【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	2019年10月11日
【計算期間】	第15期　（自　2019年1月12日　至　2019年7月11日）
【ファンド名】	クルーズコントロール
【発行者名】	アセットマネジメントOne株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長　　菅野　暁
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目８番２号
【事務連絡者氏名】	酒井　隆
【連絡場所】	東京都千代田区丸の内一丁目８番２号
【電話番号】	03-6774-5100
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【ファンド情報】

第１【ファンドの状況】

１【ファンドの性格】

（１）【ファンドの目的及び基本的性格】

①当ファンドは、信託財産の成長を図ることを目的として、運用を行います。

②当ファンドの信託金限度額は、5,000億円とします。ただし、委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

＜ファンドの特色＞

1 国内外の6資産に分散投資することにより、信託財産の成長を図ることを目的として、運用を行います。

●国内外の株式および公社債に、以下のマザーファンドを通じて実質的に投資します。
- 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
- 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
- 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
- エマージング債券パッシブ・マザーファンド
- エマージング株式パッシブ・マザーファンド

●マザーファンドのほか、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)、短期金融資産等へ投資する場合もあります。

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

●各資産への投資比率は、統計的手法により、原則として年1回見直すこととします。経済環境、運用環境の大きな変化などにより委託会社が必要と判断した場合には、適宜、投資比率の見直しを行うことがあります。

2 基準価額の下落を一定水準(下値目安値(*))までに抑えることを目標とします。

●資産価値上昇時には、値上がり益を獲得することをめざします。

●資産価値下落時でも、基準価額の下落を一定水準までに抑えることをめざします。

●下値目安値は、3ヵ月毎に下値目安値の改定日(毎年1月、4月、7月、10月の各11日。休業日の場合には、翌営業日。)を設け、改定日における基準価額から−2.0%の水準とします。ただし、当該水準は、委託会社の判断により今後変更する場合があります。

●上記の運用目標は、現金等(**)を活用し、基準価額の水準や市場環境等に応じて投資対象資産の合計資産比率(***)を機動的に変更することで行います。

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

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

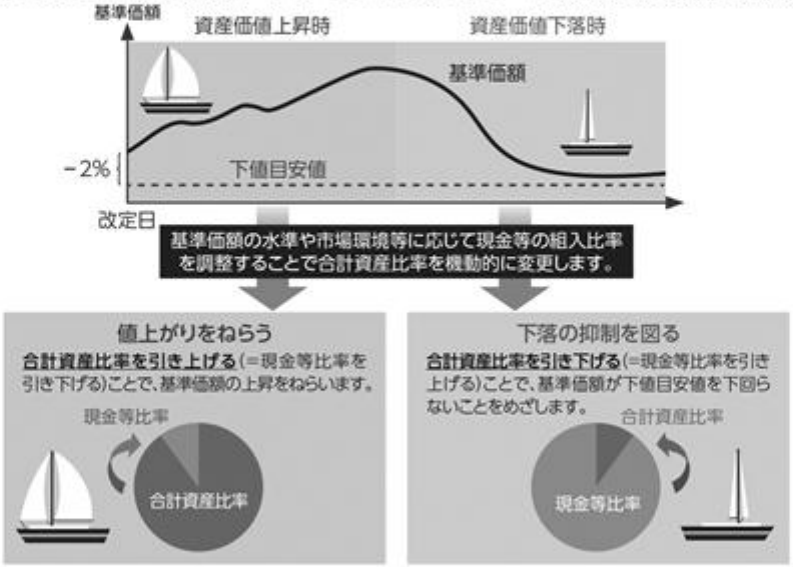
(***)合計資産比率とは、「DIAMマネーマザーファンド」を除く6つのマザーファンドの投資比率の合計をいいます。

※各資産への投資比率および合計資産比率の決定にあたっては、みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社から投資助言を受けます。

当ファンドの合計資産比率の変更(イメージ)

●資産価値上昇時は、合計資産比率*1を増加(=現金等*2比率の減少)させることで値上がり益の獲得をめざします。
●一方、資産価値下落時は、機動的に合計資産比率を減少(=現金等比率の増加)させることで基準価額下落の抑制をめざします。

*1 合計資産比率とは、「DIAMマネーマザーファンド」を除く6つのマザーファンドの投資比率の合計をいいます。
*2 現金等とは、短期国債、コール・ローンなどの短期金融資産等をいい、当該資産へは、「DIAMマネーマザーファンド」を通じてまたは直接投資を行います。
※合計資産比率の決定にあたっては、みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社の投資助言を活用します。



※下値目安値は、基準価額がこれを下回らないように目標とされる水準であり、基準価額が下値目安値を下回らないことを委託会社が保証するものではありません。
※ただし、当該水準は委託会社の判断により今後変更する場合があります。
※上記はイメージ図であり、実際にはこれと異なる場合があります。
※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。また、将来の運用成果等を示唆・保証するものではありません。

■分配方針

年2回の決算時(毎年1月、7月の各11日(休業日の場合は翌営業日))に、経費控除後の配当等収益および売買益(評価益を含みます。)等の全額を対象として、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して、分配金額を決定します。

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

○商品分類表

単位型投信 追加型投信	投資対象地域	投資対象資産 （収益の源泉）
単位型投信 追加型投信	国　内 海　外 内　外	株　式 債　券 不動産投信 その他資産 （　　） 資産複合

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

○商品分類定義

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

○属性区分表

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

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

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

○属性区分定義

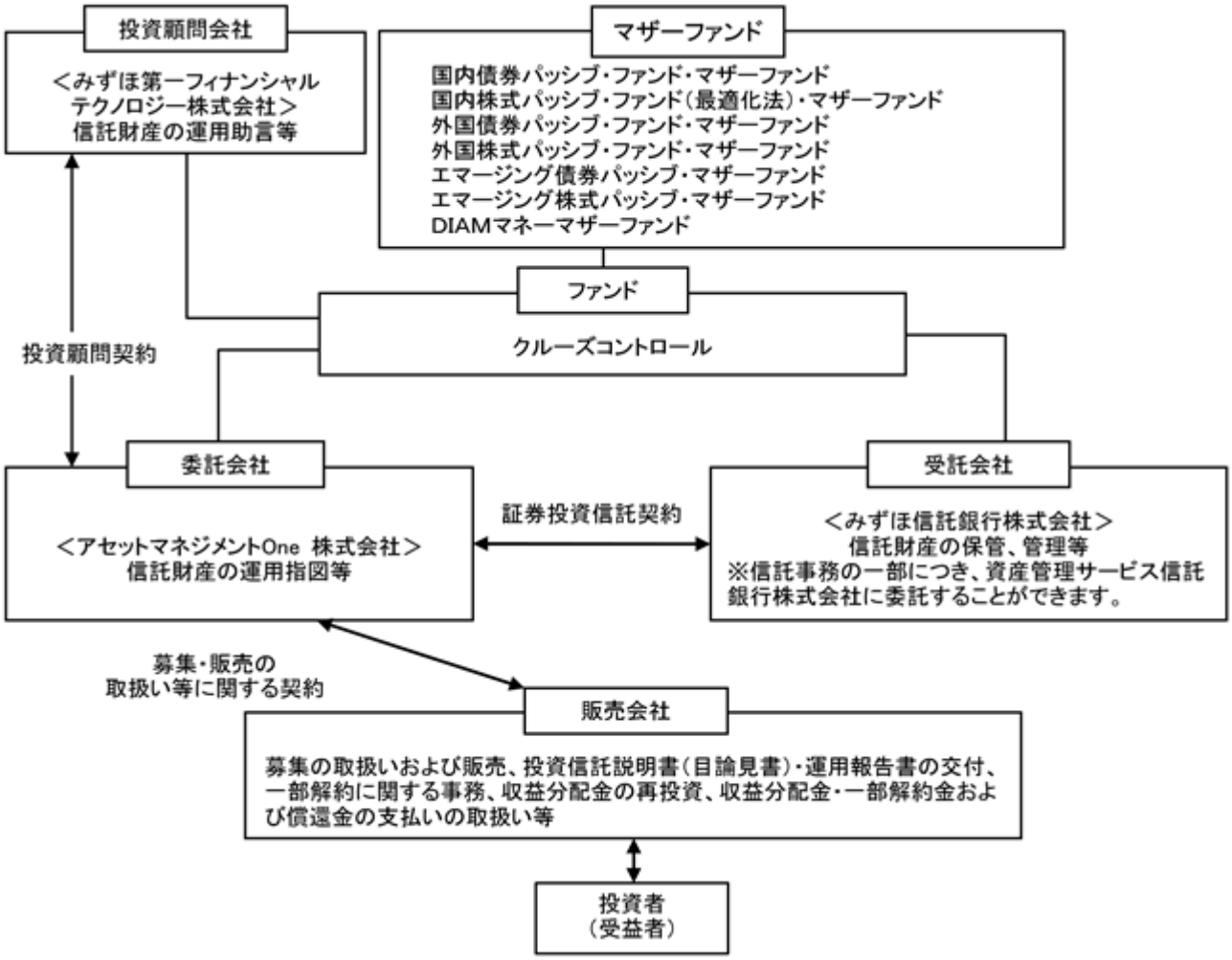
資産複合（投資信託証券（債券、株式）、先物、ＥＴＦ、短期金融資産）資産配分変更型	目論見書または投資信託約款において、複数資産（投資信託証券、先物、ＥＴＦ、短期金融資産）を投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行う旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないものをいいます。
年2回	目論見書または投資信託約款において、年2回決算する旨の記載があるものをいいます。
グローバル（日本を含む）	目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本を含む世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
ファミリーファンド	目論見書または投資信託約款において、親投資信託（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

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

（２）【ファンドの沿革】

2012年10月26日　信託契約締結、ファンドの設定、ファンドの運用開始
2013年 5月17日　投資対象、投資態度、信託期間、信託の計算期間、信託報酬率、信託財産留保額について変更

（３）【ファンドの仕組み】



・「証券投資信託契約」の概要

委託会社と受託会社との間においては、ファンドの設定時に証券投資信託契約を締結しております。

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

・「募集・販売の取扱い等に関する契約」の概要

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

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。

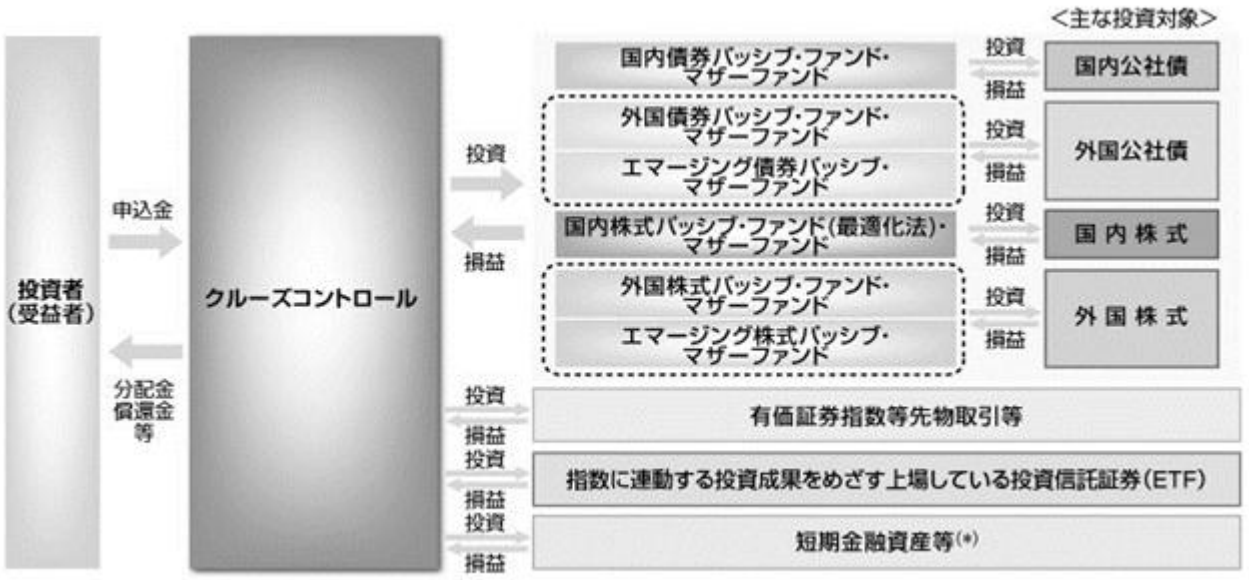
・「投資顧問契約」の概要

委託会社と投資顧問会社（みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社）との間においては、当ファンドの運用にかかる助言契約が締結されております。当該契約の内容は、投資顧問サービスの内容、助言の基本方針、運用の責任等について規定したものです。

●「ファミリーファンド方式」とは●

当ファンドは「ファミリーファンド方式」により運用を行います。

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



(*)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。

○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「ＤＩＡＭアセットマネジメント株式会社」に商号変更

2016年10月1日　　ＤＩＡＭ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※1	70.0%※2
第一生命ホールディングス株式会社	東京都千代田区有楽町一丁目13番1号	12,000株	30.0%※2

※1：Ａ種種類株式（15,510株）を含みます。

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

2【投資方針】

（1）【投資方針】

＜基本方針＞

この投資信託は、信託財産の成長を図ることを目的として、運用を行います。

＜投資対象＞

「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」受益証券、「外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「エマージング債券パッシブ・マザーファンド」受益証券、「エマージング株式パッシブ・マザーファンド」受益証券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目指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」受益証券や短期金融資産等に投資する場合もあります。

＜投資態度＞

①以下のマザーファンドへの投資を通じて、国内外の株式、公社債に実質的に分散投資を行います。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
エマージング債券パッシブ・マザーファンド
エマージング株式パッシブ・マザーファンド

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

・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や短期金融資産等へ投資する場合もあります。
・実質的な組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。

②各資産への投資比率は、統計的手法により、原則として年１回見直すこととします。
・経済環境、運用環境の大きな変化などにより委託会社が必要と判断した場合には、適宜、投資比率の見直しを行うことがあります。

③基準価額の下落を一定水準（下値目安値(*)）までに抑えることを目標とします。
・資産価値上昇時には、値上がり益を獲得することをめざします。
・資産価値下落時でも、基準価額の下落を一定水準までに抑えることをめざします。
・下値目安値は、四半期毎に、委託会社の判断により基準価額から一定の水準に設定します。
・上記の運用目標は、基準価額の水準や市場環境等に応じて投資対象資産の合計資産比率(**)を機動的に変更することで行います。

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

(＊＊)合計資産比率とは、「ＤＩＡＭマネーマザーファンド」を除く６つのマザーファンドの投資比率の合計をいいます。

・各資産への投資比率および合計資産比率の決定にあたっては、みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社から投資助言を受けます。
・資金動向、市況動向等によっては上記のような運用が出来ない場合があります。

＜運用プロセス＞

・基本配分比率の決定

委託会社は、年に一度、統計的手法を用いて現金等を除く各資産への基本配分比率を決定します。

・下値目安値の決定

委託会社は、３ヵ月に一度、下値目安値の改定日を設け、当日の基準価額の98%の水準を翌３ヵ月間の下値目安値とします。

・リバランスの実施

委託会社は、各資産の上昇益を享受しつつも基準価額が下値目安値を下回らないことを目標として、基準価額と下値目安値の水準、市況などを基に、日々の合計資産比率の推奨値を決定します。ファンドの合計資産比率と推奨値との乖離が一定以上となった場合にはリバランスを実施します。6資産への投資比率は、基本配分比率と合計資産比率から決定します。

・みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社からの助言

基本配分比率および合計資産比率の決定にあたっては、みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社から投資助言を受けます。

（２）【投資対象】

①投資の対象とする資産の種類（約款第16条）

この信託において投資の対象とする資産の種類は次に掲げるものとします。

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

イ．有価証券

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

ハ．金銭債権

ニ．約束手形

ｂ.次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

②運用の指図範囲等（約款第17条第1項）

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

1．株券または新株引受権証書

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、振替投資法人債を含みます。）

8．特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）

9．協同組織金融機関の優先出資に関する法律に規定する優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）

10.資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）

11.コマーシャル・ペーパー

12.新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）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、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、振替受益権を含みます。)

15.投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）

16.外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）

17.オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限ります。）

18.預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）

19.外国法人が発行する譲渡性預金証書

20.指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)

21.抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)

22.貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの

23.外国の者に対する権利で22.の有価証券の性質を有するもの

なお、1.の証券または証書、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。

③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②に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。)により運用することを指図することができます。

1.預金

2.指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)

3.コール・ローン

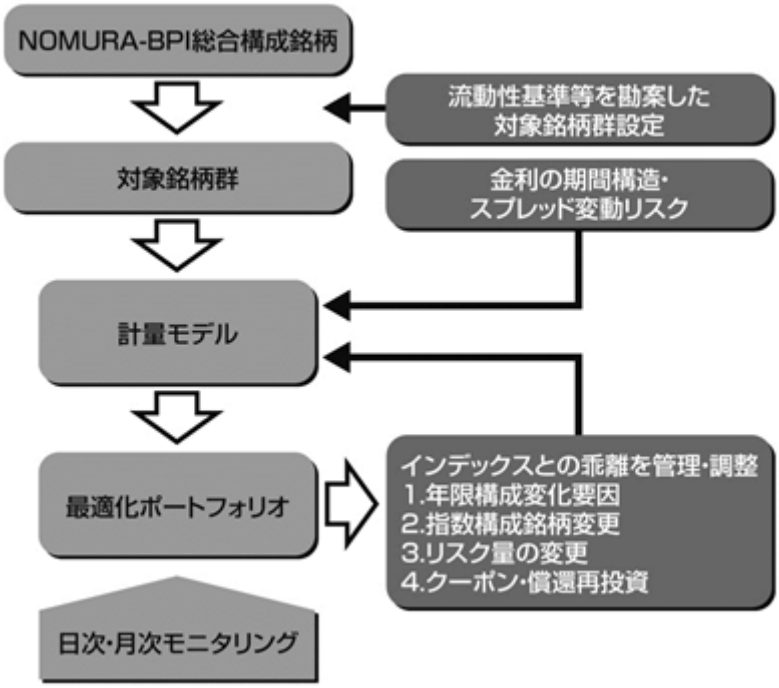
4.手形割引市場において売買される手形

5.貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

6.外国の者に対する権利で5.の権利の性質を有するもの

（参考）当ファンドが投資対象とするマザーファンドの概要

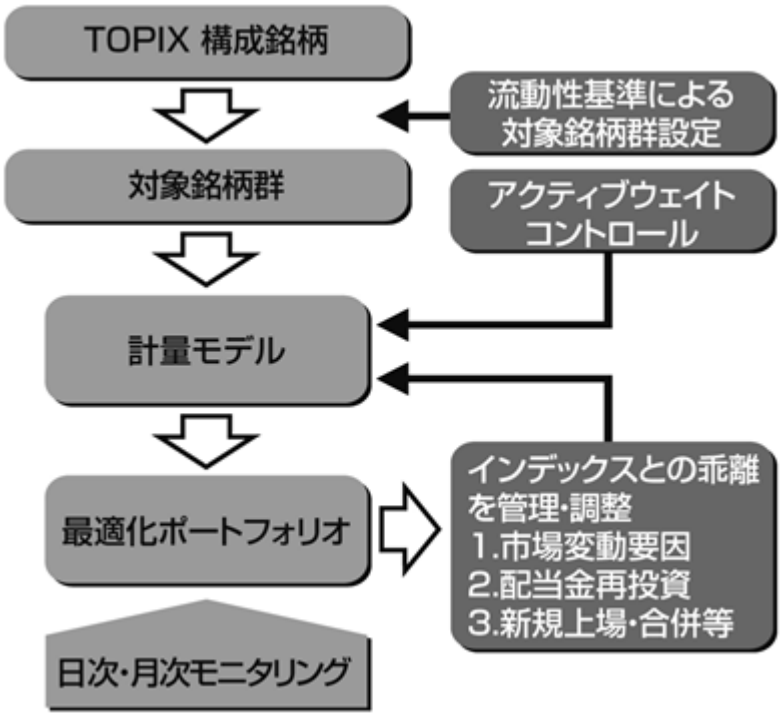
ファンド名	**国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド**
基本方針	**この投資信託は、ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合に連動する投資成果を目標として運用を行います。**
主な投資対象	**わが国の公社債を主要投資対象とします。**
投資態度	**1.主としてわが国の公社債に投資し、「ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合」※に連動する投資成果をめざして運用を行います。** **2.公社債（債券先物取引等を含みます。）の組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。** **3.公社債の組入比率の調整には、債券先物取引等を活用する場合があります。** **※ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ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。**

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

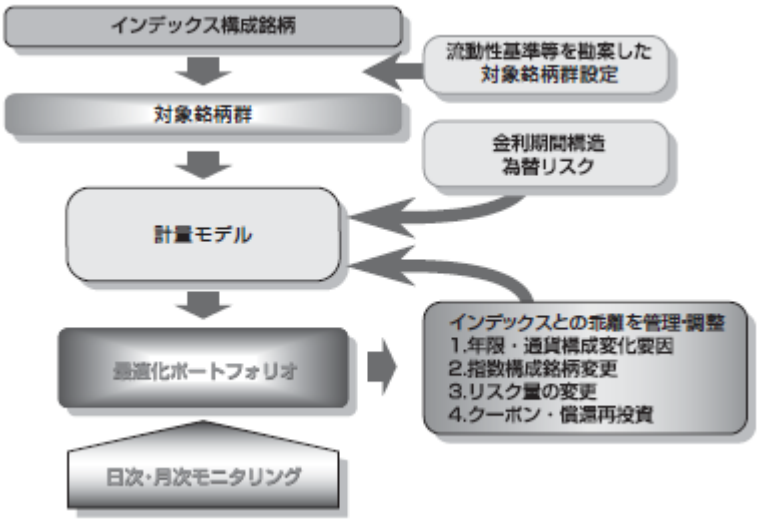
主な投資制限	1.株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限ります。 2.株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 3.同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 4.同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 5.外貨建資産への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 6.デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 7.外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。 8.一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

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

投資態度	1.主として東京証券取引所第1部に上場されている株式に投資し、「東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）（配当込み）」※に連動する投資成果をめざして運用を行います。 2.最適化法によるポートフォリオ構築を行い、運用コストの最小化と徹底したリスク管理を行います。 3.株式（株価指数先物取引を含みます。）の組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。 4.株式の組入比率の調整には、株価指数先物取引等を活用します。 5.非株式割合は原則として信託財産総額の50%以下とします。また、外貨建資産割合は原則として信託財産総額の10%以下とします。 ※①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「㈱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㈱東京証券取引所が有しています。 ②㈱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。 ③㈱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。 ④㈱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、㈱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。 ⑤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、㈱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。 ⑥㈱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。 ⑦㈱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。 ⑧以上の項目に限らず、㈱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	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	1.株式への投資割合には、制限を設けません。 2.デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 3.外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。 4.一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

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

運用プロセス	1.流動性基準等による対象銘柄群設定 FTSE世界国債インデックス構成銘柄のうち、流動性基準等を勘案して投資対象銘柄群を設定します。 2.最適化法によるポートフォリオの構築 金利の期間構造、通貨エクスポージャーから発生するベンチマーク乖離要因が最小となるポートフォリオを構築します。 3.インデックスとの乖離を管理 日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理して、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。 インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。 ・年限・通貨構成変化要因 ・指数構成銘柄変更 ・リスク量の変更 ・クーポン・償還再投資 

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

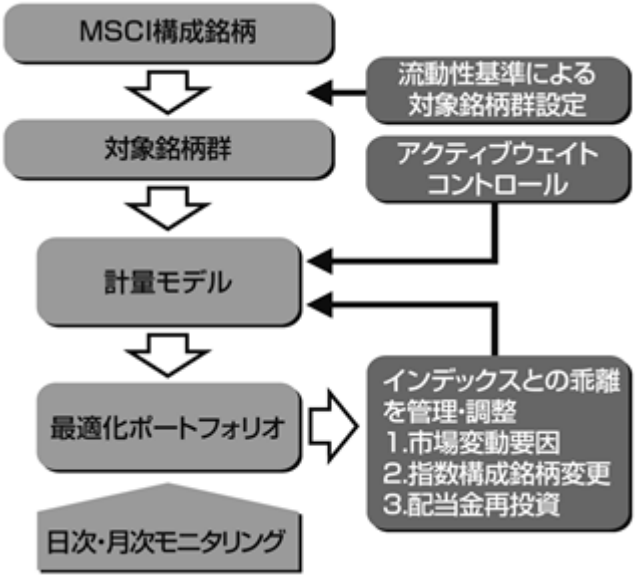
ファンド名	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。
主な投資対象	海外の株式を主要投資対象とします。

投資態度	**1.主に海外の株式に投資を行い、ＭＳＣＩコクサイ・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）※に連動する投資成果をめざして運用を行います。** **2.株式への投資は原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。** **3.組入外貨建資産については原則為替ヘッジは行いませんが、金利・為替状況によってはヘッジを実施する可能性があります。**

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

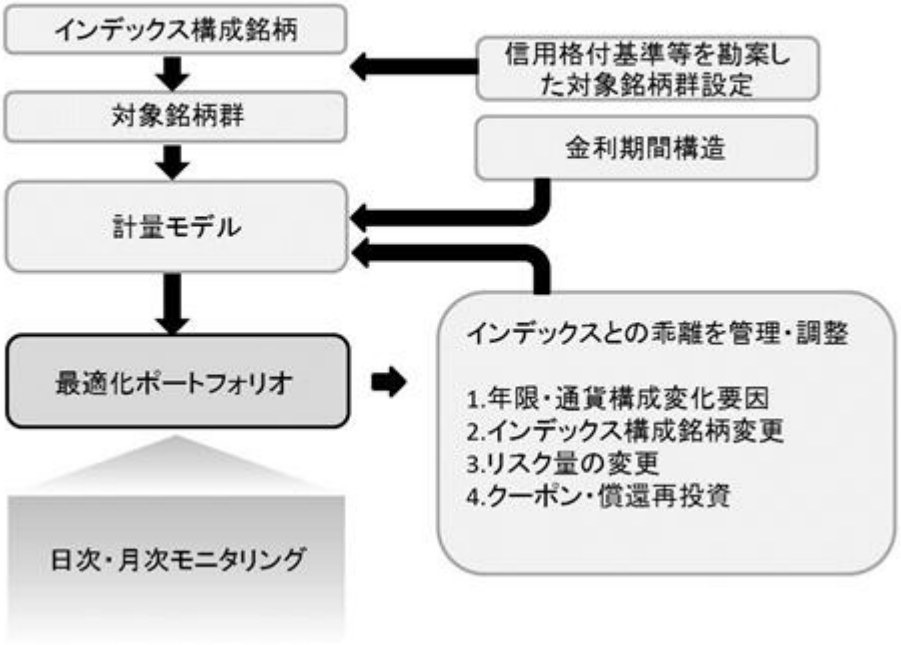
MSCIは、自らが信頼できると考える情報源からMSCI指数の計算に算入または使用するための情報を入手しますが、いかなるMSCI関係者も、MSCI指数またはそれに含まれるデータの独創性、正確性および／または完全性について保証するものではありません。いかなるMSCI関係者も、明示的か黙示的かを問わず、本ファンドの発行会社もしくは所有者、またはその他の者もしくは団体が、MSCI指数またはそれに含まれるデータを使用することにより得られる結果について保証を行いません。いかなるMSCI関係者も、MSCI指数またはそれに含まれるデータの、またはそれらに関連する過誤、脱漏または中断について責任を負いません。ま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

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

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

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

ファンド名	エマージング債券パッシブ・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、主として新興国の債券に投資し、ＪＰモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース・為替ヘッジなし）の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。
主な投資対象	新興国の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	1.主として新興国の債券に投資し、ＪＰモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース・為替ヘッジなし）※の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。 2.原則として、新興国の債券の組入比率は高位を維持します。 3.組入債券は、当初組入時において、Ｓ＆ＰもしくはＭｏｏｄｙ’ｓの外貨建て長期格付がＢＢ－格もしくはＢａ３格以上を取得している債券とします。但し、両社が格付を付与している場合には、どちらか低い方の格付を基準とします。また、当ファンドが保有する債券の格付が上記基準未満となった場合は、当該債券を速やかに売却するものとします。 4.外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。 ※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。

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

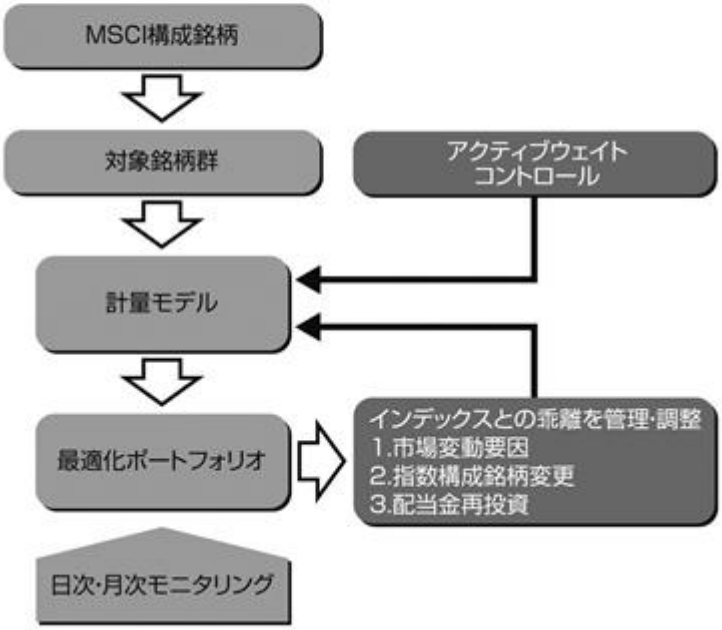
ファンド名	エマージング株式パッシブ・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、主として海外の証券取引所に上場している株式（＊）に投資し、ＭＳＣＩエマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。 （＊）ＤＲ（預託証券）もしくは株式と同等の投資効果が得られる権利を表示する証券および証書等を含みます。
主な投資対象	海外の証券取引所に上場している株式を主要投資対象とします。

投資態度	**1.主として海外の証券取引所に上場している株式に投資し、ＭＳＣＩエマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）※の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。** **2.原則として、株式の組入比率は高位を維持します。** **3.外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。**

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

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

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

	事前にMSCIの書面による承認を得ることなくMSCIとの関係を主張することはできません。
運用プロセス	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。 
主な投資制限	**1.株式への投資割合には、制限を設けません。** **2.外貨建資産への投資には、制限を設けません。** **3.投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。** **4.デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。** **5.外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。** **6.一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。**

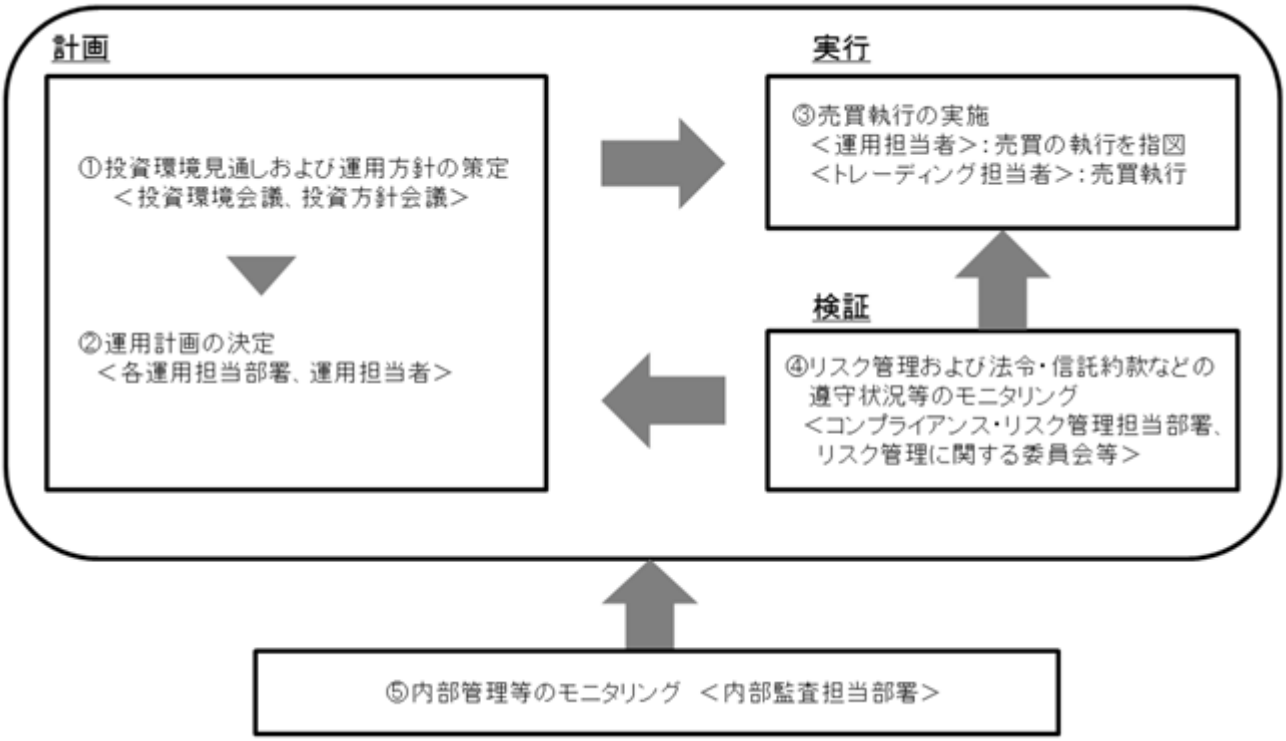
ファンド名	**ＤＩＡＭマネーマザーファンド**
基本方針	**この投資信託は、安定した収益の確保をめざします。**
主な投資対象	**国内発行体の公社債、転換社債、ユーロ円債、資産担保証券ならびにＣＤ、ＣＰ、コールローン等の国内短期金融資産を主要投資対象とします。**

投資態度	①国内の国債、政府保証債、政府機関債、地方債等のほか、取得時において主要格付機関（＊）の長期発行体格付（複数の格付機関が付与している場合は高い方の格付）がＡＡ-格相当以上の社債、転換社債、ユーロ円債、資産担保証券、さらに、国内格付機関の短期格付がa-1格相当以上のＣＤ、ＣＰを主要投資対象とします。 (＊)主要格付機関とは、Ｒ＆Ｉ、ＪＣＲ、Ｍｏｏｄｙ's、Ｓ＆Ｐとします。 ②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。 ③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。
運用プロセス	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）。
主な投資制限	①株式への投資割合は、純資産総額の10%以下とします。 ②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。 ③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。 ④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。 ⑤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。 ⑥外貨建て資産への投資は行いません。 ⑦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。 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。

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



①　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。

②　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。

③　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。

④　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。

定期的に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。

⑤　内部管理等のモニタリング

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

b．ファンドの関係法人に関する管理

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

c．運用体制に関する社内規則

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

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

※運用体制は2019年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】

①収益分配方針

毎決算時（原則として毎年1月、7月の各11日。休業日の場合は翌営業日。）に、原則として次のとおり収益分配を行う方針です。

(1)分配対象額の範囲

経費控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。

(2)分配対象額についての分配方針

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

(3)留保益の運用方針

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

②収益の分配方式

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

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

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

(2)上記(1)の1)および2)におけるみなし配当等収益とは、マザーファンドの信託財産にかかる配当等収益の額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める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。

③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販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に、原則として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】

①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）

②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）

③委託会社は、信託財産に属する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(金融商品取引所に上場等され、かつ当該取引所において常時売却可能(市場急変等により一時的に流動性が低下している場合を除きます。)な投資信託証券をいいます。以下同じ。)を除きます。）の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する投資信託証券(上場投資信託証券を除きます。)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が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。（約款第17条第3項）

④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）

⑤非株式割合（マザーファンドの信託財産に属する株式以外の資産のうち、この信託の信託財産に属するとみなした部分を含みます。）について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）

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。（約款「運用の基本方針」2.運用方法　(3)投資制限）

⑦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。

⑧信用取引の指図および範囲（約款第21条）

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

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

1.信託財産に属する株券および新株引受権証書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（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

⑨先物取引等の運用指図（約款第22条）

1)委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、および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。以下同じ。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします（以下同じ。）。

2)委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、および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行うことの指図をすることができます。

3)委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、および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行うことの指図をすることができます。

⑩スワップ取引の運用指図（約款第23条）

1)委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび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)スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等を基に算出した価額で評価するものとします。

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

⑪金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図（約款第24条）

1)委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび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。

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

⑫デリバティブ取引等にかかる投資制限（約款第24条の2）

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

⑬有価証券の貸付の指図および範囲（約款第25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たときは、担保の受け入れの指図を行うものとします。

⑭特別な場合の外貨建有価証券への投資制限（約款第26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。

⑮外国為替予約取引の指図（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、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の合計額と売予約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)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。

⑯資金の借入れ（約款第33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。

⑰同一法人の発行する株式への投資制限（投資信託及び投資法人に関する法律第9条）

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

3【投資リスク】

＜基準価額の主な変動要因＞

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

・資産配分リスク

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

当ファンドの実質資産配分において、収益率の悪い資産への配分比率が大きい場合、基準価額が下がる場合があります。
当ファンドは現金等の保有比率を増加させることにより、基準価額の下落リスクの低減をめざして運用を行いますが、当手法が効果的に機能しない場合等により、基準価額の下落リスクを低減できない場合や、市場全体の上昇に追随できない場合があります。

・株価変動リスク

投資する企業の株価の下落は、基準価額の下落要因となります。

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

・金利リスク

金利の上昇（債券の価格の下落）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の価格は下落します。当ファンドは、実質的に債券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。

・為替リスク

為替相場の円高は、基準価額の下落要因となります。

当ファンドは、実質組入外貨建資産について原則として対円で為替ヘッジを行わないため為替変動の影響を受けます。このため為替相場が当該実質組入資産の通貨に対して円高になった場合には基準価額が下がる要因となります。

・信用リスク

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

当ファンドが実質的に投資する株式・債券の発行者が経営不安・倒産に陥った場合、またこうした状況に陥ると予想される場合等には、株式・債券の価格が下落したりその価値がなくなることがあり、基準価額が下がる要因となります。

・流動性リスク

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

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

・カントリーリスク

投資する国・地域の政治・経済の不安定化等は、基準価額の下落要因となります。

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

※基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

＜その他の留意点＞

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

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

○収益分配金に関する留意点として、以下の事項にご留意ください。

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

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

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

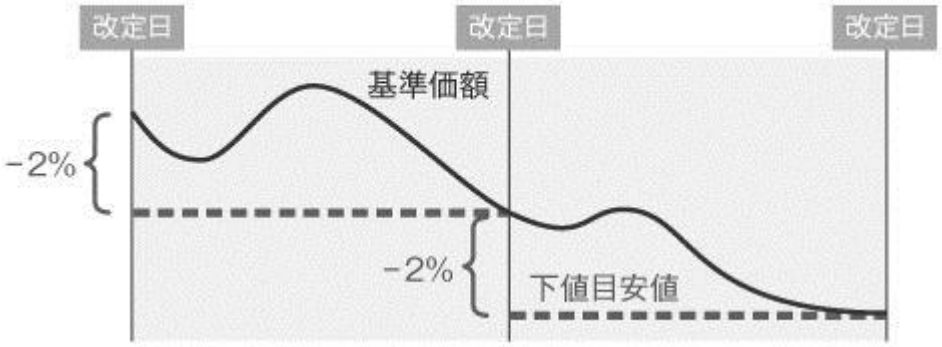
○当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行います。そのため、当ファンドが投資対象とするマザーファンドを投資対象とする他のベビーファンドに追加設定・解約等があった場合、資金変動等が起こり、その結果、当該マザーファンドにおいて売買等が生じた場合等には、当ファンドの基準価額に影響をおよぼす場合があります。

○当ファンドは下値目安値を改定日の基準価額をもとに決定し、損失の抑制をめざして合計資産比率をコントロールします。ただし損失が常に一定範囲に限定されるわけではないことにご留意ください。

＜ケース①＞下値目安値の切下げについて

下値目安値は3ヵ月（四半期）毎の改定日にその時点の基準価額をもとに定められます。そのため、当ファンドの基準価額は長期的に2%以上下落する場合があります。

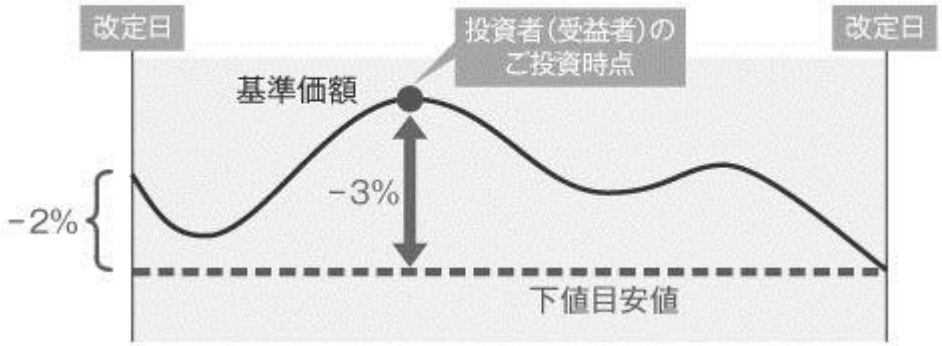
<基準価額の推移（イメージ）>



＜ケース②＞四半期途中の投資について

当ファンドの基準価額が直近の改定日の基準価額よりも上昇し、この時点でお客さまが当ファンドへ投資された場合、次回改定日までの基準価額の下落は2%以上となる場合があります。したがって、ご投資にあたっては、当該四半期の下値目安値にご留意いただきますようお願いいたします。

<基準価額の推移（イメージ）>



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

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

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

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

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

○注意事項

イ．当ファンドは、実質的に債券および株式等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。

ロ．投資信託は、預金等や保険契約ではありません。また、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。加えて、証券会社を通して購入していない場合には投資者保護基金の対象にもなりません。

ハ．投資信託は、購入金額について元本保証および利回り保証のいずれもありません。

ニ．投資信託は、投資した資産の価値が減少して購入金額を下回る場合があり、これによる損失は購入者が負担することとなります。

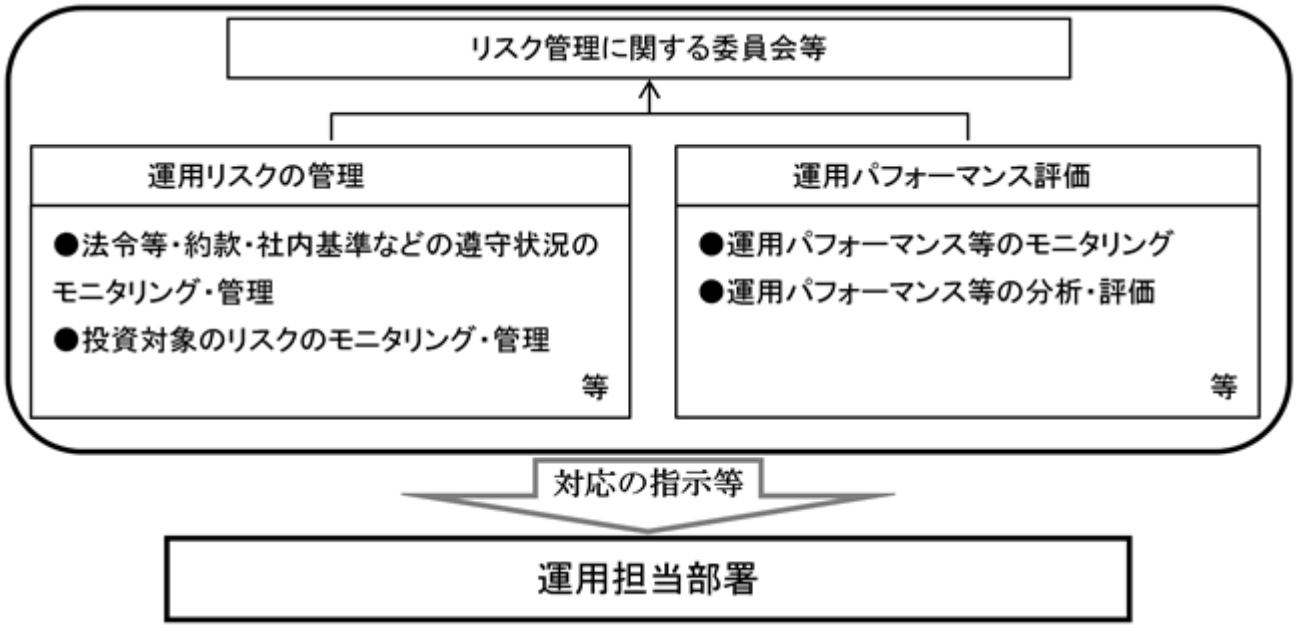
＜リスク管理体制＞

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。



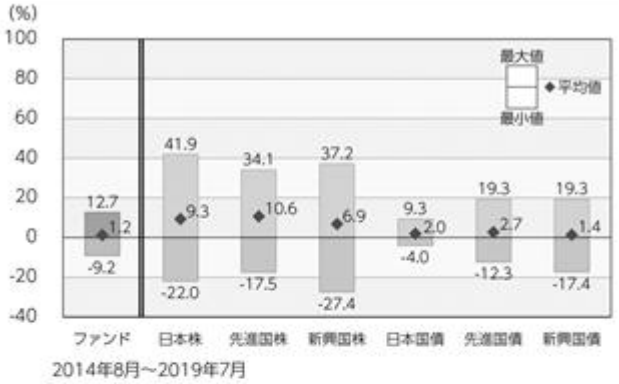
※リスク管理体制は2019年7月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

<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

*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。

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



2014年8月～2019年7月

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

(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、3.3%(税抜3.00%)を上限に各販売会社が定める手数料率を乗じて得た額とします。

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

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

※詳しくは販売会社にお問い合わせください。

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

（2）【換金（解約）手数料】

ありません。

（3）【信託報酬等】

ファンドの日々の純資産総額に対して年率1.54%（税抜1.40%）

支払先	内訳（税抜）	主な役務
委託会社	年率0.65%	信託財産の運用、目論見書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価
販売会社	年率0.70%	購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価
受託会社	年率0.05%	運用財産の保管・管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価

※信託報酬＝運用期間中の基準価額×信託報酬率

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

※委託会社の信託報酬には、当ファンドの投資顧問会社（みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社）に対する投資顧問報酬が含まれます。

※税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

（4）【その他の手数料等】

1.信託財産留保額

ありません。

2.その他の費用

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

①信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用ならびに受託会社の立て替えた立替金の利息および借入金の利息等は、受益者の負担とし、信託財産から支払われます。

②監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用は、受益者の負担とし、毎日計上（ファンドの基準価額に反映）され、毎計算期末または信託終了のとき、当該監査に要する費用にかかる消費税等相当額とともに信託財産から支払われます。

③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ならびに外貨建資産の保管等に要する費用は、受益者の負担とし、信託財産から支払われます。

④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ならびに外貨建資産の保管等に要する費用は、間接的に当ファンドで負担することになります。

※上記の「その他の費用」については、運用状況等により変動するものであり、事前に料率、上限額等を示すことができません。

※上場投資信託は市場の需給により価格形成されるため、上場投資信託の費用は表示しておりません。

※税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

（５）【課税上の取扱い】

◇当ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

○個人の受益者に対する課税

①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。

②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。

③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ます。）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、ご留意ください。

○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。

※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＞

①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。

②受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。

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

③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、①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、②当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、当該収益分配金から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。

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

※税法が改正された場合等は、上記内容が変更になることがあります。

５【運用状況】

（１）【投資状況】

令和1年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		13,426,832,331	59.26
	内　日本	13,426,832,331	59.26
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		9,229,566,056	40.74
純資産総額		22,656,398,387	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。
（注2）資産の種類の内書は、当該資産の発行体又は上場金融商品取引所の国/地域別に表示しています。

（参考）

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

令和1年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。

ＤＩＡＭマネーマザーファンド

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		701,685,000	59.93
	内　日本	701,685,000	59.93
地方債証券		105,331,652	9.00
	内　日本	105,331,652	9.00
特殊債券		66,752,450	5.70
	内　日本	66,752,450	5.70
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		297,004,408	25.37
純資産総額		1,170,773,510	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。
（注2）資産の種類の内書は、当該資産の発行体又は上場金融商品取引所の国/地域別に表示しています。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和1年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　バミューダ	1,380,386,212	0.40
	内　ベルギー	1,285,624,598	0.37
	内　ジャージィー	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　ニュージーランド	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		171,768,471,690	97.58
	内　アメリカ	81,457,669,096	46.27
	内　フランス	17,597,527,382	10.00
	内　イタリア	15,584,046,463	8.85
	内　ドイツ	10,852,889,864	6.17
	内　イギリス	10,469,026,414	5.95
	内　スペイン	10,019,394,442	5.69
	内　ベルギー	4,487,419,474	2.55
	内　オーストラリア	3,435,009,518	1.95
	内　オランダ	3,372,026,749	1.92
	内　カナダ	3,240,919,404	1.84
	内　オーストリア	2,539,175,571	1.44
	内　アイルランド	1,274,988,670	0.72
	内　メキシコ	1,241,367,816	0.71
	内　フィンランド	1,095,628,150	0.62
	内　ポーランド	1,043,218,584	0.59
	内　南アフリカ	963,277,993	0.55
	内　デンマーク	784,760,451	0.45
	内　マレーシア	750,051,519	0.43
	内　シンガポール	652,682,063	0.37
	内　スウェーデン	526,182,490	0.30
	内　ノルウェー	381,209,577	0.22
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		4,268,094,002	2.42
純資産総額		176,036,565,692	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）		659,508,728	△0.37
	－	659,508,728	△0.37

（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　ジャージィー	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】

①【投資有価証券の主要銘柄】

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	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	2,013,478,762	1.8505 3,726,021,443	1.8542 3,733,392,320	－ －	16.48%
2	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	1,874,027,480	1.3261 2,485,328,083	1.3278 2,488,333,687	－ －	10.98%
3	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	1,005,871,351	2.4696 2,484,173,264	2.4491 2,463,479,525	－ －	10.87%
4	エマージング債券パッシブ・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	634,784,760	1.9607 1,244,666,067	1.9755 1,254,017,293	－ －	5.53%
5	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	336,823,869	3.6921 1,243,591,719	3.7059 1,248,235,576	－ －	5.51%
6	エマージング株式パッシブ・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	1,084,679,673	1.1466 1,243,758,739	1.1428 1,239,571,930	－ －	5.47%
7	ＤＩＡＭマネーマザーファンド 日本	親投資信託受益証券	990,000,991	1.0098 999,802,000	1.0099 999,802,000	－ －	4.41%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資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	59.26%
合計	59.26%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資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。

ＤＩＡＭマネーマザーファンド

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	１２３回　利付国庫債券（５年） 日本	国債証券	300,000,000	100.24 300,720,000	100.18 300,561,000	0.100000 2020/3/20	25.67%
2	３９１回　利付国庫債券（２年） 日本	国債証券	200,000,000	100.33 200,672,000	100.29 200,580,000	0.100000 2020/8/1	17.13%
3	３９２回　利付国庫債券（２年） 日本	国債証券	100,000,000	100.35 100,357,000	100.31 100,315,000	0.100000 2020/9/1	8.57%
4	３８８回　利付国庫債券（２年） 日本	国債証券	100,000,000	100.28 100,281,000	100.22 100,229,000	0.100000 2020/5/15	8.56%
5	２１年度３５回　兵庫県公募公債 日本	地方債証券	40,000,000	101.14 40,457,200	100.69 40,277,200	1.460000 2020/1/22	3.44%
6	１１２回政保日本高速道路保有・債務返済機構 日本	特殊債券	30,000,000	101.51 30,455,700	101.14 30,343,500	1.100000 2020/7/31	2.59%
7	２７年度２回　千葉県公募公債 日本	地方債証券	14,670,000	100.18 14,697,726	100.13 14,690,097	0.177000 2020/5/25	1.25%
8	２７年度　京都府京都みらい債 日本	地方債証券	13,800,000	99.72 13,762,050	99.82 13,775,298	0.100000 2020/9/2	1.18%
9	４３回　川崎市公募公債　５年 日本	地方債証券	10,850,000	100.12 10,863,128	100.08 10,858,680	0.137000 2020/3/19	0.93%
10	３３１回　大阪府公募公債 日本	地方債証券	10,000,000	100.78 10,078,200	100.34 10,034,400	1.410000 2019/10/29	0.86%
11	２６年度　京都府京都みらい債 日本	地方債証券	9,200,000	99.94 9,194,848	99.98 9,198,252	0.160000 2019/9/2	0.79%

12	１００回政保日本高速道路保有・債務返済機構 日本	特殊債券	9,000,000	101.30 9,117,630	100.83 9,075,510	1.400000 2020/2/28	0.78%
13	９３回政保日本高速道路保有・債務返済機構 日本	特殊債券	8,000,000	100.94 8,075,600	100.47 8,038,240	1.400000 2019/11/29	0.69%
14	２６年度７回　福岡県公募公債 日本	地方債証券	6,500,000	99.92 6,495,255	99.96 6,497,725	0.200000 2019/12/25	0.55%
15	１１７回政保日本高速道路保有・債務返済機構 日本	特殊債券	6,000,000	101.56 6,093,780	101.22 6,073,200	1.000000 2020/9/30	0.52%
16	１３３回政保日本高速道路保有・債務返済機構 日本	特殊債券	5,000,000	102.79 5,139,500	102.35 5,117,600	1.300000 2021/4/30	0.44%
17	１３７回政保日本高速道路保有・債務返済機構 日本	特殊債券	4,000,000	102.78 4,111,440	102.38 4,095,440	1.200000 2021/6/30	0.35%
18	８９回政保日本高速道路保有・債務返済機構 日本	特殊債券	4,000,000	100.65 4,026,320	100.22 4,008,960	1.300000 2019/9/30	0.34%

（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	59.93%
地方債証券	9.00%
特殊債券	5.70%
合計	74.63%

（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 2.0 05/31/21 アメリカ	国債証券	1,303,680,000	98.92 1,289,665,440	100.16 1,305,765,888	2.000000 2021/5/31	0.74%
2	US T N/B 1.375 04/30/21 アメリカ	国債証券	1,217,854,400	97.62 1,188,966,893	99.12 1,207,198,174	1.375000 2021/4/30	0.69%
3	US T N/B 2.0 02/15/22 アメリカ	国債証券	1,200,472,000	98.65 1,184,337,656	100.44 1,205,862,119	2.000000 2022/2/15	0.69%
4	US T N/B 2.125 08/15/21 アメリカ	国債証券	1,195,040,000	99.14 1,184,858,259	100.54 1,201,517,116	2.125000 2021/8/15	0.68%
5	US T N/B 2.0 11/15/21 アメリカ	国債証券	1,129,856,000	98.77 1,116,037,861	100.39 1,134,352,826	2.000000 2021/11/15	0.64%
6	US T N/B 2.125 12/31/21 アメリカ	国債証券	1,122,251,200	99.04 1,111,544,923	100.68 1,129,961,065	2.125000 2021/12/31	0.64%
7	US T N/B 2.125 09/30/21 アメリカ	国債証券	1,086,400,000	99.11 1,076,807,088	100.59 1,092,842,352	2.125000 2021/9/30	0.62%
8	US T N/B 2.5 01/31/21 アメリカ	国債証券	1,065,758,400	99.96 1,065,346,239	100.86 1,074,955,894	2.500000 2021/1/31	0.61%
9	US T N/B 2.25 03/31/21 アメリカ	国債証券	1,060,326,400	99.49 1,054,939,941	100.56 1,066,327,847	2.250000 2021/3/31	0.61%
10	US T N/B 2.625 08/31/20 アメリカ	国債証券	1,004,920,000	100.13 1,006,286,691	100.67 1,011,703,210	2.625000 2020/8/31	0.57%
11	US T N/B 2.5 05/15/24 アメリカ	国債証券	977,760,000	100.03 978,063,105	102.99 1,007,014,579	2.500000 2024/5/15	0.57%
12	US T N/B 2.375 08/15/24 アメリカ	国債証券	966,896,000	99.31 960,243,755	102.48 990,913,696	2.375000 2024/8/15	0.56%
13	US T N/B 1.75 12/31/20 アメリカ	国債証券	977,760,000	98.63 964,384,243	99.74 975,237,379	1.750000 2020/12/31	0.55%
14	US T N/B 1.75 03/31/22 アメリカ	国債証券	961,464,000	97.87 941,032,890	99.81 959,733,364	1.750000 2022/3/31	0.55%
15	US T N/B 2.25 11/15/24 アメリカ	国債証券	933,217,600	98.56 919,797,930	101.92 951,144,710	2.250000 2024/11/15	0.54%
16	US T N/B 2.75 11/15/23 アメリカ	国債証券	899,539,200	101.18 910,216,730	103.75 933,334,887	2.750000 2023/11/15	0.53%
17	US T N/B 1.625 11/30/20 アメリカ	国債証券	924,526,400	98.44 910,150,014	99.59 920,763,577	1.625000 2020/11/30	0.52%
18	US T N/B 2.75 02/15/24 アメリカ	国債証券	873,465,600	101.24 884,314,042	103.96 908,124,715	2.750000 2024/2/15	0.52%
19	US T N/B 2.375 12/31/20 アメリカ	国債証券	901,712,000	99.73 899,313,446	100.62 907,374,751	2.375000 2020/12/31	0.52%
20	US T N/B 2.5 08/15/23 アメリカ	国債証券	869,120,000	100.09 869,928,281	102.60 891,725,811	2.500000 2023/8/15	0.51%
21	US T N/B 3.125 05/15/21 アメリカ	国債証券	869,120,000	101.36 880,966,105	102.16 887,892,992	3.125000 2021/5/15	0.50%
22	US T N/B 1.75 05/15/22 アメリカ	国債証券	881,070,400	97.76 861,378,476	99.81 879,449,230	1.750000 2022/5/15	0.50%
23	US T N/B 2.125 12/31/22 アメリカ	国債証券	869,120,000	98.70 857,847,513	101.01 877,941,568	2.125000 2022/12/31	0.50%

24	US T N/B 2.0 11/30/20 アメリカ	国債証券	860,428,800	99.08 852,555,876	100.09 861,228,998	2.000000 2020/11/30	0.49%
25	US T N/B 2.75 11/30/20 アメリカ	国債証券	851,737,600	100.40 855,161,585	101.07 860,885,261	2.750000 2020/11/30	0.49%
26	US T N/B 2.0 02/15/23 アメリカ	国債証券	830,009,600	98.20 815,094,327	100.60 834,997,957	2.000000 2023/2/15	0.47%
27	US T N/B 1.875 08/31/22 アメリカ	国債証券	831,096,000	97.98 814,341,104	100.17 832,517,174	1.875000 2022/8/31	0.47%
28	US T N/B 2.875 05/15/28 アメリカ	国債証券	773,516,800	101.88 788,136,267	106.82 826,332,527	2.875000 2028/5/15	0.47%
29	US T N/B 2.125 06/30/22 アメリカ	国債証券	805,022,400	98.88 796,022,249	100.90 812,315,902	2.125000 2022/6/30	0.46%
30	US T N/B 2.0 02/15/25 アメリカ	国債証券	806,108,800	97.05 782,360,834	100.63 811,267,896	2.000000 2025/2/15	0.46%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資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	97.58%
合計	97.58%

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

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。

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（参考）

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

令和1年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。

ＤＩＡＭマネーマザーファンド

該当事項はありません。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和1年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２０１９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０８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２０１９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０８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 ＥＭＩＮＩ ＦＵＴ Ｓｅｐ１９	買建	247	3,992,761,724	4,041,547,874	1.16%
	ＥＵＲＥＸ取引所	ＤＪ ＥＵＲＯ ＳＴＯＸＸ ５０ Ｓｅｐ１９	買建	225	950,279,875	943,191,472	0.27%
	ＩＣＥ－ＥＵ	ＦＴＳＥ １００ ＩＮＤＥＸ ＦＵＴＵＲＥ 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 ６０ ＩＸ ＦＵＴ Ｓｅｐ１９	買建	13	211,671,574	210,621,665	0.06%
	シドニー先物取引所	ＳＰＩ ２００ ＦＵＴＵＲＥＳ Ｓｅｐ１９	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	5,211,283	566,060,000	566,049,577	△0.32%
		イギリス・ポンド売／円買２０１９年０８月	売建	339,794	44,840,000	44,839,320	△0.03%
		カナダ・ドル売／円買２０１９年０８月	売建	342,245	28,290,000	28,289,999	△0.02%
		ユーロ売／円買２０１９年０８月	売建	167,751	20,330,000	20,329,832	△0.01%

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。
（注2）為替予約取引の時価は、原則としてわが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しています。
為替予約取引の数量は、現地通貨建契約金額です。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

令和1年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　Ｓｅｐ１９	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】

①【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特定期間又は計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額（分配落）（百万円）	純資産総額（分配付）（百万円）	１口当たりの純資産額（分配落）(円)	１口当たりの純資産額（分配付）(円)
第1特定期間末(平成25年1月11日)	54	54	1.0953	1.0953
第2特定期間末(平成25年7月11日)	57	57	1.1501	1.1501
第4計算期間末(平成26年1月14日)	836	836	1.1801	1.1801
第5計算期間末(平成26年7月11日)	4,833	4,833	1.1888	1.1888
第6計算期間末(平成27年1月13日)	7,664	7,664	1.2660	1.2660
第7計算期間末(平成27年7月13日)	16,373	16,373	1.2816	1.2816
第8計算期間末(平成28年1月12日)	29,373	29,373	1.2200	1.2200
第9計算期間末(平成28年7月11日)	30,524	30,524	1.1796	1.1796
第10計算期間末(平成29年1月11日)	33,083	33,083	1.2331	1.2331
第11計算期間末(平成29年7月11日)	32,461	32,461	1.2524	1.2524
第12計算期間末(平成30年1月11日)	28,678	28,678	1.2864	1.2864
第13計算期間末(平成30年7月11日)	27,026	27,026	1.2537	1.2537
第14計算期間末(平成31年1月11日)	24,449	24,449	1.2062	1.2062
第15計算期間末(令和1年7月11日)	22,938	22,938	1.2287	1.2287
平成30年7月末日	26,900	－	1.2555	－
8月末日	26,422	－	1.2440	－
9月末日	26,140	－	1.2496	－
10月末日	25,248	－	1.2193	－
11月末日	25,158	－	1.2214	－
12月末日	24,503	－	1.2066	－
平成31年1月末日	24,519	－	1.2154	－
2月末日	24,616	－	1.2307	－
3月末日	24,135	－	1.2356	－
4月末日	23,807	－	1.2443	－
令和1年5月末日	23,175	－	1.2259	－
6月末日	23,047	－	1.2282	－

7月末日	22,656	－	1.2270	－

②【分配の推移】

	１口当たりの分配金(円)
第1特定期間	0.0000
第2特定期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
第9計算期間	0.0000
第10計算期間	0.0000
第11計算期間	0.0000
第12計算期間	0.0000
第13計算期間	0.0000
第14計算期間	0.0000
第15計算期間	0.0000

③【収益率の推移】

	収益率(%)
第1特定期間	9.5
第2特定期間	5.0
第4計算期間	2.6
第5計算期間	0.7
第6計算期間	6.5
第7計算期間	1.2
第8計算期間	△4.8
第9計算期間	△3.3
第10計算期間	4.5
第11計算期間	1.6
第12計算期間	2.7
第13計算期間	△2.5
第14計算期間	△3.8
第15計算期間	1.9

（注）各特定期間又は計算期間の収益率は、特定期間又は計算期間末の基準価額（分配落の額）に当該特定期間又は計算期間の分配金を加算し、当該特定期間又は計算期間の直前の特定期間又は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特定期間については、前期末基準価額の代わりに、設定時の基準価額10,000円（1万口当たり）を用いております。
なお、小数点以下２桁目を四捨五入し、小数点以下１桁目まで表示しております。

（４）【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数
第1特定期間	50,000,000	0
第2特定期間	0	0
第4計算期間	719,575,072	60,468,768
第5計算期間	3,546,694,011	190,033,935
第6計算期間	3,178,106,719	1,190,093,443
第7計算期間	8,113,284,548	1,391,102,184
第8計算期間	12,475,200,872	1,174,643,755
第9計算期間	4,218,169,651	2,417,079,166
第10計算期間	3,726,999,882	2,774,409,766
第11計算期間	2,943,838,417	3,853,950,424
第12計算期間	2,426,808,751	6,053,103,346
第13計算期間	2,339,206,033	3,075,836,809
第14計算期間	967,336,189	2,254,647,937
第15計算期間	639,297,067	2,240,826,501

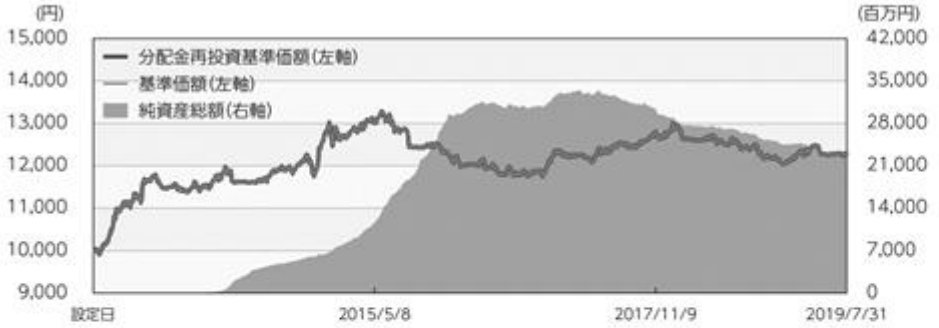
（注1） 本邦外における設定及び解約はございません。

（注2） 第1特定期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

＜＜参考情報＞＞

データの基準日:2019年7月31日

基準価額・純資産の推移 (2012年10月26日～2019年7月31日)



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。
※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額とは異なります。
(設定日:2012年10月26日)
※設定時から10年以上経過した場合は、直近10年分を記載しています。

分配の推移(税引前)

第11期(2017.07.11)	0円
第12期(2018.01.11)	0円
第13期(2018.07.11)	0円
第14期(2019.01.11)	0円
第15期(2019.07.11)	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たりです。

主要な資産の状況

■組入銘柄

※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

順位	銘柄名	比率(%)
1	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	16.48
2	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	10.98
3	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	10.87
4	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	5.53
5	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	5.51
6	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	5.47
7	DIAMマネーマザーファンド	4.41

■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

■外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還期限	比率(%)
1	US T N/B 2.0 05/31/21	国債証券	アメリカ	2.000000	2021/5/31	0.74
2	US T N/B 1.375 04/30/21	国債証券	アメリカ	1.375000	2021/4/30	0.69
3	US T N/B 2.0 02/15/22	国債証券	アメリカ	2.000000	2022/2/15	0.69
4	US T N/B 2.125 08/15/21	国債証券	アメリカ	2.125000	2021/8/15	0.68
5	US T N/B 2.0 11/15/21	国債証券	アメリカ	2.000000	2021/11/15	0.64

○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。

■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

■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

■DIAMマネーマザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還期限	比率(%)
1	123回　利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.100000	2020/3/20	25.67
2	391回　利付国庫債券(2年)	国債証券	日本	0.100000	2020/8/1	17.13
3	392回　利付国庫債券(2年)	国債証券	日本	0.100000	2020/9/1	8.57
4	388回　利付国庫債券(2年)	国債証券	日本	0.100000	2020/5/15	8.56
5	21年度35回　兵庫県公募公債	地方債証券	日本	1.460000	2020/1/22	3.44

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。
※2012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。

第２【管理及び運営】

１【申込（販売）手続等】

お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

当ファンドでは、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」に従い分配金再投資に関する契約を締結します。なお、販売会社によっては、当該契約または規定について同様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約または規定を使用することがあり、この場合、当該別の名称に読み替えるものとします。

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

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

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

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

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

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

・お申込価額

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1万口当たりに換算した基準価額で表示することがあります。)

＜基準価額の照会方法等＞

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

※当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

・販売会社へのお問い合わせ

・委託会社への照会

ホームページ　URL　http://www.am-one.co.jp/

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

・お申込手数料

お申込日の翌営業日の基準価額に、3.3%(税抜3.00%)を上限に各販売会社が定める手数料率を乗じて得た額とします。

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

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

※詳しくは販売会社にお問い合わせください。

・お申込単位

各販売会社が定める単位とします。

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

※取扱コースおよびお申込単位は、販売会社にお問い合わせください。

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

※当初元本は1口当たり1円です。

・払込期日

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

2【換金（解約）手続等】

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

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

※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、販売会社に対し振替受益権をもって行うものとします。

※海外休業日には、解約の受付を行いません。

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

・解約価額

解約価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

※当ファンドの解約価額は、以下の方法でご確認ください。

・販売会社へのお問い合わせ

・委託会社への照会

ホームページ　URL　http://www.am-one.co.jp/

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

・解約単位

各販売会社が定める単位とします。

※解約単位は販売会社にお問い合わせください。

・解約代金の受渡日

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

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

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

＜主な投資対象の時価評価方法の原則＞

投資対象	評価方法
マザーファンド 受益証券	計算日の基準価額
株式	計算日※における金融商品取引所等の最終相場
公社債等	計算日※における以下のいずれかの価額 ・日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値） ・金融商品取引業者、銀行などの提示する価額（売り気配相場を除きます。） ・価格情報会社の提供する価額
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。

※ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

・販売会社への問い合わせ

・委託会社への照会

ホームページ　URL　http://www.am-one.co.jp/

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

（2）【保管】

該当事項はありません。

（3）【信託期間】

信託期間は、2012年10月26日（設定日）から原則として無期限です。

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

（4）【計算期間】

a.計算期間は、原則として毎年1月12日から7月11日まで、7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、受益権口数が10億口を下回ることとなった場合、マザーファンドのベンチマークである対象インデックスが改廃された場合、またはやむを得ない事情が発生した場合は、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

b.委託会社は、上記a.の事項について、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日および信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託契約にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。

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、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

d.上記b.の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。

e.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も同様とします。

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。受託会社がその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を申立てることができます。受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は下記「ロ．信託約款の変更等」の規定にしたがい、新受託会社を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託会社を解任することはできないものとします。委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は信託契約を解約し、信託を終了させます。

i.この信託は、受益者が一部解約請求を行ったときは、委託会社が信託契約の一部の解約をすることにより当該請求に応じ、当該受益権の公正な価格が当該受益者に一部解約金として支払われることとなる委託者指図型投資信託に該当するため、信託契約の解約を行う場合において、

投資信託及び投資法人に関する法律第18条第1項に定める反対受益者による受益権買取請求の規定の適用を受けません。

ロ.信託約款の変更等

a.委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、約款を変更することまたはこの信託と他の投資信託との併合（投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。）を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届出ます。なお、約款はa.からg.に定める以外の方法によって変更することができないものとします。

b.委託会社は、上記a.の事項（上記a.の変更事項にあっては、その内容が重大なものに該当する場合に限り、上記a.の併合事項にあっては、その併合が受益者の利益におよぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下、「重大な約款の変更等」といいます。）について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、約款にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。

c.上記b.の書面決議において、受益者（委託会社およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

d.上記b.の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。

e.書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。

f.上記b.からe.までの規定は、委託会社が重大な約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、約款にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。

g.上記a.からf.の規定にかかわらず、この信託において併合の書面決議が可決された場合にあっても、当該併合にかかる一または複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。

h.委託会社は、監督官庁の命令に基づいて約款を変更しようとするときは、上記a.からg.の規定にしたがいます。

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

ハ. 関係法人との契約の更改

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

投資顧問契約について、委託会社と投資顧問会社との間の当該契約は、いずれの当事者からも別段の意思表示がない限り、信託終了日まで存続します。当該契約は、当事者間の合意により変更することができます。

ニ．公告

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

（URL　http://www.am-one.co.jp/）

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

ホ．運用報告書

・委託会社は、毎年1月11日、7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、委託会社が受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。

収益分配金は、決算日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）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、委託会社が受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。

償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため、委託会社または販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）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、解約の請求をすることができます。

④帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

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

第３【ファンドの経理状況】

（１）当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

（２）当ファンドの計算期間は6ヵ月であるため、財務諸表は6ヵ月ごとに作成しております。

（３）当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第15期計算期間（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】

【クルーズコントロール】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第14期 平成31年1月11日現在	第15期 令和1年7月11日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	21,243,556,581	18,677,948,428
親投資信託受益証券	3,433,246,335	4,474,169,581
流動資産合計	24,676,802,916	23,152,118,009
資産合計	24,676,802,916	23,152,118,009
負債の部		
流動負債		
未払解約金	30,126,126	33,871,518
未払受託者報酬	7,013,696	6,408,594
未払委託者報酬	189,371,049	173,033,182
その他未払費用	484,202	446,948
流動負債合計	226,995,073	213,760,242
負債合計	226,995,073	213,760,242
純資産の部		
元本等		
元本	※1 20,269,850,612	※1 18,668,321,178
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	4,179,957,231	4,270,036,589
（分配準備積立金）	745,924,010	762,081,214
元本等合計	24,449,807,843	22,938,357,767
純資産合計	24,449,807,843	22,938,357,767
負債純資産合計	24,676,802,916	23,152,118,009

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第14期 自　平成30年7月12日 至　平成31年1月11日	第15期 自　平成31年1月12日 至　令和1年7月11日
営業収益		
有価証券売買等損益	△783,445,386	647,923,246
営業収益合計	△783,445,386	647,923,246
営業費用		
支払利息	6,150,214	4,414,277
受託者報酬	7,013,696	6,408,594
委託者報酬	189,371,049	173,033,182
その他費用	495,002	446,948
営業費用合計	203,029,961	184,303,001
営業利益又は営業損失（△）	△986,475,347	463,620,245
経常利益又は経常損失（△）	△986,475,347	463,620,245
当期純利益又は当期純損失（△）	△986,475,347	463,620,245
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（△）	△38,963,648	56,765,994
期首剰余金又は期首欠損金（△）	5,469,405,581	4,179,957,231
剰余金増加額又は欠損金減少額	229,685,246	146,037,407
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	229,685,246	146,037,407
剰余金減少額又は欠損金増加額	571,621,897	462,812,300
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	571,621,897	462,812,300
分配金	※1 ―	※1 ―
期末剰余金又は期末欠損金（△）	4,179,957,231	4,270,036,589

（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。

（貸借対照表に関する注記）

項目			第14期 平成31年1月11日現在	第15期 令和1年7月11日現在
１．	※１	期首元本額	21,557,162,360円	20,269,850,612円
		期中追加設定元本額	967,336,189円	639,297,067円
		期中一部解約元本額	2,254,647,937円	2,240,826,501円
２．		受益権の総数	20,269,850,612口	18,668,321,178口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目			第14期 自　平成30年7月12日 至　平成31年1月11日	第15期 自　平成31年1月12日 至　令和1年7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（0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（4,939,816,142円）及び分配準備積立金（745,924,010円）より分配対象収益は5,685,740,152円（1万口当たり2,805.02円）でありますが、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（97,256,343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（4,572,027,950円）及び分配準備積立金（664,824,871円）より分配対象収益は5,334,109,164円（1万口当たり2,857.31円）でありますが、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14期 自　平成30年7月12日 至　平成31年1月11日	第15期 自　平成31年1月12日 至　令和1年7月11日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、主要投資対象である親投資信託受益証券が保有する金融商品に係る、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	同左
３．　金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	第14期 平成31年1月11日現在	第15期 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）

売買目的有価証券

種類	第14期 平成31年1月11日現在	第15期 令和1年7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	△98,591,461	149,248,555
合計	△98,591,461	149,248,555

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	第14期 平成31年1月11日現在	第15期 令和1年7月11日現在
1口当たり純資産額	1.2062円	1.2287円
（1万口当たり純資産額）	(12,062円)	(12,287円)

（４）【附属明細表】

第１　有価証券明細表

（１）株式

該当事項はありません。

（２）株式以外の有価証券

令和1年7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	278,945,492	688,967,470	
	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	529,226,407	701,701,293	
	ＤＩＡＭマネーマザーファンド	990,000,991	999,802,000	
	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	95,795,914	353,189,955	
	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	564,358,224	1,044,288,457	
	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	285,779,318	327,360,208	
	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	183,260,238	358,860,198	
親投資信託受益証券　合計		2,927,366,584	4,474,169,581	
合計		2,927,366,584	4,474,169,581	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

当ファンドは、「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」受益証券、「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「ＤＩＡＭマネーマザーファンド」受益証券、「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「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	112,611,312,358円	112,565,679,213円
同期中追加設定元本額	21,121,248,870円	13,644,584,572円
同期中一部解約元本額	21,166,882,015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
ＤＩＡＭ国内株式インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	38,449,340,503円	37,799,529,212円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型	930,601,954円	996,067,259円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型	3,152,850,618円	3,288,639,230円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型	3,152,192,254円	3,386,203,253円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド	353,322,394円	375,253,708円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド	1,167,901,061円	1,225,800,108円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０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　エボリューション	25,501,335円	26,814,455円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	286,731,745円	315,726,619円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	194,305,090円	219,871,828円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	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＜ＤＣ年金＞	199,016,808円	244,354,937円

ＤＩＡＭ　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	
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（堅実型）	1,884,210円	3,430,634円	
ＤＩＡＭ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	474,143円	546,021円	
リスク抑制世界８資産バランスファンド	478,027,309円	1,166,155,599円	
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	1,678,361円	2,216,483円	
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	1,302,352円	1,870,434円	
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	172,989円	605,890円	
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	2,584,094円	2,810,942円	
４資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	15,567,413円	21,934,983円	
リスクコントロール世界資産分散ファンド	140,293,071円	176,144,529円	
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	18,666円	35,296,598円	
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	－円	375,930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	125,361円	
ＤＩＡＭワールドバランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	72,428,537円	70,055,528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）	24,452,480円	679,077,334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）	121,667,701円	109,413,294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）	288,407,783円	272,840,706円	
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	15,671,232円	15,505,897円	

ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	66,509,812円	58,384,104円	
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	17,420,446円	16,580,518円	
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	14,049,764円	14,034,027円	
ＤＩＡＭ世界バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	31,643,366円	32,336,451円	
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	57,429,940円	62,390,364円	
ＤＩＡＭバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,088,244,722円	985,364,008円	
ＤＩＡＭバランスファンド３７．５ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,015,093,457円	953,313,403円	
ＤＩＡＭバランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,796,988,287円	2,672,479,679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）	199,320,662円	192,506,361円	
ＤＩＡＭグローバル・アセット・バランスＶＡ２（適格機関投資家限定）	54,728,686円	52,605,140円	
ＤＩＡＭ　アクサ　グローバル　バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	585,876,895円	530,814,269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）	387,173,977円	279,805,676円	
ＤＩＡＭグローバルβ私募ファンド（適格機関投資家向け）	10,313,671円	10,473,598円	
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	7,969,631円	3,389,647円	
ＤＩＡＭ世界バランスファンド３５ＶＡ（適格機関投資家限定）	52,147,134円	43,136,239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）	9,938,959,954円	4,733,197,994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）	195,148,097円	63,068,248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）	1,880,011,203円	904,582,818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）	10,784,276,752円	6,878,405,259円
	ＤＩＡＭバランス３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	5,201,125円	5,084,371円
	ＤＩＡＭバランス５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	118,453円	307,690円
	ＤＩＡＭバランス７０ＶＡ（適格機関投資家限定）	4,011,960円	294,829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）	9,606,107,157円	9,392,319,338円
	ＤＩＡＭ世界バランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	69,426,099円	64,552,277円
	ＤＩＡＭ国内バランス３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	29,836,616円	26,242,103円
	ＤＩＡＭバランス２０ＶＡ（適格機関投資家限定）	27,655,542円	27,057,655円
	ＤＩＡＭバランス４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	109,220円	111,785円
	ＤＩＡＭバランス６０ＶＡ（適格機関投資家限定）	121,295円	125,891円
	ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド７ＶＡ（１２１２）（適格機関投資家限定）	426,124,037円	426,124,037円
	ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド７ＶＡ（１３０３）（適格機関投資家限定）	1,366,625,210円	1,335,152,689円
	ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド７ＶＡ（１３０６）（適格機関投資家限定）	1,837,729,242円	1,766,916,070円
	ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド７ＶＡ（１３０９）（適格機関投資家限定）	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）

１．金融商品の状況に関する事項

項目	自　平成30年7月12日 至　平成31年1月11日	自　平成31年1月12日 至　令和1年7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 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成31年1月11日現在 当期の損益に含まれた評価差額（円）	令和1年7月11日現在 当期の損益に含まれた評価差額（円）
株式	△34,734,987,130	1,624,841,507
合計	△34,734,987,130	1,624,841,507

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成30年2月8日から平成31年1月11日まで及び平成31年2月8日から令和1年7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。

（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）	2.3618円 (23,618円)	2.4699円 (24,699円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

（１）株式

令和1年7月11日現在

銘　柄	株　式　数	評価額（円）		備考
		単　価	金　額	
極洋	5,000	3,065.00	15,325,000	
日本水産	153,300	711.00	108,996,300	
マルハニチロ	22,200	3,290.00	73,038,000	
ホウスイ	900	842.00	757,800	
カネコ種苗	4,600	1,328.00	6,108,800	
サカタのタネ	18,600	3,335.00	62,031,000	
ホクト	12,800	1,879.00	24,051,200	
ホクリヨウ	2,100	607.00	1,274,700	
ヒノキヤグループ	4,400	2,160.00	9,504,000	
ショーボンドホールディングス	21,800	3,915.00	85,347,000	
ミライト・ホールディングス	43,200	1,682.00	72,662,400	
タマホーム	7,500	1,254.00	9,405,000	
サンヨーホームズ	2,400	690.00	1,656,000	
日本アクア	4,000	636.00	2,544,000	
ファーストコーポレーション	4,600	649.00	2,985,400	
ベステラ	3,100	1,305.00	4,045,500	
ＴＡＴＥＲＵ	19,200	207.00	3,974,400	
スペースバリューホールディングス	19,000	517.00	9,823,000	
住石ホールディングス	34,600	137.00	4,740,200	
日鉄鉱業	3,600	4,680.00	16,848,000	
三井松島ホールディングス	6,400	1,345.00	8,608,000	
国際石油開発帝石	614,000	995.80	611,421,200	
石油資源開発	22,000	2,522.00	55,484,000	
Ｋ＆Ｏエナジーグループ	7,400	1,588.00	11,751,200	
ダイセキ環境ソリューション	3,200	667.00	2,134,400	
第一カッター興業	1,900	1,787.00	3,395,300	
安藤・間	98,300	746.00	73,331,800	
東急建設	44,800	755.00	33,824,000	
コムシスホールディングス	54,300	2,759.00	149,813,700	
ミサワホーム	12,200	1,039.00	12,675,800	
ビーアールホールディングス	13,000	351.00	4,563,000	
高松コンストラクショングループ	9,500	2,302.00	21,869,000	
東建コーポレーション	4,800	6,450.00	30,960,000	
ソネック	1,700	809.00	1,375,300	
ヤマウラ	6,200	847.00	5,251,400	
大成建設	125,700	3,935.00	494,629,500	
大林組	378,700	1,083.00	410,132,100	
清水建設	386,500	894.00	345,531,000	
飛島建設	10,800	1,314.00	14,191,200	
長谷工コーポレーション	157,900	1,177.00	185,848,300	
松井建設	13,800	639.00	8,818,200	
錢高組	1,500	4,525.00	6,787,500	
鹿島建設	296,100	1,476.00	437,043,600	

不動テトラ	8,800	1,350.00	11,880,000	
大末建設	4,700	948.00	4,455,600	
鉄建建設	7,700	3,025.00	23,292,500	
西松建設	27,100	2,141.00	58,021,100	
三井住友建設	91,100	602.00	54,842,200	
大豊建設	8,600	2,772.00	23,839,200	
前田建設工業	90,000	869.00	78,210,000	
佐田建設	8,300	382.00	3,170,600	
ナカノフドー建設	9,900	435.00	4,306,500	
奥村組	20,800	3,335.00	69,368,000	
東鉄工業	15,100	3,030.00	45,753,000	
イチケン	2,400	1,727.00	4,144,800	
富士ピー・エス	4,300	489.00	2,102,700	
淺沼組	4,600	3,550.00	16,330,000	
戸田建設	146,700	614.00	90,073,800	
熊谷組	18,000	3,115.00	56,070,000	
青木あすなろ建設	6,100	884.00	5,392,400	
北野建設	2,700	2,692.00	7,268,400	
植木組	1,500	2,230.00	3,345,000	
矢作建設工業	16,900	748.00	12,641,200	
ピーエス三菱	13,600	610.00	8,296,000	
日本ハウスホールディングス	24,400	443.00	10,809,200	
大東建託	45,000	14,275.00	642,375,000	
新日本建設	15,000	912.00	13,680,000	
ＮＩＰＰＯ	33,400	2,138.00	71,409,200	
東亜道路工業	2,400	3,310.00	7,944,000	
前田道路	39,500	2,327.00	91,916,500	
日本道路	3,500	6,310.00	22,085,000	
東亜建設工業	11,000	1,563.00	17,193,000	
日本国土開発	21,100	539.00	11,372,900	
若築建設	6,400	1,458.00	9,331,200	
東洋建設	46,100	419.00	19,315,900	
五洋建設	150,400	529.00	79,561,600	
世紀東急工業	18,700	642.00	12,005,400	
福田組	4,100	4,570.00	18,737,000	
日本ドライケミカル	3,300	1,154.00	3,808,200	
住友林業	89,300	1,314.00	117,340,200	
日本基礎技術	13,500	346.00	4,671,000	
巴コーポレーション	15,900	380.00	6,042,000	
大和ハウス工業	349,800	3,203.00	1,120,409,400	
ライト工業	24,400	1,456.00	35,526,400	
積水ハウス	386,500	1,849.00	714,638,500	
日特建設	11,100	606.00	6,726,600	
北陸電気工事	6,100	901.00	5,496,100	
ユアテック	20,100	774.00	15,557,400	
四電工	1,900	2,715.00	5,158,500	
中電工	16,100	2,357.00	37,947,700	
関電工	57,300	937.00	53,690,100	
きんでん	83,900	1,664.00	139,609,600	
東京エネシス	13,000	951.00	12,363,000	

トーエネック	3,600	3,380.00	12,168,000	
住友電設	8,700	1,803.00	15,686,100	
日本電設工業	21,500	2,191.00	47,106,500	
協和エクシオ	49,500	2,655.00	131,422,500	
新日本空調	10,600	1,743.00	18,475,800	
日本工営	7,300	2,396.00	17,490,800	
九電工	24,900	3,370.00	83,913,000	
三機工業	28,500	1,226.00	34,941,000	
日揮	108,800	1,525.00	165,920,000	
中外炉工業	3,600	1,660.00	5,976,000	
ヤマト	11,500	587.00	6,750,500	
太平電業	8,500	2,303.00	19,575,500	
高砂熱学工業	30,600	1,789.00	54,743,400	
三晃金属工業	1,500	2,448.00	3,672,000	
ＮＥＣネッツエスアイ	12,200	2,816.00	34,355,200	
朝日工業社	2,700	2,763.00	7,460,100	
明星工業	22,700	741.00	16,820,700	
大氣社	17,200	3,380.00	58,136,000	
ダイダン	8,400	2,356.00	19,790,400	
日比谷総合設備	11,400	1,911.00	21,785,400	
東芝プラントシステム	27,300	2,025.00	55,282,500	
日本製粉	35,700	1,779.00	63,510,300	
日清製粉グループ本社	127,700	2,489.00	317,845,300	
日東富士製粉	800	5,880.00	4,704,000	
昭和産業	10,300	3,175.00	32,702,500	
鳥越製粉	10,300	863.00	8,888,900	
中部飼料	13,800	1,304.00	17,995,200	
フィード・ワン	76,600	195.00	14,937,000	
東洋精糖	1,800	1,020.00	1,836,000	
日本甜菜製糖	6,300	2,085.00	13,135,500	
三井製糖	8,900	2,299.00	20,461,100	
塩水港精糖	12,800	212.00	2,713,600	
日新製糖	5,200	2,006.00	10,431,200	
ＬＩＦＵＬＬ	37,800	513.00	19,391,400	
ジェイエイシーリクルートメント	8,700	2,554.00	22,219,800	
日本M&Aセンター	80,400	2,688.00	216,115,200	
メンバーズ	3,800	1,951.00	7,413,800	
中広	1,100	627.00	689,700	
タケエイ	11,600	972.00	11,275,200	
Ｅ・Ｊホールディングス	1,400	1,080.00	1,512,000	
トラスト・テック	11,000	1,584.00	17,424,000	
コシダカホールディングス	26,000	1,532.00	39,832,000	
アルトナー	2,100	793.00	1,665,300	
パソナグループ	13,200	1,622.00	21,410,400	
ＣＤＳ	2,900	1,340.00	3,886,000	
リンクアンドモチベーション	20,100	611.00	12,281,100	
ＧＣＡ	11,200	720.00	8,064,000	
エス・エム・エス	39,700	2,568.00	101,949,600	
パーソルホールディングス	107,800	2,570.00	277,046,000	
リニカル	6,100	1,064.00	6,490,400	

クックパッド	34,700	339.00	11,763,300	
エスクリ	3,300	759.00	2,504,700	
アイ・ケイ・ケイ	5,500	711.00	3,910,500	
森永製菓	28,400	5,400.00	153,360,000	
中村屋	3,000	4,440.00	13,320,000	
江崎グリコ	34,100	4,775.00	162,827,500	
名糖産業	5,500	1,441.00	7,925,500	
井村屋グループ	4,900	2,113.00	10,353,700	
不二家	6,200	1,999.00	12,393,800	
山崎製パン	92,600	1,687.00	156,216,200	
第一屋製パン	2,000	990.00	1,980,000	
モロゾフ	1,900	5,130.00	9,747,000	
亀田製菓	7,000	5,040.00	35,280,000	
寿スピリッツ	12,100	6,050.00	73,205,000	
カルビー	51,500	3,060.00	157,590,000	
森永乳業	22,700	4,410.00	100,107,000	
六甲バター	8,300	1,833.00	15,213,900	
ヤクルト本社	83,900	6,370.00	534,443,000	
明治ホールディングス	80,200	7,650.00	613,530,000	
雪印メグミルク	27,200	2,400.00	65,280,000	
プリマハム	15,900	2,107.00	33,501,300	
日本ハム	46,800	4,585.00	214,578,000	
林兼産業	3,900	657.00	2,562,300	
丸大食品	12,100	2,053.00	24,841,300	
Ｓ　Ｆｏｏｄｓ	10,200	3,865.00	39,423,000	
伊藤ハム米久ホールディングス	72,500	742.00	53,795,000	
学情	4,600	1,193.00	5,487,800	
スタジオアリス	5,300	2,067.00	10,955,100	
クロスキャット	3,100	998.00	3,093,800	
シミックホールディングス	6,000	2,157.00	12,942,000	
システナ	39,600	1,865.00	73,854,000	
ＮＪＳ	2,600	1,712.00	4,451,200	
デジタルアーツ	5,900	10,270.00	60,593,000	
日鉄ソリューションズ	16,600	3,505.00	58,183,000	
綜合警備保障	43,000	5,020.00	215,860,000	
キューブシステム	6,100	838.00	5,111,800	
いちご	141,600	333.00	47,152,800	
エイジア	2,400	1,228.00	2,947,200	
日本駐車場開発	123,200	185.00	22,792,000	
コア	4,900	1,652.00	8,094,800	
カカクコム	80,800	2,253.00	182,042,400	
アイロムグループ	4,200	1,702.00	7,148,400	
セントケア・ホールディング	6,200	510.00	3,162,000	
サイネックス	1,800	645.00	1,161,000	
ルネサンス	6,000	1,794.00	10,764,000	
ディップ	17,500	1,849.00	32,357,500	
ＳＢＳホールディングス	11,200	1,540.00	17,248,000	
オプトホールディング	6,600	1,718.00	11,338,800	
新日本科学	14,800	740.00	10,952,000	
ツクイ	25,500	538.00	13,719,000	

キャリアデザインセンター	2,900	1,635.00	4,741,500	
ベネフィット・ワン	30,000	1,893.00	56,790,000	
エムスリー	226,900	2,047.00	464,464,300	
ツカダ・グローバルホールディング	6,500	594.00	3,861,000	
ブラス	800	724.00	579,200	
アウトソーシング	57,000	1,363.00	77,691,000	
ウェルネット	10,400	985.00	10,244,000	
ワールドホールディングス	3,100	1,731.00	5,366,100	
ディー・エヌ・エー	58,200	2,194.00	127,690,800	
博報堂ＤＹホールディングス	149,800	1,810.00	271,138,000	
ぐるなび	15,300	675.00	10,327,500	
タカミヤ	11,600	764.00	8,862,400	
ジャパンベストレスキューシステム	7,400	1,503.00	11,122,200	
ファンコミュニケーションズ	29,900	574.00	17,162,600	
ライク	4,400	1,514.00	6,661,600	
ビジネス・ブレークスルー	4,900	366.00	1,793,400	
ＷＤＢホールディングス	4,900	2,771.00	13,577,900	
ティア	5,300	650.00	3,445,000	
ＣＤＧ	1,000	1,394.00	1,394,000	
バリューコマース	7,300	2,369.00	17,293,700	
インフォマート	59,100	1,621.00	95,801,100	
サッポロホールディングス	41,300	2,396.00	98,954,800	
アサヒグループホールディングス	237,000	5,000.00	1,185,000,000	
キリンホールディングス	511,800	2,344.00	1,199,659,200	
宝ホールディングス	84,800	1,163.00	98,622,400	
オエノンホールディングス	32,500	387.00	12,577,500	
養命酒製造	3,500	2,031.00	7,108,500	
コカ・コーラ　ボトラーズジャパンホールディングス	86,600	2,751.00	238,236,600	
サントリー食品インターナショナル	75,700	4,705.00	356,168,500	
ダイドーグループホールディングス	6,300	4,745.00	29,893,500	
伊藤園	34,500	5,110.00	176,295,000	
キーコーヒー	11,100	2,175.00	24,142,500	
ユニカフェ	3,300	982.00	3,240,600	
ジャパンフーズ	1,700	1,220.00	2,074,000	
日清オイリオグループ	14,600	3,120.00	45,552,000	
不二製油グループ本社	27,600	3,370.00	93,012,000	
かどや製油	1,200	4,130.00	4,956,000	
Ｊ－オイルミルズ	5,800	4,065.00	23,577,000	
ローソン	28,000	5,400.00	151,200,000	
サンエー	8,400	4,580.00	38,472,000	
カワチ薬品	8,600	2,037.00	17,518,200	
エービーシー・マート	17,300	6,700.00	115,910,000	
ハードオフコーポレーション	4,600	705.00	3,243,000	
高千穂交易	4,500	1,066.00	4,797,000	
アスクル	11,700	2,354.00	27,541,800	
ゲオホールディングス	16,900	1,556.00	26,296,400	
アダストリア	15,300	2,126.00	32,527,800	
ジーフット	6,300	668.00	4,208,400	
シー・ヴイ・エス・ベイエリア	1,500	714.00	1,071,000	

伊藤忠食品	2,800	4,765.00	13,342,000	
くら寿司	6,500	4,375.00	28,437,500	
キャンドゥ	5,400	1,666.00	8,996,400	
エレマテック	10,300	1,054.00	10,856,200	
パルグループホールディングス	5,600	3,615.00	20,244,000	
ＪＡＬＵＸ	3,300	2,814.00	9,286,200	
エディオン	47,000	1,063.00	49,961,000	
あらた	8,200	3,790.00	31,078,000	
サーラコーポレーション	22,400	619.00	13,865,600	
ワッツ	3,900	698.00	2,722,200	
トーメンデバイス	1,700	2,333.00	3,966,100	
ハローズ	4,200	2,347.00	9,857,400	
ＪＰホールディングス	31,200	293.00	9,141,600	
フジオフードシステム	4,700	2,583.00	12,140,100	
あみやき亭	2,500	3,550.00	8,875,000	
東京エレクトロン　デバイス	4,100	2,011.00	8,245,100	
ひらまつ	22,500	382.00	8,595,000	
フィールズ	9,900	539.00	5,336,100	
双日	613,400	351.00	215,303,400	
アルフレッサ　ホールディングス	123,300	2,777.00	342,404,100	
大黒天物産	2,700	3,505.00	9,463,500	
ハニーズホールディングス	9,900	1,375.00	13,612,500	
ファーマライズホールディングス	2,800	524.00	1,467,200	
キッコーマン	74,600	4,815.00	359,199,000	
味の素	249,900	1,882.00	470,311,800	
キユーピー	63,000	2,523.00	158,949,000	
ハウス食品グループ本社	42,300	4,185.00	177,025,500	
カゴメ	45,200	2,498.00	112,909,600	
焼津水産化学工業	5,500	1,107.00	6,088,500	
アリアケジャパン	10,300	7,010.00	72,203,000	
ピエトロ	1,600	1,603.00	2,564,800	
エバラ食品工業	2,700	2,159.00	5,829,300	
ニチレイ	58,800	2,687.00	157,995,600	
横浜冷凍	29,800	1,042.00	31,051,600	
東洋水産	58,200	4,615.00	268,593,000	
イートアンド	4,100	1,670.00	6,847,000	
大冷	1,300	1,923.00	2,499,900	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	3,300	935.00	3,085,500	
日清食品ホールディングス	48,100	6,860.00	329,966,000	
永谷園ホールディングス	5,900	2,147.00	12,667,300	
一正蒲鉾	4,600	1,042.00	4,793,200	
フジッコ	12,300	2,046.00	25,165,800	
ロック・フィールド	12,300	1,460.00	17,958,000	
日本たばこ産業	653,100	2,453.00	1,602,054,300	
ケンコーマヨネーズ	6,300	2,380.00	14,994,000	
わらべや日洋ホールディングス	7,400	1,809.00	13,386,600	
なとり	6,300	1,622.00	10,218,600	
イフジ産業	2,100	671.00	1,409,100	
ピックルスコーポレーション	2,900	2,525.00	7,322,500	
北の達人コーポレーション	44,600	619.00	27,607,400	

ユーグレナ	48,500	1,040.00	50,440,000	
スター・マイカ・ホールディングス	5,000	1,695.00	8,475,000	
片倉工業	13,600	1,338.00	18,196,800	
グンゼ	7,400	5,030.00	37,222,000	
ヒューリック	232,000	920.00	213,440,000	
神栄	1,600	791.00	1,265,600	
ラサ商事	6,100	834.00	5,087,400	
アルペン	8,400	1,593.00	13,381,200	
ハブ	3,700	1,254.00	4,639,800	
ラクーンホールディングス	5,500	653.00	3,591,500	
クオールホールディングス	16,400	1,643.00	26,945,200	
アルコニックス	11,900	1,381.00	16,433,900	
神戸物産	16,800	5,430.00	91,224,000	
ソリトンシステムズ	6,300	1,068.00	6,728,400	
ジンズホールディングス	5,800	6,080.00	35,264,000	
ビックカメラ	65,800	1,111.00	73,103,800	
ＤＣＭホールディングス	59,900	1,098.00	65,770,200	
ペッパーフードサービス	8,800	1,696.00	14,924,800	
ＭｏｎｏｔａＲＯ	70,300	2,470.00	173,641,000	
東京一番フーズ	2,600	607.00	1,578,200	
ＤＤホールディングス	2,600	2,247.00	5,842,200	
あい　ホールディングス	15,900	1,775.00	28,222,500	
ディーブイエックス	4,200	799.00	3,355,800	
きちりホールディングス	3,200	725.00	2,320,000	
アークランドサービスホールディングス	8,200	1,942.00	15,924,400	
Ｊ．フロント　リテイリング	141,900	1,292.00	183,334,800	
ドトール・日レスホールディングス	19,500	2,084.00	40,638,000	
マツモトキヨシホールディングス	45,900	3,400.00	156,060,000	
ブロンコビリー	5,800	2,226.00	12,910,800	
ＺＯＺＯ	120,100	1,939.00	232,873,900	
トレジャー・ファクトリー	3,600	1,048.00	3,772,800	
物語コーポレーション	2,800	9,210.00	25,788,000	
ココカラファイン	12,500	5,890.00	73,625,000	
三越伊勢丹ホールディングス	207,600	906.00	188,085,600	
東洋紡	46,600	1,340.00	62,444,000	
ユニチカ	32,500	416.00	13,520,000	
富士紡ホールディングス	5,700	2,383.00	13,583,100	
日清紡ホールディングス	62,300	833.00	51,895,900	
倉敷紡績	10,400	1,994.00	20,737,600	
ダイワボウホールディングス	10,100	5,120.00	51,712,000	
シキボウ	5,600	1,025.00	5,740,000	
日東紡績	16,800	2,349.00	39,463,200	
トヨタ紡織	39,400	1,440.00	56,736,000	
マクニカ・富士エレホールディングス	30,800	1,523.00	46,908,400	
Ｈａｍｅｅ	3,200	851.00	2,723,200	
ラクト・ジャパン	4,900	3,600.00	17,640,000	
ウエルシアホールディングス	29,400	5,110.00	150,234,000	
クリエイトＳＤホールディングス	16,400	2,523.00	41,377,200	

バイタルケーエスケー・ホールディングス	20,800	1,041.00	21,652,800	
八洲電機	8,800	859.00	7,559,200	
メディアスホールディングス	6,500	705.00	4,582,500	
レスターホールディングス	12,200	1,626.00	19,837,200	
ジューテックホールディングス	2,700	977.00	2,637,900	
丸善ＣＨＩホールディングス	12,800	393.00	5,030,400	
大光	3,100	648.00	2,008,800	
ＯＣＨＩホールディングス	3,400	1,217.00	4,137,800	
ＴＯＫＡＩホールディングス	58,600	939.00	55,025,400	
黒谷	2,000	458.00	916,000	
ミサワ	2,200	437.00	961,400	
ティーライフ	1,600	920.00	1,472,000	
Ｃｏｍｉｎｉｘ	1,900	843.00	1,601,700	
エー・ピーカンパニー	2,400	490.00	1,176,000	
三洋貿易	5,600	2,422.00	13,563,200	
チムニー	3,400	2,451.00	8,333,400	
シュッピン	7,700	835.00	6,429,500	
ビューティガレージ	1,800	1,705.00	3,069,000	
ウイン・パートナーズ	7,200	1,193.00	8,589,600	
ネクステージ	17,400	1,201.00	20,897,400	
ジョイフル本田	32,300	1,258.00	40,633,400	
鳥貴族	3,800	2,223.00	8,447,400	
キリン堂ホールディングス	4,500	1,894.00	8,523,000	
ホットランド	5,900	1,568.00	9,251,200	
すかいらーくホールディングス	103,600	1,930.00	199,948,000	
ＳＦＰホールディングス	4,800	1,904.00	9,139,200	
綿半ホールディングス	4,200	2,423.00	10,176,600	
日本毛織	36,000	852.00	30,672,000	
ダイトウボウ	18,900	84.00	1,587,600	
トーア紡コーポレーション	4,900	458.00	2,244,200	
ダイドーリミテッド	13,700	291.00	3,986,700	
ヨシックス	1,800	2,632.00	4,737,600	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	32,300	982.00	31,718,600	
三栄建築設計	4,600	1,612.00	7,415,200	
野村不動産ホールディングス	74,100	2,443.00	181,026,300	
三重交通グループホールディングス	22,600	590.00	13,334,000	
サムティ	15,400	1,739.00	26,780,600	
ディア・ライフ	14,800	479.00	7,089,200	
コーセーアールイー	3,600	772.00	2,779,200	
エー・ディー・ワークス	340,600	37.00	12,602,200	
日本商業開発	7,100	1,535.00	10,898,500	
プレサンスコーポレーション	17,800	1,559.00	27,750,200	
ユニゾホールディングス	16,800	2,890.00	48,552,000	
ＴＨＥグローバル社	5,400	522.00	2,818,800	
日本管理センター	7,500	1,156.00	8,670,000	
サンセイランディック	3,300	757.00	2,498,100	
エストラスト	1,600	720.00	1,152,000	
フージャースホールディングス	24,500	627.00	15,361,500	

オープンハウス	16,200	4,505.00	72,981,000	
東急不動産ホールディングス	299,100	647.00	193,517,700	
飯田グループホールディングス	92,700	1,810.00	167,787,000	
イーグランド	1,600	701.00	1,121,600	
ムゲンエステート	8,000	583.00	4,664,000	
帝国繊維	12,500	2,111.00	26,387,500	
日本コークス工業	95,800	95.00	9,101,000	
ゴルフダイジェスト・オンライン	4,700	626.00	2,942,200	
ミタチ産業	3,000	708.00	2,124,000	
ＢＥＥＮＯＳ	2,800	1,655.00	4,634,000	
あさひ	9,300	1,275.00	11,857,500	
日本調剤	4,000	3,375.00	13,500,000	
コスモス薬品	4,900	18,930.00	92,757,000	
シップヘルスケアホールディングス	23,200	4,945.00	114,724,000	
トーエル	5,600	721.00	4,037,600	
ソフトクリエイトホールディングス	4,900	1,650.00	8,085,000	
オンリー	2,000	865.00	1,730,000	
セブン&アイ・ホールディングス	465,300	3,802.00	1,769,070,600	
薬王堂	4,900	2,501.00	12,254,900	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	30,000	1,425.00	42,750,000	
明治電機工業	3,600	1,387.00	4,993,200	
ツルハホールディングス	24,100	10,780.00	259,798,000	
デリカフーズホールディングス	2,100	1,498.00	3,145,800	
スターティアホールディングス	2,200	557.00	1,225,400	
サンマルクホールディングス	8,700	2,410.00	20,967,000	
フェリシモ	2,600	951.00	2,472,600	
トリドールホールディングス	13,800	2,394.00	33,037,200	
帝人	89,800	1,836.00	164,872,800	
東レ	856,300	770.10	659,436,630	
クラレ	186,200	1,257.00	234,053,400	
旭化成	785,400	1,116.50	876,899,100	
サカイオーベックス	2,800	1,748.00	4,894,400	
ＴＯＫＹＯ　ＢＡＳＥ	10,000	889.00	8,890,000	
稲葉製作所	6,200	1,498.00	9,287,600	
宮地エンジニアリンググループ	3,500	1,846.00	6,461,000	
トーカロ	28,800	812.00	23,385,600	
アルファ	4,100	1,250.00	5,125,000	
ＳＵＭＣＯ	123,300	1,349.00	166,331,700	
川田テクノロジーズ	2,600	7,760.00	20,176,000	
ＲＳ　Ｔｅｃｈｎｏｌｏｇｉｅｓ	2,400	3,110.00	7,464,000	
信和	6,000	940.00	5,640,000	
ビーロット	1,800	2,315.00	4,167,000	
ファーストブラザーズ	3,200	1,023.00	3,273,600	
ハウスドゥ	4,500	1,554.00	6,993,000	
シーアールイー	3,000	1,111.00	3,333,000	
プロパティエージェント	1,100	1,141.00	1,255,100	
ケイアイスター不動産	3,200	1,753.00	5,609,600	
アグレ都市デザイン	1,500	513.00	769,500	
グッドコムアセット	2,000	1,523.00	3,046,000	

ジェイ・エス・ビー	400	4,730.00	1,892,000	
住江織物	3,300	3,010.00	9,933,000	
日本フエルト	6,200	457.00	2,833,400	
イチカワ	1,600	1,773.00	2,836,800	
エコナックホールディングス	21,000	128.00	2,688,000	
日東製網	1,400	1,472.00	2,060,800	
芦森工業	2,500	1,645.00	4,112,500	
アツギ	9,100	925.00	8,417,500	
ウイルプラスホールディングス	1,100	812.00	893,200	
ジャパンミート	5,600	1,927.00	10,791,200	
コメダホールディングス	25,800	2,034.00	52,477,200	
サツドラホールディングス	1,700	1,888.00	3,209,600	
デファクトスタンダード	700	372.00	260,400	
アレンザホールディングス	6,000	880.00	5,280,000	
バロックジャパンリミテッド	9,000	914.00	8,226,000	
クスリのアオキホールディングス	11,000	7,200.00	79,200,000	
ダイニック	4,600	746.00	3,431,600	
共和レザー	7,000	832.00	5,824,000	
力の源ホールディングス	3,300	973.00	3,210,900	
スシローグローバルホールディングス	12,300	6,870.00	84,501,000	
ＬＩＸＩＬビバ	9,300	1,253.00	11,652,900	
セーレン	27,200	1,549.00	42,132,800	
ソトー	4,500	978.00	4,401,000	
東海染工	1,600	1,132.00	1,811,200	
小松マテーレ	18,100	800.00	14,480,000	
ワコールホールディングス	31,200	2,857.00	89,138,400	
ホギメディカル	13,800	3,175.00	43,815,000	
レナウン	33,100	104.00	3,442,400	
クラウディアホールディングス	3,000	521.00	1,563,000	
ＴＳＩホールディングス	40,700	639.00	26,007,300	
マツオカコーポレーション	3,600	2,632.00	9,475,200	
ワールド	14,500	2,145.00	31,102,500	
ＴＩＳ	36,800	5,800.00	213,440,000	
ネオス	4,200	977.00	4,103,400	
電算システム	4,400	3,475.00	15,290,000	
グリー	77,000	527.00	40,579,000	
コーエーテクモホールディングス	22,600	2,065.00	46,669,000	
三菱総合研究所	4,500	3,500.00	15,750,000	
ボルテージ	2,100	528.00	1,108,800	
電算	1,300	2,028.00	2,636,400	
ＡＧＳ	6,400	665.00	4,256,000	
ファインデックス	9,500	974.00	9,253,000	
ブレインパッド	2,100	6,640.00	13,944,000	
ＫＬａｂ	19,900	973.00	19,362,700	
ポールトゥウィン・ピットクルーホールディングス	14,800	1,148.00	16,990,400	
イーブックイニシアティブジャパン	1,800	2,134.00	3,841,200	
ネクソン	282,200	1,692.00	477,482,400	
アイスタイル	28,500	850.00	24,225,000	
エムアップ	3,900	2,542.00	9,913,800	

エイチーム	7,100	1,199.00	8,512,900	
エニグモ	4,000	2,460.00	9,840,000	
テクノスジャパン	9,700	589.00	5,713,300	
ｅｎｉｓｈ	4,200	634.00	2,662,800	
コロプラ	36,100	726.00	26,208,600	
オルトプラス	7,200	277.00	1,994,400	
ブロードリーフ	55,000	585.00	32,175,000	
クロス・マーケティンググループ	3,400	388.00	1,319,200	
デジタルハーツホールディングス	5,200	1,096.00	5,699,200	
システム情報	5,700	1,100.00	6,270,000	
メディアドゥホールディングス	3,500	3,650.00	12,775,000	
じげん	12,200	827.00	10,089,400	
ブイキューブ	6,100	596.00	3,635,600	
サイバーリンクス	1,800	1,187.00	2,136,600	
ディー・エル・イー	7,400	215.00	1,591,000	
フィックスターズ	10,800	1,978.00	21,362,400	
ＣＡＲＴＡ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	5,400	1,375.00	7,425,000	
オプティム	4,900	3,155.00	15,459,500	
セレス	3,700	1,863.00	6,893,100	
特種東海製紙	7,000	3,965.00	27,755,000	
ティーガイア	7,800	2,071.00	16,153,800	
セック	1,800	3,665.00	6,597,000	
日本アジアグループ	12,100	360.00	4,356,000	
豆蔵ホールディングス	7,700	1,484.00	11,426,800	
テクマトリックス	7,900	2,104.00	16,621,600	
プロシップ	3,300	1,250.00	4,125,000	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	26,600	3,070.00	81,662,000	
GMOペイメントゲートウェイ	18,200	7,130.00	129,766,000	
ザッパラス	5,800	347.00	2,012,600	
システムリサーチ	1,500	3,790.00	5,685,000	
インターネットイニシアティブ	18,100	2,087.00	37,774,700	
さくらインターネット	13,700	587.00	8,041,900	
ヴィンクス	3,900	1,150.00	4,485,000	
GMOクラウド	2,600	3,175.00	8,255,000	
ＳＲＡホールディングス	5,800	2,635.00	15,283,000	
ＭＩＮＯＲＩソリューションズ	2,200	1,997.00	4,393,400	
システムインテグレータ	3,400	777.00	2,641,800	
朝日ネット	9,300	718.00	6,677,400	
ｅＢＡＳＥ	6,800	1,188.00	8,078,400	
アバント	3,300	2,049.00	6,761,700	
アドソル日進	4,100	1,714.00	7,027,400	
フリービット	6,600	1,068.00	7,048,800	
コムチュア	6,200	4,275.00	26,505,000	
サイバーコム	2,000	1,938.00	3,876,000	
アステリア	5,700	1,070.00	6,099,000	
王子ホールディングス	497,000	592.00	294,224,000	
日本製紙	53,000	1,936.00	102,608,000	
三菱製紙	17,800	601.00	10,697,800	
北越コーポレーション	73,100	579.00	42,324,900	

中越パルプ工業	4,800	1,611.00	7,732,800	
巴川製紙所	3,900	909.00	3,545,100	
大王製紙	53,800	1,296.00	69,724,800	
阿波製紙	3,100	450.00	1,395,000	
マークラインズ	4,000	1,929.00	7,716,000	
メディカル・データ・ビジョン	9,900	1,190.00	11,781,000	
ｇｕｍｉ	13,800	572.00	7,893,600	
ショーケース	2,600	585.00	1,521,000	
モバイルファクトリー	3,200	1,522.00	4,870,400	
テラスカイ	1,400	1,691.00	2,367,400	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	4,900	1,811.00	8,873,900	
ＰＣＩホールディングス	2,000	2,263.00	4,526,000	
パイプドＨＤ	1,800	1,227.00	2,208,600	
アイビーシー	1,900	1,322.00	2,511,800	
ネオジャパン	2,200	970.00	2,134,000	
ＰＲ　ＴＩＭＥＳ	700	2,953.00	2,067,100	
ランドコンピュータ	1,300	1,113.00	1,446,900	
ダブルスタンダード	700	4,895.00	3,426,500	
オープンドア	5,500	2,901.00	15,955,500	
マイネット	3,700	726.00	2,686,200	
アカツキ	4,000	7,060.00	28,240,000	
ベネフィットジャパン	600	900.00	540,000	
Ｕｂｉｃｏｍホールディングス	2,100	1,767.00	3,710,700	
ＬＩＮＥ	33,900	3,165.00	107,293,500	
カナミックネットワーク	1,700	2,316.00	3,937,200	
ノムラシステムコーポレーション	900	996.00	896,400	
レンゴー	113,900	835.00	95,106,500	
トーモク	6,800	1,832.00	12,457,600	
ザ・パック	8,400	3,405.00	28,602,000	
チェンジ	1,500	2,431.00	3,646,500	
シンクロ・フード	4,900	576.00	2,822,400	
オークネット	5,900	1,326.00	7,823,400	
ＡＯＩ　ＴＹＯ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	12,200	689.00	8,405,800	
マクロミル	19,700	1,279.00	25,196,300	
ビーグリー	2,200	878.00	1,931,600	
オロ	3,100	2,600.00	8,060,000	
サインポスト	1,700	2,989.00	5,081,300	
昭和電工	73,400	2,987.00	219,245,800	
住友化学	868,300	491.00	426,335,300	
住友精化	5,300	3,400.00	18,020,000	
日産化学	67,300	4,610.00	310,253,000	
ラサ工業	4,100	1,435.00	5,883,500	
クレハ	10,200	7,160.00	73,032,000	
多木化学	3,300	4,230.00	13,959,000	
テイカ	9,000	2,469.00	22,221,000	
石原産業	21,300	1,244.00	26,497,200	
片倉コープアグリ	3,100	1,079.00	3,344,900	
日本曹達	17,400	2,701.00	46,997,400	
東ソー	170,600	1,491.00	254,364,600	

トクヤマ	31,900	2,707.00	86,353,300	
セントラル硝子	24,100	2,449.00	59,020,900	
東亞合成	69,200	1,161.00	80,341,200	
大阪ソーダ	12,000	2,643.00	31,716,000	
関東電化工業	26,300	718.00	18,883,400	
デンカ	43,400	3,195.00	138,663,000	
イビデン	69,000	1,841.00	127,029,000	
信越化学工業	194,500	9,790.00	1,904,155,000	
日本カーバイド工業	3,900	1,374.00	5,358,600	
堺化学工業	7,400	2,616.00	19,358,400	
第一稀元素化学工業	12,100	862.00	10,430,200	
エア・ウォーター	90,300	1,767.00	159,560,100	
大陽日酸	91,000	2,156.00	196,196,000	
日本化学工業	3,800	2,089.00	7,938,200	
東邦アセチレン	1,700	1,311.00	2,228,700	
日本パーカライジング	60,100	1,196.00	71,879,600	
高圧ガス工業	17,400	898.00	15,625,200	
チタン工業	1,400	2,999.00	4,198,600	
四国化成工業	18,500	1,156.00	21,386,000	
戸田工業	2,500	2,395.00	5,987,500	
ステラ　ケミファ	6,400	2,826.00	18,086,400	
保土谷化学工業	3,900	2,772.00	10,810,800	
日本触媒	18,500	7,090.00	131,165,000	
大日精化工業	9,100	3,130.00	28,483,000	
カネカ	28,500	4,020.00	114,570,000	
協和キリン	132,200	1,914.00	253,030,800	
三菱瓦斯化学	112,200	1,406.00	157,753,200	
三井化学	100,100	2,559.00	256,155,900	
ＪＳＲ	110,800	1,635.00	181,158,000	
東京応化工業	18,900	3,480.00	65,772,000	
大阪有機化学工業	10,300	979.00	10,083,700	
三菱ケミカルホールディングス	737,700	752.00	554,750,400	
ＫＨネオケム	16,800	2,807.00	47,157,600	
ダイセル	162,600	947.00	153,982,200	
住友ベークライト	19,100	3,580.00	68,378,000	
積水化学工業	237,400	1,610.00	382,214,000	
日本ゼオン	99,500	1,172.00	116,614,000	
アイカ工業	33,100	3,615.00	119,656,500	
宇部興産	55,600	2,206.00	122,653,600	
積水樹脂	18,200	2,134.00	38,838,800	
タキロンシーアイ	23,900	664.00	15,869,600	
旭有機材	7,700	1,399.00	10,772,300	
日立化成	51,100	2,989.00	152,737,900	
ニチバン	5,800	2,041.00	11,837,800	
リケンテクノス	30,200	542.00	16,368,400	
大倉工業	5,600	1,744.00	9,766,400	
積水化成品工業	16,600	764.00	12,682,400	
群栄化学工業	2,900	2,428.00	7,041,200	
タイガースポリマー	6,000	568.00	3,408,000	
ミライアル	3,400	1,390.00	4,726,000	

ダイキアクシス	4,100	868.00	3,558,800	
ダイキョーニシカワ	23,300	914.00	21,296,200	
竹本容器	4,100	1,256.00	5,149,600	
森六ホールディングス	5,800	2,469.00	14,320,200	
日本化薬	68,300	1,331.00	90,907,300	
カーリットホールディングス	12,100	635.00	7,683,500	
ＥＰＳホールディングス	16,300	1,732.00	28,231,600	
ソルクシーズ	4,900	977.00	4,787,300	
レッグス	2,900	1,856.00	5,382,400	
プレステージ・インターナショナル	20,200	1,687.00	34,077,400	
フェイス	4,200	842.00	3,536,400	
プロトコーポレーション	10,000	1,086.00	10,860,000	
ハイマックス	1,400	1,812.00	2,536,800	
アミューズ	6,500	2,514.00	16,341,000	
野村総合研究所	211,200	1,789.00	377,836,800	
ドリームインキュベータ	3,400	1,411.00	4,797,400	
サイバネットシステム	9,300	653.00	6,072,900	
クイック	6,800	1,619.00	11,009,200	
ＴＡＣ	6,500	198.00	1,287,000	
ＣＥホールディングス	3,100	1,144.00	3,546,400	
ケネディクス	94,700	575.00	54,452,500	
日本システム技術	1,900	1,812.00	3,442,800	
電通	131,300	3,885.00	510,100,500	
インテージホールディングス	14,400	952.00	13,708,800	
テイクアンドギヴ・ニーズ	4,300	1,111.00	4,777,300	
東邦システムサイエンス	3,500	1,067.00	3,734,500	
ぴあ	3,100	4,850.00	15,035,000	
イオンファンタジー	3,500	2,382.00	8,337,000	
ソースネクスト	43,300	433.00	18,748,900	
シーティーエス	12,400	700.00	8,680,000	
ネクシィーズグループ	3,300	2,120.00	6,996,000	
インフォコム	12,200	2,452.00	29,914,400	
メディカルシステムネットワーク	12,100	563.00	6,812,300	
日本精化	8,900	1,265.00	11,258,500	
扶桑化学工業	11,200	2,075.00	23,240,000	
トリケミカル研究所	2,600	4,655.00	12,103,000	
ＦＩＧ	10,200	340.00	3,468,000	
ＡＤＥＫＡ	54,400	1,599.00	86,985,600	
日油	41,600	3,895.00	162,032,000	
ミヨシ油脂	4,500	1,104.00	4,968,000	
新日本理化	20,700	214.00	4,429,800	
ハリマ化成グループ	9,200	1,081.00	9,945,200	
アルテリア・ネットワークス	12,400	1,253.00	15,537,200	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	2,700	1,846.00	4,984,200	
花王	273,600	8,303.00	2,271,700,800	
第一工業製薬	4,200	3,405.00	14,301,000	
石原ケミカル	2,900	1,641.00	4,758,900	
日華化学	3,900	841.00	3,279,900	
ニイタカ	1,800	1,442.00	2,595,600	

三洋化成工業	7,400	5,530.00	40,922,000	
武田薬品工業	984,100	3,931.00	3,868,497,100	
アステラス製薬	991,500	1,562.50	1,549,218,750	
大日本住友製薬	83,700	2,017.00	168,822,900	
塩野義製薬	144,100	6,259.00	901,921,900	
田辺三菱製薬	117,700	1,236.00	145,477,200	
わかもと製薬	14,000	270.00	3,780,000	
あすか製薬	14,000	1,306.00	18,284,000	
日本新薬	29,600	8,050.00	238,280,000	
ビオフェルミン製薬	1,800	2,300.00	4,140,000	
中外製薬	117,500	7,260.00	853,050,000	
科研製薬	19,300	5,560.00	107,308,000	
エーザイ	134,900	6,123.00	825,992,700	
理研ビタミン	5,300	3,495.00	18,523,500	
ロート製薬	57,800	3,070.00	177,446,000	
小野薬品工業	266,100	2,021.50	537,921,150	
久光製薬	33,300	4,435.00	147,685,500	
有機合成薬品工業	8,200	237.00	1,943,400	
持田製薬	17,100	4,790.00	81,909,000	
参天製薬	209,900	1,756.00	368,584,400	
扶桑薬品工業	4,000	1,948.00	7,792,000	
日本ケミファ	1,500	2,944.00	4,416,000	
ツムラ	34,900	3,110.00	108,539,000	
日医工	29,700	1,277.00	37,926,900	
テルモ	319,000	3,284.00	1,047,596,000	
みらかホールディングス	30,100	2,524.00	75,972,400	
キッセイ薬品工業	19,800	2,755.00	54,549,000	
生化学工業	21,900	1,293.00	28,316,700	
栄研化学	19,800	1,794.00	35,521,200	
日水製薬	4,800	1,242.00	5,961,600	
鳥居薬品	6,000	2,790.00	16,740,000	
ＪＣＲファーマ	8,000	6,570.00	52,560,000	
東和薬品	16,300	2,891.00	47,123,300	
富士製薬工業	7,700	1,485.00	11,434,500	
沢井製薬	23,200	6,150.00	142,680,000	
ゼリア新薬工業	22,400	2,114.00	47,353,600	
第一三共	322,600	5,933.00	1,913,985,800	
キョーリン製薬ホールディングス	24,800	1,889.00	46,847,200	
大幸薬品	5,100	2,185.00	11,143,500	
ダイト	6,500	3,510.00	22,815,000	
大塚ホールディングス	214,700	3,848.00	826,165,600	
大正製薬ホールディングス	25,200	8,400.00	211,680,000	
ペプチドリーム	56,500	5,630.00	318,095,000	
大日本塗料	12,400	1,045.00	12,958,000	
日本ペイントホールディングス	91,100	4,365.00	397,651,500	
関西ペイント	124,100	2,070.00	256,887,000	
神東塗料	8,800	173.00	1,522,400	
中国塗料	36,300	928.00	33,686,400	
日本特殊塗料	8,400	1,397.00	11,734,800	
藤倉化成	14,800	596.00	8,820,800	

太陽ホールディングス	9,000	3,255.00	29,295,000	
ＤＩＣ	49,900	2,836.00	141,516,400	
サカタインクス	24,200	1,032.00	24,974,400	
東洋インキＳＣホールディングス	23,200	2,357.00	54,682,400	
Ｔ＆Ｋ　ＴＯＫＡ	8,500	997.00	8,474,500	
アルプス技研	10,400	1,654.00	17,201,600	
サニックス	19,500	238.00	4,641,000	
ダイオーズ	2,700	1,439.00	3,885,300	
日本空調サービス	12,600	731.00	9,210,600	
オリエンタルランド	127,200	13,815.00	1,757,268,000	
フォーカスシステムズ	7,500	866.00	6,495,000	
ダスキン	27,600	2,956.00	81,585,600	
パーク２４	64,900	2,473.00	160,497,700	
明光ネットワークジャパン	12,800	991.00	12,684,800	
ファルコホールディングス	6,000	1,672.00	10,032,000	
クレスコ	3,400	3,885.00	13,209,000	
フジ・メディア・ホールディングス	114,600	1,516.00	173,733,600	
秀英予備校	2,600	426.00	1,107,600	
田谷	2,100	604.00	1,268,400	
ラウンドワン	33,500	1,584.00	53,064,000	
リゾートトラスト	45,500	1,622.00	73,801,000	
オービック	38,400	11,780.00	452,352,000	
ジャストシステム	15,800	3,570.00	56,406,000	
ＴＤＣソフト	10,000	887.00	8,870,000	
ヤフー	722,200	340.00	245,548,000	
ビー・エム・エル	14,000	3,085.00	43,190,000	
ワタベウェディング	1,900	627.00	1,191,300	
トレンドマイクロ	59,000	4,840.00	285,560,000	
りらいあコミュニケーションズ	19,700	1,306.00	25,728,200	
ＩＤホールディングス	3,400	1,186.00	4,032,400	
リソー教育	55,000	493.00	27,115,000	
日本オラクル	22,400	8,700.00	194,880,000	
早稲田アカデミー	3,300	774.00	2,554,200	
アルファシステムズ	3,500	2,821.00	9,873,500	
フューチャー	15,000	2,110.00	31,650,000	
ＣＡＣ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	8,100	1,319.00	10,683,900	
ソフトバンク・テクノロジー	4,800	2,353.00	11,294,400	
トーセ	3,100	859.00	2,662,900	
ユー・エス・エス	131,600	2,174.00	286,098,400	
オービックビジネスコンサルタント	11,400	4,940.00	56,316,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	50,400	2,810.00	141,624,000	
アイティフォー	13,600	888.00	12,076,800	
東京個別指導学院	3,900	930.00	3,627,000	
東計電算	1,600	3,115.00	4,984,000	
サイバーエージェント	62,100	3,990.00	247,779,000	
楽天	502,300	1,190.00	597,737,000	
エックスネット	2,200	913.00	2,008,600	
クリーク・アンド・リバー社	6,400	1,293.00	8,275,200	
テー・オー・ダブリュー	9,800	790.00	7,742,000	
大塚商会	59,800	4,385.00	262,223,000	

サイボウズ	13,100	1,392.00	18,235,200	
ソフトブレーン	9,000	520.00	4,680,000	
山田コンサルティンググループ	5,200	2,099.00	10,914,800	
セントラルスポーツ	4,100	3,255.00	13,345,500	
パラカ	3,000	2,031.00	6,093,000	
電通国際情報サービス	6,900	3,580.00	24,702,000	
デジタルガレージ	21,600	3,690.00	79,704,000	
イーエムシステムズ	9,100	1,650.00	15,015,000	
ウェザーニューズ	3,800	3,190.00	12,122,000	
ＣＩＪ	8,900	1,022.00	9,095,800	
東洋ビジネスエンジニアリング	1,100	2,150.00	2,365,000	
日本エンタープライズ	12,600	193.00	2,431,800	
WOWOW	5,200	2,728.00	14,185,600	
スカラ	8,000	948.00	7,584,000	
インテリジェント　ウェイブ	4,300	924.00	3,973,200	
フルキャストホールディングス	10,800	2,348.00	25,358,400	
エン・ジャパン	15,600	4,470.00	69,732,000	
富士フイルムホールディングス	234,100	5,425.00	1,269,992,500	
コニカミノルタ	246,200	1,086.00	267,373,200	
資生堂	224,000	8,144.00	1,824,256,000	
ライオン	157,000	2,111.00	331,427,000	
高砂香料工業	7,800	2,961.00	23,095,800	
マンダム	25,300	2,674.00	67,652,200	
ミルボン	14,000	5,510.00	77,140,000	
ファンケル	50,200	2,638.00	132,427,600	
コーセー	19,100	17,850.00	340,935,000	
コタ	5,900	1,193.00	7,038,700	
シーボン	1,300	2,373.00	3,084,900	
ポーラ・オルビスホールディングス	48,100	2,828.00	136,026,800	
ノエビアホールディングス	10,700	5,860.00	62,702,000	
アジュバンコスメジャパン	2,700	936.00	2,527,200	
エステー	8,100	1,653.00	13,389,300	
アグロ　カネショウ	4,700	1,771.00	8,323,700	
コニシ	19,900	1,550.00	30,845,000	
長谷川香料	14,900	1,958.00	29,174,200	
星光ＰＭＣ	7,700	773.00	5,952,100	
小林製薬	31,600	7,730.00	244,268,000	
荒川化学工業	10,100	1,533.00	15,483,300	
メック	7,900	1,067.00	8,429,300	
日本高純度化学	3,300	2,350.00	7,755,000	
タカラバイオ	29,600	2,162.00	63,995,200	
ＪＣＵ	14,700	2,049.00	30,120,300	
新田ゼラチン	7,300	729.00	5,321,700	
ＯＡＴアグリオ	1,600	1,399.00	2,238,400	
デクセリアルズ	29,000	712.00	20,648,000	
アース製薬	8,500	4,800.00	40,800,000	
北興化学工業	12,000	492.00	5,904,000	
大成ラミック	3,700	2,895.00	10,711,500	
クミアイ化学工業	46,600	777.00	36,208,200	
日本農薬	20,200	433.00	8,746,600	

富士興産	4,500	1,037.00	4,666,500	
ニチレキ	14,500	1,060.00	15,370,000	
ユシロ化学工業	5,800	1,333.00	7,731,400	
ビーピー・カストロール	4,100	1,380.00	5,658,000	
富士石油	28,100	276.00	7,755,600	
ＭＯＲＥＳＣＯ	4,300	1,476.00	6,346,800	
出光興産	130,200	3,260.00	424,452,000	
ＪＸＴＧホールディングス	1,895,700	542.80	1,028,985,960	
コスモエネルギーホールディングス	32,700	2,480.00	81,096,000	
横浜ゴム	65,200	2,057.00	134,116,400	
ＴＯＹＯ　ＴＩＲＥ	58,000	1,541.00	89,378,000	
ブリヂストン	346,500	4,230.00	1,465,695,000	
住友ゴム工業	101,200	1,240.00	125,488,000	
藤倉コンポジット	10,200	444.00	4,528,800	
オカモト	7,500	4,985.00	37,387,500	
アキレス	8,200	2,080.00	17,056,000	
フコク	5,100	757.00	3,860,700	
ニッタ	12,700	3,010.00	38,227,000	
クリエートメディック	3,900	947.00	3,693,300	
住友理工	21,700	836.00	18,141,200	
三ツ星ベルト	14,800	2,038.00	30,162,400	
バンドー化学	21,500	995.00	21,392,500	
ＡＧＣ	111,400	3,705.00	412,737,000	
日本板硝子	54,000	717.00	38,718,000	
石塚硝子	1,600	2,159.00	3,454,400	
有沢製作所	17,800	895.00	15,931,000	
日本山村硝子	4,800	1,415.00	6,792,000	
日本電気硝子	48,700	2,751.00	133,973,700	
オハラ	4,600	1,563.00	7,189,800	
住友大阪セメント	22,800	4,145.00	94,506,000	
太平洋セメント	71,200	3,230.00	229,976,000	
リソルホールディングス	1,200	4,030.00	4,836,000	
日本ヒューム	11,200	715.00	8,008,000	
日本コンクリート工業	24,600	294.00	7,232,400	
三谷セキサン	5,200	3,005.00	15,626,000	
アジアパイルホールディングス	16,300	579.00	9,437,700	
東海カーボン	102,600	1,070.00	109,782,000	
日本カーボン	5,400	4,165.00	22,491,000	
東洋炭素	6,600	2,235.00	14,751,000	
ノリタケカンパニーリミテド	6,800	4,515.00	30,702,000	
ＴＯＴＯ	86,600	4,320.00	374,112,000	
日本碍子	137,300	1,565.00	214,874,500	
日本特殊陶業	95,100	1,941.00	184,589,100	
ダントーホールディングス	9,300	113.00	1,050,900	
ＭＡＲＵＷＡ	4,000	5,760.00	23,040,000	
品川リフラクトリーズ	3,100	2,937.00	9,104,700	
黒崎播磨	2,200	6,080.00	13,376,000	
ヨータイ	10,100	585.00	5,908,500	
イソライト工業	6,000	468.00	2,808,000	
東京窯業	14,800	300.00	4,440,000	

ニッカトー	5,300	676.00	3,582,800	
フジミインコーポレーテッド	10,000	2,249.00	22,490,000	
クニミネ工業	4,000	899.00	3,596,000	
エーアンドエーマテリアル	2,400	1,027.00	2,464,800	
ニチアス	30,900	1,945.00	60,100,500	
日本製鉄	517,700	1,821.50	942,990,550	
神戸製鋼所	203,700	697.00	141,978,900	
中山製鋼所	15,200	512.00	7,782,400	
合同製鐵	5,400	2,130.00	11,502,000	
ジェイ　エフ　イー　ホールディングス	301,000	1,523.50	458,573,500	
東京製鐵	59,800	831.00	49,693,800	
共英製鋼	12,600	1,880.00	23,688,000	
大和工業	23,700	3,090.00	73,233,000	
東京鐵鋼	4,700	1,332.00	6,260,400	
大阪製鐵	7,400	1,720.00	12,728,000	
淀川製鋼所	14,800	2,073.00	30,680,400	
丸一鋼管	39,500	2,831.00	111,824,500	
モリ工業	3,400	2,008.00	6,827,200	
大同特殊鋼	18,200	3,995.00	72,709,000	
日本高周波鋼業	4,200	475.00	1,995,000	
日本冶金工業	92,900	226.00	20,995,400	
山陽特殊製鋼	14,100	1,443.00	20,346,300	
愛知製鋼	6,100	3,240.00	19,764,000	
日立金属	120,100	1,192.00	143,159,200	
日本金属	2,700	922.00	2,489,400	
大平洋金属	7,600	2,294.00	17,434,400	
新日本電工	67,400	206.00	13,884,400	
栗本鐵工所	5,500	1,531.00	8,420,500	
虹　技	1,700	1,368.00	2,325,600	
日本鋳鉄管	1,200	1,228.00	1,473,600	
日本製鋼所	33,900	1,850.00	62,715,000	
三菱製鋼	8,200	1,249.00	10,241,800	
日亜鋼業	17,100	343.00	5,865,300	
日本精線	1,600	2,651.00	4,241,600	
エンビプロ・ホールディングス	2,600	666.00	1,731,600	
大紀アルミニウム工業所	18,500	792.00	14,652,000	
日本軽金属ホールディングス	303,600	230.00	69,828,000	
三井金属鉱業	30,100	2,446.00	73,624,600	
東邦亜鉛	6,100	2,481.00	15,134,100	
三菱マテリアル	73,600	3,010.00	221,536,000	
住友金属鉱山	152,700	3,088.00	471,537,600	
ＤＯＷＡホールディングス	26,000	3,395.00	88,270,000	
古河機械金属	18,400	1,420.00	26,128,000	
エス・サイエンス	51,100	63.00	3,219,300	
大阪チタニウムテクノロジーズ	13,000	1,812.00	23,556,000	
東邦チタニウム	20,000	1,027.00	20,540,000	
ＵＡＣＪ	16,900	1,824.00	30,825,600	
ＣＫサンエツ	2,100	2,824.00	5,930,400	
古河電気工業	32,200	3,190.00	102,718,000	

住友電気工業	416,400	1,418.00	590,455,200	
フジクラ	134,500	412.00	55,414,000	
昭和電線ホールディングス	13,100	906.00	11,868,600	
東京特殊電線	1,500	1,854.00	2,781,000	
タツタ電線	22,200	523.00	11,610,600	
カナレ電気	1,900	1,887.00	3,585,300	
平河ヒューテック	4,700	1,255.00	5,898,500	
リョービ	13,800	2,034.00	28,069,200	
アーレスティ	14,100	571.00	8,051,100	
アサヒホールディングス	21,100	2,264.00	47,770,400	
東洋製罐グループホールディングス	71,000	2,055.00	145,905,000	
ホッカンホールディングス	5,600	1,735.00	9,716,000	
コロナ	5,900	1,085.00	6,401,500	
横河ブリッジホールディングス	20,800	1,686.00	35,068,800	
ＯＳＪＢホールディングス	56,500	262.00	14,803,000	
駒井ハルテック	2,100	1,663.00	3,492,300	
高田機工	1,000	2,530.00	2,530,000	
三和ホールディングス	115,100	1,133.00	130,408,300	
文化シヤッター	32,900	860.00	28,294,000	
三協立山	15,400	1,267.00	19,511,800	
アルインコ	8,700	1,017.00	8,847,900	
東洋シヤッター	3,000	695.00	2,085,000	
ＬＩＸＩＬグループ	164,300	1,796.00	295,082,800	
日本フイルコン	8,800	486.00	4,276,800	
ノーリツ	24,800	1,272.00	31,545,600	
長府製作所	11,200	2,342.00	26,230,400	
リンナイ	19,800	6,990.00	138,402,000	
ユニプレス	21,900	1,780.00	38,982,000	
ダイニチ工業	6,000	632.00	3,792,000	
日東精工	15,500	596.00	9,238,000	
三洋工業	1,500	1,810.00	2,715,000	
岡部	22,700	937.00	21,269,900	
ジーテクト	12,400	1,567.00	19,430,800	
中国工業	1,900	587.00	1,115,300	
東プレ	20,900	1,722.00	35,989,800	
高周波熱錬	21,400	907.00	19,409,800	
東京製綱	6,900	986.00	6,803,400	
サンコール	6,500	531.00	3,451,500	
モリテックスチール	8,900	374.00	3,328,600	
パイオラックス	17,800	1,911.00	34,015,800	
エイチワン	11,000	766.00	8,426,000	
日本発条	111,000	841.00	93,351,000	
中央発條	1,300	2,883.00	3,747,900	
アドバネクス	1,500	1,717.00	2,575,500	
三浦工業	48,300	3,175.00	153,352,500	
タクマ	40,700	1,407.00	57,264,900	
テクノプロ・ホールディングス	21,700	6,210.00	134,757,000	
アトラ	2,400	290.00	696,000	
インターワークス	2,400	719.00	1,725,600	

アイ・アールジャパンホールディングス	3,500	2,672.00	9,352,000	
ＫｅｅＰｅｒ技研	4,000	1,333.00	5,332,000	
ファーストロジック	2,400	597.00	1,432,800	
三機サービス	1,900	1,255.00	2,384,500	
Ｇｕｎｏｓｙ	7,100	1,803.00	12,801,300	
デザインワン・ジャパン	2,400	316.00	758,400	
イー・ガーディアン	5,300	1,904.00	10,091,200	
リブセンス	6,200	256.00	1,587,200	
ジャパンマテリアル	29,600	1,547.00	45,791,200	
ベクトル	13,300	1,058.00	14,071,400	
ウチヤマホールディングス	5,600	545.00	3,052,000	
チャーム・ケア・コーポレーション	3,600	1,753.00	6,310,800	
ライクキッズネクスト	2,600	1,062.00	2,761,200	
キャリアリンク	4,300	594.00	2,554,200	
ＩＢＪ	7,400	969.00	7,170,600	
アサンテ	4,500	2,149.00	9,670,500	
Ｎ・フィールド	7,100	735.00	5,218,500	
バリューＨＲ	2,500	3,355.00	8,387,500	
Ｍ＆Ａキャピタルパートナーズ	3,900	6,200.00	24,180,000	
ライドオンエクスプレスホールディングス	4,600	1,191.00	5,478,600	
ＥＲＩホールディングス	3,300	826.00	2,725,800	
アビスト	1,800	2,584.00	4,651,200	
シグマクシス	5,300	1,345.00	7,128,500	
ウィルグループ	7,200	903.00	6,501,600	
エスクロー・エージェント・ジャパン	15,300	253.00	3,870,900	
日本ビューホテル	3,700	1,436.00	5,313,200	
リクルートホールディングス	771,700	3,581.00	2,763,457,700	
エラン	7,500	1,780.00	13,350,000	
ツガミ	25,200	962.00	24,242,400	
オークマ	14,200	5,610.00	79,662,000	
東芝機械	12,700	2,418.00	30,708,600	
アマダホールディングス	167,300	1,208.00	202,098,400	
アイダエンジニアリング	30,000	906.00	27,180,000	
滝澤鉄工所	3,600	1,434.00	5,162,400	
ＦＵＪＩ	44,500	1,408.00	62,656,000	
牧野フライス製作所	13,100	4,385.00	57,443,500	
オーエスジー	54,800	2,218.00	121,546,400	
ダイジェット工業	1,300	1,637.00	2,128,100	
旭ダイヤモンド工業	29,400	677.00	19,903,800	
ＤＭＧ森精機	70,500	1,599.00	112,729,500	
ソディック	24,400	984.00	24,009,600	
ディスコ	15,000	18,970.00	284,550,000	
日東工器	6,000	2,156.00	12,936,000	
日進工具	3,400	2,054.00	6,983,600	
パンチ工業	7,900	601.00	4,747,900	
冨士ダイス	5,000	686.00	3,430,000	
土木管理総合試験所	4,900	472.00	2,312,800	
日本郵政	882,600	1,195.00	1,054,707,000	

ベルシステム２４ホールディングス	18,100	1,707.00	30,896,700	
鎌倉新書	8,000	1,515.00	12,120,000	
一蔵	1,300	689.00	895,700	
ＬＩＴＡＬＩＣＯ	2,600	1,891.00	4,916,600	
グローバルキッズＣＯＭＰＡＮＹ	1,400	1,018.00	1,425,200	
エボラブルアジア	4,800	2,585.00	12,408,000	
アトラエ	2,900	2,737.00	7,937,300	
ストライク	4,200	2,347.00	9,857,400	
ソラスト	26,400	1,094.00	28,881,600	
セラク	2,600	676.00	1,757,600	
インソース	3,800	2,520.00	9,576,000	
豊田自動織機	91,200	5,920.00	539,904,000	
豊和工業	6,200	875.00	5,425,000	
ＯＫＫ	4,700	823.00	3,868,100	
石川製作所	2,800	1,464.00	4,099,200	
東洋機械金属	8,300	607.00	5,038,100	
津田駒工業	2,500	1,586.00	3,965,000	
エンシュウ	3,100	1,211.00	3,754,100	
島精機製作所	15,300	3,120.00	47,736,000	
オプトラン	10,900	2,578.00	28,100,200	
ＮＣホールディングス	3,900	493.00	1,922,700	
イワキ	4,900	1,153.00	5,649,700	
フリュー	9,000	1,157.00	10,413,000	
ヤマシンフィルタ	19,500	637.00	12,421,500	
日阪製作所	13,800	915.00	12,627,000	
やまびこ	21,600	965.00	20,844,000	
平田機工	5,200	6,390.00	33,228,000	
ペガサスミシン製造	10,700	572.00	6,120,400	
マルマエ	3,300	808.00	2,666,400	
タツモ	3,700	856.00	3,167,200	
ナブテスコ	61,400	2,995.00	183,893,000	
三井海洋開発	11,900	3,005.00	35,759,500	
レオン自動機	11,000	1,797.00	19,767,000	
ＳＭＣ	33,000	38,770.00	1,279,410,000	
ヤマハモーターロボティクスホールディングス	8,700	446.00	3,880,200	
ホソカワミクロン	4,000	4,525.00	18,100,000	
ユニオンツール	4,800	3,105.00	14,904,000	
オイレス工業	15,500	1,592.00	24,676,000	
日精エー・エス・ビー機械	3,400	2,523.00	8,578,200	
サトーホールディングス	13,500	2,720.00	36,720,000	
技研製作所	9,800	3,255.00	31,899,000	
日本エアーテック	3,800	584.00	2,219,200	
カワタ	2,400	1,074.00	2,577,600	
日精樹脂工業	9,400	1,054.00	9,907,600	
オカダアイヨン	4,000	1,283.00	5,132,000	
ワイエイシイホールディングス	4,700	961.00	4,516,700	
小松製作所	510,200	2,507.50	1,279,326,500	
住友重機械工業	64,400	3,620.00	233,128,000	
日立建機	45,100	2,717.00	122,536,700	

日工	3,200	2,968.00	9,497,600	
巴工業	4,900	2,420.00	11,858,000	
井関農機	11,100	1,594.00	17,693,400	
ＴＯＷＡ	9,900	846.00	8,375,400	
丸山製作所	2,500	1,134.00	2,835,000	
北川鉄工所	5,000	2,218.00	11,090,000	
シンニッタン	17,800	354.00	6,301,200	
ローツェ	5,000	2,459.00	12,295,000	
タカキタ	4,200	567.00	2,381,400	
クボタ	603,900	1,755.00	1,059,844,500	
荏原実業	3,400	2,005.00	6,817,000	
東洋エンジニアリング	14,900	559.00	8,329,100	
三菱化工機	4,000	1,681.00	6,724,000	
月島機械	22,300	1,297.00	28,923,100	
帝国電機製作所	8,000	1,240.00	9,920,000	
東京機械製作所	4,700	421.00	1,978,700	
新東工業	26,600	982.00	26,121,200	
澁谷工業	9,800	3,035.00	29,743,000	
アイチコーポレーション	19,400	729.00	14,142,600	
小森コーポレーション	28,600	1,177.00	33,662,200	
鶴見製作所	8,800	1,980.00	17,424,000	
住友精密工業	1,900	2,779.00	5,280,100	
酒井重工業	2,100	2,692.00	5,653,200	
荏原製作所	49,900	2,945.00	146,955,500	
石井鐵工所	1,800	2,015.00	3,627,000	
酉島製作所	11,600	1,065.00	12,354,000	
北越工業	11,700	1,247.00	14,589,900	
千代田化工建設	91,500	305.00	27,907,500	
ダイキン工業	153,800	14,045.00	2,160,121,000	
オルガノ	4,100	3,635.00	14,903,500	
トーヨーカネツ	4,300	2,148.00	9,236,400	
栗田工業	61,000	2,754.00	167,994,000	
椿本チエイン	14,700	3,520.00	51,744,000	
大同工業	5,200	891.00	4,633,200	
日機装	36,400	1,393.00	50,705,200	
木村化工機	9,400	357.00	3,355,800	
レイズネクスト	22,700	1,206.00	27,376,200	
アネスト岩田	17,500	964.00	16,870,000	
ダイフク	62,100	5,910.00	367,011,000	
サムコ	3,300	916.00	3,022,800	
加藤製作所	5,700	2,024.00	11,536,800	
油研工業	1,900	1,736.00	3,298,400	
タダノ	54,400	1,083.00	58,915,200	
フジテック	40,900	1,409.00	57,628,100	
ＣＫＤ	31,500	1,120.00	35,280,000	
キトー	8,600	1,662.00	14,293,200	
平和	31,400	2,181.00	68,483,400	
理想科学工業	9,900	1,769.00	17,513,100	
ＳＡＮＫＹＯ	28,100	3,900.00	109,590,000	
日本金銭機械	12,600	1,102.00	13,885,200	

マースグループホールディングス	7,100	2,067.00	14,675,700	
福島工業	7,000	3,445.00	24,115,000	
オーイズミ	4,900	383.00	1,876,700	
ダイコク電機	5,200	1,364.00	7,092,800	
竹内製作所	18,800	1,716.00	32,260,800	
アマノ	32,200	3,055.00	98,371,000	
ＪＵＫＩ	15,600	1,013.00	15,802,800	
サンデンホールディングス	14,200	559.00	7,937,800	
蛇の目ミシン工業	10,300	463.00	4,768,900	
ブラザー工業	146,800	2,110.00	309,748,000	
マックス	17,200	1,607.00	27,640,400	
モリタホールディングス	19,700	1,902.00	37,469,400	
グローリー	31,200	2,906.00	90,667,200	
新晃工業	10,500	1,668.00	17,514,000	
大和冷機工業	16,300	1,070.00	17,441,000	
セガサミーホールディングス	111,800	1,373.00	153,501,400	
日本ピストンリング	4,300	1,410.00	6,063,000	
リケン	5,200	4,245.00	22,074,000	
ＴＰＲ	15,000	1,861.00	27,915,000	
ツバキ・ナカシマ	17,100	1,835.00	31,378,500	
ホシザキ	33,000	7,770.00	256,410,000	
大豊工業	9,300	846.00	7,867,800	
日本精工	231,500	942.00	218,073,000	
ＮＴＮ	241,900	316.00	76,440,400	
ジェイテクト	108,000	1,327.00	143,316,000	
不二越	10,400	4,500.00	46,800,000	
ミネベアミツミ	209,300	1,816.00	380,088,800	
日本トムソン	33,700	497.00	16,748,900	
ＴＨＫ	70,400	2,582.00	181,772,800	
ユーシン精機	8,800	1,011.00	8,896,800	
前澤給装工業	4,500	2,059.00	9,265,500	
イーグル工業	13,900	1,045.00	14,525,500	
前澤工業	7,700	367.00	2,825,900	
日本ピラー工業	11,600	1,052.00	12,203,200	
キッツ	45,700	748.00	34,183,600	
日立製作所	507,500	4,048.00	2,054,360,000	
三菱電機	1,126,900	1,461.00	1,646,400,900	
富士電機	73,200	3,690.00	270,108,000	
東洋電機製造	4,600	1,362.00	6,265,200	
安川電機	130,700	3,565.00	465,945,500	
シンフォニア　テクノロジー	15,600	1,281.00	19,983,600	
明電舎	22,300	1,703.00	37,976,900	
オリジン	3,200	1,483.00	4,745,600	
山洋電気	5,400	4,270.00	23,058,000	
デンヨー	10,400	1,567.00	16,296,800	
ベイカレント・コンサルティング	7,700	4,230.00	32,571,000	
アイモバイル	2,800	791.00	2,214,800	
キャリアインデックス	3,900	802.00	3,127,800	
ＭＳ－Ｊａｐａｎ	4,500	1,621.00	7,294,500	
船場	1,800	970.00	1,746,000	

グレイステクノロジー	3,100	2,571.00	7,970,100	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	8,500	2,704.00	22,984,000	
フルテック	1,200	1,172.00	1,406,400	
グリーンズ	2,700	1,537.00	4,149,900	
ツナググループ・ホールディングス	1,000	613.00	613,000	
ソウルドアウト	1,100	2,307.00	2,537,700	
日総工産	5,400	1,526.00	8,240,400	
キュービーネットホールディングス	6,500	2,414.00	15,691,000	
ＲＰＡホールディングス	4,200	2,346.00	9,853,200	
三櫻工業	14,800	463.00	6,852,400	
マキタ	137,100	3,710.00	508,641,000	
東芝テック	14,100	3,165.00	44,626,500	
芝浦メカトロニクス	2,000	2,803.00	5,606,000	
マブチモーター	31,200	3,780.00	117,936,000	
日本電産	135,600	14,480.00	1,963,488,000	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	6,100	1,352.00	8,247,200	
トレックス・セミコンダクター	4,000	1,195.00	4,780,000	
東光高岳	5,600	1,235.00	6,916,000	
ダブル・スコープ	16,500	1,396.00	23,034,000	
宮越ホールディングス	4,300	919.00	3,951,700	
ダイヘン	12,400	3,085.00	38,254,000	
田淵電機	16,400	112.00	1,836,800	
ヤーマン	16,400	949.00	15,563,600	
ＪＶＣケンウッド	86,900	252.00	21,898,800	
ミマキエンジニアリング	10,300	620.00	6,386,000	
第一精工	4,800	1,296.00	6,220,800	
日新電機	26,500	1,221.00	32,356,500	
大崎電気工業	22,500	709.00	15,952,500	
オムロン	119,900	5,530.00	663,047,000	
日東工業	18,100	2,122.00	38,408,200	
ＩＤＥＣ	15,100	2,041.00	30,819,100	
不二電機工業	1,300	1,272.00	1,653,600	
ジーエス・ユアサ　コーポレーション	40,500	2,123.00	85,981,500	
サクサホールディングス	2,900	1,973.00	5,721,700	
メルコホールディングス	4,700	3,085.00	14,499,500	
テクノメディカ	2,600	2,150.00	5,590,000	
日本電気	145,800	4,355.00	634,959,000	
富士通	108,600	7,758.00	842,518,800	
沖電気工業	48,800	1,348.00	65,782,400	
岩崎通信機	5,400	804.00	4,341,600	
電気興業	5,900	2,959.00	17,458,100	
サンケン電気	13,300	2,346.00	31,201,800	
ナカヨ	2,100	1,638.00	3,439,800	
アイホン	6,300	1,726.00	10,873,800	
ルネサスエレクトロニクス	117,000	613.00	71,721,000	
セイコーエプソン	139,700	1,754.00	245,033,800	
ワコム	81,700	372.00	30,392,400	
アルバック	22,500	3,670.00	82,575,000	
アクセル	4,900	711.00	3,483,900	

ＥＩＺＯ	10,300	4,060.00	41,818,000	
ジャパンディスプレイ	267,500	79.00	21,132,500	
日本信号	28,800	1,243.00	35,798,400	
京三製作所	24,200	378.00	9,147,600	
能美防災	14,900	2,346.00	34,955,400	
ホーチキ	7,200	1,382.00	9,950,400	
星和電機	4,200	531.00	2,230,200	
エレコム	10,700	3,880.00	41,516,000	
パナソニック	1,287,500	925.00	1,190,937,500	
シャープ	111,900	1,412.00	158,002,800	
アンリツ	72,600	1,858.00	134,890,800	
富士通ゼネラル	34,500	1,694.00	58,443,000	
ソニー	756,400	5,974.00	4,518,733,600	
ＴＤＫ	59,000	8,490.00	500,910,000	
帝国通信工業	4,900	1,188.00	5,821,200	
タムラ製作所	43,600	598.00	26,072,800	
アルプスアルパイン	117,300	1,877.00	220,172,100	
池上通信機	3,700	1,111.00	4,110,700	
日本電波工業	10,400	501.00	5,210,400	
鈴木	6,000	660.00	3,960,000	
日本トリム	2,100	5,010.00	10,521,000	
ローランド　ディー．ジー．	5,600	2,494.00	13,966,400	
フォスター電機	12,800	1,647.00	21,081,600	
ＳＭＫ	3,200	2,823.00	9,033,600	
ヨコオ	8,100	2,198.00	17,803,800	
ティアック	8,500	203.00	1,725,500	
ホシデン	33,300	1,212.00	40,359,600	
ヒロセ電機	16,200	12,080.00	195,696,000	
日本航空電子工業	25,900	1,547.00	40,067,300	
ＴＯＡ	12,200	1,272.00	15,518,400	
マクセルホールディングス	24,300	1,534.00	37,276,200	
古野電気	14,600	1,022.00	14,921,200	
ユニデンホールディングス	3,400	2,002.00	6,806,800	
スミダコーポレーション	9,600	1,174.00	11,270,400	
アイコム	6,100	2,486.00	15,164,600	
リオン	5,200	2,174.00	11,304,800	
本多通信工業	9,900	509.00	5,039,100	
船井電機	11,700	815.00	9,535,500	
横河電機	112,800	2,140.00	241,392,000	
新電元工業	4,000	3,580.00	14,320,000	
アズビル	71,100	2,648.00	188,272,800	
東亜ディーケーケー	5,600	824.00	4,614,400	
日本光電工業	49,700	2,964.00	147,310,800	
チノー	4,000	1,434.00	5,736,000	
共和電業	12,000	420.00	5,040,000	
日本電子材料	4,700	533.00	2,505,100	
堀場製作所	22,400	5,730.00	128,352,000	
アドバンテスト	76,900	3,080.00	236,852,000	
小野測器	5,200	563.00	2,927,600	
エスペック	10,000	2,304.00	23,040,000	

キーエンス	55,300	64,570.00	3,570,721,000	
日置電機	5,800	3,585.00	20,793,000	
シスメックス	87,800	7,454.00	654,461,200	
日本マイクロニクス	18,700	983.00	18,382,100	
メガチップス	8,900	1,444.00	12,851,600	
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	5,800	3,700.00	21,460,000	
ＩＭＡＧＩＣＡ　ＧＲＯＵＰ	9,600	652.00	6,259,200	
澤藤電機	1,400	1,784.00	2,497,600	
デンソー	248,200	4,602.00	1,142,216,400	
原田工業	3,700	831.00	3,074,700	
コーセル	14,300	1,151.00	16,459,300	
イリソ電子工業	10,300	5,420.00	55,826,000	
オプテックスグループ	19,800	1,369.00	27,106,200	
千代田インテグレ	4,700	2,168.00	10,189,600	
アイ・オー・データ機器	4,300	949.00	4,080,700	
レーザーテック	23,200	4,445.00	103,124,000	
スタンレー電気	79,800	2,668.00	212,906,400	
岩崎電気	4,500	1,304.00	5,868,000	
ウシオ電機	65,400	1,441.00	94,241,400	
岡谷電機産業	8,300	388.00	3,220,400	
ヘリオス　テクノ　ホールディング	10,700	649.00	6,944,300	
エノモト	2,500	809.00	2,022,500	
日本セラミック	11,500	2,986.00	34,339,000	
遠藤照明	5,800	758.00	4,396,400	
古河電池	8,300	654.00	5,428,200	
双信電機	5,600	562.00	3,147,200	
山一電機	8,300	1,064.00	8,831,200	
図研	7,300	1,781.00	13,001,300	
日本電子	22,300	2,425.00	54,077,500	
カシオ計算機	99,700	1,327.00	132,301,900	
ファナック	107,100	19,605.00	2,099,695,500	
日本シイエムケイ	28,800	625.00	18,000,000	
エンプラス	5,000	3,200.00	16,000,000	
大真空	4,200	1,186.00	4,981,200	
ローム	54,000	7,380.00	398,520,000	
浜松ホトニクス	80,800	4,165.00	336,532,000	
三井ハイテック	12,600	1,212.00	15,271,200	
新光電気工業	37,900	941.00	35,663,900	
京セラ	171,800	7,203.00	1,237,475,400	
協栄産業	1,300	1,460.00	1,898,000	
太陽誘電	50,200	2,120.00	106,424,000	
村田製作所	354,800	4,904.00	1,739,939,200	
双葉電子工業	18,300	1,432.00	26,205,600	
日東電工	77,700	5,247.00	407,691,900	
北陸電気工業	4,300	1,086.00	4,669,800	
東海理化電機製作所	29,700	1,813.00	53,846,100	
ニチコン	35,400	897.00	31,753,800	
日本ケミコン	8,000	1,686.00	13,488,000	
ＫＯＡ	17,000	1,408.00	23,936,000	
三井Ｅ＆Ｓホールディングス	40,800	950.00	38,760,000	

日立造船	89,400	402.00	35,938,800	
三菱重工業	188,900	4,788.00	904,453,200	
川崎重工業	87,500	2,535.00	221,812,500	
ＩＨＩ	86,600	2,514.00	217,712,400	
名村造船所	33,600	298.00	10,012,800	
サノヤスホールディングス	15,600	210.00	3,276,000	
スプリックス	3,200	1,679.00	5,372,800	
日本車輌製造	4,200	2,519.00	10,579,800	
三菱ロジスネクスト	13,500	1,139.00	15,376,500	
近畿車輌	1,700	1,771.00	3,010,700	
ＦＰＧ	35,100	935.00	32,818,500	
島根銀行	2,600	714.00	1,856,400	
じもとホールディングス	77,600	107.00	8,303,200	
全国保証	31,400	4,395.00	138,003,000	
めぶきフィナンシャルグループ	576,700	284.00	163,782,800	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	14,900	1,635.00	24,361,500	
九州フィナンシャルグループ	182,300	444.00	80,941,200	
かんぽ生命保険	39,400	1,795.00	70,723,000	
ゆうちょ銀行	314,300	1,107.00	347,930,100	
富山第一銀行	26,300	327.00	8,600,100	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	697,400	419.00	292,210,600	
ジェイリース	2,700	368.00	993,600	
西日本フィナンシャルホールディングス	69,800	801.00	55,909,800	
マーキュリアインベストメント	4,600	822.00	3,781,200	
イントラスト	3,400	610.00	2,074,000	
日本モーゲージサービス	1,600	1,213.00	1,940,800	
ＣＡＳＡ	4,000	1,145.00	4,580,000	
アルヒ	10,200	2,060.00	21,012,000	
プレミアグループ	6,400	1,950.00	12,480,000	
日産自動車	1,329,100	776.30	1,031,780,330	
いすゞ自動車	356,400	1,221.00	435,164,400	
トヨタ自動車	1,256,100	6,865.00	8,623,126,500	＊
日野自動車	140,700	859.00	120,861,300	
三菱自動車工業	417,300	505.00	210,736,500	
エフテック	8,100	742.00	6,010,200	
レシップホールディングス	4,400	819.00	3,603,600	
ＧＭＢ	2,400	842.00	2,020,800	
ファルテック	2,000	814.00	1,628,000	
武蔵精密工業	27,400	1,419.00	38,880,600	
日産車体	22,000	1,094.00	24,068,000	
新明和工業	47,200	1,344.00	63,436,800	
極東開発工業	22,400	1,367.00	30,620,800	
日信工業	20,800	1,494.00	31,075,200	
トピー工業	9,300	2,407.00	22,385,100	
ティラド	4,200	1,906.00	8,005,200	
曙ブレーキ工業	63,900	128.00	8,179,200	
タチエス	18,500	1,376.00	25,456,000	
ＮＯＫ	60,300	1,649.00	99,434,700	

フタバ産業	31,600	637.00	20,129,200	
ＫＹＢ	11,800	3,180.00	37,524,000	
市光工業	17,000	725.00	12,325,000	
大同メタル工業	18,500	663.00	12,265,500	
プレス工業	56,000	491.00	27,496,000	
ミクニ	14,800	381.00	5,638,800	
太平洋工業	23,700	1,591.00	37,706,700	
ケーヒン	25,900	1,511.00	39,134,900	
河西工業	13,900	835.00	11,606,500	
アイシン精機	92,900	3,690.00	342,801,000	
マツダ	353,700	1,115.50	394,552,350	
今仙電機製作所	10,600	933.00	9,889,800	
本田技研工業	950,800	2,844.00	2,704,075,200	
スズキ	206,300	4,590.00	946,917,000	
ＳＵＢＡＲＵ	350,000	2,747.00	961,450,000	
安永	5,500	1,465.00	8,057,500	
ヤマハ発動機	159,200	1,893.00	301,365,600	
ショーワ	26,700	1,449.00	38,688,300	
小糸製作所	67,500	5,870.00	396,225,000	
ＴＢＫ	13,800	402.00	5,547,600	
エクセディ	15,200	2,240.00	34,048,000	
ミツバ	20,900	630.00	13,167,000	
豊田合成	36,400	2,074.00	75,493,600	
愛三工業	17,500	685.00	11,987,500	
盟和産業	1,800	1,043.00	1,877,400	
日本プラスト	9,000	720.00	6,480,000	
ヨロズ	10,600	1,371.00	14,532,600	
エフ・シー・シー	20,400	2,166.00	44,186,400	
新家工業	2,700	1,530.00	4,131,000	
シマノ	45,400	15,860.00	720,044,000	
テイ・エス　テック	26,200	2,953.00	77,368,600	
関西みらいフィナンシャルグループ	52,100	748.00	38,970,800	
三十三フィナンシャルグループ	9,400	1,564.00	14,701,600	
第四北越フィナンシャルグループ	19,200	2,844.00	54,604,800	
ジャムコ	5,600	2,100.00	11,760,000	
小野建	9,900	1,436.00	14,216,400	
はるやまホールディングス	5,200	815.00	4,238,000	
南陽	2,400	1,657.00	3,976,800	
ノジマ	19,700	1,843.00	36,307,100	
佐鳥電機	8,200	890.00	7,298,000	
カッパ・クリエイト	15,500	1,427.00	22,118,500	
エコートレーディング	2,700	544.00	1,468,800	
伯東	7,500	1,249.00	9,367,500	
コンドーテック	8,600	935.00	8,041,000	
中山福	6,200	552.00	3,422,400	
ライトオン	8,300	732.00	6,075,600	
ナガイレーベン	16,000	2,414.00	38,624,000	
ジーンズメイト	3,800	361.00	1,371,800	
三菱食品	12,100	2,917.00	35,295,700	
良品計画	15,600	19,570.00	305,292,000	

三城ホールディングス	13,800	360.00	4,968,000	
松田産業	8,100	1,538.00	12,457,800	
第一興商	16,500	5,010.00	82,665,000	
メディパルホールディングス	119,800	2,401.00	287,639,800	
アドヴァン	17,000	1,138.00	19,346,000	
ＳＰＫ	2,600	2,530.00	6,578,000	
萩原電気ホールディングス	4,200	2,941.00	12,352,200	
アルビス	4,300	2,749.00	11,820,700	
アズワン	8,000	9,170.00	73,360,000	
スズデン	4,000	1,368.00	5,472,000	
尾家産業	3,500	1,332.00	4,662,000	
シモジマ	6,800	1,155.00	7,854,000	
ドウシシャ	10,400	1,752.00	18,220,800	
小津産業	2,600	1,744.00	4,534,400	
コナカ	13,100	445.00	5,829,500	
高速	6,500	1,239.00	8,053,500	
ハウス　オブ　ローゼ	1,500	1,635.00	2,452,500	
Ｇ－７ホールディングス	3,400	3,060.00	10,404,000	
たけびし	3,900	1,428.00	5,569,200	
イオン北海道	10,800	747.00	8,067,600	
コジマ	17,000	512.00	8,704,000	
ヒマラヤ	3,700	833.00	3,082,100	
コーナン商事	14,600	2,352.00	34,339,200	
ネットワンシステムズ	39,200	2,942.00	115,326,400	
エコス	4,200	1,521.00	6,388,200	
ワタミ	14,700	1,536.00	22,579,200	
マルシェ	3,300	783.00	2,583,900	
リックス	2,700	1,561.00	4,214,700	
システムソフト	27,900	122.00	3,403,800	
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	66,500	6,850.00	455,525,000	
丸文	10,000	602.00	6,020,000	
西松屋チェーン	24,300	874.00	21,238,200	
ゼンショーホールディングス	52,500	2,315.00	121,537,500	
ハピネット	9,300	1,341.00	12,471,300	
幸楽苑ホールディングス	7,100	2,938.00	20,859,800	
ハークスレイ	2,400	1,067.00	2,560,800	
橋本総業ホールディングス	2,400	1,613.00	3,871,200	
日本ライフライン	32,900	1,942.00	63,891,800	
サイゼリヤ	18,300	2,648.00	48,458,400	
タカショー	5,700	463.00	2,639,100	
エクセル	4,200	1,644.00	6,904,800	
ＶＴホールディングス	50,500	421.00	21,260,500	
マルカ	3,700	1,970.00	7,289,000	
アルゴグラフィックス	9,400	2,452.00	23,048,800	
魚力	3,200	1,514.00	4,844,800	
ＩＤＯＭ	37,700	315.00	11,875,500	
日本エム・ディ・エム	6,500	1,504.00	9,776,000	
ポプラ	3,100	506.00	1,568,600	
フジ・コーポレーション	2,400	2,090.00	5,016,000	

ユナイテッドアローズ	12,800	3,330.00	42,624,000	
進和	6,500	2,311.00	15,021,500	
エスケイジャパン	2,900	600.00	1,740,000	
ダイトロン	5,100	1,220.00	6,222,000	
ハイデイ日高	16,000	2,058.00	32,928,000	
シークス	14,100	1,374.00	19,373,400	
京都きもの友禅	7,300	342.00	2,496,600	
コロワイド	36,900	2,158.00	79,630,200	
ピーシーデポコーポレーション	14,800	458.00	6,778,400	
田中商事	3,800	619.00	2,352,200	
オーハシテクニカ	6,400	1,502.00	9,612,800	
壱番屋	7,800	4,930.00	38,454,000	
白銅	3,800	1,441.00	5,475,800	
トップカルチャー	4,600	358.00	1,646,800	
ＰＬＡＮＴ	2,700	788.00	2,127,600	
スギホールディングス	24,400	5,280.00	128,832,000	
島津製作所	145,000	2,783.00	403,535,000	
ＪＭＳ	10,600	760.00	8,056,000	
クボテック	2,700	437.00	1,179,900	
長野計器	9,000	786.00	7,074,000	
ブイ・テクノロジー	5,200	5,140.00	26,728,000	
スター精密	19,200	1,428.00	27,417,600	
東京計器	7,300	987.00	7,205,100	
愛知時計電機	1,500	4,120.00	6,180,000	
インターアクション	5,400	1,409.00	7,608,600	
オーバル	11,200	264.00	2,956,800	
東京精密	20,500	2,804.00	57,482,000	
マニー	14,900	7,820.00	116,518,000	
ニコン	196,300	1,577.00	309,565,100	
トプコン	60,500	1,345.00	81,372,500	
オリンパス	671,700	1,223.00	821,489,100	
理研計器	9,900	2,019.00	19,988,100	
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	19,500	5,100.00	99,450,000	
キヤノン電子	10,200	1,936.00	19,747,200	
タムロン	10,000	2,271.00	22,710,000	
ＨＯＹＡ	226,900	8,155.00	1,850,369,500	
シード	4,900	1,170.00	5,733,000	
ノーリツ鋼機	8,900	2,076.00	18,476,400	
エー・アンド・デイ	10,400	812.00	8,444,800	
朝日インテック	95,600	2,759.00	263,760,400	
キヤノン	606,700	3,217.00	1,951,753,900	
リコー	338,700	1,057.00	358,005,900	
シチズン時計	123,000	564.00	69,372,000	
リズム時計工業	3,900	1,380.00	5,382,000	
大研医器	9,000	646.00	5,814,000	
メニコン	15,400	3,755.00	57,827,000	
シンシア	1,800	618.00	1,112,400	
中本パックス	3,400	1,532.00	5,208,800	
スノーピーク	4,500	1,448.00	6,516,000	
パラマウントベッドホールディングス	13,000	4,155.00	54,015,000	

トランザクション	6,300	978.00	6,161,400	
ＳＨＯ‐ＢＩ	3,600	378.00	1,360,800	
ニホンフラッシュ	4,900	2,848.00	13,955,200	
前田工繊	12,500	1,969.00	24,612,500	
永大産業	14,900	376.00	5,602,400	
アートネイチャー	11,900	678.00	8,068,200	
バンダイナムコホールディングス	116,500	6,190.00	721,135,000	
アイフィスジャパン	2,800	633.00	1,772,400	
共立印刷	19,600	188.00	3,684,800	
ＳＨＯＥＩ	5,400	4,600.00	24,840,000	
フランスベッドホールディングス	15,800	999.00	15,784,200	
マーベラス	16,900	812.00	13,722,800	
パイロットコーポレーション	19,600	4,135.00	81,046,000	
萩原工業	6,300	1,365.00	8,599,500	
エイベックス	18,900	1,419.00	26,819,100	
トッパン・フォームズ	24,100	928.00	22,364,800	
フジシールインターナショナル	25,300	3,405.00	86,146,500	
タカラトミー	47,200	1,314.00	62,020,800	
廣済堂	10,600	704.00	7,462,400	
エステールホールディングス	3,000	624.00	1,872,000	
アーク	44,200	103.00	4,552,600	
レック	12,200	1,210.00	14,762,000	
タカノ	4,400	780.00	3,432,000	
三光合成	9,400	361.00	3,393,400	
プロネクサス	9,700	1,142.00	11,077,400	
ホクシン	7,600	133.00	1,010,800	
ウッドワン	3,900	1,036.00	4,040,400	
大建工業	8,600	2,182.00	18,765,200	
きもと	19,600	172.00	3,371,200	
凸版印刷	159,000	1,770.00	281,430,000	
大日本印刷	158,700	2,372.00	376,436,400	
図書印刷	10,700	1,409.00	15,076,300	
共同印刷	3,600	2,857.00	10,285,200	
ＮＩＳＳＨＡ	23,200	1,180.00	27,376,000	
光村印刷	1,000	2,005.00	2,005,000	
藤森工業	10,100	2,956.00	29,855,600	
ヴィア・ホールディングス	13,900	623.00	8,659,700	
宝印刷	5,600	1,682.00	9,419,200	
前澤化成工業	7,700	1,126.00	8,670,200	
未来工業	6,000	1,926.00	11,556,000	
アシックス	106,300	1,186.00	126,071,800	
ツツミ	3,600	2,050.00	7,380,000	
ウェーブロックホールディングス	2,500	699.00	1,747,500	
ＪＳＰ	6,500	2,027.00	13,175,500	
ニチハ	15,600	3,035.00	47,346,000	
エフピコ	12,400	6,550.00	81,220,000	
小松ウオール工業	3,500	1,881.00	6,583,500	
ヤマハ	67,000	5,130.00	343,710,000	
河合楽器製作所	3,600	3,185.00	11,466,000	
クリナップ	10,400	584.00	6,073,600	

ピジョン	68,100	4,000.00	272,400,000	
天馬	7,800	1,895.00	14,781,000	
兼松サステック	800	1,690.00	1,352,000	
キングジム	9,400	838.00	7,877,200	
象印マホービン	28,000	1,337.00	37,436,000	
リンテック	26,700	2,259.00	60,315,300	
信越ポリマー	20,200	740.00	14,948,000	
東リ	27,900	252.00	7,030,800	
イトーキ	20,600	468.00	9,640,800	
任天堂	64,400	41,660.00	2,682,904,000	
三菱鉛筆	18,500	1,730.00	32,005,000	
松風	5,500	1,457.00	8,013,500	
タカラスタンダード	23,200	1,741.00	40,391,200	
コクヨ	54,100	1,516.00	82,015,600	
ナカバヤシ	11,200	536.00	6,003,200	
ニフコ	45,100	2,684.00	121,048,400	
立川ブラインド工業	4,900	1,438.00	7,046,200	
グローブライド	5,400	3,420.00	18,468,000	
オカムラ	39,300	1,075.00	42,247,500	
バルカー	9,200	2,251.00	20,709,200	
ＭＵＴＯＨホールディングス	1,500	1,722.00	2,583,000	
伊藤忠商事	776,500	2,094.50	1,626,379,250	
丸紅	1,094,600	722.10	790,410,660	
スクロール	17,300	353.00	6,106,900	
高島	1,800	1,710.00	3,078,000	
ヨンドシーホールディングス	12,400	2,632.00	32,636,800	
三陽商会	6,600	1,592.00	10,507,200	
長瀬産業	62,300	1,609.00	100,240,700	
ナイガイ	4,500	464.00	2,088,000	
蝶理	7,000	1,761.00	12,327,000	
豊田通商	123,700	3,360.00	415,632,000	
オンワードホールディングス	66,000	593.00	39,138,000	
三共生興	18,700	539.00	10,079,300	
兼松	44,500	1,245.00	55,402,500	
美津濃	11,100	2,495.00	27,694,500	
ツカモトコーポレーション	2,000	1,064.00	2,128,000	
ユニー・ファミリーマートホールディングス	124,200	2,630.00	326,646,000	
ルックホールディングス	4,200	1,280.00	5,376,000	
三井物産	914,500	1,809.50	1,654,787,750	
日本紙パルプ商事	6,200	3,770.00	23,374,000	
東京エレクトロン	75,200	16,660.00	1,252,832,000	
日立ハイテクノロジーズ	33,700	5,900.00	198,830,000	
カメイ	14,500	1,193.00	17,298,500	
東都水産	1,600	2,588.00	4,140,800	
ＯＵＧホールディングス	1,800	2,690.00	4,842,000	
スターゼン	4,200	4,355.00	18,291,000	
セイコーホールディングス	17,300	2,300.00	39,790,000	
山善	43,400	1,067.00	46,307,800	
椿本興業	2,600	3,325.00	8,645,000	

住友商事	656,600	1,646.50	1,081,091,900	
日本ユニシス	34,600	3,705.00	128,193,000	
内田洋行	4,800	3,710.00	17,808,000	
三菱商事	779,000	2,921.50	2,275,848,500	
第一実業	5,000	3,190.00	15,950,000	
キヤノンマーケティングジャパン	31,700	2,390.00	75,763,000	
西華産業	6,200	1,374.00	8,518,800	
佐藤商事	9,900	919.00	9,098,100	
菱洋エレクトロ	11,200	1,869.00	20,932,800	
東京産業	11,200	515.00	5,768,000	
ユアサ商事	11,400	3,230.00	36,822,000	
神鋼商事	2,600	2,354.00	6,120,400	
小林産業	6,900	318.00	2,194,200	
阪和興業	19,200	2,952.00	56,678,400	
正栄食品工業	7,800	3,305.00	25,779,000	
カナデン	10,100	1,428.00	14,422,800	
菱電商事	8,700	1,646.00	14,320,200	
ニプロ	77,900	1,228.00	95,661,200	
フルサト工業	6,000	1,424.00	8,544,000	
岩谷産業	24,600	3,755.00	92,373,000	
すてきナイスグループ	4,800	598.00	2,870,400	
昭光通商	4,200	656.00	2,755,200	
ニチモウ	1,800	1,758.00	3,164,400	
極東貿易	3,500	1,588.00	5,558,000	
イワキ	13,600	503.00	6,840,800	
兼松エレクトロニクス	5,900	3,150.00	18,585,000	
三愛石油	29,700	1,065.00	31,630,500	
稲畑産業	26,600	1,399.00	37,213,400	
ＧＳＩクレオス	3,000	1,281.00	3,843,000	
明和産業	10,400	386.00	4,014,400	
キムラタン	56,700	39.00	2,211,300	
ゴールドウイン	10,000	13,800.00	138,000,000	
ユニ・チャーム	239,000	3,187.00	761,693,000	
デサント	26,900	1,767.00	47,532,300	
キング	6,000	596.00	3,576,000	
ワキタ	23,600	1,088.00	25,676,800	
ヤマトインターナショナル	6,900	423.00	2,918,700	
東邦ホールディングス	32,800	2,541.00	83,344,800	
サンゲツ	32,900	2,077.00	68,333,300	
ミツウロコグループホールディングス	14,700	851.00	12,509,700	
シナネンホールディングス	4,600	1,940.00	8,924,000	
伊藤忠エネクス	24,200	895.00	21,659,000	
サンリオ	34,400	2,419.00	83,213,600	
サンワ　テクノス	6,800	919.00	6,249,200	
リョーサン	12,300	2,582.00	31,758,600	
新光商事	10,400	1,909.00	19,853,600	
トーホー	5,000	2,109.00	10,545,000	
三信電気	7,600	1,811.00	13,763,600	
東陽テクニカ	12,800	1,007.00	12,889,600	
モスフードサービス	14,600	2,401.00	35,054,600	

加賀電子	11,000	1,697.00	18,667,000	
三益半導体工業	9,400	1,622.00	15,246,800	
ソーダニッカ	11,800	596.00	7,032,800	
立花エレテック	8,100	1,733.00	14,037,300	
木曽路	13,600	2,634.00	35,822,400	
ＳＲＳホールディングス	13,300	1,025.00	13,632,500	
千趣会	20,600	295.00	6,077,000	
タカキュー	9,100	184.00	1,674,400	
ケーヨー	20,500	490.00	10,045,000	
上新電機	13,100	2,185.00	28,623,500	
日本瓦斯	17,500	2,878.00	50,365,000	
ロイヤルホールディングス	19,300	2,797.00	53,982,100	
東天紅	800	1,218.00	974,400	
いなげや	12,400	1,463.00	18,141,200	
島忠	23,400	2,552.00	59,716,800	
チヨダ	11,500	1,631.00	18,756,500	
ライフコーポレーション	8,400	2,332.00	19,588,800	
リンガーハット	13,800	2,387.00	32,940,600	
ＭｒＭａｘＨＤ	15,500	489.00	7,579,500	
テンアライド	10,900	430.00	4,687,000	
ＡＯＫＩホールディングス	22,000	1,068.00	23,496,000	
オークワ	15,800	1,127.00	17,806,600	
コメリ	17,100	2,262.00	38,680,200	
青山商事	19,300	2,102.00	40,568,600	
しまむら	12,900	8,220.00	106,038,000	
はせがわ	6,000	404.00	2,424,000	
高島屋	87,100	1,250.00	108,875,000	
松屋	22,500	909.00	20,452,500	
エイチ・ツー・オー　リテイリング	56,800	1,286.00	73,044,800	
近鉄百貨店	4,200	3,265.00	13,713,000	
パルコ	10,600	1,173.00	12,433,800	
丸井グループ	94,000	2,410.00	226,540,000	
クレディセゾン	77,900	1,319.00	102,750,100	
アクシアル　リテイリング	9,200	3,970.00	36,524,000	
井筒屋	5,800	255.00	1,479,000	
イオン	427,200	1,880.00	803,136,000	
イズミ	22,600	4,270.00	96,502,000	
フォーバル	4,900	964.00	4,723,600	
平和堂	22,500	2,047.00	46,057,500	
フジ	13,400	1,877.00	25,151,800	
ヤオコー	12,700	4,995.00	63,436,500	
ゼビオホールディングス	13,400	1,284.00	17,205,600	
ケーズホールディングス	115,500	1,063.00	122,776,500	
ＰＡＬＴＡＣ	20,000	6,100.00	122,000,000	
三谷産業	13,800	285.00	3,933,000	
Ｏｌｙｍｐｉｃグループ	6,600	692.00	4,567,200	
日産東京販売ホールディングス	16,900	283.00	4,782,700	
新生銀行	81,700	1,733.00	141,586,100	
あおぞら銀行	62,200	2,643.00	164,394,600	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	7,652,400	526.30	4,027,458,120	

りそなホールディングス	1,220,400	459.90	561,261,960	
三井住友トラスト・ホールディングス	218,500	3,953.00	863,730,500	
三井住友フィナンシャルグループ	783,600	3,828.00	2,999,620,800	
千葉銀行	382,400	555.00	212,232,000	
群馬銀行	222,000	388.00	86,136,000	
武蔵野銀行	16,500	2,165.00	35,722,500	
千葉興業銀行	31,200	277.00	8,642,400	
筑波銀行	46,900	177.00	8,301,300	
七十七銀行	34,900	1,595.00	55,665,500	
青森銀行	8,600	2,733.00	23,503,800	
秋田銀行	7,100	2,062.00	14,640,200	
山形銀行	12,500	1,717.00	21,462,500	
岩手銀行	7,700	2,889.00	22,245,300	
東邦銀行	99,000	273.00	27,027,000	
東北銀行	5,900	1,078.00	6,360,200	
みちのく銀行	7,200	1,723.00	12,405,600	
ふくおかフィナンシャルグループ	98,100	2,046.00	200,712,600	
静岡銀行	275,300	818.00	225,195,400	
十六銀行	14,800	2,400.00	35,520,000	
スルガ銀行	114,000	415.00	47,310,000	
八十二銀行	268,400	448.00	120,243,200	
山梨中央銀行	13,400	1,174.00	15,731,600	
大垣共立銀行	23,400	2,446.00	57,236,400	
福井銀行	9,500	1,499.00	14,240,500	
北國銀行	11,500	3,055.00	35,132,500	
清水銀行	4,700	1,874.00	8,807,800	
富山銀行	2,200	2,630.00	5,786,000	
滋賀銀行	22,300	2,536.00	56,552,800	
南都銀行	17,300	2,378.00	41,139,400	
百五銀行	99,500	337.00	33,531,500	
京都銀行	39,800	4,185.00	166,563,000	
紀陽銀行	39,300	1,468.00	57,692,400	
ほくほくフィナンシャルグループ	73,900	1,167.00	86,241,300	
広島銀行	163,800	542.00	88,779,600	
山陰合同銀行	65,800	698.00	45,928,400	
中国銀行	95,600	995.00	95,122,000	
鳥取銀行	4,000	1,431.00	5,724,000	
伊予銀行	146,800	573.00	84,116,400	
百十四銀行	11,700	2,263.00	26,477,100	
四国銀行	15,800	967.00	15,278,600	
阿波銀行	17,000	2,594.00	44,098,000	
大分銀行	6,800	3,140.00	21,352,000	
宮崎銀行	7,400	2,594.00	19,195,600	
佐賀銀行	6,800	1,648.00	11,206,400	
沖縄銀行	10,100	3,455.00	34,895,500	
琉球銀行	25,700	1,156.00	29,709,200	
セブン銀行	376,000	292.00	109,792,000	
みずほフィナンシャルグループ	15,104,200	158.80	2,398,546,960	
高知銀行	4,300	805.00	3,461,500	
山口フィナンシャルグループ	138,700	778.00	107,908,600	

芙蓉総合リース	12,700	6,310.00	80,137,000	
興銀リース	20,900	2,685.00	56,116,500	
東京センチュリー	22,400	4,630.00	103,712,000	
ＳＢＩホールディングス	132,500	2,743.00	363,447,500	
日本証券金融	49,200	575.00	28,290,000	
アイフル	170,600	229.00	39,067,400	
日本アジア投資	9,800	267.00	2,616,600	
長野銀行	3,900	1,764.00	6,879,600	
名古屋銀行	8,900	3,470.00	30,883,000	
北洋銀行	167,300	256.00	42,828,800	
愛知銀行	4,100	3,845.00	15,764,500	
中京銀行	4,600	2,259.00	10,391,400	
大光銀行	4,000	1,828.00	7,312,000	
愛媛銀行	15,400	1,096.00	16,878,400	
トマト銀行	4,600	1,066.00	4,903,600	
京葉銀行	47,400	670.00	31,758,000	
栃木銀行	57,800	184.00	10,635,200	
北日本銀行	3,700	1,834.00	6,785,800	
東和銀行	19,600	723.00	14,170,800	
福島銀行	10,000	260.00	2,600,000	
大東銀行	5,400	551.00	2,975,400	
リコーリース	8,700	3,365.00	29,275,500	
イオンフィナンシャルサービス	71,100	1,785.00	126,913,500	
アコム	223,600	390.00	87,204,000	
ジャックス	12,300	2,261.00	27,810,300	
オリエントコーポレーション	301,000	128.00	38,528,000	
日立キャピタル	26,200	2,313.00	60,600,600	
アプラスフィナンシャル	54,800	74.00	4,055,200	
オリックス	741,700	1,661.00	1,231,963,700	
三菱ＵＦＪリース	250,500	589.00	147,544,500	
ジャフコ	18,200	4,165.00	75,803,000	
九州リースサービス	5,700	628.00	3,579,600	
トモニホールディングス	85,800	378.00	32,432,400	
大和証券グループ本社	891,400	472.90	421,543,060	
野村ホールディングス	1,954,900	378.80	740,516,120	
岡三証券グループ	94,000	407.00	38,258,000	
丸三証券	33,100	569.00	18,833,900	
東洋証券	39,900	124.00	4,947,600	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	132,400	331.00	43,824,400	
光世証券	2,700	675.00	1,822,500	
水戸証券	33,200	210.00	6,972,000	
いちよし証券	23,300	765.00	17,824,500	
松井証券	54,500	1,017.00	55,426,500	
ＳＯＭＰＯホールディングス	195,900	4,400.00	861,960,000	
だいこう証券ビジネス	4,800	497.00	2,385,600	
日本取引所グループ	300,400	1,745.00	524,198,000	
マネックスグループ	103,000	359.00	36,977,000	
極東証券	14,900	912.00	13,588,800	
岩井コスモホールディングス	11,500	1,194.00	13,731,000	

藍澤證券	20,100	671.00	13,487,100	
フィデアホールディングス	109,700	121.00	13,273,700	
池田泉州ホールディングス	119,600	209.00	24,996,400	
アニコム　ホールディングス	9,200	3,740.00	34,408,000	
ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホールディングス	290,600	3,571.00	1,037,732,600	
ソニーフィナンシャルホールディングス	91,400	2,595.00	237,183,000	
マネーパートナーズグループ	13,700	299.00	4,096,300	
スパークス・グループ	44,500	237.00	10,546,500	
小林洋行	3,500	249.00	871,500	
第一生命ホールディングス	628,900	1,637.50	1,029,823,750	
東京海上ホールディングス	397,500	5,593.00	2,223,217,500	
アドバンテッジリスクマネジメント	4,500	729.00	3,280,500	
イー・ギャランティ	10,500	1,361.00	14,290,500	
アサックス	4,900	583.00	2,856,700	
ＮＥＣキャピタルソリューション	4,600	1,957.00	9,002,200	
Ｔ＆Ｄホールディングス	343,800	1,197.50	411,700,500	
アドバンスクリエイト	2,800	1,843.00	5,160,400	
三井不動産	589,800	2,611.50	1,540,262,700	
三菱地所	779,000	2,049.00	1,596,171,000	
平和不動産	20,400	2,343.00	47,797,200	
東京建物	121,500	1,302.00	158,193,000	
ダイビル	32,700	1,050.00	34,335,000	
京阪神ビルディング	19,900	1,046.00	20,815,400	
住友不動産	249,900	3,987.00	996,351,300	
太平洋興発	4,500	772.00	3,474,000	
テーオーシー	25,400	713.00	18,110,200	
東京楽天地	1,600	5,190.00	8,304,000	
レオパレス２１	137,400	250.00	34,350,000	
スターツコーポレーション	15,000	2,658.00	39,870,000	
フジ住宅	14,300	776.00	11,096,800	
空港施設	12,700	516.00	6,553,200	
明和地所	6,600	574.00	3,788,400	
ゴールドクレスト	8,800	1,986.00	17,476,800	
リログループ	58,900	2,899.00	170,751,100	
日本エスリード	4,500	1,669.00	7,510,500	
日神不動産	16,500	486.00	8,019,000	
日本エスコン	20,200	713.00	14,402,600	
タカラレーベン	50,900	398.00	20,258,200	
サンヨーハウジング名古屋	6,300	956.00	6,022,800	
イオンモール	55,600	1,741.00	96,799,600	
ファースト住建	4,300	1,250.00	5,375,000	
ランド	479,500	9.00	4,315,500	
カチタス	12,500	4,120.00	51,500,000	
東祥	6,800	2,709.00	18,421,200	
トーセイ	15,300	1,150.00	17,595,000	
穴吹興産	1,200	2,897.00	3,476,400	
サンフロンティア不動産	15,400	1,117.00	17,201,800	
エフ・ジェー・ネクスト	9,900	1,083.00	10,721,700	

インテリックス	3,500	703.00	2,460,500	
ランドビジネス	5,000	770.00	3,850,000	
グランディハウス	10,200	480.00	4,896,000	
東武鉄道	118,800	3,155.00	374,814,000	
相鉄ホールディングス	38,600	2,977.00	114,912,200	
東京急行電鉄	306,200	1,958.00	599,539,600	
京浜急行電鉄	154,300	1,868.00	288,232,400	
小田急電鉄	180,600	2,580.00	465,948,000	
京王電鉄	63,100	7,130.00	449,903,000	
京成電鉄	84,500	4,040.00	341,380,000	
富士急行	15,300	4,145.00	63,418,500	
新京成電鉄	3,000	2,043.00	6,129,000	
東日本旅客鉄道	200,400	10,240.00	2,052,096,000	
西日本旅客鉄道	101,000	8,883.00	897,183,000	
東海旅客鉄道	100,900	21,840.00	2,203,656,000	
西武ホールディングス	139,600	1,807.00	252,257,200	
鴻池運輸	17,900	1,741.00	31,163,900	
西日本鉄道	31,100	2,387.00	74,235,700	
ハマキョウレックス	8,700	3,840.00	33,408,000	
サカイ引越センター	5,900	6,680.00	39,412,000	
近鉄グループホールディングス	106,800	5,250.00	560,700,000	
阪急阪神ホールディングス	142,400	3,860.00	549,664,000	
南海電気鉄道	47,600	2,663.00	126,758,800	
京阪ホールディングス	47,600	4,615.00	219,674,000	
神戸電鉄	2,900	4,020.00	11,658,000	
名古屋鉄道	87,500	3,025.00	264,687,500	
山陽電気鉄道	8,300	2,168.00	17,994,400	
トランコム	3,100	6,400.00	19,840,000	
日本通運	41,100	5,790.00	237,969,000	
ヤマトホールディングス	187,200	2,210.50	413,805,600	
山九	29,700	5,720.00	169,884,000	
日新	9,200	1,839.00	16,918,800	
丸運	6,100	286.00	1,744,600	
丸全昭和運輸	8,700	3,440.00	29,928,000	
センコーグループホールディングス	58,900	872.00	51,360,800	
トナミホールディングス	2,600	5,840.00	15,184,000	
ニッコンホールディングス	40,500	2,579.00	104,449,500	
日本石油輸送	1,300	2,878.00	3,741,400	
福山通運	13,700	4,055.00	55,553,500	
セイノーホールディングス	80,000	1,419.00	113,520,000	
エスライン	3,200	991.00	3,171,200	
神奈川中央交通	2,700	3,830.00	10,341,000	
日立物流	23,600	3,430.00	80,948,000	
丸和運輸機関	5,600	4,575.00	25,620,000	
Ｃ＆Ｆロジホールディングス	10,800	1,360.00	14,688,000	
日本郵船	89,200	1,818.00	162,165,600	
商船三井	63,300	2,667.00	168,821,100	
川崎汽船	33,000	1,457.00	48,081,000	
ＮＳユナイテッド海運	5,800	2,417.00	14,018,600	
明治海運	11,400	324.00	3,693,600	

飯野海運	50,300	367.00	18,460,100	
共栄タンカー	800	1,448.00	1,158,400	
九州旅客鉄道	89,600	3,165.00	283,584,000	
ＳＧホールディングス	100,900	3,020.00	304,718,000	
日本航空	195,300	3,468.00	677,300,400	
ＡＮＡホールディングス	195,100	3,658.00	713,675,800	
パスコ	2,200	846.00	1,861,200	
西本Ｗｉｓｍｅｔｔａｃホールディングス	2,600	3,810.00	9,906,000	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	900	1,419.00	1,277,100	
Ｇｅｎｋｙ　ＤｒｕｇＳｔｏｒｅｓ	4,700	2,671.00	12,553,700	
国際紙パルプ商事	20,000	326.00	6,520,000	
総合メディカルホールディングス	9,700	1,737.00	16,848,900	
ブックオフグループホールディングス	5,900	1,251.00	7,380,900	
三菱倉庫	36,900	3,020.00	111,438,000	
三井倉庫ホールディングス	13,200	1,565.00	20,658,000	
住友倉庫	39,200	1,403.00	54,997,600	
澁澤倉庫	5,800	1,772.00	10,277,600	
ヤマタネ	5,600	1,409.00	7,890,400	
東陽倉庫	19,700	326.00	6,422,200	
乾汽船	9,800	879.00	8,614,200	
日本トランスシティ	23,600	516.00	12,177,600	
ケイヒン	2,000	1,254.00	2,508,000	
中央倉庫	6,500	1,102.00	7,163,000	
川西倉庫	2,200	1,059.00	2,329,800	
安田倉庫	8,800	910.00	8,008,000	
東洋埠頭	3,400	1,426.00	4,848,400	
宇徳	9,400	500.00	4,700,000	
上組	65,800	2,556.00	168,184,800	
サンリツ	2,700	651.00	1,757,700	
キムラユニティー	3,100	1,113.00	3,450,300	
キユーソー流通システム	2,700	2,050.00	5,535,000	
近鉄エクスプレス	20,100	1,427.00	28,682,700	
東海運	6,200	277.00	1,717,400	
エーアイテイー	7,100	1,061.00	7,533,100	
内外トランスライン	3,600	1,334.00	4,802,400	
日本コンセプト	3,200	1,283.00	4,105,600	
東京放送ホールディングス	73,400	1,915.00	140,561,000	
日本テレビホールディングス	101,500	1,681.00	170,621,500	
朝日放送グループホールディングス	10,600	737.00	7,812,200	
テレビ朝日ホールディングス	30,300	1,897.00	57,479,100	
スカパーＪＳＡＴホールディングス	72,800	434.00	31,595,200	
テレビ東京ホールディングス	9,100	2,371.00	21,576,100	
日本ＢＳ放送	4,000	1,074.00	4,296,000	
ビジョン	3,500	4,990.00	17,465,000	
スマートバリュー	3,400	733.00	2,492,200	
ＵＳＥＮ－ＮＥＸＴ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	4,300	831.00	3,573,300	
ワイヤレスゲート	5,200	553.00	2,875,600	
コネクシオ	7,800	1,428.00	11,138,400	

日本通信	96,600	273.00	26,371,800	
クロップス	2,100	617.00	1,295,700	
日本電信電話	756,500	5,200.00	3,933,800,000	
ＫＤＤＩ	906,700	2,883.50	2,614,469,450	
ソフトバンク	1,172,900	1,442.00	1,691,321,800	
光通信	13,100	23,800.00	311,780,000	
ＮＴＴドコモ	700,100	2,605.00	1,823,760,500	
エムティーアイ	10,900	791.00	8,621,900	
GMOインターネット	40,400	1,929.00	77,931,600	
アイドママーケティングコミュニケーション	2,600	680.00	1,768,000	
ＫＡＤＯＫＡＷＡ	32,400	1,466.00	47,498,400	
学研ホールディングス	3,800	5,370.00	20,406,000	
ゼンリン	22,100	1,978.00	43,713,800	
昭文社	5,300	357.00	1,892,100	
インプレスホールディングス	9,600	143.00	1,372,800	
東京電力ホールディングス	900,000	553.00	497,700,000	
中部電力	345,000	1,520.50	524,572,500	
関西電力	460,000	1,283.50	590,410,000	
中国電力	155,900	1,360.00	212,024,000	
北陸電力	110,500	786.00	86,853,000	
東北電力	263,800	1,095.00	288,861,000	
四国電力	101,500	1,014.00	102,921,000	
九州電力	232,400	1,084.00	251,921,600	
北海道電力	105,700	604.00	63,842,800	
沖縄電力	21,000	1,746.00	36,666,000	
電源開発	89,600	2,500.00	224,000,000	
エフオン	5,500	835.00	4,592,500	
イーレックス	19,600	1,149.00	22,520,400	
レノバ	18,600	807.00	15,010,200	
東京瓦斯	221,100	2,674.50	591,331,950	
大阪瓦斯	218,700	1,925.00	420,997,500	
東邦瓦斯	55,800	3,965.00	221,247,000	
北海道瓦斯	5,900	1,491.00	8,796,900	
広島ガス	22,800	338.00	7,706,400	
西部瓦斯	12,700	2,244.00	28,498,800	
静岡ガス	34,600	830.00	28,718,000	
メタウォーター	5,400	3,490.00	18,846,000	
アイネット	6,200	1,232.00	7,638,400	
松竹	7,300	12,750.00	93,075,000	
東宝	72,800	4,805.00	349,804,000	
エイチ・アイ・エス	19,200	2,659.00	51,052,800	
東映	4,700	15,150.00	71,205,000	
ラックランド	2,200	2,260.00	4,972,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	294,400	1,479.00	435,417,600	
共立メンテナンス	16,500	4,815.00	79,447,500	
イチネンホールディングス	11,200	1,148.00	12,857,600	
建設技術研究所	7,600	1,549.00	11,772,400	
スペース	6,900	1,202.00	8,293,800	
長　大	4,400	769.00	3,383,600	

アインホールディングス	14,800	6,530.00	96,644,000	
燦ホールディングス	2,400	2,322.00	5,572,800	
ピー・シー・エー	1,500	3,440.00	5,160,000	
スバル興業	700	6,270.00	4,389,000	
東京テアトル	4,500	1,350.00	6,075,000	
タナベ経営	2,200	1,207.00	2,655,400	
ビジネスブレイン太田昭和	1,900	2,318.00	4,404,200	
ナガワ	3,100	5,040.00	15,624,000	
よみうりランド	2,400	5,030.00	12,072,000	
東京都競馬	7,100	3,295.00	23,394,500	
常磐興産	4,500	1,676.00	7,542,000	
カナモト	16,100	2,870.00	46,207,000	
東京ドーム	40,300	1,029.00	41,468,700	
ＤＴＳ	25,000	2,316.00	57,900,000	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	51,500	3,830.00	197,245,000	
シーイーシー	11,900	2,472.00	29,416,800	
カプコン	47,400	2,248.00	106,555,200	
西尾レントオール	10,900	3,100.00	33,790,000	
アイ・エス・ビー	2,200	1,734.00	3,814,800	
アゴーラ・ホスピタリティー・グループ	62,500	35.00	2,187,500	
日本空港ビルデング	35,500	4,270.00	151,585,000	
トランス・コスモス	12,000	2,420.00	29,040,000	
乃村工藝社	50,400	1,415.00	71,316,000	
ジャステック	6,400	1,104.00	7,065,600	
ＳＣＳＫ	29,100	5,420.00	157,722,000	
藤田観光	4,300	2,960.00	12,728,000	
ＫＮＴ－ＣＴホールディングス	5,700	1,419.00	8,088,300	
日本管財	11,700	1,870.00	21,879,000	
トーカイ	10,400	2,300.00	23,920,000	
白洋舎	1,200	2,885.00	3,462,000	
セコム	114,200	9,102.00	1,039,448,400	
日本システムウエア	3,700	2,700.00	9,990,000	
セントラル警備保障	5,200	5,440.00	28,288,000	
アイネス	14,100	1,153.00	16,257,300	
丹青社	20,500	1,287.00	26,383,500	
メイテック	13,400	5,630.00	75,442,000	
ＴＫＣ	9,400	4,845.00	45,543,000	
富士ソフト	16,600	4,930.00	81,838,000	
応用地質	11,700	1,130.00	13,221,000	
船井総研ホールディングス	22,300	2,586.00	57,667,800	
ＮＳＤ	18,200	3,285.00	59,787,000	
進学会ホールディングス	5,100	601.00	3,065,100	
丸紅建材リース	1,100	1,737.00	1,910,700	
オオバ	8,800	619.00	5,447,200	
コナミホールディングス	45,200	4,930.00	222,836,000	
いであ	2,400	1,203.00	2,887,200	
学究社	3,800	1,327.00	5,042,600	
ベネッセホールディングス	39,400	2,567.00	101,139,800	

イオンディライト	13,300	3,190.00	42,427,000	
ナック	6,900	1,003.00	6,920,700	
福井コンピュータホールディングス	3,700	2,433.00	9,002,100	
ニチイ学館	15,300	1,667.00	25,505,100	
ダイセキ	18,100	2,770.00	50,137,000	
ステップ	4,000	1,485.00	5,940,000	
日鉄物産	7,900	4,480.00	35,392,000	
泉州電業	3,700	2,826.00	10,456,200	
元気寿司	3,200	3,280.00	10,496,000	
トラスコ中山	23,200	2,309.00	53,568,800	
ヤマダ電機	338,000	503.00	170,014,000	
オートバックスセブン	44,100	1,807.00	79,688,700	
モリト	8,100	822.00	6,658,200	
アークランドサカモト	18,700	1,369.00	25,600,300	
ニトリホールディングス	48,100	14,765.00	710,196,500	
グルメ杵屋	8,100	1,168.00	9,460,800	
愛眼	9,400	255.00	2,397,000	
ケーユーホールディングス	5,800	917.00	5,318,600	
吉野家ホールディングス	38,900	2,142.00	83,323,800	
加藤産業	17,300	3,290.00	56,917,000	
北恵	2,200	871.00	1,916,200	
イノテック	6,600	910.00	6,006,000	
イエローハット	21,000	1,429.00	30,009,000	
松屋フーズホールディングス	5,300	3,455.00	18,311,500	
ＪＢＣＣホールディングス	8,800	1,450.00	12,760,000	
ＪＫホールディングス	10,000	590.00	5,900,000	
サガミホールディングス	14,900	1,352.00	20,144,800	
日伝	9,200	1,935.00	17,802,000	
関西スーパーマーケット	8,400	1,131.00	9,500,400	
ミロク情報サービス	11,000	3,380.00	37,180,000	
北沢産業	8,700	267.00	2,322,900	
杉本商事	6,000	2,154.00	12,924,000	
因幡電機産業	15,800	4,765.00	75,287,000	
王将フードサービス	8,200	6,540.00	53,628,000	
プレナス	12,400	1,821.00	22,580,400	
ミニストップ	8,200	1,575.00	12,915,000	
アークス	20,800	2,269.00	47,195,200	
バローホールディングス	24,000	2,330.00	55,920,000	
東テク	3,800	2,359.00	8,964,200	
ミスミグループ本社	139,100	2,488.00	346,080,800	
藤久	900	730.00	657,000	
アルテック	8,600	217.00	1,866,200	
ベルク	5,400	5,450.00	29,430,000	
大　庄	5,900	1,607.00	9,481,300	
タキヒヨー	3,400	1,854.00	6,303,600	
ファーストリテイリング	14,800	67,650.00	1,001,220,000	
ソフトバンクグループ	924,600	5,241.00	4,845,828,600	
蔵王産業	1,800	1,346.00	2,422,800	
スズケン	50,600	6,350.00	321,310,000	
サンドラッグ	41,800	3,080.00	128,744,000	

サックスバー　ホールディングス	9,400	986.00	9,268,400	
ジェコス	7,600	1,006.00	7,645,600	
ヤマザワ	2,400	1,671.00	4,010,400	
やまや	1,900	2,237.00	4,250,300	
グローセル	10,300	457.00	4,707,100	
ベルーナ	27,300	745.00	20,338,500	
合計	132,905,400		255,087,906,650	

＊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	265,317,226,510円	235,499,717,802円
同期中追加設定元本額	65,375,386,237円	57,275,574,767円
同期中一部解約元本額	95,192,894,945円	81,889,009,905円
元本の内訳		
ファンド名		
ＤＩＡＭ国内債券パッシブ・ファンド	17,996,235,320円	19,637,666,236円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	108,081,600円	92,780,551円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	82,802,762円	78,080,655円
ＭＩＴＯ　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
ＤＩＡＭ国内債券インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	12,967,075,063円	13,458,325,770円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型	5,919,885,310円	6,225,337,779円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型	8,202,301,648円	8,584,327,097円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型	3,408,620,510円	3,414,554,922円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド	1,805,683,819円	1,779,642,841円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド	1,999,358,879円	1,963,720,077円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０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
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	3,136,906,696円	3,299,169,376円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	750,943,777円	838,025,492円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	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＜ＤＣ年金＞	420,762,180円	609,876,331円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	2,285,488,089円	2,636,179,699円
４資産分散投資・ハイクラス＜ＤＣ年金＞	281,787,055円	307,514,498円
クルーズコントロール＜ＤＣ年金＞	255,346円	781,654円
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（堅実型）	1,255,528円	2,155,856円
ＤＩＡＭ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＜ＤＣ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２５ＶＡ（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
ＤＩＡＭ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
ＤＩＡＭ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
ＤＩＡＭ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
ＤＩＡＭ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
ＤＩＡＭ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

ＤＩＡＭ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
ＤＩＡＭバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	5,165,098,735円	4,810,695,018円
ＤＩＡＭバランスファンド３７．５ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,708,406,989円	2,617,310,614円
ＤＩＡＭバランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	4,973,738,654円	4,890,696,722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）	531,889,925円	528,183,732円
ＤＩＡＭグローバル・アセット・バランスＶＡ２（適格機関投資家限定）	243,809,467円	240,648,790円
ＤＩＡＭ　アクサ　グローバル　バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	3,132,650,273円	2,917,761,720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）	688,618,271円	512,115,704円
ＤＩＡＭグローバルβ私募ファンド（適格機関投資家向け）	194,752,933円	188,050,355円
ＤＩＡＭ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
ＤＩＡＭ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
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）	47,134,774,807円	23,114,860,837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）	346,165,294円	115,416,908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）	6,693,326,830円	3,312,659,705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）	25,584,090,821円	16,794,060,322円
ＤＩＡＭバランス３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	74,330,112円	74,416,976円
ＤＩＡＭバランス５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	529,804円	1,402,505円
ＤＩＡＭバランス７０ＶＡ（適格機関投資家限定）	7,143,275円	538,981円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド４ＶＡ（適格機関投資家限定）	28,504,043,744円	28,651,900,935円
ＤＩＡＭ世界バランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	405,780,698円	388,117,555円
ＤＩＡＭ国内バランス３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	123,848,735円	112,179,649円
ＤＩＡＭバランス２０ＶＡ（適格機関投資家限定）	494,147,950円	495,613,852円
ＤＩＡＭバランス４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	685,633円	713,232円
ＤＩＡＭ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）

１．金融商品の状況に関する事項

項目	自　平成30年7月12日 至　平成31年1月11日	自　平成31年1月12日 至　令和1年7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）

売買目的有価証券

種類	平成31年1月11日現在	令和1年7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	1,160,223,000	3,446,717,100
地方債証券	△92,342,197	△34,602,384
特殊債券	△29,125,983	87,324,801
社債券	△97,189,180	△38,318,140
合計	941,565,640	3,461,121,377

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成30年2月15日から平成31年1月11日まで及び平成31年2月15日から令和1年7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)

附属明細表

第１　有価証券明細表

（１）株式

該当事項はありません。

（２）株式以外の有価証券

令和1年7月11日現在

種　類	銘　柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
国債証券	３９３回　利付国庫債券（２年）	1,000,000,000	1,003,490,000	
	３９４回　利付国庫債券（２年）	700,000,000	702,653,000	
	３９５回　利付国庫債券（２年）	900,000,000	903,627,000	
	３９６回　利付国庫債券（２年）	700,000,000	702,996,000	
	３９７回　利付国庫債券（２年）	800,000,000	803,624,000	
	３９８回　利付国庫債券（２年）	1,100,000,000	1,105,225,000	
	１２６回　利付国庫債券（５年）	2,500,000,000	2,510,475,000	
	１２７回　利付国庫債券（５年）	1,820,000,000	1,828,918,000	
	１２８回　利付国庫債券（５年）	2,200,000,000	2,212,408,000	
	１２９回　利付国庫債券（５年）	2,120,000,000	2,133,758,800	
	１３０回　利付国庫債券（５年）	1,300,000,000	1,309,555,000	
	１３１回　利付国庫債券（５年）	2,020,000,000	2,036,644,800	
	１３２回　利付国庫債券（５年）	2,000,000,000	2,018,040,000	
	１３３回　利付国庫債券（５年）	1,180,000,000	1,191,552,200	
	１３４回　利付国庫債券（５年）	1,180,000,000	1,192,673,200	
	１３５回　利付国庫債券（５年）	2,100,000,000	2,124,570,000	
	１３６回　利付国庫債券（５年）	1,700,000,000	1,721,607,000	
	１３７回　利付国庫債券（５年）	1,400,000,000	1,419,250,000	
	１３８回　利付国庫債券（５年）	1,900,000,000	1,927,683,000	
	１３９回　利付国庫債券（５年）	800,000,000	812,312,000	
	2回　利付国庫債券（４０年）	460,000,000	699,200,000	
	3回　利付国庫債券（４０年）	380,000,000	582,885,800	
	4回　利付国庫債券（４０年）	540,000,000	836,892,000	
	5回　利付国庫債券（４０年）	580,000,000	872,215,600	
	6回　利付国庫債券（４０年）	580,000,000	861,288,400	
	7回　利付国庫債券（４０年）	580,000,000	831,198,000	
	8回　利付国庫債券（４０年）	620,000,000	833,137,400	
	9回　利付国庫債券（４０年）	1,000,000,000	1,008,060,000	
	１０回　利付国庫債券（４０年）	940,000,000	1,112,132,800	
	１１回　利付国庫債券（４０年）	680,000,000	781,598,800	
	１２回　利付国庫債券（４０年）	200,000,000	208,276,000	
	３１０回　利付国庫債券（１０年）	1,500,000,000	1,521,135,000	
	３１１回　利付国庫債券（１０年）	1,020,000,000	1,031,934,000	
	３１２回　利付国庫債券（１０年）	2,200,000,000	2,244,176,000	
	３１３回　利付国庫債券（１０年）	1,790,000,000	1,835,143,800	
	３１４回　利付国庫債券（１０年）	800,000,000	817,472,000	
	３１５回　利付国庫債券（１０年）	1,500,000,000	1,540,590,000	
	３１６回　利付国庫債券（１０年）	1,000,000,000	1,025,110,000	
	３１７回　利付国庫債券（１０年）	600,000,000	617,034,000	
	３１８回　利付国庫債券（１０年）	600,000,000	615,714,000	

３１９回　利付国庫債券（１０年）	800,000,000	825,408,000	
３２０回　利付国庫債券（１０年）	1,500,000,000	1,543,965,000	
３２１回　利付国庫債券（１０年）	800,000,000	825,936,000	
３２２回　利付国庫債券（１０年）	500,000,000	514,860,000	
３２３回　利付国庫債券（１０年）	750,000,000	774,390,000	
３２４回　利付国庫債券（１０年）	1,050,000,000	1,081,048,500	
３２５回　利付国庫債券（１０年）	2,100,000,000	2,167,452,000	
３２６回　利付国庫債券（１０年）	500,000,000	515,680,000	
３２７回　利付国庫債券（１０年）	1,450,000,000	1,500,489,000	
３２８回　利付国庫債券（１０年）	2,190,000,000	2,255,919,000	
３２９回　利付国庫債券（１０年）	2,270,000,000	2,361,526,400	
３３０回　利付国庫債券（１０年）	1,450,000,000	1,512,567,500	
３３１回　利付国庫債券（１０年）	650,000,000	672,548,500	
３３２回　利付国庫債券（１０年）	2,460,000,000	2,550,454,200	
３３３回　利付国庫債券（１０年）	2,100,000,000	2,182,068,000	
３３４回　利付国庫債券（１０年）	2,170,000,000	2,259,425,700	
３３５回　利付国庫債券（１０年）	2,050,000,000	2,128,064,000	
３３６回　利付国庫債券（１０年）	850,000,000	884,187,000	
３３７回　利付国庫債券（１０年）	1,400,000,000	1,440,880,000	
３３８回　利付国庫債券（１０年）	2,080,000,000	2,155,504,000	
３３９回　利付国庫債券（１０年）	2,240,000,000	2,324,963,200	
３４０回　利付国庫債券（１０年）	2,300,000,000	2,391,011,000	
３４１回　利付国庫債券（１０年）	2,560,000,000	2,648,704,000	
３４２回　利付国庫債券（１０年）	2,730,000,000	2,791,179,300	
３４３回　利付国庫債券（１０年）	2,480,000,000	2,538,602,400	
３４４回　利付国庫債券（１０年）	2,280,000,000	2,335,860,000	
３４５回　利付国庫債券（１０年）	2,160,000,000	2,214,799,200	
３４６回　利付国庫債券（１０年）	2,370,000,000	2,432,141,400	
３４７回　利付国庫債券（１０年）	2,300,000,000	2,361,364,000	
３４８回　利付国庫債券（１０年）	2,230,000,000	2,289,518,700	
３４９回　利付国庫債券（１０年）	1,860,000,000	1,909,531,800	
３５０回　利付国庫債券（１０年）	2,800,000,000	2,874,256,000	
３５１回　利付国庫債券（１０年）	2,110,000,000	2,165,640,700	
３５２回　利付国庫債券（１０年）	1,970,000,000	2,020,609,300	
３５３回　利付国庫債券（１０年）	2,000,000,000	2,050,820,000	
３５４回　利付国庫債券（１０年）	1,520,000,000	1,558,121,600	
１回　利付国庫債券（３０年）	100,000,000	129,927,000	
２回　利付国庫債券（３０年）	100,000,000	126,879,000	
３回　利付国庫債券（３０年）	200,000,000	252,536,000	
４回　利付国庫債券（３０年）	200,000,000	268,166,000	
５回　利付国庫債券（３０年）	200,000,000	253,966,000	
６回　利付国庫債券（３０年）	200,000,000	260,610,000	
７回　利付国庫債券（３０年）	300,000,000	389,949,000	
８回　利付国庫債券（３０年）	200,000,000	248,276,000	
１１回　利付国庫債券（３０年）	200,000,000	246,878,000	
１２回　利付国庫債券（３０年）	200,000,000	258,686,000	
１３回　利付国庫債券（３０年）	300,000,000	384,978,000	
１４回　利付国庫債券（３０年）	290,000,000	389,934,000	
１５回　利付国庫債券（３０年）	200,000,000	272,660,000	
１６回　利付国庫債券（３０年）	300,000,000	410,508,000	

１７回　利付国庫債券（３０年）	200,000,000	271,392,000	
１８回　利付国庫債券（３０年）	420,000,000	564,895,800	
１９回　利付国庫債券（３０年）	200,000,000	269,668,000	
２０回　利付国庫債券（３０年）	300,000,000	415,383,000	
２１回　利付国庫債券（３０年）	300,000,000	406,755,000	
２２回　利付国庫債券（３０年）	320,000,000	445,324,800	
２３回　利付国庫債券（３０年）	200,000,000	279,258,000	
２４回　利付国庫債券（３０年）	300,000,000	419,913,000	
２５回　利付国庫債券（３０年）	400,000,000	547,564,000	
２６回　利付国庫債券（３０年）	400,000,000	556,032,000	
２７回　利付国庫債券（３０年）	580,000,000	821,367,000	
２８回　利付国庫債券（３０年）	680,000,000	967,844,000	
２９回　利付国庫債券（３０年）	710,000,000	1,002,399,300	
３０回　利付国庫債券（３０年）	720,000,000	1,008,309,600	
３１回　利付国庫債券（３０年）	700,000,000	971,712,000	
３２回　利付国庫債券（３０年）	860,000,000	1,217,562,200	
３３回　利付国庫債券（３０年）	1,070,000,000	1,457,104,600	
３４回　利付国庫債券（３０年）	920,000,000	1,297,071,200	
３５回　利付国庫債券（３０年）	870,000,000	1,195,127,700	
３６回　利付国庫債券（３０年）	1,000,000,000	1,380,160,000	
３７回　利付国庫債券（３０年）	1,040,000,000	1,419,267,200	
３８回　利付国庫債券（３０年）	720,000,000	970,653,600	
３９回　利付国庫債券（３０年）	630,000,000	865,777,500	
４０回　利付国庫債券（３０年）	550,000,000	744,469,000	
４１回　利付国庫債券（３０年）	460,000,000	612,927,000	
４２回　利付国庫債券（３０年）	610,000,000	813,770,500	
４３回　利付国庫債券（３０年）	580,000,000	775,610,800	
４４回　利付国庫債券（３０年）	610,000,000	816,710,700	
４５回　利付国庫債券（３０年）	700,000,000	904,967,000	
４６回　利付国庫債券（３０年）	830,000,000	1,073,945,300	
４７回　利付国庫債券（３０年）	760,000,000	1,003,815,600	
４８回　利付国庫債券（３０年）	790,000,000	1,005,907,000	
４９回　利付国庫債券（３０年）	760,000,000	969,547,200	
５０回　利付国庫債券（３０年）	780,000,000	876,361,200	
５１回　利付国庫債券（３０年）	730,000,000	726,371,900	
５２回　利付国庫債券（３０年）	830,000,000	868,453,900	
５３回　利付国庫債券（３０年）	700,000,000	750,386,000	
５４回　利付国庫債券（３０年）	700,000,000	787,458,000	
５５回　利付国庫債券（３０年）	740,000,000	832,159,600	
５６回　利付国庫債券（３０年）	680,000,000	765,387,600	
５７回　利付国庫債券（３０年）	740,000,000	832,588,800	
５８回　利付国庫債券（３０年）	860,000,000	967,190,400	
５９回　利付国庫債券（３０年）	680,000,000	746,463,200	
６０回　利付国庫債券（３０年）	650,000,000	749,645,000	
６１回　利付国庫債券（３０年）	650,000,000	713,576,500	
６２回　利付国庫債券（３０年）	600,000,000	625,044,000	
４７回　利付国庫債券（２０年）	250,000,000	257,122,500	
４８回　利付国庫債券（２０年）	500,000,000	519,470,000	
６１回　利付国庫債券（２０年）	500,000,000	522,480,000	
６４回　利付国庫債券（２０年）	600,000,000	653,676,000	

７２回　利付国庫債券（２０年）	350,000,000	392,539,000	
７３回　利付国庫債券（２０年）	340,000,000	381,565,000	
７５回　利付国庫債券（２０年）	140,000,000	158,706,800	
７８回　利付国庫債券（２０年）	190,000,000	214,240,200	
８１回　利付国庫債券（２０年）	240,000,000	273,444,000	
８３回　利付国庫債券（２０年）	480,000,000	552,758,400	
８５回　利付国庫債券（２０年）	440,000,000	509,286,800	
８８回　利付国庫債券（２０年）	750,000,000	883,192,500	
９０回　利付国庫債券（２０年）	700,000,000	823,781,000	
９２回　利付国庫債券（２０年）	1,000,000,000	1,175,500,000	
９３回　利付国庫債券（２０年）	700,000,000	821,520,000	
９４回　利付国庫債券（２０年）	800,000,000	945,136,000	
９５回　利付国庫債券（２０年）	350,000,000	421,102,500	
９７回　利付国庫債券（２０年）	500,000,000	600,185,000	
９９回　利付国庫債券（２０年）	900,000,000	1,077,264,000	
１００回　利付国庫債券（２０年）	850,000,000	1,028,993,000	
１０２回　利付国庫債券（２０年）	360,000,000	444,186,000	
１０５回　利付国庫債券（２０年）	700,000,000	847,581,000	
１０６回　利付国庫債券（２０年）	350,000,000	427,056,000	
１０７回　利付国庫債券（２０年）	400,000,000	486,420,000	
１０８回　利付国庫債券（２０年）	750,000,000	897,667,500	
１０９回　利付国庫債券（２０年）	520,000,000	624,483,600	
１１０回　利付国庫債券（２０年）	630,000,000	768,965,400	
１１１回　利付国庫債券（２０年）	290,000,000	358,219,600	
１１２回　利付国庫債券（２０年）	750,000,000	918,877,500	
１１３回　利付国庫債券（２０年）	1,020,000,000	1,254,283,800	
１１４回　利付国庫債券（２０年）	800,000,000	987,264,000	
１１５回　利付国庫債券（２０年）	400,000,000	497,856,000	
１１６回　利付国庫債券（２０年）	450,000,000	562,113,000	
１１７回　利付国庫債券（２０年）	800,000,000	990,664,000	
１１８回　利付国庫債券（２０年）	310,000,000	381,792,900	
１１９回　利付国庫債券（２０年）	300,000,000	362,844,000	
１２０回　利付国庫債券（２０年）	600,000,000	712,422,000	
１２１回　利付国庫債券（２０年）	730,000,000	893,731,700	
１２２回　利付国庫債券（２０年）	500,000,000	606,495,000	
１２３回　利付国庫債券（２０年）	680,000,000	850,673,200	
１２４回　利付国庫債券（２０年）	500,000,000	619,725,000	
１２５回　利付国庫債券（２０年）	360,000,000	456,030,000	
１２６回　利付国庫債券（２０年）	450,000,000	559,435,500	
１２７回　利付国庫債券（２０年）	450,000,000	554,139,000	
１２８回　利付国庫債券（２０年）	550,000,000	679,228,000	
１２９回　利付国庫債券（２０年）	440,000,000	538,093,600	
１３０回　利付国庫債券（２０年）	580,000,000	711,619,400	
１３１回　利付国庫債券（２０年）	450,000,000	546,597,000	
１３２回　利付国庫債券（２０年）	540,000,000	657,477,000	
１３３回　利付国庫債券（２０年）	720,000,000	885,643,200	
１３４回　利付国庫債券（２０年）	620,000,000	764,503,400	
１３５回　利付国庫債券（２０年）	350,000,000	427,115,500	
１３６回　利付国庫債券（２０年）	200,000,000	241,518,000	
１３７回　利付国庫債券（２０年）	490,000,000	599,338,600	

	１３８回　利付国庫債券（２０年）	280,000,000	335,213,200	
	１３９回　利付国庫債券（２０年）	430,000,000	520,368,800	
	１４０回　利付国庫債券（２０年）	940,000,000	1,152,317,800	
	１４１回　利付国庫債券（２０年）	650,000,000	798,518,500	
	１４２回　利付国庫債券（２０年）	400,000,000	496,772,000	
	１４３回　利付国庫債券（２０年）	760,000,000	925,170,800	
	１４４回　利付国庫債券（２０年）	510,000,000	613,866,600	
	１４５回　利付国庫債券（２０年）	1,200,000,000	1,481,268,000	
	１４６回　利付国庫債券（２０年）	1,100,000,000	1,360,557,000	
	１４７回　利付国庫債券（２０年）	1,230,000,000	1,507,660,200	
	１４８回　利付国庫債券（２０年）	1,080,000,000	1,310,234,400	
	１４９回　利付国庫債券（２０年）	1,050,000,000	1,275,760,500	
	１５０回　利付国庫債券（２０年）	1,250,000,000	1,502,162,500	
	１５１回　利付国庫債券（２０年）	1,010,000,000	1,184,336,100	
	１５２回　利付国庫債券（２０年）	1,140,000,000	1,337,812,800	
	１５３回　利付国庫債券（２０年）	1,190,000,000	1,416,266,600	
	１５４回　利付国庫債券（２０年）	1,050,000,000	1,234,033,500	
	１５５回　利付国庫債券（２０年）	1,180,000,000	1,349,589,600	
	１５６回　利付国庫債券（２０年）	1,030,000,000	1,076,298,500	
	１５７回　利付国庫債券（２０年）	1,100,000,000	1,111,836,000	
	１５８回　利付国庫債券（２０年）	1,010,000,000	1,071,034,300	
	１５９回　利付国庫債券（２０年）	1,120,000,000	1,205,657,600	
	１６０回　利付国庫債券（２０年）	850,000,000	929,747,000	
	１６１回　利付国庫債券（２０年）	960,000,000	1,032,758,400	
	１６２回　利付国庫債券（２０年）	950,000,000	1,022,076,500	
	１６３回　利付国庫債券（２０年）	970,000,000	1,042,711,200	
	１６４回　利付国庫債券（２０年）	1,210,000,000	1,277,687,400	
	１６５回　利付国庫債券（２０年）	920,000,000	971,244,000	
	１６６回　利付国庫債券（２０年）	900,000,000	983,169,000	
	１６７回　利付国庫債券（２０年）	1,050,000,000	1,106,868,000	
	１６８回　利付国庫債券（２０年）	650,000,000	672,074,000	
国債証券　合計		202,330,000,000	225,834,094,600	
地方債証券	６８８回　東京都公募公債	200,000,000	202,234,000	
	６９７回　東京都公募公債	500,000,000	510,750,000	
	７０１回　東京都公募公債	700,000,000	715,148,000	
	７０８回　東京都公募公債	500,000,000	513,155,000	
	７２０回　東京都公募公債	300,000,000	310,347,000	
	７２６回　東京都公募公債	400,000,000	413,060,000	
	5回　東京都公募公債　２０年	100,000,000	112,026,000	
	9回　東京都公募公債　２０年	200,000,000	233,532,000	
	１０回　東京都公募公債　２０年	300,000,000	349,731,000	
	２２年度１２回　北海道公募公債	200,000,000	203,920,000	
	３０年度１４回　北海道公募公債	300,000,000	303,966,000	
	１９４回　神奈川県公募公債	300,000,000	308,223,000	
	２０８回　神奈川県公募公債	300,000,000	308,256,000	
	３４５回　大阪府公募公債	300,000,000	305,487,000	
	３５６回　大阪府公募公債	200,000,000	205,250,000	
	３６４回　大阪府公募公債	300,000,000	307,737,000	
	３７４回　大阪府公募公債	300,000,000	311,385,000	
	２６年度１１回　京都府公募公債	350,000,000	359,166,500	

	２６年度１７回　兵庫県公募公債	200,000,000	205,178,000	
	１回　兵庫県公募公債（１２年）	300,000,000	316,371,000	
	２２年度８回　静岡県公募公債	200,000,000	202,378,000	
	２３年度９回　静岡県公募公債	200,000,000	204,980,000	
	８回　静岡県公募公債　１５年	200,000,000	216,546,000	
	１回　静岡県公募公債　２０年	100,000,000	113,533,000	
	２２年度６回　愛知県公募公債	200,000,000	202,478,000	
	２３年度２０回　愛知県公募公債	500,000,000	514,745,000	
	２５年度４回　愛知県公募公債	300,000,000	310,032,000	
	２３年度２回　埼玉県公募公債	200,000,000	204,452,000	
	２６年度５回　埼玉県公募公債	400,000,000	412,448,000	
	１４回　埼玉県公募公債　２０年	300,000,000	358,440,000	
	２５年度１１回　福岡県公募公債	200,000,000	206,472,000	
	２４年度２回　福岡県公募公債（２０年）	300,000,000	357,657,000	
	２４年度７回　千葉県公募公債	300,000,000	307,707,000	
	２５年度５回　千葉県公募公債	200,000,000	206,970,000	
	９４回　共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,916,000	
	９９回　共同発行市場公募地方債	700,000,000	716,016,000	
	１０６回　共同発行市場公募地方債	300,000,000	307,431,000	
	１０９回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	514,705,000	
	１１１回　共同発行市場公募地方債	700,000,000	718,494,000	
	１１９回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	514,585,000	
	１２１回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	510,885,000	
	１２６回　共同発行市場公募地方債	793,900,000	821,130,770	
	１２７回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	514,695,000	
	１２８回　共同発行市場公募地方債	300,000,000	308,721,000	
	１３７回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	514,615,000	
	１３９回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	514,525,000	
	１４２回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	509,700,000	
	１４４回　共同発行市場公募地方債	400,000,000	410,832,000	
	１４６回　共同発行市場公募地方債	400,000,000	413,088,000	
	１４８回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	516,850,000	
	１６６回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	506,095,000	
	２９年度４回　大阪市公募公債	200,000,000	202,208,000	
	４８８回　名古屋市公募公債　１０年	450,000,000	464,094,000	
	４回　京都市公募公債　２０年	100,000,000	117,869,000	
	３０年度７回　神戸市公募公債　３０年	300,000,000	306,045,000	
	２２年度３回　横浜市公募公債	200,000,000	202,776,000	
	２２年度５回　横浜市公募公債	200,000,000	203,592,000	
	２３年度４回　横浜市公募公債	450,000,000	461,016,000	
	２５年度２回　横浜市公募公債	400,000,000	414,312,000	
	２５年度４回　札幌市公募公債	200,000,000	206,344,000	
	第９１回　川崎市公募公債	200,000,000	202,858,000	
	２３年度１回　千葉市公募公債	200,000,000	204,830,000	
地方債証券　合計		20,943,900,000	21,713,988,270	
特殊債券	７８回　日本政策投資銀行債券	200,000,000	202,468,000	
	１９回　高速道路機構債	150,000,000	236,031,000	
	２６回　高速道路機構債	200,000,000	282,672,000	
	９６回　高速道路機構債	700,000,000	718,193,000	
	１１６回　高速道路機構債	100,000,000	103,017,000	

１７２回　高速道路機構債	200,000,000	199,300,000	
９回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	103,340,000	
１８回政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	314,469,000	
１２１回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	599,730,000	
１４９回政保日本高速道路保有・債務返済機構	400,000,000	410,128,000	
１８０回政保日本高速道路保有・債務返済機構	1,000,000,000	1,027,560,000	
１８９回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	511,430,000	
１９３回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	518,735,000	
１９５回政保日本高速道路保有・債務返済機構	330,000,000	343,021,800	
２３９回政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	346,326,000	
２４１回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	514,485,000	
２６０回政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	248,630,000	
３０９回政保日本高速道路保有・債務返済機構	800,000,000	812,528,000	
３１９回政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	213,146,000	
２８回　日本道路・機構承継債	400,000,000	548,836,000	
１回　地方公共団体金融機構債券　２０年	200,000,000	237,734,000	
１５回　政保地方公共団体金融機構債券	200,000,000	202,306,000	
２０回　政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	305,757,000	
２４回　地方公共団体金融機構債券	300,000,000	306,783,000	
１９回　地方公共団体金融機構債券	200,000,000	241,928,000	
３６回　政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	308,250,000	
２４回　地方公共団体金融機構債券２０年	200,000,000	239,884,000	
４４回　政保地方公共団体金融機構債券	400,000,000	412,640,000	
５０回　政保地方公共団体金融機構債券	500,000,000	519,505,000	
５６回　政保地方公共団体金融機構債券	542,000,000	561,842,620	
６４回　政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	309,324,000	
４４回　地方公共団体金融機構債券　２０年	200,000,000	232,192,000	
８３回　地方公共団体金融機構債券　１０年	400,000,000	400,540,000	
１５回　日本政策金融公庫債券	200,000,000	240,478,000	
３９回　住宅金融支援機構債券	200,000,000	241,880,000	
７５回　住宅金融支援機構債券	350,000,000	430,094,000	
２２２回　住宅金融支援機構債券	300,000,000	303,615,000	
２３０回　住宅金融支援機構債券	300,000,000	305,136,000	
６回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	40,611,000	42,380,421	
８回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	28,584,000	29,917,443	
９回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	42,717,000	44,785,784	

	２回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	45,501,000	48,115,487	
	１３回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	15,212,000	15,585,606	
	１４回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	76,850,000	78,454,628	
	４３回貸付債権担保住宅金融公庫債券	15,084,000	15,929,910	
	４４回貸付債権担保住宅金融公庫債券	58,172,000	61,334,229	
	５１回貸付債権担保住宅金融公庫債券	42,963,000	45,187,194	
	１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,880,000	76,031,331	
	２９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	151,620,000	164,171,103	
	３６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	260,952,000	278,581,917	
	１２６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	279,858,000	285,136,121	
	１２８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	280,779,000	285,973,411	
	１３１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	284,823,000	289,625,115	
	１３２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	285,111,000	289,929,375	
	１３７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	291,363,000	297,909,926	
	い第７８３号　利付商工債	300,000,000	300,702,000	
	３２５回　利附信金中金債	400,000,000	400,312,000	
	２２０号　利附商工債（３年）	300,000,000	300,435,000	
	１５回　国際協力機構債	100,000,000	120,336,000	
	５５回　鉄道建設運輸施設債	500,000,000	515,540,000	
特殊債券　合計		16,845,080,000	18,040,308,421	
社債券	1回　ＢＰＣＥ　ＳＡ円貨社債（ソーシャルボンド）	200,000,000	200,042,000	
	6回　クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	200,000,000	206,072,000	
	３３７回　東京交通債	200,000,000	207,458,000	
	２２回　中日本高速道路債券	300,000,000	303,660,000	
	３４回　西日本高速道路債券	200,000,000	203,288,000	
	１９回　三菱ケミカルホールディングス社債	100,000,000	101,236,000	
	6回　ＪＸホールディングス社債	100,000,000	103,786,000	
	１４回　ブリヂストン社債	200,000,000	202,056,000	
	２３回　ジェイ　エフ　イー　ホールディングス社債	100,000,000	99,970,000	
	１３回　パナソニック社債	100,000,000	101,198,000	
	１４回　トヨタ自動車社債	200,000,000	206,648,000	
	１６回　トヨタ自動車社債	200,000,000	205,468,000	
	９４回　丸紅社債	100,000,000	103,269,000	
	４５回　住友商事社債	100,000,000	102,785,000	
	４７回　住友商事社債	100,000,000	103,077,000	
	４８回　クレディセゾン社債	100,000,000	103,440,000	
	５７回　東京三菱銀行社債	200,000,000	214,136,000	
	２５回　三菱東京ＵＦＪ銀行劣後社債	200,000,000	203,248,000	
	２８回　三菱東京ＵＦＪ銀行劣後社債	200,000,000	204,346,000	

	３２回　三菱東京ＵＦＪ銀行劣後社債	300,000,000	308,556,000	
	９回　三菱ＵＦＪ信託銀行劣後債	100,000,000	102,786,000	
	１２回　住友信託銀行劣後債	100,000,000	101,705,000	
	１０回　三井住友信託銀行社債	200,000,000	204,952,000	
	１０回　セブン銀行社債	100,000,000	102,600,000	
	２２回　三井住友銀行劣後社債	200,000,000	203,218,000	
	２３回　三井住友銀行劣後社債	400,000,000	408,624,000	
	１５回　トヨタファイナンス社債	200,000,000	203,936,000	
	４７回　日立キャピタル社債	200,000,000	205,120,000	
	５６回　三菱ＵＦＪリース社債	200,000,000	203,286,000	
	２６回　野村ホールディングス社債	100,000,000	101,735,000	
	７２回　三菱地所社債	100,000,000	111,121,000	
	１０８回　住友不動産社債	200,000,000	201,938,000	
	８０回　東京急行電鉄社債	100,000,000	109,635,000	
	１５回　東日本旅客鉄道社債	300,000,000	308,880,000	
	１９回　東日本旅客鉄道社債	100,000,000	106,158,000	
	２１回　東日本旅客鉄道社債	100,000,000	106,401,000	
	３９回　東日本旅客鉄道社債	300,000,000	334,548,000	
	４２回　東日本旅客鉄道社債	200,000,000	224,744,000	
	９回　西日本旅客鉄道社債	200,000,000	212,242,000	
	１０回　西日本旅客鉄道社債	300,000,000	325,125,000	
	６回　東海旅客鉄道社債	100,000,000	106,172,000	
	１１回　東海旅客鉄道社債	300,000,000	311,610,000	
	１３回　東海旅客鉄道社債	200,000,000	217,422,000	
	１４回　東海旅客鉄道社債	100,000,000	110,001,000	
	４回　東京地下鉄社債	120,000,000	138,802,800	
	６０回　日本電信電話社債	300,000,000	305,493,000	
	５１８回　中部電力社債	200,000,000	200,422,000	
	３７７回　中国電力社債	400,000,000	416,004,000	
	３７９回　中国電力社債	300,000,000	302,604,000	
	３０１回　北陸電力社債	100,000,000	103,767,000	
	３０７回　北陸電力社債	100,000,000	105,792,000	
	４７１回　東北電力社債	400,000,000	417,656,000	
	４７３回　東北電力社債	300,000,000	302,709,000	
	２５３回　四国電力社債	200,000,000	206,838,000	
	４２４回　九州電力社債	200,000,000	209,272,000	
	４２６回　九州電力社債	400,000,000	416,396,000	
	３２０回　北海道電力社債	200,000,000	202,102,000	
	３２１回　北海道電力社債	161,000,000	166,113,360	
	３４０回　北海道電力社債	300,000,000	303,993,000	
	１３回　電源開発社債	200,000,000	220,966,000	
	３８回　電源開発社債	300,000,000	310,476,000	
	２３回　東京瓦斯社債	300,000,000	311,424,000	
	１８回　大阪ガス社債	100,000,000	104,971,000	
	２７回　ＮＴＴデータ社債	100,000,000	103,323,000	
	７回　ファーストリテイリング社債	200,000,000	202,652,000	
社債券　合計		12,681,000,000	13,159,474,160	
合計		252,799,980,000	278,747,865,451	

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。

「ＤＩＡＭマネーマザーファンド」の状況

貸借対照表

（単位：円）

科　　目	注記番号	平成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		333,544,929	285,987,795
国債証券		502,582,000	701,752,000
地方債証券		136,619,037	115,382,283
特殊債券		196,455,940	66,803,990
未収利息		1,001,661	881,668
前払費用		281,358	9,862
流動資産合計		1,170,484,925	1,170,817,598
資産合計		1,170,484,925	1,170,817,598
負債の部			
流動負債			
流動負債合計		－	－
負債合計		－	－
純資産の部			
元本等			
元本	※1	1,159,318,038	1,159,298,220
剰余金			
剰余金又は欠損金（△）		11,166,887	11,519,378
元本等合計		1,170,484,925	1,170,817,598
純資産合計		1,170,484,925	1,170,817,598
負債純資産合計		1,170,484,925	1,170,817,598

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	平成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	1,139,212,074円	1,159,318,038円
同期中追加設定元本額	25,057,931円	14,851,485,149円
同期中一部解約元本額	4,951,967円	14,851,504,967円
元本の内訳		
ファンド名		
クルーズコントロール	990,000,991円	990,000,991円
ダイナミック・ナビゲーション	98,710円	98,710円
ＤＩＡＭ新興国ソブリンオープン通貨選択シリーズ＜円コース＞	870,000円	870,000円
ＤＩＡＭ新興国ソブリンオープン通貨選択シリーズ＜豪ドルコース＞	530,000円	530,000円
ＤＩＡＭ新興国ソブリンオープン通貨選択シリーズ＜南アフリカランドコース＞	70,000円	70,000円
ＤＩＡＭ新興国ソブリンオープン通貨選択シリーズ＜ブラジルレアルコース＞	10,530,000円	10,530,000円
世界ハイブリッド証券ファンド通貨選択シリーズ（毎月分配型）＜円コース＞	1,281,836円	1,281,836円
世界ハイブリッド証券ファンド通貨選択シリーズ（毎月分配型）＜豪ドルコース＞	246,797円	246,797円
世界ハイブリッド証券ファンド通貨選択シリーズ（毎月分配型）＜ブラジルレアルコース＞	1,689,581円	1,689,581円
世界ハイブリッド証券ファンド通貨選択シリーズ（毎月分配型）＜中国元コース＞	654,944円	654,944円
ＤＩＡＭ新興国ソブリンオープン通貨選択シリーズ＜中国元コース＞	149,716円	149,716円
ネット証券専用ファンドシリーズ　新興市場日本株　レアル型	103,986円	103,986円

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

	マシューズ・アジア株式ファンド	99,019,705円	99,019,705円
	Ｏｎｅ世界分散セレクト（Ａコース）	99,040円	99,040円
	Ｏｎｅ世界分散セレクト（Ｂコース）	99,040円	99,040円
	Ｏｎｅ世界分散セレクト（Ｃコース）	99,040円	99,040円
	リスクコントロール型ＥＴＦ分散投資ファンド（適格機関投資家限定）	39,612,786円	39,612,786円
	計	1,159,318,038円	1,159,298,220円
２．	受益権の総数	1,159,318,038口	1,159,298,220口

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

項目	自　平成30年7月12日 至　平成31年1月11日	自　平成31年1月12日 至　令和1年7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）

売買目的有価証券

種類	平成31年1月11日現在	令和1年7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	△1,075,000	△278,000
地方債証券	△205,656	△211,624
特殊債券	△1,920,440	△215,980
合計	△3,201,096	△705,604

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成30年4月6日から平成31年1月11日まで及び平成31年4月6日から令和1年7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	1.0096円	1.0099円
（1万口当たり純資産額）	(10,096円)	(10,099円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

（１）株式

該当事項はありません。

（２）株式以外の有価証券

令和1年7月11日現在

種　類	銘　柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
国債証券	３８８回　利付国庫債券（２年）	100,000,000	100,236,000	
	３９１回　利付国庫債券（２年）	200,000,000	200,612,000	
	３９２回　利付国庫債券（２年）	100,000,000	100,325,000	
	１２３回　利付国庫債券（５年）	300,000,000	300,579,000	
国債証券　合計		700,000,000	701,752,000	
地方債証券	３３１回　大阪府公募公債	10,000,000	10,042,500	
	２６年度　京都府京都みらい債	9,200,000	9,197,608	
	２７年度　京都府京都みらい債	13,800,000	13,772,400	
	２１年度３５回　兵庫県公募公債	40,000,000	40,310,800	
	２１年度６回　愛知県公募公債	10,000,000	10,008,200	
	２６年度７回　福岡県公募公債	6,500,000	6,497,985	
	２７年度２回　千葉県公募公債	14,670,000	14,692,591	
	４３回　川崎市公募公債　５年	10,850,000	10,860,199	
地方債証券　合計		115,020,000	115,382,283	
特殊債券	８９回政保日本高速道路保有・債務返済機構	4,000,000	4,012,000	
	９３回政保日本高速道路保有・債務返済機構	8,000,000	8,044,880	
	１００回政保日本高速道路保有・債務返済機構	9,000,000	9,083,160	
	１１２回政保日本高速道路保有・債務返済機構	30,000,000	30,365,400	
	１１７回政保日本高速道路保有・債務返済機構	6,000,000	6,077,340	
	１３３回政保日本高速道路保有・債務返済機構	5,000,000	5,122,250	
	１３７回政保日本高速道路保有・債務返済機構	4,000,000	4,098,960	
特殊債券　合計		66,000,000	66,803,990	
合計		881,020,000	883,938,273	

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」の状況

貸借対照表

（単位：円）

科　　目	注記番号	平成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	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。 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。 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。 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。
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。
４．　その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	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。

（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		88,975,107,871円	101,086,948,774円
同期中追加設定元本額		27,148,319,972円	12,073,878,254円
同期中一部解約元本額		15,036,479,069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

ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型	177,126,536円	176,650,905円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型	921,869,976円	880,045,133円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型	1,083,135,794円	1,077,647,728円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド	127,206,341円	126,384,378円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド	360,021,829円	355,814,509円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０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
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	213,418,470円	212,887,825円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	144,027,570円	147,316,450円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	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＜ＤＣ年金＞	62,512,430円	111,395,952円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	167,809,740円	169,183,049円
４資産分散投資・ハイクラス＜ＤＣ年金＞	94,014,637円	95,388,259円
クルーズコントロール＜ＤＣ年金＞	44,663円	140,577円
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（堅実型）	449,001円	794,546円
ＤＩＡＭ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＜ＤＣ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２０４５）	1,012,100円	1,153,105円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	789,212円	982,574円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	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２５ＶＡ（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	
ＤＩＡＭバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	534,544,227円	442,026,146円	
ＤＩＡＭバランスファンド３７．５ＶＡ（適格機関投資家限定）	654,815,220円	561,563,200円	
ＤＩＡＭバランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,062,322,007円	1,799,290,175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）	756,981,970円	643,148,820円	
ＤＩＡＭグローバル・アセット・バランスＶＡ２（適格機関投資家限定）	124,735,564円	105,761,230円	
ＤＩＡＭ　アクサ　グローバル　バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	865,106,063円	715,481,449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）	95,074,329円	62,774,978円	
ＤＩＡＭグローバルβ私募ファンド（適格機関投資家向け）	2,754,975円	2,754,975円	
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	27,248,619円	10,225,561円	
ＤＩＡＭ世界バランスファンド３５ＶＡ（適格機関投資家限定）	15,458,639円	11,746,417円	
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド２ＶＡ（適格機関投資家限定）	4,884,528,633円	2,125,221,429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）	144,037,122円	42,468,288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）	1,386,057,134円	609,147,808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）	5,298,403,339円	3,088,701,884円	
ＤＩＡＭバランス３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	19,797,555円	17,123,800円	
ＤＩＡＭバランス５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	355,559円	827,766円	
ＤＩＡＭバランス７０ＶＡ（適格機関投資家限定）	10,994,618円	726,238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）	7,082,295,609円	6,322,837,855円	

ＤＩＡＭバランス２０ＶＡ（適格機関投資家限定）	63,114,592円	54,693,394円
ＤＩＡＭバランス４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	246,843円	225,102円
ＤＩＡＭ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）

１．金融商品の状況に関する事項

項目	自　平成30年7月12日 至　平成31年1月11日	自　平成31年1月12日 至　令和1年7月11日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
３．　金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	平成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 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成31年1月11日現在	令和1年7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	△12,919,777,352	24,962,812,601
投資信託受益証券	47,396,539	94,107,923
投資証券	234,989,246	673,944,556
合計	△12,637,391,567	25,730,865,080

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成30年2月16日から平成31年1月11日まで及び平成31年2月16日から令和1年7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。

①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。

②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	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)

附属明細表

第１　有価証券明細表

（１）株式

令和1年7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	34,301	2,017.410	69,199,180.410	
	ABBOTT LABORATORIES	143,519	85.380	12,253,652.220	
	AES CORP	55,631	16.990	945,170.690	
	ABIOMED INC	3,574	255.810	914,264.940	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	73,032	140.470	10,258,805.040	
	ADVANCED MICRO DEVICES	78,323	33.790	2,646,534.170	
	ADOBE INC	39,772	306.980	12,209,208.560	
	CHUBB LTD	37,602	149.150	5,608,338.300	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	18,048	226.260	4,083,540.480	
	ALLEGHANY CORP	1,094	703.440	769,563.360	
	RALPH LAUREN CORP	4,893	109.560	536,077.080	
	ALLSTATE CORP	27,204	104.260	2,836,289.040	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	59,983	174.460	10,464,634.180	
	AMGEN INC	50,795	182.270	9,258,404.650	
	HESS CORP	21,367	63.180	1,349,967.060	
	AMERICAN EXPRESS CO	59,618	126.890	7,564,928.020	
	AMERICAN ELECTRIC POWER	42,628	90.810	3,871,048.680	
	AFLAC INC	63,655	56.510	3,597,144.050	
	AMERICAN INTL GROUP	70,786	55.730	3,944,903.780	
	AMERCO	585	372.150	217,707.750	
	ANALOG DEVICES	31,028	114.010	3,537,502.280	
	ANADARKO PETROLEUM CORP	40,368	71.160	2,872,586.880	
	ALEXION PHARMACEUTICALS INC	18,192	124.370	2,262,539.040	
	JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	65,366	41.330	2,701,576.780	
	JONES LANG LASALLE INC	4,087	137.120	560,409.440	
	VALERO ENERGY CORP	35,152	83.400	2,931,676.800	
	APACHE CORP	31,470	27.470	864,480.900	
	ANSYS INC	6,770	209.550	1,418,653.500	
	APPLE INC	387,571	203.230	78,766,054.330	
	APPLIED MATERIALS INC	77,627	44.720	3,471,479.440	
	ALBEMARLE CORP	9,826	70.490	692,634.740	
	ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	45,602	41.800	1,906,163.600	
	PINNACLE WEST CAPITAL CORP	9,600	95.460	916,416.000	
	AMEREN CORP	19,487	76.650	1,493,678.550	
	ARROW ELECTRONICS INC	7,754	68.910	534,328.140	

AUTOLIV INC	5,913	66.620	393,924.060	
AUTODESK INC	18,337	172.740	3,167,533.380	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	36,118	164.540	5,942,855.720	
AUTOZONE INC	2,049	1,148.470	2,353,215.030	
AVERY DENNISON CORP	6,549	114.600	750,515.400	
BALL CORP	25,262	70.430	1,779,202.660	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	107,096	214.030	22,921,756.880	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	70,127	43.040	3,018,266.080	
BAXTER INTERNATIONAL INC	39,377	82.120	3,233,639.240	
BECTON DICKINSON & CO	22,265	253.470	5,643,509.550	
AMETEK INC	19,925	89.580	1,784,881.500	
VERIZON COMM INC	339,647	57.000	19,359,879.000	
WR BERKLEY CORP	12,201	67.790	827,105.790	
BEST BUY CO INC	20,918	71.930	1,504,631.740	
YUM! BRANDS INC	24,852	110.980	2,758,074.960	
FIRSTENERGY CORP	43,584	43.490	1,895,468.160	
H&R BLOCK INC	16,114	28.440	458,282.160	
BOEING CO	44,105	352.300	15,538,191.500	
ROBERT HALF INTL INC	10,827	57.280	620,170.560	
BORGWARNER INC	17,210	39.230	675,148.300	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	114,141	42.890	4,895,507.490	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	11,755	82.190	966,143.450	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	8,766	117.160	1,027,024.560	
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	2,142	858.480	1,838,864.160	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	135,696	45.960	6,236,588.160	
AFFILIATED MANAGERS GROUP INC	5,215	90.560	472,270.400	
INGREDION INC	5,305	82.370	436,972.850	
ONEOK INC	35,019	70.450	2,467,088.550	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	5,900	105.400	621,860.000	
UNITED RENTALS INC	6,505	130.480	848,772.400	
SEMPRA ENERGY	22,708	139.660	3,171,399.280	
FEDEX CORP	20,406	159.990	3,264,755.940	
VERISIGN INC	8,852	218.870	1,937,437.240	
AMPHENOL CORP	25,265	97.520	2,463,842.800	
BROWN-FORMAN CORP	24,381	56.350	1,373,869.350	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	125,254	6.030	755,281.620	
CSX CORP	64,079	76.580	4,907,169.820	
CABOT OIL & GAS CORP	31,416	24.030	754,926.480	
CAMPBELL SOUP CO	14,050	41.400	581,670.000	
SEAGATE TECHNOLOGY	20,798	47.240	982,497.520	
CONSTELLATION BRANDS INC	13,652	200.790	2,741,185.080	

CARDINAL HEALTH INC	22,950	47.460	1,089,207.000	
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	35,566	45.510	1,618,608.660	
CATERPILLAR INC	47,697	132.640	6,326,530.080	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	9,865	119.740	1,181,235.100	
CELGENE CORP	58,351	93.590	5,461,070.090	
CITRIX SYSTEMS INC	10,886	99.640	1,084,681.040	
CENTURYLINK INC	80,424	11.930	959,458.320	
CERNER CORP	27,382	75.680	2,072,269.760	
JPMORGAN CHASE & CO	268,844	113.020	30,384,748.880	
CHURCH & DWIGHT CO INC	19,896	74.370	1,479,665.520	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	12,715	107.070	1,361,395.050	
CINTAS CORP	7,247	238.690	1,729,786.430	
CISCO SYSTEMS INC	361,349	57.130	20,643,868.370	
CLOROX COMPANY	10,885	154.510	1,681,841.350	
COCA-COLA CO/THE	334,203	51.820	17,318,399.460	
COPART INC	16,749	75.780	1,269,239.220	
COGNEX CORP	15,291	42.440	648,950.040	
COLGATE-PALMOLIVE CO	68,106	73.490	5,005,109.940	
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	23,382	141.570	3,310,189.740	
COMERICA INC	12,770	71.480	912,799.600	
NRG ENERGY, INC.	21,039	35.960	756,562.440	
COMCAST CORP-CL A	370,714	43.790	16,233,566.060	
CONAGRA BRANDS INC	40,573	28.340	1,149,838.820	
CONSOLIDATED EDISON INC	27,005	89.110	2,406,415.550	
CMS ENERGY CORP	22,937	58.920	1,351,448.040	
COOPER COS INC	3,936	330.970	1,302,697.920	
MOLSON COORS BREWING CO	16,200	55.870	905,094.000	
CORNING INC	63,750	32.740	2,087,175.000	
SEALED AIR CORP	13,870	42.780	593,358.600	
HEICO CORP-CL A	6,718	106.960	718,557.280	
CUMMINS INC	12,238	167.400	2,048,641.200	
DR HORTON INC	28,355	44.660	1,266,334.300	
DANAHER CORP	51,515	142.600	7,346,039.000	
MOODY'S CORP	14,550	199.770	2,906,653.500	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	47,441	64.060	3,039,070.460	
TARGET CORP	42,502	85.850	3,648,796.700	
DEERE & CO	25,116	160.810	4,038,903.960	
MORGAN STANLEY	103,914	43.310	4,500,515.340	
REPUBLIC SERVICES INC	18,081	87.510	1,582,268.310	
COSTAR GROUP INC	3,044	580.810	1,767,985.640	
THE WALT DISNEY CO	147,864	143.540	21,224,398.560	
DOLLAR TREE INC	20,078	111.690	2,242,511.820	
DOVER CORP	12,635	98.540	1,245,052.900	
OMNICOM GROUP	19,325	83.770	1,618,855.250	

DTE ENERGY CO	14,817	131.560	1,949,324.520	
DUKE ENERGY CORP	60,686	89.630	5,439,286.180	
FLOWSERVE CORP	9,882	51.380	507,737.160	
DARDEN RESTAURANTS INC	9,700	121.500	1,178,550.000	
EBAY INC	70,386	40.010	2,816,143.860	
BANK OF AMERICA CORP	752,856	29.020	21,847,881.120	
CITIGROUP INC	192,316	71.130	13,679,437.080	
EASTMAN CHEMICAL CO	11,935	74.310	886,889.850	
E*TRADE FINANCIAL CORP	21,624	44.550	963,349.200	
EATON CORP PLC	34,489	79.040	2,726,010.560	
EATON VANCE CORP	9,184	43.690	401,248.960	
CADENCE DESIGN SYS INC	22,628	75.100	1,699,362.800	
DISH NETWORK CORP	17,517	40.660	712,241.220	
ECOLAB INC	21,250	198.130	4,210,262.500	
PERKINELMER INC	8,338	95.820	798,947.160	
ELECTRONIC ARTS INC	23,975	93.960	2,252,691.000	
SALESFORCE.COM INC	63,205	156.270	9,877,045.350	
ERIE INDEMNITY CO	2,243	264.810	593,968.830	
EMERSON ELECTRIC CO	50,465	63.700	3,214,620.500	
ATMOS ENERGY CORP	10,220	106.810	1,091,598.200	
ENTERGY CORP	16,259	104.670	1,701,829.530	
EOG RESOURCES INC	47,426	90.660	4,299,641.160	
EQUIFAX INC	10,231	135.250	1,383,742.750	
ESTEE LAUDER COS INC/THE	18,554	184.290	3,419,316.660	
EXPEDITORS INTERNATIONAL	14,792	71.630	1,059,550.960	
EXXON MOBIL CORP	348,433	77.510	27,007,041.830	
FMC CORP	10,209	81.540	832,441.860	
NEXTERA ENERGY INC	38,773	209.480	8,122,168.040	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	3,418	291.480	996,278.640	
ASSURANT INC	5,949	110.010	654,449.490	
FASTENAL CO	45,891	31.250	1,434,093.750	
FIFTH THIRD BANCORP	63,648	27.640	1,759,230.720	
M&T BANK CORP	10,640	171.300	1,822,632.000	
FISERV INC	32,020	93.860	3,005,397.200	
FLIR SYSTEMS INC	11,623	53.820	625,549.860	
MACY'S INC	24,741	21.180	524,014.380	
FORD MOTOR CO	334,331	10.110	3,380,086.410	
FRANKLIN RESOURCES INC	23,713	34.780	824,738.140	
FREEPORT-MCMORAN INC	120,727	10.950	1,321,960.650	
FLEX LTD	34,372	9.710	333,752.120	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	16,007	90.860	1,454,396.020	
GAP INC/THE	18,295	17.860	326,748.700	
DENTSPLY SIRONA INC	18,386	57.290	1,053,333.940	
GENERAL DYNAMICS CORP	20,124	182.540	3,673,434.960	
GENERAL MILLS INC	49,173	54.500	2,679,928.500	
GENUINE PARTS CO	11,605	104.190	1,209,124.950	
GILEAD SCIENCES INC	103,704	67.460	6,995,871.840	
GARTNER INC	7,384	168.360	1,243,170.240	

MCKESSON CORP	15,690	141.010	2,212,446.900	
NVIDIA CORP	47,708	160.060	7,636,142.480	
GENERAL ELECTRIC CO	723,566	10.200	7,380,373.200	
WW GRAINGER INC	3,762	258.540	972,627.480	
HALLIBURTON CO	74,684	23.600	1,762,542.400	
MONSTER BEVERAGE CORP	33,500	65.030	2,178,505.000	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	27,326	205.970	5,628,336.220	
HARLEY-DAVIDSON INC	12,901	35.640	459,791.640	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	18,810	192.610	3,622,994.100	
HASBRO INC	9,473	108.300	1,025,925.900	
HENRY SCHEIN INC	13,800	69.230	955,374.000	
HEICO CORP	2,769	136.340	377,525.460	
HELMERICH & PAYNE INC	10,055	51.830	521,150.650	
HERSHEY FOODS CORP	12,265	138.570	1,699,561.050	
HP INC	129,509	20.590	2,666,590.310	
F5 NETWORKS INC	4,874	141.570	690,012.180	
CROWN HOLDINGS INC NPR	10,472	61.010	638,896.720	
JUNIPER NETWORKS INC	27,939	26.290	734,516.310	
HOLLYFRONTIER CORP	11,855	46.940	556,473.700	
HOLOGIC INC	23,212	47.820	1,109,997.840	
UNUM GROUP	15,185	32.870	499,130.950	
HOME DEPOT INC	92,646	210.750	19,525,144.500	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	15,079	85.110	1,283,373.690	
HORMEL FOODS CORP	24,161	41.300	997,849.300	
CENTERPOINT ENERGY INC	43,020	29.010	1,248,010.200	
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,913	284.420	828,515.460	
HUMANA INC	11,172	267.910	2,993,090.520	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	7,359	87.630	644,869.170	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	90,155	13.720	1,236,926.600	
NEKTAR THERAPEUTICS	15,689	34.790	545,820.310	
BIOGEN INC	15,909	232.430	3,697,728.870	
IDEX CORP	6,154	169.010	1,040,087.540	
ILLINOIS TOOL WORKS	27,037	146.150	3,951,457.550	
INTUIT INC	21,465	274.810	5,898,796.650	
IDEXX LABORATORIES INC	6,791	282.530	1,918,661.230	
IONIS PHARMACEUTICALS INC	11,699	65.200	762,774.800	
INGERSOLL-RAND PLC	19,439	124.210	2,414,518.190	
INTEL CORP	369,463	48.210	17,811,811.230	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	7,965	142.540	1,135,331.100	
INTERNATIONAL PAPER CO	32,983	43.150	1,423,216.450	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	28,862	23.280	671,907.360	

JACOBS ENGINEERING GROUP INC	11,766	83.820	986,226.120	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	6,019	137.400	827,010.600	
INCYTE CORP	15,601	83.770	1,306,895.770	
JOHNSON & JOHNSON	218,908	141.210	30,911,998.680	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	29,441	57.170	1,683,141.970	
KLA-TENCOR CORP	13,639	119.610	1,631,360.790	
DEVON ENERGY CORP	33,312	28.840	960,718.080	
KELLOGG CO	21,564	54.780	1,181,275.920	
EAST WEST BANCORP INC	11,560	45.150	521,934.000	
KEYCORP	79,497	17.610	1,399,942.170	
KIMBERLY-CLARK CORP	28,430	137.800	3,917,654.000	
BLACKROCK INC/NEW YORK	9,774	475.540	4,647,927.960	
KOHLS CORP	14,910	47.160	703,155.600	
KROGER CO	66,610	21.650	1,442,106.500	
LAM RESEARCH CORP	12,854	184.220	2,367,963.880	
PACKAGING CORP OF AMERICA	7,143	100.050	714,657.150	
AKAMAI TECHNOLOGIES	13,254	81.730	1,083,249.420	
LEGGETT & PLATT INC	10,928	37.870	413,843.360	
LENNAR CORP	22,753	48.420	1,101,700.260	
JEFFERIES FINANCIAL GROUP INC	20,795	21.410	445,220.950	
ELI LILLY & CO	72,929	114.530	8,352,558.370	
L BRANDS INC	21,698	25.780	559,374.440	
LINCOLN NATIONAL CORP	16,387	65.000	1,065,155.000	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	57,844	101.620	5,878,107.280	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	25,544	73.370	1,874,163.280	
LOCKHEED MARTIN CORP	20,760	368.160	7,643,001.600	
LOEWS CORP	21,759	55.550	1,208,712.450	
LOWE'S COS INC	66,422	103.080	6,846,779.760	
DOMINION ENERGY INC	66,616	78.130	5,204,708.080	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	44,798	29.130	1,304,965.740	
MCCORMICK & CO INC	9,935	157.450	1,564,265.750	
MCDONALD'S CORPORATION	62,950	213.000	13,408,350.000	
S&P GLOBAL INC	20,529	234.760	4,819,388.040	
EVEREST RE GROUP LTD	3,114	258.270	804,252.780	
MANPOWERGROUP INC	4,555	93.000	423,615.000	
MARKEL CORPORATION	1,222	1,121.620	1,370,619.640	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	17,601	191.180	3,364,959.180	
MARSH & MCLENNAN COS	41,804	101.690	4,251,048.760	
MASCO CORP	24,537	38.400	942,220.800	
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	5,382	226.010	1,216,385.820	

METLIFE INC	69,898	50.320	3,517,267.360	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	21,386	61.120	1,307,112.320	
MEDTRONIC PLC	109,862	98.850	10,859,858.700	
ACTIVISION BLIZZARD INC	62,904	46.840	2,946,423.360	
CVS HEALTH CORP	107,677	55.380	5,963,152.260	
MERCK & CO.INC.	211,731	84.820	17,959,023.420	
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	32,686	19.690	643,587.340	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	8,049	174.310	1,403,021.190	
MICROSOFT CORP	599,090	137.850	82,584,556.500	
MICRON TECH INC	91,784	42.900	3,937,533.600	
MIDDLEBY CORP	4,188	134.960	565,212.480	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	20,269	89.360	1,811,237.840	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	48,715	25.100	1,222,746.500	
3M CO	47,007	165.700	7,789,059.900	
MOHAWK INDUSTRIES INC	4,976	148.600	739,433.600	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	13,643	170.730	2,329,269.390	
KANSAS CITY SOUTHERN	8,856	119.170	1,055,369.520	
MYLAN NV	43,574	19.130	833,570.620	
ILLUMINA INC	12,114	372.700	4,514,887.800	
XCEL ENERGY INC	41,501	61.170	2,538,616.170	
NATIONAL OILWELL VARCO INC	33,468	22.090	739,308.120	
NETAPP INC	20,797	60.280	1,253,643.160	
NEWELL BRANDS INC	33,317	14.920	497,089.640	
NEWMONT GOLDCORP CORP	67,723	39.050	2,644,583.150	
NVR INC	307	3,468.150	1,064,722.050	
NIKE INC-CL B	102,838	87.440	8,992,154.720	
NOBLE ENERGY INC	39,436	22.320	880,211.520	
NORDSTROM INC	9,487	30.330	287,740.710	
NORFOLK SOUTHERN CORP	22,115	198.210	4,383,414.150	
EVERSOURCE ENERGY	27,088	77.670	2,103,924.960	
NISOURCE INC	31,548	29.500	930,666.000	
TAPESTRY INC	21,790	28.860	628,859.400	
NORTHERN TRUST CORP	17,867	90.420	1,615,534.140	
NORTHROP GRUMMAN CORP	13,019	324.060	4,218,937.140	
WELLS FARGO & CO	354,628	47.150	16,720,710.200	
NUCOR CORP	25,192	54.170	1,364,650.640	
CHENIERE ENERGY INC	19,175	68.670	1,316,747.250	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	37,906	90.160	3,417,604.960	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	61,202	50.240	3,074,788.480	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	5,209	142.570	742,647.130	
OGE ENERGY CORP	16,028	43.050	690,005.400	

O'REILLY AUTOMOTIVE INC	6,592	389.200	2,565,606.400	
ORACLE CORP	206,320	60.150	12,410,148.000	
PACCAR INC	29,661	70.510	2,091,397.110	
PTC INC	10,028	91.060	913,149.680	
EXELON CORP	77,211	49.370	3,811,907.070	
PARKER HANNIFIN CORP	11,023	161.760	1,783,080.480	
PAYCHEX INC	27,544	85.460	2,353,910.240	
ALIGN TECHNOLOGY INC	6,375	286.650	1,827,393.750	
PPL CORPORATION	58,220	30.350	1,766,977.000	
PEPSICO INC	115,459	134.410	15,518,844.190	
PENTAIR PLC	12,511	36.810	460,529.910	
PFIZER INC	455,494	44.060	20,069,065.640	
CONOCOPHILLIPS	93,517	61.210	5,724,175.570	
PVH CORP	6,862	87.470	600,219.140	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	14,369	146.600	2,106,495.400	
ALTRIA GROUP INC	155,911	49.000	7,639,639.000	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	37,972	140.050	5,317,978.600	
POLARIS INDUSTRIES INC	5,726	84.000	480,984.000	
GARMIN LTD	10,774	78.740	848,344.760	
FLUOR CORP (NEW)	9,821	31.890	313,191.690	
PPG INDUSTRIES INC	19,031	115.410	2,196,367.710	
IPG PHOTONICS CORP	2,608	141.920	370,127.360	
COSTCO WHOLESALE CORP	36,042	271.420	9,782,519.640	
T ROWE PRICE GROUP INC	20,133	109.450	2,203,556.850	
QUEST DIAGNOSTICS	10,883	102.520	1,115,725.160	
PROCTER & GAMBLE CO	205,366	113.750	23,360,382.500	
PROGRESSIVE CORP	48,142	83.430	4,016,487.060	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	41,411	60.220	2,493,770.420	
PULTE GROUP INC	21,209	32.650	692,473.850	
GLOBAL PAYMENTS INC	13,406	163.880	2,196,975.280	
QUALCOMM INC	100,618	74.360	7,481,954.480	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	10,388	84.860	881,525.680	
EXACT SCIENCES CORP	9,729	119.820	1,165,728.780	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	3,948	184.310	727,655.880	
REGENERON PHARMACEUTICALS	6,547	301.430	1,973,462.210	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA INC	5,042	158.300	798,148.600	
RESMED INC	12,271	124.000	1,521,604.000	
US BANCORP	123,829	53.180	6,585,226.220	
SEATTLE GENETICS INC /WA	10,269	66.250	680,321.250	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	31,500	38.470	1,211,805.000	
ROSS STORES INC	30,276	102.610	3,106,620.360	
ROLLINS INC	12,378	37.230	460,832.940	

ROPER TECHNOLOGIES INC	8,404	374.800	3,149,819.200	
ROCKWELL AUTOMATION INC	10,439	153.570	1,603,117.230	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	14,075	110.380	1,553,598.500	
RAYTHEON COMPANY	23,282	177.000	4,120,914.000	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	3,848	147.940	569,273.120	
ACCENTURE PLC-CL A	52,371	191.710	10,040,044.410	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	117,584	55.530	6,529,439.520	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	11,016	195.610	2,154,839.760	
THE TRAVELERS COMPANIES INC	21,771	153.330	3,338,147.430	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	26,521	126.920	3,366,045.320	
BOOKING HOLDINGS INC	3,735	1,869.390	6,982,171.650	
SCHLUMBERGER LTD	113,122	40.620	4,595,015.640	
SCHWAB (CHARLES) CORP	97,212	39.660	3,855,427.920	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	16,659	120.780	2,012,074.020	
BUNGE LTD	10,622	57.190	607,472.180	
SEI INVESTMENTS CO	12,294	56.030	688,832.820	
ANTHEM INC	21,433	287.920	6,170,989.360	
AMERISOURCEBERGEN CORP	12,749	89.300	1,138,485.700	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	23,125	58.080	1,343,100.000	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	6,722	457.540	3,075,583.880	
CENTENE CORP	33,216	51.210	1,700,991.360	
SVB FINANCIAL GROUP	4,044	212.640	859,916.160	
IAC INTERACTIVE CORP	6,252	232.200	1,451,714.400	
SMITH (A.O.) CORP	11,351	44.770	508,184.270	
ACUITY BRANDS INC	3,087	127.950	394,981.650	
SNAP-ON INC	4,935	156.670	773,166.450	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	33,083	100.750	3,333,112.250	
ADVANCE AUTO PARTS	6,330	156.430	990,201.900	
EDISON INTERNATIONAL	26,277	69.620	1,829,404.740	
SOUTHERN CO	85,765	56.910	4,880,886.150	
BB&T CORP	61,315	49.750	3,050,421.250	
SOUTHWEST AIRLINES	11,352	51.860	588,714.720	
AT&T INC	598,468	33.760	20,204,279.680	
CHEVRON CORP	156,297	125.440	19,605,895.680	
STANLEY BLACK & DECKER INC	13,077	142.970	1,869,618.690	
STATE STREET CORP	30,100	54.420	1,638,042.000	
STARBUCKS CORP	101,557	88.380	8,975,607.660	
STEEL DYNAMICS INC	19,030	29.170	555,105.100	
STRYKER CORP	27,759	209.060	5,803,296.540	
NETFLIX INC	35,768	381.000	13,627,608.000	
SUNTRUST BANKS INC	35,828	64.020	2,293,708.560	

SYMANTEC CORP	55,368	25.800	1,428,494.400	
KNIGHT SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	9,793	31.670	310,144.310	
SYNOPSYS INC	11,855	137.570	1,630,892.350	
SYSCO CORP	40,114	72.060	2,890,614.840	
INTUITIVE SURGICAL INC	9,427	532.280	5,017,803.560	
TELEFLEX INC	3,905	331.900	1,296,069.500	
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	96,274	9.180	883,795.320	
TEXAS INSTRUMENTS INC	76,781	116.640	8,955,735.840	
TEXTRON INC	19,312	52.420	1,012,335.040	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	32,601	296.520	9,666,848.520	
TIFFANY & CO	8,733	92.770	810,160.410	
TORCHMARK CORP	8,807	91.120	802,493.840	
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	14,384	132.040	1,899,263.360	
DAVITA INC	10,878	54.650	594,482.700	
TRACTOR SUPPLY CO	9,573	109.320	1,046,520.360	
TRIMBLE INC	20,073	43.950	882,208.350	
TYSON FOODS INC	24,553	82.030	2,014,082.590	
UGI CORP	14,725	53.090	781,750.250	
MARATHON OIL CORP	71,846	13.900	998,659.400	
UNION PACIFIC CORP	59,079	169.570	10,018,026.030	
UNITED TECHNOLOGIES CORP	67,018	130.450	8,742,498.100	
UNITEDHEALTH GROUP INC	78,383	247.480	19,398,224.840	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	6,135	129.660	795,464.100	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	7,226	136.590	986,999.340	
VF CORP	28,494	86.840	2,474,418.960	
CBS CORP	27,306	52.570	1,435,476.420	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	20,956	178.760	3,746,094.560	
VULCAN MATERIALS CO	10,913	136.920	1,494,207.960	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	65,144	55.570	3,620,052.080	
WALMART INC	119,431	112.980	13,493,314.380	
WASTE MANAGEMENT INC	35,221	117.790	4,148,681.590	
WATERS CORP	6,203	217.270	1,347,725.810	
ALLERGAN PLC	27,014	166.700	4,503,233.800	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	9,176	118.140	1,084,052.640	
VAIL RESORTS INC	3,109	224.580	698,219.220	
WESTERN DIGITAL CORP	22,567	54.040	1,219,520.680	
WABTEC CORP	14,029	69.940	981,188.260	
WHIRLPOOL CORP	5,553	142.080	788,970.240	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	13,902	79.910	1,110,908.820	
WYNN RESORTS LTD	7,970	130.340	1,038,809.800	

NASDAQ INC	9,020	103.020	929,240.400	
CME GROUP INC	29,696	203.170	6,033,336.320	
WILLIAMS COS INC	97,461	28.820	2,808,826.020	
LKQ CORP	26,690	26.160	698,210.400	
ALLIANT ENERGY CORP	19,910	50.370	1,002,866.700	
WEC ENERGY GROUP INC	25,582	86.130	2,203,377.660	
TD AMERITRADE HOLDING CORP	21,820	50.010	1,091,218.200	
CARMAX INC	13,973	87.410	1,221,379.930	
XEROX CORP	17,455	35.480	619,303.400	
XILINX INC	20,599	117.490	2,420,176.510	
CIMAREX ENERGY CO	9,253	57.090	528,253.770	
TJX COMPANIES INC	101,621	55.160	5,605,414.360	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP	4,664	211.960	988,581.440	
ZIONS BANCORP NA	16,584	45.280	750,923.520	
DAIRY FARM INTERNATIONAL HLDNGS	27,400	7.130	195,362.000	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	76,400	6.650	508,060.000	
JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	15,700	63.390	995,223.000	
JARDINE STRATEGIC HOLDINGS LTD	17,100	39.260	671,346.000	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	8,192	74.110	607,109.120	
SIGNATURE BANK	4,171	124.400	518,872.400	
CBRE GROUP INC	26,222	52.040	1,364,592.880	
LIBERTY GLOBAL PLC	12,732	26.810	341,344.920	
WELLCARE HEALTH PLANS INC	4,350	280.300	1,219,305.000	
REGIONS FINANCIAL CORP	88,517	15.060	1,333,066.020	
DOMINO'S PIZZA INC	3,256	275.350	896,539.600	
WESTLAKE CHEMICAL CORP	3,000	68.240	204,720.000	
T-MOBILE US INC	27,710	78.630	2,178,837.300	
LAS VEGAS SANDS CORP	27,759	62.250	1,727,997.750	
MOSAIC CO/THE	31,433	23.080	725,473.640	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	3,334	349.400	1,164,899.600	
CELANESE CORP	10,326	104.400	1,078,034.400	
DEXCOM INC	7,665	150.880	1,156,495.200	
DISCOVERY INC-A	10,423	31.650	329,887.950	
EXPEDIA GROUP INC	10,373	133.300	1,382,720.900	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	18,475	44.220	816,964.500	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	11,363	148.320	1,685,360.160	
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	41,818	26.060	1,089,777.080	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	47,010	90.290	4,244,532.900	
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	14,696	26.420	388,268.320	

VIACOM INC-CLASS B	30,282	31.280	947,220.960	
LIVE NATION	11,339	69.340	786,246.260	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,224	743.010	1,652,454.240	
UNITED AIRLINES HOLIDINGS INC	6,191	89.510	554,156.410	
TRANSDIGM GROUP INC	3,972	489.760	1,945,326.720	
MASTERCARD INC	74,867	275.380	20,616,874.460	
QURATE RETAIL INC	35,733	12.420	443,803.860	
HANESBRANDS INC	27,619	16.340	451,294.460	
WESTERN UNION CO	35,222	20.550	723,812.100	
OWENS CORNING	7,756	55.770	432,552.120	
LEIDOS HOLDINGS INC	11,113	81.500	905,709.500	
AERCAP HOLDINGS NV	11,586	50.200	581,617.200	
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLDINGS INC	9,175	73.920	678,216.000	
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT-ADR	17,350	23.580	409,113.000	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	9,176	131.160	1,203,524.160	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	31,119	16.610	516,886.590	
DELTA AIR LINES INC	13,898	59.470	826,514.060	
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	6,038	42.320	255,528.160	
DISCOVER FINANCIAL	26,157	80.100	2,095,175.700	
TE CONNECTIVITY LTD	27,658	93.750	2,592,937.500	
CONCHO RESOURCES INC/MIDLAND TX	15,970	103.000	1,644,910.000	
WABCO HOLDING INC	4,076	132.400	539,662.400	
LULULEMON ATHLETICA INC	8,939	183.870	1,643,613.930	
VMWARE INC	6,532	166.570	1,088,035.240	
MERCADOLIBRE INC	3,500	633.330	2,216,655.000	
ULTA BEAUTY INC	4,577	347.200	1,589,134.400	
INVESCO LTD	33,443	20.430	683,240.490	
MSCI INC	6,714	238.000	1,597,932.000	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	127,528	80.280	10,237,947.840	
VISA INC	143,645	179.310	25,756,984.950	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	14,536	118.710	1,725,568.560	
DISCOVERY INC-C	30,421	28.970	881,296.370	
MARATHON PETROLEUM CORP	53,915	54.980	2,964,246.700	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	11,624	54.990	639,203.760	
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	167,476	21.180	3,547,141.680	
XYLEM INC	15,111	80.390	1,214,773.290	
ALKERMES PLC	12,053	23.060	277,942.180	

LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	23,895	84.080	2,009,091.600	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,479	230.390	801,526.810	
SPLUNK INC	12,240	132.210	1,618,250.400	
EPAM SYSTEMS INC	4,879	188.110	917,788.690	
HCA HEALTHCARE INC	22,908	136.680	3,131,065.440	
VERISK ANALYTICS INC	12,320	150.010	1,848,123.200	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,273	141.750	605,697.750	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	6,885	292.290	2,012,416.650	
FIRST REPUBLIC BANK/SAN FRANCISCO CA	13,805	100.500	1,387,402.500	
CIT GROUP INC	9,287	50.610	470,015.070	
NXP SEMICONDUCTOR NV	24,113	96.130	2,317,982.690	
TARGA RESOURCES CORP	19,038	41.640	792,742.320	
LEAR CORP	4,681	132.400	619,764.400	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	8,622	111.700	963,077.400	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	17,268	58.100	1,003,270.800	
DOLLAR GENERAL CORP	21,173	140.930	2,983,910.890	
FORTINET INC	11,150	81.050	903,707.500	
AON PLC	19,835	197.820	3,923,759.700	
TESLA INC	10,991	238.920	2,625,969.720	
GENERAL MOTORS CO	104,794	38.100	3,992,651.400	
WORLDPAY INC	25,307	128.390	3,249,165.730	
XPO LOGISTICS INC	10,273	54.630	561,213.990	
TRIPADVISOR INC	9,263	45.800	424,245.400	
ALLY FINANCIAL INC	33,215	31.400	1,042,951.000	
CAPRI HOLDINGS LTD	12,138	34.630	420,338.940	
VOYA FINANCIAL INC	13,525	56.080	758,482.000	
APTIV PLC	20,610	77.520	1,597,687.200	
PHILLIPS 66	37,156	98.110	3,645,375.160	
FACEBOOK INC	195,885	202.730	39,711,766.050	
IQVIA HOLDINGS INC	13,453	159.350	2,143,735.550	
DIAMONDBACK ENERGY INC	13,109	109.680	1,437,795.120	
SERVICENOW INC	14,538	298.750	4,343,227.500	
PALO ALTO NETWORKS INC	7,935	214.680	1,703,485.800	
TABLEAU SOFTWARE INC	6,429	171.590	1,103,152.110	
WORKDAY INC	12,264	219.230	2,688,636.720	
ABBVIE INC	120,629	71.650	8,643,067.850	
ZOETIS INC	39,442	114.570	4,518,869.940	
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDINGS LTD	16,899	49.650	839,035.350	
COTY INC	23,813	11.300	269,086.900	
NEWS CORP/NEW-CL A	30,263	13.300	402,497.900	
HD SUPPLY HOLDINGS INC	14,075	39.470	555,540.250	
CDW CORP	11,406	112.460	1,282,718.760	
SPRINT CORP	63,882	7.160	457,395.120	

AMERICAN AIRLINES GROUP INC	10,199	32.940	335,955.060	
ARCONIC INC	36,761	25.790	948,066.190	
TWILIO INC	9,434	145.440	1,372,080.960	
SNAP INC	60,570	15.260	924,298.200	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	17,852	38.580	688,730.160	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	5,006	39.610	198,287.660	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-C	17,931	39.680	711,502.080	
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	15,410	23.020	354,738.200	
OKTA INC	7,689	135.480	1,041,705.720	
BAKER HUGHES A GE CO	43,404	25.380	1,101,593.520	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	12,611	66.200	834,848.200	
ALTICE USA INC-A	13,887	25.080	348,285.960	
TECHNIPFMC LTD	31,257	25.260	789,551.820	
BROADCOM INC	32,387	274.500	8,890,231.500	
MONGODB INC	2,869	157.230	451,092.870	
BURLINGTON STORES INC	5,095	177.700	905,381.500	
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	9,985	37.320	372,640.200	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	24,000	33.160	795,840.000	
VEEVA SYSTEMS INC	10,852	173.820	1,886,294.640	
TWITTER INC	61,369	37.470	2,299,496.430	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING PLC	13,214	46.750	617,754.500	
EVERGY INC	21,366	61.690	1,318,068.540	
PLAINS GP HOLDINGS LP	14,935	25.290	377,706.150	
COMMSCOPE HOLDING CO INC	19,592	15.450	302,696.400	
ALLEGION PLC	7,469	109.320	816,511.080	
STERIS PLC	6,658	149.700	996,702.600	
DOCUSIGN INC	9,325	51.350	478,838.750	
WIX.COM LTD	4,000	145.590	582,360.000	
DROPBOX INC	17,573	25.510	448,287.230	
KKR & CO INC	37,307	26.210	977,816.470	
PERRIGO CO PLC	10,553	50.510	533,032.030	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	22,290	99.190	2,210,945.100	
ARAMARK	21,772	36.080	785,533.760	
CIGNA CORP	31,466	160.510	5,050,607.660	
DELL TECHNOLOGIES INC	12,960	52.290	677,678.400	
DOW INC	62,645	47.550	2,978,769.750	
AMCOR PLC	130,000	10.960	1,424,800.000	
FOX CORP-A	30,595	36.140	1,105,703.300	
FOX CORP-B	13,009	36.140	470,145.260	
UBER TECHNOLOGIES INC	17,038	43.700	744,560.600	
CORTEVA INC	64,517	26.500	1,709,700.500	
GRUBHUB INC	8,158	77.060	628,655.480	
PAYCOM SOFTWARE INC	3,772	244.470	922,140.840	
SABRE CORP	25,826	22.930	592,190.180	

	PARSLEY ENERGY INC	25,677	18.700	480,159.900	
	ARISTA NETWORKS INC	4,441	270.390	1,200,801.990	
	IHS MARKIT LTD	31,980	64.840	2,073,583.200	
	FNF GROUP	21,372	41.390	884,587.080	
	SYNCHRONY FINANCIAL	50,790	35.520	1,804,060.800	
	CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	35,820	34.990	1,253,341.800	
	CYBERARK SOFTWARE LTD	3,457	132.090	456,635.130	
	CDK GLOBAL INC	9,969	50.100	499,446.900	
	WAYFAIR INC	5,091	150.180	764,566.380	
	KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	15,515	88.950	1,380,059.250	
	QORVO INC	10,887	69.340	754,904.580	
	ZAYO GROUP HOLDINGS INC	21,407	33.370	714,351.590	
	LIBERTY BROADBAND CORP-C W/I	8,307	107.200	890,510.400	
	AXALTA COATING SYSTEMS LTD	17,018	29.400	500,329.200	
	GODADDY INC	14,641	70.070	1,025,894.870	
	NIELSEN HOLDINGS PLC	32,827	22.470	737,622.690	
	TRANSUNION	15,000	74.350	1,115,250.000	
	SQUARE INC	26,487	78.370	2,075,786.190	
	DUPONT DE NEMOURS INC	62,055	69.650	4,322,130.750	
	COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS PLC	19,321	57.040	1,102,069.840	
	WESTROCK CO	22,394	37.400	837,535.600	
	KRAFT HEINZ CO	56,277	31.300	1,761,470.100	
	FORTIVE CORP	24,560	79.390	1,949,818.400	
	WASTE CONNECTIONS INC	22,523	96.790	2,180,001.170	
	ALPHABET INC-CL A	24,410	1,140.910	27,849,613.100	
	HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	114,656	14.770	1,693,469.120	
	PAYPAL HOLDINGS INC	91,157	119.640	10,906,023.480	
	AXA EQUITABLE HOLDINGS INC	23,220	21.870	507,821.400	
	FIRST DATA CORP	45,458	27.840	1,265,550.720	
	DXC TECHNOLOGY CO	20,848	55.250	1,151,852.000	
	ZILLOW GROUP INC-C	11,723	51.350	601,976.050	
	ALPHABET INC-CL C	26,069	1,140.480	29,731,173.120	
	BEIGENE LTD ADR	3,159	124.270	392,568.930	
	CHEMOURS CO	12,723	19.640	249,879.720	
	LINDE PLC	45,719	201.770	9,224,722.630	
	ATHENE HOLDING LTD	11,847	42.500	503,497.500	
	CHARTER COMMUNICATIONS INC	12,962	407.210	5,278,256.020	
	VISTRA ENERGY CORP	30,000	22.430	672,900.000	
アメリカ・ドル　小計		24,962,633		2,103,760,424.440 (227,626,877,925)	
イギリス・ポンド	ANTOFAGASTA PLC	31,798	8.632	274,480.330	

ASHTEAD GROUP	36,689	22.420	822,567.380	
SEVERN TRENT PLC	18,217	20.800	378,913.600	
BHP GROUP PLC	174,846	19.970	3,491,674.620	
BARCLAYS PLC	1,418,427	1.564	2,218,419.820	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	82,283	5.842	480,697.280	
BT GROUP PLC	696,282	1.923	1,338,950.280	
BUNZL PLC	27,838	21.040	585,711.520	
EASYJET PLC	13,628	9.800	133,554.400	
AVIVA PLC	314,691	4.265	1,342,157.110	
CRODA INTERNATIONAL	10,391	48.120	500,014.920	
DIAGEO PLC	198,889	34.385	6,838,798.260	
SCHRODERS PLC	10,932	29.870	326,538.840	
DCC PLC	7,898	68.740	542,908.520	
NATIONAL GRID PLC	276,384	8.539	2,360,042.970	
KINGFISHER PLC	165,680	2.163	358,365.840	
BAE SYSTEMS PLC	270,106	4.923	1,329,731.830	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	186,622	29.475	5,500,683.450	
HALMA PLC	33,930	20.190	685,046.700	
NEXT PLC	12,064	54.680	659,659.520	
IMPERIAL BRANDS PLC	77,987	20.150	1,571,438.050	
JOHNSON MATTHEY PLC	15,017	32.850	493,308.450	
ANGLO AMERICAN PLC	84,546	21.535	1,820,698.110	
COMPASS GROUP PLC	132,112	19.320	2,552,403.840	
HSBC HOLDINGS PLC	1,647,910	6.667	10,986,615.970	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	508,463	2.690	1,367,765.470	
CENTRICA PLC	471,340	0.873	411,479.820	
UNILEVER PLC	90,514	50.220	4,545,613.080	
MEGGITT PLC	62,181	5.282	328,440.040	
MORRISON <WM.> SUPERMARKETS	168,676	2.060	347,472.560	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	54,487	7.940	432,626.780	
RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	80,864	5.840	472,245.760	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	30,240	23.710	716,990.400	
PEARSON PLC	65,009	8.554	556,086.980	
PERSIMMON PLC	26,085	18.855	491,832.670	
PRUDENTIAL PLC	214,791	17.270	3,709,440.570	
RIO TINTO PLC	94,671	48.560	4,597,223.760	
VODAFONE GROUP PLC	2,204,526	1.325	2,920,996.950	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	58,874	64.280	3,784,420.720	
RELX PLC	160,490	19.475	3,125,542.750	
RENTOKIL INITIAL PLC	140,617	4.134	581,310.670	
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	139,268	8.456	1,177,650.200	

ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	397,434	2.280	906,149.520	
ST JAMES'S PLACE PLC	48,466	11.390	552,027.740	
SSE PLC	83,105	11.435	950,305.670	
BP PLC	1,670,638	5.457	9,116,671.560	
SAGE GROUP PLC(THE)	87,111	8.120	707,341.320	
SMITHS GROUP PLC	31,720	15.650	496,418.000	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	5,518	87.950	485,308.100	
STANDARD CHARTERED PLC	238,009	7.338	1,746,510.040	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	5,910,523	0.579	3,422,192.810	
TAYLOR WIMPLEY PLC	252,287	1.585	399,874.890	
TESCO PLC	808,049	2.371	1,915,884.170	
3I GROUP PLC	76,643	11.285	864,916.250	
SMITH & NEPHEW PLC	74,903	17.415	1,304,435.740	
GLAXOSMITHKLINE PLC	406,821	16.432	6,684,882.670	
WEIR GROUP	19,161	14.985	287,127.580	
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	26,266	56.680	1,488,756.880	
WPP PLC	107,494	9.610	1,033,017.340	
ASTRAZENECA PLC	103,777	64.890	6,734,089.530	
WHITBREAD PLC	15,639	47.990	750,515.610	
CARNIVAL PLC	13,350	34.730	463,645.500	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	176,730	2.081	367,775.130	
JOHN WOOD GROUP PLC	48,988	4.889	239,502.330	
INTERTEK GROUP PLC	14,335	55.200	791,292.000	
BURBERRY GROUP PLC	31,686	19.250	609,955.500	
INVESTEC PLC	50,655	5.020	254,288.100	
INTERCONTINENTAL HOTELS	15,125	54.000	816,750.000	
ITV PLC	254,308	1.089	276,941.410	
SAINSBURY (J) PLC	137,215	2.014	276,351.010	
G4S PLC	122,250	1.973	241,199.250	
ADMIRAL GROUP PLC	15,893	22.850	363,155.050	
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	10,726	37.390	401,045.140	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	371,786	26.045	9,683,166.370	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	303,093	26.075	7,903,149.970	
TUI AG-DI	45,043	7.578	341,335.850	
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	214,715	2.996	643,286.140	
EXPERIAN PLC	75,294	23.850	1,795,761.900	
MONDI PLC	28,318	17.470	494,715.460	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	20,927	19.965	417,807.550	
FRESNILLO PLC NPR	15,639	8.750	136,841.250	
OCADO GROUP PLC	40,627	12.150	493,618.050	
INFORMA PLC	102,475	8.470	867,963.250	

	GLENCORE PLC	914,168	2.701	2,469,167.760	
	GVC HOLDINGS PLC	49,618	6.036	299,494.240	
	EVRAZ PLC	48,765	6.252	304,878.780	
	NMC HEALTH PLC	8,149	22.670	184,737.830	
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP PLC	112,694	3.390	382,032.660	
	COCA-COLA HBC AG	15,208	27.260	414,570.080	
	MERLIN ENTERTAINMENTS PLC	50,037	4.490	224,666.130	
	FERGUSON PLC	18,865	57.360	1,082,096.400	
	MICRO FOCUS INTERNATIONAL PLC	26,100	17.530	457,533.000	
	AUTO TRADER GROUP PLC	76,348	5.614	428,617.670	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	417,620	1.773	740,440.260	
イギリス・ポンド　小計		24,726,577		151,874,727.230 (20,560,800,573)	
イスラエル・シュケル	BANK HAPOALIM BM	102,044	27.950	2,852,129.800	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	128,049	25.800	3,303,664.200	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,760	558.100	982,256.000	
	ISRAEL DISCOUNT BANK LTD	102,134	14.920	1,523,839.280	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	49,411	18.110	894,833.210	
	NICE LTD	4,902	517.400	2,536,294.800	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	10,444	84.430	881,786.920	
	AZRIELI GROUP	4,428	230.900	1,022,425.200	
イスラエル・シュケル　小計		403,172		13,997,229.410 (426,355,607)	
オーストラリア・ドル	RAMSAY HEALTH CARE LTD	11,115	73.290	814,618.350	
	AUST AND NZ BANKING GROUP LT	237,677	27.530	6,543,247.810	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	282,429	27.870	7,871,296.230	
	BANK OF QUEENSLAND LTD	30,569	9.340	285,514.460	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	115,662	8.890	1,028,235.180	
	TELSTRA CORP LTD	360,654	3.870	1,395,730.980	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD	39,014	11.350	442,808.900	
	AMP LTD	302,414	2.140	647,165.960	
	ASX LTD	15,573	86.490	1,346,908.770	
	BHP GROUP LTD	244,265	40.960	10,005,094.400	
	CALTEX AUSTRALIA LTD	20,946	26.090	546,481.140	
	HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	22,182	4.150	92,055.300	
	COMPUTERSHARE LT	38,040	16.720	636,028.800	
	CSL LIMITED	37,679	220.190	8,296,539.010	
	REA GROUP LTD	4,119	98.990	407,739.810	
	TRANSURBAN GROUP	224,755	15.380	3,456,731.900	
	COCA-COLA AMATIL LTD	48,601	10.480	509,338.480	

COCHLEAR LTD	5,374	222.170	1,193,941.580	
ORIGIN ENERGY LTD	132,860	7.450	989,807.000	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	144,996	81.240	11,779,475.040	
BORAL LIMITED	86,101	5.390	464,084.390	
RIO TINTO LIMITED	30,337	103.670	3,145,036.790	
APA GROUP	94,106	11.020	1,037,048.120	
ARISTOCRAT LEISU	45,323	29.660	1,344,280.180	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	206,789	8.530	1,763,910.170	
TPG TELECOM LTD	28,719	6.540	187,822.260	
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	3,275	43.490	142,429.750	
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	33,926	18.600	631,023.600	
ORICA LTD	37,821	20.480	774,574.080	
CIMIC GROUP LTD	8,709	45.220	393,820.980	
BLUESCOPE STEEL LTD	36,941	11.650	430,362.650	
SYDNEY AIRPORT	85,130	8.090	688,701.700	
MACQUARIE GROUP LTD	26,417	128.010	3,381,640.170	
WORLEYPARSONS LTD	34,652	15.150	524,977.800	
SUNCORP GROUP LTD	107,913	13.360	1,441,717.680	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	226,421	26.860	6,081,668.060	
NEWCREST MINING LTD	62,080	31.490	1,954,899.200	
OIL SEARCH LTD	105,470	6.950	733,016.500	
INCITEC PIVOT LTD	136,426	3.210	437,927.460	
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	107,820	11.910	1,284,136.200	
CHALLENGER FINANCIAL SERVICES	45,707	6.890	314,921.230	
SANTOS LTD	132,862	6.850	910,104.700	
SONIC HEALTHCARE	34,684	27.570	956,237.880	
WASHINGTON H SOUL PATTINSON & CO LTD	15,007	22.820	342,459.740	
TABCORP HOLDINGS LTD	194,274	4.690	911,145.060	
WESFARMERS LTD	91,516	37.460	3,428,189.360	
ALUMINA LIMITED	184,613	2.300	424,609.900	
WOODSIDE PETROLEUM LTD	79,115	36.020	2,849,722.300	
WOOLWORTHS GROUP LTD	101,937	34.490	3,515,807.130	
SEEK LTD	25,899	21.940	568,224.060	
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES LTD	4,581	40.810	186,950.610	
AUSNET SERVICES	165,066	1.910	315,276.060	
AGL ENERGY LTD	49,644	20.460	1,015,716.240	
BRAMBLES LTD	126,693	12.350	1,564,658.550	
CROWN RESORTS LTD	32,861	12.870	422,921.070	
AURIZON HOLDINGS LTD	150,150	5.530	830,329.500	

	TREASURY WINE ESTATES LTD	54,001	16.010	864,556.010	
	MEDIBANK PVT LTD	206,910	3.580	740,737.800	
	SOUTH32 LTD(AUD)	443,160	3.060	1,356,069.600	
	COLES GROUP LTD	96,821	14.030	1,358,398.630	
オーストラリア・ドル　小計		6,058,801		108,008,872.270 (8,137,388,436)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	20,281	68.030	1,379,716.430	
	ALIMENTATION COUCHE TARD INC	37,169	85.810	3,189,471.890	
	BARRICK GOLD CORP	140,953	21.630	3,048,813.390	
	ATCO LTD	7,193	44.750	321,886.750	
	BANK OF MONTREAL	52,765	100.230	5,288,635.950	
	BANK OF NOVA SCOTIA	102,244	70.780	7,236,830.320	
	NATIONAL BANK OF CANADA	28,553	64.000	1,827,392.000	
	BCE INC	11,673	60.320	704,115.360	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT	69,355	63.830	4,426,929.650	
	BAUSCH HEALTH COS INC	25,819	32.610	841,957.590	
	BOMBARDIER INC 'B'	151,615	2.220	336,585.300	
	SAPUTO INC	18,601	39.580	736,227.580	
	BLACKBERRY LTD	39,652	9.250	366,781.000	
	CGI INC	20,610	102.200	2,106,342.000	
	CCL INDUSTRIES INC	11,340	65.740	745,491.600	
	CAE INC	23,000	35.800	823,400.000	
	CAMECO CORP	32,627	14.020	457,430.540	
	ROGERS COMM-CL B	30,739	70.360	2,162,796.040	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	36,378	103.370	3,760,393.860	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	96,491	36.150	3,488,149.650	
	CANADIAN TIRE CORP-CL A	4,862	145.080	705,378.960	
	CANADIAN UTILITIES LTD	9,119	36.730	334,940.870	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	60,271	121.740	7,337,391.540	
	FIRST CAPITAL REALTY INC	8,610	22.210	191,228.100	
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	15,911	50.780	807,960.580	
	OPEN TEXT CORP	21,795	55.610	1,212,019.950	
	EMPIRE CO LTD	15,093	33.090	499,427.370	
	KINROSS GOLD CORP	99,741	5.390	537,603.990	
	FORTIS INC	36,000	52.510	1,890,360.000	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	55,296	11.080	612,679.680	
	TELUS CORP	15,945	48.780	777,797.100	
	GREAT WEST LIFECO INC	20,722	30.300	627,876.600	
	IMPERIAL OIL LTD	21,542	36.820	793,176.440	
	ENBRIDGE INC	167,524	48.060	8,051,203.440	
	IGM FINANCIAL INC	8,426	37.770	318,250.020	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	164,593	24.080	3,963,399.440	
	LOBLAW CO LTD	15,354	67.310	1,033,477.740	

MAGNA INTERNATIONAL INC	25,247	61.190	1,544,863.930	
SUN LIFE FINANCIAL INC	47,728	54.930	2,621,699.040	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,419	641.300	1,551,304.700	
METRO INC	19,949	49.600	989,470.400	
HUSKY ENERGY INC	28,749	12.640	363,387.360	
EMERA INC	6,509	54.700	356,042.300	
METHANEX CORP	5,281	56.530	298,534.930	
ONEX CORP	6,646	81.650	542,645.900	
POWER CORP OF CANADA	23,792	28.290	673,075.680	
POWER FINANCIAL CORP	21,676	30.060	651,580.560	
QUEBECOR INC-B	18,078	32.060	579,580.680	
ROYAL BANK OF CANADA	117,009	105.170	12,305,836.530	
SNC-LAVALIN GROUP INC	13,134	24.780	325,460.520	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	11,446	307.910	3,524,337.860	
SHAW COMM INC-B	35,431	26.480	938,212.880	
SUNCOR ENERGY INC	128,812	42.400	5,461,628.800	
LUNDIN MINING CORP	43,480	7.010	304,794.800	
ENCANA CORP	127,517	6.540	833,961.180	
TECK RESOURCES LTD-CL B	41,016	28.140	1,154,190.240	
THOMSON REUTERS CORP	16,394	87.050	1,427,097.700	
TORONTO DOMINION BANK (THE) C$	149,135	76.420	11,396,896.700	
TC ENERGY CORP	75,767	66.610	5,046,839.870	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	5,696	55.510	316,184.960	
WESTON (GEORGE) LTD	6,184	100.680	622,605.120	
INTACT FINANCIAL CORP	10,989	126.550	1,390,657.950	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	34,963	31.650	1,106,578.950	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,729	1,244.580	2,151,878.820	
FRANCO-NEVADA CORP NPR	14,922	112.290	1,675,591.380	
CI FINANCIAL CORP	20,695	21.570	446,391.150	
TOURMALINE OIL CORP	27,410	16.780	459,939.800	
KEYERA CORP	16,668	34.910	581,879.880	
ALTAGAS LTD	23,944	20.090	481,034.960	
PEMBINA PIPELINE CORP	43,784	49.960	2,187,448.640	
DOLLARAMA INC	23,536	49.200	1,157,971.200	
STARS GROUP INC	18,529	20.900	387,256.100	
CENOVUS ENERGY INC W/I	80,721	12.260	989,639.460	
VERMILION ENERGY INC	12,923	28.630	369,985.490	
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	17,317	55.150	955,032.550	
INTER PIPELINE LTD	38,609	22.200	857,119.800	
NUTRIEN LTD	47,484	66.260	3,146,289.840	
CRONOS GROUP INC	16,000	19.990	319,840.000	
WSP GLOBAL INC	8,400	72.790	611,436.000	
IA FINANCIAL CORP INC	8,104	53.700	435,184.800	

	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	14,961	18.870	282,314.070	
	RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	20,664	93.060	1,922,991.840	
	AURORA CANNABIS INC	66,562	9.640	641,657.680	
	SHOPIFY INC	7,998	417.240	3,337,085.520	
	CANOPY GROWTH CORP	18,634	50.560	942,135.040	
	HYDRO ONE LTD	27,340	23.390	639,482.600	
カナダ・ドル　小計		3,297,843		154,250,574.880 (12,767,320,083)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE TECH ENG	125,000	4.250	531,250.000	
	SEMBCORP INDUSTRIES	81,400	2.380	193,732.000	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	123,700	2.520	311,724.000	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	692,140	0.300	207,642.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	149,500	25.400	3,797,300.000	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	36,400	9.490	345,436.000	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	5,944	36.250	215,470.000	
	SINGAPORE AIRPORT TERMINAL SERVICES LTD	47,800	5.230	249,994.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	68,900	7.930	546,377.000	
	CAPITALAND LTD	204,515	3.690	754,660.350	
	GENTING SINGAPORE LTD	416,400	0.910	378,924.000	
	KEPPEL CORP LTD	134,600	6.530	878,938.000	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	177,900	2.820	501,678.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	269,953	11.480	3,099,060.440	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	670,722	3.500	2,347,527.000	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	47,500	9.480	450,300.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	103,200	26.410	2,725,512.000	
	UOL GROUP LIMITED	40,500	7.530	304,965.000	
	VENTURE CORP LTD	21,000	15.380	322,980.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	142,300	3.720	529,356.000	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	188,800	1.490	281,312.000	
シンガポール・ドル　小計		3,748,174		18,974,137.790 (1,512,618,265)	
スイス・フラン	CREDIT SUISSE GROUP AG	214,364	11.950	2,561,649.800	
	NESTLE SA-REGISTERED	252,060	102.840	25,921,850.400	
	CIE FINANC RICHEMONT	42,946	81.940	3,518,995.240	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	57,693	275.600	15,900,190.800	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,607	214.100	772,258.700	
	SIKA INHABER	10,209	160.400	1,637,523.600	
	SGS SA-REG	424	2,460.000	1,043,040.000	
	NOVARTIS AG-REG SHS	177,773	90.340	16,060,012.820	

	BALOISE HOLDING AG -R	4,127	177.600	732,955.200	
	BARRY CALLEBAUT AG	157	1,980.000	310,860.000	
	CLARIANT AG-REG	19,496	18.965	369,741.640	
	SWISSCOM AG-REG	2,280	483.800	1,103,064.000	
	ABB LTD	152,119	18.580	2,826,371.020	
	ADECCO GROUP AG-REG	12,944	53.640	694,316.160	
	GEBERIT AG	3,243	456.600	1,480,753.800	
	LONZA GROUP AG-REG	6,237	331.100	2,065,070.700	
	LINDT & SPRUENGLI PART	79	7,190.000	568,010.000	
	LINDT & SPRUENGLI NAMEN	9	79,700.000	717,300.000	
	GIVAUDAN-REG	742	2,737.000	2,030,854.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	12,546	344.300	4,319,587.800	
	LAFARGEHOLCIM LTD	41,122	48.160	1,980,435.520	
	TEMENOS GROUP	5,640	174.500	984,180.000	
	SONOVA HOLDING AG	4,584	219.800	1,007,563.200	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG	4,018	142.950	574,373.100	
	STRAUMANN HOLDING AG	794	847.400	672,835.600	
	THE SWATCH GROUP AG-B	2,691	275.200	740,563.200	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	4,592	51.800	237,865.600	
	SCHINDLER NAMEN	1,663	210.800	350,560.400	
	SWISS LIFE HOLDING AG	2,774	488.400	1,354,821.600	
	VIFOR PHARMA AG	3,465	142.250	492,896.250	
	EMS-CHEMIE HOLDING	633	579.500	366,823.500	
	SWISS PRIME SITE AG	5,990	86.600	518,734.000	
	PARGESA HOLDING PORTEUR	3,000	74.800	224,400.000	
	DUFRY GROUP	3,138	83.500	262,023.000	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,505	770.400	1,159,452.000	
	JULIUS BAER GROUP LTD	17,849	42.060	750,728.940	
	SWISS RE LTD	24,816	97.460	2,418,567.360	
	ALCON INC	34,609	60.300	2,086,922.700	
	UBS GROUP AG	315,607	11.935	3,766,769.540	
スイス・フラン　小計		1,451,545		104,584,921.190 (11,456,232,267)	
スウェーデン・クローナ	ATLAS COPCO AB-A SHS	52,284	283.600	14,827,742.400	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	33,303	253.500	8,442,310.500	
	ERICSSON LM-B SHS	254,497	89.260	22,716,402.220	
	LUNDBERGS B	7,382	357.600	2,639,803.200	
	SKF AB-B SHS	28,812	155.950	4,493,231.400	
	SANDVIK AB	96,746	159.050	15,387,451.300	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	130,827	90.420	11,829,377.340	
	SKANSKA AB-B SHS	32,547	175.500	5,711,998.500	
	SWEDBANK AB	71,958	145.300	10,455,497.400	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	126,705	97.400	12,341,067.000	
	VOLVO AB-B SHS	119,227	145.750	17,377,335.250	

	SWEDISH MATCH AB	12,941	410.000	5,305,810.000	
	TELE2 AB-B SHS	44,876	132.300	5,937,094.800	
	INDUSTRIVARDEN C	11,403	215.600	2,458,486.800	
	ELECTROLUX AB-SER B	19,191	239.200	4,590,487.200	
	SECURITAS AB-B SHS	24,098	165.550	3,989,423.900	
	INVESTOR AB-B SHS	38,298	460.100	17,620,909.800	
	HENNES&MAURITZ AB-B SHS	67,565	170.000	11,486,050.000	
	ASSA ABLOY AB-B	81,088	210.800	17,093,350.400	
	TELIA CO AB	231,855	43.380	10,057,869.900	
	LUNDIN PETROLEUM AB	16,790	311.700	5,233,443.000	
	BOLIDEN AB	21,855	219.900	4,805,914.500	
	ALFA LAVAL AB	23,343	199.850	4,665,098.550	
	KINNEVIK AB-B	18,310	244.400	4,474,964.000	
	MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR SA	5,332	552.000	2,943,264.000	
	ICA GRUPPEN AB	5,920	406.600	2,407,072.000	
	HUSQVARNA AB-B SHS	33,692	84.500	2,846,974.000	
	HEXAGON AB	22,037	462.000	10,181,094.000	
	EPIROC AB-A	63,358	91.520	5,798,524.160	
	EPIROC AB-B	30,899	87.280	2,696,864.720	
	ESSITY AB-B	52,522	292.500	15,362,685.000	
	NORDEA BANK ABP	246,268	70.490	17,359,431.320	
スウェーデン・クローナ　小計		2,025,929		283,537,028.560 (3,260,675,829)	
デンマーク・クローネ	CARLSBERG AS-B	8,441	913.000	7,706,633.000	
	A P MOLLER A/S	604	7,728.000	4,667,712.000	
	AP MOLLER MAERSK A	273	7,335.000	2,002,455.000	
	DANSKE BANK A/S	51,034	102.850	5,248,846.900	
	GENMAB A/S	4,754	1,194.500	5,678,653.000	
	NOVOZYMES-B SHS	19,111	306.200	5,851,788.200	
	NOVO NORDISK A/S-B	142,420	335.050	47,717,821.000	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	15,604	591.600	9,231,326.400	
	COLOPLAST-B	9,729	803.000	7,812,387.000	
	DSV A/S	15,349	634.800	9,743,545.200	
	DEMANT A/S	12,042	202.200	2,434,892.400	
	H LUNDBECK A/S	4,840	255.600	1,237,104.000	
	TRYG A/S	11,107	219.800	2,441,318.600	
	PANDORA A/S	8,251	250.000	2,062,750.000	
	CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S	9,283	591.200	5,488,109.600	
	ISS A/S	11,107	195.450	2,170,863.150	
	ORSTED A/S	15,090	612.600	9,244,134.000	
デンマーク・クローネ　小計		339,039		130,740,339.450 (2,133,682,340)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	85,245	9.470	807,270.150	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	29,894	12.630	377,561.220	
	A2 MILK CO LTD	55,091	16.250	895,228.750	

	FISHER & PAYKEL	57,274	15.850	907,792.900	
	FLETCHER BUILDING LTD	64,104	5.160	330,776.640	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	159,623	3.940	628,914.620	
	MERIDIAN ENERGY LTD	90,173	4.860	438,240.780	
ニュージーランド・ドル　小計		541,404		4,385,785.060 (315,644,950)	
ノルウェー・クローネ	MOWI ASA	35,183	214.900	7,560,826.700	
	DNB ASA	79,858	163.000	13,016,854.000	
	NORSK HYDRO ASA	93,139	30.400	2,831,425.600	
	TELENOR ASA	62,076	181.950	11,294,728.200	
	ORKLA ASA	64,938	78.280	5,083,346.640	
	EQUINOR ASA	81,022	170.650	13,826,404.300	
	YARA INTERNATIONAL ASA	16,000	394.300	6,308,800.000	
	AKER BP ASA	8,552	262.200	2,242,334.400	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	16,683	173.000	2,886,159.000	
	SCHIBSTED ASA	7,445	215.800	1,606,631.000	
ノルウェー・クローネ　小計		464,896		66,657,509.840 (841,217,774)	
ユーロ	CRH PLC	66,500	29.210	1,942,465.000	
	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	6,246	73.940	461,829.240	
	KERRY GROUP PLC-A	13,865	104.600	1,450,279.000	
	KINGSPAN GROUP PLC	11,768	45.700	537,797.600	
	UMICORE	14,115	26.750	377,576.250	
	AIR LIQUIDE	35,338	123.050	4,348,340.900	
	AIRBUS SE	48,367	125.840	6,086,503.280	
	AXA	159,701	23.705	3,785,712.200	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	44,449	22.450	997,880.050	
	ADIDAS AG	14,991	278.650	4,177,242.150	
	ASSICURAZIONI GENERALI	95,191	17.210	1,638,237.110	
	DASSAULT AVIATION SA	163	1,186.000	193,318.000	
	DANONE	51,072	75.100	3,835,507.200	
	SAFRAN SA	26,876	128.700	3,458,941.200	
	INTESA SANPAOLO	1,249,933	2.031	2,538,613.920	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	27,742	65.650	1,821,262.300	
	ACCOR SA	16,000	38.060	608,960.000	
	BOUYGUES	17,572	32.130	564,588.360	
	BNP PARIBAS	90,643	42.695	3,870,002.880	
	THALES SA	8,549	103.650	886,103.850	
	CAPGEMINI SA	12,515	114.150	1,428,587.250	
	CASINO GUICHARD PERRACHON	4,264	31.570	134,614.480	
	INGENICO GROUP	4,334	75.300	326,350.200	
	UNICREDIT SPA	170,144	11.464	1,950,530.810	
	NATIXIS	70,166	3.661	256,877.720	
	KONINKLIJKE DSM NV	15,111	110.400	1,668,254.400	

COMMERZBANK AG	83,118	6.417	533,368.200	
EIFFAGE	6,461	88.040	568,826.440	
FRESENIUS SE & CO KGAA	34,325	46.115	1,582,897.370	
UNITED INTERNET	9,882	29.060	287,170.920	
FUCHS PETROLUB SE PREF	5,546	34.960	193,888.160	
PUBLICIS GROUPE	18,222	47.220	860,442.840	
FAURECIA	6,117	37.160	227,307.720	
IBERDROLA SA	498,442	8.614	4,293,579.380	
ENI SPA	207,168	14.706	3,046,612.600	
IMERYS SA	2,256	44.120	99,534.720	
JERONIMO MARTINS	19,517	14.260	278,312.420	
KBC GROUPE	20,803	59.900	1,246,099.700	
HANNOVER RUECK SE	4,868	143.900	700,505.200	
WARTSILA OYJ	34,935	12.115	423,237.520	
L'OREAL	21,000	253.800	5,329,800.000	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	22,696	381.000	8,647,176.000	
GEA GROUP AG	11,838	22.800	269,906.400	
BOLLORE	71,347	3.932	280,536.400	
MEDIOBANCA SPA	56,009	9.400	526,484.600	
MICHELIN(CGDE)-B	13,744	108.250	1,487,788.000	
CONTINENTAL AG	9,528	118.220	1,126,400.160	
DEUTSCHE POST AG-REG	81,617	29.320	2,393,010.440	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	15,885	14.850	235,892.250	
NOKIAN RENKAAT OYJ	9,399	27.300	256,592.700	
AXEL SPRINGER SE	4,978	61.950	308,387.100	
OMV AG	12,817	43.550	558,180.350	
VERBUND AG	6,778	47.040	318,837.120	
PERNOD-RICARD	17,565	158.250	2,779,661.250	
PEUGEOT SA	50,087	21.430	1,073,364.410	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	13,249	58.900	780,366.100	
RENAULT SA	14,917	51.900	774,192.300	
REPSOL SA	116,954	13.790	1,612,795.660	
REMY COINTREAU	1,860	126.300	234,918.000	
MERCK KGAA	11,193	93.000	1,040,949.000	
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	39,436	33.690	1,328,598.840	
RWE AG	45,905	22.800	1,046,634.000	
SEB SA	1,551	160.700	249,245.700	
SOCIETE GENERALE-A	64,277	22.475	1,444,625.570	
VINCI S.A.	42,039	90.340	3,797,803.260	
SODEXO	7,075	101.700	719,527.500	
SOLVAY SA	5,563	87.340	485,872.420	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	45,384	77.020	3,495,475.680	
VIVENDI SA	73,790	24.950	1,841,060.500	
SAP SE	80,585	121.900	9,823,311.500	
TELEFONICA S.A	390,910	7.396	2,891,170.360	

TOTAL SA	194,758	49.760	9,691,158.080	
VALEO	19,653	25.500	501,151.500	
E.ON SE	181,317	9.541	1,729,945.490	
VOEST-ALPINE AG	9,875	25.430	251,121.250	
HENKEL AG & CO KGAA	9,300	80.850	751,905.000	
SIEMENS AG-REG	62,647	100.780	6,313,564.660	
UPM-KYMMENE OYJ	44,548	22.400	997,875.200	
ING GROEP NV-CVA	318,806	10.276	3,276,050.450	
PUMA AG	7,351	59.500	437,384.500	
BAYER AG	77,331	59.510	4,601,967.810	
STORA ENSO OYJ-R SHS	54,186	9.952	539,259.070	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	13,759	88.040	1,211,342.360	
DAIMLER AG	75,036	47.020	3,528,192.720	
BASF SE	75,940	60.120	4,565,512.800	
BEIERSDORF AG	8,371	106.550	891,930.050	
HOCHTIEF AG	1,707	109.300	186,575.100	
HEIDELBERGCEMENT AG	12,031	66.680	802,227.080	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	18,494	67.740	1,252,783.560	
ORANGE	162,849	13.730	2,235,916.770	
SAMPO OYJ-A SHS	36,141	41.810	1,511,055.210	
RANDSTAD NV	9,074	45.430	412,231.820	
ALLIANZ SE	34,967	216.500	7,570,355.500	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	201,606	3.350	675,380.100	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	96,798	20.055	1,941,283.890	
HERMES INTL	2,703	641.000	1,732,623.000	
ENDESA S.A.	29,314	22.920	671,876.880	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	16,096	14.970	240,957.120	
ERSTE GROUP BANK AG	25,117	33.600	843,931.200	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	12,266	224.600	2,754,943.600	
ARCELOR MITTAL (NL)	58,189	14.650	852,468.850	
SOCIETE BIC SA	2,478	70.000	173,460.000	
DASSAULT SYSTEMES SA	10,913	139.700	1,524,546.100	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	23,521	37.010	870,512.210	
HEINEKEN NV	21,624	99.000	2,140,776.000	
AKZO NOBEL	19,142	82.460	1,578,449.320	
ASML HOLDING NV	34,481	184.480	6,361,054.880	
AEGON NV	150,349	4.539	682,434.110	
BANKINTER S.A.	57,960	6.320	366,307.200	
VOLKSWAGEN AG	3,545	154.400	547,348.000	
VOLKSWAGEN AG PFD	14,401	152.400	2,194,712.400	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	561,745	4.944	2,777,267.280	
KERING	6,216	516.800	3,212,428.800	
CNP ASSURANCES	13,987	20.540	287,292.980	

FORTUM OYJ	37,452	19.730	738,927.960	
AGEAS	14,365	48.030	689,950.950	
UCB SA	11,267	73.780	831,279.260	
THYSSENKRUPP AG	37,894	11.585	439,001.990	
CARREFOUR SA	51,094	17.805	909,728.670	
NATURGY ENERGY GROUP SA	23,612	22.660	535,047.920	
ATOS SE	8,816	77.600	684,121.600	
NOKIA OYJ	460,748	4.450	2,050,328.600	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	75,143	39.455	2,964,767.060	
WOLTERS KLUWER-CVA	22,865	64.280	1,469,762.200	
SANOFI	93,361	76.550	7,146,784.550	
STMICROELECTRONICS NV	55,611	15.710	873,648.810	
ELISA OYJ	10,787	42.820	461,899.340	
BANCO SANTANDER SA	1,337,561	4.170	5,577,629.370	
METSO OYJ	8,585	34.650	297,470.250	
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	34,596	17.540	606,813.840	
QIAGEN N.V.	17,974	35.620	640,233.880	
1&1 DRILLISCH AG	3,149	32.040	100,893.960	
DEUTSCHE BANK AG-REG	149,384	6.530	975,477.520	
BMW VORZUG	4,116	56.150	231,113.400	
ENEL SPA	652,089	6.426	4,190,323.910	
COLRUYT NV	4,673	50.720	237,014.560	
VOPAK (KON.)	5,364	42.740	229,257.360	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	273,413	15.410	4,213,294.330	
SARTORIUS AG	2,712	180.100	488,431.200	
LEONARDO SPA	28,316	11.495	325,492.420	
UBISOFT ENTERTAINMENT	7,786	73.660	573,516.760	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	99,068	15.910	1,576,171.880	
CARL ZEISS MEDITEC AG	3,771	85.750	323,363.250	
KONINKLIJKE KPN NV	291,029	2.673	777,920.510	
EUROFINS SCIENTIFIC	794	392.000	311,248.000	
TELEPERFORMANCE	4,425	174.200	770,835.000	
DEUTSCHE BOERSE AG	15,665	128.000	2,005,120.000	
EURAZEO	2,748	61.550	169,139.400	
BANCO SABADELL	407,477	0.940	383,028.380	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	6,689	86.020	575,387.780	
FRAPORT AG	3,149	74.100	233,340.900	
HEINEKEN HOLDING NV-A	9,791	94.300	923,291.300	
INDITEX	89,759	26.820	2,407,336.380	
JC DECAUX SA	6,058	25.840	156,538.720	
ANDRITZ AG	6,265	30.860	193,337.900	
MAPFRE SA	84,474	2.670	225,545.580	
ESSILORLUXOTTICA	22,811	116.000	2,646,076.000	
SNAM SPA	169,163	4.600	778,149.800	
CREDIT AGRICOLE SA	99,973	10.970	1,096,703.810	
ENAGAS	18,095	19.285	348,962.070	
WENDEL	2,220	120.600	267,732.000	

WIRECARD AG	9,891	149.500	1,478,704.500	
TENARIS SA	36,959	11.990	443,138.410	
TELECOM ITALIA SPA	762,675	0.494	376,761.450	
TELECOM ITALIA-RNC	497,596	0.468	232,874.920	
ATLANTIA SPA	43,688	23.720	1,036,279.360	
ILIAD SA	2,102	98.000	205,996.000	
PROXIMUS	14,283	25.190	359,788.770	
SES FDR	34,268	13.640	467,415.520	
TERNA SPA	113,654	5.792	658,283.960	
BIOMERIEUX	3,248	72.750	236,292.000	
GRIFOLS SA	23,518	27.760	652,859.680	
FERROVIAL SA	38,062	22.750	865,910.500	
LANXESS AG	6,856	52.980	363,230.880	
NESTE OYJ	32,931	29.880	983,978.280	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	9,641	21.320	205,546.120	
RECORDATI SPA	6,859	38.000	260,642.000	
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	55,725	8.760	488,151.000	
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	4,168	214.000	891,952.000	
KONE OYJ	29,124	51.100	1,488,236.400	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,884	136.300	256,789.200	
ENGIE	148,970	13.830	2,060,255.100	
ALSTOM	12,046	41.350	498,102.100	
TELENET GROUP HOLDING NV	3,634	44.680	162,367.120	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	12,542	17.065	214,029.230	
ELECTRICITE DE FRANCE	53,800	11.120	598,256.000	
IPSEN SA	3,646	117.500	428,405.000	
DEUTSCHE WOHNEN	30,689	33.730	1,035,139.970	
ARKEMA SA	5,033	79.900	402,136.700	
LEGRAND SA	23,308	62.580	1,458,614.640	
UNILEVER NV	119,119	54.010	6,433,617.190	
ADP	2,313	159.000	367,767.000	
ORION OYJ	8,051	33.930	273,170.430	
RTL GROUP SA	3,446	45.720	157,551.120	
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	40,088	13.500	541,188.000	
SYMRISE AG	9,988	82.120	820,214.560	
SCOR SE	13,875	39.150	543,206.250	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	17,397	28.100	488,855.700	
PRYSMIAN SPA	21,452	18.355	393,751.460	
CAIXABANK	297,224	2.561	761,190.660	
BUREAU VERITAS SA	23,179	21.600	500,666.400	
GETLINK	37,646	13.810	519,891.260	
SUEZ SA	26,620	12.970	345,261.400	
AMADEUS IT GROUP SA	35,976	70.860	2,549,259.360	
BRENNTAG AG	12,353	42.630	526,608.390	
EVONIK INDUSTRIES AG	17,116	25.230	431,836.680	

	EDENRED	19,188	44.640	856,552.320	
	BANKIA SA	100,675	2.089	210,310.070	
	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	61,541	2.385	146,775.280	
	HUGO BOSS AG -ORD	5,218	56.760	296,173.680	
	KION GROUP AG	4,567	50.520	230,724.840	
	VONOVIA SE	41,371	44.550	1,843,078.050	
	BANK OF IRELAND GROUP PLC	82,256	4.654	382,819.420	
	KNORR-BREMSE AG	4,492	93.930	421,933.560	
	SIEMENS HEALTHINEERS AG	11,468	38.200	438,077.600	
	FERRARI NV	9,887	148.400	1,467,230.800	
	METRO AG	10,774	15.900	171,306.600	
	CNH INDUSTRIAL NV	77,951	9.202	717,305.100	
	AROUNDTOWN SA	71,783	7.720	554,164.760	
	AIB GROUP PLC	86,464	3.720	321,646.080	
	INNOGY SE-TEMPORARY	9,769	37.800	369,268.200	
	MONCLER SPA	14,353	38.330	550,150.490	
	ACS ACTIVIDADES DE CONSTRUCCION Y SERV-RTS	23,521	1.590	37,398.390	
	REPSOL SA-RTS	116,928	0.490	57,294.720	
	IBERDROLA SA-RTS	498,442	0.201	100,186.840	
	WORLDLINE SA	7,758	63.000	488,754.000	
	NN GROUP NV	27,458	35.480	974,209.840	
	FINECOBANK SPA	45,048	10.315	464,670.120	
	ZALANDO SE	9,414	41.130	387,197.820	
	FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	89,977	12.430	1,118,414.110	
	AENA SME SA	5,338	173.100	924,007.800	
	CELLNEX TELECOM SAU	14,116	33.560	473,732.960	
	ABN AMRO BANK NV	34,251	19.105	654,365.350	
	EXOR NV	7,971	63.840	508,868.640	
	COVESTRO AG	15,802	41.090	649,304.180	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	62,980	80.770	5,086,894.600	
	POSTE ITALIANE SPA	40,015	9.748	390,066.220	
	AMUNDI SA	4,119	60.450	248,993.550	
	ADYEN NV	929	652.600	606,265.400	
	PIRELLI & C SPA	34,086	5.394	183,859.880	
	UNIPER SE	14,252	27.510	392,072.520	
	DELIVERY HERO SE	11,128	39.520	439,778.560	
ユーロ　小計		16,535,933		318,815,747.360 (38,841,322,501)	
香港・ドル	ASM PACIFIC TECH	32,700	78.350	2,562,045.000	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	164,000	18.840	3,089,760.000	
	BANK OF EAST ASIA	103,860	22.200	2,305,692.000	
	CLP HOLDINGS LTD	136,000	87.300	11,872,800.000	
	PCCW LTD	331,000	4.520	1,496,120.000	

	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	49,500	63.250	3,130,875.000	
	HONG KONG EXCHANGES &CLEAR	94,840	270.800	25,682,672.000	
	MTR CORP	126,000	53.850	6,785,100.000	
	HANG SENG BANK LTD	65,400	194.300	12,707,220.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	115,450	42.500	4,906,625.000	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	123,000	57.500	7,072,500.000	
	(THE) WHARF HOLDINGS LTD	95,750	20.400	1,953,300.000	
	HONG KONG & CHINA GAS	850,755	17.600	14,973,288.000	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	50,000	40.650	2,032,500.000	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	178,000	55.850	9,941,300.000	
	KERRY PROPERTIES LTD	73,500	33.050	2,429,175.000	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	324,000	30.700	9,946,800.000	
	NWS HOLDINGS LTD	135,000	15.780	2,130,300.000	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HOLDINGS	50,500	22.450	1,133,725.000	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	484,266	12.200	5,908,045.200	
	SHANGRI-LA ASIA LTD	104,000	9.840	1,023,360.000	
	SINO LAND CO	255,400	13.140	3,355,956.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	135,000	131.700	17,779,500.000	
	SWIRE PACIFIC LTD A	47,500	94.850	4,505,375.000	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	113,500	58.600	6,651,100.000	
	VITASOY INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	70,000	37.150	2,600,500.000	
	WHEELOCK & CO LTD	64,000	55.100	3,526,400.000	
	SJM HOLDINGS LTD	156,000	9.240	1,441,440.000	
	WYNN MACAU LTD	124,400	18.780	2,336,232.000	
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	64,800	13.880	899,424.000	
	AIA GROUP LTD	985,627	83.300	82,102,729.100	
	HKT TRUST / HKT LTD	289,000	12.660	3,658,740.000	
	SANDS CHINA LTD	199,200	39.550	7,878,360.000	
	SWIRE PROPERTIES LTD	104,200	31.250	3,256,250.000	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT CO LTD	95,750	52.400	5,017,300.000	
	HK ELECTRIC INVESTMENTS & HK ELECTRIC INVESTMENTS LTD	230,000	8.030	1,846,900.000	
	WH GROUP LTD	872,000	7.650	6,670,800.000	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	225,332	75.800	17,080,165.600	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	222,832	59.700	13,303,070.400	
香港・ドル　小計		7,942,062		316,993,444.300 (4,387,189,269)	
合計		92,498,008		332,267,325,819	

				(332,267,325,819)	

（２）株式以外の有価証券

令和1年7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	84,575.000	1,134,996.500	
		GOODMAN GROUP	132,051.000	2,042,828.970	
		GPT GROUP	179,806.000	1,123,787.500	
		LENDLEASE GROUP	42,974.000	605,503.660	
		MIRVAC GROUP	367,123.000	1,196,820.980	
		SCENTRE GROUP	420,268.000	1,693,680.040	
		STOCKLAND	194,018.000	888,602.440	
		VICINITY CENTRES	270,443.000	713,969.520	
	オーストラリア・ドル　小計		1,691,258.000	9,400,189.610 (708,210,286)	
	シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	200,806.000	620,490.540	
		CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	206,300.000	451,797.000	
		CAPITALAND MALL TRUST	199,000.000	527,350.000	
		SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	192,100.000	376,516.000	
	シンガポール・ドル　小計		798,206.000	1,976,153.540 (157,538,960)	
投資信託受益証券　合計			2,489,464	865,749,246 (865,749,246)	
投資証券	アメリカ・ドル	AGNC INVESTMENT CORP	44,741.000	766,413.330	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	9,644.000	1,436,184.480	
		AMERICAN TOWER CORP	36,033.000	7,622,060.490	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	108,247.000	1,002,367.220	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	11,347.000	2,425,648.190	
		BOSTON PROPERTIES INC	12,027.000	1,610,054.490	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	8,062.000	887,868.060	
		CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	33,772.000	4,595,693.760	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	16,931.000	2,067,613.720	
		DUKE REALTY TRUST	27,278.000	905,356.820	
		EQUINIX INC	6,636.000	3,498,233.760	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	6,813.000	872,404.650	
		EQUITY RESIDENTIAL	31,567.000	2,511,786.190	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	5,653.000	1,742,141.540	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	10,754.000	1,198,425.760	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	6,000.000	800,220.000	
		HCP INC	41,301.000	1,374,084.270	

	HOST HOTELS & RESORTS INC	64,001.000	1,173,778.340	
	INVITATION HOMES INC	36,281.000	1,016,593.620	
	IRON MOUNTAIN INC	23,977.000	768,942.390	
	KIMCO REALTY	32,980.000	616,396.200	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	11,649.000	602,486.280	
	MID AMERICA	8,834.000	1,091,529.040	
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	13,649.000	747,965.200	
	PROLOGIS INC	51,811.000	4,301,349.220	
	PUBLIC STORAGE	12,786.000	3,191,002.020	
	REALTY INCOME CORP	24,034.000	1,712,182.160	
	REGENCY CENTERS CORP	14,358.000	996,732.360	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	9,447.000	2,229,208.590	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	24,926.000	4,084,872.880	
	SL GREEN	7,097.000	579,115.200	
	SUN COMMUNITIES INC	6,979.000	950,260.640	
	THE MACERICH COMPANY	9,014.000	306,385.860	
	UDR INC	22,345.000	1,048,427.400	
	VENTAS INC	30,244.000	2,143,089.840	
	VEREIT INC	69,822.000	652,137.480	
	VORNADO REALTY TRUST	15,346.000	1,017,439.800	
	WELLTOWER INC	31,455.000	2,727,777.600	
	WEYERHAEUSER CO	63,699.000	1,675,920.690	
	WP CAREY INC	12,956.000	1,095,688.920	
アメリカ・ドル　小計		1,014,496.000	70,045,838.460 (7,578,959,722)	
イギリス・ポンド	BRITISH LAND CO PLC	69,819.000	377,022.600	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	55,843.000	467,852.650	
	SEGRO PLC	87,247.000	654,701.480	
イギリス・ポンド　小計		212,909.000	1,499,576.730 (203,012,698)	
カナダ・ドル	H & R REAL ESTATE INVESTMENT	10,748.000	253,760.280	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	13,467.000	358,491.540	
	SMARTCENTRES REIT	9,288.000	314,863.200	
カナダ・ドル　小計		33,503.000	927,115.020 (76,737,311)	
ユーロ	COVIVIO	4,675.000	437,813.750	
	GECINA SA	3,670.000	482,972.000	
	ICADE	2,234.000	178,608.300	
	KLEPIERRE	17,042.000	502,739.000	
	UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	10,898.000	1,411,835.900	
ユーロ　小計		38,519.000	3,013,968.950 (367,191,837)	
香港・ドル	LINK REIT	173,000.000	16,832,900.000	

	香港・ドル　小計	173,000.000	16,832,900.000 (232,967,336)	
投資証券　合計		1,472,427	8,458,868,904 (8,458,868,904)	
合計			9,324,618,150 (9,324,618,150)	

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

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入 投資信託受益 証券 時価比率	組入 投資証券 時価比率	有価証券の 合計金額 に対する比 率
アメリカ・ドル	株式　614銘柄 投資証券　40銘柄	65.26% -%	-% -%	-% 2.17%	68.86%
イギリス・ポンド	株式　94銘柄 投資証券　3銘柄	5.89% -%	-% -%	-% 0.06%	6.08%
イスラエル・シュケル	株式　8銘柄	0.12%	-%	-%	0.12%
オーストラリア・ドル	株式　60銘柄 投資信託 受益証券　8銘柄	2.33% -%	-% 0.20%	-% -%	2.59%
カナダ・ドル	株式　86銘柄 投資証券　3銘柄	3.66% -%	-% -%	-% 0.02%	3.76%
シンガポール・ドル	株式　21銘柄 投資信託 受益証券　4銘柄	0.43% -%	-% 0.05%	-% -%	0.49%
スイス・フラン	株式　39銘柄	3.28%	-%	-%	3.35%
スウェーデン・クローナ	株式　32銘柄	0.93%	-%	-%	0.95%
デンマーク・クローネ	株式　17銘柄	0.61%	-%	-%	0.62%
ニュージーランド・ドル	株式　7銘柄	0.09%	-%	-%	0.09%
ノルウェー・クローネ	株式　10銘柄	0.24%	-%	-%	0.25%
ユーロ	株式　242銘柄 投資証券　5銘柄	11.14% -%	-% -%	-% 0.11%	11.48%
香港・ドル	株式　39銘柄 投資証券　1銘柄	1.26% -%	-% -%	-% 0.07%	1.35%

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

「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		1,908,913,542	2,041,572,574
コール・ローン		1,135,808,636	706,278,770
国債証券		183,826,971,003	175,262,230,905
派生商品評価勘定		204,390	2,010,406
未収入金		－	671,356,241
未収利息		1,557,116,947	1,299,885,970
前払費用		22,390,099	19,341,617
流動資産合計		188,451,404,617	180,002,676,483
資産合計		188,451,404,617	180,002,676,483
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		1	－
未払金		3,034,790,332	2,063,180,504
未払解約金		61,066,000	802,366,000
流動負債合計		3,095,856,333	2,865,546,504
負債合計		3,095,856,333	2,865,546,504
純資産の部			
元本等			
元本	※1	104,514,418,065	95,726,952,071
剰余金			
剰余金又は欠損金（△）		80,841,130,219	81,410,177,908
元本等合計		185,355,548,284	177,137,129,979
純資産合計		185,355,548,284	177,137,129,979
負債純資産合計		188,451,404,617	180,002,676,483

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 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。
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。
３．　その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	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。

（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		117,601,828,446円	104,514,418,065円
同期中追加設定元本額		8,979,631,591円	9,460,902,434円
同期中一部解約元本額		22,067,041,972円	18,248,368,428円
元本の内訳			
ファンド名			
	ＤＩＡＭ外国債券パッシブ・ファンド	6,786,662,853円	8,333,243,800円
	ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	9,822,148円	7,817,708円
	ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	25,893,084円	26,354,122円
	ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	31,409,274円	32,191,957円
	グローバル８資産ラップファンド（安定型）	73,651,471円	74,979,498円
	グローバル８資産ラップファンド（中立型）	71,228,791円	71,610,659円
	グローバル８資産ラップファンド（積極型）	38,058,966円	39,415,440円
	たわらノーロード　先進国債券	3,265,662,747円	4,563,463,463円
	たわらノーロード　先進国債券＜ラップ向け＞	606,412円	77,647,010円
	たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	130,006,533円	247,108,202円
	たわらノーロード　バランス（堅実型）	2,710,128円	4,970,034円

たわらノーロード　バランス（標準型）	14,081,954円	26,476,779円
たわらノーロード　バランス（積極型）	3,828,901円	6,096,925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）	292,673円	752,046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）	21,405,923円	43,706,093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）	35,016,416円	75,510,489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）	10,049,800円	22,389,394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）	5,196,463円	24,965,376円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	335,681円	786,689円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	1,556,752円	1,574,356円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	544,028円	621,788円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	1,027,964円	835,964円
ＤＩＡＭ外国債券インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	5,233,603,399円	5,585,455,628円
Ｏｎｅ　ＤＣ　先進国債券インデックスファンド	－円	536,470円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型	517,237,588円	549,583,102円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型	1,668,750,000円	1,722,345,333円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型	1,750,349,034円	1,770,605,506円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド	373,232,148円	370,418,880円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド	812,192,171円	800,053,150円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０インデックスファンド	628,183,246円	612,075,187円
マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	22,571,041円	22,781,286円
マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	598,545,875円	610,421,668円
マネックス資産設計ファンド　エボリューション	11,297,386円	10,065,174円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	116,671,618円	123,561,385円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	67,978,539円	76,408,183円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	113,004,112円	125,523,306円
クルーズコントロール	423,294,781円	564,358,224円

ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	85,525,941円	98,934,802円
４資産分散投資・ハイクラス＜ＤＣ年金＞	146,786,408円	159,371,691円
クルーズコントロール＜ＤＣ年金＞	271,437円	835,455円
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（堅実型）	1,371,699円	2,344,328円
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（積極型）	2,586,260円	3,439,266円
ダイナミック・ナビゲーション	1,510,449円	363,905円
４資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	15,625,341円	21,823,796円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	11,075円	18,664,645円
４資産分散投資・ミドルクラス＜ＤＣ年金＞	－円	82,111円
ＤＩＡＭパッシブ資産分散ファンド	1,226,746,285円	1,282,866,932円
ＤＩＡＭ為替フルヘッジ型外国債券パッシブ私募ファンド（適格機関投資家向け）	7,190,891,462円	6,936,305,981円
ＤＩＡＭ外国債券パッシブファンド（適格機関投資家向け）	3,749,208,940円	3,762,404,174円
外国債券パッシブファンド（適格機関投資家限定）	3,093,632,320円	2,487,091,451円
先進国債券パッシブファンド（適格機関投資家限定）	6,084,705,149円	6,079,877,835円
ＤＩＡＭワールドバランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	92,602,048円	91,951,478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）	747,492,851円	690,755,836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）	590,066,412円	573,907,866円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	46,785,848円	47,535,463円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	85,033,887円	76,743,215円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	22,271,660円	21,778,447円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	5,980,093円	6,139,730円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	60,706,694円	63,713,945円

ＤＩＡＭ世界バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	73,426,704円	81,939,965円	
ＤＩＡＭバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	3,249,458,679円	3,022,595,229円	
ＤＩＡＭバランスファンド３７．５ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,109,670,928円	2,036,673,156円	
ＤＩＡＭバランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	3,576,104,598円	3,512,903,051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）	637,545,838円	632,182,408円	
ＤＩＡＭグローバル・アセット・バランスＶＡ２（適格機関投資家限定）	245,210,091円	242,136,103円	
ＤＩＡＭ　アクサ　グローバル　バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	3,035,022,980円	2,791,295,663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）	1,860,903,792円	1,341,986,211円	
ＤＩＡＭグローバルβ私募ファンド（適格機関投資家向け）	13,975,529円	14,665,687円	
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	15,293,391円	6,685,226円	
ＤＩＡＭ世界バランスファンド３５ＶＡ（適格機関投資家限定）	123,782,019円	102,964,909円	
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド２ＶＡ（適格機関投資家限定）	8,469,323,911円	4,148,752,530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）	18,386,940,356円	12,062,752,072円	
ＤＩＡＭバランス３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	20,008,473円	20,045,603円	
ＤＩＡＭバランス５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	380,438円	1,007,500円	
ＤＩＡＭバランス７０ＶＡ（適格機関投資家限定）	5,128,930円	386,742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）	16,380,805,594円	16,462,391,215円	
ＤＩＡＭ世界バランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	88,756,482円	84,809,374円	
ＤＩＡＭバランス２０ＶＡ（適格機関投資家限定）	106,400,750円	106,606,660円	
ＤＩＡＭバランス４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	351,229円	365,579円	
ＤＩＡＭバランス６０ＶＡ（適格機関投資家限定）	155,194円	164,562円	

計	104,514,418,065円	95,726,952,071円
2．　受益権の総数	104,514,418,065口	95,726,952,071口

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

項目	自　平成30年7月12日 至　平成31年1月11日	自　平成31年1月12日 至　令和1年7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 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成31年1月11日現在	令和1年7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	575,322,133	6,625,351,955
合計	575,322,133	6,625,351,955

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成30年2月22日から平成31年1月11日まで及び平成31年2月22日から令和1年7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	－	－	－	－	285,280,000	－	283,363,627	1,916,373
アメリカ・ドル	－	－	－	－	247,670,000	－	245,843,049	1,826,951
イギリス・ポンド	－	－	－	－	18,830,000	－	18,778,396	51,604
オーストラリア・ドル	－	－	－	－	18,780,000	－	18,742,182	37,818
買　建	2,991,320,000	－	2,991,524,389	204,389	2,913,790,000	－	2,913,884,033	94,033
アメリカ・ドル	1,399,920,000	－	1,399,919,999	△1	1,485,580,000	－	1,485,580,000	－
イギリス・ポンド	204,700,000	－	204,707,406	7,406	186,210,000	－	186,211,376	1,376
オーストラリア・ドル	54,840,000	－	54,844,923	4,923	－	－	－	－
スウェーデン・クローナ	－	－	－	－	68,800,000	－	68,805,983	5,983
ユーロ	1,331,860,000	－	1,332,052,061	192,061	1,173,200,000	－	1,173,286,674	86,674
合計	2,991,320,000	－	2,991,524,389	204,389	3,199,070,000	－	3,197,247,660	2,010,406

（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。

①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。

②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	1.7735円	1.8504円
（1万口当たり純資産額）	(17,735円)	(18,504円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

（１）株式

該当事項はありません。

（２）株式以外の有価証券

令和1年7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 02/28/21	3,680,000.000	3,635,140.800	
		US T N/B 1.375 01/31/21	2,750,000.000	2,727,862.500	
		US T N/B 1.375 04/30/21	11,210,000.000	11,114,490.800	
		US T N/B 1.375 06/30/23	7,000,000.000	6,883,450.000	
		US T N/B 1.375 09/30/23	5,900,000.000	5,795,334.000	
		US T N/B 1.5 08/15/26	6,260,000.000	6,077,521.000	
		US T N/B 1.625 02/15/26	5,500,000.000	5,398,580.000	
		US T N/B 1.625 05/15/26	6,130,000.000	6,009,790.700	
		US T N/B 1.625 05/31/23	5,300,000.000	5,262,688.000	
		US T N/B 1.625 08/15/22	6,190,000.000	6,156,140.700	
		US T N/B 1.625 11/15/22	8,580,000.000	8,529,378.000	
		US T N/B 1.625 11/30/20	8,510,000.000	8,477,406.700	
		US T N/B 1.75 01/31/23	7,130,000.000	7,116,025.200	
		US T N/B 1.75 03/31/22	8,850,000.000	8,836,105.500	
		US T N/B 1.75 05/15/22	8,110,000.000	8,097,267.300	
		US T N/B 1.75 05/15/23	7,000,000.000	6,984,110.000	
		US T N/B 1.75 06/15/22	830,000.000	829,120.200	
		US T N/B 1.75 09/30/22	7,860,000.000	7,845,223.200	
		US T N/B 1.75 10/31/20	6,000,000.000	5,985,000.000	
		US T N/B 1.75 12/31/20	9,000,000.000	8,978,850.000	
		US T N/B 1.875 02/28/22	1,680,000.000	1,682,620.800	
		US T N/B 1.875 06/30/20	6,630,000.000	6,622,176.600	
		US T N/B 1.875 08/31/22	7,650,000.000	7,666,065.000	
		US T N/B 1.875 08/31/24	5,760,000.000	5,769,849.600	
		US T N/B 2.0 02/15/22	11,050,000.000	11,105,250.000	
		US T N/B 2.0 02/15/23	9,500,000.000	9,563,745.000	
		US T N/B 2.0 02/15/25	8,390,000.000	8,444,367.200	
		US T N/B 2.0 05/31/21	12,000,000.000	12,033,240.000	
		US T N/B 2.0 05/31/24	4,770,000.000	4,809,495.600	
		US T N/B 2.0 08/15/25	6,920,000.000	6,957,783.200	
		US T N/B 2.0 09/30/20	6,000,000.000	5,998,560.000	
		US T N/B 2.0 11/15/21	10,400,000.000	10,449,088.000	
		US T N/B 2.0 11/15/26	6,300,000.000	6,322,617.000	
		US T N/B 2.0 11/30/20	7,920,000.000	7,927,999.200	
		US T N/B 2.0 11/30/22	6,590,000.000	6,630,660.300	
		US T N/B 2.125 01/31/21	5,000,000.000	5,014,450.000	
		US T N/B 2.125 02/29/24	1,300,000.000	1,316,952.000	
		US T N/B 2.125 03/31/24	4,080,000.000	4,134,182.400	
		US T N/B 2.125 05/15/25	6,250,000.000	6,332,500.000	
		US T N/B 2.125 05/31/26	2,050,000.000	2,075,297.000	

		US T N/B 2.125 06/30/22	7,410,000.000	7,477,727.400	
		US T N/B 2.125 08/15/21	11,000,000.000	11,065,670.000	
		US T N/B 2.125 08/31/20	3,000,000.000	3,005,610.000	
		US T N/B 2.125 09/30/21	10,000,000.000	10,065,600.000	
		US T N/B 2.125 09/30/24	5,710,000.000	5,787,598.900	
		US T N/B 2.125 12/31/21	10,330,000.000	10,409,024.500	
		US T N/B 2.125 12/31/22	8,000,000.000	8,083,680.000	
		US T N/B 2.25 01/31/24	350,000.000	356,450.500	
		US T N/B 2.25 02/15/27	5,710,000.000	5,825,970.100	
		US T N/B 2.25 03/31/21	9,760,000.000	9,822,073.600	
		US T N/B 2.25 03/31/26	3,090,000.000	3,153,468.600	
		US T N/B 2.25 04/30/24	3,300,000.000	3,363,657.000	
		US T N/B 2.25 08/15/27	5,920,000.000	6,035,144.000	
		US T N/B 2.25 08/15/46	3,470,000.000	3,249,863.200	
		US T N/B 2.25 11/15/24	8,590,000.000	8,759,738.400	
		US T N/B 2.25 11/15/25	7,000,000.000	7,140,000.000	
		US T N/B 2.25 11/15/27	6,620,000.000	6,745,118.000	
		US T N/B 2.25 12/31/23	5,860,000.000	5,966,652.000	
		US T N/B 2.375 04/30/26	1,760,000.000	1,810,036.800	
		US T N/B 2.375 05/15/27	6,330,000.000	6,515,912.100	
		US T N/B 2.375 05/15/29	3,780,000.000	3,884,819.400	
		US T N/B 2.375 08/15/24	8,900,000.000	9,129,442.000	
		US T N/B 2.375 12/31/20	8,300,000.000	8,354,116.000	
		US T N/B 2.5 01/15/22	3,850,000.000	3,914,179.500	
		US T N/B 2.5 01/31/21	9,810,000.000	9,899,271.000	
		US T N/B 2.5 01/31/24	3,890,000.000	4,003,354.600	
		US T N/B 2.5 02/15/22	1,070,000.000	1,088,511.000	
		US T N/B 2.5 02/15/45	3,890,000.000	3,844,992.700	
		US T N/B 2.5 02/15/46	2,970,000.000	2,930,766.300	
		US T N/B 2.5 02/28/26	2,550,000.000	2,641,239.000	
		US T N/B 2.5 03/31/23	1,020,000.000	1,045,092.000	
		US T N/B 2.5 05/15/24	9,000,000.000	9,278,370.000	
		US T N/B 2.5 05/15/46	3,940,000.000	3,885,825.000	
		US T N/B 2.5 08/15/23	8,000,000.000	8,215,600.000	
		US T N/B 2.625 01/31/26	2,180,000.000	2,274,176.000	
		US T N/B 2.625 02/15/29	5,580,000.000	5,853,754.800	
		US T N/B 2.625 03/31/25	4,080,000.000	4,244,464.800	
		US T N/B 2.625 06/30/23	1,820,000.000	1,876,438.200	
		US T N/B 2.625 08/15/20	6,350,000.000	6,395,339.000	
		US T N/B 2.625 08/31/20	9,250,000.000	9,317,525.000	
		US T N/B 2.625 11/15/20	6,000,000.000	6,053,640.000	
		US T N/B 2.625 12/15/21	3,770,000.000	3,844,646.000	
		US T N/B 2.625 12/31/23	3,060,000.000	3,164,223.600	
		US T N/B 2.625 12/31/25	2,290,000.000	2,388,218.100	
		US T N/B 2.75 02/15/24	8,040,000.000	8,367,871.200	
		US T N/B 2.75 02/15/28	5,950,000.000	6,296,290.000	
		US T N/B 2.75 02/28/25	3,510,000.000	3,674,513.700	
		US T N/B 2.75 04/30/23	2,490,000.000	2,574,809.400	
		US T N/B 2.75 05/31/23	3,270,000.000	3,383,665.200	

		US T N/B 2.75 06/30/25	790,000.000	828,141.200	
		US T N/B 2.75 07/31/23	6,500,000.000	6,734,585.000	
		US T N/B 2.75 08/15/42	1,800,000.000	1,875,366.000	
		US T N/B 2.75 08/15/47	3,930,000.000	4,061,379.900	
		US T N/B 2.75 08/31/23	2,170,000.000	2,249,834.300	
		US T N/B 2.75 08/31/25	1,640,000.000	1,720,196.000	
		US T N/B 2.75 11/15/23	9,370,000.000	9,732,337.900	
		US T N/B 2.75 11/15/42	2,780,000.000	2,894,007.800	
		US T N/B 2.75 11/15/47	3,360,000.000	3,477,600.000	
		US T N/B 2.75 11/30/20	7,840,000.000	7,928,435.200	
		US T N/B 2.875 05/15/28	7,120,000.000	7,608,930.400	
		US T N/B 2.875 05/15/43	3,880,000.000	4,121,568.800	
		US T N/B 2.875 05/15/49	3,000,000.000	3,188,670.000	
		US T N/B 2.875 05/31/25	2,530,000.000	2,669,150.000	
		US T N/B 2.875 07/31/25	3,390,000.000	3,578,551.800	
		US T N/B 2.875 08/15/28	5,730,000.000	6,126,573.300	
		US T N/B 2.875 08/15/45	4,100,000.000	4,348,542.000	
		US T N/B 2.875 09/30/23	840,000.000	875,632.800	
		US T N/B 2.875 10/31/23	6,010,000.000	6,269,632.000	
		US T N/B 2.875 11/15/21	4,880,000.000	4,997,608.000	
		US T N/B 2.875 11/15/46	3,420,000.000	3,628,654.200	
		US T N/B 2.875 11/30/23	5,640,000.000	5,889,344.400	
		US T N/B 2.875 11/30/25	3,480,000.000	3,680,900.400	
		US T N/B 3.0 02/15/47	3,480,000.000	3,786,379.200	
		US T N/B 3.0 02/15/48	4,020,000.000	4,366,403.400	
		US T N/B 3.0 02/15/49	4,660,000.000	5,072,829.400	
		US T N/B 3.0 05/15/42	980,000.000	1,066,200.800	
		US T N/B 3.0 05/15/45	3,800,000.000	4,123,000.000	
		US T N/B 3.0 05/15/47	3,380,000.000	3,666,759.200	
		US T N/B 3.0 08/15/48	4,230,000.000	4,599,448.200	
		US T N/B 3.0 09/30/25	1,410,000.000	1,500,211.800	
		US T N/B 3.0 10/31/25	1,920,000.000	2,043,590.400	
		US T N/B 3.0 11/15/44	3,760,000.000	4,076,629.600	
		US T N/B 3.0 11/15/45	3,900,000.000	4,238,169.000	
		US T N/B 3.125 02/15/42	1,800,000.000	1,999,116.000	
		US T N/B 3.125 02/15/43	2,600,000.000	2,879,890.000	
		US T N/B 3.125 05/15/21	8,000,000.000	8,182,800.000	
		US T N/B 3.125 05/15/48	4,350,000.000	4,840,375.500	
		US T N/B 3.125 08/15/44	3,470,000.000	3,843,267.900	
		US T N/B 3.125 11/15/28	5,830,000.000	6,363,794.800	
		US T N/B 3.125 11/15/41	760,000.000	844,603.200	
		US T N/B 3.375 05/15/44	3,910,000.000	4,511,749.000	
		US T N/B 3.375 11/15/48	4,420,000.000	5,158,582.000	
		US T N/B 3.5 02/15/39	1,300,000.000	1,534,000.000	
		US T N/B 3.625 02/15/21	5,500,000.000	5,648,885.000	
		US T N/B 3.625 02/15/44	3,550,000.000	4,259,716.000	
		US T N/B 3.625 08/15/43	2,720,000.000	3,262,068.800	
		US T N/B 3.75 08/15/41	1,500,000.000	1,829,295.000	
		US T N/B 3.75 11/15/43	3,710,000.000	4,536,921.900	

		US T N/B 3.875 08/15/40	1,430,000.000	1,774,644.300	
		US T N/B 4.25 05/15/39	810,000.000	1,052,238.600	
		US T N/B 4.25 11/15/40	1,470,000.000	1,915,586.400	
		US T N/B 4.375 02/15/38	750,000.000	985,485.000	
		US T N/B 4.375 05/15/40	1,640,000.000	2,168,900.000	
		US T N/B 4.375 05/15/41	1,040,000.000	1,379,300.000	
		US T N/B 4.375 11/15/39	1,470,000.000	1,942,002.300	
		US T N/B 4.5 02/15/36	1,230,000.000	1,612,923.600	
		US T N/B 4.5 05/15/38	800,000.000	1,068,120.000	
		US T N/B 4.5 08/15/39	1,400,000.000	1,878,842.000	
		US T N/B 4.625 02/15/40	1,820,000.000	2,482,298.000	
		US T N/B 4.75 02/15/41	1,800,000.000	2,501,712.000	
		US T N/B 5.0 05/15/37	800,000.000	1,120,808.000	
		US T N/B 5.25 02/15/29	1,000,000.000	1,278,980.000	
		US T N/B 5.25 11/15/28	850,000.000	1,081,956.500	
		US T N/B 5.375 02/15/31	1,500,000.000	2,002,845.000	
		US T N/B 5.5 08/15/28	1,100,000.000	1,416,327.000	
		US T N/B 6.0 02/15/26	840,000.000	1,052,032.800	
		US T N/B 6.125 11/15/27	1,400,000.000	1,842,526.000	
		US T N/B 6.25 05/15/30	710,000.000	996,328.800	
		US T N/B 6.25 08/15/23	1,000,000.000	1,174,330.000	
		US T N/B 8.0 11/15/21	6,000,000.000	6,841,620.000	
アメリカ・ドル　小計			737,870,000.000 (79,837,534,000)	764,350,665.900 (82,702,742,050)	
イギリス・ポンド		UK TREASURY 0.5 07/22/22	2,350,000.000	2,349,013.000	
		UK TREASURY 0.75 07/22/23	1,560,000.000	1,573,072.800	
		UK TREASURY 1.0 04/22/24	820,000.000	836,826.400	
		UK TREASURY 1.25 07/22/27	1,680,000.000	1,756,120.800	
		UK TREASURY 1.5 01/22/21	2,700,000.000	2,738,934.000	
		UK TREASURY 1.5 07/22/26	1,330,000.000	1,411,475.800	
		UK TREASURY 1.5 07/22/47	1,960,000.000	2,016,644.000	
		UK TREASURY 1.625 10/22/28	2,150,000.000	2,318,732.000	
		UK TREASURY 1.625 10/22/54	290,000.000	314,061.300	
		UK TREASURY 1.625 10/22/71	1,010,000.000	1,145,138.000	
		UK TREASURY 1.75 01/22/49	460,000.000	501,814.000	
		UK TREASURY 1.75 07/22/57	1,540,000.000	1,744,050.000	
		UK TREASURY 1.75 09/07/22	2,310,000.000	2,399,119.800	

		UK TREASURY 1.75 09/07/37	1,900,000.000	2,051,050.000	
		UK TREASURY 2.0 09/07/25	1,110,000.000	1,207,402.500	
		UK TREASURY 2.25 09/07/23	2,590,000.000	2,772,776.300	
		UK TREASURY 2.5 07/22/65	1,720,000.000	2,442,365.600	
		UK TREASURY 2.75 09/07/24	1,700,000.000	1,889,465.000	
		UK TREASURY 3.25 01/22/44	2,110,000.000	2,936,487.000	
		UK TREASURY 3.5 01/22/45	2,000,000.000	2,916,600.000	
		UK TREASURY 3.5 07/22/68	1,580,000.000	2,839,892.000	
		UK TREASURY 3.75 07/22/52	1,530,000.000	2,515,320.000	
		UK TREASURY 3.75 09/07/21	1,850,000.000	1,977,927.500	
		UK TREASURY 4.0 01/22/60	1,310,000.000	2,422,714.000	
		UK TREASURY 4.0 03/07/22	1,040,000.000	1,135,711.200	
		UK TREASURY 4.25 03/07/36	1,760,000.000	2,580,160.000	
		UK TREASURY 4.25 06/07/32	1,440,000.000	2,010,528.000	
		UK TREASURY 4.25 09/07/39	1,180,000.000	1,803,276.000	
		UK TREASURY 4.25 12/07/27	1,360,000.000	1,760,506.400	
		UK TREASURY 4.25 12/07/40	1,560,000.000	2,416,596.000	
		UK TREASURY 4.25 12/07/46	1,510,000.000	2,501,315.000	
		UK TREASURY 4.25 12/07/49	1,310,000.000	2,251,235.000	
		UK TREASURY 4.25 12/07/55	1,500,000.000	2,767,650.000	
		UK TREASURY 4.5 09/07/34	1,490,000.000	2,196,707.000	
		UK TREASURY 4.5 12/07/42	1,820,000.000	2,977,520.000	
		UK TREASURY 4.75 12/07/30	1,500,000.000	2,135,700.000	
		UK TREASURY 4.75 12/07/38	1,450,000.000	2,327,975.000	
		UK TREASURY 5.0 03/07/25	2,030,000.000	2,531,369.400	

	UK TREASURY 6.0 12/07/28	1,050,000.000	1,554,063.000	
	UK TREASURY 8.0 06/07/21	1,700,000.000	1,941,281.000	
イギリス・ポンド　小計		63,260,000.000 (8,564,138,800)	81,968,594.800 (11,096,908,364)	
オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN 5.75 05/15/21	2,760,000.000	2,999,540.400	
	AUSTRALIAN 2.0 12/21/21	1,770,000.000	1,813,524.300	
	AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	2,570,000.000	2,767,119.000	
	AUSTRALIAN 2.25 11/21/22	890,000.000	927,504.600	
	AUSTRALIAN 2.5 05/21/30	830,000.000	923,507.800	
	AUSTRALIAN 2.75 04/21/24	3,100,000.000	3,348,620.000	
	AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	900,000.000	1,044,648.000	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	2,900,000.000	3,229,092.000	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/28	2,700,000.000	3,032,073.000	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/29	1,560,000.000	1,767,136.800	
	AUSTRALIAN 3.0 03/21/47	1,250,000.000	1,523,162.500	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	1,920,000.000	2,150,284.800	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	3,100,000.000	3,637,106.000	
	AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	900,000.000	1,121,418.000	
	AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	1,200,000.000	1,579,152.000	
	AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	2,480,000.000	2,973,693.600	
	AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	1,500,000.000	2,062,410.000	
	AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	2,950,000.000	3,711,336.000	
	AUSTRALIAN 5.5 04/21/23	3,000,000.000	3,501,600.000	
	AUSTRALIAN 5.75 07/15/22	2,040,000.000	2,328,415.200	
オーストラリア・ドル　小計		40,320,000.000 (3,037,708,800)	46,441,344.000 (3,498,890,857)	
カナダ・ドル	CANADA 8.0 06/01/27	430,000.000	633,329.800	
	CANADA 0.75 03/01/21	2,300,000.000	2,268,283.000	
	CANADA 0.75 09/01/20	2,400,000.000	2,375,328.000	
	CANADA 0.75 09/01/21	600,000.000	589,830.000	
	CANADA 1.0 06/01/27	800,000.000	766,416.000	
	CANADA 1.0 09/01/22	800,000.000	786,832.000	
	CANADA 1.5 06/01/23	2,300,000.000	2,295,906.000	

	CANADA 1.5 06/01/26	1,700,000.000	1,694,067.000	
	CANADA 1.75 03/01/23	1,160,000.000	1,168,038.800	
	CANADA 2.0 06/01/28	1,020,000.000	1,055,302.200	
	CANADA 2.0 09/01/23	740,000.000	753,423.600	
	CANADA 2.0 12/01/51	250,000.000	265,575.000	
	CANADA 2.25 03/01/24	530,000.000	547,182.600	
	CANADA 2.25 06/01/25	1,500,000.000	1,559,715.000	
	CANADA 2.25 06/01/29	610,000.000	646,959.900	
	CANADA 2.5 06/01/24	1,600,000.000	1,672,480.000	
	CANADA 2.75 06/01/22	3,230,000.000	3,340,239.900	
	CANADA 2.75 12/01/48	1,450,000.000	1,780,020.000	
	CANADA 2.75 12/01/64	550,000.000	728,249.500	
	CANADA 3.25 06/01/21	4,700,000.000	4,845,841.000	
	CANADA 3.5 12/01/45	1,460,000.000	1,996,550.000	
	CANADA 4.0 06/01/41	1,400,000.000	1,966,048.000	
	CANADA 5.0 06/01/37	1,180,000.000	1,772,702.200	
	CANADA 5.75 06/01/29	1,450,000.000	1,996,186.000	
	CANADA 5.75 06/01/33	1,260,000.000	1,898,794.800	
カナダ・ドル　小計		35,420,000.000 (2,931,713,400)	39,403,300.300 (3,261,411,166)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE 1.25 10/01/21	1,000,000.000	990,910.000	
	SINGAPORE 2.125 06/01/26	210,000.000	213,675.000	
	SINGAPORE 2.25 08/01/36	200,000.000	200,414.000	
	SINGAPORE 2.375 06/01/25	500,000.000	515,750.000	
	SINGAPORE 2.75 03/01/46	660,000.000	699,567.000	
	SINGAPORE 2.75 04/01/42	550,000.000	587,840.000	
	SINGAPORE 2.875 07/01/29	400,000.000	431,920.000	
	SINGAPORE 2.875 09/01/30	460,000.000	496,478.000	
	SINGAPORE 3.0 09/01/24	810,000.000	857,790.000	
	SINGAPORE 3.125 09/01/22	1,600,000.000	1,670,240.000	
	SINGAPORE 3.375 09/01/33	480,000.000	549,787.200	
	SINGAPORE 3.5 03/01/27	900,000.000	1,002,870.000	
シンガポール・ドル　小計		7,770,000.000 (619,424,400)	8,217,241.200 (655,078,468)	
スウェーデン・クローナ	SWEDEN 0.75 05/12/28	4,970,000.000	5,325,355.000	
	SWEDEN 0.75 11/12/29	2,170,000.000	2,319,795.100	
	SWEDEN 1.0 11/12/26	7,000,000.000	7,602,420.000	
	SWEDEN 2.5 05/12/25	7,300,000.000	8,509,756.000	
	SWEDEN 3.5 03/30/39	4,600,000.000	7,080,504.000	
	SWEDEN 3.5 06/01/22	13,360,000.000	14,930,334.400	
スウェーデン・クローナ　小計		39,400,000.000 (453,100,000)	45,768,164.500 (526,333,892)	
デンマーク・クローネ	DENMARK 0.5 11/15/27	7,130,000.000	7,678,867.400	

	DENMARK 1.5 11/15/23	5,500,000.000	6,026,075.000	
	DENMARK 1.75 11/15/25	9,470,000.000	10,874,874.500	
	DENMARK 4.5 11/15/39	12,750,000.000	24,177,315.000	
デンマーク・クローネ　小計		34,850,000.000 (568,752,000)	48,757,131.900 (795,716,393)	
ノルウェー・クローネ	NORWAY 1.5 02/19/26	6,000,000.000	6,052,800.000	
	NORWAY 1.75 02/17/27	3,970,000.000	4,071,195.300	
	NORWAY 1.75 03/13/25	3,800,000.000	3,884,132.000	
	NORWAY 2.0 04/26/28	2,070,000.000	2,163,232.800	
	NORWAY 2.0 05/24/23	7,600,000.000	7,800,184.000	
	NORWAY 3.0 03/14/24	6,200,000.000	6,667,046.000	
ノルウェー・クローネ　小計		29,640,000.000 (374,056,800)	30,638,590.100 (386,659,007)	
ポーランド・ズロチ	POLAND 1.75 07/25/21	2,200,000.000	2,205,962.000	
	POLAND 2.0 04/25/21	1,130,000.000	1,140,170.000	
	POLAND 2.25 04/25/22	4,000,000.000	4,068,240.000	
	POLAND 2.5 01/25/23	1,350,000.000	1,386,585.000	
	POLAND 2.5 04/25/24	2,290,000.000	2,358,516.800	
	POLAND 2.5 07/25/26	4,200,000.000	4,310,166.000	
	POLAND 2.5 07/25/27	3,000,000.000	3,075,900.000	
	POLAND 2.75 04/25/28	1,900,000.000	1,984,949.000	
	POLAND 3.25 07/25/25	3,300,000.000	3,532,914.000	
	POLAND 4.0 10/25/23	3,100,000.000	3,380,085.000	
	POLAND 5.75 04/25/29	1,440,000.000	1,896,537.600	
	POLAND 5.75 09/23/22	3,200,000.000	3,599,840.000	
	POLAND 5.75 10/25/21	3,680,000.000	4,027,428.800	
ポーランド・ズロチ　小計		34,790,000.000 (993,950,300)	36,967,294.200 (1,056,155,595)	
マレーシア・リンギット	MALAYSIA 3.418 08/15/22	3,000,000.000	3,003,990.000	
	MALAYSIA 3.48 03/15/23	1,220,000.000	1,222,452.200	
	MALAYSIA 3.502 05/31/27	2,570,000.000	2,545,148.100	
	MALAYSIA 3.733 06/15/28	2,000,000.000	2,010,980.000	
	MALAYSIA 3.844 04/15/33	1,210,000.000	1,209,165.100	
	MALAYSIA 3.892 03/15/27	800,000.000	813,824.000	
	MALAYSIA 4.127 04/15/32	1,850,000.000	1,907,683.000	
	MALAYSIA 4.16 07/15/21	4,000,000.000	4,068,320.000	
	MALAYSIA 4.181 07/15/24	2,430,000.000	2,507,808.600	
	MALAYSIA 4.392 04/15/26	3,070,000.000	3,219,079.200	
	MALAYSIA 4.498 04/15/30	1,800,000.000	1,912,392.000	
	MALAYSIA 4.935 09/30/43	2,000,000.000	2,226,200.000	
	MALAYSIA 5.248 09/15/28	1,600,000.000	1,791,552.000	
マレーシア・リンギット　小計		27,550,000.000 (721,810,000)	28,438,594.200 (745,091,168)	
メキシコ・ペソ	MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	13,000,000.000	15,708,030.000	
	MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	35,000,000.000	38,992,450.000	
	MEXICAN BONDS 5.75 03/05/26	14,859,000.000	13,510,694.340	

		MEXICAN BONDS 6.5 06/09/22	26,000,000.000	25,339,860.000	
		MEXICAN BONDS 7.25 12/09/21	10,880,000.000	10,813,849.600	
		MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	18,071,000.000	18,022,389.010	
		MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	10,000,000.000	10,087,300.000	
		MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	22,000,000.000	21,638,320.000	
		MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	7,000,000.000	7,025,550.000	
		MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47	5,000,000.000	5,034,700.000	
		MEXICAN BONDS 8.0 12/07/23	14,000,000.000	14,286,580.000	
		MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	19,301,000.000	20,520,630.190	
		MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	15,000,000.000	15,940,050.000	
	メキシコ・ペソ　小計		210,111,000.000 (1,189,228,260)	216,920,403.140 (1,227,769,482)	
	ユーロ	AUSTRIA 0.5 02/20/29	340,000.000	358,230.800	
		AUSTRIA 0.5 04/20/27	520,000.000	550,310.800	
		AUSTRIA 0.75 02/20/28	820,000.000	885,149.000	
		AUSTRIA 0.75 10/20/26	1,090,000.000	1,173,134.300	
		AUSTRIA 07/15/23	350,000.000	357,892.500	
		AUSTRIA 09/20/22	470,000.000	479,461.100	
		AUSTRIA 1.2 10/20/25	1,000,000.000	1,101,970.000	
		AUSTRIA 1.5 02/20/47	300,000.000	363,285.000	
		AUSTRIA 1.5 11/02/86	290,000.000	356,337.500	
		AUSTRIA 1.65 10/21/24	950,000.000	1,058,252.500	
		AUSTRIA 1.75 10/20/23	1,400,000.000	1,540,700.000	
		AUSTRIA 2.1 09/20/17	220,000.000	339,924.200	
		AUSTRIA 2.4 05/23/34	670,000.000	876,936.200	
		AUSTRIA 3.15 06/20/44	660,000.000	1,056,765.600	
		AUSTRIA 3.4 11/22/22	740,000.000	841,113.600	
		AUSTRIA 3.5 09/15/21	1,900,000.000	2,073,470.000	
		AUSTRIA 3.65 04/20/22	1,200,000.000	1,344,180.000	
		AUSTRIA 3.8 01/26/62	680,000.000	1,411,591.600	
		AUSTRIA 4.15 03/15/37	1,310,000.000	2,149,972.000	
		AUSTRIA 4.85 03/15/26	790,000.000	1,069,746.900	
		AUSTRIA 6.25 07/15/27	1,010,000.000	1,542,118.500	
		BELGIUM 0.2 10/22/23	660,000.000	680,526.000	
		BELGIUM 0.5 10/22/24	1,070,000.000	1,121,681.000	
		BELGIUM 0.8 06/22/25	1,570,000.000	1,677,011.200	
		BELGIUM 0.8 06/22/27	1,100,000.000	1,182,555.000	
		BELGIUM 0.8 06/22/28	1,560,000.000	1,677,000.000	
		BELGIUM 0.9 06/22/29	500,000.000	542,025.000	

BELGIUM 1.0 06/22/26	1,220,000.000	1,326,676.800	
BELGIUM 1.0 06/22/31	1,140,000.000	1,245,997.200	
BELGIUM 1.25 04/22/33	510,000.000	572,985.000	
BELGIUM 1.45 06/22/37	440,000.000	502,598.800	
BELGIUM 1.6 06/22/47	1,000,000.000	1,163,430.000	
BELGIUM 1.7 06/22/50	390,000.000	459,677.400	
BELGIUM 1.9 06/22/38	590,000.000	722,744.100	
BELGIUM 2.15 06/22/66	610,000.000	810,507.000	
BELGIUM 2.25 06/22/23	1,230,000.000	1,368,854.700	
BELGIUM 2.25 06/22/57	380,000.000	502,622.200	
BELGIUM 2.6 06/22/24	1,510,000.000	1,741,045.100	
BELGIUM 3.0 06/22/34	720,000.000	992,340.000	
BELGIUM 3.75 06/22/45	890,000.000	1,492,565.600	
BELGIUM 3.75 09/28/20	2,200,000.000	2,316,886.000	
BELGIUM 4.0 03/28/22	1,500,000.000	1,691,175.000	
BELGIUM 4.0 03/28/32	790,000.000	1,164,159.800	
BELGIUM 4.25 03/28/41	1,560,000.000	2,661,219.600	
BELGIUM 4.25 09/28/21	1,870,000.000	2,075,120.300	
BELGIUM 4.25 09/28/22	1,190,000.000	1,378,757.800	
BELGIUM 4.5 03/28/26	790,000.000	1,045,975.800	
BELGIUM 5.0 03/28/35	1,730,000.000	2,925,516.500	
BELGIUM 5.5 03/28/28	1,820,000.000	2,710,234.800	
BUNDESOBL 0.25 10/16/20	1,500,000.000	1,518,300.000	
BUNDESOBL 04/05/24	630,000.000	649,668.600	
BUNDESOBL 04/08/22	2,010,000.000	2,051,566.800	
BUNDESOBL 04/09/21	2,200,000.000	2,228,358.000	
BUNDESOBL 04/14/23	1,130,000.000	1,160,939.400	
BUNDESOBL 10/07/22	2,090,000.000	2,140,598.900	
BUNDESOBL 10/13/23	1,280,000.000	1,318,016.000	
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27	2,420,000.000	2,556,342.800	
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/29	1,410,000.000	1,487,056.500	
DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28	1,780,000.000	1,879,074.800	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25	2,200,000.000	2,338,776.000	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26	2,480,000.000	2,654,666.400	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28	2,210,000.000	2,384,280.600	
DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27	2,060,000.000	2,220,824.200	
DEUTSCHLAND 08/15/26	1,960,000.000	2,033,264.800	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/24	1,340,000.000	1,453,913.400	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25	1,880,000.000	2,064,503.200	

		DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48	1,440,000.000	1,820,980.800	
		DEUTSCHLAND 1.5 02/15/23	2,100,000.000	2,270,877.000	
		DEUTSCHLAND 1.5 05/15/23	1,650,000.000	1,792,312.500	
		DEUTSCHLAND 1.5 05/15/24	2,000,000.000	2,212,680.000	
		DEUTSCHLAND 1.5 09/04/22	1,650,000.000	1,768,305.000	
		DEUTSCHLAND 1.75 02/15/24	1,500,000.000	1,669,815.000	
		DEUTSCHLAND 1.75 07/04/22	2,290,000.000	2,462,528.600	
		DEUTSCHLAND 2.0 01/04/22	2,220,000.000	2,373,624.000	
		DEUTSCHLAND 2.0 08/15/23	1,500,000.000	1,668,660.000	
		DEUTSCHLAND 2.25 09/04/21	1,070,000.000	1,139,539.300	
		DEUTSCHLAND 2.5 01/04/21	2,200,000.000	2,307,976.000	
		DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	2,450,000.000	3,794,805.000	
		DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	2,490,000.000	3,943,213.800	
		DEUTSCHLAND 3.25 07/04/21	3,150,000.000	3,401,023.500	
		DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	1,320,000.000	2,236,515.600	
		DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	2,100,000.000	3,567,165.000	
		DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	1,320,000.000	2,406,360.000	
		DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	1,120,000.000	1,648,214.400	
		DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	1,780,000.000	3,079,560.200	
		DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	1,430,000.000	2,808,677.300	
		DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	1,500,000.000	2,509,845.000	
		DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	1,600,000.000	2,439,072.000	
		DEUTSCHLAND 6.25 01/04/24	1,700,000.000	2,237,693.000	
		DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	1,100,000.000	1,872,068.000	
		DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	1,120,000.000	1,753,651.200	

FINLAND 0.375 09/15/20	500,000.000	506,100.000	
FINLAND 0.5 04/15/26	600,000.000	634,392.000	
FINLAND 0.5 09/15/27	300,000.000	317,565.000	
FINLAND 0.5 09/15/28	450,000.000	476,482.500	
FINLAND 0.5 09/15/29	270,000.000	284,790.600	
FINLAND 0.75 04/15/31	450,000.000	485,514.000	
FINLAND 0.875 09/15/25	300,000.000	323,721.000	
FINLAND 04/15/22	320,000.000	325,721.600	
FINLAND 09/15/23	230,000.000	235,513.100	
FINLAND 1.125 04/15/34	420,000.000	474,369.000	
FINLAND 1.375 04/15/47	80,000.000	97,436.000	
FINLAND 1.5 04/15/23	590,000.000	636,964.000	
FINLAND 1.625 09/15/22	400,000.000	428,972.000	
FINLAND 2.0 04/15/24	680,000.000	762,905.600	
FINLAND 2.625 07/04/42	430,000.000	637,969.500	
FINLAND 2.75 07/04/28	630,000.000	796,439.700	
FINLAND 3.5 04/15/21	700,000.000	751,695.000	
FINLAND 4.0 07/04/25	800,000.000	1,016,056.000	
FRANCE BTAN 8.5 04/25/23	1,280,000.000	1,729,484.800	
FRANCE OAT 0.25 11/25/20	1,100,000.000	1,113,376.000	
FRANCE OAT 0.25 11/25/26	3,000,000.000	3,118,290.000	
FRANCE OAT 0.5 05/25/25	3,700,000.000	3,902,501.000	
FRANCE OAT 0.5 05/25/26	2,920,000.000	3,086,936.400	
FRANCE OAT 0.5 05/25/29	2,700,000.000	2,839,401.000	
FRANCE OAT 0.75 05/25/28	2,610,000.000	2,814,154.200	
FRANCE OAT 0.75 11/25/28	2,940,000.000	3,168,144.000	
FRANCE OAT 02/25/21	1,370,000.000	1,384,659.000	
FRANCE OAT 03/25/23	1,900,000.000	1,944,137.000	
FRANCE OAT 03/25/24	2,720,000.000	2,787,320.000	
FRANCE OAT 05/25/21	2,510,000.000	2,540,571.800	
FRANCE OAT 05/25/22	3,000,000.000	3,057,510.000	
FRANCE OAT 1.0 05/25/27	2,730,000.000	2,995,137.600	
FRANCE OAT 1.0 11/25/25	3,000,000.000	3,265,590.000	
FRANCE OAT 1.25 05/25/34	1,740,000.000	1,970,341.200	
FRANCE OAT 1.25 05/25/36	2,580,000.000	2,906,112.000	
FRANCE OAT 1.5 05/25/31	4,240,000.000	4,923,912.000	
FRANCE OAT 1.5 05/25/50	1,010,000.000	1,163,388.700	
FRANCE OAT 1.75 05/25/23	3,670,000.000	4,010,135.600	
FRANCE OAT 1.75 05/25/66	980,000.000	1,210,045.200	

		FRANCE OAT 1.75 06/25/39	1,530,000.000	1,865,758.500	
		FRANCE OAT 1.75 11/25/24	3,630,000.000	4,070,319.000	
		FRANCE OAT 2.0 05/25/48	2,420,000.000	3,111,708.600	
		FRANCE OAT 2.25 05/25/24	3,240,000.000	3,684,042.000	
		FRANCE OAT 2.25 10/25/22	3,400,000.000	3,728,440.000	
		FRANCE OAT 2.5 05/25/30	3,490,000.000	4,418,654.100	
		FRANCE OAT 2.5 10/25/20	6,330,000.000	6,586,554.900	
		FRANCE OAT 2.75 10/25/27	3,580,000.000	4,470,560.800	
		FRANCE OAT 3.0 04/25/22	4,200,000.000	4,634,574.000	
		FRANCE OAT 3.25 05/25/45	2,280,000.000	3,612,660.000	
		FRANCE OAT 3.25 10/25/21	4,190,000.000	4,570,284.400	
		FRANCE OAT 3.5 04/25/26	3,360,000.000	4,256,448.000	
		FRANCE OAT 3.75 04/25/21	4,000,000.000	4,318,320.000	
		FRANCE OAT 4.0 04/25/55	1,330,000.000	2,536,443.000	
		FRANCE OAT 4.0 04/25/60	1,170,000.000	2,323,713.600	
		FRANCE OAT 4.0 10/25/38	2,430,000.000	3,996,207.900	
		FRANCE OAT 4.25 10/25/23	4,510,000.000	5,462,015.900	
		FRANCE OAT 4.5 04/25/41	3,200,000.000	5,753,696.000	
		FRANCE OAT 4.75 04/25/35	2,410,000.000	4,055,138.300	
		FRANCE OAT 5.5 04/25/29	3,650,000.000	5,654,288.000	
		FRANCE OAT 5.75 10/25/32	2,890,000.000	5,010,219.600	
		FRANCE OAT 6.0 10/25/25	2,900,000.000	4,080,677.000	
		IRISH 0.8 03/15/22	370,000.000	383,194.200	
		IRISH 0.9 05/15/28	580,000.000	624,689.000	
		IRISH 1.0 05/15/26	840,000.000	906,780.000	
		IRISH 1.1 05/15/29	340,000.000	371,038.600	
		IRISH 1.3 05/15/33	450,000.000	496,462.500	
		IRISH 1.35 03/18/31	210,000.000	234,691.800	
		IRISH 1.5 05/15/50	320,000.000	354,780.800	
		IRISH 1.7 05/15/37	570,000.000	662,642.100	
		IRISH 10/18/22	220,000.000	223,456.200	
		IRISH 2.0 02/18/45	810,000.000	1,013,593.500	
		IRISH 2.4 05/15/30	1,100,000.000	1,354,914.000	
		IRISH 3.4 03/18/24	930,000.000	1,095,772.500	
		IRISH 3.9 03/20/23	700,000.000	813,589.000	
		IRISH 5.0 10/18/20	850,000.000	910,095.000	
		IRISH 5.4 03/13/25	980,000.000	1,296,246.000	

		ITALY BTPS 0.35 11/01/21	1,700,000.000	1,703,587.000	
		ITALY BTPS 0.45 06/01/21	910,000.000	915,805.800	
		ITALY BTPS 0.65 10/15/23	2,100,000.000	2,090,340.000	
		ITALY BTPS 0.65 11/01/20	3,600,000.000	3,632,796.000	
		ITALY BTPS 0.9 08/01/22	980,000.000	989,525.600	
		ITALY BTPS 0.95 03/01/23	2,020,000.000	2,037,715.400	
		ITALY BTPS 0.95 03/15/23	2,040,000.000	2,058,360.000	
		ITALY BTPS 1.2 04/01/22	770,000.000	784,938.000	
		ITALY BTPS 1.25 12/01/26	1,610,000.000	1,604,526.000	
		ITALY BTPS 1.35 04/15/22	1,660,000.000	1,698,910.400	
		ITALY BTPS 1.45 05/15/25	1,540,000.000	1,568,105.000	
		ITALY BTPS 1.45 09/15/22	1,500,000.000	1,540,170.000	
		ITALY BTPS 1.45 11/15/24	2,020,000.000	2,061,834.200	
		ITALY BTPS 1.5 06/01/25	2,010,000.000	2,048,732.700	
		ITALY BTPS 1.6 06/01/26	1,500,000.000	1,533,300.000	
		ITALY BTPS 1.65 03/01/32	2,040,000.000	1,988,612.400	
		ITALY BTPS 1.85 05/15/24	1,800,000.000	1,877,760.000	
		ITALY BTPS 2.0 02/01/28	2,090,000.000	2,179,389.300	
		ITALY BTPS 2.0 12/01/25	2,010,000.000	2,104,490.100	
		ITALY BTPS 2.05 08/01/27	1,870,000.000	1,954,991.500	
		ITALY BTPS 2.15 12/15/21	2,200,000.000	2,295,260.000	
		ITALY BTPS 2.2 06/01/27	1,820,000.000	1,923,558.000	
		ITALY BTPS 2.25 09/01/36	1,500,000.000	1,522,500.000	
		ITALY BTPS 2.45 09/01/33	1,100,000.000	1,156,793.000	
		ITALY BTPS 2.5 11/15/25	550,000.000	591,662.500	
		ITALY BTPS 2.5 12/01/24	970,000.000	1,042,012.800	
		ITALY BTPS 2.7 03/01/47	1,650,000.000	1,709,235.000	
		ITALY BTPS 2.8 03/01/67	660,000.000	657,228.000	
		ITALY BTPS 2.8 12/01/28	1,400,000.000	1,545,698.000	
		ITALY BTPS 2.95 09/01/38	1,270,000.000	1,386,319.300	
		ITALY BTPS 3.0 08/01/29	570,000.000	637,225.800	
		ITALY BTPS 3.1 03/01/40	520,000.000	573,331.200	

		ITALY BTPS 3.25 09/01/46	1,250,000.000	1,422,275.000	
		ITALY BTPS 3.35 03/01/35	1,100,000.000	1,275,285.000	
		ITALY BTPS 3.45 03/01/48	1,430,000.000	1,677,089.700	
		ITALY BTPS 3.5 03/01/30	2,570,000.000	2,987,445.100	
		ITALY BTPS 3.75 03/01/21	3,300,000.000	3,500,475.000	
		ITALY BTPS 3.75 05/01/21	2,300,000.000	2,449,776.000	
		ITALY BTPS 3.75 08/01/21	3,200,000.000	3,430,080.000	
		ITALY BTPS 3.75 09/01/24	1,900,000.000	2,154,087.000	
		ITALY BTPS 3.85 09/01/49	890,000.000	1,099,443.700	
		ITALY BTPS 4.0 02/01/37	2,940,000.000	3,668,826.000	
		ITALY BTPS 4.5 03/01/24	2,390,000.000	2,774,001.300	
		ITALY BTPS 4.5 03/01/26	2,110,000.000	2,540,440.000	
		ITALY BTPS 4.5 05/01/23	1,400,000.000	1,596,014.000	
		ITALY BTPS 4.75 08/01/23	1,900,000.000	2,199,630.000	
		ITALY BTPS 4.75 09/01/21	2,470,000.000	2,705,638.000	
		ITALY BTPS 4.75 09/01/28	2,400,000.000	3,061,512.000	
		ITALY BTPS 4.75 09/01/44	1,630,000.000	2,267,101.800	
		ITALY BTPS 5.0 03/01/22	2,590,000.000	2,899,764.000	
		ITALY BTPS 5.0 03/01/25	2,400,000.000	2,904,528.000	
		ITALY BTPS 5.0 08/01/34	2,250,000.000	3,072,600.000	
		ITALY BTPS 5.0 08/01/39	1,820,000.000	2,555,826.000	
		ITALY BTPS 5.0 09/01/40	2,050,000.000	2,871,845.000	
		ITALY BTPS 5.25 11/01/29	2,900,000.000	3,848,300.000	
		ITALY BTPS 5.5 09/01/22	2,480,000.000	2,856,935.200	
		ITALY BTPS 5.5 11/01/22	2,500,000.000	2,893,650.000	
		ITALY BTPS 5.75 02/01/33	1,970,000.000	2,821,237.000	
		ITALY BTPS 6.0 05/01/31	2,710,000.000	3,872,590.000	
		ITALY BTPS 6.5 11/01/27	2,330,000.000	3,237,302.000	
		ITALY BTPS 7.25 11/01/26	1,080,000.000	1,517,940.000	
		ITALY BTPS 9.0 11/01/23	1,510,000.000	2,029,138.000	
		NETHERLANDS 0.25 07/15/25	1,020,000.000	1,064,971.800	
		NETHERLANDS 0.25 07/15/29	400,000.000	416,416.000	

		NETHERLANDS 0.5 01/15/40	430,000.000	449,221.000	
		NETHERLANDS 0.5 07/15/26	1,410,000.000	1,499,535.000	
		NETHERLANDS 0.75 07/15/27	1,450,000.000	1,574,526.000	
		NETHERLANDS 0.75 07/15/28	1,260,000.000	1,373,790.600	
		NETHERLANDS 01/15/22	1,750,000.000	1,780,870.000	
		NETHERLANDS 01/15/24	1,360,000.000	1,396,339.200	
		NETHERLANDS 1.75 07/15/23	1,670,000.000	1,832,808.300	
		NETHERLANDS 2.0 07/15/24	1,560,000.000	1,762,831.200	
		NETHERLANDS 2.25 07/15/22	1,550,000.000	1,689,779.000	
		NETHERLANDS 2.5 01/15/33	1,300,000.000	1,738,191.000	
		NETHERLANDS 2.75 01/15/47	1,300,000.000	2,134,535.000	
		NETHERLANDS 3.25 07/15/21	1,860,000.000	2,009,581.200	
		NETHERLANDS 3.75 01/15/23	590,000.000	682,630.000	
		NETHERLANDS 3.75 01/15/42	1,460,000.000	2,586,579.800	
		NETHERLANDS 4.0 01/15/37	1,420,000.000	2,372,536.000	
		NETHERLANDS 5.5 01/15/28	1,220,000.000	1,833,294.000	
		SPAIN 0.05 01/31/21	400,000.000	403,144.000	
		SPAIN 0.25 07/30/24	340,000.000	347,418.800	
		SPAIN 0.35 07/30/23	1,460,000.000	1,496,485.400	
		SPAIN 0.4 04/30/22	2,200,000.000	2,251,040.000	
		SPAIN 0.45 10/31/22	1,340,000.000	1,376,019.200	
		SPAIN 0.75 07/30/21	1,700,000.000	1,742,415.000	
		SPAIN 1.3 10/31/26	1,940,000.000	2,108,372.600	
		SPAIN 1.4 04/30/28	2,050,000.000	2,253,565.000	
		SPAIN 1.4 07/30/28	1,950,000.000	2,140,027.500	
		SPAIN 1.45 04/30/29	1,370,000.000	1,510,575.700	
		SPAIN 1.45 10/31/27	1,860,000.000	2,048,380.800	
		SPAIN 1.5 04/30/27	1,650,000.000	1,819,455.000	
		SPAIN 1.6 04/30/25	2,160,000.000	2,372,133.600	
		SPAIN 1.85 07/30/35	320,000.000	365,059.200	
		SPAIN 1.95 04/30/26	1,790,000.000	2,022,234.600	
		SPAIN 1.95 07/30/30	2,240,000.000	2,585,587.200	
		SPAIN 2.15 10/31/25	2,100,000.000	2,387,028.000	
		SPAIN 2.35 07/30/33	1,620,000.000	1,960,038.000	
		SPAIN 2.7 10/31/48	950,000.000	1,243,854.000	
		SPAIN 2.75 10/31/24	2,390,000.000	2,759,350.600	

		SPAIN 2.9 10/31/46	1,590,000.000	2,147,454.000	
		SPAIN 3.45 07/30/66	850,000.000	1,318,324.500	
		SPAIN 3.8 04/30/24	1,720,000.000	2,051,237.600	
		SPAIN 4.2 01/31/37	1,960,000.000	3,001,583.200	
		SPAIN 4.4 10/31/23	2,300,000.000	2,762,116.000	
		SPAIN 4.65 07/30/25	1,910,000.000	2,455,954.400	
		SPAIN 4.7 07/30/41	1,900,000.000	3,221,735.000	
		SPAIN 4.8 01/31/24	1,130,000.000	1,389,787.000	
		SPAIN 4.85 10/31/20	2,900,000.000	3,101,463.000	
		SPAIN 4.9 07/30/40	1,720,000.000	2,951,004.000	
		SPAIN 5.15 10/31/28	1,900,000.000	2,740,940.000	
		SPAIN 5.15 10/31/44	1,260,000.000	2,320,743.600	
		SPAIN 5.4 01/31/23	2,470,000.000	2,974,991.500	
		SPAIN 5.5 04/30/21	3,600,000.000	3,988,440.000	
		SPAIN 5.75 07/30/32	2,190,000.000	3,600,907.500	
		SPAIN 5.85 01/31/22	2,300,000.000	2,670,530.000	
		SPAIN 5.9 07/30/26	2,040,000.000	2,875,930.800	
		SPAIN 6.0 01/31/29	2,410,000.000	3,700,289.900	
	ユーロ　小計		465,630,000.000 (56,727,702,900)	560,343,704.400 (68,266,673,507)	
	南アフリカ・ランド	SOUTH AFRICA 10.5 12/21/26	25,000,000.000	28,291,500.000	
		SOUTH AFRICA 6.25 03/31/36	7,460,000.000	5,497,050.200	
		SOUTH AFRICA 6.5 02/28/41	11,760,000.000	8,396,757.600	
		SOUTH AFRICA 7.0 02/28/31	11,600,000.000	9,973,680.000	
		SOUTH AFRICA 7.75 02/28/23	3,600,000.000	3,660,336.000	
		SOUTH AFRICA 8.0 01/31/30	13,110,000.000	12,464,594.700	
		SOUTH AFRICA 8.25 03/31/32	10,000,000.000	9,390,000.000	
		SOUTH AFRICA 8.5 01/31/37	10,910,000.000	10,003,160.800	
		SOUTH AFRICA 8.75 01/31/44	10,000,000.000	9,096,800.000	
		SOUTH AFRICA 8.75 02/28/48	20,280,000.000	18,416,268.000	
		SOUTH AFRICA 8.875 02/28/35	12,510,000.000	12,001,218.300	
		SOUTH AFRICA 9.0 01/31/40	8,000,000.000	7,537,440.000	
	南アフリカ・ランド　小計		144,230,000.000 (1,116,340,200)	134,728,805.600 (1,042,800,955)	
国債証券　合計			157,135,459,860 (157,135,459,860)	175,262,230,905 (175,262,230,905)	
合計			157,135,459,860 (157,135,459,860)	175,262,230,905 (175,262,230,905)	

（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	160銘柄	46.69%	47.19%
イギリス・ポンド	国債証券	40銘柄	6.26%	6.33%
オーストラリア・ドル	国債証券	20銘柄	1.98%	2.00%
カナダ・ドル	国債証券	25銘柄	1.84%	1.86%
シンガポール・ドル	国債証券	12銘柄	0.37%	0.37%
スウェーデン・クローナ	国債証券	6銘柄	0.30%	0.30%
デンマーク・クローネ	国債証券	4銘柄	0.45%	0.45%
ノルウェー・クローネ	国債証券	6銘柄	0.22%	0.22%
ポーランド・ズロチ	国債証券	13銘柄	0.60%	0.60%
マレーシア・リンギット	国債証券	13銘柄	0.42%	0.43%
メキシコ・ペソ	国債証券	13銘柄	0.69%	0.70%
ユーロ	国債証券	285銘柄	38.54%	38.95%
南アフリカ・ランド	国債証券	12銘柄	0.59%	0.59%

(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）

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。** **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。** **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。** **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。** **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。**
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。**
４．　その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	**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。**

（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	55,614,868,236円	43,032,611,492円
		同期中追加設定元本額	13,556,720,259円	27,785,967,336円
		同期中一部解約元本額	26,138,977,003円	19,386,726,592円
		元本の内訳		
	ファンド名			
		ＤＩＡＭ新興国株式インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	4,229,653,765円	5,170,590,841円
		ＤＩＡＭ新興国株式インデックスファンド＜為替ヘッジなし＞（ファンドラップ）	538,952,510円	497,859,715円
		ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	5,084,297円	3,158,076円
		ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	13,283,178円	10,613,946円
		ＭＩＴＯ　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ＶＡ（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
	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）	7,261,569,827円	3,347,895,346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）	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）

１．金融商品の状況に関する事項

項目	自　平成30年7月12日 至　平成31年1月11日	自　平成31年1月12日 至　令和1年7月11日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
３．　金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	平成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 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成31年1月11日現在	令和1年7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	△4,492,632,172	△1,404,710,002
新株予約権証券	11,159	263,530
投資信託受益証券	△16,919,785	△19,718,270
投資証券	△15,048,911	△3,284,899
合計	△4,524,589,709	△1,427,449,641

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成30年4月19日から平成31年1月11日まで及び平成31年4月19日から令和1年7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。

①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。

②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)

附属明細表

第１　有価証券明細表

（１）株式

令和1年7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	BBVA ARGENTINA SA ADR	6,180	12.130	74,963.400	
	CTRIP.COM INTERNATIONAL LTD ADR	37,132	37.960	1,409,530.720	
	CIA DE MINAS BUENAVENTURA SA ADR	19,751	16.590	327,669.090	
	SURGUTNEFTEGAZ SP ADR PREF	69,900	6.763	472,733.700	
	CREDICORP LTD	6,030	235.820	1,421,994.600	
	SINA CORP	6,514	40.810	265,836.340	
	MOBILE TELESYSTEMS PJSC ADR	50,770	8.660	439,668.200	
	NETEASE INC-ADR	6,369	262.620	1,672,626.780	
	GRUPO FINANCIERO GALICIA SA ADR	11,420	38.000	433,960.000	
	SOUTHERN COPPER CORP	8,161	37.250	303,997.250	
	TELECOM ARGENTINA SA SP ADR	7,366	17.780	130,967.480	
	TRANSPORTADORA DE GAS DEL SUR SP ADR	6,243	15.410	96,204.630	
	YPF SA ADR	13,657	18.450	251,971.650	
	LUKOIL SPON ADR	37,740	84.740	3,198,087.600	
	GAZPROM PAO ADR	483,486	7.862	3,801,166.930	
	COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK SP GDR	148,738	4.350	647,010.300	
	INNER MONGOLIA YITAI COAL CO	66,800	1.049	70,073.200	
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRADE	86,736	1.210	104,950.560	
	SURGUTNEFTEGAZ ADR	64,929	4.234	274,909.380	
	51JOB INC ADR	1,814	76.050	137,954.700	
	X5 RETAIL GROUP NV GDR	12,169	34.950	425,306.550	
	NOVATEK PJSC GDR	8,417	212.800	1,791,137.600	
	BAIDU INC -SPON ADR	24,909	114.400	2,849,589.600	
	NOVOLIPETSK STEEL GDR	12,150	24.540	298,161.000	
	BANCO MACRO SA ADR	3,717	74.550	277,102.350	
	MMC NORILSK NICKEL ADR	59,570	22.560	1,343,899.200	
	ROSNEFT OIL CO GDR	110,942	6.698	743,089.510	
	NEW ORIENTAL EDUCATION & TECH	12,816	90.530	1,160,232.480	
	SEVERSTAL GDR	21,951	16.970	372,508.470	
	TATNEFT ADR	23,549	70.900	1,669,624.100	
	MAGNITOGORSK IRON & STEEL SPON GDR	25,801	9.120	235,305.120	

	VTB BANK OJSC GDR	172,000	1.386	238,392.000	
	DP WORLD PLC	12,841	15.500	199,035.500	
	MAGNIT PJSC GDR	34,762	15.300	531,858.600	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD ADR	34,821	7.880	274,389.480	
	PAMPA ENERGIA SA ADR	5,773	35.390	204,306.470	
	TAL EDUCATION GROUP-ADR	32,149	36.490	1,173,117.010	
	NOAH HOLDINGS LTD ADR	2,700	33.420	90,234.000	
	SBERBANK ADR	243,502	15.755	3,836,374.010	
	PHOSAGRO PJSC GDR	13,784	12.760	175,883.840	
	HUAZHU GROUP LTD ADR	12,147	34.700	421,500.900	
	YY INC-ADR	3,748	69.470	260,373.560	
	GDS HOLDINGS LTD ADR	4,404	37.980	167,263.920	
	NIO INC ADR	57,194	3.680	210,473.920	
	TENCENT MUSIC ENTERTAINMENT GROUP ADR	8,115	15.700	127,405.500	
	58.COM INC ADR	8,736	57.500	502,320.000	
	AUTOHOME INC ADR	5,418	84.320	456,845.760	
	WEIBO CORP ADR	4,093	42.330	173,256.690	
	JD.COM INC ADR	66,311	30.710	2,036,410.810	
	GLOBANT SA	2,914	108.970	317,538.580	
	ALIBABA GROUP HOLDING LTD-ADR	127,273	166.930	21,245,681.890	
	MOMO INC SPON ADR	13,537	34.690	469,598.530	
	BAOZUN INC-SPN ADR	3,400	53.060	180,404.000	
	PINDUODUO INC ADR	17,775	19.840	352,656.000	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	32,210	44.200	1,423,682.000	
	IQIYI INC ADR	9,440	19.910	187,950.400	
	POLYUS PJSC GDR	4,556	49.960	227,617.760	
	HUTCHISON CHINA MEDITECH LTD ADR	4,746	22.300	105,835.800	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC ADR	29,576	19.720	583,238.720	
アメリカ・ドル　小計		2,423,652		62,875,878.140 (6,803,170,014)	
アラブ首長国連邦・ディルハム	DUBAI ISLAMIC BANK PJSC	136,145	5.140	699,785.300	
	EMIRATES TELECOMMUNICATIONS GROUP CO PJSC	158,220	16.780	2,654,931.600	
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK PJSC	263,921	8.650	2,282,916.650	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	251,692	14.840	3,735,109.280	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	283,990	4.770	1,354,632.300	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	356,142	2.010	715,845.420	
	EMAAR DEVELOPMENT PJSC	77,463	4.100	317,598.300	
	EMAAR MALLS PJSC	178,166	2.020	359,895.320	
アラブ首長国連邦・ディルハム　小計		1,705,739		12,120,714.170 (357,682,275)	

イギリス・ポンド	POLYMETAL INTERNATIONAL PLC	23,613	9.664	228,196.030	
イギリス・ポンド　小計		23,613		228,196.030 (30,893,179)	
インド・ルピー	RELIANCE INDUSTRIES LTD	254,856	1,278.850	325,922,595.600	
	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	58,246	349.600	20,362,801.600	
	ASIAN PAINTS LTD	26,857	1,322.950	35,530,468.150	
	EICHER MOTORS LTD	1,291	18,751.000	24,207,541.000	
	GRASIM INDUSTRIES LTD	25,384	913.450	23,187,014.800	
	MAHINDRA & MAHINDRA LTD	64,106	621.650	39,851,494.900	
	SHREE CEMENT LTD	702	21,199.550	14,882,084.100	
	ICICI BANK LTD	213,313	430.900	91,916,571.700	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP LTD	46,395	286.700	13,301,446.500	
	STATE BANK OF INDIA LTD	160,842	354.200	56,970,236.400	
	CONTAINER CORP OF INDIA LTD	21,881	555.350	12,151,613.350	
	LIC HOUSING FINANCE LTD	26,242	541.450	14,208,730.900	
	TATA STEEL LTD	30,106	454.800	13,692,208.800	
	TATA MOTORS LTD	148,744	151.650	22,557,027.600	
	JSW STEEL LTD	71,572	254.900	18,243,702.800	
	TATA POWER CO LTD	100,483	66.350	6,667,047.050	
	BRITANNIA INDUSTRIES LTD	4,334	2,769.550	12,003,229.700	
	NESTLE INDIA LTD	2,230	11,550.450	25,757,503.500	
	GAIL INDIA LTD	150,694	144.950	21,843,095.300	
	VEDANTA LTD	153,887	160.000	24,621,920.000	
	AXIS BANK LTD	170,862	769.250	131,435,593.500	
	TITAN COMPANY LTD	28,852	1,101.200	31,771,822.400	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	226,935	151.650	34,414,692.750	
	LUPIN LTD	18,852	760.150	14,330,347.800	
	BAJAJ FINANCE LTD	15,773	3,429.050	54,086,405.650	
	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP	146,019	2,227.750	325,293,827.250	
	ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISES LTD	48,770	332.750	16,228,217.500	
	INFOSYS LTD	313,352	717.250	224,751,722.000	
	WIPRO LTD	103,325	266.950	27,582,608.750	
	INDIAN OIL CORP LTD	174,628	148.150	25,871,138.200	
	HINDUSTAN UNILEVER LTD	57,560	1,718.600	98,922,616.000	
	HCL TECHNOLOGIES LTD	49,458	1,018.900	50,392,756.200	
	DABUR INDIA LTD	52,173	409.750	21,377,886.750	
	HERO MOTOCORP LTD	4,509	2,400.000	10,821,600.000	
	DR REDDYS LABORATORIES LTD	10,980	2,584.650	28,379,457.000	
	BHARTI AIRTEL LTD	201,436	358.550	72,224,877.800	
	UNITED SPIRITS LTD	24,162	560.450	13,541,592.900	

SUN PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD	80,560	392.200	31,595,632.000	
DIVI'S LABORATORIES LTD	5,865	1,623.450	9,521,534.250	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	9,533	5,927.900	56,510,670.700	
GLENMARK PHARMACEUTICALS LTD	9,463	445.900	4,219,551.700	
AUROBINDO PHARMA LTD	22,361	597.100	13,351,753.100	
HAVELLS INDIA LTD	26,377	726.550	19,164,209.350	
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	99,877	118.150	11,800,467.550	
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE CO LTD	11,319	1,034.200	11,706,109.800	
PETRONET LNG LTD	59,517	244.200	14,534,051.400	
CIPLA LTD/INDIA	26,157	544.950	14,254,257.150	
LARSEN & TOUBRO LTD	43,142	1,499.550	64,693,586.100	
ULTRATECH CEMENT LTD	8,252	4,480.700	36,974,736.400	
ASHOK LEYLAND LTD	110,886	84.800	9,403,132.800	
BOSCH LTD	529	15,915.450	8,419,273.050	
TATA CONSULTANCY SERVICES LTD	80,435	2,108.200	169,573,067.000	
NTPC LTD	210,066	129.050	27,109,017.300	
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	7,493	1,937.050	14,514,315.650	
YES BANK LTD	133,947	93.000	12,457,071.000	
AMBUJA CEMENTS LTD	60,245	208.850	12,582,168.250	
BHARAT FORGE LTD	18,421	443.200	8,164,187.200	
HINDALCO INDUSTRIES LTD	100,088	193.650	19,382,041.200	
ITC LTD	309,493	273.150	84,538,012.950	
PIDILITE INDUSTRIES LTD	9,127	1,183.250	10,799,522.750	
UNITED PHOSPHORUS LTD	49,354	634.850	31,332,386.900	
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	33,093	637.750	21,105,060.750	
TECH MAHINDRA LTD	43,799	674.850	29,557,755.150	
VODAFONE IDEA LTD	714,690	11.250	8,040,262.500	
MARICO LTD	37,213	370.400	13,783,695.200	
PAGE INDUSTRIES LTD	581	20,169.450	11,718,450.450	
POWER GRID CORP OF INDIA LTD	145,077	205.300	29,784,308.100	
ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	54,822	405.000	22,202,910.000	
REC LTD	55,173	143.100	7,895,256.300	
BAJAJ FINSERV LTD	3,559	7,658.200	27,255,533.800	
BAJAJ AUTO LTD	6,471	2,740.400	17,733,128.400	
COAL INDIA LTD	114,340	233.350	26,681,239.000	
MAHINDRA & MAHINDRA FINANCIAL SERVICES LTD	31,084	387.900	12,057,483.600	
BHARTI INFRATEL LTD	32,296	259.950	8,395,345.200	
INDIABULLS HOUSING FINANCE LTD	26,467	659.600	17,457,633.200	

	TATA STEEL LTD-PARTLY PAID	2,333	56.450	131,697.850	
	AVENUE SUPERMARTS LTD	11,216	1,350.800	15,150,572.800	
	ICICI LOMBARD GENERAL INSURANCE CO LTD	12,372	1,058.800	13,099,473.600	
	INTERGLOBE AVIATION LTD	8,300	1,398.050	11,603,815.000	
インド・ルピー　小計		6,035,204		2,989,559,872.650 (4,753,400,198)	
インドネシア・ルピア	BARITO PACIFIC TBK PT	507,200	3,370.000	1,709,264,000.000	
	UNITED TRACTORS TBK PT	143,901	28,025.000	4,032,825,525.000	
	INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK PT	347,600	6,900.000	2,398,440,000.000	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	133,200	45,000.000	5,994,000,000.000	
	PT ASTRA INTERNATIONAL TBK	1,854,400	7,450.000	13,815,280,000.000	
	TELEKOMUNIKASI INDONESIA PERSERO TBK	4,476,600	4,290.000	19,204,614,000.000	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA TBK PT	549,000	5,725.000	3,143,025,000.000	
	GUDANG GARAM TBK PT	48,900	76,400.000	3,735,960,000.000	
	HANJAYA MANDALA SAMPOERNA TBK	795,500	3,140.000	2,497,870,000.000	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA TBK PT	183,300	22,000.000	4,032,600,000.000	
	INDAH KIAT PULP AND PAPER CORP TBK PT	262,000	8,750.000	2,292,500,000.000	
	BUKIT ASAM TBK PT	256,700	2,940.000	754,698,000.000	
	BANK MANDIRI	1,698,700	7,950.000	13,504,665,000.000	
	PABRIK KERTAS TJIWI KIMIA TBK PT	98,000	12,975.000	1,271,550,000.000	
	BANK RAKYAT INDONESIA	4,988,800	4,470.000	22,299,936,000.000	
	PERUSAHAAN GAS NEGARA TBK PT	806,800	2,120.000	1,710,416,000.000	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSERO TBK PT	709,200	9,150.000	6,489,180,000.000	
	KALBE FARMA TBK PT	2,100,200	1,465.000	3,076,793,000.000	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK PT	219,900	12,550.000	2,759,745,000.000	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	883,800	30,000.000	26,514,000,000.000	
	JASA MARGA PERSERO TBK PT	200,125	5,675.000	1,135,709,375.000	
	BUMI SERPONG DAMAI PT	746,500	1,480.000	1,104,820,000.000	
	ADARO ENERGY PT	1,016,200	1,345.000	1,366,789,000.000	
	PAKUWON JATI TBK	1,659,900	735.000	1,220,026,500.000	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR TBK PT	165,800	10,125.000	1,678,725,000.000	
	BANK TABUNGAN NEGARA TBK PT	480,300	2,450.000	1,176,735,000.000	

	PT SURYA CITRA MEDIA TBK	511,300	1,600.000	818,080,000.000	
インドネシア・ルピア　小計		25,843,826		149,738,246,400.000 (1,152,984,497)	
オフショア・人民元	LUXSHARE PRECISION INDUSTRY CO LTD	44,850	19.880	891,618.000	
	FOCUS MEDIA INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD	131,100	5.170	677,787.000	
	IFLYTEK CO LTD	22,200	33.000	732,600.000	
	YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD	2,300	82.090	188,807.000	
	JIANGSU YANGHE BREWERY JOINT-STOCK CO LTD	8,200	129.050	1,058,210.000	
	WULIANGYE YIBIN CO LTD	15,100	126.430	1,909,093.000	
	SUNING.COM CO LTD	69,400	10.980	762,012.000	
	BOE TECHNOLOGY GROUP CO LTD	232,600	3.680	855,968.000	
	CHINA MERCHANTS SHEKOU INDUSTRIAL ZONE HOLDINGS CO LTD	39,700	21.740	863,078.000	
	GREE ELECTRIC APPLIANCES INC OF ZHUHAI	16,900	56.290	951,301.000	
	MIDEA GROUP CO LTD	18,800	53.900	1,013,320.000	
	HANGZHOU HIKVISION DIGITAL TECHNOLOGY CO LTD	44,500	26.920	1,197,940.000	
	PING AN BANK CO LTD	84,900	13.560	1,151,244.000	
	WENS FOODSTUFFS GROUP CO LTD	28,400	38.170	1,084,028.000	
	CHINA VANKE CO LTD	43,900	29.170	1,280,563.000	
	WEICHAI POWER CO LTD	29,900	11.880	355,212.000	
	BANK OF SHANGHAI CO LTD	92,690	8.790	814,745.100	
	PETROCHINA CO LTD	32,800	6.660	218,448.000	
	INDUSTRIAL & COMMERCIAL BANK OF CHINA LTD	75,500	5.550	419,025.000	
	AGRICULTURAL BANK OF CHINA LTD	82,500	3.590	296,175.000	
	BANK OF CHINA LTD	74,500	3.700	275,650.000	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL CORP	51,300	5.200	266,760.000	
	CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	69,600	35.120	2,444,352.000	
	PING AN INSURANCE GROUP CO OF CHINA LTD	35,300	87.880	3,102,164.000	
	INDUSTRIAL BANK CO LTD	82,000	17.720	1,453,040.000	
	SHANGHAI PUDONG DEVELOPMENT BANK CO LTD	121,700	11.350	1,381,295.000	
	CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	173,700	5.980	1,038,726.000	
	SAIC MOTOR CORP LTD	41,300	25.690	1,060,997.000	
	KWEICHOW MOUTAI CO LTD	3,800	982.520	3,733,576.000	

BANK OF COMMUNICATIONS CO LTD	182,200	5.740	1,045,828.000	
CITIC SECURITIES CO LTD	50,200	23.200	1,164,640.000	
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	31,400	35.370	1,110,618.000	
CHINA YANGTZE POWER CO LTD	26,500	18.000	477,000.000	
DAQIN RAILWAY CO LTD	30,100	7.870	236,887.000	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD	60,800	3.780	229,824.000	
CHINA STATE CONSTRUCTION ENGINEERING CORP LTD	199,700	5.770	1,152,269.000	
HUAXIA BANK CO LTD	98,400	7.640	751,776.000	
INNER MONGOLIA YILI INDUSTRIAL GROUP CO LTD	32,300	33.160	1,071,068.000	
BANK OF BEIJING CO LTD	42,800	5.880	251,664.000	
BAOSHAN IRON & STEEL CO LTD	121,700	6.350	772,795.000	
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	22,900	40.820	934,778.000	
CHINA MERCHANTS SECURITIES CO LTD	22,800	16.720	381,216.000	
POLY DEVELOPMENTS AND HOLDINGS GROUP CO LTD	70,000	13.460	942,200.000	
CRRC CORP LTD	126,800	7.880	999,184.000	
JIANGSU HENGRUI MEDICINE CO LTD	19,800	67.410	1,334,718.000	
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION CORP LTD	81,900	9.630	788,697.000	
HUATAI SECURITIES CO LTD	43,200	21.120	912,384.000	
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD	60,700	12.480	757,536.000	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	11,000	27.320	300,520.000	
FOUNDER SECURITIES CO LTD	84,500	6.900	583,050.000	
CHINA INTERNATIONAL TRAVEL SERVICE CORP LTD	11,600	87.940	1,020,104.000	
AVIC CAPITAL CO LTD	49,800	5.270	262,446.000	
POWER CONSTRUCTION CORP OF CHINA LTD	132,100	5.050	667,105.000	
SICHUAN CHUANTOU ENERGY CO LTD	23,700	9.280	219,936.000	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD	9,900	17.460	172,854.000	
AECC AVIATION POWER CO LTD	9,500	23.660	224,770.000	
JOINTOWN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	16,000	12.240	195,840.000	

	INDUSTRIAL SECURITIES CO LTD	53,200	6.520	346,864.000	
	BEIJING TONGRENTANG CO LTD	19,900	29.970	596,403.000	
	SHANDONG GOLD MINING CO LTD	8,000	38.900	311,200.000	
	YONGHUI SUPERSTORES CO LTD	74,000	9.980	738,520.000	
	AISINO CORP	26,300	22.430	589,909.000	
	ZHANGZHOU PIENTZEHUANG PHARMACEUTICAL CO LTD	6,100	111.380	679,418.000	
	HENGTONG OPTIC-ELECTRIC CO LTD	35,900	16.280	584,452.000	
	GUOTAI JUNAN SECURITIES CO LTD	49,500	18.030	892,485.000	
	CHINA NATIONAL NUCLEAR POWER CO LTD	51,300	5.490	281,637.000	
	BANK OF JIANGSU CO LTD	96,200	7.200	692,640.000	
	ORIENT SECURITIES CO LTD/CHINA	24,800	10.080	249,984.000	
	EVERBRIGHT SECURITIES CO LTD	24,000	11.380	273,120.000	
オフショア・人民元　小計		3,910,940		56,676,073.100 (892,081,391)	
カタール・リアル	QATAR INSURANCE CO SAQ	144,170	3.540	510,361.800	
	QATAR NATIONAL BANK	398,770	19.210	7,660,371.700	
	COMMERCIAL BANK OF QATAR QSC	182,020	4.810	875,516.200	
	OOREDOO QSC	67,600	6.750	456,300.000	
	QATAR FUEL QSC	41,330	21.340	881,982.200	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	50,500	16.640	840,320.000	
	INDUSTRIES QATAR QSC	162,970	11.440	1,864,376.800	
	QATAR ISLAMIC BANK SAQ	105,030	17.210	1,807,566.300	
	MASRAF AL RAYAN	365,350	3.820	1,395,637.000	
	BARWA REAL ESTATE CO	167,630	3.530	591,733.900	
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDING CO	376,450	2.600	978,770.000	
カタール・リアル　小計		2,061,820		17,862,935.900 (529,278,791)	
コロンビア・ペソ	INTERCONEXION ELECTRICA SA ESP	49,106	19,900.000	977,209,400.000	
	ECOPETROL SA	397,193	3,090.000	1,227,326,370.000	
	GRUPO DE INVERSIONES SURAMERICANA SA-PREF	10,138	32,880.000	333,337,440.000	
	GRUPO AVAL ACCIONES Y VALORES SA-PREF	341,831	1,305.000	446,089,455.000	
	CEMENTOS ARGOS SA	37,720	7,820.000	294,970,400.000	
	GRUPO ARGOS SA	36,619	17,780.000	651,085,820.000	
	BANCOLOMBIA SA	17,386	38,800.000	674,576,800.000	

	BANCOLOMBIA SA-PREF	38,573	40,940.000	1,579,178,620.000	
	GRUPO DE INVERSIONES SURAMERICANA SA	26,465	34,900.000	923,628,500.000	
コロンビア・ペソ　小計		955,031		7,107,402,805.000 (239,519,474)	
タイ・バーツ	BANGKOK BANK PCL	38,300	199.000	7,621,700.000	
	BERLI JUCKER PCL NVDR	88,100	50.750	4,471,075.000	
	KRUNG THAI BANK PCL NVDR	286,500	19.400	5,558,100.000	
	RATCHABURI ELECTRICITY GENERATING HOLDING PCL NVDR	78,600	67.250	5,285,850.000	
	ROBINSON PCL-NVDR	38,800	57.250	2,221,300.000	
	SIAM COMMERCIAL BANK PCL NVDR	68,700	139.000	9,549,300.000	
	TRUE CORP PCL NVDR	1,079,055	5.900	6,366,424.500	
	KASIKORNBANK PCL NVDR	74,600	188.500	14,062,100.000	
	TMB BANK PCL -NVDR	1,010,000	1.900	1,919,000.000	
	IRPC PCL NVDR	1,300,500	4.860	6,320,430.000	
	BANPU PCL PUBLIC CO LTD NVDR	384,200	14.500	5,570,900.000	
	ELECTRICITY GENERATING PCL NVDR	26,600	339.000	9,017,400.000	
	SHIN CORP PCL	187,000	63.500	11,874,500.000	
	CHAROEN POKPHAND FOODS PCL	325,800	30.000	9,774,000.000	
	ADVANCED INFO SERVICE PCL	98,800	217.000	21,439,600.000	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	510,820	17.800	9,092,596.000	
	PTT PCL	1,005,300	48.250	48,505,725.000	
	THAI UNION GROUP PCL-NVDR	315,400	18.700	5,897,980.000	
	LAND AND HOUSES PCL NVDR	604,500	11.100	6,709,950.000	
	SIAM CEMENT PCL NVDR	69,250	456.000	31,578,000.000	
	AIRPORTS OF THAILAND PCL-NVDR	384,400	74.250	28,541,700.000	
	KASIKORNBANK PCL - FOREIGN	106,600	189.500	20,200,700.000	
	CENTRAL PATTANA PCL NVDR	192,100	75.250	14,455,525.000	
	BANGKOK DUSIT MEDICAL SERVICES NVDR	837,800	25.500	21,363,900.000	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR	47,900	175.000	8,382,500.000	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	239,010	41.500	9,918,915.000	
	THAI OIL PCL NVDR	116,500	68.000	7,922,000.000	
	CP ALL PCL NVDR	516,600	87.750	45,331,650.000	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL	531,300	12.700	6,747,510.000	
	PTT EXPLORATION & PRODUCTION PCL NVDR	125,845	134.500	16,926,152.500	

	TOTAL ACCESS COMMUNICATION PCL	66,700	52.500	3,501,750.000	
	INDORAMA VENTURES PCL NVDR	166,322	42.500	7,068,685.000	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	210,208	62.000	13,032,896.000	
	ENERGY ABSOLUTE PCL NVDR	164,800	54.750	9,022,800.000	
	BANGKOK EXPRESSWAY & METRO PCL NVDR	612,500	11.200	6,860,000.000	
	GULF ENERGY DEVELOPMENT PCL NVDR	61,800	128.000	7,910,400.000	
	MUANGTHAI CAPITAL PCL NVDR	59,400	56.750	3,370,950.000	
タイ・バーツ　小計		12,030,610		453,393,964.000 (1,600,480,692)	
チェコ・コルナ	KOMERCNI BANKA AS	5,669	885.500	5,019,899.500	
	CEZ	13,157	510.000	6,710,070.000	
	MONETA MONEY BANK AS	62,868	76.600	4,815,688.800	
チェコ・コルナ　小計		81,694		16,545,658.300 (78,757,334)	
チリ・ペソ	BANCO SANTANDER CHILE	5,043,748	51.000	257,231,148.000	
	BANCO DE CREDITO E INVERSIONES	4,816	47,225.000	227,435,600.000	
	BANCO DE CHILE	2,670,286	99.680	266,174,108.480	
	EMPRESAS CMPC SA	93,978	1,822.300	171,256,109.400	
	EMPRESAS COPEC SA	37,352	7,040.000	262,958,080.000	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	13,024	9,935.000	129,393,440.000	
	ENTEL CHILE SA	13,572	6,898.000	93,619,656.000	
	ENEL AMERICAS SA	2,742,103	116.000	318,083,948.000	
	COLBUN SA	554,294	133.500	73,998,249.000	
	AGUAS ANDINAS SA	224,014	406.000	90,949,684.000	
	EMBOTELLADORA ANDINA SA	35,748	2,475.000	88,476,300.000	
	LATAM AIRLINES GROUP SA	30,315	7,035.000	213,266,025.000	
	SOCIEDAD QUIMICA Y MINERA DE CHILE SA	9,147	19,880.000	181,842,360.000	
	SACI FALABELLA	69,528	4,456.900	309,879,343.200	
	ITAU CORPBANCA	13,236,977	5.518	73,041,639.080	
	CENCOSUD SA	122,212	1,420.000	173,541,040.000	
	ENEL AMERICAS SA-RTS	893,936	5.015	4,483,089.040	
	ENEL CHILE SA	2,872,558	64.770	186,055,581.660	
チリ・ペソ　小計		28,667,608		3,121,685,400.860 (491,977,619)	
トルコ・リラ	AKBANK TAS	289,930	7.530	2,183,172.900	
	ANADOLU EFES BIRACILIK VE MALT SANAYII AS	19,724	20.260	399,608.240	
	ARCELIK	18,902	19.590	370,290.180	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	31,766	17.140	544,469.240	

	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIKALARI TAS	91,528	7.190	658,086.320	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	5,919	60.450	357,803.550	
	KOC HOLDING AS	49,560	17.920	888,115.200	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI AS	54,397	4.780	260,017.660	
	TURK HAVA YOLLARI	49,081	12.380	607,622.780	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	93,118	13.130	1,222,639.340	
	TURKIYE GARANTI BANKASI AS	230,296	9.800	2,256,900.800	
	TURKIYE IS BANKASI	151,063	6.480	978,888.240	
	TUPRAS TURKIYE PETROL RAFINE	10,681	116.900	1,248,608.900	
	HACI OMER SABANCI HOLDING AS	77,665	9.180	712,964.700	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	20,916	88.000	1,840,608.000	
	TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	13,735	25.020	343,649.700	
トルコ・リラ　小計		1,208,281		14,873,445.750 (283,041,672)	
ハンガリー・フォリント	RICHTER GEDEON NYRT	10,134	5,110.000	51,784,740.000	
	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NYRT	40,691	2,962.000	120,526,742.000	
	OTP BANK NYRT	19,509	12,270.000	239,375,430.000	
ハンガリー・フォリント　小計		70,334		411,686,912.000 (153,929,737)	
パキスタン・ルピー	MCB BANK LTD	39,000	174.960	6,823,440.000	
	OIL & GAS DEVELOPMENT CO LTD	74,500	130.560	9,726,720.000	
	HABIB BANK LTD	54,400	116.220	6,322,368.000	
パキスタン・ルピー　小計		167,900		22,872,528.000 (15,782,045)	
フィリピン・ペソ	AYALA LAND INC	678,800	51.250	34,788,500.000	
	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	179,890	56.000	10,073,840.000	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAND	89,510	78.500	7,026,535.000	
	AYALA CORP	24,123	910.000	21,951,930.000	
	ALLIANCE GLOBAL GROUP INC	307,700	15.400	4,738,580.000	
	DMCI HOLDINGS INC	351,850	10.020	3,525,537.000	
	GLOBE TELECOM INC	2,785	2,174.000	6,054,590.000	
	INTERNATIONAL CONTAINER TERM SERVICES INC	91,810	142.500	13,082,925.000	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	245,040	69.700	17,079,288.000	
	JOLLIBEE FOODS CORP	36,330	282.000	10,245,060.000	

	METROPOLITAN BANK & TRUST	143,447	71.500	10,256,460.500	
	BDO UNIBANK INC	188,813	142.300	26,868,089.900	
	MEGAWORLD CORP	962,000	6.010	5,781,620.000	
	PLDT INC	6,525	1,198.000	7,816,950.000	
	ROBINSONS LAND CORP	218,722	26.650	5,828,941.300	
	SECURITY BANK CORP	23,420	173.000	4,051,660.000	
	SM PRIME HOLDINGS INC	927,675	38.500	35,715,487.500	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	79,130	175.000	13,847,750.000	
	SM INVESTMENTS CORP	23,468	980.000	22,998,640.000	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CORP	1,148,900	4.800	5,514,720.000	
	ABOITIZ POWER CORP	153,700	36.700	5,640,790.000	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	23,430	383.000	8,973,690.000	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	6,401	845.000	5,408,845.000	
フィリピン・ペソ 小計		5,913,469		287,270,429.200 (603,267,901)	
ブラジル・レアル	BRF SA	48,492	34.980	1,696,250.160	
	VALE SA	284,121	52.130	14,811,227.730	
	RAIA DROGASIL SA	21,900	83.500	1,828,650.000	
	TIM PARTICIPACOES SA	76,300	12.150	927,045.000	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	19,250	37.680	725,340.000	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	16,400	36.300	595,320.000	
	BANCO DO BRASIL SA	77,600	54.260	4,210,576.000	
	INVESTIMENTOS ITAU SA	397,460	13.340	5,302,116.400	
	LOJAS AMERICANAS SA	63,874	17.380	1,110,130.120	
	GERDAU SA	104,330	15.310	1,597,292.300	
	CIA BRASILEIRA DE DISTRIBUICAO GRUPO PAO DE ACUCAR	12,306	92.560	1,139,043.360	
	PETROLEO BRASILEIRO SA	267,010	30.720	8,202,547.200	
	PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	26,100	26.600	694,260.000	
	PETROLEO BRASILEIRO SA	374,912	28.070	10,523,779.840	
	KROTON EDUCACIONAL SA	141,468	12.330	1,744,300.440	
	CCR SA	115,620	14.850	1,716,957.000	
	WEG SA	73,972	23.690	1,752,396.680	
	BANCO BRADESCO SA PREF	363,650	39.050	14,200,532.500	
	BANCO BRADESCO SA	100,441	35.100	3,525,479.100	
	NATURA COSMETICOS SA	19,000	58.250	1,106,750.000	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	47,606	17.240	820,727.440	
	SUZANO SA	50,475	31.500	1,589,962.500	
	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	429,647	37.200	15,982,868.400	
	PORTO SEGURO SA	8,800	55.000	484,000.000	
	B2W CIA DIGITAL	16,200	39.210	635,202.000	
	BRASKEM SA	15,730	36.940	581,066.200	

	ENGIE BRASIL SA	15,487	46.160	714,879.920	
	LOCALIZA RENT A CAR	50,980	44.130	2,249,747.400	
	TELEFONICA BRASIL S.A.	40,528	52.000	2,107,456.000	
	LOJAS RENNER SA	74,737	48.840	3,650,155.080	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	71,504	20.850	1,490,858.400	
	COSAN SA	12,000	50.870	610,440.000	
	EQUATORIAL ENERGIA SA	17,100	97.140	1,661,094.000	
	EMBRAER SA	69,460	19.420	1,348,913.200	
	M DIAS BRANCO SA	10,400	39.860	414,544.000	
	BR MALLS PARTICIPACOES SA	88,965	15.460	1,375,398.900	
	JBS SA	89,900	25.370	2,280,763.000	
	CIA ENERGETICA DE MINAS GERAIS	90,649	15.400	1,395,994.600	
	CIA DE SANEAMENTO BASICO DO ESTADO DE SAO PAULO	32,798	49.500	1,623,501.000	
	MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS IMOBILIARIOS SA	23,340	29.540	689,463.600	
	SUL AMERICA SA	17,869	42.350	756,752.150	
	HYPERA SA	29,600	29.620	876,752.000	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BAICAO	188,116	42.100	7,919,683.600	
	MAGAZINE LUIZA SA	6,200	233.500	1,447,700.000	
	BANCO SANTANDER BRASIL SA	37,500	46.590	1,747,125.000	
	ENERGISA SA	18,800	48.940	920,072.000	
	CIELO SA	111,307	7.300	812,541.100	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	65,000	33.740	2,193,100.000	
	NOTRE DAME INTERMEDICA PARTICIPACOES SA	27,500	42.750	1,175,625.000	
	ATACADAO DISTRIBUICAO COMERCIO E INDUSTRIA LTDA	27,000	23.490	634,230.000	
	AMBEV SA	419,695	19.020	7,982,598.900	
	KLABIN SA	67,600	16.800	1,135,680.000	
	RUMO SA	103,300	21.970	2,269,501.000	
	IRB BRASIL RESSEGUROS S/A	13,500	101.450	1,369,575.000	
	BANCO BTG PACTUAL SA	16,700	56.320	940,544.000	
ブラジル・レアル　小計		5,010,199		151,298,509.220 (4,357,397,065)	
ポーランド・ズロチ	BANK MILLENNIUM SA	49,782	8.905	443,308.710	
	MBANK	1,644	406.600	668,450.400	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	12,732	96.200	1,224,818.400	
	BANK PEKAO SA	15,704	104.650	1,643,423.600	
	ORANGE POLSKA SA	58,600	6.710	393,206.000	

	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	27,274	93.860	2,559,937.640	
	LPP SA	110	7,785.000	856,350.000	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	3,375	359.000	1,211,625.000	
	CD PROJEKT RED SA	6,332	215.900	1,367,078.800	
	POWSZECHNA KASA OSZCZEDNOSCI BANK POLSKI SA	75,449	41.600	3,138,678.400	
	CCC SA	2,763	153.700	424,673.100	
	GRUPA LOTOS SA	6,865	85.480	586,820.200	
	POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I GAZOWNICTWO SA	140,134	5.310	744,111.540	
	CYFROWY POLSAT SA	23,495	30.720	721,766.400	
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	70,529	9.876	696,544.400	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZEN SA	54,011	43.700	2,360,280.700	
	JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA SA	5,380	45.740	246,081.200	
	ALIOR BANK SA	11,052	52.700	582,440.400	
	DINO POLSKA SA	3,444	141.000	485,604.000	
ポーランド・ズロチ　小計		568,675		20,355,198.890 (581,548,032)	
マレーシア・リンギット	AMMB HOLDINGS BHD	134,500	4.310	579,695.000	
	GENTING PLANTATIONS BHD	13,100	10.040	131,524.000	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	422,100	5.330	2,249,793.000	
	DIGI.COM BHD	286,300	5.050	1,445,815.000	
	MALAYSIA AIRPORTS HOLDINGS BHD	115,020	8.800	1,012,176.000	
	RHB BANK BHD	77,780	5.710	444,123.800	
	HAP SENG CONSOLIDATED BHD	41,300	9.950	410,935.000	
	TOP GLOVE CORP BHD	170,700	4.790	817,653.000	
	GAMUDA BHD	124,000	3.880	481,120.000	
	GENTING BHD	188,000	6.600	1,240,800.000	
	YTL CORP BHD	283,710	1.120	317,755.200	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP BHD	20,256	18.880	382,433.280	
	HONG LEONG BANK BHD	50,408	19.000	957,752.000	
	IJM CORP BHD	230,360	2.380	548,256.800	
	IOI CORP BHD	219,613	4.270	937,747.510	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	35,400	24.560	869,424.000	
	FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	12,800	34.600	442,880.000	
	MALAYAN BANKING BHD	315,575	8.940	2,821,240.500	
	ALLIANCE BANK MALAYSIA BHD	88,400	3.730	329,732.000	
	MISC BHD	90,280	7.230	652,724.400	

	NESTLE MALAYSIA BHD	6,800	148.500	1,009,800.000	
	PPB GROUP BHD	47,560	18.720	890,323.200	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	19,600	25.000	490,000.000	
	PETRONAS GAS BHD	60,400	17.320	1,046,128.000	
	GENTING MALAYSIA BHD	294,200	3.300	970,860.000	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD	14,700	29.100	427,770.000	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	103,400	4.430	458,062.000	
	SP SETIA BHD	136,700	2.100	287,070.000	
	TENAGA NASIONAL BHD	284,250	13.740	3,905,595.000	
	QL RESOURCES BHD	53,800	6.830	367,454.000	
	DIALOG GROUP BHD	336,644	3.380	1,137,856.720	
	PUBLIC BANK BHD(LOCAL)	272,230	23.120	6,293,957.600	
	AIRASIA GROUP BHD	147,900	2.890	427,431.000	
	SIME DARBY BERHAD	259,100	2.340	606,294.000	
	HARTALEGA HOLDINGS BHD	117,100	5.230	612,433.000	
	AXIATA GROUP BERHAD	246,200	5.180	1,275,316.000	
	MAXIS BHD	201,200	5.650	1,136,780.000	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	213,400	8.410	1,794,694.000	
	IHH HEALTHCARE BHD	238,500	5.810	1,385,685.000	
	WESTPORTS HOLDINGS BHD	64,500	3.950	254,775.000	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDINGS BHD	124,000	4.430	549,320.000	
	SIME DARBY PROPERTY BHD	232,700	0.995	231,536.500	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	178,300	4.880	870,104.000	
マレーシア・リンギット　小計		6,572,786		43,502,825.510 (1,139,774,028)	
メキシコ・ペソ	ALFA SAB DE CV	264,100	17.470	4,613,827.000	
	EL PUERTO DE LIVERPOOL SAB DE CV	13,600	103.550	1,408,280.000	
	GRUPO TELEVISA SAB	233,900	35.650	8,338,535.000	
	GRUPO BIMBO SAB DE CV	124,900	40.010	4,997,249.000	
	GRUMA SAB DE CV	21,340	179.350	3,827,329.000	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INFRAESTRUCTURA	20,260	192.370	3,897,416.200	
	GRUPO CARSO SAB DE CV	37,600	70.120	2,636,512.000	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE SAB DE CV	236,200	104.800	24,753,760.000	
	MEXICHEM SAB DE CV	94,025	42.990	4,042,134.750	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	14,295	230.490	3,294,854.550	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO SAB DE CV	134,300	35.900	4,821,370.000	
	ALSEA SAB DE CV	43,700	36.990	1,616,463.000	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL SURESTE SAB DE CV	21,020	313.520	6,590,190.400	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV	322,652	49.240	15,887,384.480	

	AMERICA MOVIL SAB DE CV	3,017,678	14.130	42,639,790.140	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA SA	176,800	27.490	4,860,232.000	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	31,600	104.070	3,288,612.000	
	WAL-MART DE MEXICO SAB DE CV	468,500	53.440	25,036,640.000	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL PACIFICO SAB DE CV	35,600	202.370	7,204,372.000	
	MEGACABLE HOLDINGS SAB DE CV	27,400	80.270	2,199,398.000	
	INFRAESTRUCTURA ENERGETICA NOVA SAB DE CV	53,000	74.570	3,952,210.000	
	BANCO SANTANDER MEXICO SA	154,590	29.630	4,580,501.700	
	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	39,700	119.640	4,749,708.000	
メキシコ・ペソ　小計		5,586,760		189,236,769.220 (1,071,080,114)	
ユーロ	ALPHA BANK A.E.	99,133	1.668	165,353.840	
	NATIONAL BANK OF GREECE	48,905	2.330	113,948.650	
	TITAN CEMENT CO. S.A.	4,089	17.880	73,111.320	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	24,457	12.460	304,734.220	
	FF GROUP	3,130	2.400	7,512.000	
	EUROBANK ERGASIAS	221,515	0.830	183,857.450	
	MOTOR OIL HELLAS CORINTH REFIN	5,847	23.580	137,872.260	
	OPAP SA	19,846	9.730	193,101.580	
	JUMBO SA	8,952	17.440	156,122.880	
ユーロ　小計		435,874		1,335,614.200 (162,717,878)	
韓国・ウォン	CHEIL WORLDWIDE INC	5,553	28,350.000	157,427,550.000	
	HANMI SCIENCE CO LTD	1,187	47,850.000	56,797,950.000	
	HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	3,124	87,400.000	273,037,600.000	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANC	2,645	261,500.000	691,667,500.000	
	DB INSURANCE CO LTD	5,027	52,400.000	263,414,800.000	
	WOONGJIN COWAY CO LTD	4,918	78,100.000	384,095,800.000	
	KT&G CORP	10,002	97,700.000	977,195,400.000	
	S-1 CORPORATION	1,444	97,600.000	140,934,400.000	
	KOREA GAS CORP	2,469	43,000.000	106,167,000.000	
	CJ CORP	1,188	95,100.000	112,978,800.000	
	KAKAO CORP	4,647	131,000.000	608,757,000.000	
	CJ ENM CO LTD	791	170,000.000	134,470,000.000	
	DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE	2,634	31,500.000	82,971,000.000	
	SK TELECOM CO LTD	1,876	254,500.000	477,442,000.000	

DAELIM INDUSTRIAL CO	2,948	108,500.000	319,858,000.000	
MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD	33,940	7,870.000	267,107,800.000	
NCSOFT CORPORATION	1,419	486,500.000	690,343,500.000	
LG UPLUS CORP	9,656	13,650.000	131,804,400.000	
DAEWOO ENGINEERING & CONSTRUCT	13,540	4,600.000	62,284,000.000	
POSCO INTERNATIONAL CORP	3,600	18,550.000	66,780,000.000	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD	848	1,261,000.000	1,069,328,000.000	
LG CHEM LTD	4,129	337,500.000	1,393,537,500.000	
LG CHEM LTD	726	189,000.000	137,214,000.000	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD	201	776,000.000	155,976,000.000	
SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD	40,328	43,600.000	1,758,300,800.000	
S-OIL CORP	4,486	89,500.000	401,497,000.000	
HANWHA CHEMICAL CORPORATION	8,289	21,800.000	180,700,200.000	
MERITZ SECURITIES CO LTD	33,835	5,250.000	177,633,750.000	
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	4,354	37,450.000	163,057,300.000	
POSCO CHEMICAL CO LTD	2,126	51,200.000	108,851,200.000	
LOTTE CHEMICAL CORPORATION	1,654	248,500.000	411,019,000.000	
HOTEL SHILLA CO LTD	2,355	83,900.000	197,584,500.000	
KOREA SHIPBUILDING & OFFSHORE ENGINEERING CO LTD	3,478	113,000.000	393,014,000.000	
HYUNDAI MOBIS	6,157	231,500.000	1,425,345,500.000	
SK HYNIX INC	49,053	72,900.000	3,575,963,700.000	
HYUNDAI ENGINEERING & CONSTRUCTION CO LTD	6,166	48,450.000	298,742,700.000	
HYUNDAI MOTOR CO	1,954	79,200.000	154,756,800.000	
HYUNDAI MOTOR CO	13,518	137,000.000	1,851,966,000.000	
HYUNDAI STEEL CO	7,953	40,000.000	318,120,000.000	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	23,732	13,550.000	321,568,600.000	
KCC CORP	700	260,000.000	182,000,000.000	
KIA MOTORS CORP	23,760	42,950.000	1,020,492,000.000	
KOREA ZINC CO LTD	733	439,500.000	322,153,500.000	
KOREA ELECTRIC POWER CORP	24,243	25,250.000	612,135,750.000	
HANWHA CORP	3,785	25,900.000	98,031,500.000	
KOREAN AIR CO LTD	4,387	28,400.000	124,590,800.000	
OCI COMPANY LTD	1,315	87,200.000	114,668,000.000	
CJ LOGISTICS	985	131,000.000	129,035,000.000	
KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	1,509	88,500.000	133,546,500.000	
HLB INC	2,994	32,400.000	97,005,600.000	

LG ELECTRONICS INC	8,648	70,600.000	610,548,800.000	
LOTTE CORP	2,810	40,400.000	113,524,000.000	
LG CORP	8,976	75,100.000	674,097,600.000	
NH INVESTMENT & SECURITIES CO LTD	13,362	14,200.000	189,740,400.000	
GS ENGINEERING & CONSTRUCTION	4,436	35,650.000	158,143,400.000	
NAVER CORP	12,715	115,500.000	1,468,582,500.000	
HYUNDAI DEPARTMENT STORE CO LTD	1,249	78,800.000	98,421,200.000	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO LTD	3,607	77,900.000	280,985,300.000	
OTTOGI CORP	112	676,000.000	75,712,000.000	
AMOREPACIFIC GROUP	2,018	62,800.000	126,730,400.000	
KANGWON LAND INC	11,398	29,700.000	338,520,600.000	
POSCO	7,052	239,000.000	1,685,428,000.000	
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	11,773	16,700.000	196,609,100.000	
SAMSUNG SDI CO LTD	4,974	231,500.000	1,151,481,000.000	
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO LTD	5,188	90,100.000	467,438,800.000	
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	427,247	45,550.000	19,461,100,850.000	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES CO LTD	43,514	7,600.000	330,706,400.000	
SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	73,481	37,850.000	2,781,255,850.000	
SHINSEGAE CO LTD	646	270,000.000	174,420,000.000	
YUHAN CORP	750	230,000.000	172,500,000.000	
HANON SYSTEMS	13,526	11,350.000	153,520,100.000	
HYUNDAI MARINE & FIRE INSURANCE CO LTD	5,667	26,900.000	152,442,300.000	
GS HOLDINGS CORP	5,020	50,900.000	255,518,000.000	
LG DISPLAY CO LTD	22,144	16,800.000	372,019,200.000	
CELLTRION INC	8,093	189,000.000	1,529,577,000.000	
HELIXMITH CO LTD	1,190	173,700.000	206,703,000.000	
HANA FINANCIAL GROUP	27,193	35,950.000	977,588,350.000	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	1,420	160,000.000	227,200,000.000	
CELLTRION PHARM INC	1,457	42,350.000	61,703,950.000	
LOTTE SHOPPING CO	1,003	148,000.000	148,444,000.000	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LTD	6,537	80,100.000	523,613,700.000	
AMOREPACIFIC CORP	2,810	159,000.000	446,790,000.000	
AMOREPACIFIC CORP-PREF	1,184	87,300.000	103,363,200.000	
SAMSUNG CARD CO	2,877	36,850.000	106,017,450.000	
SK INNOVATION CO LTD	4,940	165,500.000	817,570,000.000	
CJ CHEILJEDANG CORP	705	283,000.000	199,515,000.000	
STX PAN OCEAN CO LTD	18,395	4,795.000	88,204,025.000	
LG INNOTEK CO LTD	999	106,500.000	106,393,500.000	
SK HOLDINGS CO LTD	3,262	220,000.000	717,640,000.000	

	KB FINANCIAL GROUP INC	35,738	43,350.000	1,549,242,300.000	
	MEDY-TOX INC	320	423,300.000	135,456,000.000	
	KOREA AEROSPACE INDUSTRIES LTD	6,602	33,700.000	222,487,400.000	
	BNK FINANCIAL GROUP INC	28,752	7,300.000	209,889,600.000	
	HANMI PHARM CO LTD	695	292,500.000	203,287,500.000	
	HANWHA LIFE INSURANCE CO LTD	11,369	2,990.000	33,993,310.000	
	FILA KOREA LTD	4,708	72,400.000	340,859,200.000	
	E-MART CO LTD	2,077	138,500.000	287,664,500.000	
	GS RETAIL CO LTD	2,482	38,400.000	95,308,800.000	
	HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO LTD	6,590	32,600.000	214,834,000.000	
	HDC HYUNDAI DEVELOPMENT CO-ENGINEERING & CONSTRUCTION	2,482	37,850.000	93,943,700.000	
	HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOLDIMGS CO LTD	863	328,500.000	283,495,500.000	
	BGF RETAIL CO LTD	631	188,500.000	118,943,500.000	
	ORION CORP REPUBLIC OF KOREA	2,506	86,100.000	215,766,600.000	
	ORANGE LIFE INSURANCE LTD	2,763	29,950.000	82,751,850.000	
	NETMARBLE CORP	2,531	94,100.000	238,167,100.000	
	WOORI FINANCIAL GROUP INC	43,879	13,650.000	598,948,350.000	
	SAMSUNG SDS CO LTD	3,225	212,000.000	683,700,000.000	
	SAMSUNG C&T CORP	7,422	91,300.000	677,628,600.000	
	SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	1,301	299,500.000	389,649,500.000	
	PEARL ABYSS CORP	534	199,000.000	106,266,000.000	
	DOOSAN BOBCAT INC	3,636	35,550.000	129,259,800.000	
	SILLAJEN INC	5,857	44,800.000	262,393,600.000	
	CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	3,789	52,800.000	200,059,200.000	
韓国・ウォン　小計		1,345,491		68,457,134,585.000 (6,304,902,095)	
香港・ドル	JIANGXI COPPER CO LTD	124,000	10.000	1,240,000.000	
	JIANGSU EXPRESS	124,000	10.880	1,349,120.000	
	CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD	220,000	5.420	1,192,400.000	
	ANGANG STEEL CO LTD-H	135,200	3.280	443,456.000	
	CHINA MOBILE LIMITED	544,500	70.150	38,196,675.000	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	102,000	47.900	4,885,800.000	
	DATANG INTERNATIONAL POWER GEN	430,000	1.890	812,700.000	
	BEIJING ENTERPRISES	43,000	39.950	1,717,850.000	
	HUANENG POWER INTERNATIONAL IN	328,000	4.690	1,538,320.000	

ALIBABA HEALTH INFORMATION TECHNOLOGY	356,000	7.380	2,627,280.000	
YANZHOU COAL MINING CO LTD	172,000	7.140	1,228,080.000	
HENGAN INTERNATIONAL GROUP	66,500	56.000	3,724,000.000	
HUADIAN POWER INTL CORP-H	144,000	3.060	440,640.000	
CHINA EASTERN AIRLINES CORP LT	124,000	4.560	565,440.000	
CNOOC LTD	1,591,000	13.140	20,905,740.000	
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	298,000	9.110	2,714,780.000	
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LTD	438,000	12.700	5,562,600.000	
CHINA OVERSEAS LAND & INVESTME	345,120	28.400	9,801,408.000	
CHINA RESOURCES LAND LTD	252,888	34.400	8,699,347.200	
CITIC LTD	508,000	10.860	5,516,880.000	
BEIJING CAPITAL INTERNATIONAL	162,000	6.740	1,091,880.000	
LENOVO GROUP LTD	666,000	6.120	4,075,920.000	
PETRO CHINA CO LTD	1,844,000	4.210	7,763,240.000	
CHINA UNICOM HONG KONG LTD	564,742	8.350	4,715,595.700	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS CO LTD	148,990	21.500	3,203,285.000	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL COR	2,251,200	5.100	11,481,120.000	
TONG REN TANG TECHNOLOGIES CO	86,000	9.360	804,960.000	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	72,000	16.240	1,169,280.000	
KINGDEE INTERNATIONAL SOFTWARE GROUP CO LTD	185,000	7.090	1,311,650.000	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	73,000	80.350	5,865,550.000	
KUNLUN ENERGY COMPANY LTD	312,000	7.120	2,221,440.000	
TOWNGAS CHINA CO LTD	91,000	6.170	561,470.000	
COSCO SHIPPING PORTS LTD	152,000	7.460	1,133,920.000	
YUEXIU PROPERTY CO LTD	634,000	1.870	1,185,580.000	
CHINA MERCHANTS PORT HOLDINGS CO LTD	130,000	13.400	1,742,000.000	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	374,000	2.580	964,920.000	
CHINA DING YI FENG HOLDINGS LTD	80,000	23.100	1,848,000.000	
SHENZHEN INTERNATIONAL HOLDING	81,000	15.160	1,227,960.000	
CHINA EVERBRIGHT LTD	78,000	11.660	909,480.000	

CHINA GAS HOLDINGS LTD	167,400	30.800	5,155,920.000	
KINGBOARD HOLDINGS LTD	63,500	19.560	1,242,060.000	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LTD	431,000	12.000	5,172,000.000	
SHENZHEN INVESTMENT LTD	414,000	2.910	1,204,740.000	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LTD	70,000	41.100	2,877,000.000	
BYD CO LTD	65,500	47.600	3,117,800.000	
CHINA TELECOM CORP LTD	1,234,000	3.820	4,713,880.000	
CHINA OILFIELD SERVICES LTD	134,000	8.020	1,074,680.000	
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	1,470,000	1.620	2,381,400.000	
SINOTRANS LTD	190,000	2.840	539,600.000	
MAANSHAN IRON & STEEL	172,000	2.960	509,120.000	
CHINA EVERBRIGHT INTERNATIONAL	337,592	7.460	2,518,436.320	
MMG LTD	220,000	2.490	547,800.000	
LEE & MAN PAPER MANUFACTURING LTD	136,000	5.280	718,080.000	
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	623,788	8.940	5,576,664.720	
AVICHINA INDUSTRY & TECHNOLOGY	189,000	4.400	831,600.000	
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS	159,200	11.320	1,802,144.000	
GREAT WALL MOTOR COMPANY LTD	246,000	5.810	1,429,260.000	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	679,000	19.500	13,240,500.000	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD	547,000	3.100	1,695,700.000	
CHINA ORIENTAL GROUP CO LTD	70,000	4.420	309,400.000	
SHANDONG WEIGAO GROUP MEDICAL-H	176,000	7.220	1,270,720.000	
SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	296,200	8.420	2,494,004.000	
WEICHAI POWER CO LTD	137,440	12.420	1,707,004.800	
CHINA SHIPPING DEVELOPMENT CO	100,000	4.400	440,000.000	
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEMICAL	287,000	2.950	846,650.000	
SHANGHAI INDUSTRIAL	58,000	16.820	975,560.000	
TINGYI HOLDING CORP	194,000	13.400	2,599,600.000	
TSINGTAO BREWERY CO LTD	40,000	48.450	1,938,000.000	
GUANGDONG INVESTMENTS LTD	266,000	16.160	4,298,560.000	

CHINA TRADITIONAL CHINESE MEDICINE HOLDINGS CO LTD	208,000	3.720	773,760.000	
CHINA RESOURCES BEER HOLDINGS	137,333	37.150	5,101,920.950	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO LTD	166,000	8.210	1,362,860.000	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	652,500	8.720	5,689,800.000	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	254,000	31.300	7,950,200.000	
TENCENT HOLDINGS LTD	511,900	356.800	182,645,920.000	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	493,500	93.450	46,117,575.000	
LI NING CO LTD	177,000	19.260	3,409,020.000	
BEIJING ENTERPRISES WATER GROUP LTD	554,000	4.660	2,581,640.000	
GOME RETAIL HOLDINGS LTD	970,240	0.820	795,596.800	
CHINA POWER INTERNATIONAL	350,000	1.980	693,000.000	
AIR CHINA / HONG KONG	164,000	7.850	1,287,400.000	
ZTE CORP	57,288	22.750	1,303,302.000	
SHANGHAI ELECTRIC GROUP CO LTD	250,000	2.750	687,500.000	
CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD	322,000	16.160	5,203,520.000	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO LTD	248,500	3.040	755,440.000	
BANK OF COMMUNICATIONS	704,205	5.860	4,126,641.300	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT HOLDINGS LTD	150,250	8.020	1,205,005.000	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	70,500	42.450	2,992,725.000	
CHINA CONSTRUCTION BANK	8,583,530	6.140	52,702,874.200	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP HOLDINGS LTD	69,800	105.900	7,391,820.000	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	232,000	6.510	1,510,320.000	
AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	120,000	10.680	1,281,600.000	
SSY GROUP LTD	104,000	6.970	724,880.000	
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS LTD	180,000	6.780	1,220,400.000	
CHINA NATIONAL BLDG MATERIAL	382,000	7.330	2,800,060.000	
BANK OF CHINA LTD	6,952,200	3.240	22,525,128.000	
SHUI ON LAND LTD	335,500	1.770	593,835.000	
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	111,000	23.250	2,580,750.000	
GUANGZHOU R&F PROPERTIES CO LTD	80,000	15.320	1,225,600.000	

CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	335,470	37.600	12,613,672.000	
IND & COMM BK OF CHINA - H	5,827,235	5.490	31,991,520.150	
ZHAOJIN MINING INDUSTRY CO LTD	96,000	8.510	816,960.000	
KINGBOARD LAMINATES HOLDING	104,000	6.320	657,280.000	
CHINA COMMUNICATIONS SERVICES	179,600	5.740	1,030,904.000	
CHINA COMMUNICATIONS CONSTRUCTION CO LTD	427,000	6.710	2,865,170.000	
CHINA COAL ENERGY CO	178,000	3.110	553,580.000	
HAITIAN INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	54,000	15.620	843,480.000	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC CO LTD	61,100	40.100	2,450,110.000	
HAIER ELECTRONICS GROUP CO LTD	130,000	21.650	2,814,500.000	
CHINA AGRI-INDUSTRIES HOLDINGS LTD	191,000	2.490	475,590.000	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD	697,142	11.380	7,933,475.960	
CHINA MOLYBDENUM CO LTD	369,000	2.330	859,770.000	
CHINA CITIC BANK-H	793,800	4.400	3,492,720.000	
KWG GROUP HOLDINGS LTD	121,000	8.000	968,000.000	
SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	66,900	82.500	5,519,250.000	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	92,000	50.800	4,673,600.000	
FOSUN INTERNATIONAL	243,028	10.540	2,561,515.120	
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP LTD	522,000	4.830	2,521,260.000	
CHINA AOYUAN PROPERTY GROUP LTD	111,000	10.760	1,194,360.000	
SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD	253,500	3.330	844,155.000	
SOHO CHINA LTD	172,500	2.780	479,550.000	
KINGSOFT CORP LTD	61,000	16.600	1,012,600.000	
SINOTRUK HONG KONG LTD	64,500	13.340	860,430.000	
CHINA RAILWAY GROUP LTD	288,000	5.730	1,650,240.000	
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS LTD	122,000	9.030	1,101,660.000	
BYD ELECTRONIC INTERNATIONAL CO LTD	52,500	10.700	561,750.000	
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION CORP	165,000	9.080	1,498,200.000	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	478,000	6.250	2,987,500.000	
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	223,200	29.900	6,673,680.000	

CHINA EVERGRANDE GROUP	153,000	22.100	3,381,300.000	
CRRC CORP LTD - H	342,450	6.370	2,181,406.500	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDINGS LTD	126,000	7.460	939,960.000	
SUN ART RETAIL GROUP LTD	211,500	7.410	1,567,215.000	
BBMG CORP	222,000	2.440	541,680.000	
CHINA ZHONGWANG HOLDINGS LTD	145,200	4.010	582,252.000	
SINOPHARM GROUP CO	115,600	27.050	3,126,980.000	
CHINA RESOURCES CEMENT	190,000	7.710	1,464,900.000	
METALLURGICAL CORP OF CHINA LTD	489,000	2.040	997,560.000	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD	294,527	8.210	2,418,066.670	
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	199,500	5.820	1,161,090.000	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL BANK	181,000	4.120	745,720.000	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP CORP	272,000	5.140	1,398,080.000	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD	48,200	15.260	735,532.000	
HUANENG RENEWABLES CORP LTD	330,000	2.200	726,000.000	
SIHUAN PHARMACEUTICAL HOLDINGS GROUP LTD	244,000	1.750	427,000.000	
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	225,000	37.500	8,437,500.000	
YUZHOU PROPERTIES CO LTD	166,000	3.660	607,560.000	
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	149,000	30.150	4,492,350.000	
NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	80,000	36.750	2,940,000.000	
CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	555,656	5.380	2,989,429.280	
KAISA GROUP HOLDINGS LTD	203,000	3.650	740,950.000	
XINJIANG GOLDWIND SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	55,200	9.400	518,880.000	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD	322,000	3.550	1,143,100.000	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA	2,567,000	3.230	8,291,410.000	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS LTD	39,500	20.700	817,650.000	
FAR EAST HORIZON LTD	229,000	7.730	1,770,170.000	
CITIC SECURITIES CO LTD	201,500	15.440	3,111,160.000	
FUTURE LAND DEVELOPMENT HOLDINGS LTD	132,000	7.030	927,960.000	
HAITONG SECURITIES CO LTD	325,200	8.380	2,725,176.000	

PEOPLE'S INSURANCE CO GROUP OF CHINA LTD	629,000	3.130	1,968,770.000	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	31,000	24.350	754,850.000	
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	262,000	5.470	1,433,140.000	
SINOPEC ENGINEERING GROUP CO LTD	121,500	6.530	793,395.000	
CHINA GALAXY SECURITIES CO LTD	392,000	4.450	1,744,400.000	
HANERGY THIN FILM POWER GROUP	986,000	0.000	0.000	
NEXTEER AUTOMOTIVE GROUP LTD	85,000	9.300	790,500.000	
CHINA HUISHAN DAIRY HOLDINGS CO LTD	323,000	0.000	0.000	
GREENTOWN SERVICE GROUP CO LTD	96,000	6.500	624,000.000	
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO LTD	59,800	13.100	783,380.000	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA CO LTD	634,000	4.680	2,967,120.000	
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING LTD	35,000	45.000	1,575,000.000	
GENSCRIPT BIOTECH CORP	74,000	19.600	1,450,400.000	
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLDINGS CO LTD	93,000	18.740	1,742,820.000	
CHINA FIRST CAPITAL GROUP LTD	308,000	2.400	739,200.000	
CHINA EDUCATION GROUP HOLDINGS LTD	65,000	12.020	781,300.000	
CHINA TOWER CORP LTD	3,836,000	2.130	8,170,680.000	
XIAOMI CORP	330,200	9.590	3,166,618.000	
WUXI APPTEC CO LTD	16,100	69.500	1,118,950.000	
MEITUAN DIANPING	92,200	67.450	6,218,890.000	
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	276,000	3.750	1,035,000.000	
CHINA CINDA ASSET MANAGEMENT CO LTD	796,000	1.760	1,400,960.000	
LOGAN PROPERTY HOLDINGS CO LTD	102,000	12.880	1,313,760.000	
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS LTD	159,000	27.300	4,340,700.000	
CHINA VANKE CO LTD-H	121,061	30.850	3,734,731.850	
LUYE PHARMA GROUP LTD	108,000	5.780	624,240.000	
HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	39,000	14.160	552,240.000	
CGN POWER CO LTD	749,000	2.210	1,655,290.000	
FULLSHARE HOLDINGS LTD	490,000	0.310	151,900.000	
BAIC MOTOR CORP LTD	163,500	5.060	827,310.000	

	GF SECURITIES CO LTD	112,000	9.050	1,013,600.000	
	FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD	60,400	24.600	1,485,840.000	
	HUATAI SECURITIES CO LTD	124,800	13.220	1,649,856.000	
	3SBIO INC	109,500	14.160	1,550,520.000	
	LEGEND HOLDINGS CORP	31,500	17.900	563,850.000	
	CHINA RESOURCES PHARMACEUTICAL GROUP LTD	133,000	8.840	1,175,720.000	
	CHINA HUARONG ASSET MANAGEMENT CO LTD	904,000	1.350	1,220,400.000	
	CHINA LITERATURE LTD	24,000	37.200	892,800.000	
	DALI FOODS GROUP CO LTD	188,000	5.090	956,920.000	
	CHINA RAILWAY SIGNAL & COMMUNICATION CORP LTD	141,000	5.840	823,440.000	
	CHINA REINSURANCE GROUP CORP	525,000	1.370	719,250.000	
	MEITU INC	152,500	2.170	330,925.000	
	BOC AVIATION LTD	21,900	65.950	1,444,305.000	
	ZHONGAN ONLINE P&C INSURANCE CO LTD	23,000	20.250	465,750.000	
	CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CORP LTD	96,000	15.300	1,468,800.000	
	WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	48,500	73.600	3,569,600.000	
	HENGTEN NETWORKS GROUP LTD	2,096,000	0.173	362,608.000	
香港・ドル　小計		84,652,975		847,475,992.520 (11,729,067,736)	
台湾・ドル	ACER INC	220,532	19.250	4,245,241.000	
	ASUSTEK COMPUTER INC	64,554	215.500	13,911,387.000	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	46,616	219.000	10,208,904.000	
	ASIA CEMENT CORP	164,928	48.500	7,999,008.000	
	WALSIN TECHNOLOGY CORP	24,000	172.000	4,128,000.000	
	TAIWAN BUSINESS BANK	286,457	13.450	3,852,846.650	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMICONDUCTOR CORP	66,000	61.000	4,026,000.000	
	MICRO-STAR INTERNATIONAL CO LTD	51,000	89.800	4,579,800.000	
	CHICONY ELECTRONICS CO LTD	54,975	78.000	4,288,050.000	
	QUANTA COMPUTER INC	245,858	60.900	14,972,752.200	
	HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	58,070	49.550	2,877,368.500	
	EVA AIRWAYS CORP	196,269	14.950	2,934,221.550	
	CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	61,760	234.000	14,451,840.000	
	CHANG HWA COMMERCIAL BANK	571,345	21.150	12,083,946.750	
	CHINA AIRLINES	232,156	9.860	2,289,058.160	

CHENG SHIN RUBBER INDUSTRY CO	161,169	40.250	6,487,052.250	
CHINA STEEL CORP	1,074,058	24.850	26,690,341.300	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD/TAIWAN	278,994	25.700	7,170,145.800	
ADVANTECH CO LTD	29,889	258.000	7,711,362.000	
COMPAL ELECTRONICS INC	423,304	20.250	8,571,906.000	
DELTA ELECTRONICS INC	176,663	151.500	26,764,444.500	
NANYA TECHNOLOGY CORP	114,000	64.400	7,341,600.000	
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	324,327	113.500	36,811,114.500	
AU OPTRONICS CORP	742,194	9.300	6,902,404.200	
TAIWAN MOBILE CO LTD	140,800	113.500	15,980,800.000	
EVERGREEN MARINE CORP	198,276	13.450	2,666,812.200	
FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	319,824	33.900	10,842,033.600	
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	24,825	249.000	6,181,425.000	
ECLAT TEXTILE CO LTD	15,322	398.000	6,098,156.000	
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	56,285	175.000	9,849,875.000	
FORMOSA PLASTICS CORP	401,633	103.000	41,368,199.000	
FORMOSA TAFFETA CO LTD	60,000	38.800	2,328,000.000	
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE CO	318,594	98.700	31,445,227.800	
GIANT MANUFACTURING	24,151	241.500	5,832,466.500	
MEDIATEK INC	136,507	318.000	43,409,226.000	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD	601,936	44.300	26,665,764.800	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	720,232	21.000	15,124,872.000	
HOTAI MOTOR CO LTD	26,000	502.000	13,052,000.000	
FAR EASTONE TELECOMMUNICATIONS CO LTD	155,000	77.000	11,935,000.000	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	953,141	18.000	17,156,538.000	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	652,920	42.200	27,553,224.000	
CHINA DEPT FINANCIAL HOLDING	1,301,403	9.290	12,090,033.870	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO LTD	849,168	26.500	22,502,952.000	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	1,115,225	77.900	86,876,027.500	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LTD	924,495	31.600	29,214,042.000	
LARGAN PRECISION CO LTD	8,220	4,155.000	34,154,100.000	
TAISHIN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	769,589	14.400	11,082,081.600	

SHIN KONG FINANCIAL HOLDING CO	1,071,061	9.500	10,175,079.500	
INVENTEC CO LTD	206,005	25.500	5,253,127.500	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	184,845	46.700	8,632,261.500	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	1,013,443	13.000	13,174,759.000	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,667,048	21.750	36,258,294.000	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO LTD	908,220	22.850	20,752,827.000	
POWERTECH TECHNOLOGY INC	61,560	79.200	4,875,552.000	
NAN YA PLASTICS CORP	466,828	72.300	33,751,664.400	
WISTRON CORP	213,916	24.750	5,294,421.000	
POU CHEN CORP	180,990	38.200	6,913,818.000	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CORP	443,297	82.000	36,350,354.000	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	52,392	302.000	15,822,384.000	
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	113,480	107.000	12,142,360.000	
PHISON ELECTRONICS CORP	12,658	320.000	4,050,560.000	
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	73,393	42.550	3,122,872.150	
RUENTEX INDUSTRIES LTD	33,829	68.800	2,327,435.200	
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	103,588	64.200	6,650,349.600	
STANDARD FOODS CORP	34,639	61.600	2,133,762.400	
SYNNEX TECHNOLOGY INTERNATIONAL CORP	116,899	39.200	4,582,440.800	
TAIWAN CEMENT CORP	421,561	45.850	19,328,571.850	
TATUNG CO LTD	164,000	18.950	3,107,800.000	
TAIWAN SEMICONDUCTOR	2,200,083	247.000	543,420,501.000	
UNITED MICROELECTRONICS CORP	1,118,525	14.650	16,386,391.250	
WINBOND ELECTRONICS CORP	219,000	16.850	3,690,150.000	
YAGEO CORP	20,160	269.000	5,423,040.000	
TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	163,000	44.750	7,294,250.000	
INNOLUX CORPORATION	666,345	7.330	4,884,308.850	
WPG HOLDINGS CO LTD	109,203	41.250	4,504,623.750	
HIWIN TECHNOLOGIES CORP	19,073	266.500	5,082,954.500	
TAIMED BIOLOGICS INC	18,000	161.500	2,907,000.000	
PEGATRON CORP	186,554	54.700	10,204,503.800	
AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	9,000	342.500	3,082,500.000	
WIN SEMICONDUCTORS CORP	31,000	222.000	6,882,000.000	
CHAILEASE HOLDING CO LTD	109,737	136.500	14,979,100.500	
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING LTD	31,385	100.500	3,154,192.500	

	TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL HOLDING	828,412	20.750	17,189,549.000	
	SHANGHAI COMMERCIAL & SAVINGS BANK LTD	290,000	57.200	16,588,000.000	
	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	320,903	66.100	21,211,688.300	
	GLOBALWAFERS CO LTD	19,000	335.000	6,365,000.000	
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	15,000	251.500	3,772,500.000	
台湾・ドル　小計		29,360,696		1,676,430,598.580 (5,817,214,176)	
南アフリカ・ランド	BIDVEST GROUP LTD	26,406	194.000	5,122,764.000	
	CLICKS GROUP LTD	23,124	209.240	4,838,465.760	
	TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	37,135	66.410	2,466,135.350	
	DISCOVERY LTD	35,409	145.730	5,160,153.570	
	REDEFINE PROPERTIES LTD	554,792	9.040	5,015,319.680	
	GOLD FIELDS LTD	69,936	77.050	5,388,568.800	
	REMGRO LTD	49,611	188.580	9,355,642.380	
	THE FOSCHINI GROUP LTD	23,348	180.250	4,208,477.000	
	MOMENTUM METROPOLITAN HOLDINGS LTD	80,877	18.080	1,462,256.160	
	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	258,736	24.580	6,359,730.880	
	EXXARO RESOURCES LTD	19,729	168.330	3,320,982.570	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	3,983	1,264.920	5,038,176.360	
	LIBERTY HOLDINGS LTD	11,438	106.100	1,213,571.800	
	MTN GROUP LTD	153,349	103.650	15,894,623.850	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	40,450	255.800	10,347,110.000	
	TELKOM SA SOC LTD	22,080	87.900	1,940,832.000	
	FIRSTRAND LTD	301,650	65.510	19,761,091.500	
	PSG GROUP LTD	11,126	243.680	2,711,183.680	
	NASPERS LTD	39,254	3,471.100	136,254,559.400	
	NEDBANK GROUP LTD	31,059	244.250	7,586,160.750	
	NETCARE LTD	85,575	17.190	1,471,034.250	
	PICK'N PAY STORES LTD	31,255	66.500	2,078,457.500	
	RMB HOLDINGS LTD	75,870	81.900	6,213,753.000	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	5,042	809.000	4,078,978.000	
	SAPPI LTD	45,640	51.040	2,329,465.600	
	SASOL LTD	51,184	336.420	17,219,321.280	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	40,773	155.050	6,321,853.650	
	MR PRICE GROUP LTD	24,787	193.120	4,786,865.440	
	STANDARD BANK GROUP LTD	115,773	189.250	21,910,040.250	
	SPAR GROUP LTD/THE	18,051	188.180	3,396,837.180	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	102,426	49.090	5,028,092.340	

	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LTD	28,788	105.000	3,022,740.000	
	ABSA GROUP LTD	66,088	168.810	11,156,315.280	
	TIGER BRANDS LTD	15,965	229.970	3,671,471.050	
	SANLAM LTD	162,753	77.110	12,549,883.830	
	INVESTEC LTD	21,242	88.950	1,889,475.900	
	KUMBA IRON ORE LTD	5,327	479.560	2,554,616.120	
	MONDI LTD	12,308	304.400	3,746,555.200	
	LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDINGS LTD	110,531	22.450	2,481,420.950	
	RMI HOLDINGS	55,570	33.380	1,854,926.600	
	VODACOM GROUP PTY LTD	59,032	115.930	6,843,579.760	
	NEPI ROCKCASTLE PLC	28,593	132.420	3,786,285.060	
	OLD MUTUAL LTD	452,416	21.550	9,749,564.800	
	REINET INVESTMENTS SCA	11,346	236.000	2,677,656.000	
	MULTICHOICE GROUP LTD	35,091	135.450	4,753,075.950	
	FORTRESS REIT LTD-A	135,465	21.510	2,913,852.150	
	BID CORP LTD	30,877	306.940	9,477,386.380	
南アフリカ・ランド　小計		3,621,260		411,409,309.010 (3,184,308,051)	
合計		228,254,437		52,334,255,994 (52,334,255,994)	

（２）株式以外の有価証券

令和1年7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・バーツ	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	59,033.000	122,788.640	
		MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	9,465.000	52,057.500	
	タイ・バーツ　小計		68,498.000	174,846.140 (617,207)	
新株予約権証券　合計			68,498	617,207 (617,207)	
投資信託受益証券	アメリカ・ドル	ISHARES MSCI SAUDI ARABIA CAPPED UCITS ETF	1,435,616.000	7,035,954.010	
	アメリカ・ドル　小計		1,435,616.000	7,035,954.010 (761,290,224)	
	メキシコ・ペソ	CEMEX SAB DE CV	1,429,775.000	10,823,396.750	
		FOMENTO ECONOMICO MEXICANO SAB DE CV	173,400.000	32,229,858.000	
	メキシコ・ペソ　小計		1,603,175.000	43,053,254.750 (243,681,422)	
投資信託受益証券　合計			3,038,791	1,004,971,646 (1,004,971,646)	
投資証券	メキシコ・ペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	258,400.000	6,467,752.000	
	メキシコ・ペソ　小計		258,400.000	6,467,752.000 (36,607,477)	
投資証券　合計			258,400	36,607,477 (36,607,477)	
合計				1,042,196,330 (1,042,196,330)	

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

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

通貨	銘柄数	組入株式時価比率	組入新株予約権証券時価比率	組入投資信託受益証券時価比率	組入投資証券時価比率	有価証券の合計金額に対する比率
アメリカ・ドル	株式 59銘柄 投資信託受益証券 1銘柄	11.55% -%	-% -%	-% 1.29%	-% -%	14.17%
アラブ首長国連邦・ディルハム	株式 8銘柄	0.61%	-%	-%	-%	0.67%
イギリス・ポンド	株式 1銘柄	0.05%	-%	-%	-%	0.06%
インド・ルピー	株式 79銘柄	8.07%	-%	-%	-%	8.91%
インドネシア・ルピア	株式 27銘柄	1.96%	-%	-%	-%	2.16%
オフショア・人民元	株式 69銘柄	1.51%	-%	-%	-%	1.67%
カタール・リアル	株式 11銘柄	0.90%	-%	-%	-%	0.99%
コロンビア・ペソ	株式 9銘柄	0.41%	-%	-%	-%	0.45%
タイ・バーツ	株式 37銘柄 新株予約権証券 2銘柄	2.72% -%	-% 0.00%	-% -%	-% -%	3.00%
チェコ・コルナ	株式 3銘柄	0.13%	-%	-%	-%	0.15%
チリ・ペソ	株式 18銘柄	0.84%	-%	-%	-%	0.92%
トルコ・リラ	株式 16銘柄	0.48%	-%	-%	-%	0.53%
ハンガリー・フォリント	株式 3銘柄	0.26%	-%	-%	-%	0.29%
パキスタン・ルピー	株式 3銘柄	0.03%	-%	-%	-%	0.03%
フィリピン・ペソ	株式 23銘柄	1.02%	-%	-%	-%	1.13%
ブラジル・レアル	株式 55銘柄	7.40%	-%	-%	-%	8.16%
ポーランド・ズロチ	株式 19銘柄	0.99%	-%	-%	-%	1.09%
マレーシア・リンギット	株式 43銘柄	1.93%	-%	-%	-%	2.14%
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	1.82% -% -%	-% -% -%	-% 0.41% -%	-% -% 0.06%	2.53%
ユーロ	株式 9銘柄	0.28%	-%	-%	-%	0.30%
韓国・ウォン	株式 113銘柄	10.70%	-%	-%	-%	11.81%
香港・ドル	株式 206銘柄	19.91%	-%	-%	-%	21.97%
台湾・ドル	株式 87銘柄	9.87%	-%	-%	-%	10.90%
南アフリカ・ランド	株式 47銘柄	5.41%	-%	-%	-%	5.97%

(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	国債証券 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。
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。
３．	その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	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。

（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	59,857,001,615円	52,757,465,400円
	同期中追加設定元本額	46,706,860,967円	31,334,577,861円
	同期中一部解約元本額	53,806,397,182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	454,825円	512,806円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	3,446,924,591円	3,565,443,159円
ワールドアセットバランス（基本コース）	1,129,715,395円	951,156,570円
ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）	2,262,347,925円	3,697,617,320円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	2,617,018円	4,639,943円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	2,029,113円	3,925,139円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	1,240,199円	1,852,291円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	4,146,714円	8,241,094円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	779,406,995円	648,733,942円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	13,655円	22,145,866円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	－円	790,977円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	－円	790,977円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー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

ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド２ＶＡ（適格機関投資家限定）	4,245,286,325円	1,963,944,077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）	4,605,400,717円	2,854,291,863円
ＤＩＡＭグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンド（適格機関投資家限定）	4,132,286,126円	3,998,328,626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）	2,192,663,196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）	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）

１．金融商品の状況に関する事項

項目	自　平成30年7月12日 至　平成31年1月11日	自　平成31年1月12日 至　令和1年7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 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	平成31年1月11日現在	令和1年7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	432,798,496	3,585,610,370
合計	432,798,496	3,585,610,370

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（平成30年4月19日から平成31年1月11日まで及び平成31年4月19日から令和1年7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。

①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。

②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)

附属明細表

第１　有価証券明細表

（１）株式

該当事項はありません。

（２）株式以外の有価証券

令和1年7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	7,800,000.000	7,776,600.000	
		BRAZIL 4.25 01/07/25	13,100,000.000	13,836,875.000	
		BRAZIL 4.625 01/13/28	9,800,000.000	10,400,250.000	
		BRAZIL 4.875 01/22/21	9,400,000.000	9,776,094.000	
		BRAZIL 5.0 01/27/45	10,800,000.000	10,847,304.000	
		BRAZIL 5.625 01/07/41	8,100,000.000	8,808,831.000	
		BRAZIL 5.625 02/21/47	9,600,000.000	10,422,048.000	
		BRAZIL 6.0 04/07/26	5,800,000.000	6,707,700.000	
		BRAZIL 7.125 01/20/37	5,300,000.000	6,651,553.000	
		BRAZIL 8.25 01/20/34	6,200,000.000	8,316,680.000	
		BRAZIL 8.75 02/04/25	2,800,000.000	3,509,800.000	
		COLOMBIA 2.625 03/15/23	3,700,000.000	3,686,162.000	
		COLOMBIA 3.875 04/25/27	7,600,000.000	7,938,732.000	
		COLOMBIA 4.0 02/26/24	6,100,000.000	6,406,586.000	
		COLOMBIA 4.375 07/12/21	6,200,000.000	6,431,012.000	
		COLOMBIA 4.5 01/28/26	4,000,000.000	4,327,480.000	
		COLOMBIA 4.5 03/15/29	5,000,000.000	5,482,500.000	
		COLOMBIA 5.0 06/15/45	14,000,000.000	15,575,000.000	
		COLOMBIA 5.625 02/26/44	7,000,000.000	8,369,340.000	
		COLOMBIA 6.125 01/18/41	8,000,000.000	10,000,080.000	
		COLOMBIA 7.375 09/18/37	5,400,000.000	7,418,304.000	
		COLOMBIA 8.125 05/21/24	3,900,000.000	4,787,835.000	
		CROATIA 5.5 04/04/23	7,400,000.000	8,180,256.000	
		CROATIA 6.0 01/26/24	7,400,000.000	8,490,316.000	
		CROATIA 6.375 03/24/21	7,400,000.000	7,821,800.000	
		HUNGARY 5.375 02/21/23	7,600,000.000	8,366,612.000	
		HUNGARY 5.375 03/25/24	7,600,000.000	8,564,972.000	
		HUNGARY 5.75 11/22/23	7,000,000.000	7,933,450.000	
		HUNGARY 6.375 03/29/21	12,000,000.000	12,784,080.000	
		HUNGARY 7.625 03/29/41	4,400,000.000	7,028,032.000	
		INDONESIA 2.95 01/11/23	3,800,000.000	3,831,768.000	
		INDONESIA 3.375 04/15/23	4,700,000.000	4,793,436.000	
		INDONESIA 3.5 01/11/28	3,200,000.000	3,247,328.000	
		INDONESIA 3.75 04/25/22	6,000,000.000	6,169,380.000	
		INDONESIA 3.85 07/18/27	2,600,000.000	2,695,368.000	
		INDONESIA 4.1 04/24/28	3,000,000.000	3,182,670.000	
		INDONESIA 4.125 01/15/25	6,800,000.000	7,173,252.000	
		INDONESIA 4.35 01/08/27	5,000,000.000	5,351,500.000	
		INDONESIA 4.35 01/11/48	5,400,000.000	5,601,042.000	
		INDONESIA 4.625 04/15/43	5,400,000.000	5,735,070.000	

		INDONESIA 4.75 01/08/26	6,800,000.000	7,428,932.000	
		INDONESIA 4.875 05/05/21	10,100,000.000	10,503,899.000	
		INDONESIA 5.125 01/15/45	4,400,000.000	4,975,256.000	
		INDONESIA 5.25 01/08/47	4,400,000.000	5,086,048.000	
		INDONESIA 5.25 01/17/42	5,300,000.000	6,040,675.000	
		INDONESIA 5.875 01/15/24	6,200,000.000	6,949,270.000	
		INDONESIA 5.95 01/08/46	4,200,000.000	5,301,954.000	
		INDONESIA 6.75 01/15/44	4,500,000.000	6,153,885.000	
		INDONESIA 7.75 01/17/38	6,500,000.000	9,388,730.000	
		PANAMA 3.75 03/16/25	4,200,000.000	4,433,142.000	
		PANAMA 3.875 03/17/28	4,100,000.000	4,389,583.000	
		PANAMA 4.5 04/16/50	6,300,000.000	7,098,399.000	
		PANAMA 4.5 05/15/47	4,000,000.000	4,526,640.000	
		PANAMA 6.7 01/26/36	6,900,000.000	9,391,590.000	
		PANAMA 7.125 01/29/26	3,800,000.000	4,749,050.000	
		PANAMA 9.375 04/01/29	3,900,000.000	5,874,414.000	
		PERU 4.125 08/25/27	5,300,000.000	5,924,075.000	
		PERU 5.625 11/18/50	11,000,000.000	15,298,690.000	
		PERU 6.55 03/14/37	5,000,000.000	7,084,000.000	
		PERU 7.35 07/21/25	8,300,000.000	10,569,220.000	
		PHILIPPINES 3.0 02/01/28	6,000,000.000	6,186,420.000	
		PHILIPPINES 3.7 02/02/42	6,400,000.000	6,935,168.000	
		PHILIPPINES 3.7 03/01/41	6,600,000.000	7,147,338.000	
		PHILIPPINES 3.95 01/20/40	5,800,000.000	6,481,326.000	
		PHILIPPINES 4.0 01/15/21	5,400,000.000	5,526,414.000	
		PHILIPPINES 4.2 01/21/24	5,800,000.000	6,246,310.000	
		PHILIPPINES 5.0 01/13/37	3,800,000.000	4,777,626.000	
		PHILIPPINES 5.5 03/30/26	3,600,000.000	4,258,044.000	
		PHILIPPINES 6.375 01/15/32	3,600,000.000	4,862,268.000	
		PHILIPPINES 6.375 10/23/34	6,000,000.000	8,368,980.000	
		PHILIPPINES 7.75 01/14/31	6,100,000.000	8,985,300.000	
		PHILIPPINES 9.5 02/02/30	6,400,000.000	10,267,712.000	
		ROMANIA 4.375 08/22/23	6,000,000.000	6,357,060.000	
		ROMANIA 4.875 01/22/24	3,600,000.000	3,886,308.000	
		ROMANIA 5.125 06/15/48	5,600,000.000	6,180,384.000	
		ROMANIA 6.125 01/22/44	4,400,000.000	5,547,036.000	
		ROMANIA 6.75 02/07/22	11,500,000.000	12,628,495.000	
		RUSSIAN FEDERATION 03/31/30	10,800,000.000	12,199,356.000	
		RUSSIAN FEDERATION 4.25 06/23/27	6,400,000.000	6,595,008.000	
		RUSSIAN FEDERATION 4.375 03/21/29	5,400,000.000	5,626,584.000	
		RUSSIAN FEDERATION 4.5 04/04/22	8,800,000.000	9,170,832.000	

		RUSSIAN FEDERATION 4.75 05/27/26	10,400,000.000	11,073,816.000	
		RUSSIAN FEDERATION 4.875 09/16/23	8,400,000.000	8,984,976.000	
		RUSSIAN FEDERATION 5.25 06/23/47	21,000,000.000	23,360,400.000	
		RUSSIAN FEDERATION 5.625 04/04/42	9,800,000.000	11,567,234.000	
		RUSSIAN FEDERATION 5.875 09/16/43	4,200,000.000	5,126,688.000	
		SOUTH AFRICA 4.3 10/12/28	7,200,000.000	7,044,624.000	
		SOUTH AFRICA 4.665 01/17/24	6,100,000.000	6,373,097.000	
		SOUTH AFRICA 4.875 04/14/26	4,400,000.000	4,544,628.000	
		SOUTH AFRICA 5.0 10/12/46	3,800,000.000	3,634,206.000	
		SOUTH AFRICA 5.375 07/24/44	3,800,000.000	3,795,782.000	
		SOUTH AFRICA 5.65 09/27/47	5,200,000.000	5,281,276.000	
		SOUTH AFRICA 5.875 05/30/22	4,000,000.000	4,286,760.000	
		SOUTH AFRICA 5.875 06/22/30	5,400,000.000	5,842,422.000	
		SOUTH AFRICA 5.875 09/16/25	7,200,000.000	7,874,640.000	
		SOUTH AFRICA 6.3 06/22/48	2,000,000.000	2,175,200.000	
		UNITED MEXICAN STATES 3.5 01/21/21	4,400,000.000	4,465,428.000	
		UNITED MEXICAN STATES 3.6 01/30/25	7,200,000.000	7,369,200.000	
		UNITED MEXICAN STATES 3.625 03/15/22	6,900,000.000	7,081,125.000	
		UNITED MEXICAN STATES 3.75 01/11/28	7,200,000.000	7,302,600.000	
		UNITED MEXICAN STATES 4.0 10/02/23	9,500,000.000	9,930,065.000	
		UNITED MEXICAN STATES 4.125 01/21/26	8,000,000.000	8,366,000.000	
		UNITED MEXICAN STATES 4.15 03/28/27	8,400,000.000	8,769,600.000	
		UNITED MEXICAN STATES 4.35 01/15/47	5,000,000.000	4,920,000.000	
		UNITED MEXICAN STATES 4.6 01/23/46	8,000,000.000	8,124,080.000	
		UNITED MEXICAN STATES 4.6 02/10/48	8,400,000.000	8,610,000.000	

		UNITED MEXICAN STATES 4.75 03/08/44	11,400,000.000	11,810,514.000	
		UNITED MEXICAN STATES 5.55 01/21/45	8,400,000.000	9,765,000.000	
		UNITED MEXICAN STATES 5.75 10/12/2110	6,800,000.000	7,429,000.000	
		UNITED MEXICAN STATES 6.05 01/11/40	9,900,000.000	11,880,000.000	
		UNITED MEXICAN STATES 6.75 09/27/34	4,200,000.000	5,339,880.000	
	アメリカ・ドル　小計		726,100,000.000 (78,564,020,000)	815,956,760.000 (88,286,521,432)	
国債証券　合計			78,564,020,000 (78,564,020,000)	88,286,521,432 (88,286,521,432)	
合計			78,564,020,000 (78,564,020,000)	88,286,521,432 (88,286,521,432)	

（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	97.22%	100%

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

２【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

令和1年7月31日現在

Ⅰ　資産総額	22,709,871,830円
Ⅱ　負債総額	53,473,443円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	22,656,398,387円
Ⅳ　発行済数量	18,464,385,084口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.2270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

Ⅰ　資産総額	256,591,857,178円
Ⅱ　負債総額	1,322,533,334円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	255,269,323,844円
Ⅳ　発行済数量	104,231,793,484口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	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

Ⅰ　資産総額	281,222,540,462円
Ⅱ　負債総額	2,282,232,000円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	278,940,308,462円
Ⅳ　発行済数量	210,079,437,875口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.3278円

ＤＩＡＭマネーマザーファンド

令和1年7月31日現在

Ⅰ　資産総額	1,170,773,510円
Ⅱ　負債総額	0円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	1,170,773,510円
Ⅳ　発行済数量	1,159,298,220口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.0099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

Ⅰ　資産総額	350,136,019,620円
Ⅱ　負債総額	702,307,178円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	349,433,712,442円
Ⅳ　発行済数量	94,290,034,594口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	3.7059円

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

Ⅰ　資産総額	**176,845,621,692円**
Ⅱ　負債総額	**809,056,000円**
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	**176,036,565,692円**
Ⅳ　発行済数量	**94,937,088,165口**
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	**1.8542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

Ⅰ　資産総額	**59,271,153,370円**
Ⅱ　負債総額	**297,774,325円**
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	**58,973,379,045円**
Ⅳ　発行済数量	**51,603,318,141口**
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	**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

Ⅰ　資産総額	**98,920,546,990円**
Ⅱ　負債総額	**4,300,019,080円**
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	**94,620,527,910円**
Ⅳ　発行済数量	**47,897,528,370口**
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	**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。

①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。

②上記①の申請のある場合には、上記①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①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。

③上記①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たときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

(5)受益権の譲渡の対抗要件

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

(6)受益権の再分割

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

(7)質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

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

第二部【委託会社等の情報】

第１【委託会社等の概況】

１【委託会社等の概況】

（1）資本金の額（2019年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）

① 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。

② 投資運用の意思決定機構

1.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。

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		1,643,826		1,461,316
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		1,934,700		2,411,540
ソフトウエア		1,026,319		885,545
ソフトウエア仮勘定		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		8,270,313		9,269,808
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
	利益剰余金合計	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	
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	(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 (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
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	(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。 (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エアについては、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。
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	(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。 (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。 (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。 ①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。 ②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。 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。 (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。 (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。
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
ソフトウエア	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おります。

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

（2）金融商品の内容及びそのリスク

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

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

営業債務である未払手数料は、１年以内の支払期日であります。

（3）金融商品に係るリスク管理体制

①信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

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

②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。

③資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

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

（4）金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。
なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは含まれておりません（（注2）参照）。

第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			
その他有価証券	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			
その他有価証券	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）
①非上場株式	272,464	276,764
②関係会社株式	3,229,196	4,499,196

①非上場株式は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券」には含めておりません。
②関係会社株式は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載しておりません。

（注3）金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第33期（2018年3月31日現在）

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

第34期（2019年3月31日現在）

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

（有価証券関係）

1．子会社株式及び関連会社株式

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

2．その他有価証券

第33期（2018年3月31日現在）

（千円）

区分	貸借対照表日における貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
①株式	1,267,157	146,101	1,121,055
②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			
①株式	－	－	－
②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			
①株式	1,326,372	111,223	1,215,148
②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			
①株式	－	－	－
②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 (2018年3月31日現在)	第34期 (2019年3月31日現在)
繰延税金資産	（千円）	（千円）
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

①MHAM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、②TB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、③DIAM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」③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」③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A種種類株式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」③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」①の吸収合併及び②の吸収分割については共通支配下の取引として処理し、③の吸収合併については逆取得として処理しております。

11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

（1）被取得企業の取得原価及びその内訳

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

（2）発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

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

（3）企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

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

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

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

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

12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

（1）貸借対照表項目

	第33期（2018年3月31日現在）	第34期（2019年3月31日現在）
流動資産	－千円	－千円
固定資産	114,270,495千円	104,326,078千円
資産合計	114,270,495千円	104,326,078千円
流動負債	－千円	－千円
固定負債	13,059,836千円	10,571,428千円
負債合計	13,059,836千円	10,571,428千円
純資産	101,210,659千円	93,754,650千円
（注）固定資産及び資産合計には、のれん及び顧客関連資産の金額が含まれております。		
のれん	70,507,975千円	66,696,733千円
顧客関連資産	45,200,838千円	39,959,586千円

（2）損益計算書項目

	第33期（自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日）	第34期（自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日）
営業収益	－千円	－千円
営業利益	△9,012,128千円	△9,043,138千円
経常利益	△9,012,128千円	△9,043,138千円
税引前当期純利益	△9,012,128千円	△9,091,728千円
当期純利益	△7,419,617千円	△7,489,721千円
1株当たり当期純利益	△185,490円43銭	△187,243円04銭
（注）営業利益には、のれん及び顧客関連資産の償却額が含まれております。		
のれんの償却額	3,811,241千円	3,811,241千円
顧客関連資産の償却額	5,233,360千円	5,241,252千円

（資産除去債務関係）

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

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

（セグメント情報等）

1. セグメント情報

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

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

（1）サービスごとの情報

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

（2）地域ごとの情報

①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。

②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) 通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下（4）（5）において同じ。）または子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引または店頭デリバティブ取引を行うこと。

(4) 委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。

(5) 上記（3）（4）に掲げるもののほか、委託会社の親法人等または子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

５【その他】

(1) 定款の変更、事業譲渡又は事業譲受、出資の状況その他の重要事項

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

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

(2) 訴訟事件その他の重要事項

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

第２【その他の関係法人の概況】

１【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

ａ．名称

みずほ信託銀行株式会社

ｂ．資本金の額

2019年3月末現在　　247,369百万円

ｃ．事業の内容

日本において銀行業務および信託業務を営んでいます。

(2) 販売会社

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

名　　称	資本金の額 (単位:百万円)	事 業 の 内 容
株式会社東北銀行	13,233	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社東邦銀行（※1）	23,519	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社群馬銀行	48,652	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。
株式会社北陸銀行	140,409	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社富山銀行	6,730	日本において銀行業務を営んでおります。
スルガ銀行株式会社	30,043	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社大垣共立銀行	46,773	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社池田泉州銀行	61,385	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社紀陽銀行	80,096	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社広島銀行	54,573	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社阿波銀行	23,452	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社伊予銀行	20,948	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社十八銀行	24,404	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社親和銀行	36,878	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。
株式会社鹿児島銀行	18,130	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社きらやか銀行	22,700	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社仙台銀行	22,485	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社東和銀行	38,653	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社神奈川銀行	5,191	日本において銀行業務を営んでおります。
信金中央金庫	（※2）690,998	日本において全国の信用金庫の中央金融機関として、信用金庫の余裕資金の効率運用と信用金庫間の資金の受給調整、信用金庫業界の信用力の維持向上および業務機能の補完を図っています。
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。
藍澤證券株式会社	8,000	「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。
カブドットコム証券株式会社	7,196	「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。
池田泉州ＴＴ証券株式会社	1,250	「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。
四国アライアンス証券株式会社	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。

株式会社ＳＢＩ証券	48,323	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
ＯＫＢ証券株式会社	1,500	「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。
岡三オンライン証券株式会社	2,500	「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。
九州ＦＧ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。
ぐんぎん証券株式会社	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。
静岡東海証券株式会社	600	「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。
みずほ証券株式会社	125,167	「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。
十六ＴＴ証券株式会社	（※3）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。
立花証券株式会社	6,695	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
楽天証券株式会社	7,495	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
東海東京証券株式会社	6,000	「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。
とうほう証券株式会社	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。
内藤証券株式会社	3,002	「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。
マネックス証券株式会社	12,200	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
株式会社証券ジャパン	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。
浜銀ＴＴ証券株式会社	3,307	「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。
ひろぎん証券株式会社	5,000	「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。
フィデリティ証券株式会社	9,257	「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。
ほくほくＴＴ証券株式会社	1,250	「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。
松井証券株式会社	11,945	「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。
水戸証券株式会社	12,272	「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。
ワイエム証券株式会社	1,270	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。

（注）資本金の額は2019年3月末現在

（※1）新規の取得のお申込みのお取扱いを行っておりません。

（※2）出資の総額

（※3）2019年6月3日現在

（3）投資顧問会社

ａ．名称

みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社

ｂ．資本金の額

2019年3月末現在　　200百万円

ｃ．事業の内容

日本において投資顧問業務を営んでいます。

2【関係業務の概要】

「受託会社」は、以下の業務を行います。

(1)委託会社の指図に基づく信託財産の管理、保管、処分

(2)信託財産の計算

(3)信託財産に関する報告書の作成

(4)その他上記に付帯する業務

「販売会社」は、以下の業務を行います。

(1)募集の取扱い

(2)追加設定の申込事務

(3)信託契約の一部解約事務

(4)受益者に対する収益分配金、一部解約金および償還金の支払い

(5)受益者に対する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

「投資顧問会社」は、以下の業務を行います。

みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社は委託会社との投資顧問契約に基づき、当ファンドの信託財産の運用指図等について助言を行います。

3【資本関係】

該当事項はありません。

※持株比率5%以上を記載します。

第３【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

書類名	提出年月日
有価証券報告書	2019年4月11日
有価証券届出書	2019年4月11日

独立監査人の監査報告書

２０１９年5月３０日

アセットマネジメントOne株式会社
取　締　役　会　　御　中

EY新日本有限責任監査法人

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

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

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

監査人の責任
当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。
監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。
当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

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

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

以　上

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

（注２）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

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
業務執行社員　公認会計士　丘本　正彦　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、「ファンドの経理状況」に掲げられているクルーズコントロールの平成３１年１月１２日から令和１年７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、クルーズコントロールの令和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計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以　上

（注１）上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
（注２）ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれておりません。