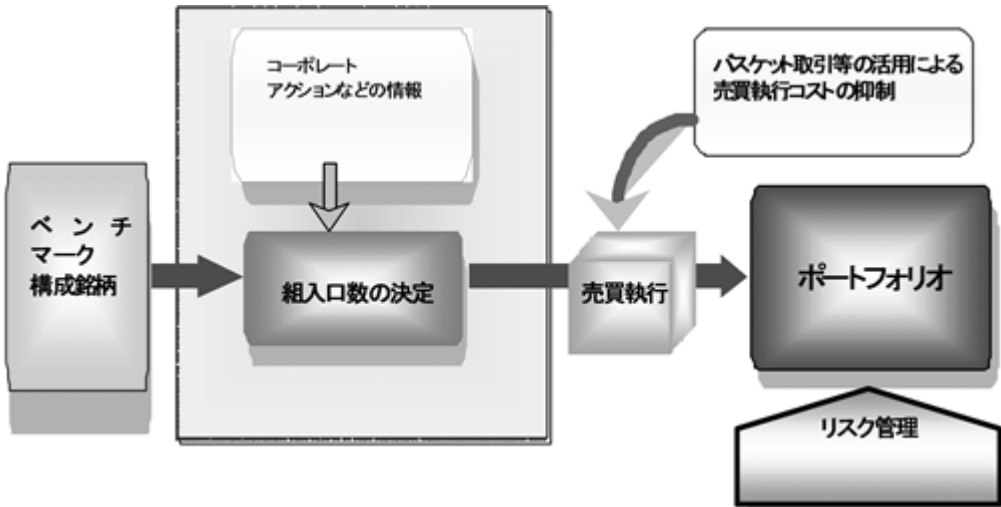
当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドは、株東京証券取引所により提供、保証または販売されるものではありません。

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

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

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



運用プロセス	<ul style="list-style-type: none"> <li>・原則としてベンチマーク構成全銘柄をその構成比率で保有します。ベンチマーク構成銘柄および採用予定銘柄を投資対象銘柄とします。</li> <li>・新規上場、公募増資、第三者割当等ベンチマーク構成の変更情報を事前に取得し、最適な執行方法によりリバランスを実施します。</li> <li>・配当金入金等によりキャッシュ比率が上昇した場合にもリバランスを実施します。</li> </ul> 
主な投資制限	<p>投資信託証券への投資割合には制限を設けません。</p> <p>同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として信託財産の純資産総額の30%を超えないものとします。ただし、東証REIT指数採用の不動産投資信託証券の上場時価総額の合計額に占める同一銘柄の不動産投資信託証券の時価総額の割合が30%を超えている場合、当該同一銘柄の不動産投資信託証券への投資割合は、原則として当該同一銘柄の不動産投資信託証券の時価総額が東証REIT指数採用の不動産投資信託証券の上場時価総額の合計額に占める割合の範囲で投資することができるものとします。</p> <p>株式への投資は行いません。</p> <p>外貨建資産への投資は行いません。</p> <p>デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動および金利変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>
ファンド名	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、S & P 先進国 REIT インデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）に連動する投資成果をめざして運用を行います。

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



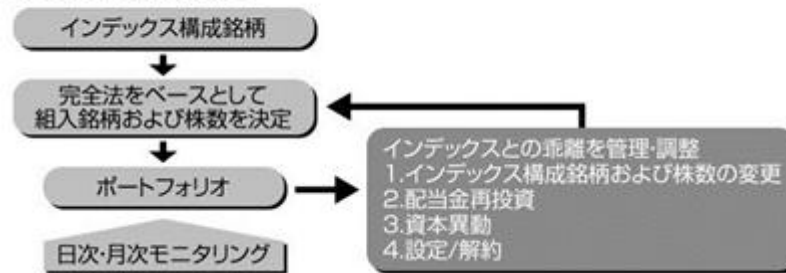
S & P 先進国 R E I Tインデックスは、S&P Globalの一部門であるS&Pダウ・ジョーンズ・インデックスLLCまたはその関連会社(「SPDJI」)の商品であり、これを利用するライセンスが委託会社に付与されています。Standard & Poor's®およびS&P®は、S&P Globalの一部門であるスタンダード・プアーズ・ファイナンシャル・サービシーズLLC(「S&P」)の登録商標で、Dow Jones®は、ダウ・ジョーンズ・トレードマーク・ホールディングズLLC(「Dow Jones」)の登録商標です。指数に直接投資することはできません。本商品は、SPDJI、Dow Jones、S&P、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

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

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

## 運用プロセス

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



## 主な投資制限

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

ファンド名

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

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

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

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

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



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

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

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

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

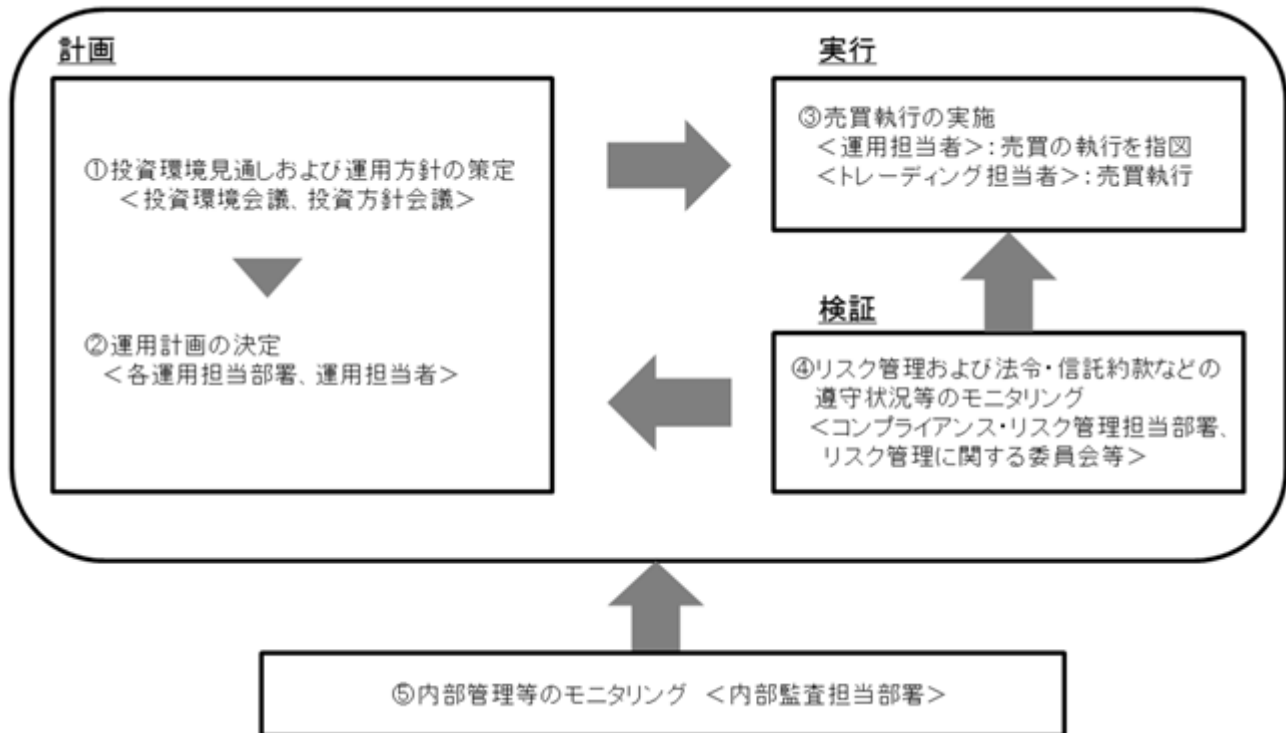
ファンド名	D I A Mマネーマザーファンド
基本方針	この投資信託は、安定した収益の確保をめざします。
主な投資対象	国内発行体の公社債、転換社債、ユーロ円債、資産担保証券ならびにCD、CP、コールローン等の国内短期金融資産を主要投資対象とします。

投資態度	<p>国内の国債、政府保証債、政府機関債、地方債等のほか、取得時において主要格付機関<sup>(*)</sup>の長期発行体格付(複数の格付機関が付与している場合は高い方の格付)がAA-格相当以上の社債、転換社債、ユーロ円債、資産担保証券、さらに、国内格付機関の短期格付がa-1格相当以上のCD、CPを主要投資対象とします。</p> <p>(*)主要格付機関とは、R&amp;I、JCR、Moody's、S&amp;Pとします。</p> <p>国債および政府保証債を除き、原則として、ファンドの元本総額に対する1発行体当たりの有価証券の額面総額の割合は5%以内とします。</p> <p>ポートフォリオ全体の修正デュレーションは1年未満を基本として運用します。</p>
運用プロセス	<p>マクロ経済分析を主体としたファンダメンタルズ分析、投資家の需給動向等分析および信用リスク市場の分析等に基づき、短期金利の方向性見通し、セクター別のクレジットスプレッドの拡縮等を予測し、ファンドのデュレーションおよびセクター配分を決定します(トップダウンアプローチ)。</p>
主な投資制限	<p>株式への投資割合は、純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の株式への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>新株引受権証券及び新株予約権証券への投資割合は、取得時において、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建て資産への投資は行いません。</p> <p>デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます。)は、価格変動および金利変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>

資金動向、市況動向等によっては、上記の運用ができない場合があります。

## (3) 【運用体制】

## a. ファンドの運用体制



## 投資環境見通しおよび運用方針の策定

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

## 運用計画の決定

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

## 売買執行の実施

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

## モニタリング

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

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

## 内部管理等のモニタリング

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

b. ファンドの関係法人に関する管理

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

c. 運用体制に関する社内規則

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

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

運用体制は2019年7月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

上記体制は、マザーファンドを通じた実質的な運用体制を記載しております。

(4) 【分配方針】

収益分配方針

毎決算時（原則として毎年1月11日（休業日の場合は翌営業日））に、原則として以下の方針に基づき収益の分配を行います。

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

収益の分配方式

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

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

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

(3)毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

#### 収益分配金の支払い

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

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

#### (5)【投資制限】

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

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

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

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

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

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

投資する株式等の範囲(約款第20条)

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

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

信用取引の指図範囲(約款第22条)

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

#### 先物取引等の運用指図(約款第23条)

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

象とする外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。)との合計額の範囲内とします。

2. 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の買予約と合せて、外貨建有価証券の買付代金等実需の範囲内とします。
  3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点の保有外貨建資産の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。
- 3) 委託会社は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。
1. 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする金利商品(信託財産が1年以内に受取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに上記(2)投資対象 運用の指図範囲等1.~4.に掲げる金融商品で運用されているものをいい、以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。)の時価総額の範囲内とします。
  2. 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに上記(2)投資対象 運用の指図範囲等1.~4.に掲げる金融商品で運用している額(以下2.において「金融商品運用額等」といいます。)の範囲内とします。ただし、ヘッジ対象金利商品が外貨建で、信託財産の外貨建資産組入可能額(約款上の組入可能額から保有外貨建資産の時価総額を差引いた額をいいます。以下同じ。)に信託財産が限月までに受取る外貨建組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに外貨建組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額が当該金融商品運用額等の額より少ない場合には外貨建資産組入可能額に信託財産が限月までに受取る外貨建組入有価証券にかかる利払金および償還金を加えた額を限度とします。
  3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点のヘッジ対象金利商品の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

#### スワップ取引の運用指図(約款第24条)

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



4) 上記3)においてマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

5) スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。

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

金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図(約款第25条)

1) 委託会社は、信託財産に属する資産の価格変動リスクや為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。

2) 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

3) 金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(「金利先渡取引の想定元本の合計額」といいます。以下3)において同じ。)が、信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額とマザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(「ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額」といいます。以下3)において同じ。)を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額が減少して、金利先渡取引の想定元本の合計額がヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかにその超える額に相当する金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。

4) 上記3)においてマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

5) 為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(「為替先渡取引の想定元本の合計額」といいます。以下5)において同じ。)が、信託財産にかかるヘッジ対象とする外貨建資産(「ヘッジ対象外貨建資産」といいます。以下5)において同じ。)の時価総額とマザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(「ヘッジ対象外貨建資産の時価総額の合計額」といいます。以下5)において同じ。)を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、ヘッジ対象外貨建資産の時価総額の合計額が減少して、為替先渡取引の想定元本の合計額がヘッジ対象外貨建資産の時価総額の合計額を超えるこ

となった場合には、委託会社は、速やかにその超える額に相当する為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。

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

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

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

デリバティブ取引等にかかる投資制限(約款第26条)

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

有価証券の貸付の指図および範囲(約款第27条)

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

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

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

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

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

公社債の空売りの指図および範囲(約款第28条)

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

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

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

公社債の借入れの指図および範囲(約款第29条)

1) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図を行うものとします。

- 2)上記1)の指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 3)信託財産の一部解約等の事由により、上記2)の借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。
- 4)上記1)の借入れにかかる品借料は信託財産中から支弁します。

#### 特別な場合の外貨建有価証券への投資制限(約款第30条)

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

#### 外国為替予約取引の指図(約款第31条)

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

#### 資金の借入れ(約款第37条)

- 1)委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、および運用の安定性を図るため、一部解約に伴う支払資金の手当て(一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。)を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ(コール市場を通じる場合を含みます。)の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
- 2)一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は、借入れ指図を行う日の信託財産の純資産総額の10%以内における、当該有価証券等の売却代金または解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。

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

4) 借入金の利息は信託財産中より支弁します。

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

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

### 3【投資リスク】

< 基準価額の主な変動要因 >

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

また、投資信託は預貯金と異なります。

#### 資産配分リスク

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

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

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

#### 株価変動リスク

投資する企業の株価の下落は、基準価額の下落要因となります。

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

#### 金利リスク

金利の上昇は、基準価額の下落要因となります。

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

#### リートの価格変動リスク

リートの価格の下落は、基準価額の下落要因となります。

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

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

#### 為替リスク

為替相場の円高は、基準価額の下落要因となります。

各ファンドは実質組入外貨建資産について、弾力的に対円での為替ヘッジを行います。

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

為替ヘッジを行う場合、為替リスクの低減をめざしますが、為替リスクを完全に排除できるものではなく為替相場の影響を受ける場合があります。なお、実質組入通貨の直接ヘッジのほか、先進国通貨を用いた代替ヘッジを行う場合があります。その場合、通貨間の値動きが異なる場合が想定されますので、十分な為替ヘッジ効果が得られない可能性や、円と当該代替通貨との為替変動の影響を受ける可能性があります。また、為替ヘッジには円金利がヘッジ対象通貨の金利よりも低い場合、その金利差相当分程度のコストがかかることにご留意ください。

#### 信用リスク

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

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

#### 流動性リスク

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

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

#### カントリーリスク

投資する国・地域の政治・経済の不安定化等は、基準価額の下落要因となります。

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

基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

#### <その他の留意点>

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

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

収益分配金に関する留意点として、以下の事項にご留意ください。

- ・収益分配は、計算期間中に発生した運用収益（経費控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。））を超えて行われる場合があります。したがって、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。
- ・受益者の個別元本の状況によっては、分配金の全額または一部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。個別元本とは、追加型投資信託を保有する受益者毎の取得元本のこと、受益者毎に異なります。
- ・分配金は純資産総額から支払われます。このため、分配金支払い後の純資産総額は減少することとなり、基準価額が下落する要因となります。計算期間中の運用収益以上に分配金の支払いを行う場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。

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

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

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

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

#### 注意事項

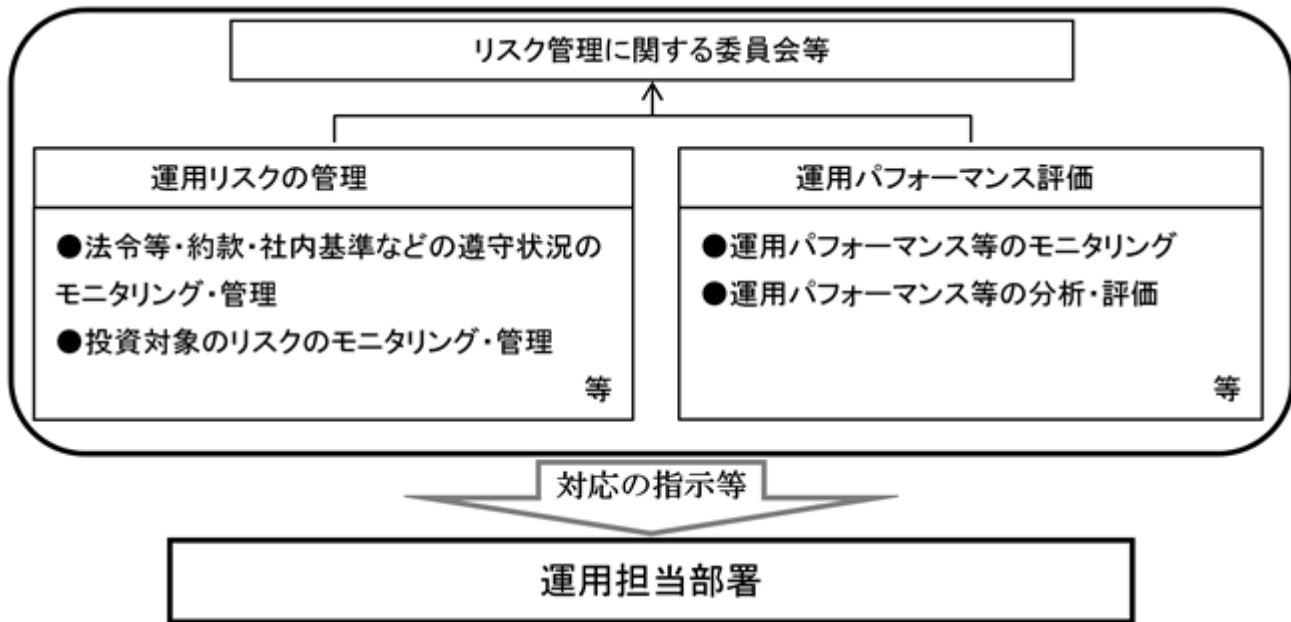
- ・各ファンドは、実質的に債券、株式、不動産投資信託証券（リート）など値動きのある有価証券（外貨建資産には為替リスクもあります。）に投資しますので、基準価額は変動します。
- ・投資信託は、預金等や保険契約ではありません。また、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。加えて、証券会社を通して購入していない場合には投資者保護基金の対象にもなりません。
- ・投資信託は、購入金額について元本保証および利回り保証のいずれもありません。
- ・投資信託は、投資した資産の価値が減少して購入金額を下回る場合があります、これによる損失は購入者が負担することとなります。

#### <リスク管理体制>

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

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

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



リスク管理体制は2019年7月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

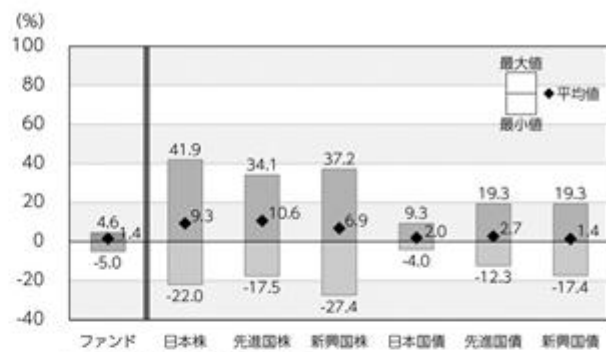
## <参考情報>

### ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移

#### ターゲット・イヤー2045

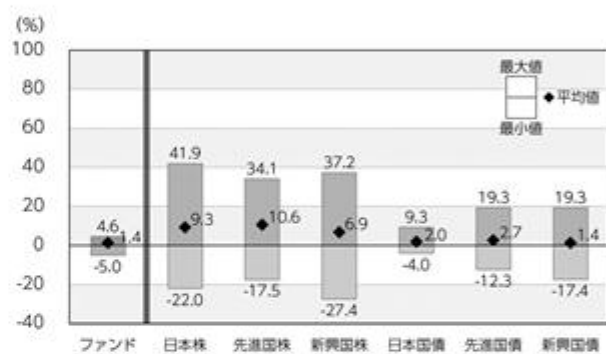


### ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



ファンド:2018年6月~2019年7月  
代表的な資産クラス:2014年8月~2019年7月

#### ターゲット・イヤー2055



ファンド:2018年6月~2019年7月  
代表的な資産クラス:2014年8月~2019年7月

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

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

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

\*全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

### 各資産クラスの指数

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

(注)海外の指数は為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。



#### 4【手数料等及び税金】

##### (1)【申込手数料】

お申込日の翌営業日の基準価額に各販売会社が定める手数料率を乗じて得た額としますが、2019年10月11日現在の各販売会社における申込手数料は無手数料です。なお、申込手数料は変更になる場合があります。

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

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

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

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

##### (2)【換金（解約）手数料】

ありません。

##### (3)【信託報酬等】

各ファンドの日々の純資産総額に対して年率0.649%～年率0.913%（税抜0.59%～税抜0.83%）

[ターゲット・イヤー2045]

計算期間	運用管理費用（信託報酬）の配分（税抜）		
	委託会社	販売会社	受託会社
第1計算期から第8計算期まで	0.40%	0.40%	0.03%
年率0.913% （税抜0.83%）			
第9計算期から第18計算期まで	0.36%	0.36%	0.03%
年率0.825% （税抜0.75%）			
第19計算期から第28計算期まで	0.32%	0.32%	0.03%
年率0.737% （税抜0.67%）			
第29計算期から第43計算期まで	0.28%	0.28%	0.03%
年率0.649% （税抜0.59%）			

[ターゲット・イヤー2055]

計算期間	運用管理費用（信託報酬）の配分（税抜）		
	委託会社	販売会社	受託会社
第1計算期から第18計算期まで	0.40%	0.40%	0.03%
年率0.913% （税抜0.83%）			

第19計算期から第28計算期まで			
年率0.825% (税抜0.75%)	0.36%	0.36%	0.03%
第29計算期から第38計算期まで			
年率0.737% (税抜0.67%)	0.32%	0.32%	0.03%
第39計算期から第53計算期まで			
年率0.649% (税抜0.59%)	0.28%	0.28%	0.03%

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

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率

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

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

#### （４）【その他の手数料等】

- ・ 信託財産留保額

ありません。

- ・ その他の費用

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

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

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

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

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

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

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

税法が改正された場合等は、上記内容が変更になることがあります。

#### (5)【課税上の取扱い】

各ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

個人の受益者に対する課税

収益分配時

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

詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

解約時および償還時

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

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

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

損益通算について

解約(換金)時および償還時の差損(譲渡損)については、確定申告を行うことにより上場株式等(上場株式、上場投資信託(ETF)、上場不動産投資信託(REIT)、公募株式投資信託および特定公社債等(公募公社債投資信託を含みます。))など。以下同じ。)の譲渡益ならびに上場株式等の配当所得および利子所得の金額(配当所得については申告分離課税を選択したものに限り、)との損益通算ならびに3年間の繰越控除の対象とすることができます。また、特定口座(源泉徴収口座)をご利用の場合、その口座内において損益通算を行います(確定申告不要)。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

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

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

## 法人の受益者に対する課税

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

なお、益金不算入制度の適用はありません。

2020年1月1日以降の分配時において、外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。

受益者が確定拠出年金法に規定する資産管理機関および国民年金基金連合会等の場合は、所得税（復興特別所得税を含みます。）および地方税がかかりません。また、確定拠出年金制度の加入者については、確定拠出年金の積立金の運用にかかる税制が適用されます。

上記は、2019年7月末現在のものです。税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。

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

## 個別元本方式について

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

### < 個別元本について >

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

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

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

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

### < 収益分配金の課税について >

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

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

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

税法が改正された場合等は、上記内容が変更になることがあります。

## 5【運用状況】

## (1)【投資状況】

投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2045）

令和1年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（%）
親投資信託受益証券	64,124,875	97.38
内 日本	64,124,875	97.38
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	1,726,702	2.62
純資産総額	65,851,577	100.00

その他資産の投資状況

令和1年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（%）
為替予約取引（買建）	10,637,434	16.15
-	10,637,434	16.15
為替予約取引（売建）	34,129,623	51.83
-	34,129,623	51.83

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

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

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

投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2055）

令和1年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（%）
親投資信託受益証券	53,209,368	97.40
内 日本	53,209,368	97.40
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	1,419,769	2.60
純資産総額	54,629,137	100.00

その他資産の投資状況

令和1年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（%）
為替予約取引（買建）	9,190,829	16.82
-	9,190,829	16.82
為替予約取引（売建）	28,693,424	52.52
-	28,693,424	52.52

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

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

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

(参考)

## 国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

令和1年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	252,559,347,270	98.94
内 日本	252,559,347,270	98.94
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	2,709,976,574	1.06
純資産総額	255,269,323,844	100.00

## その他資産の投資状況

令和1年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引（買建）	2,161,080,000	0.85
内 日本	2,161,080,000	0.85

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

## 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和1年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	225,319,013,800	80.78
内 日本	225,319,013,800	80.78
地方債証券	21,493,873,077	7.71
内 日本	21,493,873,077	7.71
特殊債券	17,853,877,085	6.40
内 日本	17,853,877,085	6.40
社債券	12,647,918,480	4.53
内 日本	12,241,648,480	4.39
内 フランス	406,270,000	0.15
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	1,625,626,020	0.58
純資産総額	278,940,308,462	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

## J-REITインデックスファンド・マザーファンド

令和1年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	34,920,446,660	97.48
内 日本	34,920,446,660	97.48
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	902,208,858	2.52
純資産総額	35,822,655,518	100.00

## その他資産の投資状況

令和1年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
不動産投信指数先物取引（買建）	704,106,000	1.97
内 日本	704,106,000	1.97

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

## 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和1年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	334,034,241,390	95.59
内 アメリカ	219,175,912,208	62.72
内 イギリス	20,192,242,035	5.78
内 カナダ	12,852,836,732	3.68
内 スイス	12,539,641,086	3.59
内 フランス	12,467,409,944	3.57
内 ドイツ	10,499,528,786	3.00
内 オーストラリア	8,135,675,217	2.33
内 アイルランド	6,210,441,298	1.78
内 オランダ	6,148,126,036	1.76
内 スペイン	3,577,617,782	1.02
内 香港	3,431,974,180	0.98
内 スウェーデン	2,963,749,165	0.85
内 イタリア	2,337,239,547	0.67
内 デンマーク	2,081,179,578	0.60
内 シンガポール	1,545,701,669	0.44
内 フィンランド	1,406,392,865	0.40
内 パミュエダ	1,380,386,212	0.40
内 ベルギー	1,285,624,598	0.37
内 ジャージー	1,205,405,656	0.34
内 ケイマン諸島	871,331,051	0.25
内 ノルウェー	802,678,870	0.23
内 イスラエル	756,340,133	0.22
内 オランダ領キュラソー	486,052,654	0.14
内 ルクセンブルグ	364,299,849	0.10
内 ニューゼaland	324,879,052	0.09
内 オーストリア	287,812,879	0.08
内 ポルトガル	183,577,943	0.05
内 パナマ	183,071,119	0.05
内 リベリア	177,361,236	0.05
内 パプアニューギニア	55,698,411	0.02
内 イギリス領バージン諸島	47,248,029	0.01
内 マン島	39,799,275	0.01
内 モーリシャス	17,006,295	0.00
投資信託受益証券	849,554,851	0.24
内 オーストラリア	695,960,213	0.20



	内 シンガポール	153,594,638	0.04
投資証券		8,335,330,591	2.39
	内 アメリカ	7,479,909,402	2.14
	内 香港	221,673,982	0.06
	内 イギリス	199,338,367	0.06
	内 フランス	194,899,615	0.06
	内 オランダ	165,421,259	0.05
	内 カナダ	74,087,966	0.02
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		6,214,585,610	1.78
純資産総額		349,433,712,442	100.00

#### その他資産の投資状況

令和1年7月31日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引(買建)	11,208,670	0.00
-	11,208,670	0.00
為替予約取引(売建)	420,281,580	0.12
-	420,281,580	0.12
株価指数先物取引(買建)	5,700,354,583	1.63
内 アメリカ	4,041,547,874	1.16
内 ドイツ	943,191,472	0.27
内 イギリス	340,561,782	0.10
内 カナダ	210,621,665	0.06
内 オーストラリア	164,431,790	0.05

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

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

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

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

## 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和1年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	5,046,926,579	10.77
内 オーストラリア	3,321,360,708	7.09
内 シンガポール	1,700,075,503	3.63
内 カナダ	25,490,368	0.05
投資証券	41,550,450,623	88.70
内 アメリカ	34,044,181,142	72.68
内 イギリス	2,137,083,128	4.56
内 香港	1,077,391,543	2.30
内 フランス	1,021,190,052	2.18
内 カナダ	885,451,476	1.89
内 オランダ	847,481,029	1.81
内 ベルギー	467,078,812	1.00
内 スペイン	328,093,865	0.70
内 ニュージーランド	231,959,219	0.50
内 ドイツ	127,765,981	0.27
内 アイルランド	122,164,860	0.26
内 シンガポール	114,769,069	0.25
内 ガーンジー	76,679,099	0.16
内 イスラエル	36,912,923	0.08
内 マン島	14,837,239	0.03
内 イタリア	11,283,122	0.02
内 韓国	6,128,064	0.01
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	245,811,610	0.52
純資産総額	46,843,188,812	100.00

## その他資産の投資状況

令和1年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引（売建）	88,976,800	0.19
-	88,976,800	0.19

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

## 為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和1年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	466,315,106,597	96.82
内 アメリカ	223,664,493,367	46.44
内 フランス	45,412,380,014	9.43
内 イタリア	38,861,931,053	8.07
内 ドイツ	29,447,371,188	6.11
内 イギリス	29,049,784,846	6.03
内 スペイン	27,603,863,382	5.73
内 ベルギー	12,760,904,684	2.65
内 オランダ	10,475,960,698	2.18
内 オーストラリア	9,004,883,856	1.87
内 カナダ	8,542,975,724	1.77
内 オーストリア	7,704,562,827	1.60
内 アイルランド	4,433,746,019	0.92
内 フィンランド	4,102,846,064	0.85
内 メキシコ	3,401,355,431	0.71
内 ポーランド	2,725,512,564	0.57
内 南アフリカ	2,517,305,574	0.52
内 デンマーク	1,847,341,846	0.38
内 シンガポール	1,619,332,042	0.34
内 スウェーデン	1,236,657,764	0.26
内 マレーシア	1,152,108,189	0.24
内 ノルウェー	749,789,465	0.16
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	15,329,835,806	3.18
純資産総額	481,644,942,403	100.00

## その他資産の投資状況

令和1年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引（売建）	477,891,222,290	99.22
-	477,891,222,290	99.22

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

## エマージング株式パッシブ・マザーファンド

令和1年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	52,188,012,363	88.49
内 ケイマン諸島	8,911,169,043	15.11
内 韓国	6,313,805,523	10.71
内 中国	5,865,540,806	9.95
内 台湾	5,841,421,571	9.91
内 インド	4,568,184,025	7.75
内 ブラジル	4,258,576,963	7.22
内 南アフリカ	3,043,509,018	5.16
内 ロシア	2,040,413,063	3.46

内 香港	1,758,997,841	2.98
内 タイ	1,558,530,912	2.64
内 インドネシア	1,157,125,667	1.96
内 マレーシア	1,116,240,962	1.89
内 メキシコ	1,044,449,005	1.77
内 フィリピン	614,600,101	1.04
内 ポーランド	560,273,527	0.95
内 バミューダ	542,095,989	0.92
内 カタール	534,831,729	0.91
内 チリ	484,685,018	0.82
内 アラブ首長国連邦	406,784,696	0.69
内 トルコ	302,231,946	0.51
内 コロンビア	226,643,373	0.38
内 アメリカ	186,826,758	0.32
内 ギリシャ	165,935,117	0.28
内 ハンガリー	154,040,712	0.26
内 アルゼンチン	153,685,168	0.26
内 チェコ	80,062,484	0.14
内 エジプト	67,867,364	0.12
内 ルクセンブルグ	55,669,418	0.09
内 オランダ	43,653,766	0.07
内 ペルー	34,932,787	0.06
内 ジャージー	31,162,076	0.05
内 マン島	28,201,962	0.05
内 シンガポール	20,426,425	0.03
内 パキスタン	15,437,548	0.03
新株予約権証券	560,098	0.00
内 タイ	560,098	0.00
投資信託受益証券	974,630,871	1.65
内 アイルランド	746,138,101	1.27
内 メキシコ	228,492,770	0.39
投資証券	35,466,950	0.06
内 メキシコ	35,466,950	0.06
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	5,774,708,763	9.79
純資産総額	58,973,379,045	100.00

## その他資産の投資状況

令和1年7月31日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引(売建)	176,944,730	0.30
-	176,944,730	0.30
株価指数先物取引(買建)	5,589,536,691	9.48
内 アメリカ	5,589,536,691	9.48

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

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

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

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

## エマージング債券パッシブ・マザーファンド

令和1年7月31日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	91,145,440,884	96.33
内 メキシコ	14,061,343,313	14.86
内 ブラジル	11,036,001,668	11.66
内 インドネシア	10,934,013,365	11.56
内 ロシア	10,713,057,754	11.32
内 コロンビア	9,768,619,704	10.32
内 フィリピン	8,142,169,284	8.61
内 南アフリカ	5,471,964,414	5.78
内 ハンガリー	5,256,699,579	5.56
内 パナマ	4,773,487,329	5.04
内 ペルー	4,207,676,412	4.45
内 ルーマニア	3,767,292,004	3.98
内 クロアチア	3,013,116,058	3.18
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	3,475,087,026	3.67
純資産総額	94,620,527,910	100.00

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

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

## (2) 【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)

令和1年7月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	18,253,165	1.3549 24,732,977	1.3987 25,530,701	- -	38.77%
2	エマージング債券パッシブ・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	4,970,225	1.8473 9,181,725	1.9755 9,818,679	- -	14.91%
3	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	5,012,482	1.2304 6,167,387	1.3137 6,584,897	- -	10.00%
4	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	2,399,540	2.4395 5,853,889	2.4491 5,876,713	- -	8.92%
5	エマージング株式パッシブ・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	5,102,556	1.1404 5,819,343	1.1428 5,831,200	- -	8.86%
6	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	1,236,644	3.4933 4,320,033	3.7059 4,582,878	- -	6.96%
7	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	2,466,389	1.3112 3,234,130	1.3278 3,274,871	- -	4.97%
8	J-REITインデックスファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	1,188,023	2.0087 2,386,384	2.2095 2,624,936	- -	3.99%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 投資有価証券の種類別投資比率

令和1年7月31日現在

種類	投資比率
親投資信託受益証券	97.38%
合計	97.38%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

## 投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2055）

令和1年7月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	15,150,208	1.3532 20,502,318	1.3987 21,190,595	- -	38.79%
2	エマージング債券パッシブ・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	4,123,535	1.8450 7,608,079	1.9755 8,146,043	- -	14.91%
3	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	4,160,996	1.2358 5,142,487	1.3137 5,466,300	- -	10.01%
4	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	1,988,508	2.4421 4,856,201	2.4491 4,870,054	- -	8.91%
5	エマージング株式パッシブ・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	4,235,861	1.1404 4,830,981	1.1428 4,840,741	- -	8.86%
6	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	1,025,715	3.4923 3,582,129	3.7059 3,801,197	- -	6.96%
7	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	2,047,883	1.3108 2,684,462	1.3278 2,719,179	- -	4.98%
8	J-REITインデックスファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	984,503	2.0039 1,972,914	2.2095 2,175,259	- -	3.98%

（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7月31日現在

種類	投資比率
親投資信託受益証券	97.40%
合計	97.40%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

(参考)

## 国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

令和1年7月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	1,256,100	6,571.87 8,254,935,451	7,024.00 8,822,846,400	- -	3.46%
2	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	877,500	4,985.02 4,374,359,823	5,628.00 4,938,570,000	- -	1.93%
3	ソニー 日本	株式 電気機器	756,400	4,726.32 3,574,992,768	6,170.00 4,666,988,000	- -	1.83%
4	三菱UFJフィナンシャル・ グループ 日本	株式 銀行業	7,652,400	576.47 4,411,396,259	524.20 4,011,388,080	- -	1.57%
5	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	756,500	4,641.89 3,511,591,636	4,922.00 3,723,493,000	- -	1.46%
6	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	984,100	4,456.51 4,385,658,368	3,635.00 3,577,203,500	- -	1.40%
7	キーエンス 日本	株式 電気機器	55,300	62,257.85 3,442,859,290	63,130.00 3,491,089,000	- -	1.37%
8	三井住友フィナンシャルグ ループ 日本	株式 銀行業	783,600	3,925.23 3,075,810,283	3,807.00 2,983,165,200	- -	1.17%
9	リクルートホールディングス 日本	株式 サービス業	771,700	2,928.37 2,259,825,114	3,718.00 2,869,180,600	- -	1.12%
10	KDDI 日本	株式 情報・通信業	906,700	2,661.60 2,413,277,170	2,853.50 2,587,268,450	- -	1.01%
11	任天堂 日本	株式 その他製品	64,500	29,539.08 1,905,270,860	40,100.00 2,586,450,000	- -	1.01%
12	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	950,800	2,994.94 2,847,596,276	2,710.50 2,577,143,400	- -	1.01%
13	みずほフィナンシャルグル ープ 日本	株式 銀行業	15,104,200	172.97 2,612,632,958	154.40 2,332,088,480	- -	0.91%
14	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	397,500	5,344.46 2,124,424,060	5,797.00 2,304,307,500	- -	0.90%
15	三菱商事 日本	株式 卸売業	779,000	3,149.25 2,453,266,225	2,936.50 2,287,533,500	- -	0.90%
16	東海旅客鉄道 日本	株式 陸運業	100,900	23,606.51 2,381,897,790	21,920.00 2,211,728,000	- -	0.87%
17	花王 日本	株式 化学	273,600	8,061.13 2,205,527,436	7,979.00 2,183,054,400	- -	0.86%
18	信越化学工業 日本	株式 化学	194,500	9,241.43 1,797,460,040	11,155.00 2,169,647,500	- -	0.85%
19	第一三共 日本	株式 医薬品	322,600	3,642.59 1,175,101,453	6,647.00 2,144,322,200	- -	0.84%
20	ファナック 日本	株式 電気機器	107,100	18,790.96 2,012,512,144	19,530.00 2,091,663,000	- -	0.82%



21	ダイキン工業 日本	株式 機械	153,800	11,793.76 1,813,881,784	13,585.00 2,089,373,000	- -	0.82%
22	東日本旅客鉄道 日本	株式 陸運業	200,400	10,163.95 2,036,856,900	10,005.00 2,005,002,000	- -	0.79%
23	日本電産 日本	株式 電気機器	135,600	13,159.05 1,784,368,330	14,715.00 1,995,354,000	- -	0.78%
24	日立製作所 日本	株式 電気機器	507,500	3,506.87 1,779,741,563	3,892.00 1,975,190,000	- -	0.77%
25	HOYA 日本	株式 精密機器	226,900	6,612.40 1,500,354,480	8,405.00 1,907,094,500	- -	0.75%
26	オリエンタルランド 日本	株式 サービス業	127,200	11,641.10 1,480,748,670	14,440.00 1,836,768,000	- -	0.72%
27	NTTドコモ 日本	株式 情報・通信業	700,100	2,553.48 1,787,691,942	2,615.00 1,830,761,500	- -	0.72%
28	資生堂 日本	株式 化学	224,000	7,215.42 1,616,254,534	8,046.00 1,802,304,000	- -	0.71%
29	キヤノン 日本	株式 電気機器	606,700	3,182.70 1,930,949,530	2,970.50 1,802,202,350	- -	0.71%
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	3,728.00 1,734,638,400	- -	0.68%

(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7月31日現在

種類	投資比率
株式	98.94%
合計	98.94%

(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7月31日現在

業種	国内/外国	投資比率
電気機器	国内	13.72%
情報・通信業		8.94%
輸送用機器		7.67%
化学		7.26%
銀行業		5.75%
医薬品		5.53%
サービス業		5.21%
機械		4.99%
卸売業		4.90%
陸運業		4.62%
小売業		4.59%
食料品		3.99%
建設業		2.74%
不動産業		2.40%
保険業		2.36%
その他製品		2.17%
精密機器		2.12%
電気・ガス業		1.68%
その他金融業		1.09%
鉄鋼		0.84%
ガラス・土石製品		0.83%
ゴム製品		0.75%
非鉄金属		0.74%
証券、商品先物取引業		0.71%
繊維製品		0.63%
石油・石炭製品		0.59%
金属製品		0.57%
空運業		0.54%
鉱業		0.27%
パルプ・紙		0.27%
倉庫・運輸関連業		0.20%
海運業	0.17%	
水産・農林業	0.11%	
合計	98.94%	

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和1年7月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	350回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,800,000,000	101.55 2,843,405,000	102.77 2,877,560,000	0.100000 2028/3/20	1.03%
2	341回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,460,000,000	103.19 2,538,531,000	103.56 2,547,797,400	0.300000 2025/12/20	0.91%
3	343回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,480,000,000	101.92 2,527,644,000	102.48 2,541,677,600	0.100000 2026/6/20	0.91%
4	126回 利付国庫債券(5年) 日本	国債証券	2,500,000,000	100.50 2,512,700,000	100.39 2,509,900,000	0.100000 2020/12/20	0.90%
5	342回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,380,000,000	101.88 2,424,821,000	102.36 2,436,168,000	0.100000 2026/3/20	0.87%
6	346回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,370,000,000	101.88 2,414,556,000	102.68 2,433,587,100	0.100000 2027/3/20	0.87%
7	340回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,300,000,000	103.74 2,386,136,000	104.05 2,393,173,000	0.400000 2025/9/20	0.86%
8	347回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,300,000,000	101.85 2,342,697,000	102.77 2,363,779,000	0.100000 2027/6/20	0.85%
9	329回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,270,000,000	104.22 2,365,794,000	104.07 2,362,570,600	0.800000 2023/6/20	0.85%
10	332回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,260,000,000	103.76 2,344,976,000	103.74 2,344,659,600	0.600000 2023/12/20	0.84%
11	344回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,280,000,000	101.91 2,323,666,000	102.58 2,338,824,000	0.100000 2026/9/20	0.84%
12	339回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,240,000,000	103.60 2,320,827,000	103.88 2,326,956,800	0.400000 2025/6/20	0.83%
13	349回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,260,000,000	101.83 2,301,571,200	102.82 2,323,754,600	0.100000 2027/12/20	0.83%
14	348回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,230,000,000	101.73 2,268,645,900	102.77 2,291,971,700	0.100000 2027/9/20	0.82%
15	334回 利付国庫債券(10年) 日本	国債証券	2,170,000,000	104.10 2,259,155,000	104.17 2,260,640,900	0.600000 2024/6/20	0.81%

16	328回 利付国庫債券(10年)	日本	国債証券	2,190,000,000	103.15 2,258,985,000	103.05 2,256,992,100	0.600000 2023/3/20	0.81%
17	312回 利付国庫債券(10年)	日本	国債証券	2,200,000,000	102.53 2,255,726,000	101.92 2,242,328,000	1.200000 2020/12/20	0.80%
18	345回 利付国庫債券(10年)	日本	国債証券	2,160,000,000	101.90 2,201,049,000	102.63 2,216,872,800	0.100000 2026/12/20	0.79%
19	128回 利付国庫債券(5年)	日本	国債証券	2,200,000,000	100.63 2,213,948,000	100.56 2,212,474,000	0.100000 2021/6/20	0.79%
20	333回 利付国庫債券(10年)	日本	国債証券	2,100,000,000	103.96 2,183,196,000	103.95 2,183,139,000	0.600000 2024/3/20	0.78%
21	351回 利付国庫債券(10年)	日本	国債証券	2,110,000,000	101.40 2,139,626,800	102.76 2,168,236,000	0.100000 2028/6/20	0.78%
22	325回 利付国庫債券(10年)	日本	国債証券	2,100,000,000	103.48 2,173,218,000	103.23 2,167,998,000	0.800000 2022/9/20	0.78%
23	338回 利付国庫債券(10年)	日本	国債証券	2,080,000,000	103.41 2,150,970,000	103.71 2,157,230,400	0.400000 2025/3/20	0.77%
24	129回 利付国庫債券(5年)	日本	国債証券	2,120,000,000	100.70 2,134,850,500	100.66 2,134,098,000	0.100000 2021/9/20	0.77%
25	335回 利付国庫債券(10年)	日本	国債証券	2,050,000,000	103.76 2,127,081,000	103.90 2,129,991,000	0.500000 2024/9/20	0.76%
26	135回 利付国庫債券(5年)	日本	国債証券	2,100,000,000	101.11 2,123,352,000	101.24 2,126,166,000	0.100000 2023/3/20	0.76%
27	353回 利付国庫債券(10年)	日本	国債証券	2,000,000,000	101.40 2,028,064,000	102.72 2,054,440,000	0.100000 2028/12/20	0.74%
28	131回 利付国庫債券(5年)	日本	国債証券	2,020,000,000	100.83 2,036,927,600	100.83 2,036,846,800	0.100000 2022/3/20	0.73%
29	352回 利付国庫債券(10年)	日本	国債証券	1,970,000,000	101.25 1,994,625,000	102.74 2,024,056,800	0.100000 2028/9/20	0.73%
30	132回 利付国庫債券(5年)	日本	国債証券	2,000,000,000	100.90 2,018,140,000	100.92 2,018,580,000	0.100000 2022/6/20	0.72%

(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7月31日現在

種類	投資比率
国債証券	80.78%
地方債証券	7.71%
特殊債券	6.40%
社債券	4.53%
合計	99.42%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

## J - R E I Tインデックスファンド・マザーファンド

令和1年7月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	日本ビルファンド投資法人 日本	投資証券	3,323	752,977.50 2,502,144,255	764,000.00 2,538,772,000	- -	7.09%
2	ジャパンリアルエステイト投資法人 日本	投資証券	3,431	656,896.13 2,253,810,648	681,000.00 2,336,511,000	- -	6.52%
3	野村不動産マスターファンド投資法人 日本	投資証券	10,701	166,361.41 1,780,233,472	172,900.00 1,850,202,900	- -	5.16%
4	オリックス不動産投資法人 日本	投資証券	6,837	195,777.35 1,338,529,799	211,300.00 1,444,658,100	- -	4.03%
5	日本リテールファンド投資法人 日本	投資証券	6,485	217,114.13 1,407,985,186	218,800.00 1,418,918,000	- -	3.96%
6	ユナイテッド・アーバン投資法人 日本	投資証券	7,704	177,501.03 1,367,467,970	184,100.00 1,418,306,400	- -	3.96%
7	日本プロロジスリート投資法人 日本	投資証券	4,930	232,642.28 1,146,926,449	261,700.00 1,290,181,000	- -	3.60%
8	大和ハウスリート投資法人 日本	投資証券	4,626	257,175.08 1,189,691,936	266,500.00 1,232,829,000	- -	3.44%
9	アドバンス・レジデンス投資法人 日本	投資証券	3,177	314,366.75 998,743,169	337,500.00 1,072,237,500	- -	2.99%
10	日本プライムリアルティ投資法人 日本	投資証券	2,172	465,289.60 1,010,609,021	481,500.00 1,045,818,000	- -	2.92%
11	G L P投資法人 日本	投資証券	8,546	118,349.70 1,011,416,574	121,400.00 1,037,484,400	- -	2.90%
12	ジャパン・ホテル・リート投資法人 日本	投資証券	11,054	87,445.82 966,626,145	90,800.00 1,003,703,200	- -	2.80%

13	インヴィンシブル投資法人 日本	投資証券	15,052	59,352.01 893,366,582	62,500.00 940,750,000	- -	2.63%
14	アクティビア・プロパティーズ投資法人 日本	投資証券	1,719	471,688.88 810,833,195	499,500.00 858,640,500	- -	2.40%
15	積水ハウス・リート投資法人 日本	投資証券	10,033	78,206.43 784,645,183	84,400.00 846,785,200	- -	2.36%
16	ケネディクス・オフィス投資法人 日本	投資証券	1,061	747,385.77 792,976,305	782,000.00 829,702,000	- -	2.32%
17	日本アコモデーションファンド投資法人 日本	投資証券	1,140	582,049.87 663,536,853	641,000.00 730,740,000	- -	2.04%
18	大和証券オフィス投資法人 日本	投資証券	792	750,578.26 594,457,982	805,000.00 637,560,000	- -	1.78%
19	森ヒルズリート投資法人 日本	投資証券	3,948	151,953.09 599,910,806	160,300.00 632,864,400	- -	1.77%
20	産業ファンド投資法人 日本	投資証券	4,222	129,731.73 547,727,374	142,400.00 601,212,800	- -	1.68%
21	日本ロジスティクスファンド投資法人 日本	投資証券	2,242	245,513.30 550,440,836	261,300.00 585,834,600	- -	1.64%
22	フロンティア不動産投資法人 日本	投資証券	1,167	465,866.28 543,665,952	469,000.00 547,323,000	- -	1.53%
23	ヒューリックリート投資法人 日本	投資証券	2,789	181,963.32 507,495,722	194,200.00 541,623,800	- -	1.51%
24	ジャパンエクセレント投資法人 日本	投資証券	3,073	159,338.12 489,646,044	162,000.00 497,826,000	- -	1.39%
25	イオンリート投資法人 日本	投資証券	3,522	134,057.57 472,150,789	141,300.00 497,658,600	- -	1.39%
26	日本リート投資法人 日本	投資証券	1,115	420,830.92 469,226,486	437,000.00 487,255,000	- -	1.36%
27	コンフォリア・レジデンシャル投資法人 日本	投資証券	1,429	296,668.21 423,938,878	325,500.00 465,139,500	- -	1.30%
28	プレミアム投資法人 日本	投資証券	3,099	137,012.19 424,600,800	146,700.00 454,623,300	- -	1.27%
29	東急リアル・エステート投資法人 日本	投資証券	2,301	183,390.92 421,982,519	197,300.00 453,987,300	- -	1.27%
30	森トラスト総合リート投資法人 日本	投資証券	2,452	174,247.29 427,254,379	181,100.00 444,057,200	- -	1.24%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 投資有価証券の種類別投資比率

令和1年7月31日現在

種類	投資比率
投資証券	97.48%
合計	97.48%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

## 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和1年7月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフトウェア	599,090	11,668.52 6,990,499,481	15,247.62 9,134,699,062	- -	2.61%
2	APPLE INC アメリカ	株式 コンピュータ・周辺機器	387,571	18,569.40 7,196,963,603	22,681.85 8,790,830,852	- -	2.52%
3	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 インターネット販売・通信販売	34,301	176,977.60 6,070,508,885	206,256.29 7,074,797,318	- -	2.02%
4	FACEBOOK INC アメリカ	株式 インタラクティブ・メディアおよびサービス	195,885	17,849.23 3,496,396,786	21,406.42 4,193,197,678	- -	1.20%
5	ALPHABET INC-CL C アメリカ	株式 インタラクティブ・メディアおよびサービス	26,069	121,848.01 3,176,456,006	133,099.20 3,469,763,295	- -	0.99%
6	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	268,844	11,134.49 2,993,441,011	12,557.69 3,376,061,653	- -	0.97%
7	ALPHABET INC-CL A アメリカ	株式 インタラクティブ・メディアおよびサービス	24,410	122,687.52 2,994,802,586	133,409.91 3,256,536,147	- -	0.93%
8	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	218,908	14,587.04 3,193,221,684	14,349.17 3,141,148,369	- -	0.90%
9	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	252,060	9,697.72 2,444,408,840	11,537.01 2,908,019,295	- -	0.83%
10	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 石油・ガス・消耗燃料	348,433	8,274.21 2,883,008,692	8,186.02 2,852,280,900	- -	0.82%
11	VISA INC アメリカ	株式 情報技術サービス	143,645	15,599.52 2,240,793,868	19,721.41 2,832,883,260	- -	0.81%
12	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品	205,366	10,716.09 2,200,722,143	13,081.34 2,686,462,963	- -	0.77%
13	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 銀行	752,856	3,083.43 2,321,381,099	3,355.88 2,526,501,620	- -	0.72%
14	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 各種金融サービス	107,096	22,016.02 2,357,828,688	22,576.47 2,417,850,530	- -	0.69%
15	THE WALT DISNEY CO アメリカ	株式 娯楽	147,864	12,137.64 1,794,720,983	15,745.19 2,328,147,543	- -	0.67%



16	MASTERCARD INC アメリカ	株式 情報技術サービス	74,867	23,953.77 1,793,346,913	30,219.30 2,262,428,512	- -	0.65%
17	AT&T INC アメリカ	株式 各種電気通信サービス	598,468	3,244.68 1,941,842,724	3,713.31 2,222,300,321	- -	0.64%
18	CISCO SYSTEMS INC アメリカ	株式 通信機器	361,349	5,262.73 1,901,684,713	6,134.90 2,216,840,269	- -	0.63%
19	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 専門小売り	92,646	20,402.71 1,890,229,492	23,613.99 2,187,741,754	- -	0.63%
20	UNITEDHEALTH GROUP INC アメリカ	株式 ヘルスケア・ プロバイ ダー/ヘルス ケア・サー ビス	78,383	28,755.16 2,253,916,291	27,695.59 2,170,863,838	- -	0.62%
21	CHEVRON CORP アメリカ	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	156,297	12,836.70 2,006,339,167	13,508.29 2,111,306,389	- -	0.60%
22	VERIZON COMM INC アメリカ	株式 各種電気通信 サービス	339,647	5,885.24 1,998,904,482	6,152.28 2,089,604,532	- -	0.60%
23	INTEL CORP アメリカ	株式 半導体・半導 体製造装置	369,463	5,510.64 2,035,977,672	5,616.68 2,075,158,398	- -	0.59%
24	COCA-COLA CO/THE アメリカ	株式 飲料	334,203	4,961.31 1,658,086,491	5,836.14 1,950,455,763	- -	0.56%
25	PFIZER INC アメリカ	株式 医薬品	455,494	4,559.18 2,076,682,817	4,214.14 1,919,518,035	- -	0.55%
26	MERCK & CO. INC. アメリカ	株式 医薬品	211,731	8,577.14 1,816,046,720	9,046.45 1,915,414,497	- -	0.55%
27	WELLS FARGO & CO アメリカ	株式 銀行	354,628	5,266.30 1,867,578,420	5,274.47 1,870,475,456	- -	0.54%
28	COMCAST CORP-CL A アメリカ	株式 メディア	370,714	4,058.56 1,504,565,223	4,788.85 1,775,294,183	- -	0.51%
29	NOVARTIS AG-REG SHS スイス	株式 医薬品	177,773	8,625.82 1,533,438,761	9,956.90 1,770,068,019	- -	0.51%
30	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN スイス	株式 医薬品	57,693	29,689.27 1,712,863,101	29,221.09 1,685,852,864	- -	0.48%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 投資有価証券の種類別投資比率

令和1年7月31日現在

種類	投資比率
株式	95.59%
投資信託受益証券	0.24%
投資証券	2.39%
合計	98.22%

（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7月31日現在

業種	国内/外国	投資比率
銀行	外国	7.71%
石油・ガス・消耗燃料		5.36%
ソフトウェア		5.29%
医薬品		5.16%
情報技術サービス		4.29%
保険		3.87%
インタラクティブ・メディアおよびサービス		3.34%
半導体・半導体製造装置		3.03%
コンピュータ・周辺機器		2.80%
ヘルスケア機器・用品		2.80%
資本市場		2.78%
インターネット販売・通信販売		2.55%
航空宇宙・防衛		2.29%
化学		2.24%
飲料		2.05%
各種電気通信サービス		2.02%
食品		2.02%
電力		1.96%
ホテル・レストラン・レジャー		1.92%
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス		1.91%
バイオテクノロジー		1.71%
専門小売り		1.69%
機械		1.58%
繊維・アパレル・贅沢品		1.46%
食品・生活必需品小売り		1.46%
家庭用品		1.42%
金属・鉱業		1.41%
娯楽		1.38%
コングロマリット		1.32%
メディア		1.27%
陸運・鉄道		1.09%
総合公益事業		1.05%
通信機器		0.95%
各種金融サービス		0.93%
タバコ		0.86%
自動車		0.79%
専門サービス		0.76%
ライフサイエンス・ツール/サービス		0.75%

パーソナル用品	0.72%
電気設備	0.69%
不動産管理・開発	0.53%
電子装置・機器・部品	0.52%
消費者金融	0.51%
航空貨物・物流サービス	0.51%
商業サービス・用品	0.48%
複合小売り	0.48%
建設関連製品	0.38%
家庭用耐久財	0.33%
エネルギー設備・サービス	0.33%
建設・土木	0.33%
容器・包装	0.29%
無線通信サービス	0.29%
建設資材	0.28%
自動車部品	0.28%
商社・流通業	0.26%
運送インフラ	0.22%
ガス	0.21%
ヘルスケア・テクノロジー	0.12%
旅客航空輸送業	0.10%
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.10%
紙製品・林産品	0.08%
水道	0.08%
販売	0.06%
レジャー用品	0.05%
海運業	0.05%
各種消費者サービス	0.01%
合計	95.59%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和1年7月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	PROLOGIS INC アメリカ	投資証券	218,468	8,834.97 1,930,159,841	8,909.56 1,946,455,152	- -	4.16%
2	SIMON PROPERTY GROUP INC アメリカ	投資証券	107,010	17,816.38 1,906,531,020	17,405.21 1,862,531,992	- -	3.98%
3	PUBLIC STORAGE アメリカ	投資証券	51,968	26,133.99 1,358,131,366	26,410.38 1,372,494,835	- -	2.93%
4	WELLTOWER INC アメリカ	投資証券	140,202	9,089.31 1,274,339,512	9,120.32 1,278,688,226	- -	2.73%
5	EQUITY RESIDENTIAL アメリカ	投資証券	128,247	8,474.35 1,086,810,989	8,641.22 1,108,211,259	- -	2.37%
6	AVALONBAY COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	48,258	22,570.95 1,089,229,233	22,907.83 1,105,486,079	- -	2.36%
7	VENTAS INC アメリカ	投資証券	127,859	7,634.23 976,106,145	7,354.92 940,393,739	- -	2.01%
8	LINK REIT 香港	投資証券	732,020	1,335.21 977,401,599	1,281.35 937,975,657	- -	2.00%
9	DIGITAL REALTY TRUST INC アメリカ	投資証券	72,083	13,363.03 963,247,502	12,384.95 892,745,071	- -	1.91%
10	REALTY INCOME CORP アメリカ	投資証券	108,945	7,836.12 853,706,273	7,606.97 828,741,651	- -	1.77%
11	BOSTON PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	53,580	14,763.50 791,028,531	14,450.20 774,242,058	- -	1.65%
12	ESSEX PROPERTY TRUST INC アメリカ	投資証券	22,832	32,586.27 744,009,855	33,317.71 760,710,073	- -	1.62%
13	UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD オランダ	投資証券	47,713	16,245.85 775,138,414	15,179.04 724,237,893	- -	1.55%
14	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT アメリカ	投資証券	39,223	15,780.59 618,962,209	16,080.89 630,740,858	- -	1.35%
15	GOODMAN GROUP オーストラリア	投資信託受益 証券	558,805	1,125.64 629,014,601	1,109.89 620,217,222	- -	1.32%
16	HCP INC アメリカ	投資証券	165,619	3,550.99 588,112,281	3,503.63 580,269,353	- -	1.24%
17	WP CAREY INC アメリカ	投資証券	59,035	9,285.12 548,147,284	9,385.40 554,067,655	- -	1.18%
18	SCENTRE GROUP オーストラリア	投資信託受益 証券	1,844,659	287.33 530,041,720	295.37 544,868,734	- -	1.16%
19	EXTRA SPACE STORAGE INC アメリカ	投資証券	44,154	11,704.99 516,822,392	12,156.81 536,772,053	- -	1.15%
20	MID AMERICA アメリカ	投資証券	39,489	12,941.67 511,053,950	12,952.06 511,463,928	- -	1.09%
21	UDR INC アメリカ	投資証券	97,966	4,960.13 485,924,433	5,062.62 495,965,022	- -	1.06%
22	HOST HOTELS & RESORTS INC アメリカ	投資証券	256,636	1,974.18 506,647,055	1,920.75 492,934,931	- -	1.05%

23	DUKE REALTY TRUST アメリカ	投資証券	124,471	3,467.38 431,588,403	3,658.99 455,438,791	- -	0.97%
24	SUN COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	31,230	14,110.76 440,679,276	14,498.00 452,772,789	- -	0.97%
25	INVITATION HOMES INC アメリカ	投資証券	145,426	2,957.22 430,056,763	3,015.84 438,582,478	- -	0.94%
26	VORNADO REALTY TRUST アメリカ	投資証券	60,103	7,249.81 435,735,734	7,008.36 421,223,845	- -	0.90%
27	REGENCY CENTERS CORP アメリカ	投資証券	57,857	7,549.25 436,777,266	7,271.27 420,694,169	- -	0.90%
28	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES アメリカ	投資証券	31,137	13,267.28 413,103,349	13,453.97 418,916,500	- -	0.89%
29	SEGRO PLC イギリス	投資証券	375,433	980.79 368,224,626	1,032.26 387,547,974	- -	0.83%
30	CAMDEN PROPERTY TRUST アメリカ	投資証券	33,542	11,536.67 386,963,159	11,525.61 386,592,265	- -	0.83%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

令和1年7月31日現在

種類	投資比率
投資信託受益証券	10.77%
投資証券	88.70%
合計	99.48%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

## 為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和1年7月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	US T N/B 1.75 05/15/23 アメリカ	国債証券	3,751,339,200	99.85 3,746,049,811	99.70 3,740,197,722	1.750000 2023/5/15	0.78%
2	US T N/B 1.5 03/31/23 アメリカ	国債証券	3,180,979,200	98.97 3,148,405,972	98.84 3,144,175,270	1.500000 2023/3/31	0.65%
3	US T N/B 2.875 08/15/28 アメリカ	国債証券	2,853,972,800	106.90 3,051,042,120	106.91 3,051,296,479	2.875000 2028/8/15	0.63%
4	US T N/B 2.0 08/15/25 アメリカ	国債証券	2,891,996,800	100.58 2,908,812,641	100.54 2,907,787,102	2.000000 2025/8/15	0.60%
5	US T N/B 2.25 11/15/25 アメリカ	国債証券	2,811,603,200	102.03 2,868,706,860	101.93 2,866,063,953	2.250000 2025/11/15	0.60%
6	US T N/B 2.75 08/15/21 アメリカ	国債証券	2,725,777,600	102.05 2,781,874,103	101.79 2,774,623,534	2.750000 2021/8/15	0.58%
7	US T N/B 1.75 06/15/22 アメリカ	国債証券	2,758,369,600	99.91 2,756,074,168	99.86 2,754,590,633	1.750000 2022/6/15	0.57%
8	US T N/B 2.0 05/31/24 アメリカ	国債証券	2,712,740,800	100.94 2,738,326,841	100.75 2,733,086,356	2.000000 2024/5/31	0.57%
9	US T N/B 1.375 08/31/20 アメリカ	国債証券	2,750,764,800	99.37 2,733,655,042	99.34 2,732,692,275	1.375000 2020/8/31	0.57%
10	US T N/B 3.125 11/15/28 アメリカ	国債証券	2,316,204,800	109.09 2,526,909,950	109.10 2,527,187,895	3.125000 2028/11/15	0.52%
11	US T N/B 2.25 04/15/22 アメリカ	国債証券	2,479,164,800	101.33 2,512,360,816	101.10 2,506,559,571	2.250000 2022/4/15	0.52%
12	US T N/B 1.5 08/15/20 アメリカ	国債証券	2,485,683,200	99.53 2,474,124,773	99.47 2,472,757,647	1.500000 2020/8/15	0.51%
13	US T N/B 2.625 02/15/29 アメリカ	国債証券	2,350,969,600	104.85 2,465,109,174	104.92 2,466,660,814	2.625000 2029/2/15	0.51%
14	US T N/B 2.875 07/31/25 アメリカ	国債証券	2,314,032,000	105.70 2,446,001,244	105.50 2,441,303,760	2.875000 2025/7/31	0.51%
15	US T N/B 2.125 05/31/21 アメリカ	国債証券	2,399,857,600	100.52 2,412,576,605	100.44 2,410,440,972	2.125000 2021/5/31	0.50%
16	US T N/B 2.0 02/15/25 アメリカ	国債証券	2,354,228,800	100.70 2,370,943,824	100.63 2,369,295,864	2.000000 2025/2/15	0.49%
17	US T N/B 2.375 05/15/27 アメリカ	国債証券	2,169,540,800	102.89 2,232,414,092	102.90 2,232,587,655	2.375000 2027/5/15	0.46%
18	US T N/B 2.125 03/31/24 アメリカ	国債証券	2,199,960,000	101.40 2,230,891,437	101.24 2,227,283,503	2.125000 2024/3/31	0.46%
19	FRANCE OAT 1.5 05/25/31 フランス	国債証券	1,888,140,200	115.21 2,175,439,612	117.61 2,220,830,503	1.500000 2031/5/25	0.46%
20	FRANCE OAT 5.75 10/25/32 フランス	国債証券	1,207,052,400	172.29 2,079,739,214	175.26 2,115,492,106	5.750000 2032/10/25	0.44%
21	US T N/B 2.75 09/30/20 アメリカ	国債証券	2,048,950,400	101.05 2,070,628,295	100.88 2,067,186,058	2.750000 2020/9/30	0.43%
22	FRANCE OAT 1.0 11/25/25 フランス	国債証券	1,840,876,100	108.56 1,998,473,502	109.44 2,014,673,212	1.000000 2025/11/25	0.42%
23	FRANCE OAT 5.5 04/25/29 フランス	国債証券	1,288,249,700	154.23 1,986,970,572	156.08 2,010,751,661	5.500000 2029/4/25	0.42%

24	US T N/B 2.5 01/31/21 アメリカ	国債証券	1,950,088,000	101.03 1,970,271,410	100.86 1,966,917,259	2.500000 2021/1/31	0.41%
25	US T N/B 2.875 10/31/20 アメリカ	国債証券	1,827,324,800	101.33 1,851,792,679	101.12 1,847,937,023	2.875000 2020/10/31	0.38%
26	US T N/B 2.625 07/15/21 アメリカ	国債証券	1,811,028,800	101.70 1,841,997,392	101.45 1,837,415,489	2.625000 2021/7/15	0.38%
27	FRANCE OAT 2.25 10/25/22 フランス	国債証券	1,653,031,600	109.70 1,813,392,195	109.69 1,813,309,543	2.250000 2022/10/25	0.38%
28	SPAIN 2.75 10/31/24 スペイン	国債証券	1,565,774,800	115.15 1,803,052,313	115.61 1,810,270,535	2.750000 2024/10/31	0.38%
29	US T N/B 3.375 11/15/48 アメリカ	国債証券	1,542,688,000	116.20 1,792,649,736	116.37 1,795,303,160	3.375000 2048/11/15	0.37%
30	US T N/B 2.625 06/15/21 アメリカ	国債証券	1,766,486,400	101.65 1,795,810,074	101.38 1,790,969,901	2.625000 2021/6/15	0.37%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

令和1年7月31日現在

種類	投資比率
国債証券	96.82%
合計	96.82%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

## エマージング株式パッシブ・マザーファンド

令和1年7月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	TENCENT HOLDINGS LTD ケイマン諸島	株式 インタラク ティブ・メ ディアおよび サービス	511,900	5,366.50 2,747,112,749	5,183.74 2,653,560,601	- -	4.50%
2	ALIBABA GROUP HOLDING LTD- ADR ケイマン諸島	株式 インターネッ ト販売・通信 販売	127,273	19,624.49 2,497,668,527	18,914.22 2,407,270,031	- -	4.08%
3	TAIWAN SEMICONDUCTOR 台湾	株式 半導体・半導 体製造装置	2,200,083	901.38 1,983,113,753	910.00 2,002,075,530	- -	3.39%
4	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD 韓国	株式 コンピュー タ・周辺機器	427,247	4,270.70 1,824,645,163	4,282.59 1,829,728,002	- -	3.10%
5	NASPERS LTD 南アフリカ	株式 インターネッ ト販売・通信 販売	39,254	27,237.93 1,069,197,728	27,074.63 1,062,787,604	- -	1.80%
6	ISHARES MSCI SAUDI ARABIA CAPPED UCITS ETF アイルランド	投資信託受益 証券 -	1,435,616	540.82 776,423,030	519.73 746,138,101	- -	1.27%
7	CHINA CONSTRUCTION BANK 中国	株式 銀行	8,583,530	97.74 838,958,781	85.42 733,235,174	- -	1.24%
8	PING AN INSURANCE GROUP CO-H 中国	株式 保険	493,500	1,290.90 637,060,868	1,321.63 652,226,132	- -	1.11%
9	CHINA MOBILE LIMITED 香港	株式 無線通信サー ビス	544,500	1,046.21 569,661,624	937.57 510,509,587	- -	0.87%
10	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP インド	株式 貯蓄・抵当・ 不動産金融	146,019	3,247.57 474,208,213	3,382.32 493,884,079	- -	0.84%
11	RELIANCE INDUSTRIES LTD インド	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	254,856	2,131.55 543,238,559	1,877.63 478,525,526	- -	0.81%
12	ITAU UNIBANCO HOLDING SA ブラジル	株式 銀行	429,647	935.13 401,779,507	1,024.81 440,306,756	- -	0.75%
13	IND & COMM BK OF CHINA - H 中国	株式 銀行	5,827,235	83.65 487,454,742	74.58 434,649,379	- -	0.74%
14	VALE SA ブラジル	株式 金属・鉱業	284,121	1,487.91 422,746,694	1,432.78 407,084,733	- -	0.69%
15	SBERBANK ADR ロシア	株式 銀行	243,502	1,612.60 392,671,356	1,638.29 398,927,183	- -	0.68%



16	INFOSYS LTD インド	株式 情報技術サービス	313,352	1,152.36 361,094,331	1,260.39 394,946,667	- -	0.67%
17	GAZPROM PAO ADR ロシア	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	483,486	565.00 273,171,352	802.19 387,851,385	- -	0.66%
18	BANCO BRADESCO SA PREF ブラジル	株式 銀行	363,650	990.21 360,093,264	1,014.20 368,817,466	- -	0.63%
19	SK HYNIX INC 韓国	株式 半導体・半導 体製造装置	49,053	7,281.08 357,159,195	7,258.79 356,065,916	- -	0.60%
20	LUKOIL SPON ADR ロシア	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	37,740	9,378.07 353,928,543	8,684.68 327,759,883	- -	0.56%
21	BANK OF CHINA LTD 中国	株式 銀行	6,952,200	52.14 362,540,853	44.86 311,908,367	- -	0.53%
22	BAIDU INC -SPON ADR ケイマン諸島	株式 インタラク ティブ・メ ディアおよび サービス	24,909	17,675.49 440,279,006	12,249.15 305,114,326	- -	0.52%
23	HON HAI PRECISION INDUSTRY 台湾	株式 電子装置・機 器・部品	1,115,225	315.89 352,291,663	272.29 303,675,767	- -	0.51%
24	CNOOC LTD 香港	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	1,591,000	202.76 322,598,107	182.23 289,938,748	- -	0.49%
25	PETROLEO BRASILEIRO SA ブラジル	株式 石油・ガス・ 消耗燃料	374,912	766.07 287,209,119	751.77 281,849,843	- -	0.48%
26	TATA CONSULTANCY SERVICES LTD インド	株式 情報技術サー ビス	80,435	3,382.82 272,097,650	3,464.84 278,695,089	- -	0.47%
27	SAMSUNG ELECTRONICS-PFD 韓国	株式 コンピュー タ・周辺機器	73,481	3,439.85 252,763,942	3,500.59 257,227,588	- -	0.44%
28	AMBEV SA ブラジル	株式 飲料	419,695	489.38 205,394,535	582.74 244,573,483	- -	0.41%
29	AMERICA MOVIL SAB DE CV メキシコ	株式 無線通信サー ビス	3,017,678	84.06 253,672,451	78.60 237,198,543	- -	0.40%
30	QATAR NATIONAL BANK カタール	株式 銀行	398,770	537.97 214,529,226	583.30 232,603,577	- -	0.39%

(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7月31日現在

種類	投資比率
株式	88.49%
新株予約権証券	0.00%
投資信託受益証券	1.65%
投資証券	0.06%
合計	90.21%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 投資株式の業種別投資比率

令和1年7月31日現在

業種	国内/外国	投資比率
銀行	外国	14.93%
インターネット販売・通信販売		6.87%
石油・ガス・消耗燃料		6.85%
インタラクティブ・メディアおよびサービス		5.77%
半導体・半導体製造装置		4.95%
コンピュータ・周辺機器		4.35%
保険		3.67%
金属・鉱業		2.95%
無線通信サービス		2.60%
不動産管理・開発		2.45%
化学		1.82%
電子装置・機器・部品		1.81%
食品		1.66%
食品・生活必需品小売り		1.64%
情報技術サービス		1.63%
自動車		1.58%
各種電気通信サービス		1.35%
資本市場		1.32%
コングロマリット		1.23%
医薬品		1.08%
電力		0.98%
建設資材		0.97%
飲料		0.96%
貯蓄・抵当・不動産金融		0.91%
運送インフラ		0.89%
各種金融サービス		0.76%
繊維・アパレル・贅沢品		0.76%
ホテル・レストラン・レジャー		0.68%
建設・土木		0.67%
娯楽		0.61%
ガス		0.61%
パーソナル用品		0.59%
独立系発電事業者・エネルギー販売業者		0.56%
複合小売り		0.55%
各種消費者サービス		0.54%
機械		0.54%
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス		0.48%

タバコ	0.47%
自動車部品	0.47%
専門小売り	0.46%
家庭用品	0.39%
バイオテクノロジー	0.37%
家庭用耐久財	0.32%
陸運・鉄道	0.32%
メディア	0.30%
水道	0.27%
旅客航空輸送業	0.24%
ライフサイエンス・ツール/サービス	0.24%
紙製品・林産品	0.23%
消費者金融	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	0.16%
ソフトウェア	0.15%
航空宇宙・防衛	0.15%
商業サービス・用品	0.14%
ヘルスケア機器・用品	0.09%
海運業	0.09%
エネルギー設備・サービス	0.08%
通信機器	0.06%
ヘルスケア・テクノロジー	0.06%
総合公益事業	0.05%
容器・包装	0.05%
商社・流通業	0.05%
レジャー用品	0.04%
専門サービス	0.03%
建設関連製品	0.03%
合計	88.49%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## エマージング債券パッシブ・マザーファンド

令和1年7月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率(%) 償還日	投資 比率
1	RUSSIAN FEDERATION 5.25 06/23/47 ロシア	国債証券	2,498,720,000	103.83 2,594,649,120	112.12 2,801,564,864	5.250000 2047/6/23	2.96%
2	COLOMBIA 5.0 06/15/45 コロンビア	国債証券	1,629,600,000	104.64 1,705,322,080	110.97 1,808,464,896	5.000000 2045/6/15	1.91%
3	PERU 5.625 11/18/50 ペルー	国債証券	1,195,040,000	128.22 1,532,280,288	138.38 1,653,732,203	5.625000 2050/11/18	1.75%
4	BRAZIL 4.25 01/07/25 ブラジル	国債証券	1,423,184,000	101.24 1,440,851,580	105.55 1,502,241,871	4.250000 2025/1/7	1.59%
5	UNITED MEXICAN STATES 4.75 03/08/44 メキシコ	国債証券	1,455,776,000	98.78 1,438,122,000	103.10 1,500,919,613	4.750000 2044/3/8	1.59%
6	HUNGARY 6.375 03/29/21 ハンガリー	国債証券	1,303,680,000	106.49 1,388,327,942	106.39 1,387,011,225	6.375000 2021/3/29	1.47%
7	ROMANIA 6.75 02/07/22 ルーマニア	国債証券	1,249,360,000	109.18 1,364,115,345	109.71 1,370,685,349	6.750000 2022/2/7	1.45%
8	RUSSIAN FEDERATION 03/31/30 ロシア	国債証券	1,173,312,000	111.50 1,308,242,880	112.72 1,322,674,617	7.500000 2030/3/31	1.40%
9	UNITED MEXICAN STATES 6.05 01/11/40 メキシコ	国債証券	1,075,536,000	114.09 1,227,149,529	119.62 1,286,620,695	6.050000 2040/1/11	1.36%
10	RUSSIAN FEDERATION 5.625 04/04/42 ロシア	国債証券	1,064,672,000	110.73 1,179,014,296	118.60 1,262,807,459	5.625000 2042/4/4	1.33%
11	RUSSIAN FEDERATION 4.75 05/27/26 ロシア	国債証券	1,129,856,000	103.65 1,171,117,472	107.48 1,214,470,915	4.750000 2026/5/27	1.28%
12	BRAZIL 5.0 01/27/45 ブラジル	国債証券	1,173,312,000	91.09 1,068,823,786	103.37 1,212,946,479	5.000000 2045/1/27	1.28%
13	PANAMA 6.7 01/26/36 パナマ	国債証券	858,256,000	131.08 1,125,009,569	136.96 1,175,553,243	6.700000 2036/1/26	1.24%
14	UNITED MEXICAN STATES 4.15 03/28/27 メキシコ	国債証券	1,129,856,000	102.32 1,156,146,880	104.00 1,175,095,434	4.150000 2027/3/28	1.24%
15	COLOMBIA 5.625 02/26/44 コロンビア	国債証券	977,760,000	113.66 1,111,370,904	119.62 1,169,655,177	5.625000 2044/2/26	1.24%
16	BRAZIL 5.625 02/21/47 ブラジル	国債証券	1,042,944,000	98.10 1,023,191,944	111.61 1,164,061,086	5.625000 2047/2/21	1.23%
17	PERU 7.35 07/21/25 ペルー	国債証券	901,712,000	124.17 1,119,745,961	126.93 1,144,633,212	7.350000 2025/7/21	1.21%
18	INDONESIA 4.875 05/05/21 インドネシア	国債証券	1,097,264,000	103.51 1,135,876,720	104.00 1,141,154,560	4.875000 2021/5/5	1.21%
19	BRAZIL 4.625 01/13/28 ブラジル	国債証券	1,064,672,000	100.42 1,069,181,429	106.27 1,131,480,168	4.625000 2028/1/13	1.20%

20	PHILIPPINES 9.5 02/02/30 フィリピン	国債証券	695,296,000	153.88 1,069,945,385	161.25 1,121,206,517	9.500000 2030/2/2	1.18%
21	HUNGARY 5.75 11/22/23 ハンガリー	国債証券	977,760,000	111.35 1,088,755,315	112.95 1,104,438,585	5.750000 2023/11/22	1.17%
22	RUSSIAN FEDERATION 4.875 09/16/23 ロシア	国債証券	1,021,216,000	105.99 1,082,473,098	107.50 1,097,827,624	4.875000 2023/9/16	1.16%
23	UNITED MEXICAN STATES 4.6 01/23/46 メキシコ	国債証券	1,086,400,000	96.88 1,052,504,320	100.67 1,093,744,064	4.600000 2046/1/23	1.16%
24	COLOMBIA 6.125 01/18/41 コロンビア	国債証券	869,120,000	117.43 1,020,679,318	125.37 1,089,667,891	6.125000 2041/1/18	1.15%
25	UNITED MEXICAN STATES 4.0 10/02/23 メキシコ	国債証券	1,032,080,000	103.18 1,064,915,353	104.72 1,080,866,421	4.000000 2023/10/2	1.14%
26	BRAZIL 2.625 01/05/23 ブラジル	国債証券	1,064,672,000	97.78 1,041,046,928	99.85 1,063,085,638	2.625000 2023/1/5	1.12%
27	BRAZIL 4.875 01/22/21 ブラジル	国債証券	1,021,216,000	103.38 1,055,785,248	104.00 1,062,074,852	4.875000 2021/1/22	1.12%
28	UNITED MEXICAN STATES 5.55 01/21/45 メキシコ	国債証券	912,576,000	109.31 997,604,616	115.35 1,052,665,541	5.550000 2045/1/21	1.11%
29	CROATIA 6.0 01/26/24 クロアチア	国債証券	912,576,000	111.98 1,021,924,984	114.35 1,043,612,787	6.000000 2024/1/26	1.10%
30	INDONESIA 7.75 01/17/38 インドネシア	国債証券	706,160,000	137.16 968,632,610	146.31 1,033,189,757	7.750000 2038/1/17	1.09%

(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7月31日現在

種類	投資比率
国債証券	96.33%
合計	96.33%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)

令和1年7月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
為替予約取引	-	ユーロ買/円売2019年08月	買建	37,900	4,659,926	4,593,480	6.98%
		イギリス・ポンド買/円売2019年08月	買建	19,000	2,606,266	2,505,530	3.80%
		アメリカ・ドル買/円売2019年08月	買建	13,700	1,474,154	1,485,080	2.26%
		オーストラリア・ドル買/円売2019年08月	買建	17,700	1,337,887	1,318,827	2.00%
		カナダ・ドル買/円売2019年08月	買建	8,900	728,046	734,517	1.12%
		アメリカ・ドル売/円買2019年08月	売建	86,100	9,316,873	9,333,240	14.17%
		イギリス・ポンド売/円買2019年08月	売建	70,400	9,784,454	9,283,648	14.10%
		ユーロ売/円買2019年08月	売建	67,800	8,334,903	8,217,360	12.48%
		カナダ・ドル売/円買2019年08月	売建	44,700	3,656,907	3,689,091	5.60%
		オーストラリア・ドル売/円買2019年08月	売建	48,400	3,656,700	3,606,284	5.48%

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

(注2) 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。

## 投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）

令和1年7月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
為替予約取引	-	ユーロ買/円売2019年08月	買建	32,500	3,995,979	3,939,000	7.21%
		イギリス・ポンド買/円売2019年08月	買建	16,500	2,263,336	2,175,855	3.98%
		アメリカ・ドル買/円売2019年08月	買建	11,700	1,258,949	1,268,280	2.32%
		オーストラリア・ドル買/円売2019年08月	買建	15,400	1,164,038	1,147,454	2.10%
		カナダ・ドル買/円売2019年08月	買建	8,000	654,651	660,240	1.21%
		イギリス・ポンド売/円買2019年08月	売建	59,200	8,232,468	7,806,704	14.29%
		アメリカ・ドル売/円買2019年08月	売建	71,800	7,769,602	7,783,120	14.25%
		ユーロ売/円買2019年08月	売建	57,300	7,042,019	6,944,760	12.71%
		カナダ・ドル売/円買2019年08月	売建	37,700	3,082,701	3,111,381	5.70%
		オーストラリア・ドル売/円買2019年08月	売建	40,900	3,089,537	3,047,459	5.58%

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

為替予約取引の数量は、現地通貨建契約金額です。

（参考）

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

令和1年7月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
株価指数先物取引	大阪取引所	TOPIX先物 0109月	買建	138	2,175,314,712	2,161,080,000	0.85%

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

## J-REITインデックスファンド・マザーファンド

令和1年7月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
不動産投信指 数先物取引	大阪取引所	TREIT 先物 0109月	買建	351	668,763,108	704,106,000	1.97%

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

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



## 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和1年7月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
為替予約取引	-	アメリカ・ドル買/円 売2019年08月	買建	69,000	7,512,306	7,495,470	0.00%
		ユーロ買/円売201 9年08月	買建	14,000	1,698,228	1,696,660	0.00%
		カナダ・ドル買/円売 2019年08月	買建	11,000	909,942	909,260	0.00%
		イギリス・ポンド買/ 円売2019年08月	買建	5,000	664,720	659,800	0.00%
		オーストラリア・ドル 買/円売2019年0 8月	買建	6,000	451,110	447,480	0.00%
		アメリカ・ドル売/円 買2019年08月	売建	2,748,000	298,493,256	298,487,760	0.09%
		ユーロ売/円買201 9年08月	売建	590,000	71,502,690	71,502,100	0.02%
		イギリス・ポンド売/ 円買2019年08月	売建	190,000	25,072,780	25,072,400	0.01%
		カナダ・ドル売/円買 2019年08月	売建	186,000	15,374,760	15,374,760	0.00%
		オーストラリア・ドル 売/円買2019年0 8月	売建	132,000	9,844,956	9,844,560	0.00%
株価指数先物 取引	シカゴ商品 取引所	S&P500 EMI NI FUT Sep 19	買建	247	3,992,761,724	4,041,547,874	1.16%
	EUREX 取引所	DJ EURO ST OXX 50 Sep 19	買建	225	950,279,875	943,191,472	0.27%
	ICE-E EU	FTSE 100 I NDEX FUTUR E Sep19	買建	34	333,593,106	340,561,782	0.10%
	モン トリ オール 取引 所	S&P/TSE 6 0 IX FUT S ep19	買建	13	211,671,574	210,621,665	0.06%
	シド ニー 先 物 取引 所	SPI 200 FU TURES Sep1 9	買建	13	160,733,991	164,431,790	0.05%

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

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

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

## 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和1年7月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
為替予約取引	-	アメリカ・ドル売/円買2019年08月	売建	600,000	65,176,680	65,178,000	0.14%
		イギリス・ポンド売/円買2019年08月	売建	65,000	8,577,400	8,577,400	0.02%
		オーストラリア・ドル売/円買2019年08月	売建	70,000	5,220,600	5,220,600	0.01%
		ユーロ売/円買2019年08月	売建	40,000	4,847,568	4,847,600	0.01%
		香港・ドル売/円買2019年08月	売建	200,000	2,776,000	2,776,000	0.01%
		シンガポール・ドル売/円買2019年08月	売建	30,000	2,377,200	2,377,200	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。

## 為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和1年7月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
為替予約取引	-	アメリカ・ドル売/円買2019年08月	売建	2,113,781,387	227,199,991,293	229,536,227,952	47.66%
		ユーロ売/円買2019年08月	売建	1,531,128,285	187,767,541,600	185,557,436,874	38.53%
		イギリス・ポンド売/円買2019年08月	売建	225,675,200	30,889,415,315	29,777,842,640	6.18%
		オーストラリア・ドル売/円買2019年08月	売建	120,603,300	9,104,320,322	8,993,388,081	1.87%
		カナダ・ドル売/円買2019年08月	売建	105,246,100	8,660,647,577	8,697,537,704	1.81%
		メキシコ・ペソ売/円買2019年08月	売建	599,909,700	3,336,320,408	3,413,486,193	0.71%
		ポーランド・ズロチ売/円買2019年08月	売建	97,238,900	2,804,118,513	2,740,192,202	0.57%
		南アフリカ・ランド売/円買2019年08月	売建	350,229,500	2,664,295,186	2,672,251,085	0.55%
		デンマーク・クローネ売/円買2019年08月	売建	111,702,300	1,836,756,216	1,812,928,329	0.38%
		シンガポール・ドル売/円買2019年08月	売建	20,357,700	1,617,712,293	1,612,736,994	0.33%
		スウェーデン・クローナ売/円買2019年08月	売建	107,322,000	1,246,144,289	1,218,104,700	0.25%
		マレーシア・リングgit売/円買2019年08月	売建	41,940,000	1,086,761,862	1,103,022,000	0.23%
ノルウェー・クローネ売/円買2019年08月	売建	61,022,400	769,832,175	756,067,536	0.16%		

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

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

為替予約取引の数量は、現地通貨建契約金額です。

## エマージング株式パッシブ・マザーファンド

令和1年7月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資 比率
為替予約取引	-	アメリカ・ドル売/円 買2019年08月	売建	1,629,000	177,010,730	176,944,730	0.30%
株価指数先物 取引	ICE-US	MINI MSCI EMG MKT Sep 19	買建	992	5,571,668,127	5,589,536,691	9.48%

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

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

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

## エマージング債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

## (3) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

直近日(令和1年7月末)、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。  
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)

	純資産総額 (分配落) (百万円)	純資産総額 (分配付) (百万円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (平成30年1月11日)	10	10	1.0321	1.0321
第2計算期間末 (平成31年1月11日)	31	31	0.9913	0.9913
平成30年7月末日	22	-	1.0180	-
8月末日	24	-	1.0212	-
9月末日	26	-	1.0278	-
10月末日	27	-	0.9995	-
11月末日	30	-	1.0084	-
12月末日	31	-	0.9777	-
平成31年1月末日	37	-	1.0034	-
2月末日	39	-	1.0128	-
3月末日	41	-	1.0321	-
4月末日	46	-	1.0387	-
令和1年5月末日	49	-	1.0325	-
6月末日	58	-	1.0522	-
7月末日	65	-	1.0650	-

## 投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)

	純資産総額 (分配落) (百万円)	純資産総額 (分配付) (百万円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (平成30年1月11日)	10	10	1.0321	1.0321
第2計算期間末 (平成31年1月11日)	24	24	0.9907	0.9907
平成30年7月末日	14	-	1.0180	-
8月末日	15	-	1.0210	-
9月末日	19	-	1.0279	-
10月末日	20	-	0.9994	-
11月末日	23	-	1.0083	-
12月末日	23	-	0.9770	-
平成31年1月末日	26	-	1.0029	-
2月末日	31	-	1.0124	-
3月末日	38	-	1.0318	-
4月末日	40	-	1.0385	-
令和1年5月末日	41	-	1.0323	-
6月末日	50	-	1.0519	-
7月末日	54	-	1.0648	-

## 【分配の推移】

## 投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)

	1口当たりの分配金(円)
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
平成31年1月12日～ 令和1年7月11日	-

## 投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)

	1口当たりの分配金(円)
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
平成31年1月12日～ 令和1年7月11日	-

## 【収益率の推移】

投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2045）

	収益率(%)
第1計算期間	3.2
第2計算期間	4.0
平成31年1月12日～ 令和1年7月11日	7.2

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

なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2055）

	収益率(%)
第1計算期間	3.2
第2計算期間	4.0
平成31年1月12日～ 令和1年7月11日	7.2

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

なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

## （4）【設定及び解約の実績】

投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2045）

	設定口数	解約口数
第1計算期間	10,000,000	0
第2計算期間	24,073,563	1,857,992
平成31年1月12日～ 令和1年7月11日	29,299,750	4,318,132

（注1）本邦外における設定及び解約はございません。

（注2）第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2055）

	設定口数	解約口数
第1計算期間	10,371,948	0
第2計算期間	22,953,363	8,382,806
平成31年1月12日～ 令和1年7月11日	24,824,686	719,323

（注1）本邦外における設定及び解約はございません。

（注2）第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

&lt;&lt; 参考情報 &gt;&gt;

データの基準日:2019年7月31日

ターゲット・イヤー2045

## 基準価額・純資産の推移 (2017年6月23日～2019年7月31日)



## 分配の推移(税引前)

第1期(2018.01.11)	0円
第2期(2019.01.11)	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たりです。

※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。

※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額とは異なります。(設定日:2017年6月23日)

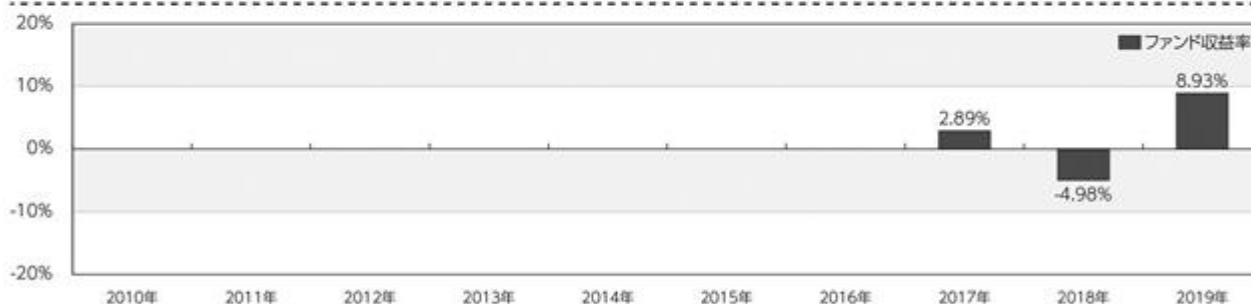
※設定時から10年以上経過した場合は、直近10年分を記載しています。

## 主要な資産の状況

■組入銘柄 ※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

順位	銘柄名	比率(%)
1	為替フルヘッジ外国債券/パッシブ・ファンド・マザーファンド	38.77
2	エマージング債券/パッシブ・マザーファンド	14.91
3	外国リート/パッシブ・ファンド・マザーファンド	10.00
4	国内株式/パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	8.92
5	エマージング株式/パッシブ・マザーファンド	8.86
6	外国株式/パッシブ・ファンド・マザーファンド	6.96
7	国内債券/パッシブ・ファンド・マザーファンド	4.97
8	J-REITインデックスファンド・マザーファンド	3.99

## 年間収益率の推移(暦年ベース)



※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。

※2017年は設定日から年末までの収益率、および2019年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

※当ファンドにはベンチマークはありません。

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

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。



データの基準日:2019年7月31日

## ターゲット・イヤー2055

## 基準価額・純資産の推移 (2017年6月23日～2019年7月31日)

## 分配の推移(税引前)



第1期(2018.01.11)	0円
第2期(2019.01.11)	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たりです。

※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。

※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額とは異なります。(設定日:2017年6月23日)

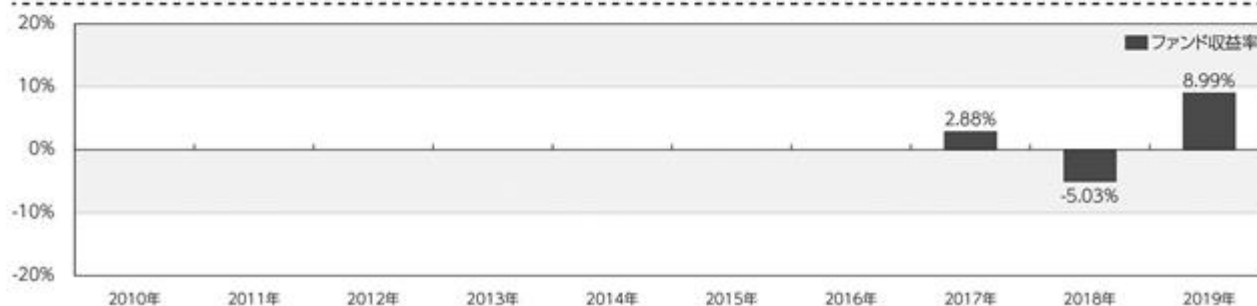
※設定時から10年以上経過した場合は、直近10年分を記載しています。

## 主要な資産の状況

## ■組入銘柄 ※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

順位	銘柄名	比率(%)
1	為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	38.79
2	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	14.91
3	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	10.01
4	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	8.91
5	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	8.86
6	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	6.96
7	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	4.98
8	J-REITインデックスファンド・マザーファンド	3.98

## 年間収益率の推移(暦年ベース)



※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。

※2017年は設定日から年末までの収益率、および2019年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

※当ファンドにはベンチマークはありません。

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

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

## 主要な資産の状況

### ■国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

#### 組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還期限	比率(%)
1	350回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.100000	2028/3/20	1.03
2	341回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.300000	2025/12/20	0.91
3	343回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.100000	2026/6/20	0.91
4	126回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.100000	2020/12/20	0.90
5	342回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.100000	2026/3/20	0.87

### ■国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

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

#### 組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	業種	比率(%)
1	トヨタ自動車	株式	日本	輸送用機器	3.46
2	ソフトバンクグループ	株式	日本	情報・通信業	1.93
3	ソニー	株式	日本	電気機器	1.83
4	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	日本	銀行業	1.57
5	日本電信電話	株式	日本	情報・通信業	1.46

### ■為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

#### 組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還期限	比率(%)
1	US T N/B 1.75 05/15/23	国債証券	アメリカ	1.750000	2023/5/15	0.78
2	US T N/B 1.5 03/31/23	国債証券	アメリカ	1.500000	2023/3/31	0.65
3	US T N/B 2.875 08/15/28	国債証券	アメリカ	2.875000	2028/8/15	0.63
4	US T N/B 2.0 08/15/25	国債証券	アメリカ	2.000000	2025/8/15	0.60
5	US T N/B 2.25 11/15/25	国債証券	アメリカ	2.250000	2025/11/15	0.60

### ■外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

#### 組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	業種	比率(%)
1	MICROSOFT CORP	株式	アメリカ	ソフトウェア	2.61
2	APPLE INC	株式	アメリカ	コンピュータ・周辺機器	2.52
3	AMAZON.COM INC	株式	アメリカ	インターネット販売・通信販売	2.02
4	FACEBOOK INC	株式	アメリカ	インタラクティブ・メディアおよびサービス	1.20
5	ALPHABET INC-CL C	株式	アメリカ	インタラクティブ・メディアおよびサービス	0.99

### ■J-REITインデックスファンド・マザーファンド

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

#### 組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	比率(%)
1	日本ビルファンド投資法人	投資証券	日本	7.09
2	ジャパンリアルエステイト投資法人	投資証券	日本	6.52
3	野村不動産マスターファンド投資法人	投資証券	日本	5.16
4	オリックス不動産投資法人	投資証券	日本	4.03
5	日本リテールファンド投資法人	投資証券	日本	3.96

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

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

データの基準日:2019年7月31日

### ■外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

#### 組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	比率(%)
1	PROLOGIS INC	投資証券	アメリカ	4.16
2	SIMON PROPERTY GROUP INC	投資証券	アメリカ	3.98
3	PUBLIC STORAGE	投資証券	アメリカ	2.93
4	WELLTOWER INC	投資証券	アメリカ	2.73
5	EQUITY RESIDENTIAL	投資証券	アメリカ	2.37

### ■エマージング債券パッシブ・マザーファンド

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

#### 組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還期限	比率(%)
1	RUSSIAN FEDERATION 5.25 06/23/47	国債証券	ロシア	5.250000	2047/6/23	2.96
2	COLOMBIA 5.0 06/15/45	国債証券	コロンビア	5.000000	2045/6/15	1.91
3	PERU 5.625 11/18/50	国債証券	ペルー	5.625000	2050/11/18	1.75
4	BRAZIL 4.25 01/07/25	国債証券	ブラジル	4.250000	2025/1/7	1.59
5	UNITED MEXICAN STATES 4.75 03/08/44	国債証券	メキシコ	4.750000	2044/3/8	1.59

### ■エマージング株式パッシブ・マザーファンド

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

#### 組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	業種	比率(%)
1	TENCENT HOLDINGS LTD	株式	ケイマン諸島	インタラクティブメディアおよびサービス	4.50
2	ALIBABA GROUP HOLDING LTD-ADR	株式	ケイマン諸島	インターネット販売・通信販売	4.08
3	TAIWAN SEMICONDUCTOR	株式	台湾	半導体・半導体製造装置	3.39
4	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	株式	韓国	コンピュータ・周辺機器	3.10
5	NASPERS LTD	株式	南アフリカ	インターネット販売・通信販売	1.80

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

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込（販売）手続等】

お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

確定拠出年金制度のご利用によるお申込みの場合には、確定拠出年金制度にかかる手続きが必要となります。この場合、「分配金自動けいぞく投資コース」でのお申込みとなります。

確定拠出年金制度によるお申込みの場合は、取扱いが一部異なる場合があります。

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

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

各ファンドのお申込みは、原則として販売会社の毎営業日に行われます。お申込みの受付は、原則として午後3時までにお申込みが行われ、かつ、お申込みの受付にかかる販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。ただし、ニューヨーク証券取引所、ロンドン証券取引所、フランクフルト証券取引所、ニューヨークの銀行、ロンドンの銀行のいずれかの休業日に該当する日（以下、「海外休業日」という場合があります。）には、お申込みの受付を行いません。

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

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

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

#### ・お申込価額

お申込日の翌営業日の基準価額 とします。

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

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

### < 基準価額の照会方法等 >

基準価額は、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。

各ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・ 販売会社へのお問い合わせ
- ・ 委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

### ・ お申込手数料

お申込日の翌営業日の基準価額に各販売会社が定める手数料率を乗じて得た額としますが、2019年10月11日現在の各販売会社における申込手数料は無手数料です。なお、申込手数料は変更になる場合があります。

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

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

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

### ・ お申込単位

各販売会社が定める単位とします。

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

取扱コースおよびお申込単位は、販売会社にお問い合わせください。

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

確定拠出年金制度によるお申込みの場合は、1円以上1円単位となります。

当初元本は1口当たり1円です。

### ・ 払込期日

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

## 2【換金（解約）手続等】

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

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

海外休業日には、解約の受付を行いません。

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

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

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

#### ・解約価額

解約価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

各ファンドの解約価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

#### ・解約単位

各販売会社が定める単位とします。

解約単位は販売会社にお問い合わせください。

#### ・解約代金の受渡日

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

### 3【資産管理等の概要】

#### (1)【資産の評価】

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

## &lt; 主な投資対象の時価評価方法の原則 &gt;

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

外国で取引されているものについては、計算時に知りうる直近の日

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

各ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

## （2）【保管】

該当事項はありません。

## （3）【信託期間】

ターゲット・イヤー 2045：2017年6月23日（設定日）から原則として2060年1月9日までです。

ターゲット・イヤー 2055：2017年6月23日（設定日）から原則として2070年1月10日までです。

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

## （4）【計算期間】

a. 計算期間は、原則として毎年1月12日から翌年1月11日までとします。

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

(5)【その他】

イ.償還規定

- a. 委託会社は、信託期間中において、信託契約を解約することが受益者のために有利であると認める場合、各ファンドにおいて受益権口数が10億口を下回ることとなった場合、マザーファンドのベンチマークである対象インデックスが改廃された場合、またはやむを得ない事情が発生した場合は、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
- b. 委託会社は、上記a.の事項について、書面による決議(以下「書面決議」といいます。)を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日および信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託契約にかかる知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発送します。
- c. 上記b.の書面決議において、受益者(委託会社およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下イ.償還規定c.において同じ。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- d. 上記b.の書面決議は議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- e. 上記b.からd.までの規定は、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、信託契約にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記b.からd.までの手続きを行うことが困難な場合にも適用しません。
- f. 委託会社は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し信託を終了させます。
- g. 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が、信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、下記「ロ.信託約款の変更等 b.」の書面決議が否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
- h. 受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたこと、その他重要な事由があるときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を申立てることができます。受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は下記「ロ.信託約款の変更等」の規定にしたがい、新受託会社を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託会社を解任することはできないものとします。委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は信託契約を解約し、信託を終了させます。
- i. この信託は、受益者が一部解約請求を行ったときは、委託会社が信託契約の一部の解約をすることにより当該請求に応じ、当該受益権の公正な価格が当該受益者に一部解約金として支払われることとなる委託者指図型投資信託に該当するため、信託契約の解約を行う場合において、投資信託及び投資法人に関する法律第18条第1項に定める反対受益者による受益権買取請求の規定の適用を受けません。



## ロ. 信託約款の変更等

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

## 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。

## 二. 公告

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

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

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

#### ホ.運用報告書

- ・委託会社は、毎年1月11日(休業日の場合は翌営業日とします。)および償還時に交付運用報告書を作成し、販売会社を通じて受益者に対して交付します。
- ・運用報告書(全体版)は、委託会社のホームページにおいて開示します。ただし、受益者から運用報告書(全体版)の請求があった場合には、これを交付します。

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

## 4【受益者の権利等】

### (1)収益分配金請求権

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

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

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

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

### (2)償還金請求権

受益者は、持ち分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

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

### (3)一部解約請求権

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

(4)帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

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

### 第3【ファンドの経理状況】

#### 投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。  
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドの第1期計算期間は信託約款の規定に基づき、平成29年6月23日から平成30年1月11日までとなっております。
- (3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第2期計算期間(平成30年1月12日から平成31年1月11日まで)の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

## 1【財務諸表】

## 【投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)】

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第1期 平成30年1月11日現在	第2期 平成31年1月11日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	445,192	943,158
親投資信託受益証券	9,911,875	30,368,685
派生商品評価勘定	23,366	547,818
未収入金	-	280,000
流動資産合計	10,380,433	32,139,661
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	54,657	83,464
未払受託者報酬	180	4,295
未払委託者報酬	4,871	115,920
その他未払費用	20	478
流動負債合計	59,728	204,157
負債合計	59,728	204,157
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	<sup>1</sup> 10,000,000	<sup>1</sup> 32,215,571
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	<sup>2</sup> 320,705	<sup>2</sup> 280,067
(分配準備積立金)	320,705	723,092
元本等合計	10,320,705	31,935,504
純資産合計	10,320,705	31,935,504
負債純資産合計	10,380,433	32,139,661

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第1期		第2期	
	自	平成29年6月23日 平成30年1月11日	自	平成30年1月12日 平成31年1月11日
営業収益				
有価証券売買等損益		551,875		1,393,190
為替差損益		180,930		748,478
営業収益合計		370,945		644,712
営業費用				
支払利息		129		289
受託者報酬		1,776		6,892
委託者報酬		48,133		186,652
その他費用		202		713
営業費用合計		50,240		194,546
営業利益又は営業損失( )		320,705		839,258
経常利益又は経常損失( )		320,705		839,258
当期純利益又は当期純損失( )		320,705		839,258
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( )		-		30,732
期首剰余金又は期首欠損金( )		-		320,705
剰余金増加額又は欠損金減少額		-		257,823
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		257,823
剰余金減少額又は欠損金増加額		-		50,069
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		50,069
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金( )		320,705		280,067

## (3) 【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

## (貸借対照表に関する注記)

項目	第1期 平成30年1月11日現在	第2期 平成31年1月11日現在
1. 1 期首元本額	10,000,000円	10,000,000円
期中追加設定元本額	- 円	24,073,563円
期中一部解約元本額	- 円	1,857,992円
2. 受益権の総数	10,000,000口	32,215,571口
3. 2 元本の欠損		貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は280,067円であります。

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第1期 自 平成29年6月23日 至 平成30年1月11日	第2期 自 平成30年1月12日 至 平成31年1月11日
1. 1 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(127,636円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(193,069円)、信託約款に規定される収益調整金(0円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象収益は320,705円(1万口当たり320.71円)であります。なお、分配を行っておりません。なお、分配金の計算過程においては、親投資信託の配当等収益及び収益調整金相当額を充当する方法によっております。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(436,570円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(778,264円)及び分配準備積立金(286,522円)より分配対象収益は1,501,356円(1万口当たり466.03円)であります。なお、分配を行っておりません。なお、分配金の計算過程においては、親投資信託の配当等収益及び収益調整金相当額を充当する方法によっております。

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

項目	第1期 自 平成29年6月23日 至 平成30年1月11日	第2期 自 平成30年1月12日 至 平成31年1月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、主要投資対象である親投資信託受益証券が保有する金融商品に係る、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。	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1期 平成30年1月11日現在	第2期 平成31年1月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

(有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	第1期 平成30年1月11日現在	第2期 平成31年1月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
親投資信託受益証券	427,745	693,987
合計	427,745	693,987

(デリバティブ取引等に関する注記)

## 通貨関連

種類	第1期 平成30年1月11日 現在				第2期 平成31年1月11日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
	市場取引以外の取引							
為替予約取引								
売 建	4,489,478	-	4,509,831	20,353	15,151,484	-	14,632,058	519,426
アメリカ・ドル	819,373	-	811,979	7,394	-	-	-	-
イギリス・ポンド	1,311,654	-	1,324,048	12,394	6,118,472	-	5,865,425	253,047
オーストラリア・ドル	457,723	-	472,878	15,155	2,055,306	-	1,967,075	88,231
カナダ・ドル	640,137	-	648,094	7,957	937,209	-	931,608	5,601
ユーロ	1,260,591	-	1,252,832	7,759	6,040,497	-	5,867,950	172,547
買 建	1,223,699	-	1,212,761	10,938	4,548,177	-	4,493,105	55,072
アメリカ・ドル	358,324	-	355,936	2,388	-	-	-	-
イギリス・ポンド	595,159	-	586,794	8,365	1,145,201	-	1,117,881	27,320
オーストラリア・ドル	59,308	-	61,299	1,991	588,878	-	552,025	36,853
カナダ・ドル	90,236	-	88,780	1,456	144,915	-	138,924	5,991
ユーロ	120,672	-	119,952	720	2,669,183	-	2,684,275	15,092
合計	5,713,177	-	5,722,592	31,291	19,699,661	-	19,125,163	464,354

## （注）時価の算定方法

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

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

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

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

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

- 3．換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （1口当たり情報に関する注記）

	第1期 平成30年1月11日現在	第2期 平成31年1月11日現在
1口当たり純資産額	1.0321円	0.9913円
（1万口当たり純資産額）	（10,321円）	（9,913円）

## (4) 【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

平成31年1月11日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	1,678,361	3,963,953	
	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	1,679,916	2,181,706	
	J-REITインデックスファンド・マザーファンド	818,404	1,587,785	
	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	1,012,100	3,255,217	
	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	2,773,084	3,215,390	
	為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	8,138,115	10,836,713	
	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	598,449	644,768	
	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	2,617,018	4,683,153	
親投資信託受益証券 合計		19,315,447	30,368,685	
合計		19,315,447	30,368,685	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。  
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドの第1期計算期間は信託約款の規定に基づき、平成29年6月23日から平成30年1月11日までとなっております。
- (3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第2期計算期間(平成30年1月12日から平成31年1月11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。

## 【投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)】

## (1) 【貸借対照表】

(単位:円)

	第1期 平成30年1月11日現在	第2期 平成31年1月11日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	829,456	672,284
親投資信託受益証券	9,911,963	23,628,908
派生商品評価勘定	23,366	418,612
未収入金	-	140,000
流動資産合計	10,764,785	24,859,804
資産合計	10,764,785	24,859,804
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	54,661	63,503
未払受託者報酬	180	3,085
未払委託者報酬	4,870	83,314
その他未払費用	20	311
流動負債合計	59,731	150,213
負債合計	59,731	150,213
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1 10,371,948	1 24,942,505
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	2 333,106	2 232,914
(分配準備積立金)	319,865	496,827
元本等合計	10,705,054	24,709,591
純資産合計	10,705,054	24,709,591
負債純資産合計	10,764,785	24,859,804

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第1期		第2期	
	自	平成29年6月23日 平成30年1月11日	自	平成30年1月12日 平成31年1月11日
<b>営業収益</b>				
有価証券売買等損益		551,963		1,353,055
為替差損益		181,860		586,514
営業収益合計		370,103		766,541
<b>営業費用</b>				
支払利息		129		172
受託者報酬		1,777		5,110
委託者報酬		48,130		138,432
その他費用		202		511
営業費用合計		50,238		144,225
営業利益又は営業損失( )		319,865		910,766
経常利益又は経常損失( )		319,865		910,766
当期純利益又は当期純損失( )		319,865		910,766
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( )		-		246,308
期首剰余金又は期首欠損金( )		-		333,106
剰余金増加額又は欠損金減少額		13,241		358,079
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		13,241		358,079
剰余金減少額又は欠損金増加額		-		259,641
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		259,641
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金( )		333,106		232,914

## (3) 【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

## (貸借対照表に関する注記)

項目	第1期 平成30年1月11日現在	第2期 平成31年1月11日現在
1. 1 期首元本額	10,000,000円	10,371,948円
期中追加設定元本額	371,948円	22,953,363円
期中一部解約元本額	- 円	8,382,806円
2. 受益権の総数	10,371,948口	24,942,505口
3. 2 元本の欠損		貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は232,914円であります。

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第1期 自 平成29年6月23日 至 平成30年1月11日	第2期 自 平成30年1月12日 至 平成31年1月11日
1. 1 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(127,593円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(192,272円)、信託約款に規定される収益調整金(13,241円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象収益は333,106円(1万口当たり321.16円)であります。なお、分配を行っておりません。なお、分配金の計算過程においては、親投資信託の配当等収益及び収益調整金相当額を充当する方法によっております。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(317,600円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(616,522円)及び分配準備積立金(179,227円)より分配対象収益は1,113,349円(1万口当たり446.37円)であります。なお、分配を行っておりません。なお、分配金の計算過程においては、親投資信託の配当等収益及び収益調整金相当額を充当する方法によっております。



## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

項目	第1期 自 平成29年6月23日 至 平成30年1月11日	第2期 自 平成30年1月12日 至 平成31年1月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、主要投資対象である親投資信託受益証券が保有する金融商品に係る、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。	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1期 平成30年1月11日現在	第2期 平成31年1月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

(有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	第1期 平成30年1月11日現在	第2期 平成31年1月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
親投資信託受益証券	427,807	567,112
合計	427,807	567,112

(デリバティブ取引等に関する注記)

## 通貨関連

種類	第1期 平成30年1月11日 現在				第2期 平成31年1月11日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
	市場取引以外の取引							
為替予約取引								
売 建	4,634,822	-	4,655,179	20,357	11,716,239	-	11,319,171	397,068
アメリカ・ドル	841,618	-	834,225	7,393	-	-	-	-
イギリス・ポンド	1,341,745	-	1,354,140	12,395	4,775,554	-	4,581,932	193,622
オーストラリア・ドル	475,237	-	490,392	15,155	1,599,770	-	1,531,675	68,095
カナダ・ドル	675,647	-	683,606	7,959	714,710	-	710,964	3,746
ユーロ	1,300,575	-	1,292,816	7,759	4,626,205	-	4,494,600	131,605
買 建	1,223,699	-	1,212,761	10,938	3,507,543	-	3,465,584	41,959
アメリカ・ドル	358,324	-	355,936	2,388	-	-	-	-
イギリス・ポンド	595,159	-	586,794	8,365	917,733	-	897,065	20,668
オーストラリア・ドル	59,308	-	61,299	1,991	464,356	-	435,400	28,956
カナダ・ドル	90,236	-	88,780	1,456	102,293	-	98,064	4,229
ユーロ	120,672	-	119,952	720	2,023,161	-	2,035,055	11,894
合計	5,858,521	-	5,867,940	31,295	15,223,782	-	14,784,755	355,109

## （注）時価の算定方法

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

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

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

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

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （1口当たり情報に関する注記）

	第1期 平成30年1月11日現在	第2期 平成31年1月11日現在
1口当たり純資産額	1.0321円	0.9907円
（1万口当たり純資産額）	（10,321円）	（9,907円）

## (4) 【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

平成31年1月11日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	1,302,352	3,075,894	
	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	1,314,061	1,706,571	
	J-REITインデックスファンド・マザーファンド	637,800	1,237,395	
	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	789,212	2,538,342	
	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	2,168,352	2,514,204	
	為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	6,322,250	8,418,708	
	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	470,297	506,697	
	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	2,029,113	3,631,097	
親投資信託受益証券 合計		15,033,437	23,628,908	
合計		15,033,437	23,628,908	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

（参考）

「投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）」、「投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）」は、「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」受益証券、「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「Ｊ-ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド」受益証券、「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「エマージング株式パッシブ・マザーファンド」受益証券及び「エマージング債券パッシブ・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同親投資信託の受益証券であります。

同親投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」の状況

貸借対照表

（単位：円）

科 目	注記 番号	平成30年1月11日現在	平成31年1月11日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		9,174,734,961	5,292,310,851
株式	2	312,504,179,760	268,142,003,270
派生商品評価勘定		176,588,080	158,349,508
未収入金		131,159,280	82,010,000
未収配当金		394,538,223	407,430,514
流動資産合計		322,381,200,304	274,082,104,143
資産合計		322,381,200,304	274,082,104,143
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		706,480	9,175,220
前受金		349,245,000	123,755,000
未払金		-	8,034,485,480
未払解約金		262,677,000	53,755,000
流動負債合計		612,628,480	8,221,170,700
負債合計		612,628,480	8,221,170,700
純資産の部			
元本等			
元本	1	112,835,531,288	112,565,679,213
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		208,933,040,536	153,295,254,230
元本等合計		321,768,571,824	265,860,933,443
純資産合計		321,768,571,824	265,860,933,443
負債純資産合計		322,381,200,304	274,082,104,143

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

## （貸借対照表に関する注記）

項目	平成30年1月11日現在	平成31年1月11日現在
1 . 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	123,575,785,948円	112,835,531,288円
同期中追加設定元本額	11,017,023,811円	36,549,394,271円
同期中一部解約元本額	21,757,278,471円	36,819,246,346円
元本の内訳		
ファンド名		
DIAM DC 国内株式インデックスファンド	8,226,196,501円	12,256,998,801円
DIAM国内株式パッシブ・ファンド	1,839,482,555円	2,386,874,810円
MITO ラップ型ファンド（安定型）	4,123,447円	3,886,220円
MITO ラップ型ファンド（中立型）	9,291,815円	8,201,981円
MITO ラップ型ファンド（積極型）	16,267,567円	13,986,982円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	17,474,561円	29,125,646円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	13,210,945円	22,563,437円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	11,886,882円	16,943,092円
たわらノーロード TOPIX	105,629,384円	382,451,857円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	9,120,978円	97,173,355円
たわらノーロード バランス（堅実型）	62,731円	2,768,469円
たわらノーロード バランス（標準型）	457,256円	18,790,896円

たわらノーロード バランス (積極型)	1,941,760円	37,831,498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)	14,568円	228,637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)	18,634円	9,300,086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)	22,365円	31,294,481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)	33,208円	23,577,333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)	44,401円	60,955,847円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(保守型)	- 円	74,040円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定型)	- 円	174,817円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定成長型)	- 円	1,095,745円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(成長型)	- 円	691,039円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(積極型)	- 円	2,411,837円
D I A M国内株式インデックス ファンド< D C年金>	36,033,477,757円	38,449,340,503円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 1 安定型	755,786,995円	930,601,954円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 2 安定・成長型	2,674,104,581円	3,152,850,618円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 3 成長型	2,772,861,201円	3,152,192,254円
D I A M D C バランス3 0 インデックスファンド	328,683,164円	353,322,394円
D I A M D C バランス5 0 インデックスファンド	1,127,448,779円	1,167,901,061円
D I A M D C バランス7 0 インデックスファンド	1,054,085,428円	1,104,473,614円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型>	47,522,960円	40,917,509円
マネックス資産設計ファンド< 育成型>	1,171,577,546円	1,083,076,227円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	24,024,004円	25,501,335円
D I A M D C 8資産バラ ンスファンド(新興国1 0)	37,610,795円	286,731,745円
D I A M D C 8資産バラ ンスファンド(新興国2 0)	93,210,788円	194,305,090円
D I A M D C 8資産バラ ンスファンド(新興国3 0)	185,672,845円	335,172,615円
投資のソムリエ	2,476,860,905円	2,176,455,324円
クルーズコントロール	2,066,117,052円	188,360,302円
投資のソムリエ< D C年金>	157,129,259円	199,016,808円



D I A M 8 資産バランスファンドN<DC年金>	145,551,548円	222,726,425円
D I A M DC バランス・F (成長型)	190,593,286円	270,071,033円
クルーズコントロール<DC年金>	721,180円	120,118円
D I A Mコア資産設計ファンド (堅実型)	11,905,936円	1,884,210円
D I A Mコア資産設計ファンド (積極型)	27,115,492円	3,452,430円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	41,009,745円	27,709,254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	2,126,231円 566,776,687円	474,143円 478,027,309円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2045)	507,000円	1,678,361円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2055)	507,000円	1,302,352円
リスク抑制世界8資産バランス ファンド(DC)	194,381円	172,989円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2035)	467,415円	2,584,094円
4資産分散投資・スタンダード <DC年金>	-円	15,567,413円
リスクコントロール世界資産分 散ファンド	-円	140,293,071円
9資産分散投資・スタンダード <DC年金>	-円	18,666円
D I A Mワールドバランス25 VA(適格機関投資家限定)	71,627,508円	72,428,537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)	-円	24,452,480円
D I A Mグローバル・バランス ファンド25VA(適格機関投 資家限定)	139,026,202円	121,667,701円
D I A Mグローバル・バランス ファンド50VA(適格機関投 資家限定)	305,156,483円	288,407,783円
D I A M国際分散バランスファ ンド30VA(適格機関投資家 限定)	16,481,224円	15,671,232円
D I A M国際分散バランスファ ンド50VA(適格機関投資家 限定)	73,774,906円	66,509,812円
D I A M国内重視バランスファ ンド30VA(適格機関投資家 限定)	20,065,167円	17,420,446円
D I A M国内重視バランスファ ンド50VA(適格機関投資家 限定)	24,943,302円	14,049,764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 )	33,391,434円	31,643,366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 )	59,453,532円	57,429,940円
D I A Mバランスファンド2 5 V A ( 適格機関投資家限定 )	1,110,380,656円	1,088,244,722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 )	1,056,123,054円	1,015,093,457円
D I A Mバランスファンド5 0 V A ( 適格機関投資家限定 )	2,858,693,114円	2,796,988,287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 )	203,597,030円	199,320,662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 )	103,572,859円	54,728,686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 )	614,329,833円	585,876,895円
D I A M世界アセットバランス ファンドV A ( 適格機関投資家 向け )	1,931,779,617円	387,173,977円
D I A Mグローバル 私募ファ ンド ( 適格機関投資家向け )	10,313,671円	10,313,671円
D I A M世界バランスファンド 5 5 V A ( 適格機関投資家限 定 )	50,384,094円	7,969,631円
D I A M世界バランスファンド 3 5 V A ( 適格機関投資家限 定 )	1,341,418,363円	52,147,134円
D I A M世界アセットバランス ファンド2 V A ( 適格機関投資 家限定 )	15,452,034,881円	9,938,959,954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 )	551,734,251円	195,148,097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 )	1,768,841,652円	1,880,011,203円
D I A M世界アセットバランス ファンド3 V A ( 適格機関投資 家限定 )	10,058,436,721円	10,784,276,752円
D I A Mバランス3 0 V A ( 適 格機関投資家限定 )	523,029円	5,201,125円
D I A Mバランス5 0 V A ( 適 格機関投資家限定 )	9,153,617円	118,453円
D I A Mバランス7 0 V A ( 適 格機関投資家限定 )	3,719,126円	4,011,960円

	D I A M世界アセットバランス ファンド4 V A ( 適格機関投資 家限定)	8,946,206,418円	9,606,107,157円
	D I A M世界バランス25 V A ( 適格機関投資家限定)	72,553,517円	69,426,099円
	D I A M国内バランス30 V A ( 適格機関投資家限定)	27,930,610円	29,836,616円
	D I A Mバランス20 V A ( 適 格機関投資家限定)	23,981,894円	27,655,542円
	D I A Mバランス40 V A ( 適 格機関投資家限定)	5,401,067円	109,220円
	D I A Mバランス60 V A ( 適 格機関投資家限定)	109,957円	121,295円
	D I A M世界アセットバランス ファンド7 V A ( 1 2 1 2 ) ( 適格機関投資家限定)	477,777,807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)	1,323,021,834円	1,366,625,210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)	1,764,382,103円	1,837,729,242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)	76,281,237円	72,976,941円
	計	112,835,531,288円	112,565,679,213円
2 .	受益権の総数	112,835,531,288口	112,565,679,213口
3 .	2 差入代用有価証券	株式 3,814,500,000円	株式 3,410,500,000円

## （金融商品に関する注記）

## 1．金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成29年6月23日 至 平成30年1月11日	自 平成30年1月12日 至 平成31年1月11日
1． 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2． 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価の変動によるリスクを有しております。	同左
3． 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成30年1月11日現在	平成31年1月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

(有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	平成30年1月11日現在	平成31年1月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
株式	60,868,980,291	34,734,987,130
合計	60,868,980,291	34,734,987,130

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成29年2月8日から平成30年1月11日まで及び平成30年2月8日から平成31年1月11日まで）に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

## 株式関連

種類	平成30年1月11日 現在				平成31年1月11日 現在			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引								
先物取引								
買 建	6,418,005,000	-	6,594,000,000	175,995,000	5,773,520,000	-	5,922,820,000	149,300,000
合計	6,418,005,000	-	6,594,000,000	175,995,000	5,773,520,000	-	5,922,820,000	149,300,000

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成30年1月11日現在	平成31年1月11日現在
1口当たり純資産額	2.8517円	2.3618円
(1万口当たり純資産額)	(28,517円)	(23,618円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

平成31年1月11日現在

銘柄	株式数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
極洋	5,500	2,862.00	15,741,000	
日本水産	168,200	643.00	108,152,600	
マルハニチロ	24,300	3,790.00	92,097,000	
ハウスイ	900	821.00	738,900	
カネコ種苗	4,600	1,296.00	5,961,600	
サカタのタネ	20,400	3,360.00	68,544,000	
ホクト	14,100	1,972.00	27,805,200	
ホクリヨウ	2,300	637.00	1,465,100	
ヒノキヤグループ	3,500	2,052.00	7,182,000	
ショーボンドホールディングス	13,100	7,770.00	101,787,000	
ミライト・ホールディングス	47,400	1,516.00	71,858,400	
タマホーム	10,400	1,060.00	11,024,000	
サンヨーホームズ	2,500	822.00	2,055,000	
日本アクア	4,100	426.00	1,746,600	
ファーストコーポレーション	4,600	715.00	3,289,000	
ベステラ	3,200	1,462.00	4,678,400	
TATERU	20,400	292.00	5,956,800	
スペースバリューホールディングス	20,500	888.00	18,204,000	
住石ホールディングス	36,300	101.00	3,666,300	
日鉄鉱業	3,900	4,735.00	18,466,500	
三井松島ホールディングス	7,000	1,412.00	9,884,000	
国際石油開発帝石	675,400	1,019.50	688,570,300	
石油資源開発	24,200	2,034.00	49,222,800	
K&Oエナジーグループ	8,100	1,461.00	11,834,100	
ダイセキ環境ソリューション	3,200	648.00	2,073,600	
第一カッター興業	1,900	1,766.00	3,355,400	
安藤・間	107,500	732.00	78,690,000	
東急建設	49,300	1,000.00	49,300,000	
コムシスホールディングス	59,700	2,741.00	163,637,700	
ミサワホーム	13,200	747.00	9,860,400	
ピーアールホールディングス	13,900	314.00	4,364,600	
高松コンストラクショングループ	10,400	2,762.00	28,724,800	
東建コーポレーション	5,200	6,420.00	33,384,000	
ソネック	1,800	747.00	1,344,600	
ヤマウラ	6,600	961.00	6,342,600	
大成建設	138,200	4,815.00	665,433,000	
大林組	416,500	1,003.00	417,749,500	
清水建設	424,700	915.00	388,600,500	
飛島建設	11,900	1,433.00	17,052,700	
長谷工コーポレーション	173,600	1,230.00	213,528,000	
松井建設	15,400	764.00	11,765,600	
銭高組	1,800	5,130.00	9,234,000	
鹿島建設	325,500	1,504.00	489,552,000	

不動テトラ	9,500	1,738.00	16,511,000
大末建設	4,900	963.00	4,718,700
鉄建建設	8,400	2,511.00	21,092,400
西松建設	29,900	2,439.00	72,926,100
三井住友建設	100,100	680.00	68,068,000
大豊建設	9,400	3,530.00	33,182,000
前田建設工業	99,100	1,033.00	102,370,300
佐田建設	8,900	400.00	3,560,000
ナカノフドー建設	10,600	471.00	4,992,600
奥村組	22,800	3,360.00	76,608,000
東鉄工業	16,700	2,933.00	48,981,100
イチケン	2,600	2,019.00	5,249,400
富士ピー・エス	4,300	410.00	1,763,000
浅沼組	4,900	2,913.00	14,273,700
戸田建設	161,400	688.00	111,043,200
熊谷組	19,800	3,340.00	66,132,000
青木あすなろ建設	6,900	929.00	6,410,100
北野建設	2,900	3,160.00	9,164,000
植木組	1,800	2,271.00	4,087,800
矢作建設工業	19,000	685.00	13,015,000
ピーエス三菱	14,600	571.00	8,336,600
日本ハウスホールディングス	26,500	419.00	11,103,500
大東建託	49,500	14,905.00	737,797,500
新日本建設	16,600	1,050.00	17,430,000
N I P P O	36,800	2,045.00	75,256,000
東亜道路工業	2,600	3,100.00	8,060,000
前田道路	43,500	2,165.00	94,177,500
日本道路	3,800	6,060.00	23,028,000
東亜建設工業	12,200	1,372.00	16,738,400
若築建設	7,000	1,539.00	10,773,000
東洋建設	50,800	382.00	19,405,600
五洋建設	165,000	630.00	103,950,000
世紀東急工業	20,300	613.00	12,443,900
福田組	4,500	4,140.00	18,630,000
日本ドライケミカル	3,400	1,180.00	4,012,000
住友林業	98,500	1,450.00	142,825,000
日本基礎技術	14,500	335.00	4,857,500
巴コーポレーション	17,300	349.00	6,037,700
大和ハウス工業	384,600	3,566.00	1,371,483,600
ライト工業	26,700	1,446.00	38,608,200
積水ハウス	425,100	1,646.00	699,714,600
日特建設	11,900	626.00	7,449,400
北陸電気工事	6,800	944.00	6,419,200
ユアテック	22,300	870.00	19,401,000
四電工	2,000	2,620.00	5,240,000
中電工	17,800	2,326.00	41,402,800
関電工	63,200	1,056.00	66,739,200
きんでん	92,400	1,788.00	165,211,200
東京エネシス	14,300	946.00	13,527,800
トーエネック	3,800	3,050.00	11,590,000



住友電設	9,600	1,769.00	16,982,400
日本電設工業	23,700	2,195.00	52,021,500
協和エクシオ	54,300	2,669.00	144,926,700
新日本空調	11,800	1,767.00	20,850,600
日本工営	7,900	2,486.00	19,639,400
九電工	27,300	3,925.00	107,152,500
三機工業	31,900	1,172.00	37,386,800
日揮	119,600	1,660.00	198,536,000
中外炉工業	3,900	2,003.00	7,811,700
ヤマト	12,500	478.00	5,975,000
太平電業	9,400	2,369.00	22,268,600
高砂熱学工業	34,900	1,779.00	62,087,100
三晃金属工業	1,500	2,852.00	4,278,000
NEC ネットエスアイ	13,500	2,425.00	32,737,500
朝日工業社	2,700	3,155.00	8,518,500
明星工業	25,200	683.00	17,211,600
大気社	19,000	2,931.00	55,689,000
ダイダン	9,300	2,447.00	22,757,100
日比谷総合設備	13,200	1,821.00	24,037,200
東芝プラントシステム	30,000	2,069.00	62,070,000
日本製粉	41,300	1,897.00	78,346,100
日清製粉グループ本社	140,500	2,257.00	317,108,500
日東富士製粉	800	5,670.00	4,536,000
昭和産業	11,500	2,992.00	34,408,000
鳥越製粉	11,200	819.00	9,172,800
中部飼料	15,200	1,195.00	18,164,000
フィード・ワン	83,800	183.00	15,335,400
東洋精糖	2,100	1,017.00	2,135,700
日本甜菜製糖	7,100	1,811.00	12,858,100
三井製糖	9,800	2,906.00	28,478,800
塩水港精糖	14,500	221.00	3,204,500
日新製糖	5,900	2,085.00	12,301,500
L I F U L L	41,100	769.00	31,605,900
ジェイエイシーリクルートメント	9,500	2,021.00	19,199,500
日本M&Aセンター	88,200	2,487.00	219,353,400
メンバーズ	4,000	1,089.00	4,356,000
中広	1,100	559.00	614,900
タケエイ	12,300	663.00	8,154,900
E・Jホールディングス	1,500	1,024.00	1,536,000
トラスト・テック	5,700	3,175.00	18,097,500
コシダカホールディングス	31,600	1,251.00	39,531,600
アルトナー	2,200	661.00	1,454,200
パソナグループ	11,200	1,230.00	13,776,000
C D S	2,900	1,120.00	3,248,000
リンクアンドモチベーション	21,800	851.00	18,551,800
G C A	12,100	689.00	8,336,900
エス・エム・エス	43,500	1,742.00	75,777,000
パーソルホールディングス	118,500	1,839.00	217,921,500
リニカル	6,700	1,376.00	9,219,200
クックパッド	37,100	302.00	11,204,200

エスクリ	3,200	593.00	1,897,600
アイ・ケイ・ケイ	5,900	736.00	4,342,400
森永製菓	31,300	4,690.00	146,797,000
中村屋	3,000	4,275.00	12,825,000
江崎グリコ	37,300	5,360.00	199,928,000
名糖産業	6,000	1,294.00	7,764,000
井村屋グループ	5,300	2,425.00	12,852,500
不二家	7,000	2,277.00	15,939,000
山崎製パン	101,800	2,215.00	225,487,000
第一屋製パン	2,100	1,058.00	2,221,800
モロゾフ	2,000	5,030.00	10,060,000
亀田製菓	7,700	4,840.00	37,268,000
寿スピリッツ	13,100	4,215.00	55,216,500
カルビー	56,700	3,425.00	194,197,500
森永乳業	24,800	3,225.00	79,980,000
六甲バター	9,100	2,045.00	18,609,500
ヤクルト本社	92,200	7,390.00	681,358,000
明治ホールディングス	88,100	8,780.00	773,518,000
雪印メグミルク	29,900	2,939.00	87,876,100
プリマハム	17,500	2,029.00	35,507,500
日本ハム	53,700	4,485.00	240,844,500
林兼産業	4,300	609.00	2,618,700
丸大食品	13,400	1,784.00	23,905,600
S Foods	11,200	4,250.00	47,600,000
伊藤ハム米久ホールディングス	80,100	661.00	52,946,100
学情	4,700	1,167.00	5,484,900
スタジオアリス	5,900	2,306.00	13,605,400
シミックホールディングス	6,600	1,632.00	10,771,200
システナ	43,400	1,308.00	56,767,200
NJS	2,600	1,574.00	4,092,400
デジタルアーツ	6,600	5,940.00	39,204,000
新日鉄住金ソリューションズ	18,200	2,616.00	47,611,200
総合警備保障	47,100	5,040.00	237,384,000
キューブシステム	6,500	593.00	3,854,500
いちご	155,500	326.00	50,693,000
エイジア	2,400	1,086.00	2,606,400
日本駐車場開発	147,300	143.00	21,063,900
コア	5,200	1,155.00	6,006,000
カカクコム	89,200	1,921.00	171,353,200
アイロムグループ	4,500	1,512.00	6,804,000
セントケア・ホールディング	6,500	538.00	3,497,000
サイネックス	1,800	678.00	1,220,400
ルネサンス	6,600	2,110.00	13,926,000
ディップ	19,100	1,943.00	37,111,300
SBSホールディングス	12,300	1,509.00	18,560,700
オプトホールディング	7,200	1,405.00	10,116,000
新日本科学	16,100	789.00	12,702,900
ツクイ	27,900	789.00	22,013,100
キャリアデザインセンター	3,000	1,066.00	3,198,000
ベネフィット・ワン	16,400	3,395.00	55,678,000

エムスリー	249,400	1,644.00	410,013,600
ツカダ・グローバルホールディング	7,600	591.00	4,491,600
プラス	800	585.00	468,000
アウトソーシング	62,400	1,136.00	70,886,400
ウェルネット	12,000	971.00	11,652,000
ワールドホールディングス	3,200	2,405.00	7,696,000
ディー・エヌ・エー	63,800	1,903.00	121,411,400
博報堂DYホールディングス	164,600	1,552.00	255,459,200
ぐるなび	16,800	716.00	12,028,800
エスアールジータカミヤ	12,300	714.00	8,782,200
ジャパンベストレスキューシステム	9,400	1,339.00	12,586,600
ファンコミュニケーションズ	32,500	544.00	17,680,000
ライク	4,600	1,193.00	5,487,800
ビジネス・ブレークスルー	4,900	318.00	1,558,200
WDBホールディングス	5,400	2,293.00	12,382,200
ティア	5,500	603.00	3,316,500
CDG	1,000	1,230.00	1,230,000
パリュウコマース	7,900	1,293.00	10,214,700
インフォマート	64,900	1,033.00	67,041,700
サッポロホールディングス	45,600	2,424.00	110,534,400
アサヒグループホールディングス	260,500	4,359.00	1,135,519,500
キリンホールディングス	562,800	2,417.00	1,360,287,600
宝ホールディングス	93,100	1,324.00	123,264,400
オエノンホールディングス	35,600	342.00	12,175,200
養命酒製造	3,900	2,120.00	8,268,000
コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールディングス	95,300	3,130.00	298,289,000
サントリー食品インターナショナル	83,200	4,865.00	404,768,000
ダイドーグループホールディングス	7,000	5,750.00	40,250,000
伊藤園	41,200	4,780.00	196,936,000
キーコーヒー	12,300	2,016.00	24,796,800
ユニカフェ	3,900	1,059.00	4,130,100
ジャパンフーズ	1,800	1,194.00	2,149,200
日清オイリオグループ	16,100	3,185.00	51,278,500
不二製油グループ本社	30,400	3,450.00	104,880,000
かどや製油	1,300	5,500.00	7,150,000
J・オイルミルズ	6,500	3,875.00	25,187,500
ローソン	30,900	6,820.00	210,738,000
サンエー	9,300	4,440.00	41,292,000
カワチ薬品	9,500	1,851.00	17,584,500
エービーシー・マート	19,100	6,100.00	116,510,000
ハードオフコーポレーション	4,800	833.00	3,998,400
高千穂交易	4,700	956.00	4,493,200
アスクル	10,600	2,211.00	23,436,600
ゲオホールディングス	18,600	1,569.00	29,183,400
アダストリア	16,900	2,141.00	36,182,900
ジーフット	7,500	680.00	5,100,000
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	1,500	715.00	1,072,500
伊藤忠食品	2,900	4,720.00	13,688,000
くらコーポレーション	7,200	5,240.00	37,728,000

キャンドウ	5,800	1,610.00	9,338,000
エレマテック	5,700	1,978.00	11,274,600
パルグループホールディングス	6,300	3,120.00	19,656,000
JALUX	3,400	2,521.00	8,571,400
エディオン	51,600	1,069.00	55,160,400
あらた	6,800	4,220.00	28,696,000
サーラコーポレーション	24,700	606.00	14,968,200
ワッツ	4,100	700.00	2,870,000
トーメンデバイス	1,900	2,310.00	4,389,000
ハローズ	4,600	2,154.00	9,908,400
J Pホールディングス	33,800	261.00	8,821,800
あみやき亭	2,700	3,505.00	9,463,500
東京エレクトロン デバイス	4,400	1,770.00	7,788,000
ひらまつ	24,300	362.00	8,796,600
フィールズ	10,600	757.00	8,024,200
双日	674,100	406.00	273,684,600
アルフレッサ ホールディングス	135,700	3,040.00	412,528,000
大黒天物産	2,800	4,070.00	11,396,000
ハニーズホールディングス	11,900	923.00	10,983,700
ファーマライズホールディングス	2,700	592.00	1,598,400
キッコーマン	82,100	5,580.00	458,118,000
味の素	274,600	1,916.00	526,133,600
キューピー	69,300	2,435.00	168,745,500
ハウス食品グループ本社	47,500	3,860.00	183,350,000
カゴメ	49,900	2,913.00	145,358,700
焼津水産化学工業	6,200	1,051.00	6,516,200
アリアケジャパン	11,400	7,050.00	80,370,000
ピエトロ	1,600	1,643.00	2,628,800
エバラ食品工業	2,600	2,145.00	5,577,000
ニチレイ	64,600	3,015.00	194,769,000
横浜冷凍	32,000	937.00	29,984,000
東洋水産	63,900	3,890.00	248,571,000
イトアンド	4,300	1,544.00	6,639,200
大冷	1,500	1,711.00	2,566,500
ヨシムラ・フード・ホールディングス	3,300	503.00	1,659,900
日清食品ホールディングス	52,900	6,700.00	354,430,000
永谷園ホールディングス	6,700	2,488.00	16,669,600
一正蒲鉾	4,900	1,078.00	5,282,200
フジッコ	13,500	2,339.00	31,576,500
ロック・フィールド	13,500	1,617.00	21,829,500
日本たばこ産業	718,300	2,663.00	1,912,832,900
ケンコーマヨネーズ	7,000	1,948.00	13,636,000
わらべや日洋ホールディングス	8,100	1,854.00	15,017,400
なとり	7,000	1,642.00	11,494,000
イフジ産業	2,100	644.00	1,352,400
ピックルスコーポレーション	3,000	2,157.00	6,471,000
北の達人コーポレーション	48,900	391.00	19,119,900
ユーグレナ	49,400	605.00	29,887,000
片倉工業	14,900	1,155.00	17,209,500
グンゼ	8,100	4,375.00	35,437,500

ヒューリック	255,200	987.00	251,882,400
神栄	1,600	888.00	1,420,800
ラサ商事	6,600	825.00	5,445,000
アルペン	9,400	1,688.00	15,867,200
ハブ	3,900	883.00	3,443,700
ラクーンホールディングス	7,200	664.00	4,780,800
クオールホールディングス	17,900	1,695.00	30,340,500
アルコニックス	12,900	1,068.00	13,777,200
神戸物産	18,500	3,570.00	66,045,000
ソリトンシステムズ	6,900	733.00	5,057,700
ジーンズ	8,200	5,270.00	43,214,000
ビックカメラ	65,200	1,434.00	93,496,800
DCMホールディングス	65,800	1,153.00	75,867,400
ペッパーフードサービス	9,600	3,015.00	28,944,000
MonotaRO	77,100	2,523.00	194,523,300
東京一番フーズ	2,500	586.00	1,465,000
DDホールディングス	2,700	2,103.00	5,678,100
あいホールディングス	19,600	1,938.00	37,984,800
ディーブイエックス	4,200	1,062.00	4,460,400
きちりホールディングス	3,100	663.00	2,055,300
アークランドサービスホールディングス	9,000	1,978.00	17,802,000
J.フロントリテイリング	156,100	1,277.00	199,339,700
ドトール・日レスホールディングス	21,400	2,017.00	43,163,800
マツモトキヨシホールディングス	50,500	3,310.00	167,155,000
ブロンコビリー	6,400	2,644.00	16,921,600
ZOZO	131,900	2,122.00	279,891,800
トレジャー・ファクトリー	3,700	661.00	2,445,700
物語コーポレーション	3,400	9,010.00	30,634,000
ココカラファイン	13,700	5,090.00	69,733,000
三越伊勢丹ホールディングス	228,200	1,245.00	284,109,000
東洋紡	51,300	1,537.00	78,848,100
ユニチカ	35,600	497.00	17,693,200
富士紡ホールディングス	6,400	2,512.00	16,076,800
日清紡ホールディングス	68,800	878.00	60,406,400
倉敷紡績	11,600	2,417.00	28,037,200
ダイワボウホールディングス	11,100	5,100.00	56,610,000
シキボウ	6,400	1,018.00	6,515,200
日東紡績	18,500	1,790.00	33,115,000
トヨタ紡織	43,300	1,717.00	74,346,100
マクニカ・富士エレホールディングス	33,800	1,429.00	48,300,200
Hamee	3,100	896.00	2,777,600
ラクト・ジャパン	2,700	6,550.00	17,685,000
ウエルシアホールディングス	32,300	4,200.00	135,660,000
クリエイトSDホールディングス	17,900	2,625.00	46,987,500
バイタルケーエスケー・ホールディングス	23,100	1,150.00	26,565,000
八洲電機	9,600	740.00	7,104,000
メディアスホールディングス	6,800	666.00	4,528,800
UKCホールディングス	7,800	1,804.00	14,071,200

ジューテックホールディングス	2,700	952.00	2,570,400
丸善CHIホールディングス	14,600	333.00	4,861,800
大光	3,000	508.00	1,524,000
OCHIホールディングス	3,400	1,112.00	3,780,800
TOKAIホールディングス	64,500	875.00	56,437,500
黒谷	2,000	398.00	796,000
ミサワ	2,400	439.00	1,053,600
ティーライフ	1,600	928.00	1,484,800
Cominix	1,900	778.00	1,478,200
エー・ピーカンパニー	2,300	488.00	1,122,400
三洋貿易	6,200	1,781.00	11,042,200
チムニー	3,800	2,528.00	9,606,400
シュッピン	8,200	690.00	5,658,000
ビューティガレージ	1,800	1,444.00	2,599,200
ウイン・パートナーズ	7,900	993.00	7,844,700
ネクステージ	18,800	1,173.00	22,052,400
ジョイフル本田	35,800	1,380.00	49,404,000
鳥貴族	4,000	1,841.00	7,364,000
キリン堂ホールディングス	4,800	1,285.00	6,168,000
ホットランド	6,400	1,261.00	8,070,400
すかいらくホールディングス	113,700	1,769.00	201,135,300
綿半ホールディングス	4,500	2,100.00	9,450,000
日本毛織	39,800	838.00	33,352,400
ダイトウボウ	19,200	80.00	1,536,000
トーア紡コーポレーション	5,100	473.00	2,412,300
ダイドーリミテッド	15,200	320.00	4,864,000
ヨシックス	2,000	2,777.00	5,554,000
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	35,600	1,150.00	40,940,000
三栄建築設計	4,900	1,644.00	8,055,600
スター・マイカ	5,600	1,560.00	8,736,000
野村不動産ホールディングス	81,400	2,092.00	170,288,800
三重交通グループホールディングス	24,800	601.00	14,904,800
サムティ	16,900	1,539.00	26,009,100
ディア・ライフ	15,600	427.00	6,661,200
コーセーアールイー	3,700	871.00	3,222,700
エー・ディー・ワークス	173,200	36.00	6,235,200
日本商業開発	7,600	1,483.00	11,270,800
プレサンスコーポレーション	19,300	1,371.00	26,460,300
ユニゾホールディングス	18,500	2,055.00	38,017,500
THEグローバル社	5,600	527.00	2,951,200
日本管理センター	8,000	844.00	6,752,000
サンセイランディック	3,200	808.00	2,585,600
エストラスト	1,600	727.00	1,163,200
フージャースホールディングス	27,300	645.00	17,608,500
オープンハウス	19,900	3,945.00	78,505,500
東急不動産ホールディングス	328,700	564.00	185,386,800
飯田グループホールディングス	102,000	1,949.00	198,798,000
イーグランド	1,800	680.00	1,224,000
ムゲンエステート	8,600	543.00	4,669,800

帝国繊維	13,600	2,202.00	29,947,200
日本コークス工業	105,300	95.00	10,003,500
ゴルフダイジェスト・オンライン	4,900	701.00	3,434,900
ミタチ産業	2,900	707.00	2,050,300
B E E N O S	2,800	1,267.00	3,547,600
あさひ	10,100	1,419.00	14,331,900
日本調剤	4,300	3,245.00	13,953,500
コスモス薬品	6,200	18,660.00	115,692,000
シップヘルスケアホールディングス	25,400	4,035.00	102,489,000
トーエル	5,900	707.00	4,171,300
ソフトクリエイイトホールディングス	5,300	1,352.00	7,165,600
オンリー	2,200	1,002.00	2,204,400
セブン&アイ・ホールディングス	511,700	4,834.00	2,473,557,800
薬王堂	5,300	2,917.00	15,460,100
クリエイイト・レストランツ・ホールディングス	32,900	1,191.00	39,183,900
明治電機工業	3,900	1,735.00	6,766,500
ツルハホールディングス	26,500	9,340.00	247,510,000
デリカフーズホールディングス	2,200	1,388.00	3,053,600
スターティアホールディングス	2,400	589.00	1,413,600
サンマルクホールディングス	9,600	2,530.00	24,288,000
フェリシモ	2,700	1,195.00	3,226,500
トリドールホールディングス	15,100	1,845.00	27,859,500
帝人	99,000	1,825.00	180,675,000
東レ	941,600	795.50	749,042,800
クラレ	204,900	1,618.00	331,528,200
旭化成	863,600	1,134.50	979,754,200
サカイオーベックス	3,000	1,878.00	5,634,000
T O K Y O B A S E	10,800	553.00	5,972,400
稲葉製作所	7,000	1,284.00	8,988,000
宮地エンジニアリンググループ	3,800	1,893.00	7,193,400
トーカロ	31,600	882.00	27,871,200
アルファ	4,300	1,204.00	5,177,200
S U M C O	135,500	1,289.00	174,659,500
川田テクノロジーズ	2,700	7,010.00	18,927,000
R S T e c h n o l o g i e s	2,500	2,553.00	6,382,500
ピーロット	2,000	1,232.00	2,464,000
ファーストブラザーズ	3,300	1,257.00	4,148,100
ハウズドゥ	4,500	1,132.00	5,094,000
シーアールイー	4,000	953.00	3,812,000
プロパティエージェント	1,100	926.00	1,018,600
ケイアイスター不動産	3,200	1,661.00	5,315,200
アグレ都市デザイン	1,500	601.00	901,500
グッドコムアセット	2,200	1,412.00	3,106,400
ジェイ・エス・ピー	400	3,585.00	1,434,000
住江織物	3,200	2,353.00	7,529,600
日本フェルト	6,700	450.00	3,015,000
イチカワ	1,800	1,367.00	2,460,600
エコナックホールディングス	22,400	107.00	2,396,800
日東製網	1,400	1,249.00	1,748,600

芦森工業	2,600	1,403.00	3,647,800
アツギ	10,100	961.00	9,706,100
ウイルプラスホールディングス	1,100	815.00	896,500
ジャパンミート	4,600	1,703.00	7,833,800
コメダホールディングス	28,000	2,022.00	56,616,000
サツドラホールディングス	2,000	1,872.00	3,744,000
デファクトスタンダード	700	498.00	348,600
ダイユー・リックホールディングス	6,600	940.00	6,204,000
パロックジャパンリミテッド	9,800	890.00	8,722,000
クスリのアオキホールディングス	9,700	6,580.00	63,826,000
ダイニック	4,700	737.00	3,463,900
共和レザー	7,600	788.00	5,988,800
力の源ホールディングス	3,400	710.00	2,414,000
スシローグローバルホールディングス	13,400	5,940.00	79,596,000
L I X I L ビバ	10,300	1,667.00	17,170,100
セーレン	29,800	1,729.00	51,524,200
ソトー	4,600	954.00	4,388,400
東海染工	1,800	970.00	1,746,000
小松マテーレ	19,900	787.00	15,661,300
ワコールホールディングス	35,400	2,840.00	100,536,000
ホギメディカル	15,100	3,230.00	48,773,000
レナウン	35,400	97.00	3,433,800
クラウドシアホールディングス	2,900	461.00	1,336,900
T S I ホールディングス	44,700	705.00	31,513,500
マツオカコーポレーション	3,900	2,734.00	10,662,600
ワールド	12,500	1,577.00	19,712,500
T I S	40,500	4,555.00	184,477,500
ネオス	4,100	1,405.00	5,760,500
電算システム	4,600	2,329.00	10,713,400
グリー	65,300	465.00	30,364,500
コーエーテクモホールディングス	24,800	1,853.00	45,954,400
三菱総合研究所	4,700	3,115.00	14,640,500
ボルテージ	2,400	529.00	1,269,600
電算	1,300	2,120.00	2,756,000
A G S	6,900	647.00	4,464,300
ファインデックス	10,200	524.00	5,344,800
ヒト・コミュニケーションズ	2,800	1,394.00	3,903,200
ブレインパッド	2,600	5,620.00	14,612,000
K L a b	21,600	904.00	19,526,400
ポールトゥウィン・ピットクルーホールディングス	16,200	880.00	14,256,000
イーブクイニシアティブジャパン	2,000	1,547.00	3,094,000
ネクソン	309,700	1,522.00	471,363,400
アイスタイル	30,900	799.00	24,689,100
エムアップ	4,200	1,577.00	6,623,400
エイチーム	7,600	1,563.00	11,878,800
テクノスジャパン	10,200	751.00	7,660,200
e n i s h	4,200	470.00	1,974,000
コロブラ	34,600	739.00	25,569,400
オルトプラス	7,400	329.00	2,434,600



ブロードリーフ	60,300	565.00	34,069,500
クロス・マーケティンググループ	3,300	336.00	1,108,800
デジタルハーツホールディングス	5,500	1,414.00	7,777,000
メディアドゥホールディングス	3,500	2,079.00	7,276,500
じげん	12,900	535.00	6,901,500
バイキューブ	6,400	377.00	2,412,800
サイバーリンクス	1,900	945.00	1,795,500
ディー・エル・イー	7,600	139.00	1,056,400
フィックスターズ	11,600	1,117.00	12,957,200
CARTA HOLDINGS	6,500	1,025.00	6,662,500
オブティム	2,700	4,525.00	12,217,500
セレス	4,000	1,522.00	6,088,000
特種東海製紙	7,700	4,030.00	31,031,000
ベリサーブ	1,100	4,335.00	4,768,500
ティーガイア	12,200	2,073.00	25,290,600
セック	2,000	3,560.00	7,120,000
日本アジアグループ	12,900	332.00	4,282,800
豆蔵ホールディングス	8,200	1,005.00	8,241,000
テクマトリックス	8,700	1,650.00	14,355,000
プロシップ	1,800	2,547.00	4,584,600
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	293,100	213.00	62,430,300
GMOペイメントゲートウェイ	20,000	5,180.00	103,600,000
ザッパラス	6,000	375.00	2,250,000
システムリサーチ	1,600	2,744.00	4,390,400
インターネットイニシアティブ	19,800	2,551.00	50,509,800
さくらインターネット	14,500	450.00	6,525,000
ヴィンクス	4,100	1,296.00	5,313,600
GMOクラウド	2,700	3,180.00	8,586,000
SRAホールディングス	6,500	2,534.00	16,471,000
MINORIソリューションズ	2,400	1,644.00	3,945,600
システムインテグレータ	3,400	896.00	3,046,400
朝日ネット	10,200	501.00	5,110,200
eBASE	3,700	1,651.00	6,108,700
アバント	3,200	1,146.00	3,667,200
アドソル日進	4,300	1,576.00	6,776,800
フリービット	8,000	776.00	6,208,000
コムチュア	6,800	2,485.00	16,898,000
サイバーコム	2,200	2,075.00	4,565,000
アステリア	6,000	735.00	4,410,000
王子ホールディングス	546,500	602.00	328,993,000
日本製紙	58,100	2,099.00	121,951,900
三菱製紙	19,900	585.00	11,641,500
北越コーポレーション	80,500	543.00	43,711,500
中越パルプ工業	5,200	1,347.00	7,004,400
巴川製紙所	4,100	1,030.00	4,223,000
大王製紙	59,100	1,319.00	77,952,900
阿波製紙	3,000	432.00	1,296,000
マークラインズ	4,200	1,282.00	5,384,400
メディカル・データ・ビジョン	10,700	905.00	9,683,500

g u m i	14,000	578.00	8,092,000	
ショーケース・ティービー	2,600	643.00	1,671,800	
モバイルファクトリー	3,300	1,073.00	3,540,900	
テラスカイ	700	3,465.00	2,425,500	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	5,400	1,291.00	6,971,400	
P C Iホールディングス	2,200	2,173.00	4,780,600	
パイブドHD	2,000	985.00	1,970,000	
アイピーシー	2,000	1,005.00	2,010,000	
ネオジャパン	2,300	789.00	1,814,700	
P R T I M E S	700	2,590.00	1,813,000	
ランドコンピュータ	1,400	989.00	1,384,600	
ダブルスタンダード	700	3,455.00	2,418,500	
オープンドア	6,000	2,753.00	16,518,000	
マイネット	3,900	1,764.00	6,879,600	
アカツキ	4,300	6,600.00	28,380,000	
ベネフィットジャパン	600	701.00	420,600	
U b i c o mホールディングス	2,200	1,161.00	2,554,200	
L I N E	37,000	4,000.00	148,000,000	
カナミックネットワーク	1,900	1,677.00	3,186,300	
ノムラシステムコーポレーション	900	723.00	650,700	
レンゴー	125,300	902.00	113,020,600	
トーモク	7,500	1,665.00	12,487,500	
ザ・パック	9,200	3,005.00	27,646,000	
チェンジ	1,500	3,455.00	5,182,500	
シンクロ・フード	5,200	573.00	2,979,600	
オークネット	6,400	946.00	6,054,400	
A O I T Y O H O L D I N G S	13,200	770.00	10,164,000	
マクロミル	15,300	1,521.00	23,271,300	
ビーグリー	2,300	766.00	1,761,800	
オロ	1,100	4,475.00	4,922,500	
昭和電工	80,600	3,535.00	284,921,000	
住友化学	955,600	561.00	536,091,600	
住友精化	5,900	4,260.00	25,134,000	
日産化学	74,500	5,790.00	431,355,000	
ラサ工業	4,300	1,334.00	5,736,200	
クレハ	11,200	6,530.00	73,136,000	
多木化学	3,400	5,350.00	18,190,000	
テイカ	9,900	1,813.00	17,948,700	
石原産業	23,400	1,089.00	25,482,600	
片倉コープアグリ	3,000	1,156.00	3,468,000	
日東エフシー	7,800	726.00	5,662,800	
日本曹達	19,200	2,809.00	53,932,800	
東ソー	187,600	1,456.00	273,145,600	
トクヤマ	34,900	2,458.00	85,784,200	
セントラル硝子	26,500	2,184.00	57,876,000	
東亜合成	76,200	1,243.00	94,716,600	
大阪ソーダ	13,000	2,466.00	32,058,000	
関東電化工業	28,800	852.00	24,537,600	
デンカ	47,700	3,285.00	156,694,500	

イビデン	75,900	1,513.00	114,836,700
信越化学工業	213,900	8,610.00	1,841,679,000
日本カーバイド工業	4,100	1,714.00	7,027,400
堺化学工業	8,000	2,135.00	17,080,000
第一稀元素化学工業	9,900	828.00	8,197,200
エア・ウォーター	99,500	1,697.00	168,851,500
大陽日酸	100,000	1,760.00	176,000,000
日本化学工業	4,100	2,271.00	9,311,100
東邦アセチレン	1,900	1,348.00	2,561,200
日本パーカライジング	66,300	1,302.00	86,322,600
高压ガス工業	19,400	797.00	15,461,800
チタン工業	1,500	2,364.00	3,546,000
四国化成工業	20,400	1,076.00	21,950,400
戸田工業	2,600	2,210.00	5,746,000
ステラ ケミファ	7,100	2,682.00	19,042,200
保土谷化学工業	4,200	2,018.00	8,475,600
日本触媒	20,400	7,090.00	144,636,000
大日精化工業	10,000	2,750.00	27,500,000
カネカ	32,300	4,190.00	135,337,000
協和発酵キリン	155,300	2,130.00	330,789,000
三菱瓦斯化学	124,900	1,692.00	211,330,800
三井化学	110,100	2,557.00	281,525,700
J S R	121,800	1,675.00	204,015,000
東京応化工業	20,800	2,909.00	60,507,200
大阪有機化学工業	11,200	1,105.00	12,376,000
三菱ケミカルホールディングス	811,500	875.90	710,792,850
K Hネオケム	18,500	2,488.00	46,028,000
ダイセル	188,600	1,136.00	214,249,600
住友ベークライト	21,000	4,030.00	84,630,000
積水化学工業	265,300	1,586.00	420,765,800
日本ゼオン	109,500	1,043.00	114,208,500
アイカ工業	36,400	3,585.00	130,494,000
宇部興産	61,200	2,261.00	138,373,200
積水樹脂	20,000	1,944.00	38,880,000
タキロンシーアイ	26,300	576.00	15,148,800
旭有機材	8,400	1,470.00	12,348,000
日立化成	56,100	1,672.00	93,799,200
ニチバン	6,400	1,973.00	12,627,200
リケンテクノス	33,200	443.00	14,707,600
大倉工業	6,300	1,770.00	11,151,000
積水化成品工業	18,000	927.00	16,686,000
群栄化学工業	2,900	2,861.00	8,296,900
タイガースポリマー	6,600	590.00	3,894,000
ミライアル	3,500	985.00	3,447,500
ダイキアクシス	4,300	915.00	3,934,500
ダイキョーニシカワ	25,700	1,109.00	28,501,300
竹本容器	4,300	1,415.00	6,084,500
森六ホールディングス	6,600	2,594.00	17,120,400
日本化薬	77,200	1,398.00	107,925,600
カーリットホールディングス	12,900	763.00	9,842,700

E P S ホールディングス	17,800	1,683.00	29,957,400
ソルクシーズ	5,200	618.00	3,213,600
レグス	2,900	904.00	2,621,600
プレステージ・インターナショナル	22,200	1,240.00	27,528,000
フェイス	4,200	839.00	3,523,800
ハイマックス	1,500	1,760.00	2,640,000
アミューズ	7,200	2,326.00	16,747,200
野村総合研究所	77,300	4,330.00	334,709,000
ドリームインキュベータ	3,500	1,340.00	4,690,000
サイバネットシステム	10,000	559.00	5,590,000
クイック	7,300	1,320.00	9,636,000
T A C	6,900	215.00	1,483,500
C E ホールディングス	3,200	681.00	2,179,200
ケネディクス	110,700	490.00	54,243,000
日本システム技術	2,000	1,490.00	2,980,000
電通	144,300	4,895.00	706,348,500
インテージホールディングス	15,600	884.00	13,790,400
テイクアンドギヴ・ニーズ	4,500	1,700.00	7,650,000
東邦システムサイエンス	3,700	909.00	3,363,300
ぴあ	3,300	3,945.00	13,018,500
イオンファンタジー	3,800	2,267.00	8,614,600
ソースネクスト	46,900	619.00	29,031,100
シーティーエス	13,400	684.00	9,165,600
ネクシィーズグループ	3,700	1,912.00	7,074,400
インフォコム	4,900	3,815.00	18,693,500
メディカルシステムネットワーク	13,000	440.00	5,720,000
日本精化	9,800	1,074.00	10,525,200
扶桑化学工業	12,300	2,050.00	25,215,000
トリケミカル研究所	2,700	3,820.00	10,314,000
F I G	10,700	302.00	3,231,400
A D E K A	59,900	1,695.00	101,530,500
日油	46,700	3,685.00	172,089,500
ミヨシ油脂	5,100	1,090.00	5,559,000
新日本理化	22,100	144.00	3,182,400
ハリマ化成グループ	10,100	941.00	9,504,100
花王	300,900	7,475.00	2,249,227,500
第一工業製薬	4,500	2,515.00	11,317,500
石原ケミカル	3,100	1,589.00	4,925,900
日華化学	4,000	947.00	3,788,000
ニイタカ	1,900	1,375.00	2,612,500
三洋化成工業	8,100	5,110.00	41,391,000
武田薬品工業	489,400	4,414.00	2,160,211,600
アステラス製薬	1,142,800	1,520.00	1,737,056,000
大日本住友製薬	91,900	3,635.00	334,056,500
塩野義製薬	162,200	6,343.00	1,028,834,600
田辺三菱製薬	129,600	1,604.00	207,878,400
わかもと製薬	14,400	286.00	4,118,400
あすか製薬	15,300	1,177.00	18,008,100
日本新薬	32,400	6,300.00	204,120,000
ピオフェルミン製薬	2,000	2,491.00	4,982,000

中外製薬	129,200	6,460.00	834,632,000
科研製薬	22,400	5,230.00	117,152,000
エーザイ	148,300	8,517.00	1,263,071,100
理研ビタミン	5,900	3,560.00	21,004,000
ロート製薬	63,500	2,888.00	183,388,000
小野薬品工業	292,800	2,318.50	678,856,800
久光製薬	36,600	5,850.00	214,110,000
有機合成薬品工業	8,400	202.00	1,696,800
持田製薬	9,400	9,620.00	90,428,000
参天製薬	235,000	1,540.00	361,900,000
扶桑薬品工業	4,200	2,598.00	10,911,600
日本ケミファ	1,600	3,230.00	5,168,000
ツムラ	38,500	3,085.00	118,772,500
日医工	30,400	1,652.00	50,220,800
テルモ	175,400	6,030.00	1,057,662,000
みらかホールディングス	33,200	2,538.00	84,261,600
キッセイ薬品工業	22,000	2,874.00	63,228,000
生化学工業	24,000	1,286.00	30,864,000
栄研化学	21,800	2,398.00	52,276,400
日水製薬	5,300	1,165.00	6,174,500
鳥居薬品	6,700	2,529.00	16,944,300
JCRファーマ	8,800	5,700.00	50,160,000
東和薬品	5,900	7,850.00	46,315,000
富士製薬工業	8,400	1,813.00	15,229,200
沢井製薬	25,400	5,480.00	139,192,000
ゼリア新薬工業	24,500	1,941.00	47,554,500
第一三共	354,600	3,632.00	1,287,907,200
キョーリン製薬ホールディングス	27,300	2,304.00	62,899,200
大幸薬品	5,500	1,840.00	10,120,000
ダイト	7,200	2,961.00	21,319,200
大塚ホールディングス	236,100	4,417.00	1,042,853,700
大正製薬ホールディングス	27,700	11,610.00	321,597,000
ペプチドリーム	57,100	4,485.00	256,093,500
大日本塗料	13,800	970.00	13,386,000
日本ペイントホールディングス	100,100	3,570.00	357,357,000
関西ペイント	136,400	1,880.00	256,432,000
神東塗料	9,500	164.00	1,558,000
中国塗料	39,800	914.00	36,377,200
日本特殊塗料	9,100	1,325.00	12,057,500
藤倉化成	16,600	581.00	9,644,600
太陽ホールディングス	10,000	3,160.00	31,600,000
DIC	54,900	3,395.00	186,385,500
サカイクス	26,500	1,187.00	31,455,500
東洋インキSCホールディングス	25,700	2,455.00	63,093,500
T&K TOKA	9,500	970.00	9,215,000
アルプス技研	10,300	1,704.00	17,551,200
サニックス	20,700	194.00	4,015,800
ダイオーズ	2,800	1,286.00	3,600,800
日本空調サービス	13,500	658.00	8,883,000
オリエンタルランド	140,000	11,100.00	1,554,000,000

フォーカスシステムズ	8,100	973.00	7,881,300
ダスキン	31,900	2,473.00	78,888,700
パーク24	71,300	2,614.00	186,378,200
明光ネットワークジャパン	14,900	968.00	14,423,200
ファルコホールディングス	6,600	1,500.00	9,900,000
クレスコ	3,700	2,918.00	10,796,600
フジ・メディア・ホールディングス	126,200	1,559.00	196,745,800
秀英予備校	2,500	481.00	1,202,500
田谷	2,100	619.00	1,299,900
ラウンドワン	36,700	1,093.00	40,113,100
リゾートトラスト	50,100	1,593.00	79,809,300
オービック	42,200	8,830.00	372,626,000
ジャストシステム	17,300	2,156.00	37,298,800
TDCソフト	10,600	792.00	8,395,200
ヤフー	793,000	292.00	231,556,000
ビー・エム・エル	15,300	2,828.00	43,268,400
ワタベウェディング	1,900	583.00	1,107,700
トレンドマイクロ	64,800	5,990.00	388,152,000
りらいあコミュニケーションズ	21,400	952.00	20,372,800
インフォメーション・ディベロプメント	3,400	1,282.00	4,358,800
リソー教育	60,100	461.00	27,706,100
日本オラクル	19,700	7,550.00	148,735,000
早稲田アカデミー	1,600	1,956.00	3,129,600
アルファシステムズ	4,000	2,618.00	10,472,000
フューチャー	16,500	1,514.00	24,981,000
CAC Holdings	9,200	932.00	8,574,400
ソフトバンク・テクノロジー	5,200	1,764.00	9,172,800
トーセ	3,300	808.00	2,666,400
ユー・エス・エス	144,700	1,875.00	271,312,500
オービックビジネスコンサルタント	12,500	4,265.00	53,312,500
伊藤忠テクノソリューションズ	55,500	2,192.00	121,656,000
アイティフォー	14,700	702.00	10,319,400
東京個別指導学院	4,200	1,233.00	5,178,600
東計電算	1,800	3,115.00	5,607,000
サイバーエージェント	73,000	4,225.00	308,425,000
楽天	552,100	828.00	457,138,800
エクスネット	2,300	810.00	1,863,000
クリーク・アンド・リバー社	6,900	1,044.00	7,203,600
テー・オー・ダブリュー	11,300	752.00	8,497,600
大塚商会	65,800	3,190.00	209,902,000
サイボウズ	14,200	658.00	9,343,600
ソフトブレーン	9,600	417.00	4,003,200
セントラルスポーツ	4,400	3,495.00	15,378,000
パラカ	3,100	1,607.00	4,981,700
電通国際情報サービス	7,500	2,842.00	21,315,000
デジタルガレージ	23,700	2,514.00	59,581,800
イーエムシステムズ	9,800	1,120.00	10,976,000
ウェザーニューズ	4,100	2,901.00	11,894,100
C I J	9,600	730.00	7,008,000

東洋ビジネスエンジニアリング	1,100	1,870.00	2,057,000
日本エンタープライズ	12,800	180.00	2,304,000
WOWOW	5,800	3,030.00	17,574,000
スカラ	9,800	714.00	6,997,200
フルキャストホールディングス	11,900	1,777.00	21,146,300
エン・ジャパン	12,900	3,575.00	46,117,500
富士フイルムホールディングス	257,400	4,459.00	1,147,746,600
コニカミノルタ	270,800	1,033.00	279,736,400
資生堂	246,300	6,070.00	1,495,041,000
ライオン	172,700	2,153.00	371,823,100
高砂香料工業	8,600	3,390.00	29,154,000
マンダム	27,900	2,866.00	79,961,400
ミルボン	15,300	4,295.00	65,713,500
ファンケル	55,200	2,294.00	126,628,800
コーセー	21,000	15,110.00	317,310,000
コタ	5,900	1,400.00	8,260,000
シーボン	1,400	2,624.00	3,673,600
ポーラ・オルビスホールディングス	52,900	2,793.00	147,749,700
ノエビアホールディングス	7,800	4,300.00	33,540,000
アジュバンコスメジャパン	2,800	941.00	2,634,800
エステー	8,900	1,811.00	16,117,900
アグロ カネショウ	5,100	2,054.00	10,475,400
コニシ	22,000	1,604.00	35,288,000
長谷川香料	14,700	1,575.00	23,152,500
星光PMC	8,200	751.00	6,158,200
小林製薬	34,700	7,030.00	243,941,000
荒川化学工業	11,200	1,305.00	14,616,000
メック	8,600	1,040.00	8,944,000
日本高純度化学	3,200	2,234.00	7,148,800
タカラバイオ	32,400	2,692.00	87,220,800
JCU	16,100	1,438.00	23,151,800
新田ゼラチン	7,800	667.00	5,202,600
OATアグリオ	1,800	1,880.00	3,384,000
デクセリアルズ	31,900	833.00	26,572,700
アース製薬	9,400	5,020.00	47,188,000
北興化学工業	12,900	557.00	7,185,300
大成ラミック	3,700	2,931.00	10,844,700
クミアイ化学工業	51,200	646.00	33,075,200
日本農薬	29,700	500.00	14,850,000
昭和シェル石油	114,600	1,595.00	182,787,000
富士興産	4,600	597.00	2,746,200
ニチレキ	16,000	999.00	15,984,000
ユシロ化学工業	6,500	1,214.00	7,891,000
ピーピー・カストロール	4,400	1,254.00	5,517,600
富士石油	30,000	301.00	9,030,000
MORESCO	4,500	1,522.00	6,849,000
出光興産	96,100	3,740.00	359,414,000
JXTGホールディングス	2,084,700	596.60	1,243,732,020
コスモエネルギーホールディングス	35,900	2,495.00	89,570,500
横浜ゴム	71,900	2,185.00	157,101,500

TOYO TIRE	63,600	1,422.00	90,439,200
ブリヂストン	380,900	4,260.00	1,622,634,000
住友ゴム工業	111,300	1,358.00	151,145,400
藤倉ゴム工業	11,000	453.00	4,983,000
オカモト	8,700	5,800.00	50,460,000
アキレス	9,100	1,970.00	17,927,000
フコク	5,600	869.00	4,866,400
ニッタ	14,000	3,515.00	49,210,000
クリエートメディック	4,200	1,003.00	4,212,600
住友理工	24,100	980.00	23,618,000
三ツ星ベルト	16,400	2,060.00	33,784,000
バンドー化学	23,700	1,082.00	25,643,400
A G C	122,600	3,495.00	428,487,000
日本板硝子	59,200	895.00	52,984,000
石塚硝子	1,600	1,954.00	3,126,400
有沢製作所	19,500	758.00	14,781,000
日本山村硝子	5,300	1,557.00	8,252,100
日本電気硝子	53,600	2,725.00	146,060,000
オハラ	4,800	1,603.00	7,694,400
住友大阪セメント	24,900	4,550.00	113,295,000
太平洋セメント	78,200	3,545.00	277,219,000
リソルホールディングス	1,300	4,010.00	5,213,000
日本ヒューム	12,500	822.00	10,275,000
日本コンクリート工業	26,900	256.00	6,886,400
三谷セキサン	5,800	2,610.00	15,138,000
アジアパイルホールディングス	17,500	585.00	10,237,500
東海カーボン	112,500	1,452.00	163,350,000
日本カーボン	5,900	4,110.00	24,249,000
東洋炭素	7,300	2,186.00	15,957,800
ノリタケカンパニーリミテド	7,400	4,850.00	35,890,000
T O T O	95,400	3,905.00	372,537,000
日本碍子	151,200	1,554.00	234,964,800
日本特殊陶業	104,500	2,133.00	222,898,500
ダントーホールディングス	9,500	105.00	997,500
M A R U W A	4,300	5,910.00	25,413,000
品川リフラクトリーズ	3,200	3,615.00	11,568,000
黒崎播磨	2,500	6,490.00	16,225,000
ヨータイ	10,800	588.00	6,350,400
イソライト工業	6,400	472.00	3,020,800
東京窯業	15,900	361.00	5,739,900
ニッカトー	5,600	883.00	4,944,800
フジインコーポレーテッド	11,100	2,185.00	24,253,500
クニミネ工業	4,200	807.00	3,389,400
エーアンドエーマテリアル	2,600	954.00	2,480,400
ニチアス	33,900	1,888.00	64,003,200
新日鐵住金	569,625	1,934.50	1,101,939,562
神戸製鋼所	224,200	813.00	182,274,600
中山製鋼所	17,000	460.00	7,820,000
合同製鐵	5,900	1,636.00	9,652,400



ジェイ エフ イー ホールディングス	331,000	1,820.50	602,585,500	
東京製鐵	65,600	913.00	59,892,800	
共英製鋼	13,800	1,769.00	24,412,200	
大和工業	26,100	2,753.00	71,853,300	
東京鐵鋼	5,100	1,147.00	5,849,700	
大阪製鐵	8,100	1,818.00	14,725,800	
淀川製鋼所	16,600	2,215.00	36,769,000	
丸一鋼管	43,400	3,465.00	150,381,000	
モリ工業	3,700	2,353.00	8,706,100	
大同特殊鋼	20,000	4,470.00	89,400,000	
日本高周波鋼業	4,600	536.00	2,465,600	
日本冶金工業	101,300	237.00	24,008,100	
山陽特殊製鋼	15,400	2,297.00	35,373,800	
愛知製鋼	6,900	3,520.00	24,288,000	
日立金属	132,100	1,197.00	158,123,700	
日本金属	2,800	1,104.00	3,091,200	
大平洋金属	8,200	2,845.00	23,329,000	
新日本電工	73,300	217.00	15,906,100	
栗本鐵工所	6,300	1,372.00	8,643,600	
虹 技	1,800	1,298.00	2,336,400	
日本鑄鉄管	1,300	1,001.00	1,301,300	
日本製鋼所	37,100	1,903.00	70,601,300	
三菱製鋼	9,200	1,611.00	14,821,200	
日垂鋼業	17,400	286.00	4,976,400	
日本精線	1,800	3,305.00	5,949,000	
エンビプロ・ホールディングス	2,500	484.00	1,210,000	
大紀アルミニウム工業所	20,100	574.00	11,537,400	
日本軽金属ホールディングス	333,900	221.00	73,791,900	
三井金属鉱業	33,100	2,385.00	78,943,500	
東邦亜鉛	6,800	3,445.00	23,426,000	
三菱マテリアル	80,900	3,000.00	242,700,000	
住友金属鉱山	167,800	3,060.00	513,468,000	
D O W Aホールディングス	28,700	3,375.00	96,862,500	
古河機械金属	20,200	1,271.00	25,674,200	
エス・サイエンス	54,200	52.00	2,818,400	
大阪チタニウムテクノロジーズ	14,200	1,652.00	23,458,400	
東邦チタニウム	22,000	1,003.00	22,066,000	
U A C J	18,700	2,238.00	41,850,600	
C Kサンエツ	2,300	2,240.00	5,152,000	
古河電気工業	35,400	2,960.00	104,784,000	
住友電気工業	458,200	1,489.50	682,488,900	
フジクラ	147,900	448.00	66,259,200	
昭和電線ホールディングス	14,200	625.00	8,875,000	
東京特殊電線	1,600	1,866.00	2,985,600	
タツタ電線	24,300	481.00	11,688,300	
カナレ電気	2,000	1,714.00	3,428,000	
平河ヒューテック	5,100	1,012.00	5,161,200	
リョービ	15,100	2,666.00	40,256,600	
アーレスティ	15,100	627.00	9,467,700	

アサヒホールディングス	23,100	2,367.00	54,677,700
東洋製罐グループホールディングス	78,000	2,589.00	201,942,000
ホッカンホールディングス	6,300	1,696.00	10,684,800
コロナ	6,900	1,070.00	7,383,000
横河ブリッジホールディングス	22,800	1,687.00	38,463,600
OSJBホールディングス	61,400	305.00	18,727,000
駒井ハルテック	2,400	1,821.00	4,370,400
高田機工	1,000	2,697.00	2,697,000
三和ホールディングス	126,600	1,240.00	156,984,000
文化シャッター	36,200	728.00	26,353,600
三協立山	17,000	1,392.00	23,664,000
アルインコ	9,800	963.00	9,437,400
東洋シャッター	3,000	610.00	1,830,000
LIXILグループ	180,900	1,437.00	259,953,300
日本ファイルコン	9,500	541.00	5,139,500
ノーリツ	27,300	1,550.00	42,315,000
長府製作所	12,500	2,108.00	26,350,000
リンナイ	21,900	7,090.00	155,271,000
ユニプレス	24,000	1,839.00	44,136,000
ダイニチ工業	6,500	654.00	4,251,000
日東精工	16,900	456.00	7,706,400
三洋工業	1,500	1,914.00	2,871,000
岡部	24,800	871.00	21,600,800
ジーテクト	13,600	1,463.00	19,896,800
中国工業	1,900	547.00	1,039,300
東プレ	22,800	2,270.00	51,756,000
高周波熱錬	23,700	832.00	19,718,400
東京製綱	7,500	950.00	7,125,000
サンコール	7,000	587.00	4,109,000
モリテックスチール	9,600	401.00	3,849,600
パイオラックス	19,600	2,260.00	44,296,000
エイチワン	12,100	1,034.00	12,511,400
日本発条	122,100	985.00	120,268,500
中央発條	1,400	3,265.00	4,571,000
アドパネクス	1,600	1,579.00	2,526,400
三浦工業	53,100	2,560.00	135,936,000
タクマ	44,600	1,352.00	60,299,200
テクノプロ・ホールディングス	22,300	5,000.00	111,500,000
アトラ	2,300	451.00	1,037,300
インターワークス	2,300	690.00	1,587,000
アイ・アールジャパンホールディングス	3,800	1,178.00	4,476,400
KeepPer 技研	3,900	966.00	3,767,400
ファーストロジック	2,300	660.00	1,518,000
三機サービス	1,900	1,739.00	3,304,100
Gunosy	7,300	2,940.00	21,462,000
デザインワン・ジャパン	2,300	311.00	715,300
イー・ガーディアン	5,600	1,993.00	11,160,800
リブセンス	6,400	257.00	1,644,800
ジャパンマテリアル	32,400	1,042.00	33,760,800

ベクトル	14,400	1,401.00	20,174,400
ウチヤマホールディングス	6,000	431.00	2,586,000
ライクキッズネクスト	2,500	768.00	1,920,000
キャリアリンク	4,300	337.00	1,449,100
I B J	7,900	835.00	6,596,500
アサンテ	4,700	2,048.00	9,625,600
N・フィールド	7,600	902.00	6,855,200
バリューHR	2,500	1,763.00	4,407,500
M&Aキャピタルパートナーズ	3,000	3,885.00	11,655,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	4,800	1,225.00	5,880,000
E R Iホールディングス	3,300	728.00	2,402,400
アビスト	1,900	3,100.00	5,890,000
シグマクシス	5,600	785.00	4,396,000
ウィルグループ	7,600	914.00	6,946,400
エスクロー・エージェント・ジャパン	16,300	266.00	4,335,800
日本ビューホテル	3,800	1,109.00	4,214,200
リクルートホールディングス	848,400	2,852.00	2,419,636,800
エラン	8,100	1,329.00	10,764,900
ツガミ	27,400	637.00	17,453,800
オークマ	15,600	5,190.00	80,964,000
東芝機械	13,800	2,065.00	28,497,000
アマダホールディングス	189,100	1,028.00	194,394,800
アイダエンジニアリング	34,000	732.00	24,888,000
滝澤鉄工所	3,900	1,396.00	5,444,400
F U J I	36,700	1,315.00	48,260,500
牧野フライス製作所	14,300	4,010.00	57,343,000
オーエスジー	60,300	2,153.00	129,825,900
ダイジェット工業	1,400	1,723.00	2,412,200
旭ダイヤモンド工業	32,100	623.00	19,998,300
D M G 森精機	77,500	1,297.00	100,517,500
ソディック	26,700	739.00	19,731,300
ディスコ	16,600	13,340.00	221,444,000
日東工器	6,700	2,146.00	14,378,200
日進工具	3,700	2,181.00	8,069,700
パンチ工業	8,600	481.00	4,136,600
富士ダイス	5,500	620.00	3,410,000
土木管理総合試験所	5,200	497.00	2,584,400
日本郵政	970,800	1,321.00	1,282,426,800
ベルシステム24ホールディングス	19,800	1,327.00	26,274,600
鎌倉新書	8,700	1,405.00	12,223,500
一蔵	1,500	570.00	855,000
L I T A L I C O	2,700	1,755.00	4,738,500
グローバルグループ	1,400	916.00	1,282,400
エボラブルアジア	3,300	1,850.00	6,105,000
アトラエ	2,300	2,029.00	4,666,700
ストライク	3,000	1,696.00	5,088,000
ソラスト	28,800	1,145.00	32,976,000
セラク	2,600	533.00	1,385,800
インソース	3,900	1,846.00	7,199,400

豊田自動織機	100,300	5,400.00	541,620,000
豊和工業	6,800	771.00	5,242,800
OKK	5,100	803.00	4,095,300
石川製作所	2,900	1,153.00	3,343,700
東洋機械金属	8,900	549.00	4,886,100
津田駒工業	2,600	1,842.00	4,789,200
エンシュウ	3,200	1,019.00	3,260,800
島精機製作所	16,900	3,340.00	56,446,000
オプトラ	12,000	1,566.00	18,792,000
NCホールディングス	3,800	581.00	2,207,800
フリー	9,800	1,025.00	10,045,000
ヤマシンフィルタ	21,300	658.00	14,015,400
日阪製作所	15,200	812.00	12,342,400
やまびこ	23,800	1,030.00	24,514,000
平田機工	5,800	5,280.00	30,624,000
ペガサスミシン製造	11,500	662.00	7,613,000
マルマエ	3,300	628.00	2,072,400
タツモ	3,900	704.00	2,745,600
ナブテスコ	67,400	2,534.00	170,791,600
三井海洋開発	13,000	2,429.00	31,577,000
レオン自動機	12,100	1,300.00	15,730,000
SMC	36,300	34,750.00	1,261,425,000
新川	9,300	368.00	3,422,400
ホソカワミクロン	4,300	4,080.00	17,544,000
ユニオンツール	5,300	3,065.00	16,244,500
オイレス工業	17,100	1,757.00	30,044,700
日精エー・エス・ビー機械	3,500	3,510.00	12,285,000
サトーホールディングス	14,700	2,607.00	38,322,900
技研製作所	8,600	3,100.00	26,660,000
日本エアーテック	3,800	587.00	2,230,600
カワタ	2,500	1,308.00	3,270,000
日精樹脂工業	10,300	921.00	9,486,300
オカダアイヨン	4,200	1,455.00	6,111,000
ワイエイシーホールディングス	4,900	606.00	2,969,400
小松製作所	561,100	2,595.00	1,456,054,500
住友重機械工業	70,900	3,415.00	242,123,500
日立建機	49,600	2,567.00	127,323,200
日工	3,400	2,307.00	7,843,800
巴工業	5,300	2,381.00	12,619,300
井関農機	12,400	1,592.00	19,740,800
TOWA	10,500	606.00	6,363,000
丸山製作所	2,600	1,317.00	3,424,200
北川鉄工所	5,600	2,229.00	12,482,400
シンニッタン	19,200	333.00	6,393,600
ローツェ	5,400	1,472.00	7,948,800
タカキタ	4,400	676.00	2,974,400
クボタ	664,800	1,624.00	1,079,635,200
荏原実業	3,500	1,794.00	6,279,000
東洋エンジニアリング	16,400	719.00	11,791,600
三菱化工機	4,300	1,474.00	6,338,200

月島機械	24,500	1,399.00	34,275,500
帝国電機製作所	8,700	1,276.00	11,101,200
東京機械製作所	4,700	395.00	1,856,500
新東工業	29,400	896.00	26,342,400
澁谷工業	10,800	3,600.00	38,880,000
アイチコーポレーション	21,400	595.00	12,733,000
小森コーポレーション	33,500	1,124.00	37,654,000
鶴見製作所	9,700	1,808.00	17,537,600
住友精密工業	2,000	3,110.00	6,220,000
酒井重工業	2,300	2,350.00	5,405,000
荏原製作所	54,900	2,664.00	146,253,600
石井鐵工所	1,900	1,799.00	3,418,100
西島製作所	12,700	939.00	11,925,300
北越工業	12,800	1,086.00	13,900,800
千代田化工建設	100,100	317.00	31,731,700
ダイキン工業	169,200	12,150.00	2,055,780,000
オルガノ	4,500	2,500.00	11,250,000
トヨーカネツ	4,600	2,269.00	10,437,400
栗田工業	67,100	2,644.00	177,412,400
椿本チエイン	16,200	3,725.00	60,345,000
大同工業	5,900	904.00	5,333,600
日機装	40,100	964.00	38,656,400
木村化工機	10,300	361.00	3,718,300
新興プランテック	24,900	1,141.00	28,410,900
アネスト岩田	19,300	963.00	18,585,900
ダイフク	68,100	4,940.00	336,414,000
サムコ	3,400	906.00	3,080,400
加藤製作所	6,400	2,632.00	16,844,800
油研工業	2,200	1,876.00	4,127,200
タダノ	59,800	1,144.00	68,411,200
フジテック	45,100	1,165.00	52,541,500
C K D	34,400	968.00	33,299,200
キトー	9,400	1,580.00	14,852,000
平和	34,500	2,254.00	77,763,000
理想科学工業	11,000	1,644.00	18,084,000
SANKYO	31,000	4,145.00	128,495,000
日本金銭機械	13,700	989.00	13,549,300
マースグループホールディングス	7,800	2,217.00	17,292,600
福島工業	7,600	3,810.00	28,956,000
オーイズミ	5,100	355.00	1,810,500
ダイコク電機	5,700	1,529.00	8,715,300
竹内製作所	20,700	1,830.00	37,881,000
アマノ	35,500	2,141.00	76,005,500
JUKI	17,200	1,112.00	19,126,400
サンデンホールディングス	15,100	805.00	12,155,500
蛇の目ミシン工業	11,300	484.00	5,469,200
ブラザー工業	161,500	1,711.00	276,326,500
マックス	19,100	1,440.00	27,504,000
モリタホールディングス	21,600	1,806.00	39,009,600
グローリー	34,300	2,574.00	88,288,200

新晃工業	11,500	1,458.00	16,767,000
大和冷機工業	17,800	1,099.00	19,562,200
セガサミーホールディングス	123,000	1,565.00	192,495,000
日本ピストンリング	4,500	1,800.00	8,100,000
リケン	5,700	4,630.00	26,391,000
T P R	16,700	2,215.00	36,990,500
ツバキ・ナカシマ	18,700	1,608.00	30,069,600
ホシザキ	36,200	7,890.00	285,618,000
大豊工業	10,100	977.00	9,867,700
日本精工	254,500	992.00	252,464,000
N T N	266,400	338.00	90,043,200
ジェイテクト	118,900	1,298.00	154,332,200
不二越	11,500	4,115.00	47,322,500
ミネベアミツミ	230,100	1,617.00	372,071,700
日本トムソン	36,800	509.00	18,731,200
T H K	77,300	2,164.00	167,277,200
ユーシン精機	9,600	864.00	8,294,400
前澤給装工業	4,800	1,895.00	9,096,000
イーグル工業	15,300	1,246.00	19,063,800
前澤工業	9,200	356.00	3,275,200
日本ピラー工業	12,500	1,286.00	16,075,000
キッツ	50,200	873.00	43,824,600
日立製作所	558,000	3,346.00	1,867,068,000
三菱電機	1,239,400	1,250.00	1,549,250,000
富士電機	80,400	3,240.00	260,496,000
東洋電機製造	4,800	1,296.00	6,220,800
安川電機	143,600	2,693.00	386,714,800
シンフォニアテクノロジー	17,200	1,281.00	22,033,200
明電舎	24,500	1,390.00	34,055,000
オリジン電気	3,300	1,678.00	5,537,400
山洋電気	6,000	3,820.00	22,920,000
デンヨー	11,400	1,420.00	16,188,000
アイモバイル	2,800	722.00	2,021,600
キャリアインデックス	4,000	1,229.00	4,916,000
M S - J a p a n	4,700	1,293.00	6,077,100
船場	2,100	855.00	1,795,500
グレイステクノロジー	3,200	1,765.00	5,648,000
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	7,000	1,806.00	12,642,000
フルテック	1,300	1,124.00	1,461,200
グリーンズ	2,600	1,328.00	3,452,800
ツナグ・ソリューションズ	1,000	602.00	602,000
日総工産	2,900	1,839.00	5,333,100
キュービーネットホールディングス	6,000	1,916.00	11,496,000
三櫻工業	15,700	617.00	9,686,900
マキタ	150,800	3,875.00	584,350,000
東芝テック	15,500	2,554.00	39,587,000
芝浦メカトロニクス	2,200	3,610.00	7,942,000
マブチモーター	34,200	3,500.00	119,700,000
日本電産	149,200	12,290.00	1,833,668,000

ユー・エム・シー・エレクトロニクス	6,700	1,730.00	11,591,000
トレックス・セミコンダクター	4,200	1,137.00	4,775,400
東光高岳	6,300	1,381.00	8,700,300
ダブル・スコープ	18,000	1,166.00	20,988,000
宮越ホールディングス	4,600	1,029.00	4,733,400
ダイヘン	13,600	2,289.00	31,130,400
田淵電機	16,700	126.00	2,104,200
ヤーマン	17,900	1,305.00	23,359,500
JVCケンウッド	90,800	246.00	22,336,800
ミマキエンジニアリング	11,100	855.00	9,490,500
第一精工	5,200	1,152.00	5,990,400
日新電機	29,100	871.00	25,346,100
大崎電気工業	24,600	716.00	17,613,600
オムロン	131,600	3,970.00	522,452,000
日東工業	19,800	1,926.00	38,134,800
I D E C	16,600	1,912.00	31,739,200
不二電機工業	1,300	1,318.00	1,713,400
ジーエス・ユアサ コーポレーション	44,500	2,289.00	101,860,500
サクサホールディングス	3,000	1,797.00	5,391,000
メルコホールディングス	5,200	3,410.00	17,732,000
テクノメディカ	2,800	2,076.00	5,812,800
日本電気	160,400	3,550.00	569,420,000
富士通	119,500	6,918.00	826,701,000
沖電気工業	53,700	1,368.00	73,461,600
岩崎通信機	5,900	775.00	4,572,500
電気興業	6,500	2,331.00	15,151,500
サンケン電気	14,400	2,038.00	29,347,200
ナカヨ	2,300	1,444.00	3,321,200
アイホン	7,100	1,706.00	12,112,600
ルネサスエレクトロニクス	128,300	578.00	74,157,400
セイコーエプソン	153,700	1,620.00	248,994,000
ワコム	89,800	446.00	40,050,800
アルバック	28,500	3,335.00	95,047,500
アクセル	5,100	499.00	2,544,900
E I Z O	11,400	4,060.00	46,284,000
ジャパンディスプレイ	293,000	74.00	21,682,000
日本信号	31,500	897.00	28,255,500
京三製作所	26,600	419.00	11,145,400
能美防災	16,400	1,862.00	30,536,800
ホーチキ	7,800	1,098.00	8,564,400
星和電機	4,100	364.00	1,492,400
エレコム	11,200	2,835.00	31,752,000
パナソニック	1,416,000	1,067.00	1,510,872,000
シャープ	123,000	1,209.00	148,707,000
アンリツ	79,800	1,570.00	125,286,000
富士通ゼネラル	37,800	1,508.00	57,002,400
ソニー	830,900	5,320.00	4,420,388,000
T D K	64,800	7,500.00	486,000,000
帝国通信工業	5,500	1,157.00	6,363,500
タムラ製作所	47,700	519.00	24,756,300

アルプスアルパイン	129,032	2,124.00	274,063,968
池上通信機	3,900	1,179.00	4,598,100
パイオニア	206,600	64.00	13,222,400
日本電波工業	11,300	375.00	4,237,500
鈴木	6,200	562.00	3,484,400
日本トリム	2,400	5,790.00	13,896,000
ローランド ディー・ジー	6,400	2,145.00	13,728,000
フォスター電機	14,500	1,380.00	20,010,000
クラリオン	10,800	2,491.00	26,902,800
S M K	3,400	2,232.00	7,588,800
ヨコオ	8,900	1,331.00	11,845,900
ティアック	8,700	217.00	1,887,900
ホシデン	36,500	735.00	26,827,500
ヒロセ電機	17,700	11,060.00	195,762,000
日本航空電子工業	28,500	1,282.00	36,537,000
T O A	13,400	990.00	13,266,000
マクセルホールディングス	26,700	1,489.00	39,756,300
古野電気	16,000	1,140.00	18,240,000
ユニデンホールディングス	3,700	2,066.00	7,644,200
スミダコーポレーション	10,500	1,165.00	12,232,500
アイコム	6,900	2,137.00	14,745,300
リオン	5,700	1,802.00	10,271,400
本多通信工業	10,600	458.00	4,854,800
船井電機	12,600	574.00	7,232,400
横河電機	124,000	1,944.00	241,056,000
新電元工業	4,400	3,945.00	17,358,000
アズビル	80,000	2,214.00	177,120,000
東亜ディーケーケー	6,200	776.00	4,811,200
日本光電工業	54,600	3,415.00	186,459,000
チノー	4,300	1,217.00	5,233,100
共和電業	13,100	381.00	4,991,100
日本電子材料	4,700	629.00	2,956,300
堀場製作所	24,500	4,595.00	112,577,500
アドバンテスト	84,400	2,317.00	195,554,800
小野測器	5,800	580.00	3,364,000
エスペック	11,000	1,814.00	19,954,000
キーエンス	60,800	53,560.00	3,256,448,000
日置電機	6,500	3,430.00	22,295,000
シスメックス	96,600	5,469.00	528,305,400
日本マイクロニクス	20,000	704.00	14,080,000
メガチップス	9,800	2,580.00	25,284,000
O B A R A G R O U P	7,200	3,900.00	28,080,000
I M A G I C A G R O U P	10,300	497.00	5,119,100
澤藤電機	1,500	1,379.00	2,068,500
デンソー	272,900	5,079.00	1,386,059,100
原田工業	3,800	787.00	2,990,600
コーセル	17,200	947.00	16,288,400
イリソ電子工業	11,300	4,150.00	46,895,000
オブテックスグループ	21,800	1,858.00	40,504,400
千代田インテグレ	5,200	1,999.00	10,394,800



アイ・オー・データ機器	5,200	1,121.00	5,829,200
レーザーテック	25,400	2,916.00	74,066,400
スタンレー電気	87,800	3,080.00	270,424,000
岩崎電気	4,800	1,348.00	6,470,400
ウシオ電機	75,300	1,214.00	91,414,200
岡谷電機産業	8,900	370.00	3,293,000
ヘリオス テクノ ホールディング	11,400	637.00	7,261,800
エノモト	2,600	792.00	2,059,200
日本セラミック	12,600	2,425.00	30,555,000
遠藤照明	6,400	706.00	4,518,400
古河電池	8,900	676.00	6,016,400
双信電機	6,000	360.00	2,160,000
山一電機	9,000	1,194.00	10,746,000
図研	8,000	1,554.00	12,432,000
日本電子	24,400	1,725.00	42,090,000
カシオ計算機	109,600	1,333.00	146,096,800
ファナック	117,800	17,185.00	2,024,393,000
日本シイエムケイ	31,500	643.00	20,254,500
エンプラス	5,600	2,950.00	16,520,000
大真空	4,500	903.00	4,063,500
ローム	59,900	7,230.00	433,077,000
浜松ホトニクス	89,000	3,680.00	327,520,000
三井ハイテック	13,700	865.00	11,850,500
新光電気工業	41,500	674.00	27,971,000
京セラ	189,000	5,688.00	1,075,032,000
協栄産業	1,400	1,564.00	2,189,600
太陽誘電	55,200	1,523.00	84,069,600
村田製作所	130,100	13,375.00	1,740,087,500
ユーシン	19,600	981.00	19,227,600
双葉電子工業	20,200	1,635.00	33,027,000
日東電工	93,600	5,731.00	536,421,600
北陸電気工業	4,600	943.00	4,337,800
東海理化電機製作所	32,600	1,897.00	61,842,200
ニチコン	39,000	873.00	34,047,000
日本ケミコン	8,900	1,898.00	16,892,200
K O A	18,800	1,340.00	25,192,000
三井E & Sホールディングス	44,700	1,141.00	51,002,700
日立造船	98,100	361.00	35,414,100
三菱重工業	207,700	4,123.00	856,347,100
川崎重工業	96,500	2,521.00	243,276,500
I H I	95,300	3,160.00	301,148,000
名村造船所	37,200	469.00	17,446,800
サノヤスホールディングス	16,500	172.00	2,838,000
スプリックス	3,300	2,021.00	6,669,300
日本車輛製造	4,500	2,220.00	9,990,000
三菱ロジスネクスト	14,700	1,091.00	16,037,700
近畿車輛	1,900	1,986.00	3,773,400
F P G	39,100	1,140.00	44,574,000
島根銀行	2,700	686.00	1,852,200
じもとホールディングス	82,900	127.00	10,528,300

全国保証	34,400	3,565.00	122,636,000	
めぶきフィナンシャルグループ	635,000	303.00	192,405,000	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	16,500	1,651.00	27,241,500	
九州フィナンシャルグループ	200,500	424.00	85,012,000	
かんぽ生命保険	46,200	2,625.00	121,275,000	
ゆうちょ銀行	346,600	1,252.00	433,943,200	
富山第一銀行	29,500	397.00	11,711,500	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	778,500	434.00	337,869,000	
ジェイリース	2,600	323.00	839,800	
西日本フィナンシャルホールディングス	78,200	999.00	78,121,800	
マーキュリアインベストメント	4,700	698.00	3,280,600	
イントラスト	3,400	351.00	1,193,400	
日本モーゲージサービス	1,600	819.00	1,310,400	
CASA	4,100	1,197.00	4,907,700	
アルヒ	11,100	2,217.00	24,608,700	
日産自動車	1,461,900	905.50	1,323,750,450	
いすゞ自動車	391,800	1,628.50	638,046,300	
トヨタ自動車	1,381,300	6,821.00	9,421,847,300	*
日野自動車	154,700	1,088.00	168,313,600	
三菱自動車工業	458,800	643.00	295,008,400	
エフテック	8,800	946.00	8,324,800	
レシップホールディングス	4,500	710.00	3,195,000	
GMB	2,500	935.00	2,337,500	
ファルテック	2,100	785.00	1,648,500	
武蔵精密工業	29,200	1,507.00	44,004,400	
日産車体	24,200	957.00	23,159,400	
新明和工業	57,700	1,350.00	77,895,000	
極東開発工業	24,600	1,435.00	35,301,000	
日信工業	22,600	1,445.00	32,657,000	
トビー工業	10,200	2,291.00	23,368,200	
ティラド	4,500	2,309.00	10,390,500	
曙ブレーキ工業	68,000	199.00	13,532,000	
タチエス	21,000	1,468.00	30,828,000	
NOK	66,600	1,574.00	104,828,400	
フタバ産業	34,400	548.00	18,851,200	
KYB	12,900	2,796.00	36,068,400	
市光工業	18,600	582.00	10,825,200	
大同メタル工業	20,100	794.00	15,959,400	
プレス工業	61,400	539.00	33,094,600	
ミクニ	15,700	515.00	8,085,500	
太平洋工業	26,000	1,520.00	39,520,000	
ケーヒン	28,500	1,861.00	53,038,500	
河西工業	15,200	830.00	12,616,000	
アイシン精機	102,100	4,050.00	413,505,000	
マツダ	389,000	1,183.50	460,381,500	
今仙電機製作所	11,500	1,004.00	11,546,000	
本田技研工業	1,045,700	3,170.00	3,314,869,000	
スズキ	226,800	5,676.00	1,287,316,800	

S U B A R U	384,800	2,419.00	930,831,200
安永	6,000	1,501.00	9,006,000
ヤマハ発動機	175,000	2,219.00	388,325,000
ショーワ	29,300	1,314.00	38,500,200
小糸製作所	74,300	5,810.00	431,683,000
T B K	14,900	402.00	5,989,800
エクセディ	16,800	2,568.00	43,142,400
ミツバ	22,800	649.00	14,797,200
豊田合成	40,100	2,326.00	93,272,600
愛三工業	19,400	733.00	14,220,200
盟和産業	1,900	1,017.00	1,932,300
日本プラスト	9,700	751.00	7,284,700
ヨロズ	11,600	1,385.00	16,066,000
エフ・シー・シー	22,300	2,629.00	58,626,700
新家工業	2,700	1,567.00	4,230,900
シマノ	50,000	15,760.00	788,000,000
テイ・エス テック	28,800	3,035.00	87,408,000
関西みらいフィナンシャルグループ	57,400	832.00	47,756,800
三十三フィナンシャルグループ	10,500	1,679.00	17,629,500
第四北越フィナンシャルグループ	21,200	3,160.00	66,992,000
ジャムコ	6,300	2,397.00	15,101,100
小野建	10,700	1,646.00	17,612,200
はるやまホールディングス	5,600	837.00	4,687,200
ノジマ	21,800	2,207.00	48,112,600
佐島電機	9,100	894.00	8,135,400
カッパ・クリエイト	17,100	1,364.00	23,324,400
エコートレーディング	2,600	602.00	1,565,200
伯東	8,400	1,145.00	9,618,000
コンドーテック	9,500	949.00	9,015,500
中山福	6,700	523.00	3,504,100
ライトオン	10,300	850.00	8,755,000
ナガイレーベン	17,600	2,337.00	41,131,200
ジーンズメイト	3,700	379.00	1,402,300
三菱食品	13,500	2,880.00	38,880,000
良品計画	17,300	23,080.00	399,284,000
三城ホールディングス	15,300	435.00	6,655,500
松田産業	9,000	1,458.00	13,122,000
第一興商	18,200	5,200.00	94,640,000
メディカルホールディングス	131,800	2,453.00	323,305,400
アドヴァン	18,800	904.00	16,995,200
S P K	2,500	2,284.00	5,710,000
萩原電気ホールディングス	4,500	2,729.00	12,280,500
アルビス	4,600	2,367.00	10,888,200
アズワン	8,800	7,360.00	64,768,000
スズデン	4,300	1,227.00	5,276,100
尾家産業	3,400	1,240.00	4,216,000
シモジマ	7,500	1,121.00	8,407,500
ドウシシャ	11,500	1,727.00	19,860,500
小津産業	2,600	1,890.00	4,914,000
コナカ	15,900	455.00	7,234,500

高速	7,400	1,082.00	8,006,800
ハウス オブ ローゼ	1,500	1,829.00	2,743,500
G - 7ホールディングス	3,500	2,141.00	7,493,500
たけびし	4,300	1,365.00	5,869,500
イオン北海道	12,400	790.00	9,796,000
コジマ	17,900	502.00	8,985,800
ヒマラヤ	3,900	941.00	3,669,900
コーナン商事	16,100	2,639.00	42,487,900
ネットワンシステムズ	43,100	1,957.00	84,346,700
エコス	4,500	1,847.00	8,311,500
ワタミ	16,100	1,372.00	22,089,200
マルシェ	3,300	752.00	2,481,600
リックス	2,700	1,457.00	3,933,900
システムソフト	29,400	94.00	2,763,600
ドンキホーテホールディングス	79,200	6,240.00	494,208,000
丸文	10,800	706.00	7,624,800
西松屋チェーン	26,800	884.00	23,691,200
ゼンショーホールディングス	57,600	2,538.00	146,188,800
ハビネット	10,200	1,516.00	15,463,200
幸楽苑ホールディングス	7,700	2,392.00	18,418,400
ハークスレイ	2,700	1,107.00	2,988,900
橋本総業ホールディングス	2,400	1,410.00	3,384,000
日本ライフライン	38,300	1,477.00	56,569,100
サイゼリヤ	20,100	2,019.00	40,581,900
タカショー	6,200	478.00	2,963,600
エクセル	4,500	1,932.00	8,694,000
V Tホールディングス	41,400	411.00	17,015,400
マルカキカイ	4,000	1,890.00	7,560,000
アルゴグラフィックス	5,200	3,655.00	19,006,000
魚力	3,400	1,421.00	4,831,400
I D O M	41,100	381.00	15,659,100
日本エム・ディ・エム	7,100	1,043.00	7,405,300
ポブラ	3,100	574.00	1,779,400
フジ・コーポレーション	2,500	2,040.00	5,100,000
ユナイテッドアローズ	14,000	3,575.00	50,050,000
進和	7,200	2,325.00	16,740,000
エスケイジャパン	2,900	870.00	2,523,000
ダイترون	5,600	1,255.00	7,028,000
ハイデイ日高	16,100	2,201.00	35,436,100
シークス	15,500	1,381.00	21,405,500
京都きもの友禅	7,800	419.00	3,268,200
コロワイド	40,600	2,350.00	95,410,000
ピーシーデボコーポレーション	16,200	440.00	7,128,000
田中商事	3,700	548.00	2,027,600
オーハシテクニカ	6,900	1,247.00	8,604,300
壱番屋	8,700	4,355.00	37,888,500
白銅	4,000	1,584.00	6,336,000
トップカルチャー	4,600	290.00	1,334,000
P L A N T	2,900	1,018.00	2,952,200
スギホールディングス	26,800	4,485.00	120,198,000

島津製作所	159,500	2,314.00	369,083,000
JMS	11,200	574.00	6,428,800
クボテック	2,600	223.00	579,800
長野計器	9,700	785.00	7,614,500
ブイ・テクノロジー	2,900	13,170.00	38,193,000
スター精密	21,300	1,549.00	32,993,700
東京計器	7,800	940.00	7,332,000
愛知時計電機	1,600	3,770.00	6,032,000
インターアクション	6,600	1,836.00	12,117,600
オーバル	11,800	228.00	2,690,400
東京精密	22,400	2,799.00	62,697,600
マニー	15,100	4,850.00	73,235,000
ニコン	216,000	1,684.00	363,744,000
トプコン	66,500	1,478.00	98,287,000
オリンパス	184,600	4,005.00	739,323,000
理研計器	11,000	2,086.00	22,946,000
SCREENホールディングス	21,500	4,955.00	106,532,500
キヤノン電子	11,400	1,883.00	21,466,200
タムロン	11,000	1,621.00	17,831,000
HOYA	249,600	6,412.00	1,600,435,200
シード	5,300	1,248.00	6,614,400
ノーリツ鋼機	9,800	1,579.00	15,474,200
エー・アンド・デイ	11,300	641.00	7,243,300
朝日インテック	44,700	4,520.00	202,044,000
キヤノン	667,300	3,059.00	2,041,270,700
リコー	372,700	1,085.00	404,379,500
シチズン時計	135,600	551.00	74,715,600
リズム時計工業	4,100	1,889.00	7,744,900
大研医器	9,900	624.00	6,177,600
メニコン	17,000	2,749.00	46,733,000
シンシア	1,900	486.00	923,400
中本パックス	3,400	1,734.00	5,895,600
スノーピーク	4,500	1,236.00	5,562,000
パラマウントベッドホールディングス	14,200	4,470.00	63,474,000
トランザクション	6,800	713.00	4,848,400
SHOBI	3,500	354.00	1,239,000
ニホンフラッシュ	5,300	1,670.00	8,851,000
前田工織	13,700	2,575.00	35,277,500
永大産業	16,600	429.00	7,121,400
アートネイチャー	13,200	625.00	8,250,000
バンダイナムコホールディングス	128,100	4,705.00	602,710,500
アイフィスジャパン	2,700	570.00	1,539,000
共立印刷	21,000	202.00	4,242,000
SHOEI	5,900	3,550.00	20,945,000
フランスベッドホールディングス	17,600	910.00	16,016,000
マーベラス	18,600	855.00	15,903,000
パイロットコーポレーション	21,600	5,370.00	115,992,000
萩原工業	6,900	1,484.00	10,239,600
エイベックス	20,900	1,499.00	31,329,100
トッパン・フォームズ	26,600	900.00	23,940,000

フジシールインターナショナル	27,700	3,795.00	105,121,500
タカラトミー	51,900	1,103.00	57,245,700
廣濟堂	11,500	406.00	4,669,000
エステールホールディングス	3,500	647.00	2,264,500
アーク	47,200	75.00	3,540,000
レック	13,200	1,610.00	21,252,000
タカノ	4,900	816.00	3,998,400
三光合成	9,600	330.00	3,168,000
プロネクス	10,600	985.00	10,441,000
ホクシン	7,800	147.00	1,146,600
ウッドワン	4,000	1,116.00	4,464,000
大建工業	9,400	1,929.00	18,132,600
きもと	21,100	186.00	3,924,600
凸版印刷	174,900	1,714.00	299,778,600
大日本印刷	174,600	2,435.00	425,151,000
図書印刷	11,600	775.00	8,990,000
共同印刷	3,900	2,423.00	9,449,700
N I S S H A	25,400	1,360.00	34,544,000
光村印刷	1,000	2,122.00	2,122,000
藤森工業	11,100	2,894.00	32,123,400
ヴィア・ホールディングス	14,900	676.00	10,072,400
宝印刷	6,500	1,624.00	10,556,000
前澤化成工業	8,700	1,058.00	9,204,600
アシックス	123,100	1,468.00	180,710,800
ツツミ	3,900	1,899.00	7,406,100
ウェーブロックホールディングス	2,600	709.00	1,843,400
J S P	7,200	2,073.00	14,925,600
ニチハ	17,200	2,636.00	45,339,200
エフピコ	10,200	6,210.00	63,342,000
小松ウオール工業	3,800	1,957.00	7,436,600
ヤマハ	73,700	4,560.00	336,072,000
河合楽器製作所	3,800	2,938.00	11,164,400
クリナップ	11,600	616.00	7,145,600
ビジョン	74,900	4,315.00	323,193,500
天馬	8,700	1,762.00	15,329,400
兼松サステック	800	1,556.00	1,244,800
キングジム	10,300	835.00	8,600,500
象印マホービン	23,100	1,020.00	23,562,000
リンテック	29,500	2,368.00	69,856,000
信越ポリマー	22,300	694.00	15,476,200
東リ	31,000	263.00	8,153,000
イトーキ	22,800	596.00	13,588,800
任天堂	76,300	30,330.00	2,314,179,000
三菱鉛筆	20,400	2,198.00	44,839,200
松風	6,300	1,094.00	6,892,200
タカラスタンダード	25,700	1,654.00	42,507,800
コクヨ	59,500	1,617.00	96,211,500
ナカバヤシ	12,400	538.00	6,671,200
ニフコ	49,600	2,529.00	125,438,400
立川ブラインド工業	5,500	1,034.00	5,687,000

グローブライド	6,000	2,575.00	15,450,000
オカムラ	43,300	1,389.00	60,143,700
バルカー	10,000	2,197.00	21,970,000
MUTOHホールディングス	1,600	1,949.00	3,118,400
伊藤忠商事	853,900	1,921.50	1,640,768,850
丸紅	1,203,900	795.40	957,582,060
スクロール	18,800	398.00	7,482,400
高島	2,000	1,766.00	3,532,000
ヨンドシーホールディングス	13,600	2,014.00	27,390,400
三陽商会	7,300	1,605.00	11,716,500
長瀬産業	68,700	1,523.00	104,630,100
ナイガイ	4,600	525.00	2,415,000
蝶理	7,800	1,638.00	12,776,400
豊田通商	136,300	3,355.00	457,286,500
オンワードホールディングス	73,000	614.00	44,822,000
三共生興	20,900	403.00	8,422,700
兼松	48,800	1,316.00	64,220,800
美津濃	12,300	2,420.00	29,766,000
ツカモトコーポレーション	2,200	1,054.00	2,318,800
ユニー・ファミリーマートホールディングス	34,100	12,690.00	432,729,000
ルックホールディングス	4,400	1,052.00	4,628,800
三井物産	1,005,800	1,738.00	1,748,080,400
日本紙パルプ商事	7,000	4,115.00	28,805,000
東京エレクトロン	82,700	13,525.00	1,118,517,500
日立ハイテクノロジーズ	37,100	3,625.00	134,487,500
カメイ	16,000	1,217.00	19,472,000
東都水産	1,800	2,163.00	3,893,400
OUGホールディングス	2,100	2,487.00	5,222,700
スターゼン	4,500	3,705.00	16,672,500
セイコーホールディングス	19,200	2,274.00	43,660,800
山善	47,700	1,078.00	51,420,600
椿本興業	2,700	3,135.00	8,464,500
住友商事	721,900	1,609.00	1,161,537,100
日本ユニシス	38,000	2,491.00	94,658,000
内田洋行	5,600	2,529.00	14,162,400
三菱商事	856,600	3,091.00	2,647,750,600
第一実業	5,600	3,475.00	19,460,000
キヤノンマーケティングジャパン	34,800	1,962.00	68,277,600
西華産業	6,900	1,486.00	10,253,400
佐藤商事	11,000	910.00	10,010,000
菱洋エレクトロ	12,400	1,538.00	19,071,200
東京産業	12,200	506.00	6,173,200
ユアサ商事	12,500	3,095.00	38,687,500
神鋼商事	2,700	2,455.00	6,628,500
小林産業	7,100	267.00	1,895,700
阪和興業	21,200	2,957.00	62,688,400
正栄食品工業	6,500	2,673.00	17,374,500
カナデン	11,800	1,205.00	14,219,000
菱電商事	9,700	1,398.00	13,560,600

ニプロ	85,800	1,391.00	119,347,800
フルサト工業	6,800	1,559.00	10,601,200
岩谷産業	27,000	3,720.00	100,440,000
すてきナイスグループ	5,100	900.00	4,590,000
昭光通商	4,400	630.00	2,772,000
ニチモウ	1,900	1,688.00	3,207,200
極東貿易	3,800	1,529.00	5,810,200
イワキ	14,600	402.00	5,869,200
兼松エレクトロニクス	6,600	3,165.00	20,889,000
三愛石油	32,700	1,016.00	33,223,200
稲畑産業	29,300	1,430.00	41,899,000
G S Iクレオス	3,200	1,294.00	4,140,800
明和産業	11,500	392.00	4,508,000
キムラタン	57,700	23.00	1,327,100
ゴールドウイン	11,000	10,570.00	116,270,000
ユニ・チャーム	262,800	3,374.00	886,687,200
デサント	29,600	1,842.00	54,523,200
キング	6,300	458.00	2,885,400
ワキタ	26,100	1,089.00	28,422,900
ヤマトインターナショナル	8,000	414.00	3,312,000
東邦ホールディングス	36,200	2,747.00	99,441,400
サンゲツ	36,900	2,074.00	76,530,600
ミツウロコグループホールディングス	17,700	779.00	13,788,300
シナネンホールディングス	5,100	2,334.00	11,903,400
伊藤忠エネクス	26,900	984.00	26,469,600
サンリオ	37,700	2,180.00	82,186,000
サンワテクノス	7,400	1,020.00	7,548,000
リョーサン	13,500	2,908.00	39,258,000
新光商事	11,500	1,713.00	19,699,500
トーヨー	5,600	2,163.00	12,112,800
三信電気	10,100	1,789.00	18,068,900
東陽テクニカ	14,100	805.00	11,350,500
モスフードサービス	16,100	2,767.00	44,548,700
加賀電子	12,200	1,977.00	24,119,400
三益半導体工業	9,600	1,260.00	12,096,000
ソーダニッカ	12,800	528.00	6,758,400
立花エレテック	9,100	1,595.00	14,514,500
木曽路	14,900	2,417.00	36,013,300
S R Sホールディングス	14,400	991.00	14,270,400
千趣会	22,100	254.00	5,613,400
タカキュー	9,300	175.00	1,627,500
ケーヨー	22,600	524.00	11,842,400
上新電機	14,400	2,432.00	35,020,800
日本瓦斯	19,800	3,900.00	77,220,000
ロイヤルホールディングス	21,600	2,598.00	56,116,800
東天紅	800	1,202.00	961,600
いなげや	13,700	1,379.00	18,892,300
島忠	27,600	3,090.00	85,284,000
チヨダ	12,800	1,760.00	22,528,000
ライフコーポレーション	9,300	2,408.00	22,394,400



リンガーハット	15,100	2,265.00	34,201,500
MrMaxHD	16,800	468.00	7,862,400
テンアライド	11,600	404.00	4,686,400
AOKIホールディングス	24,400	1,264.00	30,841,600
オークワ	17,400	1,045.00	18,183,000
コメリ	18,900	2,460.00	46,494,000
青山商事	21,300	2,662.00	56,700,600
しまむら	14,200	8,490.00	120,558,000
はせがわ	6,200	407.00	2,523,400
高島屋	95,700	1,474.00	141,061,800
松屋	24,500	1,008.00	24,696,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	62,700	1,609.00	100,884,300
近鉄百貨店	4,700	3,470.00	16,309,000
パルコ	11,800	1,072.00	12,649,600
丸井グループ	103,300	2,184.00	225,607,200
クレディセゾン	85,600	1,344.00	115,046,400
アクシアル リテイリング	10,100	3,610.00	36,461,000
井筒屋	6,500	202.00	1,313,000
イオン	469,800	2,100.50	986,814,900
イズミ	24,700	5,370.00	132,639,000
フォーバル	5,400	843.00	4,552,200
平和堂	24,700	2,529.00	62,466,300
フジ	14,700	1,912.00	28,106,400
ヤオコー	13,900	6,050.00	84,095,000
ゼビオホールディングス	14,700	1,265.00	18,595,500
ケーズホールディングス	126,800	1,070.00	135,676,000
PALTAC	22,000	5,070.00	111,540,000
三谷産業	14,500	281.00	4,074,500
Olympicグループ	7,200	658.00	4,737,600
日産東京販売ホールディングス	18,400	326.00	5,998,400
新生銀行	89,700	1,413.00	126,746,100
あおぞら銀行	68,200	3,315.00	226,083,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	8,513,900	564.60	4,806,947,940
りそなホールディングス	1,341,400	545.10	731,197,140
三井住友トラスト・ホールディングス	240,300	4,200.00	1,009,260,000
三井住友フィナンシャルグループ	861,600	3,818.00	3,289,588,800
千葉銀行	433,000	641.00	277,553,000
群馬銀行	244,400	469.00	114,623,600
武蔵野銀行	18,200	2,571.00	46,792,200
千葉興業銀行	33,600	365.00	12,264,000
筑波銀行	50,900	231.00	11,757,900
七十七銀行	38,300	1,990.00	76,217,000
青森銀行	9,500	2,793.00	26,533,500
秋田銀行	7,800	2,201.00	17,167,800
山形銀行	13,800	2,178.00	30,056,400
岩手銀行	8,600	3,435.00	29,541,000
東邦銀行	109,300	317.00	34,648,100
東北銀行	6,400	1,100.00	7,040,000
みちのく銀行	7,800	1,758.00	13,712,400
ふくおかフィナンシャルグループ	99,300	2,350.00	233,355,000

静岡銀行	307,600	880.00	270,688,000
十六銀行	16,400	2,349.00	38,523,600
スルガ銀行	125,000	433.00	54,125,000
八十二銀行	221,100	462.00	102,148,200
山梨中央銀行	15,200	1,427.00	21,690,400
大垣共立銀行	19,300	2,290.00	44,197,000
福井銀行	10,400	1,669.00	17,357,600
北國銀行	13,000	3,555.00	46,215,000
清水銀行	5,100	1,674.00	8,537,400
富山銀行	2,300	3,210.00	7,383,000
滋賀銀行	24,400	2,536.00	61,878,400
南都銀行	14,300	2,255.00	32,246,500
百五銀行	109,900	399.00	43,850,100
京都銀行	43,800	4,555.00	199,509,000
紀陽銀行	43,300	1,568.00	67,894,400
ほくほくフィナンシャルグループ	81,400	1,268.00	103,215,200
広島銀行	180,300	620.00	111,786,000
山陰合同銀行	72,500	782.00	56,695,000
中国銀行	78,900	972.00	76,690,800
鳥取銀行	4,300	1,427.00	6,136,100
伊予銀行	161,900	594.00	96,168,600
百十四銀行	13,000	2,672.00	34,736,000
四国銀行	17,500	1,133.00	19,827,500
阿波銀行	19,600	2,918.00	57,192,800
大分銀行	7,500	3,470.00	26,025,000
宮崎銀行	8,100	2,898.00	23,473,800
佐賀銀行	7,400	1,795.00	13,283,000
十八銀行	7,500	2,586.00	19,395,000
沖縄銀行	11,200	3,275.00	36,680,000
琉球銀行	28,200	1,138.00	32,091,600
セブン銀行	412,900	318.00	131,302,200
みずほフィナンシャルグループ	16,611,800	174.10	2,892,114,380
高知銀行	4,500	775.00	3,487,500
山口フィナンシャルグループ	152,600	1,095.00	167,097,000
芙蓉総合リース	14,000	5,560.00	77,840,000
興銀リース	22,900	2,429.00	55,624,100
東京センチュリー	24,600	4,810.00	118,326,000
SBIホールディングス	145,700	2,222.00	323,745,400
日本証券金融	53,800	568.00	30,558,400
アイフル	186,300	266.00	49,555,800
日本アジア投資	10,600	190.00	2,014,000
長野銀行	4,100	1,706.00	6,994,600
名古屋銀行	9,900	3,320.00	32,868,000
北洋銀行	184,100	296.00	54,493,600
愛知銀行	4,400	3,770.00	16,588,000
中京銀行	5,100	2,149.00	10,959,900
大光銀行	4,000	1,819.00	7,276,000
愛媛銀行	17,100	1,078.00	18,433,800
トマト銀行	4,800	1,097.00	5,265,600
京葉銀行	53,900	703.00	37,891,700

栃木銀行	63,300	246.00	15,571,800
北日本銀行	3,900	2,264.00	8,829,600
東和銀行	21,400	776.00	16,606,400
福島銀行	10,600	398.00	4,218,800
大東銀行	5,900	621.00	3,663,900
リコーリース	9,600	3,300.00	31,680,000
イオンフィナンシャルサービス	78,000	2,018.00	157,404,000
アコム	245,700	373.00	91,646,100
ジャックス	13,500	1,855.00	25,042,500
オリエントコーポレーション	330,400	131.00	43,282,400
日立キャピタル	28,900	2,367.00	68,406,300
アプラスフィナンシャル	59,300	81.00	4,803,300
オリックス	815,700	1,667.00	1,359,771,900
三菱UFJリース	275,900	545.00	150,365,500
ジャフコ	20,000	3,610.00	72,200,000
九州リースサービス	6,000	683.00	4,098,000
トモニホールディングス	94,400	405.00	38,232,000
大和証券グループ本社	980,900	584.10	572,943,690
野村ホールディングス	2,243,400	437.90	982,384,860
岡三証券グループ	104,100	518.00	53,923,800
丸三証券	36,300	791.00	28,713,300
東洋証券	43,800	178.00	7,796,400
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	145,800	485.00	70,713,000
光世証券	2,900	747.00	2,166,300
水戸証券	35,500	264.00	9,372,000
いちよし証券	25,700	840.00	21,588,000
松井証券	59,900	1,177.00	70,502,300
SOMPOホールディングス	215,500	3,825.00	824,287,500
だいこう証券ビジネス	5,100	389.00	1,983,900
日本取引所グループ	330,100	1,824.00	602,102,400
マネックスグループ	114,100	385.00	43,928,500
カブドットコム証券	91,300	383.00	34,967,900
極東証券	16,400	1,197.00	19,630,800
岩井コスモホールディングス	12,500	1,202.00	15,025,000
藍澤証券	22,900	625.00	14,312,500
フィデアホールディングス	119,000	136.00	16,184,000
池田泉州ホールディングス	129,800	306.00	39,718,800
アニコムホールディングス	9,500	3,700.00	35,150,000
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	319,700	3,206.00	1,024,958,200
ソニーフィナンシャルホールディングス	100,400	2,063.00	207,125,200
マネーパートナーズグループ	14,300	288.00	4,118,400
小林洋行	3,400	251.00	853,400
第一生命ホールディングス	691,600	1,734.50	1,199,580,200
東京海上ホールディングス	443,200	5,185.00	2,297,992,000
アドバンテッジリスクマネジメント	4,600	866.00	3,983,600
イー・ギャランティ	11,400	991.00	11,297,400
アサックス	4,900	542.00	2,655,800

NECキャピタルソリューション	5,100	1,586.00	8,088,600
T&Dホールディングス	378,000	1,342.00	507,276,000
アドバンスクリエイト	2,800	1,775.00	4,970,000
三井不動産	648,700	2,540.00	1,647,698,000
三菱地所	856,500	1,817.00	1,556,260,500
平和不動産	23,200	1,819.00	42,200,800
東京建物	133,500	1,160.00	154,860,000
ダイビル	36,000	1,062.00	38,232,000
京阪神ビルディング	21,900	878.00	19,228,200
住友不動産	274,700	4,065.00	1,116,655,500
太平洋興発	4,900	768.00	3,763,200
テオーシー	28,000	776.00	21,728,000
東京楽天地	1,900	4,810.00	9,139,000
レオパレス21	150,800	475.00	71,630,000
スターツコーポレーション	16,600	2,395.00	39,757,000
フジ住宅	15,600	822.00	12,823,200
空港施設	14,500	527.00	7,641,500
明和地所	6,800	590.00	4,012,000
ゴールドクレスト	9,600	1,625.00	15,600,000
リログループ	64,700	2,742.00	177,407,400
日本エスリード	4,700	1,465.00	6,885,500
日神不動産	18,000	455.00	8,190,000
日本エスコン	22,100	744.00	16,442,400
タカラレーベン	57,200	317.00	18,132,400
サンヨーハウジング名古屋	6,900	957.00	6,603,300
イオンモール	61,200	1,765.00	108,018,000
ファースト住建	4,600	1,196.00	5,501,600
ランド	497,600	9.00	4,478,400
カチタス	13,600	2,814.00	38,270,400
東祥	7,300	3,165.00	23,104,500
トーセイ	16,800	981.00	16,480,800
穴吹興産	1,300	2,770.00	3,601,000
サンフロンティア不動産	16,900	1,090.00	18,421,000
エフ・ジェー・ネクスト	10,600	885.00	9,381,000
インテリックス	3,500	654.00	2,289,000
ランドビジネス	6,300	782.00	4,926,600
グランディハウス	10,700	399.00	4,269,300
東武鉄道	130,700	3,080.00	402,556,000
相鉄ホールディングス	42,600	3,370.00	143,562,000
東京急行電鉄	336,700	1,858.00	625,588,600
京浜急行電鉄	169,800	1,823.00	309,545,400
小田急電鉄	198,600	2,530.00	502,458,000
京王電鉄	69,300	6,420.00	444,906,000
京成電鉄	92,900	3,505.00	325,614,500
富士急行	16,900	3,190.00	53,911,000
新京成電鉄	3,100	2,162.00	6,702,200
東日本旅客鉄道	220,400	9,945.00	2,191,878,000
西日本旅客鉄道	111,100	8,010.00	889,911,000
東海旅客鉄道	111,000	23,790.00	2,640,690,000
西武ホールディングス	157,900	1,948.00	307,589,200

鴻池運輸	19,800	1,605.00	31,779,000
西日本鉄道	34,300	2,830.00	97,069,000
ハマキョウレックス	9,500	3,710.00	35,245,000
サカイ引越センター	6,600	5,960.00	39,336,000
近鉄グループホールディングス	117,300	4,905.00	575,356,500
阪急阪神ホールディングス	156,600	3,820.00	598,212,000
南海電気鉄道	52,400	2,987.00	156,518,800
京阪ホールディングス	52,300	4,640.00	242,672,000
神戸電鉄	3,000	3,940.00	11,820,000
名古屋鉄道	94,000	2,894.00	272,036,000
山陽電気鉄道	9,100	2,149.00	19,555,900
トランコム	3,300	5,630.00	18,579,000
日本通運	46,100	6,190.00	285,359,000
ヤマトホールディングス	205,800	2,996.00	616,576,800
山九	32,600	5,130.00	167,238,000
日新	10,100	1,836.00	18,543,600
丸運	6,300	291.00	1,833,300
丸全昭和運輸	9,500	2,616.00	24,852,000
センコーグループホールディングス	64,700	853.00	55,189,100
トナミホールディングス	2,800	5,780.00	16,184,000
ニッコンホールディングス	44,600	2,723.00	121,445,800
日本石油輸送	1,400	2,837.00	3,971,800
福山通運	15,100	4,365.00	65,911,500
セイノーホールディングス	87,900	1,466.00	128,861,400
エスライン	3,100	1,057.00	3,276,700
神奈川中央交通	2,900	3,685.00	10,686,500
日立物流	25,900	3,155.00	81,714,500
丸和運輸機関	6,200	2,816.00	17,459,200
C & F ロジホールディングス	12,000	1,196.00	14,352,000
日本郵船	98,100	1,790.00	175,599,000
商船三井	69,700	2,550.00	177,735,000
川崎汽船	36,200	1,435.00	51,947,000
NSユナイテッド海運	6,500	2,989.00	19,428,500
明治海運	12,200	333.00	4,062,600
飯野海運	55,600	403.00	22,406,800
共栄タンカー	800	1,554.00	1,243,200
九州旅客鉄道	98,600	3,715.00	366,299,000
S Gホールディングス	110,900	2,998.00	332,478,200
日本航空	214,900	3,925.00	843,482,500
ANAホールディングス	214,600	3,921.00	841,446,600
パスコ	2,300	746.00	1,715,800
西本Wismettacホールディングス	2,800	4,415.00	12,362,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	900	1,173.00	1,055,700
Genky DrugStores	4,700	3,005.00	14,123,500
国際紙パルプ商事	21,400	242.00	5,178,800
総合メディカルホールディングス	10,600	2,006.00	21,263,600
ブックオフグループホールディングス	6,500	758.00	4,927,000
三菱倉庫	40,600	2,709.00	109,985,400
三井倉庫ホールディングス	14,400	1,860.00	26,784,000

住友倉庫	44,100	1,387.00	61,166,700
澁澤倉庫	6,600	1,568.00	10,348,800
ヤマタネ	6,200	1,646.00	10,205,200
東陽倉庫	20,700	284.00	5,878,800
乾汽船	10,500	740.00	7,770,000
日本トランスシティ	26,000	444.00	11,544,000
ケイヒン	2,200	1,249.00	2,747,800
中央倉庫	7,000	1,024.00	7,168,000
川西倉庫	2,300	1,245.00	2,863,500
安田倉庫	9,800	780.00	7,644,000
東洋埠頭	3,300	1,454.00	4,798,200
宇徳	10,200	534.00	5,446,800
上組	72,500	2,274.00	164,865,000
サンリツ	2,900	641.00	1,858,900
キムラユニティー	3,200	991.00	3,171,200
キューソー流通システム	3,000	1,989.00	5,967,000
近鉄エクスプレス	22,200	1,615.00	35,853,000
東海運	6,400	289.00	1,849,600
エーアイティー	7,600	973.00	7,394,800
内外トランスライン	3,800	1,360.00	5,168,000
日本コンセプト	3,200	984.00	3,148,800
東京放送ホールディングス	80,600	1,788.00	144,112,800
日本テレビホールディングス	111,600	1,701.00	189,831,600
朝日放送グループホールディングス	12,200	724.00	8,832,800
テレビ朝日ホールディングス	33,400	2,079.00	69,438,600
スカパーJ S A Tホールディングス	92,900	479.00	44,499,100
テレビ東京ホールディングス	10,000	2,377.00	23,770,000
日本BS放送	4,200	1,096.00	4,603,200
ビジョン	3,800	3,920.00	14,896,000
USEN-NEXT HOLDINGS	4,600	985.00	4,531,000
ワイヤレスゲート	5,400	424.00	2,289,600
コネクシオ	8,700	1,375.00	11,962,500
日本通信	103,600	107.00	11,085,200
クロップス	2,300	632.00	1,453,600
日本電信電話	831,800	4,585.00	3,813,803,000
KDDI	1,071,800	2,665.00	2,856,347,000
光通信	14,300	17,290.00	247,247,000
NTTドコモ	873,300	2,575.00	2,248,747,500
エムティーアイ	14,200	551.00	7,824,200
GMOインターネット	44,200	1,453.00	64,222,600
アйдママーケティングコミュニケーション	2,500	458.00	1,145,000
カドカワ	35,500	1,153.00	40,931,500
学研ホールディングス	4,100	4,025.00	16,502,500
ゼンリン	24,200	2,384.00	57,692,800
昭文社	5,500	495.00	2,722,500
インプレスホールディングス	9,800	138.00	1,352,400
東京電力ホールディングス	989,400	741.00	733,145,400
中部電力	379,200	1,760.00	667,392,000

関西電力	505,800	1,782.50	901,588,500
中国電力	171,300	1,506.00	257,977,800
北陸電力	121,300	1,020.00	123,726,000
東北電力	290,300	1,552.00	450,545,600
四国電力	111,600	1,405.00	156,798,000
九州電力	255,500	1,379.00	352,334,500
北海道電力	116,000	777.00	90,132,000
沖縄電力	22,900	2,167.00	49,624,300
電源開発	98,700	2,740.00	270,438,000
エフオン	7,400	864.00	6,393,600
イーレックス	21,500	604.00	12,986,000
レノバ	12,800	1,033.00	13,222,400
東京瓦斯	243,100	2,923.00	710,581,300
大阪瓦斯	240,400	2,159.00	519,023,600
東邦瓦斯	61,300	4,830.00	296,079,000
北海道瓦斯	6,700	1,523.00	10,204,100
広島ガス	25,800	345.00	8,901,000
西部瓦斯	14,000	2,577.00	36,078,000
静岡ガス	38,100	902.00	34,366,200
メタウォーター	6,000	3,010.00	18,060,000
アイネット	6,900	1,433.00	9,887,700
松竹	8,000	9,980.00	79,840,000
東宝	80,000	4,035.00	322,800,000
エイチ・アイ・エス	21,100	3,975.00	83,872,500
東映	5,200	13,360.00	69,472,000
ラックランド	2,300	2,080.00	4,784,000
エヌ・ティ・ティ・データ	323,900	1,246.00	403,579,400
共立メンテナンス	18,000	4,690.00	84,420,000
イチネンホールディングス	12,400	1,159.00	14,371,600
建設技術研究所	8,100	1,538.00	12,457,800
スペース	7,700	1,202.00	9,255,400
長 大	4,700	702.00	3,299,400
アインホールディングス	16,400	7,880.00	129,232,000
燦ホールディングス	2,600	2,333.00	6,065,800
ピー・シー・エー	1,600	1,886.00	3,017,600
スバル興業	700	5,440.00	3,808,000
東京テアトル	4,600	1,235.00	5,681,000
タナベ経営	2,300	1,255.00	2,886,500
ビジネスブレイン太田昭和	2,100	1,910.00	4,011,000
ナガワ	3,300	5,570.00	18,381,000
よみうりランド	2,600	3,935.00	10,231,000
東京都競馬	7,700	2,695.00	20,751,500
常磐興産	4,800	1,589.00	7,627,200
カナモト	17,600	2,924.00	51,462,400
東京ドーム	44,200	934.00	41,282,800
D T S	13,600	3,595.00	48,892,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	56,600	3,205.00	181,403,000
シーイーシー	13,000	1,746.00	22,698,000
カプコン	52,100	2,144.00	111,702,400

西尾レントオール	12,100	3,375.00	40,837,500
アイ・エス・ビー	2,400	1,664.00	3,993,600
アゴーラ・ホスピタリティー・グループ	63,600	25.00	1,590,000
日本空港ビルデング	39,000	3,735.00	145,665,000
トランス・コスモス	13,100	2,206.00	28,898,600
乃村工藝社	27,600	2,725.00	75,210,000
ジャステック	7,100	927.00	6,581,700
S C S K	32,100	4,055.00	130,165,500
藤田観光	4,700	2,834.00	13,319,800
K N T - C Tホールディングス	6,400	1,251.00	8,006,400
日本管財	12,700	1,931.00	24,523,700
トーカイ	11,400	2,750.00	31,350,000
白洋舎	1,300	2,878.00	3,741,400
セコム	125,700	9,232.00	1,160,462,400
日本システムウエア	4,000	1,749.00	6,996,000
セントラル警備保障	5,700	4,585.00	26,134,500
アイネス	15,400	1,178.00	18,141,200
丹青社	22,400	1,080.00	24,192,000
メイテック	14,900	4,630.00	68,987,000
T K C	10,200	4,000.00	40,800,000
富士ソフト	18,200	4,345.00	79,079,000
応用地質	12,700	1,175.00	14,922,500
船井総研ホールディングス	24,500	1,673.00	40,988,500
N S D	19,900	2,132.00	42,426,800
進学会ホールディングス	5,300	548.00	2,904,400
丸紅建材リース	1,100	1,839.00	2,022,900
オオバ	9,400	591.00	5,555,400
コナミホールディングス	49,800	4,880.00	243,024,000
いであ	2,300	975.00	2,242,500
学究社	4,000	1,451.00	5,804,000
ベネッセホールディングス	43,400	2,741.00	118,959,400
イオンディライト	14,500	3,945.00	57,202,500
ナック	7,500	1,035.00	7,762,500
福井コンピュータホールディングス	4,000	1,562.00	6,248,000
ニチイ学館	16,900	1,012.00	17,102,800
ダイセキ	19,800	2,312.00	45,777,600
ステップ	4,400	1,275.00	5,610,000
日鉄住金物産	8,800	4,585.00	40,348,000
泉州電業	4,100	2,830.00	11,603,000
元気寿司	3,400	4,325.00	14,705,000
トラスコ中山	25,400	2,902.00	73,710,800
ヤマダ電機	371,700	535.00	198,859,500
オートバックスセブン	48,500	1,848.00	89,628,000
モリト	9,000	784.00	7,056,000
アークランドサカモト	20,700	1,337.00	27,675,900
ニトリホールディングス	52,900	14,720.00	778,688,000
グルメ杵屋	8,900	1,153.00	10,261,700
愛眼	9,800	296.00	2,900,800
ケーユーホールディングス	6,300	821.00	5,172,300



吉野家ホールディングス	42,700	1,710.00	73,017,000
加藤産業	19,100	3,135.00	59,878,500
北恵	2,300	1,003.00	2,306,900
イノテック	8,400	989.00	8,307,600
イエローハット	11,500	2,572.00	29,578,000
松屋フーズホールディングス	5,900	3,550.00	20,945,000
JBC Cホールディングス	9,600	1,455.00	13,968,000
J Kホールディングス	11,200	559.00	6,260,800
サガミホールディングス	16,400	1,354.00	22,205,600
日伝	10,100	1,592.00	16,079,200
関西スーパーマーケット	9,300	1,014.00	9,430,200
ミロク情報サービス	12,100	2,419.00	29,269,900
北沢産業	9,300	259.00	2,408,700
杉本商事	6,700	1,754.00	11,751,800
因幡電機産業	17,300	4,265.00	73,784,500
王将フードサービス	9,000	7,120.00	64,080,000
プレナス	13,700	1,847.00	25,303,900
ミニストップ	9,100	2,001.00	18,209,100
アークス	22,900	2,503.00	57,318,700
パローホールディングス	26,400	2,615.00	69,036,000
バイテックホールディングス	5,500	1,788.00	9,834,000
東テク	4,100	1,967.00	8,064,700
ミスミグループ本社	152,800	2,418.00	369,470,400
藤久	900	789.00	710,100
アルテック	8,800	246.00	2,164,800
ベルク	6,000	4,895.00	29,370,000
大 庄	6,600	1,564.00	10,322,400
タキヒヨー	3,800	1,706.00	6,482,800
ファーストリテイリング	16,400	55,280.00	906,592,000
ソフトバンクグループ	508,300	7,698.00	3,912,893,400
蔵王産業	2,100	1,301.00	2,732,100
スズケン	55,700	5,810.00	323,617,000
サンドラッグ	45,900	3,445.00	158,125,500
サックスパー ホールディングス	10,300	1,088.00	11,206,400
ジェコス	8,600	1,023.00	8,797,800
ヤマザワ	2,400	1,776.00	4,262,400
やまや	2,100	2,137.00	4,487,700
ルネサスイーストン	11,300	403.00	4,553,900
ベルーナ	29,900	976.00	29,182,400
合計	142,775,657		268,142,003,270

\*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1月11日現在	平成31年1月11日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		1,225,455,365	4,665,269,969
国債証券		303,128,208,700	249,079,246,900
地方債証券		22,902,738,657	22,258,855,068
特殊債券		15,780,383,842	18,733,640,508
社債券		16,879,127,400	14,924,593,070
未収入金		1,447,832,100	-
未収利息		770,154,466	582,607,024
前払費用		8,463,736	30,975,267
流動資産合計		362,142,364,266	310,275,187,806
資産合計		362,142,364,266	310,275,187,806
負債の部			
流動負債			
未払解約金		315,300,000	4,426,743,000
流動負債合計		315,300,000	4,426,743,000
負債合計		315,300,000	4,426,743,000
純資産の部			
元本等			
元本	1	282,148,441,520	235,499,717,802
剰余金			
剰余金又は欠損金( )		79,678,622,746	70,348,727,004
元本等合計		361,827,064,266	305,848,444,806
純資産合計		361,827,064,266	305,848,444,806
負債純資産合計		362,142,364,266	310,275,187,806

## 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1月11日現在	平成31年1月11日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額 同期中追加設定元本額 同期中一部解約元本額	291,230,539,663円 34,677,166,570円 43,759,264,713円	282,148,441,520円 107,335,270,578円 153,983,994,296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	14,044,050,293円	17,996,235,320円
M I T O ラップ型ファンド（安定型）	137,430,777円	108,081,600円
M I T O ラップ型ファンド（中立型）	112,114,796円	82,802,762円
M I T O ラップ型ファンド（積極型）	34,436,660円	25,181,286円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	583,451,400円	810,160,816円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	159,609,573円	227,772,315円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	25,188,228円	30,531,946円
たわらノーロード 国内債券	2,792,034,873円	5,300,114,866円
たわらノーロード 国内債券<ラップ向け>	754,493円	- 円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	19,455,389円	170,314,416円
たわらノーロード バランス（堅実型）	1,243,754円	43,778,367円
たわらノーロード バランス（標準型）	2,399,845円	79,403,926円
たわらノーロード バランス（積極型）	826,692円	13,097,187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）	440,066円	5,342,959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）	234,451円	97,570,005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）	164,351円	128,691,152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)	90,351円	33,191,904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)	19,472円	18,064,952円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(保守型)	- 円	1,862,270円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定型)	- 円	1,270,410円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定成長型)	- 円	3,572,067円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(成長型)	- 円	613,753円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(積極型)	- 円	17,517円
D I A M国内債券インデックス ファンド< D C年金>	12,427,315,535円	12,967,075,063円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 1 安定型	5,528,653,854円	5,919,885,310円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 2 安定・成長型	7,985,672,600円	8,202,301,648円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 3 成長型	3,263,681,041円	3,408,620,510円
D I A M D C バランス3 0 インデックスファンド	1,826,494,969円	1,805,683,819円
D I A M D C バランス5 0 インデックスファンド	2,010,449,233円	1,999,358,879円
D I A M D C バランス7 0 インデックスファンド	309,647,783円	316,274,220円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型>	89,820,576円	87,494,470円
マネックス資産設計ファンド< 育成型>	2,234,726,830円	2,320,757,716円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	2,224,336円	2,827,451円
D I A M D C 8 資産 balan スファンド(新興国1 0)	470,102,235円	3,136,906,696円
D I A M D C 8 資産 balan スファンド(新興国2 0)	421,003,073円	750,943,777円
D I A M D C 8 資産 balan スファンド(新興国3 0)	99,634,072円	161,069,244円
投資のソムリエ	5,412,751,268円	4,610,531,799円
クルーズコントロール	4,127,957,852円	397,524,317円
投資のソムリエ< D C年金>	343,120,269円	420,762,180円
D I A M 8 資産 バランスファ ンドN< D C年金>	1,785,743,778円	2,285,488,089円
D I A M D C バランス・F (成長型)	228,300,610円	281,787,055円
クルーズコントロール< D C年 金>	1,441,246円	255,346円
D I A Mコア資産設計ファンド (堅実型)	9,543,074円	1,255,528円
D I A Mコア資産設計ファンド (積極型)	21,666,572円	2,413,600円

投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	296,996,808円	451,953,189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	559,152円	1,704,726円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	4,119,995,045円	7,797,597,987円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	721,386円	1,679,916円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	721,391円	1,314,061円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	1,382,114円	2,812,984円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	708,794円	2,675,959円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	-円	73,934,208円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	-円	1,592,435,784円
DIAM高金利通貨ファンド	-円	290,676円
DIAMエマージング債券ファンド	9,608,918円	-円
DIAM国内債券パッシブファンド(適格機関投資家向け)	9,450,010円	9,450,010円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	22,732,301,633円	22,700,190,772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)	502,918,166円	423,862,810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)	356,392,042円	260,162,439円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	260,572,513円	205,011,654円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	82,170,787円	65,148,400円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	236,417,399円	177,679,515円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	107,172,904円	77,562,193円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	71,047,134円	33,341,168円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	107,073,029円	84,548,966円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	190,740,120円	153,438,009円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	6,327,385,858円	5,165,098,735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)	3,384,413,398円	2,708,406,989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)	6,106,252,901円	4,973,738,654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)	652,541,797円	531,889,925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)	553,747,291円	243,809,467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)	3,945,456,574円	3,132,650,273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)	4,127,295,962円	688,618,271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	194,752,933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)	322,047,228円	42,590,827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)	2,383,950,442円	75,249,648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)	88,035,522,422円	47,134,774,807円
D I A M世界アセットバランス ファンド40 V A (適格機関投 資家限定)	1,178,525,546円	346,165,294円
D I A M世界アセットバランス ファンド25 V A (適格機関投 資家限定)	7,559,824,166円	6,693,326,830円
D I A M世界アセットバランス ファンド3 V A (適格機関投資 家限定)	28,649,485,500円	25,584,090,821円
D I A Mバランス30 V A (適 格機関投資家限定)	8,960,230円	74,330,112円
D I A Mバランス50 V A (適 格機関投資家限定)	48,915,437円	529,804円
D I A Mバランス70 V A (適 格機関投資家限定)	7,941,011円	7,143,275円
D I A M世界アセットバランス ファンド4 V A (適格機関投資 家限定)	31,857,319,666円	28,504,043,744円
D I A M世界バランス25 V A (適格機関投資家限定)	509,422,227円	405,780,698円
D I A M国内バランス30 V A (適格機関投資家限定)	139,681,767円	123,848,735円
D I A Mバランス20 V A (適 格機関投資家限定)	513,354,007円	494,147,950円



	D I A Mバランス40VA(適 格機関投資家限定)	40,409,042円	685,633円
	D I A Mバランス60VA(適 格機関投資家限定)	390,500円	360,438円
	計	282,148,441,520円	235,499,717,802円
2.	受益権の総数	282,148,441,520口	235,499,717,802口

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成29年6月23日 至 平成30年1月11日	自 平成30年1月12日 至 平成31年1月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成30年1月11日現在	平成31年1月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	平成30年1月11日現在	平成31年1月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
国債証券	117,176,300	1,160,223,000
地方債証券	147,619,176	92,342,197
特殊債券	114,681,960	29,125,983
社債券	133,148,070	97,189,180
合計	512,625,506	941,565,640

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成29年2月15日から平成30年1月11日まで及び平成30年2月15日から平成31年1月11日まで）に対応する金額であります。

## （デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （1口当たり情報に関する注記）

	平成30年1月11日現在	平成31年1月11日現在
1口当たり純資産額	1.2824円	1.2987円
（1万口当たり純資産額）	（12,824円）	（12,987円）

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

平成31年1月11日現在

種 類	銘 柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
国債証券	387回 利付国庫債券(2年)	1,000,000,000	1,003,240,000	
	388回 利付国庫債券(2年)	800,000,000	802,768,000	
	390回 利付国庫債券(2年)	1,200,000,000	1,204,548,000	
	391回 利付国庫債券(2年)	1,400,000,000	1,405,726,000	
	392回 利付国庫債券(2年)	800,000,000	803,392,000	
	393回 利付国庫債券(2年)	1,000,000,000	1,004,450,000	
	394回 利付国庫債券(2年)	700,000,000	703,206,000	
	123回 利付国庫債券(5年)	3,000,000,000	3,009,180,000	
	124回 利付国庫債券(5年)	2,200,000,000	2,208,162,000	
	125回 利付国庫債券(5年)	3,000,000,000	3,013,110,000	
	126回 利付国庫債券(5年)	2,500,000,000	2,512,575,000	
	127回 利付国庫債券(5年)	1,220,000,000	1,226,917,400	
	128回 利付国庫債券(5年)	2,200,000,000	2,213,926,000	
	129回 利付国庫債券(5年)	2,420,000,000	2,436,915,800	
	130回 利付国庫債券(5年)	2,500,000,000	2,519,125,000	
	131回 利付国庫債券(5年)	2,020,000,000	2,036,422,600	
	132回 利付国庫債券(5年)	2,000,000,000	2,017,560,000	
	133回 利付国庫債券(5年)	1,170,000,000	1,181,033,100	
	134回 利付国庫債券(5年)	1,190,000,000	1,201,983,300	
	135回 利付国庫債券(5年)	2,100,000,000	2,122,491,000	
	136回 利付国庫債券(5年)	1,700,000,000	1,719,312,000	
	137回 利付国庫債券(5年)	1,400,000,000	1,416,492,000	
	2回 利付国庫債券(40年)	460,000,000	648,043,400	
	3回 利付国庫債券(40年)	490,000,000	694,075,200	
	4回 利付国庫債券(40年)	640,000,000	911,244,800	
	5回 利付国庫債券(40年)	580,000,000	795,852,800	
	6回 利付国庫債券(40年)	700,000,000	943,355,000	
	7回 利付国庫債券(40年)	750,000,000	968,520,000	
	8回 利付国庫債券(40年)	720,000,000	864,230,400	
	9回 利付国庫債券(40年)	1,100,000,000	966,988,000	
	10回 利付国庫債券(40年)	1,050,000,000	1,090,267,500	
	11回 利付国庫債券(40年)	370,000,000	371,106,300	
	306回 利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,527,540,000	
	308回 利付国庫債券(10年)	800,000,000	816,704,000	
	309回 利付国庫債券(10年)	1,000,000,000	1,018,020,000	
	310回 利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,529,160,000	
	311回 利付国庫債券(10年)	1,020,000,000	1,036,401,600	
	312回 利付国庫債券(10年)	2,200,000,000	2,257,662,000	
	313回 利付国庫債券(10年)	1,790,000,000	1,846,832,500	
	314回 利付国庫債券(10年)	800,000,000	821,912,000	

315回	利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,549,320,000
316回	利付国庫債券(10年)	500,000,000	515,225,000
317回	利付国庫債券(10年)	1,000,000,000	1,033,620,000
318回	利付国庫債券(10年)	1,600,000,000	1,649,488,000
319回	利付国庫債券(10年)	800,000,000	829,416,000
320回	利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,550,730,000
321回	利付国庫債券(10年)	1,600,000,000	1,658,704,000
322回	利付国庫債券(10年)	1,000,000,000	1,033,500,000
323回	利付国庫債券(10年)	750,000,000	777,127,500
324回	利付国庫債券(10年)	850,000,000	877,812,000
325回	利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,552,710,000
326回	利付国庫債券(10年)	500,000,000	516,795,000
327回	利付国庫債券(10年)	1,450,000,000	1,504,433,000
328回	利付国庫債券(10年)	2,390,000,000	2,465,308,900
329回	利付国庫債券(10年)	2,270,000,000	2,366,111,800
330回	利付国庫債券(10年)	1,450,000,000	1,514,902,000
331回	利付国庫債券(10年)	650,000,000	672,971,000
332回	利付国庫債券(10年)	2,460,000,000	2,551,610,400
333回	利付国庫債券(10年)	2,500,000,000	2,597,775,000
334回	利付国庫債券(10年)	2,120,000,000	2,206,983,600
335回	利付国庫債券(10年)	1,950,000,000	2,022,598,500
336回	利付国庫債券(10年)	850,000,000	883,048,000
337回	利付国庫債券(10年)	1,610,000,000	1,653,325,100
338回	利付国庫債券(10年)	2,000,000,000	2,068,560,000
339回	利付国庫債券(10年)	2,440,000,000	2,527,083,600
340回	利付国庫債券(10年)	3,100,000,000	3,215,010,000
341回	利付国庫債券(10年)	3,060,000,000	3,156,390,000
342回	利付国庫債券(10年)	3,000,000,000	3,054,390,000
343回	利付国庫債券(10年)	3,000,000,000	3,054,030,000
344回	利付国庫債券(10年)	2,200,000,000	2,238,368,000
345回	利付国庫債券(10年)	2,610,000,000	2,653,821,900
346回	利付国庫債券(10年)	2,370,000,000	2,408,062,200
347回	利付国庫債券(10年)	2,000,000,000	2,030,540,000
348回	利付国庫債券(10年)	2,230,000,000	2,262,112,000
349回	利付国庫債券(10年)	2,610,000,000	2,645,104,500
350回	利付国庫債券(10年)	3,400,000,000	3,442,228,000
351回	利付国庫債券(10年)	2,360,000,000	2,386,738,800
352回	利付国庫債券(10年)	1,900,000,000	1,919,304,000
1回	利付国庫債券(30年)	100,000,000	129,006,000
2回	利付国庫債券(30年)	100,000,000	125,729,000
3回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	249,906,000
4回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	265,564,000
5回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	250,442,000
6回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	256,878,000
7回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	383,616,000
8回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	243,458,000
11回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	241,390,000
12回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	379,929,000
13回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	376,095,000
14回	利付国庫債券(30年)	290,000,000	381,437,000

15回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	266,844,000	
16回	利付国庫債券(30年)	400,000,000	534,580,000	
17回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	264,856,000	
18回	利付国庫債券(30年)	420,000,000	550,855,200	
19回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	262,828,000	
20回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	404,517,000	
21回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	395,388,000	
22回	利付国庫債券(30年)	470,000,000	636,290,700	
23回	利付国庫債券(30年)	200,000,000	271,298,000	
24回	利付国庫債券(30年)	300,000,000	407,724,000	
25回	利付国庫債券(30年)	400,000,000	530,688,000	
26回	利付国庫債券(30年)	700,000,000	942,795,000	
27回	利付国庫債券(30年)	700,000,000	958,825,000	
28回	利付国庫債券(30年)	680,000,000	935,149,600	
29回	利付国庫債券(30年)	900,000,000	1,225,026,000	
30回	利付国庫債券(30年)	960,000,000	1,293,273,600	
31回	利付国庫債券(30年)	900,000,000	1,199,106,000	
32回	利付国庫債券(30年)	960,000,000	1,303,353,600	
33回	利付国庫債券(30年)	1,070,000,000	1,392,091,400	
34回	利付国庫債券(30年)	1,040,000,000	1,399,912,800	
35回	利付国庫債券(30年)	960,000,000	1,255,872,000	
36回	利付国庫債券(30年)	1,050,000,000	1,377,106,500	
37回	利付国庫債券(30年)	1,250,000,000	1,615,387,500	
38回	利付国庫債券(30年)	720,000,000	915,948,000	
39回	利付国庫債券(30年)	630,000,000	816,662,700	
40回	利付国庫債券(30年)	650,000,000	829,257,000	
41回	利付国庫債券(30年)	680,000,000	852,366,400	
42回	利付国庫債券(30年)	680,000,000	852,924,000	
43回	利付国庫債券(30年)	700,000,000	878,591,000	
44回	利付国庫債券(30年)	610,000,000	766,983,500	
45回	利付国庫債券(30年)	700,000,000	847,056,000	
46回	利付国庫債券(30年)	800,000,000	968,352,000	
47回	利付国庫債券(30年)	760,000,000	938,706,400	
48回	利付国庫債券(30年)	940,000,000	1,115,507,400	
49回	利付国庫債券(30年)	790,000,000	937,595,700	
50回	利付国庫債券(30年)	760,000,000	788,142,800	
51回	利付国庫債券(30年)	930,000,000	847,323,000	
52回	利付国庫債券(30年)	910,000,000	873,873,000	
53回	利付国庫債券(30年)	900,000,000	886,212,000	
54回	利付国庫債券(30年)	900,000,000	931,032,000	
55回	利付国庫債券(30年)	740,000,000	764,797,400	
56回	利付国庫債券(30年)	900,000,000	929,259,000	
57回	利付国庫債券(30年)	760,000,000	783,940,000	
58回	利付国庫債券(30年)	1,010,000,000	1,040,764,600	
59回	利付国庫債券(30年)	800,000,000	802,936,000	
60回	利付国庫債券(30年)	500,000,000	527,815,000	
46回	利付国庫債券(20年)	500,000,000	516,945,000	
47回	利付国庫債券(20年)	250,000,000	259,927,500	
48回	利付国庫債券(20年)	500,000,000	525,715,000	
51回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	631,458,000	

52回	利付国庫債券(20年)	550,000,000	583,324,500	
55回	利付国庫債券(20年)	410,000,000	438,076,800	
58回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	645,384,000	
60回	利付国庫債券(20年)	590,000,000	626,013,600	
61回	利付国庫債券(20年)	500,000,000	524,045,000	
64回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	657,804,000	
72回	利付国庫債券(20年)	350,000,000	394,996,000	
73回	利付国庫債券(20年)	340,000,000	383,611,800	
75回	利付国庫債券(20年)	440,000,000	501,547,200	
78回	利付国庫債券(20年)	640,000,000	724,908,800	
81回	利付国庫債券(20年)	240,000,000	274,720,800	
83回	利付国庫債券(20年)	780,000,000	902,553,600	
85回	利付国庫債券(20年)	440,000,000	511,434,000	
88回	利付国庫債券(20年)	750,000,000	886,680,000	
90回	利付国庫債券(20年)	700,000,000	825,552,000	
92回	利付国庫債券(20年)	1,300,000,000	1,529,177,000	
93回	利付国庫債券(20年)	700,000,000	820,491,000	
94回	利付国庫債券(20年)	800,000,000	944,288,000	
95回	利付国庫債券(20年)	350,000,000	420,497,000	
97回	利付国庫債券(20年)	500,000,000	598,590,000	
99回	利付国庫債券(20年)	900,000,000	1,073,061,000	
100回	利付国庫債券(20年)	850,000,000	1,024,862,000	
102回	利付国庫債券(20年)	660,000,000	810,856,200	
105回	利付国庫債券(20年)	700,000,000	842,695,000	
106回	利付国庫債券(20年)	350,000,000	424,735,500	
107回	利付国庫債券(20年)	650,000,000	784,745,000	
108回	利付国庫債券(20年)	750,000,000	890,595,000	
109回	利付国庫債券(20年)	770,000,000	916,993,000	
110回	利付国庫債券(20年)	750,000,000	908,407,500	
111回	利付国庫債券(20年)	570,000,000	698,210,100	
112回	利付国庫債券(20年)	750,000,000	910,905,000	
113回	利付国庫債券(20年)	1,170,000,000	1,425,539,700	
114回	利付国庫債券(20年)	500,000,000	610,745,000	
115回	利付国庫債券(20年)	400,000,000	492,940,000	
116回	利付国庫債券(20年)	740,000,000	914,773,200	
117回	利付国庫債券(20年)	950,000,000	1,163,835,500	
118回	利付国庫債券(20年)	700,000,000	851,704,000	
119回	利付国庫債券(20年)	300,000,000	358,227,000	
120回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	702,870,000	
121回	利付国庫債券(20年)	730,000,000	882,205,000	
122回	利付国庫債券(20年)	500,000,000	598,470,000	
123回	利付国庫債券(20年)	680,000,000	839,324,000	
124回	利付国庫債券(20年)	500,000,000	611,265,000	
125回	利付国庫債券(20年)	720,000,000	899,712,000	
126回	利付国庫債券(20年)	450,000,000	551,520,000	
127回	利付国庫債券(20年)	450,000,000	546,120,000	
128回	利付国庫債券(20年)	850,000,000	1,033,991,000	
129回	利付国庫債券(20年)	150,000,000	180,634,500	
130回	利付国庫債券(20年)	900,000,000	1,085,445,000	
131回	利付国庫債券(20年)	450,000,000	537,120,000	



132回	利付国庫債券(20年)	660,000,000	789,241,200		
133回	利付国庫債券(20年)	510,000,000	616,329,900		
134回	利付国庫債券(20年)	470,000,000	569,090,100		
135回	利付国庫債券(20年)	500,000,000	598,965,000		
136回	利付国庫債券(20年)	500,000,000	592,520,000		
137回	利付国庫債券(20年)	490,000,000	588,029,400		
138回	利付国庫債券(20年)	640,000,000	751,244,800		
139回	利付国庫債券(20年)	580,000,000	688,425,200		
140回	利付国庫債券(20年)	1,350,000,000	1,622,862,000		
141回	利付国庫債券(20年)	900,000,000	1,083,672,000		
142回	利付国庫債券(20年)	600,000,000	730,584,000		
143回	利付国庫債券(20年)	970,000,000	1,155,599,800		
144回	利付国庫債券(20年)	410,000,000	482,803,700		
145回	利付国庫債券(20年)	1,400,000,000	1,689,730,000		
146回	利付国庫債券(20年)	1,100,000,000	1,329,614,000		
147回	利付国庫債券(20年)	1,280,000,000	1,529,779,200		
148回	利付国庫債券(20年)	1,080,000,000	1,276,441,200		
149回	利付国庫債券(20年)	1,020,000,000	1,206,700,800		
150回	利付国庫債券(20年)	1,260,000,000	1,471,957,200		
151回	利付国庫債券(20年)	1,160,000,000	1,319,708,800		
152回	利付国庫債券(20年)	1,140,000,000	1,297,274,400		
153回	利付国庫債券(20年)	1,110,000,000	1,280,762,400		
154回	利付国庫債券(20年)	1,150,000,000	1,308,171,000		
155回	利付国庫債券(20年)	1,180,000,000	1,303,616,800		
156回	利付国庫債券(20年)	1,220,000,000	1,225,904,800		
157回	利付国庫債券(20年)	1,300,000,000	1,259,687,000		
158回	利付国庫債券(20年)	980,000,000	997,826,200		
159回	利付国庫債券(20年)	1,270,000,000	1,312,481,500		
160回	利付国庫債券(20年)	1,050,000,000	1,102,437,000		
161回	利付国庫債券(20年)	1,200,000,000	1,236,936,000		
162回	利付国庫債券(20年)	950,000,000	977,920,500		
163回	利付国庫債券(20年)	1,210,000,000	1,243,819,500		
164回	利付国庫債券(20年)	1,460,000,000	1,471,577,800		
165回	利付国庫債券(20年)	1,220,000,000	1,227,600,600		
166回	利付国庫債券(20年)	500,000,000	520,715,000		
国債証券 合計		227,680,000,000	249,079,246,900		
地方債証券	680回	東京都公募公債	200,000,000	203,268,000	
	685回	東京都公募公債	500,000,000	508,000,000	
	688回	東京都公募公債	200,000,000	203,116,000	
	697回	東京都公募公債	500,000,000	513,315,000	
	701回	東京都公募公債	700,000,000	718,298,000	
	708回	東京都公募公債	500,000,000	514,955,000	
	720回	東京都公募公債	300,000,000	311,307,000	
	726回	東京都公募公債	400,000,000	414,012,000	
	5回	東京都公募公債 20年	100,000,000	112,940,000	
	9回	東京都公募公債 20年	200,000,000	236,016,000	
	10回	東京都公募公債 20年	300,000,000	353,304,000	
	22年度12回	北海道公募公債	200,000,000	205,216,000	
	194回	神奈川県公募公債	300,000,000	309,111,000	
	208回	神奈川県公募公債	300,000,000	308,652,000	

336回	大阪府公募公債	200,000,000	203,518,000	
345回	大阪府公募公債	300,000,000	307,293,000	
356回	大阪府公募公債	200,000,000	206,154,000	
364回	大阪府公募公債	300,000,000	308,562,000	
374回	大阪府公募公債	300,000,000	312,498,000	
26年度11回	京都府公募公債	350,000,000	359,565,500	
26年度17回	兵庫県公募公債	200,000,000	205,446,000	
1回	兵庫県公募公債(12年)	300,000,000	317,652,000	
22年度8回	静岡県公募公債	200,000,000	203,380,000	
23年度9回	静岡県公募公債	200,000,000	205,892,000	
1回	静岡県公募公債 20年	100,000,000	114,462,000	
22年度6回	愛知県公募公債	200,000,000	203,600,000	
23年度20回	愛知県公募公債	500,000,000	517,045,000	
25年度4回	愛知県公募公債	300,000,000	310,977,000	
22年度1回	広島県公募公債	200,000,000	203,722,000	
23年度2回	埼玉県公募公債	200,000,000	205,560,000	
26年度5回	埼玉県公募公債	400,000,000	413,092,000	
14回	埼玉県公募公債 20年	300,000,000	350,367,000	
25年度11回	福岡県公募公債	200,000,000	206,902,000	
24年度2回	福岡県公募公債(20年)	300,000,000	350,718,000	
24年度7回	千葉県公募公債	300,000,000	308,520,000	
25年度5回	千葉県公募公債	200,000,000	207,568,000	
94回	共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,496,000	
99回	共同発行市場公募地方債	700,000,000	719,817,000	
106回	共同発行市場公募地方債	300,000,000	308,658,000	
109回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	516,915,000	
111回	共同発行市場公募地方債	700,000,000	721,000,000	
119回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	516,060,000	
121回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	511,770,000	
126回	共同発行市場公募地方債	793,900,000	823,369,568	
127回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	515,780,000	
128回	共同発行市場公募地方債	300,000,000	309,339,000	
137回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	515,305,000	
139回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	515,195,000	
142回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	509,945,000	
144回	共同発行市場公募地方債	400,000,000	411,272,000	
146回	共同発行市場公募地方債	400,000,000	413,676,000	
148回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	517,555,000	
166回	共同発行市場公募地方債	500,000,000	505,200,000	
29年度4回	大阪市公募公債	200,000,000	201,382,000	
488回	名古屋市長公募公債 10年	450,000,000	464,782,500	
4回	京都市公募公債 20年	100,000,000	119,148,000	
30年度7回	神戸市長公募公債 30年	300,000,000	303,384,000	
22年度3回	横浜市公募公債	200,000,000	203,884,000	
22年度5回	横浜市公募公債	200,000,000	204,786,000	
23年度4回	横浜市公募公債	450,000,000	463,099,500	
25年度2回	横浜市公募公債	400,000,000	415,624,000	
25年度4回	札幌市長公募公債	200,000,000	206,918,000	
2回	川崎市長公募公債 15年	100,000,000	102,331,000	
23年度1回	千葉市長公募公債	200,000,000	206,160,000	

地方債証券 合計		21,443,900,000	22,258,855,068	
特殊債券	78回 日本政策投資銀行債券	200,000,000	202,128,000	
	19回 高速道路機構債	150,000,000	220,462,500	
	26回 高速道路機構債	200,000,000	273,864,000	
	96回 高速道路機構債	700,000,000	719,495,000	
	116回 高速道路機構債	100,000,000	103,144,000	
	172回 高速道路機構債	200,000,000	191,204,000	
	9回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	104,299,000	
	18回政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	317,790,000	
	121回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	591,405,000	
	149回政保日本高速道路保有・債務返済機構	400,000,000	412,088,000	
	180回政保日本高速道路保有・債務返済機構	1,000,000,000	1,030,930,000	
	189回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	512,600,000	
	193回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	520,740,000	
	195回政保日本高速道路保有・債務返済機構	330,000,000	344,384,700	
	239回政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	339,456,000	
	241回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	515,585,000	
	260回政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	231,180,000	
	309回政保日本高速道路保有・債務返済機構	800,000,000	808,952,000	
	319回政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	203,892,000	
	28回 日本道路・機構承継債	400,000,000	537,776,000	
	1回 地方公共団体金融機構債券 20年	200,000,000	236,434,000	
	10回 政保地方公共団体金融機構債券	500,000,000	507,905,000	
	15回 政保地方公共団体金融機構債券	200,000,000	203,338,000	
	20回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	307,599,000	
	24回 地方公共団体金融機構債券	300,000,000	308,571,000	
	19回 政保地方公共団体金融機構債券	200,000,000	237,506,000	
	36回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	309,534,000	
	24回 政保地方公共団体金融機構債券 20年	200,000,000	235,240,000	
	44回 政保地方公共団体金融機構債券	400,000,000	414,180,000	
	50回 政保地方公共団体金融機構債券	500,000,000	521,570,000	
	56回 政保地方公共団体金融機構債券	542,000,000	563,604,120	
	64回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	310,044,000	
44回 地方公共団体金融機構債券 20年	200,000,000	224,980,000		
83回 地方公共団体金融機構債券 10年	400,000,000	401,308,000		

15回	日本政策金融公庫債券	200,000,000	237,192,000	
39回	住宅金融支援機構債券	200,000,000	240,196,000	
75回	住宅金融支援機構債券	350,000,000	423,510,500	
222回	住宅金融支援機構債券	300,000,000	301,704,000	
230回	住宅金融支援機構債券	300,000,000	302,826,000	
6回	貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	43,185,000	45,363,251	
8回	貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	30,408,000	32,022,056	
9回	貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	45,270,000	47,515,844	
2回	貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	48,435,000	51,461,218	
13回	貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	17,235,000	17,714,477	
14回	貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	86,795,000	88,819,927	
43回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	16,184,000	17,107,297	
44回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	60,860,000	64,090,448	
51回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	45,636,000	47,983,059	
1回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	77,070,000	80,649,901	
29回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	161,505,000	173,793,915	
36回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	280,312,000	298,184,693	
126回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	285,882,000	288,423,490	
128回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	287,097,000	289,416,743	
131回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	291,117,000	292,834,590	
132回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	291,735,000	293,438,732	
137回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	297,111,000	300,397,047	
	い第779号 利付商工債	200,000,000	200,432,000	
	い第783号 利付商工債	300,000,000	300,900,000	
	325回 利附信金中金債	400,000,000	399,884,000	
	220号 利附商工債(3年)	300,000,000	300,105,000	
	15回 国際協力機構債	100,000,000	117,946,000	
	55回 鉄道建設運輸施設債	500,000,000	516,540,000	
特殊債券 合計		17,637,837,000	18,733,640,508	
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	198,988,000	
	6回 クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	200,000,000	205,666,000	
	337回 東京交通債	200,000,000	209,646,000	
	27回 ラボバンク・ネダーランド円貨社債	200,000,000	200,662,000	
	22回 中日本高速道路債券	300,000,000	305,214,000	
	34回 政保西日本高速道路債券	200,000,000	203,366,000	
	9回 日本たばこ産業社債	200,000,000	200,516,000	
	19回 三菱ケミカルホールディングス社債	100,000,000	101,409,000	
	6回 J Xホールディングス社債	100,000,000	104,385,000	

23回 ジェイ エフ イー ホールディングス社債	100,000,000	99,855,000	
30回 豊田自動織機社債	200,000,000	199,906,000	
12回 パナソニック社債	200,000,000	200,726,000	
13回 パナソニック社債	100,000,000	101,311,000	
56回 日産自動車社債	100,000,000	100,513,000	
14回 トヨタ自動車社債	200,000,000	207,108,000	
16回 トヨタ自動車社債	200,000,000	205,408,000	
94回 丸紅社債	100,000,000	103,582,000	
45回 住友商事社債	100,000,000	103,069,000	
47回 住友商事社債	100,000,000	103,155,000	
48回 クレディセゾン社債	100,000,000	103,657,000	
57回 東京三菱銀行社債	200,000,000	215,936,000	
25回 三菱東京UFJ銀行劣後社債	200,000,000	204,452,000	
28回 三菱東京UFJ銀行劣後社債	200,000,000	205,794,000	
32回 三菱東京UFJ銀行劣後社債	300,000,000	310,767,000	
6回 りそな銀行劣後社債	100,000,000	102,264,000	
7回 三菱UFJ信託銀行劣後債	200,000,000	204,240,000	
9回 三菱UFJ信託銀行劣後債	100,000,000	103,546,000	
12回 住友信託銀行劣後債	100,000,000	102,330,000	
10回 三井住友信託銀行社債	200,000,000	205,214,000	
10回 セブン銀行社債	100,000,000	102,900,000	
22回 三井住友銀行劣後社債	200,000,000	204,548,000	
23回 三井住友銀行劣後社債	400,000,000	411,648,000	
15回 トヨタファイナンス社債	200,000,000	205,640,000	
47回 日立キャピタル社債	200,000,000	205,706,000	
14回 大和証券グループ本社社債	100,000,000	101,482,000	
26回 野村ホールディングス社債	100,000,000	102,493,000	
42回 野村ホールディングス社債	200,000,000	203,252,000	
38回 三井不動産社債	200,000,000	203,350,000	
72回 三菱地所社債	100,000,000	111,975,000	
87回 住友不動産社債	100,000,000	100,859,000	
15回 東日本旅客鉄道社債	300,000,000	312,798,000	
19回 東日本旅客鉄道社債	100,000,000	107,239,000	
21回 東日本旅客鉄道社債	100,000,000	107,276,000	
39回 東日本旅客鉄道社債	300,000,000	337,848,000	
42回 東日本旅客鉄道社債	200,000,000	226,928,000	
9回 西日本旅客鉄道社債	200,000,000	214,286,000	
10回 西日本旅客鉄道社債	300,000,000	327,783,000	
6回 東海旅客鉄道社債	100,000,000	107,268,000	
11回 東海旅客鉄道社債	300,000,000	313,041,000	
13回 東海旅客鉄道社債	200,000,000	219,202,000	
14回 東海旅客鉄道社債	100,000,000	111,001,000	
4回 東京地下鉄社債	120,000,000	140,190,000	
60回 日本電信電話社債	300,000,000	307,185,000	
496回 中部電力社債	500,000,000	509,280,000	
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	416,956,000	
379回 中国電力社債	300,000,000	303,288,000	
260回 北陸電力社債	100,000,000	103,124,000	

301回	北陸電力社債	100,000,000	104,095,000	
307回	北陸電力社債	100,000,000	105,733,000	
471回	東北電力社債	400,000,000	418,888,000	
473回	東北電力社債	300,000,000	303,492,000	
253回	四国電力社債	200,000,000	207,280,000	
424回	九州電力社債	200,000,000	209,708,000	
426回	九州電力社債	400,000,000	416,556,000	
320回	北海道電力社債	200,000,000	202,528,000	
321回	北海道電力社債	161,000,000	166,614,070	
340回	北海道電力社債	300,000,000	302,409,000	
13回	電源開発社債	200,000,000	222,382,000	
38回	電源開発社債	300,000,000	310,929,000	
23回	東京瓦斯社債	300,000,000	312,390,000	
18回	大阪ガス社債	100,000,000	105,523,000	
27回	NTTデータ社債	100,000,000	103,535,000	
7回	ファーストリテイリング社債	200,000,000	200,938,000	
社債券	合計	14,381,000,000	14,924,593,070	
合計		281,142,737,000	304,996,335,546	

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1月11日現在	平成31年1月11日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		957,714,377	2,314,167,249
投資証券		33,647,153,300	32,839,378,200
派生商品評価勘定		14,948,352	8,421,192
未収配当金		323,661,804	305,320,935
差入委託証拠金		6,500,352	10,492,092
流動資産合計		34,949,978,185	35,477,779,668
資産合計		34,949,978,185	35,477,779,668
負債の部			
流動負債			
前受金		13,412,352	2,980,692
未払金		673,826,209	1,776,310,520
未払解約金		28,461,800	31,354,000
流動負債合計		715,700,361	1,810,645,212
負債合計		715,700,361	1,810,645,212
純資産の部			
元本等			
元本	1	19,626,564,592	17,353,251,443
剰余金			
剰余金又は欠損金( )		14,607,713,232	16,313,883,013
元本等合計		34,234,277,824	33,667,134,456
純資産合計		34,234,277,824	33,667,134,456
負債純資産合計		34,949,978,185	35,477,779,668



## 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1月11日現在	平成31年1月11日現在
1 . 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	16,987,974,680円	19,626,564,592円
同期中追加設定元本額	9,684,096,255円	18,392,838,806円
同期中一部解約元本額	7,045,506,343円	20,666,151,955円
元本の内訳		
ファンド名		
MITO ラップ型ファンド（安定型）	361,083円	273,617円
MITO ラップ型ファンド（中立型）	912,903円	1,005,641円
MITO ラップ型ファンド（積極型）	2,407,898円	2,030,344円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	1,532,660円	1,959,291円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	1,298,870円	2,803,635円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	1,761,249円	2,391,639円
たわらノーロード 国内リート	1,064,897,610円	1,829,589,442円
たわらノーロード 国内リート<ラップ向け>	292,610,032円	631,502,662円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	14,983,358円	120,157,449円
たわらノーロード バランス（堅実型）	51,544円	1,675,645円
たわらノーロード バランス（標準型）	1,073,973円	32,882,913円
たわらノーロード バランス（積極型）	3,189,831円	46,534,171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)	35,677円	13,535,312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)	53,803円	47,448,867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)	64,927円	28,598,521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)	77,218円	64,075,667円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定型)	- 円	318,290円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定成長型)	- 円	1,772,149円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(成長型)	- 円	1,031,995円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(積極型)	- 円	2,925,114円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型>	13,914,114円	13,878,394円
マネックス資産設計ファンド< 育成型>	343,011,189円	367,687,724円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	3,270,978円	2,800,682円
D I A M D C 8資産バラ ンスファンド(新興国10)	18,476,325円	112,562,702円
D I A M D C 8資産バラ ンスファンド(新興国20)	60,982,941円	97,972,560円
D I A M D C 8資産バラ ンスファンド(新興国30)	134,732,676円	193,573,200円
投資のソムリエ	1,515,538,797円	1,494,850,661円
投資のソムリエ<DC年金>	96,091,039円	136,466,780円
D I A M 8資産バランスファ ンドN<DC年金>	70,215,123円	80,069,705円
投資のソムリエ<DC年金>リ スク抑制型	55,236,473円	26,060,325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	207,978円	436,240円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2045)	764,041,600円	454,608,007円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2055)	237,910円	818,404円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2055)	237,910円	637,800円
リスク抑制世界8資産バランス ファンド(DC)	256,978円	163,238円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2035)	234,001円	1,297,694円
リスクコントロール世界資産分 散ファンド	- 円	170,175,871円
9資産分散投資・スタンダード <DC年金>	- 円	8,057円
Jリートインデックスファンド (DC)	6,728,716円	6,898,990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)	94,383,939円	90,667,967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)	1,819,511,382円	814,638,139円
DIAM J-REITイン デックスファンド(適格機関投 資家向け)	9,605,103,606円	8,542,863,384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)	-円	62,731,397円
DIAMグローバル 私募ファ ンド(適格機関投資家向け)	14,402,370円	14,402,370円
DIAMグローバル・リスク ファクター・パリティ戦略ファ ンド(適格機関投資家限定)	1,779,304,967円	1,189,092,929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)	1,845,130,944円	645,375,859円
計	19,626,564,592円	17,353,251,443円
2. 受益権の総数	19,626,564,592口	17,353,251,443口

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成29年6月23日 至 平成30年1月11日	自 平成30年1月12日 至 平成31年1月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、不動産投信指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、不動産投資信託証券の価格の変動によるリスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成30年1月11日現在	平成31年1月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、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1月11日現在	平成31年1月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
投資証券	472,451,364	1,032,127,528
合計	472,451,364	1,032,127,528

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(平成29年6月7日から平成30年1月11日まで及び平成30年6月7日から平成31年1月11日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

## 不動産投信関連

種類	平成30年1月11日 現在				平成31年1月11日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
不動産投信指数先物 取引								
買 建	414,592,000	-	429,568,000	14,976,000	620,883,900	-	629,343,000	8,459,100
合計	414,592,000	-	429,568,000	14,976,000	620,883,900	-	629,343,000	8,459,100

(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1月11日現在	平成31年1月11日現在
1口当たり純資産額	1.7443円	1.9401円
(1万口当たり純資産額)	(17,443円)	(19,401円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

平成31年1月11日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
投資証券	CRE ロジスティクスファンド投資法人	372	37,646,400	
	GLP 投資法人	9,202	1,017,741,200	
	MCUBS MidCity 投資法人	4,185	369,954,000	
	One リート投資法人	541	147,314,300	
	いちごオフィスリート投資法人	3,081	300,397,500	
	いちごホテルリート投資法人	649	90,146,100	
	さくら総合リート投資法人	803	66,408,100	
	アクティブ・プロパティーズ投資法人	1,951	849,660,500	
	アドバンス・レジデンス投資法人	3,619	1,132,747,000	
	イオンリート投資法人	3,812	493,272,800	
	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	22,014	344,519,100	
	インヴィンシブル投資法人	12,996	611,461,800	
	オリックス不動産投資法人	7,399	1,369,554,900	
	グローバル・ワン不動産投資法人	2,374	293,663,800	
	ケネディクス・オフィス投資法人	1,149	828,429,000	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	2,203	372,967,900	
	ケネディクス商業リート投資法人	1,361	345,557,900	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	1,416	402,852,000	
	サムティ・レジデンシャル投資法人	743	66,424,200	
	ザイマックス・リート投資法人	342	38,851,200	
	ジャパン・ホテル・リート投資法人	10,753	847,336,400	
	ジャパンエクセレント投資法人	3,326	505,552,000	
	ジャパンリアルエステイト投資法人	3,714	2,380,674,000	
	スターアジア不動産投資法人	1,153	123,947,500	
	スターツプロシード投資法人	585	99,508,500	
	タカラレーベン不動産投資法人	556	49,650,800	
	トーセイ・リート投資法人	715	79,937,000	
	ヒューリックリート投資法人	3,002	516,043,800	
	フロンティア不動産投資法人	1,263	548,142,000	
	プレミア投資法人	3,531	443,846,700	
	ヘルスケア&メディカル投資法人	492	56,924,400	
	マリモ地方創生リート投資法人	319	33,909,700	
	ユナイテッド・アーバン投資法人	8,191	1,409,671,100	
	ラサールロジポート投資法人	2,802	298,413,000	
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	574	49,191,800		
阪急阪神リート投資法人	1,671	242,295,000		
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	634	199,710,000		
三菱地所物流リート投資法人	393	96,285,000		

産業ファンド投資法人	4,327	498,470,400	
森トラスト・ホテルリート投資法人	871	115,146,200	
森トラスト総合リート投資法人	2,654	437,910,000	
森ヒルズリート投資法人	4,259	594,556,400	
星野リゾート・リート投資法人	565	297,190,000	
積水ハウス・リート投資法人	9,582	699,486,000	
大江戸温泉リート投資法人	599	48,519,000	
大和ハウスリート投資法人	4,650	1,157,850,000	
大和証券オフィス投資法人	857	611,041,000	
投資法人みらい	1,000	189,100,000	
東急リアル・エステート投資法人	2,490	417,324,000	
日本アコモデーションファンド投資法人	1,234	673,764,000	
日本ビルファンド投資法人	3,596	2,538,776,000	
日本プライムリアルティ投資法人	2,351	1,010,930,000	
日本プロロジスリート投資法人	4,981	1,173,025,500	
日本ヘルスケア投資法人	170	28,730,000	
日本リート投資法人	1,199	445,428,500	
日本リテールファンド投資法人	7,019	1,550,497,100	
日本ロジスティクスファンド投資法人	2,450	558,110,000	
日本賃貸住宅投資法人	4,177	348,779,500	
福岡リート投資法人	1,921	322,920,100	
平和不動産リート投資法人	2,313	282,648,600	
野村不動産マスターファンド投資法人	11,007	1,678,567,500	
投資証券 合計	198,158	32,839,378,200	
合計	198,158	32,839,378,200	

投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。



## 「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成30年1月11日現在	平成31年1月11日現在
資産の部			
流動資産			
預金		5,822,987,447	3,836,684,496
コール・ローン		726,764,720	101,330,406
株式		292,877,407,767	308,327,397,174
投資信託受益証券		801,364,202	765,582,162
投資証券		6,273,413,009	7,344,836,469
派生商品評価勘定		175,170,660	342,984,345
未収入金		2,663,502	2,935,713
未収配当金		323,899,180	399,646,537
差入委託証拠金		2,025,207,755	4,288,210,905
流動資産合計		309,028,878,242	325,409,608,207
資産合計		309,028,878,242	325,409,608,207
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		3,689,542	5,777,780
未払金		-	191,353,057
未払解約金		331,777,000	83,153,000
流動負債合計		335,466,542	280,283,837
負債合計		335,466,542	280,283,837
純資産の部			
元本等			
元本	1	87,104,816,912	101,086,948,774
剰余金			
剰余金又は欠損金( )		221,588,594,788	224,042,375,596
元本等合計		308,693,411,700	325,129,324,370
純資産合計		308,693,411,700	325,129,324,370
負債純資産合計		309,028,878,242	325,409,608,207

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

## （貸借対照表に関する注記）

項目	平成30年1月11日現在	平成31年1月11日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	88,044,154,334円	87,104,816,912円
同期中追加設定元本額	12,511,775,460円	41,186,554,316円
同期中一部解約元本額	13,451,112,882円	27,204,422,454円
元本の内訳 ファンド名		

D I A M外国株式パッシブ・ ファンド	1,822,423,973円	2,834,834,285円
M I T O ラップ型ファンド (安定型)	3,191,830円	2,795,385円
M I T O ラップ型ファンド (中立型)	7,279,030円	8,338,508円
M I T O ラップ型ファンド (積極型)	18,898,552円	16,109,487円
グローバル8資産ラップファン ド(安定型)	13,544,215円	20,660,274円
グローバル8資産ラップファン ド(中立型)	10,359,460円	22,937,156円
グローバル8資産ラップファン ド(積極型)	13,818,783円	19,511,274円
たわらノーロード 先進国株式	5,502,154,955円	8,432,850,323円
たわらノーロード 先進国株式 <ラップ向け>	424,744円	423,862円
たわらノーロード 先進国株式 <為替ヘッジあり>	463,445,507円	1,113,800,589円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	7,231,042円	72,340,579円
たわらノーロード バランス (堅実型)	150,198円	5,902,698円
たわらノーロード バランス (標準型)	1,404,580円	53,764,222円
たわらノーロード バランス (積極型)	4,751,015円	86,792,047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)	14,227円	251,550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)	57,189円	22,507,488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)	80,559円	67,724,316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)	103,944円	45,651,641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)	127,326円	118,572,173円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(保守型)	- 円	27,125円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定型)	- 円	129,058円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定成長型)	- 円	897,827円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(成長型)	- 円	666,772円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(積極型)	- 円	2,471,010円
D I A M外国株式インデックス ファンド<DC年金>	36,937,428,806円	40,302,652,318円
D I A Mバランス・ファンド< DC年金>1安定型	157,435,724円	177,126,536円

DIAMバランス・ファンド< DC年金> 2安定・成長型	857,026,223円	921,869,976円
DIAMバランス・ファンド< DC年金> 3成長型	1,043,554,352円	1,083,135,794円
DIAM DC バランス30 インデックスファンド	130,707,011円	127,206,341円
DIAM DC バランス50 インデックスファンド	385,930,973円	360,021,829円
DIAM DC バランス70 インデックスファンド	330,441,705円	323,498,598円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型>	33,185,995円	30,117,672円
マネックス資産設計ファンド< 育成型>	817,871,261円	797,590,298円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	187,072,304円	209,301,312円
DIAM DC 8資産バラン スファンド(新興国10)	29,811,822円	213,418,470円
DIAM DC 8資産バラン スファンド(新興国20)	73,885,125円	144,027,570円
DIAM DC 8資産バラン スファンド(新興国30)	145,725,386円	249,535,320円
投資のソムリエ	970,425,131円	678,676,729円
クルーズコントロール	790,811,166円	70,085,435円
投資のソムリエ< DC年金>	61,679,304円	62,512,430円
DIAM 8資産バラン スファンドN< DC年金>	114,876,755円	167,809,740円
DIAM DC バランス・F (成長型)	70,873,790円	94,014,637円
クルーズコントロール< DC年 金>	275,806円	44,663円
DIAMコア資産設計ファンド (堅実型)	3,642,956円	449,001円
DIAMコア資産設計ファンド (積極型)	8,318,622円	844,676円
投資のソムリエ< DC年金>リ スク抑制型	27,153,058円	21,167,331円
ダイナミック・ナビゲーション	1,144,316円	343,259円
リスク抑制世界8資産バラン スファンド	373,981,024円	357,646,638円
ワールドアセットバランス(基 本コース)	588,185,085円	610,427,443円
ワールドアセットバランス(リ スク抑制コース)	2,227,897,121円	1,389,438,673円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2045)	517,823円	1,012,100円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2055)	517,846円	789,212円
リスク抑制世界8資産バラン スファンド(DC)	126,045円	128,251円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2035)	365,458円	806,566円

4資産分散投資・スタンダード <DC年金>	-円	5,789,621円
リスクコントロール世界資産分 散ファンド	-円	105,791,997円
9資産分散投資・スタンダード <DC年金>	-円	13,989円
DIAM外国株式インデックス ファンドVA(適格機関投資家 専用)	95,685,592円	90,254,658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)	2,953,403,840円	2,390,882,636円
DIAM先進国株式パッシブ ファンド(適格機関投資家限 定)	161,207,978円	12,402,698,618円
外国株式パッシブ・ファンド2 (適格機関投資家限定)	208,789,234円	206,183,273円
DIAMワールドバランス25 VA(適格機関投資家限定)	23,987,145円	22,840,539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)	108,709,025円	89,701,630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)	238,629,259円	212,654,359円
DIAM国際分散バランスファ ンド30VA(適格機関投資家 限定)	12,888,459円	11,554,549円
DIAM国際分散バランスファ ンド50VA(適格機関投資家 限定)	86,550,378円	73,589,651円
DIAM国内重視バランスファ ンド30VA(適格機関投資家 限定)	7,842,084円	6,413,299円
DIAM国内重視バランスファ ンド50VA(適格機関投資家 限定)	13,001,598円	6,903,870円
DIAM世界バランスファンド 40VA(適格機関投資家限 定)	26,103,100円	23,330,526円
DIAM世界バランスファンド 50VA(適格機関投資家限 定)	69,758,648円	63,541,976円
DIAMバランスファンド25 VA(適格機関投資家限定)	578,673,845円	534,544,227円
DIAMバランスファンド3 7.5VA(適格機関投資家限 定)	722,585,419円	654,815,220円
DIAMバランスファンド50 VA(適格機関投資家限定)	2,235,486,581円	2,062,322,007円
DIAMグローバル・アセッ ト・バランスVA(適格機関投 資家限定)	794,469,102円	756,981,970円

D I A Mグローバル・アセ ト・バランスV A 2 ( 適格機 関投資家限定)	242,322,969円	124,735,564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)	962,367,378円	865,106,063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)	499,820,780円	95,074,329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)	176,485,295円	27,248,619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)	424,964,949円	15,458,639円
D I A M世界アセットバラン スファンド2 V A ( 適格機関投資 家限定)	8,054,309,887円	4,884,528,633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)	431,455,488円	144,037,122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)	1,383,217,436円	1,386,057,134円
D I A M世界アセットバラン スファンド3 V A ( 適格機関投資 家限定)	5,242,924,377円	5,298,403,339円
D I A Mバランス3 0 V A ( 適 格機関投資家限定)	2,048,915円	19,797,555円
D I A Mバランス5 0 V A ( 適 格機関投資家限定)	28,490,332円	355,559円
D I A Mバランス7 0 V A ( 適 格機関投資家限定)	10,665,941円	10,994,618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)	6,995,839,213円	7,082,295,609円
D I A Mバランス2 0 V A ( 適 格機関投資家限定)	56,125,154円	63,114,592円
D I A Mバランス4 0 V A ( 適 格機関投資家限定)	12,665,761円	246,843円
D I A Mバランス6 0 V A ( 適 格機関投資家限定)	257,653円	272,499円
計	87,104,816,912円	101,086,948,774円
2 . 受益権の総数	87,104,816,912口	101,086,948,774口

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成29年6月23日 至 平成30年1月11日	自 平成30年1月12日 至 平成31年1月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<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1月11日現在	平成31年1月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、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1月11日現在	平成31年1月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
株式	38,008,423,503	12,919,777,352
投資信託受益証券	21,791,655	47,396,539
投資証券	100,610,106	234,989,246
合計	38,130,825,264	12,637,391,567

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成29年2月16日から平成30年1月11日まで及び平成30年2月16日から平成31年1月11日まで）に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

## 通貨関連

種類	平成30年1月11日 現在				平成31年1月11日 現在			
	契約額等	うち 1年超	時価	評価損益	契約額等	うち 1年超	時価	評価損益
	(円)		(円)	(円)	(円)		(円)	(円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	1,026,890,881	-	1,026,860,650	30,231	-	-	-	-
アメリカ・ドル	723,398,115	-	723,375,400	22,715	-	-	-	-
イギリス・ポンド	74,535,466	-	74,532,150	3,316	-	-	-	-
オーストラリア・ドル	29,758,776	-	29,757,420	1,356	-	-	-	-
カナダ・ドル	44,107,048	-	44,104,320	2,728	-	-	-	-
ユーロ	155,091,476	-	155,091,360	116	-	-	-	-
買 建	368,878,305	-	365,713,490	3,164,815	3,879,788,937	-	3,879,951,050	162,113
アメリカ・ドル	250,403,880	-	248,221,420	2,182,460	2,662,040,379	-	2,662,064,930	24,551
イギリス・ポンド	28,149,045	-	27,855,450	293,595	262,145,481	-	262,165,400	19,919
オーストラリア・ドル	11,862,585	-	11,850,300	12,285	105,725,286	-	105,727,320	2,034
カナダ・ドル	17,942,835	-	17,695,080	247,755	143,511,225	-	143,523,840	12,615
ユーロ	60,519,960	-	60,091,240	428,720	706,366,566	-	706,469,560	102,994
合計	1,395,769,186	-	1,392,574,140	3,134,584	3,879,788,937	-	3,879,951,050	162,113

## (注) 時価の算定方法

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

## 株式関連

種類	平成30年1月11日 現在				平成31年1月11日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
先物取引								
買 建	7,434,733,565	-	7,609,349,267	174,615,702	12,045,683,104	-	12,382,727,556	337,044,452
合計	7,434,733,565	-	7,609,349,267	174,615,702	12,045,683,104	-	12,382,727,556	337,044,452

## (注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (1口当たり情報に関する注記)

	平成30年1月11日現在	平成31年1月11日現在
1口当たり純資産額	3.5439円	3.2163円
(1万口当たり純資産額)	(35,439円)	(32,163円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

平成31年1月11日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	AMAZON.COM INC	35,638	1,656.220	59,024,368.360	
	ABBOTT LABORATORIES	151,576	69.080	10,470,870.080	
	AES CORP	55,631	15.340	853,379.540	
	ABIOMED INC	3,560	335.130	1,193,062.800	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	78,671	121.790	9,581,341.090	
	ADVANCED MICRO DEVICES	76,385	19.740	1,507,839.900	
	ADOBE INC	42,294	237.770	10,056,244.380	
	CHUBB LTD	39,378	129.530	5,100,632.340	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	18,105	157.200	2,846,106.000	
	ALLEGHANY CORP	1,325	618.490	819,499.250	
	RALPH LAUREN CORP	4,893	106.860	522,865.980	
	ALLSTATE CORP	28,995	83.540	2,422,242.300	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	64,120	137.750	8,832,530.000	
	AMGEN INC	55,718	202.680	11,292,924.240	
	HESS CORP	23,734	51.950	1,232,981.300	
	AMERICAN EXPRESS CO	62,115	98.260	6,103,419.900	
	AMERICAN ELECTRIC POWER	42,628	74.720	3,185,164.160	
	AFLAC INC	63,317	45.770	2,898,019.090	
	AMERICAN INTL GROUP	73,820	41.420	3,057,624.400	
	AMERCO	551	341.700	188,276.700	
	ANALOG DEVICES	32,962	88.610	2,920,762.820	
	ANADARKO PETROLEUM CORP	42,877	48.330	2,072,245.410	
	ALEXION PHARMACEUTICALS INC	19,482	110.930	2,161,138.260	
	JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	81,035	31.880	2,583,395.800	
	JONES LANG LASALLE INC	4,087	134.090	548,025.830	
	VALERO ENERGY CORP	37,219	77.420	2,881,494.980	
	APACHE CORP	36,095	30.960	1,117,501.200	
	ANSYS INC	7,633	152.600	1,164,795.800	
	APPLE INC	415,036	153.800	63,832,536.800	
	APPLIED MATERIALS INC	83,106	34.760	2,888,764.560	
	ALBEMARLE CORP	9,826	77.270	759,255.020	
	ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	49,679	43.370	2,154,578.230	
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	9,600	86.070	826,272.000		
AMEREN CORP	22,070	65.810	1,452,426.700		
ARROW ELECTRONICS INC	8,346	72.530	605,335.380		

AUTOLIV INC	6,197	77.350	479,337.950	
AUTODESK INC	19,295	136.710	2,637,819.450	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	37,336	132.460	4,945,526.560	
AUTOZONE INC	2,231	827.340	1,845,795.540	
AVERY DENNISON CORP	8,042	93.620	752,892.040	
BALL CORP	27,803	47.650	1,324,812.950	
BERKSHIRE HATHAWAY INC- CL B	111,618	196.580	21,941,866.440	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	86,363	47.470	4,099,651.610	
BAXTER INTERNATIONAL INC	42,327	67.310	2,849,030.370	
BECTON DICKINSON & CO	22,865	229.450	5,246,374.250	
AMETEK INC	19,925	70.600	1,406,705.000	
VERIZON COMM INC	355,398	57.600	20,470,924.800	
WR BERKLEY CORP	8,134	72.980	593,619.320	
BEST BUY CO INC	23,206	56.870	1,319,725.220	
YUM! BRANDS INC	26,216	91.790	2,406,366.640	
FIRSTENERGY CORP	41,503	38.580	1,601,185.740	
H&R BLOCK INC	16,114	25.600	412,518.400	
BOEING CO	47,049	352.610	16,589,947.890	
ROBERT HALF INTL INC	10,827	58.190	630,023.130	
BORGWARNER INC	21,554	39.290	846,856.660	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	119,820	35.950	4,307,529.000	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	11,755	85.440	1,004,347.200	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	10,153	110.000	1,116,830.000	
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	2,142	576.290	1,234,413.180	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	139,051	47.720	6,635,513.720	
AFFILIATED MANAGERS GROUP INC	5,215	104.070	542,725.050	
INGREDION INC	5,305	96.880	513,948.400	
ONEOK INC	34,002	60.040	2,041,480.080	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	5,900	93.500	551,650.000	
UNITED RENTALS INC	6,332	118.780	752,114.960	
SEMPRA ENERGY	23,049	114.430	2,637,497.070	
FEDEX CORP	21,525	170.120	3,661,833.000	
VERISIGN INC	9,648	157.760	1,522,068.480	
AMPHENOL CORP	25,201	81.820	2,061,945.820	
BROWN-FORMAN CORP	23,558	46.890	1,104,634.620	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	127,092	6.070	771,448.440	
CSX CORP	71,027	64.690	4,594,736.630	
CABOT OIL & GAS CORP	38,255	24.120	922,710.600	
CAMPBELL SOUP CO	14,050	34.480	484,444.000	
SEAGATE TECHNOLOGY	24,337	40.600	988,082.200	
CONSTELLATION BRANDS INC	14,553	159.930	2,327,461.290	

CARDINAL HEALTH INC	26,919	47.590	1,281,075.210	
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	35,448	52.290	1,853,575.920	
CATERPILLAR INC	50,787	132.960	6,752,639.520	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	11,232	107.820	1,211,034.240	
CELGENE CORP	60,871	86.950	5,292,733.450	
CITRIX SYSTEMS INC	10,896	105.850	1,153,341.600	
CENTURYLINK INC	80,424	16.000	1,286,784.000	
CERNER CORP	26,414	54.070	1,428,204.980	
JPMORGAN CHASE & CO	288,829	100.390	28,995,543.310	
CHURCH & DWIGHT CO INC	22,243	67.030	1,490,948.290	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	14,286	77.300	1,104,307.800	
CINTAS CORP	7,944	177.480	1,409,901.120	
CISCO SYSTEMS INC	405,361	43.240	17,527,809.640	
CLOROX COMPANY	10,885	153.110	1,666,602.350	
COCA-COLA CO/THE	346,285	47.070	16,299,634.950	
COPART INC	18,944	50.600	958,566.400	
COGNEX CORP	15,291	42.110	643,904.010	
COLGATE-PALMOLIVE CO	71,000	61.820	4,389,220.000	
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	24,763	110.050	2,725,168.150	
COMERICA INC	14,931	73.080	1,091,157.480	
NRG ENERGY, INC.	25,631	40.410	1,035,748.710	
COMCAST CORP-CL A	394,384	35.820	14,126,834.880	
CONAGRA BRANDS INC	40,573	21.470	871,102.310	
CONSOLIDATED EDISON INC	26,733	76.550	2,046,411.150	
CMS ENERGY CORP	23,616	49.820	1,176,549.120	
COOPER COS INC	4,484	259.640	1,164,225.760	
MOLSON COORS BREWING CO	16,200	62.860	1,018,332.000	
CORNING INC	68,691	30.350	2,084,771.850	
SEALED AIR CORP	13,870	36.090	500,568.300	
CUMMINS INC	13,193	139.330	1,838,180.690	
DR HORTON INC	32,152	39.110	1,257,464.720	
DANAHER CORP	53,471	105.360	5,633,704.560	
MOODY'S CORP	14,293	149.040	2,130,228.720	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	50,331	64.810	3,261,952.110	
TARGET CORP	43,650	68.290	2,980,858.500	
DEERE & CO	26,237	159.120	4,174,831.440	
MORGAN STANLEY	113,217	41.660	4,716,620.220	
REPUBLIC SERVICES INC	19,891	74.550	1,482,874.050	
COSTAR GROUP INC	2,994	359.620	1,076,702.280	
THE WALT DISNEY CO	128,037	112.800	14,442,573.600	
DOLLAR TREE INC	20,078	96.410	1,935,719.980	
DOVER CORP	12,635	77.480	978,959.800	
OMNICOM GROUP	19,325	75.950	1,467,733.750	
DTE ENERGY CO	16,034	111.700	1,790,997.800	

DUKE ENERGY CORP	61,177	85.270	5,216,562.790	
FLOWERVE CORP	13,139	41.630	546,976.570	
DARDEN RESTAURANTS INC	10,990	105.780	1,162,522.200	
EBAY INC	78,355	30.570	2,395,312.350	
BANK OF AMERICA CORP	816,074	25.730	20,997,584.020	
CITIGROUP INC	216,690	56.440	12,229,983.600	
EASTMAN CHEMICAL CO	13,009	76.450	994,538.050	
E*TRADE FINANCIAL CORP	21,624	47.660	1,030,599.840	
EATON CORP PLC	38,409	70.190	2,695,927.710	
EATON VANCE CORP	9,184	36.810	338,063.040	
CADENCE DESIGN SYS INC	24,922	44.320	1,104,543.040	
DISH NETWORK CORP	16,150	28.640	462,536.000	
ECOLAB INC	22,192	149.630	3,320,588.960	
ELECTRONIC ARTS INC	25,240	91.010	2,297,092.400	
SALESFORCE.COM INC	62,435	147.040	9,180,442.400	
EMERSON ELECTRIC CO	54,324	62.110	3,374,063.640	
ATMOS ENERGY CORP	10,220	92.420	944,532.400	
ENERGY CORP	16,259	86.630	1,408,517.170	
EOG RESOURCES INC	50,726	99.120	5,027,961.120	
EQUIFAX INC	10,231	96.660	988,928.460	
ESTEE LAUDER COS INC/THE	19,424	125.300	2,433,827.200	
EXPEDITORS INTERNATIONAL	14,792	68.730	1,016,654.160	
EXXON MOBIL CORP	364,152	72.050	26,237,151.600	
FMC CORP	10,614	80.670	856,231.380	
NEXTERA ENERGY INC	39,952	175.390	7,007,181.280	
ASSURANT INC	4,089	92.500	378,232.500	
FASTENAL CO	25,418	54.480	1,384,772.640	
FIFTH THIRD BANCORP	60,050	24.920	1,496,446.000	
M&T BANK CORP	11,394	150.440	1,714,113.360	
FISERV INC	35,737	74.380	2,658,118.060	
FLIR SYSTEMS INC	11,623	44.640	518,850.720	
MACY'S INC	24,741	26.110	645,987.510	
FORD MOTOR CO	324,391	8.670	2,812,469.970	
FRANKLIN RESOURCES INC	28,548	30.470	869,857.560	
FREEMPORT-MCMORAN INC	117,269	11.510	1,349,766.190	
FLEX LTD	67,669	7.980	539,998.620	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	16,478	73.690	1,214,263.820	
GAP INC/THE	18,295	25.250	461,948.750	
DENTSPLY SIRONA INC	17,477	40.040	699,779.080	
GENERAL DYNAMICS CORP	22,143	162.430	3,596,687.490	
GENERAL MILLS INC	52,709	41.420	2,183,206.780	
GENUINE PARTS CO	11,759	97.060	1,141,328.540	
GILEAD SCIENCES INC	111,111	68.040	7,559,992.440	
GARTNER INC	7,153	128.240	917,300.720	
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	18,097	21.520	389,447.440	
MCKESSON CORP	16,848	122.040	2,056,129.920	
NVIDIA CORP	49,351	145.230	7,167,245.730	
GENERAL ELECTRIC CO	744,025	8.940	6,651,583.500	

WW GRAINGER INC	3,832	284.490	1,090,165.680	
HALLIBURTON CO	73,763	30.870	2,277,063.810	
MONSTER BEVERAGE CORP	36,373	53.260	1,937,225.980	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	30,711	176.000	5,405,136.000	
HARLEY-DAVIDSON INC	12,901	36.600	472,176.600	
HARRIS CORP	10,033	134.890	1,353,351.370	
HASBRO INC	10,927	85.250	931,526.750	
HENRY SCHEIN INC	13,800	79.480	1,096,824.000	
HELMERICH & PAYNE INC	10,055	53.970	542,668.350	
HERSHEY FOODS CORP	12,135	106.800	1,296,018.000	
HP INC	137,654	21.470	2,955,431.380	
F5 NETWORKS INC	4,874	165.600	807,134.400	
CROWN HOLDINGS INC NPR	10,472	45.690	478,465.680	
UNITED THERAPEUTICS CORP	3,447	114.280	393,923.160	
JUNIPER NETWORKS INC	27,740	28.260	783,932.400	
HOLLYFRONTIER CORP	12,551	53.320	669,219.320	
HOLOGIC INC	23,377	42.560	994,925.120	
UNUM GROUP	16,000	32.200	515,200.000	
HOME DEPOT INC	98,482	179.060	17,634,186.920	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	15,079	93.940	1,416,521.260	
HORMEL FOODS CORP	24,161	43.250	1,044,963.250	
CENTERPOINT ENERGY INC	43,020	29.510	1,269,520.200	
LENNOX INTERNATIONAL INC	3,569	225.060	803,239.140	
HUMANA INC	11,962	275.020	3,289,789.240	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	7,359	97.100	714,558.900	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	93,648	12.560	1,176,218.880	
RED HAT INC	14,824	174.500	2,586,788.000	
NEKTAR THERAPEUTICS	12,000	41.470	497,640.000	
BIOGEN INC	17,388	331.190	5,758,731.720	
IDEX CORP	5,924	136.570	809,040.680	
ILLINOIS TOOL WORKS	26,425	131.440	3,473,302.000	
INTUIT INC	20,880	206.060	4,302,532.800	
IDEXX LABORATORIES INC	7,402	192.720	1,426,513.440	
INGERSOLL-RAND PLC	20,370	95.270	1,940,649.900	
INTEL CORP	396,933	48.560	19,275,066.480	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	7,446	135.720	1,010,571.120	
INTERNATIONAL PAPER CO	32,983	44.810	1,477,968.230	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	29,157	22.250	648,743.250	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	9,631	60.750	585,083.250	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	5,919	126.130	746,563.470	
INCYTE CORP	15,601	75.120	1,171,947.120	
JOHNSON & JOHNSON	230,821	129.710	29,939,791.910	

HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	29,441	44.220	1,301,881.020	
KLA-TENCOR CORP	13,639	93.710	1,278,110.690	
DEVON ENERGY CORP	44,878	26.290	1,179,842.620	
KELLOGG CO	21,564	58.290	1,256,965.560	
EAST WEST BANCORP INC	11,000	47.300	520,300.000	
KEYCORP	88,511	15.800	1,398,473.800	
KIMBERLY-CLARK CORP	30,175	116.660	3,520,215.500	
BLACKROCK INC/NEW YORK	10,326	399.500	4,125,237.000	
KOHL'S CORP	14,910	66.540	992,111.400	
KROGER CO	66,610	28.480	1,897,052.800	
LAM RESEARCH CORP	13,725	144.570	1,984,223.250	
PACKAGING CORP OF AMERICA	7,057	90.870	641,269.590	
AKAMAI TECHNOLOGIES	15,452	63.130	975,484.760	
LEGGETT & PLATT INC	9,588	38.310	367,316.280	
LENNAR CORP	26,065	45.170	1,177,356.050	
JEFFERIES FINANCIAL GROUP INC	21,462	18.870	404,987.940	
ELI LILLY & CO	82,322	115.940	9,544,412.680	
L BRANDS INC	21,698	26.990	585,629.020	
LINCOLN NATIONAL CORP	18,890	54.960	1,038,194.400	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	58,932	98.910	5,828,964.120	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	28,167	69.900	1,968,873.300	
LOCKHEED MARTIN CORP	21,860	277.500	6,066,150.000	
LOEWS CORP	21,346	46.390	990,240.940	
LOWE'S COS INC	69,257	95.980	6,647,286.860	
DOMINION ENERGY INC	63,070	71.900	4,534,733.000	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	46,414	28.000	1,299,592.000	
MCCORMICK & CO INC	10,952	140.880	1,542,917.760	
MCDONALD'S CORPORATION	66,710	181.550	12,111,200.500	
S&P GLOBAL INC	21,599	177.150	3,826,262.850	
EVEREST RE GROUP LTD	3,751	214.440	804,364.440	
MANPOWERGROUP INC	6,265	70.650	442,622.250	
MARKEL CORPORATION	1,222	1,041.480	1,272,688.560	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	17,378	155.110	2,695,501.580	
MARSH & MCLENNAN COS	43,593	81.460	3,551,085.780	
MASCO CORP	28,638	32.810	939,612.780	
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	5,382	179.530	966,230.460	
MATTEL INC	24,003	11.900	285,635.700	
METLIFE INC	70,251	43.370	3,046,785.870	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	24,323	51.720	1,257,985.560	
MEDTRONIC PLC	116,237	84.840	9,861,547.080	
ACTIVISION BLIZZARD INC	62,953	51.350	3,232,636.550	



CVS HEALTH CORP	109,980	65.550	7,209,189.000	
MERCK & CO. INC.	229,279	74.480	17,076,699.920	
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	31,900	17.890	570,691.000	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	8,994	130.900	1,177,314.600	
MICROSOFT CORP	626,042	103.600	64,857,951.200	
MICRON TECH INC	101,604	35.910	3,648,599.640	
MIDDLEBY CORP	4,100	110.570	453,337.000	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	20,269	76.620	1,553,010.780	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	55,242	17.110	945,190.620	
3M CO	50,559	193.600	9,788,222.400	
MOHAWK INDUSTRIES INC	6,093	126.590	771,312.870	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	13,480	117.560	1,584,708.800	
KANSAS CITY SOUTHERN	8,856	102.470	907,474.320	
MYLAN NV	43,574	29.110	1,268,439.140	
ILLUMINA INC	12,690	309.770	3,930,981.300	
XCEL ENERGY INC	44,702	49.270	2,202,467.540	
NATIONAL OILWELL VARCO INC	33,468	28.760	962,539.680	
NETAPP INC	23,104	61.460	1,419,971.840	
NEWELL BRANDS INC	36,206	20.550	744,033.300	
NEWMONT MINING CORP	45,565	34.820	1,586,573.300	
NVR INC	307	2,563.370	786,954.590	
NIKE INC-CL B	108,754	76.420	8,310,980.680	
NOBLE ENERGY INC	39,436	22.370	882,183.320	
NORDSTROM INC	9,487	47.300	448,735.100	
NORFOLK SOUTHERN CORP	24,531	161.410	3,959,548.710	
EVERSOURCE ENERGY	27,088	66.050	1,789,162.400	
NISOURCE INC	31,548	26.670	841,385.160	
TAPESTRY INC	22,269	36.110	804,133.590	
NORTHERN TRUST CORP	17,867	84.890	1,516,729.630	
NORTHROP GRUMMAN CORP	13,967	257.660	3,598,737.220	
WELLS FARGO & CO	393,536	47.750	18,791,344.000	
NUCOR CORP	28,241	56.490	1,595,334.090	
CHENIERE ENERGY INC	19,175	65.710	1,259,989.250	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	41,783	79.950	3,340,550.850	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	65,907	66.190	4,362,384.330	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	4,917	128.070	629,720.190	
OGE ENERGY CORP	16,028	40.110	642,883.080	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	7,014	343.440	2,408,888.160	
ORACLE CORP	256,860	47.820	12,283,045.200	
PACCAR INC	29,661	59.160	1,754,744.760	
PTC INC	10,028	86.670	869,126.760	
EXELON CORP	82,176	45.790	3,762,839.040	

PARKER HANNIFIN CORP	11,023	157.960	1,741,193.080	
PAYCHEX INC	26,670	67.410	1,797,824.700	
ALIGN TECHNOLOGY INC	6,875	202.640	1,393,150.000	
PPL CORPORATION	57,297	29.570	1,694,272.290	
PEPSICO INC	121,484	108.150	13,138,494.600	
PENTAIR PLC	16,869	40.470	682,688.430	
PFIZER INC	505,099	42.310	21,370,738.690	
CONOCOPHILLIPS	99,913	67.940	6,788,089.220	
PVH CORP	6,862	98.940	678,926.280	
PG&E CORP	43,406	17.760	770,890.560	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	14,308	145.240	2,078,093.920	
ALTRIA GROUP INC	160,329	48.860	7,833,674.940	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	39,730	119.580	4,750,913.400	
POLARIS INDUSTRIES INC	5,726	84.250	482,415.500	
GARMIN LTD	10,774	66.050	711,622.700	
FLUOR CORP (NEW)	9,821	36.120	354,734.520	
PPG INDUSTRIES INC	20,371	102.650	2,091,083.150	
IPG PHOTONICS CORP	2,441	128.520	313,717.320	
COSTCO WHOLESALE CORP	37,378	210.640	7,873,301.920	
T ROWE PRICE GROUP INC	19,916	92.290	1,838,047.640	
QUEST DIAGNOSTICS	12,875	84.730	1,090,898.750	
PROCTER & GAMBLE CO	213,736	91.170	19,486,311.120	
PROGRESSIVE CORP	50,598	61.970	3,135,558.060	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	43,956	52.000	2,285,712.000	
PULTE GROUP INC	21,209	28.610	606,789.490	
GLOBAL PAYMENTS INC	13,406	110.250	1,478,011.500	
QUALCOMM INC	119,664	56.800	6,796,915.200	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	10,187	76.540	779,712.980	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	3,948	132.240	522,083.520	
REGENERON PHARMACEUTICALS	7,045	408.060	2,874,782.700	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA INC	6,079	144.310	877,260.490	
RESMED INC	12,271	115.390	1,415,950.690	
US BANCORP	131,136	47.310	6,204,044.160	
SEATTLE GENETICS INC /WA	10,269	71.000	729,099.000	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	31,422	27.120	852,164.640	
ROSS STORES INC	32,858	90.730	2,981,206.340	
ROLLINS INC	12,378	38.660	478,533.480	
ROPER TECHNOLOGIES INC	8,618	275.180	2,371,501.240	
ROCKWELL AUTOMATION INC	10,439	153.310	1,600,403.090	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	14,121	104.900	1,481,292.900	
RAYTHEON COMPANY	24,616	159.580	3,928,221.280	

ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	3,848	167.230	643,501.040	
ACCENTURE PLC-CL A	54,463	147.020	8,007,150.260	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	125,693	42.340	5,321,841.620	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	11,016	153.350	1,689,303.600	
THE TRAVELERS COMPANIES INC	23,127	120.270	2,781,484.290	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	27,213	103.830	2,825,525.790	
BOOKING HOLDINGS INC	4,042	1,677.330	6,779,767.860	
SCHLUMBERGER LTD	121,122	41.650	5,044,731.300	
SCHWAB (CHARLES) CORP	105,264	43.710	4,601,089.440	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	16,874	103.720	1,750,171.280	
BUNGE LTD	10,334	56.670	585,627.780	
SEI INVESTMENTS CO	12,294	47.420	582,981.480	
ANTHEM INC	22,172	252.270	5,593,330.440	
AMERISOURCEBERGEN CORP	14,724	76.000	1,119,024.000	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	26,093	45.920	1,198,190.560	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	7,397	399.550	2,955,471.350	
CENTENE CORP	17,128	118.420	2,028,297.760	
SVB FINANCIAL GROUP	4,852	212.470	1,030,904.440	
IAC INTERACTIVE CORP	6,938	185.330	1,285,819.540	
SMITH (A.O.) CORP	14,699	46.550	684,238.450	
ACUITY BRANDS INC	3,087	122.050	376,768.350	
SNAP-ON INC	4,935	160.110	790,142.850	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	35,083	87.310	3,063,096.730	
ADVANCE AUTO PARTS	6,330	165.070	1,044,893.100	
EDISON INTERNATIONAL	26,721	59.340	1,585,624.140	
SOUTHERN CO	86,524	46.340	4,009,522.160	
BB&T CORP	67,781	45.860	3,108,436.660	
SOUTHWEST AIRLINES	11,352	48.990	556,134.480	
AT&T INC	624,573	30.400	18,987,019.200	
CHEVRON CORP	164,712	113.450	18,686,576.400	
STANLEY BLACK & DECKER INC	13,077	132.030	1,726,556.310	
STATE STREET CORP	33,680	66.510	2,240,056.800	
STARBUCKS CORP	114,648	64.190	7,359,255.120	
STEEL DYNAMICS INC	19,030	33.400	635,602.000	
STRYKER CORP	28,706	161.340	4,631,426.040	
NETFLIX INC	37,125	324.660	12,053,002.500	
SUNTRUST BANKS INC	40,838	55.370	2,261,200.060	
SYMANTEC CORP	55,368	20.070	1,111,235.760	
KNIGHT SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	9,793	28.840	282,430.120	
SYNOPSIS INC	13,239	87.820	1,162,648.980	

SYSCO CORP	43,043	63.260	2,722,900.180	
INTUITIVE SURGICAL INC	9,901	518.070	5,129,411.070	
TELEFLEX INC	3,905	262.620	1,025,531.100	
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	80,553	18.170	1,463,648.010	
TEXAS INSTRUMENTS INC	82,547	97.720	8,066,492.840	
TEXTRON INC	19,076	47.920	914,121.920	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	34,192	238.860	8,167,101.120	
TIFFANY & CO	8,733	84.960	741,955.680	
TORCHMARK CORP	10,661	79.820	850,961.020	
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	14,384	84.780	1,219,475.520	
DAVITA INC	10,878	55.160	600,030.480	
TRACTOR SUPPLY CO	11,088	84.670	938,820.960	
TRIMBLE INC	20,073	35.300	708,576.900	
TYSON FOODS INC	24,607	57.560	1,416,378.920	
UGI CORP	14,725	55.030	810,316.750	
MARATHON OIL CORP	71,846	16.350	1,174,682.100	
UNION PACIFIC CORP	63,870	154.660	9,878,134.200	
UNITED TECHNOLOGIES CORP	70,943	110.410	7,832,816.630	
UNITEDHEALTH GROUP INC	82,823	244.870	20,280,868.010	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	7,743	125.670	973,062.810	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	8,438	124.040	1,046,649.520	
VF CORP	27,791	73.640	2,046,529.240	
CBS CORP	27,376	47.850	1,309,941.600	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	22,369	186.030	4,161,305.070	
VULCAN MATERIALS CO	12,142	103.030	1,250,990.260	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	71,945	72.480	5,214,573.600	
WALMART INC	127,054	94.960	12,065,047.840	
WASTE MANAGEMENT INC	36,986	93.190	3,446,725.340	
WATERS CORP	6,953	196.970	1,369,532.410	
ALLERGAN PLC	29,620	146.300	4,333,406.000	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	8,855	101.480	898,605.400	
VAIL RESORTS INC	3,773	214.630	809,798.990	
WESTERN DIGITAL CORP	26,076	39.810	1,038,085.560	
WABTEC CORP	7,530	73.110	550,518.300	
WHIRLPOOL CORP	5,553	122.510	680,298.030	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	16,296	68.590	1,117,742.640	
WYNN RESORTS LTD	9,240	111.400	1,029,336.000	
NASDAQ INC	9,132	80.550	735,582.600	
CME GROUP INC	30,437	179.850	5,474,094.450	
WILLIAMS COS INC	106,174	25.150	2,670,276.100	
LKQ CORP	26,690	26.190	699,011.100	
ALLIANT ENERGY CORP	19,910	42.510	846,374.100	

WEC ENERGY GROUP INC	28,063	69.450	1,948,975.350	
TD AMERITRADE HOLDING CORP	25,664	51.530	1,322,465.920	
CARMAX INC	15,979	64.610	1,032,403.190	
XEROX CORP	17,455	22.150	386,628.250	
XILINX INC	21,093	90.370	1,906,174.410	
CIMAREX ENERGY CO	9,253	70.460	651,966.380	
TJX COMPANIES INC	107,399	47.090	5,057,418.910	
ZIONS BANCORP NA	16,584	43.760	725,715.840	
DAIRY FARM INTERNATIONAL HLDNGS	27,400	9.250	253,450.000	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	76,400	6.850	523,340.000	
JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	15,700	68.690	1,078,433.000	
JARDINE STRATEGIC HOLDINGS LTD	17,100	38.080	651,168.000	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	8,192	89.160	730,398.720	
SIGNATURE BANK	4,171	109.240	455,640.040	
CBRE GROUP INC	29,499	42.090	1,241,612.910	
LIBERTY GLOBAL PLC	19,835	20.560	407,807.600	
WELLCARE HEALTH PLANS INC	4,350	243.060	1,057,311.000	
REGIONS FINANCIAL CORP	92,992	14.710	1,367,912.320	
DOMINO'S PIZZA INC	3,256	246.190	801,594.640	
WESTLAKE CHEMICAL CORP	3,000	75.740	227,220.000	
T-MOBILE US INC	27,739	67.960	1,885,142.440	
LAS VEGAS SANDS CORP	33,332	56.730	1,890,924.360	
MOSAIC CO/THE	31,433	31.570	992,339.810	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX NEWS	35,913	48.470	1,740,703.110	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC	91,784	48.850	4,483,648.400	
CELANESE CORP	11,880	94.430	1,121,828.400	
DEXCOM INC	7,665	141.900	1,087,663.500	
DISCOVERY INC-A	10,423	26.810	279,440.630	
EXPEDIA GROUP INC	10,373	114.200	1,184,596.600	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	18,475	45.050	832,298.750	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	12,493	113.440	1,417,205.920	
LIBERTY GLOBAL PLC- SERIES C	41,818	19.790	827,578.220	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	49,425	72.780	3,597,151.500	
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	14,696	19.200	282,163.200	
VIACOM INC-CLASS B	30,282	29.330	888,171.060	
LIVE NATION	13,682	53.010	725,282.820	

CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,224	509.620	1,133,394.880	
UNITED CONTINENTAL HOLIDINGS INC	6,191	81.370	503,761.670	
TRANSDIGM GROUP INC	4,312	349.890	1,508,725.680	
MASTERCARD INC	79,564	196.950	15,670,129.800	
QURATE RETAIL INC	35,733	20.870	745,747.710	
HANESBRANDS INC	27,619	13.620	376,170.780	
WESTERN UNION CO	35,222	17.410	613,215.020	
OWENS CORNING	7,333	46.750	342,817.750	
LEIDOS HOLDINGS INC	13,182	54.910	723,823.620	
AERCAP HOLDINGS NV	11,586	44.410	514,534.260	
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLDINGS INC	9,175	77.710	712,989.250	
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT-ADR	18,099	19.810	358,541.190	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	10,519	99.120	1,042,643.280	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	29,653	15.130	448,649.890	
DELTA AIR LINES INC	13,898	48.730	677,249.540	
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	6,354	47.070	299,082.780	
DISCOVER FINANCIAL	29,057	62.490	1,815,771.930	
TE CONNECTIVITY LTD	29,610	78.120	2,313,133.200	
CONCHO RESOURCES INC/MIDLAND TX	17,807	122.330	2,178,330.310	
WABCO HOLDING INC	4,076	110.060	448,604.560	
LULULEMON ATHLETICA INC	7,883	131.610	1,037,481.630	
VMWARE INC	6,648	148.880	989,754.240	
MERCADOLIBRE INC	3,750	339.590	1,273,462.500	
ULTA BEAUTY INC	5,020	277.030	1,390,690.600	
INVESCO LTD	42,125	17.550	739,293.750	
MSCI INC	7,537	153.940	1,160,245.780	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	134,139	68.150	9,141,572.850	
VISA INC	152,977	138.670	21,213,320.590	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	15,933	90.760	1,446,079.080	
DISCOVERY INC-C	29,484	24.940	735,330.960	
MARATHON PETROLEUM CORP	59,929	63.630	3,813,282.270	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	11,624	42.580	494,949.920	
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	166,114	17.360	2,883,739.040	
XYLEM INC	15,111	68.910	1,041,299.010	
ALKERMES PLC	12,053	32.480	391,481.440	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	28,987	87.400	2,533,463.800	

HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,479	192.530	669,811.870	
SPLUNK INC	12,240	116.700	1,428,408.000	
HCA HEALTHCARE INC	24,178	129.750	3,137,095.500	
VERISK ANALYTICS INC	13,405	112.640	1,509,939.200	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	5,474	130.480	714,247.520	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	7,443	190.060	1,414,616.580	
FIRST REPUBLIC BANK/SAN FRANCISCO CA	13,676	86.050	1,176,819.800	
CIT GROUP INC	9,287	41.760	387,825.120	
NXP SEMICONDUCTOR NV	28,555	80.030	2,285,256.650	
TARGA RESOURCES CORP	21,417	42.830	917,290.110	
LEAR CORP	5,132	145.300	745,679.600	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	10,084	91.550	923,190.200	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	17,000	47.510	807,670.000	
DOLLAR GENERAL CORP	22,291	116.520	2,597,347.320	
FORTINET INC	11,399	73.210	834,520.790	
AON PLC	20,942	147.630	3,091,667.460	
TESLA INC	10,991	344.970	3,791,565.270	
GENERAL MOTORS CO	110,050	34.730	3,822,036.500	
WORLDPAY INC	26,592	78.930	2,098,906.560	
XPO LOGISTICS INC	12,825	62.790	805,281.750	
TRIPADVISOR INC	9,263	57.560	533,178.280	
ALLY FINANCIAL INC	39,819	24.270	966,407.130	
CAPRI HOLDINGS LTD	12,138	40.280	488,918.640	
VOYA FINANCIAL INC	13,525	42.150	570,078.750	
APTIV PLC	22,571	70.230	1,585,161.330	
PHILLIPS 66	38,115	92.940	3,542,408.100	
FACEBOOK INC	207,494	144.200	29,920,634.800	
IQVIA HOLDINGS INC	13,426	123.360	1,656,231.360	
DIAMONDBACK ENERGY INC	13,109	106.130	1,391,258.170	
SERVICENOW INC	15,071	190.000	2,863,490.000	
PALO ALTO NETWORKS INC	7,935	196.000	1,555,260.000	
WORKDAY INC	12,376	167.960	2,078,672.960	
ABBVIE INC	128,907	88.200	11,369,597.400	
ZOETIS INC	42,209	85.900	3,625,753.100	
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDINGS LTD	19,821	46.170	915,135.570	
COTY INC	38,541	7.190	277,109.790	
NEWS CORP/NEW-CL A	30,263	12.180	368,603.340	
HD SUPPLY HOLDINGS INC	12,891	38.190	492,307.290	
CDW CORP	13,040	81.940	1,068,497.600	
SPRINT CORP	63,882	6.280	401,178.960	
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	10,199	32.040	326,775.960	
ARCONIC INC	36,761	19.610	720,883.210	

LIBERTY MEDIA CORP- LIBERTY-C	17,852	32.190	574,655.880	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	5,006	37.990	190,177.940	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-C	17,931	38.200	684,964.200	
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	15,410	17.550	270,445.500	
BAKER HUGHES A GE CO	43,404	23.350	1,013,483.400	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	12,611	69.860	881,004.460	
TECHNIPFMC LTD	38,724	22.680	878,260.320	
BROADCOM INC	36,734	249.520	9,165,867.680	
BURLINGTON STORES INC	6,007	164.300	986,950.100	
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	9,985	33.530	334,797.050	
ANTERO RESOURCES CORP	13,163	10.660	140,317.580	
VEEVA SYSTEMS INC	10,852	97.970	1,063,170.440	
TWITTER INC	56,256	33.090	1,861,511.040	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING PLC	17,181	45.070	774,347.670	
EVERGY INC	24,427	56.860	1,388,919.220	
PLAINS GP HOLDINGS LP	14,935	23.640	353,063.400	
COMMScope HOLDING CO INC	12,920	18.730	241,991.600	
ALLEGION PLC	7,325	82.200	602,115.000	
WIX.COM LTD	4,000	99.890	399,560.000	
PERRIGO CO PLC	10,553	43.900	463,276.700	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	23,927	72.070	1,724,418.890	
ARAMARK	21,772	30.930	673,407.960	
CIGNA CORP	32,831	191.780	6,296,329.180	
DELL TECHNOLOGIES INC	29,960	45.190	1,353,892.400	
GRUBHUB INC	8,158	80.970	660,553.260	
SABRE CORP	25,826	22.610	583,925.860	
PARSLEY ENERGY INC	17,454	19.010	331,800.540	
ARISTA NETWORKS INC	4,441	217.960	967,960.360	
IHS MARKIT LTD	34,991	49.890	1,745,700.990	
FNF GROUP	20,660	34.010	702,646.600	
SYNCHRONY FINANCIAL	60,568	25.750	1,559,626.000	
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	40,320	32.240	1,299,916.800	
CDK GLOBAL INC	12,715	49.600	630,664.000	
WAYFAIR INC	5,091	99.230	505,179.930	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	17,479	67.260	1,175,637.540	
QORVO INC	10,887	61.860	673,469.820	
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	16,089	25.300	407,051.700	
LIBERTY BROADBAND CORP-C W/I	10,018	75.590	757,260.620	
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	23,155	25.020	579,338.100	
GODADDY INC	14,641	63.920	935,852.720	
NIELSEN HOLDINGS PLC	26,840	25.610	687,372.400	



TRANSUNION	17,208	56.690	975,521.520	
SQUARE INC	26,820	66.100	1,772,802.000	
DOWDUPONT INC	199,338	55.680	11,099,139.840	
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS PLC	17,100	46.800	800,280.000	
WESTROCK CO	22,394	40.290	902,254.260	
KRAFT HEINZ CO	50,303	45.600	2,293,816.800	
FORTIVE CORP	26,779	69.880	1,871,316.520	
WASTE CONNECTIONS INC	23,491	77.220	1,813,975.020	
ALPHABET INC-CL A	25,719	1,078.830	27,746,428.770	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	125,608	14.130	1,774,841.040	
PAYPAL HOLDINGS INC	95,755	90.700	8,684,978.500	
AXA EQUITABLE HOLDINGS INC	23,220	18.060	419,353.200	
FIRST DATA CORP	44,487	17.550	780,746.850	
DXC TECHNOLOGY CO	23,734	60.630	1,438,992.420	
ZILLOW GROUP INC-C	8,134	33.890	275,661.260	
ALPHABET INC-CL C	27,012	1,070.330	28,911,753.960	
BEIGENE LTD ADR	2,000	142.370	284,740.000	
L3 TECHNOLOGIES INC	6,752	173.200	1,169,446.400	
CHEMOURS CO	12,723	33.590	427,365.570	
LINDE PLC	46,815	161.850	7,577,007.750	
ATHENE HOLDING LTD	11,784	41.870	493,396.080	
CHARTER COMMUNICATIONS INC	14,227	292.670	4,163,816.090	
VISTRA ENERGY CORP	30,000	24.110	723,300.000	
アメリカ・ドル 小計	26,041,737		1,917,253,863.460 (207,964,526,569)	
イギリス・ポンド				
ANTOFAGASTA PLC	46,324	8.436	390,789.260	
ASHTED GROUP	42,154	18.845	794,392.130	
SEVERN TRENT PLC	25,530	18.515	472,687.950	
BHP GROUP PLC	182,343	16.166	2,947,756.930	
BARCLAYS PLC	1,506,906	1.593	2,400,501.250	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	103,764	4.892	507,613.480	
BT GROUP PLC	696,796	2.335	1,627,018.660	
BUNZL PLC	32,652	24.420	797,361.840	
EASYJET PLC	13,628	11.420	155,631.760	
AVIVA PLC	350,451	3.959	1,387,435.500	
CRODA INTERNATIONAL	10,645	49.390	525,756.550	
DIAGEO PLC	212,915	27.335	5,820,031.520	
SCHRODERS PLC	10,932	26.460	289,260.720	
DCC PLC	9,753	65.150	635,407.950	
NATIONAL GRID PLC	293,775	8.014	2,354,312.850	
KINGFISHER PLC	165,680	2.275	376,922.000	
BAE SYSTEMS PLC	268,920	4.914	1,321,472.880	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	196,028	25.050	4,910,501.400	
NEXT PLC	12,064	47.870	577,503.680	

IMPERIAL BRANDS PLC	84,312	24.195	2,039,928.840	
JOHNSON MATTHEY PLC	15,017	29.540	443,602.180	
ANGLO AMERICAN PLC	88,044	18.082	1,592,011.600	
COMPASS GROUP PLC	139,409	16.755	2,335,797.790	
HSBC HOLDINGS PLC	1,719,571	6.514	11,201,285.490	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	508,463	2.419	1,229,971.990	
CENTRICA PLC	471,340	1.328	625,939.520	
UNILEVER PLC	96,785	40.920	3,960,442.200	
MEGGITT PLC	62,181	4.881	303,505.460	
MORRISON <WM.> SUPERMARKETS	230,551	2.196	506,289.990	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	54,487	7.682	418,569.130	
RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	80,864	5.294	428,094.010	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	30,240	22.470	679,492.800	
PEARSON PLC	65,009	10.215	664,066.930	
PERSIMMON PLC	30,957	21.110	653,502.270	
PRUDENTIAL PLC	221,979	14.495	3,217,585.600	
RIO TINTO PLC	99,624	38.825	3,867,901.800	
VODAFONE GROUP PLC	2,332,041	1.537	3,584,347.010	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	58,278	60.970	3,553,209.660	
RELX PLC	173,666	16.415	2,850,727.390	
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	138,993	8.598	1,195,061.810	
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	389,955	2.241	873,889.150	
ST JAMES'S PLACE PLC	40,884	9.864	403,279.770	
SSE PLC	84,479	11.520	973,198.080	
BP PLC	1,703,037	5.270	8,975,004.990	
SAGE GROUP PLC(THE)	85,271	6.210	529,532.910	
SMITHS GROUP PLC	31,720	14.400	456,768.000	
STANDARD CHARTERED PLC	234,243	6.210	1,454,649.030	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	6,133,835	0.547	3,355,207.740	
TAYLOR WIMPLEY PLC	253,022	1.489	376,749.750	
TESCO PLC	877,157	2.164	1,898,167.740	
3I GROUP PLC	88,662	8.230	729,688.260	
SMITH & NEPHEW PLC	74,903	14.460	1,083,097.380	
GLAXOSMITHKLINE PLC	422,951	15.360	6,496,527.360	
WEIR GROUP	18,336	14.200	260,371.200	
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	26,266	42.700	1,121,558.200	
BABCOCK INT'L GROUP	21,302	5.234	111,494.660	
WPP PLC	107,494	8.800	945,947.200	
FERGUSON PLC	21,079	52.750	1,111,917.250	
ASTRAZENECA PLC	107,885	59.230	6,390,028.550	
WHITBREAD PLC	15,639	49.650	776,476.350	

CARNIVAL PLC	13,153	40.340	530,592.020		
MARKS & SPENCER GROUP PLC	120,290	2.745	330,196.050		
JOHN WOOD GROUP PLC	48,988	5.944	291,184.670		
INTERTEK GROUP PLC	14,335	50.600	725,351.000		
BURBERRY GROUP PLC	38,727	17.420	674,624.340		
INVESTEC PLC	50,655	4.772	241,725.660		
INTERCONTINENTAL HOTELS	15,922	42.660	679,232.520		
ITV PLC	370,908	1.373	509,256.680		
SAINSBURY (J) PLC	137,215	2.760	378,713.400		
RANDGOLD RESOURCES LTD NPR	6,998	65.460	458,089.080		
G4S PLC	122,250	2.095	256,113.750		
ADMIRAL GROUP PLC	15,893	20.370	323,740.410		
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	10,726	37.350	400,616.100		
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	395,585	23.920	9,462,393.200		
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	324,753	24.185	7,854,151.300		
TUI AG-DI	45,043	11.965	538,939.490		
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	214,715	2.694	578,442.210		
EXPERIAN PLC	80,395	19.125	1,537,554.370		
MONDI PLC	28,318	17.715	501,653.370		
HARGREAVES LANSDOWN PLC	21,290	18.775	399,719.750		
FRESNILLO PLC NPR	15,639	9.496	148,507.940		
INFORMA PLC	102,475	6.482	664,242.950		
GLENCORE PLC	982,806	2.951	2,900,260.500		
GVC HOLDINGS PLC	49,618	7.275	360,970.950		
NMC HEALTH PLC	8,149	29.300	238,765.700		
DIRECT LINE INSURANCE GROUP PLC	112,694	3.238	364,903.170		
COCA-COLA HBC AG	19,447	24.790	482,091.130		
CONVATEC GROUP PLC	118,400	1.425	168,720.000		
ROYAL MAIL PLC	55,060	2.831	155,874.860		
MERLIN ENTERTAINMENTS PLC	50,037	3.272	163,721.060		
MICRO FOCUS INTERNATIONAL PLC	32,342	15.000	485,130.000		
AUTO TRADER GROUP PLC	76,348	4.466	340,970.160		
MELROSE INDUSTRIES PLC	417,620	1.767	737,934.540		
イギリス・ボンド 小計	25,737,985		145,851,627.680 (20,159,611,978)		
イスラエル・シュケル	BANK HAPOLIM BM	78,428	23.770	1,864,233.560	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	128,049	22.950	2,938,724.550	
	BEZEQ ISRAELI TELECOMMUNICATION CORP LTD	188,230	3.450	649,393.500	

	ELBIT SYSTEMS LTD	1,760	454.000	799,040.000	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	49,411	21.000	1,037,631.000	
	NICE LTD	6,065	391.200	2,372,628.000	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	10,444	65.620	685,335.280	
	AZRIELI GROUP	4,428	186.100	824,050.800	
イスラエル・シュケル 小計		466,815		11,171,036.690 (329,992,424)	
オーストラリア・ ドル	RAMSAY HEALTH CARE LTD	11,115	58.810	653,673.150	
	AUST AND NZ BANKING GROUP LT	239,374	25.330	6,063,343.420	
	AMCOR LTD	110,142	13.350	1,470,395.700	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	293,260	25.850	7,580,771.000	
	BANK OF QUEENSLAND LTD	30,569	10.240	313,026.560	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	114,125	4.570	521,551.250	
	TELSTRA CORP LTD	360,654	2.890	1,042,290.060	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD	39,014	10.920	426,032.880	
	AMP LTD	302,414	2.560	774,179.840	
	ASX LTD	15,573	62.220	968,952.060	
	BHP GROUP LTD	251,325	33.140	8,328,910.500	
	CALTEX AUSTRALIA LTD	20,946	26.510	555,278.460	
	HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	22,182	3.260	72,313.320	
	COMPUTERSHARE LT	38,040	17.380	661,135.200	
	CSL LIMITED	37,602	196.470	7,387,664.940	
	REA GROUP LTD	4,119	73.460	302,581.740	
	TRANSURBAN GROUP	223,354	11.840	2,644,511.360	
	COCA-COLA AMATIL LTD	48,601	8.150	396,098.150	
	COCHLEAR LTD	6,524	184.670	1,204,787.080	
	ORIGIN ENERGY LTD	163,057	6.950	1,133,246.150	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	149,602	72.450	10,838,664.900	
	BORAL LIMITED	86,101	5.090	438,254.090	
	RIO TINTO LIMITED	32,562	80.130	2,609,193.060	
	APA GROUP	116,193	9.070	1,053,870.510	
	ARISTOCRAT LEISU	43,933	23.090	1,014,412.970	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	206,789	6.990	1,445,455.110	
	TPG TELECOM LTD	28,719	6.510	186,960.690	
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	3,275	43.510	142,495.250		
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	46,091	15.300	705,192.300		
ORICA LTD	25,308	17.420	440,865.360		
CIMIC GROUP LTD	8,709	44.380	386,505.420		
BLUESCOPE STEEL LTD	36,941	12.230	451,788.430		

	SYDNEY AIRPORT	85,130	6.670	567,817.100	
	MACQUARIE GROUP LTD	28,250	113.950	3,219,087.500	
	WORLEYPARSONS LTD	35,828	13.390	479,736.920	
	SUNCORP GROUP LTD	107,913	12.380	1,335,962.940	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	234,196	24.600	5,761,221.600	
	NEWCREST MINING LTD	69,638	23.900	1,664,348.200	
	OIL SEARCH LTD	138,806	7.630	1,059,089.780	
	INCITEC PIVOT LTD	136,426	3.520	480,219.520	
	QBE INSURANCE GROUP LIMITED	129,436	10.450	1,352,606.200	
	CHALLENGER FINANCIAL SERVICES	45,707	9.340	426,903.380	
	SANTOS LTD	133,862	5.850	783,092.700	
	SONIC HEALTHCARE	43,041	21.900	942,597.900	
	WASHINGTON H SOUL PATTINSON & CO LTD	5,000	26.560	132,800.000	
	TABCORP HOLDINGS LTD	194,274	4.540	882,003.960	
	WESFARMERS LTD	96,821	31.970	3,095,367.370	
	ALUMINA LIMITED	184,613	2.320	428,302.160	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	79,115	33.370	2,640,067.550	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	110,022	29.870	3,286,357.140	
	SEEK LTD	25,899	17.330	448,829.670	
	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES LTD	4,581	41.220	188,828.820	
	AUSNET SERVICES	165,066	1.585	261,629.610	
	AGL ENERGY LTD	60,649	21.020	1,274,841.980	
	BRAMBLES LTD	144,062	10.480	1,509,769.760	
	CROWN RESORTS LTD	32,861	12.110	397,946.710	
	AURIZON HOLDINGS LTD	139,184	4.390	611,017.760	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	69,179	14.245	985,454.850	
	MEDIBANK PVT LTD	273,424	2.560	699,965.440	
	SOUTH32 LTD(AUD)	443,160	3.430	1,520,038.800	
	COLES GROUP LTD	96,821	11.660	1,128,932.860	
	オーストラリア・ドル 小計	6,429,177		99,779,239.090 (7,782,780,649)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	20,281	52.510	1,064,955.310	
	ALIMENTATION COUCHE TARD INC	36,030	70.570	2,542,637.100	
	BARRICK GOLD CORP	96,442	16.370	1,578,755.540	
	ATCO LTD	7,193	39.600	284,842.800	
	BANK OF MONTREAL	55,083	92.470	5,093,525.010	
	BANK OF NOVA SCOTIA	104,973	71.200	7,474,077.600	
	NATIONAL BANK OF CANADA	28,553	59.240	1,691,479.720	
	BCE INC	11,568	55.140	637,859.520	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT	74,072	53.860	3,989,517.920	
	BAUSCH HEALTH COS INC	25,819	29.800	769,406.200	

BOMBARDIER INC 'B'	151,615	2.230	338,101.450	
SAPUTO INC	18,601	39.930	742,737.930	
BLACKBERRY LTD	39,652	9.960	394,933.920	
CGI GROUP INC	22,736	86.380	1,963,935.680	
CCL INDUSTRIES INC	11,340	53.220	603,514.800	
CAE INC	23,000	26.320	605,360.000	
CAMECO CORP	32,627	16.260	530,515.020	
ROGERS COMM-CL B	30,822	71.920	2,216,718.240	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	38,586	105.790	4,082,012.940	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	108,040	35.600	3,846,224.000	
CANADIAN TIRE CORP-CL A	4,862	147.150	715,443.300	
CANADIAN UTILITIES LTD	9,119	32.540	296,732.260	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	63,781	106.420	6,787,574.020	
FIRST CAPITAL REALTY INC	11,417	19.610	223,887.370	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	20,176	42.180	851,023.680	
OPEN TEXT CORP	25,788	45.660	1,177,480.080	
EMPIRE CO LTD	15,093	29.770	449,318.610	
KINROSS GOLD CORP	99,741	4.190	417,914.790	
FINNING INTERNATIONAL INC	9,892	25.200	249,278.400	
FORTIS INC	36,000	45.460	1,636,560.000	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	55,296	10.990	607,703.040	
TELUS CORP	15,945	45.350	723,105.750	
GREAT WEST LIFECO INC	27,766	28.780	799,105.480	
IMPERIAL OIL LTD	21,542	35.420	763,017.640	
ENBRIDGE INC	172,777	45.900	7,930,464.300	
IGM FINANCIAL INC	8,426	32.480	273,676.480	
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	87,995	2.110	185,669.450	
MANULIFE FINANCIAL CORP	173,640	20.600	3,576,984.000	
LOBLAW CO LTD	15,354	62.890	965,613.060	
MAGNA INTERNATIONAL INC	28,590	66.270	1,894,659.300	
SUN LIFE FINANCIAL INC	52,457	46.830	2,456,561.310	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,419	600.000	1,451,400.000	
METRO INC	19,226	47.710	917,272.460	
HUSKY ENERGY INC	28,749	15.030	432,097.470	
EMERA INC	6,509	44.540	289,910.860	
METHANEX CORP	5,281	73.850	390,001.850	
ONEX CORP	6,646	74.530	495,326.380	
GOLDCORP INC	81,902	12.780	1,046,707.560	
POWER CORP OF CANADA	37,942	25.610	971,694.620	
POWER FINANCIAL CORP	27,773	26.550	737,373.150	
ROYAL BANK OF CANADA	123,507	96.620	11,933,246.340	
SNC-LAVALIN GROUP INC	13,134	47.800	627,805.200	

	CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	11,916	251.370	2,995,324.920	
	SHAW COMM INC-B	35,748	25.820	923,013.360	
	SUNCOR ENERGY INC	142,403	40.640	5,787,257.920	
	LUNDIN MINING CORP	71,805	5.880	422,213.400	
	ENCANA CORP	87,517	8.760	766,648.920	
	TECK RESOURCES LTD-CL B	41,016	30.180	1,237,862.880	
	THOMSON REUTERS CORP	15,772	64.720	1,020,763.840	
	TORONTO DOMINION BANK (THE) C\$	157,419	68.800	10,830,427.200	
	TRANSCANADA CORP	76,327	53.820	4,107,919.140	
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	5,696	72.270	411,649.920	
	WESTON (GEORGE) LTD	8,239	92.760	764,249.640	
	INTACT FINANCIAL CORP	12,716	100.590	1,279,102.440	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	42,447	25.510	1,082,822.970	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,729	911.030	1,575,170.870	
	FRANCO-NEVADA CORP NPR	16,887	92.540	1,562,722.980	
	CI FINANCIAL CORP	20,695	17.730	366,922.350	
	TOURMALINE OIL CORP	27,410	18.250	500,232.500	
	KEYERA CORP	23,206	28.130	652,784.780	
	ALTAGAS LTD	23,944	14.100	337,610.400	
	PEMBINA PIPELINE CORP	43,784	43.760	1,915,987.840	
	DOLLARAMA INC	28,295	34.300	970,518.500	
	STARS GROUP INC	18,529	24.880	461,001.520	
	CENOVUS ENERGY INC W/I	80,545	10.850	873,913.250	
	VERMILION ENERGY INC	12,923	31.560	407,849.880	
	ARC RESOURCES LTD	22,997	9.260	212,952.220	
	INTER PIPELINE LTD	38,609	21.240	820,055.160	
	NUTRIEN LTD	54,224	66.280	3,593,966.720	
	WSP GLOBAL INC	8,400	62.450	524,580.000	
	IA FINANCIAL CORP INC	12,997	47.300	614,758.100	
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	14,961	18.850	282,014.850	
	SEVEN GENERATIONS ENERGY LTD	17,231	11.320	195,054.920	
	RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	20,664	73.350	1,515,704.400	
	AURORA CANNABIS INC	50,000	7.880	394,000.000	
	SHOPIFY INC	7,671	195.960	1,503,209.160	
	CANOPY GROWTH CORP	15,000	49.820	747,300.000	
	HYDRO ONE LTD	27,340	20.700	565,938.000	
	カナダ・ドル 小計	3,542,840		144,949,223.860 (11,877,139,404)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE TECH ENG	125,000	3.600	450,000.000	
	SEMBCORP INDUSTRIES	81,400	2.690	218,966.000	

	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	123,700	2.490	308,013.000	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	692,140	0.260	179,956.400	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	158,100	24.440	3,863,964.000	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	29,000	8.700	252,300.000	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	5,944	36.520	217,074.880	
	SINGAPORE AIRPORT TERMINAL SERVICES LTD	42,300	4.940	208,962.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	68,900	7.330	505,037.000	
	CAPITALAND LTD	192,415	3.270	629,197.050	
	GENTING SINGAPORE LTD	416,400	1.040	433,056.000	
	KEPPEL CORP LTD	168,400	6.220	1,047,448.000	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	177,900	2.200	391,380.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	267,053	11.610	3,100,485.330	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	734,322	3.040	2,232,338.880	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	47,500	9.650	458,375.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	120,500	25.800	3,108,900.000	
	UOL GROUP LIMITED	40,500	6.450	261,225.000	
	VENTURE CORP LTD	21,000	14.910	313,110.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	142,300	3.250	462,475.000	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	188,800	1.300	245,440.000	
シンガポール・ドル	小計	3,843,574		18,887,703.540 (1,516,115,963)	
スイス・フラン	CREDIT SUISSE GROUP AG	218,040	11.560	2,520,542.400	
	NESTLE SA-REGISTERED	264,031	83.040	21,925,134.240	
	CIE FINANC RICHEMONT	46,547	65.800	3,062,792.600	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	60,583	256.000	15,509,248.000	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,607	206.400	744,484.800	
	SIKA INHABER	11,291	129.500	1,462,184.500	
	SGS SA-REG	484	2,311.000	1,118,524.000	
	NOVARTIS AG-REG SHS	187,505	86.360	16,192,931.800	
	BALOISE HOLDING AG -R	4,127	143.800	593,462.600	
	BARRY CALLEBAUT AG	144	1,545.000	222,480.000	
	CLARIANT AG-REG	19,496	19.190	374,128.240	
	SWISSCOM AG-REG	2,280	481.000	1,096,680.000	
	ABB LTD	162,358	19.485	3,163,545.630	
	ADECCO GROUP AG-REG	12,341	49.250	607,794.250	
	GEBERIT AG	3,243	371.100	1,203,477.300	
	LONZA GROUP AG-REG	6,228	286.100	1,781,830.800	
	LINDT & SPRUENGLI PART	105	6,050.000	635,250.000	
	LINDT & SPRUENGLI NAMEN	9	72,200.000	649,800.000	
	GIVAUDAN-REG	771	2,345.000	1,807,995.000	



	ZURICH INSURANCE GROUP AG	13,046	303.600	3,960,765.600	
	LAFARGEHOLCIM LTD	40,615	43.750	1,776,906.250	
	TEMENOS GROUP	4,521	121.100	547,493.100	
	SONOVA HOLDING AG	4,142	165.300	684,672.600	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG	5,105	132.450	676,157.250	
	STRAUMANN HOLDING AG	782	644.500	503,999.000	
	THE SWATCH GROUP AG-B	2,691	296.900	798,957.900	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	4,592	59.050	271,157.600	
	SCHINDLER NAMEN	1,663	203.000	337,589.000	
	SWISS LIFE HOLDING AG	3,119	399.300	1,245,416.700	
	VIFOR PHARMA AG	4,583	115.300	528,419.900	
	EMS-CHEMIE HOLDING	553	491.200	271,633.600	
	SWISS PRIME SITE AG	5,990	82.600	494,774.000	
	PARGESA HOLDING PORTEUR	3,000	75.650	226,950.000	
	DUFREY GROUP	2,390	99.400	237,566.000	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,505	635.500	956,427.500	
	JULIUS BAER GROUP LTD	17,849	38.340	684,330.660	
	SWISS RE LTD	25,316	93.360	2,363,501.760	
	UBS GROUP AG	336,464	12.880	4,333,656.320	
	スイス・フラン 小計	1,481,116		95,572,660.900 (10,534,974,411)	
スウェーデン・ク ローナ	ATLAS COPCO AB-A SHS	57,191	224.950	12,865,115.450	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	30,899	207.800	6,420,812.200	
	ERICSSON LM-B SHS	271,783	78.300	21,280,608.900	
	LUNDBERGS B	7,382	273.600	2,019,715.200	
	SKF AB-B SHS	37,198	145.000	5,393,710.000	
	SANDVIK AB	96,746	134.000	12,963,964.000	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	147,588	90.060	13,291,775.280	
	SKANSKA AB-B SHS	32,547	151.750	4,939,007.250	
	SWEDBANK AB	74,223	208.400	15,468,073.200	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	126,539	100.650	12,736,150.350	
	VOLVO AB-B SHS	129,013	121.050	15,617,023.650	
	SWEDISH MATCH AB	16,488	377.800	6,229,166.400	
	TELE2 AB-B SHS	44,876	112.000	5,026,112.000	
	INDUSTRIVARDEN C	11,403	184.500	2,103,853.500	
	ELECTROLUX AB-SER B	19,191	201.600	3,868,905.600	
	SECURITAS AB-B SHS	24,098	142.700	3,438,784.600	
	INVESTOR AB-B SHS	37,657	394.100	14,840,623.700	
	HENNES&MAURITZ AB-B SHS	77,779	135.180	10,514,165.220	
	ASSA ABLOY AB-B	88,327	159.450	14,083,740.150	
	TELIA CO AB	267,889	42.870	11,484,401.430	
	LUNDIN PETROLEUM AB	16,790	252.600	4,241,154.000	
	BOLIDEN AB	21,855	206.000	4,502,130.000	
	ALFA LAVAL AB	23,343	197.250	4,604,406.750	

	KINNEVIK AB-B	18,310	226.800	4,152,708.000	
	MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR SA	5,332	610.000	3,252,520.000	
	ICA GRUPPEN AB	5,920	324.200	1,919,264.000	
	HUSQVARNA AB-B SHS	33,692	69.300	2,334,855.600	
	HEXAGON AB	22,037	415.200	9,149,762.400	
	EPIROC AB-A	63,358	83.940	5,318,270.520	
	EPIROC AB-B	30,899	79.650	2,461,105.350	
	ESSITY AB-B	52,522	227.800	11,964,511.600	
	NORDEA BANK ABP	267,838	79.960	21,416,326.480	
スウェーデン・クローナ 小計		2,160,713		269,902,722.780 (3,290,114,191)	
デンマーク・ク ローネ	CARLSBERG AS-B	9,644	703.200	6,781,660.800	
	A P MOLLER A/S	604	8,882.000	5,364,728.000	
	AP MOLLER MAERSK A	273	8,300.000	2,265,900.000	
	DANSKE BANK A/S	61,114	127.750	7,807,313.500	
	GENMAB A/S	5,622	1,084.500	6,097,059.000	
	NOVOZYMES-B SHS	19,111	306.600	5,859,432.600	
	NOVO NORDISK A/S-B	154,973	314.550	48,746,757.150	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	15,808	506.000	7,998,848.000	
	COLOPLAST-B	11,212	601.600	6,745,139.200	
	DSV A/S	17,123	474.200	8,119,726.600	
	WILLIAM DEMANT	6,537	202.400	1,323,088.800	
	H LUNDBECK A/S	4,840	294.200	1,423,928.000	
	TRYG A/S	11,107	164.600	1,828,212.200	
	PANDORA A/S	8,251	276.400	2,280,576.400	
	CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S	7,708	623.000	4,802,084.000	
ISS A/S	16,240	189.800	3,082,352.000		
ORSTED A/S	17,249	445.700	7,687,879.300		
デンマーク・クローネ 小計		367,416		128,214,685.550 (2,143,749,542)	
ニュージーラン ド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	114,550	7.280	833,924.000	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	29,894	10.980	328,236.120	
	A2 MILK CO LTD	55,091	11.360	625,833.760	
	FISHER & PAYKEL	42,678	13.500	576,153.000	
	FLETCHER BUILDING LTD	64,104	4.970	318,596.880	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	159,623	4.160	664,031.680	
	MERIDIAN ENERGY LTD	90,173	3.600	324,622.800	
ニュージーランド・ドル 小計		556,113		3,671,398.240 (270,214,911)	
ノルウェー・ク ローネ	MOWI ASA	33,000	184.600	6,091,800.000	
	DNB ASA	79,783	148.100	11,815,862.300	
	NORSK HYDRO ASA	137,190	40.710	5,585,004.900	
	TELENOR ASA	62,076	167.850	10,419,456.600	
	ORKLA ASA	61,421	69.480	4,267,531.080	

	EQUINOR ASA	98,397	191.750	18,867,624.750	
	YARA INTERNATIONAL ASA	16,000	366.100	5,857,600.000	
	AKER BP ASA	8,552	254.400	2,175,628.800	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	16,683	135.200	2,255,541.600	
	SCHIBSTED ASA	7,445	289.500	2,155,327.500	
ノルウェー・クローネ 小計		520,547		69,491,377.530 (888,794,719)	
ユーロ	CRH PLC	71,394	24.560	1,753,436.640	
	PADDY POWER BETFAIR PLC	6,246	73.300	457,831.800	
	KERRY GROUP PLC-A	13,865	93.600	1,297,764.000	
	KINGSPAN GROUP PLC	14,756	37.900	559,252.400	
	UMICORE	19,109	36.820	703,593.380	
	AIR LIQUIDE	37,092	104.000	3,857,568.000	
	AIRBUS SE	49,776	89.610	4,460,427.360	
	AXA	165,252	19.508	3,223,736.010	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	49,632	18.250	905,784.000	
	ADIDAS AG	16,356	195.500	3,197,598.000	
	ASSICURAZIONI GENERALI	104,014	14.790	1,538,367.060	
	DASSAULT AVIATION SA	274	1,226.000	335,924.000	
	DANONE	54,023	61.760	3,336,460.480	
	SAFRAN SA	29,268	105.600	3,090,700.800	
	INTESA SANPAOLO	1,255,372	2.021	2,537,106.810	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	28,171	72.530	2,043,242.630	
	ACCOR SA	16,000	37.650	602,400.000	
	BOUYGUES	22,276	30.430	677,858.680	
	BNP PARIBAS	96,988	41.215	3,997,360.420	
	THALES SA	9,883	103.600	1,023,878.800	
	CAPGEMINI SA	13,759	90.900	1,250,693.100	
	CASINO GUICHARD PERRACHON	4,264	36.000	153,504.000	
	INGENICO GROUP	4,334	52.400	227,101.600	
	UNICREDIT SPA	170,144	10.508	1,787,873.150	
	NATIXIS	70,166	4.298	301,573.460	
	KONINKLIJKE DSM NV	15,111	75.760	1,144,809.360	
	COMMERZBANK AG	83,118	6.280	521,981.040	
	EIFFAGE	5,949	74.680	444,271.320	
	FRESENIUS SE & CO KGAA	34,640	44.220	1,531,780.800	
	UNITED INTERNET	9,882	37.200	367,610.400	
	FUCHS PETROLUB SE PREF	5,546	38.060	211,080.760	
	PUBLICIS GROUPE	18,222	52.780	961,757.160	
	FAURECIA	6,117	35.090	214,645.530	
IBERDROLA SA	520,730	6.902	3,594,078.460		
ENI SPA	222,205	14.242	3,164,643.610		
IMERYS SA	2,256	45.520	102,693.120		
JERONIMO MARTINS	19,517	10.680	208,441.560		
KBC GROUPE	20,803	58.520	1,217,391.560		
HANNOVER RUECK SE	4,868	122.600	596,816.800		

WARTSILA OYJ	34,935	14.270	498,522.450	
L'OREAL	21,581	198.150	4,276,275.150	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	23,750	259.150	6,154,812.500	
GEA GROUP AG	11,838	24.110	285,414.180	
BOLLORE	71,347	3.650	260,416.550	
MEDIOBANCA SPA	62,022	7.658	474,964.470	
MICHELIN(CGDE)-B	15,018	89.220	1,339,905.960	
CONTINENTAL AG	9,528	129.150	1,230,541.200	
DEUTSCHE POST AG-REG	86,663	25.050	2,170,908.150	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	14,426	11.385	164,240.010	
NOKIAN RENKAAT OYJ	9,399	28.180	264,863.820	
AXEL SPRINGER SE	7,792	51.900	404,404.800	
OMV AG	12,817	40.800	522,933.600	
VERBUND AG	6,778	41.140	278,846.920	
PERNOD-RICARD	18,479	138.500	2,559,341.500	
PEUGEOT SA	50,087	20.070	1,005,246.090	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG- PFD	13,249	55.600	736,644.400	
RENAULT SA	17,786	56.610	1,006,865.460	
REPSOL SA	123,478	14.775	1,824,387.450	
REMY COINTREAU	1,860	99.750	185,535.000	
MERCK KGAA	11,193	90.540	1,013,414.220	
COMPAGNIE DE SAINT- GOBAIN	44,331	29.600	1,312,197.600	
RWE AG	45,905	20.260	930,035.300	
SEB SA	1,405	127.600	179,278.000	
SOCIETE GENERALE-A	63,145	28.780	1,817,313.100	
VINCI S.A.	43,889	73.080	3,207,408.120	
SODEXO	8,639	93.740	809,819.860	
SOLVAY SA	7,086	92.500	655,455.000	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	48,032	59.920	2,878,077.440	
VIVENDI SA	86,200	21.780	1,877,436.000	
SAP SE	83,668	89.440	7,483,265.920	
TELEFONICA S.A	387,431	7.661	2,968,108.890	
TOTAL SA	204,541	47.600	9,736,151.600	
VALEO	24,798	27.090	671,777.820	
E.ON SE	181,272	9.020	1,635,073.440	
VOEST-ALPINE AG	9,875	27.860	275,117.500	
HENKEL AG & CO KGAA	9,300	88.750	825,375.000	
SIEMENS AG-REG	65,624	98.760	6,481,026.240	
UPM-KYMMENE OYJ	49,371	23.840	1,177,004.640	
ING GROEP NV-CVA	341,295	9.851	3,362,097.040	
PUMA AG	600	459.500	275,700.000	
BAYER AG	79,508	65.880	5,237,987.040	
STORA ENSO OYJ-R SHS	42,303	11.025	466,390.570	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	15,350	96.820	1,486,187.000	

DAIMLER AG	75,975	49.290	3,744,807.750	
BASF SE	79,836	63.500	5,069,586.000	
BEIERSDORF AG	8,371	90.640	758,747.440	
HOCHTIEF AG	1,707	119.700	204,327.900	
HEIDELBERGCEMENT AG	14,126	56.580	799,249.080	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	18,494	59.580	1,101,872.520	
ORANGE	172,654	13.570	2,342,914.780	
SAMPO OYJ-A SHS	39,403	39.760	1,566,663.280	
RANDSTAD NV	12,061	41.230	497,275.030	
ALLIANZ SE	36,756	178.520	6,561,681.120	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	242,094	3.062	741,291.820	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	109,641	22.610	2,478,983.010	
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	17,602	15.765	277,495.530	
HERMES INTL	2,703	489.900	1,324,199.700	
ENDESA S.A.	29,314	20.570	602,988.980	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	24,926	19.490	485,807.740	
ERSTE GROUP BANK AG	25,117	30.730	771,845.410	
MUENCHENER RUECKVER AG- REG	12,966	190.150	2,465,484.900	
ARCELOR MITTAL (NL)	58,189	19.406	1,129,215.730	
SOCIETE BIC SA	2,478	86.700	214,842.600	
DASSAULT SYSTEMES SA	10,913	107.450	1,172,601.850	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	23,216	34.290	796,076.640	
HEINEKEN NV	23,051	77.120	1,777,693.120	
AKZO NOBEL	21,135	69.860	1,476,491.100	
ASML HOLDING NV	34,902	140.140	4,891,166.280	
AEGON NV	150,349	4.292	645,297.900	
BANKINTER S.A.	57,960	7.000	405,720.000	
VOLKSWAGEN AG	3,545	146.900	520,760.500	
VOLKSWAGEN AG PFD	15,382	144.920	2,229,159.440	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	595,667	4.984	2,968,804.320	
KERING	6,609	405.400	2,679,288.600	
CNP ASSURANCES	13,987	18.980	265,473.260	
FORTUM OYJ	37,452	18.910	708,217.320	
AGEAS	17,904	39.400	705,417.600	
UCB SA	11,267	76.560	862,601.520	
THYSSENKRUPP AG	37,894	16.270	616,535.380	
UNILEVER NV-CVA	131,958	46.365	6,118,232.670	
CARREFOUR SA	51,094	15.810	807,796.140	
NATURGY ENERGY GROUP SA	29,010	22.850	662,878.500	
ATOS SE	8,816	74.580	657,497.280	
NOKIA OYJ	495,975	5.294	2,625,691.650	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	83,260	30.680	2,554,416.800	
WOLTERS KLUWER-CVA	25,051	52.580	1,317,181.580	
SANOFI	97,788	74.180	7,253,913.840	

STMICROELECTRONICS NV	65,384	12.170	795,723.280	
ELISA OYJ	14,176	38.220	541,806.720	
BANCO SANTANDER SA	1,411,232	4.275	6,033,016.800	
METSO OYJ	8,585	24.430	209,731.550	
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	34,596	19.825	685,865.700	
QIAGEN N.V.	17,387	31.400	545,951.800	
1&1 DRILLISCH AG	3,149	40.200	126,589.800	
DEUTSCHE BANK AG-REG	171,985	7.480	1,286,447.800	
BMW VORZUG	4,116	63.450	261,160.200	
ENEL SPA	674,493	5.250	3,541,088.250	
COLRUYT NV	4,673	63.940	298,791.620	
VOPAK (KON.)	5,364	43.620	233,977.680	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	288,779	14.780	4,268,153.620	
SARTORIUS AG	2,712	118.400	321,100.800	
LEONARDO SPA	26,269	7.958	209,048.700	
UBISOFT ENTERTAINMENT	5,911	77.840	460,112.240	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	99,068	17.930	1,776,289.240	
KONINKLIJKE KPN NV	291,029	2.496	726,408.380	
EUROFINS SCIENTIFIC	794	354.400	281,393.600	
TELEPERFORMANCE	5,363	143.700	770,663.100	
DEUTSCHE BOERSE AG	16,913	108.000	1,826,604.000	
EURAZEO	4,725	64.050	302,636.250	
BANCO SABADELL	563,371	1.031	580,835.500	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	5,814	79.400	461,631.600	
FRAPORT AG	3,149	65.520	206,322.480	
HEINEKEN HOLDING NV-A	9,791	74.850	732,856.350	
INDITEX	90,509	23.510	2,127,866.590	
JC DECAUX SA	6,058	26.160	158,477.280	
ANDRITZ AG	6,265	42.120	263,881.800	
MAPFRE SA	84,474	2.388	201,723.910	
ESSILORLUXOTTICA	24,121	112.100	2,703,964.100	
SNAM SPA	199,702	4.112	821,174.620	
CREDIT AGRICOLE SA	99,973	9.882	987,933.180	
ENAGAS	18,095	24.990	452,194.050	
WENDEL	2,220	108.900	241,758.000	
WIRECARD AG	9,891	141.750	1,402,049.250	
TENARIS SA	36,959	10.400	384,373.600	
TELECOM ITALIA SPA	1,158,473	0.500	579,236.500	
TELECOM ITALIA-RNC	497,596	0.432	214,961.470	
ATLANTIA SPA	43,688	19.445	849,513.160	
ILIAD SA	2,102	115.450	242,675.900	
PROXIMUS	14,283	23.020	328,794.660	
SES FDR	34,268	17.290	592,493.720	
TERNA SPA	112,686	5.278	594,756.700	
BIOMERIEUX	3,248	59.000	191,632.000	
GRIFOLS SA	23,518	24.070	566,078.260	
FERROVIAL SA	46,831	18.630	872,461.530	

LANXESS AG	6,856	46.380	317,981.280	
NESTE OYJ	10,840	76.060	824,490.400	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	9,641	23.940	230,805.540	
RECORDATI SPA	6,859	29.920	205,221.280	
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	55,725	7.575	422,116.870	
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	4,859	169.000	821,171.000	
KONE OYJ	29,124	43.440	1,265,146.560	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	2,881	89.650	258,281.650	
ENGIE	159,735	13.465	2,150,831.770	
ALSTOM	12,046	34.510	415,707.460	
TELENET GROUP HOLDING NV	3,634	40.540	147,322.360	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	12,542	18.045	226,320.390	
ELECTRICITE DE FRANCE	53,800	13.895	747,551.000	
IPSEN SA	3,646	117.250	427,493.500	
DEUTSCHE WOHNEN	30,689	41.290	1,267,148.810	
ARKEMA SA	5,230	82.600	431,998.000	
LEGRAND SA	23,308	51.140	1,191,971.120	
ADP	2,313	168.200	389,046.600	
ORION OYJ	8,051	33.710	271,399.210	
RTL GROUP SA	3,446	48.440	166,924.240	
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	37,921	14.495	549,664.890	
SYMRISE AG	11,548	69.520	802,816.960	
SCOR SE	13,875	40.980	568,597.500	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	17,397	25.000	434,925.000	
REXEL SA	23,245	9.842	228,777.290	
PRYSMIAN SPA	29,418	18.540	545,409.720	
CAIXABANK	297,224	3.223	957,952.950	
BUREAU VERITAS SA	21,480	18.625	400,065.000	
GETLINK	37,646	11.865	446,669.790	
SUEZ SA	25,406	11.760	298,774.560	
AMADEUS IT GROUP SA	38,492	61.460	2,365,718.320	
BRENTNAG AG	12,353	40.350	498,443.550	
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GROUP SA	44,747	6.588	294,793.230	
EVONIK INDUSTRIES AG	22,784	23.480	534,968.320	
EDENRED	18,306	35.470	649,313.820	
BANKIA SA	100,675	2.633	265,077.270	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	61,541	3.166	194,838.800	
HUGO BOSS AG -ORD	5,218	58.960	307,653.280	
OSRAM LICHT AG	7,017	35.500	249,103.500	
KION GROUP AG	4,686	46.690	218,789.340	
VONOVIA SE	40,775	40.150	1,637,116.250	

	BANK OF IRELAND GROUP PLC	106,363	5.030	535,005.890	
	SIEMENS HEALTHINEERS AG	15,254	34.965	533,356.110	
	FERRARI NV	10,895	96.360	1,049,842.200	
	METRO AG	10,774	13.990	150,728.260	
	CNH INDUSTRIAL NV	94,317	8.514	803,014.930	
	AROUNDTOWN SA	71,783	7.375	529,399.620	
	AIB GROUP PLC	52,322	3.680	192,544.960	
	INNOGY SE-TEMPORARY	9,769	37.440	365,751.360	
	MONCLER SPA	14,353	30.860	442,933.580	
	REPSOL SA-RTS	113,583	0.420	47,704.860	
	IBERDROLA SA-RTS	520,730	0.153	79,671.690	
	NN GROUP NV	28,528	35.760	1,020,161.280	
	ZALANDO SE	14,353	27.500	394,707.500	
	FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	89,977	13.866	1,247,621.080	
	AENA SME SA	5,256	139.250	731,898.000	
	ABN AMRO GROUP NV	34,251	21.700	743,246.700	
	EXOR NV	7,726	52.160	402,988.160	
	COVESTRO AG	15,802	45.550	719,781.100	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	65,858	61.220	4,031,826.760	
	POSTE ITALIANE SPA	40,015	7.200	288,108.000	
	AMUNDI SA	3,894	49.080	191,117.520	
	PIRELLI & C SPA	34,086	5.998	204,447.820	
	UNIPER SE	13,897	24.110	335,056.670	
	DELIVERY HERO SE	7,238	32.800	237,406.400	
ユーロ 小計		17,679,361		300,036,924.840 (37,456,609,697)	
香港・ドル	ASM PACIFIC TECH	32,700	73.850	2,414,895.000	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	164,000	15.560	2,551,840.000	
	BANK OF EAST ASIA	153,660	25.050	3,849,183.000	
	CLP HOLDINGS LTD	149,500	90.650	13,552,175.000	
	PCCW LTD	331,000	4.660	1,542,460.000	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	49,000	60.900	2,984,100.000	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	102,440	234.000	23,970,960.000	
	MTR CORP	118,500	41.800	4,953,300.000	
	HANG LUNG GROUP LTD	63,000	20.850	1,313,550.000	
	HANG SENG BANK LTD	65,400	173.600	11,353,440.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	132,228	42.050	5,560,187.400	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	123,000	54.400	6,691,200.000	
	(THE) WHARF HOLDINGS LTD	95,750	22.550	2,159,162.500	
	HONG KONG & CHINA GAS	837,050	16.580	13,878,289.000	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	50,000	38.200	1,910,000.000	



GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	224,000	49.450	11,076,800.000	
KERRY PROPERTIES LTD	33,000	28.000	924,000.000	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	324,000	29.150	9,444,600.000	
NWS HOLDINGS LTD	135,000	16.280	2,197,800.000	
YUE YUEN INDUSTRIAL HOLDINGS	50,500	25.400	1,282,700.000	
NEW WORLD DEVELOPMENT	605,266	11.260	6,815,295.160	
SHANGRI-LA ASIA LTD	104,000	10.520	1,094,080.000	
SINO LAND CO	255,400	14.600	3,728,840.000	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	135,000	120.800	16,308,000.000	
SWIRE PACIFIC LTD A	47,500	87.350	4,149,125.000	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	113,500	44.400	5,039,400.000	
WHEELLOCK & CO LTD	86,000	47.500	4,085,000.000	
MINTH GROUP LTD	44,000	26.700	1,174,800.000	
SJM HOLDINGS LTD	156,000	7.130	1,112,280.000	
WYNN MACAU LTD	124,400	17.300	2,152,120.000	
MGM CHINA HOLDINGS LTD	64,800	13.300	861,840.000	
AIA GROUP LTD	1,030,627	66.800	68,845,883.600	
HKT TRUST / HKT LTD	282,000	11.640	3,282,480.000	
SANDS CHINA LTD	232,800	35.550	8,276,040.000	
SWIRE PROPERTIES LTD	104,200	26.900	2,802,980.000	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT CO LTD	95,750	48.000	4,596,000.000	
HK ELECTRIC INVESTMENTS & HK ELECTRIC INVESTMENTS LTD	230,000	8.130	1,869,900.000	
WH GROUP LTD	701,500	6.510	4,566,765.000	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	242,832	77.100	18,722,347.200	
CK ASSET HOLDINGS LTD	222,832	63.150	14,071,840.800	
香港・ドル 小計	8,112,135		297,165,658.660 (4,112,772,716)	
合計	96,939,529		308,327,397,174 (308,327,397,174)	

## (2) 株式以外の有価証券

平成31年1月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	オーストラリア・ドル	DEXUS	80,596.000	869,630.840	
		GOODMAN GROUP	147,572.000	1,645,427.800	
		GPT GROUP	144,955.000	785,656.100	
		LENDLEASE GROUP	60,871.000	709,147.150	
		MIRVAC GROUP	295,783.000	674,385.240	
		SCENTRE GROUP	476,956.000	1,936,441.360	
		STOCKLAND	194,018.000	704,285.340	
		VICINITY CENTRES	270,443.000	711,265.090	
オーストラリア・ドル 小計		1,671,194.000	8,036,238.920		

				(626,826,636)	
	シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVNT	200,806.000	536,152.020	
		CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	206,300.000	373,403.000	
		CAPITALAND MALL TRUST	199,000.000	463,670.000	
		SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	192,100.000	355,385.000	
	シンガポール・ドル	小計	798,206.000	1,728,610.020 (138,755,526)	
投資信託受益証券 合計			2,469,400	765,582,162 (765,582,162)	
投資証券	アメリカ・ドル	AGNC INVESTMENT CORP	44,741.000	794,600.160	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	9,644.000	1,153,133.080	
		AMERICAN TOWER CORP	37,466.000	6,064,246.760	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	110,918.000	1,083,668.860	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	12,353.000	2,198,710.470	
		BOSTON PROPERTIES INC	13,309.000	1,586,698.980	
		BROOKFIELD PROPERTY REIT INC	19,124.000	331,992.640	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	8,062.000	713,406.380	
		CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	35,534.000	3,796,807.900	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	17,035.000	1,790,037.800	
		DUKE REALTY TRUST	32,954.000	894,701.100	
		EQUINIX INC	6,964.000	2,581,415.520	
		EQUITY RESIDENTIAL	32,976.000	2,222,912.160	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	5,653.000	1,405,788.040	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	11,885.000	1,069,293.450	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	6,000.000	742,200.000	
		HCP INC	39,277.000	1,133,926.990	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	64,001.000	1,131,537.680	
		INVITATION HOMES INC	30,427.000	618,580.910	
		IRON MOUNTAIN INC	23,977.000	832,241.670	
		KIMCO REALTY	32,980.000	521,084.000	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	11,649.000	507,546.930	
		MID AMERICA	10,258.000	990,615.060	
		NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	13,649.000	666,890.140	
		PROLOGIS INC	55,164.000	3,441,130.320	
		PUBLIC STORAGE	13,721.000	2,756,823.320	
		REALTY INCOME CORP	26,616.000	1,701,560.880	
		REGENCY CENTERS CORP	13,023.000	775,649.880	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	9,444.000	1,587,064.200	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	26,500.000	4,593,775.000	
		SL GREEN	7,097.000	618,432.580	
		THE MACERICH COMPANY	9,014.000	414,553.860	
		UDR INC	21,658.000	866,536.580	

	VENTAS INC	30,244.000	1,793,166.760	
	VEREIT INC	72,429.000	546,838.950	
	VORNADO REALTY TRUST	15,346.000	997,950.380	
	WELLTOWER INC	31,178.000	2,221,120.720	
	WEYERHAEUSER CO	63,699.000	1,547,885.700	
	WP CAREY INC	15,148.000	1,046,878.280	
アメリカ・ドル	小計	1,041,117.000	59,741,404.090 (6,480,150,102)	
イギリス・ポンド	BRITISH LAND CO PLC	71,871.000	388,965.850	
	HAMMERSON PLC	58,616.000	196,949.760	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	59,062.000	486,080.260	
	SEGRO PLC	82,914.000	509,091.960	
イギリス・ポンド	小計	272,463.000	1,581,087.830 (218,537,960)	
カナダ・ドル	H & R REAL ESTATE INVESTMENT	10,748.000	230,759.560	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	9,675.000	234,038.250	
	SMARTCENTRES REIT	2,582.000	82,339.980	
カナダ・ドル	小計	23,005.000	547,137.790 (44,832,470)	
ユーロ	COVIVIO	4,675.000	393,868.750	
	GECINA SA	3,670.000	435,262.000	
	ICADE	2,234.000	156,603.400	
	KLEPIERRE	17,042.000	472,063.400	
	UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	12,061.000	1,728,100.080	
ユーロ	小計	39,682.000	3,185,897.630 (397,727,461)	
香港・ドル	LINK REIT	185,500.000	14,710,150.000	
香港・ドル	小計	185,500.000	14,710,150.000 (203,588,476)	
投資証券	合計	1,561,767	7,344,836,469 (7,344,836,469)	
合計			8,110,418,631 (8,110,418,631)	

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 594銘柄	63.96%	-%	-%	67.77%
	投資証券 39銘柄	-%	-%	1.99%	
イギリス・ポンド	株式 93銘柄	6.20%	-%	-%	6.44%
	投資証券 4銘柄	-%	-%	0.07%	
イスラエル・シケル	株式 8銘柄	0.10%	-%	-%	0.10%
オーストラリア・ドル	株式 61銘柄	2.39%	-%	-%	2.66%
	投資信託 受益証券 8銘柄	-%	0.19%	-%	
カナダ・ドル	株式 88銘柄	3.65%	-%	-%	3.77%
	投資証券 3銘柄	-%	-%	0.01%	
シンガポール・ドル	株式 21銘柄	0.47%	-%	-%	0.52%
	投資信託 受益証券 4銘柄	-%	0.04%	-%	
スイス・フラン	株式 38銘柄	3.24%	-%	-%	3.33%
スウェーデン・クローナ	株式 32銘柄	1.01%	-%	-%	1.04%
デンマーク・クローネ	株式 17銘柄	0.66%	-%	-%	0.68%
ニュージーランド・ドル	株式 7銘柄	0.08%	-%	-%	0.09%
ノルウェー・クローネ	株式 10銘柄	0.27%	-%	-%	0.28%
ユーロ	株式 239銘柄	11.52%	-%	-%	11.96%
	投資証券 5銘柄	-%	-%	0.12%	
香港・ドル	株式 40銘柄	1.26%	-%	-%	1.36%
	投資証券 1銘柄	-%	-%	0.06%	

(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1月11日現在	平成31年1月11日現在
資産の部			
流動資産			
預金		409,027,141	732,549,513
コール・ローン		81,777,811	78,368,735
投資信託受益証券		6,493,687,842	4,104,663,329
投資証券		48,340,326,547	40,893,156,516
派生商品評価勘定		-	254,365
未収入金		28,955	-
未収配当金		276,841,525	175,364,522
流動資産合計		55,601,689,821	45,984,356,980
資産合計		55,601,689,821	45,984,356,980
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		167,021	48,620
未払金		392,565,351	7,488,749,372
未払解約金		6,842,000	27,776,000
流動負債合計		399,574,372	7,516,573,992
負債合計		399,574,372	7,516,573,992
純資産の部			
元本等			
元本	1	46,402,765,697	33,176,902,219
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		8,799,349,752	5,290,880,769
元本等合計		55,202,115,449	38,467,782,988
純資産合計		55,202,115,449	38,467,782,988
負債純資産合計		55,601,689,821	45,984,356,980

## 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1月11日現在	平成31年1月11日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	36,552,926,130円	46,402,765,697円
同期中追加設定元本額	19,096,470,617円	46,019,259,577円
同期中一部解約元本額	9,246,631,050円	59,245,123,055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）	274,804,177円	250,874,408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）	67,370,416円	91,252,071円
MITO ラップ型ファンド（安定型）	5,909,943円	4,172,228円
MITO ラップ型ファンド（中立型）	15,182,713円	15,919,954円
MITO ラップ型ファンド（積極型）	39,369,153円	31,826,259円

グローバル8資産ラップファンド(安定型)	25,105,584円	30,843,640円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	21,627,261円	43,636,068円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	28,808,725円	38,541,149円
たわらノーロード 先進国リート	1,721,168,125円	3,063,958,957円
たわらノーロード 先進国リート<ラップ向け>	400,970,948円	616,803,762円
たわらノーロード 先進国リート<為替ヘッジあり>	125,946,635円	150,639,471円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	21,115,226円	201,222,909円
たわらノーロード バランス(堅実型)	35,727円	1,439,001円
たわらノーロード バランス(標準型)	758,305円	27,934,331円
たわらノーロード バランス(積極型)	4,154,380円	72,665,658円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定型)	- 円	7,556,297円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定成長型)	50,006円	55,627,064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)	90,164円	47,896,710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)	122,951円	140,337,863円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	- 円	296,229円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	- 円	1,978,581円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	- 円	1,511,910円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	- 円	5,171,309円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	22,174,404円	22,837,296円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	539,811,573円	604,119,097円
マネックス資産設計ファンドエボリューション	78,019,353円	52,317,354円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	25,595,252円	172,886,995円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	84,478,084円	153,844,071円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	189,120,828円	305,200,295円
投資のソムリエ	6,351,242,412円	5,091,609,781円
投資のソムリエ<DC年金>	402,574,454円	465,395,016円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	96,943,349円	133,586,692円

投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	186,280,072円	119,937,911円
ダイナミック・ナビゲーション	286,863円	695,215円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	2,578,280,510円	2,064,821,221円
ワールドアセットバランス(基本コース)	1,100,032,739円	1,107,749,531円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	4,194,614,874円	2,627,039,919円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	840,948円	2,773,084円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	840,948円	2,168,352円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	865,578円	740,407円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	820,132円	4,412,949円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	-円	379,757,137円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	-円	12,333円
DIAMパッシブ資産分散ファンド	1,113,784,191円	1,063,616,864円
DIAM外国リートインデックスファンド<DC年金>	20,739,627円	33,855,546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)	2,834,824,826円	524,032,259円
DIAMグローバル 私募ファンド(適格機関投資家向け)	11,580,328円	11,580,328円
DIAM世界アセットバランスファンド2VA(適格機関投資家限定)	11,354,337,336円	6,722,401,410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)	4,236,813,769円	1,664,252,242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)	4,407,569,364円	923,299,332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)	3,257,586,698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)	560,116,746円	558,597,232円
計	46,402,765,697円	33,176,902,219円
2. 受益権の総数	46,402,765,697口	33,176,902,219口



## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成29年6月23日 至 平成30年1月11日	自 平成30年1月12日 至 平成31年1月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成30年1月11日現在	平成31年1月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	平成30年1月11日現在	平成31年1月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
投資信託受益証券	175,410,396	78,125,761
投資証券	1,673,572,217	1,206,760,695
合計	1,498,161,821	1,128,634,934

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成29年6月23日から平成30年1月11日まで及び平成30年6月23日から平成31年1月11日まで）に対応する金額であります。

## （デリバティブ取引等に関する注記）

## 通貨関連

種類	平成30年1月11日 現在				平成31年1月11日 現在			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
買 建	114,761,091	-	114,594,070	167,021	7,968,937,355	-	7,969,143,100	205,745
アメリカ・ドル	49,601,257	-	49,599,700	1,557	5,746,737,000	-	5,746,790,000	53,000
イギリス・ポンド	-	-	-	-	433,915,030	-	433,948,000	32,970
オーストラリア・ドル	32,503,570	-	32,478,600	24,970	561,373,200	-	561,384,000	10,800
カナダ・ドル	1,778,510	-	1,778,400	110	152,357,808	-	152,371,200	13,392
シンガポール・ドル	11,768,880	-	11,706,800	62,080	291,246,153	-	291,307,500	61,347
ニュージーランド・ドル	2,813,335	-	2,809,450	3,885	37,522,842	-	37,525,800	2,958
ユーロ	6,395,524	-	6,395,520	4	547,967,702	-	548,047,600	79,898
香港・ドル	9,900,015	-	9,825,600	74,415	197,817,620	-	197,769,000	48,620
合計	114,761,091	-	114,594,070	167,021	7,968,937,355	-	7,969,143,100	205,745

## （注）時価の算定方法

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

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

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

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

( 関連当事者との取引に関する注記 )

該当事項はありません。

( 1口当たり情報に関する注記 )

	平成30年1月11日現在	平成31年1月11日現在
1口当たり純資産額	1.1896円	1.1595円
(1万口当たり純資産額)	(11,896円)	(11,595円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

平成31年1月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	オーストラリア・ドル	ABACUS PROPERTY GROUP	107,574.000	358,221.420	
		ARENA REIT	86,139.000	211,040.550	
		BWP TRUST	160,157.000	581,369.910	
		CHARTER HALL EDUCATION TRUST	59,920.000	179,760.000	
		CHARTER HALL GROUP	150,921.000	1,124,361.450	
		CHARTER HALL LONG WALE REIT	62,982.000	267,673.500	
		CHARTER HALL RETAIL REIT	108,606.000	495,243.360	
		CROMWELL PROPERTY GROUP	543,112.000	537,680.880	
		DEXUS	328,185.000	3,541,116.150	
		GDI PROPERTY GROUP	167,395.000	223,472.320	
		GOODMAN GROUP	520,491.000	5,803,474.650	
		GPT GROUP	581,163.000	3,149,903.460	
		GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA	88,881.000	327,970.890	
		HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD	45,873.000	138,995.190	
		INDUSTRIA REIT	28,737.000	78,164.640	
		INGENIA COMMUNITIES GROUP	54,740.000	158,746.000	
		MIRVAC GROUP	1,200,544.000	2,737,240.320	
		NATIONAL STORAGE REIT	215,708.000	378,567.540	
		PROPERTYLINK GROUP	137,268.000	158,544.540	
		RURAL FUNDS GROUP	100,157.000	218,342.260	
		SCENTRE GROUP	1,720,492.000	6,985,197.520	
		SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	289,398.000	737,964.900	
		STOCKLAND	788,700.000	2,862,981.000	
		VICINITY CENTRES	1,041,278.000	2,738,561.140	
VIVA ENERGY REIT	146,272.000	330,574.720			
	オーストラリア・ドル 小計		8,734,693.000	34,325,168.310 (2,677,363,128)	
	カナダ・ドル	KILLAM APARTMENT REIT	17,202.000	277,640.280	
	カナダ・ドル 小計		17,202.000	277,640.280 (22,749,845)	
	シンガポール・ドル	AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL REIT	192,095.000	261,249.200	

ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	226,300.000	179,908.500	
ASCENDAS REAL ESTATE INVT	826,560.000	2,206,915.200	
ASCOTT RESIDENCE TRUST	401,515.000	445,681.650	
CACHE LOGISTICS TRUST	320,080.000	232,058.000	
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	900,179.000	1,629,323.990	
CAPITALAND MALL TRUST	907,860.000	2,115,313.800	
CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST	190,480.000	268,576.800	
CDL HOSPITALITY TRUSTS	223,300.000	334,950.000	
ESR REIT	641,130.000	343,004.550	
FAR EAST HOSPITALITY TRUST	304,300.000	190,187.500	
FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	151,800.000	157,872.000	
FRASERS CENTREPOINT TRUST	191,800.000	431,550.000	
FRASERS COMMERCIAL TRUST	227,180.000	322,595.600	
FRASERS HOSPITALITY TRUST	257,000.000	183,755.000	
FRASERS LOGISTICS & INDUSTRIAL TRUST	526,350.000	552,667.500	
KEPPEL DC REIT	313,600.000	432,768.000	
KEPPEL REIT	591,800.000	692,406.000	
LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST	704,800.000	140,960.000	
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	612,500.000	1,041,250.000	
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	407,620.000	798,935.200	
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	760,820.000	1,011,890.600	
MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL TRUST	694,400.000	819,392.000	
QUE HOSPITALITY TRUST	347,820.000	238,256.700	
PARKWAY LIFE REIT	129,200.000	350,132.000	
SABANA SHARIAH COMP IND REIT	290,600.000	119,146.000	
SOILBUILD BUSINESS SPACE REIT	206,400.000	122,808.000	
SPH REIT	205,000.000	211,150.000	
STARHILL GLOBAL REIT	453,100.000	312,639.000	
SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	729,990.000	1,350,481.500	
シンガポール・ドル 小計	12,935,579.000	17,497,824.290 (1,404,550,356)	
投資信託受益証券 合計	21,687,474	4,104,663,329	

(4,104,663,329)

投資証券	アメリカ・ドル			
		ACADIA REALTY TRUST	32,271.000	847,436.460
		AGREE REALTY CORP	13,652.000	829,222.480
		ALEXANDER'S INC.	1,247.000	392,829.940
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	42,112.000	5,035,331.840
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	12,328.000	504,585.040
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	53,801.000	2,303,758.820
		AMERICAN FINANCE TRUST INC	16,000.000	211,040.000
		AMERICAN HOMES 4 RENT	101,130.000	2,071,142.400
		AMERICOLD REALTY TRUST	19,495.000	528,704.400
		APARTMENT INVT & MGMT CO-A	61,065.000	2,760,138.000
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	84,728.000	1,313,284.000
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	36,167.000	171,069.910
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	54,079.000	9,625,521.210
		BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH REIT INC	10,301.000	106,100.300
		BOSTON PROPERTIES INC	60,446.000	7,206,372.120
		BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	13,037.000	124,633.720
		BRANDYWINE REALTY TRUST	70,568.000	978,778.160
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	117,839.000	1,845,358.740
		BRT APARTMENTS CORP	3,818.000	46,503.240
		CAMDEN PROPERTY TRUST	36,518.000	3,231,477.820
		CARETRUST REIT INC	27,643.000	545,949.250
		CBL & ASSOCIATES	72,173.000	159,502.330
		CEDAR REALTY TRUST INC	37,745.000	121,538.900
		CHATHAM LODGING TRUST	18,720.000	364,852.800
		CHESAPEAKE LODGING TRUST	19,901.000	532,152.740
		CITY OFFICE REIT INC	16,349.000	187,032.560
		CLIPPER REALTY INC	5,169.000	68,334.180
		COLONY CAPITAL INC	193,512.000	1,068,186.240
		COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	46,635.000	937,363.500
		COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	5,236.000	159,540.920
		CORECIVIC INC	46,935.000	905,376.150
		CORESITE REALTY CORP	14,461.000	1,311,034.260
		CORPORATE OFFICE PROPERTIES	42,998.000	1,006,153.200
		COUSINS PROPERTIES INC	165,548.000	1,407,158.000

CUBESMART	73,181.000	2,106,880.990	
CYRUSONE INC	41,570.000	2,157,898.700	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	82,352.000	795,520.320	
DIGITAL REALTY TRUST INC	80,720.000	8,482,057.600	
DOUGLAS EMMETT INC	63,397.000	2,237,914.100	
DUKE REALTY TRUST	140,429.000	3,812,647.350	
EAST GROUP	14,198.000	1,335,747.840	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	18,471.000	313,637.580	
EMPIRE STATE REALTY TRUST INC	55,477.000	824,942.990	
EPR PROPERTIES	29,208.000	2,018,564.880	
EQUITY COMMONWEALTH	47,826.000	1,458,214.740	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	35,183.000	3,482,765.170	
EQUITY RESIDENTIAL	144,149.000	9,717,084.090	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY TRUST INC	10,000.000	143,000.000	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	25,862.000	6,431,362.160	
EXTRA SPACE STORAGE INC	49,562.000	4,459,093.140	
FARMLAND PARTNERS INC	13,379.000	80,140.210	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	28,953.000	3,581,486.100	
FIRST INDUSTRIAL RT	49,718.000	1,498,003.340	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST INC	26,886.000	699,842.580	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	43,448.000	299,791.200	
FRONT YARD RESIDENTIAL CORP	20,144.000	200,029.920	
GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	78,957.000	2,704,277.250	
GEO GROUP INC	48,096.000	1,048,492.800	
GETTY REALTY CORP	13,501.000	403,544.890	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	11,868.000	232,494.120	
GLADSTONE LAND CORP	6,902.000	86,067.940	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	5,145.000	48,363.000	
GLOBAL NET LEASE INC	30,262.000	596,766.640	
HCP INC	186,974.000	5,397,939.380	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	49,303.000	1,462,820.010	
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA INC	81,282.000	2,128,775.580	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	14,777.000	257,710.880	



HIGHWOODS PROPERTIES INC	40,697.000	1,712,122.790	
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	64,676.000	1,684,809.800	
HOST HOTELS & RESORTS INC	290,607.000	5,137,931.760	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	61,599.000	1,852,281.930	
INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	35,830.000	350,059.100	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES TRUST	21,983.000	435,703.060	
INFREIT INC	12,061.000	253,281.000	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES INC	2,897.000	148,036.700	
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	4,862.000	271,007.880	
INVITATION HOMES INC	116,480.000	2,368,038.400	
IRON MOUNTAIN INC	112,163.000	3,893,177.730	
JBG SMITH PROPERTIES	42,820.000	1,571,922.200	
KILROY REALTY CORP	39,533.000	2,640,013.740	
KIMCO REALTY	165,351.000	2,612,545.800	
KITE REALTY GROUP TRUST	27,575.000	426,033.750	
LEXINGTON REALTY TRUST	83,399.000	728,907.260	
LIBERTY PROPERTY TRUST	58,014.000	2,527,669.980	
LIFE STORAGE INC	18,327.000	1,698,179.820	
LTC PROPERTIES INC	15,744.000	678,094.080	
MACK CALI	35,815.000	733,491.200	
MANULIFE US REIT	368,100.000	300,001.500	
MEDEQUITIES REALTY TRUST INC	10,830.000	114,473.100	
MEDICAL PROPERTIES TRUST	143,259.000	2,366,638.680	
MID AMERICA	44,600.000	4,307,022.000	
MONMOUTH RE INVEST CP -CL A	30,235.000	388,822.100	
NATIONAL HEALTH INVS INC	16,640.000	1,298,086.400	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	62,413.000	3,049,499.180	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUST	22,521.000	585,095.580	
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP INC	34,385.000	155,076.350	
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	6,313.000	235,032.990	
NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP	15,308.000	248,142.680	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST	19,098.000	662,891.580	

OMEGA HEALTHCARE INVS INC	78,722.000	2,900,118.480	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	6,092.000	156,564.400	
PARAMOUNT GROUP INC	80,540.000	1,066,349.600	
PARK HOTELS & RESORTS INC	79,009.000	2,250,176.320	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	50,375.000	1,556,587.500	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	26,498.000	190,520.620	
PHYSICIANS REALTY TRUST	71,900.000	1,182,036.000	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC	50,753.000	922,182.010	
PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES INC	16,699.000	273,696.610	
PROLOGIS INC	246,198.000	15,357,831.240	
PS BUSINESS PARKS	7,881.000	1,056,211.620	
PUBLIC STORAGE	58,656.000	11,785,163.520	
QTS REALTY TRUST INC	20,218.000	778,190.820	
REALTY INCOME CORP	115,501.000	7,383,978.930	
REGENCY CENTERS CORP	66,399.000	3,954,724.440	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	45,175.000	754,874.250	
RETAIL PROPERTIES OF AMERICA INC	85,101.000	997,383.720	
RETAIL VALUE INC	5,243.000	156,503.550	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	36,612.000	1,120,693.320	
RLJ LODGING TRUST	69,064.000	1,238,317.520	
RPT REALTY	32,157.000	402,927.210	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	20,202.000	1,518,382.320	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	70,249.000	1,286,961.680	
SAFETY INCOME & GROWTH INC	2,130.000	36,955.500	
SAUL CENTERS INC	4,710.000	240,445.500	
SENIOR HOUSING PPTYS TRUST	93,735.000	1,191,371.850	
SERITAGE GROWTH PROPERTIES	8,499.000	300,864.600	
SIMON PROPERTY GROUP INC	120,936.000	20,964,255.600	
SITE CENTERS CORP	57,870.000	715,851.900	
SL GREEN	33,447.000	2,914,571.580	
SPIRIT MTA REIT	14,648.000	112,057.200	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	33,784.000	1,241,224.160	
STAG INDUSTRIAL INC	42,968.000	1,121,464.800	
STORE CAPITAL CORP	74,396.000	2,174,595.080	

	SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	41,946.000	435,818.940	
	SUN COMMUNITIES INC	33,852.000	3,477,954.480	
	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	89,962.000	1,262,166.860	
	TANGER FACTORY OUTLET	37,174.000	820,801.920	
	TAUBMAN CENTERS INC	24,076.000	1,199,466.320	
	TERRENO REALTY CORP	23,398.000	865,726.000	
	THE MACERICH COMPANY	41,569.000	1,911,758.310	
	TIER REIT INC	21,542.000	472,416.060	
	UDR INC	107,954.000	4,319,239.540	
	UMH PROPERTIES INC	14,380.000	181,763.200	
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	5,101.000	341,001.850	
	URBAN EDGE PROPERTIES	45,232.000	854,884.800	
	URSTADT BIDDLE PROPERTIES	12,165.000	248,166.000	
	VENTAS INC	139,492.000	8,270,480.680	
	VEREIT INC	379,507.000	2,865,277.850	
	VICI PROPERTIES INC	141,302.000	2,835,931.140	
	VORNADO REALTY TRUST	67,837.000	4,411,440.110	
	WASHINGTON PRIME GROUP INC	74,573.000	415,371.610	
	WASHINGTON REIT	31,641.000	769,509.120	
	WEINGARTEN REALTY INVST	47,040.000	1,250,793.600	
	WELLTOWER INC	146,956.000	10,469,145.440	
	WHITESTONE REIT	16,314.000	224,317.500	
	WP CAREY INC	63,099.000	4,360,771.890	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	44,574.000	806,343.660	
	アメリカ・ドル 小計	8,675,995.000	307,220,011.570 (33,324,154,655)	
イギリス・ポンド	ASSURA PLC	943,550.000	514,234.750	
	BIG YELLOW GROUP PLC	62,135.000	547,409.350	
	BRITISH LAND CO PLC	382,756.000	2,071,475.470	
	CAPITAL & REGIONAL PLC	239,118.000	68,865.980	
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	251,312.000	257,594.800	
	DERWENT LONDON PLC	43,587.000	1,273,612.140	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	167,778.000	153,013.530	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	111,282.000	759,388.360	
	HAMMERSON PLC	303,446.000	1,019,578.560	
	HANSTEEN HOLDINGS PLC	170,454.000	153,067.690	
	INTU PROPERTIES PLC	337,836.000	364,862.880	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	294,605.000	2,424,599.150	

	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	275,255.000	481,971.500	
	LXI REIT PLC	118,335.000	141,410.320	
	NEWRIVER REIT PLC	123,484.000	259,316.400	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC	249,275.000	282,677.850	
	RDI REIT PLC	544,520.000	160,633.400	
	REGIONAL REIT LTD	105,299.000	97,401.570	
	SAFESTORE HOLDINGS LTD	83,297.000	450,636.770	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT TRUST LTD	218,113.000	124,324.410	
	SEGR0 PLC	395,793.000	2,430,169.020	
	SHAFTESBURY PLC	91,049.000	762,535.370	
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING REIT PLC	100,970.000	100,768.060	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	581,963.000	786,813.970	
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT LTD	273,410.000	238,686.930	
	UNITE GROUP PLC	103,782.000	874,882.260	
	WORKSPACE GROUP PLC	51,662.000	436,285.590	
	イギリス・ボンド 小計	6,624,066.000	17,236,216.080 (2,382,389,787)	
	イスラエル・シュケル REIT 1 LTD	56,934.000	792,521.280	
	イスラエル・シュケル 小計	56,934.000	792,521.280 (23,411,078)	
カナダ・ドル	AGELLAN COMMERCIAL REIT	5,891.000	83,887.840	
	ALLIED PROPERTIES REIT	20,201.000	905,408.820	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	30,509.000	302,649.280	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	7,598.000	297,005.820	
	CANADIAN APT PPTYS REIT	28,133.000	1,256,138.450	
	CHOICE PROPERTIES REIT	54,397.000	646,780.330	
	COMINAR REAL ESTATE INVT TR	36,006.000	438,553.080	
	CROMBIE REAL ESTATE INV	18,230.000	238,813.000	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	19,546.000	238,070.280	
	DREAM GLOBAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	37,896.000	474,836.880	
	DREAM INDUSTRIAL REIT	13,629.000	137,789.190	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV TRUST	12,120.000	272,336.400	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	9,005.000	512,204.400	
	H & R REAL ESTATE INVESTMENT	55,355.000	1,188,471.850	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	21,355.000	279,536.950	

	MINTO APARTMENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	2,832.000	51,400.800	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT	5,590.000	92,905.800	
	NORTHVIEW APARTMENT REIT	11,318.000	286,232.220	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	14,401.000	148,186.290	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	59,331.000	1,435,216.890	
	SLATE OFFICE REIT	12,079.000	74,648.220	
	SLATE RETAIL REIT	7,739.000	96,350.550	
	SMARTCENTRES REIT	26,133.000	833,381.370	
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	13,699.000	135,894.080	
	TRUE NORTH COMMERCIAL REIT	10,465.000	62,894.650	
カナダ・ドル 小計		533,458.000	10,489,593.440 (859,517,286)	
ニュージーランド・ドル	ARGOSY PROPERTY LTD	256,712.000	306,770.840	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	342,358.000	539,213.850	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	470,378.000	649,121.640	
	PRECINCT PROPERTIES	305,553.000	452,218.440	
	STRIDE STAPLED GROUP	121,901.000	231,611.900	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	113,481.000	233,770.860	
ニュージーランド・ドル 小計		1,610,383.000	2,412,707.530 (177,575,274)	
ユーロ	AEDIFICA	7,322.000	581,366.800	
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	62,385.000	767,335.500	
	ALTAREA	1,434.000	240,338.400	
	BEFIMMO	9,184.000	451,852.800	
	COFINIMMO SA	8,365.000	927,678.500	
	COVIVIO	21,740.000	1,831,595.000	
	COVIVIO	2,776.000	232,628.800	
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	16,223.000	434,451.940	
	GECINA SA	21,509.000	2,550,967.400	
	GREEN REIT PLC	266,289.000	367,478.820	
	HAMBORNER REIT AG	30,133.000	267,279.710	
	HIBERNIA REIT PLC	277,699.000	356,565.510	
	ICADE	17,513.000	1,227,661.300	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE	18,974.000	112,250.180	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA	105,062.000	889,875.140	
	INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	8,979.000	186,763.200	

	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES REIT PLC	128,126.000	177,326.380	
	KLEPIERRE	81,409.000	2,255,029.300	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA	29,010.000	216,704.700	
	MERCIALYS	18,098.000	220,071.680	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	144,039.000	1,566,424.120	
	MONTEA SCA	1,490.000	86,420.000	
	NSI NV	7,526.000	257,765.500	
	RETAIL ESTATES	3,101.000	236,296.200	
	UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	53,854.000	7,716,201.120	
	VASTNED RETAIL	5,588.000	173,507.400	
	WAREHOUSES DE PAUW	6,839.000	789,220.600	
	WERELDHAVE NV	16,067.000	447,305.280	
	ユーロ 小計	1,370,734.000	25,568,361.280 (3,191,954,222)	
	香港・ドル			
	CHAMPION REIT	647,070.000	3,565,355.700	
	FORTUNE REAL ESTATE (HK)	459,000.000	4,268,700.000	
	LINK REIT	690,520.000	54,758,236.000	
	PROSPERITY REIT	390,000.000	1,209,000.000	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	279,000.000	1,450,800.000	
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	435,000.000	2,244,600.000	
	香港・ドル 小計	2,900,590.000	67,496,691.700 (934,154,214)	
投資証券 合計		21,772,160	40,893,156,516 (40,893,156,516)	
合計			44,997,819,845 (44,997,819,845)	

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 157銘柄	-%	86.63%	74.06%
イギリス・ポンド	投資証券 27銘柄	-%	6.19%	5.29%
イスラエル・シケル	投資証券 1銘柄	-%	0.06%	0.05%
オーストラリア・ドル	投資信託受益証券 25銘柄	6.96%	-%	5.95%
カナダ・ドル	投資信託受益証券 1銘柄 投資証券 25銘柄	0.06% -%	-% 2.23%	1.96%
シンガポール・ドル	投資信託受益証券 30銘柄	3.65%	-%	3.12%
ニュージーランド・ドル	投資証券 6銘柄	-%	0.46%	0.39%
ユーロ	投資証券 28銘柄	-%	8.30%	7.09%

香港・ドル	投資証券	6銘柄	-%	2.43%	2.08%
-------	------	-----	----	-------	-------

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

## 「為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成30年1月11日現在	平成31年1月11日現在
資産の部			
流動資産			
預金		194,211,625	4,957,421,720
コール・ローン		16,369,828,774	23,058,949,456
国債証券		257,363,274,468	280,518,393,946
派生商品評価勘定		3,169,354,253	2,289,344,712
未収入金		424,832,472	125,047,606
未収利息		1,710,167,438	1,896,026,464
前払費用		253,433,853	350,541,979
流動資産合計		279,485,102,883	313,195,725,883
資産合計		279,485,102,883	313,195,725,883
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		108,103,162	268,565,372
未払金		14,393,773,859	9,774,476
未払解約金		37,599,000	20,751,274,000
流動負債合計		14,539,476,021	21,029,613,848
負債合計		14,539,476,021	21,029,613,848
純資産の部			
元本等			
元本	1	199,035,898,706	219,411,521,246
剰余金			
剰余金又は欠損金( )		65,909,728,156	72,754,590,789
元本等合計		264,945,626,862	292,166,112,035
純資産合計		264,945,626,862	292,166,112,035
負債純資産合計		279,485,102,883	313,195,725,883



## 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1月11日現在	平成31年1月11日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額 同期中追加設定元本額 同期中一部解約元本額	131,360,464,925円  77,264,290,403円 9,588,856,622円	199,035,898,706円  192,648,894,792円 172,273,272,252円
元本の内訳		
ファンド名		
たわらノーロード 先進国債券 <為替ヘッジあり>	1,371,990,619円	2,541,588,844円
たわらノーロード バランス (堅実型)	1,111,328円	39,692,572円
たわらノーロード バランス (標準型)	3,216,299円	108,015,715円
たわらノーロード バランス (積極型)	4,148,746円	66,384,511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)	217,449円	3,171,241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)	228,647円	96,614,108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)	176,521円	155,789,675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)	121,387円	51,031,337円
たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(積極型)	53,621円	42,217,203円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(保守型)	- 円	994,940円

たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	- 円	1,565,962円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	- 円	5,270,118円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	- 円	1,564,742円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	- 円	1,484,463円
投資のソムリエ	32,526,151,669円	39,714,410,033円
投資のソムリエ<DC年金>	2,062,045,129円	3,625,824,284円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	1,712,840,756円	3,099,194,888円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	23,751,087,877円	53,514,646,349円
ワールドアセットバランス(基本コース)	5,065,279,117円	4,716,820,251円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	19,501,495,101円	9,389,872,068円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	1,851,588円	8,138,115円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	1,851,588円	6,322,250円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	7,956,474円	19,290,361円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	2,261,149円	14,912,929円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	- 円	7,479,169,253円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	- 円	283,833円
外国債券パッシブファンド2(為替フルヘッジ)(適格機関投資家限定)	8,840,073,265円	8,814,294,746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)	21,132,977,228円	11,469,553,596円
DIAM世界アセットバランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	1,132,048,640円	336,916,667円
DIAM世界アセットバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	7,261,638,027円	6,517,289,100円
DIAM世界アセットバランスファンド3VA(適格機関投資家限定)	34,401,391,575円	31,138,685,642円
DIAMバランス30VA(適格機関投資家限定)	3,226,003円	27,119,601円
DIAM世界アセットバランスファンド4VA(適格機関投資家限定)	30,601,099,769円	27,754,379,971円
DIAMバランス20VA(適格機関投資家限定)	147,846,567円	144,225,620円

	D I A M世界アセットバランス ファンド7 V A ( 1 2 1 2 ) ( 適格機関投資家限定 )	2,852,126,136円	2,343,618,618円
	D I A M世界アセットバランス ファンド7 V A ( 1 3 0 3 ) ( 適格機関投資家限定 )	2,672,709,186円	2,597,230,650円
	D I A M世界アセットバランス ファンド7 V A ( 1 3 0 6 ) ( 適格機関投資家限定 )	3,520,962,596円	3,430,389,721円
	D I A M世界アセットバランス ファンド7 V A ( 1 3 0 9 ) ( 適格機関投資家限定 )	455,714,649円	133,547,269円
	計	199,035,898,706円	219,411,521,246円
2 .	受益権の総数	199,035,898,706口	219,411,521,246口

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成29年6月23日 至 平成30年1月11日	自 平成30年1月12日 至 平成31年1月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成30年1月11日現在	平成31年1月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

(有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	平成30年1月11日現在	平成31年1月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
国債証券	4,254,220,070	1,508,696,309
合計	4,254,220,070	1,508,696,309

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(平成29年6月23日から平成30年1月11日まで及び平成30年6月23日から平成31年1月11日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

## 通貨関連

種類	平成30年1月11日 現在				平成31年1月11日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	263,900,648,588	-	260,741,033,698	3,159,614,890	289,674,664,755	-	287,653,885,415	2,020,779,340
アメリカ・ドル	113,413,762,270	-	112,270,583,744	1,143,178,526	133,657,561,192	-	132,183,683,808	1,473,877,384
イギリス・ポンド	18,852,459,581	-	18,631,057,200	221,402,381	19,317,818,398	-	19,106,991,220	210,827,178
オーストラリア・ドル	5,826,599,654	-	5,806,146,360	20,453,294	6,040,012,262	-	6,099,661,404	59,649,142
カナダ・ドル	5,768,253,269	-	5,705,127,120	63,126,149	5,714,264,994	-	5,828,708,889	114,443,895
シンガポール・ドル	994,570,780	-	987,193,380	7,377,400	962,746,989	-	959,997,465	2,749,524
スウェーデン・クローナ	1,237,389,129	-	1,225,022,490	12,366,639	887,609,818	-	874,149,776	13,460,042
デンマーク・クローネ	1,519,660,746	-	1,496,299,921	23,360,825	1,463,445,147	-	1,455,410,792	8,034,355
ノルウェー・クローネ	754,064,899	-	755,011,800	946,901	548,344,045	-	553,550,364	5,206,319
ポーランド・ズロチ	1,707,996,495	-	1,684,745,511	23,250,984	1,589,414,495	-	1,580,888,600	8,525,895
マレーシア・リンギット	1,197,215,604	-	1,182,594,600	14,621,004	1,101,256,326	-	1,106,796,600	5,540,274
メキシコ・ペソ	1,942,105,705	-	1,947,386,266	5,280,561	2,203,784,314	-	2,244,366,283	40,581,969

ユーロ	109,120,772,255	-	107,506,252,356	1,614,519,899	114,562,437,906	-	113,990,567,572	571,870,334
南アフリ カ・ランド	1,565,798,201	-	1,543,612,950	22,185,251	1,625,968,869	-	1,669,112,642	43,143,773
買 建	13,964,225,786	-	13,865,861,987	98,363,799	-	-	-	-
アメリカ・ ドル	5,734,111,661	-	5,692,741,478	41,370,183	-	-	-	-
イギリス・ ポンド	953,199,492	-	944,480,439	8,719,053	-	-	-	-
オーストラ リア・ドル	345,712,212	-	345,554,748	157,464	-	-	-	-
カナダ・ド ル	355,300,340	-	350,647,128	4,653,212	-	-	-	-
シンガポー ル・ドル	102,073,120	-	101,514,680	558,440	-	-	-	-
スウェーデ ン・クロー ナ	175,819,312	-	175,381,182	438,130	-	-	-	-
デンマー ク・クロー ネ	59,854,434	-	59,455,626	398,808	-	-	-	-
ノル ウェー・ク ローネ	161,606,280	-	160,848,660	757,620	-	-	-	-
ポーラン ド・ズロチ	157,898,291	-	157,405,321	492,970	-	-	-	-
マレーシ ア・リン ギット	166,158,392	-	165,362,160	796,232	-	-	-	-
メキシコ・ ペソ	234,358,782	-	231,351,612	3,007,170	-	-	-	-
ユーロ	5,428,869,124	-	5,393,248,748	35,620,376	-	-	-	-
南アフリ カ・ランド	89,264,346	-	87,870,205	1,394,141	-	-	-	-
合計	277,864,874,374	-	274,606,895,685	3,061,251,091	289,674,664,755	-	287,653,885,415	2,020,779,340

## （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1月11日現在	平成31年1月11日現在
1口当たり純資産額	1.3311円	1.3316円
（1万口当たり純資産額）	（13,311円）	（13,316円）



## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

平成31年1月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	US T N/B 1.125 03/31/20	11,000,000.000	10,804,860.000	
		US T N/B 1.125 06/30/21	10,000,000.000	9,666,400.000	
		US T N/B 1.125 07/31/21	13,900,000.000	13,412,388.000	
		US T N/B 1.125 08/31/21	11,000,000.000	10,602,020.000	
		US T N/B 1.125 09/30/21	430,000.000	414,274.900	
		US T N/B 1.25 02/29/20	4,200,000.000	4,137,000.000	
		US T N/B 1.25 07/31/23	8,400,000.000	7,932,036.000	
		US T N/B 1.25 10/31/21	10,500,000.000	10,134,075.000	
		US T N/B 1.375 02/29/20	6,420,000.000	6,331,725.000	
		US T N/B 1.375 03/31/20	7,620,000.000	7,506,843.000	
		US T N/B 1.375 04/30/20	11,510,000.000	11,329,177.900	
		US T N/B 1.375 04/30/21	10,000,000.000	9,737,500.000	
		US T N/B 1.375 05/31/20	12,010,000.000	11,808,232.000	
		US T N/B 1.375 05/31/21	12,350,000.000	12,015,191.500	
		US T N/B 1.375 06/30/23	550,000.000	522,714.500	
		US T N/B 1.375 08/31/23	9,500,000.000	9,010,085.000	
		US T N/B 1.375 09/30/20	10,640,000.000	10,422,199.200	
		US T N/B 1.375 09/30/23	9,000,000.000	8,528,850.000	
		US T N/B 1.375 10/31/20	10,000,000.000	9,787,500.000	
		US T N/B 1.5 06/15/20	13,000,000.000	12,797,330.000	
		US T N/B 1.5 08/15/26	9,800,000.000	9,019,038.000	
		US T N/B 1.625 02/15/26	9,630,000.000	8,995,768.200	
		US T N/B 1.625 04/30/23	9,800,000.000	9,430,148.000	
		US T N/B 1.625 05/15/26	9,000,000.000	8,386,830.000	
		US T N/B 1.625 05/31/23	1,460,000.000	1,403,877.600	
		US T N/B 1.625 07/31/20	19,250,000.000	18,964,137.500	
		US T N/B 1.625 08/31/22	3,280,000.000	3,175,696.000	
		US T N/B 1.625 11/15/22	1,120,000.000	1,082,368.000	
		US T N/B 1.625 11/30/20	10,000,000.000	9,824,200.000	
		US T N/B 1.75 02/28/22	10,500,000.000	10,252,200.000	
		US T N/B 1.75 05/15/22	1,250,000.000	1,218,400.000	
		US T N/B 1.75 05/15/23	5,000,000.000	4,835,150.000	
		US T N/B 1.75 05/31/22	9,490,000.000	9,243,829.400	
		US T N/B 1.75 09/30/22	5,360,000.000	5,209,652.000	
		US T N/B 1.75 11/30/21	1,380,000.000	1,349,695.200	
		US T N/B 1.75 12/31/20	12,590,000.000	12,399,135.600	
US T N/B 1.875 01/31/22	6,840,000.000	6,706,346.400			
US T N/B 1.875 02/28/22	2,440,000.000	2,391,370.800			
US T N/B 1.875 03/31/22	13,300,000.000	13,028,680.000			
US T N/B 1.875 04/30/22	10,390,000.000	10,167,550.100			

US T N/B 1.875 08/31/24	7,320,000.000	7,049,452.800	
US T N/B 1.875 09/30/22	8,860,000.000	8,651,612.800	
US T N/B 2.0 02/15/22	10,000,000.000	9,841,700.000	
US T N/B 2.0 02/15/23	14,000,000.000	13,702,500.000	
US T N/B 2.0 02/15/25	8,600,000.000	8,303,644.000	
US T N/B 2.0 05/31/21	11,560,000.000	11,412,725.600	
US T N/B 2.0 05/31/24	3,500,000.000	3,399,235.000	
US T N/B 2.0 06/30/24	210,000.000	203,830.200	
US T N/B 2.0 07/31/20	12,600,000.000	12,483,828.000	
US T N/B 2.0 08/15/25	11,600,000.000	11,157,692.000	
US T N/B 2.0 08/31/21	7,060,000.000	6,960,665.800	
US T N/B 2.0 09/30/20	12,660,000.000	12,535,299.000	
US T N/B 2.0 10/31/22	4,280,000.000	4,195,726.800	
US T N/B 2.0 11/15/21	7,900,000.000	7,784,265.000	
US T N/B 2.0 11/15/26	8,900,000.000	8,480,009.000	
US T N/B 2.0 11/30/22	12,020,000.000	11,778,638.400	
US T N/B 2.0 12/31/21	14,720,000.000	14,499,200.000	
US T N/B 2.125 03/31/24	620,000.000	606,484.000	
US T N/B 2.125 05/15/25	8,400,000.000	8,156,484.000	
US T N/B 2.125 07/31/24	2,100,000.000	2,049,957.000	
US T N/B 2.125 08/15/21	9,590,000.000	9,487,291.100	
US T N/B 2.125 08/31/20	11,660,000.000	11,571,617.200	
US T N/B 2.125 09/30/21	9,800,000.000	9,692,788.000	
US T N/B 2.125 09/30/24	2,720,000.000	2,653,060.800	
US T N/B 2.125 11/30/23	10,290,000.000	10,084,920.300	
US T N/B 2.125 11/30/24	3,970,000.000	3,867,613.700	
US T N/B 2.125 12/31/21	7,000,000.000	6,920,130.000	
US T N/B 2.125 12/31/22	13,500,000.000	13,283,730.000	
US T N/B 2.25 01/31/24	3,780,000.000	3,723,867.000	
US T N/B 2.25 02/15/27	10,300,000.000	9,966,795.000	
US T N/B 2.25 02/29/20	40,000.000	39,848.400	
US T N/B 2.25 03/31/21	11,920,000.000	11,842,639.200	
US T N/B 2.25 08/15/27	10,030,000.000	9,685,971.000	
US T N/B 2.25 08/15/46	6,000,000.000	5,096,700.000	
US T N/B 2.25 10/31/24	4,560,000.000	4,474,819.200	
US T N/B 2.25 11/15/24	12,600,000.000	12,362,742.000	
US T N/B 2.25 11/15/25	10,800,000.000	10,537,560.000	
US T N/B 2.25 11/15/27	12,870,000.000	12,406,422.600	
US T N/B 2.25 12/31/23	9,550,000.000	9,411,907.000	
US T N/B 2.25 12/31/24	4,530,000.000	4,441,846.200	
US T N/B 2.375 01/31/23	2,760,000.000	2,741,646.000	
US T N/B 2.375 05/15/27	9,600,000.000	9,379,488.000	
US T N/B 2.375 08/15/24	12,610,000.000	12,471,037.800	
US T N/B 2.5 01/31/25	2,980,000.000	2,962,745.800	
US T N/B 2.5 02/15/45	5,610,000.000	5,053,375.800	
US T N/B 2.5 02/15/46	5,600,000.000	5,025,552.000	
US T N/B 2.5 03/31/23	6,720,000.000	6,706,828.800	
US T N/B 2.5 05/15/24	10,790,000.000	10,747,811.100	
US T N/B 2.5 05/15/46	4,870,000.000	4,366,977.700	

US T N/B 2.5 08/15/23	6,700,000.000	6,684,255.000	
US T N/B 2.625 02/28/23	1,190,000.000	1,193,617.600	
US T N/B 2.625 03/31/25	2,400,000.000	2,401,680.000	
US T N/B 2.625 06/30/23	2,650,000.000	2,658,268.000	
US T N/B 2.625 08/15/20	13,350,000.000	13,352,536.500	
US T N/B 2.625 08/31/20	12,790,000.000	12,794,476.500	
US T N/B 2.625 11/15/20	11,860,000.000	11,865,930.000	
US T N/B 2.625 12/15/21	11,320,000.000	11,347,847.200	
US T N/B 2.75 02/15/24	11,930,000.000	12,033,433.100	
US T N/B 2.75 02/15/28	10,150,000.000	10,176,897.500	
US T N/B 2.75 02/28/25	6,290,000.000	6,339,628.100	
US T N/B 2.75 04/30/23	10,670,000.000	10,756,640.400	
US T N/B 2.75 05/31/23	3,880,000.000	3,913,639.600	
US T N/B 2.75 06/30/25	8,100,000.000	8,163,909.000	
US T N/B 2.75 07/31/23	2,100,000.000	2,117,871.000	
US T N/B 2.75 08/15/42	3,220,000.000	3,067,533.000	
US T N/B 2.75 08/15/47	5,850,000.000	5,490,751.500	
US T N/B 2.75 08/31/23	7,030,000.000	7,092,567.000	
US T N/B 2.75 08/31/25	480,000.000	483,633.600	
US T N/B 2.75 09/15/21	2,960,000.000	2,975,836.000	
US T N/B 2.75 09/30/20	18,860,000.000	18,909,224.600	
US T N/B 2.75 11/15/23	7,000,000.000	7,061,250.000	
US T N/B 2.75 11/15/42	4,500,000.000	4,281,480.000	
US T N/B 2.75 11/15/47	6,690,000.000	6,290,673.900	
US T N/B 2.75 11/30/20	5,110,000.000	5,125,738.800	
US T N/B 2.875 04/30/25	4,220,000.000	4,283,595.400	
US T N/B 2.875 05/15/28	9,170,000.000	9,283,891.400	
US T N/B 2.875 05/15/43	5,980,000.000	5,809,450.400	
US T N/B 2.875 05/31/25	4,550,000.000	4,618,250.000	
US T N/B 2.875 07/31/25	2,720,000.000	2,761,208.000	
US T N/B 2.875 08/15/28	11,120,000.000	11,256,331.200	
US T N/B 2.875 08/15/45	7,640,000.000	7,398,805.200	
US T N/B 2.875 09/30/23	7,810,000.000	7,919,808.600	
US T N/B 2.875 10/15/21	13,100,000.000	13,213,053.000	
US T N/B 2.875 10/31/20	16,820,000.000	16,903,427.200	
US T N/B 2.875 10/31/23	9,290,000.000	9,422,754.100	
US T N/B 2.875 11/15/21	8,440,000.000	8,515,453.600	
US T N/B 2.875 11/15/46	6,200,000.000	5,995,090.000	
US T N/B 2.875 11/30/23	9,810,000.000	9,957,836.700	
US T N/B 2.875 11/30/25	6,780,000.000	6,884,818.800	
US T N/B 3.0 02/15/47	6,000,000.000	5,947,500.000	
US T N/B 3.0 02/15/48	6,450,000.000	6,374,406.000	
US T N/B 3.0 05/15/42	2,310,000.000	2,300,690.700	
US T N/B 3.0 05/15/45	6,200,000.000	6,156,848.000	
US T N/B 3.0 05/15/47	5,920,000.000	5,845,052.800	
US T N/B 3.0 08/15/48	5,790,000.000	5,724,862.500	
US T N/B 3.0 09/30/25	7,430,000.000	7,602,376.000	
US T N/B 3.0 10/31/25	6,560,000.000	6,712,716.800	
US T N/B 3.0 11/15/44	6,500,000.000	6,454,760.000	

US T N/B 3.0 11/15/45	4,040,000.000	4,008,084.000	
US T N/B 3.125 02/15/42	2,760,000.000	2,811,198.000	
US T N/B 3.125 02/15/43	6,130,000.000	6,225,260.200	
US T N/B 3.125 05/15/21	100,000.000	101,304.000	
US T N/B 3.125 05/15/48	8,270,000.000	8,375,277.100	
US T N/B 3.125 08/15/44	6,260,000.000	6,358,782.800	
US T N/B 3.125 11/15/28	6,010,000.000	6,212,356.700	
US T N/B 3.125 11/15/41	2,350,000.000	2,393,874.500	
US T N/B 3.375 05/15/44	6,300,000.000	6,673,527.000	
US T N/B 3.375 11/15/48	6,700,000.000	7,123,976.000	
US T N/B 3.5 02/15/39	2,150,000.000	2,340,963.000	
US T N/B 3.625 02/15/21	2,010,000.000	2,052,772.800	
US T N/B 3.625 02/15/44	7,940,000.000	8,754,405.800	
US T N/B 3.625 08/15/43	5,590,000.000	6,158,558.900	
US T N/B 3.75 11/15/43	7,740,000.000	8,699,605.200	
US T N/B 3.875 08/15/40	2,450,000.000	2,799,688.500	
US T N/B 4.25 05/15/39	1,790,000.000	2,150,935.600	
US T N/B 4.25 11/15/40	3,650,000.000	4,389,672.500	
US T N/B 4.375 02/15/38	1,210,000.000	1,475,716.000	
US T N/B 4.375 05/15/40	2,790,000.000	3,409,463.700	
US T N/B 4.375 05/15/41	2,100,000.000	2,572,983.000	
US T N/B 4.375 11/15/39	2,000,000.000	2,441,400.000	
US T N/B 4.5 02/15/36	2,180,000.000	2,674,402.200	
US T N/B 4.5 05/15/38	840,000.000	1,040,743.200	
US T N/B 4.5 08/15/39	2,000,000.000	2,480,300.000	
US T N/B 4.625 02/15/40	3,370,000.000	4,248,828.600	
US T N/B 4.75 02/15/41	2,600,000.000	3,342,404.000	
US T N/B 5.0 05/15/37	890,000.000	1,163,114.300	
US T N/B 5.25 02/15/29	830,000.000	1,012,110.300	
US T N/B 5.25 11/15/28	1,700,000.000	2,065,551.000	
US T N/B 5.375 02/15/31	2,300,000.000	2,910,558.000	
US T N/B 5.5 08/15/28	930,000.000	1,145,853.000	
US T N/B 6.0 02/15/26	800,000.000	973,184.000	
US T N/B 6.125 11/15/27	2,050,000.000	2,597,801.000	
US T N/B 6.25 05/15/30	1,200,000.000	1,604,856.000	
US T N/B 6.25 08/15/23	1,200,000.000	1,390,212.000	
US T N/B 6.5 11/15/26	500,000.000	635,390.000	
US T N/B 8.0 11/15/21	2,100,000.000	2,410,800.000	
アメリカ・ドル 小計	1,197,590,000.000 (129,902,587,300)	1,191,393,373.100 (129,230,439,180)	
イギリス・ポンド			
UK TREASURY 0.5 07/22/22	3,560,000.000	3,521,516.400	
UK TREASURY 0.75 07/22/23	4,080,000.000	4,051,072.800	
UK TREASURY 1.0 04/22/24	2,070,000.000	2,071,593.900	
UK TREASURY 1.25 07/22/27	3,650,000.000	3,671,863.500	

UK TREASURY 1.5 01/22/21	4,310,000.000	4,374,132.800	
UK TREASURY 1.5 07/22/26	2,850,000.000	2,937,523.500	
UK TREASURY 1.5 07/22/47	3,310,000.000	3,095,512.000	
UK TREASURY 1.625 10/22/28	3,000,000.000	3,097,920.000	
UK TREASURY 1.625 10/22/71	1,450,000.000	1,433,629.500	
UK TREASURY 1.75 01/22/49	720,000.000	713,592.000	
UK TREASURY 1.75 07/22/57	2,020,000.000	2,053,734.000	
UK TREASURY 1.75 09/07/22	3,840,000.000	3,966,873.600	
UK TREASURY 1.75 09/07/37	1,430,000.000	1,438,437.000	
UK TREASURY 2.0 09/07/25	3,130,000.000	3,330,288.700	
UK TREASURY 2.25 09/07/23	1,970,000.000	2,091,352.000	
UK TREASURY 2.5 07/22/65	2,950,000.000	3,738,771.000	
UK TREASURY 2.75 09/07/24	2,500,000.000	2,745,800.000	
UK TREASURY 3.25 01/22/44	3,680,000.000	4,750,144.000	
UK TREASURY 3.5 01/22/45	3,810,000.000	5,148,834.000	
UK TREASURY 3.5 07/22/68	2,930,000.000	4,720,816.000	
UK TREASURY 3.75 07/22/52	2,920,000.000	4,416,500.000	
UK TREASURY 3.75 09/07/20	3,050,000.000	3,199,145.000	
UK TREASURY 3.75 09/07/21	2,200,000.000	2,372,260.000	
UK TREASURY 4.0 01/22/60	2,170,000.000	3,663,611.000	
UK TREASURY 4.0 03/07/22	2,350,000.000	2,586,245.500	
UK TREASURY 4.25 03/07/36	3,460,000.000	4,806,978.000	
UK TREASURY 4.25 06/07/32	2,440,000.000	3,260,816.000	
UK TREASURY 4.25 09/07/39	2,250,000.000	3,235,725.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/27	2,290,000.000	2,887,552.600	

	UK TREASURY 4.25 12/07/40	2,820,000.000	4,104,792.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/46	2,690,000.000	4,134,530.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/49	2,130,000.000	3,383,079.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/55	2,850,000.000	4,839,015.000	
	UK TREASURY 4.5 09/07/34	3,020,000.000	4,238,872.000	
	UK TREASURY 4.5 12/07/42	3,040,000.000	4,656,976.000	
	UK TREASURY 4.75 12/07/30	2,320,000.000	3,176,776.000	
	UK TREASURY 4.75 12/07/38	2,530,000.000	3,836,998.000	
	UK TREASURY 5.0 03/07/25	2,200,000.000	2,723,908.000	
	UK TREASURY 6.0 12/07/28	1,450,000.000	2,092,147.000	
	UK TREASURY 8.0 06/07/21	1,520,000.000	1,783,020.800	
	イギリス・ポンド 小計	106,960,000.000 (14,784,011,200)	132,352,353.600 (18,293,742,315)	
オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN 5.75 05/15/21	5,340,000.000	5,813,871.600	
	AUSTRALIAN 1.75 11/21/20	4,500,000.000	4,487,850.000	
	AUSTRALIAN 2.0 12/21/21	2,700,000.000	2,713,905.000	
	AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	4,120,000.000	4,096,104.000	
	AUSTRALIAN 2.25 11/21/22	2,190,000.000	2,221,995.900	
	AUSTRALIAN 2.5 05/21/30	1,620,000.000	1,643,862.600	
	AUSTRALIAN 2.75 04/21/24	4,000,000.000	4,150,960.000	
	AUSTRALIAN 2.75 05/21/41	590,000.000	587,250.600	
	AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	1,100,000.000	1,126,059.000	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	4,610,000.000	4,778,080.600	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/28	4,200,000.000	4,360,524.000	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/29	3,130,000.000	3,254,730.500	
	AUSTRALIAN 3.0 03/21/47	2,040,000.000	2,107,707.600	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	3,560,000.000	3,801,225.600	

	AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	3,100,000.000	3,363,066.000	
	AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	1,330,000.000	1,443,808.100	
	AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	2,010,000.000	2,333,770.800	
	AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	5,250,000.000	5,979,802.500	
	AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	2,220,000.000	2,764,099.800	
	AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	4,750,000.000	5,646,087.500	
	AUSTRALIAN 5.5 04/21/23	3,820,000.000	4,383,870.200	
	AUSTRALIAN 5.75 07/15/22	3,890,000.000	4,406,553.100	
オーストラリア・ドル 小計		70,070,000.000 (5,465,460,000)	75,465,185.000 (5,886,284,430)	
カナダ・ドル	CANADA 8.0 06/01/27	900,000.000	1,317,582.000	
	CANADA 0.5 03/01/22	2,280,000.000	2,182,644.000	
	CANADA 0.75 03/01/21	5,890,000.000	5,748,993.400	
	CANADA 0.75 09/01/20	4,600,000.000	4,516,096.000	
	CANADA 0.75 09/01/21	2,790,000.000	2,707,555.500	
	CANADA 1.0 06/01/27	2,690,000.000	2,493,683.800	
	CANADA 1.0 09/01/22	2,300,000.000	2,226,975.000	
	CANADA 1.5 06/01/23	2,200,000.000	2,162,886.000	
	CANADA 1.5 06/01/26	2,060,000.000	1,998,529.600	
	CANADA 1.75 03/01/23	1,910,000.000	1,897,928.800	
	CANADA 1.75 05/01/20	1,520,000.000	1,517,461.600	
	CANADA 1.75 08/01/20	1,940,000.000	1,935,576.800	
	CANADA 2.0 06/01/28	2,220,000.000	2,222,308.800	
	CANADA 2.0 09/01/23	2,820,000.000	2,831,844.000	
	CANADA 2.0 12/01/51	750,000.000	719,505.000	
	CANADA 2.25 03/01/24	670,000.000	680,907.600	
	CANADA 2.25 06/01/25	2,190,000.000	2,232,288.900	
	CANADA 2.25 06/01/29	810,000.000	828,387.000	
	CANADA 2.5 06/01/24	2,250,000.000	2,316,937.500	
	CANADA 2.75 06/01/22	1,850,000.000	1,900,912.000	
	CANADA 2.75 12/01/48	2,540,000.000	2,861,564.000	
	CANADA 2.75 12/01/64	770,000.000	906,005.100	
	CANADA 3.25 06/01/21	2,400,000.000	2,474,976.000	
	CANADA 3.5 06/01/20	2,000,000.000	2,043,860.000	
CANADA 3.5 12/01/45	2,070,000.000	2,619,502.200		
CANADA 4.0 06/01/41	2,480,000.000	3,273,079.200		
CANADA 5.0 06/01/37	1,800,000.000	2,577,078.000		
CANADA 5.75 06/01/29	1,700,000.000	2,293,946.000		
CANADA 5.75 06/01/33	1,850,000.000	2,689,918.500		
カナダ・ドル 小計		62,250,000.000 (5,100,765,000)	66,178,932.300 (5,422,701,713)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE 1.25 10/01/21	800,000.000	786,400.000	
	SINGAPORE 1.75 02/01/23	270,000.000	268,002.000	

	SINGAPORE 1.75 04/01/22	300,000.000	298,560.000	
	SINGAPORE 2.125 06/01/26	500,000.000	499,900.000	
	SINGAPORE 2.25 08/01/36	420,000.000	403,485.600	
	SINGAPORE 2.375 06/01/25	500,000.000	508,250.000	
	SINGAPORE 2.625 05/01/28	500,000.000	516,625.000	
	SINGAPORE 2.75 03/01/46	900,000.000	918,207.000	
	SINGAPORE 2.75 04/01/42	760,000.000	778,240.000	
	SINGAPORE 2.75 07/01/23	1,280,000.000	1,322,252.800	
	SINGAPORE 2.875 07/01/29	200,000.000	211,140.000	
	SINGAPORE 2.875 09/01/30	610,000.000	642,940.000	
	SINGAPORE 3.0 09/01/24	1,110,000.000	1,165,278.000	
	SINGAPORE 3.125 09/01/22	1,200,000.000	1,250,760.000	
	SINGAPORE 3.375 09/01/33	1,010,000.000	1,122,655.400	
	SINGAPORE 3.5 03/01/27	1,260,000.000	1,385,748.000	
シンガポール・ドル 小計		11,620,000.000 (932,737,400)	12,078,443.800 (969,536,684)	
スウェーデン・クローナ	SWEDEN 0.75 05/12/28	8,540,000.000	8,802,178.000	
	SWEDEN 0.75 11/12/29	5,560,000.000	5,643,844.800	
	SWEDEN 1.0 11/12/26	9,290,000.000	9,806,988.500	
	SWEDEN 1.5 11/13/23	12,920,000.000	13,897,527.200	
	SWEDEN 2.5 05/12/25	10,780,000.000	12,409,397.000	
	SWEDEN 3.5 03/30/39	7,610,000.000	10,869,134.700	
スウェーデン・クローナ 小計		54,700,000.000 (666,793,000)	61,429,070.200 (748,820,366)	
デンマーク・クローネ	DENMARK 0.5 11/15/27	14,860,000.000	15,295,695.200	
	DENMARK 1.5 11/15/23	8,570,000.000	9,312,590.500	
	DENMARK 1.75 11/15/25	12,910,000.000	14,511,356.400	
	DENMARK 4.5 11/15/39	21,610,000.000	37,854,020.900	
デンマーク・クローネ 小計		57,950,000.000 (968,924,000)	76,973,663.000 (1,286,999,645)	
ノルウェー・クローネ	NORWAY 1.5 02/19/26	5,610,000.000	5,577,630.300	
	NORWAY 1.75 02/17/27	7,030,000.000	7,070,281.900	
	NORWAY 1.75 03/13/25	5,990,000.000	6,076,675.300	
	NORWAY 2.0 04/26/28	2,820,000.000	2,875,948.800	
	NORWAY 2.0 05/24/23	9,380,000.000	9,658,023.200	
	NORWAY 3.0 03/14/24	9,430,000.000	10,177,704.700	
ノルウェー・クローネ 小計		40,260,000.000 (514,925,400)	41,436,264.200 (529,969,819)	
ポーランド・ズロチ	POLAND 1.75 07/25/21	4,500,000.000	4,520,250.000	
	POLAND 2.25 04/25/22	4,880,000.000	4,944,904.000	
	POLAND 2.5 01/25/23	6,870,000.000	6,995,034.000	
	POLAND 2.5 04/25/24	1,970,000.000	1,994,231.000	



	POLAND 2.5 07/25/26	5,520,000.000	5,460,660.000	
	POLAND 2.5 07/25/27	4,890,000.000	4,797,921.300	
	POLAND 2.75 04/25/28	4,230,000.000	4,203,139.500	
	POLAND 3.25 07/25/25	4,790,000.000	5,004,160.900	
	POLAND 4.0 10/25/23	4,070,000.000	4,406,792.500	
	POLAND 5.75 04/25/29	1,800,000.000	2,260,260.000	
	POLAND 5.75 09/23/22	3,380,000.000	3,836,840.800	
	POLAND 5.75 10/25/21	2,690,000.000	2,985,496.500	
ポーランド・ズロチ 小計		49,590,000.000 (1,440,589,500)	51,409,690.500 (1,493,451,509)	
マレーシア・リングgit	MALAYSIA 3.418 08/15/22	5,000,000.000	4,950,700.000	
	MALAYSIA 3.48 03/15/23	3,910,000.000	3,864,018.400	
	MALAYSIA 3.502 05/31/27	4,580,000.000	4,371,655.800	
	MALAYSIA 3.844 04/15/33	1,340,000.000	1,254,092.600	
	MALAYSIA 3.9 11/30/26	1,500,000.000	1,481,985.000	
	MALAYSIA 3.955 09/15/25	4,400,000.000	4,385,744.000	
	MALAYSIA 4.127 04/15/32	1,180,000.000	1,145,343.400	
	MALAYSIA 4.181 07/15/24	2,190,000.000	2,218,032.000	
	MALAYSIA 4.232 06/30/31	2,000,000.000	1,975,540.000	
	MALAYSIA 4.392 04/15/26	1,480,000.000	1,508,638.000	
	MALAYSIA 4.498 04/15/30	2,820,000.000	2,867,883.600	
	MALAYSIA 4.642 11/07/33	1,050,000.000	1,076,806.500	
	MALAYSIA 4.762 04/07/37	5,540,000.000	5,685,369.600	
	MALAYSIA 4.935 09/30/43	3,470,000.000	3,563,065.400	
	MALAYSIA 5.248 09/15/28	1,480,000.000	1,600,368.400	
マレーシア・リングgit 小計		41,940,000.000 (1,110,571,200)	41,949,242.700 (1,110,815,947)	
メキシコ・ペソ	MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	13,880,000.000	15,249,262.000	
	MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	66,505,000.000	70,991,427.300	
	MEXICAN BONDS 5.75 03/05/26	24,224,000.000	20,566,660.480	
	MEXICAN BONDS 6.5 06/09/22	42,000,000.000	39,566,520.000	
	MEXICAN BONDS 6.5 06/10/21	47,648,000.000	45,635,824.960	
	MEXICAN BONDS 7.25 12/09/21	11,110,000.000	10,758,035.200	
	MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	37,069,000.000	34,565,730.430	
	MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	21,054,000.000	19,370,943.240	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	38,302,000.000	33,870,075.580	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	16,399,000.000	14,844,374.800	
	MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47	11,366,000.000	10,258,042.320	

	MEXICAN BONDS 8.0 12/07/23	22,730,000.000	22,304,267.100	
	MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	16,000,000.000	15,741,280.000	
	MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	17,526,000.000	16,850,372.700	
メキシコ・ペソ 小計		385,813,000.000 (2,187,559,710)	370,572,816.110 (2,101,147,867)	
ユーロ	AUSTRIA 0.5 04/20/27	2,300,000.000	2,324,035.000	
	AUSTRIA 0.75 02/20/28	760,000.000	778,832.800	
	AUSTRIA 0.75 10/20/26	1,700,000.000	1,761,013.000	
	AUSTRIA 07/15/23	1,430,000.000	1,442,727.000	
	AUSTRIA 09/20/22	800,000.000	809,256.000	
	AUSTRIA 1.2 10/20/25	1,940,000.000	2,081,891.600	
	AUSTRIA 1.5 02/20/47	760,000.000	790,992.800	
	AUSTRIA 1.5 11/02/86	340,000.000	321,388.400	
	AUSTRIA 1.65 10/21/24	1,580,000.000	1,734,745.200	
	AUSTRIA 1.75 10/20/23	1,820,000.000	1,990,716.000	
	AUSTRIA 2.1 09/20/17	730,000.000	851,289.500	
	AUSTRIA 2.4 05/23/34	1,190,000.000	1,436,579.900	
	AUSTRIA 3.15 06/20/44	1,040,000.000	1,477,892.000	
	AUSTRIA 3.4 11/22/22	3,350,000.000	3,835,817.000	
	AUSTRIA 3.65 04/20/22	1,270,000.000	1,437,830.500	
	AUSTRIA 3.8 01/26/62	600,000.000	1,052,862.000	
	AUSTRIA 3.9 07/15/20	2,450,000.000	2,613,905.000	
	AUSTRIA 4.15 03/15/37	1,980,000.000	3,006,828.000	
	AUSTRIA 4.85 03/15/26	1,400,000.000	1,867,138.000	
	AUSTRIA 6.25 07/15/27	1,160,000.000	1,734,524.800	
	BELGIUM 0.2 10/22/23	2,020,000.000	2,043,836.000	
	BELGIUM 0.5 10/22/24	1,500,000.000	1,530,435.000	
	BELGIUM 0.8 06/22/25	2,430,000.000	2,516,872.500	
	BELGIUM 0.8 06/22/27	2,050,000.000	2,085,752.000	
	BELGIUM 0.8 06/22/28	1,650,000.000	1,661,500.500	
	BELGIUM 1.0 06/22/26	2,050,000.000	2,136,940.500	
	BELGIUM 1.0 06/22/31	1,500,000.000	1,496,250.000	
	BELGIUM 1.25 04/22/33	700,000.000	708,379.000	
	BELGIUM 1.45 06/22/37	600,000.000	602,028.000	
	BELGIUM 1.6 06/22/47	1,750,000.000	1,709,295.000	
	BELGIUM 1.9 06/22/38	1,220,000.000	1,312,305.200	
	BELGIUM 2.15 06/22/66	640,000.000	663,744.000	
	BELGIUM 2.25 06/22/23	1,850,000.000	2,049,319.000	
BELGIUM 2.25 06/22/57	810,000.000	876,314.700		
BELGIUM 2.6 06/22/24	2,260,000.000	2,570,433.600		
BELGIUM 3.0 06/22/34	1,200,000.000	1,500,012.000		
BELGIUM 3.75 06/22/45	1,480,000.000	2,153,059.600		
BELGIUM 3.75 09/28/20	2,520,000.000	2,705,598.000		
BELGIUM 4.0 03/28/22	2,130,000.000	2,430,095.700		
BELGIUM 4.0 03/28/32	1,550,000.000	2,114,510.000		
BELGIUM 4.25 03/28/41	2,830,000.000	4,274,969.700		

BELGIUM 4.25 09/28/21	2,400,000.000	2,706,864.000	
BELGIUM 4.25 09/28/22	2,300,000.000	2,689,781.000	
BELGIUM 4.5 03/28/26	1,500,000.000	1,940,625.000	
BELGIUM 5.0 03/28/35	2,750,000.000	4,256,175.000	
BELGIUM 5.5 03/28/28	3,370,000.000	4,823,615.800	
BUNDESUBL 0.25 10/16/20	3,000,000.000	3,046,230.000	
BUNDESUBL 04/08/22	2,500,000.000	2,542,825.000	
BUNDESUBL 04/09/21	2,850,000.000	2,888,190.000	
BUNDESUBL 04/14/23	2,960,000.000	3,012,273.600	
BUNDESUBL 04/17/20	2,950,000.000	2,972,892.000	
BUNDESUBL 10/07/22	3,000,000.000	3,054,450.000	
BUNDESUBL 10/08/21	3,400,000.000	3,452,632.000	
BUNDESUBL 10/13/23	4,800,000.000	4,880,160.000	
BUNDESSCHAT 06/12/20	4,950,000.000	4,993,857.000	
BUNDESSCHAT 09/11/20	5,060,000.000	5,112,573.400	
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27	3,800,000.000	3,871,820.000	
DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28	3,420,000.000	3,437,134.200	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25	3,440,000.000	3,587,232.000	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26	4,000,000.000	4,168,560.000	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28	3,330,000.000	3,439,723.500	
DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27	4,490,000.000	4,655,276.900	
DEUTSCHLAND 08/15/26	3,770,000.000	3,779,990.500	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/24	3,100,000.000	3,319,542.000	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25	3,410,000.000	3,669,807.900	
DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48	1,920,000.000	2,120,620.800	
DEUTSCHLAND 1.5 02/15/23	3,100,000.000	3,348,341.000	
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/23	3,070,000.000	3,327,388.800	
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/24	2,600,000.000	2,849,860.000	
DEUTSCHLAND 1.5 09/04/22	3,300,000.000	3,541,560.000	
DEUTSCHLAND 1.75 02/15/24	2,090,000.000	2,312,250.600	
DEUTSCHLAND 1.75 07/04/22	3,350,000.000	3,615,320.000	
DEUTSCHLAND 2.0 01/04/22	2,700,000.000	2,906,091.000	
DEUTSCHLAND 2.0 08/15/23	2,900,000.000	3,220,508.000	

DEUTSCHLAND 2.25 09/04/20	3,000,000.000	3,142,710.000	
DEUTSCHLAND 2.25 09/04/21	2,700,000.000	2,902,716.000	
DEUTSCHLAND 2.5 01/04/21	2,200,000.000	2,336,950.000	
DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	4,250,000.000	5,929,387.500	
DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	4,440,000.000	6,285,130.800	
DEUTSCHLAND 3.0 07/04/20	3,200,000.000	3,372,032.000	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/21	2,490,000.000	2,727,795.000	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	2,330,000.000	3,602,459.600	
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	2,990,000.000	4,732,572.000	
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	2,100,000.000	3,546,228.000	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	1,800,000.000	2,580,066.000	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	3,040,000.000	4,972,740.800	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	2,400,000.000	4,363,704.000	
DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	2,600,000.000	4,192,266.000	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/24	1,180,000.000	1,567,866.000	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	1,400,000.000	2,313,276.000	
DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	1,670,000.000	2,586,663.000	
FINLAND 0.375 09/15/20	1,150,000.000	1,167,238.500	
FINLAND 0.5 04/15/26	730,000.000	746,600.200	
FINLAND 0.5 09/15/27	600,000.000	606,540.000	
FINLAND 0.5 09/15/28	280,000.000	279,773.200	
FINLAND 0.75 04/15/31	750,000.000	753,825.000	
FINLAND 0.875 09/15/25	450,000.000	473,229.000	
FINLAND 04/15/22	770,000.000	779,209.200	
FINLAND 09/15/23	750,000.000	756,225.000	
FINLAND 1.125 04/15/34	610,000.000	630,886.400	
FINLAND 1.375 04/15/47	390,000.000	412,366.500	
FINLAND 1.5 04/15/23	830,000.000	891,752.000	
FINLAND 1.625 09/15/22	690,000.000	739,969.800	
FINLAND 2.0 04/15/24	700,000.000	777,546.000	
FINLAND 2.625 07/04/42	780,000.000	1,042,875.600	
FINLAND 2.75 07/04/28	700,000.000	850,220.000	
FINLAND 3.375 04/15/20	3,840,000.000	4,031,001.600	

FINLAND 3.5 04/15/21	2,460,000.000	2,682,703.800	
FINLAND 4.0 07/04/25	740,000.000	929,358.600	
FRANCE BTAN 8.5 04/25/23	1,480,000.000	2,033,964.000	
FRANCE OAT 0.25 11/25/20	4,300,000.000	4,361,748.000	
FRANCE OAT 0.25 11/25/26	6,490,000.000	6,418,415.300	
FRANCE OAT 0.5 05/25/25	5,500,000.000	5,617,205.000	
FRANCE OAT 0.5 05/25/26	5,000,000.000	5,067,900.000	
FRANCE OAT 0.75 05/25/28	5,470,000.000	5,538,101.500	
FRANCE OAT 0.75 11/25/28	4,350,000.000	4,380,841.500	
FRANCE OAT 02/25/20	4,210,000.000	4,236,059.900	
FRANCE OAT 02/25/21	7,080,000.000	7,148,746.800	
FRANCE OAT 03/25/23	2,800,000.000	2,820,020.000	
FRANCE OAT 03/25/24	4,560,000.000	4,560,000.000	
FRANCE OAT 05/25/20	5,400,000.000	5,439,744.000	
FRANCE OAT 05/25/21	4,160,000.000	4,203,056.000	
FRANCE OAT 05/25/22	5,500,000.000	5,559,455.000	
FRANCE OAT 1.0 05/25/27	5,000,000.000	5,216,700.000	
FRANCE OAT 1.0 11/25/25	5,200,000.000	5,471,492.000	
FRANCE OAT 1.25 05/25/34	1,860,000.000	1,894,875.000	
FRANCE OAT 1.25 05/25/36	3,600,000.000	3,602,880.000	
FRANCE OAT 1.5 05/25/31	8,170,000.000	8,726,948.900	
FRANCE OAT 1.75 05/25/23	7,450,000.000	8,078,705.500	
FRANCE OAT 1.75 05/25/66	1,450,000.000	1,408,428.500	
FRANCE OAT 1.75 06/25/39	2,620,000.000	2,808,561.400	
FRANCE OAT 1.75 11/25/24	5,600,000.000	6,149,304.000	
FRANCE OAT 2.0 05/25/48	2,430,000.000	2,647,120.500	
FRANCE OAT 2.25 05/25/24	5,400,000.000	6,053,562.000	
FRANCE OAT 2.25 10/25/22	4,900,000.000	5,367,460.000	
FRANCE OAT 2.5 05/25/30	4,850,000.000	5,734,979.500	
FRANCE OAT 2.5 10/25/20	4,300,000.000	4,533,361.000	
FRANCE OAT 2.75 10/25/27	5,580,000.000	6,665,923.800	
FRANCE OAT 3.0 04/25/22	6,220,000.000	6,908,740.600	
FRANCE OAT 3.25 05/25/45	3,850,000.000	5,303,952.500	
FRANCE OAT 3.25 10/25/21	6,000,000.000	6,616,440.000	

FRANCE OAT 3.5 04/25/20	3,020,000.000	3,176,556.800	
FRANCE OAT 3.5 04/25/26	7,840,000.000	9,672,208.000	
FRANCE OAT 3.75 04/25/21	5,510,000.000	6,044,029.200	
FRANCE OAT 4.0 04/25/55	2,250,000.000	3,636,225.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/60	2,440,000.000	4,040,030.000	
FRANCE OAT 4.0 10/25/38	4,510,000.000	6,669,793.900	
FRANCE OAT 4.25 10/25/23	6,320,000.000	7,646,694.400	
FRANCE OAT 4.5 04/25/41	5,850,000.000	9,373,104.000	
FRANCE OAT 4.75 04/25/35	2,460,000.000	3,803,037.000	
FRANCE OAT 5.5 04/25/29	5,620,000.000	8,319,623.200	
FRANCE OAT 5.75 10/25/32	5,000,000.000	8,098,100.000	
FRANCE OAT 6.0 10/25/25	2,220,000.000	3,086,266.200	
IRISH 0.8 03/15/22	930,000.000	959,425.200	
IRISH 0.9 05/15/28	1,360,000.000	1,362,584.000	
IRISH 1.0 05/15/26	1,300,000.000	1,338,493.000	
IRISH 1.3 05/15/33	740,000.000	731,171.800	
IRISH 1.7 05/15/37	930,000.000	946,228.500	
IRISH 2.0 02/18/45	1,350,000.000	1,424,587.500	
IRISH 2.4 05/15/30	1,490,000.000	1,693,370.100	
IRISH 3.4 03/18/24	1,120,000.000	1,307,264.000	
IRISH 3.9 03/20/23	950,000.000	1,107,206.000	
IRISH 4.5 04/18/20	1,570,000.000	1,668,580.300	
IRISH 5.0 10/18/20	2,710,000.000	2,969,889.000	
IRISH 5.4 03/13/25	2,460,000.000	3,213,079.800	
ITALY BTPS 0.05 04/15/21	950,000.000	934,638.500	
ITALY BTPS 0.2 10/15/20	2,500,000.000	2,486,875.000	
ITALY BTPS 0.35 06/15/20	3,600,000.000	3,600,180.000	
ITALY BTPS 0.35 11/01/21	10,200,000.000	10,015,380.000	
ITALY BTPS 0.45 06/01/21	3,750,000.000	3,720,750.000	
ITALY BTPS 0.65 10/15/23	1,870,000.000	1,776,126.000	
ITALY BTPS 0.65 11/01/20	2,000,000.000	2,004,180.000	
ITALY BTPS 0.7 05/01/20	3,800,000.000	3,817,480.000	
ITALY BTPS 0.9 08/01/22	3,000,000.000	2,944,830.000	
ITALY BTPS 0.95 03/01/23	2,000,000.000	1,943,060.000	
ITALY BTPS 0.95 03/15/23	2,700,000.000	2,624,400.000	
ITALY BTPS 1.2 04/01/22	2,700,000.000	2,692,710.000	
ITALY BTPS 1.25 12/01/26	3,500,000.000	3,204,670.000	

ITALY BTPS 1.35 04/15/22	3,000,000.000	3,003,600.000	
ITALY BTPS 1.45 05/15/25	1,360,000.000	1,295,590.400	
ITALY BTPS 1.45 11/15/24	2,800,000.000	2,692,004.000	
ITALY BTPS 1.5 06/01/25	7,430,000.000	7,090,449.000	
ITALY BTPS 1.6 06/01/26	3,300,000.000	3,120,810.000	
ITALY BTPS 1.65 03/01/32	3,300,000.000	2,803,977.000	
ITALY BTPS 1.85 05/15/24	2,800,000.000	2,774,240.000	
ITALY BTPS 2.0 12/01/25	2,900,000.000	2,833,880.000	
ITALY BTPS 2.05 08/01/27	1,550,000.000	1,478,405.500	
ITALY BTPS 2.15 12/15/21	2,000,000.000	2,058,800.000	
ITALY BTPS 2.2 06/01/27	2,500,000.000	2,420,500.000	
ITALY BTPS 2.25 09/01/36	2,400,000.000	2,080,080.000	
ITALY BTPS 2.45 09/01/33	2,650,000.000	2,419,423.500	
ITALY BTPS 2.5 12/01/24	2,650,000.000	2,700,164.500	
ITALY BTPS 2.7 03/01/47	2,650,000.000	2,280,325.000	
ITALY BTPS 2.8 03/01/67	1,100,000.000	915,750.000	
ITALY BTPS 2.8 12/01/28	3,190,000.000	3,170,923.800	
ITALY BTPS 2.95 09/01/38	2,130,000.000	1,972,380.000	
ITALY BTPS 3.25 09/01/46	2,200,000.000	2,080,188.000	
ITALY BTPS 3.45 03/01/48	2,050,000.000	1,970,193.500	
ITALY BTPS 3.5 03/01/30	3,980,000.000	4,165,030.200	
ITALY BTPS 3.75 03/01/21	2,950,000.000	3,136,587.500	
ITALY BTPS 3.75 05/01/21	3,000,000.000	3,196,200.000	
ITALY BTPS 3.75 08/01/21	3,500,000.000	3,740,100.000	
ITALY BTPS 3.75 09/01/24	2,500,000.000	2,708,675.000	
ITALY BTPS 4.0 02/01/37	4,570,000.000	4,944,740.000	
ITALY BTPS 4.0 09/01/20	4,220,000.000	4,458,978.600	
ITALY BTPS 4.25 03/01/20	2,110,000.000	2,202,987.700	
ITALY BTPS 4.5 03/01/24	3,500,000.000	3,919,475.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/26	2,850,000.000	3,231,045.000	
ITALY BTPS 4.5 05/01/23	2,600,000.000	2,896,842.000	
ITALY BTPS 4.75 08/01/23	4,010,000.000	4,532,102.000	

ITALY BTPS 4.75 09/01/21	3,810,000.000	4,171,950.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/28	3,100,000.000	3,617,173.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/44	2,600,000.000	3,051,256.000	
ITALY BTPS 5.0 03/01/22	2,500,000.000	2,783,750.000	
ITALY BTPS 5.0 03/01/25	3,860,000.000	4,461,426.600	
ITALY BTPS 5.0 08/01/34	3,670,000.000	4,408,404.000	
ITALY BTPS 5.0 08/01/39	4,160,000.000	4,992,416.000	
ITALY BTPS 5.0 09/01/40	3,450,000.000	4,127,235.000	
ITALY BTPS 5.25 11/01/29	6,380,000.000	7,722,352.000	
ITALY BTPS 5.5 09/01/22	2,960,000.000	3,380,112.800	
ITALY BTPS 5.5 11/01/22	3,200,000.000	3,658,688.000	
ITALY BTPS 5.75 02/01/33	3,440,000.000	4,384,280.000	
ITALY BTPS 6.0 05/01/31	4,300,000.000	5,552,160.000	
ITALY BTPS 6.5 11/01/27	3,400,000.000	4,404,700.000	
ITALY BTPS 7.25 11/01/26	2,150,000.000	2,862,725.000	
ITALY BTPS 9.0 11/01/23	1,700,000.000	2,257,600.000	
NETHERLANDS 0.25 07/15/25	2,400,000.000	2,442,312.000	
NETHERLANDS 0.5 07/15/26	3,140,000.000	3,232,630.000	
NETHERLANDS 0.75 07/15/27	2,390,000.000	2,493,056.800	
NETHERLANDS 0.75 07/15/28	2,340,000.000	2,428,756.200	
NETHERLANDS 01/15/22	2,800,000.000	2,842,000.000	
NETHERLANDS 01/15/24	1,640,000.000	1,656,678.800	
NETHERLANDS 1.75 07/15/23	3,350,000.000	3,663,794.500	
NETHERLANDS 2.0 07/15/24	2,030,000.000	2,272,016.600	
NETHERLANDS 2.25 07/15/22	2,280,000.000	2,498,104.800	
NETHERLANDS 2.5 01/15/33	2,110,000.000	2,646,741.800	
NETHERLANDS 2.75 01/15/47	2,310,000.000	3,377,566.500	
NETHERLANDS 3.25 07/15/21	2,760,000.000	3,026,119.200	
NETHERLANDS 3.5 07/15/20	2,290,000.000	2,432,598.300	
NETHERLANDS 3.75 01/15/23	1,670,000.000	1,950,393.000	
NETHERLANDS 3.75 01/15/42	1,980,000.000	3,216,232.800	



	NETHERLANDS 4.0 01/15/37	2,310,000.000	3,594,822.000	
	NETHERLANDS 5.5 01/15/28	2,070,000.000	3,040,623.000	
	NETHERLANDS 7.5 01/15/23	590,000.000	778,210.000	
	SPAIN 0.05 01/31/21	2,500,000.000	2,510,575.000	
	SPAIN 0.35 07/30/23	1,000,000.000	998,770.000	
	SPAIN 0.4 04/30/22	3,300,000.000	3,336,927.000	
	SPAIN 0.45 10/31/22	2,600,000.000	2,629,770.000	
	SPAIN 0.75 07/30/21	2,650,000.000	2,708,485.500	
	SPAIN 1.15 07/30/20	4,500,000.000	4,599,855.000	
	SPAIN 1.3 10/31/26	3,500,000.000	3,549,770.000	
	SPAIN 1.4 04/30/28	3,760,000.000	3,766,655.200	
	SPAIN 1.4 07/30/28	2,080,000.000	2,070,452.800	
	SPAIN 1.45 10/31/27	3,300,000.000	3,340,359.000	
	SPAIN 1.5 04/30/27	2,700,000.000	2,754,000.000	
	SPAIN 1.6 04/30/25	3,100,000.000	3,258,379.000	
	SPAIN 1.95 04/30/26	3,000,000.000	3,193,800.000	
	SPAIN 1.95 07/30/30	3,050,000.000	3,130,062.500	
	SPAIN 2.15 10/31/25	4,650,000.000	5,029,486.500	
	SPAIN 2.35 07/30/33	2,380,000.000	2,481,150.000	
	SPAIN 2.7 10/31/48	1,730,000.000	1,742,386.800	
	SPAIN 2.75 10/31/24	3,800,000.000	4,247,222.000	
	SPAIN 2.9 10/31/46	2,500,000.000	2,649,875.000	
	SPAIN 3.45 07/30/66	1,720,000.000	1,938,268.000	
	SPAIN 3.8 04/30/24	2,980,000.000	3,477,928.200	
	SPAIN 4.0 04/30/20	2,890,000.000	3,051,030.800	
	SPAIN 4.2 01/31/37	3,000,000.000	3,913,860.000	
	SPAIN 4.4 10/31/23	4,080,000.000	4,842,837.600	
	SPAIN 4.65 07/30/25	3,380,000.000	4,197,013.600	
	SPAIN 4.7 07/30/41	3,060,000.000	4,283,816.400	
	SPAIN 4.8 01/31/24	3,000,000.000	3,639,390.000	
	SPAIN 4.85 10/31/20	2,630,000.000	2,870,250.500	
	SPAIN 4.9 07/30/40	2,970,000.000	4,244,724.000	
	SPAIN 5.15 10/31/28	4,410,000.000	5,873,238.000	
	SPAIN 5.15 10/31/44	2,100,000.000	3,143,679.000	
	SPAIN 5.4 01/31/23	3,000,000.000	3,622,380.000	
	SPAIN 5.5 04/30/21	3,700,000.000	4,179,002.000	
	SPAIN 5.75 07/30/32	4,390,000.000	6,449,788.000	
	SPAIN 5.85 01/31/22	4,160,000.000	4,898,400.000	
	SPAIN 6.0 01/31/29	3,500,000.000	4,975,565.000	
ユーロ	小計	793,190,000.000 (99,021,839,600)	895,691,971.500 (111,818,185,722)	
南アフリカ・ランド	SOUTH AFRICA 10.5 12/21/26	41,080,000.000	45,088,586.400	
	SOUTH AFRICA 6.25 03/31/36	17,630,000.000	12,765,177.800	

	SOUTH AFRICA 6.5 02/28/41	13,680,000.000	9,705,139.200	
	SOUTH AFRICA 7.0 02/28/31	17,190,000.000	14,286,609.000	
	SOUTH AFRICA 8.0 01/31/30	15,820,000.000	14,474,825.400	
	SOUTH AFRICA 8.25 03/31/32	13,000,000.000	11,857,950.000	
	SOUTH AFRICA 8.5 01/31/37	16,500,000.000	14,909,400.000	
	SOUTH AFRICA 8.75 01/31/44	15,000,000.000	13,591,050.000	
	SOUTH AFRICA 8.75 02/28/48	58,790,000.000	53,193,192.000	
	SOUTH AFRICA 8.875 02/28/35	10,000,000.000	9,428,100.000	
	SOUTH AFRICA 9.0 01/31/40	9,000,000.000	8,400,960.000	
	南アフリカ・ランド 小計	227,690,000.000 (1,782,812,700)	207,700,989.800 (1,626,298,750)	
国債証券 合計		263,879,576,010 (263,879,576,010)	280,518,393,946 (280,518,393,946)	
合計		263,879,576,010 (263,879,576,010)	280,518,393,946 (280,518,393,946)	

- (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 176銘柄	44.23%	46.07%
イギリス・ポンド	国債証券 40銘柄	6.26%	6.52%
オーストラリア・ドル	国債証券 22銘柄	2.01%	2.10%
カナダ・ドル	国債証券 29銘柄	1.86%	1.93%
シンガポール・ドル	国債証券 16銘柄	0.33%	0.35%
スウェーデン・クローナ	国債証券 6銘柄	0.26%	0.27%
デンマーク・クローネ	国債証券 4銘柄	0.44%	0.46%
ノルウェー・クローネ	国債証券 6銘柄	0.18%	0.19%
ポーランド・ズロチ	国債証券 12銘柄	0.51%	0.53%
マレーシア・リンギット	国債証券 15銘柄	0.38%	0.40%
メキシコ・ペソ	国債証券 14銘柄	0.72%	0.75%
ユーロ	国債証券 280銘柄	38.27%	39.86%
南アフリカ・ランド	国債証券 11銘柄	0.56%	0.58%

(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1月11日現在	平成31年1月11日現在
資産の部			
流動資産			
預金		3,319,230,119	1,299,271,008
コール・ローン		107,218,956	32,772,864
株式		56,566,691,714	44,235,304,878
新株予約権証券		-	78,278
投資信託受益証券		291,974,467	227,631,777
投資証券		112,860,012	73,487,373
派生商品評価勘定		256,498,285	93,745,445
未収入金		704,406	1,309,313
未収配当金		80,996,576	40,348,430
差入委託証拠金		1,115,971,723	368,721,191
流動資産合計		61,852,146,258	46,372,670,557
資産合計		61,852,146,258	46,372,670,557
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		692,746	-
未払金		4,986	4,923
未払解約金		34,717,000	7,564,000
流動負債合計		35,414,732	7,568,923
負債合計		35,414,732	7,568,923
純資産の部			
元本等			
元本	1	47,332,729,770	43,032,611,492
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		14,484,001,756	3,332,490,142
元本等合計		61,816,731,526	46,365,101,634
純資産合計		61,816,731,526	46,365,101,634
負債純資産合計		61,852,146,258	46,372,670,557

## 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1月11日現在	平成31年1月11日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	43,685,667,131円	47,332,729,770円
同期中追加設定元本額	15,398,192,304円	37,708,746,421円
同期中一部解約元本額	11,751,129,665円	42,008,864,699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 >	2,967,430,561円	4,229,653,765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)	249,749,689円	538,952,510円
M I T O ラップ型ファンド (安定型)	6,258,056円	5,084,297円
M I T O ラップ型ファンド (中立型)	16,063,826円	13,283,178円
M I T O ラップ型ファンド (積極型)	18,157,927円	16,008,746円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	26,539,962円	38,106,625円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	22,849,313円	36,541,116円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	13,271,449円	19,391,290円
たわらノーロード 新興国株式	3,190,937,167円	4,503,768,120円
たわらノーロード 新興国株式<ラップ向け>	968,725,817円	1,937,088,275円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	19,503,319円	218,593,721円
たわらノーロード バランス (堅実型)	33,387円	1,544,922円
たわらノーロード バランス (標準型)	138,526円	5,991,440円
たわらノーロード バランス (積極型)	635,967円	12,990,571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)	7,956円	125,758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)	15,911円	8,172,737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)	23,867円	25,788,023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)	39,778円	17,269,961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)	47,733円	53,574,501円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	- 円	63,713円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	- 円	534,057円

たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	- 円	349,997円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	- 円	1,177,612円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	462,876,236円	447,212,307円
DIAM DC 8資産バランス ファンド(新興国10)	40,575,086円	323,578,911円
DIAM DC 8資産バランス ファンド(新興国20)	133,439,313円	283,538,394円
DIAM DC 8資産バランス ファンド(新興国30)	298,885,378円	560,502,321円
投資のソムリエ	1,371,356,428円	1,125,613,712円
クルーズコントロール	2,170,535,683円	229,645,946円
投資のソムリエ<DC年金>	87,148,003円	103,543,744円
DIAM 8資産バランス ファンドN<DC年金>	157,925,647円	244,460,621円
クルーズコントロール<DC 年金>	757,609円	147,820円
DIAMコア資産設計ファンド (堅実型)	24,975,794円	3,790,466円
DIAMコア資産設計ファンド (積極型)	57,019,939円	7,033,164円
投資のソムリエ<DC年金> リスク抑制型	89,462,427円	62,324,346円
ダイナミック・ナビゲーション	1,743,533円	1,288,060円
リスク抑制世界8資産 バランス ファンド	1,214,158,639円	1,075,304,118円
ワールドアセットバランス(基 本コース)	1,627,105,199円	1,879,064,959円
ワールドアセットバランス(リ スク抑制コース)	6,091,354,580円	3,890,272,267円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2045)	230,203円	598,449円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2055)	230,203円	470,297円
リスク抑制世界8資産 バランス ファンド(DC)	415,873円	389,308円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2035)	240,421円	947,979円
リスクコントロール世界資産 分散ファンド	- 円	313,785,870円
9資産分散投資・スタンダード <DC年金>	- 円	20,870円
エマージング株式パッシブ ファンドVA(適格機関投資家 専用)	5,065,986,468円	3,535,043,726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)	2,638,488,353円	2,125,194,681円
DIAM世界アセット バランス ファンド2VA(適格機関 投資家 限定)	11,082,972,525円	7,261,569,827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 )	7,214,416,019円	7,873,214,394円
	計	47,332,729,770円	43,032,611,492円
2 .	受益権の総数	47,332,729,770口	43,032,611,492口

## （金融商品に関する注記）

## 1．金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成29年6月23日 至 平成30年1月11日	自 平成30年1月12日 至 平成31年1月11日
1． 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2． 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<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1月11日現在	平成31年1月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、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1月11日現在	平成31年1月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
株式	9,392,239,360	4,492,632,172
新株予約権証券	-	11,159
投資信託受益証券	281,450	16,919,785
投資証券	3,539,125	15,048,911
合計	9,388,981,685	4,524,589,709

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成29年4月19日から平成30年1月11日まで及び平成30年4月19日から平成31年1月11日まで）に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

## 通貨関連

種類	平成30年1月11日 現在				平成31年1月11日 現在					
	契約額等 （円）	うち		時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）	うち		時価 （円）	評価損益 （円）
		1年超					1年超			
市場取引以外の取引										
為替予約取引										
売 建	1,161,449,670	-	1,161,413,200	36,470	-	-	-	-	-	-
アメリカ・ドル	1,161,449,670	-	1,161,413,200	36,470	-	-	-	-	-	-
買 建	39,578,880	-	39,233,920	344,960	3,084,805,050	-	3,084,833,500	28,450		
アメリカ・ドル	39,578,880	-	39,233,920	344,960	3,084,805,050	-	3,084,833,500	28,450		
合計	1,201,028,550	-	1,200,647,120	308,490	3,084,805,050	-	3,084,833,500	28,450		

(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1月11日 現在				平成31年1月11日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
先物取引								
買 建	3,403,250,998	-	3,659,365,027	256,114,029	4,803,549,477	-	4,897,266,472	93,716,995
合計	3,403,250,998	-	3,659,365,027	256,114,029	4,803,549,477	-	4,897,266,472	93,716,995

## (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1月11日現在	平成31年1月11日現在
1口当たり純資産額	1.3060円	1.0774円
(1万口当たり純資産額)	(13,060円)	(10,774円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

平成31年1月11日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	CTRI.P.COM INTERNATIONAL LTD ADR	34,700	30.080	1,043,776.000	
	CIA DE MINAS BUENAVENTURA SA ADR	17,000	15.890	270,130.000	
	SURGUTNEFTEGAZ SP ADR PREF	69,900	5.750	401,925.000	
	CREDICORP LTD	5,849	230.470	1,348,019.030	
	SINA CORP	5,300	59.960	317,788.000	
	MOBILE TELESYSTEMS PJSC ADR	38,725	7.980	309,025.500	
	NETEASE INC-ADR	6,400	255.150	1,632,960.000	
	SOUTHERN COPPER CORP	5,280	31.910	168,484.800	
	LUKOIL SPON ADR	40,288	76.660	3,088,478.080	
	GAZPROM PAO ADR	448,380	4.758	2,133,392.040	
	COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK SP GDR	103,943	4.150	431,363.450	
	INNER MONGOLIA YITAI COAL CO	105,800	1.190	125,902.000	
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRADE	63,980	1.312	83,941.760	
	SURGUTNEFTEGAZ ADR	74,317	4.036	299,943.410	
	51JOB INC ADR	2,300	64.690	148,787.000	
	X5 RETAIL GROUP NV GDR	10,913	26.060	284,392.780	
	NOVATEK PJSC GDR	7,591	176.500	1,339,811.500	
	BAIDU INC -SPON ADR	22,900	168.350	3,855,215.000	
	NOVOLIPETSK STEEL GDR	11,980	22.830	273,503.400	
	MMC NORILSK NICKEL ADR	57,716	20.000	1,154,320.000	
	ROSNEFT OIL CO GDR	104,550	6.410	670,165.500	
	NEW ORIENTAL EDUCATION & TECH	12,100	61.990	750,079.000	
	SEVERSTAL GDR	21,907	14.430	316,118.010	
	TATNEFT ADR	21,050	64.920	1,366,566.000	
	MAGNITOGORSK IRON & STEEL SPON GDR	19,500	8.670	169,065.000	
	VTB BANK OJSC GDR	172,000	1.184	203,648.000	
	DP WORLD LTD	15,219	16.890	257,048.910	
	MAGNIT PJSC GDR	28,329	14.330	405,954.570	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD ADR	32,600	5.930	193,318.000	
	TAL EDUCATION GROUP-ADR	30,400	29.020	882,208.000	
NOAH HOLDINGS LTD ADR	2,700	44.820	121,014.000		
SBERBANK ADR	224,930	11.995	2,698,035.350		
PHOSAGRO PJSC GDR	13,784	13.260	182,775.840		

	HUAZHU GROUP LTD ADR	11,800	31.500	371,700.000	
	YY INC-ADR	3,900	69.050	269,295.000	
	GDS HOLDINGS LTD ADR	5,600	27.010	151,256.000	
	58.COM INC ADR	7,300	57.080	416,684.000	
	AUTOHOME INC ADR	4,600	82.590	379,914.000	
	WEIBO CORP ADR	4,700	59.590	280,073.000	
	JD.COM INC ADR	57,800	23.400	1,352,520.000	
	ALIBABA GROUP HOLDING LTD-ADR	106,580	151.690	16,167,120.200	
	MOMO INC SPON ADR	13,100	27.000	353,700.000	
	BAOZUN INC-SPN ADR	3,400	31.810	108,154.000	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	28,400	34.460	978,664.000	
	POLYUS PJSC GDR	6,012	40.200	241,682.400	
	HUTCHISON CHINA MEDITECH LTD ADR	3,600	22.460	80,856.000	
アメリカ・ドル 小計		2,089,123		48,078,773.530 (5,215,104,565)	
アラブ首長国連邦・ディルハム	DUBAI ISLAMIC BANK PJSC	136,145	5.080	691,616.600	
	EMIRATES TELECOMMUNICATIONS GROUP CO PJSC	130,625	17.020	2,223,237.500	
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK PJSC	172,040	8.350	1,436,534.000	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	215,991	14.380	3,105,950.580	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	289,208	4.060	1,174,184.480	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	356,142	1.550	552,020.100	
	EMAAR DEVELOPMENT PJSC	77,463	4.130	319,922.190	
	EMAAR MALLS PJSC	178,166	1.780	317,135.480	
	DAMAC PROPERTIES DUBAI CO PJSC	190,235	1.500	285,352.500	
アラブ首長国連邦・ディルハム 小計		1,746,015		10,105,953.430 (298,934,103)	
イギリス・ポンド	POLYMETAL INTERNATIONAL PLC	12,287	8.588	105,520.750	
イギリス・ポンド 小計		12,287		105,520.750 (14,585,078)	
インド・ルピー	RELIANCE INDUSTRIES LTD	233,815	1,107.500	258,950,112.500	
	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	66,548	335.600	22,333,508.800	
	ASIAN PAINTS LTD	24,074	1,396.350	33,615,729.900	
	EICHER MOTORS LTD	923	20,556.100	18,973,280.300	
	GRASIM INDUSTRIES LTD	22,267	820.200	18,263,393.400	
	MAHINDRA & MAHINDRA LTD	63,234	733.200	46,363,168.800	
	SHREE CEMENT LTD	446	16,496.150	7,357,282.900	
	ICICI BANK LTD	191,895	379.500	72,824,152.500	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP LTD	58,463	232.900	13,616,032.700	
	STATE BANK OF INDIA LTD	150,942	305.550	46,120,328.100	

CONTAINER CORP OF INDIA LTD	15,148	689.050	10,437,729.400	
LIC HOUSING FINANCE LTD	26,242	483.450	12,686,694.900	
TATA STEEL LTD	28,060	480.400	13,480,024.000	
TATA MOTORS LTD	138,820	185.750	25,785,815.000	
JSW STEEL LTD	69,648	289.300	20,149,166.400	
TATA POWER CO LTD	82,406	74.900	6,172,209.400	
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	4,658	3,088.950	14,388,329.100	
NESTLE INDIA LTD	1,904	11,416.600	21,737,206.400	
GAIL INDIA LTD	70,027	343.900	24,082,285.300	
VEDANTA LTD	110,581	195.450	21,613,056.450	
AXIS BANK LTD	145,336	663.250	96,394,102.000	
TITAN COMPANY LTD	27,648	966.700	26,727,321.600	
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	122,655	143.250	17,570,328.750	
LUPIN LTD	18,317	838.000	15,349,646.000	
BAJAJ FINANCE LTD	14,571	2,514.650	36,640,965.150	
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP	131,396	1,980.100	260,177,219.600	
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISES LTD	43,870	451.350	19,800,724.500	
INFOSYS LTD	301,453	679.700	204,897,604.100	
WIPRO LTD	100,958	325.750	32,887,068.500	
INDIAN OIL CORP LTD	119,485	129.900	15,521,101.500	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	55,659	1,786.200	99,418,105.800	
HCL TECHNOLOGIES LTD	47,449	935.850	44,405,146.650	
DABUR INDIA LTD	43,516	421.150	18,326,763.400	
HERO MOTOCORP LTD	4,509	2,919.500	13,164,025.500	
DR REDDYS LABORATORIES LTD	8,183	2,600.400	21,279,073.200	
BHARTI AIRTEL LTD	105,866	337.300	35,708,601.800	
UNITED SPIRITS LTD	23,992	586.550	14,072,507.600	
SUN PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD	71,008	444.600	31,570,156.800	
DIVI'S LABORATORIES LTD	5,467	1,520.450	8,312,300.150	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	8,165	7,391.600	60,352,414.000	
GLENMARK PHARMACEUTICALS LTD	4,790	667.850	3,199,001.500	
AUROBINDO PHARMA LTD	17,598	776.950	13,672,766.100	
HAVELLS INDIA LTD	20,334	688.050	13,990,808.700	
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	51,716	161.950	8,375,406.200	
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE CO LTD	13,834	1,186.350	16,411,965.900	
PETRONET LNG LTD	52,875	214.050	11,317,893.750	
CIPLA LTD/INDIA	31,870	513.250	16,357,277.500	
LARSEN & TOUBRO LTD	36,754	1,392.600	51,183,620.400	
ULTRATECH CEMENT LTD	7,975	3,818.200	30,450,145.000	
ASHOK LEYLAND LTD	110,886	95.000	10,534,170.000	

	BOSCH LTD	496	19,704.000	9,773,184.000	
	TATA CONSULTANCY SERVICES LTD	72,050	1,888.550	136,070,027.500	
	NTPC LTD	175,055	148.100	25,925,645.500	
	PIRAMAL ENTERPRISES LTD	7,474	2,305.050	17,227,943.700	
	YES BANK LTD	153,758	186.900	28,737,370.200	
	AMBUJA CEMENTS LTD	54,635	213.150	11,645,450.250	
	BHARAT FORGE LTD	18,421	482.350	8,885,369.350	
	HINDALCO INDUSTRIES LTD	99,935	204.000	20,386,740.000	
	ITC LTD	294,156	289.600	85,187,577.600	
	PIDILITE INDUSTRIES LTD	11,666	1,115.150	13,009,339.900	
	UNITED PHOSPHORUS LTD	29,391	773.100	22,722,182.100	
	GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	32,823	779.500	25,585,528.500	
	TECH MAHINDRA LTD	32,685	694.550	22,701,366.750	
	VODAFONE IDEA LTD	196,527	37.100	7,291,151.700	
	MARICO LTD	35,723	387.100	13,828,373.300	
	PAGE INDUSTRIES LTD	528	23,176.350	12,237,112.800	
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	130,563	195.650	25,544,650.950	
	ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	40,710	380.250	15,479,977.500	
	REC LTD	55,173	122.850	6,778,003.050	
	BAJAJ FINSERV LTD	3,159	6,371.950	20,128,990.050	
	BAJAJ AUTO LTD	7,015	2,725.300	19,117,979.500	
	COAL INDIA LTD	62,457	233.000	14,552,481.000	
	MAHINDRA & MAHINDRA FINANCIAL SERVICES LTD	28,933	459.500	13,294,713.500	
	BHARTI INFRA TEL LTD	32,296	285.050	9,205,974.800	
	INDIABULLS HOUSING FINANCE LTD	25,466	814.250	20,735,690.500	
	TATA STEEL LTD-PARTLY PAID	2,333	53.400	124,582.200	
	CADILA HEALTHCARE LTD	16,962	350.000	5,936,700.000	
	AVENUE SUPERMARTS LTD	8,740	1,587.800	13,877,372.000	
	INTERGLOBE AVIATION LTD	8,300	1,097.000	9,105,100.000	
	インド・ルピー 小計	4,745,666		2,592,114,316.100 (4,017,777,190)	
インドネシア・ルピア	UNITED TRACTORS TBK PT	139,101	28,225.000	3,926,125,725.000	
	INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK PT	359,200	7,450.000	2,676,040,000.000	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	137,500	48,325.000	6,644,687,500.000	
	PT ASTRA INTERNATIONAL TBK	1,715,400	8,200.000	14,066,280,000.000	
	TELEKOMUNIKASI INDONESIA PERSERO TBK	4,307,500	3,800.000	16,368,500,000.000	

	CHAROEN POKPHAND INDONESIA TBK PT	675,600	7,700.000	5,202,120,000.000	
	GUDANG GARAM TBK PT	44,800	82,350.000	3,689,280,000.000	
	HANJAYA MANDALA SAMPOERNA TBK	655,400	3,850.000	2,523,290,000.000	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA TBK PT	149,500	17,150.000	2,563,925,000.000	
	INDAH KIAT PULP AND PAPER CORP TBK PT	262,000	12,575.000	3,294,650,000.000	
	BUKIT ASAM TBK PT	154,500	4,290.000	662,805,000.000	
	BANK DANAMON INDONESIA TBK PT	261,316	8,225.000	2,149,324,100.000	
	BANK MANDIRI	1,568,800	7,700.000	12,079,760,000.000	
	PABRIK KERTAS TJIWI KIMIA TBK PT	98,000	12,400.000	1,215,200,000.000	
	BANK RAKYAT INDONESIA	4,337,100	3,750.000	16,264,125,000.000	
	PERUSAHAAN GAS NEGARA PT	1,064,100	2,290.000	2,436,789,000.000	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSERO TBK PT	529,100	8,850.000	4,682,535,000.000	
	KALBE FARMA TBK PT	1,822,200	1,600.000	2,915,520,000.000	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK PT	276,500	11,925.000	3,297,262,500.000	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	839,300	26,275.000	22,052,607,500.000	
	JASA MARGA PERSERO TBK PT	200,125	4,920.000	984,615,000.000	
	ADARO ENERGY PT	1,434,500	1,405.000	2,015,472,500.000	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR TBK PT	170,700	10,150.000	1,732,605,000.000	
	TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE TBK PT	180,800	4,500.000	813,600,000.000	
	BANK TABUNGAN NEGARA TBK PT	480,300	2,680.000	1,287,204,000.000	
	PT SURYA CITRA MEDIA TBK	511,300	1,950.000	997,035,000.000	
	インドネシア・ルピア 小計	22,374,642		136,541,357,825.000 (1,065,022,591)	
オフショア・人民 元	LUXSHARE PRECISION INDUSTRY CO LTD	9,600	14.910	143,136.000	
	FOCUS MEDIA INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD	26,300	5.620	147,806.000	
	IFLYTEK CO LTD	6,400	29.260	187,264.000	
	YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD	2,300	73.640	169,372.000	
	JIANGSU YANGHE BREWERY JOINT-STOCK CO LTD	2,500	92.190	230,475.000	
	WULIANGYE YIBIN CO LTD	4,500	49.860	224,370.000	
	SUNING.COM CO LTD	29,500	10.670	314,765.000	
	BOE TECHNOLOGY GROUP CO LTD	79,900	2.670	213,333.000	



CHINA MERCHANTS SHEKOU INDUSTRIAL ZONE HOLDINGS CO LTD	12,300	17.410	214,143.000	
GREE ELECTRIC APPLIANCES INC OF ZHUHAI	5,700	37.760	215,232.000	
MIDEA GROUP CO LTD	8,000	39.290	314,320.000	
HANGZHOU HIKVISION DIGITAL TECHNOLOGY CO LTD	12,000	28.330	339,960.000	
PING AN BANK CO LTD	27,200	10.100	274,720.000	
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO LTD	79,000	4.330	342,070.000	
CHINA VANKE CO LTD	13,700	25.110	344,007.000	
WEICHAI POWER CO LTD	29,900	7.820	233,818.000	
GF SECURITIES CO LTD	22,700	13.220	300,094.000	
BYD CO LTD	7,500	48.850	366,375.000	
BANK OF SHANGHAI CO LTD	20,900	11.160	233,244.000	
PETROCHINA CO LTD	32,800	7.350	241,080.000	
INDUSTRIAL & COMMERCIAL BANK OF CHINA LTD	75,500	5.220	394,110.000	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA LTD	82,500	3.510	289,575.000	
BANK OF CHINA LTD	74,500	3.520	262,240.000	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL CORP	51,300	5.300	271,890.000	
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	17,100	25.850	442,035.000	
PING AN INSURANCE GROUP CO OF CHINA LTD	14,000	57.500	805,000.000	
INDUSTRIAL BANK CO LTD	27,400	15.330	420,042.000	
SHANGHAI PUDONG DEVELOPMENT BANK CO LTD	36,700	9.960	365,532.000	
CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	73,320	5.740	420,856.800	
SAIC MOTOR CORP LTD	10,900	24.840	270,756.000	
KWEICHOW MOUTAI CO LTD	1,800	618.770	1,113,786.000	
BANK OF COMMUNICATIONS CO LTD	79,200	5.850	463,320.000	
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	10,900	27.980	304,982.000	
CHINA YANGTZE POWER CO LTD	26,500	15.330	406,245.000	
DAQIN RAILWAY CO LTD	30,100	8.020	241,402.000	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD	60,800	3.840	233,472.000	
CHINA STATE CONSTRUCTION ENGINEERING CORP LTD	61,600	5.680	349,888.000	
HAITONG SECURITIES CO LTD	36,000	9.500	342,000.000	
HUAXIA BANK CO LTD	23,200	7.420	172,144.000	

INNER MONGOLIA YILI INDUSTRIAL GROUP CO LTD	10,400	23.100	240,240.000	
BANK OF BEIJING CO LTD	42,800	5.690	243,532.000	
BAOSHAN IRON & STEEL CO LTD	29,200	6.680	195,056.000	
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	4,200	29.330	123,186.000	
CHINA MERCHANTS SECURITIES CO LTD	22,800	13.870	316,236.000	
POLY DEVELOPMENTS AND HOLDINGS GROUP CO LTD	20,400	12.000	244,800.000	
CRRC CORP LTD	38,600	9.040	348,944.000	
JIANGSU HENGRUI MEDICINE CO LTD	4,900	56.270	275,723.000	
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION CORP LTD	27,400	10.740	294,276.000	
HUATAI SECURITIES CO LTD	30,600	17.530	536,418.000	
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD	21,100	8.040	169,644.000	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	11,000	22.400	246,400.000	
FOUNDER SECURITIES CO LTD	31,000	6.910	214,210.000	
KANGMEI PHARMACEUTICAL CO LTD	14,300	7.500	107,250.000	
CHINA INTERNATIONAL TRAVEL SERVICE CORP LTD	3,900	60.100	234,390.000	
AVIC CAPITAL CO LTD	49,800	4.460	222,108.000	
METALLURGICAL CORP OF CHINA LTD	54,400	3.040	165,376.000	
POWER CONSTRUCTION CORP OF CHINA LTD	36,100	5.000	180,500.000	
SICHUAN CHUANTOU ENERGY CO LTD	23,700	8.280	196,236.000	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD	9,900	16.400	162,360.000	
AECC AVIATION POWER CO LTD	9,500	22.610	214,795.000	
JOINTOWN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	16,000	14.480	231,680.000	
INDUSTRIAL SECURITIES CO LTD	53,200	5.100	271,320.000	
BEIJING TONGRENTANG CO LTD	6,400	26.730	171,072.000	
SHANDONG GOLD MINING CO LTD	8,000	30.480	243,840.000	
YONGHUI SUPERSTORES CO LTD	24,000	8.020	192,480.000	
AISINO CORP	6,400	24.430	156,352.000	

	CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD	28,600	7.100	203,060.000	
	ZHANGZHOU PIENZHEHUANG PHARMACEUTICAL CO LTD	1,800	84.600	152,280.000	
	HENGTONG OPTIC-ELECTRIC CO LTD	8,100	18.650	151,065.000	
	CHINA NATIONAL NUCLEAR POWER CO LTD	51,300	5.380	275,994.000	
	BANK OF JIANGSU CO LTD	32,400	6.020	195,048.000	
	ORIENT SECURITIES CO LTD/CHINA	24,800	8.340	206,832.000	
	EVERBRIGHT SECURITIES CO LTD	24,000	9.550	229,200.000	
オフショア・人民元 小計		2,007,020		20,230,762.800 (323,085,281)	
カタール・リアル	QATAR INSURANCE CO SAQ	14,417	39.500	569,471.500	
	QATAR NATIONAL BANK	36,289	197.500	7,167,077.500	
	COMMERCIAL BANK OF QATAR QSC	18,202	42.000	764,484.000	
	OOREDOO QSC	6,760	75.590	510,988.400	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	4,887	182.990	894,272.130	
	INDUSTRIES QATAR QSC	16,138	143.500	2,315,803.000	
	QATAR ISLAMIC BANK SAQ	10,281	159.000	1,634,679.000	
	MASRAF AL RAYAN	32,079	41.900	1,344,110.100	
	BARWA REAL ESTATE CO	11,235	39.670	445,692.450	
	EZDAN HOLDING GROUP QSC	59,601	15.000	894,015.000	
カタール・リアル 小計		209,889		16,540,593.080 (493,736,703)	
コロンビア・ペソ	INTERCONEXION ELECTRICA SA ESP	35,733	14,220.000	508,123,260.000	
	ECOPETROL SA	412,135	2,935.000	1,209,616,225.000	
	GRUPO DE INVERSIONES SURAMERICANA SA-PREF	10,138	30,900.000	313,264,200.000	
	GRUPO AVAL ACCIONES Y VALORES SA-PREF	341,831	1,070.000	365,759,170.000	
	CEMENTOS ARGOS SA	37,720	7,100.000	267,812,000.000	
	GRUPO ARGOS SA	28,217	17,100.000	482,510,700.000	
	BANCOLOMBIA SA	13,764	33,100.000	455,588,400.000	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	37,498	33,940.000	1,272,682,120.000	
	GRUPO DE INVERSIONES SURAMERICANA SA	19,105	32,260.000	616,327,300.000	
コロンビア・ペソ 小計		936,141		5,491,683,375.000 (190,012,245)	
タイ・パーツ	BANGKOK BANK PCL	15,900	210.000	3,339,000.000	
	BERLI JUCKER PCL NVDR	94,300	48.250	4,549,975.000	
	KRUNG THAI BANK PCL NVDR	348,000	19.900	6,925,200.000	
	ROBINSON PCL-NVDR	38,800	67.250	2,609,300.000	
	SIAM COMMERCIAL BANK PCL NVDR	162,900	136.000	22,154,400.000	

TRUE CORP PCL NVDR	820,155	4.980	4,084,371.900	
KASIKORNBANK PCL NVDR	60,200	180.000	10,836,000.000	
TMB BANK PCL -NVDR	1,010,000	2.200	2,222,000.000	
IRPC PCL NVDR	784,600	5.850	4,589,910.000	
BANPU PCL PUBLIC CO LTD NVDR	172,000	16.300	2,803,600.000	
ELECTRICITY GENERATING PCL NVDR	13,100	250.000	3,275,000.000	
CHAROEN POKPHAND FOODS PCL	311,500	25.750	8,021,125.000	
ADVANCED INFO SERVICE PCL	92,800	174.000	16,147,200.000	
HOME PRODUCT CENTER PCL- NVDR	380,520	14.700	5,593,644.000	
DELTA ELECTRONICS THAI PCL NVDR	44,200	69.000	3,049,800.000	
PTT PCL	831,200	48.750	40,521,000.000	
THAI UNION GROUP PCL- NVDR	162,600	17.400	2,829,240.000	
LAND AND HOUSES PCL NVDR	263,900	9.850	2,599,415.000	
SIAM CEMENT PCL NVDR	33,850	428.000	14,487,800.000	
AIRPORTS OF THAILAND PCL-NVDR	367,300	66.000	24,241,800.000	
KASIKORNBANK PCL - FOREIGN	97,700	181.500	17,732,550.000	
CENTRAL PATTANA PCL NVDR	119,200	75.500	8,999,600.000	
BANGKOK DUSIT MEDICAL SERVICES NVDR	322,400	22.800	7,350,720.000	
BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL- NVDR	25,800	172.000	4,437,600.000	
MINOR INTERNATIONAL PCL- NVDR	185,110	35.500	6,571,405.000	
THAI OIL PCL NVDR	65,600	69.750	4,575,600.000	
GLOW ENERGY PCL NVDR	54,000	89.000	4,806,000.000	
CP ALL PCL NVDR	428,400	74.000	31,701,600.000	
BTS GROUP HOLDINGS PCL	531,300	9.550	5,073,915.000	
PTT EXPLORATION & PRODUCTION PCL NVDR	99,145	122.500	12,145,262.500	
INDORAMA VENTURES PCL NVDR	139,122	53.750	7,477,807.500	
PTT GLOBAL CHEMICAL PCL- NVDR	156,508	71.500	11,190,322.000	
ENERGY ABSOLUTE PCL NVDR	118,000	45.500	5,369,000.000	
BANGKOK EXPRESSWAY & METRO PCL NVDR	740,700	9.800	7,258,860.000	
GULF ENERGY DEVELOPMENT PCL NVDR	14,300	83.750	1,197,625.000	
MUANGTHAI CAPITAL PCL NVDR	28,100	48.750	1,369,875.000	
タイ・パーツ 小計	9,133,210		322,137,522.900	

				(1,095,267,577)	
チェコ・コルナ	KOMERCNI BANKA AS	6,162	866.500	5,339,373.000	
	CEZ	15,014	544.500	8,175,123.000	
	MONETA MONEY BANK AS	37,459	72.500	2,715,777.500	
チェコ・コルナ 小計		58,635		16,230,273.500 (79,203,735)	
チリ・ペソ	BANCO SANTANDER CHILE	4,814,683	51.690	248,870,964.270	
	BANCO DE CREDITO E INVERSIONES	4,013	45,460.000	182,430,980.000	
	BANCO DE CHILE	2,035,145	100.390	204,308,206.550	
	EMPRESAS CMPC SA	103,228	2,202.900	227,400,961.200	
	EMPRESAS COPEC SA	34,981	8,785.900	307,339,567.900	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	10,642	8,902.700	94,742,533.400	
	ENTEL CHILE SA	10,666	5,842.000	62,310,772.000	
	ENEL AMERICAS SA	2,523,913	130.800	330,127,820.400	
	COLBUN SA	385,654	141.370	54,519,905.980	
	AGUAS ANDINAS SA	224,014	393.490	88,147,268.860	
	EMBOTELLADORA ANDINA SA	27,270	2,589.800	70,623,846.000	
	LATAM AIRLINES GROUP SA	26,485	7,971.600	211,127,826.000	
	SOCIEDAD QUIMICA Y MINERA DE CHILE SA	10,624	28,174.000	299,320,576.000	
	SACI FALABELLA	60,890	5,209.600	317,212,544.000	
	ITAU CORPBANCA	13,236,977	6.517	86,265,379.100	
	CENCOSUD SA	125,078	1,368.300	171,144,227.400	
ENEL CHILE SA	1,722,009	69.050	118,904,721.450		
チリ・ペソ 小計		25,356,272		3,074,798,100.510 (493,197,616)	
トルコ・リラ	AKBANK TAS	185,577	5.750	1,067,067.750	
	ANADOLU EFES BIRACILIK VE MALT SANAYII AS	4,454	19.450	86,630.300	
	ARCELIK	7,401	15.780	116,787.780	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	31,766	23.580	749,042.280	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIKALARI TAS	125,960	7.530	948,478.800	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	5,919	56.150	332,351.850	
	KOC HOLDING AS	67,325	14.720	991,024.000	
	PETKIM PETROKIMYA HOLDING	88,174	5.090	448,805.660	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI AS	79,624	5.240	417,229.760	
	TURK HAVA YOLLARI	36,589	14.960	547,371.440	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	72,290	12.600	910,854.000	
	TURKIYE GARANTI BANKASI AS	201,717	7.870	1,587,512.790	
	TURKIYE IS BANKASI	151,063	4.230	638,996.490	
	TUPRAS TURKIYE PETROL RAFINE	9,240	121.100	1,118,964.000	

	HACI OMER SABANCI HOLDING AS	88,752	7.240	642,564.480	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	19,011	89.700	1,705,286.700	
	TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	13,735	23.880	327,991.800	
	TURKIYE HALK BANKASI AS	61,970	6.780	420,156.600	
	AKBANK TAS-RTS	185,577	0.970	180,009.690	
トルコ・リラ 小計		1,436,144		13,237,126.170 (264,610,152)	
ハンガリー・フォロント	RICHTER GEDEON NYRT	11,011	5,820.000	64,084,020.000	
	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NYRT	30,013	3,220.000	96,641,860.000	
	OTP BANK NYRT	17,606	11,620.000	204,581,720.000	
ハンガリー・フォロント 小計		58,630		365,307,600.000 (141,885,472)	
パキスタン・ルビー	MCB BANK LTD	39,000	194.970	7,603,830.000	
	OIL & GAS DEVELOPMENT CO LTD	74,500	142.960	10,650,520.000	
	HABIB BANK LTD	54,400	132.020	7,181,888.000	
パキスタン・ルビー 小計		167,900		25,436,238.000 (19,840,266)	
フィリピン・ペソ	AYALA LAND INC	641,100	45.000	28,849,500.000	
	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	128,910	61.600	7,940,856.000	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAND	47,550	94.500	4,493,475.000	
	AYALA CORP	21,583	1,000.000	21,583,000.000	
	ALLIANCE GLOBAL GROUP INC	307,700	12.720	3,913,944.000	
	DMCI HOLDINGS INC	351,850	12.820	4,510,717.000	
	GLOBE TELECOM INC	2,785	2,020.000	5,625,700.000	
	INTERNATIONAL CONTAINER TERM SERVICES INC	40,680	104.600	4,255,128.000	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	229,950	63.500	14,601,825.000	
	JOLLIBEE FOODS CORP	35,320	314.000	11,090,480.000	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	117,297	81.900	9,606,624.300	
	BDO UNIBANK INC	146,363	131.300	19,217,461.900	
	MEGAWORLD CORP	962,000	5.060	4,867,720.000	
	PLDT INC	8,600	1,234.000	10,612,400.000	
	ROBINSONS LAND CORP	218,722	22.250	4,866,564.500	
	SECURITY BANK CORP	23,420	178.400	4,178,128.000	
	SM PRIME HOLDINGS INC	900,475	39.450	35,523,738.750	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	63,330	133.900	8,479,887.000	
	SM INVESTMENTS CORP	19,828	985.000	19,530,580.000	
METRO PACIFIC INVESTMENTS CORP	1,148,900	4.920	5,652,588.000		

	ABOITIZ POWER CORP	128,200	36.900	4,730,580.000	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	17,910	393.400	7,045,794.000	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	6,997	1,020.000	7,136,940.000	
フィリピン・ペソ	小計	5,569,470		248,313,631.450 (516,492,354)	
ブラジル・リアル	BRF SA	47,492	23.450	1,113,687.400	
	VALE SA	257,821	53.100	13,690,295.100	
	RAIA DROGASIL SA	20,600	63.520	1,308,512.000	
	TIM PARTICIPACOES SA	76,300	12.500	953,750.000	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	19,450	34.370	668,496.500	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	23,000	31.000	713,000.000	
	BANCO DO BRASIL SA	73,400	48.500	3,559,900.000	
	INVESTIMENTOS ITAU SA	378,560	12.960	4,906,137.600	
	LOJAS AMERICANAS SA	61,374	20.780	1,275,351.720	
	GERDAU SA	90,630	15.590	1,412,921.700	
	CIA BRASILEIRA DE DISTRIBUICAO GRUPO PAO DE ACUCAR	11,306	85.760	969,602.560	
	PETROLEO BRASILEIRO SA	241,810	28.680	6,935,110.800	
	PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	32,800	25.750	844,600.000	
	PETROLEO BRASILEIRO SA	326,012	25.260	8,235,063.120	
	KROTON EDUCACIONAL SA	122,968	9.660	1,187,870.880	
	CCR SA	100,520	12.910	1,297,713.200	
	WEG SA	74,072	18.500	1,370,332.000	
	BANCO BRADESCO SA PREF	273,125	41.770	11,408,431.250	
	BANCO BRADESCO SA	85,018	37.270	3,168,620.860	
	NATURA COSMETICOS SA	16,000	45.540	728,640.000	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	61,606	9.980	614,827.880	
	SUZANO PAPEL E CELULOSE SA	39,900	38.860	1,550,514.000	
	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	399,247	37.830	15,103,514.010	
	PORTO SEGURO SA	8,800	51.050	449,240.000	
	FIBRIA CELULOSE SA	18,590	66.300	1,232,517.000	
	B2W CIA DIGITAL	12,600	46.500	585,900.000	
	BRASKEM SA	12,930	47.510	614,304.300	
	ENGIE BRASIL SA	16,087	36.220	582,671.140	
	LOCALIZA RENT A CAR	33,780	30.050	1,015,089.000	
	TELEFONICA BRASIL S.A.	39,428	48.450	1,910,286.600	
	LOJAS RENNER SA	53,370	42.660	2,276,764.200	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	25,952	53.470	1,387,653.440	
	COSAN SA	16,200	39.740	643,788.000	
	EQUATORIAL ENERGIA SA	13,800	80.990	1,117,662.000	
	EMBRAER SA	55,760	20.990	1,170,402.400	
	M DIAS BRANCO SA	10,400	46.800	486,720.000	

	BR MALLS PARTICIPACOES SA	67,065	13.340	894,647.100	
	JBS SA	89,900	12.160	1,093,184.000	
	CIA ENERGETICA DE MINAS GERAIS	68,649	13.830	949,415.670	
	CIA DE SANEAMENTO BASICO DO ESTADO DE SAO PAULO	25,798	37.830	975,938.340	
	MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS IMOBILIARIOS SA	20,740	24.170	501,285.800	
	SUL AMERICA SA	17,869	27.900	498,545.100	
	HYPERA SA	28,000	30.900	865,200.000	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BAICAO	164,516	28.270	4,650,867.320	
	MAGAZINE LUIZA SA	6,500	180.850	1,175,525.000	
	BANCO SANTANDER BRASIL SA	37,100	47.490	1,761,879.000	
	CIELO SA	111,307	11.090	1,234,394.630	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	52,500	27.400	1,438,500.000	
	ATACADAO DISTRIBUICAO COMERCIO E INDUSTRIA LTDA	37,300	19.280	719,144.000	
	AMBEV SA	380,595	16.850	6,413,025.750	
	KLABIN SA	64,800	17.390	1,126,872.000	
	RUMO SA	82,100	17.470	1,434,287.000	
	IRB BRASIL RESSEGUROS S/A	10,500	81.080	851,340.000	
	ブラジル・リアル 小計	4,415,947		123,073,941.370 (3,593,759,088)	
ポーランド・ズロチ	BANK MILLENNIUM SA	49,782	9.020	449,033.640	
	MBANK	1,142	429.400	490,374.800	
	BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA	2,596	69.500	180,422.000	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	11,899	92.000	1,094,708.000	
	BANK PEKAO SA	14,392	113.100	1,627,735.200	
	ORANGE POLSKA SA	58,600	5.120	300,032.000	
	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	23,605	109.000	2,572,945.000	
	LPP SA	108	7,895.000	852,660.000	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	2,286	372.000	850,392.000	
	CD PROJEKT RED SA	6,015	171.000	1,028,565.000	
	POWSZECHNA KASA OSZCZEDNOSCI BANK POLSKI SA	74,465	39.600	2,948,814.000	
	CCC SA	2,763	186.000	513,918.000	
	GRUPA LOTOS SA	7,605	93.120	708,177.600	
	POLSKIE GORNICtwo NAFTOWE I GAZOWNICTWO SA	136,123	7.300	993,697.900	



	CYFROWY POLSAT SA	23,495	23.060	541,794.700	
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	70,529	10.060	709,521.740	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZEN SA	46,065	44.220	2,036,994.300	
	JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA SA	5,380	66.140	355,833.200	
	ALIOR BANK SA	9,007	55.000	495,385.000	
	DINO POLSKA SA	4,709	102.600	483,143.400	
ポーランド・ズロチ	小計	550,566		19,234,147.480 (558,751,984)	
マレーシア・リン ギット	AMMB HOLDINGS BHD	134,500	4.480	602,560.000	
	GENTING PLANTATIONS BHD	18,800	9.820	184,616.000	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	359,500	5.650	2,031,175.000	
	DIGI.COM BHD	288,700	4.430	1,278,941.000	
	MALAYSIA AIRPORTS HOLDINGS BHD	71,420	8.200	585,644.000	
	RHB BANK BHD	77,780	5.340	415,345.200	
	HAP SENG CONSOLIDATED BHD	63,200	9.850	622,520.000	
	TOP GLOVE CORP BHD	133,800	4.700	628,860.000	
	GAMUDA BHD	194,600	2.790	542,934.000	
	GENTING BHD	175,600	6.400	1,123,840.000	
	YTL CORP BHD	283,710	1.070	303,569.700	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP BHD	20,256	19.360	392,156.160	
	HONG LEONG BANK BHD	54,008	20.640	1,114,725.120	
	IJM CORP BHD	230,360	1.780	410,040.800	
	IOI CORP BHD	187,213	4.490	840,586.370	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	36,600	23.960	876,936.000	
	FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	12,800	33.340	426,752.000	
	MALAYAN BANKING BHD	295,675	9.450	2,794,128.750	
	ALLIANCE BANK MALAYSIA BHD	88,400	4.130	365,092.000	
	MISC BHD	90,280	6.430	580,500.400	
	NESTLE MALAYSIA BHD	4,800	144.700	694,560.000	
	PPB GROUP BHD	47,560	17.240	819,934.400	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	19,600	25.860	506,856.000	
	PETRONAS GAS BHD	60,400	17.980	1,085,992.000	
	GENTING MALAYSIA BHD	242,100	3.260	789,246.000	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD	14,700	36.360	534,492.000	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	49,100	2.590	127,169.000	
	SP SETIA BHD	66,300	2.240	148,512.000	
	TENAGA NASIONAL BHD	270,550	13.860	3,749,823.000	
	QL RESOURCES BHD	16,800	6.720	112,896.000	
	DIALOG GROUP BHD	320,544	2.800	897,523.200	

	PUBLIC BANK BHD(LOCAL)	230,130	24.800	5,707,224.000	
	AIRASIA GROUP BHD	147,900	2.950	436,305.000	
	SIME DARBY BERHAD	125,000	2.360	295,000.000	
	HARTELEGA HOLDINGS BHD	95,900	4.990	478,541.000	
	AXIATA GROUP BERHAD	219,800	4.000	879,200.000	
	MAXIS BHD	203,300	5.640	1,146,612.000	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	207,400	8.700	1,804,380.000	
	IHH HEALTHCARE BHD	220,400	5.750	1,267,300.000	
	WESTPORTS HOLDINGS BHD	109,200	3.610	394,212.000	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDINGS BHD	92,900	4.650	431,985.000	
	SIME DARBY PROPERTY BHD	232,700	1.060	246,662.000	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	216,100	5.050	1,091,305.000	
	IOI PROPERTIES GROUP SDN BHD	174,548	1.480	258,331.040	
マレーシア・リンギット 小計		6,204,934		40,024,983.140 (1,059,861,554)	
メキシコ・ペソ	ALFA SAB DE CV	264,100	24.590	6,494,219.000	
	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	44,300	126.240	5,592,432.000	
	EL PUERTO DE LIVERPOOL SAB DE CV	19,100	134.490	2,568,759.000	
	GRUPO TELEVISIA SAB	208,500	47.890	9,985,065.000	
	GRUPO BIMBO SAB DE CV	105,300	39.610	4,170,933.000	
	GRUMA SAB DE CV	12,680	224.840	2,850,971.200	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INFRAESTRUCTURA	20,260	194.590	3,942,393.400	
	GRUPO CARSO SAB DE CV	37,600	76.420	2,873,392.000	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE SAB DE CV	209,700	103.610	21,727,017.000	
	MEXICHEM SAB DE CV	81,325	47.700	3,879,202.500	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	8,830	266.070	2,349,398.100	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO SAB DE CV	115,200	30.970	3,567,744.000	
	ALSEA SAB DE CV	43,700	54.170	2,367,229.000	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL SURESTE SAB DE CV	17,990	329.550	5,928,604.500	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV	305,952	44.770	13,697,471.040	
	AMERICA MOVIL SAB DE CV	2,717,078	15.010	40,783,340.780	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA SA	198,800	28.300	5,626,040.000	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	42,600	112.750	4,803,150.000	
WAL-MART DE MEXICO SAB DE CV	449,900	48.920	22,009,108.000		
GRUPO AEROPORTUARIO DEL PACIFICO SAB DE CV	31,200	176.030	5,492,136.000		

	MEGACABLE HOLDINGS SAB DE CV	18,400	89.160	1,640,544.000	
	INFRAESTRUCTURA ENERGETICA NOVA SAB DE CV	43,600	78.050	3,402,980.000	
	BANCO SANTANDER MEXICO SA-B	174,090	24.640	4,289,577.600	
メキシコ・ペソ 小計		5,170,205		180,041,707.120 (1,020,836,480)	
ユーロ	ALPHA BANK A.E.	125,732	1.180	148,363.760	
	TITAN CEMENT CO. S.A.	4,089	20.250	82,802.250	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	22,051	10.730	236,607.230	
	FF GROUP	3,130	4.800	15,024.000	
	MOTOR OIL HELLAS CORINTH REFIN	5,847	21.200	123,956.400	
	OPAP SA	19,846	8.000	158,768.000	
	JUMBO SA	4,749	12.880	61,167.120	
ユーロ 小計		185,444		826,688.760 (103,203,825)	
韓国・ウォン	CHEIL WORLDWIDE INC	7,097	22,750.000	161,456,750.000	
	HANMI SCIENCE CO LTD	1,187	77,800.000	92,348,600.000	
	HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	3,477	79,000.000	274,683,000.000	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANC	2,650	269,000.000	712,850,000.000	
	DB INSURANCE CO LTD	4,209	67,800.000	285,370,200.000	
	COWAY CO LTD	4,439	75,300.000	334,256,700.000	
	KT&G CORP	10,022	101,500.000	1,017,233,000.000	
	S-1 CORPORATION	1,444	100,500.000	145,122,000.000	
	KOREA GAS CORP	1,727	50,000.000	86,350,000.000	
	CJ CORP	1,179	118,000.000	139,122,000.000	
	KAKAO CORP	4,263	101,000.000	430,563,000.000	
	CJ ENM CO LTD	987	208,500.000	205,789,500.000	
	DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE	2,634	32,350.000	85,209,900.000	
	SK TELECOM CO LTD	1,859	271,000.000	503,789,000.000	
	DAELIM INDUSTRIAL CO	2,649	96,800.000	256,423,200.000	
	MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD	33,492	6,760.000	226,405,920.000	
	NCSOFT CORPORATION	1,387	472,000.000	654,664,000.000	
	LG UPLUS CORP	6,540	17,150.000	112,161,000.000	
	DAEWOO ENGINEERING & CONSTRUCT	13,540	5,640.000	76,365,600.000	
	POSCO DAEWOO CORP	3,600	19,750.000	71,100,000.000	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD	722	1,091,000.000	787,702,000.000		
LG CHEM LTD	3,673	347,000.000	1,274,531,000.000		
LG CHEM LTD	726	194,000.000	140,844,000.000		

LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD	201	690,000.000	138,690,000.000	
SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD	34,256	38,350.000	1,313,717,600.000	
S-OIL CORP	3,782	96,900.000	366,475,800.000	
HANWHA CHEMICAL CORPORATION	10,493	20,200.000	211,958,600.000	
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	5,997	31,500.000	188,905,500.000	
POSCO CHEMTECH CO LTD	1,672	61,400.000	102,660,800.000	
LOTTE CHEMICAL CORPORATION	1,313	265,000.000	347,945,000.000	
HOTEL SHILLA CO LTD	2,826	69,700.000	196,972,200.000	
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	3,207	135,000.000	432,945,000.000	
HYUNDAI MOBIS	5,855	196,000.000	1,147,580,000.000	
SK HYNIX INC	47,543	65,300.000	3,104,557,900.000	
HYUNDAI ENGINEERING & CONSTRUCTION CO LTD	6,587	58,600.000	385,998,200.000	
HYUNDAI MOTOR CO	1,954	70,500.000	137,757,000.000	
HYUNDAI MOTOR CO	10,785	123,000.000	1,326,555,000.000	
HYUNDAI STEEL CO	6,150	48,900.000	300,735,000.000	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	17,323	13,550.000	234,726,650.000	
KCC CORP	554	295,000.000	163,430,000.000	
KIA MOTORS CORP	22,988	34,300.000	788,488,400.000	
KOREA ZINC CO LTD	698	447,500.000	312,355,000.000	
KOREA ELECTRIC POWER CORP	22,108	34,450.000	761,620,600.000	
HANWHA CORP	3,785	30,300.000	114,685,500.000	
KOREAN AIR CO LTD	2,345	33,600.000	78,792,000.000	
OCI COMPANY LTD	1,829	98,000.000	179,242,000.000	
CJ LOGISTICS	860	163,000.000	140,180,000.000	
KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	1,509	88,300.000	133,244,700.000	
KT CORP	2,048	29,400.000	60,211,200.000	
HLB INC	2,994	74,300.000	222,454,200.000	
LG ELECTRONICS INC	9,110	65,600.000	597,616,000.000	
LOTTE CORP	1,940	51,600.000	100,104,000.000	
LG CORP	8,116	70,400.000	571,366,400.000	
NH INVESTMENT & SECURITIES CO LTD	13,362	12,850.000	171,701,700.000	
GS ENGINEERING & CONSTRUCTION	4,872	45,150.000	219,970,800.000	
NAVER CORP	11,313	131,000.000	1,482,003,000.000	
HYUNDAI DEPARTMENT STORE CO LTD	1,249	88,600.000	110,661,400.000	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO LTD	3,504	59,100.000	207,086,400.000	
OTTOGI CORP	112	770,000.000	86,240,000.000	
AMOREPACIFIC GROUP	1,754	66,000.000	115,764,000.000	

KANGWON LAND INC	10,655	31,800.000	338,829,000.000	
POSCO	6,264	258,500.000	1,619,244,000.000	
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	11,910	17,700.000	210,807,000.000	
SAMSUNG SDI CO LTD	4,723	227,000.000	1,072,121,000.000	
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO LTD	4,863	97,200.000	472,683,600.000	
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	397,189	39,800.000	15,808,122,200.000	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES CO LTD	32,995	7,410.000	244,492,950.000	
SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	70,564	32,450.000	2,289,801,800.000	
SHINSEGAE CO LTD	646	241,000.000	155,686,000.000	
YUHAN CORP	707	228,000.000	161,196,000.000	
HANON SYSTEMS	13,644	10,800.000	147,355,200.000	
HYUNDAI MARINE & FIRE INSURANCE CO LTD	4,648	37,600.000	174,764,800.000	
GS HOLDINGS CORP	2,892	51,000.000	147,492,000.000	
LG DISPLAY CO LTD	18,262	19,800.000	361,587,600.000	
CELLTRION INC	6,730	216,500.000	1,457,045,000.000	
VIROMED CO LTD	1,302	249,300.000	324,588,600.000	
HANA FINANCIAL GROUP	25,782	35,400.000	912,682,800.000	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	1,800	137,500.000	247,500,000.000	
CELLTRION PHARM INC	1,457	61,100.000	89,022,700.000	
LOTTE SHOPPING CO	839	206,000.000	172,834,000.000	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LTD	5,956	81,100.000	483,031,600.000	
AMOREPACIFIC CORP	2,677	184,500.000	493,906,500.000	
AMOREPACIFIC CORP-PREF	848	101,500.000	86,072,000.000	
SAMSUNG CARD CO	2,877	34,650.000	99,688,050.000	
SK INNOVATION CO LTD	5,196	181,500.000	943,074,000.000	
CJ CHEILJEDANG CORP	695	337,000.000	234,215,000.000	
STX PAN OCEAN CO LTD	18,395	4,630.000	85,168,850.000	
LG INNOTEK CO LTD	1,440	85,700.000	123,408,000.000	
SK HOLDINGS CO LTD	2,692	257,000.000	691,844,000.000	
KB FINANCIAL GROUP INC	32,019	45,500.000	1,456,864,500.000	
MEDY-TOX INC	421	571,400.000	240,559,400.000	
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES LTD	6,602	33,950.000	224,137,900.000	
BNK FINANCIAL GROUP INC	13,241	6,680.000	88,449,880.000	
HANMI PHARM CO LTD	530	450,500.000	238,765,000.000	
HANWHA LIFE INSURANCE CO LTD	27,836	4,175.000	116,215,300.000	
FILA KOREA LTD	3,324	47,100.000	156,560,400.000	
E-MART CO LTD	1,699	193,500.000	328,756,500.000	
DGB FINANCIAL GROUP INC	10,752	8,050.000	86,553,600.000	
GS RETAIL CO LTD	2,482	35,850.000	88,979,700.000	
HANKOOK TIRE CO LTD NEW	6,590	37,000.000	243,830,000.000	

	HDC HYUNDAI DEVELOPMENT CO-ENGINEERING & CONSTRUCTION	1,688	45,350.000	76,550,800.000	
	HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOLDINGS CO LTD	773	356,000.000	275,188,000.000	
	BGF RETAIL CO LTD	631	189,500.000	119,574,500.000	
	ORION CORP REPUBLIC OF KOREA	2,071	118,000.000	244,378,000.000	
	ORANGE LIFE INSURANCE LTD	3,735	27,450.000	102,525,750.000	
	NETMARBLE CORP	1,935	114,000.000	220,590,000.000	
	SAMSUNG SDS CO LTD	2,537	205,000.000	520,085,000.000	
	WOORI BANK	41,071	14,800.000	607,850,800.000	
	SAMSUNG C&T CORP	5,828	108,500.000	632,338,000.000	
	SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	1,432	388,000.000	555,616,000.000	
	PEARL ABYSS CORP	534	206,100.000	110,057,400.000	
	DOOSAN BOBCAT INC	3,636	32,950.000	119,806,200.000	
	SILLAJEN INC	4,787	72,700.000	348,014,900.000	
	CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	3,951	73,900.000	291,978,900.000	
韓国・ウォン 小計		1,229,250		61,772,228,600.000 (6,004,260,620)	
香港・ドル	JIANGXI COPPER CO LTD	91,000	9.330	849,030.000	
	JIANGSU EXPRESS	94,000	11.320	1,064,080.000	
	CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD	156,000	5.060	789,360.000	
	ANGANG STEEL CO LTD-H	104,000	5.390	560,560.000	
	CHINA MOBILE LIMITED	502,000	79.750	40,034,500.000	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	106,000	38.650	4,096,900.000	
	DATANG INTERNATIONAL POWER GEN	288,000	1.860	535,680.000	
	BEIJING ENTERPRISES	41,500	42.450	1,761,675.000	
	HUANENG POWER INTERNATIONAL IN	306,000	5.060	1,548,360.000	
	ALIBABA HEALTH INFORMATION TECHNOLOGY	290,000	6.800	1,972,000.000	
	YANZHOU COAL MINING CO LTD	136,000	6.280	854,080.000	
	HENGAN INTERNATIONAL GROUP	65,000	56.650	3,682,250.000	
	HUADIAN POWER INTL CORP- H	144,000	3.550	511,200.000	
	CHINA EASTERN AIRLINES CORP LT	124,000	4.430	549,320.000	
	CNOOC LTD	1,463,000	12.820	18,755,660.000	
	BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	270,000	6.520	1,760,400.000	
	CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LTD	368,000	12.220	4,496,960.000	

CHINA OVERSEAS LAND & INVESTME	307,120	26.650	8,184,748.000	
CHINA RESOURCES LAND LTD	220,888	30.650	6,770,217.200	
CITIC LTD	445,000	12.500	5,562,500.000	
CHINA TRAVEL INTERNATIONAL INV	198,000	2.140	423,720.000	
BEIJING CAPITAL INTERNATIONAL	162,000	6.610	1,070,820.000	
LENOVO GROUP LTD	552,000	5.380	2,969,760.000	
PETRO CHINA CO LTD	1,708,000	5.030	8,591,240.000	
CHINA UNICOM HONG KONG LTD	514,742	8.500	4,375,307.000	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS CO LTD	122,790	19.080	2,342,833.200	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL COR	2,065,200	6.090	12,577,068.000	
TONG REN TANG TECHNOLOGIES CO	54,000	10.180	549,720.000	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	77,000	19.940	1,535,380.000	
KINGDEE INTERNATIONAL SOFTWARE GROUP CO LTD	220,000	6.860	1,509,200.000	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	64,900	69.650	4,520,285.000	
KUNLUN ENERGY COMPANY LTD	288,000	8.430	2,427,840.000	
TOWNGAS CHINA CO LTD	91,000	5.870	534,170.000	
COSCO SHIPPING PORTS LTD	84,000	7.730	649,320.000	
YUEXIU PROPERTY CO LTD	444,000	1.450	643,800.000	
CHINA MERCHANTS PORT HOLDINGS CO LTD	104,000	15.120	1,572,480.000	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	374,000	2.560	957,440.000	
CHINA INVESTMENT FUND INTERNATIONAL HOLDINGS CO LTD	72,000	25.700	1,850,400.000	
SHENZHEN INTERNATIONAL HOLDING	84,500	15.240	1,287,780.000	
CHINA EVERBRIGHT LTD	82,000	13.540	1,110,280.000	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	139,000	25.650	3,565,350.000	
KINGBOARD HOLDINGS LTD	63,500	24.400	1,549,400.000	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LTD	419,000	11.000	4,609,000.000	
SHENZHEN INVESTMENT LTD	306,000	2.510	768,060.000	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LTD	82,000	30.300	2,484,600.000	
BYD CO LTD	45,000	47.050	2,117,250.000	
CHINA TELECOM CORP LTD	1,244,000	4.000	4,976,000.000	
CHINA OILFIELD SERVICES LTD	172,000	6.750	1,161,000.000	

ALIBABA PICTURES GROUP LTD	1,220,000	1.290	1,573,800.000	
SINOTRANS LTD	190,000	3.340	634,600.000	
MAANSHAN IRON & STEEL	100,000	3.450	345,000.000	
CHINA EVERBRIGHT INTERNATIONAL	275,592	7.720	2,127,570.240	
MMG LTD	220,000	3.200	704,000.000	
LEE & MAN PAPER MANUFACTURING LTD	97,000	6.770	656,690.000	
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	589,788	8.140	4,800,874.320	
AVICHINA INDUSTRY & TECHNOLOGY	126,000	4.750	598,500.000	
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS	163,200	15.960	2,604,672.000	
GREAT WALL MOTOR COMPANY LTD	300,500	4.920	1,478,460.000	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	610,000	17.380	10,601,800.000	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD	561,000	2.820	1,582,020.000	
CHINA ORIENTAL GROUP CO LTD	70,000	5.000	350,000.000	
SHANDONG WEIGAO GROUP MEDICAL-H	176,000	6.260	1,101,760.000	
SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	274,700	6.560	1,802,032.000	
WEICHAJ POWER CO LTD	176,440	8.960	1,580,902.400	
CHINA SHIPPING DEVELOPMENT CO	100,000	4.040	404,000.000	
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEMICAL	215,000	3.660	786,900.000	
SHANGHAI INDUSTRIAL	46,000	15.580	716,680.000	
TINGYI HOLDING CORP	178,000	10.000	1,780,000.000	
TSINGTAO BREWERY CO LTD	26,000	33.250	864,500.000	
GUANGDONG INVESTMENTS LTD	250,000	15.120	3,780,000.000	
CHINA TRADITIONAL CHINESE MEDICINE HOLDINGS CO LTD	208,000	4.800	998,400.000	
CHINA RESOURCES BEER HOLDINGS	123,333	26.350	3,249,824.550	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO LTD	52,000	7.210	374,920.000	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	589,500	5.670	3,342,465.000	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	235,000	24.750	5,816,250.000	
TENCENT HOLDINGS LTD	470,800	329.000	154,893,200.000	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	428,500	69.100	29,609,350.000	



BEIJING ENTERPRISES WATER GROUP LTD	466,000	4.140	1,929,240.000	
GOME RETAIL HOLDINGS LTD	970,240	0.650	630,656.000	
CHINA POWER INTERNATIONAL	350,000	1.840	644,000.000	
AIR CHINA / HONG KONG	132,000	6.740	889,680.000	
ZTE CORP	71,288	15.420	1,099,260.960	
SHANGHAI ELECTRIC GROUP CO LTD	250,000	2.590	647,500.000	
CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD	276,500	17.980	4,971,470.000	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO LTD	248,500	3.180	790,230.000	
BANK OF COMMUNICATIONS	659,205	6.190	4,080,478.950	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT HOLDINGS LTD	142,250	6.760	961,610.000	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	62,000	44.000	2,728,000.000	
CHINA CONSTRUCTION BANK	7,943,530	6.570	52,188,992.100	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP HOLDINGS LTD	64,000	93.150	5,961,600.000	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	224,000	7.640	1,711,360.000	
AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	106,000	8.570	908,420.000	
SSY GROUP LTD	144,000	5.860	843,840.000	
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS LTD	131,000	7.330	960,230.000	
CHINA NATIONAL BLDG MATERIAL	364,000	5.240	1,907,360.000	
BANK OF CHINA LTD	6,554,200	3.420	22,415,364.000	
SHUI ON LAND LTD	335,500	1.740	583,770.000	
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	95,500	20.450	1,952,975.000	
GREENTOWN CHINA HOLDINGS LTD	82,000	5.970	489,540.000	
GUANGZHOU R&F PROPERTIES CO LTD	62,000	12.800	793,600.000	
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	330,470	29.550	9,765,388.500	
IND & COMM BK OF CHINA - H	5,721,235	5.690	32,553,827.150	
ZHAOJIN MINING INDUSTRY CO LTD	96,000	7.900	758,400.000	
KINGBOARD LAMINATES HOLDING	104,000	7.730	803,920.000	
CHINA COMMUNICATIONS SERVICES	227,600	6.840	1,556,784.000	
CHINA COMMUNICATIONS CONSTRUCTION CO LTD	334,000	7.690	2,568,460.000	

CHINA COAL ENERGY CO	178,000	3.120	555,360.000	
HAITIAN INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	31,000	16.100	499,100.000	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC CO LTD	51,000	44.600	2,274,600.000	
HAIER ELECTRONICS GROUP CO LTD	103,000	20.550	2,116,650.000	
CHINA AGRI-INDUSTRIES HOLDINGS LTD	191,000	2.800	534,800.000	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD	641,142	9.200	5,898,506.400	
CHINA MOLYBDENUM CO LTD	369,000	2.910	1,073,790.000	
CHINA CITIC BANK-H	698,800	4.730	3,305,324.000	
KWG GROUP HOLDINGS LTD	121,000	6.950	840,950.000	
SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	60,600	66.950	4,057,170.000	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	77,000	35.400	2,725,800.000	
FOSUN INTERNATIONAL	230,028	10.800	2,484,302.400	
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP LTD	372,000	3.580	1,331,760.000	
SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD	141,000	3.370	475,170.000	
SOHO CHINA LTD	172,500	2.830	488,175.000	
KINGSOFT CORP LTD	76,000	13.000	988,000.000	
SINOTRUK HONG KONG LTD	64,500	11.080	714,660.000	
CHINA RAILWAY GROUP LTD	338,000	7.370	2,491,060.000	
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS LTD	122,000	6.340	773,480.000	
BYD ELECTRONIC INTERNATIONAL CO LTD	52,500	9.530	500,325.000	
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION CORP	128,500	11.020	1,416,070.000	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	355,000	6.230	2,211,650.000	
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	206,800	25.150	5,201,020.000	
CHINA EVERGRANDE GROUP	211,000	22.100	4,663,100.000	
CRRC CORP LTD - H	338,450	7.830	2,650,063.500	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDINGS LTD	126,000	7.340	924,840.000	
SUN ART RETAIL GROUP LTD	179,000	7.410	1,326,390.000	
BBMG CORP	222,000	2.430	539,460.000	
CHINA ZHONGWANG HOLDINGS LTD	145,200	3.610	524,172.000	
SINOPHARM GROUP CO	107,600	32.800	3,529,280.000	
CHINA RESOURCES CEMENT	200,000	7.030	1,406,000.000	
METALLURGICAL CORP OF CHINA LTD	276,000	1.920	529,920.000	

GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD	274,527	8.420	2,311,517.340	
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	154,000	4.720	726,880.000	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL BANK	196,000	4.210	825,160.000	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP CORP	242,000	5.580	1,350,360.000	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD	59,100	16.540	977,514.000	
HUANENG RENEWABLES CORP LTD	472,000	2.130	1,005,360.000	
SIHUA PHARMACEUTICAL HOLDINGS GROUP LTD	325,000	1.540	500,500.000	
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	205,000	25.200	5,166,000.000	
YUZHOU PROPERTIES CO LTD	166,000	3.160	524,560.000	
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	128,500	23.600	3,032,600.000	
NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	75,800	27.650	2,095,870.000	
CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	491,656	5.500	2,704,108.000	
KAISA GROUP HOLDINGS LTD	203,000	2.280	462,840.000	
XINJIANG GOLDWIND SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	60,000	7.110	426,600.000	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD	171,000	3.450	589,950.000	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA	2,526,000	3.480	8,790,480.000	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS LTD	55,000	15.260	839,300.000	
FAR EAST HORIZON LTD	199,000	7.620	1,516,380.000	
CITIC SECURITIES CO LTD	184,000	14.620	2,690,080.000	
FUTURE LAND DEVELOPMENT HOLDINGS LTD	172,000	5.490	944,280.000	
HAITONG SECURITIES CO LTD	210,000	8.300	1,743,000.000	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROUP OF CHINA LTD	618,000	3.070	1,897,260.000	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	46,000	22.150	1,018,900.000	
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	334,000	4.100	1,369,400.000	
SINOPEC ENGINEERING GROUP CO LTD	121,500	6.650	807,975.000	
CHINA GALAXY SECURITIES CO LTD	328,500	3.800	1,248,300.000	
HANERGY THIN FILM POWER GROUP	986,000	0.000	0.000	

NEXTEER AUTOMOTIVE GROUP LTD	85,000	10.840	921,400.000	
CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS CO LTD	323,000	0.000	0.000	
GREENTOWN SERVICE GROUP CO LTD	96,000	6.220	597,120.000	
JIAYUAN INTERNATIONAL GROUP LTD	94,000	15.140	1,423,160.000	
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO LTD	42,400	15.820	670,768.000	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA CO LTD	267,000	4.140	1,105,380.000	
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING LTD	31,000	20.250	627,750.000	
GENSCRIPT BIOTECH CORP	74,000	11.400	843,600.000	
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLDINGS CO LTD	95,000	12.900	1,225,500.000	
CHINA FIRST CAPITAL GROUP LTD	308,000	3.790	1,167,320.000	
CHINA TOWER CORP LTD	2,904,000	1.480	4,297,920.000	
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	276,000	3.040	839,040.000	
CHINA CINDA ASSET MANAGEMENT CO LTD	796,000	2.020	1,607,920.000	
LOGAN PROPERTY HOLDINGS CO LTD	134,000	10.700	1,433,800.000	
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS LTD	137,000	22.950	3,144,150.000	
CHINA VANKE CO LTD-H	103,361	28.200	2,914,780.200	
LUYE PHARMA GROUP LTD	108,000	5.480	591,840.000	
CAR INC	68,000	5.900	401,200.000	
HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	39,000	14.460	563,940.000	
CGN POWER CO LTD	981,000	1.930	1,893,330.000	
FULLSHARE HOLDINGS LTD	517,500	1.310	677,925.000	
BAIC MOTOR CORP LTD	163,500	4.570	747,195.000	
GF SECURITIES CO LTD	78,200	11.040	863,328.000	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD	51,200	25.350	1,297,920.000	
HUATAI SECURITIES CO LTD	112,600	13.340	1,502,084.000	
3SBIO INC	101,500	10.720	1,088,080.000	
LEGEND HOLDINGS CORP	31,500	21.800	686,700.000	
CHINA RESOURCES PHARMACEUTICAL GROUP LTD	89,000	10.300	916,700.000	
CHINA HUARONG ASSET MANAGEMENT CO LTD	904,000	1.470	1,328,880.000	
CHINA LITERATURE LTD	17,200	37.250	640,700.000	
DALI FOODS GROUP CO LTD	188,000	5.430	1,020,840.000	
CHINA RAILWAY SIGNAL & COMMUNICATION CORP LTD	141,000	5.790	816,390.000	

	CHINA REINSURANCE GROUP CORP	525,000	1.600	840,000.000	
	MEITU INC	152,500	2.700	411,750.000	
	BOC AVIATION LTD	15,700	58.400	916,880.000	
	ZHONGAN ONLINE P&C INSURANCE CO LTD	15,500	26.000	403,000.000	
	CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CORP LTD	81,600	15.280	1,246,848.000	
	WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	44,500	58.200	2,589,900.000	
	HENG TEN NETWORKS GROUP LTD	2,096,000	0.226	473,696.000	
香港・ドル	小計	77,850,475		723,678,967.410 (10,015,716,909)	
台湾・ドル	ACER INC	278,532	19.050	5,306,034.600	
	ASUSTEK COMPUTER INC	59,554	223.500	13,310,319.000	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	37,616	145.000	5,454,320.000	
	ASIA CEMENT CORP	160,928	35.600	5,729,036.800	
	WALSIN TECHNOLOGY CORP	31,000	154.500	4,789,500.000	
	TAIWAN BUSINESS BANK	371,457	10.800	4,011,735.600	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMICONDUCTOR CORP	85,000	56.300	4,785,500.000	
	MICRO-STAR INTERNATIONAL CO LTD	65,000	77.200	5,018,000.000	
	CHICONY ELECTRONICS CO LTD	54,975	65.200	3,584,370.000	
	QUANTA COMPUTER INC	200,858	53.300	10,705,731.400	
	HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	89,070	46.350	4,128,394.500	
	EVA AIRWAYS CORP	149,269	15.500	2,313,669.500	
	CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	54,760	212.000	11,609,120.000	
	CHANG HWA COMMERCIAL BANK	509,345	17.850	9,091,808.250	
	CHINA AIRLINES	232,156	10.950	2,542,108.200	
	CHENG SHIN RUBBER INDUSTRY CO	158,169	42.550	6,730,090.950	
	CHINA STEEL CORP	1,075,058	24.900	26,768,944.200	
	CHINA LIFE INSURANCE CO LTD/TAIWAN	256,994	28.100	7,221,531.400	
	ADVANTECH CO LTD	29,889	223.000	6,665,247.000	
	COMPAL ELECTRONICS INC	240,304	17.550	4,217,335.200	
	DELTA ELECTRONICS INC	162,663	145.000	23,586,135.000	
	NANYA TECHNOLOGY CORP	73,000	53.800	3,927,400.000	
	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	296,327	107.000	31,706,989.000	
	AU OPTRONICS CORP	727,194	12.450	9,053,565.300	
	TAIWAN MOBILE CO LTD	146,800	108.000	15,854,400.000	
	EVERGREEN MARINE CORP	198,276	12.000	2,379,312.000	

FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	275,824	29.350	8,095,434.400	
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	29,825	186.000	5,547,450.000	
ECLAT TEXTILE CO LTD	13,322	361.500	4,815,903.000	
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	51,285	145.000	7,436,325.000	
FORMOSA PLASTICS CORP	359,633	100.500	36,143,116.500	
FORMOSA TAFFETA CO LTD	61,000	34.750	2,119,750.000	
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE CO	283,594	107.000	30,344,558.000	
GIANT MANUFACTURING	30,151	159.000	4,794,009.000	
MEDIATEK INC	120,507	226.000	27,234,582.000	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD	529,936	46.900	24,853,998.400	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	634,232	17.950	11,384,464.400	
HOTAI MOTOR CO LTD	15,000	260.000	3,900,000.000	
FAR EASTONE TELECOMMUNICATIONS CO LTD	144,000	72.900	10,497,600.000	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	876,141	15.700	13,755,413.700	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	655,920	45.850	30,073,932.000	
CHINA DEPT FINANCIAL HOLDING	924,403	9.900	9,151,589.700	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO LTD	829,168	20.900	17,329,611.200	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	1,071,225	69.300	74,235,892.500	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LTD	934,495	26.100	24,390,319.500	
LARGAN PRECISION CO LTD	8,220	3,280.000	26,961,600.000	
TAISHIN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	843,589	13.350	11,261,913.150	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING CO	831,061	8.910	7,404,753.510	
INVENTEC CO LTD	206,005	22.500	4,635,112.500	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	145,845	42.950	6,264,042.750	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	893,443	10.400	9,291,807.200	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,381,048	20.200	27,897,169.600	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO LTD	844,220	20.200	17,053,244.000	
POWERTECH TECHNOLOGY INC	61,560	66.500	4,093,740.000	
NAN YA PLASTICS CORP	414,828	74.800	31,029,134.400	
WISTRON CORP	266,916	19.300	5,151,478.800	
POU CHEN CORP	183,990	34.450	6,338,455.500	

	UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CORP	413,297	70.500	29,137,438.500	
	PRESIDENT CHAIN STORE CORP	49,392	321.500	15,879,528.000	
	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	108,480	111.500	12,095,520.000	
	PHISON ELECTRONICS CORP	7,658	237.500	1,818,775.000	
	RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	54,393	47.000	2,556,471.000	
	RUENTEX INDUSTRIES LTD	20,829	82.700	1,722,558.300	
	FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	75,588	58.300	4,406,780.400	
	STANDARD FOODS CORP	34,639	51.100	1,770,052.900	
	SYNNEX TECHNOLOGY INTERNATIONAL CORP	113,899	37.200	4,237,042.800	
	TAIWAN CEMENT CORP	406,561	36.550	14,859,804.550	
	TATUNG CO LTD	100,000	25.850	2,585,000.000	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR	2,030,083	216.000	438,497,928.000	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	904,525	11.150	10,085,453.750	
	WINBOND ELECTRONICS CORP	241,000	13.650	3,289,650.000	
	YAGEO CORP	23,160	304.500	7,052,220.000	
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	156,000	30.850	4,812,600.000	
	INNOLUX CORPORATION	820,345	10.250	8,408,536.250	
	WPG HOLDINGS CO LTD	75,203	38.000	2,857,714.000	
	HIWIN TECHNOLOGIES CORP	19,073	217.000	4,138,841.000	
	TAIMED BIOLOGICS INC	18,000	175.500	3,159,000.000	
	PEGATRON CORP	143,554	48.500	6,962,369.000	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	9,000	315.000	2,835,000.000	
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	38,000	120.000	4,560,000.000	
	CHAILEASE HOLDING CO LTD	101,737	106.500	10,834,990.500	
	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING LTD	48,385	74.100	3,585,328.500	
	TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL HOLDING	742,412	18.100	13,437,657.200	
	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	294,903	57.000	16,809,471.000	
	GLOBALWAFERS CO LTD	21,000	292.000	6,132,000.000	
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	15,000	287.500	4,312,500.000	
	台湾・ドル 小計	26,750,696		1,376,817,229.260 (4,846,396,647)	
南アフリカ・ランド	BIDVEST GROUP LTD	29,572	200.490	5,928,890.280	
	CLICKS GROUP LTD	16,495	189.290	3,122,338.550	
	TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	36,909	91.000	3,358,719.000	
	DISCOVERY LTD	31,052	160.660	4,988,814.320	

REDEFINE PROPERTIES LTD	469,360	9.710	4,557,485.600	
GOLD FIELDS LTD	64,234	50.500	3,243,817.000	
REMGRO LTD	39,466	204.270	8,061,719.820	
THE FOSCHINI GROUP LTD	19,873	173.550	3,448,959.150	
MMI HOLDINGS LTD	30,301	16.900	512,086.900	
GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	260,960	23.800	6,210,848.000	
EXXARO RESOURCES LTD	19,195	134.200	2,575,969.000	
CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	3,704	1,141.000	4,226,264.000	
LIBERTY HOLDINGS LTD	7,234	105.300	761,740.200	
MTN GROUP LTD	145,185	86.560	12,567,213.600	
ANGLOGOLD ASHANTI LTD	38,047	177.250	6,743,830.750	
TELKOM SA SOC LTD	22,080	66.890	1,476,931.200	
FIRSTSTRAND LTD	269,420	67.990	18,317,865.800	
PSG GROUP LTD	12,431	242.000	3,008,302.000	
NASPERS LTD	36,084	2,954.160	106,597,909.440	
NEDBANK GROUP LTD	34,119	274.570	9,368,053.830	
NETCARE LTD	105,465	27.250	2,873,921.250	
PICK'N PAY STORES LTD	31,255	73.000	2,281,615.000	
RMB HOLDINGS LTD	61,174	79.720	4,876,791.280	
ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	5,042	545.000	2,747,890.000	
SAPPI LTD	34,752	76.700	2,665,478.400	
SASOL LTD	45,354	443.950	20,134,908.300	
SHOPRITE HOLDINGS LTD	37,476	189.930	7,117,816.680	
MR PRICE GROUP LTD	23,411	251.460	5,886,930.060	
STANDARD BANK GROUP LTD	103,115	183.750	18,947,381.250	
SPAR GROUP LTD/THE	16,512	202.250	3,339,552.000	
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	88,009	56.250	4,950,506.250	
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LTD	34,576	139.650	4,828,538.400	
ABSA GROUP LTD	54,711	167.460	9,161,904.060	
TIGER BRANDS LTD	13,510	270.180	3,650,131.800	
SANLAM LTD	153,496	81.790	12,554,437.840	
INVESTEC LTD	19,077	84.320	1,608,572.640	
KUMBA IRON ORE LTD	5,327	278.990	1,486,179.730	
MONDI LTD	10,866	316.220	3,436,046.520	
LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDINGS LTD	110,218	26.950	2,970,375.100	
RMI HOLDINGS	55,278	36.600	2,023,174.800	
VODACOM GROUP PTY LTD	50,576	131.340	6,642,651.840	
NEPI ROCKCASTLE PLC	32,983	113.680	3,749,507.440	
OLD MUTUAL LTD	423,449	22.840	9,671,575.160	
REINET INVESTMENTS SCA	13,993	207.640	2,905,506.520	
FORTRESS REIT LTD-A	102,950	18.400	1,894,280.000	
BID CORP LTD	24,891	265.000	6,596,115.000	
南アフリカ・ランド 小計	3,243,187		358,079,545.760 (2,803,762,843)	



合計	201,501,748		44,235,304,878 (44,235,304,878)	
----	-------------	--	------------------------------------	--

## (2) 株式以外の有価証券

平成31年1月11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	23,022.870		
	タイ・パーツ 小計		59,033.000	23,022.870 (78,278)		
新株予約権証券 合計			59,033	78,278 (78,278)		
投資信託受益証券	メキシコ・ペソ	CEMEX SAB DE CV	1,231,475.000	12,511,786.000		
		FOMENTO ECONOMICO MEXICANO SAB DE CV	155,200.000	27,634,912.000		
	メキシコ・ペソ 小計		1,386,675.000	40,146,698.000 (227,631,777)		
投資信託受益証券 合計			1,386,675	227,631,777 (227,631,777)		
投資証券	メキシコ・ペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	283,800.000	6,850,932.000		
	メキシコ・ペソ 小計		283,800.000	6,850,932.000 (38,844,785)		
	南アフリカ・ランド	FORTRESS REIT LTD-B		57,784.000	843,068.560	
		HYPROP INVESTMENTS LTD		22,174.000	1,906,742.260	
		RESILIENT REIT LTD		28,600.000	1,674,530.000	
	南アフリカ・ランド 小計		108,558.000	4,424,340.820 (34,642,588)		
投資証券 合計			392,358	73,487,373 (73,487,373)		
合計				301,197,428 (301,197,428)		

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 46銘柄	11.25%	-%	-%	-%	11.71%
アラブ首長国連邦・ディ ルハム	株式 9銘柄	0.64%	-%	-%	-%	0.67%
イギリス・ポンド	株式 1銘柄	0.03%	-%	-%	-%	0.03%
インド・ルピー	株式 79銘柄	8.67%	-%	-%	-%	9.02%
インドネシア・ルピア	株式 26銘柄	2.30%	-%	-%	-%	2.39%
オフショア・人民元	株式 73銘柄	0.70%	-%	-%	-%	0.73%
カタール・リアル	株式 10銘柄	1.06%	-%	-%	-%	1.11%
コロンビア・ペソ	株式 9銘柄	0.41%	-%	-%	-%	0.43%
タイ・バーツ	株式 36銘柄 新株予約 権証券 1銘柄	2.36% -%	-% 0.00%	-% -%	-% -%	2.46%
チェコ・コルナ	株式 3銘柄	0.17%	-%	-%	-%	0.18%
チリ・ペソ	株式 17銘柄	1.06%	-%	-%	-%	1.11%
トルコ・リラ	株式 19銘柄	0.57%	-%	-%	-%	0.59%
ハンガリー・フォリント	株式 3銘柄	0.31%	-%	-%	-%	0.32%
パキスタン・ルピー	株式 3銘柄	0.04%	-%	-%	-%	0.04%
フィリピン・ペソ	株式 23銘柄	1.11%	-%	-%	-%	1.16%
ブラジル・レアル	株式 53銘柄	7.75%	-%	-%	-%	8.07%
ポーランド・ズロチ	株式 20銘柄	1.21%	-%	-%	-%	1.25%
マレーシア・リンギット	株式 44銘柄	2.29%	-%	-%	-%	2.38%
メキシコ・ペソ	株式 23銘柄 投資信託 受益証券 2銘柄 投資証券 1銘柄	2.20% -% -%	-% -% -%	-% 0.49% -%	-% -% 0.08%	2.89%
ユーロ	株式 7銘柄	0.22%	-%	-%	-%	0.23%
韓国・ウォン	株式 114銘柄	12.95%	-%	-%	-%	13.48%
香港・ドル	株式 204銘柄	21.60%	-%	-%	-%	22.49%
台湾・ドル	株式 86銘柄	10.45%	-%	-%	-%	10.88%
南アフリカ・ランド	株式 46銘柄 投資証券 3銘柄	6.05% -%	-% -%	-% -%	-% 0.07%	6.37%

(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1月11日現在	平成31年1月11日現在
資産の部			
流動資産			
預金		2,451,465,696	16,123,382,089
コール・ローン		395,982,514	87,215,102
国債証券		98,971,707,355	107,326,775,455
派生商品評価勘定		-	145,000
未収入金		418,714,761	-
未収利息		1,507,428,223	820,451,685
前払費用		95,331,659	462,658,928
流動資産合計		103,840,630,208	124,820,628,259
資産合計		103,840,630,208	124,820,628,259
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		2,556,800	-
未払金		602,479,744	30,405,438,410
未払解約金		68,895,000	7,529,000
流動負債合計		673,931,544	30,412,967,410
負債合計		673,931,544	30,412,967,410
純資産の部			
元本等			
元本	1	54,256,447,518	52,757,465,400
剰余金			
剰余金又は欠損金( )		48,910,251,146	41,650,195,449
元本等合計		103,166,698,664	94,407,660,849
純資産合計		103,166,698,664	94,407,660,849
負債純資産合計		103,840,630,208	124,820,628,259

## 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1月11日現在	平成31年1月11日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	51,052,967,173円	54,256,447,518円
同期中追加設定元本額	13,271,200,418円	77,661,828,674円
同期中一部解約元本額	10,067,720,073円	79,160,810,792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）	231,736,287円	286,716,961円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	13,439,320円	128,371,531円
たわらノーロード バランス（堅実型）	185,533円	7,136,042円
たわらノーロード バランス（標準型）	578,044円	20,905,547円
たわらノーロード バランス（積極型）	658,928円	11,342,432円
たわらノーロード 最適化バランス（保守型）	- 円	142,739円
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	- 円	299,198円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	- 円	1,094,144円
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	- 円	341,158円
たわらノーロード 最適化バランス（積極型）	- 円	515,076円

マネックス資産設計ファンド エボリューション	75,944,530円	58,646,088円
DIAM DC 8資産バラン スファンド(新興国10)	27,320,395円	196,510,788円
DIAM DC 8資産バラン スファンド(新興国20)	90,077,700円	172,561,704円
DIAM DC 8資産バラン スファンド(新興国30)	200,732,596円	338,305,279円
投資のソムリエ	5,386,829,880円	4,780,199,975円
クルーズコントロール	1,391,418,497円	139,177,158円
投資のソムリエ<DC年金>	341,339,293円	436,204,954円
DIAM 8資産バランスファ ンドN<DC年金>	103,835,053円	143,653,316円
クルーズコントロール<DC年 金>	485,809円	89,225円
DIAMコア資産設計ファンド (堅実型)	6,404,568円	915,607円
DIAMコア資産設計ファンド (積極型)	14,622,181円	1,691,798円
投資のソムリエ<DC年金>リ スク抑制型	137,701,694円	199,792,522円
ダイナミック・ナビゲーション	188,968円	454,825円
リスク抑制世界8資産バラン スファンド	1,912,437,568円	3,446,924,591円
ワールドアセットバランス(基 本コース)	704,245,670円	1,129,715,395円
ワールドアセットバランス(リ スク抑制コース)	2,707,059,809円	2,262,347,925円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤ-2045)	802,092円	2,617,018円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤ-2055)	802,092円	2,029,113円
リスク抑制世界8資産バラン スファンド(DC)	641,925円	1,240,199円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤ-2035)	680,332円	4,146,714円
リスクコントロール世界資産分 散ファンド	-円	779,406,995円
9資産分散投資・スタンダード <DC年金>	-円	13,655円
エマージング債券リスク抑制型 (適格機関投資家限定)	12,745,371,625円	16,751,347,027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)	3,284,400,424円	2,044,980,656円
DIAM世界アセットバラン スファンド2VA(適格機関投資 家限定)	7,316,952,369円	4,245,286,325円
DIAM世界アセットバラン スファンド3VA(適格機関投資 家限定)	4,762,929,633円	4,605,400,717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)	4,695,478,120円	4,132,286,126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)	4,875,707,169円	2,192,663,196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)	3,225,439,414円	4,231,991,681円
	計	54,256,447,518円	52,757,465,400円
2 .	受益権の総数	54,256,447,518口	52,757,465,400口

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成29年6月23日 至 平成30年1月11日	自 平成30年1月12日 至 平成31年1月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左



## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成30年1月11日現在	平成31年1月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

(有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	平成30年1月11日現在	平成31年1月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
国債証券	248,212,144	432,798,496
合計	248,212,144	432,798,496

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成29年4月19日から平成30年1月11日まで及び平成30年4月19日から平成31年1月11日まで）に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

## 通貨関連

種類	平成30年1月11日 現在				平成31年1月11日 現在			
	契約額等	うち 1年超	時価	評価損益	契約額等	うち 1年超	時価	評価損益
	(円)		(円)	(円)	(円)		(円)	(円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	980,663,200	-	980,672,000	8,800	-	-	-	-
アメリカ・ドル	980,663,200	-	980,672,000	8,800	-	-	-	-
買 建	292,344,000	-	289,796,000	2,548,000	16,588,120,000	-	16,588,265,000	145,000
アメリカ・ドル	292,344,000	-	289,796,000	2,548,000	16,588,120,000	-	16,588,265,000	145,000
合計	1,273,007,200	-	1,270,468,000	2,556,800	16,588,120,000	-	16,588,265,000	145,000

(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1月11日現在	平成31年1月11日現在
1口当たり純資産額	1.9015円	1.7895円
(1万口当たり純資産額)	(19,015円)	(17,895円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

平成31年1月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	BRAZIL 2.625 01/05/23	8,200,000.000	7,818,782.000	
		BRAZIL 4.25 01/07/25	14,700,000.000	14,620,179.000	
		BRAZIL 4.625 01/13/28	11,800,000.000	11,584,650.000	
		BRAZIL 4.875 01/22/21	13,000,000.000	13,364,000.000	
		BRAZIL 5.0 01/27/45	14,400,000.000	12,839,328.000	
		BRAZIL 5.625 01/07/41	9,300,000.000	9,158,268.000	
		BRAZIL 5.625 02/21/47	10,200,000.000	9,834,126.000	
		BRAZIL 6.0 04/07/26	9,000,000.000	9,738,630.000	
		BRAZIL 7.125 01/20/37	8,700,000.000	10,005,000.000	
		BRAZIL 8.25 01/20/34	7,400,000.000	9,250,740.000	
		BRAZIL 8.75 02/04/25	6,400,000.000	7,857,600.000	
		COLOMBIA 2.625 03/15/23	5,900,000.000	5,633,733.000	
		COLOMBIA 3.875 04/25/27	11,400,000.000	11,140,194.000	
		COLOMBIA 4.0 02/26/24	10,700,000.000	10,750,932.000	
		COLOMBIA 4.375 07/12/21	10,000,000.000	10,237,500.000	
		COLOMBIA 4.5 01/28/26	6,400,000.000	6,539,968.000	
		COLOMBIA 5.0 06/15/45	18,800,000.000	18,687,388.000	
		COLOMBIA 5.625 02/26/44	11,000,000.000	11,836,110.000	
		COLOMBIA 6.125 01/18/41	9,400,000.000	10,575,000.000	
		COLOMBIA 7.375 09/18/37	7,800,000.000	9,787,128.000	
		COLOMBIA 8.125 05/21/24	3,100,000.000	3,684,815.000	
		CROATIA 5.5 04/04/23	10,000,000.000	10,601,000.000	
		CROATIA 6.0 01/26/24	7,800,000.000	8,515,260.000	
		CROATIA 6.375 03/24/21	9,500,000.000	10,006,350.000	
		CROATIA 6.625 07/14/20	12,400,000.000	12,947,212.000	
		HUNGARY 5.375 02/21/23	9,500,000.000	10,088,430.000	
		HUNGARY 5.375 03/25/24	10,000,000.000	10,734,000.000	
		HUNGARY 5.75 11/22/23	11,400,000.000	12,369,912.000	
		HUNGARY 6.375 03/29/21	14,200,000.000	15,012,950.000	
		HUNGARY 7.625 03/29/41	5,200,000.000	7,362,472.000	
		INDONESIA 2.95 01/11/23	3,800,000.000	3,669,166.000	
		INDONESIA 3.375 04/15/23	4,700,000.000	4,592,229.000	
		INDONESIA 3.5 01/11/28	3,000,000.000	2,833,170.000	
		INDONESIA 3.75 04/25/22	8,000,000.000	7,971,040.000	
		INDONESIA 3.85 07/18/27	2,600,000.000	2,510,326.000	
		INDONESIA 4.1 04/24/28	5,000,000.000	4,932,000.000	
INDONESIA 4.125 01/15/25	12,200,000.000	12,191,582.000			
INDONESIA 4.35 01/08/27	5,400,000.000	5,400,162.000			

INDONESIA 4.35 01/11/48	6,000,000.000	5,637,420.000	
INDONESIA 4.625 04/15/43	5,400,000.000	5,183,028.000	
INDONESIA 4.75 01/08/26	7,200,000.000	7,403,328.000	
INDONESIA 4.875 05/05/21	12,100,000.000	12,417,988.000	
INDONESIA 5.125 01/15/45	6,800,000.000	6,916,008.000	
INDONESIA 5.25 01/08/47	5,000,000.000	5,173,350.000	
INDONESIA 5.25 01/17/42	8,100,000.000	8,421,408.000	
INDONESIA 5.875 01/15/24	6,600,000.000	7,136,052.000	
INDONESIA 5.95 01/08/46	4,400,000.000	4,942,432.000	
INDONESIA 6.75 01/15/44	6,900,000.000	8,483,481.000	
INDONESIA 7.75 01/17/38	6,900,000.000	9,160,095.000	
PANAMA 3.75 03/16/25	8,200,000.000	8,220,500.000	
PANAMA 3.875 03/17/28	6,600,000.000	6,593,466.000	
PANAMA 4.5 04/16/50	8,800,000.000	8,583,784.000	
PANAMA 4.5 05/15/47	5,000,000.000	4,934,500.000	
PANAMA 6.7 01/26/36	10,400,000.000	12,875,200.000	
PANAMA 7.125 01/29/26	4,800,000.000	5,711,136.000	
PANAMA 9.375 04/01/29	4,900,000.000	6,915,125.000	
PERU 4.125 08/25/27	7,200,000.000	7,534,800.000	
PERU 5.625 11/18/50	14,400,000.000	17,191,584.000	
PERU 6.55 03/14/37	6,400,000.000	8,163,200.000	
PERU 7.35 07/21/25	12,000,000.000	14,643,000.000	
PHILIPPINES 3.0 02/01/28	6,400,000.000	6,105,344.000	
PHILIPPINES 3.7 02/02/42	6,200,000.000	5,968,926.000	
PHILIPPINES 3.7 03/01/41	6,600,000.000	6,374,214.000	
PHILIPPINES 3.95 01/20/40	6,800,000.000	6,803,808.000	
PHILIPPINES 4.0 01/15/21	7,400,000.000	7,477,182.000	
PHILIPPINES 4.2 01/21/24	6,000,000.000	6,218,340.000	
PHILIPPINES 5.0 01/13/37	4,800,000.000	5,406,816.000	
PHILIPPINES 5.5 03/30/26	3,600,000.000	4,043,412.000	
PHILIPPINES 6.375 01/15/32	3,600,000.000	4,480,344.000	
PHILIPPINES 6.375 10/23/34	6,400,000.000	8,131,968.000	
PHILIPPINES 7.75 01/14/31	6,500,000.000	8,846,630.000	
PHILIPPINES 9.5 02/02/30	6,800,000.000	10,141,656.000	

ROMANIA 4.375 08/22/23	9,400,000.000	9,512,706.000	
ROMANIA 4.875 01/22/24	6,600,000.000	6,831,330.000	
ROMANIA 6.125 01/22/44	5,800,000.000	6,496,522.000	
ROMANIA 6.75 02/07/22	14,300,000.000	15,419,547.000	
RUSSIA FOREIGN BOND 5.0 04/29/20	15,800,000.000	16,123,584.000	
RUSSIAN FEDERATION 03/31/30	14,815,500.000	16,327,718.080	
RUSSIAN FEDERATION 4.25 06/23/27	10,000,000.000	9,664,800.000	
RUSSIAN FEDERATION 4.375 03/21/29	5,800,000.000	5,622,172.000	
RUSSIAN FEDERATION 4.5 04/04/22	9,400,000.000	9,594,862.000	
RUSSIAN FEDERATION 4.75 05/27/26	11,400,000.000	11,501,118.000	
RUSSIAN FEDERATION 4.875 09/16/23	11,800,000.000	12,187,394.000	
RUSSIAN FEDERATION 5.25 06/23/47	26,200,000.000	25,302,650.000	
RUSSIAN FEDERATION 5.625 04/04/42	12,400,000.000	13,053,728.000	
RUSSIAN FEDERATION 5.875 09/16/43	4,800,000.000	5,211,360.000	
SOUTH AFRICA 4.3 10/12/28	8,800,000.000	8,004,744.000	
SOUTH AFRICA 4.665 01/17/24	6,500,000.000	6,454,760.000	
SOUTH AFRICA 4.875 04/14/26	5,800,000.000	5,625,420.000	
SOUTH AFRICA 5.0 10/12/46	3,800,000.000	3,309,192.000	
SOUTH AFRICA 5.375 07/24/44	3,800,000.000	3,432,996.000	
SOUTH AFRICA 5.5 03/09/20	7,200,000.000	7,328,592.000	
SOUTH AFRICA 5.65 09/27/47	4,800,000.000	4,416,960.000	
SOUTH AFRICA 5.875 05/30/22	4,000,000.000	4,172,960.000	
SOUTH AFRICA 5.875 06/22/30	5,800,000.000	5,809,802.000	
SOUTH AFRICA 5.875 09/16/25	9,200,000.000	9,500,196.000	
UNITED MEXICAN STATES 3.5 01/21/21	7,800,000.000	7,793,682.000	
UNITED MEXICAN STATES 3.6 01/30/25	9,600,000.000	9,288,000.000	
UNITED MEXICAN STATES 3.625 03/15/22	6,900,000.000	6,862,050.000	

	UNITED MEXICAN STATES 3.75 01/11/28	9,600,000.000	9,093,600.000	
	UNITED MEXICAN STATES 4.0 10/02/23	13,100,000.000	13,142,837.000	
	UNITED MEXICAN STATES 4.125 01/21/26	9,400,000.000	9,340,028.000	
	UNITED MEXICAN STATES 4.15 03/28/27	13,000,000.000	12,712,830.000	
	UNITED MEXICAN STATES 4.35 01/15/47	7,400,000.000	6,528,650.000	
	UNITED MEXICAN STATES 4.6 01/23/46	10,600,000.000	9,664,656.000	
	UNITED MEXICAN STATES 4.6 02/10/48	8,800,000.000	8,053,056.000	
	UNITED MEXICAN STATES 4.75 03/08/44	16,600,000.000	15,471,200.000	
	UNITED MEXICAN STATES 5.55 01/21/45	11,000,000.000	11,453,750.000	
	UNITED MEXICAN STATES 5.75 10/12/2110	9,600,000.000	9,252,000.000	
	UNITED MEXICAN STATES 6.05 01/11/40	12,300,000.000	13,312,905.000	
	UNITED MEXICAN STATES 6.75 09/27/34	6,600,000.000	7,665,240.000	
	アメリカ・ドル 小計	948,015,500.000 (102,831,241,285)	989,460,454.080 (107,326,775,455)	
国債証券	合計	102,831,241,285 (102,831,241,285)	107,326,775,455 (107,326,775,455)	
合計		102,831,241,285 (102,831,241,285)	107,326,775,455 (107,326,775,455)	

- (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 111銘柄	113.68%	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。

投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)

- (1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。
- なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間(平成31年1月12日から令和1年7月11日まで)の中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による中間監査を受けております。



## 【中間財務諸表】

## 【投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)】

## (1) 【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第2期 平成31年1月11日現在	第3期中間計算期間末 令和1年7月11日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	943,158	1,115,718
親投資信託受益証券	30,368,685	59,581,136
派生商品評価勘定	547,818	420,910
未収入金	280,000	-
流動資産合計	32,139,661	61,117,764
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	83,464	129,331
未払解約金	-	34,040
未払受託者報酬	4,295	7,116
未払委託者報酬	115,920	191,004
その他未払費用	478	818
流動負債合計	204,157	362,309
負債合計	204,157	362,309
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1 32,215,571	1 57,197,189
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )	2 280,067	2 3,558,266
(分配準備積立金)	723,092	654,390
元本等合計	31,935,504	60,755,455
純資産合計	31,935,504	60,755,455
負債純資産合計	32,139,661	61,117,764

## (2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第2期中間計算期間 自 平成30年1月12日 至 平成30年7月11日	第3期中間計算期間 自 平成31年1月12日 至 令和1年7月11日
<b>営業収益</b>		
有価証券売買等損益	275,026	2,972,451
為替差損益	170,341	338,281
営業収益合計	104,685	3,310,732
<b>営業費用</b>		
支払利息	50	328
受託者報酬	2,597	7,116
委託者報酬	70,732	191,004
その他費用	235	818
営業費用合計	73,614	199,266
営業利益又は営業損失( )	178,299	3,111,466
経常利益又は経常損失( )	178,299	3,111,466
中間純利益又は中間純損失( )	178,299	3,111,466
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額( )	18,832	133,223
期首剰余金又は期首欠損金( )	320,705	280,067
剰余金増加額又は欠損金減少額	174,219	860,090
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	8,157
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	174,219	851,933
剰余金減少額又は欠損金増加額	42,376	-
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	42,376	-
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金( )	293,081	3,558,266

## ( 3 ) 【中間注記表】

( 重要な会計方針に係る事項に関する注記 )

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

( 中間貸借対照表に関する注記 )

項目	第2期 平成31年1月11日現在	第3期中間計算期間末 令和1年7月11日現在
1 . 1 期首元本額 期中追加設定元本額 期中一部解約元本額	10,000,000円 24,073,563円 1,857,992円	32,215,571円 29,299,750円 4,318,132円
2 . 受益権の総数	32,215,571口	57,197,189口
3 . 2 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は280,067円であります。	

( 中間損益及び剰余金計算書に関する注記 )

該当事項はありません。

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	第2期 平成31年1月11日現在	第3期中間計算期間末 令和1年7月11日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

## （有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

## 通貨関連

種類	第2期 平成31年1月11日現在				第3期中間計算期間末 令和1年7月11日現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	15,151,484	-	14,632,058	519,426	32,793,427	-	32,423,196	370,231
アメリカ・ドル	-	-	-	-	8,722,880	-	8,687,874	35,006
イギリス・ポンド	6,118,472	-	5,865,425	253,047	9,166,681	-	8,894,186	272,495
オーストラリア・ドル	2,055,306	-	1,967,075	88,231	3,453,163	-	3,434,812	18,351
カナダ・ドル	937,209	-	931,608	5,601	3,418,152	-	3,450,172	32,020
ユーロ	6,040,497	-	5,867,950	172,547	8,032,551	-	7,956,152	76,399
買 建	4,548,177	-	4,493,105	55,072	10,806,279	-	10,727,627	78,652
アメリカ・ドル	-	-	-	-	1,474,154	-	1,476,723	2,569
イギリス・ポンド	1,145,201	-	1,117,881	27,320	2,606,266	-	2,568,230	38,036
オーストラリア・ドル	588,878	-	552,025	36,853	1,337,887	-	1,330,332	7,555
カナダ・ドル	144,915	-	138,924	5,991	728,046	-	734,606	6,560
ユーロ	2,669,183	-	2,684,275	15,092	4,659,926	-	4,617,736	42,190
合計	19,699,661	-	19,125,163	464,354	43,599,706	-	43,150,823	291,579

(注) 時価の算定方法

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

(1口当たり情報に関する注記)

	第2期 平成31年1月11日現在	第3期中間計算期間末 令和1年7月11日現在
1口当たり純資産額	0.9913円	1.0622円
(1万口当たり純資産額)	(9,913円)	(10,622円)

投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)

- (1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。
- なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間(平成31年1月12日から令和1年7月11日まで)の中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による中間監査を受けております。

## 【投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)】

## (1) 【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第2期 平成31年1月11日現在	第3期中間計算期間末 令和1年7月11日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	672,284	1,430,039
親投資信託受益証券	23,628,908	50,583,129
派生商品評価勘定	418,612	357,393
未収入金	140,000	-
流動資産合計	24,859,804	52,370,561
資産合計	24,859,804	52,370,561
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	63,503	114,352
未払受託者報酬	3,085	5,974
未払委託者報酬	83,314	160,469
その他未払費用	311	662
流動負債合計	150,213	281,457
負債合計	150,213	281,457
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	<sup>1</sup> 24,942,505	<sup>1</sup> 49,047,868
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )	<sup>2</sup> 232,914	<sup>2</sup> 3,041,236
(分配準備積立金)	496,827	486,878
元本等合計	24,709,591	52,089,104
純資産合計	24,709,591	52,089,104
負債純資産合計	24,859,804	52,370,561



## (2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第2期中間計算期間 自 平成30年1月12日 至 平成30年7月11日	第3期中間計算期間 自 平成31年1月12日 至 令和1年7月11日
<b>営業収益</b>		
有価証券売買等損益	509,737	2,444,221
為替差損益	164,075	312,989
営業収益合計	345,662	2,757,210
<b>営業費用</b>		
支払利息	36	213
受託者報酬	2,025	5,974
委託者報酬	55,118	160,469
その他費用	200	662
営業費用合計	57,379	167,318
営業利益又は営業損失( )	403,041	2,589,892
経常利益又は経常損失( )	403,041	2,589,892
中間純利益又は中間純損失( )	403,041	2,589,892
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額( )	246,846	21,201
期首剰余金又は期首欠損金( )	333,106	232,914
剰余金増加額又は欠損金減少額	257,488	705,459
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	1,029
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	257,488	704,430
剰余金減少額又は欠損金増加額	248,692	-
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	248,692	-
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金( )	185,707	3,041,236

## (3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第2期 平成31年1月11日現在	第3期中間計算期間末 令和1年7月11日現在
1. 1 期首元本額 期中追加設定元本額 期中一部解約元本額	10,371,948円 22,953,363円 8,382,806円	24,942,505円 24,824,686円 719,323円
2. 受益権の総数	24,942,505口	49,047,868口
3. 2 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は232,914円であります。	

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	第2期 平成31年1月11日現在	第3期中間計算期間末 令和1年7月11日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

## （有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

## 通貨関連

種類	第2期 平成31年1月11日現在				第3期中間計算期間末 令和1年7月11日現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	11,716,239	-	11,319,171	397,068	28,096,698	-	27,785,736	310,962
アメリカ・ドル	-	-	-	-	7,467,231	-	7,437,510	29,721
イギリス・ポンド	4,775,554	-	4,581,932	193,622	7,856,754	-	7,623,588	233,166
オーストラリア・ドル	1,599,770	-	1,531,675	68,095	2,961,321	-	2,946,272	15,049
カナダ・ドル	714,710	-	710,964	3,746	2,950,946	-	2,979,694	28,748
ユーロ	4,626,205	-	4,494,600	131,605	6,860,446	-	6,798,672	61,774
買 建	3,507,543	-	3,465,584	41,959	9,336,953	-	9,269,032	67,921
アメリカ・ドル	-	-	-	-	1,258,949	-	1,261,143	2,194
イギリス・ポンド	917,733	-	897,065	20,668	2,263,336	-	2,230,305	33,031
オーストラリア・ドル	464,356	-	435,400	28,956	1,164,038	-	1,157,464	6,574
カナダ・ドル	102,293	-	98,064	4,229	654,651	-	660,320	5,669
ユーロ	2,023,161	-	2,035,055	11,894	3,995,979	-	3,959,800	36,179
合計	15,223,782	-	14,784,755	355,109	37,433,651	-	37,054,768	243,041

(注) 時価の算定方法

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

(1口当たり情報に関する注記)

	第2期 平成31年1月11日現在	第3期中間計算期間末 令和1年7月11日現在
1口当たり純資産額	0.9907円	1.0620円
(1万口当たり純資産額)	(9,907円)	(10,620円)

（参考）

「投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2045）」、「投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2055）」は、「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」受益証券、「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「J-REITインデックスファンド・マザーファンド」受益証券、「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「エマージング株式パッシブ・マザーファンド」受益証券及び「エマージング債券パッシブ・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同親投資信託の受益証券であります。

同親投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」の状況

貸借対照表

（単位：円）

科 目	注記 番号	平成31年1月11日現在	令和1年7月11日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		5,292,310,851	4,913,037,006
株式	2	268,142,003,270	255,087,906,650
派生商品評価勘定		158,349,508	47,585,176
未収入金		82,010,000	-
未収配当金		407,430,514	381,583,415
流動資産合計		274,082,104,143	260,430,112,247
資産合計		274,082,104,143	260,430,112,247
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		9,175,220	3,251,664
前受金		123,755,000	17,787,000
未払金		8,034,485,480	-
未払解約金		53,755,000	834,484,000
流動負債合計		8,221,170,700	855,522,664
負債合計		8,221,170,700	855,522,664
純資産の部			
元本等			
元本	1	112,565,679,213	105,093,136,075
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		153,295,254,230	154,481,453,508
元本等合計		265,860,933,443	259,574,589,583
純資産合計		265,860,933,443	259,574,589,583
負債純資産合計		274,082,104,143	260,430,112,247

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

## （貸借対照表に関する注記）

項目	平成31年1月11日現在	令和1年7月11日現在
1 . 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	112,835,531,288円	112,565,679,213円
同期中追加設定元本額	36,549,394,271円	13,644,584,572円
同期中一部解約元本額	36,819,246,346円	21,117,127,710円
元本の内訳		
ファンド名		
DIAM DC 国内株式インデックスファンド	12,256,998,801円	13,241,614,465円
DIAM国内株式パッシブ・ファンド	2,386,874,810円	2,774,630,418円
MITO ラップ型ファンド（安定型）	3,886,220円	3,161,298円
MITO ラップ型ファンド（中立型）	8,201,981円	7,360,034円
MITO ラップ型ファンド（積極型）	13,986,982円	12,114,705円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	29,125,646円	30,269,764円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	22,563,437円	19,656,275円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	16,943,092円	14,847,701円
たわらノーロード TOPIX	382,451,857円	478,955,759円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	97,173,355円	186,918,049円
たわらノーロード バランス（堅実型）	2,768,469円	4,991,418円
たわらノーロード バランス（標準型）	18,790,896円	34,902,734円

たわらノーロード バランス (積極型)	37,831,498円	59,731,351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)	228,637円	382,921円
たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(安定型)	9,300,086円	19,982,981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)	31,294,481円	57,541,347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)	23,577,333円	44,360,292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)	60,955,847円	107,805,387円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(保守型)	74,040円	280,014円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定型)	174,817円	599,186円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定成長型)	1,095,745円	1,649,447円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(成長型)	691,039円	1,083,709円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(積極型)	2,411,837円	3,345,591円
D I A M国内株式インデックス ファンド< D C年金>	38,449,340,503円	37,799,529,212円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 1 安定型	930,601,954円	996,067,259円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 2 安定・成長型	3,152,850,618円	3,288,639,230円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 3 成長型	3,152,192,254円	3,386,203,253円
D I A M D C バランス3 0 インデックスファンド	353,322,394円	375,253,708円
D I A M D C バランス5 0 インデックスファンド	1,167,901,061円	1,225,800,108円
D I A M D C バランス7 0 インデックスファンド	1,104,473,614円	1,150,355,129円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型>	40,917,509円	41,914,007円
マネックス資産設計ファンド< 育成型>	1,083,076,227円	1,122,667,639円
マネックス資産設計ファンド エポリューション	25,501,335円	26,814,455円
D I A M D C 8 資産バラ ンスファンド(新興国1 0)	286,731,745円	315,726,619円
D I A M D C 8 資産バラ ンスファンド(新興国2 0)	194,305,090円	219,871,828円
D I A M D C 8 資産バラ ンスファンド(新興国3 0)	335,172,615円	380,568,614円
投資のソムリエ	2,176,455,324円	2,330,785,591円
クルーズコントロール	188,360,302円	278,945,492円
投資のソムリエ< D C年金>	199,016,808円	244,354,937円



D I A M 8 資産バランスファン ドN<DC年金>	222,726,425円	251,016,294円
4 資産分散投資・ハイクラス< DC年金>	270,071,033円	298,654,853円
クルーズコントロール<DC年 金>	120,118円	410,234円
D I A Mコア資産設計ファンド ( 堅実型 )	1,884,210円	3,430,634円
D I A Mコア資産設計ファンド ( 積極型 )	3,452,430円	5,047,482円
投資のソムリエ<DC年金>リ スク抑制型	27,709,254円	85,033,783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	474,143円	546,021円
投資のソムリエ( ターゲット・ イヤー2045 )	478,027,309円	1,166,155,599円
投資のソムリエ( ターゲット・ イヤー2055 )	1,678,361円	2,216,483円
リスク抑制世界8 資産バランス ファンド( DC )	1,302,352円	1,870,434円
投資のソムリエ( ターゲット・ イヤー2035 )	172,989円	605,890円
4 資産分散投資・スタンダード <DC年金>	2,584,094円	2,810,942円
リスクコントロール世界資産分 散ファンド	15,567,413円	21,934,983円
9 資産分散投資・スタンダード <DC年金>	140,293,071円	176,144,529円
投資のソムリエ( ターゲット・ イヤー2040 )	18,666円	35,296,598円
投資のソムリエ( ターゲット・ イヤー2050 )	- 円	375,930円
投資のソムリエ( ターゲット・ イヤー2060 )	- 円	375,930円
4 資産分散投資・ミドルクラス <DC年金>	- 円	375,930円
D I A Mワールドバランス25 VA( 適格機関投資家限定 )	- 円	125,361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 )	72,428,537円	70,055,528円
D I A Mグローバル・バランス ファンド25VA( 適格機関投 資家限定 )	24,452,480円	679,077,334円
D I A Mグローバル・バランス ファンド50VA( 適格機関投 資家限定 )	121,667,701円	109,413,294円
D I A M国際分散バランスファ ンド30VA( 適格機関投資家 限定 )	288,407,783円	272,840,706円
	15,671,232円	15,505,897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 )	66,509,812円	58,384,104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 )	17,420,446円	16,580,518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 )	14,049,764円	14,034,027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 )	31,643,366円	32,336,451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 )	57,429,940円	62,390,364円
D I A Mバランスファンド2 5 V A ( 適格機関投資家限定 )	1,088,244,722円	985,364,008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 )	1,015,093,457円	953,313,403円
D I A Mバランスファンド5 0 V A ( 適格機関投資家限定 )	2,796,988,287円	2,672,479,679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 )	199,320,662円	192,506,361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 )	54,728,686円	52,605,140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 )	585,876,895円	530,814,269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 )	387,173,977円	279,805,676円
D I A Mグローバル 私募ファ ンド ( 適格機関投資家向け )	10,313,671円	10,473,598円
D I A M世界バランスファンド 5 5 V A ( 適格機関投資家限 定 )	7,969,631円	3,389,647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 )	52,147,134円	43,136,239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 )	9,938,959,954円	4,733,197,994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 )	195,148,097円	63,068,248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 )	1,880,011,203円	904,582,818円

	D I A M世界アセットバランス ファンド3 V A ( 適格機関投資 家限定)	10,784,276,752円	6,878,405,259円
	D I A Mバランス3 0 V A ( 適 格機関投資家限定)	5,201,125円	5,084,371円
	D I A Mバランス5 0 V A ( 適 格機関投資家限定)	118,453円	307,690円
	D I A Mバランス7 0 V A ( 適 格機関投資家限定)	4,011,960円	294,829円
	D I A M世界アセットバランス ファンド4 V A ( 適格機関投資 家限定)	9,606,107,157円	9,392,319,338円
	D I A M世界バランス2 5 V A ( 適格機関投資家限定)	69,426,099円	64,552,277円
	D I A M国内バランス3 0 V A ( 適格機関投資家限定)	29,836,616円	26,242,103円
	D I A Mバランス2 0 V A ( 適 格機関投資家限定)	27,655,542円	27,057,655円
	D I A Mバランス4 0 V A ( 適 格機関投資家限定)	109,220円	111,785円
	D I A Mバランス6 0 V A ( 適 格機関投資家限定)	121,295円	125,891円
	D I A M世界アセットバランス ファンド7 V A ( 1 2 1 2 ) ( 適格機関投資家限定)	426,124,037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)	1,366,625,210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)	1,837,729,242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)	72,976,941円	72,976,941円
	計	112,565,679,213円	105,093,136,075円
2 .	受益権の総数	112,565,679,213口	105,093,136,075口
3 .	2 差入代用有価証券	株式 3,410,500,000円	株式 3,432,500,000円

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成31年1月11日現在	令和1年7月11日現在
1 . 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左

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

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

## 株式関連

種類	平成31年1月11日 現在				令和1年7月11日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
先物取引								
買 建	5,773,520,000	-	5,922,820,000	149,300,000	6,458,953,000	-	6,503,420,000	44,467,000
合計	5,773,520,000	-	5,922,820,000	149,300,000	6,458,953,000	-	6,503,420,000	44,467,000

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成31年1月11日現在	令和1年7月11日現在
1口当たり純資産額	2.3618円	2.4699円
(1万口当たり純資産額)	(23,618円)	(24,699円)

## 「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成31年1月11日現在	令和1年7月11日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		4,665,269,969	1,807,193,800
国債証券		249,079,246,900	225,834,094,600
地方債証券		22,258,855,068	21,713,988,270
特殊債券		18,733,640,508	18,040,308,421
社債券		14,924,593,070	13,159,474,160
未収利息		582,607,024	509,939,747
前払費用		30,975,267	20,060,046
流動資産合計		310,275,187,806	281,085,059,044
資産合計		310,275,187,806	281,085,059,044
負債の部			
流動負債			
未払解約金		4,426,743,000	1,466,133,000
流動負債合計		4,426,743,000	1,466,133,000
負債合計		4,426,743,000	1,466,133,000
純資産の部			
元本等			
元本	1	235,499,717,802	210,886,282,664
剰余金			
剰余金又は欠損金( )		70,348,727,004	68,732,643,380
元本等合計		305,848,444,806	279,618,926,044
純資産合計		305,848,444,806	279,618,926,044
負債純資産合計		310,275,187,806	281,085,059,044

## 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31年1月11日現在	令和1年7月11日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額 同期中追加設定元本額 同期中一部解約元本額	282,148,441,520円 107,335,270,578円 153,983,994,296円	235,499,717,802円 57,275,574,767円 81,889,009,905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	17,996,235,320円	19,637,666,236円
M I T O ラップ型ファンド（安定型）	108,081,600円	92,780,551円
M I T O ラップ型ファンド（中立型）	82,802,762円	78,080,655円
M I T O ラップ型ファンド（積極型）	25,181,286円	22,556,909円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	810,160,816円	888,494,976円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	227,772,315円	209,370,246円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	30,531,946円	27,618,876円
たわらノーロード 国内債券	5,300,114,866円	7,265,389,120円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	170,314,416円	333,194,981円
たわらノーロード バランス（堅実型）	43,778,367円	82,280,525円
たわらノーロード バランス（標準型）	79,403,926円	152,802,880円
たわらノーロード バランス（積極型）	13,097,187円	21,340,393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）	5,342,959円	8,812,844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）	97,570,005円	179,795,943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）	128,691,152円	216,450,718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）	33,191,904円	59,322,736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)	18,064,952円	17,407,298円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(保守型)	1,862,270円	5,696,187円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定型)	1,270,410円	3,359,862円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定成長型)	3,572,067円	4,528,075円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(成長型)	613,753円	805,182円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(積極型)	17,517円	17,517円
D I A M国内債券インデックス ファンド< D C年金>	12,967,075,063円	13,458,325,770円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 1 安定型	5,919,885,310円	6,225,337,779円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 2 安定・成長型	8,202,301,648円	8,584,327,097円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 3 成長型	3,408,620,510円	3,414,554,922円
D I A M D C バランス3 0 インデックスファンド	1,805,683,819円	1,779,642,841円
D I A M D C バランス5 0 インデックスファンド	1,999,358,879円	1,963,720,077円
D I A M D C バランス7 0 インデックスファンド	316,274,220円	303,597,011円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型>	87,494,470円	88,911,335円
マネックス資産設計ファンド< 育成型>	2,320,757,716円	2,380,276,474円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	2,827,451円	2,490,772円
D I A M D C 8資産バラ ンスファンド(新興国1 0)	3,136,906,696円	3,299,169,376円
D I A M D C 8資産バラ ンスファンド(新興国2 0)	750,943,777円	838,025,492円
D I A M D C 8資産バラ ンスファンド(新興国3 0)	161,069,244円	175,362,247円
投資のソムリエ	4,610,531,799円	5,820,503,576円
クルーズコントロール	397,524,317円	529,226,407円
投資のソムリエ< D C年金>	420,762,180円	609,876,331円
D I A M 8資産バランスファ ンドN< D C年金>	2,285,488,089円	2,636,179,699円
4資産分散投資・ハイクラス< D C年金>	281,787,055円	307,514,498円
クルーズコントロール< D C年 金>	255,346円	781,654円
D I A Mコア資産設計ファンド (堅実型)	1,255,528円	2,155,856円
D I A Mコア資産設計ファンド (積極型)	2,413,600円	3,200,970円
投資のソムリエ< D C年金>リ スク抑制型	451,953,189円	830,376,910円



ダイナミック・ナビゲーション	1,704,726円	1,742,663円
リスク抑制世界8資産バランス ファンド	7,797,597,987円	11,373,967,887円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2045)	1,679,916円	2,292,925円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2055)	1,314,061円	1,942,253円
リスク抑制世界8資産バランス ファンド(DC)	2,812,984円	5,904,395円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2035)	2,675,959円	4,053,835円
4資産分散投資・スタンダード <DC年金>	73,934,208円	105,996,882円
リスクコントロール世界資産分 散ファンド	1,592,435,784円	2,062,513,475円
9資産分散投資・スタンダード <DC年金>	290,676円	491,676,216円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2040)	-円	391,365円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2050)	-円	391,365円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2060)	-円	391,365円
4資産分散投資・ミドルクラス <DC年金>	-円	280,894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)	22,700,190,772円	7,853,561,008円
DIAMワールドバランス25 VA(適格機関投資家限定)	423,862,810円	421,257,916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	5,024,920,806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	2,533,463,372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	2,510,988,052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	2,526,463,436円
One収益追求型マルチアセッ ト戦略ファンドV(適格機関投 資家限定)	-円	2,507,144,354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)	260,162,439円	240,272,154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)	205,011,654円	199,571,069円

D I A M国際分散バランスファン ド30VA(適格機関投資家 限定)	65,148,400円	66,180,106円
D I A M国際分散バランスファン ド50VA(適格機関投資家 限定)	177,679,515円	160,293,442円
D I A M国内重視バランスファン ド30VA(適格機関投資家 限定)	77,562,193円	75,833,112円
D I A M国内重視バランスファン ド50VA(適格機関投資家 限定)	33,341,168円	34,227,268円
D I A M世界バランスファンド 40VA(適格機関投資家限 定)	84,548,966円	88,703,678円
D I A M世界バランスファンド 50VA(適格機関投資家限 定)	153,438,009円	171,156,082円
D I A Mバランスファンド25 VA(適格機関投資家限定)	5,165,098,735円	4,810,695,018円
D I A Mバランスファンド3 7.5VA(適格機関投資家限 定)	2,708,406,989円	2,617,310,614円
D I A Mバランスファンド50 VA(適格機関投資家限定)	4,973,738,654円	4,890,696,722円
D I A Mグローバル・アセッ ト・バランスVA(適格機関投 資家限定)	531,889,925円	528,183,732円
D I A Mグローバル・アセッ ト・バランスVA2(適格機関 投資家限定)	243,809,467円	240,648,790円
D I A M アクサ グローバ ル バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	3,132,650,273円	2,917,761,720円
D I A M世界アセットバランス ファンドVA(適格機関投資家 向け)	688,618,271円	512,115,704円
D I A Mグローバル 私募ファン ド(適格機関投資家向け)	194,752,933円	188,050,355円
D I A M世界バランスファンド 55VA(適格機関投資家限 定)	42,590,827円	18,621,766円
D I A M世界バランスファンド 35VA(適格機関投資家限 定)	75,249,648円	63,572,920円
D I A M世界アセットバランス ファンド2VA(適格機関投資 家限定)	47,134,774,807円	23,114,860,837円
D I A M世界アセットバランス ファンド40VA(適格機関投 資家限定)	346,165,294円	115,416,908円

D I A M世界アセットバランス ファンド25VA(適格機関投資 家限定)	6,693,326,830円	3,312,659,705円
D I A M世界アセットバランス ファンド3VA(適格機関投資 家限定)	25,584,090,821円	16,794,060,322円
D I A Mバランス30VA(適 格機関投資家限定)	74,330,112円	74,416,976円
D I A Mバランス50VA(適 格機関投資家限定)	529,804円	1,402,505円
D I A Mバランス70VA(適 格機関投資家限定)	7,143,275円	538,981円
D I A M世界アセットバランス ファンド4VA(適格機関投資 家限定)	28,504,043,744円	28,651,900,935円
D I A M世界バランス25VA (適格機関投資家限定)	405,780,698円	388,117,555円
D I A M国内バランス30VA (適格機関投資家限定)	123,848,735円	112,179,649円
D I A Mバランス20VA(適 格機関投資家限定)	494,147,950円	495,613,852円
D I A Mバランス40VA(適 格機関投資家限定)	685,633円	713,232円
D I A Mバランス60VA(適 格機関投資家限定)	360,438円	382,677円
計	235,499,717,802円	210,886,282,664円
2. 受益権の総数	235,499,717,802口	210,886,282,664口

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成31年1月11日現在	令和1年7月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

## （有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

## （デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

## （1口当たり情報に関する注記）

	平成31年1月11日現在	令和1年7月11日現在
1口当たり純資産額	1,2987円	1,3259円
（1万口当たり純資産額）	（12,987円）	（13,259円）

## 「J-REITインデックスファンド・マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

(単位:円)

科 目	注記 番号	平成31年1月11日現在	令和1年7月11日現在
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		2,314,167,249	683,809,435
投資証券		32,839,378,200	33,907,407,120
派生商品評価勘定		8,421,192	29,726,892
未収配当金		305,320,935	242,420,534
差入委託証拠金		10,492,092	10,667,592
流動資産合計		35,477,779,668	34,874,031,573
資産合計		35,477,779,668	34,874,031,573
負債の部			
流動負債			
前受金		2,980,692	25,514,892
未払金		1,776,310,520	-
未払解約金		31,354,000	80,757,000
流動負債合計		1,810,645,212	106,271,892
負債合計		1,810,645,212	106,271,892
純資産の部			
元本等			
元本	1	17,353,251,443	15,854,128,990
剰余金			
剰余金又は欠損金( )		16,313,883,013	18,913,630,691
元本等合計		33,667,134,456	34,767,759,681
純資産合計		33,667,134,456	34,767,759,681
負債純資産合計		35,477,779,668	34,874,031,573

## 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31年1月11日現在	令和1年7月11日現在
1 . 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	19,626,564,592円	17,353,251,443円
同期中追加設定元本額	18,392,838,806円	11,255,190,957円
同期中一部解約元本額	20,666,151,955円	12,754,313,410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	369,566円
MITO ラップ型ファンド（中立型）	1,005,641円	949,650円
MITO ラップ型ファンド（積極型）	2,030,344円	1,505,516円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	1,959,291円	3,537,928円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	2,803,635円	2,579,247円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	2,391,639円	1,844,313円
たわらノーロード 国内リート	1,829,589,442円	2,718,972,353円
たわらノーロード 国内リート<ラップ向け>	631,502,662円	636,631,408円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	120,157,449円	212,522,414円
たわらノーロード バランス（堅実型）	1,675,645円	2,850,792円
たわらノーロード バランス（標準型）	32,882,913円	57,055,728円
たわらノーロード バランス（積極型）	46,534,171円	68,323,953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)	13,535,312円	22,906,391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)	47,448,867円	73,286,247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)	28,598,521円	46,933,760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)	64,075,667円	101,768,845円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定型)	318,290円	858,806円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定成長型)	1,772,149円	2,234,182円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(成長型)	1,031,995円	1,319,941円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(積極型)	2,925,114円	3,468,733円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型>	13,878,394円	12,293,543円
マネックス資産設計ファンド< 育成型>	367,687,724円	329,108,574円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	2,800,682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	110,074,791円
D I A M D C 8資産 balan スファンド(新興国20)	97,972,560円	100,125,827円
D I A M D C 8資産 balan スファンド(新興国30)	193,573,200円	196,178,324円
投資のソムリエ	1,494,850,661円	2,112,926,947円
投資のソムリエ<DC年金>	136,466,780円	220,624,785円
D I A M 8資産 balan スファ ンドN<DC年金>	80,069,705円	86,375,207円
投資のソムリエ<DC年金>リ スク抑制型	26,060,325円	118,639,899円
ダイナミック・ナビゲーション	436,240円	462,781円
リスク抑制世界8資産 balan スファンド	454,608,007円	1,632,198,716円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2045)	818,404円	1,128,727円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2055)	637,800円	961,678円
リスク抑制世界8資産 balan スファンド(DC)	163,238円	849,414円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2035)	1,297,694円	1,737,424円
リスクコントロール世界資産分 散ファンド	170,175,871円	302,836,657円
9資産分散投資・スタンダード <DC年金>	8,057円	12,010,671円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2040)	-円	192,254円

投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2050)	- 円	192,254円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2060)	- 円	192,254円
Jリートインデックスファンド (DC)	6,898,990円	13,470,283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)	90,667,967円	88,865,089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)	814,638,139円	799,031,482円
DIAM J-REITイン デックスファンド(適格機関投 資家向け)	8,542,863,384円	4,098,901,168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)	62,731,397円	400,914,971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)	1,189,092,929円	1,234,686,291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)	645,375,859円	- 円
計	17,353,251,443円	15,854,128,990円
2. 受益権の総数	17,353,251,443口	15,854,128,990口



## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成31年1月11日現在	令和1年7月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

## （有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

## 不動産投信関連

種類	平成31年1月11日 現在				令和1年7月11日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引  不動産投信指数先物取引  買 建	620,883,900	-	629,343,000	8,459,100	668,725,200	-	698,490,000	29,764,800
合計	620,883,900	-	629,343,000	8,459,100	668,725,200	-	698,490,000	29,764,800

(注) 1. 時価の算定方法

不動産投信指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成31年1月11日現在	令和1年7月11日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.9401円 (19,401円)	2.1930円 (21,930円)

## 「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成31年1月11日現在	令和1年7月11日現在
資産の部			
流動資産			
預金		3,836,684,496	4,132,150,703
コール・ローン		101,330,406	567,754,814
株式		308,327,397,174	332,267,325,819
投資信託受益証券		765,582,162	865,749,246
投資証券		7,344,836,469	8,458,868,904
派生商品評価勘定		342,984,345	162,529,373
未収入金		2,935,713	319,406,147
未収配当金		399,646,537	383,660,059
差入委託証拠金		4,288,210,905	2,429,195,579
流動資産合計		325,409,608,207	349,586,640,644
資産合計		325,409,608,207	349,586,640,644
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		5,777,780	1,075,704
未払金		191,353,057	-
未払解約金		83,153,000	790,887,000
流動負債合計		280,283,837	791,962,704
負債合計		280,283,837	791,962,704
純資産の部			
元本等			
元本	1	101,086,948,774	94,603,893,162
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		224,042,375,596	254,190,784,778
元本等合計		325,129,324,370	348,794,677,940
純資産合計		325,129,324,370	348,794,677,940
負債純資産合計		325,409,608,207	349,586,640,644

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

## （貸借対照表に関する注記）

項目	平成31年1月11日現在	令和1年7月11日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	87,104,816,912円	101,086,948,774円
同期中追加設定元本額	41,186,554,316円	12,073,878,254円
同期中一部解約元本額	27,204,422,454円	18,556,933,866円
元本の内訳 ファンド名		

DIAM外国株式パッシブ・ ファンド	2,834,834,285円	2,964,146,781円
MITO ラップ型ファンド (安定型)	2,795,385円	2,836,367円
MITO ラップ型ファンド (中立型)	8,338,508円	7,276,686円
MITO ラップ型ファンド (積極型)	16,109,487円	11,121,382円
グローバル8資産ラップファン ド(安定型)	20,660,274円	27,163,269円
グローバル8資産ラップファン ド(中立型)	22,937,156円	19,438,991円
グローバル8資産ラップファン ド(積極型)	19,511,274円	13,616,730円
たわらノーロード 先進国株式	8,432,850,323円	9,896,682,450円
たわらノーロード 先進国株式 <ラップ向け>	423,862円	44,534,521円
たわらノーロード 先進国株式 <為替ヘッジあり>	1,113,800,589円	1,264,769,587円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	72,340,579円	124,628,369円
たわらノーロード バランス (堅実型)	5,902,698円	9,867,657円
たわらノーロード バランス (標準型)	53,764,222円	88,715,208円
たわらノーロード バランス (積極型)	86,792,047円	121,320,562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)	251,550円	383,014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)	22,507,488円	30,002,596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)	67,724,316円	82,425,238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)	45,651,641円	64,472,804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)	118,572,173円	152,265,791円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(保守型)	27,125円	75,164円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定型)	129,058円	302,405円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(安定成長型)	897,827円	1,008,660円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(成長型)	666,772円	728,904円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(積極型)	2,471,010円	2,571,388円
DIAM外国株式インデックス ファンド<DC年金>	40,302,652,318円	41,142,517,703円
One DC 先進国株式イン デックスファンド	- 円	85,562,920円

D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 1 安定型	177,126,536円	176,650,905円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 2 安定・成長型	921,869,976円	880,045,133円
D I A Mバランス・ファンド< D C年金> 3 成長型	1,083,135,794円	1,077,647,728円
D I A M D C バランス3 0 インデックスファンド	127,206,341円	126,384,378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	355,814,509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	310,681,226円
マネックス資産設計ファンド< 隔月分配型>	30,117,672円	29,668,261円
マネックス資産設計ファンド< 育成型>	797,590,298円	794,921,104円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	209,301,312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)	213,418,470円	212,887,825円
D I A M D C 8資産バラン スファンド(新興国2 0)	144,027,570円	147,316,450円
D I A M D C 8資産バラン スファンド(新興国3 0)	249,535,320円	255,675,336円
投資のソムリエ	678,676,729円	1,067,731,770円
クルーズコントロール	70,085,435円	95,795,914円
投資のソムリエ< D C年金>	62,512,430円	111,395,952円
D I A M 8資産バランスマ ンドN< D C年金>	167,809,740円	169,183,049円
4資産分散投資・ハイクラス< D C年金>	94,014,637円	95,388,259円
クルーズコントロール< D C年 金>	44,663円	140,577円
D I A Mコア資産設計ファンド (堅実型)	449,001円	794,546円
D I A Mコア資産設計ファンド (積極型)	844,676円	1,152,095円
投資のソムリエ< D C年金>リ スク抑制型	21,167,331円	46,660,190円
ダイナミック・ナビゲーション	343,259円	1,459,114円
リスク抑制世界8資産バラン スファンド	357,646,638円	640,465,965円
ワールドアセットバランス(基 本コース)	610,427,443円	511,168,457円
ワールドアセットバランス(リ スク抑制コース)	1,389,438,673円	2,025,496,386円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2 0 4 5)	1,012,100円	1,153,105円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2 0 5 5)	789,212円	982,574円
リスク抑制世界8資産バラン スファンド(D C)	128,251円	332,632円

投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2035)	806,566円	1,456,920円
4資産分散投資・スタンダード <DC年金>	5,789,621円	7,328,627円
リスクコントロール世界資産分 散ファンド	105,791,997円	118,508,997円
9資産分散投資・スタンダード <DC年金>	13,989円	23,534,028円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2040)	-円	199,351円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2050)	-円	199,351円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2060)	-円	199,351円
4資産分散投資・ミドルクラス <DC年金>	-円	41,872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)	90,254,658円	87,609,932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)	2,390,882,636円	2,342,036,018円
DIAM先進国株式パッシブ ファンド(適格機関投資家限 定)	12,402,698,618円	9,261,112,810円
外国株式パッシブ・ファンド2 (適格機関投資家限定)	206,183,273円	206,084,716円
DIAMワールドバランス25 VA(適格機関投資家限定)	22,840,539円	20,181,928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)	89,701,630円	73,664,706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)	212,654,359円	183,710,080円
DIAM国際分散バランスファ ンド30VA(適格機関投資家 限定)	11,554,549円	10,431,187円
DIAM国際分散バランスファ ンド50VA(適格機関投資家 限定)	73,589,651円	58,971,490円
DIAM国内重視バランスファ ンド30VA(適格機関投資家 限定)	6,413,299円	5,574,124円
DIAM国内重視バランスファ ンド50VA(適格機関投資家 限定)	6,903,870円	6,293,906円
DIAM世界バランスファンド 40VA(適格機関投資家限 定)	23,330,526円	21,752,437円
DIAM世界バランスファンド 50VA(適格機関投資家限 定)	63,541,976円	62,968,491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)	534,544,227円	442,026,146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)	654,815,220円	561,563,200円
D I A Mバランスファンド50 V A (適格機関投資家限定)	2,062,322,007円	1,799,290,175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)	756,981,970円	643,148,820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)	124,735,564円	105,761,230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)	865,106,063円	715,481,449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)	95,074,329円	62,774,978円
D I A Mグローバル 私募ファ ンド(適格機関投資家向け)	2,754,975円	2,754,975円
D I A M世界バランスファンド 55 V A (適格機関投資家限 定)	27,248,619円	10,225,561円
D I A M世界バランスファンド 35 V A (適格機関投資家限 定)	15,458,639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)	4,884,528,633円	2,125,221,429円
D I A M世界アセットバランス ファンド40 V A (適格機関投 資家限定)	144,037,122円	42,468,288円
D I A M世界アセットバランス ファンド25 V A (適格機関投 資家限定)	1,386,057,134円	609,147,808円
D I A M世界アセットバランス ファンド3 V A (適格機関投資 家限定)	5,298,403,339円	3,088,701,884円
D I A Mバランス30 V A (適 格機関投資家限定)	19,797,555円	17,123,800円
D I A Mバランス50 V A (適 格機関投資家限定)	355,559円	827,766円
D I A Mバランス70 V A (適 格機関投資家限定)	10,994,618円	726,238円
D I A M世界アセットバランス ファンド4 V A (適格機関投資 家限定)	7,082,295,609円	6,322,837,855円
D I A Mバランス20 V A (適 格機関投資家限定)	63,114,592円	54,693,394円
D I A Mバランス40 V A (適 格機関投資家限定)	246,843円	225,102円



	D I A Mバランス60VA(適 格機関投資家限定)	272,499円	253,969円
計		101,086,948,774円	94,603,893,162円
2.	受益権の総数	101,086,948,774口	94,603,893,162口

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成31年1月11日現在	令和1年7月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

## （有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

## 通貨関連

種類	平成31年1月11日 現在				令和1年7月11日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	-	-	-	-	256,120,109	-	254,611,530	1,508,579
アメリカ・ドル	-	-	-	-	178,532,172	-	177,215,220	1,316,952
イギリス・ポンド	-	-	-	-	15,067,362	-	15,026,070	41,292
オーストラリア・ドル	-	-	-	-	7,019,826	-	7,005,690	14,136
カナダ・ドル	-	-	-	-	9,461,886	-	9,434,640	27,246
ユーロ	-	-	-	-	46,038,863	-	45,929,910	108,953
買 建	3,879,788,937	-	3,879,951,050	162,113	1,089,597,401	-	1,089,651,660	54,259
アメリカ・ドル	2,662,040,379	-	2,662,064,930	24,551	757,401,784	-	757,438,190	36,406
イギリス・ポンド	262,145,481	-	262,165,400	19,919	70,795,424	-	70,798,510	3,086
オーストラリア・ドル	105,725,286	-	105,727,320	2,034	30,731,947	-	30,734,640	2,693
カナダ・ドル	143,511,225	-	143,523,840	12,615	35,756,726	-	35,752,320	4,406
ユーロ	706,366,566	-	706,469,560	102,994	194,911,520	-	194,928,000	16,480
合計	3,879,788,937	-	3,879,951,050	162,113	1,345,717,510	-	1,344,263,190	1,562,838

(注) 時価の算定方法

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

## 株式関連

種類	平成31年1月11日 現在				令和1年7月11日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
先物取引								
買 建	12,045,683,104	-	12,382,727,556	337,044,452	8,005,900,615	-	8,165,791,446	159,890,831
合計	12,045,683,104	-	12,382,727,556	337,044,452	8,005,900,615	-	8,165,791,446	159,890,831

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成31年1月11日現在	令和1年7月11日現在
1口当たり純資産額	3.2163円	3.6869円
(1万口当たり純資産額)	(32,163円)	(36,869円)

## 「外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

（単位：円）

科 目	注記 番号	平成31年1月11日現在	令和1年7月11日現在
資産の部			
流動資産			
預金		732,549,513	108,765,282
コール・ローン		78,368,735	94,986,583
投資信託受益証券		4,104,663,329	5,197,203,423
投資証券		40,893,156,516	42,576,203,812
派生商品評価勘定		254,365	-
未収配当金		175,364,522	197,680,479
流動資産合計		45,984,356,980	48,174,839,579
資産合計		45,984,356,980	48,174,839,579
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		48,620	750
未払金		7,488,749,372	-
未払解約金		27,776,000	72,069,000
流動負債合計		7,516,573,992	72,069,750
負債合計		7,516,573,992	72,069,750
純資産の部			
元本等			
元本	1	33,176,902,219	36,007,799,513
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		5,290,880,769	12,094,970,316
元本等合計		38,467,782,988	48,102,769,829
純資産合計		38,467,782,988	48,102,769,829
負債純資産合計		45,984,356,980	48,174,839,579

## 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31年1月11日現在	令和1年7月11日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	46,402,765,697円	33,176,902,219円
同期中追加設定元本額	46,019,259,577円	21,870,955,742円
同期中一部解約元本額	59,245,123,055円	19,040,058,448円
元本の内訳		
ファンド名		
D I A M先進国RE I Tインデックスファンド<為替ヘッジなし>（ファンドラップ）	250,874,408円	159,817,761円
D I A M先進国RE I Tインデックスファンド<為替ヘッジあり>（ファンドラップ）	91,252,071円	95,189,351円
M I T O ラップ型ファンド（安定型）	4,172,228円	5,718,776円
M I T O ラップ型ファンド（中立型）	15,919,954円	14,621,134円
M I T O ラップ型ファンド（積極型）	31,826,259円	22,970,643円

グローバル8資産ラップファンド(安定型)	30,843,640円	54,761,483円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	43,636,068円	39,196,988円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	38,541,149円	27,781,742円
たわらノーロード 先進国リート	3,063,958,957円	3,952,481,677円
たわらノーロード 先進国リート<ラップ向け>	616,803,762円	604,995,933円
たわらノーロード 先進国リート<為替ヘッジあり>	150,639,471円	157,835,253円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	201,222,909円	347,572,459円
たわらノーロード バランス(堅実型)	1,439,001円	2,311,743円
たわらノーロード バランス(標準型)	27,934,331円	46,940,958円
たわらノーロード バランス(積極型)	72,665,658円	103,837,951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)	7,556,297円	18,923,298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)	55,627,064円	96,870,840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)	47,896,710円	84,009,452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)	140,337,863円	216,191,988円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	296,229円	567,549円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	1,978,581円	1,987,715円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	1,511,910円	1,667,534円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	5,171,309円	5,429,553円
One DC 先進国リートインデックスファンド	- 円	771,846円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	22,837,296円	19,510,171円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	604,119,097円	522,158,857円
マネックス資産設計ファンドエボリューション	52,317,354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	176,778,690円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	153,844,071円	164,672,695円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	305,200,295円	324,075,249円
投資のソムリエ	5,091,609,781円	8,428,116,435円
投資のソムリエ<DC年金>	465,395,016円	884,073,093円

DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	133,586,692円	142,655,966円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	119,937,911円	263,879,427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	695,215円 2,064,821,221円	758,378円 3,627,808,356円
ワールドアセットバランス(基本 コース)	1,107,749,531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)	2,627,039,919円	3,679,207,636円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2045)	2,773,084円	4,608,063円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2055)	2,168,352円	3,977,720円
リスク抑制世界8資産バランス ファンド(DC)	740,407円	1,884,146円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2035)	4,412,949円	7,763,761円
リスクコントロール世界資産分 散ファンド	379,757,137円	650,236,523円
9資産分散投資・スタンダード <DC年金>	12,333円	19,533,790円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2040)	-円	801,699円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2050)	-円	801,699円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤー2060)	-円	801,699円
DIAMパッシブ資産分散ファ ンド	1,063,616,864円	834,894,408円
DIAM外国リートインデック スファンド<DC年金>	33,855,546円	46,193,240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)	524,032,259円	352,626,090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)	6,722,401,410円	2,989,019,140円
DIAMグローバル・リスク ファクター・パリティ戦略ファ ンド(適格機関投資家限定)	1,664,252,242円	1,762,493,192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)	923,299,332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)	3,461,256,521円	3,461,256,521円



	D I A M海外リートインデックスファンド(適格機関投資家限定)	558,597,232円	557,838,959円
計		33,176,902,219円	36,007,799,513円
2 .	受益権の総数	33,176,902,219口	36,007,799,513口

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成31年1月11日現在	令和1年7月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

## （有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

## 通貨関連

種類	平成31年1月11日 現在				令和1年7月11日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	-	-	-	-	30,456,750	-	30,457,500	750
ユーロ	-	-	-	-	30,456,750	-	30,457,500	750
買 建	7,968,937,355	-	7,969,143,100	205,745	-	-	-	-
アメリカ・ドル	5,746,737,000	-	5,746,790,000	53,000	-	-	-	-
イギリス・ポンド	433,915,030	-	433,948,000	32,970	-	-	-	-
オーストラリア・ドル	561,373,200	-	561,384,000	10,800	-	-	-	-
カナダ・ドル	152,357,808	-	152,371,200	13,392	-	-	-	-
シンガポール・ドル	291,246,153	-	291,307,500	61,347	-	-	-	-
ニュージーランド・ドル	37,522,842	-	37,525,800	2,958	-	-	-	-
ユーロ	547,967,702	-	548,047,600	79,898	-	-	-	-
香港・ドル	197,817,620	-	197,769,000	48,620	-	-	-	-
合計	7,968,937,355	-	7,969,143,100	205,745	30,456,750	-	30,457,500	750

(注) 時価の算定方法

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

(1口当たり情報に関する注記)

	平成31年1月11日現在	令和1年7月11日現在
1口当たり純資産額	1.1595円	1.3359円
(1万口当たり純資産額)	(11,595円)	(13,359円)

## 「為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

(単位:円)

科 目	注記 番号	平成31年1月11日現在	令和1年7月11日現在
資産の部			
流動資産			
預金		4,957,421,720	7,731,878,129
コール・ローン		23,058,949,456	1,670,030,701
国債証券		280,518,393,946	467,069,286,065
派生商品評価勘定		2,289,344,712	1,708,293,283
未収入金		125,047,606	213,500
未収利息		1,896,026,464	2,443,431,382
前払費用		350,541,979	865,582,602
流動資産合計		313,195,725,883	481,488,715,662
資産合計		313,195,725,883	481,488,715,662
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		268,565,372	1,175,269,130
未払金		9,774,476	23,809,229,010
未払解約金		20,751,274,000	1,260,714,000
流動負債合計		21,029,613,848	26,245,212,140
負債合計		21,029,613,848	26,245,212,140
純資産の部			
元本等			
元本	1	219,411,521,246	326,527,873,375
剰余金			
剰余金又は欠損金( )		72,754,590,789	128,715,630,147
元本等合計		292,166,112,035	455,243,503,522
純資産合計		292,166,112,035	455,243,503,522
負債純資産合計		313,195,725,883	481,488,715,662

## 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31年1月11日現在	令和1年7月11日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	199,035,898,706円	219,411,521,246円
同期中追加設定元本額	192,648,894,792円	186,626,541,454円
同期中一部解約元本額	172,273,272,252円	79,510,189,325円
元本の内訳		
ファンド名		
たわらノーロード 先進国債券 <為替ヘッジあり>	2,541,588,844円	3,320,644,812円
たわらノーロード バランス (堅実型)	39,692,572円	72,601,718円
たわらノーロード バランス (標準型)	108,015,715円	202,342,697円
たわらノーロード バランス (積極型)	66,384,511円	105,348,499円
たわらノーロード スマートグ ローバルバランス(保守型)	3,171,241円	5,319,848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)	96,614,108円	168,310,066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)	155,789,675円	245,110,347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)	51,031,337円	83,248,055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)	42,217,203円	55,253,893円
たわらノーロード 最適化バラ ンス(保守型)	994,940円	3,030,184円

たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	1,565,962円	4,048,170円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	5,270,118円	6,532,693円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	1,564,742円	2,006,400円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	1,484,463円	2,054,025円
投資のソムリエ	39,714,410,033円	44,230,594,862円
投資のソムリエ<DC年金>	3,625,824,284円	4,636,948,677円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	3,099,194,888円	3,728,368,340円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	53,514,646,349円	51,083,212,012円
ワールドアセットバランス(基本コース)	4,716,820,251円	4,017,498,565円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	9,389,872,068円	15,566,807,831円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	8,138,115円	16,984,978円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	6,322,250円	14,404,244円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	19,290,361円	26,521,578円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	14,912,929円	33,748,559円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	7,479,169,253円	9,284,421,801円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	283,833円	466,703,474円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	-円	2,893,437円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	-円	2,893,437円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	-円	2,893,437円
外国債券パッシブファンド2(為替フルヘッジ)(適格機関投資家限定)	8,814,294,746円	20,017,239,587円
先進国債券パッシブファンド(為替ヘッジあり)(適格機関投資家限定)	-円	104,723,508,804円
DIAM世界アセットバランスファンド2VA(適格機関投資家限定)	11,469,553,596円	5,500,148,576円
DIAM世界アセットバランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	336,916,667円	109,919,380円
DIAM世界アセットバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	6,517,289,100円	3,155,143,208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)	31,138,685,642円	19,989,868,430円
D I A Mバランス3 0 V A ( 適 格機関投資家限定)	27,119,601円	26,548,311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)	27,754,379,971円	27,288,422,062円
D I A Mバランス2 0 V A ( 適 格機関投資家限定)	144,225,620円	141,345,491円
D I A M世界アセットバランス ファンド7 V A ( 1 2 1 2 ) ( 適格機関投資家限定)	2,343,618,618円	2,242,319,606円
D I A M世界アセットバランス ファンド7 V A ( 1 3 0 3 ) ( 適格機関投資家限定)	2,597,230,650円	2,392,050,786円
D I A M世界アセットバランス ファンド7 V A ( 1 3 0 6 ) ( 適格機関投資家限定)	3,430,389,721円	3,166,832,839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)	133,547,269円	383,779,656円
計	219,411,521,246円	326,527,873,375円
2 . 受益権の総数	219,411,521,246口	326,527,873,375口



## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成31年1月11日現在	令和1年7月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

## （有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

## 通貨関連

種類	平成31年1月11日 現在				令和1年7月11日 現在			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	289,674,664,755	-	287,653,885,415	2,020,779,340	478,872,727,323	-	478,339,173,359	533,553,964
アメリカ・ドル	133,657,561,192	-	132,183,683,808	1,473,877,384	227,101,617,774	-	228,153,987,483	1,052,369,709
イギリス・ポンド	19,317,818,398	-	19,106,991,220	210,827,178	30,889,415,315	-	30,524,827,552	364,587,763
オーストラリア・ドル	6,040,012,262	-	6,099,661,404	59,649,142	9,104,320,322	-	9,074,192,292	30,128,030
カナダ・ドル	5,714,264,994	-	5,828,708,889	114,443,895	8,660,647,577	-	8,698,590,165	37,942,588
シンガポール・ドル	962,746,989	-	959,997,465	2,749,524	1,617,712,293	-	1,620,065,766	2,353,473
スウェーデン・クローナ	887,609,818	-	874,149,776	13,460,042	1,246,144,289	-	1,234,203,000	11,941,289
デンマーク・クローネ	1,463,445,147	-	1,455,410,792	8,034,355	1,836,756,216	-	1,822,981,536	13,774,680
ローネノル	548,344,045	-	553,550,364	5,206,319	769,832,175	-	768,882,240	949,935
ポーランド・ズロチ	1,589,414,495	-	1,580,888,600	8,525,895	2,804,118,513	-	2,774,225,817	29,892,696
マレーシア・リンギット	1,101,256,326	-	1,106,796,600	5,540,274	1,086,761,862	-	1,095,892,200	9,130,338
メキシコ・ペソ	2,203,784,314	-	2,244,366,283	40,581,969	3,336,320,408	-	3,371,492,514	35,172,106
ユーロ	114,562,437,906	-	113,990,567,572	571,870,334	187,754,785,393	-	186,503,065,644	1,251,719,749
南アフリカ・ランド	1,625,968,869	-	1,669,112,642	43,143,773	2,664,295,186	-	2,696,767,150	32,471,964
買 建	-	-	-	-	25,098,420,000	-	25,097,890,189	529,811
アメリカ・ドル	-	-	-	-	12,469,830,000	-	12,469,253,520	576,480

イギリス・ボンド	-	-	-	-	1,958,040,000	-	1,957,938,740	101,260
ユーロ南アフリカ・ランド	-	-	-	-	10,172,560,000	-	10,172,643,498	83,498
	-	-	-	-	497,990,000	-	498,054,431	64,431
合計	289,674,664,755	-	287,653,885,415	2,020,779,340	503,971,147,323	-	503,437,063,548	533,024,153

## (注) 時価の算定方法

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

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

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

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

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

## (1口当たり情報に関する注記)

	平成31年1月11日現在	令和1年7月11日現在
1口当たり純資産額	1.3316円	1.3942円
(1万口当たり純資産額)	(13,316円)	(13,942円)

## 「エマージング株式パッシブ・マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成31年1月11日現在	令和1年7月11日現在
資産の部			
流動資産			
預金		1,299,271,008	3,105,393,841
コール・ローン		32,772,864	218,968,236
株式		44,235,304,878	52,334,255,994
新株予約権証券		78,278	617,207
投資信託受益証券		227,631,777	1,004,971,646
投資証券		73,487,373	36,607,477
派生商品評価勘定		93,745,445	179,670,587
未収入金		1,309,313	4,347,738
未収配当金		40,348,430	329,230,187
差入委託証拠金		368,721,191	1,969,297,009
流動資産合計		46,372,670,557	59,183,359,922
資産合計		46,372,670,557	59,183,359,922
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		-	13,230,614
未払金		4,923	294,711
未払解約金		7,564,000	257,123,000
流動負債合計		7,568,923	270,648,325
負債合計		7,568,923	270,648,325
純資産の部			
元本等			
元本	1	43,032,611,492	51,431,852,236
剰余金			
剰余金又は欠損金( )		3,332,490,142	7,480,859,361
元本等合計		46,365,101,634	58,912,711,597
純資産合計		46,365,101,634	58,912,711,597
負債純資産合計		46,372,670,557	59,183,359,922

## 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31年1月11日現在	令和1年7月11日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	47,332,729,770円	43,032,611,492円
同期中追加設定元本額	37,708,746,421円	27,785,967,336円
同期中一部解約元本額	42,008,864,699円	19,386,726,592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 >	4,229,653,765円	5,170,590,841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)	538,952,510円	497,859,715円
M I T O ラップ型ファンド (安定型)	5,084,297円	3,158,076円
M I T O ラップ型ファンド (中立型)	13,283,178円	10,613,946円
M I T O ラップ型ファンド (積極型)	16,008,746円	13,371,757円
グローバル8資産ラップファンド (安定型)	38,106,625円	30,235,294円
グローバル8資産ラップファンド (中立型)	36,541,116円	28,262,517円
グローバル8資産ラップファンド (積極型)	19,391,290円	16,377,733円
たわらノーロード 新興国株式	4,503,768,120円	5,059,076,925円
たわらノーロード 新興国株式<ラップ向け>	1,937,088,275円	1,840,804,377円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	218,593,721円	402,034,527円
たわらノーロード バランス (堅実型)	1,544,922円	2,683,701円
たわらノーロード バランス (標準型)	5,991,440円	10,724,323円
たわらノーロード バランス (積極型)	12,990,571円	19,764,969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)	125,758円	202,871円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定型)	8,172,737円	14,168,351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)	25,788,023円	40,798,655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)	17,269,961円	29,032,717円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (積極型)	53,574,501円	67,446,053円
たわらノーロード 最適化バランス (安定型)	63,713円	158,353円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	534,057円	635,540円

たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	349,997円	286,853円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	1,177,612円	1,015,862円
One DC 新興国株式インデックスファンド	- 円	870,210円
マネックス資産設計ファンドエボリューション	447,212,307円	453,215,866円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	323,578,911円	344,918,448円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	283,538,394円	315,334,332円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	560,502,321円	611,668,322円
投資のソムリエ	1,125,613,712円	10,528,057,901円
クルーズコントロール	229,645,946円	285,779,318円
投資のソムリエ<DC年金>	103,543,744円	1,102,974,789円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	244,460,621円	268,921,823円
クルーズコントロール<DC年金>	147,820円	423,564円
DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)	3,790,466円	5,932,519円
DIAMコア資産設計ファンド(積極型)	7,033,164円	8,687,072円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	62,324,346円	364,370,602円
ダイナミック・ナビゲーション	1,288,060円	580,633円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	1,075,304,118円	4,994,315,586円
ワールドアセットバランス(基本コース)	1,879,064,959円	1,582,552,604円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	3,890,272,267円	6,277,274,398円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	598,449円	4,729,353円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	470,297円	3,993,071円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	389,308円	2,597,497円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	947,979円	8,849,610円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	313,785,870円	918,834,779円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	20,870円	37,958,281円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	- 円	812,459円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	- 円	812,459円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	- 円	812,459円

	エマージング株式パッシブファンドV A ( 適格機関投資家専用 )	3,535,043,726円	1,834,300,137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 )	2,125,194,681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 )	7,261,569,827円	3,347,895,346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 )	7,873,214,394円	4,865,074,842円
	計	43,032,611,492円	51,431,852,236円
2 .	受益権の総数	43,032,611,492口	51,431,852,236口



## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成31年1月11日現在	令和1年7月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

## （有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

## 通貨関連

種類	平成31年1月11日 現在				令和1年7月11日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	-	-	-	-	68,448,232	-	67,943,320	504,912
アメリカ・ドル	-	-	-	-	68,448,232	-	67,943,320	504,912
買 建	3,084,805,050	-	3,084,833,500	28,450	1,103,223,627	-	1,103,213,430	10,197
アメリカ・ドル	3,084,805,050	-	3,084,833,500	28,450	1,103,223,627	-	1,103,213,430	10,197
合計	3,084,805,050	-	3,084,833,500	28,450	1,171,671,859	-	1,171,156,750	494,715

(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31年1月11日 現在				令和1年7月11日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
先物取引								
買 建	4,803,549,477	-	4,897,266,472	93,716,995	6,435,879,906	-	6,601,825,164	165,945,258
合計	4,803,549,477	-	4,897,266,472	93,716,995	6,435,879,906	-	6,601,825,164	165,945,258

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	平成31年1月11日現在	令和1年7月11日現在
1口当たり純資産額	1.0774円	1.1455円
(1万口当たり純資産額)	(10,774円)	(11,455円)

## 「エマージング債券パッシブ・マザーファンド」の状況

## 貸借対照表

(単位：円)

科 目	注記 番号	平成31年1月11日現在	令和1年7月11日現在
資産の部			
流動資産			
預金		16,123,382,089	1,275,861,569
コール・ローン		87,215,102	210,080,076
国債証券		107,326,775,455	88,286,521,432
派生商品評価勘定		145,000	-
未収利息		820,451,685	1,014,850,998
前払費用		462,658,928	297,082,178
流動資産合計		124,820,628,259	91,084,396,253
資産合計		124,820,628,259	91,084,396,253
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		-	20,000
未払金		30,405,438,410	-
未払解約金		7,529,000	273,007,000
流動負債合計		30,412,967,410	273,027,000
負債合計		30,412,967,410	273,027,000
純資産の部			
元本等			
元本	1	52,757,465,400	46,374,799,702
剰余金			
剰余金又は欠損金( )		41,650,195,449	44,436,569,551
元本等合計		94,407,660,849	90,811,369,253
純資産合計		94,407,660,849	90,811,369,253
負債純資産合計		124,820,628,259	91,084,396,253

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</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31年1月11日現在	令和1年7月11日現在
1. 1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	54,256,447,518円	52,757,465,400円
同期中追加設定元本額	77,661,828,674円	31,334,577,861円
同期中一部解約元本額	79,160,810,792円	37,717,243,559円
元本の内訳		
ファンド名		
DIAM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）	286,716,961円	247,854,333円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	128,371,531円	234,562,608円
たわらノーロード バランス（堅実型）	7,136,042円	12,529,425円
たわらノーロード バランス（標準型）	20,905,547円	37,570,824円
たわらノーロード バランス（積極型）	11,342,432円	17,339,030円
たわらノーロード 最適化バランス（保守型）	142,739円	419,818円
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	299,198円	654,370円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	1,094,144円	1,308,912円
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	341,158円	421,792円
たわらノーロード 最適化バランス（積極型）	515,076円	595,683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	182,270,176円
DIAM DC 8資産バラン スファンド(新興国30)	338,305,279円	358,988,375円
投資のソムリエ	4,780,199,975円	9,791,719,622円
クルーズコントロール	139,177,158円	183,260,238円
投資のソムリエ<DC年金>	436,204,954円	1,026,593,590円
DIAM 8資産バランスファ ンドN<DC年金>	143,653,316円	156,920,625円
クルーズコントロール<DC年 金>	89,225円	270,126円
DIAMコア資産設計ファンド (堅実型)	915,607円	1,500,541円
DIAMコア資産設計ファンド (積極型)	1,691,798円	2,221,045円
投資のソムリエ<DC年金>リ スク抑制型	199,792,522円	259,126,482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	454,825円	512,806円
ワールドアセットバランス(基 本コース)	3,446,924,591円	3,565,443,159円
ワールドアセットバランス(リ スク抑制コース)	1,129,715,395円	951,156,570円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤ-2045)	2,262,347,925円	3,697,617,320円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤ-2055)	2,617,018円	4,639,943円
リスク抑制世界8資産バラン スファンド(DC)	2,029,113円	3,925,139円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤ-2035)	1,240,199円	1,852,291円
リスクコントロール世界資産分 散ファンド	4,146,714円	8,241,094円
9資産分散投資・スタンダード <DC年金>	779,406,995円	648,733,942円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤ-2040)	13,655円	22,145,866円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤ-2050)	-円	790,977円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤ-2060)	-円	790,977円
投資のソムリエ(ターゲット・ イヤ-2060)	-円	790,977円
エマージング債券リスク抑制型 (適格機関投資家限定)	16,751,347,027円	10,583,670,917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)	2,044,980,656円	1,057,417,437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 )	4,245,286,325円	1,963,944,077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 )	4,605,400,717円	2,854,291,863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 )	4,132,286,126円	3,998,328,626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 )	2,192,663,196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 )	4,231,991,681円	4,231,991,681円
	計	52,757,465,400円	46,374,799,702円
2 .	受益権の総数	52,757,465,400口	46,374,799,702口

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	平成31年1月11日現在	令和1年7月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

## （有価証券に関する注記）

該当事項はありません。



## （デリバティブ取引等に関する注記）

## 通貨関連

種類	平成31年1月11日 現在				令和1年7月11日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
買 建	16,588,120,000	-	16,588,265,000	145,000	432,620,000	-	432,600,000	20,000
アメリカ・ ドル	16,588,120,000	-	16,588,265,000	145,000	432,620,000	-	432,600,000	20,000
合計	16,588,120,000	-	16,588,265,000	145,000	432,620,000	-	432,600,000	20,000

## （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。

## （1口当たり情報に関する注記）

	平成31年1月11日現在	令和1年7月11日現在
1口当たり純資産額	1.7895円	1.9582円
（1万口当たり純資産額）	(17,895円)	(19,582円)

## 2【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2045）

令和1年7月31日現在

資産総額	66,144,312円
負債総額	292,735円
純資産総額（ - ）	65,851,577円
発行済数量	61,832,977口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0650円

投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2055）

令和1年7月31日現在

資産総額	54,881,740円
負債総額	252,603円
純資産総額（ - ）	54,629,137円
発行済数量	51,306,041口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0648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7月31日現在

資産総額	256,591,857,178円
負債総額	1,322,533,334円
純資産総額（ - ）	255,269,323,844円
発行済数量	104,231,793,484口
1口当たり純資産額（ / ）	2.4491円

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和1年7月31日現在

資産総額	281,222,540,462円
負債総額	2,282,232,000円
純資産総額（ - ）	278,940,308,462円
発行済数量	210,079,437,875口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3278円

J-REITインデックスファンド・マザーファンド

令和1年7月31日現在

資産総額	36,200,947,049円
負債総額	378,291,531円
純資産総額（ - ）	35,822,655,518円
発行済数量	16,212,958,836口
1口当たり純資産額（ / ）	2.2095円

## 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和1年7月31日現在

資産総額	350,136,019,620円
負債総額	702,307,178円
純資産総額( - )	349,433,712,442円
発行済数量	94,290,034,594口
1口当たり純資産額( / )	3.7059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7月31日現在

資産総額	46,947,204,164円
負債総額	104,015,352円
純資産総額( - )	46,843,188,812円
発行済数量	35,657,574,111口
1口当たり純資産額( / )	1.3137円

## 為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和1年7月31日現在

資産総額	485,285,845,633円
負債総額	3,640,903,230円
純資産総額( - )	481,644,942,403円
発行済数量	344,360,318,930口
1口当たり純資産額( / )	1.3987円

## エマージング株式パッシブ・マザーファンド

令和1年7月31日現在

資産総額	59,271,153,370円
負債総額	297,774,325円
純資産総額( - )	58,973,379,045円
発行済数量	51,603,318,141口
1口当たり純資産額( / )	1.1428円

## エマージング債券パッシブ・マザーファンド

令和1年7月31日現在

資産総額	98,920,546,990円
負債総額	4,300,019,080円
純資産総額( - )	94,620,527,910円
発行済数量	47,897,528,370口
1口当たり純資産額( / )	1.9755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7月31日現在)

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

直近5カ年の資本金の増減：該当事項はありません。

##### (2) 会社の機構(2019年7月31日現在)

###### 会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。

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

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

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

また、取締役会の決議によって、取締役社長を定めることができます。

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

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

###### 投資運用の意思決定機構

###### 1.投資環境見直しおよび運用方針の策定

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

2.運用計画、売買計画の決定

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

2【事業の内容及び営業の概況】

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

2019年7月31日現在、委託会社の運用する投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除く）

基本的性格	本数	純資産総額（単位：円）
追加型公社債投資信託	26	1,188,004,242,151
追加型株式投資信託	873	13,682,222,597,933
単位型公社債投資信託	42	117,985,594,596
単位型株式投資信託	164	1,274,431,192,895
合計	1,105	16,262,643,627,575

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

## (2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

(千円)

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

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

(千円)

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

## (4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(千円)

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

(注) 特別損失に計上しております。

## (5) 数理計算上の計算基礎に関する事項

## 主要な数理計算上の計算基礎

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

## 3. 簡便法を適用した確定給付制度

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

(千円)

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

## (2) 退職給付費用

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

## 4. 確定拠出制度

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

## (税効果会計関係)

## 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

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

## (企業結合等関係)

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

## 1. 結合当事企業

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



## 2. 企業結合日

2016年10月1日

## 3. 企業結合の方法

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

## 4. 結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

## 5. 企業結合の主な目的

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

## 6. 合併比率

「3. 企業結合の方法」の吸収合併における合併比率は以下の通りであります。

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

(\*) 普通株式と種類株式を合算して算定しております。

## 7. 交付した株式数

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

## 8. 経済的持分比率（議決権比率）

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

MHFGが企業結合日に追加取得した当社に対する経済的持分比率 20.00%

MHFGの追加取得後の当社に対する経済的持分比率 70.00%

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

## 9. 取得企業を決定するに至った主な根拠

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

## 10. 会計処理

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

## 11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

## (1) 被取得企業の取得原価及びその内訳

取得の対価 MHAMの普通株式 144,212,500千円

取得原価 144,212,500千円

## (2) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

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

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

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

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

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

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

## 12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

## (1) 貸借対照表項目

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

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

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

## (2) 損益計算書項目

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

(注) 営業利益には、のれん及び顧客関連資産の償却額が含まれております。

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

(資産除去債務関係)

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

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

(セグメント情報等)

1. セグメント情報

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

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

(1) サービスごとの情報

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

(2) 地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

(1) 親会社及び法人主要株主等

第33期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

該当はありません。

第34期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

該当はありません。

(2) 子会社及び関連会社等

第33期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

該当はありません。

第34期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

該当はありません。

## (3) 兄弟会社等

第33期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

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

第34期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

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

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

## 2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

## (1) 親会社情報

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

## (2) 重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません。

## (1株当たり情報)

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

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

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

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

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

#### 4【利害関係人との取引制限】

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

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

#### 5【その他】

- (1) 定款の変更、事業譲渡又は事業譲受、出資の状況その他の重要事項

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

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

- (2) 訴訟事件その他の重要事項

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

## 第2【その他の関係法人の概況】

### 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

#### (1)受託会社

##### a. 名称

みずほ信託銀行株式会社

##### b. 資本金の額

2019年3月末日現在 247,369百万円

##### c. 事業の内容

日本において銀行業務および信託業務を営んでいます。

#### (2)販売会社

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

名 称	資本金の額 (単位：百万円)	事 業 の 内 容
株式会社みずほ銀行	1,404,065	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社横浜銀行	215,628	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社北越銀行	24,538	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社肥後銀行	18,128	日本において銀行業務を営んでおります。
第一生命保険株式会社	60,000	日本において保険業務を営んでおります。
損保ジャパン日本興亜DC 証券株式会社	3,000	「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月末日現在

(注) 確定拠出年金向けの取扱販売会社を含みます。

### 2【関係業務の概要】

「受託会社」は、以下の業務を行います。

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

「販売会社」は、以下の業務を行います。

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

### 3【資本関係】

該当事項はありません。

持株比率5%以上を記載します。

### 第3【その他】

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

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

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

(3)投資信託説明書（請求目論見書）に約款の全文を掲載します。

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

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

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



## 独立監査人の監査報告書

2019年5月30日

アセットマネジメントOne株式会社  
取締役会 御中

## EY新日本有限責任監査法人

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

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

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

## 監査人の責任

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

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

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

## 監査意見

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

## 利害関係

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

以上

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

(注2) XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。

## 独立監査人の監査報告書

平成31年2月22日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 湯原 尚 印  
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2045）の平成30年1月12日から平成31年1月11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、投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2045）の平成31年1月11日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する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。

## その他の事項

ファンドの平成30年1月11日をもって終了した前計算期間の財務諸表は、前任監査人によって監査されている。前任監査人は、当該財務諸表に対して平成30年2月28日付けで無限定適正意見を表明している。

## 利害関係

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

以上

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

（注2）XBRLデータは監査の対象には含まれておりません。



## 独立監査人の監査報告書

平成31年2月22日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 湯原 尚 印  
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2055）の平成30年1月12日から平成31年1月11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、投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2055）の平成31年1月11日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する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。

## その他の事項

ファンドの平成30年1月11日をもって終了した前計算期間の財務諸表は、前任監査人によって監査されている。前任監査人は、当該財務諸表に対して平成30年2月28日付けで無限定適正意見を表明している。

## 利害関係

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

以上

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

（注2）XBRLデータは監査の対象には含まれておりません。



## 独立監査人の中間監査報告書

令和1年8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 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」に掲げられている投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2045）の平成31年1月12日から令和1年7月11日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

## 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

## 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2045）の令和1年7月11日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成31年1月12日から令和1年7月11日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 利害関係

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

以上

---

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

(注2) XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。

## 独立監査人の中間監査報告書

令和1年8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 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」に掲げられている投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2055）の平成31年1月12日から令和1年7月11日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

### 中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

### 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

### 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2055）の令和1年7月11日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成31年1月12日から令和1年7月11日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

### 利害関係

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

以上



---

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

(注2) XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。