

【表紙】

【提出書類】 有価証券報告書
【提出先】 関東財務局長殿
【提出日】 2020年1月10日提出
【計算期間】 第9期(自 2019年4月12日 至 2019年10月11日)
【ファンド名】 D I A Mコア資産設計ファンド(堅実型)
D I A Mコア資産設計ファンド(積極型)
【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】

各ファンドは、信託財産の成長を図ることを目的として、運用を行います。

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

<ファンドの特色>

1 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。

- 主として、日本、先進国および新興国の債券・株式にマザーファンドを通じて実質的に投資します。マザーファンドのほか、有価証券指数等先物取引等、上場投資信託証券(ETF)、短期金融資産等へ投資する場合があります。
- 実質的な組入外貨建資産に対しては、原則として、対円での為替ヘッジを行いません。
- 6資産の配分比率(以下、基本配分比率とします。)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、基本配分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の獲得をめざし、資産価値下落時では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。
- 基準価額の水準や市場環境等に応じて、投資対象である6資産合計の投資比率(以下、合計資産比率とします。)を機動的に変更します。
- 下値目安値は、3ヵ月毎に改定します(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。)

(*)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。)

3 下値目安値の異なる堅実型と積極型から選択できます。なお、2ファンド間でスイッチングが可能です。

- 各ファンドの下値目安値は、以下の通りとします。ただし、委託会社の判断により今後変更する場合があります。
(堅実型)改定日の基準価額の-2.5%
(積極型)改定日の基準価額の-3.5%

※スイッチング時には、税金、購入時手数料がかかる場合があります。販売会社によっては、スイッチングの取扱いを行わない場合があります。くわしくは販売会社にお問い合わせください。

※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。

■ 分配方針

年2回の決算時(毎年4月、10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

各ファンド

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

(注) 各ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

商品分類定義

追加型投信	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

各ファンド

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

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

(注) 各ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

属性区分定義

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。

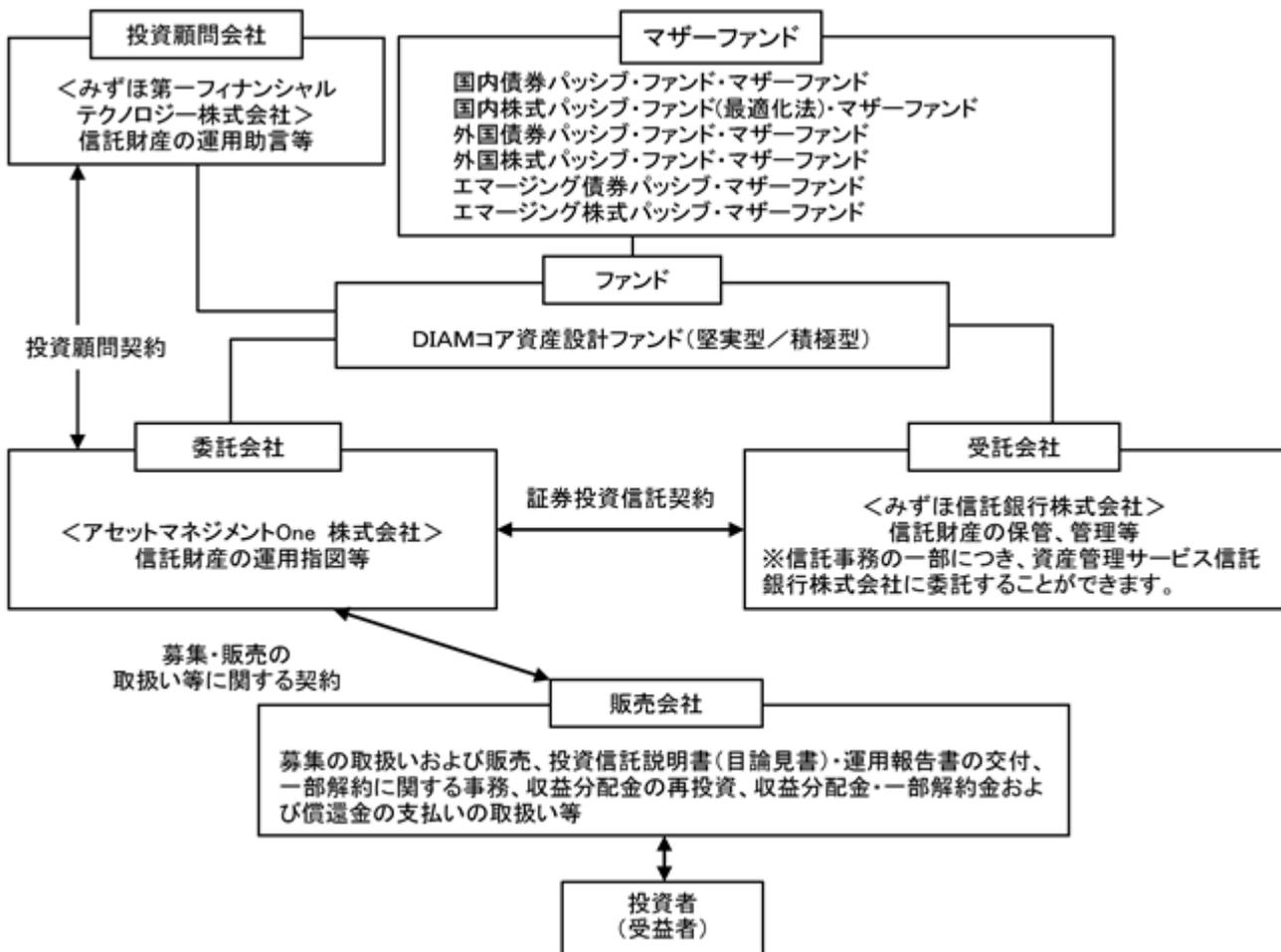
上記の分類は、一般社団法人投資信託協会の商品分類に関する指針に基づき記載しております。

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】

2015年8月28日 信託契約締結、ファンドの設定、ファンドの運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】



- ・「証券投資信託契約」の概要

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

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

- ・「募集・販売の取扱い等に関する契約」の概要

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

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

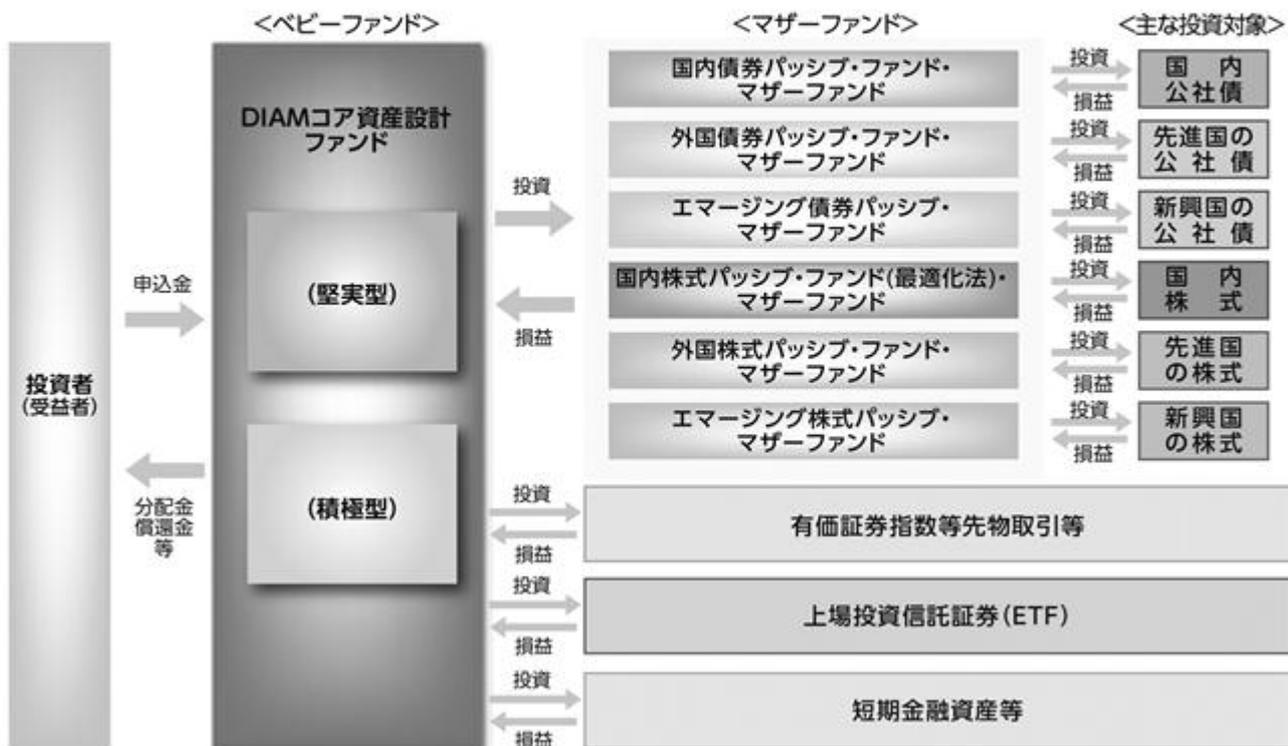
- ・「投資顧問契約」の概要

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、各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

各ファンドは「ファミリーファンド方式」により運用を行います。

「ファミリーファンド方式」とは、複数のファンドを合同運用する仕組みで、投資者からの資金をまとめてベビーファンド(各ファンド)とし、その資金の全部または一部をマザーファンドに投資して、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。



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10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10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>

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、上場投資信託証券（ETF）、短期金融資産等に投資する場合があります。

<投資態度>

以下のマザーファンド受益証券（以下、それぞれを「各マザーファンド」、または総称して「マザーファンド」ということがあります。）への投資を通じて、日本、先進国および新興国の債券・株式の6資産に実質的に分散投資を行います。マザーファンドのほか、有価証券指数等先物取引等、上場投資信託証券（ETF）、短期金融資産等（*）に投資する場合があります。

（*）市場環境によっては、残存期間3年以下の債券に投資することがあります。

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

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。

6資産の配分比率（以下、基本配分比率とします。）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、基本配分比率の見直しを行うことがあります。

基準価額の水準や市場環境等に応じて、投資対象である6資産合計の投資比率（以下、合計資産比率といいます。）を機動的に変更することで、資産価値上昇時には値上がり益の獲得をめざし、資

産価値下落時には基準価額の下落を一定水準(下値目安値(*))までに抑えることをめざします。なお、下値目安値は、3ヵ月毎に改定します。

(*) 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。)。

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。

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97.5%(堅実型)の場合)もしくは96.5%(積極型)の場合)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】

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

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・マザーファンドの各受益証券のほ

か次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することを指図します。

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

運用の指図範囲等(約款第17条第2項)

委託会社は、信託金を、上記に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。)により運用すること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）各ファンドが投資対象とするマザーファンドの概要

ファンド名	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、NOMURA - B P I 総合に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主な投資対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	<p>1.主としてわが国の公社債に投資し、「NOMURA - B P I 総合」 に連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>2.公社債（債券先物取引等を含みます。）の組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</p> <p>3.公社債の組入比率の調整には、債券先物取引等を活用する場合があります。</p>
	<p>NOMURA - B P I 総合の知的財産権その他一切の権利は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。</p>
運用プロセス	<p>1.流動性基準等による対象銘柄群設定 NOMURA - B P I 総合構成銘柄のうち、流動性基準等を勘案して投資対象銘柄群を設定します。</p> <p>2.最適化法によるポートフォリオの構築 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。</p> <p>3.インデックスとの乖離を管理 日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。 インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。 ・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</p>

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

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

投資態度	<ol style="list-style-type: none">1. 主として東京証券取引所第1部に上場されている株式に投資し、「東証株価指数(TOPIX)(配当込み)」に連動する投資成果をめざして運用を行います。2. 最適化法によるポートフォリオ構築を行い、運用コストの最小化と徹底したリスク管理を行います。3. 株式(株価指数先物取引を含みます。)の組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。4. 株式の組入比率の調整には、株価指数先物取引等を活用します。5. 非株式割合は原則として信託財産総額の50%以下とします。また、外貨建資産割合は原則として信託財産総額の10%以下とします。 <div style="border: 1px solid black; padding: 5px;"><p>東証株価指数(TOPIX)の指数値およびTOPIXの商標は、株式会社東京証券取引所(以下「株東京証券取引所」といいます。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など東証株価指数(TOPIX)に関するすべての権利・ノウハウおよびTOPIXの商標に関するすべての権利は株東京証券取引所が有しています。</p><p>株東京証券取引所は、東証株価指数(TOPIX)の指数値の算出もしくは公表の方法の変更、東証株価指数(TOPIX)の指数値の算出もしくは公表の停止またはTOPIXの商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。</p><p>株東京証券取引所は、東証株価指数(TOPIX)の指数値およびTOPIXの商標の使用に関して得られる結果ならびに特定日の東証株価指数(TOPIX)の指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。</p><p>株東京証券取引所は、東証株価指数(TOPIX)の指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、株東京証券取引所は、東証株価指数(TOPIX)の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。</p><p>当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドは、株東京証券取引所により提供、保証または販売されるものではありません。</p><p>株東京証券取引所は、当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドの購入者または公衆に対し、当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を持ちません。</p><p>株東京証券取引所は、委託会社または当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドの購入者のニーズを、東証株価指数(TOPIX)の指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。</p><p>以上の項目に限らず、株東京証券取引所は当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドの発行または売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を負いません。</p></div>
------	---

運用プロセス

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

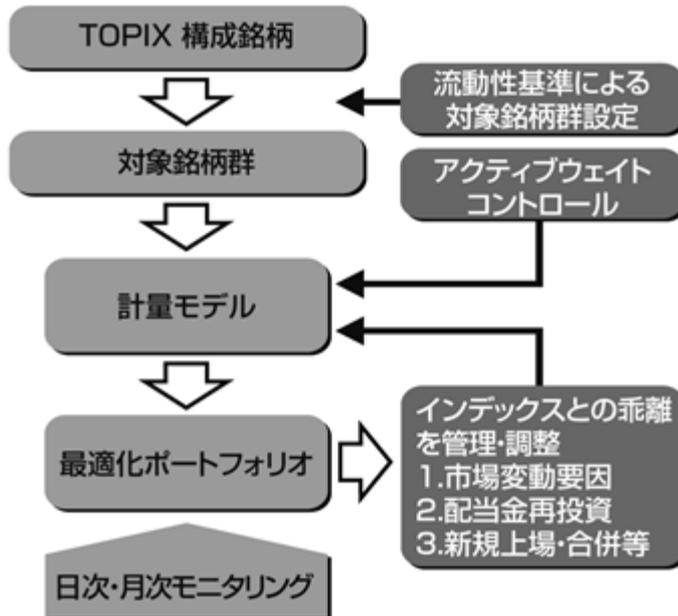
インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差(アクティブウェイト)を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。

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。

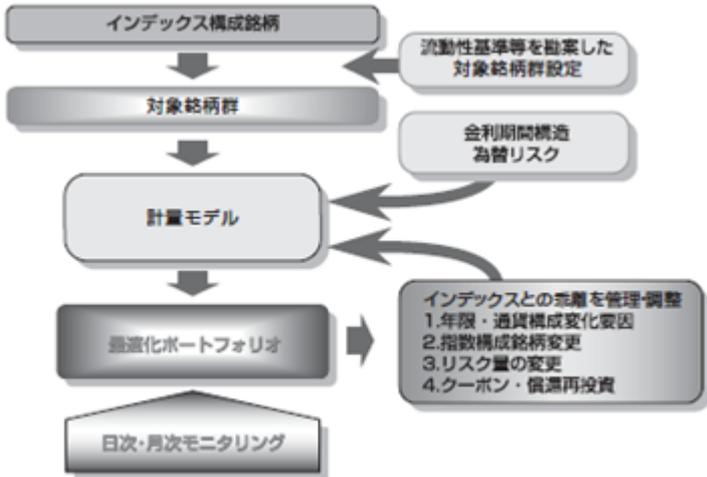
インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。

- ・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



<p>主な投資制限</p>	<ol style="list-style-type: none"> 1. 株式への投資割合には、制限を設けません。 2. 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。
---------------	--

<p>ファンド名</p>	<p>外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド</p>
<p>基本方針</p>	<p>この投資信託は、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。</p>
<p>主な投資対象</p>	<p>海外の公社債を主要投資対象とします。</p>
<p>投資態度</p>	<ol style="list-style-type: none"> 1. 主に日本を除く世界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。 <div style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin-top: 10px;"> <p>FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。</p> <p>このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。</p> </div>

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

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

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

本ファンドは、MSCI Inc. (以下、「MSCI」といいます。)、MSCI の関連会社、情報提供者その他MSCI指数の編集、計算または作成に関与または関係した第三者 (以下、総称して「MSCI関係者」といいます。) によって保証、推奨、販売、または宣伝されるものではありません。MSCI指数は、MSCIの独占的財産です。MSCI およびMSCI指数の名称は、MSCIまたはその関連会社のサービスマークであり、委託会社による特定の目的のために使用が許諾されています。MSCI関係者は、本ファンドの発行者もしくは所有者、またはその他の者もしくは団体に対して、ファンド全般もしくは本ファンド自体への投資に関する適否あるいは一般的な株式市場のパフォーマンスをトラックするMSCI 指数の能力に関して、明示的であると黙示的であるとを問わず、一切の表明または保証を行いません。MSCIまたはその関連会社は、特定のトレードマーク、サービスマークおよびトレードネーム、ならびに、本ファンドまたは本ファンドの発行会社、所有者、その他の者もしくは団体に関りなく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。

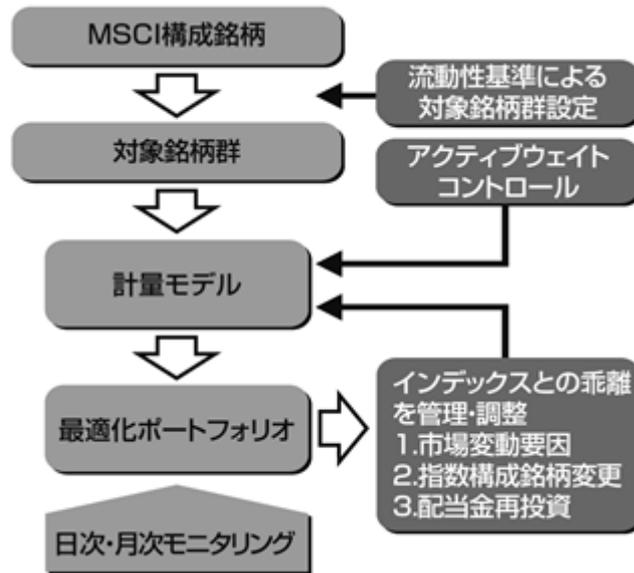
MSCIは、自らが信頼できると考える情報源からMSCI指数の計算に算入または使用するための情報を入手しますが、いかなるMSCI関係者も、MSCI指数またはそれに含まれるデータの独創性、正確性および/または完全性について保証するものではありません。いかなるMSCI関係者も、明示的か黙示的かを問わず、本ファンドの発行会社もしくは所有者、またはその他の者もしくは団体が、MSCI指数またはそれに含まれるデータを使用することにより得られる結果について保証を行いません。いかなるMSCI関係者も、MSCI指数またはそれに含まれるデータの、またはそれらに関連する過誤、脱漏または中断について責任を負いません。また、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	<ol style="list-style-type: none"> 1. 株式への投資割合には、制限を設けません。 2. 新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において、原則として信託財産の純資産総額の20%以下とします。 3. 同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、原則として信託財産の純資産総額の10%以下とします。 4. 外貨建資産への投資には、制限を設けません。 5. デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます。)は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 6. 外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。 7. 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
--------	--

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

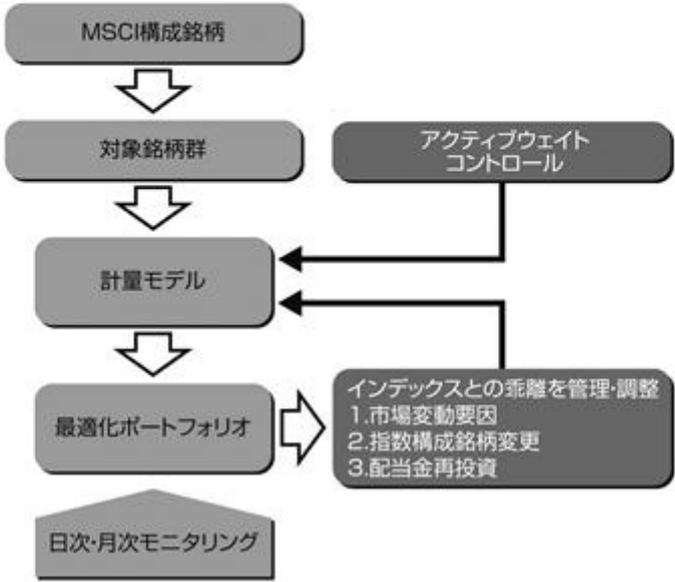
<p>運用プロセス</p>	<p>信用格付基準等を勘案した投資対象銘柄群を設定し、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。</p>
<p>主な投資制限</p>	<ol style="list-style-type: none"> 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 外貨建資産への投資には、制限を設けません。 投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、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。 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。 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

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

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

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

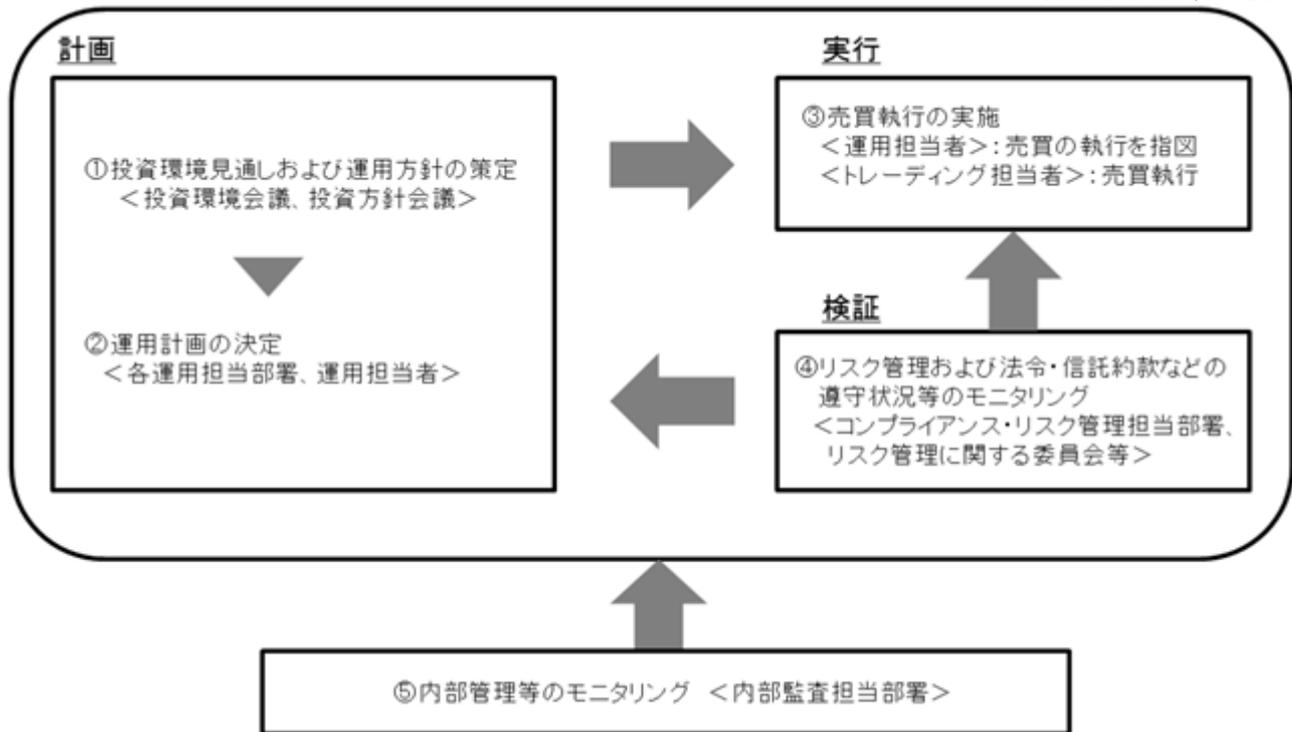
MSCIは、自らが信頼できると考える情報源からMSCI指数の計算に算入または使用するための情報を入手しますが、いかなるMSCI関係者も、MSCI指数またはそれに含まれるデータの独創性、正確性および/または完全性について保証するものではありません。いかなるMSCI関係者も、明示的か黙示的かを問わず、本ファンドの発行会社もしくは所有者、またはその他の者もしくは団体が、MSCI指数またはそれに含まれるデータを使用することにより得られる結果について保証を行いません。いかなるMSCI関係者も、MSCI指数またはそれに含まれるデータの、またはそれらに関連する過誤、脱漏または中断について責任を負いません。また、MSCI指数およびそれに含まれるデータの各々に関し、いかなるMSCI関係者も明示的または黙示的な保証を行うものではなく、かつMSCI関係者は、それらに関する特定目的に対する市場性および適合性に係る一切の保証を明示的に否認します。前記事項を制限することなく、直接的損害、間接的損害、特別損害、懲罰的損害、結果的損害その他あらゆる損害(逸失利益を含む。)については、その可能性について告知されていたとしても、MSCI関係者は、かかる損害について責任を負いません。本証券、本商品もしくは本ファンドの購入者、販売者もしくは所有者、またはその他いかなる者もしくは団体も、MSCIの承認が必要か否かの確認を事前にMSCIに求めることなく、本証券を保証、推奨、販売、または宣伝するためにMSCIのトレードネーム、トレードマークまたはサービスマークを使用したり、それらに言及することはできません。いかなる状況においても、いかなる者または団体も、事前にMSCIの書面による承認を得ることなくMSCIとの関係を主張することはできません。

運用プロセス	<p>現地口座の開設可否、預託証券の利用可否を基準に投資対象銘柄群を設定し、インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差(アクティブウェイト)を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用いて、インデックスとの乖離を抑えます。 日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理して、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。</p>  <pre> graph TD A[MSCI構成銘柄] --> B[対象銘柄群] B --> C[計量モデル] C --> D[最適化ポートフォリオ] E[アクティブウェイトコントロール] --> C E --> D D --> F[日次・月次モニタリング] G[インデックスとの乖離を管理・調整 1.市場変動要因 2.指数構成銘柄変更 3.配当金再投資] </pre>
主な投資制限	<ol style="list-style-type: none"> 1. 株式への投資割合には、制限を設けません。 2. 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。

資金動向、市況動向等によっては、上記の運用ができない場合があります。

（３）【運用体制】

a. ファンドの運用体制



投資環境見直しおよび運用方針の策定

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

運用計画の決定

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

売買執行の実施

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

モニタリング

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

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

内部管理等のモニタリング

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

b. ファンドの関係法人に関する管理

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

c. 運用体制に関する社内規則

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

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

運用体制は2019年10月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

上記体制は、マザーファンドを通じた実質的な運用体制を記載しております。

(4) 【分配方針】

収益分配方針

毎決算時(原則として毎年4月、10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。

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。

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せん。)に、原則として決算日から起算して5営業日までにお支払いを開始します。

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

(5) 【投資制限】

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

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

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。)を除きます。)への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。(約款「運用の基本方針」2. 運用方法 (3) 投資制限)

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

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する実質比率は、原則として、それぞれ10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなっ

た場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。(約款「運用の基本方針」2.運用方法(3)投資制限)

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)

非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)

投資する株式等の範囲(約款第20条)

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

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

信用取引の指図範囲(約款第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ます。

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

1.信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券

2.株式分割により取得する株券

3.有償増資により取得する株券

4.売出しにより取得する株券

5.信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権(転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限り、)の行使により取得可能な株券

6.信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権(5.に定めるものを除きます。)の行使により取得可能な株券

先物取引等の運用指図(約款第22条)

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

1.先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする有価証券(以下「ヘッジ対象有価証券」といいます。)の時価総額とマザーファンドの信託財産に属するヘッジ対象有価証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額(信

託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占めるヘッジ対象有価証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。)との合計額の範囲内とします。

2. 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象有価証券の組入可能額(信託財産の組入ヘッジ対象有価証券およびマザーファンドの組入ヘッジ対象有価証券のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める組入ヘッジ対象有価証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。)を差し引いた額)に信託財産が限月までに受取る組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券および組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金とマザーファンドが限月までに受取る組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券および組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券および組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金の割合を乗じて得た額をいいます。)を加えた額を限度とし、かつ信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに上記(2)投資対象 運用の指図範囲等の1.~4.に掲げる金融商品で運用している額(以下「金融商品運用額」といいます。)とマザーファンドが限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに金融商品運用額のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占めるマザーファンドが限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに金融商品運用額の割合を乗じて得た額をいいます。)の合計額の範囲内とします。
3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、 で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

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

1. 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の売予約と合せてヘッジ対象とする外貨建資産の時価総額とマザーファンドの信託財産に属するヘッジ対象とする外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占めるヘッジ対象とする外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。)との合計額の範囲内とします。
2. 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の買予約と合せて、外貨建有価証券とマザーファンドの信託財産に属する外貨建有価証券のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める外貨建有価証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。)を加えた額の買付代金等実需の範囲内とします。
3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点の保有外貨建資産の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

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

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

スワップ取引の運用指図(約款第23条)

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

じ。)が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、当該純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。

- 4)上記3)においてマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- 5)スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等を基に算出した価額で評価するものとします。
- 6)委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供または受入れが必要と認めるときは、担保の提供または受入れの指図を行うものとします。

金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図(約款第24条)

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

の時価総額の合計額」といいます。以下5)において同じ。)を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、ヘッジ対象外貨建資産の時価総額の合計額が減少して、為替先渡取引の想定元本の合計額がヘッジ対象外貨建資産の時価総額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかにその超える額に相当する為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。

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

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

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

デリバティブ取引等にかかる投資制限(約款第25条)

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

有価証券の貸付の指図および範囲(約款第26条)

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

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

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

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

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

特別な場合の外貨建有価証券への投資制限(約款第27条)

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

外国為替予約取引の指図(約款第28条)

1)委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、または為替変動リスクを回避するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

2)上記1)の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約とマザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約のうち信託財産に属するとみなした額との合計額と、信託財産にかかる売予約とマザーファンドの信託財産にかかる為替の売予約のうち信託財産に属するとみなした額との合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産(マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に

属するとみなした額を含みます。)の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。

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

資金の借入れ(約款第34条)

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

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

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

3【投資リスク】

<基準価額の主な変動要因>

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

準価額の下落により、損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

また、投資信託は預貯金と異なります。

・資産配分リスク

資産配分比率が高い資産の価値が下落した場合や、複数または全ての資産の価値が同時に下落した場合等は、基準価額の下落要因となります。

ファンドの實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。

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。当手法が効果的に機能しない場合等により、基準価額の下落リスクを低減できない場合や、市場全体の上昇に追従できない場合があります。

・株価変動リスク

投資する企業の株価の下落は、基準価額の下落要因となります。

ファンドは、実質的に株式に投資をします。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。ファンドは、実質的に債券に投資をします。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。

ファンドは、實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實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。

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。

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もあり、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。

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

基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

<その他の留意点>

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

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

収益分配金に関する留意点として、以下の事項にご留意ください。

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

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

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

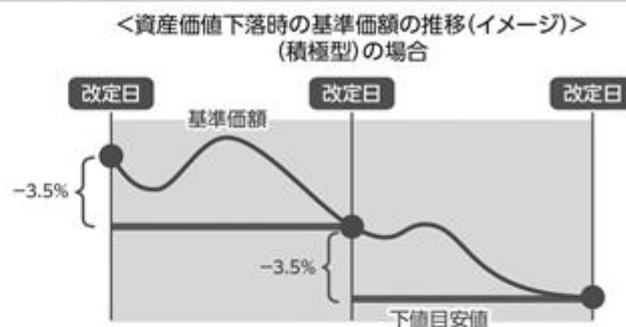
各ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行います。そのため、各ファンドが投資対象とするマザーファンドを投資対象とする他のベビーファンドに追加設定・解約等があった場合、資金変動等が起こり、その結果、当該マザーファンドにおいて売買等が生じた場合等には、各ファンドの基準価額に影響をおよぼす場合があります。

(堅実型)(積極型)の2つのファンド間でスイッチングを行うことができます。ただし、販売会社によっては、スイッチングの取扱いを行わない場合があります。くわしくは販売会社にお問い合わせください。

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調整します。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。

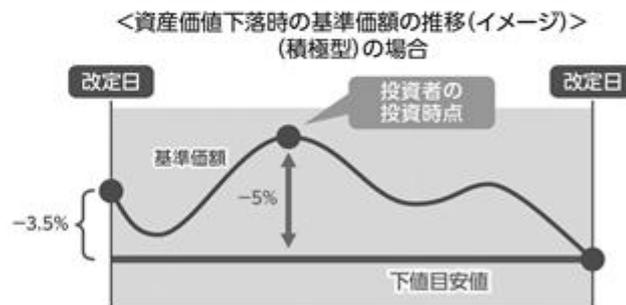
ケース① 下値目安値の切下げについて

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、ファンドの基準価額は長期的に2.5%(堅実型)の場合もしくは3.5%(積極型)の場合よりも下落する場合があります。



ケース② 四半期中途の投資について

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、この時点で投資者が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2.5%(堅実型)の場合もしくは3.5%(積極型)の場合)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。



※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等するものではありません。

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

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

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、お申込み(スイッチングのお申込みを含みます。)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(スイッチングのお申込みを含みます。)の受付または解約の受付を取り消すことができるものとします。

各ファンドは、信託契約を解約することが受益者のため有利であると認める場合、各ファンドにつき受益権口数が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。

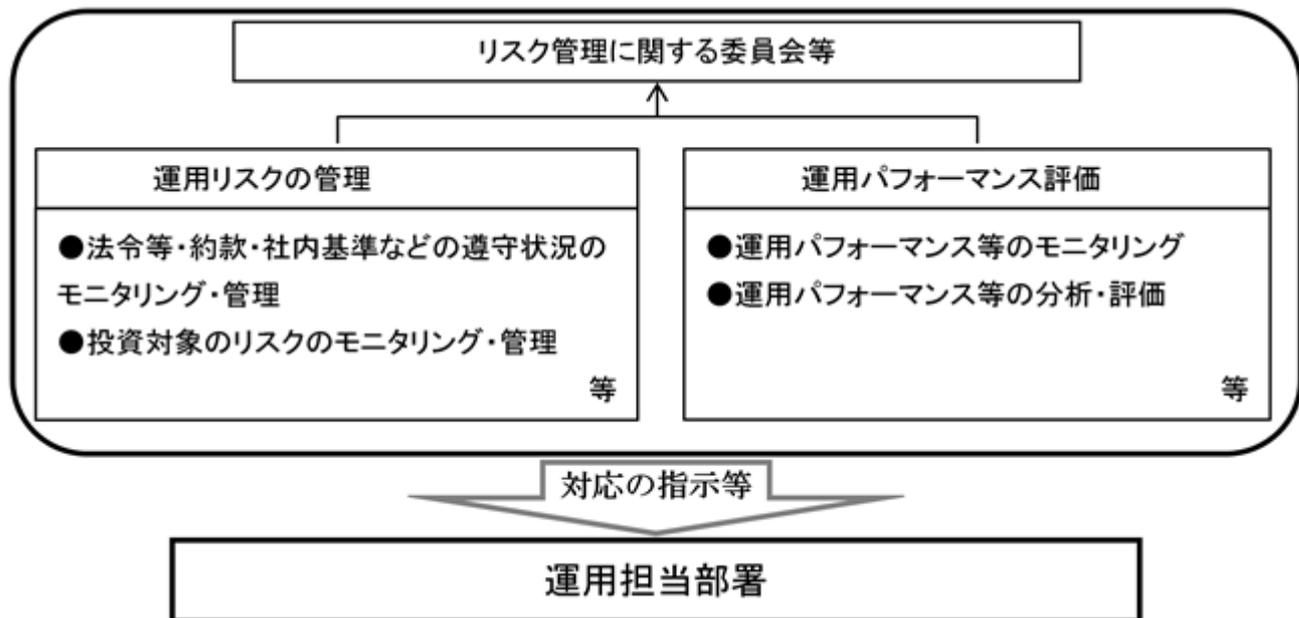
注意事項

- イ. 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ます、これによる損失は購入者が負担することとなります。

< リスク管理体制 >

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

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

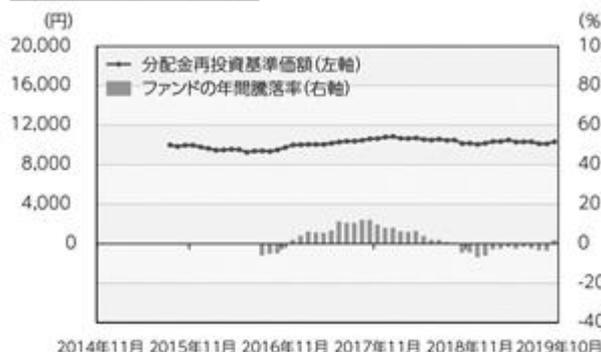


リスク管理体制は2019年10月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

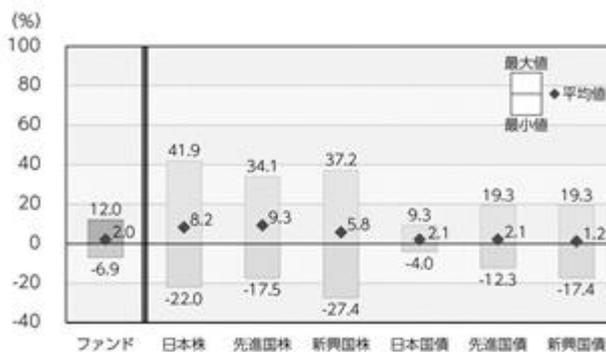
<参考情報>

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

(堅 実 型)

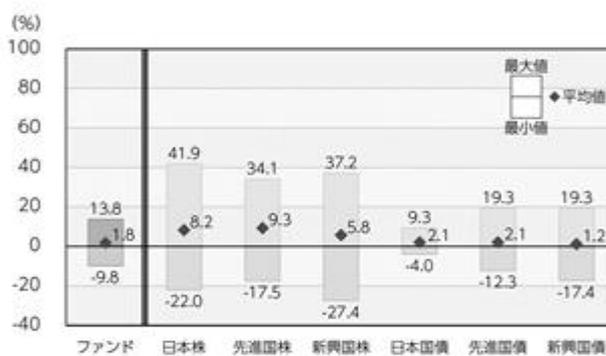


ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



ファンド:2016年8月~2019年10月
代表的な資産クラス:2014年11月~2019年10月

(積 極 型)



ファンド:2016年8月~2019年10月
代表的な資産クラス:2014年11月~2019年10月

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

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

各資産クラスの指数

日本株	東証株価指数(TOPIX) (配当込み)	「東証株価指数(TOPIX)」は、東京証券取引所第一部に上場されているすべての株式の時価総額を指数化したものです。同指数は、株式会社東京証券取引所(現東京証券取引所)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、株式会社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・ディバースファイド(円ベース)	「JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイド」は、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが公表している新興国の現地通貨建ての国債で構成されている時価総額加重平均指数です。同指数に関する著作権等の知的財産その他一切の権利はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。また、同社は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

(注) 海外の指数は為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

お申込時に、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】

各ファンドの日々の純資産総額に対して年率1.155%（税抜1.05%）

支払先	内訳（税抜）	主な役務
委託会社	年率0.50%	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0.50%	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、各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。

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

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

有価証券の売買時の売買委託手数料および有価証券取引にかかる手数料・税金、先物・オプション取引に要する費用、当該手数料にかかる消費税等相当額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。

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、間接的に各ファンドで負担することになります。

上記の「その他の費用」については、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】

各ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

個人の受益者に対する課税

収益分配時

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

詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

解約時および償還時

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

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

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

損益通算について

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

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

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

法人の受益者に対する課税

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

なお、益金不算入制度の適用はありません。

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10月末現在のもので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。

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

個別元本方式について

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

< 個別元本について >

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

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

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

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

< 収益分配金の課税について >

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

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

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

税法が改正された場合等は、上記内容が変更になることがあります。

5【運用状況】

（1）【投資状況】

DIAMコア資産設計ファンド（堅実型）

令和1年10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	118,054,690	80.37
内 日本	118,054,690	80.37
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	28,841,809	19.63
純資産総額	146,896,499	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コア資産設計ファンド（積極型）

令和1年10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	272,486,346	95.85
内 日本	272,486,346	95.85
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	11,812,097	4.15
純資産総額	284,298,443	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）

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和1年10月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	190,761,611,400	78.48
内 日本	190,761,611,400	78.48
地方債証券	21,301,088,080	8.76
内 日本	21,301,088,080	8.76
特殊債券	18,057,494,698	7.43
内 日本	18,057,494,698	7.43
社債券	11,806,193,820	4.86
内 日本	11,400,147,820	4.69
内 フランス	406,046,000	0.17
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	1,157,222,624	0.48
純資産総額	243,083,610,622	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。

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10月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	247,820,784,090	97.34
内 日本	247,820,784,090	97.34
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	6,769,099,904	2.66
純資産総額	254,589,883,994	100.00

その他資産の投資状況

令和1年10月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引（買建）	6,573,890,000	2.58
内 日本	6,573,890,000	2.58

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和1年10月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	144,484,564,126	97.59
内 アメリカ	69,673,621,339	47.06
内 フランス	14,408,517,306	9.73
内 イタリア	13,409,225,270	9.06
内 イギリス	8,925,332,320	6.03
内 ドイツ	8,893,245,358	6.01
内 スペイン	8,253,873,994	5.58
内 ベルギー	3,534,303,900	2.39
内 オーストラリア	2,782,098,298	1.88
内 オランダ	2,681,106,620	1.81
内 カナダ	2,654,048,299	1.79
内 オーストリア	2,060,153,823	1.39
内 メキシコ	1,137,515,068	0.77
内 アイルランド	972,894,758	0.66
内 フィンランド	839,226,651	0.57
内 ポーランド	788,519,094	0.53
内 南アフリカ	782,582,146	0.53
内 マレーシア	746,831,285	0.50
内 デンマーク	657,366,770	0.44
内 シンガポール	553,280,546	0.37
内 スウェーデン	459,774,664	0.31
内 ノルウェー	271,046,617	0.18
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	3,564,024,513	2.41
純資産総額	148,048,588,639	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10月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	324,775,238,883	94.98
内 アメリカ	211,742,282,728	61.92
内 イギリス	19,607,760,256	5.73
内 フランス	12,567,143,955	3.68
内 カナダ	12,477,271,939	3.65
内 スイス	12,429,518,907	3.63
内 ドイツ	10,683,484,545	3.12
内 オーストラリア	7,863,680,056	2.30

内 オランダ	6,377,451,873	1.87
内 アイルランド	6,167,534,694	1.80
内 スペイン	3,488,606,267	1.02
内 スウェーデン	3,025,239,794	0.88
内 香港	3,023,792,676	0.88
内 イタリア	2,380,269,775	0.70
内 デンマーク	2,185,841,195	0.64
内 シンガポール	1,461,706,300	0.43
内 フィンランド	1,388,420,187	0.41
内 バミューダ	1,313,746,591	0.38
内 ジャージー	1,179,534,129	0.34
内 ベルギー	1,144,529,329	0.33
内 ケイマン諸島	804,296,205	0.24
内 ノルウェー	773,469,206	0.23
内 イスラエル	707,597,243	0.21
内 オランダ領キュラソー	390,975,733	0.11
内 ルクセンブルグ	328,367,538	0.10
内 オーストリア	289,413,533	0.08
内 ニュージーランド	288,472,391	0.08
内 ポルトガル	195,308,612	0.06
内 リベリア	167,684,618	0.05
内 パナマ	150,371,774	0.04
内 マン島	61,001,619	0.02
内 パプアニューギニア	57,007,631	0.02
内 イギリス領バージン諸島	41,828,179	0.01
内 モーリシャス	11,629,405	0.00
投資信託受益証券	754,762,701	0.22
内 オーストラリア	600,813,789	0.18
内 シンガポール	153,948,912	0.05
投資証券	8,550,930,737	2.50
内 アメリカ	7,651,105,632	2.24
内 イギリス	239,614,983	0.07
内 フランス	213,507,836	0.06
内 香港	206,054,677	0.06
内 オランダ	183,460,811	0.05
内 カナダ	57,186,798	0.02
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	7,861,683,529	2.30
純資産総額	341,942,615,850	100.00

その他資産の投資状況

令和1年10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）	7,660,720,921	2.24
内 アメリカ	5,408,976,026	1.58
内 ドイツ	1,311,027,094	0.38
内 イギリス	462,373,386	0.14
内 カナダ	277,497,375	0.08
内 オーストラリア	200,847,040	0.06

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

（注3）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10月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	144,432,600,785	97.60
内 メキシコ	23,188,362,010	15.67
内 インドネシア	20,047,071,930	13.55
内 ロシア	17,734,716,560	11.98
内 ブラジル	17,496,868,464	11.82
内 コロンビア	16,476,037,675	11.13
内 フィリピン	14,197,115,918	9.59
内 南アフリカ	7,924,840,234	5.36
内 ハンガリー	6,758,405,977	4.57
内 パナマ	6,716,865,174	4.54
内 クロアチア	5,387,907,114	3.64
内 ペルー	4,315,271,851	2.92
内 ルーマニア	4,189,137,878	2.83
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	3,544,781,056	2.40
純資産総額	147,977,381,841	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。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

令和1年10月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	40,498,535,634	86.01
内 ケイマン諸島	6,678,898,511	14.19
内 韓国	5,004,563,727	10.63
内 台湾	4,837,552,492	10.27
内 中国	4,672,510,762	9.92
内 インド	3,654,402,636	7.76
内 ブラジル	3,060,004,903	6.50
内 南アフリカ	1,790,597,176	3.80
内 ロシア	1,623,059,068	3.45
内 香港	1,280,260,807	2.72
内 タイ	1,119,618,613	2.38
内 サウジアラビア	986,534,795	2.10
内 インドネシア	846,370,348	1.80

内 マレーシア	805,081,877	1.71
内 メキシコ	759,356,938	1.61
内 フィリピン	453,872,316	0.96
内 ポーランド	419,783,176	0.89
内 カタール	388,154,323	0.82
内 バミューダ	386,647,000	0.82
内 チリ	351,169,474	0.75
内 アラブ首長国連邦	279,658,446	0.59
内 トルコ	209,393,323	0.44
内 コロンビア	167,235,192	0.36
内 アメリカ	133,285,723	0.28
内 ギリシャ	124,254,874	0.26
内 ハンガリー	122,426,523	0.26
内 チェコ	56,448,209	0.12
内 エジプト	54,644,966	0.12
内 アルゼンチン	48,259,466	0.10
内 ルクセンブルグ	44,285,555	0.09
内 オランダ	32,066,401	0.07
内 ジャージー	27,726,778	0.06
内 マン島	26,607,502	0.06
内 ペルー	23,847,235	0.05
内 パキスタン	14,836,802	0.03
内 シンガポール	8,941,270	0.02
内 ベルギー	6,178,427	0.01
新株予約権証券	709,101	0.00
内 タイ	709,101	0.00
投資信託受益証券	370,941,172	0.79
内 メキシコ	241,221,192	0.51
内 ブラジル	129,719,980	0.28
投資証券	97,625,974	0.21
内 南アフリカ	63,375,814	0.13
内 メキシコ	34,250,160	0.07
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	6,115,831,462	12.99
純資産総額	47,083,643,343	100.00

その他資産の投資状況

令和1年10月31日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引(買建)	6,077,982,108	12.91
内 アメリカ	6,077,982,108	12.91

(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。

(2) 【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)

令和1年10月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	国内株式パッシブ・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	13,618,553	2.5438 34,643,824	2.6349 35,883,525	- -	24.43
2	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	26,172,768	1.1062 28,953,915	1.1519 30,148,411	- -	20.52
3	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	9,119,882	1.8826 17,169,743	1.8937 17,270,320	- -	11.76
4	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	3,164,753	3.6420 11,526,267	3.7786 11,958,335	- -	8.14
5	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	5,623,590	2.0282 11,405,940	2.0287 11,408,577	- -	7.77
6	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	8,585,072	1.3272 11,394,356	1.3262 11,385,522	- -	7.75

(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10月31日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	80.37
合計	80.37

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

D I A Mコア資産設計ファンド(積極型)

令和1年10月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	国内株式パッシブ・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	31,364,306	2.5308 79,379,091	2.6349 82,641,809	- -	29.07
2	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	60,395,653	1.0975 66,288,629	1.1519 69,569,752	- -	24.47
3	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	21,021,127	1.8812 39,545,918	1.8937 39,807,708	- -	14.00
4	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	7,309,362	3.6214 26,470,712	3.7786 27,619,155	- -	9.71
5	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	13,036,637	2.0277 26,435,135	2.0287 26,447,425	- -	9.30
6	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	19,906,875	1.3279 26,434,852	1.3262 26,400,497	- -	9.29

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

令和1年10月31日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	95.85
合計	95.85

(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)

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和1年10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	2,250,000,000	102.81 2,313,247,000	102.90 2,315,407,500	0.1 2028/3/20	0.95
2	339回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証 券	2,140,000,000	104.07 2,227,286,500	103.86 2,222,646,800	0.4 2025/6/20	0.91
3	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	100.53 2,211,704,000	0.1 2021/6/20	0.91

4	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	100.63 2,133,440,800	0.1 2021/9/20	0.88
5	343回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	2,080,000,000	101.91 2,119,924,000	102.49 2,131,958,400	0.1 2026/6/20	0.88
6	334回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	2,020,000,000	104.10 2,102,930,000	104.05 2,101,951,400	0.6 2024/6/20	0.86
7	335回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	2,000,000,000	103.93 2,078,748,000	103.78 2,075,700,000	0.5 2024/9/20	0.85
8	342回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	1,980,000,000	102.15 2,022,671,000	102.40 2,027,559,600	0.1 2026/3/20	0.83
9	345回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	1,960,000,000	102.34 2,006,045,000	102.69 2,012,743,600	0.1 2026/12/20	0.83
10	347回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	1,950,000,000	101.86 1,986,342,000	102.88 2,006,218,500	0.1 2027/6/20	0.83
11	348回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	1,930,000,000	101.73 1,963,410,000	102.93 1,986,722,700	0.1 2027/9/20	0.82
12	344回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	1,930,000,000	101.91 1,966,946,000	102.59 1,980,083,500	0.1 2026/9/20	0.81
13	341回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	1,910,000,000	103.18 1,970,756,000	103.58 1,978,511,700	0.3 2025/12/20	0.81
14	340回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	1,900,000,000	103.73 1,971,036,000	104.03 1,976,703,000	0.4 2025/9/20	0.81
15	346回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	1,920,000,000	101.88 1,956,096,000	102.78 1,973,491,200	0.1 2027/3/20	0.81
16	351回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	1,860,000,000	102.21 1,901,259,000	102.86 1,913,214,600	0.1 2028/6/20	0.79
17	352回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	1,820,000,000	102.03 1,857,046,000	102.80 1,871,069,200	0.1 2028/9/20	0.77
18	329回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	1,770,000,000	104.22 1,844,694,000	103.86 1,838,463,600	0.8 2023/6/20	0.76
19	127回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	1,820,000,000	100.54 1,829,869,200	100.45 1,828,190,000	0.1 2021/3/20	0.75
20	313回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	1,790,000,000	103.08 1,845,185,700	102.11 1,827,804,800	1.3 2021/3/20	0.75

21	135回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	1,800,000,000	101.45 1,826,250,000	101.22 1,822,086,000	0.1 2023/3/20	0.75
22	349回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	1,760,000,000	102.52 1,804,438,000	102.94 1,811,884,800	0.1 2027/12/20	0.75
23	353回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	1,650,000,000	101.42 1,673,493,000	102.74 1,695,259,500	0.1 2028/12/20	0.70
24	338回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	1,580,000,000	103.76 1,639,518,000	103.68 1,638,238,800	0.4 2025/3/20	0.67
25	320回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	1,500,000,000	103.34 1,550,145,000	102.66 1,539,900,000	1 2021/12/20	0.63
26	315回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	1,500,000,000	103.22 1,548,330,000	102.33 1,535,025,000	1.2 2021/6/20	0.63
27	330回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	1,450,000,000	104.49 1,515,119,500	104.13 1,510,015,500	0.8 2023/9/20	0.62
28	354回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	1,470,000,000	102.18 1,502,112,800	102.67 1,509,263,700	0.1 2029/3/20	0.62
29	355回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	1,450,000,000	103.57 1,501,777,000	102.59 1,487,598,500	0.1 2029/6/20	0.61
30	138回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	1,450,000,000	101.24 1,467,985,000	101.50 1,471,808,000	0.1 2023/12/20	0.61

(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10月31日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	78.48
地方債証券	8.76
特殊債券	7.43
社債券	4.86
合計	99.52

(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。

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10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	1,173,000	6,639.86 7,788,564,937	7,542.00 8,846,766,000	- -	3.47
2	ソニー 日本	株式 電気機器	665,200	4,863.34 3,235,097,633	6,625.00 4,406,950,000	- -	1.73
3	三菱UFJフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	7,146,400	572.59 4,092,027,061	569.80 4,072,018,720	- -	1.60
4	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	690,300	4,693.29 3,239,784,118	5,376.00 3,711,052,800	- -	1.46
5	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	875,800	4,393.66 3,847,967,879	3,928.00 3,440,142,400	- -	1.35
6	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	819,500	4,931.78 4,041,599,290	4,190.00 3,433,705,000	- -	1.35
7	キーエンス 日本	株式 電気機器	47,700	62,506.00 2,981,536,239	68,820.00 3,282,714,000	- -	1.29
8	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	718,000	3,898.83 2,799,362,582	3,880.00 2,785,840,000	- -	1.09
9	リクルートホールディングス 日本	株式 サービス業	720,500	2,972.56 2,141,732,333	3,611.00 2,601,725,500	- -	1.02
10	任天堂 日本	株式 その他製品	64,500	31,139.43 2,008,493,402	38,620.00 2,490,990,000	- -	0.98
11	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	828,700	2,975.36 2,465,685,092	2,942.00 2,438,035,400	- -	0.96
12	みずほフィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	14,107,000	171.93 2,425,486,772	168.80 2,381,261,600	- -	0.94
13	KDDI 日本	株式 情報・通信業	769,700	2,682.75 2,064,918,233	2,999.00 2,308,330,300	- -	0.91
14	NTTドコモ 日本	株式 情報・通信業	763,000	2,625.99 2,003,631,248	2,975.00 2,269,925,000	- -	0.89
15	信越化学工業 日本	株式 化学	181,700	9,473.49 1,721,334,200	12,160.00 2,209,472,000	- -	0.87
16	花王 日本	株式 化学	252,000	8,060.26 2,031,187,765	8,744.00 2,203,488,000	- -	0.87

17	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	371,200	5,373.60 1,994,681,124	5,868.00 2,178,201,600	- -	0.86
18	ファナック 日本	株式 電気機器	100,000	18,888.85 1,888,885,422	21,600.00 2,160,000,000	- -	0.85
19	第一三共 日本	株式 医薬品	301,200	3,974.46 1,197,107,382	7,140.00 2,150,568,000	- -	0.84
20	日立製作所 日本	株式 電気機器	505,800	3,602.48 1,822,136,610	4,069.00 2,058,100,200	- -	0.81
21	ダイキン工業 日本	株式 機械	134,100	11,994.60 1,608,475,928	15,230.00 2,042,343,000	- -	0.80
22	日本電産 日本	株式 電気機器	126,700	13,302.34 1,685,407,090	16,085.00 2,037,969,500	- -	0.80
23	HOYA 日本	株式 精密機器	211,900	6,863.85 1,454,450,446	9,603.00 2,034,875,700	- -	0.80
24	三菱商事 日本	株式 卸売業	727,500	3,103.28 2,257,642,234	2,764.00 2,010,810,000	- -	0.79
25	東海旅客鉄道 日本	株式 陸運業	87,500	23,465.01 2,053,189,183	22,295.00 1,950,812,500	- -	0.77
26	資生堂 日本	株式 化学	209,200	7,368.31 1,541,452,491	8,968.00 1,876,105,600	- -	0.74
27	東日本旅客鉄道 日本	株式 陸運業	185,300	10,163.13 1,883,228,938	9,849.00 1,825,019,700	- -	0.72
28	村田製作所 日本	株式 電気機器	309,200	5,719.39 1,768,436,250	5,863.00 1,812,839,600	- -	0.71
29	アステラス製薬 日本	株式 医薬品	925,900	1,653.16 1,530,669,869	1,858.50 1,720,785,150	- -	0.68
30	三井物産 日本	株式 卸売業	911,200	1,750.51 1,595,072,673	1,867.50 1,701,666,000	- -	0.67

(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10月31日現在

種類	投資比率(%)
株式	97.34
合計	97.34

(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。

投資株式の業種別投資比率

令和1年10月31日現在

業種	国内/外国	投資比率(%)
電気機器	国内	13.59
情報・通信業		8.20
輸送用機器		7.78
化学		7.21
銀行業		5.71
医薬品		5.66
機械		5.03
サービス業		4.94
卸売業		4.84
小売業		4.57
陸運業		4.40

食料品	3.87
建設業	2.81
不動産業	2.42
保険業	2.24
その他製品	2.18
精密機器	2.18
電気・ガス業	1.57
その他金融業	1.11
ガラス・土石製品	0.82
ゴム製品	0.78
証券、商品先物取引業	0.76
非鉄金属	0.76
鉄鋼	0.75
繊維製品	0.60
金属製品	0.59
石油・石炭製品	0.52
空運業	0.51
鉱業	0.26
パルプ・紙	0.23
倉庫・運輸関連業	0.18
海運業	0.17
水産・農林業	0.10
合計	97.34

(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。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和1年10月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	US T N/B 1.375 04/30/21 アメリカ	国債証 券	1,220,544,800	97.62 1,191,593,477	99.53 1,214,823,495	1.375 2021/4/30	0.82
2	US T N/B 2.125 08/15/21 アメリカ	国債証 券	1,197,680,000	99.14 1,187,475,766	100.79 1,207,177,219	2.125 2021/8/15	0.82
3	US T N/B 2.0 11/15/21 アメリカ	国債証 券	1,132,352,000	98.77 1,118,503,335	100.76 1,141,065,799	2 2021/11/15	0.77
4	US T N/B 2.0 05/31/21 アメリカ	国債証 券	1,102,954,400	98.92 1,091,097,640	100.49 1,108,426,079	2 2021/5/31	0.75
5	US T N/B 2.125 12/31/21 アメリカ	国債証 券	1,071,379,200	99.04 1,061,158,242	101.01 1,082,260,395	2.125 2021/12/31	0.73
6	US T N/B 2.5 01/31/21 アメリカ	国債証 券	1,068,112,800	99.96 1,067,699,728	101.01 1,078,919,088	2.5 2021/1/31	0.73
7	US T N/B 2.25 03/31/21 アメリカ	国債証 券	1,062,668,800	99.49 1,057,270,442	100.77 1,070,929,380	2.25 2021/3/31	0.72
8	US T N/B 1.75 12/31/20 アメリカ	国債証 券	979,920,000	98.63 966,514,694	100.05 980,455,888	1.75 2020/12/31	0.66
9	US T N/B 2.125 09/30/21 アメリカ	国債証 券	962,499,200	99.11 954,000,332	100.86 970,845,867	2.125 2021/9/30	0.66
10	US T N/B 2.0 02/15/22 アメリカ	国債証 券	922,213,600	98.65 909,819,049	100.80 929,670,553	2 2022/2/15	0.63

11	US T N/B 1.625 11/30/20 アメリカ	国債証 券	926,568,800	98.44 912,160,655	99.93 925,989,694	1.625 2020/11/30	0.63
12	US T N/B 2.375 12/31/20 アメリカ	国債証 券	903,704,000	99.73 901,300,147	100.80 910,975,988	2.375 2020/12/31	0.62
13	US T N/B 2.25 04/30/21 アメリカ	国債証 券	889,549,600	100.55 894,513,286	100.83 897,020,419	2.25 2021/4/30	0.61
14	US T N/B 3.125 05/15/21 アメリカ	国債証 券	871,040,000	101.36 882,912,275	102.19 890,196,068	3.125 2021/5/15	0.60
15	US T N/B 2.125 12/31/22 アメリカ	国債証 券	871,040,000	98.70 859,742,611	101.52 884,309,745	2.125 2022/12/31	0.60
16	US T N/B 2.75 11/15/23 アメリカ	国債証 券	752,360,800	101.18 761,291,322	104.32 784,865,132	2.75 2023/11/15	0.53
17	US T N/B 2.375 08/15/24 アメリカ	国債証 券	753,449,600	99.31 748,265,866	103.29 778,289,890	2.375 2024/8/15	0.53
18	US T N/B 1.75 05/15/23 アメリカ	国債証 券	762,160,000	97.09 740,004,008	100.39 765,137,187	1.75 2023/5/15	0.52
19	US T N/B 1.75 03/31/22 アメリカ	国債証 券	761,071,200	97.87 744,898,437	100.27 763,152,249	1.75 2022/3/31	0.52
20	US T N/B 8.0 11/15/21 アメリカ	国債証 券	653,280,000	114.42 747,515,640	112.69 736,241,450	8 2021/11/15	0.50
21	US T N/B 2.25 11/15/24 アメリカ	国債証 券	714,252,800	98.56 703,981,844	102.83 734,508,558	2.25 2024/11/15	0.50
22	US T N/B 2.0 11/30/22 アメリカ	国債証 券	717,519,200	98.28 705,242,446	101.10 725,423,118	2 2022/11/30	0.49
23	US T N/B 2.125 06/30/22 アメリカ	国債証 券	710,986,400	98.88 703,037,572	101.31 720,318,096	2.125 2022/6/30	0.49
24	US T N/B 2.5 05/15/24 アメリカ	国債証 券	679,411,200	100.03 679,621,817	103.74 704,836,036	2.5 2024/5/15	0.48
25	US T N/B 2.5 08/15/23 アメリカ	国債証 券	679,411,200	100.09 680,043,052	103.14 700,802,032	2.5 2023/8/15	0.47
26	US T N/B 2.125 05/15/25 アメリカ	国債証 券	680,500,000	97.58 664,065,925	102.35 696,555,546	2.125 2025/5/15	0.47
27	US T N/B 1.875 08/31/22 アメリカ	国債証 券	682,677,600	97.98 668,914,819	100.69 687,424,339	1.875 2022/8/31	0.46
28	US T N/B 3.125 11/15/28 アメリカ	国債証 券	595,573,600	104.03 619,581,171	111.21 662,389,511	3.125 2028/11/15	0.45
29	US T N/B 2.875 08/15/28 アメリカ	国債証 券	599,928,800	101.87 611,177,465	108.96 653,688,038	2.875 2028/8/15	0.44
30	US T N/B 2.625 02/15/29 アメリカ	国債証 券	607,550,400	100.53 610,806,400	107.19 651,265,545	2.625 2029/2/15	0.44

（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10月31日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	97.59
合計	97.59

（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。

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10月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (％) 償還日	投資 比率 (％)
1	APPLE INC アメリカ	株式 コン ピュー タ・周辺 機器	363,209	18,610.42 6,759,475,519	26,486.14 9,620,007,619	- -	2.81
2	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフト ウェア	575,002	11,728.09 6,743,680,652	15,745.13 9,053,485,150	- -	2.65
3	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 インター ネット販 売・通信 販売	33,054	177,581.65 5,869,783,919	193,805.31 6,406,040,756	- -	1.87
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	189,729	17,925.81 3,401,047,773	20,496.65 3,888,810,805	- -	1.14
5	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	256,348	11,160.95 2,861,087,388	13,689.48 3,509,271,434	- -	1.03
6	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	24,708	122,177.43 3,018,760,028	137,329.25 3,393,131,237	- -	0.99

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	23,530	123,027.15 2,894,828,911	137,265.01 3,229,845,826	- -	0.94
8	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	209,690	14,614.88 3,064,594,543	14,463.61 3,032,876,310	- -	0.89
9	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	241,926	9,764.48 2,362,281,711	11,663.65 2,821,741,351	- -	0.83
10	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品	198,040	10,775.97 2,134,074,164	13,603.46 2,694,030,644	- -	0.79
11	VISA INC アメリカ	株式 情報技術サービス	137,469	15,656.42 2,152,273,769	19,516.73 2,682,946,731	- -	0.78
12	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 石油・ガス・消耗燃料	334,134	8,281.50 2,767,131,947	7,373.35 2,463,688,131	- -	0.72
13	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 銀行	713,639	3,090.24 2,205,319,701	3,442.78 2,456,906,072	- -	0.72
14	AT&T INC アメリカ	株式 各種電気通信サービス	575,875	3,259.35 1,876,981,128	4,159.21 2,395,188,514	- -	0.70
15	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 各種金融サービス	102,604	22,060.26 2,263,471,661	23,218.65 2,382,327,390	- -	0.70
16	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 専門小売り	86,872	20,447.78 1,776,339,819	25,721.81 2,234,505,182	- -	0.65
17	INTEL CORP アメリカ	株式 半導体・半導体製造装置	353,705	5,518.06 1,951,768,137	6,162.60 2,179,745,262	- -	0.64
18	MASTERCARD INC アメリカ	株式 情報技術サービス	71,792	24,058.77 1,727,227,549	30,176.09 2,166,401,996	- -	0.63
19	VERIZON COMM INC アメリカ	株式 各種電気通信サービス	326,283	5,902.31 1,925,824,606	6,622.08 2,160,672,650	- -	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	75,067	28,818.69 2,163,333,091	27,742.62 2,082,555,555	- -	0.61
21	THE WALT DISNEY CO アメリカ	株式 娯楽	142,222	12,197.12 1,734,700,150	14,110.84 2,006,873,024	- -	0.59
22	WELLS FARGO & CO アメリカ	株式 銀行	337,198	5,277.94 1,779,711,237	5,665.02 1,910,235,572	- -	0.56
23	CHEVRON CORP アメリカ	株式 石油・ガス・消耗燃料	150,662	12,861.48 1,937,737,238	12,669.27 1,908,778,581	- -	0.56
24	MERCK & CO. INC. アメリカ	株式 医薬品	203,186	8,604.28 1,748,269,910	9,387.63 1,907,435,720	- -	0.56
25	COCA-COLA CO/THE アメリカ	株式 飲料	320,243	4,982.73 1,595,686,074	5,872.98 1,880,783,039	- -	0.55
26	PFIZER INC アメリカ	株式 医薬品	438,192	4,558.90 1,997,673,569	4,189.70 1,835,894,074	- -	0.54
27	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN スイス	株式 医薬品	55,462	29,812.80 1,653,477,592	32,684.89 1,812,769,757	- -	0.53
28	CISCO SYSTEMS INC アメリカ	株式 通信機器	338,608	5,274.37 1,785,943,929	5,178.33 1,753,424,912	- -	0.51
29	COMCAST CORP-CL A アメリカ	株式 メディア	358,051	4,078.85 1,460,437,938	4,865.84 1,742,221,455	- -	0.51
30	PEPSICO INC アメリカ	株式 飲料	110,679	12,319.94 1,363,558,688	14,905.67 1,649,744,871	- -	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10月31日現在

種類	投資比率（％）
株式	94.98
投資信託受益証券	0.22
投資証券	2.50
合計	97.70

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

令和1年10月31日現在

業種	国内/外国	投資比率（％）
銀行	外国	7.76
医薬品		5.35
ソフトウェア		5.18
石油・ガス・消耗燃料		4.99
情報技術サービス		4.04
保険		3.80

インタラクティブ・メディアおよびサービス	3.25
半導体・半導体製造装置	3.13
コンピュータ・周辺機器	3.09
資本市場	2.79
ヘルスケア機器・用品	2.74
インターネット販売・通信販売	2.46
航空宇宙・防衛	2.30
化学	2.19
各種電気通信サービス	2.13
電力	2.08
飲料	1.99
食品	1.96
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	1.89
バイオテクノロジー	1.88
ホテル・レストラン・レジャー	1.77
専門小売り	1.72
機械	1.61
食品・生活必需品小売り	1.52
繊維・アパレル・贅沢品	1.45
家庭用品	1.40
金属・鉱業	1.32
コングロマリット	1.28
娯楽	1.26
メディア	1.26
総合公益事業	1.08
陸運・鉄道	0.98
各種金融サービス	0.95
自動車	0.83
タバコ	0.81
通信機器	0.77
ライフサイエンス・ツール/サービス	0.75
専門サービス	0.74
電気設備	0.72
パーソナル用品	0.72
電子装置・機器・部品	0.53
不動産管理・開発	0.53
航空貨物・物流サービス	0.53
複合小売り	0.52
商業サービス・用品	0.48
消費者金融	0.48
家庭用耐久財	0.41
建設関連製品	0.41
建設・土木	0.34
自動車部品	0.29
建設資材	0.29
無線通信サービス	0.29
容器・包装	0.29
商社・流通業	0.28
エネルギー設備・サービス	0.27
運送インフラ	0.21

ガス	0.20
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.11
旅客航空輸送業	0.11
ヘルスケア・テクノロジー	0.10
紙製品・林産品	0.10
水道	0.09
販売	0.07
海運業	0.06
レジャー用品	0.04
各種消費者サービス	0.01
合計	94.98

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

令和1年10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	3,375,280,000	114.34 3,859,338,704	118.35 3,994,812,644	5.25 2047/6/23	2.70
2	BRAZIL 2.625 01/05/23 ブラジル	国債証券	3,135,744,000	100.39 3,148,150,876	100.20 3,142,015,488	2.625 2023/1/5	2.12
3	BRAZIL 4.25 01/07/25 ブラジル	国債証券	2,406,248,000	105.94 2,549,223,772	105.55 2,539,963,201	4.25 2025/1/7	1.72
4	COLOMBIA 5.0 06/15/45 コロンビア	国債証券	2,177,600,000	113.19 2,464,988,760	115.17 2,508,050,800	5 2045/6/15	1.69
5	RUSSIAN FEDERATION 5.625 04/04/42 ロシア	国債証券	1,959,840,000	122.61 2,403,003,376	122.99 2,410,415,055	5.625 2042/4/4	1.63
6	CROATIA 6.375 03/24/21 クロアチア	国債証券	2,221,152,000	105.84 2,351,024,064	105.20 2,336,651,904	6.375 2021/3/24	1.58
7	RUSSIAN FEDERATION 4.375 03/21/29 ロシア	国債証券	2,112,272,000	105.79 2,234,766,790	107.86 2,278,317,701	4.375 2029/3/21	1.54
8	UNITED MEXICAN STATES 4.0 10/02/23 メキシコ	国債証券	2,123,160,000	106.11 2,252,939,516	105.90 2,248,437,055	4 2023/10/2	1.52
9	RUSSIAN FEDERATION 4.75 05/27/26 ロシア	国債証券	1,785,632,000	108.23 1,932,750,656	109.84 1,961,477,468	4.75 2026/5/27	1.33
10	UNITED MEXICAN STATES 6.05 01/11/40 メキシコ	国債証券	1,513,432,000	127.52 1,930,017,768	126.95 1,921,301,924	6.05 2040/1/11	1.30
11	UNITED MEXICAN STATES 4.5 04/22/29 メキシコ	国債証券	1,742,080,000	110.48 1,924,780,640	109.45 1,906,723,980	4.5 2029/4/22	1.29
12	RUSSIAN FEDERATION 4.5 04/04/22 ロシア	国債証券	1,720,304,000	105.27 1,810,990,152	105.27 1,811,093,043	4.5 2022/4/4	1.22

13	BRAZIL 5.625 02/21/47 ブラジル	国債証券	1,589,648,000	112.94 1,795,387,648	111.81 1,777,441,066	5.625 2047/2/21	1.20
14	PHILIPPINES 4.2 01/21/24 フィリピン	国債証券	1,611,424,000	108.72 1,751,971,748	108.19 1,743,526,234	4.2 2024/1/21	1.18
15	COLOMBIA 5.625 02/26/44 コロンビア	国債証券	1,415,440,000	125.89 1,781,930,080	123.00 1,741,005,354	5.625 2044/2/26	1.18
16	UNITED MEXICAN STATES 5.75 10/12/2110 メキシコ	国債証券	1,502,544,000	112.20 1,685,870,700	115.55 1,736,204,617	5.75 2110/10/12	1.17
17	UNITED MEXICAN STATES 4.6 01/23/46 メキシコ	国債証券	1,633,200,000	106.88 1,745,564,160	106.27 1,735,666,968	4.6 2046/1/23	1.17
18	PERU 5.625 11/18/50 ペルー	国債証券	1,197,680,000	139.81 1,674,539,558	144.50 1,730,659,576	5.625 2050/11/18	1.17
19	HUNGARY 5.75 11/22/23 ハンガリー	国債証券	1,524,320,000	113.29 1,726,913,016	113.00 1,722,583,729	5.75 2023/11/22	1.16
20	PHILIPPINES 9.5 02/02/30 フィリピン	国債証券	1,067,024,000	163.11 1,740,511,256	161.00 1,717,973,962	9.5 2030/2/2	1.16
21	UNITED MEXICAN STATES 4.75 03/08/44 メキシコ	国債証券	1,567,872,000	108.77 1,705,398,328	108.00 1,693,301,760	4.75 2044/3/8	1.14
22	CROATIA 6.0 01/26/24 クロアチア	国債証券	1,458,992,000	114.11 1,664,977,281	115.04 1,678,546,952	6 2024/1/26	1.13
23	BRAZIL 5.0 01/27/45 ブラジル	国債証券	1,611,424,000	102.14 1,645,928,072	103.13 1,661,934,085	5 2045/1/27	1.12
24	INDONESIA 5.875 01/15/24 インドネシア	国債証券	1,437,216,000	112.92 1,622,974,861	112.83 1,621,645,506	5.875 2024/1/15	1.10
25	INDONESIA 4.125 01/15/25 インドネシア	国債証券	1,502,544,000	106.06 1,593,626,692	106.86 1,605,697,805	4.125 2025/1/15	1.09
26	BRAZIL 4.625 01/13/28 ブラジル	国債証券	1,502,544,000	106.49 1,600,182,140	106.42 1,599,097,477	4.625 2028/1/13	1.08
27	RUSSIAN FEDERATION 4.875 09/16/23 ロシア	国債証券	1,458,992,000	109.42 1,596,507,440	109.47 1,597,291,310	4.875 2023/9/16	1.08
28	PHILIPPINES 3.7 02/02/42 フィリピン	国債証券	1,415,440,000	110.56 1,564,938,772	112.74 1,595,823,063	3.7 2042/2/2	1.08
29	BRAZIL 5.625 01/07/41 ブラジル	国債証券	1,426,328,000	112.51 1,604,820,428	111.62 1,592,152,893	5.625 2041/1/7	1.08
30	COLOMBIA 3.875 04/25/27 コロンビア	国債証券	1,480,768,000	106.07 1,570,734,237	105.80 1,566,652,544	3.875 2027/4/25	1.06

(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10月31日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	97.60
合計	97.60

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資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10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	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	95,541	19,448.92 1,858,169,606	19,329.46 1,846,756,549	- -	3.92
2	TAIWAN SEMICONDUCTOR 台湾	株式 半導体・半導体製造装置	1,663,083	916.75 1,524,634,298	1,072.20 1,783,174,223	- -	3.79
3	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	384,200	5,228.91 2,008,950,467	4,392.01 1,687,413,315	- -	3.58
4	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD 韓国	株式 コンピュータ・周辺機器	322,130	4,320.48 1,391,758,878	4,732.55 1,524,499,552	- -	3.24
5	CHINA CONSTRUCTION BANK 中国	株式 銀行	6,504,530	94.49 614,623,847	86.53 562,867,552	- -	1.20
6	PING AN INSURANCE GROUP CO-H 中国	株式 保険	371,000	1,289.16 478,278,933	1,257.04 466,363,695	- -	0.99
7	NASPERS LTD 南アフリカ	株式 インターネット販売・通信販売	29,527	17,464.36 515,670,262	15,336.79 452,849,457	- -	0.96
8	RELIANCE INDUSTRIES LTD インド	株式 石油・ガス・消耗燃料	194,344	2,062.92 400,917,965	2,292.60 445,554,026	- -	0.95
9	CHINA MOBILE LIMITED 香港	株式 無線通信サービス	408,500	1,025.95 419,102,779	886.18 362,005,347	- -	0.77

10	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP インド	株式 貯蓄・抵 当・不動 産金融	108,853	3,180.56 346,213,501	3,266.54 355,573,495	- -	0.76
11	IND & COMM BK OF CHINA - H 中国	株式 銀行	4,336,235	80.93 350,964,127	77.50 336,085,097	- -	0.71
12	ITAU UNIBANCO HOLDING SA ブラジル	株式 銀行	332,247	894.63 297,238,929	1,005.44 334,056,051	- -	0.71
13	GAZPROM PAO ADR ロシア	株式 石油・ガ ス・消耗 燃料	361,911	604.91 218,926,162	880.83 318,785,395	- -	0.68
14	SBERBANK ADR ロシア	株式 銀行	185,668	1,591.51 295,493,773	1,631.02 302,828,666	- -	0.64
15	VALE SA ブラジル	株式 金属・鉱 業	208,621	1,372.68 286,371,016	1,325.04 276,433,110	- -	0.59
16	SK HYNIX INC 韓国	株式 半導体・ 半導体製 造装置	35,926	7,354.49 264,217,532	7,652.84 274,936,289	- -	0.58
17	BANCO BRADESCO SA PREF ブラジル	株式 銀行	269,450	934.13 251,703,606	999.99 269,447,548	- -	0.57
18	LUKOIL SPON ADR ロシア	株式 石油・ガ ス・消耗 燃料	26,560	9,305.04 247,141,872	9,929.85 263,736,975	- -	0.56
19	HON HAI PRECISION INDUSTRY 台湾	株式 電子装 置・機 器・部品	832,225	310.18 258,139,666	287.11 238,945,113	- -	0.51
20	BANK OF CHINA LTD 中国	株式 銀行	5,329,200	50.21 267,605,821	44.72 238,352,733	- -	0.51
21	PETROLEO BRASILEIRO SA ブラジル	株式 石油・ガ ス・消耗 燃料	286,112	722.05 206,587,418	820.28 234,692,409	- -	0.50
22	INFOSYS LTD インド	株式 情報技術 サービス	228,666	1,142.24 261,192,922	1,023.92 234,137,977	- -	0.50
23	SAMSUNG ELECTRONICS-PFD 韓国	株式 コン ピュー タ・周辺 機器	55,914	3,493.02 195,308,844	3,859.28 215,788,341	- -	0.46

24	TATA CONSULTANCY SERVICES LTD インド	株式 情報技術 サービス	60,539	3,332.47 201,744,701	3,491.83 211,392,501	- -	0.45
25	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	18,625	16,411.71 305,668,131	11,207.01 208,730,717	- -	0.44
26	AMERICA MOVIL SAB DE CV メキシコ	株式 無線通信 サービス	2,314,678	82.45 190,862,600	88.12 203,974,054	- -	0.43
27	CNOOC LTD 香港	株式 石油・ガ ス・消耗 燃料	1,171,000	194.26 227,480,024	165.01 193,230,457	- -	0.41
28	B3 SA-BRASIL BOLSA BAICAO ブラジル	株式 資本市場	135,216	942.24 127,406,022	1,322.59 178,836,005	- -	0.38
29	PETROLEO BRASILEIRO SA ブラジル	株式 石油・ガ ス・消耗 燃料	198,210	805.47 159,653,622	889.82 176,371,242	- -	0.37
30	QATAR NATIONAL BANK カタール	株式 銀行	295,265	540.20 159,503,023	580.41 171,375,408	- -	0.36

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

令和1年10月31日現在

種類	投資比率(%)
株式	86.01
新株予約権証券	0.00
投資信託受益証券	0.79
投資証券	0.21
合計	87.01

(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10月31日現在

業種	国内/外国	投資比率(%)
銀行	外国	14.87
石油・ガス・消耗燃料		6.78
インターネット販売・通信販売		5.96
半導体・半導体製造装置		5.39
インタラクティブ・メディアおよびサービス		4.77
コンピュータ・周辺機器		4.53
保険		3.47
金属・鉱業		2.79
無線通信サービス		2.49
不動産管理・開発		2.31

化学	2.19
電子装置・機器・部品	1.86
食品	1.76
自動車	1.60
食品・生活必需品小売り	1.50
情報技術サービス	1.45
各種電気通信サービス	1.38
資本市場	1.24
コングロマリット	1.19
医薬品	1.14
電力	0.94
建設資材	0.93
飲料	0.90
運送インフラ	0.83
繊維・アパレル・贅沢品	0.80
貯蓄・抵当・不動産金融	0.80
各種金融サービス	0.67
ホテル・レストラン・レジャー	0.67
娯楽	0.65
建設・土木	0.65
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.59
各種消費者サービス	0.59
ガス	0.58
パーソナル用品	0.58
機械	0.56
複合小売り	0.51
専門小売り	0.48
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	0.47
自動車部品	0.46
タバコ	0.43
家庭用品	0.42
バイオテクノロジー	0.36
家庭用耐久財	0.33
陸運・鉄道	0.31
ライフサイエンス・ツール/サービス	0.27
消費者金融	0.26
旅客航空輸送業	0.23
水道	0.22
電気設備	0.21
紙製品・林産品	0.20
メディア	0.19
商業サービス・用品	0.17
航空宇宙・防衛	0.16
航空貨物・物流サービス	0.16
ソフトウェア	0.14
ヘルスケア機器・用品	0.12
レジャー用品	0.11
海運業	0.09
エネルギー設備・サービス	0.09
通信機器	0.06

総合公益事業	0.06
ヘルスケア・テクノロジー	0.05
専門サービス	0.03
商社・流通業	0.03
建設関連製品	0.00
合計	86.01

(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。

【投資不動産物件】

D I A Mコア資産設計ファンド(堅実型)

該当事項はありません。

D I A Mコア資産設計ファンド(積極型)

該当事項はありません。

(参考)

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。

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

該当事項はありません。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

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。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

D I A Mコア資産設計ファンド(堅実型)

該当事項はありません。

D I A Mコア資産設計ファンド(積極型)

該当事項はありません。

(参考)

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。

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10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 0112月	買建	394	6,372,551,846	6,573,890,000	2.58

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

(注2) 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

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10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	シカゴ商品 取引所	S&P500 EMINI FUT Dec19	買建	326	5,258,940,747	5,408,976,026	1.58
	EUREX 取引所	DJ EURO STOXX 50 Dec19	買建	299	1,281,660,495	1,311,027,094	0.38
	ICE-EU	FTSE 100 INDEX FUTURE Dec19	買建	45	453,741,685	462,373,386	0.14
	モントリ オール取引 所	S&P/TSE 60 IX FUT Dec19	買建	17	275,330,292	277,497,375	0.08
	シドニー先 物取引所	SPI 200 FUTURES Dec19	買建	16	199,175,824	200,847,040	0.06

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

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

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。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

令和1年10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	ICE-US	MINI MSCI EMG MKT Dec19	買建	1,064	5,808,425,170	6,077,982,108	12.91

(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。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

D I A Mコア資産設計ファンド(堅実型)

直近日(令和1年10月末)、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 (分配落) (百万円)	純資産総額 (分配付) (百万円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (平成27年10月13日)	301	301	0.9926	0.9926
第2計算期間末 (平成28年4月11日)	240	240	0.9460	0.9460
第3計算期間末 (平成28年10月11日)	233	233	0.9477	0.9477
第4計算期間末 (平成29年4月11日)	165	165	1.0000	1.0000
第5計算期間末 (平成29年10月11日)	141	141	1.0538	1.0538
第6計算期間末 (平成30年4月11日)	133	133	1.0645	1.0645
第7計算期間末 (平成30年10月11日)	154	154	1.0294	1.0294
第8計算期間末 (平成31年4月11日)	157	157	1.0513	1.0513
第9計算期間末 (令和1年10月11日)	145	145	1.0129	1.0129
平成30年10月末日	154	-	1.0150	-
11月末日	157	-	1.0173	-
12月末日	155	-	1.0050	-
平成31年1月末日	162	-	1.0174	-
2月末日	160	-	1.0354	-
3月末日	156	-	1.0364	-
4月末日	157	-	1.0512	-
令和1年5月末日	153	-	1.0293	-
6月末日	153	-	1.0337	-
7月末日	153	-	1.0326	-
8月末日	150	-	1.0108	-
9月末日	146	-	1.0131	-
10月末日	146	-	1.0328	-

D I A Mコア資産設計ファンド(積極型)

直近日(令和1年10月末)、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 (分配落) (百万円)	純資産総額 (分配付) (百万円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (平成27年10月13日)	519	519	0.9901	0.9901
第2計算期間末 (平成28年4月11日)	418	418	0.9230	0.9230
第3計算期間末 (平成28年10月11日)	404	404	0.9286	0.9286
第4計算期間末 (平成29年4月11日)	368	368	0.9691	0.9691
第5計算期間末 (平成29年10月11日)	312	312	1.0451	1.0451
第6計算期間末 (平成30年4月11日)	297	297	1.0571	1.0571
第7計算期間末 (平成30年10月11日)	290	290	1.0089	1.0089
第8計算期間末 (平成31年4月11日)	310	310	1.0353	1.0353
第9計算期間末 (令和1年10月11日)	281	281	0.9819	0.9819
平成30年10月末日	285	-	0.9895	-
11月末日	292	-	0.9930	-
12月末日	292	-	0.9754	-
平成31年1月末日	297	-	0.9919	-
2月末日	306	-	1.0169	-
3月末日	307	-	1.0182	-
4月末日	310	-	1.0348	-
令和1年5月末日	298	-	1.0050	-
6月末日	299	-	1.0073	-
7月末日	293	-	1.0058	-
8月末日	286	-	0.9777	-
9月末日	282	-	0.9820	-
10月末日	284	-	1.0091	-

【分配の推移】

D I A Mコア資産設計ファンド（堅実型）

	1口当たりの分配金（円）
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
第9計算期間	0.0000

D I A Mコア資産設計ファンド（積極型）

	1口当たりの分配金（円）
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
第9計算期間	0.0000

【収益率の推移】

D I A Mコア資産設計ファンド（堅実型）

	収益率（％）
第1計算期間	0.7
第2計算期間	4.7
第3計算期間	0.2
第4計算期間	5.5
第5計算期間	5.4
第6計算期間	1.0
第7計算期間	3.3
第8計算期間	2.1
第9計算期間	3.7

（注）収益率は期間騰落率です。

D I A Mコア資産設計ファンド(積極型)

	収益率(%)
第1計算期間	1.0
第2計算期間	6.8
第3計算期間	0.6
第4計算期間	4.4
第5計算期間	7.8
第6計算期間	1.1
第7計算期間	4.6
第8計算期間	2.6
第9計算期間	5.2

(注) 収益率は期間騰落率です。

(4) 【設定及び解約の実績】

D I A Mコア資産設計ファンド(堅実型)

	設定口数	解約口数
第1計算期間	312,448,290	8,299,019
第2計算期間	41,355,881	91,105,022
第3計算期間	7,228,942	14,873,920
第4計算期間	6,056,134	87,803,625
第5計算期間	10,207,312	41,322,402
第6計算期間	12,455,819	20,836,255
第7計算期間	33,165,458	8,351,305
第8計算期間	16,604,344	16,654,728
第9計算期間	1,311,733	7,974,207

(注1) 本邦外における設定及び解約はありません。

(注2) 第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

D I A Mコア資産設計ファンド(積極型)

	設定口数	解約口数
第1計算期間	538,147,596	13,046,804
第2計算期間	67,620,276	138,974,156
第3計算期間	13,958,010	31,768,621
第4計算期間	14,712,909	70,413,301
第5計算期間	38,653,832	119,655,755
第6計算期間	34,785,616	52,794,441
第7計算期間	43,415,961	36,374,469
第8計算期間	26,771,880	14,887,931
第9計算期間	6,903,112	20,146,926

(注1) 本邦外における設定及び解約はありません。

(注2) 第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

<< 参考情報 >>

データの基準日:2019年10月31日

(堅 実 型)

基準価額・純資産の推移 (2015年8月28日～2019年10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:2015年8月28日)

分配の推移(税引前)

2017年10月	0円
2018年 4月	0円
2018年10月	0円
2019年 4月	0円
2019年10月	0円
設定来累計	0円

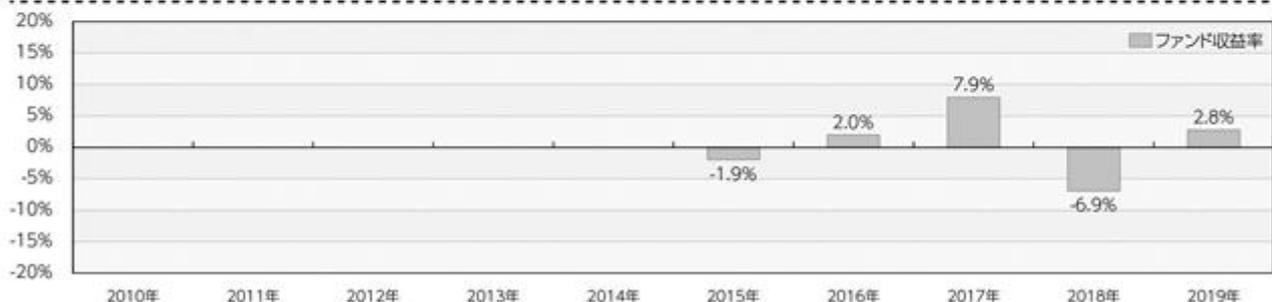
※分配金は1万口当たりです。

主要な資産の状況

■組入銘柄一覧 ※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

順位	銘柄名	比率(%)
1	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	24.43
2	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	20.52
3	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	11.76
4	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	8.14
5	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	7.77
6	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	7.75

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。

※2015年は設定日から年末までの収益率、および2019年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

※当ファンドにはベンチマークはありません。

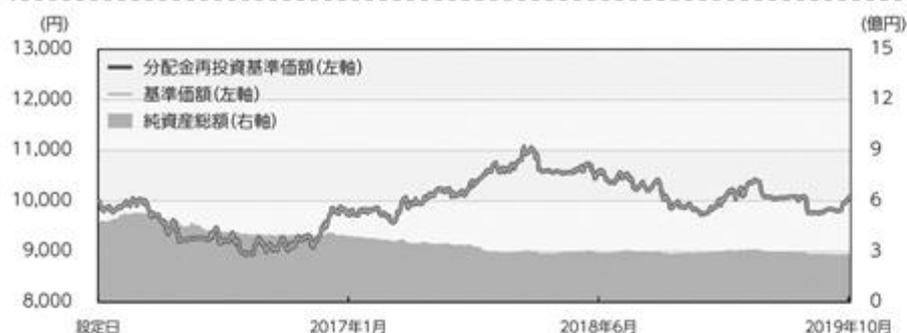
○掲載データ等はあくまでも過去の実績であり、将来の運用成果を示唆、保証するものではありません。

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

データの基準日:2019年10月31日

(積 極 型)

基準価額・純資産の推移 (2015年8月28日～2019年10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:2015年8月28日)

分配の推移(税引前)

2017年10月	0円
2018年4月	0円
2018年10月	0円
2019年4月	0円
2019年10月	0円
設定来累計	0円

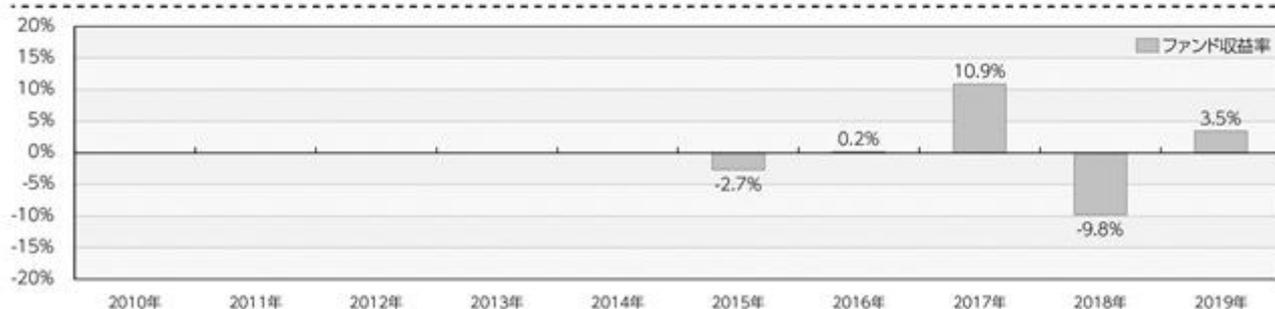
※分配金は1万口当たりです。

主要な資産の状況

■組入銘柄一覧 ※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

順位	銘柄名	比率(%)
1	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	29.07
2	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	24.47
3	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	14.00
4	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	9.71
5	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	9.30
6	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	9.29

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。

※2015年は設定日から年末までの収益率、および2019年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

※当ファンドにはベンチマークはありません。

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

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

主要な資産の状況

■国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還日	比率(%)
1	350回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.1	2028/3/20	0.95
2	339回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.4	2025/6/20	0.91
3	128回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.1	2021/6/20	0.91
4	129回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.1	2021/9/20	0.88
5	343回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.1	2026/6/20	0.88

■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	3.47
2	ソニー	株式	日本	電気機器	1.73
3	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	日本	銀行業	1.60
4	日本電信電話	株式	日本	情報・通信業	1.46
5	武田薬品工業	株式	日本	医薬品	1.35

■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(%)	償還日	比率(%)
1	US T N/B 1.375 04/30/21	国債証券	アメリカ	1.375	2021/4/30	0.82
2	US T N/B 2.125 08/15/21	国債証券	アメリカ	2.125	2021/8/15	0.82
3	US T N/B 2.0 11/15/21	国債証券	アメリカ	2	2021/11/15	0.77
4	US T N/B 2.0 05/31/21	国債証券	アメリカ	2	2021/5/31	0.75
5	US T N/B 2.125 12/31/21	国債証券	アメリカ	2.125	2021/12/31	0.73

■外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	業種	比率(%)
1	APPLE INC	株式	アメリカ	コンピュータ・周辺機器	2.81
2	MICROSOFT CORP	株式	アメリカ	ソフトウェア	2.65
3	AMAZON.COM INC	株式	アメリカ	インターネット販売・通信販売	1.87
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	1.14
5	JPMORGAN CHASE & CO	株式	アメリカ	銀行	1.03

○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。

■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(%)	償還日	比率(%)
1	RUSSIAN FEDERATION 5.25 06/23/47	国債証券	ロシア	5.25	2047/6/23	2.70
2	BRAZIL 2.625 01/05/23	国債証券	ブラジル	2.625	2023/1/5	2.12
3	BRAZIL 4.25 01/07/25	国債証券	ブラジル	4.25	2025/1/7	1.72
4	COLOMBIA 5.0 06/15/45	国債証券	コロンビア	5	2045/6/15	1.69
5	RUSSIAN FEDERATION 5.625 04/04/42	国債証券	ロシア	5.625	2042/4/4	1.63

■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	ALIBABA GROUP HOLDING LTD-ADR	株式	ケイマン諸島	インターネット販売・通信販売	3.92
2	TAIWAN SEMICONDUCTOR	株式	台湾	半導体・半導体製造装置	3.79
3	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	3.58
4	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	株式	韓国	コンピュータ・周辺機器	3.24
5	CHINA CONSTRUCTION BANK	株式	中国	銀行	1.20

○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。

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

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

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。)には取得またはスイッチングの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、取得のお申込み(スイッチングのお申込みを含みます。)の受付を中止することおよびすでに受付けた取得のお申込み(スイッチングのお申込みを含みます。)の受付を取り消すことができるものとします。

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

・お申込価額

お申込日の翌営業日の基準価額とします。

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

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

< 基準価額の照会方法等 >

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

各ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・ 販売会社へのお問い合わせ
- ・ 委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

・ お申込手数料

お申込日の翌営業日の基準価額に、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は、1口単位となります。

当初元本は1口当たり1円です。

・ 払込期日

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

2【換金（解約）手続等】

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

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

海外休業日には、解約の受付を行いません。

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

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

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

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

・解約価額

解約価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

各ファンドの解約価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

・解約単位

各販売会社が定める単位とします。

解約単位は販売会社にお問い合わせください。

・解約代金の受渡日

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

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

基準価額とは純資産総額（信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券を除きます。）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。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

(2) 【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

信託期間は、2015年8月28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4月12日から10月11日まで、および10月12日から翌年4月11日までとします。

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

(5) 【その他】

イ.償還規定

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

ロ. 信託約款の変更等

- a. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、約款を変更することまたはこの信託と他の投資信託との併合(投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。)を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合

しようとする旨およびその内容を監督官庁に届出ます。なお、約款はa.からg.に定める以外の方法によって変更することができないものとします。

- b. 委託会社は、上記a.の事項(上記a.の変更事項にあつては、その内容が重大なものに該当する場合に限り、上記a.の併合事項にあつては、その併合が受益者の利益におよぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下、「重大な約款の変更等」といいます。)について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、約款にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
- c. 上記b.の書面決議において、受益者(委託会社およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下同じ。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行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であっても、当該併合にかかる一または複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。
- h. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて約款を変更しようとするときは、上記a.からg.の規定にしたがいます。
- i. この信託は、受益者が一部解約請求を行ったときは、委託会社が信託契約の一部の解約をすることにより当該請求に応じ、当該受益権の公正な価格が当該受益者に一部解約金として支払われることとなる委託者指図型投資信託に該当するため、重大な約款の変更等を行う場合において、投資信託及び投資法人に関する法律第18条第1項に定める反対受益者による受益権買取請求の規定の適用を受けません。

八. 関係法人との契約の更改

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

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、原則として期間満了の1ヵ月前までに、当事者間の別段の意思表示がない限り、半年毎に自動的に更新されます。当該契約は、当事者間の合意により変更することができます。

二．公告

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

（URL <http://www.am-one.co.jp/>）

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

ホ．運用報告書

・委託会社は、毎年4月11日、10月11日（休業日の場合は翌営業日とします。）および償還時に交付運用報告書を作成し、販売会社を通じて受益者に対して交付します。

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

（URL <http://www.am-one.co.jp/>）

4【受益者の権利等】

収益分配金請求権

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

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

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

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

償還金請求権

受益者は、持ち分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

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

一部解約請求権

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

帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

D I A Mコア資産設計ファンド(堅実型)

D I A Mコア資産設計ファンド(積極型)

(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ヵ月毎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9期計算期間(平成31年4月12日から令和1年10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】

【DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)】

(1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第8期 平成31年4月11日現在	第9期 令和1年10月11日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	33,429,278	131,035,915
親投資信託受益証券	126,109,471	15,294,045
流動資産合計	159,538,749	146,329,960
資産合計	159,538,749	146,329,960
負債の部		
流動負債		
未払解約金	654,837	-
未払受託者報酬	42,628	41,097
未払委託者報酬	853,412	822,648
その他未払費用	3,160	3,044
流動負債合計	1,554,037	866,789
負債合計	1,554,037	866,789
純資産の部		
元本等		
元本	150,275,904	143,613,430
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	7,708,808	1,849,741
(分配準備積立金)	7,293,517	6,908,558
元本等合計	157,984,712	145,463,171
純資産合計	157,984,712	145,463,171
負債純資産合計	159,538,749	146,329,960

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第8期 自 平成30年10月12日 至 平成31年4月11日	第9期 自 平成31年4月12日 至 令和1年10月11日
営業収益		
有価証券売買等損益	4,393,877	4,815,426
営業収益合計	4,393,877	4,815,426
営業費用		
支払利息	35,694	39,446
受託者報酬	42,628	41,097
委託者報酬	853,412	822,648
その他費用	3,160	13,844
営業費用合計	934,894	917,035
営業利益又は営業損失()	3,458,983	5,732,461
経常利益又は経常損失()	3,458,983	5,732,461
当期純利益又は当期純損失()	3,458,983	5,732,461
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()	78,904	245,850
期首剰余金又は期首欠損金()	4,420,799	7,708,808
剰余金増加額又は欠損金減少額	218,042	35,781
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	218,042	35,781
剰余金減少額又は欠損金増加額	467,920	408,237
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	467,920	408,237
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金()	7,708,808	1,849,741

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第9期	
	自 平成31年4月12日	至 令和1年10月11日
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8期	第9期
	平成31年4月11日現在	令和1年10月11日現在
1. 期首元本額	150,326,288円	150,275,904円
期中追加設定元本額	16,604,344円	1,311,733円
期中一部解約元本額	16,654,728円	7,974,207円
2. 受益権の総数	150,275,904口	143,613,430口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第8期	第9期
	自 平成30年10月12日 至 平成31年4月11日	自 平成31年4月12日 至 令和1年10月11日
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(754,600円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(3,718,910円)及び分配準備積立金(6,538,917円)より分配対象収益は11,012,427円(1万口当たり732.81円)ですが、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(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(3,615,715円)及び分配準備積立金(6,908,558円)より分配対象収益は10,524,273円(1万口当たり732.81円)ですが、分配を行っておりません。

（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8期 自 平成30年10月12日 至 平成31年4月11日	第9期 自 平成31年4月12日 至 令和1年10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。	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。
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（親投資信託受益証券が保有する金融商品を含む）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。	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、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。
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。	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。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第8期 平成31年4月11日現在	第9期 令和1年10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。	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。
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。	(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。
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。	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第8期 平成31年4月11日現在	第9期 令和1年10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	6,810,787	79,299
合計	6,810,787	79,299

(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8期 平成31年4月11日現在	第9期 令和1年10月11日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0513円 (10,513円)	1.0129円 (10,129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10月11日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	国内株式パッシブ・ファンド (最適化法)・マザーファンド	1,881,574	4,743,824	
	国内債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	1,200,479	1,594,356	
	外国株式パッシブ・ファンド・ マザーファンド	395,592	1,426,267	
	外国債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	1,260,301	2,369,743	
	エマージング株式パッシブ・マ ザーファンド	3,252,714	3,553,915	
	エマージング債券パッシブ・マ ザーファンド	792,509	1,605,940	
親投資信託受益証券 合計		8,783,169	15,294,045	
合計			15,294,045	

(注) 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。

【DIAMコア資産設計ファンド(積極型)】

(1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第8期 平成31年4月11日現在	第9期 令和1年10月11日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	23,943,736	233,373,987
親投資信託受益証券	288,508,000	50,054,337
流動資産合計	312,451,736	283,428,324
資産合計	312,451,736	283,428,324
負債の部		
流動負債		
未払解約金	32,181	30,205
未払受託者報酬	79,887	79,685
未払委託者報酬	1,598,477	1,594,836
その他未払費用	5,981	5,972
流動負債合計	1,716,526	1,710,698
負債合計	1,716,526	1,710,698
純資産の部		
元本等		
元本	300,150,602	286,906,788
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	10,584,608	5,189,162
(分配準備積立金)	15,907,967	14,854,053
元本等合計	310,735,210	281,717,626
純資産合計	310,735,210	281,717,626
負債純資産合計	312,451,736	283,428,324

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第8期 自 平成30年10月12日 至 平成31年4月11日	第9期 自 平成31年4月12日 至 令和1年10月11日
営業収益		
有価証券売買等損益	9,932,540	14,053,663
営業収益合計	9,932,540	14,053,663
営業費用		
支払利息	49,336	64,541
受託者報酬	79,887	79,685
委託者報酬	1,598,477	1,594,836
その他費用	5,981	16,772
営業費用合計	1,733,681	1,755,834
営業利益又は営業損失()	8,198,859	15,809,497
経常利益又は経常損失()	8,198,859	15,809,497
当期純利益又は当期純損失()	8,198,859	15,809,497
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()	121,739	727,479
期首剰余金又は期首欠損金()	2,579,899	10,584,608
剰余金増加額又は欠損金減少額	-	11,888
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	11,888
剰余金減少額又は欠損金増加額	315,889	703,640
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	117,878	703,640
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	198,011	-
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金()	10,584,608	5,189,162

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第9期	
	自 平成31年4月12日 至 令和1年10月11日	
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8期	第9期
	平成31年4月11日現在	令和1年10月11日現在
1. 期首元本額	288,266,653円	300,150,602円
期中追加設定元本額	26,771,880円	6,903,112円
期中一部解約元本額	14,887,931円	20,146,926円
2. 受益権の総数	300,150,602口	286,906,788口
3. 元本の欠損	-	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は5,189,162円であります。

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第8期	第9期
	自 平成30年10月12日 至 平成31年4月11日	自 平成31年4月12日 至 令和1年10月11日
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(1,951,688円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(6,172,475円)及び分配準備積立金(13,956,279円)より分配対象収益は22,080,442円(1万口当たり735.65円)ですが、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(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(6,252,970円)及び分配準備積立金(14,854,053円)より分配対象収益は21,107,023円(1万口当たり735.67円)ですが、分配を行っておりません。

（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8期 自 平成30年10月12日 至 平成31年4月11日	第9期 自 平成31年4月12日 至 令和1年10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。	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。
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（親投資信託受益証券が保有する金融商品を含む）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。	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、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。
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。	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。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第8期 平成31年4月11日現在	第9期 令和1年10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。	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。
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。	(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。
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。	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第8期 平成31年4月11日現在	第9期 令和1年10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	17,321,533	147,177
合計	17,321,533	147,177

(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8期 平成31年4月11日現在	第9期 令和1年10月11日現在
1口当たり純資産額	1.0353円	0.9819円
(1万口当たり純資産額)	(10,353円)	(9,819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10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	6,139,573	15,479,091	
	国内債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	3,866,315	5,134,852	
	外国株式パッシブ・ファンド・ マザーファンド	1,323,213	4,770,712	
	外国債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	4,172,695	7,845,918	
	エマージング株式パッシブ・マ ザーファンド	10,606,470	11,588,629	
	エマージング債券パッシブ・マ ザーファンド	2,583,466	5,235,135	
親投資信託受益証券 合計		28,691,732	50,054,337	
合計			50,054,337	

(注) 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)

「DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)」、「DIAMコア資産設計ファンド(積極型)」は、「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」受益証券及び「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。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

令和1年10月11日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,208,294,086
国債証券	195,553,745,100
地方債証券	21,263,886,621
特殊債券	18,039,416,856
社債券	12,114,129,610
未収利息	339,807,718
前払費用	17,143,289
流動資産合計	248,536,423,280
資産合計	248,536,423,280
負債の部	
流動負債	
未払解約金	624,309,000
流動負債合計	624,309,000
負債合計	624,309,000
純資産の部	
元本等	
元本	186,660,155,663
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	61,251,958,617
元本等合計	247,912,114,280
純資産合計	247,912,114,280
負債純資産合計	248,536,423,280

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自 平成31年4月12日 至 令和1年10月11日
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	令和1年10月11日現在
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	223,413,510,899円
同期中追加設定元本額	72,478,665,716円
同期中一部解約元本額	109,232,020,952円
元本の内訳 ファンド名	
D I A M国内債券パッシブ・ファンド	20,677,232,267円
M I T O ラップ型ファンド（安定型）	87,197,411円
M I T O ラップ型ファンド（中立型）	75,749,652円
M I T O ラップ型ファンド（積極型）	22,389,481円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	915,869,003円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	245,941,025円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	28,239,838円
たわらノーロード 国内債券	8,382,931,545円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	433,558,208円

たわらノーロード バランス(堅実型)	118,242,625円
たわらノーロード バランス(標準型)	211,303,274円
たわらノーロード バランス(積極型)	27,657,449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)	10,036,567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)	300,328,472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)	309,772,823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)	79,353,438円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(積極型)	19,930,622円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	7,380,047円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	6,086,731円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	6,109,728円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	961,863円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	17,517円
DIAM国内債券インデックスファンド<DC年金>	13,803,658,546円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	6,420,854,199円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	8,862,931,448円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	3,494,179,735円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	1,782,018,229円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	1,960,264,036円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	299,901,798円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	86,674,059円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	2,390,880,521円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	2,490,772円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	3,369,641,349円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	884,054,003円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	183,655,152円
投資のソムリエ	4,603,326,337円
クルーズコントロール	347,315,370円
投資のソムリエ<DC年金>	482,982,700円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	2,760,752,568円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	317,841,964円
クルーズコントロール<DC年金>	781,611円
DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)	1,200,479円
DIAMコア資産設計ファンド(積極型)	3,866,315円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	1,058,588,984円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	12,237,590,820円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2045)	3,177,875円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2055)	2,504,753円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	7,703,848円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2035)	4,689,945円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	132,025,685円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	6,444,824,407円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	2,748,410,399円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2040)	443,512円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2050)	406,339円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2060)	398,877円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	285,435円
DIAMエマージング債券ファンド	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)	7,841,310,777円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	406,407,412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)	4,950,527,114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)	4,974,701,827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)	4,951,101,131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)	4,993,014,716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)	2,488,545,931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)	225,405,873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)	166,539,381円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	59,717,541円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	156,535,970円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	76,079,427円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	34,436,158円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	86,554,365円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	172,455,085円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	4,671,418,291円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	2,569,341,467円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	4,840,246,595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)	516,195,730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)	238,854,583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)	2,834,870,068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)	310,729,436円
DIAM世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	18,748,898円
DIAM世界バランスファンド35VA(適格機関投資家限定)	59,877,782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)	2,994,651,779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)	92,338,342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)	619,359,263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)	1,044,691,345円
DIAMバランス30VA(適格機関投資家限定)	19,255,261円
DIAMバランス50VA(適格機関投資家限定)	568,933円
DIAMバランス70VA(適格機関投資家限定)	367,322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)	26,580,920,636円
DIAM世界バランス25VA(適格機関投資家限定)	387,372,331円
DIAM国内バランス30VA(適格機関投資家限定)	111,150,620円
DIAMバランス20VA(適格機関投資家限定)	488,696,759円
DIAMバランス40VA(適格機関投資家限定)	719,338円
DIAMバランス60VA(適格機関投資家限定)	386,510円
計	186,660,155,663円
2. 受益権の総数	186,660,155,663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31年4月12日 至 令和1年10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。
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、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。
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。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	令和1年10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。
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。
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。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	令和1年10月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
国債証券	2,539,092,600
地方債証券	107,666,033
特殊債券	54,384,752
社債券	58,909,690
合計	2,426,901,629

(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31年2月15日から令和1年10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)

	令和1年10月11日現在
1口当たり純資産額	1.3281円
(1万口当たり純資産額)	(13,281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10月11日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
国債証券	396回 利付国庫債券(2年)	700,000,000	703,276,000	
	397回 利付国庫債券(2年)	800,000,000	804,008,000	
	398回 利付国庫債券(2年)	1,100,000,000	1,105,841,000	
	126回 利付国庫債券(5年)	1,300,000,000	1,305,928,000	
	127回 利付国庫債券(5年)	1,820,000,000	1,830,028,200	
	128回 利付国庫債券(5年)	2,200,000,000	2,214,278,000	
	129回 利付国庫債券(5年)	2,120,000,000	2,136,048,400	
	130回 利付国庫債券(5年)	2,050,000,000	2,067,527,500	
	131回 利付国庫債券(5年)	1,420,000,000	1,433,703,000	
	132回 利付国庫債券(5年)	1,200,000,000	1,212,792,000	
	133回 利付国庫債券(5年)	1,180,000,000	1,194,124,600	
	134回 利付国庫債券(5年)	1,180,000,000	1,195,540,600	
	135回 利付国庫債券(5年)	1,800,000,000	1,825,866,000	
	136回 利付国庫債券(5年)	1,250,000,000	1,269,300,000	
	137回 利付国庫債券(5年)	1,400,000,000	1,422,834,000	
	138回 利付国庫債券(5年)	1,450,000,000	1,475,172,000	
	139回 利付国庫債券(5年)	1,300,000,000	1,324,219,000	
	140回 利付国庫債券(5年)	1,300,000,000	1,325,623,000	
	2回 利付国庫債券(40年)	380,000,000	572,135,600	
	3回 利付国庫債券(40年)	380,000,000	578,082,600	
4回 利付国庫債券(40年)	490,000,000	751,978,500		
5回 利付国庫債券(40年)	480,000,000	713,764,800		
6回 利付国庫債券(40年)	500,000,000	734,120,000		
7回 利付国庫債券(40年)	580,000,000	820,572,400		

8回 利付国庫債券(40年)	520,000,000	688,833,600	
9回 利付国庫債券(40年)	850,000,000	844,628,000	
10回 利付国庫債券(40年)	840,000,000	978,314,400	
11回 利付国庫債券(40年)	580,000,000	656,177,200	
12回 利付国庫債券(40年)	210,000,000	214,953,900	
313回 利付国庫債券(10年)	1,790,000,000	1,830,650,900	
314回 利付国庫債券(10年)	800,000,000	815,880,000	
315回 利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,537,575,000	
316回 利付国庫債券(10年)	1,000,000,000	1,023,370,000	
317回 利付国庫債券(10年)	600,000,000	616,134,000	
318回 利付国庫債券(10年)	1,400,000,000	1,434,930,000	
319回 利付国庫債券(10年)	800,000,000	824,312,000	
320回 利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,542,285,000	
321回 利付国庫債券(10年)	800,000,000	825,224,000	
322回 利付国庫債券(10年)	500,000,000	514,545,000	
323回 利付国庫債券(10年)	750,000,000	774,202,500	
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)	1,300,000,000	1,342,289,000	
326回 利付国庫債券(10年)	500,000,000	516,140,000	
327回 利付国庫債券(10年)	1,200,000,000	1,242,588,000	
328回 利付国庫債券(10年)	1,090,000,000	1,124,356,800	
329回 利付国庫債券(10年)	1,770,000,000	1,842,764,700	
330回 利付国庫債券(10年)	1,450,000,000	1,513,756,500	
331回 利付国庫債券(10年)	650,000,000	673,406,500	
332回 利付国庫債券(10年)	1,410,000,000	1,464,031,200	
333回 利付国庫債券(10年)	2,050,000,000	2,133,722,000	

334回 利付国庫債券(10年)	2,020,000,000	2,107,769,000	
335回 利付国庫債券(10年)	2,000,000,000	2,081,640,000	
336回 利付国庫債券(10年)	700,000,000	730,233,000	
337回 利付国庫債券(10年)	940,000,000	970,700,400	
338回 利付国庫債券(10年)	1,580,000,000	1,642,820,800	
339回 利付国庫債券(10年)	1,640,000,000	1,708,289,600	
340回 利付国庫債券(10年)	1,900,000,000	1,983,296,000	
341回 利付国庫債券(10年)	1,910,000,000	1,985,903,400	
342回 利付国庫債券(10年)	1,980,000,000	2,035,222,200	
343回 利付国庫債券(10年)	2,080,000,000	2,140,340,800	
344回 利付国庫債券(10年)	1,930,000,000	1,987,456,100	
345回 利付国庫債券(10年)	2,360,000,000	2,433,726,400	
346回 利付国庫債券(10年)	1,920,000,000	1,982,092,800	
347回 利付国庫債券(10年)	1,950,000,000	2,014,467,000	
348回 利付国庫債券(10年)	1,930,000,000	1,995,137,500	
349回 利付国庫債券(10年)	1,760,000,000	1,819,804,800	
350回 利付国庫債券(10年)	2,250,000,000	2,325,802,500	
351回 利付国庫債券(10年)	2,110,000,000	2,180,347,400	
352回 利付国庫債券(10年)	2,020,000,000	2,085,528,800	
353回 利付国庫債券(10年)	1,650,000,000	1,702,651,500	
354回 利付国庫債券(10年)	1,470,000,000	1,515,276,000	
355回 利付国庫債券(10年)	1,450,000,000	1,493,659,500	
1回 利付国庫債券(30年)	100,000,000	130,003,000	
2回 利付国庫債券(30年)	100,000,000	126,810,000	
3回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	252,342,000	
4回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	267,638,000	
5回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	253,662,000	
6回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	260,276,000	
8回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	248,150,000	

11回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	246,846,000	
12回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	258,512,000	
13回 利付国庫債券(30年)	300,000,000	384,537,000	
14回 利付国庫債券(30年)	290,000,000	389,290,200	
15回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	272,198,000	
16回 利付国庫債券(30年)	300,000,000	409,539,000	
17回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	271,016,000	
18回 利付国庫債券(30年)	320,000,000	429,897,600	
19回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	269,380,000	
20回 利付国庫債券(30年)	300,000,000	414,531,000	
21回 利付国庫債券(30年)	300,000,000	406,062,000	
22回 利付国庫債券(30年)	320,000,000	444,480,000	
23回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	278,746,000	
24回 利付国庫債券(30年)	300,000,000	419,526,000	
25回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	273,624,000	
26回 利付国庫債券(30年)	400,000,000	555,680,000	
27回 利付国庫債券(30年)	420,000,000	593,901,000	
28回 利付国庫債券(30年)	480,000,000	682,267,200	
29回 利付国庫債券(30年)	710,000,000	1,001,313,000	
30回 利付国庫債券(30年)	720,000,000	1,006,516,800	
31回 利付国庫債券(30年)	600,000,000	831,600,000	
32回 利付国庫債券(30年)	860,000,000	1,215,627,200	
33回 利付国庫債券(30年)	870,000,000	1,183,426,200	
34回 利付国庫債券(30年)	820,000,000	1,154,592,800	
35回 利付国庫債券(30年)	770,000,000	1,056,755,700	

36回 利付国庫債券(30年)	1,000,000,000	1,378,960,000	
37回 利付国庫債券(30年)	790,000,000	1,076,201,200	
38回 利付国庫債券(30年)	670,000,000	901,826,700	
39回 利付国庫債券(30年)	480,000,000	658,531,200	
40回 利付国庫債券(30年)	450,000,000	608,184,000	
41回 利付国庫債券(30年)	460,000,000	612,089,800	
42回 利付国庫債券(30年)	510,000,000	679,457,700	
43回 利付国庫債券(30年)	500,000,000	666,975,000	
44回 利付国庫債券(30年)	560,000,000	747,930,400	
45回 利付国庫債券(30年)	650,000,000	837,512,000	
46回 利付国庫債券(30年)	730,000,000	941,400,700	
47回 利付国庫債券(30年)	660,000,000	868,711,800	
48回 利付国庫債券(30年)	590,000,000	747,943,000	
49回 利付国庫債券(30年)	660,000,000	837,243,000	
50回 利付国庫債券(30年)	680,000,000	760,457,600	
51回 利付国庫債券(30年)	730,000,000	722,853,300	
52回 利付国庫債券(30年)	680,000,000	706,839,600	
53回 利付国庫債券(30年)	600,000,000	638,814,000	
54回 利付国庫債券(30年)	700,000,000	781,760,000	
55回 利付国庫債券(30年)	590,000,000	658,658,300	
56回 利付国庫債券(30年)	680,000,000	758,818,800	
57回 利付国庫債券(30年)	650,000,000	725,959,000	
58回 利付国庫債券(30年)	860,000,000	960,052,400	
59回 利付国庫債券(30年)	680,000,000	740,098,400	
60回 利付国庫債券(30年)	500,000,000	571,495,000	

61回 利付国庫債券(30年)	600,000,000	653,004,000	
62回 利付国庫債券(30年)	500,000,000	516,560,000	
63回 利付国庫債券(30年)	570,000,000	573,038,100	
48回 利付国庫債券(20年)	500,000,000	516,535,000	
64回 利付国庫債券(20年)	600,000,000	652,512,000	
72回 利付国庫債券(20年)	350,000,000	392,143,500	
73回 利付国庫債券(20年)	340,000,000	381,354,200	
75回 利付国庫債券(20年)	140,000,000	158,624,200	
78回 利付国庫債券(20年)	190,000,000	214,274,400	
81回 利付国庫債券(20年)	240,000,000	273,499,200	
83回 利付国庫債券(20年)	480,000,000	553,070,400	
85回 利付国庫債券(20年)	440,000,000	509,537,600	
88回 利付国庫債券(20年)	750,000,000	883,207,500	
90回 利付国庫債券(20年)	700,000,000	824,747,000	
92回 利付国庫債券(20年)	1,000,000,000	1,176,560,000	
93回 利付国庫債券(20年)	250,000,000	293,790,000	
94回 利付国庫債券(20年)	800,000,000	946,208,000	
95回 利付国庫債券(20年)	350,000,000	421,529,500	
97回 利付国庫債券(20年)	500,000,000	601,315,000	
99回 利付国庫債券(20年)	900,000,000	1,079,793,000	
100回 利付国庫債券(20年)	600,000,000	727,800,000	
102回 利付国庫債券(20年)	360,000,000	444,834,000	
105回 利付国庫債券(20年)	400,000,000	485,208,000	
106回 利付国庫債券(20年)	350,000,000	427,749,000	
107回 利付国庫債券(20年)	400,000,000	487,180,000	

108回 利付国庫債券(20年)	400,000,000	479,680,000	
109回 利付国庫債券(20年)	520,000,000	625,222,000	
110回 利付国庫債券(20年)	630,000,000	769,595,400	
111回 利付国庫債券(20年)	290,000,000	358,344,300	
112回 利付国庫債券(20年)	550,000,000	674,195,500	
113回 利付国庫債券(20年)	770,000,000	947,046,100	
114回 利付国庫債券(20年)	550,000,000	678,639,500	
115回 利付国庫債券(20年)	400,000,000	497,696,000	
116回 利付国庫債券(20年)	450,000,000	561,721,500	
117回 利付国庫債券(20年)	650,000,000	804,492,000	
118回 利付国庫債券(20年)	310,000,000	381,715,400	
119回 利付国庫債券(20年)	300,000,000	362,901,000	
120回 利付国庫債券(20年)	400,000,000	475,196,000	
121回 利付国庫債券(20年)	540,000,000	660,825,000	
122回 利付国庫債券(20年)	250,000,000	303,167,500	
123回 利付国庫債券(20年)	680,000,000	850,115,600	
124回 利付国庫債券(20年)	200,000,000	247,770,000	
125回 利付国庫債券(20年)	360,000,000	455,709,600	
126回 利付国庫債券(20年)	450,000,000	559,233,000	
127回 利付国庫債券(20年)	450,000,000	554,031,000	
128回 利付国庫債券(20年)	550,000,000	679,189,500	
129回 利付国庫債券(20年)	440,000,000	538,155,200	
130回 利付国庫債券(20年)	580,000,000	711,352,600	
131回 利付国庫債券(20年)	450,000,000	546,489,000	
132回 利付国庫債券(20年)	540,000,000	657,423,000	

133回 利付国庫債券(20年)	570,000,000	700,951,800	
134回 利付国庫債券(20年)	620,000,000	764,385,600	
135回 利付国庫債券(20年)	350,000,000	427,126,000	
136回 利付国庫債券(20年)	200,000,000	241,568,000	
137回 利付国庫債券(20年)	350,000,000	428,155,000	
138回 利付国庫債券(20年)	280,000,000	335,378,400	
139回 利付国庫債券(20年)	430,000,000	520,532,200	
140回 利付国庫債券(20年)	940,000,000	1,152,599,800	
141回 利付国庫債券(20年)	650,000,000	798,804,500	
142回 利付国庫債券(20年)	400,000,000	496,864,000	
143回 利付国庫債券(20年)	560,000,000	682,136,000	
144回 利付国庫債券(20年)	510,000,000	614,366,400	
145回 利付国庫債券(20年)	850,000,000	1,049,095,500	
146回 利付国庫債券(20年)	850,000,000	1,051,305,500	
147回 利付国庫債券(20年)	980,000,000	1,200,647,000	
148回 利付国庫債券(20年)	880,000,000	1,067,360,800	
149回 利付国庫債券(20年)	900,000,000	1,093,356,000	
150回 利付国庫債券(20年)	1,100,000,000	1,322,046,000	
151回 利付国庫債券(20年)	1,010,000,000	1,184,992,600	
152回 利付国庫債券(20年)	990,000,000	1,162,507,500	
153回 利付国庫債券(20年)	1,040,000,000	1,238,390,400	
154回 利付国庫債券(20年)	850,000,000	999,753,000	
155回 利付国庫債券(20年)	980,000,000	1,122,227,400	
156回 利付国庫債券(20年)	930,000,000	974,295,900	
157回 利付国庫債券(20年)	850,000,000	861,823,500	

	158回 利付国庫債券(20年)	860,000,000	914,223,000	
	159回 利付国庫債券(20年)	870,000,000	938,712,600	
	160回 利付国庫債券(20年)	850,000,000	931,770,000	
	161回 利付国庫債券(20年)	960,000,000	1,035,292,800	
	162回 利付国庫債券(20年)	650,000,000	700,459,500	
	163回 利付国庫債券(20年)	770,000,000	829,852,100	
	164回 利付国庫債券(20年)	1,010,000,000	1,069,549,600	
	165回 利付国庫債券(20年)	920,000,000	973,194,400	
	166回 利付国庫債券(20年)	900,000,000	984,771,000	
	167回 利付国庫債券(20年)	800,000,000	845,112,000	
	168回 利付国庫債券(20年)	800,000,000	829,144,000	
	169回 利付国庫債券(20年)	850,000,000	864,450,000	
国債証券 合計		174,910,000,000	195,553,745,100	
地方債証券	697回 東京都公募公債	500,000,000	509,135,000	
	701回 東京都公募公債	700,000,000	713,055,000	
	708回 東京都公募公債	500,000,000	511,560,000	
	720回 東京都公募公債	300,000,000	309,180,000	
	726回 東京都公募公債	400,000,000	411,540,000	
	5回 東京都公募公債 20年	100,000,000	111,231,000	
	9回 東京都公募公債 20年	200,000,000	231,802,000	
	10回 東京都公募公債 20年	300,000,000	347,085,000	
	22年度12回 北海道公募公債	200,000,000	203,258,000	
	30年度14回 北海道公募公債	300,000,000	302,991,000	
	194回 神奈川県公募公債	300,000,000	307,281,000	
	208回 神奈川県公募公債	300,000,000	307,167,000	
	345回 大阪府公募公債	300,000,000	304,482,000	
	356回 大阪府公募公債	200,000,000	204,572,000	
	364回 大阪府公募公債	300,000,000	306,738,000	
	374回 大阪府公募公債	300,000,000	310,206,000	
	26年度11回 京都府公募公債	350,000,000	357,878,500	
	26年度17回 兵庫県公募公債	200,000,000	204,498,000	
	1回 兵庫県公募公債(12年)	300,000,000	314,934,000	
	23年度9回 静岡県公募公債	200,000,000	204,328,000	

8回 静岡県公募公債 15年	200,000,000	215,192,000	
1回 静岡県公募公債 20年	100,000,000	112,686,000	
23年度20回 愛知県公募公債	500,000,000	513,005,000	
25年度4回 愛知県公募公債	300,000,000	308,895,000	
30年度19回 愛知県公募公債	200,000,000	200,928,000	
23年度2回 埼玉県公募公債	200,000,000	203,774,000	
26年度5回 埼玉県公募公債	400,000,000	410,924,000	
14回 埼玉県公募公債 20年	300,000,000	359,211,000	
25年度11回 福岡県公募公債	200,000,000	205,710,000	
24年度2回 福岡県公募公債(20年)	300,000,000	356,337,000	
24年度7回 千葉県公募公債	300,000,000	306,804,000	
25年度5回 千葉県公募公債	200,000,000	206,182,000	
14回 千葉県公募公債 20年	100,000,000	113,050,000	
94回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,574,000	
99回 共同発行市場公募地方債	700,000,000	713,643,000	
106回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	306,489,000	
109回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	512,970,000	
111回 共同発行市場公募地方債	700,000,000	716,247,000	
119回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	512,900,000	
121回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	509,405,000	
126回 共同発行市場公募地方債	793,900,000	818,026,621	
127回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	512,885,000	
128回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	307,641,000	
137回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	512,755,000	
139回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	512,650,000	
142回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	508,015,000	
144回 共同発行市場公募地方債	400,000,000	409,340,000	
146回 共同発行市場公募地方債	400,000,000	411,480,000	
148回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	514,790,000	

	166回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	504,505,000	
	29年度4回 大阪市公募公債	200,000,000	201,488,000	
	488回 名古屋市公募公債 10年	450,000,000	462,370,500	
	4回 京都市公募公債 20年	100,000,000	116,940,000	
	30年度7回 神戸市公募公債 30年	300,000,000	305,292,000	
	22年度5回 横浜市公募公債	200,000,000	202,906,000	
	23年度4回 横浜市公募公債	450,000,000	459,576,000	
	25年度2回 横浜市公募公債	400,000,000	412,724,000	
	25年度4回 札幌市公募公債	200,000,000	205,604,000	
	第91回 川崎市公募公債	200,000,000	202,298,000	
	17回 北九州市公募公債 20年	100,000,000	119,641,000	
	23年度1回 千葉市公募公債	200,000,000	204,112,000	
地方債証券 合計		20,543,900,000	21,263,886,621	
特殊債券	78回 日本政策投資銀行債券	200,000,000	201,848,000	
	19回 高速道路機構債	150,000,000	235,900,500	
	26回 高速道路機構債	200,000,000	284,928,000	
	96回 高速道路機構債	700,000,000	715,638,000	
	116回 高速道路機構債	100,000,000	102,661,000	
	172回 高速道路機構債	200,000,000	201,530,000	
	9回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	102,838,000	
	18回政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	312,705,000	
	121回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	595,825,000	
	149回政保日本高速道路保有・債務返済機構	400,000,000	408,936,000	
	180回政保日本高速道路保有・債務返済機構	1,000,000,000	1,024,890,000	
	189回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	510,175,000	
	193回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	516,975,000	
	195回政保日本高速道路保有・債務返済機構	330,000,000	341,820,600	
	239回政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	346,350,000	
	241回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	512,705,000	
	260回政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	246,726,000	
	309回政保日本高速道路保有・債務返済機構	800,000,000	809,320,000	
	319回政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	214,408,000	
	28回 日本道路・機構承継債	400,000,000	549,468,000	

1回 地方公共団体金融機構債券 20年	200,000,000	236,240,000	
20回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	304,788,000	
24回 地方公共団体金融機構債券	300,000,000	305,778,000	
19回 地方公共団体金融機構債券	200,000,000	241,804,000	
36回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	307,377,000	
24回 地方公共団体金融機構債券20年	200,000,000	240,224,000	
44回 政保地方公共団体金融機構債券	400,000,000	411,444,000	
50回 政保地方公共団体金融機構債券	500,000,000	517,695,000	
56回 政保地方公共団体金融機構債券	542,000,000	560,005,240	
64回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	308,481,000	
44回 地方公共団体金融機構債券 20年	200,000,000	233,634,000	
83回 地方公共団体金融機構債券 10年	400,000,000	400,624,000	
15回 日本政策金融公庫債券	200,000,000	239,696,000	
109回 都市再生機構債券	200,000,000	217,380,000	
39回 住宅金融支援機構債券	200,000,000	240,632,000	
75回 住宅金融支援機構債券	350,000,000	428,627,500	
222回 住宅金融支援機構債券	300,000,000	302,751,000	
230回 住宅金融支援機構債券	300,000,000	304,206,000	
6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	39,417,000	41,059,112	
8回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	27,630,000	28,887,165	
9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	41,373,000	43,327,046	
2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	44,112,000	46,606,533	
13回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	14,144,000	14,464,078	
14回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	71,320,000	72,702,181	
43回貸付債権担保住宅金融公庫債券	14,598,000	15,391,985	
44回貸付債権担保住宅金融公庫債券	56,092,000	59,050,292	
51回貸付債権担保住宅金融公庫債券	41,637,000	43,733,839	

	1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	69,805,000	72,694,927	
	2 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	147,560,000	160,380,012	
	3 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	253,032,000	270,205,281	
	1 1 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	262,665,000	266,150,564	
	1 2 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	276,525,000	282,061,030	
	1 2 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	277,098,000	282,748,028	
	1 3 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	281,412,000	286,699,731	
	1 3 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	281,142,000	286,337,504	
	1 3 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	288,429,000	295,440,708	
	い第 8 2 8 号 利付商工債	100,000,000	100,294,000	
	3 2 5 回 利附信金中金債	400,000,000	399,992,000	
	2 2 0 号 利附商工債(3年)	300,000,000	300,369,000	
	1 5 回 国際協力機構債	100,000,000	120,033,000	
	5 5 回 鉄道建設運輸施設債	500,000,000	513,755,000	
特殊債券 合計		16,859,991,000	18,039,416,856	
社債券	1 回 B P C E S A 円貨社債(ソーシャルボンド)	200,000,000	200,302,000	
	6 回 クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	200,000,000	206,318,000	
	3 3 7 回 東京交通債	200,000,000	206,284,000	
	3 4 回 西日本高速道路債券	200,000,000	203,342,000	
	1 9 回 三菱ケミカルホールディングス社債	100,000,000	101,196,000	
	6 回 J X ホールディングス社債	100,000,000	103,806,000	
	1 4 回 プリヂストン社債	200,000,000	202,616,000	
	2 3 回 ジェイ エフ イーホールディングス社債	100,000,000	99,928,000	
	1 3 回 パナソニック社債	100,000,000	101,107,000	
	1 4 回 トヨタ自動車社債	200,000,000	206,050,000	
	1 6 回 トヨタ自動車社債	200,000,000	204,762,000	
	9 4 回 丸紅社債	100,000,000	103,176,000	
	4 5 回 住友商事社債	100,000,000	102,554,000	
	4 7 回 住友商事社債	100,000,000	102,937,000	
	4 8 回 クレディセゾン社債	100,000,000	103,487,000	
	5 7 回 東京三菱銀行社債	200,000,000	212,964,000	
	2 5 回 三菱東京UFJ銀行劣後社債	200,000,000	202,600,000	
	2 8 回 三菱東京UFJ銀行劣後社債	200,000,000	203,684,000	
	3 2 回 三菱東京UFJ銀行劣後社債	300,000,000	307,458,000	

9回 三菱UFJ信託銀行劣後債	100,000,000	102,417,000	
12回 住友信託銀行劣後債	100,000,000	101,390,000	
10回 三井住友信託銀行社債	200,000,000	204,420,000	
10回 セブン銀行社債	100,000,000	102,339,000	
23回 三井住友銀行劣後社債	400,000,000	407,084,000	
47回 日立キャピタル社債	200,000,000	205,164,000	
56回 三菱UFJリース社債	200,000,000	203,350,000	
72回 三菱地所社債	100,000,000	110,570,000	
108回 住友不動産社債	200,000,000	202,490,000	
80回 東京急行電鉄社債	100,000,000	108,920,000	
43回 京浜急行電鉄社債	100,000,000	101,549,000	
19回 東日本旅客鉄道社債	100,000,000	105,456,000	
21回 東日本旅客鉄道社債	100,000,000	105,724,000	
39回 東日本旅客鉄道社債	300,000,000	333,015,000	
42回 東日本旅客鉄道社債	200,000,000	223,678,000	
9回 西日本旅客鉄道社債	200,000,000	210,846,000	
10回 西日本旅客鉄道社債	300,000,000	323,046,000	
6回 東海旅客鉄道社債	100,000,000	105,463,000	
11回 東海旅客鉄道社債	300,000,000	310,320,000	
13回 東海旅客鉄道社債	200,000,000	216,124,000	
14回 東海旅客鉄道社債	100,000,000	109,323,000	
4回 東京地下鉄社債	120,000,000	138,048,000	
60回 日本電信電話社債	300,000,000	304,464,000	
518回 中部電力社債	200,000,000	200,640,000	
377回 中国電力社債	400,000,000	415,504,000	
379回 中国電力社債	300,000,000	302,199,000	
301回 北陸電力社債	100,000,000	103,634,000	
307回 北陸電力社債	100,000,000	105,652,000	
471回 東北電力社債	400,000,000	417,356,000	
473回 東北電力社債	300,000,000	302,454,000	
253回 四国電力社債	200,000,000	206,558,000	
424回 九州電力社債	200,000,000	208,952,000	
426回 九州電力社債	400,000,000	415,860,000	
320回 北海道電力社債	200,000,000	202,130,000	
321回 北海道電力社債	161,000,000	166,636,610	
340回 北海道電力社債	300,000,000	304,176,000	
13回 電源開発社債	200,000,000	221,028,000	
38回 電源開発社債	300,000,000	310,977,000	
23回 東京瓦斯社債	300,000,000	310,023,000	
18回 大阪ガス社債	100,000,000	104,460,000	
27回 NTTデータ社債	100,000,000	102,867,000	
7回 ファーストリテイリング社債	200,000,000	203,252,000	
社債券 合計	11,681,000,000	12,114,129,610	
合計		246,971,178,187	

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。

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

令和1年10月11日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,951,899,294
株式	231,448,218,280
派生商品評価勘定	23,188,808
未収入金	9,997,987,960
未収配当金	2,439,838,281
前払金	30,230,600
流動資産合計	246,891,363,223
資産合計	
246,891,363,223	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	4,696,748
未払解約金	10,025,578,000
流動負債合計	10,030,274,748
負債合計	
10,030,274,748	
純資産の部	
元本等	
元本	93,946,912,393
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	142,914,176,082
元本等合計	236,861,088,475
純資産合計	
236,861,088,475	
負債純資産合計	
246,891,363,223	

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自 平成31年4月12日 至 令和1年10月11日
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	令和1年10月11日現在
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	109,661,282,654円
同期中追加設定元本額	18,605,004,517円
同期中一部解約元本額	34,319,374,778円
元本の内訳 ファンド名	

One DC 国内株式インデックスファンド	13,557,024,449円
DIAM国内株式パッシブ・ファンド	2,907,412,024円
MITO ラップ型ファンド(安定型)	2,923,070円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	7,011,566円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	11,662,546円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	30,491,294円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	22,803,267円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	14,711,100円
たわらノーロード TOPIX	537,049,825円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	240,222,723円
たわらノーロード バランス(堅実型)	7,091,978円
たわらノーロード バランス(標準型)	47,672,259円
たわらノーロード バランス(積極型)	76,484,977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)	438,068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)	39,137,192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)	97,724,447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)	70,908,853円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(積極型)	140,992,928円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	352,478円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	1,054,256円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	2,161,270円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	1,256,355円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	3,400,196円
DIAM国内株式インデックスファンド<DC年金>	37,441,844,356円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	1,035,937,400円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	3,334,145,511円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	3,399,701,439円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	367,688,702円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	1,240,067,107円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	1,152,250,150円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	40,899,436円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	1,127,773,245円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	26,814,455円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	316,883,519円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	229,450,582円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	392,389,471円
投資のソムリエ	2,253,192,354円
クルーズコントロール	183,258,980円
投資のソムリエ<DC年金>	236,319,307円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	261,778,974円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	306,953,668円
クルーズコントロール<DC年金>	417,582円
DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)	1,881,574円
DIAMコア資産設計ファンド(積極型)	6,139,573円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	119,510,094円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	1,377,177,309円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2045)	4,395,592円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2055)	3,433,623円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	867,180円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2035)	6,304,861円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	27,070,772円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	898,053,980円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	195,612,909円

投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	615,596円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	555,722円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	550,785円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	121,536円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	65,596,476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)	821,382,965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)	99,656,550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)	220,980,887円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	13,564,100円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	55,327,507円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	16,130,522円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	13,693,734円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	30,592,543円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	60,954,248円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	928,360,099円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	908,046,908円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	2,566,450,536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)	181,937,751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)	50,670,052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)	500,896,885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)	164,780,731円
DIAM世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	3,305,256円
DIAM世界バランスファンド35VA(適格機関投資家限定)	39,525,205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)	595,723,087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)	48,941,236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)	163,534,372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)	415,736,335円
DIAMバランス30VA(適格機関投資家限定)	1,274,638円
DIAMバランス50VA(適格機関投資家限定)	120,337円
DIAMバランス70VA(適格機関投資家限定)	194,614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)	8,454,465,785円
DIAM世界バランス25VA(適格機関投資家限定)	62,527,230円
DIAM国内バランス30VA(適格機関投資家限定)	25,254,604円
DIAMバランス20VA(適格機関投資家限定)	25,841,335円
DIAMバランス40VA(適格機関投資家限定)	108,794円
DIAMバランス60VA(適格機関投資家限定)	122,869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
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)	1,335,152,689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)	1,766,916,070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
計	93,946,912,393円

2. 受益権の総数	93,946,912,393口
3. 差入代用有価証券 株式	3,634,500,000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31年4月12日 至 令和1年10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。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。</p> <p>また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。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。</p>
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。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	令和1年10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。
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。
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。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	令和1年10月11日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	
株式	4,238,783,774	
合計	4,238,783,774	

(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31年2月8日から令和1年10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	令和1年10月11日現在			
	契約額等(円)	うち		評価損益(円)
		1年超	時価(円)	
市場取引 先物取引 買建	6,700,530,600	-	6,719,160,000	18,629,400
合計	6,700,530,600	-	6,719,160,000	18,629,400

(注) 時価の算定方法

株価指数先物取引

1. 原則として計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。
2. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。
3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

令和1年10月11日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.5212円 (25,212円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

令和1年10月11日現在

銘柄	株式数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
極洋	4,500	2,842.00	12,789,000	
日本水産	137,700	612.00	84,272,400	
マルハニチロ	19,900	2,755.00	54,824,500	
ハウスイ	900	855.00	769,500	
カネコ種苗	4,300	1,305.00	5,611,500	
サカタのタネ	16,400	3,510.00	57,564,000	
ホクト	11,500	1,948.00	22,402,000	
ホクリヨウ	1,900	678.00	1,288,200	
ヒノキヤグループ	3,400	1,986.00	6,752,400	
ショーボンドホールディングス	19,700	3,910.00	77,027,000	
ミライト・ホールディングス	38,700	1,625.00	62,887,500	
タマホーム	6,700	1,493.00	10,003,100	
サンヨーホームズ	2,200	646.00	1,421,200	
日本アクア	4,000	640.00	2,560,000	
ファーストコーポレーション	4,500	638.00	2,871,000	
ベステラ	2,700	1,206.00	3,256,200	
TATERU	18,900	188.00	3,553,200	
スペースバリューホールディングス	17,000	503.00	8,551,000	
住石ホールディングス	31,300	135.00	4,225,500	
日鉄鉱業	3,200	4,140.00	13,248,000	
三井松島ホールディングス	5,900	1,219.00	7,192,100	
国際石油開発帝石	552,300	950.50	524,961,150	
石油資源開発	19,800	2,644.00	52,351,200	
K&Oエナジーグループ	6,700	1,468.00	9,835,600	
ダイセキ環境ソリューション	3,000	762.00	2,286,000	
第一カッター興業	1,800	1,738.00	3,128,400	
安藤・間	88,300	787.00	69,492,100	
東急建設	40,300	829.00	33,408,700	
コムシスホールディングス	48,800	3,075.00	150,060,000	
ミサワホーム	10,800	1,124.00	12,139,200	

ビーアールホールディングス	12,800	416.00	5,324,800
高松コンストラクショングループ	8,600	2,482.00	21,345,200
東建コーポレーション	4,200	6,660.00	27,972,000
ソネック	1,700	829.00	1,409,300
ヤマウラ	5,500	873.00	4,801,500
大成建設	113,100	4,075.00	460,882,500
大林組	340,400	1,046.00	356,058,400
清水建設	347,400	988.00	343,231,200
飛島建設	9,800	1,208.00	11,838,400
長谷工コーポレーション	142,000	1,272.00	180,624,000
松井建設	12,500	770.00	9,625,000
銭高組	1,400	3,880.00	5,432,000
鹿島建設	266,100	1,411.00	375,467,100
不動テトラ	7,900	1,310.00	10,349,000
大末建設	4,100	937.00	3,841,700
鉄建建設	6,900	2,757.00	19,023,300
西松建設	24,500	2,050.00	50,225,000
三井住友建設	82,100	571.00	46,879,100
大豊建設	7,700	2,900.00	22,330,000
前田建設工業	79,600	946.00	75,301,600
佐田建設	7,500	404.00	3,030,000
ナカノフドー建設	8,800	477.00	4,197,600
奥村組	18,700	2,919.00	54,585,300
東鉄工業	13,600	3,215.00	43,724,000
イチケン	2,100	1,675.00	3,517,500
富士ピー・エス	4,200	512.00	2,150,400
浅沼組	3,800	3,845.00	14,611,000
戸田建設	131,800	625.00	82,375,000
熊谷組	16,200	3,020.00	48,924,000
北野建設	2,400	2,357.00	5,656,800
植木組	1,400	2,538.00	3,553,200
矢作建設工業	15,400	719.00	11,072,600
ピーエス三菱	12,100	740.00	8,954,000
日本ハウスホールディングス	21,800	509.00	11,096,200
大東建託	40,500	13,600.00	550,800,000
新日本建設	13,700	795.00	10,891,500
N I P P O	30,000	2,112.00	63,360,000
東亜道路工業	2,100	3,370.00	7,077,000
前田道路	33,600	2,368.00	79,564,800
日本道路	3,100	6,580.00	20,398,000
東亜建設工業	10,000	1,348.00	13,480,000
日本国土開発	18,600	563.00	10,471,800
若築建設	5,800	1,590.00	9,222,000
東洋建設	41,600	464.00	19,302,400
五洋建設	135,100	595.00	80,384,500
世紀東急工業	16,600	729.00	12,101,400
福田組	3,700	4,190.00	15,503,000
日本ドライケミカル	2,800	1,123.00	3,144,400
住友林業	80,400	1,479.00	118,911,600
日本基礎技術	11,800	352.00	4,153,600

巴コーポレーション	14,300	413.00	5,905,900
大和ハウス工業	314,500	3,523.00	1,107,983,500
ライト工業	21,800	1,487.00	32,416,600
積水ハウス	347,700	2,203.50	766,156,950
日特建設	9,700	665.00	6,450,500
北陸電気工事	5,600	905.00	5,068,000
ユアテック	18,000	678.00	12,204,000
四電工	1,700	2,776.00	4,719,200
中電工	14,500	2,400.00	34,800,000
関電工	51,500	1,005.00	51,757,500
きんでん	75,300	1,593.00	119,952,900
東京エネシス	11,600	918.00	10,648,800
トーエネック	3,200	3,445.00	11,024,000
住友電設	7,800	2,159.00	16,840,200
日本電設工業	19,300	2,243.00	43,289,900
協和エクシオ	44,500	2,576.00	114,632,000
新日本空調	9,200	1,962.00	18,050,400
日本工営	6,500	3,225.00	20,962,500
九電工	22,300	3,500.00	78,050,000
三機工業	24,800	1,289.00	31,967,200
日揮ホールディングス	97,900	1,438.00	140,780,200
中外炉工業	3,200	1,522.00	4,870,400
ヤマト	10,300	711.00	7,323,300
太平電業	7,700	2,504.00	19,280,800
高砂熱学工業	27,500	1,800.00	49,500,000
三晃金属工業	1,400	2,435.00	3,409,000
NEC ネットエスアイ	11,000	3,080.00	33,880,000
朝日工業社	2,400	3,025.00	7,260,000
明星工業	20,500	784.00	16,072,000
大気社	15,400	3,210.00	49,434,000
ダイダン	7,600	2,241.00	17,031,600
日比谷総合設備	10,200	1,868.00	19,053,600
東芝プラントシステム	24,500	1,945.00	47,652,500
日本製粉	32,000	1,719.00	55,008,000
日清製粉グループ本社	115,000	2,008.00	230,920,000
日東富士製粉	700	6,450.00	4,515,000
昭和産業	9,300	3,145.00	29,248,500
鳥越製粉	9,100	890.00	8,099,000
中部飼料	12,400	1,170.00	14,508,000
フィード・ワン	68,800	164.00	11,283,200
東洋精糖	1,700	1,067.00	1,813,900
日本甜菜製糖	5,800	1,936.00	11,228,800
三井製糖	8,000	2,280.00	18,240,000
塩水港精糖	11,300	206.00	2,327,800
日新製糖	4,700	1,935.00	9,094,500
LIFULL	34,000	684.00	23,256,000
ジェイエイシーリクルートメント	6,600	1,999.00	13,193,400
日本M&Aセンター	73,200	2,998.00	219,453,600
メンバーズ	3,400	1,767.00	6,007,800
中広	1,100	550.00	605,000

タケエイ	10,200	1,041.00	10,618,200
E・Jホールディングス	1,300	1,343.00	1,745,900
トラスト・テック	10,700	1,250.00	13,375,000
コシダカホールディングス	23,400	1,553.00	36,340,200
アルトナー	2,000	727.00	1,454,000
パソナグループ	11,900	1,552.00	18,468,800
CDS	2,500	1,338.00	3,345,000
リンクアンドモチベーション	19,800	539.00	10,672,200
GCA	10,900	819.00	8,927,100
エス・エム・エス	35,700	2,620.00	93,534,000
パーソルホールディングス	96,900	2,007.00	194,478,300
リニカル	5,600	968.00	5,420,800
クックパッド	34,000	300.00	10,200,000
エスクリ	2,800	853.00	2,388,400
アイ・ケイ・ケイ	4,700	688.00	3,233,600
森永製菓	25,600	5,250.00	134,400,000
中村屋	2,700	4,540.00	12,258,000
江崎グリコ	30,200	4,570.00	138,014,000
名糖産業	4,900	1,234.00	6,046,600
井村屋グループ	4,300	2,014.00	8,660,200
不二家	5,600	2,065.00	11,564,000
山崎製パン	76,300	1,918.00	146,343,400
第一屋製パン	1,800	975.00	1,755,000
モロゾフ	1,800	4,905.00	8,829,000
亀田製菓	6,300	4,815.00	30,334,500
寿スピリッツ	10,800	7,270.00	78,516,000
カルビー	46,400	3,325.00	154,280,000
森永乳業	20,400	4,240.00	86,496,000
六甲バター	6,800	1,766.00	12,008,800
ヤクルト本社	75,400	5,860.00	441,844,000
明治ホールディングス	72,100	7,770.00	560,217,000
雪印メグミルク	24,500	2,591.00	63,479,500
プリマハム	14,300	2,417.00	34,563,100
日本ハム	42,100	4,580.00	192,818,000
林兼産業	3,600	601.00	2,163,600
丸大食品	10,800	2,277.00	24,591,600
S Foods	9,100	3,050.00	27,755,000
伊藤ハム米久ホールディングス	65,300	689.00	44,991,700
学情	3,500	1,431.00	5,008,500
スタジオアリス	4,900	1,891.00	9,265,900
クロスキャット	2,700	984.00	2,656,800
シミックホールディングス	5,400	1,704.00	9,201,600
システナ	35,500	1,556.00	55,238,000
NJS	2,300	1,644.00	3,781,200
デジタルアーツ	5,400	6,720.00	36,288,000
日鉄ソリューションズ	14,900	3,605.00	53,714,500
総合警備保障	38,500	5,570.00	214,445,000
キューブシステム	5,500	766.00	4,213,000
いちご	127,200	415.00	52,788,000
エイジア	2,100	1,195.00	2,509,500

日本駐車場開発	110,400	162.00	17,884,800
コア	4,300	1,328.00	5,710,400
カカクコム	72,600	2,401.00	174,312,600
アイロムグループ	3,900	1,585.00	6,181,500
セントケア・ホールディング	6,000	503.00	3,018,000
サイネックス	1,800	626.00	1,126,800
ルネサンス	5,400	1,639.00	8,850,600
ディップ	15,700	2,500.00	39,250,000
SBSホールディングス	8,800	1,749.00	15,391,200
オプトホールディング	5,400	1,529.00	8,256,600
新日本科学	13,300	615.00	8,179,500
ツクイ	23,000	420.00	9,660,000
キャリアデザインセンター	2,600	1,300.00	3,380,000
ベネフィット・ワン	26,600	2,063.00	54,875,800
エムスリー	204,100	2,637.00	538,211,700
ツカダ・グローバルホールディング	5,900	595.00	3,510,500
プラス	800	642.00	513,600
アウトソーシング	55,500	1,035.00	57,442,500
ウェルネット	9,500	705.00	6,697,500
ワールドホールディングス	3,100	1,642.00	5,090,200
ディー・エヌ・エー	52,300	1,959.00	102,455,700
博報堂DYホールディングス	134,700	1,544.00	207,976,800
ぐるなび	13,900	700.00	9,730,000
タカミヤ	10,500	657.00	6,898,500
ジャパンベストレスキューシステム	6,700	1,073.00	7,189,100
ファンコミュニケーションズ	26,900	506.00	13,611,400
ライク	3,900	1,581.00	6,165,900
ビジネス・ブレークスルー	4,700	366.00	1,720,200
エスプール	18,800	557.00	10,471,600
WDBホールディングス	4,500	2,808.00	12,636,000
ティア	5,200	591.00	3,073,200
CDG	1,000	1,364.00	1,364,000
パリュウ・コマース	5,500	1,532.00	8,426,000
インフォマート	53,100	1,550.00	82,305,000
サッポロホールディングス	34,700	2,756.00	95,633,200
アサヒグループホールディングス	213,100	5,480.00	1,167,788,000
麒麟ホールディングス	431,500	2,282.00	984,683,000
宝ホールディングス	76,200	1,068.00	81,381,600
オエノンホールディングス	26,900	375.00	10,087,500
養命酒製造	3,100	1,913.00	5,930,300
コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールディングス	71,400	2,475.00	176,715,000
サントリー食品インターナショナル	68,100	4,630.00	315,303,000
ダイドーグループホールディングス	5,700	4,430.00	25,251,000
伊藤園	30,900	5,170.00	159,753,000
キーコーヒー	10,000	2,220.00	22,200,000
ユニカフェ	2,700	1,008.00	2,721,600
ジャパンフーズ	1,500	1,200.00	1,800,000
日清オイリオグループ	13,100	3,540.00	46,374,000
不二製油グループ本社	24,800	3,195.00	79,236,000

かどや製油	1,100	3,645.00	4,009,500
J-オイルミルズ	5,200	4,280.00	22,256,000
ローソン	25,300	5,860.00	148,258,000
サンエー	7,600	5,080.00	38,608,000
カワチ薬品	7,700	2,111.00	16,254,700
エービーシー・マート	15,600	7,250.00	113,100,000
ハードオフコーポレーション	4,200	751.00	3,154,200
高千穂交易	3,900	1,106.00	4,313,400
アスクル	10,500	2,855.00	29,977,500
ゲオホールディングス	15,200	1,306.00	19,851,200
アダストリア	13,900	2,520.00	35,028,000
ジーフット	5,900	616.00	3,634,400
シー・ヴィ・エス・バイエリア	1,500	675.00	1,012,500
伊藤忠食品	2,400	4,495.00	10,788,000
くら寿司	5,200	4,445.00	23,114,000
キャンドウ	4,800	1,625.00	7,800,000
エレマテック	9,300	1,007.00	9,365,100
パルグループホールディングス	5,100	3,460.00	17,646,000
JALUX	2,900	2,402.00	6,965,800
エディオン	42,200	1,038.00	43,803,600
あらた	7,400	3,945.00	29,193,000
サーラコーポレーション	20,100	609.00	12,240,900
ワッツ	3,900	614.00	2,394,600
トーメンデバイス	1,500	2,316.00	3,474,000
ハローズ	3,800	2,348.00	8,922,400
J Pホールディングス	28,000	281.00	7,868,000
フジオフードシステム	4,200	2,988.00	12,549,600
あみやき亭	2,100	3,410.00	7,161,000
東京エレクトロン デバイス	3,600	2,015.00	7,254,000
ひらまつ	20,100	326.00	6,552,600
フィールズ	8,800	507.00	4,461,600
双日	550,900	330.00	181,797,000
アルフレッサ ホールディングス	110,900	2,383.00	264,274,700
大黒天物産	2,400	3,505.00	8,412,000
ハニーズホールディングス	8,800	1,361.00	11,976,800
ファーマライズホールディングス	2,300	584.00	1,343,200
キッコーマン	67,100	5,030.00	337,513,000
味の素	224,700	2,000.00	449,400,000
キュービー	56,600	2,407.00	136,236,200
ハウス食品グループ本社	38,000	4,100.00	155,800,000
カゴメ	38,600	2,801.00	108,118,600
焼津水産化学工業	5,000	1,034.00	5,170,000
アリアケジャパン	9,300	8,450.00	78,585,000
ピエトロ	1,400	1,607.00	2,249,800
エバラ食品工業	2,500	2,110.00	5,275,000
ニチレイ	52,900	2,459.00	130,081,100
横浜冷凍	27,900	1,054.00	29,406,600
東洋水産	52,300	4,345.00	227,243,500
イートアンド	3,600	1,703.00	6,130,800
大冷	1,200	1,974.00	2,368,800

ヨシムラ・フード・ホールディングス	2,900	973.00	2,821,700
日清食品ホールディングス	43,200	8,080.00	349,056,000
永谷園ホールディングス	5,400	2,055.00	11,097,000
一正蒲鉾	4,000	1,052.00	4,208,000
フジッコ	11,000	1,965.00	21,615,000
ロック・フィールド	11,000	1,490.00	16,390,000
日本たばこ産業	587,300	2,369.50	1,391,607,350
ケンコーマヨネーズ	5,700	2,450.00	13,965,000
わらべや日洋ホールディングス	6,700	1,887.00	12,642,900
なとり	5,700	1,636.00	9,325,200
イフジ産業	2,000	734.00	1,468,000
ピククルスコーポレーション	2,500	2,751.00	6,877,500
北の達人コーポレーション	40,100	755.00	30,275,500
ユーグレナ	43,500	842.00	36,627,000
スター・マイカ・ホールディングス	4,800	1,875.00	9,000,000
片倉工業	14,500	1,350.00	19,575,000
グンゼ	6,700	4,610.00	30,887,000
ヒューリック	213,600	1,108.00	236,668,800
神栄	1,500	724.00	1,086,000
ラサ商事	5,500	838.00	4,609,000
アルペン	7,600	1,705.00	12,958,000
ハブ	3,300	1,193.00	3,936,900
ラクーンホールディングス	5,100	717.00	3,656,700
クオールホールディングス	14,700	1,446.00	21,256,200
アルコニックス	10,700	1,294.00	13,845,800
神戸物産	17,300	5,800.00	100,340,000
ソリトンシステムズ	4,400	938.00	4,127,200
ジーンズホールディングス	5,300	6,190.00	32,807,000
ビックカメラ	59,200	1,160.00	68,672,000
DCMホールディングス	53,600	1,065.00	57,084,000
ペッパーフードサービス	8,000	1,618.00	12,944,000
MonotaRO	71,000	2,770.00	196,670,000
東京一番フーズ	2,600	610.00	1,586,000
DDホールディングス	4,500	1,515.00	6,817,500
あいホールディングス	14,300	1,825.00	26,097,500
ディービーエックス	4,000	851.00	3,404,000
きちりホールディングス	2,800	782.00	2,189,600
アークランドサービスホールディングス	7,300	1,908.00	13,928,400
J.フロントリテイリング	127,600	1,320.00	168,432,000
ドトール・日レスホールディングス	17,500	2,105.00	36,837,500
マツモトキヨシホールディングス	41,300	3,880.00	160,244,000
broncoビリー	5,300	2,419.00	12,820,700
ZOZO	108,000	2,504.00	270,432,000
トレジャー・ファクトリー	3,100	1,166.00	3,614,600
物語コーポレーション	2,500	9,950.00	24,875,000
ココカラファイン	11,200	6,000.00	67,200,000
三越伊勢丹ホールディングス	186,800	861.00	160,834,800
東洋紡	42,000	1,398.00	58,716,000
ユニチカ	29,700	324.00	9,622,800

富士紡ホールディングス	5,200	3,110.00	16,172,000
日清紡ホールディングス	67,300	845.00	56,868,500
倉敷紡績	9,400	2,380.00	22,372,000
ダイワボウホールディングス	9,100	4,455.00	40,540,500
シキボウ	5,100	927.00	4,727,700
日東紡績	15,100	3,225.00	48,697,500
トヨタ紡織	35,400	1,493.00	52,852,200
マクニカ・富士エレホールディングス	27,700	1,461.00	40,469,700
Hamee	3,200	1,185.00	3,792,000
ラクト・ジャパン	3,700	3,700.00	13,690,000
ウエルシアホールディングス	26,400	5,980.00	157,872,000
クリエイトSDホールディングス	14,700	2,647.00	38,910,900
バイタルケーエスケー・ホールディングス	18,600	1,053.00	19,585,800
八洲電機	7,900	841.00	6,643,900
メディアスホールディングス	5,800	738.00	4,280,400
レスターホールディングス	11,000	1,784.00	19,624,000
ジューテックホールディングス	2,300	985.00	2,265,500
丸善CHIホールディングス	11,200	368.00	4,121,600
大光	3,100	663.00	2,055,300
OCHIホールディングス	3,000	1,284.00	3,852,000
TOKAIホールディングス	52,700	1,048.00	55,229,600
黒谷	1,900	439.00	834,100
ミサワ	2,100	683.00	1,434,300
ティーライフ	1,500	825.00	1,237,500
Cominix	1,900	832.00	1,580,800
エー・ピーカンパニー	2,100	540.00	1,134,000
三洋貿易	5,100	2,104.00	10,730,400
チムニー	3,000	2,363.00	7,089,000
シュッピン	6,900	1,014.00	6,996,600
ビューティガレージ	1,700	1,706.00	2,900,200
ウイン・パートナーズ	6,500	1,183.00	7,689,500
ネクステージ	14,300	1,040.00	14,872,000
ジョイフル本田	29,300	1,394.00	40,844,200
鳥貴族	3,300	2,199.00	7,256,700
キリン堂ホールディングス	4,000	2,110.00	8,440,000
ホットランド	5,700	1,174.00	6,691,800
すかいらーくホールディングス	111,900	1,908.00	213,505,200
SFPホールディングス	4,300	2,154.00	9,262,200
綿半ホールディングス	3,800	1,990.00	7,562,000
日本毛織	32,500	1,000.00	32,500,000
ダイトウボウ	18,600	81.00	1,506,600
トーア紡コーポレーション	4,100	531.00	2,177,100
ダイドーリミテッド	12,200	272.00	3,318,400
ヨシックス	1,600	3,005.00	4,808,000
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	28,900	930.00	26,877,000
三栄建築設計	4,100	1,574.00	6,453,400
野村不動産ホールディングス	66,700	2,452.00	163,548,400
三重交通グループホールディングス	20,200	565.00	11,413,000

サムティ	14,200	1,990.00	28,258,000
ディア・ライフ	13,200	502.00	6,626,400
コーセーアールイー	3,200	717.00	2,294,400
エー・ディー・ワークス	180,500	31.00	5,595,500
日本商業開発	6,500	1,460.00	9,490,000
プレサンスコーポレーション	16,000	1,755.00	28,080,000
ユニゾホールディングス	15,100	4,700.00	70,970,000
THEグローバル社	5,300	464.00	2,459,200
日本管理センター	6,700	1,448.00	9,701,600
サンセイランディック	3,200	851.00	2,723,200
エストラスト	1,500	825.00	1,237,500
フージャースホールディングス	21,900	641.00	14,037,900
オープンハウス	29,100	2,741.00	79,763,100
東急不動産ホールディングス	269,100	713.00	191,868,300
飯田グループホールディングス	83,300	1,726.00	143,775,800
イーグランド	1,500	711.00	1,066,500
ムゲンエステート	7,200	652.00	4,694,400
帝国繊維	11,200	1,849.00	20,708,800
日本コークス工業	85,500	83.00	7,096,500
ゴルフダイジェスト・オンライン	4,500	664.00	2,988,000
ミタチ産業	3,000	711.00	2,133,000
B E E N O S	2,800	1,196.00	3,348,800
あさひ	8,300	1,176.00	9,760,800
日本調剤	3,500	3,790.00	13,265,000
コスモス薬品	4,400	22,470.00	98,868,000
シップヘルスケアホールディングス	20,800	4,610.00	95,888,000
トーエル	5,000	772.00	3,860,000
ソフトクリエイトホールディングス	4,400	1,637.00	7,202,800
オンリー	1,900	790.00	1,501,000
セブン&アイ・ホールディングス	418,400	4,367.00	1,827,152,800
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	26,900	1,819.00	48,931,100
明治電機工業	3,200	1,344.00	4,300,800
ツルハホールディングス	21,700	11,910.00	258,447,000
デリカフーズホールディングス	3,700	703.00	2,601,100
スターティアホールディングス	2,100	561.00	1,178,100
サンマルクホールディングス	7,900	2,471.00	19,520,900
フェリシモ	2,300	1,032.00	2,373,600
トリドールホールディングス	12,400	2,423.00	30,045,200
帝人	80,800	2,102.00	169,841,600
東レ	770,100	823.10	633,869,310
クラレ	156,300	1,312.00	205,065,600
旭化成	706,200	1,144.50	808,245,900
サカイオーベックス	2,500	1,813.00	4,532,500
T O K Y O B A S E	9,100	748.00	6,806,800
稲葉製作所	5,600	1,413.00	7,912,800
宮地エンジニアリンググループ	3,100	1,735.00	5,378,500
トーカロ	26,000	936.00	24,336,000
アルファ	3,600	1,217.00	4,381,200
S U M C O	120,100	1,612.00	193,601,200

川田テクノロジーズ	2,200	6,730.00	14,806,000
RS Technologies	2,300	3,790.00	8,717,000
信和	5,500	962.00	5,291,000
ビーロット	1,800	1,823.00	3,281,400
ファーストブラザーズ	2,400	1,171.00	2,810,400
ハウズドゥ	4,400	1,831.00	8,056,400
シーアールイー	2,600	1,040.00	2,704,000
プロパティエージェント	1,100	1,000.00	1,100,000
ケイアイスター不動産	2,800	1,899.00	5,317,200
アグレ都市デザイン	1,500	441.00	661,500
グッドコムアセット	1,900	1,879.00	3,570,100
ジェイ・エス・ビー	1,100	4,665.00	5,131,500
住江織物	2,900	2,843.00	8,244,700
日本フェルト	5,700	471.00	2,684,700
イチカワ	1,500	1,486.00	2,229,000
エコナックホールディングス	19,200	126.00	2,419,200
日東製網	1,300	1,587.00	2,063,100
芦森工業	2,100	1,422.00	2,986,200
アツギ	8,100	813.00	6,585,300
ウイルプラスホールディングス	1,100	747.00	821,700
ジャパンミート	5,100	2,188.00	11,158,800
コメダホールディングス	23,200	2,077.00	48,186,400
サツドラホールディングス	1,500	1,735.00	2,602,500
デファクトスタンダード	700	324.00	226,800
アレンザホールディングス	5,400	788.00	4,255,200
串カツ田中ホールディングス	1,600	2,095.00	3,352,000
パロックジャパンリミテッド	8,100	950.00	7,695,000
クスリのアオキホールディングス	9,900	7,760.00	76,824,000
ダイニック	3,900	734.00	2,862,600
共和レザー	6,200	723.00	4,482,600
力の源ホールディングス	3,300	802.00	2,646,600
スシローグローバルホールディングス	11,000	7,580.00	83,380,000
LIXILピバ	8,500	1,636.00	13,906,000
セーレン	24,400	1,231.00	30,036,400
ソトー	3,800	972.00	3,693,600
東海染工	1,400	1,136.00	1,590,400
小松マテーレ	16,200	798.00	12,927,600
ワコールホールディングス	28,000	2,780.00	77,840,000
ホギメディカル	12,300	3,085.00	37,945,500
レナウン	30,900	113.00	3,491,700
クラウドシアホールディングス	2,800	488.00	1,366,400
TSIホールディングス	36,500	573.00	20,914,500
マツオカコーポレーション	3,200	1,966.00	6,291,200
ワールド	13,000	2,396.00	31,148,000
TIS	33,200	6,560.00	217,792,000
ネオス	4,100	790.00	3,239,000
電算システム	3,800	2,957.00	11,236,600
グリー	69,000	488.00	33,672,000
コーエーテクモホールディングス	20,300	2,350.00	47,705,000
三菱総合研究所	4,300	3,760.00	16,168,000

ボルテージ	2,000	539.00	1,078,000
電算	1,200	2,063.00	2,475,600
A G S	5,800	689.00	3,996,200
ファインデックス	8,500	925.00	7,862,500
ブレインパッド	1,900	6,160.00	11,704,000
K L a b	19,200	982.00	18,854,400
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	13,300	1,052.00	13,991,600
イーブックイニシアティブジャパン	1,700	1,701.00	2,891,700
ネクソン	282,500	1,259.00	355,667,500
アイスタイル	25,700	755.00	19,403,500
エムアップ	3,500	1,903.00	6,660,500
エイチーム	6,900	1,051.00	7,251,900
エニグモ	7,100	973.00	6,908,300
テクノスジャパン	8,900	516.00	4,592,400
e n i s h	4,100	862.00	3,534,200
コロプラ	32,600	1,574.00	51,312,400
オルトプラス	6,700	715.00	4,790,500
ブロードリーフ	49,500	599.00	29,650,500
クロス・マーケティンググループ	3,400	352.00	1,196,800
デジタルハーツホールディングス	4,700	893.00	4,197,100
システム情報	5,200	974.00	5,064,800
メディアドゥホールディングス	3,500	3,580.00	12,530,000
じげん	12,000	549.00	6,588,000
バイキューブ	5,900	409.00	2,413,100
サイバーリンクス	1,700	1,103.00	1,875,100
ディー・エル・イー	7,300	175.00	1,277,500
フィックスターズ	10,600	1,460.00	15,476,000
C A R T A H O L D I N G S	4,900	991.00	4,855,900
オブティム	4,400	2,768.00	12,179,200
セレス	3,400	1,224.00	4,161,600
特種東海製紙	6,300	3,830.00	24,129,000
ティーガイア	7,100	2,227.00	15,811,700
セック	1,700	2,906.00	4,940,200
日本アジアグループ	10,800	341.00	3,682,800
豆蔵ホールディングス	6,900	1,738.00	11,992,200
テクマトリックス	7,100	2,254.00	16,003,400
プロシップ	3,000	1,241.00	3,723,000
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	24,000	2,203.00	52,872,000
GMOペイメントゲートウェイ	16,400	7,590.00	124,476,000
ザッパラス	5,700	358.00	2,040,600
システムリサーチ	2,700	1,763.00	4,760,100
インターネットイニシアティブ	16,200	2,441.00	39,544,200
さくらインターネット	12,200	609.00	7,429,800
ヴィンクス	2,800	1,160.00	3,248,000
GMOクラウド	1,900	2,503.00	4,755,700
S R Aホールディングス	5,300	2,425.00	12,852,500
M I N O R Iソリューションズ	2,000	1,865.00	3,730,000
システムインテグレータ	3,000	748.00	2,244,000

朝日ネット	8,500	669.00	5,686,500
e B A S E	6,100	971.00	5,923,100
アバント	3,300	2,035.00	6,715,500
アドソル日進	3,600	2,277.00	8,197,200
フリービット	6,000	906.00	5,436,000
コムチュア	11,200	1,936.00	21,683,200
サイバーコム	1,800	1,772.00	3,189,600
アステリア	5,600	653.00	3,656,800
アイル	1,800	2,614.00	4,705,200
王子ホールディングス	446,800	543.00	242,612,400
日本製紙	47,500	1,794.00	85,215,000
三菱製紙	16,200	471.00	7,630,200
北越コーポレーション	65,600	539.00	35,358,400
中越パルプ工業	4,200	1,522.00	6,392,400
巴川製紙所	3,400	897.00	3,049,800
大王製紙	48,400	1,417.00	68,582,800
阿波製紙	3,100	402.00	1,246,200
マークライnz	5,000	1,871.00	9,355,000
メディカル・データ・ビジョン	7,600	1,104.00	8,390,400
g u m i	12,900	729.00	9,404,100
ショーケース	2,600	732.00	1,903,200
モバイルファクトリー	2,300	1,620.00	3,726,000
テラスカイ	1,400	1,777.00	2,487,800
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	4,500	1,749.00	7,870,500
P C Iホールディングス	1,900	1,992.00	3,784,800
パイプドHD	1,600	1,883.00	3,012,800
アイビーシー	1,900	1,100.00	2,090,000
ネオジャパン	2,000	977.00	1,954,000
P R T I M E S	700	2,670.00	1,869,000
ランドコンピュータ	1,300	1,036.00	1,346,800
ダブルスタンダード	700	5,300.00	3,710,000
オープンドア	5,000	2,093.00	10,465,000
マイネット	3,400	521.00	1,771,400
アカツキ	3,500	6,630.00	23,205,000
ベネフィットジャパン	600	1,713.00	1,027,800
U b i c o mホールディングス	1,900	1,445.00	2,745,500
L I N E	22,800	3,920.00	89,376,000
カナミックネットワーク	5,100	567.00	2,891,700
ノムラシステムコーポレーション	1,800	590.00	1,062,000
レンゴー	102,300	772.00	78,975,600
トーモク	6,100	1,530.00	9,333,000
ザ・バック	7,500	3,885.00	29,137,500
チェンジ	1,500	1,985.00	2,977,500
シンクロ・フード	4,500	472.00	2,124,000
オークネット	5,700	1,344.00	7,660,800
A O I T Y O H O L D I N G S	10,200	622.00	6,344,400
マクロミル	18,000	854.00	15,372,000
ビーグリー	2,100	932.00	1,957,200
オロ	2,600	2,706.00	7,035,600

サインポスト	1,600	2,083.00	3,332,800	
昭和電工	70,700	2,878.00	203,474,600	
住友化学	780,800	504.00	393,523,200	
住友精化	4,800	3,170.00	15,216,000	
日産化学	60,100	4,200.00	252,420,000	
ラサ工業	3,600	1,315.00	4,734,000	
クレハ	9,200	6,510.00	59,892,000	
多木化学	2,900	4,400.00	12,760,000	
テイカ	8,100	1,941.00	15,722,100	
石原産業	19,100	998.00	19,061,800	
片倉コープアグリ	2,900	1,146.00	3,323,400	
日本曹達	15,600	2,714.00	42,338,400	
東ソー	153,400	1,456.00	223,350,400	
トクヤマ	28,600	2,615.00	74,789,000	
セントラル硝子	21,600	2,393.00	51,688,800	
東亜合成	62,300	1,196.00	74,510,800	
大阪ソーダ	10,900	2,790.00	30,411,000	
関東電化工業	23,700	863.00	20,453,100	
デンカ	39,000	3,015.00	117,585,000	
イビデン	62,100	2,322.00	144,196,200	
信越化学工業	174,900	11,700.00	2,046,330,000	
日本カーバイド工業	3,400	1,263.00	4,294,200	
堺化学工業	6,600	2,555.00	16,863,000	
第一稀元素化学工業	10,800	801.00	8,650,800	
エア・ウォーター	81,200	1,967.00	159,720,400	
大陽日酸	81,800	2,381.00	194,765,800	
日本化学工業	3,400	2,852.00	9,696,800	
東邦アセチレン	1,500	1,307.00	1,960,500	
日本パーカライジング	54,100	1,189.00	64,324,900	
高圧ガス工業	15,700	818.00	12,842,600	
チタン工業	1,300	2,412.00	3,135,600	
四国化成工業	16,700	1,156.00	19,305,200	
戸田工業	2,100	2,100.00	4,410,000	
ステラ ケミファ	5,900	2,674.00	15,776,600	
保土谷化学工業	3,500	3,480.00	12,180,000	
日本触媒	16,700	6,370.00	106,379,000	
大日精化工業	8,200	3,140.00	25,748,000	
カネカ	25,700	3,465.00	89,050,500	
協和キリン	102,000	1,962.00	200,124,000	
三菱瓦斯化学	100,900	1,498.00	151,148,200	
三井化学	90,000	2,452.00	220,680,000	
J S R	99,600	1,769.00	176,192,400	
東京応化工業	17,000	4,240.00	72,080,000	
大阪有機化学工業	9,200	1,071.00	9,853,200	
三菱ケミカルホールディングス	663,300	812.50	538,931,250	
K Hネオケム	17,500	2,395.00	41,912,500	
ダイセル	146,200	930.00	135,966,000	
住友ベークライト	17,200	4,275.00	73,530,000	
積水化学工業	213,300	1,717.00	366,236,100	
日本ゼオン	89,500	1,334.00	119,393,000	

アイカ工業	29,800	3,295.00	98,191,000
宇部興産	50,100	2,233.00	111,873,300
積水樹脂	16,300	2,059.00	33,561,700
タキロンシーアイ	21,400	620.00	13,268,000
旭有機材	6,900	1,308.00	9,025,200
日立化成	45,900	3,520.00	161,568,000
ニチパン	5,300	1,733.00	9,184,900
リケンテクノス	27,000	474.00	12,798,000
大倉工業	4,700	1,715.00	8,060,500
積水化成成品工業	14,800	754.00	11,159,200
群栄化学工業	2,600	2,372.00	6,167,200
タイガースポリマー	5,600	611.00	3,421,600
ミライアル	3,000	1,360.00	4,080,000
ダイキアクシス	3,700	854.00	3,159,800
ダイキョーニシカワ	21,000	800.00	16,800,000
竹本容器	3,700	931.00	3,444,700
森六ホールディングス	5,300	2,357.00	12,492,100
日本化薬	61,400	1,297.00	79,635,800
カーリットホールディングス	10,700	610.00	6,527,000
E P Sホールディングス	14,700	1,242.00	18,257,400
ソルクシーズ	4,300	937.00	4,029,100
レグス	2,500	1,740.00	4,350,000
プレステージ・インターナショナル	36,400	879.00	31,995,600
フェイス	4,100	805.00	3,300,500
プロトコーポレーション	9,000	1,131.00	10,179,000
ハイマックス	1,300	1,823.00	2,369,900
アミューズ	5,900	2,820.00	16,638,000
野村総合研究所	189,800	2,290.00	434,642,000
ドリームインキュベータ	3,000	1,555.00	4,665,000
サイバネットシステム	7,400	695.00	5,143,000
クイック	6,200	1,393.00	8,636,600
T A C	5,800	195.00	1,131,000
C Eホールディングス	6,100	413.00	2,519,300
ケネディクス	92,400	556.00	51,374,400
日本システム技術	1,700	1,208.00	2,053,600
電通	99,900	3,665.00	366,133,500
インテージホールディングス	12,600	923.00	11,629,800
テイクアンドギヴ・ニーズ	3,800	1,201.00	4,563,800
東邦システムサイエンス	3,100	988.00	3,062,800
ぴあ	2,800	4,585.00	12,838,000
イオンファンタジー	3,100	3,270.00	10,137,000
ソースネクスト	38,800	482.00	18,701,600
シーティーエス	11,100	723.00	8,025,300
ネクシィーズグループ	3,300	1,980.00	6,534,000
インフォコム	10,900	2,391.00	26,061,900
メディカルシステムネットワーク	10,700	512.00	5,478,400
日本精化	8,000	1,237.00	9,896,000
扶桑化学工業	10,100	2,488.00	25,128,800
トリケミカル研究所	2,200	6,190.00	13,618,000
ラクスル	5,300	3,525.00	18,682,500

FIG	10,000	314.00	3,140,000
ADEKA	48,900	1,417.00	69,291,300
日油	37,400	3,560.00	133,144,000
ミヨシ油脂	4,000	1,182.00	4,728,000
新日本理化	18,200	192.00	3,494,400
ハリマ化成グループ	8,200	1,240.00	10,168,000
アルテリア・ネットワークス	11,100	1,435.00	15,928,500
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	2,300	1,844.00	4,241,200
花王	242,700	8,267.00	2,006,400,900
第一工業製薬	3,700	3,175.00	11,747,500
石原ケミカル	2,500	1,584.00	3,960,000
日華化学	3,500	876.00	3,066,000
ニイタカ	1,600	1,543.00	2,468,800
三洋化成工業	6,700	4,920.00	32,964,000
武田薬品工業	884,900	3,720.00	3,291,828,000
アステラス製薬	891,600	1,586.00	1,414,077,600
大日本住友製薬	75,200	1,781.00	133,931,200
塩野義製薬	129,600	5,884.00	762,566,400
田辺三菱製薬	105,900	1,244.00	131,739,600
わかもと製薬	12,900	252.00	3,250,800
あすか製薬	12,600	1,076.00	13,557,600
日本新薬	26,500	9,270.00	245,655,000
ピオフェルミン製薬	1,700	2,153.00	3,660,100
中外製薬	105,700	8,100.00	856,170,000
科研製薬	17,300	4,910.00	84,943,000
エーザイ	121,300	5,436.00	659,386,800
理研ビタミン	4,800	3,560.00	17,088,000
ロート製薬	52,000	2,989.00	155,428,000
小野薬品工業	239,400	1,900.00	454,860,000
久光製薬	29,900	4,785.00	143,071,500
有機合成薬品工業	8,000	232.00	1,856,000
持田製薬	15,300	4,055.00	62,041,500
参天製薬	188,800	1,833.00	346,070,400
扶桑薬品工業	3,600	1,940.00	6,984,000
日本ケミファ	1,400	2,801.00	3,921,400
ツムラ	31,400	2,887.00	90,651,800
日医工	26,600	1,210.00	32,186,000
テルモ	286,800	3,362.00	964,221,600
みらかホールディングス	27,100	2,446.00	66,286,600
キッセイ薬品工業	17,900	2,668.00	47,757,200
生化学工業	19,700	1,149.00	22,635,300
栄研化学	17,900	1,563.00	27,977,700
日水製薬	4,200	1,191.00	5,002,200
鳥居薬品	6,400	2,748.00	17,587,200
JCRファーマ	7,200	8,160.00	58,752,000
東和薬品	14,600	2,460.00	35,916,000
富士製薬工業	6,900	1,299.00	8,963,100
沢井製薬	20,800	5,530.00	115,024,000
ゼリア新薬工業	20,000	1,895.00	37,900,000

第一三共	290,100	6,518.00	1,890,871,800
キョーリン製薬ホールディングス	22,300	1,773.00	39,537,900
大幸薬品	4,600	2,583.00	11,881,800
ダイト	5,900	2,943.00	17,363,700
大塚ホールディングス	193,100	4,214.00	813,723,400
大正製薬ホールディングス	21,400	7,630.00	163,282,000
ペプチドリーム	51,300	4,925.00	252,652,500
大日本塗料	11,200	1,080.00	12,096,000
日本ペイントホールディングス	81,900	6,000.00	491,400,000
関西ペイント	111,600	2,537.00	283,129,200
神東塗料	8,700	191.00	1,661,700
中国塗料	32,700	934.00	30,541,800
日本特殊塗料	7,500	1,064.00	7,980,000
藤倉化成	13,300	531.00	7,062,300
太陽ホールディングス	8,200	3,715.00	30,463,000
D I C	41,800	3,050.00	127,490,000
サカタインクス	21,700	1,162.00	25,215,400
東洋インキS Cホールディングス	20,900	2,524.00	52,751,600
T & K T O K A	7,600	971.00	7,379,600
アルプス技研	8,700	1,503.00	13,076,100
サニックス	17,200	393.00	6,759,600
ダイオーズ	2,300	1,393.00	3,203,900
日本空調サービス	11,200	686.00	7,683,200
オリエンタルランド	114,500	16,275.00	1,863,487,500
フォーカスシステムズ	6,900	860.00	5,934,000
ダスキン	24,800	2,811.00	69,712,800
パーク24	53,700	2,521.00	135,377,700
明光ネットワークジャパン	11,500	921.00	10,591,500
ファルコホールディングス	5,400	1,583.00	8,548,200
クレスコ	3,000	3,160.00	9,480,000
フジ・メディア・ホールディングス	103,100	1,412.00	145,577,200
秀英予備校	2,300	432.00	993,600
田谷	2,000	598.00	1,196,000
ラウンドワン	30,100	1,411.00	42,471,100
リゾートトラスト	41,000	1,751.00	71,791,000
オービック	34,500	12,390.00	427,455,000
ジャストシステム	14,200	4,245.00	60,279,000
T D C ソフト	8,900	825.00	7,342,500
Zホールディングス	649,400	321.00	208,457,400
ビー・エム・エル	12,500	2,949.00	36,862,500
ワタベウェディング	1,700	552.00	938,400
トレンドマイクロ	44,200	5,240.00	231,608,000
りらいあコミュニケーションズ	17,600	1,343.00	23,636,800
I Dホールディングス	3,400	1,235.00	4,199,000
リソー教育	49,300	420.00	20,706,000
日本オラクル	20,200	9,110.00	184,022,000
早稲田アカデミー	2,900	882.00	2,557,800
アルファシステムズ	3,100	2,793.00	8,658,300
フューチャー	12,000	1,914.00	22,968,000
C A C Holdings	6,500	1,280.00	8,320,000

S Bテクノロジー	4,300	1,944.00	8,359,200
トーセ	2,800	835.00	2,338,000
ユー・エス・エス	118,400	2,017.00	238,812,800
オービックビジネスコンサルタント	10,200	4,190.00	42,738,000
伊藤忠テクノソリューションズ	45,400	2,924.00	132,749,600
アイティフォー	12,200	844.00	10,296,800
東京個別指導学院	3,500	887.00	3,104,500
東計電算	1,500	3,195.00	4,792,500
サイバーエージェント	55,800	3,995.00	222,921,000
楽天	451,700	1,009.00	455,765,300
エクスネット	2,000	970.00	1,940,000
クリーク・アンド・リバー社	5,800	1,140.00	6,612,000
テー・オー・ダブリュー	8,800	746.00	6,564,800
大塚商会	53,800	4,085.00	219,773,000
サイボウズ	11,700	1,012.00	11,840,400
ソフトブレーン	6,100	690.00	4,209,000
山田コンサルティンググループ	4,800	1,732.00	8,313,600
セントラルスポーツ	3,600	3,205.00	11,538,000
パラカ	2,600	1,978.00	5,142,800
電通国際情報サービス	6,200	3,415.00	21,173,000
デジタルガレージ	19,400	3,410.00	66,154,000
イーエムシステムズ	8,100	1,855.00	15,025,500
ウェザーニューズ	3,400	3,310.00	11,254,000
C I J	7,600	821.00	6,239,600
ビジネスエンジニアリング	1,100	2,921.00	3,213,100
日本エンタープライズ	11,600	226.00	2,621,600
WOWOW	4,700	2,540.00	11,938,000
スカラ	7,200	923.00	6,645,600
インテリジェント ウェイブ	3,900	779.00	3,038,100
フルキャストホールディングス	9,800	2,125.00	20,825,000
エン・ジャパン	14,100	3,935.00	55,483,500
富士フイルムホールディングス	210,500	4,661.00	981,140,500
コニカミノルタ	221,400	755.00	167,157,000
資生堂	201,400	8,590.00	1,730,026,000
ライオン	131,800	2,146.00	282,842,800
高砂香料工業	7,000	2,545.00	17,815,000
マンダム	22,800	2,659.00	60,625,200
ミルボン	13,600	5,530.00	75,208,000
ファンケル	45,200	2,855.00	129,046,000
コーセー	17,200	18,790.00	323,188,000
コタ	5,400	1,263.00	6,820,200
シーボン	1,200	2,410.00	2,892,000
ポーラ・オルビスホールディングス	43,300	2,489.00	107,773,700
ノビアホールディングス	9,700	5,610.00	54,417,000
アジュバンコスメジャパン	2,300	945.00	2,173,500
エステー	7,200	1,551.00	11,167,200
アグロ カネショウ	3,200	1,521.00	4,867,200
コニシ	17,900	1,489.00	26,653,100
長谷川香料	13,400	1,945.00	26,063,000
星光PMC	5,900	794.00	4,684,600

小林製薬	28,400	8,570.00	243,388,000
荒川化学工業	9,100	1,515.00	13,786,500
メック	7,000	1,623.00	11,361,000
日本高純度化学	2,800	2,430.00	6,804,000
タカラバイオ	26,600	2,147.00	57,110,200
JCU	13,200	2,321.00	30,637,200
新田ゼラチン	6,600	679.00	4,481,400
OATアグリオ	1,500	1,625.00	2,437,500
デクセリアルズ	26,200	817.00	21,405,400
アース製薬	7,600	5,490.00	41,724,000
北興化学工業	10,500	512.00	5,376,000
大成ラミック	3,300	2,783.00	9,183,900
クミアイ化学工業	42,000	989.00	41,538,000
日本農薬	18,300	510.00	9,333,000
富士興産	4,000	677.00	2,708,000
ニチレキ	13,000	1,119.00	14,547,000
ユシロ化学工業	5,300	1,333.00	7,064,900
ピーピー・カストロール	3,600	1,428.00	5,140,800
富士石油	24,700	250.00	6,175,000
MORESCO	3,700	1,345.00	4,976,500
出光興産	117,000	3,120.00	365,040,000
JXTGホールディングス	1,676,500	494.80	829,532,200
コスモエネルギーホールディングス	29,400	2,258.00	66,385,200
横浜ゴム	58,600	2,197.00	128,744,200
TOYO TIRE	58,300	1,338.00	78,005,400
ブリヂストン	311,500	4,204.00	1,309,546,000
住友ゴム工業	90,900	1,310.00	119,079,000
藤倉コンポジット	9,200	425.00	3,910,000
オカモト	6,800	3,955.00	26,894,000
アキレス	7,000	1,771.00	12,397,000
フコク	4,500	694.00	3,123,000
ニッタ	11,400	2,842.00	32,398,800
クリエートメディック	3,400	955.00	3,247,000
住友理工	19,600	876.00	17,169,600
三ツ星ベルト	13,400	1,832.00	24,548,800
バンドー化学	19,300	828.00	15,980,400
AGC	100,200	3,405.00	341,181,000
日本板硝子	48,500	655.00	31,767,500
石塚硝子	1,500	2,049.00	3,073,500
有沢製作所	16,000	1,046.00	16,736,000
日本山村硝子	4,300	1,248.00	5,366,400
日本電気硝子	40,700	2,403.00	97,802,100
オハラ	4,100	1,525.00	6,252,500
住友大阪セメント	20,500	4,625.00	94,812,500
太平洋セメント	64,000	2,841.00	181,824,000
リソルホールディングス	1,000	3,990.00	3,990,000
日本ヒューム	10,300	797.00	8,209,100
日本コンクリート工業	22,300	304.00	6,779,200
三谷セキサン	4,700	3,350.00	15,745,000
アジアパイルホールディングス	14,600	528.00	7,708,800

東海カーボン	106,300	1,090.00	115,867,000
日本カーボン	5,200	3,895.00	20,254,000
東洋炭素	6,000	2,366.00	14,196,000
ノリタケカンパニーリミテド	6,100	4,110.00	25,071,000
TOTO	78,000	4,070.00	317,460,000
日本碍子	123,600	1,541.00	190,467,600
日本特殊陶業	85,500	2,041.00	174,505,500
ダントーホールディングス	9,200	115.00	1,058,000
MARUWA	3,500	7,270.00	25,445,000
品川リフラクトリーズ	2,700	2,703.00	7,298,100
黒崎播磨	2,000	5,860.00	11,720,000
ヨータイ	9,000	663.00	5,967,000
イソライト工業	5,400	459.00	2,478,600
東京窯業	13,300	299.00	3,976,700
ニッカトー	4,800	734.00	3,523,200
フジインコーポレーテッド	9,000	2,559.00	23,031,000
クニミネ工業	4,000	943.00	3,772,000
エーアンドエーマテリアル	2,000	1,037.00	2,074,000
ニチアス	27,800	1,934.00	53,765,200
日本製鉄	465,400	1,504.50	700,194,300
神戸製鋼所	183,300	570.00	104,481,000
中山製鋼所	13,800	454.00	6,265,200
合同製鐵	4,900	2,229.00	10,922,100
ジェイ エフ イー ホールディングス	270,600	1,325.00	358,545,000
東京製鐵	53,800	848.00	45,622,400
共英製鋼	11,300	1,944.00	21,967,200
大和工業	21,300	2,726.00	58,063,800
東京鐵鋼	4,200	1,341.00	5,632,200
大阪製鐵	6,600	1,340.00	8,844,000
淀川製鋼所	13,500	2,055.00	27,742,500
丸一鋼管	35,500	2,784.00	98,832,000
モリ工業	3,100	2,022.00	6,268,200
大同特殊鋼	16,400	4,520.00	74,128,000
日本高周波鋼業	3,600	411.00	1,479,600
日本冶金工業	8,300	2,313.00	19,197,900
山陽特殊製鋼	12,600	1,452.00	18,295,200
愛知製鋼	5,600	3,370.00	18,872,000
日立金属	107,900	1,209.00	130,451,100
日本金属	2,400	823.00	1,975,200
大平洋金属	6,800	2,346.00	15,952,800
新日本電工	65,000	176.00	11,440,000
栗本鐵工所	5,000	1,587.00	7,935,000
虹 技	1,600	1,392.00	2,227,200
日本鑄鉄管	1,100	1,037.00	1,140,700
日本製鋼所	30,400	2,157.00	65,572,800
三菱製鋼	7,400	1,123.00	8,310,200
日亜鋼業	15,100	316.00	4,771,600
日本精線	1,500	2,391.00	3,586,500
エンピプロ・ホールディングス	2,600	630.00	1,638,000

大紀アルミニウム工業所	16,500	701.00	11,566,500	
日本軽金属ホールディングス	272,800	201.00	54,832,800	
三井金属鉱業	27,100	2,652.00	71,869,200	
東邦亜鉛	5,600	2,056.00	11,513,600	
三菱マテリアル	66,100	2,905.00	192,020,500	
住友金属鉱山	137,300	3,403.00	467,231,900	
DOWAホールディングス	23,400	3,710.00	86,814,000	
古河機械金属	16,500	1,460.00	24,090,000	
エス・サイエンス	47,600	53.00	2,522,800	
大阪チタニウムテクノロジーズ	11,600	1,641.00	19,035,600	
東邦チタニウム	18,000	841.00	15,138,000	
UACJ	15,200	1,813.00	27,557,600	
CKサンエツ	1,900	2,816.00	5,350,400	
古河電気工業	28,900	2,749.00	79,446,100	
住友電気工業	374,400	1,385.00	518,544,000	
フジクラ	121,100	436.00	52,799,600	
昭和電線ホールディングス	11,700	893.00	10,448,100	
東京特殊電線	1,300	2,217.00	2,882,100	
タツタ電線	20,000	486.00	9,720,000	
カナレ電気	1,700	1,885.00	3,204,500	
平河ヒューテック	4,200	1,064.00	4,468,800	
リョービ	12,300	1,787.00	21,980,100	
アーレスティ	12,300	553.00	6,801,900	
アサヒホールディングス	18,800	2,246.00	42,224,800	
東洋製罐グループホールディングス	63,900	1,703.00	108,821,700	
ホッカンホールディングス	5,100	1,613.00	8,226,300	
コロナ	5,500	1,056.00	5,808,000	
横河ブリッジホールディングス	18,700	1,643.00	30,724,100	
OSJBホールディングス	50,700	248.00	12,573,600	
駒井ハルテック	1,900	1,653.00	3,140,700	
高田機工	900	2,537.00	2,283,300	
三和ホールディングス	103,500	1,233.00	127,615,500	
文化シャッター	29,500	928.00	27,376,000	
三協立山	13,900	1,193.00	16,582,700	
アルインコ	8,100	1,105.00	8,950,500	
東洋シャッター	2,500	711.00	1,777,500	
LIXILグループ	147,900	1,949.00	288,257,100	
日本フィルコン	7,800	501.00	3,907,800	
ノーリツ	20,700	1,295.00	26,806,500	
長府製作所	10,100	2,465.00	24,896,500	
リンナイ	17,900	7,370.00	131,923,000	
ユニプレス	19,600	1,686.00	33,045,600	
ダイニチ工業	5,400	684.00	3,693,600	
日東精工	14,000	563.00	7,882,000	
三洋工業	1,400	1,924.00	2,693,600	
岡部	20,200	871.00	17,594,200	
ジーテクト	11,000	1,692.00	18,612,000	
中国工業	1,700	481.00	817,700	
東プレ	18,700	1,746.00	32,650,200	
高周波熱錬	19,300	895.00	17,273,500	

東京製綱	6,200	1,033.00	6,404,600
サンコール	5,700	453.00	2,582,100
モリテックスチール	8,000	341.00	2,728,000
パイオラックス	16,000	1,879.00	30,064,000
エイチワン	9,900	645.00	6,385,500
日本発条	99,800	825.00	82,335,000
中央発條	1,200	2,762.00	3,314,400
アドバネクス	1,300	1,705.00	2,216,500
三浦工業	43,400	3,110.00	134,974,000
タクマ	36,500	1,228.00	44,822,000
テクノプロ・ホールディングス	19,400	6,430.00	124,742,000
アトラ	2,300	370.00	851,000
インターワークス	2,300	501.00	1,152,300
アイ・アールジャパンホールディングス	3,500	3,845.00	13,457,500
Keepers 技研	3,700	1,506.00	5,572,200
ファーストロジック	2,300	618.00	1,421,400
三機サービス	1,900	938.00	1,782,200
Gunosy	6,800	1,424.00	9,683,200
デザインワン・ジャパン	2,300	332.00	763,600
イー・ガーディアン	5,100	1,625.00	8,287,500
リブセンス	6,000	263.00	1,578,000
ジャパンマテリアル	26,600	1,408.00	37,452,800
ベクトル	12,300	808.00	9,938,400
ウチヤマホールディングス	5,100	483.00	2,463,300
チャーム・ケア・コーポレーション	3,200	2,309.00	7,388,800
ライクキッズ	2,400	884.00	2,121,600
キャリアリンク	4,000	601.00	2,404,000
IBJ	6,700	995.00	6,666,500
アサンテ	4,000	2,017.00	8,068,000
N・フィールド	6,900	609.00	4,202,100
バリューHR	1,900	3,340.00	6,346,000
M&Aキャピタルパートナーズ	3,500	6,670.00	23,345,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	4,100	1,434.00	5,879,400
ERIホールディングス	2,900	781.00	2,264,900
アピスト	1,600	2,632.00	4,211,200
シグマクシス	4,700	1,434.00	6,739,800
ウィルグループ	6,500	959.00	6,233,500
エスクロー・エージェント・ジャパン	14,000	217.00	3,038,000
リクルートホールディングス	693,900	3,507.00	2,433,507,300
エラン	5,800	1,692.00	9,813,600
ツガミ	22,700	908.00	20,611,600
オークマ	12,800	6,010.00	76,928,000
東芝機械	11,300	2,265.00	25,594,500
アマダホールディングス	150,400	1,159.00	174,313,600
アイダエンジニアリング	27,000	866.00	23,382,000
滝澤鉄工所	3,100	1,271.00	3,940,100
FUJI	40,000	1,674.00	66,960,000
牧野フライス製作所	11,700	4,735.00	55,399,500

オーエスジー	46,300	2,088.00	96,674,400
ダイジェット工業	1,200	1,532.00	1,838,400
旭ダイヤモンド工業	26,300	625.00	16,437,500
D M G 森精機	63,400	1,571.00	99,601,400
ソディック	23,600	792.00	18,691,200
ディスコ	13,600	21,320.00	289,952,000
日東工器	5,500	2,182.00	12,001,000
日進工具	3,000	1,925.00	5,775,000
パンチ工業	7,100	475.00	3,372,500
富士ダイス	4,600	622.00	2,861,200
土木管理総合試験所	4,500	432.00	1,944,000
日本郵政	793,600	981.00	778,521,600
ベルシステム24ホールディングス	16,300	1,695.00	27,628,500
鎌倉新書	7,300	1,423.00	10,387,900
一蔵	1,300	640.00	832,000
L I T A L I C O	2,300	2,054.00	4,724,200
グローバルキッズCOMPANY	1,400	838.00	1,173,200
エポラブルアジア	4,400	1,975.00	8,690,000
アトラエ	2,500	3,100.00	7,750,000
ストライク	3,700	3,460.00	12,802,000
ソラスト	23,800	1,217.00	28,964,600
セラク	2,600	695.00	1,807,000
インソース	4,500	2,532.00	11,394,000
豊田自動織機	82,000	6,110.00	501,020,000
豊和工業	5,600	742.00	4,155,200
O K K	4,100	706.00	2,894,600
石川製作所	2,500	1,363.00	3,407,500
東洋機械金属	7,200	573.00	4,125,600
津田駒工業	2,000	1,250.00	2,500,000
エンシュウ	2,700	1,129.00	3,048,300
島精機製作所	13,800	2,561.00	35,341,800
オプトラン	11,200	3,200.00	35,840,000
N C ホールディングス	3,600	490.00	1,764,000
イワキ	4,300	962.00	4,136,600
フリー	8,100	940.00	7,614,000
ヤマシンフィルタ	17,600	913.00	16,068,800
日阪製作所	12,300	880.00	10,824,000
やまびこ	19,500	1,178.00	22,971,000
平田機工	4,800	7,390.00	35,472,000
ペガサスミシン製造	9,500	502.00	4,769,000
マルマエ	3,300	985.00	3,250,500
タツモ	3,700	1,090.00	4,033,000
ナブテスコ	59,100	3,295.00	194,734,500
三井海洋開発	10,700	2,640.00	28,248,000
レオン自動機	9,900	1,532.00	15,166,800
S M C	29,700	46,150.00	1,370,655,000
ヤマハモーターロボティクスホールディングス	7,800	461.00	3,595,800
ホソカワミクロン	3,500	3,685.00	12,897,500
ユニオンツール	3,700	3,370.00	12,469,000

オイレス工業	14,100	1,590.00	22,419,000
日精エー・エス・ビー機械	3,400	3,675.00	12,495,000
サトーホールディングス	12,100	2,865.00	34,666,500
技研製作所	8,800	3,450.00	30,360,000
日本エアテック	3,300	589.00	1,943,700
カワタ	2,300	945.00	2,173,500
日精樹脂工業	8,400	1,004.00	8,433,600
オカダアイヨン	3,600	1,193.00	4,294,800
ワイエイシイホールディングス	4,300	672.00	2,889,600
小松製作所	458,900	2,427.50	1,113,979,750
住友重機械工業	58,000	3,210.00	186,180,000
日立建機	40,600	2,533.00	102,839,800
日工	14,000	625.00	8,750,000
巴工業	4,300	2,344.00	10,079,200
井関農機	10,100	1,500.00	15,150,000
TOWA	8,900	910.00	8,099,000
丸山製作所	2,200	1,180.00	2,596,000
北川鉄工所	4,500	1,967.00	8,851,500
シンニッタン	15,800	422.00	6,667,600
ローツェ	4,500	3,145.00	14,152,500
タカキタ	3,700	547.00	2,023,900
クボタ	542,900	1,608.50	873,254,650
荏原実業	2,600	2,097.00	5,452,200
東洋エンジニアリング	13,500	665.00	8,977,500
三菱化工機	3,500	1,790.00	6,265,000
月島機械	20,100	1,508.00	30,310,800
帝国電機製作所	7,100	1,211.00	8,598,100
東京機械製作所	4,200	368.00	1,545,600
新東工業	23,900	966.00	23,087,400
澁谷工業	8,900	2,842.00	25,293,800
アイチコーポレーション	17,500	698.00	12,215,000
小森コーポレーション	25,500	1,182.00	30,141,000
鶴見製作所	7,900	2,059.00	16,266,100
住友精密工業	1,700	3,100.00	5,270,000
酒井重工業	1,900	2,783.00	5,287,700
荏原製作所	44,900	2,953.00	132,589,700
石井鐵工所	1,600	2,264.00	3,622,400
西島製作所	10,300	975.00	10,042,500
北越工業	10,400	1,225.00	12,740,000
ダイキン工業	138,400	14,125.00	1,954,900,000
オルガノ	3,700	4,930.00	18,241,000
トーヨーカネツ	3,900	1,935.00	7,546,500
栗田工業	54,800	2,807.00	153,823,600
椿本チエイン	13,200	3,460.00	45,672,000
大同工業	4,700	814.00	3,825,800
日機装	30,400	1,107.00	33,652,800
木村化工機	8,500	390.00	3,315,000
レイズネクスト	20,400	1,072.00	21,868,800
アネスト岩田	15,800	991.00	15,657,800
ダイフク	55,800	5,590.00	311,922,000

サムコ	3,000	929.00	2,787,000
加藤製作所	5,200	1,936.00	10,067,200
油研工業	1,700	1,620.00	2,754,000
タダノ	48,900	1,023.00	50,024,700
フジテック	36,800	1,381.00	50,820,800
C K D	28,300	1,390.00	39,337,000
キトー	7,700	1,561.00	12,019,700
平和	28,200	2,173.00	61,278,600
理想科学工業	8,900	1,654.00	14,720,600
SANKYO	25,300	3,745.00	94,748,500
日本金銭機械	11,200	925.00	10,360,000
マースグループホールディングス	6,400	1,972.00	12,620,800
福島工業	6,300	3,210.00	20,223,000
オーイズミ	4,500	517.00	2,326,500
ダイコク電機	4,700	1,457.00	6,847,900
竹内製作所	17,000	1,762.00	29,954,000
アマノ	28,900	3,170.00	91,613,000
JUKI	14,100	898.00	12,661,800
サンデンホールディングス	12,700	611.00	7,759,700
蛇の目ミシン工業	9,000	400.00	3,600,000
ブラザー工業	132,000	1,961.00	258,852,000
マックス	15,400	1,842.00	28,366,800
モリタホールディングス	17,700	1,759.00	31,134,300
グローリー	28,000	3,010.00	84,280,000
新晃工業	9,500	1,742.00	16,549,000
大和冷機工業	14,700	1,177.00	17,301,900
セガサミーホールディングス	100,500	1,547.00	155,473,500
日本ピストンリング	3,700	1,273.00	4,710,100
リケン	4,700	3,800.00	17,860,000
T P R	13,600	1,723.00	23,432,800
ツバキ・ナカシマ	20,700	1,626.00	33,658,200
ホシザキ	29,600	8,550.00	253,080,000
大豊工業	8,500	766.00	6,511,000
日本精工	208,200	950.00	197,790,000
NTN	217,600	322.00	70,067,200
ジェイテクト	97,100	1,260.00	122,346,000
不二越	9,400	4,805.00	45,167,000
ミネベアミツミ	188,200	1,849.00	347,981,800
日本トムソン	30,300	454.00	13,756,200
THK	59,000	2,762.00	162,958,000
ユーシン精機	7,900	926.00	7,315,400
前澤給装工業	4,000	2,032.00	8,128,000
イーグル工業	12,400	998.00	12,375,200
前澤工業	6,700	368.00	2,465,600
日本ピラー工業	10,400	1,295.00	13,468,000
キッツ	41,200	695.00	28,634,000
日立製作所	456,300	4,002.00	1,826,112,600
三菱電機	1,013,500	1,442.50	1,461,973,750
富士電機	65,800	3,310.00	217,798,000
東洋電機製造	4,000	1,476.00	5,904,000

安川電機	117,500	3,810.00	447,675,000
シンフォニアテクノロジー	14,100	1,243.00	17,526,300
明電舎	20,100	1,867.00	37,526,700
オリジン	2,800	1,382.00	3,869,600
山洋電気	4,900	4,810.00	23,569,000
デンヨー	9,400	1,758.00	16,525,200
ベイクレント・コンサルティング	6,900	5,040.00	34,776,000
Orchestra Holdings	2,000	1,037.00	2,074,000
アイモバイル	2,800	513.00	1,436,400
キャリアインデックス	3,600	387.00	1,393,200
MS-Japan	4,000	1,228.00	4,912,000
船場	1,700	947.00	1,609,900
グレイステクノロジー	3,100	2,987.00	9,259,700
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	7,700	2,728.00	21,005,600
フルテック	1,200	1,281.00	1,537,200
グリーンズ	2,700	1,300.00	3,510,000
ツナググループ・ホールディングス	1,000	587.00	587,000
ソウルドアウト	1,100	1,295.00	1,424,500
日総工業	5,300	1,152.00	6,105,600
キュービーネットホールディングス	6,000	2,207.00	13,242,000
RPAホールディングス	4,100	1,349.00	5,530,900
三櫻工業	13,000	816.00	10,608,000
マキタ	123,400	3,270.00	403,518,000
東芝テック	12,700	3,530.00	44,831,000
芝浦メカトロニクス	1,800	2,951.00	5,311,800
マブチモーター	28,000	3,905.00	109,340,000
日本電産	122,000	14,435.00	1,761,070,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	5,600	592.00	3,315,200
トレックス・セミコンダクター	4,000	1,323.00	5,292,000
東光高岳	5,100	1,172.00	5,977,200
ダブル・スコープ	13,900	561.00	7,797,900
宮越ホールディングス	3,800	1,023.00	3,887,400
ダイヘン	11,100	3,250.00	36,075,000
ヤーマン	14,800	699.00	10,345,200
JVCケンウッド	77,700	307.00	23,853,900
ミマキエンジニアリング	9,200	515.00	4,738,000
第一精工	3,700	2,492.00	9,220,400
日新電機	23,800	1,330.00	31,654,000
大崎電気工業	20,300	688.00	13,966,400
オムロン	107,700	5,930.00	638,661,000
日東工業	16,300	2,095.00	34,148,500
I D E C	13,600	2,015.00	27,404,000
不二電機工業	1,200	1,226.00	1,471,200
ジーエス・ユアサコーポレーション	36,400	1,851.00	67,376,400
サクサホールディングス	2,500	1,820.00	4,550,000
メルコホールディングス	4,200	2,734.00	11,482,800
テクノメディカ	2,300	2,046.00	4,705,800

ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	1,500	1,047.00	1,570,500	
日本電気	131,200	4,540.00	595,648,000	
富士通	97,700	8,828.00	862,495,600	
沖電気工業	43,800	1,442.00	63,159,600	
岩崎通信機	4,800	807.00	3,873,600	
電気興業	5,300	3,345.00	17,728,500	
サンケン電気	11,900	2,410.00	28,679,000	
ナカヨ	1,900	1,569.00	2,981,100	
アイホン	5,800	1,637.00	9,494,600	
ルネサスエレクトロニクス	483,200	718.00	346,937,600	
セイコーエプソン	125,600	1,458.00	183,124,800	
ワコム	73,600	346.00	25,465,600	
アルバック	20,200	4,605.00	93,021,000	
アクセル	4,400	593.00	2,609,200	
E I Z O	9,300	3,765.00	35,014,500	
ジャパンディスプレイ	240,600	56.00	13,473,600	
日本信号	25,900	1,207.00	31,261,300	
京三製作所	22,000	385.00	8,470,000	
能美防災	13,400	2,029.00	27,188,600	
ホーチキ	6,500	1,437.00	9,340,500	
星和電機	4,100	534.00	2,189,400	
エレコム	9,600	3,970.00	38,112,000	
パナソニック	1,157,700	877.90	1,016,344,830	
シャープ	100,600	1,206.00	121,323,600	
アンリツ	65,300	2,067.00	134,975,100	
富士通ゼネラル	30,900	1,768.00	54,631,200	
ソニー	680,400	6,230.00	4,238,892,000	
T D K	53,000	10,060.00	533,180,000	
帝国通信工業	4,500	1,171.00	5,269,500	
タムラ製作所	39,100	586.00	22,912,600	
アルプスアルパイン	105,500	2,110.00	222,605,000	
池上通信機	3,200	1,095.00	3,504,000	
日本電波工業	9,300	468.00	4,352,400	
鈴木	5,400	632.00	3,412,800	
日本トリム	1,900	4,700.00	8,930,000	
ローランド ディー . ジー .	5,500	2,044.00	11,242,000	
フォスター電機	11,400	2,017.00	22,993,800	
S M K	2,800	2,742.00	7,677,600	
ヨコオ	7,200	3,065.00	22,068,000	
ティアック	8,400	199.00	1,671,600	
ホシデン	29,900	1,051.00	31,424,900	
ヒロセ電機	14,500	13,360.00	193,720,000	
日本航空電子工業	23,200	1,678.00	38,929,600	
T O A	10,900	1,213.00	13,221,700	
マクセルホールディングス	21,800	1,561.00	34,029,800	
古野電気	13,100	971.00	12,720,100	
ユニデンホールディングス	3,000	1,948.00	5,844,000	
スミダコーポレーション	7,800	1,059.00	8,260,200	
アイコム	5,600	2,282.00	12,779,200	

リオン	4,700	2,493.00	11,717,100
本多通信工業	8,800	490.00	4,312,000
船井電機	10,300	576.00	5,932,800
横河電機	101,400	1,824.00	184,953,600
新電元工業	3,600	3,565.00	12,834,000
アズビル	64,000	2,905.00	185,920,000
東亜ディーケーケー	5,100	830.00	4,233,000
日本光電工業	44,700	3,060.00	136,782,000
チノー	3,500	1,415.00	4,952,500
共和電業	10,600	418.00	4,430,800
日本電子材料	4,200	549.00	2,305,800
堀場製作所	20,100	6,540.00	131,454,000
アドバンテスト	69,100	5,010.00	346,191,000
小野測器	4,200	519.00	2,179,800
エスベック	9,000	1,878.00	16,902,000
キーエンス	49,700	64,190.00	3,190,243,000
日置電機	5,300	3,605.00	19,106,500
シスメックス	79,000	6,990.00	552,210,000
日本マイクロニクス	17,800	918.00	16,340,400
メガチップス	8,000	1,752.00	14,016,000
OBARA GROUP	5,300	3,675.00	19,477,500
IMAGICA GROUP	8,500	527.00	4,479,500
澤藤電機	1,300	1,801.00	2,341,300
デンソー	223,200	4,700.00	1,049,040,000
原田工業	3,700	847.00	3,133,900
コーセル	12,400	1,095.00	13,578,000
イリソ電子工業	9,300	5,020.00	46,686,000
オブテックスグループ	16,700	1,621.00	27,070,700
千代田インテグレ	4,500	2,215.00	9,967,500
アイ・オー・データ機器	3,800	870.00	3,306,000
レーザーテック	20,800	7,730.00	160,784,000
スタンレー電気	71,500	2,908.00	207,922,000
岩崎電気	4,000	1,331.00	5,324,000
ウシオ電機	58,800	1,495.00	87,906,000
岡谷電機産業	7,400	371.00	2,745,400
ヘリオス テクノ ホールディング	9,500	581.00	5,519,500
エノモト	2,500	1,028.00	2,570,000
日本セラミック	10,200	2,700.00	27,540,000
遠藤照明	5,200	670.00	3,484,000
古河電池	7,400	615.00	4,551,000
双信電機	5,200	420.00	2,184,000
山一電機	7,400	1,337.00	9,893,800
図研	6,600	1,886.00	12,447,600
日本電子	20,000	2,594.00	51,880,000
カシオ計算機	89,700	1,658.00	148,722,600
ファナック	96,300	19,465.00	1,874,479,500
日本シイエムケイ	25,900	627.00	16,239,300
エンプラス	4,600	3,450.00	15,870,000
大真空	3,800	1,037.00	3,940,600
ローム	48,500	8,500.00	412,250,000

浜松ホトニクス	72,700	4,025.00	292,617,500	
三井ハイテック	11,200	1,813.00	20,305,600	
新光電気工業	34,100	979.00	33,383,900	
京セラ	154,500	6,737.00	1,040,866,500	
協栄産業	1,200	1,333.00	1,599,600	
太陽誘電	45,100	2,770.00	124,927,000	
村田製作所	319,000	5,778.00	1,843,182,000	
双葉電子工業	15,900	1,333.00	21,194,700	
日東電工	69,900	5,415.00	378,508,500	
北陸電気工業	3,800	1,077.00	4,092,600	
東海理化電機製作所	26,600	1,861.00	49,502,600	
ニチコン	31,900	1,026.00	32,729,400	
日本ケミコン	7,200	1,666.00	11,995,200	
K O A	15,300	1,358.00	20,777,400	
三井E & Sホールディングス	36,700	969.00	35,562,300	
日立造船	80,300	346.00	27,783,800	
三菱重工業	169,800	4,309.00	731,668,200	
川崎重工業	78,800	2,447.00	192,823,600	
I H I	77,900	2,431.00	189,374,900	
名村造船所	30,700	289.00	8,872,300	
サノヤスホールディングス	13,800	189.00	2,608,200	
スプリックス	3,200	1,391.00	4,451,200	
日本車輛製造	3,700	2,568.00	9,501,600	
三菱ロジスネクスト	16,800	1,016.00	17,068,800	
近畿車輛	1,700	1,357.00	2,306,900	
F P G	31,500	1,087.00	34,240,500	
島根銀行	2,400	672.00	1,612,800	
じもとホールディングス	69,100	99.00	6,840,900	
全国保証	28,200	4,150.00	117,030,000	
めぶきフィナンシャルグループ	518,500	263.00	136,365,500	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	13,500	1,370.00	18,495,000	
九州フィナンシャルグループ	163,700	435.00	71,209,500	
かんぼ生命保険	35,400	1,637.00	57,949,800	
ゆうちょ銀行	282,700	1,036.00	292,877,200	
富山第一銀行	24,200	307.00	7,429,400	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	627,100	410.00	257,111,000	
ジェイリース	2,700	312.00	842,400	
西日本フィナンシャルホールディングス	62,900	762.00	47,929,800	
マーキュリアインベストメント	4,500	729.00	3,280,500	
イントラスト	3,000	687.00	2,061,000	
日本モーゲージサービス	1,500	1,207.00	1,810,500	
C A S A	4,000	1,189.00	4,756,000	
アルヒ	9,100	2,153.00	19,592,300	
プレミアグループ	5,800	1,850.00	10,730,000	
日産自動車	1,195,000	668.70	799,096,500	
いすゞ自動車	320,500	1,191.50	381,875,750	
トヨタ自動車	1,129,500	7,269.00	8,210,335,500	代用有価証券 500,000株

日野自動車	126,600	896.00	113,433,600
三菱自動車工業	375,300	473.00	177,516,900
エフテック	7,200	685.00	4,932,000
レシップホールディングス	4,000	709.00	2,836,000
GMB	2,200	793.00	1,744,600
ファルテック	1,900	757.00	1,438,300
武蔵精密工業	24,700	1,373.00	33,913,100
日産車体	19,800	900.00	17,820,000
新明和工業	42,400	1,264.00	53,593,600
極東開発工業	20,200	1,356.00	27,391,200
日信工業	18,500	1,516.00	28,046,000
トピー工業	8,400	2,000.00	16,800,000
ティラド	3,700	1,924.00	7,118,800
曙ブレーキ工業	56,100	224.00	12,566,400
タチエス	16,700	1,319.00	22,027,300
NOK	54,300	1,634.00	88,726,200
フタバ産業	28,300	740.00	20,942,000
KYB	10,500	3,135.00	32,917,500
市光工業	15,200	793.00	12,053,600
大同メタル工業	16,500	639.00	10,543,500
プレス工業	50,200	458.00	22,991,600
ミクニ	13,200	317.00	4,184,400
太平洋工業	21,200	1,538.00	32,605,600
ケーヒン	23,300	1,651.00	38,468,300
河西工業	12,400	831.00	10,304,400
アイシン精機	83,400	3,510.00	292,734,000
マツダ	317,900	966.10	307,123,190
今仙電機製作所	9,400	845.00	7,943,000
本田技研工業	855,000	2,828.50	2,418,367,500
スズキ	185,500	4,549.00	843,839,500
SUBARU	314,700	2,982.50	938,592,750
安永	5,000	1,217.00	6,085,000
ヤマハ発動機	132,200	1,992.00	263,342,400
ショーワ	24,000	1,619.00	38,856,000
小糸製作所	60,700	5,280.00	320,496,000
TBK	12,000	420.00	5,040,000
エクセディ	13,700	2,132.00	29,208,400
ミツバ	18,700	634.00	11,855,800
豊田合成	32,700	2,163.00	70,730,100
愛三工業	15,900	922.00	14,659,800
盟和産業	1,600	1,083.00	1,732,800
日本プラスト	7,900	679.00	5,364,100
ヨロズ	9,500	1,351.00	12,834,500
エフ・シー・シー	18,200	2,087.00	37,983,400
新家工業	2,300	1,503.00	3,456,900
シマノ	37,900	15,620.00	591,998,000
テイ・エス テック	23,500	3,275.00	76,962,500
関西みらいフィナンシャルグループ	46,900	677.00	31,751,300
三十三フィナンシャルグループ	8,700	1,609.00	13,998,300
第四北越フィナンシャルグループ	17,300	2,668.00	46,156,400

ジャムコ	5,100	1,465.00	7,471,500
小野建	8,900	1,343.00	11,952,700
はるやまホールディングス	4,500	811.00	3,649,500
南陽	2,100	1,594.00	3,347,400
ノジマ	17,800	1,843.00	32,805,400
佐鳥電機	7,400	822.00	6,082,800
カッパ・クリエイト	14,000	1,396.00	19,544,000
エコートレーディング	2,300	525.00	1,207,500
伯東	6,800	1,165.00	7,922,000
コンドーテック	7,800	978.00	7,628,400
中山福	5,700	519.00	2,958,300
ライトオン	7,600	600.00	4,560,000
ナガイレーベン	14,400	2,373.00	34,171,200
ジーンズメイト	3,400	312.00	1,060,800
三菱食品	10,800	2,739.00	29,581,200
良品計画	141,400	2,101.00	297,081,400
三城ホールディングス	12,600	280.00	3,528,000
松田産業	7,300	1,423.00	10,387,900
第一興商	14,800	5,070.00	75,036,000
メディカルホールディングス	107,600	2,373.00	255,334,800
アドヴァン	15,200	1,126.00	17,115,200
S P K	2,300	2,552.00	5,869,600
萩原電気ホールディングス	3,700	2,755.00	10,193,500
アルピス	3,800	2,383.00	9,055,400
アズワン	7,200	8,790.00	63,288,000
スズデン	3,500	1,325.00	4,637,500
尾家産業	3,300	1,279.00	4,220,700
シモジマ	6,100	1,143.00	6,972,300
ドウシシャ	9,400	1,715.00	16,121,000
小津産業	2,200	1,833.00	4,032,600
コナカ	11,600	409.00	4,744,400
高速	5,900	1,345.00	7,935,500
ハウス オブ ローゼ	1,300	1,647.00	2,141,100
G - 7ホールディングス	3,000	3,590.00	10,770,000
たけびし	3,500	1,362.00	4,767,000
イオン北海道	9,700	761.00	7,381,700
コジマ	16,700	438.00	7,314,600
ヒマラヤ	3,500	824.00	2,884,000
コーナン商事	13,000	2,510.00	32,630,000
ネットワークシステムズ	35,200	2,905.00	102,256,000
エコス	3,700	1,705.00	6,308,500
ワタミ	13,200	1,413.00	18,651,600
マルシェ	2,800	773.00	2,164,400
リックス	2,300	1,554.00	3,574,200
システムソフト	27,400	107.00	2,931,800
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	239,300	1,717.00	410,878,100
丸文	8,900	559.00	4,975,100
西松屋チェーン	21,900	941.00	20,607,900
ゼンショーホールディングス	48,500	2,355.00	114,217,500

ハビネット	8,300	1,331.00	11,047,300
幸楽苑ホールディングス	6,400	2,228.00	14,259,200
ハークスレイ	2,000	1,026.00	2,052,000
橋本総業ホールディングス	2,100	1,563.00	3,282,300
日本ライフライン	29,600	1,699.00	50,290,400
サイゼリヤ	16,500	2,607.00	43,015,500
タカショー	5,000	467.00	2,335,000
エクセル	3,800	1,195.00	4,541,000
V Tホールディングス	45,200	448.00	20,249,600
マルカ	3,600	2,155.00	7,758,000
アルゴグラフィックス	8,500	2,586.00	21,981,000
魚力	2,800	1,493.00	4,180,400
I D O M	33,900	461.00	15,627,900
日本エム・ディ・エム	5,900	1,825.00	10,767,500
ポブラ	2,900	501.00	1,452,900
フジ・コーポレーション	2,300	2,098.00	4,825,400
ユナイテッドアローズ	11,400	3,160.00	36,024,000
進和	5,900	2,231.00	13,162,900
エスケイジャパン	2,600	436.00	1,133,600
ダイトロン	4,300	1,348.00	5,796,400
ハイデイ日高	14,400	2,115.00	30,456,000
シークス	12,700	1,558.00	19,786,600
京都きもの友禅	6,900	374.00	2,580,600
コロワイド	33,200	2,092.00	69,454,400
ピーシーデポコーポレーション	13,400	477.00	6,391,800
田中商事	3,500	644.00	2,254,000
オーハシテクニカ	5,700	1,380.00	7,866,000
壱番屋	7,000	5,260.00	36,820,000
白銅	3,300	1,300.00	4,290,000
トップカルチャー	4,200	359.00	1,507,800
P L A N T	2,700	708.00	1,911,600
スギホールディングス	21,900	5,940.00	130,086,000
薬王堂ホールディングス	4,400	2,587.00	11,382,800
島津製作所	130,400	2,646.00	345,038,400
J M S	9,400	636.00	5,978,400
クボテック	2,400	418.00	1,003,200
長野計器	8,000	675.00	5,400,000
ブイ・テクノロジー	4,800	5,580.00	26,784,000
スター精密	15,900	1,575.00	25,042,500
東京計器	6,400	881.00	5,638,400
愛知時計電機	1,300	4,010.00	5,213,000
インターアクション	5,300	2,201.00	11,665,300
オーバル	10,200	239.00	2,437,800
東京精密	18,400	3,275.00	60,260,000
マニー	40,400	2,543.00	102,737,200
ニコン	176,600	1,345.00	237,527,000
トプコン	54,400	1,373.00	74,691,200
オリンパス	604,000	1,450.00	875,800,000
理研計器	8,900	2,065.00	18,378,500
S C R E E Nホールディングス	17,600	6,830.00	120,208,000

キヤノン電子	10,500	1,842.00	19,341,000
タムロン	8,200	2,321.00	19,032,200
HOYA	204,100	8,931.00	1,822,817,100
シード	4,400	815.00	3,586,000
ノーリツ鋼機	8,000	1,526.00	12,208,000
エー・アンド・デイ	9,300	754.00	7,012,200
朝日インテック	86,100	2,802.00	241,252,200
キヤノン	545,500	2,864.50	1,562,584,750
リコー	304,600	949.00	289,065,400
シチズン時計	110,700	546.00	60,442,200
リズム時計工業	3,600	1,017.00	3,661,200
大研医器	8,300	505.00	4,191,500
メニコン	13,900	3,800.00	52,820,000
シンシア	1,200	619.00	742,800
中本パックス	2,900	1,441.00	4,178,900
スノーピーク	4,400	1,206.00	5,306,400
パラマウントベッドホールディングス	11,600	3,945.00	45,762,000
トランザクション	6,100	886.00	5,404,600
SHOBI	3,100	382.00	1,184,200
ニホンフラッシュ	4,400	2,554.00	11,237,600
前田工織	11,200	1,581.00	17,707,200
永大産業	13,300	321.00	4,269,300
アートネイチャー	10,700	633.00	6,773,100
バンダイナムコホールディングス	104,800	6,740.00	706,352,000
アイフィスジャパン	2,800	791.00	2,214,800
共立印刷	18,200	156.00	2,839,200
SHOEI	4,900	4,615.00	22,613,500
フランスベッドホールディングス	14,200	986.00	14,001,200
マーベラス	15,100	790.00	11,929,000
パイロットコーポレーション	17,700	4,015.00	71,065,500
萩原工業	5,700	1,650.00	9,405,000
エイベックス	17,000	1,261.00	21,437,000
トッパン・フォームズ	21,700	1,013.00	21,982,100
フジシールインターナショナル	22,800	2,643.00	60,260,400
タカラトミー	42,500	1,177.00	50,022,500
廣濟堂	9,500	717.00	6,811,500
エステールホールディングス	2,700	638.00	1,722,600
アーク	39,100	93.00	3,636,300
レック	10,900	978.00	10,660,200
タカノ	4,000	794.00	3,176,000
三光合成	9,300	359.00	3,338,700
プロネクサス	8,800	1,129.00	9,935,200
ホクシン	7,500	173.00	1,297,500
ウッドワン	3,500	1,100.00	3,850,000
大建工業	7,700	1,896.00	14,599,200
きもと	17,800	173.00	3,079,400
凸版印刷	150,600	1,922.00	289,453,200
大日本印刷	142,900	2,747.00	392,546,300
共同印刷	3,100	2,640.00	8,184,000
NISSHA	20,900	1,136.00	23,742,400

光村印刷	900	1,719.00	1,547,100	
藤森工業	9,100	3,355.00	30,530,500	
ヴィア・ホールディングス	12,300	644.00	7,921,200	
宝印刷	5,000	1,676.00	8,380,000	
前澤化成工業	6,900	1,116.00	7,700,400	
未来工業	5,500	2,071.00	11,390,500	
アシックス	83,700	1,802.00	150,827,400	
ツツミ	3,200	1,879.00	6,012,800	
ウェーブロックホールディングス	2,500	787.00	1,967,500	
J S P	5,900	1,825.00	10,767,500	
ニチハ	14,100	2,929.00	41,298,900	
エフピコ	11,100	6,430.00	71,373,000	
小松ウオール工業	3,100	1,935.00	5,998,500	
ヤマハ	60,300	4,755.00	286,726,500	
河合楽器製作所	3,100	2,909.00	9,017,900	
クリナップ	9,400	552.00	5,188,800	
ピジョン	61,300	4,610.00	282,593,000	
天馬	6,700	1,982.00	13,279,400	
兼松サステック	700	1,756.00	1,229,200	
キングジム	8,300	859.00	7,129,700	
象印マホービン	29,700	1,479.00	43,926,300	
リンテック	24,100	2,173.00	52,369,300	
信越ポリマー	18,100	780.00	14,118,000	
東リ	25,200	252.00	6,350,400	
イトーキ	20,100	456.00	9,165,600	
任天堂	58,000	39,870.00	2,312,460,000	
三菱鉛筆	16,600	1,734.00	28,784,400	
松風	5,000	1,436.00	7,180,000	
タカラスタンダード	20,800	1,813.00	37,710,400	
コクヨ	48,500	1,522.00	73,817,000	
ナカバヤシ	9,900	519.00	5,138,100	
ニフコ	40,600	2,589.00	105,113,400	
立川ブラインド工業	4,400	1,347.00	5,926,800	
グローブライド	4,900	2,607.00	12,774,300	
オカムラ	35,300	1,052.00	37,135,600	
バルカー	8,300	2,175.00	18,052,500	
M U T O Hホールディングス	1,400	1,692.00	2,368,800	
伊藤忠商事	698,300	2,236.50	1,561,747,950	
丸紅	984,300	734.50	722,968,350	
スクロール	15,600	328.00	5,116,800	
高島	1,600	1,661.00	2,657,600	
ヨンドシーホールディングス	11,000	2,580.00	28,380,000	
三陽商会	5,200	1,416.00	7,363,200	
長瀬産業	55,900	1,539.00	86,030,100	
ナイガイ	4,000	483.00	1,932,000	
蝶理	6,300	1,628.00	10,256,400	
豊田通商	111,400	3,490.00	388,786,000	
オンワードホールディングス	59,400	600.00	35,640,000	
三共生興	16,900	519.00	8,771,100	
兼松	39,800	1,232.00	49,033,600	

美津濃	10,000	2,811.00	28,110,000
ツカモトコーポレーション	1,800	1,061.00	1,909,800
ファミリーマート	111,700	2,754.00	307,621,800
ルックホールディングス	3,400	1,095.00	3,723,000
三井物産	822,500	1,761.00	1,448,422,500
日本紙パルプ商事	5,600	3,800.00	21,280,000
東京エレクトロン	67,600	21,505.00	1,453,738,000
日立ハイテクノロジーズ	30,300	6,380.00	193,314,000
カメイ	12,900	1,114.00	14,370,600
東都水産	1,400	2,527.00	3,537,800
OUGホールディングス	1,600	2,722.00	4,355,200
スターゼン	3,700	4,505.00	16,668,500
セイコーホールディングス	15,600	2,403.00	37,486,800
山善	38,900	933.00	36,293,700
椿本興業	2,300	3,795.00	8,728,500
住友商事	590,300	1,681.50	992,589,450
日本ユニシス	31,100	3,555.00	110,560,500
内田洋行	4,300	4,045.00	17,393,500
三菱商事	700,600	2,681.00	1,878,308,600
第一実業	4,600	3,095.00	14,237,000
キヤノンマーケティングジャパン	28,500	2,255.00	64,267,500
西華産業	5,600	1,339.00	7,498,400
佐藤商事	8,900	816.00	7,262,400
菱洋エレクトロ	10,100	1,876.00	18,947,600
東京産業	10,100	494.00	4,989,400
ユアサ商事	10,200	3,145.00	32,079,000
神鋼商事	2,200	2,351.00	5,172,200
小林産業	6,700	320.00	2,144,000
阪和興業	17,300	2,972.00	51,415,600
正栄食品工業	6,500	3,275.00	21,287,500
カナデン	9,000	1,238.00	11,142,000
菱電商事	7,900	1,474.00	11,644,600
ニプロ	70,000	1,213.00	84,910,000
フルサト工業	5,500	1,565.00	8,607,500
岩谷産業	22,100	3,675.00	81,217,500
すてきナイスグループ	4,400	830.00	3,652,000
昭光通商	3,600	635.00	2,286,000
ニチモウ	1,600	1,848.00	2,956,800
極東貿易	3,100	1,800.00	5,580,000
イワキ	13,300	508.00	6,756,400
兼松エレクトロニクス	5,400	3,105.00	16,767,000
三愛石油	26,700	1,029.00	27,474,300
稲畑産業	23,900	1,316.00	31,452,400
G S Iクレオス	2,700	1,063.00	2,870,100
明和産業	9,400	503.00	4,728,200
キムラタン	52,700	35.00	1,844,500
ゴールドウイン	18,000	8,540.00	153,720,000
ユニ・チャーム	195,400	3,465.00	677,061,000
デサント	24,200	1,341.00	32,452,200
キング	5,400	549.00	2,964,600

ワキタ	21,200	1,038.00	22,005,600
ヤマトインターナショナル	6,000	393.00	2,358,000
東邦ホールディングス	29,500	2,490.00	73,455,000
サンゲツ	29,300	2,019.00	59,156,700
ミツウロコグループホールディングス	13,300	1,069.00	14,217,700
シナネンホールディングス	4,100	1,853.00	7,597,300
伊藤忠エネクス	21,700	818.00	17,750,600
サンリオ	30,800	2,093.00	64,464,400
サンワテクノス	6,200	899.00	5,573,800
リョーサン	11,000	2,704.00	29,744,000
新光商事	18,700	927.00	17,334,900
トーホー	4,500	1,682.00	7,569,000
三信電気	6,800	1,469.00	9,989,200
東陽テクニカ	11,400	1,021.00	11,639,400
モスフードサービス	13,100	2,660.00	34,846,000
加賀電子	10,000	1,990.00	19,900,000
三益半導体工業	9,000	1,891.00	17,019,000
ソーダニッカ	10,500	573.00	6,016,500
立花エレテック	7,300	1,712.00	12,497,600
木曽路	12,200	2,732.00	33,330,400
SRSホールディングス	11,700	1,021.00	11,945,700
千趣会	18,300	270.00	4,941,000
タカキュー	8,200	182.00	1,492,400
ケーヨー	18,300	509.00	9,314,700
上新電機	11,800	2,201.00	25,971,800
日本瓦斯	15,800	3,245.00	51,271,000
ロイヤルホールディングス	17,400	2,721.00	47,345,400
東天紅	800	1,215.00	972,000
いなげや	11,100	1,493.00	16,572,300
島忠	21,100	2,803.00	59,143,300
チヨダ	10,400	1,700.00	17,680,000
ライフコーポレーション	7,500	2,478.00	18,585,000
リンガーハット	12,300	2,544.00	31,291,200
MrMaxHD	13,800	465.00	6,417,000
テンアライド	9,600	432.00	4,147,200
AOKIホールディングス	19,800	1,103.00	21,839,400
オークワ	14,200	1,280.00	18,176,000
コメリ	15,400	2,236.00	34,434,400
青山商事	17,300	1,901.00	32,887,300
しまむら	11,600	9,220.00	106,952,000
はせがわ	5,300	401.00	2,125,300
高島屋	78,300	1,190.00	93,177,000
松屋	20,200	860.00	17,372,000
エイチ・ツー・オーリテイリング	51,100	1,216.00	62,137,600
近鉄百貨店	3,800	3,195.00	12,141,000
パルコ	9,500	1,285.00	12,207,500
丸井グループ	84,500	2,298.00	194,181,000
クレディセゾン	70,100	1,448.00	101,504,800
アクシアルリテイリング	8,300	4,185.00	34,735,500
井筒屋	5,700	258.00	1,470,600

イオン	384,100	2,172.50	834,457,250	
イズミ	20,300	4,160.00	84,448,000	
フォーバル	4,400	969.00	4,263,600	
平和堂	20,200	2,053.00	41,470,600	
フジ	12,000	1,864.00	22,368,000	
ヤオコー	11,300	4,940.00	55,822,000	
ゼビオホールディングス	12,000	1,202.00	14,424,000	
ケーズホールディングス	103,800	1,190.00	123,522,000	
PALTAC	18,000	5,330.00	95,940,000	
三谷産業	11,900	300.00	3,570,000	
Olympicグループ	5,900	600.00	3,540,000	
日産東京販売ホールディングス	14,800	298.00	4,410,400	
新生銀行	73,500	1,567.00	115,174,500	
あおぞら銀行	55,900	2,610.00	145,899,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	6,881,600	535.30	3,683,720,480	
りそなホールディングス	1,097,300	448.80	492,468,240	
三井住友トラスト・ホールディングス	196,500	3,741.00	735,106,500	
三井住友フィナンシャルグループ	704,500	3,651.00	2,572,129,500	
千葉銀行	343,800	546.00	187,714,800	
群馬銀行	199,800	352.00	70,329,600	
武蔵野銀行	14,800	1,824.00	26,995,200	
千葉興業銀行	27,800	298.00	8,284,400	
筑波銀行	42,400	190.00	8,056,000	
七十七銀行	31,400	1,601.00	50,271,400	
青森銀行	7,700	2,724.00	20,974,800	
秋田銀行	6,400	2,061.00	13,190,400	
山形銀行	11,200	1,407.00	15,758,400	
岩手銀行	7,000	2,467.00	17,269,000	
東邦銀行	89,000	247.00	21,983,000	
東北銀行	5,300	1,011.00	5,358,300	
みちのく銀行	6,400	1,615.00	10,336,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	88,100	1,979.00	174,349,900	
静岡銀行	247,500	794.00	196,515,000	
十六銀行	13,400	2,370.00	31,758,000	
スルガ銀行	102,500	439.00	44,997,500	
八十二銀行	241,100	451.00	108,736,100	
山梨中央銀行	12,100	1,020.00	12,342,000	
大垣共立銀行	21,000	2,454.00	51,534,000	
福井銀行	8,600	1,411.00	12,134,600	
北國銀行	10,300	2,884.00	29,705,200	
清水銀行	4,100	1,854.00	7,601,400	
富山銀行	2,000	2,461.00	4,922,000	
滋賀銀行	20,000	2,495.00	49,900,000	
南都銀行	15,600	2,528.00	39,436,800	
百五銀行	89,800	338.00	30,352,400	
京都銀行	35,800	3,995.00	143,021,000	
紀陽銀行	35,400	1,690.00	59,826,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	66,300	1,036.00	68,686,800	
広島銀行	147,300	533.00	78,510,900	
山陰合同銀行	59,200	655.00	38,776,000	

中国銀行	85,900	1,023.00	87,875,700
鳥取銀行	3,500	1,417.00	4,959,500
伊予銀行	132,100	558.00	73,711,800
百十四銀行	10,600	2,131.00	22,588,600
四国銀行	14,200	962.00	13,660,400
阿波銀行	15,300	2,467.00	37,745,100
大分銀行	6,100	2,791.00	17,025,100
宮崎銀行	6,600	2,509.00	16,559,400
佐賀銀行	6,100	1,498.00	9,137,800
沖縄銀行	9,100	3,490.00	31,759,000
琉球銀行	23,100	1,148.00	26,518,800
セブン銀行	334,100	300.00	100,230,000
みずほフィナンシャルグループ	13,582,600	162.10	2,201,739,460
高知銀行	3,800	793.00	3,013,400
山口フィナンシャルグループ	124,800	728.00	90,854,400
芙蓉総合リース	11,400	6,580.00	75,012,000
みずほリース	18,800	2,948.00	55,422,400
東京センチュリー	20,100	4,920.00	98,892,000
SBIホールディングス	119,100	2,285.00	272,143,500
日本証券金融	44,000	504.00	22,176,000
アイフル	153,500	239.00	36,686,500
日本アジア投資	9,600	276.00	2,649,600
長野銀行	3,300	1,629.00	5,375,700
名古屋銀行	8,000	3,140.00	25,120,000
北洋銀行	150,800	229.00	34,533,200
愛知銀行	3,600	3,490.00	12,564,000
中京銀行	4,000	2,117.00	8,468,000
大光銀行	3,500	1,600.00	5,600,000
愛媛銀行	13,900	1,081.00	15,025,900
トマト銀行	3,900	1,046.00	4,079,400
京葉銀行	42,500	648.00	27,540,000
栃木銀行	52,600	193.00	10,151,800
北日本銀行	3,200	1,751.00	5,603,200
東和銀行	17,600	827.00	14,555,200
福島銀行	9,800	216.00	2,116,800
大東銀行	4,900	577.00	2,827,300
リコーリース	7,800	3,455.00	26,949,000
イオンフィナンシャルサービス	63,800	1,571.00	100,229,800
アコム	201,100	426.00	85,668,600
ジャックス	11,000	2,260.00	24,860,000
オリエン特コーポレーション	270,800	146.00	39,536,800
日立キャピタル	23,500	2,369.00	55,671,500
アプラスフィナンシャル	49,300	75.00	3,697,500
オリックス	666,900	1,639.50	1,093,382,550
三菱UFJリース	225,200	643.00	144,803,600
ジャフコ	16,400	4,145.00	67,978,000
九州リースサービス	5,000	597.00	2,985,000
トモニホールディングス	77,300	351.00	27,132,300
大和証券グループ本社	801,400	494.20	396,051,880
野村ホールディングス	1,759,200	481.70	847,406,640

岡三証券グループ	84,600	380.00	32,148,000
丸三証券	29,800	490.00	14,602,000
東洋証券	37,400	175.00	6,545,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	114,800	300.00	34,440,000
光世証券	2,700	635.00	1,714,500
水戸証券	29,700	257.00	7,632,900
いちよし証券	20,000	668.00	13,360,000
松井証券	48,800	878.00	42,846,400
SOMPOホールディングス	176,200	4,155.00	732,111,000
だいがく証券ビジネス	4,100	546.00	2,238,600
日本取引所グループ	270,100	1,751.00	472,945,100
マネックスグループ	92,400	255.00	23,562,000
極東証券	13,400	875.00	11,725,000
岩井コスモホールディングス	10,100	1,105.00	11,160,500
藍澤証券	17,900	713.00	12,762,700
フィデアホールディングス	97,500	117.00	11,407,500
池田泉州ホールディングス	106,600	188.00	20,040,800
アニコムホールディングス	8,300	4,040.00	33,532,000
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	261,300	3,350.00	875,355,000
ソニーフィナンシャルホールディングス	82,100	2,226.00	182,754,600
マネーパートナーズグループ	11,900	250.00	2,975,000
スパークス・グループ	39,900	246.00	9,815,400
小林洋行	3,100	242.00	750,200
第一生命ホールディングス	565,600	1,665.00	941,724,000
東京海上ホールディングス	357,500	5,560.00	1,987,700,000
アドバンテッジリスクマネジメント	4,100	795.00	3,259,500
イー・ギャランティ	9,400	1,395.00	13,113,000
アサックス	4,200	600.00	2,520,000
NECキャピタルソリューション	4,000	2,160.00	8,640,000
T&Dホールディングス	309,200	1,165.00	360,218,000
アドバンスクリエイト	2,400	1,753.00	4,207,200
三井不動産	530,500	2,663.50	1,412,986,750
三菱地所	700,500	2,066.50	1,447,583,250
平和不動産	18,400	2,655.00	48,852,000
東京建物	109,400	1,508.00	164,975,200
ダイビル	29,500	1,184.00	34,928,000
京阪神ビルディング	17,600	1,287.00	22,651,200
住友不動産	224,800	3,930.00	883,464,000
太平洋興発	4,100	790.00	3,239,000
テーオーシー	23,000	822.00	18,906,000
東京楽天地	1,400	5,800.00	8,120,000
レオパレス21	123,500	278.00	34,333,000
スターツコーポレーション	13,600	2,699.00	36,706,400
フジ住宅	12,900	666.00	8,591,400
空港施設	11,600	531.00	6,159,600
明和地所	5,900	543.00	3,203,700
ゴールドクレスト	7,900	2,158.00	17,048,200

リログループ	53,000	2,595.00	137,535,000
エスリード	4,000	1,667.00	6,668,000
日神不動産	14,900	474.00	7,062,600
日本エスコン	18,200	897.00	16,325,400
タカラレーベン	46,000	415.00	19,090,000
サンヨーハウジング名古屋	5,800	884.00	5,127,200
イオンモール	50,200	1,748.00	87,749,600
ファースト住建	4,200	1,350.00	5,670,000
ランド	423,900	8.00	3,391,200
カチタス	11,200	4,050.00	45,360,000
東祥	6,100	2,193.00	13,377,300
トーセイ	13,800	1,360.00	18,768,000
穴吹興産	1,100	2,812.00	3,093,200
サンフロンティア不動産	14,000	1,282.00	17,948,000
エフ・ジェー・ネクスト	8,900	1,071.00	9,531,900
インテリックス	3,000	739.00	2,217,000
ランドビジネス	4,300	756.00	3,250,800
日本社宅サービス	2,700	1,020.00	2,754,000
グランディハウス	9,100	471.00	4,286,100
東武鉄道	106,800	3,565.00	380,742,000
相鉄ホールディングス	34,700	2,876.00	99,797,200
東急	275,300	2,053.00	565,190,900
京浜急行電鉄	138,900	2,123.00	294,884,700
小田急電鉄	162,400	2,607.00	423,376,800
京王電鉄	56,600	6,750.00	382,050,000
京成電鉄	76,000	4,395.00	334,020,000
富士急行	13,800	4,475.00	61,755,000
新京成電鉄	2,600	2,103.00	5,467,800
東日本旅客鉄道	178,400	10,460.00	1,866,064,000
西日本旅客鉄道	90,300	9,152.00	826,425,600
東海旅客鉄道	90,800	22,645.00	2,056,166,000
西武ホールディングス	125,500	1,919.00	240,834,500
鴻池運輸	16,100	1,633.00	26,291,300
西日本鉄道	28,000	2,392.00	66,976,000
ハマキョウレックス	7,800	3,465.00	27,027,000
サカイ引越センター	5,300	6,370.00	33,761,000
近鉄グループホールディングス	96,000	5,730.00	550,080,000
阪急阪神ホールディングス	128,000	4,260.00	545,280,000
南海電気鉄道	42,800	2,782.00	119,069,600
京阪ホールディングス	42,800	4,880.00	208,864,000
神戸電鉄	2,500	3,930.00	9,825,000
名古屋鉄道	78,900	3,320.00	261,948,000
山陽電気鉄道	7,400	2,152.00	15,924,800
トランコム	2,700	6,110.00	16,497,000
日本通運	37,000	5,640.00	208,680,000
ヤマトホールディングス	168,300	1,700.50	286,194,150
山九	26,700	5,850.00	156,195,000
日新	8,300	1,552.00	12,881,600
丸運	5,900	262.00	1,545,800
丸全昭和運輸	7,800	2,942.00	22,947,600

センコーグループホールディングス	52,800	845.00	44,616,000
トナミホールディングス	2,300	4,530.00	10,419,000
ニッコンホールディングス	36,400	2,504.00	91,145,600
日本石油輸送	1,200	2,820.00	3,384,000
福山通運	12,300	3,800.00	46,740,000
セイノーホールディングス	71,800	1,368.00	98,222,400
エスライン	3,000	902.00	2,706,000
神奈川中央交通	2,400	3,820.00	9,168,000
日立物流	21,100	3,260.00	68,786,000
丸和運輸機関	10,100	2,763.00	27,906,300
C & F ロジホールディングス	9,700	1,243.00	12,057,100
日本郵船	80,200	1,865.00	149,573,000
商船三井	56,900	2,890.00	164,441,000
川崎汽船	29,600	1,438.00	42,564,800
NSユナイテッド海運	5,300	2,346.00	12,433,800
明治海運	10,200	315.00	3,213,000
飯野海運	45,200	346.00	15,639,200
共栄タンカー	800	1,386.00	1,108,800
九州旅客鉄道	80,600	3,470.00	279,682,000
SGホールディングス	90,700	2,663.00	241,534,100
日本航空	175,700	3,329.00	584,905,300
ANAホールディングス	175,500	3,683.00	646,366,500
パスコ	2,000	983.00	1,966,000
西本Wismettacホールディングス	1,800	3,585.00	6,453,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	900	1,334.00	1,200,600
Genky DrugStores	4,500	2,346.00	10,557,000
国際紙パルプ商事	19,700	307.00	6,047,900
総合メディカルホールディングス	8,700	1,685.00	14,659,500
ブックオフグループホールディングス	5,300	1,118.00	5,925,400
三菱倉庫	33,200	2,712.00	90,038,400
三井倉庫ホールディングス	11,800	1,677.00	19,788,600
住友倉庫	35,200	1,455.00	51,216,000
澁澤倉庫	5,300	1,958.00	10,377,400
ヤマタネ	5,000	1,375.00	6,875,000
東陽倉庫	17,700	323.00	5,717,100
乾汽船	8,700	1,150.00	10,005,000
日本トランスシティ	21,200	506.00	10,727,200
ケイヒン	1,800	1,254.00	2,257,200
中央倉庫	5,900	1,115.00	6,578,500
川西倉庫	2,000	1,109.00	2,218,000
安田倉庫	7,900	947.00	7,481,300
東洋埠頭	3,000	1,349.00	4,047,000
宇徳	8,300	514.00	4,266,200
上組	59,100	2,463.00	145,563,300
サンリツ	2,300	659.00	1,515,700
キムラユニティー	2,600	1,011.00	2,628,600
キューソー流通システム	2,400	1,806.00	4,334,400
近鉄エクスプレス	18,100	1,572.00	28,453,200
東海運	6,000	286.00	1,716,000

エーアイティー	6,400	984.00	6,297,600
内外トランスライン	3,500	1,321.00	4,623,500
日本コンセプト	3,100	1,394.00	4,321,400
東京放送ホールディングス	66,000	1,741.00	114,906,000
日本テレビホールディングス	91,200	1,396.00	127,315,200
朝日放送グループホールディングス	9,600	717.00	6,883,200
テレビ朝日ホールディングス	27,200	1,685.00	45,832,000
スカパーJ S A Tホールディングス	65,000	442.00	28,730,000
テレビ東京ホールディングス	8,200	2,210.00	18,122,000
日本BS放送	3,500	1,076.00	3,766,000
ビジョン	9,400	1,616.00	15,190,400
スマートバリュー	3,200	749.00	2,396,800
USEN-NEXT HOLDINGS	3,800	898.00	3,412,400
ワイヤレスゲート	5,000	701.00	3,505,000
コネクシオ	7,000	1,368.00	9,576,000
日本通信	87,400	187.00	16,343,800
クロップス	2,000	619.00	1,238,000
日本電信電話	680,300	5,411.00	3,681,103,300
KDDI	815,400	2,965.50	2,418,068,700
ソフトバンク	1,054,600	1,518.50	1,601,410,100
光通信	11,700	23,220.00	271,674,000
NTTドコモ	629,700	2,870.00	1,807,239,000
エムティーアイ	9,800	695.00	6,811,000
GMOインターネット	39,300	1,756.00	69,010,800
ファイバーゲート	1,900	1,420.00	2,698,000
アイドママーケティングコミュニケーション	2,600	586.00	1,523,600
KADOKAWA	29,100	1,495.00	43,504,500
学研ホールディングス	3,300	5,470.00	18,051,000
ゼンリン	19,900	1,820.00	36,218,000
昭文社	5,200	393.00	2,043,600
インプレスホールディングス	9,500	143.00	1,358,500
東京電力ホールディングス	809,200	534.00	432,112,800
中部電力	310,100	1,621.00	502,672,100
関西電力	413,600	1,233.50	510,175,600
中国電力	140,100	1,433.00	200,763,300
北陸電力	99,400	731.00	72,661,400
東北電力	237,300	1,090.00	258,657,000
四国電力	91,300	1,043.00	95,225,900
九州電力	208,900	1,066.00	222,687,400
北海道電力	94,900	572.00	54,282,800
沖縄電力	18,800	1,769.00	33,257,200
電源開発	80,600	2,565.00	206,739,000
エフオン	5,100	718.00	3,661,800
イーレックス	17,700	1,303.00	23,063,100
レノバ	16,800	922.00	15,489,600
東京瓦斯	194,900	2,750.50	536,072,450
大阪瓦斯	196,600	2,076.00	408,141,600
東邦瓦斯	50,200	4,215.00	211,593,000

北海道瓦斯	5,400	1,569.00	8,472,600
広島ガス	20,500	341.00	6,990,500
西部瓦斯	11,400	2,367.00	26,983,800
静岡ガス	28,800	924.00	26,611,200
メタウォーター	4,900	3,650.00	17,885,000
アイネット	5,700	1,383.00	7,883,100
松竹	6,600	14,150.00	93,390,000
東宝	65,400	4,605.00	301,167,000
エイチ・アイ・エス	15,100	2,719.00	41,056,900
東映	4,200	15,050.00	63,210,000
ラックランド	2,000	2,323.00	4,646,000
エヌ・ティ・ティ・データ	264,900	1,417.00	375,363,300
共立メンテナンス	14,800	4,510.00	66,748,000
イチネンホールディングス	10,300	1,258.00	12,957,400
建設技術研究所	6,800	1,650.00	11,220,000
スペース	6,200	1,238.00	7,675,600
長 大	3,700	976.00	3,611,200
アインホールディングス	13,400	6,090.00	81,606,000
燦ホールディングス	4,300	1,073.00	4,613,900
ピー・シー・エー	1,300	3,865.00	5,024,500
スバル興業	700	7,050.00	4,935,000
東京テアトル	3,900	1,371.00	5,346,900
タナベ経営	2,000	1,239.00	2,478,000
ビジネスブレイン太田昭和	1,700	2,644.00	4,494,800
ナガワ	2,700	5,990.00	16,173,000
よみうりランド	2,100	4,510.00	9,471,000
東京都競馬	6,300	3,385.00	21,325,500
常磐興産	3,900	1,664.00	6,489,600
カナモト	15,900	2,745.00	43,645,500
東京ドーム	36,300	998.00	36,227,400
D T S	22,300	2,265.00	50,509,500
スクウェア・エニックス・ホールディングス	46,300	5,130.00	237,519,000
シーイーシー	10,700	2,048.00	21,913,600
カブコン	42,700	2,795.00	119,346,500
西尾レントオール	9,800	2,829.00	27,724,200
アイ・エス・ピー	2,000	1,581.00	3,162,000
アゴーラ・ホスピタリティー・グループ	61,300	33.00	2,022,900
日本空港ビルデング	31,900	4,955.00	158,064,500
トランス・コスモス	10,800	2,638.00	28,490,400
乃村工藝社	45,400	1,288.00	58,475,200
ジャステック	6,200	1,091.00	6,764,200
S C S K	26,200	5,150.00	134,930,000
藤田観光	4,200	2,809.00	11,797,800
K N T - C Tホールディングス	5,200	1,564.00	8,132,800
日本管財	10,400	1,894.00	19,697,600
トーカイ	9,400	2,287.00	21,497,800
白洋舎	1,100	2,872.00	3,159,200
セコム	102,800	9,735.00	1,000,758,000

日本システムウエア	3,300	2,386.00	7,873,800
セントラル警備保障	4,700	5,750.00	27,025,000
アイネス	12,700	1,162.00	14,757,400
丹青社	18,300	1,144.00	20,935,200
メイテック	12,000	5,360.00	64,320,000
T K C	8,400	4,520.00	37,968,000
富士ソフト	12,800	4,530.00	57,984,000
応用地質	10,400	1,116.00	11,606,400
船井総研ホールディングス	20,100	2,503.00	50,310,300
N S D	16,400	3,210.00	52,644,000
進学会ホールディングス	4,800	505.00	2,424,000
丸紅建材リース	1,100	1,697.00	1,866,700
オオバ	7,900	699.00	5,522,100
コナミホールディングス	40,600	5,020.00	203,812,000
いであ	2,000	1,312.00	2,624,000
学究社	3,300	1,246.00	4,111,800
ベネッセホールディングス	35,500	2,807.00	99,648,500
イオンディライト	12,000	3,530.00	42,360,000
ナック	6,200	964.00	5,976,800
福井コンピュータホールディングス	3,300	2,512.00	8,289,600
ニチイ学館	13,800	1,771.00	24,439,800
ダイセキ	16,300	2,779.00	45,297,700
ステップ	3,600	1,391.00	5,007,600
日鉄物産	7,100	4,365.00	30,991,500
泉州電業	3,100	2,791.00	8,652,100
元気寿司	2,800	2,719.00	7,613,200
トラスコ中山	20,800	2,542.00	52,873,600
ヤマダ電機	303,900	506.00	153,773,400
オートバックスセブン	39,600	1,770.00	70,092,000
モリト	7,200	782.00	5,630,400
アークランドサカモト	16,900	1,235.00	20,871,500
ニトリホールディングス	43,200	16,015.00	691,848,000
グルメ杵屋	7,100	1,163.00	8,257,300
愛眼	8,200	243.00	1,992,600
ケーユーホールディングス	5,200	841.00	4,373,200
吉野家ホールディングス	34,900	2,791.00	97,405,900
加藤産業	15,600	3,395.00	52,962,000
北恵	2,000	1,012.00	2,024,000
イノテック	6,000	892.00	5,352,000
イエローハット	18,900	1,595.00	30,145,500
松屋フーズホールディングス	4,800	4,015.00	19,272,000
J B C Cホールディングス	7,900	1,522.00	12,023,800
J Kホールディングス	9,100	526.00	4,786,600
サガミホールディングス	13,300	1,343.00	17,861,900
日伝	8,300	2,019.00	16,757,700
関西スーパーマーケット	7,500	1,083.00	8,122,500
ミロク情報サービス	9,900	2,910.00	28,809,000
北沢産業	7,700	271.00	2,086,700
杉本商事	5,400	1,972.00	10,648,800
因幡電機産業	14,200	4,800.00	68,160,000

王将フードサービス	7,300	6,790.00	49,567,000
プレナス	11,000	1,835.00	20,185,000
ミニストップ	7,300	1,447.00	10,563,100
アークス	18,600	2,255.00	41,943,000
パローホールディングス	21,500	1,840.00	39,560,000
東テク	3,300	2,072.00	6,837,600
ミスミグループ本社	125,100	2,418.00	302,491,800
藤久	900	751.00	675,900
アルテック	8,500	229.00	1,946,500
ベルク	4,900	5,070.00	24,843,000
大 庄	5,300	1,613.00	8,548,900
タキヒヨー	3,000	1,822.00	5,466,000
ファーストリテイリング	13,400	63,270.00	847,818,000
ソフトバンクグループ	789,200	4,156.00	3,279,915,200
蔵王産業	1,600	1,388.00	2,220,800
スズケン	45,500	5,810.00	264,355,000
サンドラッグ	37,600	3,415.00	128,404,000
サックスパー ホールディングス	8,500	891.00	7,573,500
ジェコス	6,800	877.00	5,963,600
ヤマザワ	2,000	1,692.00	3,384,000
やまや	1,700	2,160.00	3,672,000
グローセル	9,300	416.00	3,868,800
ベルーナ	24,600	683.00	16,801,800
合計	119,931,500		231,448,218,280

(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。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

令和1年10月11日現在

資産の部	
流動資産	
預金	1,374,158,627
コール・ローン	558,884,018
国債証券	147,580,659,464
派生商品評価勘定	21,900
未収入金	359,842,937
未収利息	1,140,456,994
前払費用	17,104,744
流動資産合計	151,031,128,684
資産合計	
151,031,128,684	
負債の部	
流動負債	
未払金	1,918,140,825
未払解約金	364,500,000
流動負債合計	2,282,640,825

負債合計	2,282,640,825
純資産の部	
元本等	
元本	79,110,937,109
剰余金	
剰余金又は欠損金()	69,637,550,750
元本等合計	148,748,487,859
純資産合計	148,748,487,859
負債純資産合計	151,031,128,684

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 平成31年4月12日 至 令和1年10月11日
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、計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	令和1年10月11日現在
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	106,154,635,396円
同期中追加設定元本額	6,577,374,313円
同期中一部解約元本額	33,621,072,600円
元本の内訳	
ファンド名	
D I A M外国債券パッシブ・ファンド	8,734,932,395円
M I T O ラップ型ファンド(安定型)	7,244,109円
M I T O ラップ型ファンド(中立型)	25,014,704円
M I T O ラップ型ファンド(積極型)	31,476,734円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	75,641,575円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	82,021,705円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	39,702,394円
たわらノーロード 先進国債券	5,250,845,083円
たわらノーロード 先進国債券<ラップ向け>	117,221,750円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	320,673,763円
たわらノーロード バランス(堅実型)	7,092,995円
たわらノーロード バランス(標準型)	36,364,549円
たわらノーロード バランス(積極型)	7,853,588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)	879,012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)	67,259,866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)	83,125,209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)	17,771,604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)	9,422,765円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	1,409,452円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	2,100,693円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	734,480円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	865,610円
D I A M外国債券インデックスファンド<DC年金>	5,671,602,824円
O n e DC 先進国債券インデックスファンド	536,470円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金>1安定型	559,025,083円

DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	1,741,445,044円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	1,800,873,809円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	367,533,477円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	794,341,497円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	609,925,592円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	22,216,790円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	613,149,635円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	10,065,174円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	125,271,635円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	79,598,230円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	130,726,036円
クルーズコントロール	373,689,045円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	101,282,985円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	163,427,600円
クルーズコントロール<DC年金>	837,543円
DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)	1,260,301円
DIAMコア資産設計ファンド(積極型)	4,172,695円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	27,017,128円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	103,834,337円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	82,102円
DIAMパッシブ資産分散ファンド	1,229,039,982円
DIAM為替フルヘッジ型外国債券パッシブ私募ファンド(適格機関投資家向け)	6,740,373,716円
DIAM外国債券パッシブファンド(適格機関投資家向け)	3,723,678,221円
外国債券パッシブファンド(適格機関投資家限定)	2,325,638,135円
先進国債券パッシブファンド(適格機関投資家限定)	6,077,260,061円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	87,767,057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)	640,376,556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)	473,203,213円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	42,382,346円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	74,024,494円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	21,591,855円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	6,102,284円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	61,424,328円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	81,553,063円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	2,900,227,520円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	1,975,246,157円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	3,434,568,056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)	611,660,521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)	237,456,705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)	2,682,031,152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)	810,461,349円
DIAM世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	6,642,541円
DIAM世界バランスファンド35VA(適格機関投資家限定)	95,918,546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)	530,729,234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)	740,861,312円
DIAMバランス30VA(適格機関投資家限定)	5,112,796円
DIAMバランス50VA(適格機関投資家限定)	403,654円
DIAMバランス70VA(適格機関投資家限定)	260,969円

D I A M世界アセットバランスファンド4 V A (適格機関投資家限定)	15,085,235,979円
D I A M世界バランス2 5 V A (適格機関投資家限定)	83,602,603円
D I A Mバランス2 0 V A (適格機関投資家限定)	104,003,990円
D I A Mバランス4 0 V A (適格機関投資家限定)	365,068円
D I A Mバランス6 0 V A (適格機関投資家限定)	164,579円
計	79,110,937,109円
2. 受益権の総数	79,110,937,109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31年4月12日 至 令和1年10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。
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、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 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。
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。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	令和1年10月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
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。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	令和1年10月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
国債証券	8,670,886,119
合計	8,670,886,119

(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31年2月22日から令和1年10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	令和1年10月11日現在			
	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	2,113,830,000	-	2,113,851,900	21,900
アメリカ・ドル	1,239,950,000	-	1,239,950,000	-
イギリス・ポンド	5,090,000	-	5,090,000	-
ユーロ	868,790,000	-	868,811,900	21,900
合計	2,113,830,000	-	2,113,851,900	21,900

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

計算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)

令和1年10月11日現在	
1口当たり純資産額	1.8803円
(1万口当たり純資産額)	(18,803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10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	3,653,262.480	
		US T N/B 1.25 08/31/24	2,440,000.000	2,414,265.610	
		US T N/B 1.375 01/31/21	2,750,000.000	2,741,191.390	
		US T N/B 1.375 04/30/21	11,210,000.000	11,168,838.220	
		US T N/B 1.375 06/30/23	3,460,000.000	3,444,862.500	
		US T N/B 1.375 08/31/26	1,100,000.000	1,086,078.120	

US T N/B 1.375 09/30/23	5,100,000.000	5,080,875.000	
US T N/B 1.5 08/15/26	5,360,000.000	5,338,225.000	
US T N/B 1.5 09/15/22	750,000.000	750,380.850	
US T N/B 1.5 09/30/21	5,120,000.000	5,116,999.980	
US T N/B 1.625 02/15/26	5,500,000.000	5,524,492.160	
US T N/B 1.625 05/15/26	4,290,000.000	4,309,103.880	
US T N/B 1.625 05/31/23	5,300,000.000	5,326,500.000	
US T N/B 1.625 08/15/22	5,800,000.000	5,821,523.390	
US T N/B 1.625 08/15/29	2,090,000.000	2,083,468.750	
US T N/B 1.625 11/15/22	6,090,000.000	6,115,454.250	
US T N/B 1.625 11/30/20	8,510,000.000	8,508,005.420	
US T N/B 1.75 01/31/23	5,710,000.000	5,757,285.930	
US T N/B 1.75 03/31/22	6,990,000.000	7,028,772.620	
US T N/B 1.75 05/15/22	5,400,000.000	5,434,382.760	
US T N/B 1.75 05/15/23	7,000,000.000	7,060,703.090	
US T N/B 1.75 06/15/22	830,000.000	835,803.500	
US T N/B 1.75 07/31/24	5,280,000.000	5,343,937.470	
US T N/B 1.75 09/30/22	6,510,000.000	6,558,316.370	
US T N/B 1.75 12/31/20	9,000,000.000	9,011,953.080	
US T N/B 1.875 02/28/22	1,680,000.000	1,693,125.000	
US T N/B 1.875 07/31/26	2,370,000.000	2,417,214.830	
US T N/B 1.875 08/31/22	6,270,000.000	6,336,618.750	
US T N/B 1.875 08/31/24	3,120,000.000	3,176,306.230	
US T N/B 2.0 02/15/22	8,470,000.000	8,562,309.700	
US T N/B 2.0 02/15/23	4,370,000.000	4,442,378.120	
US T N/B 2.0 02/15/25	5,300,000.000	5,435,812.500	
US T N/B 2.0 05/31/21	12,000,000.000	12,074,531.160	
US T N/B 2.0 05/31/24	4,770,000.000	4,880,306.250	
US T N/B 2.0 08/15/25	5,180,000.000	5,314,760.910	
US T N/B 2.0 11/15/21	10,400,000.000	10,497,906.220	
US T N/B 2.0 11/15/26	4,140,000.000	4,261,935.910	
US T N/B 2.0 11/30/22	6,590,000.000	6,690,394.490	
US T N/B 2.125 01/31/21	5,000,000.000	5,029,687.500	
US T N/B 2.125 02/29/24	1,300,000.000	1,334,429.680	
US T N/B 2.125 03/31/24	4,080,000.000	4,189,650.000	
US T N/B 2.125 05/15/25	6,250,000.000	6,450,683.560	
US T N/B 2.125 05/31/26	2,050,000.000	2,122,070.310	
US T N/B 2.125 06/30/22	7,410,000.000	7,533,885.930	
US T N/B 2.125 08/15/21	11,000,000.000	11,108,281.250	
US T N/B 2.125 09/30/21	10,000,000.000	10,110,156.200	
US T N/B 2.125 09/30/24	4,420,000.000	4,551,564.040	
US T N/B 2.125 12/31/21	10,330,000.000	10,468,809.370	
US T N/B 2.125 12/31/22	8,000,000.000	8,159,374.960	
US T N/B 2.25 01/31/24	350,000.000	360,910.150	
US T N/B 2.25 02/15/27	4,670,000.000	4,889,271.070	
US T N/B 2.25 03/31/21	9,760,000.000	9,845,781.220	
US T N/B 2.25 03/31/26	3,090,000.000	3,220,600.760	
US T N/B 2.25 04/30/21	8,170,000.000	8,248,827.670	
US T N/B 2.25 04/30/24	3,300,000.000	3,409,054.670	

US T N/B 2.25 08/15/27	5,000,000.000	5,242,578.100	
US T N/B 2.25 08/15/46	2,720,000.000	2,774,612.480	
US T N/B 2.25 08/15/49	2,100,000.000	2,144,789.050	
US T N/B 2.25 11/15/24	6,650,000.000	6,892,621.050	
US T N/B 2.25 11/15/25	6,230,000.000	6,484,553.870	
US T N/B 2.25 11/15/27	5,050,000.000	5,297,765.620	
US T N/B 2.25 12/31/23	4,830,000.000	4,979,805.440	
US T N/B 2.375 04/30/26	1,760,000.000	1,848,825.000	
US T N/B 2.375 05/15/27	5,110,000.000	5,401,429.680	
US T N/B 2.375 05/15/29	5,430,000.000	5,776,586.670	
US T N/B 2.375 08/15/24	7,160,000.000	7,450,875.000	
US T N/B 2.375 12/31/20	8,300,000.000	8,372,949.190	
US T N/B 2.5 01/15/22	3,850,000.000	3,931,662.080	
US T N/B 2.5 01/31/21	9,810,000.000	9,915,380.780	
US T N/B 2.5 01/31/24	3,890,000.000	4,051,070.310	
US T N/B 2.5 02/15/22	1,070,000.000	1,093,615.230	
US T N/B 2.5 02/15/45	2,840,000.000	3,042,571.860	
US T N/B 2.5 02/15/46	2,970,000.000	3,182,308.560	
US T N/B 2.5 02/28/26	2,550,000.000	2,694,632.810	
US T N/B 2.5 03/31/23	1,020,000.000	1,054,743.750	
US T N/B 2.5 05/15/24	7,450,000.000	7,781,757.810	
US T N/B 2.5 05/15/46	2,790,000.000	2,990,967.180	
US T N/B 2.5 08/15/23	6,240,000.000	6,472,537.460	
US T N/B 2.625 01/31/26	2,180,000.000	2,319,315.620	
US T N/B 2.625 02/15/29	5,580,000.000	6,051,684.360	
US T N/B 2.625 03/31/25	2,150,000.000	2,275,136.700	
US T N/B 2.625 06/30/23	1,820,000.000	1,893,795.300	
US T N/B 2.625 12/15/21	3,770,000.000	3,859,979.260	
US T N/B 2.625 12/31/23	3,060,000.000	3,200,090.620	
US T N/B 2.625 12/31/25	2,290,000.000	2,435,092.950	
US T N/B 2.75 02/15/24	6,430,000.000	6,767,072.620	
US T N/B 2.75 02/15/28	5,340,000.000	5,813,507.770	
US T N/B 2.75 02/28/25	3,510,000.000	3,734,310.930	
US T N/B 2.75 04/30/23	2,490,000.000	2,598,742.950	
US T N/B 2.75 05/31/23	3,270,000.000	3,413,828.880	
US T N/B 2.75 06/30/25	790,000.000	842,460.930	
US T N/B 2.75 07/31/23	3,270,000.000	3,419,960.130	
US T N/B 2.75 08/15/42	1,800,000.000	2,015,226.550	
US T N/B 2.75 08/15/47	3,040,000.000	3,420,475.000	
US T N/B 2.75 08/31/23	2,170,000.000	2,271,549.200	
US T N/B 2.75 08/31/25	1,640,000.000	1,751,212.500	
US T N/B 2.75 11/15/23	6,910,000.000	7,253,880.430	
US T N/B 2.75 11/15/42	2,110,000.000	2,360,644.900	
US T N/B 2.75 11/15/47	2,640,000.000	2,972,681.220	
US T N/B 2.875 05/15/28	4,990,000.000	5,489,779.680	
US T N/B 2.875 05/15/43	2,250,000.000	2,572,207.010	
US T N/B 2.875 05/15/49	3,790,000.000	4,389,885.920	
US T N/B 2.875 05/31/25	2,530,000.000	2,713,622.640	
US T N/B 2.875 07/31/25	3,390,000.000	3,642,131.250	

US T N/B 2.875 08/15/28	5,730,000.000	6,313,743.750	
US T N/B 2.875 08/15/45	3,470,000.000	3,982,367.180	
US T N/B 2.875 09/30/23	840,000.000	884,034.370	
US T N/B 2.875 10/31/23	6,010,000.000	6,332,567.930	
US T N/B 2.875 11/15/21	4,880,000.000	5,012,103.110	
US T N/B 2.875 11/15/46	3,260,000.000	3,752,565.620	
US T N/B 2.875 11/30/23	5,640,000.000	5,948,878.090	
US T N/B 2.875 11/30/25	3,480,000.000	3,748,884.350	
US T N/B 3.0 02/15/47	2,540,000.000	2,995,612.500	
US T N/B 3.0 02/15/48	3,520,000.000	4,155,249.980	
US T N/B 3.0 02/15/49	4,110,000.000	4,869,386.680	
US T N/B 3.0 05/15/42	980,000.000	1,141,929.680	
US T N/B 3.0 05/15/45	3,460,000.000	4,056,309.370	
US T N/B 3.0 05/15/47	2,350,000.000	2,769,695.310	
US T N/B 3.0 08/15/48	3,620,000.000	4,280,932.770	
US T N/B 3.0 09/30/25	1,410,000.000	1,526,765.620	
US T N/B 3.0 10/31/25	1,920,000.000	2,080,800.000	
US T N/B 3.0 11/15/44	3,470,000.000	4,060,442.180	
US T N/B 3.0 11/15/45	2,950,000.000	3,464,867.180	
US T N/B 3.125 02/15/42	1,380,000.000	1,641,121.870	
US T N/B 3.125 02/15/43	1,440,000.000	1,712,475.000	
US T N/B 3.125 05/15/21	8,000,000.000	8,190,312.480	
US T N/B 3.125 05/15/48	3,370,000.000	4,071,907.800	
US T N/B 3.125 08/15/44	3,180,000.000	3,797,615.620	
US T N/B 3.125 11/15/28	5,830,000.000	6,556,928.110	
US T N/B 3.125 11/15/41	760,000.000	903,509.370	
US T N/B 3.375 05/15/44	3,340,000.000	4,146,818.750	
US T N/B 3.375 11/15/48	3,720,000.000	4,711,031.240	
US T N/B 3.5 02/15/39	900,000.000	1,125,562.500	
US T N/B 3.625 02/15/21	5,500,000.000	5,642,656.250	
US T N/B 3.625 02/15/44	2,790,000.000	3,594,304.680	
US T N/B 3.625 08/15/43	2,720,000.000	3,497,749.990	
US T N/B 3.75 08/15/41	410,000.000	533,192.180	
US T N/B 3.75 11/15/43	3,150,000.000	4,130,683.570	
US T N/B 3.875 08/15/40	1,430,000.000	1,886,147.630	
US T N/B 4.25 05/15/39	810,000.000	1,113,939.830	
US T N/B 4.25 11/15/40	1,470,000.000	2,035,490.620	
US T N/B 4.375 02/15/38	550,000.000	762,136.710	
US T N/B 4.375 05/15/40	1,430,000.000	2,007,027.330	
US T N/B 4.375 05/15/41	1,040,000.000	1,467,293.740	
US T N/B 4.375 11/15/39	1,080,000.000	1,512,590.610	
US T N/B 4.5 02/15/36	1,230,000.000	1,695,382.000	
US T N/B 4.5 05/15/38	700,000.000	985,195.300	
US T N/B 4.5 08/15/39	1,030,000.000	1,463,324.200	
US T N/B 4.625 02/15/40	1,820,000.000	2,630,468.740	
US T N/B 4.75 02/15/41	1,440,000.000	2,124,450.000	
US T N/B 5.0 05/15/37	500,000.000	736,992.180	
US T N/B 5.25 02/15/29	490,000.000	642,933.590	
US T N/B 5.25 11/15/28	850,000.000	1,108,785.150	

	US T N/B 5.375 02/15/31	1,000,000.000	1,380,234.370	
	US T N/B 5.5 08/15/28	650,000.000	856,781.250	
	US T N/B 6.0 02/15/26	840,000.000	1,065,225.000	
	US T N/B 6.125 11/15/27	1,400,000.000	1,880,593.750	
	US T N/B 6.25 05/15/30	710,000.000	1,025,034.760	
	US T N/B 6.25 08/15/23	1,000,000.000	1,177,578.120	
	US T N/B 8.0 11/15/21	6,000,000.000	6,792,890.560	
アメリカ・ドル	小計	624,740,000.000 (67,553,136,200)	662,671,735.050 (71,654,694,706)	
イギリス・ポンド	UK TREASURY 0.5 07/22/22	2,350,000.000	2,359,611.500	
	UK TREASURY 0.75 07/22/23	1,560,000.000	1,583,825.880	
	UK TREASURY 0.875 10/22/29	150,000.000	154,755.000	
	UK TREASURY 1.0 04/22/24	820,000.000	844,386.800	
	UK TREASURY 1.25 07/22/27	1,090,000.000	1,162,190.700	
	UK TREASURY 1.5 07/22/26	1,040,000.000	1,121,910.400	
	UK TREASURY 1.5 07/22/47	1,720,000.000	1,906,964.000	
	UK TREASURY 1.625 10/22/28	2,150,000.000	2,369,730.000	
	UK TREASURY 1.625 10/22/54	510,000.000	602,753.700	
	UK TREASURY 1.625 10/22/71	750,000.000	969,750.000	
	UK TREASURY 1.75 01/22/49	790,000.000	929,909.000	
	UK TREASURY 1.75 07/22/57	1,300,000.000	1,623,570.000	
	UK TREASURY 1.75 09/07/22	2,080,000.000	2,163,824.000	
	UK TREASURY 1.75 09/07/37	1,540,000.000	1,745,128.000	
	UK TREASURY 2.0 09/07/25	950,000.000	1,044,857.500	
	UK TREASURY 2.25 09/07/23	1,810,000.000	1,944,294.760	
	UK TREASURY 2.5 07/22/65	1,280,000.000	2,018,048.000	
	UK TREASURY 2.75 09/07/24	1,380,000.000	1,542,343.200	
	UK TREASURY 3.25 01/22/44	1,540,000.000	2,268,882.000	
	UK TREASURY 3.5 01/22/45	1,680,000.000	2,596,272.000	
	UK TREASURY 3.5 07/22/68	1,090,000.000	2,174,877.000	
	UK TREASURY 3.75 07/22/52	1,340,000.000	2,365,234.000	
	UK TREASURY 3.75 09/07/21	720,000.000	765,408.960	
UK TREASURY 4.0 01/22/60	1,200,000.000	2,423,040.000		
UK TREASURY 4.0 03/07/22	1,040,000.000	1,130,885.600		

	UK TREASURY 4.25 03/07/36	1,480,000.000	2,248,564.000	
	UK TREASURY 4.25 06/07/32	1,340,000.000	1,921,426.000	
	UK TREASURY 4.25 09/07/39	920,000.000	1,469,884.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/27	1,160,000.000	1,521,537.200	
	UK TREASURY 4.25 12/07/40	1,340,000.000	2,175,490.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/46	1,330,000.000	2,338,140.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/49	1,140,000.000	2,087,682.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/55	1,170,000.000	2,333,682.000	
	UK TREASURY 4.5 09/07/34	1,070,000.000	1,629,610.000	
	UK TREASURY 4.5 12/07/42	1,450,000.000	2,495,015.000	
	UK TREASURY 4.75 12/07/30	1,120,000.000	1,628,256.000	
	UK TREASURY 4.75 12/07/38	1,230,000.000	2,058,159.000	
	UK TREASURY 5.0 03/07/25	1,610,000.000	2,011,517.900	
	UK TREASURY 6.0 12/07/28	980,000.000	1,469,274.800	
	イギリス・ボンド 小計	49,220,000.000 (6,618,613,400)	67,200,689.900 (9,036,476,771)	
オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN 2.0 12/21/21	1,770,000.000	1,823,246.910	
	AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	1,950,000.000	2,160,795.000	
	AUSTRALIAN 2.25 11/21/22	890,000.000	935,341.940	
	AUSTRALIAN 2.5 05/21/30	1,200,000.000	1,393,328.510	
	AUSTRALIAN 2.75 04/21/24	1,980,000.000	2,168,565.490	
	AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	660,000.000	814,184.310	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	2,240,000.000	2,570,780.800	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/28	2,390,000.000	2,779,692.600	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/29	1,560,000.000	1,827,540.000	
	AUSTRALIAN 3.0 03/21/47	1,010,000.000	1,353,130.830	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	1,920,000.000	2,187,747.450	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	2,820,000.000	3,427,676.160	
	AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	830,000.000	1,109,688.500	
	AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	990,000.000	1,386,602.310	
	AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	2,480,000.000	3,032,739.670	
	AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	1,310,000.000	1,888,139.810	
	AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	2,220,000.000	2,860,016.890	
	AUSTRALIAN 5.5 04/21/23	2,210,000.000	2,587,144.890	
	AUSTRALIAN 5.75 07/15/22	2,040,000.000	2,327,004.540	
	オーストラリア・ドル 小計	32,470,000.000 (2,376,804,000)	38,633,366.610 (2,827,962,436)	
カナダ・ドル	CANADA 8.0 06/01/27	430,000.000	634,069.400	
	CANADA 0.75 03/01/21	2,300,000.000	2,272,860.000	

	CANADA 0.75 09/01/21	600,000.000	591,534.000	
	CANADA 1.0 06/01/27	800,000.000	778,216.000	
	CANADA 1.0 09/01/22	800,000.000	789,512.000	
	CANADA 1.5 06/01/23	1,840,000.000	1,844,802.400	
	CANADA 1.5 06/01/26	1,120,000.000	1,128,444.800	
	CANADA 1.75 03/01/23	1,160,000.000	1,171,994.400	
	CANADA 2.0 06/01/28	1,020,000.000	1,070,867.400	
	CANADA 2.0 09/01/23	740,000.000	755,873.000	
	CANADA 2.0 12/01/51	250,000.000	276,727.500	
	CANADA 2.25 03/01/24	530,000.000	548,989.900	
	CANADA 2.25 06/01/25	1,500,000.000	1,570,200.000	
	CANADA 2.25 06/01/29	610,000.000	657,061.500	
	CANADA 2.5 06/01/24	1,600,000.000	1,678,816.000	
	CANADA 2.75 06/01/22	2,240,000.000	2,313,852.800	
	CANADA 2.75 12/01/48	1,240,000.000	1,577,404.000	
	CANADA 2.75 12/01/64	460,000.000	636,097.200	
	CANADA 3.25 06/01/21	4,700,000.000	4,827,417.000	
	CANADA 3.5 12/01/45	1,210,000.000	1,702,010.200	
	CANADA 4.0 06/01/41	1,060,000.000	1,524,693.400	
	CANADA 5.0 06/01/37	870,000.000	1,329,873.300	
	CANADA 5.75 06/01/29	1,100,000.000	1,526,668.000	
	CANADA 5.75 06/01/33	1,040,000.000	1,585,823.200	
	カナダ・ドル 小計	29,220,000.000 (2,376,462,600)	32,793,807.400 (2,667,120,356)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE 2.125 06/01/26	210,000.000	216,825.000	
	SINGAPORE 2.25 08/01/36	200,000.000	213,500.000	
	SINGAPORE 2.375 06/01/25	500,000.000	521,250.000	
	SINGAPORE 2.75 03/01/46	530,000.000	619,540.850	
	SINGAPORE 2.75 04/01/42	470,000.000	543,555.000	
	SINGAPORE 2.875 07/01/29	200,000.000	222,112.000	
	SINGAPORE 2.875 09/01/30	460,000.000	514,970.000	
	SINGAPORE 3.0 09/01/24	810,000.000	864,703.350	
	SINGAPORE 3.125 09/01/22	1,600,000.000	1,672,000.000	
	SINGAPORE 3.375 09/01/33	480,000.000	577,118.400	
	SINGAPORE 3.5 03/01/27	900,000.000	1,017,450.000	
	シンガポール・ドル 小計	6,360,000.000 (500,277,600)	6,983,024.600 (549,284,715)	
スウェーデン・クローナ	SWEDEN 0.75 05/12/28	4,970,000.000	5,455,463.630	
	SWEDEN 0.75 11/12/29	2,170,000.000	2,395,050.700	
	SWEDEN 1.0 11/12/26	4,250,000.000	4,692,799.000	
	SWEDEN 2.5 05/12/25	7,300,000.000	8,558,248.440	
	SWEDEN 3.5 03/30/39	3,270,000.000	5,339,027.100	
	SWEDEN 3.5 06/01/22	13,360,000.000	14,825,391.600	
	スウェーデン・クローナ 小計	35,320,000.000 (388,166,800)	41,265,980.470 (453,513,125)	
デンマーク・クローネ	DENMARK 0.5 11/15/27	7,130,000.000	7,783,086.610	

	DENMARK 1.5 11/15/23	5,500,000.000	6,017,000.000	
	DENMARK 1.75 11/15/25	7,750,000.000	8,925,614.550	
	DENMARK 4.5 11/15/39	9,980,000.000	19,835,808.880	
デンマーク・クローネ 小計		30,360,000.000 (483,938,400)	42,561,510.040 (678,430,470)	
ノルウェー・クローネ	NORWAY 1.5 02/19/26	6,000,000.000	6,136,843.200	
	NORWAY 1.75 02/17/27	3,970,000.000	4,140,193.900	
	NORWAY 1.75 03/13/25	3,800,000.000	3,921,961.000	
	NORWAY 2.0 04/26/28	2,070,000.000	2,219,661.000	
	NORWAY 3.0 03/14/24	6,200,000.000	6,694,613.680	
ノルウェー・クローネ 小計		22,040,000.000 (261,394,400)	23,113,272.780 (274,123,415)	
ポーランド・ズロチ	POLAND 2.25 04/25/22	4,000,000.000	4,069,768.400	
	POLAND 2.5 01/25/23	1,350,000.000	1,387,785.280	
	POLAND 2.5 04/25/24	2,290,000.000	2,372,806.850	
	POLAND 2.5 07/25/26	3,130,000.000	3,263,531.120	
	POLAND 2.5 07/25/27	3,000,000.000	3,126,660.000	
	POLAND 2.75 04/25/28	1,900,000.000	2,027,110.000	
	POLAND 3.25 07/25/25	3,300,000.000	3,571,682.400	
	POLAND 4.0 10/25/23	3,100,000.000	3,384,053.000	
	POLAND 5.75 04/25/29	1,440,000.000	1,945,566.720	
POLAND 5.75 09/23/22	3,200,000.000	3,581,952.000		
ポーランド・ズロチ 小計		26,710,000.000 (737,463,100)	28,730,915.770 (793,260,584)	
マレーシア・リングギット	MALAYSIA 3.418 08/15/22	3,000,000.000	3,027,258.600	
	MALAYSIA 3.48 03/15/23	1,220,000.000	1,231,921.100	
	MALAYSIA 3.502 05/31/27	2,570,000.000	2,575,601.570	
	MALAYSIA 3.733 06/15/28	2,000,000.000	2,045,042.800	
	MALAYSIA 3.844 04/15/33	1,210,000.000	1,232,821.680	
	MALAYSIA 3.892 03/15/27	800,000.000	822,392.240	
	MALAYSIA 4.127 04/15/32	1,850,000.000	1,941,379.820	
	MALAYSIA 4.16 07/15/21	4,000,000.000	4,071,632.400	
	MALAYSIA 4.181 07/15/24	2,430,000.000	2,525,526.210	
	MALAYSIA 4.392 04/15/26	3,070,000.000	3,246,046.080	
	MALAYSIA 4.498 04/15/30	1,800,000.000	1,944,717.120	
	MALAYSIA 4.935 09/30/43	2,000,000.000	2,319,127.800	
	MALAYSIA 5.248 09/15/28	1,600,000.000	1,810,233.430	
マレーシア・リングギット 小計		27,550,000.000 (711,616,500)	28,793,700.850 (743,741,293)	
メキシコ・ペソ	MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	8,085,000.000	10,503,627.750	
	MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	27,596,000.000	31,653,439.880	
	MEXICAN BONDS 5.75 03/05/26	14,859,000.000	14,156,466.480	
	MEXICAN BONDS 6.5 06/09/22	26,000,000.000	25,922,780.000	

	MEXICAN BONDS 7.25 12/09/21	10,880,000.000	11,016,652.800	
	MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	18,071,000.000	18,931,721.730	
	MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	10,000,000.000	10,742,600.000	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	18,497,000.000	19,798,448.920	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	7,000,000.000	7,543,130.000	
	MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47	5,000,000.000	5,518,426.000	
	MEXICAN BONDS 8.0 12/07/23	14,000,000.000	14,691,180.000	
	MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	19,301,000.000	21,704,746.540	
	MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	11,125,000.000	12,778,842.500	
	メキシコ・ペソ 小計	190,414,000.000 (1,058,701,840)	204,962,062.600 (1,139,589,068)	
ユーロ	AUSTRIA 0.5 02/20/29	340,000.000	363,741.110	
	AUSTRIA 0.5 04/20/27	520,000.000	554,824.400	
	AUSTRIA 0.75 02/20/28	820,000.000	894,122.890	
	AUSTRIA 0.75 10/20/26	580,000.000	627,985.140	
	AUSTRIA 07/15/23	350,000.000	358,050.000	
	AUSTRIA 09/20/22	470,000.000	479,385.430	
	AUSTRIA 1.2 10/20/25	640,000.000	706,142.080	
	AUSTRIA 1.5 02/20/47	370,000.000	479,738.670	
	AUSTRIA 1.5 11/02/86	290,000.000	403,709.000	
	AUSTRIA 1.65 10/21/24	950,000.000	1,055,488.950	
	AUSTRIA 1.75 10/20/23	950,000.000	1,041,658.660	
	AUSTRIA 2.1 09/20/17	300,000.000	537,909.240	
	AUSTRIA 2.4 05/23/34	670,000.000	903,088.710	
	AUSTRIA 3.15 06/20/44	540,000.000	911,992.440	
	AUSTRIA 3.4 11/22/22	740,000.000	834,237.520	
	AUSTRIA 3.5 09/15/21	1,420,000.000	1,534,026.000	
	AUSTRIA 3.65 04/20/22	860,000.000	954,428.000	
	AUSTRIA 3.8 01/26/62	430,000.000	965,329.790	
	AUSTRIA 4.15 03/15/37	1,010,000.000	1,714,172.000	
	AUSTRIA 4.85 03/15/26	790,000.000	1,064,070.750	
	AUSTRIA 6.25 07/15/27	670,000.000	1,018,567.500	
	BELGIUM 0.2 10/22/23	660,000.000	681,978.000	
	BELGIUM 0.5 10/22/24	830,000.000	872,172.300	
	BELGIUM 0.8 06/22/25	900,000.000	965,215.800	
	BELGIUM 0.8 06/22/27	1,100,000.000	1,193,874.000	
	BELGIUM 0.8 06/22/28	1,140,000.000	1,241,688.000	
	BELGIUM 0.9 06/22/29	500,000.000	552,225.700	
	BELGIUM 1.0 06/22/26	1,130,000.000	1,236,804.210	
	BELGIUM 1.0 06/22/31	810,000.000	908,823.240	

BELGIUM 1.25 04/22/33	510,000.000	592,974.450	
BELGIUM 1.45 06/22/37	440,000.000	528,984.720	
BELGIUM 1.6 06/22/47	900,000.000	1,139,745.150	
BELGIUM 1.7 06/22/50	390,000.000	503,659.650	
BELGIUM 1.9 06/22/38	590,000.000	760,246.860	
BELGIUM 2.15 06/22/66	410,000.000	616,394.000	
BELGIUM 2.25 06/22/23	1,040,000.000	1,151,682.270	
BELGIUM 2.25 06/22/57	380,000.000	560,878.200	
BELGIUM 2.6 06/22/24	1,360,000.000	1,562,656.320	
BELGIUM 3.0 06/22/34	570,000.000	811,610.460	
BELGIUM 3.75 06/22/45	680,000.000	1,215,809.940	
BELGIUM 4.0 03/28/22	1,080,000.000	1,205,149.640	
BELGIUM 4.0 03/28/32	790,000.000	1,188,595.290	
BELGIUM 4.25 03/28/41	1,140,000.000	2,039,990.100	
BELGIUM 4.25 09/28/21	1,240,000.000	1,360,244.410	
BELGIUM 4.25 09/28/22	1,190,000.000	1,364,942.130	
BELGIUM 4.5 03/28/26	790,000.000	1,044,251.620	
BELGIUM 5.0 03/28/35	1,380,000.000	2,402,379.900	
BELGIUM 5.5 03/28/28	1,660,000.000	2,483,828.120	
BUNDESOBL 04/05/24	630,000.000	650,942.460	
BUNDESOBL 04/08/22	1,340,000.000	1,365,473.400	
BUNDESOBL 04/09/21	2,200,000.000	2,223,870.000	
BUNDESOBL 04/14/23	1,130,000.000	1,161,076.130	
BUNDESOBL 10/07/22	1,400,000.000	1,432,733.260	
BUNDESOBL 10/13/23	1,280,000.000	1,319,488.000	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	240,000.000	237,966.000	
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27	2,090,000.000	2,230,510.700	
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/29	1,670,000.000	1,793,583.340	
DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28	1,780,000.000	1,909,388.200	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25	2,200,000.000	2,346,102.000	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26	1,260,000.000	1,357,032.600	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28	1,770,000.000	1,934,680.800	
DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27	1,880,000.000	2,049,124.800	
DEUTSCHLAND 08/15/26	1,960,000.000	2,051,547.680	
DEUTSCHLAND 08/15/29	430,000.000	451,171.050	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/24	1,340,000.000	1,454,434.660	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25	1,880,000.000	2,071,177.200	
DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48	1,280,000.000	1,742,161.920	
DEUTSCHLAND 1.5 02/15/23	1,660,000.000	1,788,083.940	
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/23	1,650,000.000	1,786,423.650	
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/24	2,000,000.000	2,208,902.000	
DEUTSCHLAND 1.5 09/04/22	1,650,000.000	1,760,640.750	
DEUTSCHLAND 1.75 02/15/24	1,500,000.000	1,664,995.500	

DEUTSCHLAND 1.75 07/04/22	1,540,000.000	1,647,276.400	
DEUTSCHLAND 2.0 01/04/22	2,220,000.000	2,358,927.600	
DEUTSCHLAND 2.0 08/15/23	1,500,000.000	1,661,778.000	
DEUTSCHLAND 2.25 09/04/21	1,070,000.000	1,131,097.000	
DEUTSCHLAND 2.5 01/04/21	2,200,000.000	2,290,046.000	
DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	2,070,000.000	3,397,615.200	
DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	2,100,000.000	3,534,081.600	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/21	3,150,000.000	3,367,507.500	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	900,000.000	1,601,685.000	
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	1,760,000.000	3,088,358.240	
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	990,000.000	1,878,426.000	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	600,000.000	885,174.000	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	1,280,000.000	2,268,326.400	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	1,270,000.000	2,596,222.900	
DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	1,240,000.000	2,096,158.000	
DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	1,210,000.000	1,845,467.800	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/24	840,000.000	1,092,453.600	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	710,000.000	1,215,505.800	
DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	710,000.000	1,110,319.300	
FINLAND 0.5 04/15/26	500,000.000	531,201.000	
FINLAND 0.5 09/15/27	300,000.000	320,475.000	
FINLAND 0.5 09/15/28	450,000.000	482,373.450	
FINLAND 0.5 09/15/29	270,000.000	289,755.630	
FINLAND 0.75 04/15/31	450,000.000	496,857.600	
FINLAND 0.875 09/15/25	300,000.000	324,575.700	
FINLAND 04/15/22	320,000.000	325,365.760	
FINLAND 09/15/23	230,000.000	235,600.500	
FINLAND 1.125 04/15/34	370,000.000	431,409.270	
FINLAND 1.375 04/15/47	80,000.000	103,305.040	
FINLAND 1.5 04/15/23	170,000.000	182,945.500	
FINLAND 1.625 09/15/22	400,000.000	427,050.400	
FINLAND 2.0 04/15/24	480,000.000	536,973.600	
FINLAND 2.625 07/04/42	370,000.000	573,047.120	
FINLAND 2.75 07/04/28	380,000.000	482,920.720	
FINLAND 3.5 04/15/21	700,000.000	744,145.500	
FINLAND 4.0 07/04/25	430,000.000	543,821.680	
FRANCE BTAN 8.5 04/25/23	1,280,000.000	1,700,081.280	
FRANCE OAT 0.25 11/25/26	2,530,000.000	2,647,159.240	

FRANCE OAT 0.5 05/25/25	3,240,000.000	3,425,023.440	
FRANCE OAT 0.5 05/25/26	2,070,000.000	2,198,867.850	
FRANCE OAT 0.5 05/25/29	1,970,000.000	2,103,587.670	
FRANCE OAT 0.75 05/25/28	2,610,000.000	2,846,074.500	
FRANCE OAT 0.75 11/25/28	2,140,000.000	2,334,911.200	
FRANCE OAT 02/25/21	1,370,000.000	1,382,417.680	
FRANCE OAT 03/25/23	1,900,000.000	1,943,016.000	
FRANCE OAT 03/25/24	2,720,000.000	2,790,295.680	
FRANCE OAT 03/25/25	470,000.000	482,464.870	
FRANCE OAT 05/25/21	2,510,000.000	2,536,455.400	
FRANCE OAT 05/25/22	3,000,000.000	3,053,824.800	
FRANCE OAT 1.0 05/25/27	2,730,000.000	3,015,208.560	
FRANCE OAT 1.0 11/25/25	1,720,000.000	1,875,778.680	
FRANCE OAT 1.25 05/25/34	1,740,000.000	2,029,071.060	
FRANCE OAT 1.25 05/25/36	1,990,000.000	2,345,016.000	
FRANCE OAT 1.5 05/25/31	3,470,000.000	4,106,200.210	
FRANCE OAT 1.5 05/25/50	1,430,000.000	1,770,545.920	
FRANCE OAT 1.75 05/25/23	1,930,000.000	2,099,635.420	
FRANCE OAT 1.75 05/25/66	790,000.000	1,075,585.000	
FRANCE OAT 1.75 06/25/39	1,530,000.000	1,941,462.900	
FRANCE OAT 1.75 11/25/24	3,090,000.000	3,454,913.550	
FRANCE OAT 2.0 05/25/48	2,010,000.000	2,763,870.600	
FRANCE OAT 2.25 05/25/24	1,980,000.000	2,241,348.120	
FRANCE OAT 2.25 10/25/22	3,400,000.000	3,703,943.000	
FRANCE OAT 2.5 05/25/30	3,140,000.000	4,026,481.660	
FRANCE OAT 2.75 10/25/27	3,240,000.000	4,059,447.840	
FRANCE OAT 3.0 04/25/22	4,200,000.000	4,595,892.000	
FRANCE OAT 3.25 05/25/45	1,890,000.000	3,151,015.560	
FRANCE OAT 3.25 10/25/21	2,980,000.000	3,220,524.740	
FRANCE OAT 3.5 04/25/26	2,950,000.000	3,733,077.500	
FRANCE OAT 3.75 04/25/21	4,000,000.000	4,272,128.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/55	1,150,000.000	2,340,595.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/60	920,000.000	1,965,497.200	
FRANCE OAT 4.0 10/25/38	2,070,000.000	3,510,848.340	
FRANCE OAT 4.25 10/25/23	3,910,000.000	4,691,210.180	
FRANCE OAT 4.5 04/25/41	2,670,000.000	4,976,842.620	
FRANCE OAT 4.75 04/25/35	2,260,000.000	3,871,515.600	
FRANCE OAT 5.5 04/25/29	2,540,000.000	3,945,435.340	
FRANCE OAT 5.75 10/25/32	2,340,000.000	4,107,668.760	
FRANCE OAT 6.0 10/25/25	2,580,000.000	3,600,849.240	
IRISH 0.8 03/15/22	370,000.000	381,764.250	
IRISH 0.9 05/15/28	580,000.000	626,353.600	
IRISH 1.0 05/15/26	840,000.000	905,562.000	
IRISH 1.1 05/15/29	340,000.000	373,704.540	
IRISH 1.3 05/15/33	340,000.000	381,647.960	
IRISH 1.35 03/18/31	210,000.000	236,307.750	
IRISH 1.5 05/15/50	320,000.000	367,600.730	
IRISH 1.7 05/15/37	380,000.000	453,180.400	
IRISH 10/18/22	220,000.000	223,286.580	

IRISH 2.0 02/18/45	610,000.000	785,112.700	
IRISH 2.4 05/15/30	1,010,000.000	1,248,995.290	
IRISH 3.4 03/18/24	740,000.000	865,608.110	
IRISH 3.9 03/20/23	240,000.000	276,394.320	
IRISH 5.4 03/13/25	890,000.000	1,165,206.690	
ITALY BTPS 0.35 11/01/21	1,700,000.000	1,716,677.000	
ITALY BTPS 0.45 06/01/21	910,000.000	919,600.500	
ITALY BTPS 0.65 10/15/23	1,590,000.000	1,622,499.600	
ITALY BTPS 0.9 08/01/22	980,000.000	1,004,598.000	
ITALY BTPS 0.95 03/01/23	920,000.000	946,036.000	
ITALY BTPS 0.95 03/15/23	1,070,000.000	1,100,709.000	
ITALY BTPS 1.2 04/01/22	770,000.000	794,024.000	
ITALY BTPS 1.25 12/01/26	1,610,000.000	1,679,320.160	
ITALY BTPS 1.35 04/15/22	1,660,000.000	1,717,111.470	
ITALY BTPS 1.45 05/15/25	1,540,000.000	1,623,834.520	
ITALY BTPS 1.45 09/15/22	1,500,000.000	1,562,967.000	
ITALY BTPS 1.45 11/15/24	1,040,000.000	1,097,682.560	
ITALY BTPS 1.5 06/01/25	2,010,000.000	2,125,707.660	
ITALY BTPS 1.6 06/01/26	1,500,000.000	1,600,650.000	
ITALY BTPS 1.65 03/01/32	1,880,000.000	1,977,541.920	
ITALY BTPS 1.85 05/15/24	1,610,000.000	1,725,920.000	
ITALY BTPS 2.0 02/01/28	2,090,000.000	2,297,169.160	
ITALY BTPS 2.0 12/01/25	970,000.000	1,056,743.220	
ITALY BTPS 2.05 08/01/27	1,600,000.000	1,759,516.800	
ITALY BTPS 2.1 07/15/26	130,000.000	142,602.330	
ITALY BTPS 2.15 12/15/21	1,680,000.000	1,762,656.000	
ITALY BTPS 2.2 06/01/27	520,000.000	577,200.000	
ITALY BTPS 2.25 09/01/36	1,020,000.000	1,129,650.000	
ITALY BTPS 2.45 09/01/33	1,100,000.000	1,253,869.100	
ITALY BTPS 2.5 11/15/25	550,000.000	614,391.250	
ITALY BTPS 2.5 12/01/24	970,000.000	1,074,554.360	
ITALY BTPS 2.7 03/01/47	800,000.000	936,560.000	
ITALY BTPS 2.8 03/01/67	660,000.000	756,558.000	
ITALY BTPS 2.8 12/01/28	1,400,000.000	1,637,775.850	
ITALY BTPS 2.95 09/01/38	1,170,000.000	1,400,958.000	
ITALY BTPS 3.0 08/01/29	780,000.000	929,209.320	
ITALY BTPS 3.1 03/01/40	520,000.000	634,714.600	
ITALY BTPS 3.25 09/01/46	1,250,000.000	1,595,010.250	
ITALY BTPS 3.35 03/01/35	1,100,000.000	1,378,878.600	
ITALY BTPS 3.45 03/01/48	1,280,000.000	1,688,861.690	
ITALY BTPS 3.5 03/01/30	2,190,000.000	2,718,047.980	
ITALY BTPS 3.75 03/01/21	3,300,000.000	3,482,747.400	
ITALY BTPS 3.75 05/01/21	2,300,000.000	2,441,450.000	
ITALY BTPS 3.75 08/01/21	3,200,000.000	3,423,968.000	
ITALY BTPS 3.75 09/01/24	1,900,000.000	2,211,810.900	
ITALY BTPS 3.85 09/01/49	740,000.000	1,037,107.040	
ITALY BTPS 4.0 02/01/37	1,920,000.000	2,606,784.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/24	2,390,000.000	2,829,991.830	
ITALY BTPS 4.5 03/01/26	1,630,000.000	2,032,936.000	

ITALY BTPS 4.5 05/01/23	1,400,000.000	1,616,230.000	
ITALY BTPS 4.75 08/01/23	1,900,000.000	2,229,460.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/21	2,470,000.000	2,697,981.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/28	2,080,000.000	2,780,514.880	
ITALY BTPS 4.75 09/01/44	1,330,000.000	2,063,354.020	
ITALY BTPS 5.0 03/01/22	1,700,000.000	1,906,380.000	
ITALY BTPS 5.0 03/01/25	2,400,000.000	2,983,771.200	
ITALY BTPS 5.0 08/01/34	1,990,000.000	2,929,877.000	
ITALY BTPS 5.0 08/01/39	1,690,000.000	2,608,177.000	
ITALY BTPS 5.0 09/01/40	1,670,000.000	2,578,981.000	
ITALY BTPS 5.25 11/01/29	2,480,000.000	3,488,368.000	
ITALY BTPS 5.5 09/01/22	2,130,000.000	2,466,899.970	
ITALY BTPS 5.5 11/01/22	1,960,000.000	2,283,890.000	
ITALY BTPS 5.75 02/01/33	1,280,000.000	1,964,416.000	
ITALY BTPS 6.0 05/01/31	2,330,000.000	3,549,056.000	
ITALY BTPS 6.5 11/01/27	2,330,000.000	3,373,607.000	
ITALY BTPS 7.25 11/01/26	1,080,000.000	1,570,212.000	
ITALY BTPS 9.0 11/01/23	1,510,000.000	2,045,295.000	
NETHERLANDS 0.25 07/15/25	1,020,000.000	1,069,729.080	
NETHERLANDS 0.25 07/15/29	790,000.000	836,955.700	
NETHERLANDS 0.5 01/15/40	430,000.000	474,221.630	
NETHERLANDS 0.5 07/15/26	810,000.000	870,264.000	
NETHERLANDS 0.75 07/15/27	1,150,000.000	1,260,525.920	
NETHERLANDS 0.75 07/15/28	750,000.000	827,934.750	
NETHERLANDS 01/15/22	460,000.000	467,436.820	
NETHERLANDS 01/15/24	1,360,000.000	1,398,617.200	
NETHERLANDS 1.75 07/15/23	1,440,000.000	1,575,216.000	
NETHERLANDS 2.0 07/15/24	1,250,000.000	1,409,737.250	
NETHERLANDS 2.25 07/15/22	880,000.000	953,581.200	
NETHERLANDS 2.5 01/15/33	1,120,000.000	1,533,286.720	
NETHERLANDS 2.75 01/15/47	1,090,000.000	1,895,187.780	
NETHERLANDS 3.25 07/15/21	1,860,000.000	1,990,590.600	
NETHERLANDS 3.75 01/15/23	300,000.000	344,760.000	
NETHERLANDS 3.75 01/15/42	1,150,000.000	2,125,679.310	
NETHERLANDS 4.0 01/15/37	1,160,000.000	1,993,344.000	
NETHERLANDS 5.5 01/15/28	1,100,000.000	1,659,790.000	
SPAIN 0.05 01/31/21	400,000.000	402,760.000	
SPAIN 0.25 07/30/24	340,000.000	347,959.060	
SPAIN 0.35 07/30/23	1,460,000.000	1,496,996.690	

	SPAIN 0.4 04/30/22	2,200,000.000	2,249,390.000	
	SPAIN 0.45 10/31/22	1,340,000.000	1,375,495.260	
	SPAIN 0.6 10/31/29	440,000.000	456,980.040	
	SPAIN 0.75 07/30/21	1,700,000.000	1,738,069.800	
	SPAIN 1.3 10/31/26	1,670,000.000	1,825,315.010	
	SPAIN 1.4 04/30/28	1,560,000.000	1,732,677.960	
	SPAIN 1.4 07/30/28	1,540,000.000	1,718,178.000	
	SPAIN 1.45 04/30/29	1,370,000.000	1,534,082.160	
	SPAIN 1.45 10/31/27	1,700,000.000	1,889,084.200	
	SPAIN 1.5 04/30/27	1,210,000.000	1,343,100.000	
	SPAIN 1.6 04/30/25	1,660,000.000	1,823,432.970	
	SPAIN 1.85 07/30/35	490,000.000	579,311.320	
	SPAIN 1.95 04/30/26	1,530,000.000	1,732,076.280	
	SPAIN 1.95 07/30/30	2,020,000.000	2,381,020.460	
	SPAIN 2.15 10/31/25	1,860,000.000	2,115,032.780	
	SPAIN 2.35 07/30/33	1,520,000.000	1,894,376.000	
	SPAIN 2.7 10/31/48	860,000.000	1,197,092.480	
	SPAIN 2.75 10/31/24	1,990,000.000	2,290,488.010	
	SPAIN 2.9 10/31/46	1,270,000.000	1,813,585.010	
	SPAIN 3.45 07/30/66	720,000.000	1,201,752.720	
	SPAIN 3.8 04/30/24	1,720,000.000	2,038,086.650	
	SPAIN 4.2 01/31/37	1,530,000.000	2,417,645.710	
	SPAIN 4.4 10/31/23	1,430,000.000	1,703,288.730	
	SPAIN 4.65 07/30/25	1,910,000.000	2,441,495.700	
	SPAIN 4.7 07/30/41	1,470,000.000	2,582,749.570	
	SPAIN 4.8 01/31/24	1,130,000.000	1,377,589.550	
	SPAIN 4.9 07/30/40	1,300,000.000	2,307,500.000	
	SPAIN 5.15 10/31/28	1,510,000.000	2,199,919.000	
	SPAIN 5.15 10/31/44	1,130,000.000	2,174,088.360	
	SPAIN 5.4 01/31/23	1,460,000.000	1,740,045.520	
	SPAIN 5.5 04/30/21	3,600,000.000	3,935,085.120	
	SPAIN 5.75 07/30/32	1,840,000.000	3,078,980.180	
	SPAIN 5.85 01/31/22	2,300,000.000	2,637,870.000	
	SPAIN 5.9 07/30/26	1,700,000.000	2,387,585.400	
	SPAIN 6.0 01/31/29	1,830,000.000	2,819,843.340	
	ユーロ 小計	382,660,000.000 (45,540,366,600)	470,335,703.880 (55,974,652,119)	
南アフリカ・ランド	SOUTH AFRICA 10.5 12/21/26	19,290,000.000	21,639,734.190	
	SOUTH AFRICA 6.25 03/31/36	7,460,000.000	5,463,842.750	
	SOUTH AFRICA 6.5 02/28/41	7,840,000.000	5,564,919.800	
	SOUTH AFRICA 7.0 02/28/31	7,030,000.000	5,986,045.000	
	SOUTH AFRICA 7.75 02/28/23	3,600,000.000	3,648,594.960	
	SOUTH AFRICA 8.0 01/31/30	13,110,000.000	12,315,581.320	

	SOUTH AFRICA 8.25 03/31/32	6,590,000.000	6,127,243.210	
	SOUTH AFRICA 8.5 01/31/37	10,910,000.000	9,856,716.520	
	SOUTH AFRICA 8.75 01/31/44	10,000,000.000	8,985,427.800	
	SOUTH AFRICA 8.75 02/28/48	16,040,000.000	14,398,716.610	
	SOUTH AFRICA 8.875 02/28/35	8,410,000.000	7,984,040.140	
	SOUTH AFRICA 9.0 01/31/40	8,000,000.000	7,447,249.600	
	南アフリカ・ランド 小計	118,280,000.000 (851,616,000)	109,418,111.900 (787,810,406)	
国債証券 合計		129,458,557,440 (129,458,557,440)	147,580,659,464 (147,580,659,464)	
合計			147,580,659,464 (147,580,659,464)	

(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	48.17	48.55
イギリス・ポンド	国債証券 39銘柄	6.08	6.12
オーストラリア・ドル	国債証券 19銘柄	1.90	1.92
カナダ・ドル	国債証券 24銘柄	1.79	1.81
シンガポール・ドル	国債証券 11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	0.31
デンマーク・クローネ	国債証券 4銘柄	0.46	0.46
ノルウェー・クローネ	国債証券 5銘柄	0.18	0.19
ポーランド・ズロチ	国債証券 10銘柄	0.53	0.54
マレーシア・リングgit	国債証券 13銘柄	0.50	0.50
メキシコ・ペソ	国債証券 13銘柄	0.77	0.77
ユーロ	国債証券 282銘柄	37.63	37.93
南アフリカ・ランド	国債証券 12銘柄	0.53	0.53

(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。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

令和1年10月11日現在

資産の部	
流動資産	
預金	4,061,677,041
コール・ローン	3,193,170,440
株式	309,744,265,185
投資信託受益証券	727,421,291
投資証券	8,388,478,578
派生商品評価勘定	23,180,338
未収入金	690,817,746
未収配当金	353,305,542
差入委託証拠金	1,280,619,262
流動資産合計	328,462,935,423
資産合計	
328,462,935,423	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	37,752,388
未払解約金	3,154,860,000
流動負債合計	3,192,612,388
負債合計	
3,192,612,388	
純資産の部	
元本等	
元本	90,217,747,738
剰余金	
剰余金又は欠損金()	235,052,575,297
元本等合計	325,270,323,035
純資産合計	
325,270,323,035	
負債純資産合計	
328,462,935,423	

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 平成31年4月12日 至 令和1年10月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>為替予約取引</p> <p>原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	令和1年10月11日現在
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	101,222,657,435円
同期中追加設定元本額	11,549,586,856円
同期中一部解約元本額	22,554,496,553円
元本の内訳	
ファンド名	
D I A M外国株式パッシブ・ファンド	3,128,789,057円
M I T O ラップ型ファンド（安定型）	3,040,723円
M I T O ラップ型ファンド（中立型）	8,048,839円
M I T O ラップ型ファンド（積極型）	12,770,438円

グローバル8資産ラップファンド(安定型)	31,940,591円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	26,142,373円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	16,107,724円
たわらノーロード 先進国株式	10,791,110,271円
たわらノーロード 先進国株式<ラップ向け>	144,141,780円
たわらノーロード 先進国株式<為替ヘッジあり>	1,433,612,775円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	168,264,899円
たわらノーロード バランス(堅実型)	14,444,858円
たわらノーロード バランス(標準型)	125,967,980円
たわらノーロード バランス(積極型)	162,443,249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)	457,369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)	48,141,053円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定成長型)	119,337,972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)	86,430,130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)	178,181,948円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	97,359円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	545,899円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	1,356,482円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	867,108円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	2,681,932円
たわらノーロード 全世界株式	33,676,145円
DIAM外国株式インデックスファンド<DC年金>	41,873,141,183円
One DC 先進国株式インデックスファンド	121,660,825円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	182,117,600円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	895,666,856円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	1,108,003,315円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	125,776,632円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	354,914,715円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	313,526,730円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	28,953,028円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	798,433,365円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	196,839,405円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	220,138,540円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	156,660,082円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	274,593,439円
投資のソムリエ	430,532,316円
クルーズコントロール	58,808,616円
投資のソムリエ<DC年金>	45,078,724円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	180,381,837円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	102,059,982円
クルーズコントロール<DC年金>	140,114円
DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)	395,592円
DIAMコア資産設計ファンド(積極型)	1,323,213円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	30,986,170円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	357,778,699円
ワールドアセットバランス(基本コース)	491,833,708円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	1,941,628,723円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2045)	1,322,247円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2055)	1,032,775円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	224,650円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2035)	771,257円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	9,493,424円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	268,936,267円

9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	137,924,561円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	184,029円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	166,594円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	166,444円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	42,469円
D I A M外国株式インデックスファンドV A (適格機関投資家専用)	86,273,996円
D I A M外国株式パッシブ私募ファンド(適格機関投資家向け)	2,268,088,158円
D I A M先進国株式パッシブファンド(適格機関投資家限定)	9,256,718,883円
外国株式パッシブ・ファンド2(適格機関投資家限定)	206,030,558円
D I A Mワールドバランス25V A(適格機関投資家限定)	19,400,436円
D I A Mグローバル・バランスファンド25V A(適格機関投資家限定)	68,821,105円
D I A Mグローバル・バランスファンド50V A(適格機関投資家限定)	152,577,479円
D I A M国際分散バランスファンド30V A(適格機関投資家限定)	9,371,332円
D I A M国際分散バランスファンド50V A(適格機関投資家限定)	57,328,522円
D I A M国内重視バランスファンド30V A(適格機関投資家限定)	5,568,670円
D I A M国内重視バランスファンド50V A(適格機関投資家限定)	6,304,791円
D I A M世界バランスファンド40V A(適格機関投資家限定)	21,127,188円
D I A M世界バランスファンド50V A(適格機関投資家限定)	63,158,257円
D I A Mバランスファンド25V A(適格機関投資家限定)	427,403,001円
D I A Mバランスファンド37.5V A(適格機関投資家限定)	548,803,184円
D I A Mバランスファンド50V A(適格機関投資家限定)	1,772,482,944円
D I A Mグローバル・アセット・バランスV A(適格機関投資家限定)	633,584,646円
D I A Mグローバル・アセット・バランスV A2(適格機関投資家限定)	104,437,597円
D I A M アクサ グローバル バランスファンド30V A(適格機関投資家限定)	692,184,610円
D I A M世界アセットバランスファンドV A(適格機関投資家向け)	37,804,908円
D I A M世界バランスファンド55V A(適格機関投資家限定)	10,310,184円
D I A M世界バランスファンド35V A(適格機関投資家限定)	10,887,190円
D I A M世界アセットバランスファンド2V A(適格機関投資家限定)	273,884,671円
D I A M世界アセットバランスファンド40V A(適格機関投資家限定)	33,806,318円
D I A M世界アセットバランスファンド25V A(適格機関投資家限定)	113,287,716円
D I A M世界アセットバランスファンド3V A(適格機関投資家限定)	191,075,538円
D I A Mバランス30V A(適格機関投資家限定)	4,394,580円
D I A Mバランス50V A(適格機関投資家限定)	333,901円
D I A Mバランス70V A(適格機関投資家限定)	494,998円
D I A M世界アセットバランスファンド4V A(適格機関投資家限定)	5,837,568,544円
D I A Mバランス20V A(適格機関投資家限定)	53,515,759円
D I A Mバランス40V A(適格機関投資家限定)	225,774円
D I A Mバランス60V A(適格機関投資家限定)	255,220円
計	90,217,747,738円
2. 受益権の総数	90,217,747,738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31年4月12日 至 令和1年10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。
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、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 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。
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。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	令和1年10月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
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。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	令和1年10月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
株式	16,648,533,242
投資信託受益証券	48,760,520
投資証券	835,787,243
合計	17,533,081,005

(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31年2月16日から令和1年10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	令和1年10月11日現在			
	契約額等(円)	うち		時価(円)
		1年超		
市場取引以外の取引 為替予約取引 買建	471,062,839	-	471,063,150	311
アメリカ・ドル	312,812,460	-	312,812,460	-
イギリス・ポンド	33,610,000	-	33,610,000	-
オーストラリア・ドル	13,977,762	-	13,977,380	382
カナダ・ドル	14,147,940	-	14,146,200	1,740
ユーロ	96,514,677	-	96,517,110	2,433
合計	471,062,839	-	471,063,150	311

(注)時価の算定方法

為替予約取引

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

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

計算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	令和1年10月11日現在			
	契約額等(円)	うち		時価(円)
		1年超		
市場取引 先物取引 買建	6,776,908,289	-	6,762,335,928	14,572,361
合計	6,776,908,289	-	6,762,335,928	14,572,361

(注)時価の算定方法

株価指数先物取引

1. 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）

	令和1年10月11日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	3,6054円 (36,054円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

（1）株式

令和1年10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	33,054	1,720.260	56,861,474.040	
	ABBOTT LABORATORIES	139,517	80.140	11,180,892.380	
	AES CORP	55,631	15.820	880,082.420	
	ABIOMED INC	3,574	162.340	580,203.160	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	70,063	141.130	9,887,991.190	
	ADVANCED MICRO DEVICES	83,797	28.380	2,378,158.860	
	ADOBE INC	38,479	274.980	10,580,955.420	
	CHUBB LTD	36,631	155.390	5,692,091.090	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	17,359	214.670	3,726,456.530	
	ALLEGHANY CORP	1,094	770.020	842,401.880	
	SAREPTA THERAPEUTICS INC	6,052	83.160	503,284.320	
	RALPH LAUREN CORP	3,283	90.020	295,535.660	
	ALLSTATE CORP	25,832	107.140	2,767,640.480	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	57,633	160.970	9,277,184.010	
	AMGEN INC	48,063	198.680	9,549,156.840	
	HESS CORP	21,367	65.910	1,408,298.970	
	AMERICAN EXPRESS CO	55,876	115.020	6,426,857.520	
	AMERICAN ELECTRIC POWER	39,277	92.610	3,637,442.970	
	AFLAC INC	60,093	52.070	3,129,042.510	
	AMERICAN INTL GROUP	68,037	54.060	3,678,080.220	
	AMERCO	585	374.500	219,082.500	
	ANALOG DEVICES	29,105	108.440	3,156,146.200	
	ALEXION PHARMACEUTICALS INC	18,192	98.350	1,789,183.200	
	JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	61,876	41.790	2,585,798.040	
	JONES LANG LASALLE INC	4,087	135.150	552,358.050	
	VALERO ENERGY CORP	33,171	85.800	2,846,071.800	
APACHE CORP	31,470	20.430	642,932.100		
ANSYS INC	6,770	220.670	1,493,935.900		
APPLE INC	363,209	230.090	83,570,758.810		
APPLIED MATERIALS INC	74,621	51.010	3,806,417.210		
ALBEMARLE CORP	7,634	65.460	499,721.640		

ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	45,602	39.770	1,813,591.540	
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	9,600	95.370	915,552.000	
AMEREN CORP	19,487	76.850	1,497,575.950	
ARROW ELECTRONICS INC	7,754	73.160	567,282.640	
AUTOLIV INC	5,913	76.340	451,398.420	
AUTODESK INC	17,235	144.730	2,494,421.550	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	34,670	160.720	5,572,162.400	
AUTOZONE INC	1,917	1,077.230	2,065,049.910	
AVERY DENNISON CORP	6,549	111.300	728,903.700	
BALL CORP	25,262	72.840	1,840,084.080	
BERKSHIRE HATHAWAY INC- CL B	102,604	206.860	21,224,663.440	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	66,637	43.500	2,898,709.500	
BAXTER INTERNATIONAL INC	37,658	87.610	3,299,217.380	
BECTON DICKINSON & CO	21,455	248.540	5,332,425.700	
AMETEK INC	17,821	87.950	1,567,356.950	
VERIZON COMM INC	326,283	59.830	19,521,511.890	
WR BERKLEY CORP	12,201	71.320	870,175.320	
BEST BUY CO INC	18,720	66.730	1,249,185.600	
YUM! BRANDS INC	24,852	114.330	2,841,329.160	
FIRSTENERGY CORP	43,584	47.900	2,087,673.600	
H&R BLOCK INC	16,114	23.630	380,773.820	
BOEING CO	42,262	371.000	15,679,202.000	
ROBERT HALF INTL INC	8,097	53.040	429,464.880	
BORGWARNER INC	17,210	35.400	609,234.000	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	110,194	37.980	4,185,168.120	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	9,988	84.330	842,288.040	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	8,766	122.400	1,072,958.400	
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	1,929	672.370	1,297,001.730	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	127,741	50.780	6,486,687.980	
AFFILIATED MANAGERS GROUP INC	3,426	73.060	250,303.560	
INGREDION INC	5,305	78.850	418,299.250	
ONEOK INC	32,427	68.970	2,236,490.190	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	5,900	102.130	602,567.000	
UNITED RENTALS INC	6,505	113.320	737,146.600	
SEMPRA ENERGY	21,599	146.410	3,162,309.590	
FEDEX CORP	19,368	141.360	2,737,860.480	
VERISIGN INC	8,048	185.550	1,493,306.400	
AMPHENOL CORP	23,150	95.510	2,211,056.500	
BROWN-FORMAN CORP	24,381	62.610	1,526,494.410	

SIRIUS XM HOLDINGS INC	125,254	6.250	782,837.500	
CSX CORP	59,540	66.940	3,985,607.600	
CABOT OIL & GAS CORP	31,416	17.510	550,094.160	
CAMPBELL SOUP CO	14,050	47.320	664,846.000	
SEAGATE TECHNOLOGY	20,798	52.900	1,100,214.200	
CONSTELLATION BRANDS INC	12,871	192.710	2,480,370.410	
CARDINAL HEALTH INC	22,950	46.050	1,056,847.500	
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	31,962	40.950	1,308,843.900	
CATERPILLAR INC	44,868	122.690	5,504,854.920	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	9,865	109.480	1,080,020.200	
CELGENE CORP	56,106	99.810	5,599,939.860	
CITRIX SYSTEMS INC	10,886	96.960	1,055,506.560	
CENTURYLINK INC	80,424	11.630	935,331.120	
CERNER CORP	25,143	66.840	1,680,558.120	
JPMORGAN CHASE & CO	256,348	114.210	29,277,505.080	
CHURCH & DWIGHT CO INC	19,896	75.630	1,504,734.480	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	12,715	116.230	1,477,864.450	
CINTAS CORP	7,247	266.070	1,928,209.290	
CISCO SYSTEMS INC	338,608	46.150	15,626,759.200	
CLOROX COMPANY	9,876	150.750	1,488,807.000	
COCA-COLA CO/THE	320,243	53.660	17,184,239.380	
COPART INC	16,749	81.055	1,357,590.190	
COGNEX CORP	12,284	46.840	575,382.560	
COLGATE-PALMOLIVE CO	63,469	70.770	4,491,701.130	
MARRIOTT INTERNATIONAL- CL A	22,145	118.190	2,617,317.550	
COMERICA INC	12,770	63.860	815,492.200	
NRG ENERGY, INC.	21,039	38.800	816,313.200	
COMCAST CORP-CL A	358,051	44.500	15,933,269.500	
CONAGRA BRANDS INC	40,573	28.350	1,150,244.550	
CONSOLIDATED EDISON INC	25,181	93.050	2,343,092.050	
CMS ENERGY CORP	22,937	64.330	1,475,537.210	
COOPER COS INC	3,936	290.810	1,144,628.160	
MOLSON COORS BREWING CO	16,200	55.720	902,664.000	
CORNING INC	63,750	28.200	1,797,750.000	
SEALED AIR CORP	13,870	39.660	550,084.200	
HEICO CORP-CL A	5,292	95.990	507,979.080	
CUMMINS INC	12,238	157.050	1,921,977.900	
DR HORTON INC	28,355	52.500	1,488,637.500	
DANAHER CORP	50,997	138.760	7,076,343.720	
MOODY'S CORP	13,582	211.050	2,866,481.100	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	44,962	59.800	2,688,727.600	
TARGET CORP	41,066	110.570	4,540,667.620	
DEERE & CO	24,182	167.800	4,057,739.600	
MORGAN STANLEY	100,406	41.050	4,121,666.300	

REPUBLIC SERVICES INC	18,081	86.870	1,570,696.470	
COSTAR GROUP INC	2,795	601.880	1,682,254.600	
THE WALT DISNEY CO	142,222	129.340	18,394,993.480	
DOLLAR TREE INC	18,697	113.910	2,129,775.270	
DOVER CORP	11,113	94.920	1,054,845.960	
OMNICOM GROUP	17,365	73.170	1,270,597.050	
DTE ENERGY CO	14,817	130.290	1,930,506.930	
DUKE ENERGY CORP	56,837	96.290	5,472,834.730	
FLOWSERVE CORP	9,882	43.630	431,151.660	
DARDEN RESTAURANTS INC	9,700	112.030	1,086,691.000	
EBAY INC	66,614	37.930	2,526,669.020	
BANK OF AMERICA CORP	713,639	28.450	20,303,029.550	
CITIGROUP INC	182,613	68.620	12,530,904.060	
EASTMAN CHEMICAL CO	11,935	69.790	832,943.650	
E*TRADE FINANCIAL CORP	17,663	38.965	688,238.790	
EATON CORP PLC	32,606	78.600	2,562,831.600	
EATON VANCE CORP	9,184	42.610	391,330.240	
CADENCE DESIGN SYS INC	22,628	65.540	1,483,039.120	
DISH NETWORK CORP	17,517	33.150	580,688.550	
ECOLAB INC	20,479	193.190	3,956,338.010	
PERKINELMER INC	8,338	80.500	671,209.000	
ELECTRONIC ARTS INC	23,975	92.530	2,218,406.750	
SALESFORCE.COM INC	65,596	146.410	9,603,910.360	
ERIE INDEMNITY CO	2,243	182.660	409,706.380	
EMERSON ELECTRIC CO	48,177	65.050	3,133,913.850	
ATMOS ENERGY CORP	8,650	110.850	958,852.500	
ENTERGY CORP	14,365	117.790	1,692,053.350	
EOG RESOURCES INC	45,209	68.910	3,115,352.190	
EQUIFAX INC	9,161	141.510	1,296,373.110	
ESTEE LAUDER COS INC/THE	17,346	189.690	3,290,362.740	
EXPEDITORS INTERNATIONAL	12,711	72.110	916,590.210	
EXXON MOBIL CORP	334,134	68.250	22,804,645.500	
FMC CORP	10,209	79.920	815,903.280	
NEXTERA ENERGY INC	37,460	232.000	8,690,720.000	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	2,875	241.430	694,111.250	
ASSURANT INC	4,594	125.540	576,730.760	
FASTENAL CO	45,891	31.020	1,423,538.820	
FIFTH THIRD BANCORP	58,144	26.180	1,522,209.920	
M&T BANK CORP	10,640	154.950	1,648,668.000	
FISERV INC	45,716	105.140	4,806,580.240	
FLIR SYSTEMS INC	11,623	52.095	605,500.180	
MACY'S INC	24,741	15.300	378,537.300	
FORD MOTOR CO	310,836	8.620	2,679,406.320	
FRANKLIN RESOURCES INC	23,713	26.530	629,105.890	
FREEPORT-MCMORAN INC	120,727	8.960	1,081,713.920	
FLEX LTD	34,372	9.610	330,314.920	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	14,270	87.470	1,248,196.900	
GAP INC/THE	18,295	16.650	304,611.750	

DENTSPLY SIRONA INC	18,386	53.910	991,189.260	
GENERAL DYNAMICS CORP	19,290	176.690	3,408,350.100	
GENERAL MILLS INC	46,468	54.610	2,537,617.480	
GENUINE PARTS CO	11,605	94.520	1,096,904.600	
GILEAD SCIENCES INC	101,430	63.260	6,416,461.800	
GARTNER INC	7,384	143.110	1,056,724.240	
MCKESSON CORP	14,558	132.810	1,933,447.980	
NVIDIA CORP	45,479	183.030	8,324,021.370	
GENERAL ELECTRIC CO	682,967	8.450	5,771,071.150	
VW GRAINGER INC	3,762	288.710	1,086,127.020	
HALLIBURTON CO	66,843	18.430	1,231,916.490	
MONSTER BEVERAGE CORP	33,500	56.120	1,880,020.000	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	25,659	199.870	5,128,464.330	
HARLEY-DAVIDSON INC	12,901	33.800	436,053.800	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	17,586	209.930	3,691,828.980	
HASBRO INC	9,473	119.450	1,131,549.850	
HENRY SCHEIN INC	11,516	62.380	718,368.080	
HEICO CORP	4,236	124.890	529,034.040	
HELMERICH & PAYNE INC	10,055	36.740	369,420.700	
HERSHEY FOODS CORP	11,330	156.300	1,770,879.000	
HP INC	121,318	16.030	1,944,727.540	
F5 NETWORKS INC	4,874	132.450	645,561.300	
CROWN HOLDINGS INC NPR	10,472	62.630	655,861.360	
JUNIPER NETWORKS INC	27,939	23.570	658,522.230	
HOLLYFRONTIER CORP	11,855	53.170	630,330.350	
HOLOGIC INC	20,210	48.640	983,014.400	
UNUM GROUP	15,185	27.540	418,194.900	
HOME DEPOT INC	86,872	231.610	20,120,423.920	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	15,079	66.505	1,002,828.890	
HORMEL FOODS CORP	24,161	41.670	1,006,788.870	
CENTERPOINT ENERGY INC	37,678	28.160	1,061,012.480	
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,913	232.630	677,651.190	
HUMANA INC	10,620	261.150	2,773,413.000	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	7,359	107.580	791,681.220	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	79,517	13.730	1,091,768.410	
NEKTAR THERAPEUTICS	15,689	16.130	253,063.570	
BIOGEN INC	15,267	223.000	3,404,541.000	
IDEX CORP	6,154	156.070	960,454.780	
ILLINOIS TOOL WORKS	26,049	149.900	3,904,745.100	
INTUIT INC	20,659	267.530	5,526,902.270	
IDEXX LABORATORIES INC	6,791	272.240	1,848,781.840	
IONIS PHARMACEUTICALS INC	11,699	62.100	726,507.900	
INGERSOLL-RAND PLC	19,439	114.090	2,217,795.510	
INTEL CORP	353,705	51.110	18,077,862.550	

INTL FLAVORS & FRAGRANCES	7,965	115.970	923,701.050	
INTERNATIONAL PAPER CO	29,411	40.230	1,183,204.530	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	28,862	19.830	572,333.460	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	10,108	89.640	906,081.120	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	6,019	142.750	859,212.250	
INCYTE CORP	13,798	75.770	1,045,474.460	
JOHNSON & JOHNSON	209,690	129.060	27,062,591.400	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	29,441	58.360	1,718,176.760	
KLA CORPORATION	12,724	157.400	2,002,757.600	
DEVON ENERGY CORP	33,312	20.830	693,888.960	
KELLOGG CO	19,160	62.370	1,195,009.200	
EAST WEST BANCORP INC	11,560	41.370	478,237.200	
KEYCORP	79,497	17.190	1,366,553.430	
KIMBERLY-CLARK CORP	27,296	137.890	3,763,845.440	
BLACKROCK INC/NEW YORK	9,066	420.380	3,811,165.080	
KOHL'S CORP	11,910	50.800	605,028.000	
KROGER CO	66,610	23.840	1,587,982.400	
LAM RESEARCH CORP	11,854	234.620	2,781,185.480	
PACKAGING CORP OF AMERICA	7,143	106.030	757,372.290	
AKAMAI TECHNOLOGIES	13,254	89.360	1,184,377.440	
LEGGETT & PLATT INC	10,928	39.330	429,798.240	
LENNAR CORP	22,753	58.850	1,339,014.050	
JEFFERIES FINANCIAL GROUP INC	20,795	17.610	366,199.950	
ELI LILLY & CO	68,853	106.920	7,361,762.760	
L BRANDS INC	21,698	16.840	365,394.320	
LINCOLN NATIONAL CORP	16,387	56.080	918,982.960	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	54,529	115.280	6,286,103.120	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	25,544	74.000	1,890,256.000	
LOCKHEED MARTIN CORP	20,343	386.880	7,870,299.840	
LOEWS CORP	21,759	49.540	1,077,940.860	
LOWE'S COS INC	62,772	108.190	6,791,302.680	
DOMINION ENERGY INC	63,870	81.780	5,223,288.600	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	38,573	27.430	1,058,057.390	
MCCORMICK & CO INC	9,935	165.690	1,646,130.150	
MCDONALD'S CORPORATION	60,345	211.760	12,778,657.200	
S&P GLOBAL INC	19,821	250.970	4,974,476.370	
EVEREST RE GROUP LTD	3,114	249.500	776,943.000	
MANPOWERGROUP INC	4,555	81.960	373,327.800	
MARKEL CORPORATION	1,065	1,144.850	1,219,265.250	

EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	16,561	226.090	3,744,276.490	
MARSH & MCLENNAN COS	40,294	96.230	3,877,491.620	
MASCO CORP	24,537	41.850	1,026,873.450	
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	4,786	267.870	1,282,025.820	
METLIFE INC	61,857	44.960	2,781,090.720	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	21,386	56.910	1,217,077.260	
MEDTRONIC PLC	106,145	107.420	11,402,095.900	
ACTIVISION BLIZZARD INC	60,243	53.690	3,234,446.670	
CVS HEALTH CORP	101,372	62.140	6,299,256.080	
MERCK & CO. INC.	203,186	83.760	17,018,859.360	
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	32,686	18.060	590,309.160	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	8,049	164.500	1,324,060.500	
MICROSOFT CORP	575,002	139.100	79,982,778.200	
MICRON TECH INC	88,668	43.280	3,837,551.040	
MIDDLEBY CORP	4,188	111.090	465,244.920	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	18,473	92.410	1,707,089.930	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	48,715	23.290	1,134,572.350	
3M CO	45,183	152.310	6,881,822.730	
MOHAWK INDUSTRIES INC	4,976	123.410	614,088.160	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	12,680	170.010	2,155,726.800	
KANSAS CITY SOUTHERN	7,614	130.450	993,246.300	
MYLAN NV	43,574	18.470	804,811.780	
ILLUMINA INC	11,619	298.180	3,464,553.420	
XCEL ENERGY INC	41,501	63.950	2,653,988.950	
NATIONAL OILWELL VARCO INC	33,468	20.680	692,118.240	
NETAPP INC	17,963	49.780	894,198.140	
NEWELL BRANDS INC	33,317	18.850	628,025.450	
NEWMONT GOLDCORP CORP	63,869	38.940	2,487,058.860	
NVR INC	263	3,602.600	947,483.800	
NIKE INC-CL B	99,219	93.000	9,227,367.000	
NOBLE ENERGY INC	39,436	20.120	793,452.320	
NORDSTROM INC	9,487	33.760	320,281.120	
NORFOLK SOUTHERN CORP	21,266	172.020	3,658,177.320	
EVERSOURCE ENERGY	24,768	85.540	2,118,654.720	
NISOURCE INC	31,548	29.010	915,207.480	
TAPESTRY INC	21,790	24.990	544,532.100	
NORTHERN TRUST CORP	15,959	89.490	1,428,170.910	
NORTHROP GRUMMAN CORP	12,618	368.750	4,652,887.500	
WELLS FARGO & CO	337,198	48.650	16,404,682.700	
NUCOR CORP	25,192	50.210	1,264,890.320	
CHENIERE ENERGY INC	19,175	61.340	1,176,194.500	

CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	36,209	87.030	3,151,269.270	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	69,550	41.030	2,853,636.500	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	5,209	166.710	868,392.390	
OGE ENERGY CORP	16,028	43.240	693,050.720	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	6,185	398.800	2,466,578.000	
ORACLE CORP	188,971	55.490	10,486,000.790	
PACCAR INC	27,394	67.320	1,844,164.080	
PTC INC	7,766	62.990	489,180.340	
EXELON CORP	77,211	47.420	3,661,345.620	
PARKER HANNIFIN CORP	10,092	170.750	1,723,209.000	
PAYCHEX INC	25,329	83.940	2,126,116.260	
ALIGN TECHNOLOGY INC	6,375	194.170	1,237,833.750	
PPL CORPORATION	58,220	30.560	1,779,203.200	
PEPSICO INC	110,679	137.890	15,261,527.310	
PENTAIR PLC	12,511	36.130	452,022.430	
PFIZER INC	438,192	35.790	15,682,891.680	
CONOCOPHILLIPS	90,316	55.880	5,046,858.080	
PVH CORP	5,101	83.800	427,463.800	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	12,908	129.350	1,669,649.800	
ALTRIA GROUP INC	146,052	42.980	6,277,314.960	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	35,495	138.420	4,913,217.900	
POLARIS INC	4,095	84.630	346,559.850	
GARMIN LTD	10,774	85.610	922,362.140	
FLUOR CORP (NEW)	9,821	17.920	175,992.320	
PPG INDUSTRIES INC	19,031	115.660	2,201,125.460	
IPG PHOTONICS CORP	2,608	129.960	338,935.680	
COSTCO WHOLESALE CORP	34,711	297.140	10,314,026.540	
T ROWE PRICE GROUP INC	18,483	108.510	2,005,590.330	
QUEST DIAGNOSTICS	10,883	103.000	1,120,949.000	
PROCTER & GAMBLE CO	198,040	121.940	24,148,997.600	
PROGRESSIVE CORP	46,127	74.760	3,448,454.520	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	39,039	61.510	2,401,288.890	
PULTE GROUP INC	21,209	36.950	783,672.550	
GLOBAL PAYMENTS INC	23,692	161.140	3,817,728.880	
QUALCOMM INC	95,114	74.970	7,130,696.580	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	10,388	78.350	813,899.800	
EXACT SCIENCES CORP	9,418	90.520	852,517.360	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	3,161	189.310	598,408.910	
REGENERON PHARMACEUTICALS	6,547	298.360	1,953,362.920	

REINSURANCE GROUP OF AMERICA INC	5,042	152.140	767,089.880	
RESMED INC	11,116	130.470	1,450,304.520	
US BANCORP	118,332	53.020	6,273,962.640	
SEATTLE GENETICS INC /WA	8,265	81.550	674,010.750	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	31,500	41.160	1,296,540.000	
ROSS STORES INC	28,814	111.010	3,198,642.140	
ROLLINS INC	12,378	34.820	431,001.960	
ROPER TECHNOLOGIES INC	8,404	340.050	2,857,780.200	
ROCKWELL AUTOMATION INC	9,251	154.800	1,432,054.800	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	14,075	103.610	1,458,310.750	
RAYTHEON COMPANY	21,972	198.610	4,363,858.920	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	3,848	118.210	454,872.080	
ACCENTURE PLC-CL A	50,417	183.830	9,268,157.110	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	114,749	55.410	6,358,242.090	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	10,190	187.690	1,912,561.100	
THE TRAVELERS COMPANIES INC	20,724	141.560	2,933,689.440	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	48,861	131.540	6,427,175.940	
BOOKING HOLDINGS INC	3,445	1,962.910	6,762,224.950	
SCHLUMBERGER LTD	108,486	31.070	3,370,660.020	
SCHWAB (CHARLES) CORP	97,212	36.140	3,513,241.680	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	16,659	134.070	2,233,472.130	
BUNGE LTD	10,622	55.380	588,246.360	
SEI INVESTMENTS CO	11,883	58.560	695,868.480	
ANTHEM INC	20,569	237.230	4,879,583.870	
AMERISOURCEBERGEN CORP	12,749	80.820	1,030,374.180	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	23,125	53.950	1,247,593.750	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	6,454	558.700	3,605,849.800	
CENTENE CORP	33,216	44.090	1,464,493.440	
SVB FINANCIAL GROUP	4,044	192.440	778,227.360	
IAC INTERACTIVE CORP	6,252	225.070	1,407,137.640	
SMITH (A.O.) CORP	11,351	46.340	526,005.340	
ACUITY BRANDS INC	3,087	120.030	370,532.610	
SNAP-ON INC	3,981	153.150	609,690.150	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	31,388	87.670	2,751,785.960	
ADVANCE AUTO PARTS	5,297	155.950	826,067.150	
EDISON INTERNATIONAL	28,779	74.190	2,135,114.010	
SOUTHERN CO	82,609	61.800	5,105,236.200	
BB&T CORP	61,315	51.330	3,147,298.950	
SOUTHWEST AIRLINES	11,352	53.670	609,261.840	
AT&T INC	575,875	37.420	21,549,242.500	
CHEVRON CORP	150,662	114.590	17,264,358.580	

STANLEY BLACK & DECKER INC	11,776	140.430	1,653,703.680	
STATE STREET CORP	30,100	56.830	1,710,583.000	
STARBUCKS CORP	95,691	85.960	8,225,598.360	
STEEL DYNAMICS INC	19,030	29.180	555,295.400	
STRYKER CORP	26,746	211.290	5,651,162.340	
NETFLIX INC	34,491	280.480	9,674,035.680	
SUNTRUST BANKS INC	35,828	66.170	2,370,738.760	
SYMANTEC CORP	48,955	23.490	1,149,952.950	
KNIGHT SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	9,793	34.790	340,698.470	
SYNOPSIS INC	11,855	138.220	1,638,598.100	
SYSCO CORP	38,229	78.230	2,990,654.670	
INTUITIVE SURGICAL INC	9,143	511.230	4,674,175.890	
TELEFLEX INC	3,456	317.100	1,095,897.600	
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	96,274	6.740	648,886.760	
TEXAS INSTRUMENTS INC	74,184	127.730	9,475,522.320	
TEXTRON INC	16,304	47.460	773,787.840	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	31,582	280.660	8,863,804.120	
TIFFANY & CO	8,733	88.030	768,765.990	
GLOBE LIFE INC	8,807	93.210	820,900.470	
DAVITA INC	8,159	55.820	455,435.380	
TRACTOR SUPPLY CO	9,573	93.120	891,437.760	
TRIMBLE INC	20,073	37.450	751,733.850	
TYSON FOODS INC	22,736	82.130	1,867,307.680	
UGI CORP	14,797	48.420	716,470.740	
MARATHON OIL CORP	58,418	11.400	665,965.200	
UNION PACIFIC CORP	56,020	155.770	8,726,235.400	
UNITED TECHNOLOGIES CORP	64,508	133.920	8,638,911.360	
UNITEDHEALTH GROUP INC	75,067	223.730	16,794,739.910	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	6,153	145.830	897,291.990	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	7,226	108.980	787,489.480	
VF CORP	26,750	88.620	2,370,585.000	
CBS CORP	27,306	37.660	1,028,343.960	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	20,059	170.220	3,414,442.980	
VULCAN MATERIALS CO	10,913	148.500	1,620,580.500	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	60,250	52.930	3,189,032.500	
WALMART INC	113,189	119.610	13,538,536.290	
WASTE MANAGEMENT INC	33,679	117.440	3,955,261.760	
WATERS CORP	5,468	211.300	1,155,388.400	
ALLERGAN PLC	26,094	167.830	4,379,356.020	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	9,176	107.020	982,015.520	

VAIL RESORTS INC	3,109	225.800	702,012.200	
WESTERN DIGITAL CORP	22,567	57.340	1,293,991.780	
WABTEC CORP	14,964	64.960	972,061.440	
WHIRLPOOL CORP	4,614	157.320	725,874.480	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	13,902	84.890	1,180,140.780	
WYNN RESORTS LTD	7,970	106.060	845,298.200	
NASDAQ INC	9,020	98.560	889,011.200	
CME GROUP INC	27,978	215.890	6,040,170.420	
WILLIAMS COS INC	97,461	22.740	2,216,263.140	
LKQ CORP	26,690	30.210	806,304.900	
ALLIANT ENERGY CORP	17,169	53.490	918,369.810	
WEC ENERGY GROUP INC	25,582	95.150	2,434,127.300	
TD AMERITRADE HOLDING CORP	21,820	34.490	752,571.800	
CARMAX INC	12,265	87.410	1,072,083.650	
XILINX INC	20,599	92.810	1,911,793.190	
CIMAREX ENERGY CO	9,253	44.860	415,089.580	
TJX COMPANIES INC	95,661	57.430	5,493,811.230	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP	3,937	190.860	751,415.820	
ZIONS BANCORP NA	13,142	43.210	567,865.820	
DAIRY FARM INTERNATIONAL HLDNGS	27,400	5.720	156,728.000	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	76,400	5.400	412,560.000	
JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	15,700	51.920	815,144.000	
JARDINE STRATEGIC HOLDINGS LTD	17,100	29.230	499,833.000	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	8,192	77.640	636,026.880	
SIGNATURE BANK	4,171	116.960	487,840.160	
CBRE GROUP INC	26,222	50.490	1,323,948.780	
LIBERTY GLOBAL PLC	12,732	23.800	303,021.600	
WELLCARE HEALTH PLANS INC	3,819	263.810	1,007,490.390	
REGIONS FINANCIAL CORP	76,480	15.110	1,155,612.800	
DOMINO'S PIZZA INC	3,256	254.770	829,531.120	
WESTLAKE CHEMICAL CORP	3,000	60.080	180,240.000	
T-MOBILE US INC	27,710	78.300	2,169,693.000	
LAS VEGAS SANDS CORP	27,759	54.790	1,520,915.610	
MOSAIC CO/THE	31,433	19.340	607,914.220	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	2,892	359.090	1,038,488.280	
CELANESE CORP	10,326	118.360	1,222,185.360	
DEXCOM INC	6,740	154.460	1,041,060.400	
DISCOVERY INC-A	10,423	27.345	285,016.930	
EXPEDIA GROUP INC	11,527	135.990	1,567,556.730	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	18,475	49.150	908,046.250	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	10,312	134.010	1,381,911.120	

LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	34,023	22.905	779,296.810	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	44,248	94.740	4,192,055.520	
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	14,696	19.640	288,629.440	
VIACOM INC-CLASS B	30,282	22.540	682,556.280	
LIVE NATION	11,339	67.610	766,629.790	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,040	827.750	1,688,610.000	
UNITED AIRLINES HOLIDINGS INC	4,508	87.340	393,728.720	
TRANSDIGM GROUP INC	3,685	511.000	1,883,035.000	
MASTERCARD INC	71,792	273.830	19,658,803.360	
QURATE RETAIL INC	35,733	9.575	342,143.470	
HANESBRANDS INC	27,619	14.750	407,380.250	
WESTERN UNION CO	35,222	23.560	829,830.320	
OWENS CORNING	7,756	60.850	471,952.600	
LEIDOS HOLDINGS INC	11,113	83.050	922,934.650	
AERCAP HOLDINGS NV	8,807	53.400	470,293.800	
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLDINGS INC	7,384	82.440	608,736.960	
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT-ADR	17,350	19.490	338,151.500	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	9,176	122.540	1,124,427.040	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	31,119	15.315	476,587.480	
DELTA AIR LINES INC	13,898	53.100	737,983.800	
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	6,038	27.760	167,614.880	
DISCOVER FINANCIAL	26,157	76.500	2,001,010.500	
TE CONNECTIVITY LTD	25,992	88.070	2,289,115.440	
CONCHO RESOURCES INC/MIDLAND TX	15,970	64.190	1,025,114.300	
WABCO HOLDING INC	4,076	134.180	546,917.680	
LULULEMON ATHLETICA INC	8,939	198.130	1,771,084.070	
VMWARE INC	6,532	151.670	990,708.440	
MERCADOLIBRE INC	3,500	542.410	1,898,435.000	
ULTA BEAUTY INC	4,577	241.750	1,106,489.750	
INVESCO LTD	33,443	15.350	513,350.050	
MSCI INC	6,714	222.650	1,494,872.100	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	122,545	77.750	9,527,873.750	
VISA INC	137,469	174.880	24,040,578.720	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	14,536	125.050	1,817,726.800	
DISCOVERY INC-C	30,421	25.570	777,864.970	
MARATHON PETROLEUM CORP	51,474	61.930	3,187,784.820	

FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	11,624	55.680	647,224.320	
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	160,064	20.240	3,239,695.360	
XYLEM INC	13,160	75.430	992,658.800	
ALKERMES PLC	12,053	17.290	208,396.370	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	20,876	83.920	1,751,913.920	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,479	208.590	725,684.610	
SPLUNK INC	12,240	118.150	1,446,156.000	
EPAM SYSTEMS INC	4,003	184.440	738,313.320	
HCA HEALTHCARE INC	21,724	118.560	2,575,597.440	
VERISK ANALYTICS INC	12,320	157.860	1,944,835.200	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,273	117.960	504,043.080	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	6,885	288.440	1,985,909.400	
FIRST REPUBLIC BANK/SAN FRANCISCO CA	13,805	94.190	1,300,292.950	
CIT GROUP INC	9,287	42.650	396,090.550	
NXP SEMICONDUCTOR NV	22,652	107.250	2,429,427.000	
TARGA RESOURCES CORP	19,038	38.710	736,960.980	
LEAR CORP	4,681	110.100	515,378.100	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	8,622	117.080	1,009,463.760	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	17,268	49.130	848,376.840	
DOLLAR GENERAL CORP	20,252	160.520	3,250,851.040	
FORTINET INC	11,150	77.600	865,240.000	
AON PLC	19,041	188.890	3,596,654.490	
TESLA INC	10,304	244.740	2,521,800.960	
GENERAL MOTORS CO	100,695	34.660	3,490,088.700	
XPO LOGISTICS INC	8,181	71.040	581,178.240	
TRIPADVISOR INC	9,263	37.830	350,419.290	
ALLY FINANCIAL INC	33,215	30.880	1,025,679.200	
CAPRI HOLDINGS LTD	12,138	28.250	342,898.500	
VOYA FINANCIAL INC	10,273	51.850	532,655.050	
APTIV PLC	20,610	83.170	1,714,133.700	
PHILLIPS 66	35,701	106.600	3,805,726.600	
FACEBOOK INC	189,729	180.030	34,156,911.870	
IQVIA HOLDINGS INC	13,453	144.890	1,949,205.170	
DIAMONDBACK ENERGY INC	13,109	82.540	1,082,016.860	
SERVICENOW INC	14,548	263.180	3,828,742.640	
PALO ALTO NETWORKS INC	7,242	209.300	1,515,750.600	
WORKDAY INC	13,168	174.320	2,295,445.760	
ABBVIE INC	116,273	74.450	8,656,524.850	
ZOETIS INC	38,223	127.410	4,869,992.430	
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDINGS LTD	16,899	48.090	812,672.910	
COTY INC	23,813	10.070	239,796.910	

NEWS CORP/NEW-CL A	30,263	13.180	398,866.340	
HD SUPPLY HOLDINGS INC	14,075	37.490	527,671.750	
CDW CORP	11,406	122.540	1,397,691.240	
SPRINT CORP	63,882	6.270	400,540.140	
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	10,199	27.180	277,208.820	
ARCONIC INC	30,749	26.020	800,088.980	
TWILIO INC	8,128	110.290	896,437.120	
SNAP INC	51,731	14.080	728,372.480	
LIBERTY MEDIA CORP- LIBERTY-C	14,304	40.950	585,748.800	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	5,006	42.120	210,852.720	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-C	14,205	42.620	605,417.100	
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	15,410	17.850	275,068.500	
OKTA INC	8,816	114.570	1,010,049.120	
BAKER HUGHES A GE CO	51,005	21.800	1,111,909.000	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	10,669	76.410	815,218.290	
ALTICE USA INC-A	13,887	28.250	392,307.750	
TECHNIPFMC LTD	31,257	22.920	716,410.440	
BROADCOM INC	31,228	274.450	8,570,524.600	
MONGODB INC	2,869	132.470	380,056.430	
BURLINGTON STORES INC	5,095	197.330	1,005,396.350	
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	9,985	35.730	356,764.050	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	29,578	26.550	785,295.900	
VEEVA SYSTEMS INC	9,780	150.290	1,469,836.200	
TWITTER INC	57,562	39.540	2,276,001.480	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING PLC	13,214	46.960	620,529.440	
EVERGY INC	18,388	63.470	1,167,086.360	
PLAINS GP HOLDINGS LP	14,935	19.920	297,505.200	
ALLEGION PLC	7,469	100.700	752,128.300	
STERIS PLC	6,658	139.700	930,122.600	
DOCUSIGN INC	9,325	67.140	626,080.500	
WIX.COM LTD	4,000	124.750	499,000.000	
DROPBOX INC	17,573	18.760	329,669.480	
KKR & CO INC	37,307	26.170	976,324.190	
PERRIGO CO PLC	10,553	52.000	548,756.000	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	22,290	91.550	2,040,649.500	
ARAMARK	18,144	43.400	787,449.600	
CIGNA CORP	30,329	150.830	4,574,523.070	
DELL TECHNOLOGIES INC	12,960	49.000	635,040.000	
DOW INC	59,468	44.920	2,671,302.560	
AMCOR PLC	130,000	9.320	1,211,600.000	
XEROX HOLDINGS CORP	17,455	28.820	503,053.100	
FOX CORP-A	30,595	30.520	933,759.400	
FOX CORP-B	13,009	30.425	395,798.820	
UBER TECHNOLOGIES INC	13,312	28.870	384,317.440	

CORTEVA INC	59,322	25.730	1,526,355.060	
GRUBHUB INC	8,158	53.600	437,268.800	
PAYCOM SOFTWARE INC	3,772	214.180	807,886.960	
SABRE CORP	19,809	21.230	420,545.070	
PARSLEY ENERGY INC	25,677	16.450	422,386.650	
ARISTA NETWORKS INC	4,441	227.720	1,011,304.520	
IHS MARKIT LTD	29,796	67.970	2,025,234.120	
FNF GROUP	21,372	44.200	944,642.400	
SYNCHRONY FINANCIAL	50,790	32.490	1,650,167.100	
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	35,820	33.770	1,209,641.400	
CYBERARK SOFTWARE LTD	3,457	101.980	352,544.860	
CDK GLOBAL INC	9,969	45.580	454,387.020	
WAYFAIR INC	5,091	104.660	532,824.060	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	15,515	94.430	1,465,081.450	
QORVO INC	8,871	76.800	681,292.800	
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	16,888	34.000	574,192.000	
LIBERTY BROADBAND CORP-C W/I	8,307	107.350	891,756.450	
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	17,018	28.820	490,458.760	
SPECTRUM BRANDS HOLDINGS INC	519	47.550	24,678.450	
GODADDY INC	14,641	60.350	883,584.350	
NIELSEN HOLDINGS PLC	26,204	20.260	530,893.040	
TRANSUNION	15,000	79.810	1,197,150.000	
SQUARE INC	26,487	62.030	1,642,988.610	
DUPONT DE NEMOURS INC	59,916	63.140	3,783,096.240	
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS PLC	19,321	56.180	1,085,453.780	
WESTROCK CO	18,059	35.410	639,469.190	
KRAFT HEINZ CO	51,163	26.940	1,378,331.220	
FORTIVE CORP	24,560	65.430	1,606,960.800	
WASTE CONNECTIONS INC	20,417	92.360	1,885,714.120	
ALPHABET INC-CL A	23,530	1,209.470	28,458,829.100	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	104,040	14.110	1,468,004.400	
PAYPAL HOLDINGS INC	87,864	100.540	8,833,846.560	
AXA EQUITABLE HOLDINGS INC	23,220	20.540	476,938.800	
DXC TECHNOLOGY CO	20,848	26.590	554,348.320	
ZILLOW GROUP INC-C	11,723	28.770	337,270.710	
ALPHABET INC-CL C	24,708	1,208.670	29,863,818.360	
BEIGENE LTD ADR	3,159	116.550	368,181.450	
LINDE PLC	43,407	191.230	8,300,720.610	
ATHENE HOLDING LTD	11,847	38.160	452,081.520	
ROKU INC	6,674	116.130	775,051.620	

	CHARTER COMMUNICATIONS INC	12,571	426.930	5,366,937.030	
	VISTRA ENERGY CORP	30,000	26.920	807,600.000	
アメリカ・ドル	小計	23,832,404		1,967,532,486.290 (212,749,287,739)	
イギリス・ポンド	ANTOFAGASTA PLC	31,798	8.640	274,734.720	
	ASHTED GROUP	36,689	21.500	788,813.500	
	SEVERN TRENT PLC	18,217	21.220	386,564.740	
	BHP GROUP PLC	168,058	16.966	2,851,272.020	
	BARCLAYS PLC	1,342,831	1.492	2,003,503.850	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	82,283	5.868	482,836.640	
	BT GROUP PLC	629,282	1.848	1,162,913.130	
	BUNZL PLC	27,838	19.870	553,141.060	
	EASYJET PLC	13,628	11.080	150,998.240	
	AVIVA PLC	314,691	3.812	1,199,602.090	
	CRODA INTERNATIONAL	10,391	47.600	494,611.600	
	DIAGEO PLC	187,608	33.215	6,231,399.720	
	SCHRODERS PLC	10,932	28.880	315,716.160	
	DCC PLC	7,898	68.560	541,486.880	
	NATIONAL GRID PLC	262,780	8.708	2,288,288.240	
	KINGFISHER PLC	165,680	1.928	319,431.040	
	BAE SYSTEMS PLC	248,672	5.532	1,375,653.500	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	182,423	28.100	5,126,086.300	
	HALMA PLC	27,812	19.070	530,374.840	
	NEXT PLC	10,018	59.520	596,271.360	
	IMPERIAL BRANDS PLC	77,987	18.726	1,460,384.560	
	JOHNSON MATTHEY PLC	15,017	29.080	436,694.360	
	ANGLO AMERICAN PLC	84,546	19.236	1,626,326.850	
	COMPASS GROUP PLC	125,998	20.310	2,559,019.380	
	HSBC HOLDINGS PLC	1,596,388	5.980	9,546,400.240	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	450,601	2.410	1,085,948.410	
	CENTRICA PLC	471,340	0.666	313,912.440	
	UNILEVER PLC	87,137	47.795	4,164,712.910	
	MEGGITT PLC	62,181	6.266	389,626.140	
	MORRISON SUPERMARKETS	168,676	1.950	328,918.200	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	54,487	7.912	431,101.140	
	RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	80,864	5.060	409,171.840	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	30,240	21.060	636,854.400	
	PEARSON PLC	65,009	6.948	451,682.530	
	PERSIMMON PLC	26,085	20.630	538,133.550	
	PRUDENTIAL PLC	204,940	14.400	2,951,136.000	
	RIO TINTO PLC	87,857	41.040	3,605,651.280	
	VODAFONE GROUP PLC	2,125,994	1.628	3,461,118.230	

RECKITT BENCKISER GROUP PLC	56,430	61.750	3,484,552.500	
RELX PLC	153,894	18.690	2,876,278.860	
RENTOKIL INITIAL PLC	140,617	4.566	642,057.220	
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	139,268	7.340	1,022,227.120	
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	397,434	1.958	778,175.770	
ST JAMES'S PLACE PLC	48,466	9.302	450,830.730	
SSE PLC	83,105	12.455	1,035,072.770	
BP PLC	1,608,793	5.020	8,076,140.860	
SAGE GROUP PLC(THE)	87,111	6.790	591,483.690	
SMITHS GROUP PLC	31,720	15.695	497,845.400	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	5,518	75.350	415,781.300	
STANDARD CHARTERED PLC	218,329	6.472	1,413,025.280	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	5,606,356	0.526	2,948,943.250	
TAYLOR WIMPLEY PLC	252,287	1.477	372,627.890	
TESCO PLC	757,316	2.274	1,722,136.580	
3I GROUP PLC	76,643	10.605	812,799.010	
SMITH & NEPHEW PLC	68,027	18.860	1,282,989.220	
GLAXOSMITHKLINE PLC	393,231	17.120	6,732,114.720	
WEIR GROUP	19,161	13.485	258,386.080	
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	24,660	72.880	1,797,220.800	
WPP PLC	95,148	9.638	917,036.420	
ASTRAZENECA PLC	103,134	70.520	7,273,009.680	
WHITBREAD PLC	9,814	40.380	396,289.320	
CARNIVAL PLC	13,350	31.460	419,991.000	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	176,730	1.666	294,432.180	
JOHN WOOD GROUP PLC	48,988	3.291	161,219.500	
INTERTEK GROUP PLC	12,083	52.800	637,982.400	
BURBERRY GROUP PLC	31,686	20.480	648,929.280	
INVESTEC PLC	50,655	4.038	204,544.890	
INTERCONTINENTAL HOTELS	12,653	48.195	609,811.330	
ITV PLC	254,308	1.217	309,492.830	
SAINSBURY (J) PLC	137,215	2.056	282,114.040	
G4S PLC	122,250	1.861	227,507.250	
ADMIRAL GROUP PLC	15,893	20.370	323,740.410	
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	10,726	40.140	430,541.640	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	343,568	23.155	7,955,317.040	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	296,907	23.040	6,840,737.280	
TUI AG-DI	29,824	9.194	274,201.850	
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	214,715	2.723	584,668.940	
EXPERIAN PLC	70,598	25.080	1,770,597.840	

	MONDI PLC	39,767	15.770	627,125.590	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	20,927	17.670	369,780.090	
	FRESNILLO PLC NPR	15,639	6.542	102,310.330	
	OCADO GROUP PLC	40,627	12.980	527,338.460	
	INFORMA PLC	102,475	7.856	805,043.600	
	GLENCORE PLC	866,421	2.320	2,010,096.720	
	GVC HOLDINGS PLC	49,618	8.076	400,714.960	
	EVRAZ PLC	48,765	4.140	201,887.100	
	NMC HEALTH PLC	8,149	25.440	207,310.560	
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP PLC	112,694	2.754	310,359.270	
	COCA-COLA HBC AG	15,208	25.460	387,195.680	
	MERLIN ENTERTAINMENTS PLC	50,037	4.530	226,667.610	
	FERGUSON PLC	18,865	64.020	1,207,737.300	
	MICRO FOCUS INTERNATIONAL PLC	26,100	10.638	277,651.800	
	AUTO TRADER GROUP PLC	76,348	4.909	374,792.330	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	417,620	1.948	813,523.760	
イギリス・ポンド 小計		23,722,747		138,692,881.420 (18,650,031,765)	
イスラエル・ シュケル	BANK HAPOALIM BM	79,754	26.750	2,133,419.500	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	128,049	24.810	3,176,895.690	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,760	574.500	1,011,120.000	
	ISRAEL DISCOUNT BANK LTD	102,134	15.580	1,591,247.720	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	49,411	16.090	795,022.990	
	NICE LTD	4,902	528.500	2,590,707.000	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	10,444	88.300	922,205.200	
	AZRIELI GROUP	2,291	271.200	621,319.200	
イスラエル・シュケル 小計		378,745		12,841,937.300 (395,531,669)	
オーストラリ ア・ドル	RAMSAY HEALTH CARE LTD	11,115	66.280	736,702.200	
	AUST AND NZ BANKING GROUP LT	219,575	27.180	5,968,048.500	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	274,793	28.530	7,839,844.290	
	BANK OF QUEENSLAND LTD	30,569	9.590	293,156.710	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	115,662	8.460	978,500.520	
	TELSTRA CORP LTD	360,654	3.510	1,265,895.540	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD	39,014	11.120	433,835.680	
	AMP LTD	302,414	1.595	482,350.330	
	ASX LTD	15,573	79.290	1,234,783.170	
	BHP GROUP LTD	230,460	35.070	8,082,232.200	
	CALTEX AUSTRALIA LTD	20,946	25.430	532,656.780	
	HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	70,363	4.180	294,117.340	

COMPUTERSHARE LT	38,040	15.520	590,380.800	
CSL LIMITED	36,126	239.810	8,663,376.060	
REA GROUP LTD	4,119	110.010	453,131.190	
TRANSURBAN GROUP	209,477	14.940	3,129,586.380	
COCA-COLA AMATIL LTD	48,601	10.370	503,992.370	
COCHLEAR LTD	4,381	205.750	901,390.750	
ORIGIN ENERGY LTD	132,860	7.780	1,033,650.800	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	137,350	78.100	10,727,035.000	
BORAL LIMITED	86,101	4.620	397,786.620	
RIO TINTO LIMITED	30,337	87.920	2,667,229.040	
APA GROUP	94,106	11.250	1,058,692.500	
ARISTOCRAT LEISU	45,323	30.760	1,394,135.480	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	180,573	7.590	1,370,549.070	
TPG TELECOM LTD	28,719	6.900	198,161.100	
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	3,275	41.730	136,665.750	
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	33,926	24.330	825,419.580	
ORICA LTD	27,865	22.820	635,879.300	
CIMIC GROUP LTD	8,709	30.870	268,846.830	
LEND LEASE CORP LTD	42,974	16.960	728,839.040	
BLUESCOPE STEEL LTD	36,941	11.440	422,605.040	
SYDNEY AIRPORT	85,130	8.210	698,917.300	
MACQUARIE GROUP LTD	26,417	126.630	3,345,184.710	
WORLEYPARSONS LTD	19,922	12.410	247,232.020	
SUNCORP GROUP LTD	104,783	13.380	1,401,996.540	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	226,421	28.020	6,344,316.420	
NEWCREST MINING LTD	62,080	35.770	2,220,601.600	
OIL SEARCH LTD	105,470	6.910	728,797.700	
INCITEC PIVOT LTD	136,426	3.250	443,384.500	
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	107,820	12.090	1,303,543.800	
CHALLENGER FINANCIAL SERVICES	45,707	6.820	311,721.740	
SANTOS LTD	132,862	7.360	977,864.320	
SONIC HEALTHCARE	34,684	28.540	989,881.360	
WASHINGTON H SOUL PATTINSON & CO LTD	15,007	21.400	321,149.800	
TABCORP HOLDINGS LTD	148,535	4.820	715,938.700	
WESFARMERS LTD	91,516	38.960	3,565,463.360	
ALUMINA LIMITED	184,613	2.260	417,225.380	
WOODSIDE PETROLEUM LTD	69,115	30.890	2,134,962.350	
WOOLWORTHS GROUP LTD	101,937	37.020	3,773,707.740	
MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	9,995	47.370	473,463.150	
SEEK LTD	25,899	20.860	540,253.140	

	AUSNET SERVICES	165,066	1.805	297,944.130	
	AGL ENERGY LTD	49,644	19.110	948,696.840	
	BRAMBLES LTD	126,693	11.400	1,444,300.200	
	CROWN RESORTS LTD	32,861	11.910	391,374.510	
	AURIZON HOLDINGS LTD	150,150	5.850	878,377.500	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	54,001	17.820	962,297.820	
	MEDIBANK PVT LTD	206,910	3.230	668,319.300	
	SOUTH32 LTD(AUD)	443,160	2.420	1,072,447.200	
	COLES GROUP LTD	96,821	15.200	1,471,679.200	
	オーストラリア・ドル 小計	5,980,586		103,340,518.290 (7,564,525.939)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	19,876	73.170	1,454,326.920	
	ALIMENTATION COUCHE TARD INC	68,496	40.100	2,746,689.600	
	BARRICK GOLD CORP	140,953	23.810	3,356,090.930	
	ATCO LTD	7,193	48.930	351,953.490	
	BANK OF MONTREAL	50,286	96.140	4,834,496.040	
	BANK OF NOVA SCOTIA	97,707	74.810	7,309,460.670	
	NATIONAL BANK OF CANADA	25,548	66.090	1,688,467.320	
	BCE INC	11,673	65.060	759,445.380	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT	66,522	69.550	4,626,605.100	
	BAUSCH HEALTH COS INC	25,819	25.620	661,482.780	
	BOMBARDIER INC 'B'	151,615	1.620	245,616.300	
	SAPUTO INC	18,601	38.670	719,300.670	
	BLACKBERRY LTD	39,652	6.750	267,651.000	
	CGI INC	20,610	103.810	2,139,524.100	
	CCL INDUSTRIES INC	11,340	53.340	604,875.600	
	CAE INC	23,000	32.400	745,200.000	
	CAMECO CORP	32,627	12.680	413,710.360	
	ROGERS COMM-CL B	27,696	63.670	1,763,404.320	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	34,564	108.660	3,755,724.240	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	96,491	33.070	3,190,957.370	
	CANADIAN TIRE CORP-CL A	4,862	144.000	700,128.000	
	CANADIAN UTILITIES LTD	9,119	39.470	359,926.930	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	57,704	113.700	6,560,944.800	
	FIRST CAPITAL REALTY INC	17,676	22.500	397,710.000	
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	15,911	46.350	737,474.850	
	OPEN TEXT CORP	21,795	53.620	1,168,647.900	
	EMPIRE CO LTD	15,093	35.500	535,801.500	
	KINROSS GOLD CORP	99,741	6.340	632,357.940	
	FORTIS INC	32,068	56.220	1,802,862.960	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	55,296	9.640	533,053.440	
	TELUS CORP	15,945	47.760	761,533.200	
	GREAT WEST LIFECO INC	20,722	30.400	629,948.800	

IMPERIAL OIL LTD	21,542	31.730	683,527.660	
ENBRIDGE INC	161,215	47.400	7,641,591.000	
IGM FINANCIAL INC	8,426	36.710	309,318.460	
MANULIFE FINANCIAL CORP	154,854	23.460	3,632,874.840	
LOBLAW CO LTD	15,354	73.430	1,127,444.220	
MAGNA INTERNATIONAL INC	25,247	66.910	1,689,276.770	
SUN LIFE FINANCIAL INC	47,728	57.630	2,750,564.640	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,072	556.330	1,152,715.760	
METRO INC	19,949	57.200	1,141,082.800	
HUSKY ENERGY INC	28,749	8.800	252,991.200	
EMERA INC	19,138	57.950	1,109,047.100	
METHANEX CORP	5,281	45.760	241,658.560	
ONEX CORP	6,646	78.300	520,381.800	
POWER CORP OF CANADA	23,792	29.930	712,094.560	
POWER FINANCIAL CORP	21,676	30.150	653,531.400	
QUEBECOR INC-B	17,548	30.640	537,670.720	
ROYAL BANK OF CANADA	113,038	105.760	11,954,898.880	
SNC-LAVALIN GROUP INC	13,134	17.520	230,107.680	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	10,747	284.740	3,060,100.780	
SHAW COMM INC-B	35,431	26.150	926,520.650	
SUNCOR ENERGY INC	123,985	39.200	4,860,212.000	
LUNDIN MINING CORP	43,480	6.460	280,880.800	
ENCANA CORP	96,391	5.700	549,428.700	
TECK RESOURCES LTD-CL B	41,016	21.080	864,617.280	
THOMSON REUTERS CORP	16,394	89.140	1,461,361.160	
TORONTO DOMINION BANK (THE) C\$	143,825	73.030	10,503,539.750	
TC ENERGY CORP	72,907	68.130	4,967,153.910	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	5,696	51.080	290,951.680	
WESTON (GEORGE) LTD	6,184	110.960	686,176.640	
INTACT FINANCIAL CORP	10,989	136.320	1,498,020.480	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	34,963	36.310	1,269,506.530	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,565	1,337.260	2,092,811.900	
FRANCO-NEVADA CORP NPR	14,922	127.650	1,904,793.300	
CI FINANCIAL CORP	20,695	18.650	385,961.750	
TOURMALINE OIL CORP	13,354	10.720	143,154.880	
KEYERA CORP	16,668	30.530	508,874.040	
ALTAGAS LTD	23,944	19.100	457,330.400	
PEMBINA PIPELINE CORP	38,119	47.200	1,799,216.800	
DOLLARAMA INC	23,536	47.400	1,115,606.400	
STARS GROUP INC	18,529	26.530	491,574.370	
CENOVUS ENERGY INC W/I	80,721	10.850	875,822.850	
VERMILION ENERGY INC	12,923	19.580	253,032.340	
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	14,127	61.410	867,539.070	

	INTER PIPELINE LTD	27,474	22.410	615,692.340	
	NUTRIEN LTD	44,453	66.120	2,939,232.360	
	CRONOS GROUP INC	16,000	10.580	169,280.000	
	WSP GLOBAL INC	8,400	76.280	640,752.000	
	IA FINANCIAL CORP INC	8,104	59.460	481,863.840	
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	14,961	16.490	246,706.890	
	AIR CANADA	10,722	44.810	480,452.820	
	RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	18,531	94.690	1,754,700.390	
	AURORA CANNABIS INC	66,562	4.960	330,147.520	
	SHOPIFY INC	7,998	431.240	3,449,057.520	
	CANOPY GROWTH CORP	18,634	27.160	506,099.440	
	HYDRO ONE LTD	27,340	24.950	682,133.000	
カナダ・ドル 小計		3,231,880		147,206,457.140 (11,972,301,159)	
シンガポール・ ドル	SINGAPORE TECH ENG	125,000	4.010	501,250.000	
	SEBACORP INDUSTRIES	81,400	2.100	170,940.000	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	123,700	2.120	262,244.000	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	692,140	0.210	145,349.400	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	141,900	24.710	3,506,349.000	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	36,400	9.700	353,080.000	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	5,944	29.890	177,666.160	
	SINGAPORE AIRPORT TERMINAL SERVICES LTD	47,800	4.810	229,918.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	68,900	8.220	566,358.000	
	CAPITALAND LTD	204,515	3.510	717,847.650	
	GENTING SINGAPORE LTD	416,400	0.900	374,760.000	
	KEPPEL CORP LTD	100,200	5.900	591,180.000	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	177,900	2.420	430,518.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	251,553	10.650	2,679,039.450	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	670,722	3.150	2,112,774.300	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	47,500	9.010	427,975.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	103,200	25.490	2,630,568.000	
	UOL GROUP LIMITED	40,500	7.300	295,650.000	
	VENTURE CORP LTD	21,000	15.170	318,570.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	142,300	3.600	512,280.000	
YANGZIJANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	188,800	0.935	176,528.000		
シンガポール・ドル 小計		3,687,774		17,180,844.960 (1,351,445,265)	
スイス・フラン	CREDIT SUISSE GROUP AG	207,887	11.610	2,413,568.070	
	NESTLE SA-REGISTERED	241,926	107.540	26,016,722.040	
	CIE FINANC RICHEMONT	40,915	71.100	2,909,056.500	

	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN	55,462	287.250	15,931,459.500	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2,930	219.600	643,428.000	
	SIKA INHABER	10,209	153.150	1,563,508.350	
	SGS SA-REG	424	2,377.000	1,007,848.000	
	NOVARTIS AG-REG SHS	169,630	85.400	14,486,402.000	
	BALOISE HOLDING AG -R	4,127	177.600	732,955.200	
	BARRY CALLEBAUT AG	157	2,056.000	322,792.000	
	CLARIANT AG-REG	19,496	20.150	392,844.400	
	SWISSCOM AG-REG	1,960	500.400	980,784.000	
	ABB LTD	144,013	18.125	2,610,235.620	
	ADECCO GROUP AG-REG	12,944	54.120	700,529.280	
	GEBERIT AG	2,901	466.000	1,351,866.000	
	LONZA GROUP AG-REG	5,793	328.300	1,901,841.900	
	LINDT & SPRUENGLI PART	79	7,190.000	568,010.000	
	LINDT & SPRUENGLI NAMEN	9	81,000.000	729,000.000	
	GIVAUDAN-REG	742	2,795.000	2,073,890.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	12,042	383.000	4,612,086.000	
	LAFARGEHOLCIM LTD	37,997	46.510	1,767,240.470	
	TEMENOS GROUP	4,730	164.750	779,267.500	
	SONOVA HOLDING AG	4,584	224.500	1,029,108.000	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG	4,018	148.950	598,481.100	
	STRAUMANN HOLDING AG	794	830.000	659,020.000	
	THE SWATCH GROUP AG-B	2,134	256.700	547,797.800	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	4,592	48.560	222,987.520	
	SCHINDLER NAMEN	1,663	219.200	364,529.600	
	SWISS LIFE HOLDING AG	2,774	470.600	1,305,444.400	
	VIFOR PHARMA AG	3,465	160.950	557,691.750	
	EMS-CHEMIE HOLDING	633	621.000	393,093.000	
	SWISS PRIME SITE AG	5,990	99.550	596,304.500	
	PARGESA HOLDING PORTEUR	3,000	75.450	226,350.000	
	DUFREY GROUP	3,138	80.080	251,291.040	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,505	750.000	1,128,750.000	
	JULIUS BAER GROUP LTD	17,849	42.240	753,941.760	
	SWISS RE LTD	24,816	103.000	2,556,048.000	
	ALCON INC	32,032	56.060	1,795,713.920	
	UBS GROUP AG	301,686	10.720	3,234,073.920	
スイス・フラン	小計	1,391,046		100,715,961.140 (10,925,667,464)	
スウェーデン・ クローナ	ATLAS COPCO AB-A SHS	52,284	295.600	15,455,150.400	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	33,303	259.800	8,652,119.400	
	ERICSSON LM-B SHS	236,160	81.880	19,336,780.800	
	LUNDBERGS B	7,382	355.000	2,620,610.000	
	SKF AB-B SHS	28,812	163.450	4,709,321.400	
	SANDVIK AB	87,784	149.750	13,145,654.000	

	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	130,827	89.660	11,729,948.820	
	SKANSKA AB-B SHS	24,400	198.400	4,840,960.000	
	SWEDBANK AB	71,958	135.950	9,782,690.100	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	126,705	90.680	11,489,609.400	
	VOLVO AB-B SHS	119,227	134.900	16,083,722.300	
	SWEDISH MATCH AB	12,941	399.000	5,163,459.000	
	TELE2 AB-B SHS	34,618	141.100	4,884,599.800	
	INDUSTRIVARDEN C	11,403	199.500	2,274,898.500	
	ELECTROLUX AB-SER B	19,191	240.700	4,619,273.700	
	SECURITAS AB-B SHS	24,098	147.500	3,554,455.000	
	INVESTOR AB-B SHS	35,180	470.600	16,555,708.000	
	HENNES&MAURITZ AB-B SHS	60,283	202.300	12,195,250.900	
	ASSA ABLOY AB-B	81,088	213.000	17,271,744.000	
	TELIA CO AB	231,855	44.340	10,280,450.700	
	LUNDIN PETROLEUM AB	16,790	296.000	4,969,840.000	
	BOLIDEN AB	21,855	238.600	5,214,603.000	
	ALFA LAVAL AB	23,343	195.850	4,571,726.550	
	KINNEVIK AB-B	18,310	254.800	4,665,388.000	
	MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR SA	5,332	453.600	2,418,595.200	
	ICA GRUPPEN AB	5,920	443.500	2,625,520.000	
	HUSQVARNA AB-B SHS	33,692	72.760	2,451,429.920	
	HEXAGON AB	22,037	441.500	9,729,335.500	
	EPIROC AB-A	48,955	107.200	5,247,976.000	
	EPIROC AB-B	30,899	102.650	3,171,782.350	
	ESSITY AB-B	46,640	282.700	13,185,128.000	
	NORDEA BANK ABP	259,268	68.280	17,702,819.040	
	スウェーデン・クローナ 小計	1,962,540		270,600,549.780 (2,973,900,042)	
デンマーク・ク ローネ	CARLSBERG AS-B	8,441	999.000	8,432,559.000	
	A P MOLLER A/S	604	7,658.000	4,625,432.000	
	AP MOLLER MAERSK A	273	7,270.000	1,984,710.000	
	DANSKE BANK A/S	51,034	92.040	4,697,169.360	
	GENMAB A/S	4,745	1,322.500	6,275,262.500	
	NOVOZYMES-B SHS	15,533	283.300	4,400,498.900	
	NOVO NORDISK A/S-B	140,645	349.300	49,127,298.500	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	15,604	524.000	8,176,496.000	
	COLOPLAST-B	9,729	775.000	7,539,975.000	
	DSV PANALPINA A/S	17,626	632.200	11,143,157.200	
	DEMANT A/S	7,244	161.700	1,171,354.800	
	H LUNDBECK A/S	4,840	224.400	1,086,096.000	
	TRYG A/S	11,107	184.900	2,053,684.300	
	PANDORA A/S	8,251	267.300	2,205,492.300	
	CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S	7,539	525.800	3,964,006.200	
	ISS A/S	11,107	161.550	1,794,335.850	

	ORSTED A/S	15,090	620.000	9,355,800.000	
デンマーク・クローネ 小計		329,412		128,033,327.910 (2,040,851,247)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	85,245	8.920	760,385.400	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	29,894	13.150	393,106.100	
	A2 MILK CO LTD	55,091	12.910	711,224.810	
	FISHER & PAYKEL	43,184	16.900	729,809.600	
	FLETCHER BUILDING LTD	64,104	4.740	303,852.960	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	159,623	4.480	715,111.040	
	MERIDIAN ENERGY LTD	90,173	5.275	475,662.570	
ニュージーランド・ドル 小計		527,314		4,089,152.480 (279,534,464)	
ノルウェー・クローネ	MOWI ASA	35,183	212.200	7,465,832.600	
	DNB ASA	79,858	157.050	12,541,698.900	
	NORSK HYDRO ASA	93,139	31.700	2,952,506.300	
	TELENOR ASA	54,766	180.200	9,868,833.200	
	ORKLA ASA	64,938	85.380	5,544,406.440	
	EQUINOR ASA	81,022	168.150	13,623,849.300	
	YARA INTERNATIONAL ASA	12,535	388.800	4,873,608.000	
	AKER BP ASA	8,552	245.600	2,100,371.200	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	16,683	180.950	3,018,788.850	
	SCHIBSTED ASA	7,445	247.600	1,843,382.000	
ノルウェー・クローネ 小計		454,121		63,833,276.790 (757,062,663)	
ユーロ	CRH PLC	61,990	30.230	1,873,957.700	
	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	6,246	87.100	544,026.600	
	KERRY GROUP PLC-A	12,258	105.300	1,290,767.400	
	KINGSPAN GROUP PLC	11,768	44.420	522,734.560	
	UMICORE	14,115	35.370	499,247.550	
	AIR LIQUIDE	34,252	117.550	4,026,322.600	
	AIRBUS SE	46,450	117.920	5,477,384.000	
	AXA	153,753	22.755	3,498,649.510	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	44,449	22.890	1,017,437.610	
	ADIDAS AG	14,421	278.600	4,017,690.600	
	ASSICURAZIONI GENERALI	87,030	17.870	1,555,226.100	
	DASSAULT AVIATION SA	163	1,222.000	199,186.000	
	DANONE	48,833	78.620	3,839,250.460	
	SAFRAN SA	25,898	140.700	3,643,848.600	
	INTESA SANPAOLO	1,154,007	2.149	2,479,961.040	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	25,603	63.230	1,618,877.690	
	ACCOR SA	16,000	37.320	597,120.000	
	BOUYGUES	17,572	37.880	665,627.360	
	BNP PARIBAS	87,496	43.690	3,822,700.240	
	THALES SA	8,549	97.020	829,423.980	

CAPGEMINI SA	12,515	107.350	1,343,485.250	
CASINO GUICHARD PERRACHON	4,264	42.130	179,642.320	
INGENICO GROUP	4,334	91.600	396,994.400	
UNICREDIT SPA	155,718	10.564	1,645,004.950	
NATIXIS	70,166	3.557	249,580.460	
KONINKLIJKE DSM NV	13,812	105.950	1,463,381.400	
COMMERZBANK AG	83,118	4.992	414,925.050	
EIFFAGE	6,461	93.180	602,035.980	
FRESENIUS SE & CO KGAA	34,325	41.265	1,416,421.120	
UNITED INTERNET	9,882	33.750	333,517.500	
FUCHS PETROLUB SE PREF	5,546	33.100	183,572.600	
PUBLICIS GROUPE	15,071	42.520	640,818.920	
FAURECIA	6,117	41.840	255,935.280	
IBERDROLA SA	475,457	9.298	4,420,799.180	
ENI SPA	197,346	13.682	2,700,087.970	
IMERYS SA	2,256	34.460	77,741.760	
JERONIMO MARTINS	19,517	15.065	294,023.600	
KBC GROUPE	18,480	59.000	1,090,320.000	
HANNOVER RUECK SE	4,868	154.200	750,645.600	
WARTSILA OYJ	34,935	9.948	347,533.380	
L'OREAL	19,882	245.300	4,877,054.600	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	21,883	376.850	8,246,608.550	
GEA GROUP AG	11,838	24.820	293,819.160	
BOLLORE	71,347	3.582	255,564.950	
MEDIOBANCA SPA	56,009	9.910	555,049.190	
MICHELIN(CGDE)-B	13,744	98.580	1,354,883.520	
CONTINENTAL AG	8,312	112.840	937,926.080	
DEUTSCHE POST AG-REG	77,008	29.040	2,236,312.320	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	15,885	11.600	184,266.000	
NOKIAN RENKAAT OYJ	9,399	26.190	246,159.810	
OMV AG	12,817	48.750	624,828.750	
VERBUND AG	4,095	46.900	192,055.500	
PERNOD-RICARD	16,719	170.400	2,848,917.600	
PEUGEOT SA	43,905	22.010	966,349.050	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG- PFD	13,249	60.220	797,854.780	
RENAULT SA	14,917	50.800	757,783.600	
REPSOL SA	111,616	14.310	1,597,224.960	
REMY COINTREAU	1,860	125.300	233,058.000	
MERCK KGAA	9,875	103.850	1,025,518.750	
COMPAGNIE DE SAINT- GOBAIN	39,436	35.240	1,389,724.640	
RWE AG	41,119	27.130	1,115,558.470	
SEB SA	1,551	135.500	210,160.500	
SOCIETE GENERALE-A	58,575	23.990	1,405,214.250	
VINCI S.A.	40,007	97.120	3,885,479.840	

SODEXO	7,075	97.740	691,510.500	
SOLVAY SA	5,563	92.660	515,467.580	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	43,656	78.280	3,417,391.680	
VIVENDI SA	73,790	24.750	1,826,302.500	
SAP SE	77,393	104.940	8,121,621.420	
TELEFONICA S.A	367,755	6.891	2,534,199.700	
TOTAL SA	188,674	45.295	8,545,988.830	
VALEO	19,653	30.190	593,324.070	
E.ON SE	181,317	8.680	1,573,831.560	
VOEST-ALPINE AG	9,875	21.020	207,572.500	
HENKEL AG & CO KGAA	9,300	83.750	778,875.000	
SIEMENS AG-REG	61,207	96.490	5,905,863.430	
UPM-KYMMENE OYJ	44,548	27.480	1,224,179.040	
ING GROEP NV-CVA	304,508	9.467	2,882,777.230	
PUMA AG	7,351	70.600	518,980.600	
BAYER AG	74,253	64.140	4,762,587.420	
STORA ENSO OYJ-R SHS	41,234	11.305	466,150.370	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	13,759	92.180	1,268,304.620	
DAIMLER AG	70,984	45.540	3,232,611.360	
BASF SE	72,808	62.980	4,585,447.840	
BEIERSDORF AG	8,371	104.700	876,443.700	
HOCHTIEF AG	1,707	103.000	175,821.000	
HEIDELBERGCEMENT AG	12,031	61.700	742,312.700	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	16,214	59.340	962,138.760	
ORANGE	162,849	14.490	2,359,682.010	
SAMPO OYJ-A SHS	36,141	35.240	1,273,608.840	
RANDSTAD NV	9,074	44.620	404,881.880	
ALLIANZ SE	33,915	207.150	7,025,492.250	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	201,606	3.595	724,773.570	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	90,890	22.475	2,042,752.750	
HERMES INTL	2,483	631.600	1,568,262.800	
ENDESA S.A.	23,417	23.480	549,831.160	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	16,096	14.395	231,701.920	
ERSTE GROUP BANK AG	25,117	28.870	725,127.790	
MUENCHENER RUECKVER AG- REG	11,633	237.300	2,760,510.900	
ARCELOR MITTAL (NL)	46,739	12.706	593,865.730	
SOCIETE BIC SA	2,478	63.550	157,476.900	
DASSAULT SYSTEMES SA	10,913	135.050	1,473,800.650	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	20,137	35.100	706,808.700	
HEINEKEN NV	21,066	96.440	2,031,605.040	
AKZO NOBEL	17,491	81.900	1,432,512.900	
ASML HOLDING NV	33,749	230.550	7,780,831.950	
AEGON NV	150,349	3.786	569,221.310	
BANKINTER S.A.	57,960	5.810	336,747.600	

VOLKSWAGEN AG	2,645	153.800	406,801.000	
VOLKSWAGEN AG PFD	14,401	153.940	2,216,889.940	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	523,594	4.628	2,423,193.030	
KERING	5,915	462.600	2,736,279.000	
CNP ASSURANCES	13,987	17.460	244,213.020	
FORTUM OYJ	37,452	20.920	783,495.840	
AGEAS	14,365	50.340	723,134.100	
UCB SA	9,143	64.380	588,626.340	
THYSSENKRUPP AG	27,110	12.470	338,061.700	
CARREFOUR SA	51,094	15.055	769,220.170	
NATURGY ENERGY GROUP SA	23,612	23.720	560,076.640	
ATOS SE	6,718	65.460	439,760.280	
NOKIA OYJ	430,800	4.505	1,940,754.000	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	71,925	37.955	2,729,913.370	
WOLTERS KLUWER-CVA	22,865	64.780	1,481,194.700	
SANOFI	89,628	81.910	7,341,429.480	
STMICROELECTRONICS NV	55,611	17.920	996,549.120	
ELISA OYJ	10,787	47.330	510,548.710	
BANCO SANTANDER SA	1,337,561	3.636	4,863,371.790	
METSO OYJ	8,585	31.890	273,775.650	
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	34,596	17.910	619,614.360	
QIAGEN N.V.	17,974	24.580	441,800.920	
1&1 DRILLISCH AG	3,149	29.160	91,824.840	
DEUTSCHE BANK AG-REG	149,384	6.464	965,618.170	
BMW VORZUG	4,116	49.160	202,342.560	
ENEL SPA	652,089	6.767	4,412,686.260	
COLRUYT NV	4,673	49.380	230,752.740	
VOPAK (KON.)	5,364	48.230	258,705.720	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	263,592	15.304	4,034,011.960	
SARTORIUS AG	2,712	159.900	433,648.800	
LEONARDO SPA	28,316	9.916	280,781.450	
UBISOFT ENTERTAINMENT	5,935	56.880	337,582.800	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	99,068	16.168	1,601,731.420	
CARL ZEISS MEDITEC AG	3,771	102.500	386,527.500	
KONINKLIJKE KPN NV	291,029	2.930	852,714.970	
EUROFINS SCIENTIFIC	794	456.600	362,540.400	
TELEPERFORMANCE	4,421	194.700	860,768.700	
DEUTSCHE BOERSE AG	14,705	140.950	2,072,669.750	
EURAZEO	2,748	67.000	184,116.000	
BANCO SABADELL	407,477	0.903	367,951.730	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	6,689	87.040	582,210.560	
FRAPORT AG	3,149	74.920	235,923.080	
HEINEKEN HOLDING NV-A	9,791	88.550	866,993.050	
INDITEX	84,992	28.200	2,396,774.400	
JC DECAUX SA	6,058	23.640	143,211.120	
ANDRITZ AG	6,265	36.040	225,790.600	

MAPFRE SA	84,474	2.431	205,356.290	
ESSILORLUXOTTICA	22,811	132.500	3,022,457.500	
SNAM SPA	169,163	4.552	770,029.970	
CREDIT AGRICOLE SA	85,432	10.735	917,112.520	
ENAGAS	18,095	20.490	370,766.550	
WENDEL	2,220	123.400	273,948.000	
WIRECARD AG	8,963	140.500	1,259,301.500	
TENARIS SA	36,959	9.310	344,088.290	
TELECOM ITALIA SPA	762,675	0.532	405,743.100	
TELECOM ITALIA-RNC	497,596	0.512	254,769.150	
ATLANTIA SPA	37,365	21.460	801,852.900	
ILIAD SA	2,102	85.280	179,258.560	
PROXIMUS	14,283	28.030	400,352.490	
SES FDR	25,070	16.985	425,813.950	
TERNA SPA	113,654	5.704	648,282.410	
BIOMERIEUX	3,248	74.950	243,437.600	
GRIFOLS SA	23,518	27.000	634,986.000	
FERROVIAL SA	38,062	25.810	982,380.220	
LANXESS AG	6,856	56.380	386,541.280	
NESTE OYJ	32,931	29.030	955,986.930	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	9,641	20.280	195,519.480	
RECORDATI SPA	6,859	37.000	253,783.000	
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	39,752	8.470	336,699.440	
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	4,168	241.900	1,008,239.200	
KONE OYJ	26,502	52.040	1,379,164.080	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,884	121.700	229,282.800	
ENGIE	148,970	14.675	2,186,134.750	
ALSTOM	15,712	37.360	587,000.320	
TELENET GROUP HOLDING NV	3,634	42.520	154,517.680	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	12,542	17.460	218,983.320	
ELECTRICITE DE FRANCE	53,800	9.386	504,966.800	
IPSEN SA	3,646	86.950	317,019.700	
DEUTSCHE WOHNEN	26,722	33.750	901,867.500	
ARKEMA SA	5,033	82.480	415,121.840	
LEGRAND SA	20,673	65.660	1,357,389.180	
UNILEVER NV	115,908	54.110	6,271,781.880	
ADP	2,313	161.900	374,474.700	
ORION OYJ	8,051	33.070	266,246.570	
RTL GROUP SA	3,446	42.100	145,076.600	
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	40,088	13.460	539,584.480	
SYMRISE AG	9,988	85.000	848,980.000	
SCOR SE	13,875	36.190	502,136.250	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	17,397	27.540	479,113.380	
PRYSMIAN SPA	21,452	19.595	420,351.940	
CAIXABANK	297,224	2.405	714,823.720	

BUREAU VERITAS SA	23,179	21.380	495,567.020		
GETLINK	37,646	13.590	511,609.140		
SUEZ SA	26,620	13.340	355,110.800		
AMADEUS IT GROUP SA	33,891	65.840	2,231,383.440		
BRENTAG AG	12,353	43.000	531,179.000		
EVONIK INDUSTRIES AG	17,116	22.070	377,750.120		
EDENRED	19,188	42.340	812,419.920		
BANKIA SA	100,675	1.706	171,751.550		
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	61,541	2.565	157,852.660		
HUGO BOSS AG -ORD	5,218	44.770	233,609.860		
KION GROUP AG	4,567	46.690	213,233.230		
VONOVIA SE	41,548	46.810	1,944,861.880		
BANK OF IRELAND GROUP PLC	82,256	3.794	312,079.260		
KNORR-BREMSE AG	4,492	85.010	381,864.920		
SIEMENS HEALTHINEERS AG	11,468	34.535	396,047.380		
FERRARI NV	9,887	136.400	1,348,586.800		
METRO AG	10,774	14.370	154,822.380		
CNH INDUSTRIAL NV	77,951	9.286	723,852.980		
AROUNDTOWN SA	71,783	7.400	531,194.200		
AIB GROUP PLC	86,464	2.762	238,813.560		
MONCLER SPA	14,353	33.820	485,418.460		
PROSUS NV	39,000	64.570	2,518,230.000		
AXEL SPRINGER SE	4,978	62.500	311,125.000		
WORLDLINE SA	7,758	58.450	453,455.100		
NN GROUP NV	25,887	32.560	842,880.720		
FINECOBANK SPA	45,048	9.520	428,856.960		
ZALANDO SE	9,414	40.980	385,785.720		
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	89,977	11.618	1,045,352.780		
AENA SME SA	5,338	167.150	892,246.700		
CELLNEX TELECOM SAU	14,116	40.340	569,439.440		
ABN AMRO BANK NV	34,251	16.050	549,728.550		
EXOR NV	7,971	59.520	474,433.920		
COVESTRO AG	12,708	43.370	551,145.960		
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	60,646	83.590	5,069,399.140		
POSTE ITALIANE SPA	40,015	10.250	410,153.750		
AMUNDI SA	4,119	61.250	252,288.750		
ADYEN NV	706	621.800	438,990.800		
PIRELLI & C SPA	34,086	5.330	181,678.380		
UNIPER SE	14,252	27.120	386,514.240		
DELIVERY HERO SE	8,081	39.780	321,462.180		
ユーロ 小計	15,423,951		306,821,961.460 (36,514,881,633)		
香港・ドル	ASM PACIFIC TECH	19,100	101.500	1,938,650.000	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	164,000	17.580	2,883,120.000	
	BANK OF EAST ASIA	103,860	17.980	1,867,402.800	

CLP HOLDINGS LTD	136,000	79.600	10,825,600.000	
PCCW LTD	331,000	4.450	1,472,950.000	
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	49,500	52.650	2,606,175.000	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	94,440	232.000	21,910,080.000	
MTR CORP	126,000	42.700	5,380,200.000	
HANG SENG BANK LTD	58,500	158.000	9,243,000.000	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	115,450	36.000	4,156,200.000	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	101,500	52.900	5,369,350.000	
(THE) WHARF HOLDINGS LTD	95,750	16.860	1,614,345.000	
HONG KONG & CHINA GAS	774,755	14.960	11,590,334.800	
HYSAN DEVELOPMENT CO	50,000	28.500	1,425,000.000	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	178,000	48.250	8,588,500.000	
KERRY PROPERTIES LTD	73,500	23.500	1,727,250.000	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	277,000	25.100	6,952,700.000	
NWS HOLDINGS LTD	135,000	11.740	1,584,900.000	
YUE YUEN INDUSTRIAL HOLDINGS	50,500	21.100	1,065,550.000	
NEW WORLD DEVELOPMENT	484,266	10.040	4,862,030.640	
SHANGRI-LA ASIA LTD	104,000	7.530	783,120.000	
SINO LAND CO	255,400	11.620	2,967,748.000	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	125,000	108.200	13,525,000.000	
SWIRE PACIFIC LTD A	47,500	70.550	3,351,125.000	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	113,500	51.500	5,845,250.000	
VITASOY INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	70,000	32.550	2,278,500.000	
WHEELLOCK & CO LTD	64,000	44.250	2,832,000.000	
SJM HOLDINGS LTD	156,000	7.550	1,177,800.000	
WYNN MACAU LTD	124,400	14.880	1,851,072.000	
MGM CHINA HOLDINGS LTD	64,800	12.180	789,264.000	
AIA GROUP LTD	949,427	71.700	68,073,915.900	
HKT TRUST / HKT LTD	289,000	12.400	3,583,600.000	
SANDS CHINA LTD	199,200	34.900	6,952,080.000	
SWIRE PROPERTIES LTD	104,200	23.500	2,448,700.000	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT CO LTD	95,750	41.850	4,007,137.500	
HK ELECTRIC INVESTMENTS & HK ELECTRIC INVESTMENTS LTD	230,000	7.340	1,688,200.000	
WH GROUP LTD	706,500	7.330	5,178,645.000	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	208,832	68.700	14,346,758.400	
CK ASSET HOLDINGS LTD	198,332	50.850	10,085,182.200	
香港・ドル 小計	7,523,962		258,828,436.240	

			(3,569,244,136)	
合計	88,446,482		309,744,265,185 (309,744,265,185)	

(2) 株式以外の有価証券

令和1年10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	1,000,522.250		
		GOODMAN GROUP	132,051.000	1,875,124.200		
		GPT GROUP	140,307.000	864,291.120		
		MIRVAC GROUP	290,474.000	877,231.480		
		SCENTRE GROUP	420,268.000	1,664,261.280		
		STOCKLAND	194,018.000	875,021.180		
		VICINITY CENTRES	270,443.000	700,447.370		
		オーストラリア・ドル 小計		1,532,136.000	7,856,898.880 (575,124,998)	
	シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	200,806.000	632,538.900		
		CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	206,300.000	424,978.000		
		CAPITALAND MALL TRUST	199,000.000	519,390.000		
		SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	192,100.000	359,227.000		
		シンガポール・ドル 小計		798,206.000	1,936,133.900 (152,296,293)	
	投資信託受益証券 合計			2,330,342	727,421,291 (727,421,291)	
投資証券	アメリカ・ドル	AGNC INVESTMENT CORP	44,741.000	718,540.460		
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	8,646.000	1,332,607.980		
		AMERICAN TOWER CORP	34,655.000	7,841,733.400		
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	108,247.000	940,666.430		
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	11,347.000	2,481,361.960		
		BOSTON PROPERTIES INC	12,027.000	1,529,593.860		
		CAMDEN PROPERTY TRUST	8,062.000	916,165.680		
		CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	32,699.000	4,519,655.780		
		DIGITAL REALTY TRUST INC	16,931.000	2,212,035.150		
		DUKE REALTY TRUST	27,278.000	909,175.740		
		EQUINIX INC	6,638.000	3,798,263.600		
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	6,813.000	934,471.080		
		EQUITY RESIDENTIAL	30,415.000	2,681,386.400		
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	5,075.000	1,679,723.500		
EXTRA SPACE STORAGE INC	10,754.000	1,250,475.120				
FEDERAL REALTY INVS TRUST	6,000.000	806,580.000				

	HCP INC	40,162.000	1,467,921.100	
	HOST HOTELS & RESORTS INC	55,116.000	909,965.160	
	INVITATION HOMES INC	36,281.000	1,101,128.350	
	IRON MOUNTAIN INC	23,977.000	774,457.100	
	KIMCO REALTY	32,980.000	677,409.200	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	11,649.000	592,235.160	
	MID AMERICA	8,834.000	1,179,073.980	
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	13,649.000	779,630.880	
	PROLOGIS INC	49,995.000	4,290,070.950	
	PUBLIC STORAGE	12,188.000	3,006,779.600	
	REALTY INCOME CORP	26,099.000	2,054,774.270	
	REGENCY CENTERS CORP	12,096.000	826,156.800	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	8,778.000	2,131,473.960	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	23,931.000	3,522,403.890	
	SL GREEN	7,097.000	562,650.160	
	SUN COMMUNITIES INC	6,979.000	1,066,530.780	
	THE MACERICH COMPANY	9,014.000	247,975.140	
	UDR INC	22,345.000	1,084,626.300	
	VENTAS INC	27,669.000	2,023,433.970	
	VEREIT INC	69,822.000	680,764.500	
	VORNADO REALTY TRUST	12,472.000	775,633.680	
	WELLTOWER INC	31,541.000	2,889,155.600	
	WEYERHAEUSER CO	57,621.000	1,536,175.860	
	WP CAREY INC	13,039.000	1,188,765.630	
アメリカ・ドル	小計	983,662.000	69,921,628.160 (7,560,625,654)	
イギリス・ポンド	BRITISH LAND CO PLC	69,819.000	382,608.120	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	55,843.000	468,634.450	
	SEGRO PLC	87,247.000	694,486.120	
イギリス・ポンド	小計	212,909.000	1,545,728.690 (207,854,137)	
カナダ・ドル	H & R REAL ESTATE INVESTMENT	10,748.000	249,676.040	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	13,467.000	361,454.280	
	SMARTCENTRES REIT	3,067.000	100,260.230	
カナダ・ドル	小計	27,282.000	711,390.550 (57,857,393)	
ユーロ	COVIVIO	4,265.000	419,462.750	
	GECINA SA	3,670.000	551,234.000	
	ICADE	2,234.000	186,650.700	
	KLEPIERRE	17,042.000	529,154.100	
	UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	10,898.000	1,423,278.800	
ユーロ	小計	38,109.000	3,109,780.350 (370,094,959)	

	香港・ドル	LINK REIT	173,000.000	13,926,500.000	
	香港・ドル 小計		173,000.000	13,926,500.000 (192,046,435)	
投資証券 合計			1,434,962	8,388,478,578 (8,388,478,578)	
合計				9,115,899,869 (9,115,899,869)	

(注) 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 610銘柄	65.41	-	-	69.09
	投資証券 40銘柄	-	-	2.32	
イギリス・ポンド	株式 94銘柄	5.73	-	-	5.91
	投資証券 3銘柄	-	-	0.06	
イスラエル・シケル	株式 8銘柄	0.12	-	-	0.12
オーストラリア・ドル	株式 61銘柄	2.33	-	-	2.55
	投資信託受益証券 7銘柄	-	0.18	-	
カナダ・ドル	株式 87銘柄	3.68	-	-	3.77
	投資証券 3銘柄	-	-	0.02	
シンガポール・ドル	株式 21銘柄	0.42	-	-	0.47
	投資信託受益証券 4銘柄	-	0.05	-	
スイス・フラン	株式 39銘柄	3.36	-	-	3.43
スウェーデン・クローナ	株式 32銘柄	0.91	-	-	0.93
デンマーク・クローネ	株式 17銘柄	0.63	-	-	0.64
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	0.23	-	-	0.24
ユーロ	株式 239銘柄	11.23	-	-	11.57
	投資証券 5銘柄	-	-	0.11	
香港・ドル	株式 39銘柄	1.10	-	-	1.18
	投資証券 1銘柄	-	-	0.06	

(注) 「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

令和1年10月11日現在	
資産の部	
流動資産	
預金	1,454,704,445
コール・ローン	182,597,654
国債証券	85,095,832,598
未収入金	25,986,830,998
未収利息	652,409,411
前払費用	359,687,275
流動資産合計	113,732,062,381
資産合計	113,732,062,381
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	185,092,705
未払金	1,306,375,839
未払解約金	25,649,904,000
流動負債合計	27,141,372,544
負債合計	27,141,372,544
純資産の部	
元本等	
元本	42,731,976,708
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	43,858,713,129
元本等合計	86,590,689,837
純資産合計	86,590,689,837
負債純資産合計	113,732,062,381

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自 平成31年4月12日 至 令和1年10月11日
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、計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	令和1年10月11日現在
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	56,823,091,842円
同期中追加設定元本額	50,277,858,132円
同期中一部解約元本額	64,368,973,266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)	244,298,182円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	297,975,430円
たわらノーロード バランス(堅実型)	17,627,157円
たわらノーロード バランス(標準型)	50,703,851円
たわらノーロード バランス(積極型)	21,893,480円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	527,110円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	1,148,849円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	1,712,410円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	488,540円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	604,749円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	60,597,090円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	196,542,262円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	186,963,083円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	366,061,162円
投資のソムリエ	5,574,375,393円
クルーズコントロール	116,977,247円
投資のソムリエ<DC年金>	585,001,200円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	158,217,512円
クルーズコントロール<DC年金>	264,260円
DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)	792,509円
DIAMコア資産設計ファンド(積極型)	2,583,466円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	336,250,403円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	3,874,231,486円
ワールドアセットバランス(基本コース)	925,526,321円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	3,643,538,489円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	6,298,231円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	4,962,240円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	2,439,915円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	10,335,005円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	3,063,643,503円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	121,291,924円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	881,958円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	801,501円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	795,990円
エマージング債券リスク抑制型(適格機関投資家限定)	13,689,124,058円
高度リスク分散・安定型戦略ファンド(適格機関投資家限定)	1,996,803,439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)	85,823,198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)	247,086,001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)	172,426,122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)	2,432,370,301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
計	42,731,976,708円

2. 受益権の総数

(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31年4月12日 至 令和1年10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。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。</p> <p>また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、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。</p>
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。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	令和1年10月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	令和1年10月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
国債証券	1,462,817,260
合計	1,462,817,260

（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31年4月19日から令和1年10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	令和1年10月11日現在			
	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	25,800,000,000	-	25,985,092,704	185,092,704
アメリカ・ドル	25,800,000,000	-	25,985,092,704	185,092,704
買建	900,000,000	-	899,999,999	1
アメリカ・ドル	900,000,000	-	899,999,999	1
合計	26,700,000,000	-	26,885,092,703	185,092,705

（注）時価の算定方法

為替予約取引

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

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

計算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）

	令和1年10月11日現在
1口当たり純資産額	2.0264円
（1万口当たり純資産額）	（20,264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10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	7,815,600.000	
		BRAZIL 4.25 01/07/25	9,100,000.000	9,621,703.000	
		BRAZIL 4.625 01/13/28	10,800,000.000	11,548,008.000	
		BRAZIL 4.875 01/22/21	3,000,000.000	3,102,750.000	
		BRAZIL 5.0 01/27/45	10,800,000.000	11,187,450.000	
		BRAZIL 5.625 01/07/41	8,100,000.000	9,076,131.000	

BRAZIL 5.625 02/21/47	5,600,000.000	6,254,556.000	
BRAZIL 6.0 04/07/26	7,800,000.000	9,030,450.000	
BRAZIL 7.125 01/20/37	5,300,000.000	6,784,159.000	
BRAZIL 8.25 01/20/34	7,200,000.000	9,869,760.000	
BRAZIL 8.75 02/04/25	4,800,000.000	6,102,720.000	
COLOMBIA 2.625 03/15/23	5,700,000.000	5,731,122.000	
COLOMBIA 3.875 04/25/27	7,600,000.000	8,109,200.000	
COLOMBIA 4.0 02/26/24	6,100,000.000	6,436,964.000	
COLOMBIA 4.375 07/12/21	2,200,000.000	2,279,772.000	
COLOMBIA 4.5 01/28/26	5,000,000.000	5,466,875.000	
COLOMBIA 4.5 03/15/29	7,000,000.000	7,826,000.000	
COLOMBIA 5.0 06/15/45	11,000,000.000	12,911,250.000	
COLOMBIA 5.2 05/15/49	4,000,000.000	4,882,400.000	
COLOMBIA 5.625 02/26/44	6,000,000.000	7,545,300.000	
COLOMBIA 6.125 01/18/41	8,000,000.000	10,500,080.000	
COLOMBIA 7.375 09/18/37	5,400,000.000	7,742,304.000	
COLOMBIA 8.125 05/21/24	4,900,000.000	6,052,480.000	
CROATIA 5.5 04/04/23	11,400,000.000	12,638,154.000	
CROATIA 6.0 01/26/24	7,400,000.000	8,529,610.000	
CROATIA 6.375 03/24/21	4,400,000.000	4,642,000.000	
HUNGARY 5.375 02/21/23	5,600,000.000	6,161,400.000	
HUNGARY 5.375 03/25/24	8,600,000.000	9,738,898.000	
HUNGARY 5.75 11/22/23	8,000,000.000	9,088,792.000	
HUNGARY 6.375 03/29/21	10,000,000.000	10,622,880.000	
HUNGARY 7.625 03/29/41	4,400,000.000	7,318,682.800	
INDONESIA 3.375 04/15/23	6,700,000.000	6,900,387.280	
INDONESIA 3.5 01/11/28	3,200,000.000	3,346,186.300	
INDONESIA 3.85 07/18/27	5,600,000.000	5,952,240.000	
INDONESIA 4.1 04/24/28	3,000,000.000	3,268,356.910	
INDONESIA 4.125 01/15/25	7,800,000.000	8,353,683.920	
INDONESIA 4.35 01/08/27	5,000,000.000	5,485,046.000	
INDONESIA 4.35 01/11/48	3,000,000.000	3,340,200.330	
INDONESIA 4.625 04/15/43	3,400,000.000	3,839,320.800	
INDONESIA 4.75 01/08/26	6,800,000.000	7,558,472.800	
INDONESIA 4.75 02/11/29	4,000,000.000	4,603,213.800	
INDONESIA 4.875 05/05/21	3,100,000.000	3,217,632.040	
INDONESIA 5.125 01/15/45	5,400,000.000	6,533,289.120	
INDONESIA 5.25 01/08/47	1,400,000.000	1,728,702.500	
INDONESIA 5.25 01/17/42	4,300,000.000	5,227,571.010	
INDONESIA 5.35 02/11/49	3,000,000.000	3,870,257.580	
INDONESIA 5.875 01/15/24	6,200,000.000	7,007,714.720	
INDONESIA 5.95 01/08/46	3,200,000.000	4,286,983.610	
INDONESIA 6.75 01/15/44	5,500,000.000	7,996,270.920	
INDONESIA 7.75 01/17/38	8,500,000.000	12,917,572.400	
PANAMA 3.75 03/16/25	5,200,000.000	5,525,052.000	
PANAMA 3.875 03/17/28	7,100,000.000	7,752,383.500	
PANAMA 4.5 04/16/50	6,300,000.000	7,567,938.000	
PANAMA 4.5 05/15/47	2,000,000.000	2,405,020.000	
PANAMA 6.7 01/26/36	7,900,000.000	11,218,790.000	

PANAMA 7.125 01/29/26	2,800,000.000	3,521,028.000	
PANAMA 9.375 04/01/29	2,900,000.000	4,462,404.000	
PERU 4.125 08/25/27	4,300,000.000	4,848,293.000	
PERU 5.625 11/18/50	7,000,000.000	10,368,820.000	
PERU 6.55 03/14/37	6,000,000.000	8,821,800.000	
PERU 7.35 07/21/25	5,300,000.000	6,727,820.000	
PHILIPPINES 3.0 02/01/28	6,000,000.000	6,348,341.870	
PHILIPPINES 3.7 02/02/42	6,000,000.000	6,997,366.200	
PHILIPPINES 3.7 03/01/41	3,600,000.000	4,188,804.040	
PHILIPPINES 3.75 01/14/29	5,000,000.000	5,644,745.850	
PHILIPPINES 3.95 01/20/40	4,800,000.000	5,693,685.120	
PHILIPPINES 4.2 01/21/24	3,800,000.000	4,133,589.800	
PHILIPPINES 5.0 01/13/37	4,800,000.000	6,279,408.480	
PHILIPPINES 5.5 03/30/26	3,600,000.000	4,331,146.100	
PHILIPPINES 6.375 01/15/32	3,600,000.000	4,994,569.110	
PHILIPPINES 6.375 10/23/34	4,000,000.000	5,786,127.920	
PHILIPPINES 7.75 01/14/31	5,100,000.000	7,699,909.870	
PHILIPPINES 9.5 02/02/30	4,800,000.000	7,856,704.800	
ROMANIA 4.375 08/22/23	8,000,000.000	8,577,320.000	
ROMANIA 4.875 01/22/24	6,600,000.000	7,272,606.000	
ROMANIA 5.125 06/15/48	4,600,000.000	5,338,714.000	
ROMANIA 6.125 01/22/44	3,400,000.000	4,454,333.200	
ROMANIA 6.75 02/07/22	6,500,000.000	7,160,062.000	
RUSSIAN FEDERATION 03/31/30	11,859,000.000	13,495,897.770	
RUSSIAN FEDERATION 4.25 06/23/27	8,400,000.000	8,928,150.000	
RUSSIAN FEDERATION 4.375 03/21/29	11,400,000.000	12,219,945.000	
RUSSIAN FEDERATION 4.5 04/04/22	4,800,000.000	5,061,360.000	
RUSSIAN FEDERATION 4.75 05/27/26	7,400,000.000	8,079,830.600	
RUSSIAN FEDERATION 4.875 09/16/23	8,400,000.000	9,179,301.600	
RUSSIAN FEDERATION 5.25 06/23/47	19,000,000.000	22,620,108.000	
RUSSIAN FEDERATION 5.625 04/04/42	7,000,000.000	8,620,381.000	
RUSSIAN FEDERATION 5.875 09/16/43	4,200,000.000	5,344,941.000	
SOUTH AFRICA 4.3 10/12/28	7,200,000.000	6,994,857.600	
SOUTH AFRICA 4.665 01/17/24	7,100,000.000	7,420,813.500	

SOUTH AFRICA 4.875 04/14/26	5,400,000.000	5,590,792.800	
SOUTH AFRICA 5.0 10/12/46	3,800,000.000	3,544,795.800	
SOUTH AFRICA 5.375 07/24/44	3,800,000.000	3,692,403.000	
SOUTH AFRICA 5.65 09/27/47	6,200,000.000	6,165,007.200	
SOUTH AFRICA 5.875 05/30/22	6,000,000.000	6,440,820.000	
SOUTH AFRICA 5.875 06/22/30	3,400,000.000	3,642,148.000	
SOUTH AFRICA 5.875 09/16/25	6,200,000.000	6,786,662.600	
SOUTH AFRICA 6.3 06/22/48	1,000,000.000	1,075,250.000	
UNITED MEXICAN STATES 3.6 01/30/25	7,200,000.000	7,539,840.000	
UNITED MEXICAN STATES 3.625 03/15/22	4,900,000.000	5,061,700.000	
UNITED MEXICAN STATES 3.75 01/11/28	6,200,000.000	6,434,112.000	
UNITED MEXICAN STATES 4.0 10/02/23	6,500,000.000	6,872,092.500	
UNITED MEXICAN STATES 4.125 01/21/26	5,000,000.000	5,336,300.000	
UNITED MEXICAN STATES 4.15 03/28/27	9,400,000.000	10,025,194.000	
UNITED MEXICAN STATES 4.35 01/15/47	7,000,000.000	7,284,480.000	
UNITED MEXICAN STATES 4.5 04/22/29	12,000,000.000	13,143,120.000	
UNITED MEXICAN STATES 4.6 01/23/46	7,000,000.000	7,515,060.000	
UNITED MEXICAN STATES 4.6 02/10/48	5,400,000.000	5,832,054.000	
UNITED MEXICAN STATES 4.75 03/08/44	8,400,000.000	9,193,800.000	
UNITED MEXICAN STATES 5.55 01/21/45	6,400,000.000	7,787,328.000	
UNITED MEXICAN STATES 5.75 10/12/2110	5,800,000.000	6,752,708.000	
UNITED MEXICAN STATES 6.05 01/11/40	5,900,000.000	7,493,059.000	
UNITED MEXICAN STATES 6.75 09/27/34	7,200,000.000	9,775,440.000	
アメリカ・ドル 小計	679,959,000.000 (73,523,966,670)	786,977,088.670 (85,095,832,598)	
国債証券 合計	73,523,966,670 (73,523,966,670)	85,095,832,598 (85,095,832,598)	

合計		85,095,832,598 (85,095,832,598)	
----	--	------------------------------------	--

(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 112銘柄	98.27	100.00

(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

貸借対照表

(単位：円)

令和1年10月11日現在

資産の部	
流動資産	
預金	2,962,010,000
コール・ローン	106,802,658
株式	38,392,750,377
新株予約権証券	738,435
投資信託受益証券	358,796,059
投資証券	99,245,452
派生商品評価勘定	51,424,465
未収入金	796,279
未収配当金	71,067,562
差入委託証拠金	862,667,017
流動資産合計	42,906,298,304
資産合計	42,906,298,304
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	14,037,977
未払解約金	77,122,000
流動負債合計	91,159,977
負債合計	91,159,977
純資産の部	
元本等	
元本	39,188,097,626
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	3,627,040,701
元本等合計	42,815,138,327
純資産合計	42,815,138,327
負債純資産合計	42,906,298,304

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 平成31年4月12日 至 令和1年10月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>新株予約権証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>為替予約取引</p> <p>原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	令和1年10月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	51,163,760,665円
同期中追加設定元本額	29,532,791,238円
同期中一部解約元本額	41,508,454,277円

元本の内訳	
ファンド名	
D I A M新興国株式インデックスファンド< D C 年金>	5,478,230,837円
D I A M新興国株式インデックスファンド<為替ヘッジなし>(ファン ドラップ)	562,566,230円
M I T O ラップ型ファンド(安定型)	3,094,261円
M I T O ラップ型ファンド(中立型)	10,687,402円
M I T O ラップ型ファンド(積極型)	13,414,994円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	32,675,047円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	34,044,227円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	16,922,877円
たわらノーロード 新興国株式	5,412,592,780円
たわらノーロード 新興国株式<ラップ向け>	2,029,308,647円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	556,919,113円
たわらノーロード バランス(堅実型)	4,105,508円
たわらノーロード バランス(標準型)	15,787,775円
たわらノーロード バランス(積極型)	27,279,262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)	251,918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)	25,636,231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)	61,104,609円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(成長型)	40,642,284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)	80,811,262円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	301,235円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	899,941円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	359,850円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	1,112,887円
たわらノーロード 全世界株式	15,867,551円
O n e D C 新興国株式インデックスファンド	870,210円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	453,215,866円
D I A M D C 8資産バランスファンド(新興国10)	357,586,260円
D I A M D C 8資産バランスファンド(新興国20)	346,437,606円
D I A M D C 8資産バランスファンド(新興国30)	675,454,455円
投資のソムリエ	6,806,292,005円
クルーズコントロール	187,476,092円
投資のソムリエ< D C 年金>	714,010,516円
D I A M 8資産バランスファンドN< D C 年金>	300,696,982円
クルーズコントロール< D C 年金>	273,406円
D I A Mコア資産設計ファンド(堅実型)	3,252,714円
D I A Mコア資産設計ファンド(積極型)	10,606,470円
投資のソムリエ< D C 年金>リスク抑制型	393,981,509円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	4,554,666,539円
ワールドアセットバランス(基本コース)	1,555,716,267円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	6,220,771,292円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2045)	6,405,350円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2055)	5,193,870円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(D C)	2,873,316円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2035)	7,631,545円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	974,754,077円
9資産分散投資・スタンダード< D C 年金>	225,977,688円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2040)	920,972円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2050)	841,829円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2060)	831,723円
エマージング株式パッシブファンドV A(適格機関投資家専用)	184,637,230円

D I A M世界アセットバランスファンド2 V A (適格機関投資家限定)	454,819,219円
D I A M世界アセットバランスファンド3 V A (適格機関投資家限定)	317,285,890円
計	39,188,097,626円
2. 受益権の総数	39,188,097,626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31年4月12日 至 令和1年10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。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。</p> <p>また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。</p>
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。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	令和1年10月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
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。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	令和1年10月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
株式	1,763,551,696
新株予約権証券	382,754
投資信託受益証券	7,523,576
投資証券	972,962
合計	1,754,672,404

(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31年4月19日から令和1年10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	令和1年10月11日現在				
	契約額等(円)	うち		時価(円)	評価損益(円)
		1年超			
市場取引以外の取引 為替予約取引 買建 アメリカ・ドル	1,057,120,200	-	1,057,120,200	-	
合計	1,057,120,200	-	1,057,120,200	-	

(注)時価の算定方法

為替予約取引

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

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

計算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	令和1年10月11日現在				
	契約額等(円)	うち		時価(円)	評価損益(円)
		1年超			
市場取引 先物取引 買建	4,967,394,883	-	5,004,781,371	37,386,488	
合計	4,967,394,883	-	5,004,781,371	37,386,488	

(注)時価の算定方法

株価指数先物取引

1. 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)

令和1年10月11日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0926円 (10,926円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

令和1年10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	4.600	28,428.000	
	CTRIP.COM INTERNATIONAL LTD ADR	29,012	29.380	852,372.560	
	CIA DE MINAS BUENAVENTURA SA ADR	14,930	14.570	217,530.100	
	SURGUTNEFTEGAZ SP ADR PREF	69,900	5.740	401,226.000	
	CREDICORP LTD	4,306	203.130	874,677.780	
	SINA CORP	3,696	40.110	148,246.560	
	MOBILE TELESYSTEMS PJSC ADR	28,464	8.200	233,404.800	
	NETEASE INC-ADR	4,646	258.960	1,203,128.160	
	GRUPO FINANCIERO GALICIA SA ADR	4,128	13.390	55,273.920	
	SOUTHERN COPPER CORP	5,523	33.280	183,805.440	
	TELECOM ARGENTINA SA SP ADR	7,366	10.540	77,637.640	
	TRANSPORTADORA DE GAS DEL SUR SP ADR	6,000	8.300	49,800.000	
	YPF SA ADR	8,927	9.500	84,806.500	
	LUKOIL SPON ADR	26,560	82.140	2,181,638.400	
	GAZPROM PAO ADR	361,911	6.894	2,495,014.430	
	COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK SP GDR	102,425	4.725	483,958.120	
	INNER MONGOLIA YITAI COAL CO	66,800	0.888	59,318.400	
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRADE	86,736	1.114	96,623.900	
	SURGUTNEFTEGAZ ADR	40,348	5.580	225,141.840	
	51JOB INC ADR	1,814	78.010	141,510.140	
	X5 RETAIL GROUP NV GDR	8,930	32.060	286,295.800	
	NOVATEK PJSC GDR	6,184	205.800	1,272,667.200	
	BAIDU INC -SPON ADR	18,625	103.850	1,934,206.250	
NOVOLIPETSK STEEL GDR	12,150	20.160	244,944.000		
BANCO MACRO SA ADR	3,717	27.760	103,183.920		
MMC NORILSK NICKEL ADR	44,004	24.890	1,095,259.560		
ROSNEFT OIL CO GDR	73,565	6.290	462,723.850		

	NEW ORIENTAL EDUCATION & TECH	9,695	112.650	1,092,141.750	
	SEVERSTAL GDR	17,178	13.770	236,541.060	
	TATNEFT ADR	17,571	64.800	1,138,600.800	
	MAGNITOGORSK IRON & STEEL SPON GDR	15,136	7.480	113,217.280	
	VTB BANK OJSC GDR	172,000	1.271	218,612.000	
	DP WORLD PLC	12,841	13.680	175,664.880	
	MAGNIT PJSC GDR	21,066	11.680	246,050.880	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD ADR	30,862	8.800	271,585.600	
	PAMPA ENERGIA SA ADR	5,773	17.200	99,295.600	
	TAL EDUCATION GROUP-ADR	26,298	37.350	982,230.300	
	NOAH HOLDINGS LTD ADR	407	27.260	11,094.820	
	SBERBANK ADR	185,668	14.230	2,642,055.640	
	PHOSAGRO PJSC GDR	13,784	13.000	179,192.000	
	HUAZHU GROUP LTD ADR	8,822	33.840	298,536.480	
	YY INC-ADR	4,178	56.340	235,388.520	
	GDS HOLDINGS LTD ADR	4,404	40.060	176,424.240	
	NIO INC ADR	62,042	1.530	94,924.260	
	TENCENT MUSIC ENTERTAINMENT GROUP ADR	6,256	13.280	83,079.680	
	58.COM INC ADR	6,955	48.810	339,473.550	
	AUTOHOME INC ADR	3,720	82.450	306,714.000	
	WEIBO CORP ADR	4,093	47.720	195,317.960	
	JD.COM INC ADR	48,777	28.580	1,394,046.660	
	GLOBANT SA	2,096	95.900	201,006.400	
	ALIBABA GROUP HOLDING LTD-ADR	95,541	166.070	15,866,493.870	
	MOMO INC SPON ADR	9,385	33.190	311,488.150	
	BAOZUN INC-SPN ADR	3,717	43.570	161,949.690	
	PINDUODUO INC ADR	12,456	31.940	397,844.640	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	23,227	43.010	998,993.270	
	IQIYI INC ADR	9,440	15.710	148,302.400	
	POLYUS PJSC GDR	4,556	58.000	264,248.000	
	HUTCHISON CHINA MEDITECH LTD ADR	1,538	17.270	26,561.260	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC ADR	19,971	20.210	403,613.910	
アメリカ・ドル	小計	1,906,300		44,803,512.820 (4,844,603,841)	
アラブ首長国連邦・ディルハム	DUBAI ISLAMIC BANK PJSC	136,145	5.330	725,652.850	
	EMIRATES TELECOMMUNICATIONS GROUP CO PJSC	118,789	16.500	1,960,018.500	
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK PJSC	177,861	7.600	1,351,743.600	

	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	176,159	15.220	2,681,139.980	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	193,358	4.550	879,778.900	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	194,346	2.120	412,013.520	
	EMAAR DEVELOPMENT PJSC	77,463	4.050	313,725.150	
	EMAAR MALLS PJSC	178,166	1.870	333,170.420	
アラブ首長国連邦・ディルハム 小計		1,252,287		8,657,242.920 (255,302,094)	
イギリス・ボンド	POLYMETAL INTERNATIONAL PLC	15,843	11.595	183,699.580	
イギリス・ボンド 小計		15,843		183,699.580 (24,702,083)	
インド・ルピー	RELIANCE INDUSTRIES LTD	194,344	1,362.750	264,842,286.000	
	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	39,255	489.900	19,231,024.500	
	ASIAN PAINTS LTD	18,318	1,778.600	32,580,394.800	
	EICHER MOTORS LTD	813	18,052.500	14,676,682.500	
	GRASIM INDUSTRIES LTD	18,384	696.600	12,806,294.400	
	MAHINDRA & MAHINDRA LTD	49,933	566.050	28,264,574.650	
	SHREE CEMENT LTD	702	18,268.750	12,824,662.500	
	ICICI BANK LTD	159,611	423.700	67,627,180.700	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP LTD	46,395	311.150	14,435,804.250	
	STATE BANK OF INDIA LTD	116,610	254.150	29,636,431.500	
	CONTAINER CORP OF INDIA LTD	12,991	566.500	7,359,401.500	
	LIC HOUSING FINANCE LTD	26,242	369.350	9,692,482.700	
	TATA STEEL LTD	30,106	329.950	9,933,474.700	
	TATA MOTORS LTD	111,599	116.800	13,034,763.200	
	JSW STEEL LTD	47,195	213.750	10,087,931.250	
	TATA POWER CO LTD	100,483	61.600	6,189,752.800	
	BRITANNIA INDUSTRIES LTD	3,615	3,037.750	10,981,466.250	
	NESTLE INDIA LTD	1,484	13,819.850	20,508,657.400	
	GAIL INDIA LTD	96,058	127.350	12,232,986.300	
	VEDANTA LTD	133,208	141.150	18,802,309.200	
	AXIS BANK LTD	127,655	672.950	85,905,432.250	
	TITAN COMPANY LTD	20,828	1,234.700	25,716,331.600	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	157,916	125.500	19,818,458.000	
	LUPIN LTD	18,852	690.950	13,025,789.400	
	BAJAJ FINANCE LTD	11,110	3,948.900	43,872,279.000	
	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP	108,853	1,987.950	216,394,321.350	
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISES LTD	30,410	245.000	7,450,450.000		
INFOSYS LTD	228,666	783.050	179,056,911.300		
WIPRO LTD	82,231	239.200	19,669,655.200		

INDIAN OIL CORP LTD	115,396	148.200	17,101,687.200	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	43,350	1,968.750	85,345,312.500	
HCL TECHNOLOGIES LTD	38,459	1,063.500	40,901,146.500	
DABUR INDIA LTD	31,309	439.400	13,757,174.600	
HERO MOTOCORP LTD	7,538	2,601.850	19,612,745.300	
DR REDDYS LABORATORIES LTD	7,489	2,633.500	19,722,281.500	
BHARTI AIRTEL LTD	145,571	377.250	54,916,659.750	
UNITED SPIRITS LTD	24,162	615.150	14,863,254.300	
SUN PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD	57,096	387.050	22,099,006.800	
DIVI'S LABORATORIES LTD	5,865	1,667.150	9,777,834.750	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	6,831	6,605.450	45,121,828.950	
GLENMARK PHARMACEUTICALS LTD	9,463	289.750	2,741,904.250	
AUROBINDO PHARMA LTD	22,361	465.150	10,401,219.150	
HAVELLS INDIA LTD	18,543	662.650	12,287,518.950	
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	40,483	96.150	3,892,440.450	
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE CO LTD	14,479	1,081.900	15,664,830.100	
PETRONET LNG LTD	40,593	258.650	10,499,379.450	
CIPLA LTD/INDIA	26,157	422.150	11,042,177.550	
LARSEN & TOUBRO LTD	33,228	1,425.100	47,353,222.800	
ULTRATECH CEMENT LTD	6,693	3,976.300	26,613,375.900	
ASHOK LEYLAND LTD	64,420	68.850	4,435,317.000	
BOSCH LTD	529	13,326.750	7,049,850.750	
TATA CONSULTANCY SERVICES LTD	60,539	2,004.450	121,347,398.550	
NTPC LTD	159,661	117.250	18,720,252.250	
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	5,293	1,371.450	7,259,084.850	
YES BANK LTD	104,338	40.950	4,272,641.100	
AMBUJA CEMENTS LTD	33,112	188.000	6,225,056.000	
BHARAT FORGE LTD	8,492	423.900	3,599,758.800	
HINDALCO INDUSTRIES LTD	73,359	182.250	13,369,677.750	
ITC LTD	236,170	243.200	57,436,544.000	
PIDILITE INDUSTRIES LTD	9,127	1,358.850	12,402,223.950	
UNITED PHOSPHORUS LTD	35,623	583.450	20,784,239.350	
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	22,088	680.100	15,022,048.800	
TECH MAHINDRA LTD	29,546	711.300	21,016,069.800	
VODAFONE IDEA LTD	248,533	6.200	1,540,904.600	
MARICO LTD	37,213	384.500	14,308,398.500	
PAGE INDUSTRIES LTD	355	21,258.300	7,546,696.500	
POWER GRID CORP OF INDIA LTD	111,822	199.100	22,263,760.200	
ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	46,478	399.900	18,586,552.200	
REC LTD	55,173	126.050	6,954,556.650	

	BAJAJ FINSERV LTD	2,733	8,201.850	22,415,656.050	
	BAJAJ AUTO LTD	6,471	2,886.250	18,676,923.750	
	COAL INDIA LTD	78,544	184.550	14,495,295.200	
	MAHINDRA & MAHINDRA FINANCIAL SERVICES LTD	11,467	326.000	3,738,242.000	
	BHARTI INFRATEL LTD	32,296	256.900	8,296,842.400	
	INDIABULLS HOUSING FINANCE LTD	14,918	195.350	2,914,231.300	
	TATA STEEL LTD-PARTLY PAID	2,333	33.500	78,155.500	
	HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	32,930	583.800	19,224,534.000	
	AVENUE SUPERMARTS LTD	8,108	1,821.350	14,767,505.800	
	ICICI LOMBARD GENERAL INSURANCE CO LTD	8,255	1,193.350	9,851,104.250	
	INTERGLOBE AVIATION LTD	5,373	1,790.100	9,618,207.300	
インド・ルピー	小計	4,234,232		2,218,590,919.100 (3,394,444,106)	
インドネシ ア・ルピア	BARITO PACIFIC TBK PT	1,499,800	875.000	1,312,325,000.000	
	UNITED TRACTORS TBK PT	143,901	20,150.000	2,899,605,150.000	
	INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK PT	347,600	7,650.000	2,659,140,000.000	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	92,100	43,875.000	4,040,887,500.000	
	PT ASTRA INTERNATIONAL TBK	1,318,300	6,275.000	8,272,332,500.000	
	TELEKOMUNIKASI INDONESIA PERSERO TBK	3,243,700	4,110.000	13,331,607,000.000	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA TBK PT	364,900	5,100.000	1,860,990,000.000	
	GUDANG GARAM TBK PT	32,000	50,400.000	1,612,800,000.000	
	HANJAYA MANDALA SAMPOERNA TBK	795,500	2,150.000	1,710,325,000.000	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA TBK PT	94,000	17,900.000	1,682,600,000.000	
	INDAH KIAT PULP AND PAPER CORP TBK PT	256,700	5,975.000	1,533,782,500.000	
	BUKIT ASAM TBK PT	230,000	2,260.000	519,800,000.000	
	BANK MANDIRI	1,246,000	6,525.000	8,130,150,000.000	
	PABRIK KERTAS TJIWI KIMIA TBK PT	86,800	9,750.000	846,300,000.000	
	BANK RAKYAT INDONESIA	3,700,600	3,890.000	14,395,334,000.000	
	PERUSAHAAN GAS NEGARA TBK PT	806,800	2,020.000	1,629,736,000.000	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSERO TBK PT	491,500	6,750.000	3,317,625,000.000	
	KALBE FARMA TBK PT	1,024,700	1,650.000	1,690,755,000.000	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK PT	219,900	11,550.000	2,539,845,000.000	

	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	651,500	30,550.000	19,903,325,000.000	
	JASA MARGA PERSERO TBK PT	145,625	5,275.000	768,171,875.000	
	BUMI SERPONG DAMAI PT	746,500	1,410.000	1,052,565,000.000	
	ADARO ENERGY PT	1,016,200	1,260.000	1,280,412,000.000	
	PAKUWON JATI TBK	1,659,900	640.000	1,062,336,000.000	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR TBK PT	165,800	11,450.000	1,898,410,000.000	
	BANK TABUNGAN NEGARA TBK PT	526,900	1,800.000	948,420,000.000	
	PT SURYA CITRA MEDIA TBK	450,000	1,080.000	486,000,000.000	
	インドネシア・ルピア 小計	21,357,226		101,385,579,525.000 (780,668,962)	
オフショア・ 人民元	LUZHOU LAOJIAO CO LTD	7,700	86.680	667,436.000	
	LUXSHARE PRECISION INDUSTRY CO LTD	29,450	27.050	796,622.500	
	FOCUS MEDIA INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD	120,200	5.150	619,030.000	
	NEW HOPE LIUHE CO LTD	30,900	18.850	582,465.000	
	IFLYTEK CO LTD	11,600	33.980	394,168.000	
	BANK OF NINGBO CO LTD	29,400	26.950	792,330.000	
	YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD	8,500	75.550	642,175.000	
	EAST MONEY INFORMATION CO LTD	40,200	15.060	605,412.000	
	JIANGSU YANGHE BREWERY JOINT-STOCK CO LTD	5,300	101.950	540,335.000	
	WULIANGYE YIBIN CO LTD	14,300	130.990	1,873,157.000	
	SUNING.COM CO LTD	56,100	10.380	582,318.000	
	BOE TECHNOLOGY GROUP CO LTD	168,300	3.770	634,491.000	
	CHINA MERCHANTS SHEKOU INDUSTRIAL ZONE HOLDINGS CO LTD	33,200	19.820	658,024.000	
	GREE ELECTRIC APPLIANCES INC OF ZHUHAI	13,500	57.710	779,085.000	
	MIDEA GROUP CO LTD	14,500	52.180	756,610.000	
	HANGZHOU HIKVISION DIGITAL TECHNOLOGY CO LTD	38,800	30.900	1,198,920.000	
	GUOSEN SECURITIES CO LTD	17,200	12.290	211,388.000	
	PING AN BANK CO LTD	63,800	16.240	1,036,112.000	
	WENS FOODSTUFFS GROUP CO LTD	20,200	38.850	784,770.000	

SHENWAN HONGYUAN GROUP CO LTD	125,700	4.810	604,617.000	
CHINA VANKE CO LTD	41,800	26.620	1,112,716.000	
ZTE CORP	9,700	32.870	318,839.000	
WEICHAJ POWER CO LTD	42,000	11.460	481,320.000	
XINJIANG GOLDWIND SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	26,200	13.380	350,556.000	
BANK OF SHANGHAI CO LTD	71,690	9.560	685,356.400	
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO LTD	16,120	25.910	417,669.200	
PETROCHINA CO LTD	46,100	6.090	280,749.000	
INDUSTRIAL & COMMERCIAL BANK OF CHINA LTD	184,100	5.570	1,025,437.000	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA LTD	220,200	3.490	768,498.000	
BANK OF CHINA LTD	84,000	3.600	302,400.000	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL CORP	131,200	5.000	656,000.000	
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	75,300	35.110	2,643,783.000	
PING AN INSURANCE GROUP CO OF CHINA LTD	38,500	88.500	3,407,250.000	
INDUSTRIAL BANK CO LTD	85,600	18.320	1,568,192.000	
SHANGHAI PUDONG DEVELOPMENT BANK CO LTD	121,200	11.960	1,449,552.000	
CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	161,800	6.110	988,598.000	
SAIC MOTOR CORP LTD	32,200	23.910	769,902.000	
KWEICHOW MOUTAI CO LTD	4,400	1,155.000	5,082,000.000	
BANK OF COMMUNICATIONS CO LTD	149,500	5.530	826,735.000	
CITIC SECURITIES CO LTD	45,200	22.390	1,012,028.000	
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	24,800	35.940	891,312.000	
CHINA YANGTZE POWER CO LTD	85,200	18.240	1,554,048.000	
DAQIN RAILWAY CO LTD	80,000	7.600	608,000.000	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD	197,700	4.260	842,202.000	
CHINA STATE CONSTRUCTION ENGINEERING CORP LTD	128,800	5.480	705,824.000	
CHINA SHIPBUILDING INDUSTRY CO LTD	39,100	5.520	215,832.000	
HAITONG SECURITIES CO LTD	44,200	14.500	640,900.000	
INNER MONGOLIA YILI INDUSTRIAL GROUP CO LTD	25,000	28.470	711,750.000	
BANK OF BEIJING CO LTD	119,400	5.470	653,118.000	

CHINA UNITED NETWORK COMMUNICATIONS LTD	140,700	6.090	856,863.000	
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	20,600	41.680	858,608.000	
CHINA MERCHANTS SECURITIES CO LTD	30,700	16.670	511,769.000	
POLY DEVELOPMENTS AND HOLDINGS GROUP CO LTD	50,800	15.650	795,020.000	
CRRC CORP LTD	116,500	7.310	851,615.000	
JIANGSU HENGRUI MEDICINE CO LTD	15,100	83.000	1,253,300.000	
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION CORP LTD	64,400	9.650	621,460.000	
HUATAI SECURITIES CO LTD	34,700	18.650	647,155.000	
CHINA RAILWAY GROUP LTD	108,500	6.040	655,340.000	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	6,100	25.500	155,550.000	
GEMDALE CORP	40,600	12.860	522,116.000	
WANHUA CHEMICAL GROUP CO LTD	18,100	44.240	800,744.000	
CHINA FORTUNE LAND DEVELOPMENT CO LTD	21,900	27.900	611,010.000	
SDIC POWER HOLDINGS CO LTD	63,000	9.010	567,630.000	
CHINA INTERNATIONAL TRAVEL SERVICE CORP LTD	8,400	95.280	800,352.000	
METALLURGICAL CORP OF CHINA LTD	69,300	2.830	196,119.000	
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS CO LTD	21,700	23.210	503,657.000	
SICHUAN CHUANTOU ENERGY CO LTD	23,700	9.950	235,815.000	
AECC AVIATION POWER CO LTD	17,300	21.990	380,427.000	
JOINTOWN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	16,000	14.120	225,920.000	
CHINA MOLYBDENUM CO LTD	131,800	3.610	475,798.000	
INDUSTRIAL SECURITIES CO LTD	53,200	6.250	332,500.000	
SHANDONG GOLD MINING CO LTD	11,200	35.180	394,016.000	
YONGHUI SUPERSTORES CO LTD	60,800	9.000	547,200.000	
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC	2,000	75.600	151,200.000	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD	82,700	6.800	562,360.000	

	FANGDA CARBON NEW MATERIAL CO LTD	34,000	11.760	399,840.000	
	ZHANGZHOU PIENZHEHUANG PHARMACEUTICAL CO LTD	5,000	107.990	539,950.000	
	SHANXI XINGHUACUN FEN WINE FACTORY CO LTD	3,700	78.720	291,264.000	
	LONGI GREEN ENERGY TECHNOLOGY CO LTD	24,000	26.580	637,920.000	
	SHAANXI COAL INDUSTRY CO LTD	72,351	8.820	638,135.820	
	FOSHAN HAITIAN FLAVOURING & FOOD CO LTD	10,700	109.580	1,172,506.000	
	GUOTAI JUNAN SECURITIES CO LTD	39,500	17.500	691,250.000	
	ORIENT SECURITIES CO LTD/CHINA	60,300	10.220	616,266.000	
	EVERBRIGHT SECURITIES CO LTD	24,000	11.580	277,920.000	
オフショア・人民元 小計		4,683,211		65,508,627.920 (997,696,403)	
カタール・リアル	QATAR INSURANCE CO SAQ	144,170	3.160	455,577.200	
	QATAR NATIONAL BANK	295,265	19.290	5,695,661.850	
	COMMERCIAL BANK OF QATAR QSC	107,617	4.370	470,286.290	
	OOREDOO QSC	67,600	7.250	490,100.000	
	QATAR FUEL QSC	25,420	23.000	584,660.000	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	46,760	15.360	718,233.600	
	INDUSTRIES QATAR QSC	137,470	10.830	1,488,800.100	
	QATAR ISLAMIC BANK SAQ	65,575	15.100	990,182.500	
	MASRAF AL RAYAN	218,064	3.550	774,127.200	
	BARWA REAL ESTATE CO	167,630	3.340	559,884.200	
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDING CO	266,928	2.850	760,744.800	
カタール・リアル 小計		1,542,499		12,988,257.740 (384,322,547)	
コロンビア・ペン	INTERCONEXION ELECTRICA SA ESP	26,028	19,020.000	495,052,560.000	
	ECOPETROL SA	301,511	2,950.000	889,457,450.000	
	GRUPO DE INVERSIONES SURAMERICANA SA-PREF	10,138	29,360.000	297,651,680.000	
	GRUPO AVAL ACCIONES Y VALORES SA-PREF	341,831	1,285.000	439,252,835.000	
	CEMENTOS ARGOS SA	37,720	7,500.000	282,900,000.000	
	GRUPO ARGOS SA	11,705	17,500.000	204,837,500.000	
	BANCOLOMBIA SA	17,386	39,500.000	686,747,000.000	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	26,080	42,720.000	1,114,137,600.000	

	GRUPO DE INVERSIONES SURAMERICANA SA	18,835	33,160.000	624,568,600.000	
コロンビア・ペソ 小計		791,234		5,034,605,225.000 (157,079,683)	
サウジアラビ ア・リアル	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL CO	16,490	52.700	869,023.000	
	JARIR MARKETING CO	4,309	156.400	673,927.600	
	CO FOR COOPERATIVE INSURANCE	4,489	72.400	325,003.600	
	ETIHAD ETISALAT CO	27,652	23.700	655,352.400	
	SAUDI BRITISH BANK	27,107	30.250	819,986.750	
	AL RAJHI BANK	79,173	58.000	4,592,034.000	
	BANK ALBILAD	26,934	23.420	630,794.280	
	BANK AL-JAZIRA	29,448	12.900	379,879.200	
	BANQUE SAUDI FRANSI	39,754	30.150	1,198,583.100	
	RIYAD BANK	87,949	22.980	2,021,068.020	
	SAMBA FINANCIAL GROUP	59,210	26.200	1,551,302.000	
	SAUDI TELECOM CO	25,005	101.000	2,525,505.000	
	SAUDI ARABIAN FERTILIZER CO	12,215	80.400	982,086.000	
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	48,259	88.500	4,270,921.500	
	SAUDI CEMENT CO	5,494	65.800	361,505.200	
	SAUDI ELECTRICITY CO	61,075	20.500	1,252,037.500	
	SAUDI INDUSTRIAL INVESTMENT GROUP	16,160	21.700	350,672.000	
	SAVOLA GROUP	19,176	28.000	536,928.000	
	NATIONAL INDUSTRIALIZATION CO	24,022	12.820	307,962.040	
	ALMARAI CO JSC	18,322	47.100	862,966.200	
	EMAAR ECONOMIC CITY	28,034	9.230	258,753.820	
	SAHARA INTERNATIONAL PETROCHEMICAL CO	26,336	16.500	434,544.000	
	ADVANCED PETROCHEMICAL CO	7,773	47.000	365,331.000	
	SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	53,869	9.690	521,990.610	
	DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEVELOPMENT CO	38,785	11.640	451,457.400	
	RABIGH REFINING & PETROCHEMICAL CO	16,050	19.420	311,691.000	
	BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE INSURANCE CO	2,022	106.800	215,949.600	
	ALINMA BANK	40,244	20.460	823,392.240	
	SAUDI ARABIAN MINING CO	29,973	42.900	1,285,841.700	
	SAUDI AIRLINES CATERING CO	2,944	85.000	250,240.000	
NATIONAL COMMERCIAL BANK	76,336	43.200	3,297,715.200		

サウジアラビア・リアル 小計		954,609		33,384,443.960 (963,808,897)	
タイ・パーツ	BANGKOK BANK PCL	38,300	168.000	6,434,400.000	
	BERLI JUCKER PCL NVDR	88,100	51.250	4,515,125.000	
	KRUNG THAI BANK PCL NVDR	286,500	16.800	4,813,200.000	
	RATCHABURI ELECTRICITY GENERATING HOLDING PCL NVDR	25,700	70.500	1,811,850.000	
	ROBINSON PCL-NVDR	38,800	65.000	2,522,000.000	
	SIAM COMMERCIAL BANK PCL NVDR	68,700	114.500	7,866,150.000	
	TRUE CORP PCL NVDR	711,055	5.100	3,626,380.500	
	KASIKORNBANK PCL NVDR	55,300	148.000	8,184,400.000	
	TMB BANK PCL -NVDR	1,010,000	1.510	1,525,100.000	
	IRPC PCL NVDR	679,600	3.660	2,487,336.000	
	BANPU PCL PUBLIC CO LTD NVDR	384,200	13.300	5,109,860.000	
	ELECTRICITY GENERATING PCL NVDR	17,900	353.000	6,318,700.000	
	SHIN CORP PCL	153,900	65.750	10,118,925.000	
	CHAROEN POKPHAND FOODS PCL	231,800	26.250	6,084,750.000	
	ADVANCED INFO SERVICE PCL	72,500	226.000	16,385,000.000	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	300,620	16.700	5,020,354.000	
	PTT PCL	761,200	44.500	33,873,400.000	
	THAI UNION GROUP PCL- NVDR	315,400	15.400	4,857,160.000	
	LAND AND HOUSES PCL NVDR	413,400	9.700	4,009,980.000	
	SIAM CEMENT PCL NVDR	55,850	372.000	20,776,200.000	
	AIRPORTS OF THAILAND PCL-NVDR	278,400	73.750	20,532,000.000	
	KASIKORNBANK PCL - FOREIGN	79,100	148.000	11,706,800.000	
	CENTRAL PATTANA PCL NVDR	151,000	62.500	9,437,500.000	
	BANGKOK DUSIT MEDICAL SERVICES NVDR	622,800	23.300	14,511,240.000	
BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR	34,200	123.500	4,223,700.000		
MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	177,210	35.500	6,290,955.000		
THAI OIL PCL NVDR	72,200	69.250	4,999,850.000		
CP ALL PCL NVDR	375,500	79.750	29,946,125.000		
BTS GROUP HOLDINGS PCL	531,300	13.400	7,119,420.000		
PTT EXPLORATION & PRODUCTION PCL NVDR	96,945	118.000	11,439,510.000		

	TOTAL ACCESS COMMUNICATION PCL	66,700	57.000	3,801,900.000	
	INDORAMA VENTURES PCL NVDR	85,422	31.500	2,690,793.000	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	148,408	52.250	7,754,318.000	
	ENERGY ABSOLUTE PCL NVDR	89,800	49.500	4,445,100.000	
	BANGKOK EXPRESSWAY & METRO PCL NVDR	612,500	10.800	6,615,000.000	
	GULF ENERGY DEVELOPMENT PCL NVDR	34,900	159.500	5,566,550.000	
	MUANGTHAI CAPITAL PCL NVDR	59,400	57.250	3,400,650.000	
	タイ・パーツ 小計	9,224,610		310,821,681.500 (1,103,416,969)	
チェコ・コルナ	KOMERCNI BANKA AS	5,669	743.000	4,212,067.000	
	CEZ	8,401	510.500	4,288,710.500	
	MONETA MONEY BANK AS	39,312	72.950	2,867,810.400	
	チェコ・コルナ 小計	53,382		11,368,587.900 (52,409,190)	
チリ・ペソ	BANCO SANTANDER CHILE	5,043,748	51.100	257,735,522.800	
	BANCO DE CREDITO E INVERSIONES	2,485	45,694.000	113,549,590.000	
	BANCO DE CHILE	2,676,799	101.950	272,899,658.050	
	EMPRESAS CMPC SA	55,525	1,765.000	98,001,625.000	
	EMPRESAS COPEC SA	21,456	6,910.000	148,260,960.000	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	13,024	7,985.000	103,996,640.000	
	ENTEL CHILE SA	13,572	6,324.000	85,829,328.000	
	ENEL AMERICAS SA	2,616,813	137.500	359,811,787.500	
	COLBUN SA	554,294	137.190	76,043,593.860	
	AGUAS ANDINAS SA	224,014	388.000	86,917,432.000	
	EMBOTELLADORA ANDINA SA	35,748	2,340.200	83,657,469.600	
	LATAM AIRLINES GROUP SA	23,621	8,200.000	193,692,200.000	
	SOCIEDAD QUIMICA Y MINERA DE CHILE SA	9,147	19,299.000	176,527,953.000	
	SACI FALABELLA	43,443	4,085.000	177,464,655.000	
	ITAU CORPBANCA	13,236,977	5.353	70,857,537.880	
	CENCOSUD SA	64,086	1,110.000	71,135,460.000	
	ENEL CHILE SA	2,205,539	64.520	142,301,376.280	
	チリ・ペソ 小計	26,840,291		2,518,682,788.970 (379,061,760)	
トルコ・リラ	AKBANK TAS	186,045	7.290	1,356,268.050	
	ANADOLU EFES BIRACILIK VE MALT SANAYII AS	1,860	20.000	37,200.000	
	ARCELIK	16,000	17.970	287,520.000	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	31,766	17.990	571,470.340	

	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIKALARI TAS	56,434	6.720	379,236.480	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	5,000	58.900	294,500.000	
	KOC HOLDING AS	49,560	18.230	903,478.800	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI AS	54,397	4.200	228,467.400	
	TURK HAVA YOLLARI	57,854	11.590	670,527.860	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	93,118	12.460	1,160,250.280	
	TURKIYE GARANTI BANKASI AS	142,362	9.310	1,325,390.220	
	TURKIYE IS BANKASI	151,063	5.940	897,314.220	
	TUPRAS TURKIYE PETROL RAFINE	7,949	128.100	1,018,266.900	
	HACI OMER SABANCI HOLDING AS	50,427	8.870	447,287.490	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	23,201	48.160	1,117,360.160	
	TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	13,735	24.320	334,035.200	
	トルコ・リラ 小計	940,771		11,028,573.400 (204,028,608)	
ハンガリー・ フォロント	RICHTER GEDEON NYRT	10,134	4,740.000	48,035,160.000	
	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NYRT	28,765	2,828.000	81,347,420.000	
	OTP BANK NYRT	13,775	12,530.000	172,600,750.000	
	ハンガリー・フォロント 小計	52,674		301,983,330.000 (108,200,627)	
パキスタン・ ルピー	MCB BANK LTD	33,000	171.950	5,674,350.000	
	OIL & GAS DEVELOPMENT CO LTD	74,500	126.400	9,416,800.000	
	HABIB BANK LTD	45,000	130.870	5,889,150.000	
	パキスタン・ルピー 小計	152,500		20,980,300.000 (14,686,210)	
フィリピン・ ペソ	AYALA LAND INC	461,400	46.800	21,593,520.000	
	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	85,530	51.900	4,439,007.000	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAND	89,510	93.050	8,328,905.500	
	AYALA CORP	16,883	861.000	14,536,263.000	
	ALLIANCE GLOBAL GROUP INC	52,000	10.660	554,320.000	
	DMCI HOLDINGS INC	50	8.660	433.000	
	GLOBE TELECOM INC	2,785	1,813.000	5,049,205.000	
	INTERNATIONAL CONTAINER TERM SERVICES INC	62,790	118.000	7,409,220.000	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	162,710	70.900	11,536,139.000	

	JOLLIBEE FOODS CORP	36,330	229.000	8,319,570.000	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	143,447	67.800	9,725,706.600	
	BDO UNIBANK INC	149,133	145.000	21,624,285.000	
	MEGAWORLD CORP	962,000	4.530	4,357,860.000	
	PLDT INC	6,525	1,107.000	7,223,175.000	
	ROBINSONS LAND CORP	214,900	25.500	5,479,950.000	
	SECURITY BANK CORP	23,420	199.000	4,660,580.000	
	SM PRIME HOLDINGS INC	634,975	38.500	24,446,537.500	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	58,300	157.500	9,182,250.000	
	SM INVESTMENTS CORP	17,403	1,000.000	17,403,000.000	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CORP	1,148,900	4.880	5,606,632.000	
	ABOITIZ POWER CORP	153,700	37.200	5,717,640.000	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	12,630	365.000	4,609,950.000	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	3,651	840.000	3,066,840.000	
	フィリピン・ペソ 小計	4,498,972		204,870,988.600 (428,180,366)	
ブラジル・リアル	BRF SA	34,292	36.860	1,264,003.120	
	VALE SA	208,621	47.240	9,855,256.040	
	RAIA DROGASIL SA	16,500	100.710	1,661,715.000	
	TIM PARTICIPACOES SA	41,300	11.540	476,602.000	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	19,250	37.490	721,682.500	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	16,400	35.300	578,920.000	
	BANCO DO BRASIL SA	60,300	44.400	2,677,320.000	
	INVESTIMENTOS ITAU SA	303,860	12.430	3,776,979.800	
	LOJAS AMERICANAS SA	40,374	19.690	794,964.060	
	GERDAU SA	70,630	12.980	916,777.400	
	CIA BRASILEIRA DE DISTRIBUICAO GRUPO PAO DE ACUCAR	8,706	79.630	693,258.780	
	PETROLEO BRASILEIRO SA	198,210	29.070	5,761,964.700	
	PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	43,200	26.580	1,148,256.000	
	PETROLEO BRASILEIRO SA	286,112	26.740	7,650,634.880	
	KROTON EDUCACIONAL SA	82,068	10.380	851,865.840	
	CCR SA	71,820	16.820	1,208,012.400	
	WEG SA	55,072	22.970	1,265,003.840	
	BANCO BRADESCO SA PREF	269,450	33.630	9,061,603.500	
	BANCO BRADESCO SA	83,641	30.950	2,588,688.950	
	NATURA COSMETICOS SA	24,600	31.820	782,772.000	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	47,606	13.090	623,162.540	
	SUZANO SA	36,775	33.950	1,248,511.250	
	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	332,247	33.450	11,113,662.150	

	PORTO SEGURO SA	8,800	55.580	489,104.000	
	B2W CIA DIGITAL	17,000	49.100	834,700.000	
	BRASKEM SA	15,730	28.380	446,417.400	
	ENGIE BRASIL SA	15,487	42.200	653,551.400	
	LOCALIZA RENT A CAR	36,180	42.070	1,522,092.600	
	TELEFONICA BRASIL S.A.	31,928	53.130	1,696,334.640	
	LOJAS RENNER SA	57,737	48.590	2,805,440.830	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	41,004	18.650	764,724.600	
	COSAN SA	12,000	54.510	654,120.000	
	EQUATORIAL ENERGIA SA	10,900	98.900	1,078,010.000	
	EMBRAER SA	50,960	17.050	868,868.000	
	M DIAS BRANCO SA	10,400	34.300	356,720.000	
	BR MALLS PARTICIPACOES SA	63,965	13.910	889,753.150	
	JBS SA	72,200	29.150	2,104,630.000	
	CIA ENERGETICA DE MINAS GERAIS	51,849	13.670	708,775.830	
	CIA DE SANEAMENTO BASICO DO ESTADO DE SAO PAULO	19,798	49.800	985,940.400	
	MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS IMOBILIARIOS SA	23,340	27.500	641,850.000	
	HYPERA SA	29,600	33.400	988,640.000	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BAICAO	135,216	44.060	5,957,616.960	
	MAGAZINE LUIZA SA	40,900	38.940	1,592,646.000	
	CIELO SA	84,907	7.470	634,255.290	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	45,700	33.050	1,510,385.000	
	NOTRE DAME INTERMEDICA PARTICIPACOES SA	23,600	57.760	1,363,136.000	
	ATACADAO DISTRIBUICAO COMERCIO E INDUSTRIA LTDA	27,000	18.900	510,300.000	
	AMBEV SA	305,895	18.420	5,634,585.900	
	RUMO SA	69,000	23.640	1,631,160.000	
	IRB BRASIL RESSEGUROS S/A	42,600	35.830	1,526,358.000	
	ブラジル・リアル 小計	3,694,730		105,571,732.750 (2,777,592,289)	
ポーランド・ズロチ	BANK MILLENNIUM SA	49,782	5.560	276,787.920	
	MBANK	1,047	355.600	372,313.200	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	7,166	77.700	556,798.200	
	BANK PEKAO SA	11,985	104.000	1,246,440.000	
	ORANGE POLSKA SA	58,600	5.690	333,434.000	
	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	19,130	101.950	1,950,303.500	

	LPP SA	110	7,790.000	856,900.000	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	2,258	284.800	643,078.400	
	CD PROJEKT RED SA	4,504	230.500	1,038,172.000	
	POWSZECHNA KASA OSZCZEDNOSCI BANK POLSKI SA	60,904	37.230	2,267,455.920	
	CCC SA	2,025	128.000	259,200.000	
	GRUPA LOTOS SA	6,865	91.520	628,284.800	
	POLSKIE GORNICtwo NAFTOWE I GAZOWNICTWO SA	75,839	4.574	346,887.580	
	CYFROWY POLSAT SA	23,495	27.640	649,401.800	
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	70,529	7.904	557,461.210	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZEN SA	36,949	36.550	1,350,485.950	
	JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA SA	4,000	21.240	84,960.000	
	ALIOR BANK SA	2,278	34.020	77,497.560	
	DINO POLSKA SA	3,444	144.300	496,969.200	
	ポーランド・ズロチ 小計	440,910		13,992,831.240 (386,342,071)	
マレーシア・リンギット	AMMB HOLDINGS BHD	134,500	3.830	515,135.000	
	GENTING PLANTATIONS BHD	13,100	10.080	132,048.000	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	332,800	4.860	1,617,408.000	
	DIGI.COM BHD	161,500	4.640	749,360.000	
	MALAYSIA AIRPORTS HOLDINGS BHD	48,320	8.580	414,585.600	
	RHB BANK BHD	67,480	5.660	381,936.800	
	HAP SENG CONSOLIDATED BHD	41,300	9.770	403,501.000	
	TOP GLOVE CORP BHD	148,100	4.310	638,311.000	
	GAMUDA BHD	124,000	3.760	466,240.000	
	GENTING BHD	125,600	5.600	703,360.000	
	YTL CORP BHD	283,710	0.935	265,268.850	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP BHD	20,256	16.040	324,906.240	
	HONG LEONG BANK BHD	50,408	16.120	812,576.960	
	IJM CORP BHD	153,360	2.200	337,392.000	
	IOI CORP BHD	106,413	4.220	449,062.860	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	35,400	21.440	758,976.000	
	FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	3,400	34.220	116,348.000	
	MALAYAN BANKING BHD	268,675	8.390	2,254,183.250	
	ALLIANCE BANK MALAYSIA BHD	88,400	2.630	232,492.000	
	MISC BHD	90,280	8.040	725,851.200	
	NESTLE MALAYSIA BHD	4,700	144.600	679,620.000	

	PPB GROUP BHD	47,560	17.900	851,324.000	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	19,600	23.100	452,760.000	
	PETRONAS GAS BHD	34,600	16.380	566,748.000	
	GENTING MALAYSIA BHD	203,700	3.030	617,211.000	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD	7,700	17.280	133,056.000	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	110,300	3.390	373,917.000	
	SP SETIA BHD	130,000	1.320	171,600.000	
	TENAGA NASIONAL BHD	219,350	13.660	2,996,321.000	
	QL RESOURCES BHD	53,800	7.150	384,670.000	
	DIALOG GROUP BHD	231,044	3.390	783,239.160	
	PUBLIC BANK BHD(LOCAL)	197,630	19.180	3,790,543.400	
	AIRASIA GROUP BHD	199,300	1.650	328,845.000	
	SIME DARBY BERHAD	259,100	2.280	590,748.000	
	HARTALEGA HOLDINGS BHD	117,100	5.200	608,920.000	
	AXIATA GROUP BERHAD	173,500	4.270	740,845.000	
	MAXIS BHD	116,200	5.450	633,290.000	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	156,600	7.180	1,124,388.000	
	IHH HEALTHCARE BHD	182,000	5.670	1,031,940.000	
	WESTPORTS HOLDINGS BHD	64,500	4.180	269,610.000	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDINGS BHD	51,900	4.690	243,411.000	
	SIME DARBY PROPERTY BHD	190,000	0.820	155,800.000	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	114,000	4.600	524,400.000	
	マレーシア・リンギット 小計	5,181,186		30,352,149.320 (783,996,017)	
メキシコ・ペ ソ	ALFA SAB DE CV	264,100	17.360	4,584,776.000	
	EL PUERTO DE LIVERPOOL SAB DE CV	13,600	106.040	1,442,144.000	
	GRUPO BIMBO SAB DE CV	124,900	35.390	4,420,211.000	
	GRUMA SAB DE CV	10,340	199.650	2,064,381.000	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INFRAESTRUCTURA	20,260	177.980	3,605,874.800	
	GRUPO CARSO SAB DE CV	37,600	57.980	2,180,048.000	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE SAB DE CV	167,800	107.930	18,110,654.000	
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	94,025	38.740	3,642,528.500	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	9,655	242.710	2,343,365.050	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO SAB DE CV	99,000	39.180	3,878,820.000	
	ALSEA SAB DE CV	19,900	47.590	947,041.000	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL SURESTE SAB DE CV	12,300	304.980	3,751,254.000	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV	239,052	45.810	10,950,972.120	

	AMERICA MOVIL SAB DE CV	2,314,678	14.880	34,442,408.640	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA SA	176,800	24.960	4,412,928.000	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	31,600	109.050	3,445,980.000	
	WAL-MART DE MEXICO SAB DE CV	345,600	55.370	19,135,872.000	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL PACIFICO SAB DE CV	19,500	196.460	3,830,970.000	
	INFRAESTRUCTURA ENERGETICA NOVA SAB DE CV	24,800	85.090	2,110,232.000	
メキシコ・ペソ	小計	4,025,510		129,300,460.110 (718,910,558)	
ユーロ	ALPHA BANK A.E.	86,619	1.626	140,842.490	
	NATIONAL BANK OF GREECE	35,020	2.550	89,301.000	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	14,304	13.000	185,952.000	
	FF GROUP	3,130	0.000	0.000	
	EUROBANK ERGASIAS	178,915	0.860	153,866.900	
	MOTOR OIL HELLAS CORINTH REFIN	3,854	20.860	80,394.440	
	OPAP SA	19,846	9.365	185,857.790	
	JUMBO SA	6,853	16.970	116,295.410	
	TITAN CEMENT INTERNATIONAL SA	2,700	18.200	49,140.000	
ユーロ	小計	351,241		1,001,650.030 (119,206,370)	
韓国・ウォン	CHEIL WORLDWIDE INC	5,553	24,200.000	134,382,600.000	
	HANMI SCIENCE CO LTD	1,187	39,500.000	46,886,500.000	
	HYUNDAI MOTOR CO LTD- 2ND PFD	3,124	81,000.000	253,044,000.000	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANC	1,975	213,000.000	420,675,000.000	
	DB INSURANCE CO LTD	4,376	49,000.000	214,424,000.000	
	WOONGJIN COWAY CO LTD	3,865	81,500.000	314,997,500.000	
	KT&G CORP	7,884	101,000.000	796,284,000.000	
	S-1 CORPORATION	1,444	95,500.000	137,902,000.000	
	KOREA GAS CORP	1,737	39,000.000	67,743,000.000	
	CJ CORP	197	77,900.000	15,346,300.000	
	KAKAO CORP	3,350	136,500.000	457,275,000.000	
	CJ ENM CO LTD	563	159,000.000	89,517,000.000	
	DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE	2,634	30,050.000	79,151,700.000	
	SK TELECOM CO LTD	1,341	233,000.000	312,453,000.000	
	DAELIM INDUSTRIAL CO	1,323	93,300.000	123,435,900.000	
	MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD	33,940	7,170.000	243,349,800.000	
	NCSOFT CORPORATION	1,142	521,000.000	594,982,000.000	
	LG UPLUS CORP	9,656	13,700.000	132,287,200.000	

DAEWOO ENGINEERING & CONSTRUCT	13,540	4,520.000	61,200,800.000	
POSCO INTERNATIONAL CORP	3,600	17,900.000	64,440,000.000	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD	586	1,288,000.000	754,768,000.000	
LG CHEM LTD	2,952	297,000.000	876,744,000.000	
LG CHEM LTD	726	162,500.000	117,975,000.000	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD	201	743,000.000	149,343,000.000	
SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD	29,147	40,900.000	1,192,112,300.000	
S-OIL CORP	2,872	101,500.000	291,508,000.000	
HANWHA CHEMICAL CORPORATION	8,289	17,400.000	144,228,600.000	
MERITZ SECURITIES CO LTD	11,739	4,790.000	56,229,810.000	
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	4,354	34,300.000	149,342,200.000	
POSCO CHEMICAL CO LTD	2,126	42,300.000	89,929,800.000	
LOTTE CHEMICAL CORPORATION	1,085	232,000.000	251,720,000.000	
HOTEL SHILLA CO LTD	2,355	78,300.000	184,396,500.000	
KOREA SHIPBUILDING & OFFSHORE ENGINEERING CO LTD	2,508	127,500.000	319,770,000.000	
HYUNDAI MOBIS	4,618	245,500.000	1,133,719,000.000	
SK HYNIX INC	35,926	79,000.000	2,838,154,000.000	
HYUNDAI ENGINEERING & CONSTRUCTION CO LTD	4,701	44,000.000	206,844,000.000	
HYUNDAI MOTOR CO	744	73,200.000	54,460,800.000	
HYUNDAI MOTOR CO	9,785	126,500.000	1,237,802,500.000	
HYUNDAI STEEL CO	6,974	36,250.000	252,807,500.000	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	14,942	12,300.000	183,786,600.000	
KCC CORP	109	206,000.000	22,454,000.000	
KIA MOTORS CORP	17,752	42,300.000	750,909,600.000	
KOREA ZINC CO LTD	519	433,500.000	224,986,500.000	
KOREA ELECTRIC POWER CORP	19,519	25,600.000	499,686,400.000	
HANWHA CORP	137	23,300.000	3,192,100.000	
KOREAN AIR CO LTD	2,656	22,950.000	60,955,200.000	
OCI COMPANY LTD	1,315	68,300.000	89,814,500.000	
CJ LOGISTICS	985	144,500.000	142,332,500.000	
KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	1,509	69,600.000	105,026,400.000	
HLB INC	2,106	112,500.000	236,925,000.000	
LG ELECTRONICS INC	7,254	68,300.000	495,448,200.000	
LOTTE CORP	2,810	36,050.000	101,300,500.000	
LG CORP	6,170	67,300.000	415,241,000.000	

NH INVESTMENT & SECURITIES CO LTD	4,435	12,300.000	54,550,500.000	
GS ENGINEERING & CONSTRUCTION	4,436	30,600.000	135,741,600.000	
NAVER CORP	9,164	153,500.000	1,406,674,000.000	
HYUNDAI DEPARTMENT STORE CO LTD	121	74,700.000	9,038,700.000	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO LTD	2,236	71,800.000	160,544,800.000	
OTTOGI CORP	100	563,000.000	56,300,000.000	
AMOREPACIFIC GROUP	2,018	71,600.000	144,488,800.000	
KANGWON LAND INC	8,336	29,150.000	242,994,400.000	
POSCO	5,251	220,500.000	1,157,845,500.000	
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	11,773	16,550.000	194,843,150.000	
SAMSUNG SDI CO LTD	3,821	232,500.000	888,382,500.000	
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO LTD	3,670	112,500.000	412,875,000.000	
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	322,130	48,550.000	15,639,411,500.000	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES CO LTD	27,888	7,980.000	222,546,240.000	
SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	55,914	39,650.000	2,216,990,100.000	
SHINSEGAE CO LTD	725	245,000.000	177,625,000.000	
YUHAN CORP	750	225,500.000	169,125,000.000	
HANON SYSTEMS	13,526	11,450.000	154,872,700.000	
HYUNDAI MARINE & FIRE INSURANCE CO LTD	5,667	24,400.000	138,274,800.000	
GS HOLDINGS CORP	2,933	49,500.000	145,183,500.000	
LG DISPLAY CO LTD	14,911	14,050.000	209,499,550.000	
CELLTRION INC	6,232	181,000.000	1,127,992,000.000	
HELIXMITH CO LTD	1,305	110,000.000	143,550,000.000	
HANA FINANCIAL GROUP	21,628	32,700.000	707,235,600.000	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	1,420	149,500.000	212,290,000.000	
CELLTRION PHARM INC	683	39,600.000	27,046,800.000	
LOTTE SHOPPING CO	301	124,000.000	37,324,000.000	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LTD	4,580	68,200.000	312,356,000.000	
AMOREPACIFIC CORP	2,030	145,000.000	294,350,000.000	
AMOREPACIFIC CORP-PREF	1,184	73,300.000	86,787,200.000	
SAMSUNG CARD CO	2,877	33,300.000	95,804,100.000	
SK INNOVATION CO LTD	3,938	163,000.000	641,894,000.000	
CJ CHEILJEDANG CORP	705	212,000.000	149,460,000.000	
STX PAN OCEAN CO LTD	18,395	4,325.000	79,558,375.000	
LG INNOTEK CO LTD	999	114,000.000	113,886,000.000	
SK HOLDINGS CO LTD	2,286	225,500.000	515,493,000.000	
KB FINANCIAL GROUP INC	25,851	40,850.000	1,056,013,350.000	
MEDY-TOX INC	320	366,600.000	117,312,000.000	

	KOREA AEROSPACE INDUSTRIES LTD	6,602	38,000.000	250,876,000.000	
	BNK FINANCIAL GROUP INC	9,460	6,850.000	64,801,000.000	
	HANMI PHARM CO LTD	250	291,500.000	72,875,000.000	
	HANWHA LIFE INSURANCE CO LTD	11,369	2,270.000	25,807,630.000	
	FILA KOREA LTD	2,826	57,300.000	161,929,800.000	
	E-MART CO LTD	1,295	107,500.000	139,212,500.000	
	GS RETAIL CO LTD	2,482	41,600.000	103,251,200.000	
	HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO LTD	4,090	29,900.000	122,291,000.000	
	HDC HYUNDAI DEVELOPMENT CO-ENGINEERING & CONSTRUCTION	1,233	29,950.000	36,928,350.000	
	HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOLDINGS CO LTD	644	348,000.000	224,112,000.000	
	BGF RETAIL CO LTD	631	191,500.000	120,836,500.000	
	ORION CORP REPUBLIC OF KOREA	1,298	103,500.000	134,343,000.000	
	ORANGE LIFE INSURANCE LTD	2,763	26,350.000	72,805,050.000	
	NETMARBLE CORP	2,378	96,200.000	228,763,600.000	
	WOORI FINANCIAL GROUP INC	28,543	11,200.000	319,681,600.000	
	CJ CORP-PREFERENCE	176	57,700.000	10,155,200.000	
	SAMSUNG SDS CO LTD	2,403	192,500.000	462,577,500.000	
	SAMSUNG C&T CORP	6,199	88,500.000	548,611,500.000	
	SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	1,066	326,000.000	347,516,000.000	
	PEARL ABYSS CORP	534	199,700.000	106,639,800.000	
	DOOSAN BOBCAT INC	3,636	31,850.000	115,806,600.000	
	SILLAJEN INC	5,857	15,100.000	88,440,700.000	
	CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	3,789	54,800.000	207,637,200.000	
	韓国・ウォン 小計	1,005,965		51,815,749,305.000 (4,715,233,187)	
香港・ドル	JIANGXI COPPER CO LTD	124,000	8.730	1,082,520.000	
	JIANGSU EXPRESS	124,000	10.100	1,252,400.000	
	CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD	66,000	4.710	310,860.000	
	ANGANG STEEL CO LTD-H	1,200	2.770	3,324.000	
	CHINA MOBILE LIMITED	408,500	65.200	26,634,200.000	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	74,000	45.950	3,400,300.000	
	DATANG INTERNATIONAL POWER GEN	430,000	1.550	666,500.000	
	BEIJING ENTERPRISES	43,000	35.500	1,526,500.000	
	HUANENG POWER INTERNATIONAL IN	328,000	3.660	1,200,480.000	

ALIBABA HEALTH INFORMATION TECHNOLOGY	218,000	7.160	1,560,880.000	
YANZHOU COAL MINING CO LTD	112,000	7.950	890,400.000	
HENGAN INTERNATIONAL GROUP	49,500	50.950	2,522,025.000	
HUADIAN POWER INTL CORP-H	144,000	2.960	426,240.000	
CHINA EASTERN AIRLINES CORP LT	124,000	3.800	471,200.000	
CNOOC LTD	1,171,000	11.500	13,466,500.000	
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	212,000	8.360	1,772,320.000	
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LTD	328,000	17.060	5,595,680.000	
CHINA OVERSEAS LAND & INVESTME	241,120	25.250	6,088,280.000	
CHINA RESOURCES LAND LTD	178,888	34.350	6,144,802.800	
CITIC LTD	416,000	9.860	4,101,760.000	
BEIJING CAPITAL INTERNATIONAL	130,000	7.320	951,600.000	
LENOVO GROUP LTD	554,000	5.220	2,891,880.000	
PETRO CHINA CO LTD	1,416,000	4.000	5,664,000.000	
CHINA UNICOM HONG KONG LTD	428,742	8.440	3,618,582.480	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS CO LTD	111,190	17.180	1,910,244.200	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL COR	1,671,200	4.550	7,603,960.000	
TONG REN TANG TECHNOLOGIES CO	86,000	7.310	628,660.000	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	72,000	16.700	1,202,400.000	
KINGDEE INTERNATIONAL SOFTWARE GROUP CO LTD	167,000	8.210	1,371,070.000	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	51,900	83.300	4,323,270.000	
KUNLUN ENERGY COMPANY LTD	232,000	6.430	1,491,760.000	
TOWNGAS CHINA CO LTD	80,000	5.900	472,000.000	
COSCO SHIPPING PORTS LTD	152,000	6.310	959,120.000	
YUEXIU PROPERTY CO LTD	634,000	1.720	1,090,480.000	
CHINA MERCHANTS PORT HOLDINGS CO LTD	76,000	12.040	915,040.000	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	374,000	2.480	927,520.000	
CHINA DING YI FENG HOLDINGS LTD	80,000	11.550	924,000.000	

SHANGHAI INDUSTRIAL URBAN DEVELOPMENT GROUP LTD	58,000	1.020	59,160.000	
SHENZHEN INTERNATIONAL HOLDING	56,000	15.260	854,560.000	
CHINA EVERBRIGHT LTD	38,000	9.490	360,620.000	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	121,200	31.350	3,799,620.000	
KINGBOARD HOLDINGS LTD	33,500	19.980	669,330.000	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LTD	352,000	13.860	4,878,720.000	
SHENZHEN INVESTMENT LTD	138,000	2.990	412,620.000	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LTD	56,000	40.300	2,256,800.000	
BYD CO LTD	48,000	38.100	1,828,800.000	
CHINA TELECOM CORP LTD	840,000	3.600	3,024,000.000	
CHINA OILFIELD SERVICES LTD	134,000	9.380	1,256,920.000	
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	860,000	1.300	1,118,000.000	
SINOTRANS LTD	160,000	2.490	398,400.000	
MAANSHAN IRON & STEEL	140,000	2.940	411,600.000	
CHINA EVERBRIGHT INTERNATIONAL	241,592	6.030	1,456,799.760	
MMG LTD	180,000	1.690	304,200.000	
LEE & MAN PAPER MANUFACTURING LTD	84,000	4.060	341,040.000	
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	429,788	9.150	3,932,560.200	
AVICHINA INDUSTRY & TECHNOLOGY	189,000	3.790	716,310.000	
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS	159,200	9.470	1,507,624.000	
GREAT WALL MOTOR COMPANY LTD	246,000	5.170	1,271,820.000	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	520,000	17.980	9,349,600.000	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD	401,000	2.670	1,070,670.000	
CHINA ORIENTAL GROUP CO LTD	70,000	2.660	186,200.000	
SHANDONG WEIGAO GROUP MEDICAL-H	176,000	8.390	1,476,640.000	
SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	193,700	9.720	1,882,764.000	
WEICHAJ POWER CO LTD	125,440	11.200	1,404,928.000	
CHINA SHIPPING DEVELOPMENT CO	100,000	3.510	351,000.000	
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEMICAL	287,000	2.210	634,270.000	
SHANGHAI INDUSTRIAL	58,000	14.560	844,480.000	

TINGYI HOLDING CORP	122,000	10.660	1,300,520.000	
TSINGTAO BREWERY CO LTD	22,000	48.250	1,061,500.000	
GUANGDONG INVESTMENTS LTD	186,000	16.140	3,002,040.000	
CHINA TRADITIONAL CHINESE MEDICINE HOLDINGS CO LTD	208,000	3.700	769,600.000	
CHINA RESOURCES BEER HOLDINGS	103,333	42.300	4,370,985.900	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO LTD	48,000	6.610	317,280.000	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	431,500	10.860	4,686,090.000	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	191,000	31.050	5,930,550.000	
TENCENT HOLDINGS LTD	384,200	318.800	122,482,960.000	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	371,000	91.100	33,798,100.000	
LI NING CO LTD	119,000	25.850	3,076,150.000	
BEIJING ENTERPRISES WATER GROUP LTD	338,000	3.980	1,345,240.000	
GOME RETAIL HOLDINGS LTD	970,240	0.720	698,572.800	
CHINA POWER INTERNATIONAL	210,000	1.650	346,500.000	
AIR CHINA / HONG KONG	86,000	6.700	576,200.000	
ZTE CORP	47,288	21.750	1,028,514.000	
SHANGHAI ELECTRIC GROUP CO LTD	70,000	2.460	172,200.000	
CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD	239,000	15.580	3,723,620.000	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO LTD	98,500	2.880	283,680.000	
BANK OF COMMUNICATIONS	506,205	5.050	2,556,335.250	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT HOLDINGS LTD	150,250	7.110	1,068,277.500	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	44,500	44.600	1,984,700.000	
CHINA CONSTRUCTION BANK	6,504,530	6.000	39,027,180.000	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP HOLDINGS LTD	54,200	102.600	5,560,920.000	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	142,000	7.520	1,067,840.000	
AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	80,000	9.860	788,800.000	
SSY GROUP LTD	104,000	6.350	660,400.000	
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS LTD	80,000	6.380	510,400.000	
CHINA NATIONAL BLDG MATERIAL	206,000	6.860	1,413,160.000	
BANK OF CHINA LTD	5,329,200	3.070	16,360,644.000	

SHUI ON LAND LTD	300,000	1.550	465,000.000	
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	77,000	24.800	1,909,600.000	
GUANGZHOU R&F PROPERTIES CO LTD	60,000	12.020	721,200.000	
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	253,470	37.000	9,378,390.000	
IND & COMM BK OF CHINA - H	4,336,235	5.270	22,851,958.450	
ZHAOJIN MINING INDUSTRY CO LTD	24,000	9.330	223,920.000	
KINGBOARD LAMINATES HOLDING	104,000	7.010	729,040.000	
CHINA COMMUNICATIONS SERVICES	179,600	4.550	817,180.000	
CHINA COMMUNICATIONS CONSTRUCTION CO LTD	290,000	6.040	1,751,600.000	
CHINA COAL ENERGY CO	160,000	3.180	508,800.000	
HAITIAN INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	54,000	16.040	866,160.000	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC CO LTD	48,500	31.600	1,532,600.000	
HAIER ELECTRONICS GROUP CO LTD	83,000	20.650	1,713,950.000	
CHINA AGRI-INDUSTRIES HOLDINGS LTD	191,000	2.640	504,240.000	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD	539,142	10.300	5,553,162.600	
CHINA MOLYBDENUM CO LTD	216,000	2.550	550,800.000	
CHINA CITIC BANK-H	588,800	4.210	2,478,848.000	
KWG GROUP HOLDINGS LTD	61,000	7.220	440,420.000	
SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	50,200	117.400	5,893,480.000	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	77,000	69.800	5,374,600.000	
FOSUN INTERNATIONAL	173,028	9.800	1,695,674.400	
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP LTD	318,000	4.760	1,513,680.000	
CHINA AOYUAN GROUP LTD	34,000	9.050	307,700.000	
SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD	133,500	2.640	352,440.000	
BOSIDENG INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	150,000	3.560	534,000.000	
SOHO CHINA LTD	170,000	2.250	382,500.000	
KINGSOFT CORP LTD	58,000	18.140	1,052,120.000	
SINOTRUK HONG KONG LTD	70,000	11.100	777,000.000	
CHINA RAILWAY GROUP LTD	288,000	4.680	1,347,840.000	
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS LTD	53,000	8.530	452,090.000	

BYD ELECTRONIC INTERNATIONAL CO LTD	52,500	11.520	604,800.000	
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION CORP	165,000	8.730	1,440,450.000	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	321,000	6.150	1,974,150.000	
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	168,600	28.900	4,872,540.000	
CHINA EVERGRANDE GROUP	104,000	17.140	1,782,560.000	
CRRG CORP LTD - H	342,450	5.300	1,814,985.000	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDINGS LTD	67,000	9.650	646,550.000	
SUN ART RETAIL GROUP LTD	211,500	8.260	1,746,990.000	
BBMG CORP	222,000	2.320	515,040.000	
CHINA ZHONGWANG HOLDINGS LTD	130,000	3.110	404,300.000	
SINOPHARM GROUP CO	96,800	25.550	2,473,240.000	
CHINA RESOURCES CEMENT	190,000	7.920	1,504,800.000	
METALLURGICAL CORP OF CHINA LTD	189,000	1.680	317,520.000	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD	190,527	8.000	1,524,216.000	
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	84,500	4.900	414,050.000	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL BANK	181,000	4.120	745,720.000	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP CORP	272,000	4.190	1,139,680.000	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD	48,200	14.340	691,188.000	
HUANENG RENEWABLES CORP LTD	330,000	2.960	976,800.000	
SIHUAN PHARMACEUTICAL HOLDINGS GROUP LTD	260,000	1.130	293,800.000	
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	172,000	32.500	5,590,000.000	
YUZHOU PROPERTIES CO LTD	130,000	3.120	405,600.000	
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	128,500	30.900	3,970,650.000	
NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	50,800	31.150	1,582,420.000	
CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	555,656	5.340	2,967,203.040	
KAISA GROUP HOLDINGS LTD	203,000	3.590	728,770.000	

XINJIANG GOLDWIND SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	55,200	9.380	517,776.000	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD	322,000	3.400	1,094,800.000	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA	1,928,000	3.070	5,918,960.000	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS LTD	39,500	25.500	1,007,250.000	
FAR EAST HORIZON LTD	146,000	6.930	1,011,780.000	
CITIC SECURITIES CO LTD	133,000	14.880	1,979,040.000	
FUTURE LAND DEVELOPMENT HOLDINGS LTD	132,000	6.980	921,360.000	
HAITONG SECURITIES CO LTD	177,200	8.340	1,477,848.000	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROUP OF CHINA LTD	509,000	3.110	1,582,990.000	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	31,000	21.150	655,650.000	
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	142,000	4.570	648,940.000	
SINOPEC ENGINEERING GROUP CO LTD	121,500	4.730	574,695.000	
CHINA GALAXY SECURITIES CO LTD	306,000	4.160	1,272,960.000	
HANERGY THIN FILM POWER GROUP	986,000	0.000	0.000	
NEXTEER AUTOMOTIVE GROUP LTD	120,000	6.250	750,000.000	
CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS CO LTD	323,000	0.000	0.000	
GREENTOWN SERVICE GROUP CO LTD	96,000	7.610	730,560.000	
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO LTD	59,800	12.220	730,756.000	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA CO LTD	474,000	4.800	2,275,200.000	
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING LTD	35,000	47.750	1,671,250.000	
GENSCRIPT BIOTECH CORP	54,000	15.060	813,240.000	
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLDINGS CO LTD	93,000	24.300	2,259,900.000	
CHINA FIRST CAPITAL GROUP LTD	188,000	2.180	409,840.000	
CHINA EDUCATION GROUP HOLDINGS LTD	19,000	12.020	228,380.000	
CHINA TOWER CORP LTD	2,744,000	1.750	4,802,000.000	
XIAOMI CORP	502,400	8.800	4,421,120.000	
WUXI APPTec CO LTD	11,400	87.100	992,940.000	

	MEITUAN DIANPING	66,700	91.150	6,079,705.000	
	HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDING LTD	32,000	36.200	1,158,400.000	
	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	158,000	4.650	734,700.000	
	CHINA CINDA ASSET MANAGEMENT CO LTD	516,000	1.580	815,280.000	
	LOGAN PROPERTY HOLDINGS CO LTD	102,000	11.020	1,124,040.000	
	CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS LTD	95,000	29.500	2,802,500.000	
	CHINA VANKE CO LTD-H	85,261	27.600	2,353,203.600	
	LUYE PHARMA GROUP LTD	143,000	5.750	822,250.000	
	HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	39,000	15.380	599,820.000	
	CGN POWER CO LTD	749,000	1.930	1,445,570.000	
	BAIC MOTOR CORP LTD	175,000	4.920	861,000.000	
	GF SECURITIES CO LTD	112,000	8.450	946,400.000	
	FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD	24,400	21.600	527,040.000	
	HUATAI SECURITIES CO LTD	124,800	12.020	1,500,096.000	
	3SBIO INC	64,500	13.720	884,940.000	
	LEGEND HOLDINGS CORP	13,500	17.300	233,550.000	
	CHINA RESOURCES PHARMACEUTICAL GROUP LTD	93,000	7.460	693,780.000	
	CHINA HUARONG ASSET MANAGEMENT CO LTD	604,000	1.190	718,760.000	
	CHINA LITERATURE LTD	15,600	26.150	407,940.000	
	DALI FOODS GROUP CO LTD	188,000	5.070	953,160.000	
	CHINA RAILWAY SIGNAL & COMMUNICATION CORP LTD	141,000	4.620	651,420.000	
	CHINA REINSURANCE GROUP CORP	525,000	1.240	651,000.000	
	MEITU INC	152,500	1.720	262,300.000	
	BOC AVIATION LTD	8,800	71.250	627,000.000	
	ZHONGAN ONLINE P&C INSURANCE CO LTD	23,000	18.680	429,640.000	
	CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CORP LTD	96,000	14.800	1,420,800.000	
	WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	36,500	81.200	2,963,800.000	
	HENG TEN NETWORKS GROUP LTD	2,096,000	0.119	249,424.000	
	香港・ドル 小計	65,284,675		609,566,542.980 (8,405,922,625)	
台湾・ドル	ACER INC	220,532	17.300	3,815,203.600	
	ASUSTEK COMPUTER INC	51,554	200.500	10,336,577.000	

REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	32,616	230.500	7,517,988.000	
ASIA CEMENT CORP	164,928	42.300	6,976,454.400	
WALSIN TECHNOLOGY CORP	29,000	180.000	5,220,000.000	
TAIWAN BUSINESS BANK	300,779	12.450	3,744,698.550	
VANGUARD INTERNATIONAL SEMICONDUCTOR CORP	66,000	61.700	4,072,200.000	
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO LTD	51,000	88.300	4,503,300.000	
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	54,975	92.200	5,068,695.000	
QUANTA COMPUTER INC	160,858	54.400	8,750,675.200	
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	58,070	45.300	2,630,571.000	
EVA AIRWAYS CORP	202,125	13.750	2,779,218.750	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	39,760	252.000	10,019,520.000	
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	416,771	21.600	9,002,253.600	
CHINA AIRLINES	156	9.060	1,413.360	
CHENG SHIN RUBBER INDUSTRY CO	161,169	44.900	7,236,488.100	
CHINA STEEL CORP	721,058	22.900	16,512,228.200	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD/TAIWAN	190,994	24.200	4,622,054.800	
ADVANTECH CO LTD	17,889	279.000	4,991,031.000	
COMPAL ELECTRONICS INC	199,304	17.700	3,527,680.800	
DELTA ELECTRONICS INC	142,663	127.000	18,118,201.000	
NANYA TECHNOLOGY CORP	68,000	71.400	4,855,200.000	
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	250,327	111.500	27,911,460.500	
AU OPTRONICS CORP	742,194	7.890	5,855,910.660	
TAIWAN MOBILE CO LTD	96,800	112.500	10,890,000.000	
EVERGREEN MARINE CORP	198,276	12.700	2,518,105.200	
FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	243,824	28.350	6,912,410.400	
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	27,307	217.500	5,939,272.500	
ECLAT TEXTILE CO LTD	15,322	400.500	6,136,461.000	
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	40,285	181.000	7,291,585.000	
FORMOSA PLASTICS CORP	296,633	93.100	27,616,532.300	
FORMOSA TAFFETA CO LTD	8,000	34.450	275,600.000	
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE CO	232,594	86.400	20,096,121.600	
GIANT MANUFACTURING	24,151	214.500	5,180,389.500	
MEDIATEK INC	102,507	372.000	38,132,604.000	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD	426,936	43.900	18,742,490.400	

HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	589,459	21.100	12,437,584.900	
HOTAI MOTOR CO LTD	22,000	464.000	10,208,000.000	
FAR EASTONE TELECOMMUNICATIONS CO LTD	122,000	72.100	8,796,200.000	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	702,141	18.050	12,673,645.050	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	494,920	40.550	20,069,006.000	
CHINA DEPT FINANCIAL HOLDING	834,403	9.110	7,601,411.330	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO LTD	638,545	26.250	16,761,806.250	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	832,225	72.900	60,669,202.500	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LTD	701,495	29.000	20,343,355.000	
LARGAN PRECISION CO LTD	7,220	4,460.000	32,201,200.000	
TAISHIN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	576,593	13.750	7,928,153.750	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING CO	795,061	9.450	7,513,326.450	
INVENTEC CO LTD	206,005	21.550	4,439,407.750	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	156,845	48.300	7,575,613.500	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	805,443	12.100	9,745,860.300	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,165,048	20.600	23,999,988.800	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO LTD	593,852	21.850	12,975,666.200	
POWERTECH TECHNOLOGY INC	61,560	87.300	5,374,188.000	
NAN YA PLASTICS CORP	347,828	69.000	24,000,132.000	
WISTRON CORP	213,916	26.100	5,583,207.600	
POU CHEN CORP	111,990	39.700	4,446,003.000	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CORP	303,297	72.000	21,837,384.000	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	42,392	284.500	12,060,524.000	
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	92,480	96.100	8,887,328.000	
PHISON ELECTRONICS CORP	12,658	273.000	3,455,634.000	
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	73,393	43.350	3,181,586.550	
RUENTEX INDUSTRIES LTD	829	69.600	57,698.400	
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	37,588	63.000	2,368,044.000	
STANDARD FOODS CORP	34,639	62.000	2,147,618.000	

	SYNNEX TECHNOLOGY INTERNATIONAL CORP	46,899	36.200	1,697,743.800	
	TAIWAN CEMENT CORP	363,684	39.500	14,365,518.000	
	TATUNG CO LTD	120,000	16.750	2,010,000.000	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR	1,663,083	282.000	468,989,406.000	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	713,525	13.150	9,382,853.750	
	WINBOND ELECTRONICS CORP	219,000	16.900	3,701,100.000	
	YAGEO CORP	14,160	301.500	4,269,240.000	
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	163,000	34.700	5,656,100.000	
	INNOLUX CORPORATION	666,345	6.800	4,531,146.000	
	WPG HOLDINGS CO LTD	109,203	36.750	4,013,210.250	
	HIWIN TECHNOLOGIES CORP	19,645	254.500	4,999,652.500	
	TAI MED BIOLOGICS INC	11,000	142.500	1,567,500.000	
	PEGATRON CORP	105,554	54.000	5,699,916.000	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	9,000	377.000	3,393,000.000	
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	22,000	284.500	6,259,000.000	
	CHAILEASE HOLDING CO LTD	69,029	123.000	8,490,567.000	
	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING LTD	25,385	119.000	3,020,815.000	
	TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL HOLDING	677,674	20.300	13,756,782.200	
	SHANGHAI COMMERCIAL & SAVINGS BANK LTD	233,000	50.200	11,696,600.000	
	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	220,903	72.400	15,993,377.200	
	GLOBALWAFERS CO LTD	19,000	325.000	6,175,000.000	
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	10,000	262.500	2,625,000.000	
	台湾・ドル 小計	22,132,271		1,299,432,898.450 (4,561,009,474)	
南アフリカ・ランド	BIDVEST GROUP LTD	18,432	197.650	3,643,084.800	
	CLICKS GROUP LTD	19,827	248.890	4,934,742.030	
	TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	37,135	52.170	1,937,332.950	
	DISCOVERY LTD	26,029	119.840	3,119,315.360	
	GOLD FIELDS LTD	54,414	84.410	4,593,085.740	
	REMGRO LTD	36,309	164.120	5,959,033.080	
	THE FOSCHINI GROUP LTD	12,960	159.910	2,072,433.600	
	MOMENTUM METROPOLITAN HOLDINGS LTD	31,809	19.570	622,502.130	
	EXXARO RESOURCES LTD	19,729	121.980	2,406,543.420	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	2,681	1,335.000	3,579,135.000	
	LIBERTY HOLDINGS LTD	3,907	118.000	461,026.000	

MTN GROUP LTD	116,247	94.660	11,003,941.020	
ANGLOGOLD ASHANTI LTD	28,905	315.000	9,105,075.000	
TELKOM SA SOC LTD	22,080	70.700	1,561,056.000	
FIRSTRAND LTD	234,367	64.550	15,128,389.850	
PSG GROUP LTD	11,126	222.400	2,474,422.400	
NASPERS LTD	29,527	2,260.000	66,731,020.000	
NEDBANK GROUP LTD	25,563	229.350	5,862,874.050	
NETCARE LTD	39,220	17.600	690,272.000	
PICK'N PAY STORES LTD	11,458	61.900	709,250.200	
RMB HOLDINGS LTD	48,890	78.200	3,823,198.000	
ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	4,377	1,097.000	4,801,569.000	
SAPPI LTD	50,570	36.880	1,865,021.600	
SASOL LTD	36,985	277.900	10,278,131.500	
SHOPRITE HOLDINGS LTD	33,217	126.760	4,210,586.920	
MR PRICE GROUP LTD	13,831	156.740	2,167,870.940	
STANDARD BANK GROUP LTD	87,634	176.000	15,423,584.000	
SPAR GROUP LTD/THE	12,986	191.460	2,486,299.560	
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	72,051	54.720	3,942,630.720	
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LTD	28,788	94.510	2,720,753.880	
ABSA GROUP LTD	48,353	155.250	7,506,803.250	
TIGER BRANDS LTD	15,965	208.640	3,330,937.600	
SANLAM LTD	121,412	76.460	9,283,161.520	
INVESTEC LTD	21,242	75.370	1,601,009.540	
KUMBA IRON ORE LTD	5,327	386.000	2,056,222.000	
LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDINGS LTD	61,447	22.960	1,410,823.120	
RMI HOLDINGS	55,570	29.790	1,655,430.300	
VODACOM GROUP PTY LTD	41,031	121.040	4,966,392.240	
NEPI ROCKCASTLE PLC	28,593	129.210	3,694,501.530	
OLD MUTUAL LTD	339,931	19.690	6,693,241.390	
REINET INVESTMENTS SCA	11,346	267.000	3,029,382.000	
MULTICHOICE GROUP LTD	28,769	119.740	3,444,800.060	
BID CORP LTD	21,757	342.290	7,447,203.530	
南アフリカ・ランド 小計	1,971,797		254,434,088.830 (1,831,925,440)	
合計	182,588,926		38,392,750,377 (38,392,750,377)	

(2) 株式以外の有価証券

令和1年10月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
新株予約権証券	タイ・パーツ	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	59,033.000	173,557.020	
		MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	9,465.000	34,452.600	
	タイ・パーツ 小計		68,498.000	208,009.620 (738,435)	
新株予約権証券 合計			68,498	738,435 (738,435)	
投資信託受益証券	ブラジル・レアル	BANCO BTG PACTUAL SA	12,400.000	665,880.000	
		BANCO SANTANDER BRASIL SA	27,800.000	1,271,016.000	
		ENERGISA SA	16,000.000	788,000.000	
		KLABIN SA	62,000.000	908,300.000	
		SUL AMERICA SA	17,869.000	849,134.880	
	ブラジル・レアル 小計		136,069.000	4,482,330.880 (117,930,125)	
	メキシコ・ペソ	CEMEX SAB DE CV	923,875.000	6,984,495.000	
		COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	39,700.000	4,763,603.000	
		FOMENTO ECONOMICO MEXICANO SAB DE CV	132,100.000	23,520,405.000	
		GRUPO TELEVISIA SAB	147,200.000	5,877,696.000	
		MEGACABLE HOLDINGS SAB DE CV	27,400.000	2,175,012.000	
メキシコ・ペソ 小計		1,270,275.000	43,321,211.000 (240,865,934)		
投資信託受益証券 合計			1,406,344	358,796,059 (358,796,059)	
投資証券	メキシコ・ペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	207,200.000	6,539,232.000	
	メキシコ・ペソ 小計		207,200.000	6,539,232.000 (36,358,130)	
	南アフリカ・ランド	FORTRESS REIT LTD	117,482.000	2,441,275.960	
		GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	184,218.000	4,137,536.280	
		REDEFINE PROPERTIES LTD	279,940.000	2,155,538.000	
	南アフリカ・ランド 小計		581,640.000	8,734,350.240 (62,887,322)	
投資証券 合計			788,840	99,245,452 (99,245,452)	
合計				458,779,946 (458,779,946)	

(注) 投資信託受益証券、投資証券及び新株予約権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	11.32	-	-	-	12.47
アラブ首長国連邦・ディル ハム	株式 8銘柄	0.60	-	-	-	0.66
イギリス・ポンド	株式 1銘柄	0.06	-	-	-	0.06
インド・ルピー	株式 80銘柄	7.93	-	-	-	8.74
インドネシア・ルピア	株式 27銘柄	1.82	-	-	-	2.01
オフショア・人民元	株式 84銘柄	2.33	-	-	-	2.57
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	0.37	-	-	-	0.40
サウジアラビア・リアル	株式 31銘柄	2.25	-	-	-	2.48
タイ・バーツ	株式 37銘柄 新株予約権証 券 2銘柄	2.58 -	- 0.00	- -	- -	2.84
チェコ・コルナ	株式 3銘柄	0.12	-	-	-	0.13
チリ・ペソ	株式 17銘柄	0.89	-	-	-	0.98
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	0.25	-	-	-	0.28
パキスタン・ルピー	株式 3銘柄	0.03	-	-	-	0.04
フィリピン・ペソ	株式 23銘柄	1.00	-	-	-	1.10
ブラジル・レアル	株式 50銘柄 投資信託受益 証券 5銘柄	6.49 -	- -	- 0.28	- -	7.45
ポーランド・ズロチ	株式 19銘柄	0.90	-	-	-	0.99
マレーシア・リングgit	株式 43銘柄	1.83	-	-	-	2.02
メキシコ・ペソ	株式 19銘柄 投資信託受益 証券 5銘柄 投資証券 1銘柄	1.68 - -	- - -	- 0.56 -	- - 0.08	2.56
ユーロ	株式 9銘柄	0.28	-	-	-	0.31
韓国・ウォン	株式 114銘柄	11.01	-	-	-	12.14
香港・ドル	株式 208銘柄	19.63	-	-	-	21.64
台湾・ドル	株式 87銘柄	10.65	-	-	-	11.74
南アフリカ・ランド	株式 43銘柄 投資証券 3銘柄	4.28 -	- -	- -	- 0.15	4.88

(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】

D I A Mコア資産設計ファンド(堅実型)

令和1年10月31日現在

資産総額	148,536,904円
負債総額	1,640,405円
純資産総額(-)	146,896,499円
発行済数量	142,225,123口
1口当たり純資産額(/)	1.0328円

D I A Mコア資産設計ファンド(積極型)

令和1年10月31日現在

資産総額	285,990,840円
負債総額	1,692,397円
純資産総額(-)	284,298,443円
発行済数量	281,730,430口
1口当たり純資産額(/)	1.0091円

(参考)

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和1年10月31日現在

資産総額	244,964,040,622円
負債総額	1,880,430,000円
純資産総額(-)	243,083,610,622円
発行済数量	183,291,976,206口
1口当たり純資産額(/)	1.3262円

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10月31日現在

資産総額	260,267,237,608円
負債総額	5,677,353,614円
純資産総額(-)	254,589,883,994円
発行済数量	96,622,221,425口
1口当たり純資産額(/)	2.6349円

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和1年10月31日現在

資産総額	148,868,126,339円
負債総額	819,537,700円
純資産総額(-)	148,048,588,639円
発行済数量	78,178,475,913口
1口当たり純資産額(/)	1.8937円

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和1年10月31日現在

資産総額	343,069,010,216円
負債総額	1,126,394,366円
純資産総額(-)	341,942,615,850円
発行済数量	90,494,611,138口
1口当たり純資産額(/)	3.7786円

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

令和1年10月31日現在

資産総額	165,474,600,148円
負債総額	17,497,218,307円
純資産総額(-)	147,977,381,841円
発行済数量	72,941,370,344口
1口当たり純資産額(/)	2.0287円

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

令和1年10月31日現在

資産総額	47,101,673,983円
負債総額	18,030,640円
純資産総額(-)	47,083,643,343円
発行済数量	40,873,515,395口
1口当たり純資産額(/)	1.1519円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 受益証券の名義書換

該当事項はありません。

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

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

(2) 受益者等名簿

該当事項はありません。

(3) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

(4) 受益権の譲渡制限

譲渡制限はありません。

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

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

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

(5) 受益権の譲渡の対抗要件

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

(6) 受益権の再分割

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

(7) 質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

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

第二部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額(2019年10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10月31日現在)

会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。

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

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

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

また、取締役会の決議によって、取締役社長を定めることができます。

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

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

投資運用の意思決定機構

1. 投資環境見直しおよび運用方針の策定

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

2.運用計画、売買計画の決定

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

2【事業の内容及び営業の概況】

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

2019年10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	1,198,457,447,167
追加型株式投資信託	865	13,922,418,811,581
単位型公社債投資信託	39	108,717,437,174
単位型株式投資信託	171	1,273,596,816,603
合計	1,101	16,503,190,512,525

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。
また、中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)、ならびに同規則第38条及び第57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．財務諸表及び中間財務諸表の金額は、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、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、第35期中間会計期間(自2019年4月1日至2019年9月30日)の中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の中間監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

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

(単位:千円)

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

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

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

(単位:千円)

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

(3) 【株主資本等変動計算書】

第33期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

(単位:千円)

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

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

第34期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

(単位:千円)

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

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

重要な会計方針

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

表示方法の変更

第34期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

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

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

注記事項

(貸借対照表関係)

1. 有形固定資産の減価償却累計額

(千円)

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

(損益計算書関係)

1. 関係会社に対する事項

(千円)

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

2. 固定資産除却損の内訳

(千円)

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

(株主資本等変動計算書関係)

第33期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

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

第34期（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

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

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

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

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

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

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

（4）金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。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 其他有価証券	1,448,968	1,448,968	-
資産計	78,947,251	78,947,251	-
(1) 未払手数料	4,629,133	4,629,133	-
負債計	4,629,133	4,629,133	-

第34期(2019年3月31日現在)

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

(注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3) 未収委託者報酬及び(4) 未収運用受託報酬

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

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

負 債

(1) 未払手数料

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

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(千円)

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

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

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

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第33期(2018年3月31日現在)

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

第34期(2019年3月31日現在)

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

(有価証券関係)

1. 子会社株式及び関連会社株式

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

2. その他有価証券

第33期(2018年3月31日現在)

(千円)

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

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

第34期(2019年3月31日現在)

(千円)

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

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

3. 当該事業年度中に売却したその他有価証券

第33期(自2017年4月1日至2018年3月31日)

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

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

第34期(自2018年4月1日至2019年3月31日)

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

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

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

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(千円)

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

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

(千円)

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

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

(千円)

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

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(千円)

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

(注) 特別損失に計上しております。

(5) 数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎

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

3. 簡便法を適用した確定給付制度

(1) 簡便法を適用した制度の、退職給付引当金の期首残高と期末残高の調整表

(千円)

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

(2) 退職給付費用

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

4. 確定拠出制度

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

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

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

(企業結合等関係)

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

1. 結合当事企業

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

2. 企業結合日

2016年10月1日

3. 企業結合の方法

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

4. 結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

5. 企業結合の主な目的

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

6. 合併比率

「3. 企業結合の方法」の吸収合併における合併比率は以下の通りであります。

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

(*) 普通株式と種類株式を合算して算定しております。

7. 交付した株式数

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

8. 経済的持分比率（議決権比率）

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

MHFGが企業結合日に追加取得した当社に対する経済的持分比率 20.00%

MHFGの追加取得後の当社に対する経済的持分比率 70.00%

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

9. 取得企業を決定するに至った主な根拠

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

10. 会計処理

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

11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

(1) 被取得企業の取得原価及びその内訳

取得の対価 MHAMの普通株式 144,212,500千円

取得原価 144,212,500千円

(2) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

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

(3) 企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

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

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

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

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

12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

(1) 貸借対照表項目

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

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

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

(2) 損益計算書項目

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

(注) 営業利益には、のれん及び顧客関連資産の償却額が含まれております。

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

(資産除去債務関係)

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

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

(セグメント情報等)

1. セグメント情報

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

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

(1) サービスごとの情報

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

(2) 地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

(1) 親会社及び法人主要株主等

第33期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

該当はありません。

第34期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

該当はありません。

(2) 子会社及び関連会社等

第33期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

該当はありません。

第34期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

該当はありません。

(3) 兄弟会社等

第33期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

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

第34期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

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

(1) 中間貸借対照表

(単位:千円)

	第35期中間会計期間末 (2019年9月30日現在)	
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金		37,156,171
金銭の信託		18,742,684
有価証券		997
未収委託者報酬		11,945,046
未収運用受託報酬		3,120,602
未収投資助言報酬		332,118
未収収益		58,808
前払費用		781,218
その他		2,233,840
	流動資産計	74,371,488
固定資産		
有形固定資産		
建物	1	1,051,855
器具備品	1	311,144
無形固定資産		
ソフトウェア		3,323,996
ソフトウェア仮勘定		213,219
電話加入権		3,931
電信電話専用施設利用権		6
投資その他の資産		
投資有価証券		958,309
関係会社株式		4,499,196
長期差入保証金		1,307,197
繰延税金資産		2,036,732
その他		95,551
	固定資産計	13,801,139
	資産合計	88,172,628

(単位:千円)

	第35期中間会計期間末 (2019年9月30日現在)
(負債の部)	
流動負債	
預り金	5,192,317
未払金	5,043,713
未払収益分配金	1,047
未払償還金	48,441
未払手数料	4,707,236
その他未払金	286,987
未払費用	6,512,990
未払法人税等	3,526,134
未払消費税等	516,610
前受収益	40,684
賞与引当金	1,281,617
役員賞与引当金	34,112
流動負債計	22,148,179
固定負債	
退職給付引当金	1,993,829
時効後支払損引当金	169,869
固定負債計	2,163,698
負債合計	24,311,878
(純資産の部)	
株主資本	
資本金	2,000,000
資本剰余金	19,552,957
資本準備金	2,428,478
その他資本剰余金	17,124,479
利益剰余金	41,866,681
利益準備金	123,293
その他利益剰余金	41,743,387
別途積立金	31,680,000
繰越利益剰余金	10,063,387
株主資本計	63,419,638
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	441,111
評価・換算差額等計	441,111
純資産合計	63,860,750
負債・純資産合計	88,172,628

(2) 中間損益計算書

(単位：千円)

	第35期中間会計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)	
営業収益		
委託者報酬	42,425,693	
運用受託報酬	7,240,514	
投資助言報酬	601,626	
その他営業収益	57,443	
	営業収益計	50,325,278
営業費用		
支払手数料	17,730,384	
広告宣伝費	125,471	
公告費	125	
調査費	12,182,415	
調査費	4,742,559	
委託調査費	7,439,855	
委託計算費	421,559	
営業雑経費	538,430	
通信費	22,517	
印刷費	410,573	
協会費	34,596	
諸会費	16,711	
支払販売手数料	54,031	
	営業費用計	30,998,386
一般管理費		
給料	4,829,571	
役員報酬	87,372	
給料・手当	4,615,868	
賞与	126,330	
交際費	17,168	
寄付金	6,499	
旅費交通費	165,035	
租税公課	291,415	
不動産賃借料	749,406	
退職給付費用	254,598	
固定資産減価償却費	1 345,421	
福利厚生費	21,538	
修繕費	1,263	
賞与引当金繰入額	1,281,617	
役員賞与引当金繰入額	34,112	
機器リース料	138	
事務委託費	1,700,671	
事務用消耗品費	50,852	
器具備品費	490	
諸経費	100,495	
	一般管理費計	9,850,295
営業利益		9,476,595

(単位:千円)

	第35期中間会計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)	
営業外収益		
受取利息	1,075	
受取配当金	11,185	
時効成立分配金・償還金	608	
時効後支払損引当金戻入額	7,743	
投資信託償還益	2,466	
受取負担金	287,268	
雑収入	2,670	
	営業外収益計	313,018
営業外費用		
為替差損	9,702	
投資信託償還損	1	
金銭の信託運用損	18,907	
雑損失	104	
	営業外費用計	28,716
経常利益		9,760,897
特別利益		
投資有価証券売却益	634,060	
	特別利益計	634,060
特別損失		
固定資産除却損	7,444	
	特別損失計	7,444
税引前中間純利益		10,387,514
法人税、住民税及び事業税		3,299,452
法人税等調整額		109,246
法人税等合計		3,190,205
中間純利益		7,197,308

(3) 中間株主資本等変動計算書

第35期中間会計期間（自 2019年4月1日 至 2019年9月30日）

	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	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	31,680,000	14,146,079
当中間期変動額							
剰余金の配当							11,280,000
中間純利益							7,197,308
株主資本以外 の項目の 当中間期変 動額(純額)							
当中間期変動額 合計	-	-	-	-	-	-	4,082,691
当中間期末残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	31,680,000	10,063,387

	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	45,949,372	67,502,329	846,755	846,755	68,349,085
当中間期変動額					
剰余金の配当	11,280,000	11,280,000			11,280,000
中間純利益	7,197,308	7,197,308			7,197,308
株主資本以外 の項目の 当中間期変 動額(純額)			405,643	405,643	405,643
当中間期変動額 合計	4,082,691	4,082,691	405,643	405,643	4,488,335
当中間期末残高	41,866,681	63,419,638	441,111	441,111	63,860,750

重要な会計方針

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 子会社株式及び関連会社株式 ：移動平均法による原価法</p> <p>(2) その他有価証券 時価のあるもの：中間決算日の市場価格等に基づく時価法 （評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定） 時価のないもの：移動平均法による原価法</p>
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
3. 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産 定率法を採用しております。 ただし、平成28年4月1日以降に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。 なお、主な耐用年数は次のとおりであります。 建物 … 6～18年 器具備品 … 2～20年</p> <p>(2) 無形固定資産 定額法を採用しております。 なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。</p>
4. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、中間決算日の直物等為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
5. 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金は、従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当中間会計期間に見合う分を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金は、役員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当中間会計期間に見合う分を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金は、従業員の退職給付に備えるため、退職一時金制度について、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。 退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 過去勤務費用については、その発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年）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、それぞれ発生の日翌事業年度から費用処理しております。</p> <p>(4) 時効後支払損引当金は、時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。</p>
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。

注記事項

（中間貸借対照表関係）

項目	第35期中間会計期間末 （2019年9月30日現在）	
1.有形固定資産の減価償却累計額	建物	274,959千円
	器具備品	965,214千円

（中間損益計算書関係）

項目	第35期中間会計期間 （自 2019年4月1日 至 2019年9月30日）	
1.減価償却実施額	有形固定資産	97,348千円
	無形固定資産	248,073千円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第35期中間会計期間（自 2019年4月1日 至 2019年9月30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）	当中間会計期間 増加株式数（株）	当中間会計期間 減少株式数（株）	当中間会計期間末 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
2019年6月20日 定時株主総会	普通株式	11,280,000	282,000	2019年3月31日	2019年6月21日
	A種種類 株式				

（2）基準日が当中間会計期間に属する配当のうち、配当の効力発生日が当中間会計期間後となるもの
該当事項はありません。

(金融商品関係)

第35期中間会計期間末(2019年9月30日現在)

金融商品の時価等に関する事項

2019年9月30日における中間貸借対照表計上額、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)。

	中間貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1) 現金・預金	37,156,171	37,156,171	-
(2) 金銭の信託	18,742,684	18,742,684	-
(3) 未収委託者報酬	11,945,046	11,945,046	-
(4) 未収運用受託報酬	3,120,602	3,120,602	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	699,937	699,937	-
資産計	71,664,441	71,664,441	-
(1) 未払手数料	4,707,236	4,707,236	-
負債計	4,707,236	4,707,236	-

(注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

(1) 現金・預金

これ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

区分	中間貸借対照表計上額 (千円)
非上場株式	259,369
関係会社株式	4,499,196

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

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

(有価証券関係)

第35期中間会計期間末

(2019年9月30日現在)

1. 子会社株式

関係会社株式(中間貸借対照表計上額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

区分	中間貸借対照表 計上額(千円)	取得原価 (千円)	差額 (千円)
中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの			
株式	691,010	58,146	632,863
投資信託	5,937	3,000	2,937
小計	696,947	61,146	635,800
中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
株式	-	-	-
投資信託	2,990	3,000	9
小計	2,990	3,000	9
合計	699,937	64,146	635,791

(注) 非上場株式(中間貸借対照表計上額259,369千円)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。

（企業結合等関係）

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

1. 結合当事企業

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

2. 企業結合日

2016年10月1日

3. 企業結合の方法

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

4. 結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

5. 企業結合の主な目的

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

6. 合併比率

「3. 企業結合の方法」の吸収合併における合併比率は以下の通りであります。

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

(*) 普通株式と種類株式を合算して算定しております。

7. 交付した株式数

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

8. 経済的持分比率（議決権比率）

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

MHFGが企業結合日に追加取得した当社に対する経済的持分比率 20.00%

MHFGの追加取得後の当社に対する経済的持分比率 70.00%

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

9. 取得企業を決定するに至った主な根拠

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

10. 会計処理

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

11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

(1) 中間財務諸表に含まれる被取得企業の業績の期間

2019年4月1日から2019年9月30日まで

(2) 被取得企業の取得原価及びその内訳

取得の対価 MHAMの普通株式 144,212,500千円

取得原価 144,212,500千円

(3) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

a. 発生したのれん金額 76,224,837千円

b. 発生原因 被取得企業から受け入れた資産及び引き受けた負債の純額と取得原価との差額によります。

c. のれんの償却方法及び償却期間 20年間の均等償却

(4) 企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

a. 資産の額 資産合計 40,451,657千円

うち現金・預金 11,605,537千円

うち金銭の信託 11,792,364千円

b. 負債の額 負債合計 9,256,209千円

うち未払手数料及び未払費用 4,539,592千円

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

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

a. 無形固定資産に配分された金額 53,030,000千円

b. 主要な種類別の内訳

顧客関連資産 53,030,000千円

c. 全体及び主要な種類別の加重平均償却期間

顧客関連資産 16.9年

12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

(1) 貸借対照表項目

流動資産	- 千円
固定資産	99,557,407千円
資産合計	99,557,407千円
流動負債	- 千円
固定負債	9,515,195千円
負債合計	9,515,195千円
純資産	90,042,211千円

(注) 固定資産及び資産合計には、のれんの金額64,791,112千円及び顧客関連資産の金額37,384,808千円が含まれております。

(2) 損益計算書項目

営業収益	- 千円
営業利益	4,477,219千円
経常利益	4,477,219千円
税引前中間純利益	4,551,164千円
中間純利益	3,763,741千円
1株当たり中間純利益	94,093円53銭

(注) 営業利益には、のれんの償却額1,905,620千円及び顧客関連資産の償却額2,574,777千円が含まれております。

(資産除去債務関係)

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

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

(セグメント情報等)

第35期中間会計期間(自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)

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

(1)サービスごとの情報

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

(2)地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3)主要な顧客ごとの情報

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

(1株当たり情報)

第35期中間会計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)	
1株当たり純資産額	1,596,518円75銭
1株当たり中間純利益金額	179,932円71銭

(注)潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載していません。

1株当たり中間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35期中間会計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)
中間純利益金額	7,197,308千円
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中間純利益金額	7,197,308千円
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
(うち普通株式)	(24,490株)
(うちA種種類株式)	(15,510株)

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

4【利害関係人との取引制限】

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

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

5【その他】

- (1) 定款の変更、事業譲渡又は事業譲受、出資の状況その他の重要事項
該当事項はありません。
- (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
信金中央金庫	(1) 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おります。
GMOクリック証券株式会社	4,346	「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。

(注) 資本金の額は2019年3月末日現在

(1) 出資の総額

(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月末日現在 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、各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7月11日
有価証券届出書	2019年7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) XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

令和1年11月21日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 丘本 正彦 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDIAMコア資産設計ファンド（堅実型）の平成31年4月12日から令和1年10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、DIAMコア資産設計ファンド（堅実型）の令和1年10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。

独立監査人の監査報告書

令和1年11月21日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 丘本 正彦 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDIAMコア資産設計ファンド（積極型）の平成31年4月12日から令和1年10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、DIAMコア資産設計ファンド（積極型）の令和1年10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。

独立監査人の中間監査報告書

2019年11月28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	山野 浩 印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	長谷川 敬 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2019年4月1日から2020年3月31日までの第35期事業年度の中間会計期間(2019年4月1日から2019年9月30日まで)に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間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中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、アセットマネジメントOne株式会社の2019年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間(2019年4月1日から2019年9月30日まで)の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

(注2) XBR Lデータは中間監査の対象には含まれておりません。