【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15日提出
【計算期間】	第2期　（自　2018年10月13日　至　2019年10月15日）
【ファンド名】	たわらノーロード　スマートグローバルバランス（保守型） たわらノーロード　スマートグローバルバランス（安定型） 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） たわらノーロード　スマートグローバルバランス（成長型） たわらノーロード　スマートグローバルバランス（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】

①各ファンドの目的は、以下の通りです。

（保守型）	安定した収益の確保を図ることを目的として、運用を行います。
（安定型）	安定した収益の確保と信託財産の着実な成長を図ることを目的として、運用を行います。
（安定成長型）	信託財産の着実な成長と安定した収益の確保を図ることを目的として、運用を行います。
（成長型）	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。
（積極型）	信託財産の成長を図ることを目的として、積極的な運用を行います。

②各ファンドの信託金限度額は、各々1兆円とします。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 主としてマザーファンド*1*2への投資を通じて、実質的に国内外の株式、公社債および不動産投資信託証券に投資します。

*1 各マザーファンドは各資産クラスの代表的な指数(インデックス)に連動した投資成果をめざして運用を行います。
*2 各ファンドが投資するマザーファンドは下記のとおりです。なお、短期金融資産等に「DIAMマネーマザーファンド」を通じてまたは直接投資する場合もあります。(以下および「DIAMマネーマザーファンド」を総称して「マザーファンド」あるいは個別に「各マザーファンド」といいます。)

マザーファンド	マザーファンドが連動対象とする指数	資産クラス
国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	東証株価指数(TOPIX)(配当込み)	国内株式
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	NOMURA-BPI総合	国内債券
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド*3	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)	先進国株式*
		先進国株式*(ヘッジあり)
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	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)	先進国債券*
為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース、為替ヘッジあり)	先進国債券*(ヘッジあり)
エマージング株式パッシブ・マザーファンド	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)	新興国株式
J-REITインデックスファンド・マザーファンド	東証REIT指数(配当込み)	国内リート
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	S&P 先進国 REITインデックス(除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)	先進国リート*

*3 先進国株式については、各ファンドにおいてその一部または全部の為替ヘッジを行います。
*先進国株式、先進国債券、先進国リートについては日本を除きます(以下同じ。)。

2 各資産への投資比率を委託会社が決定するにあたっては、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。

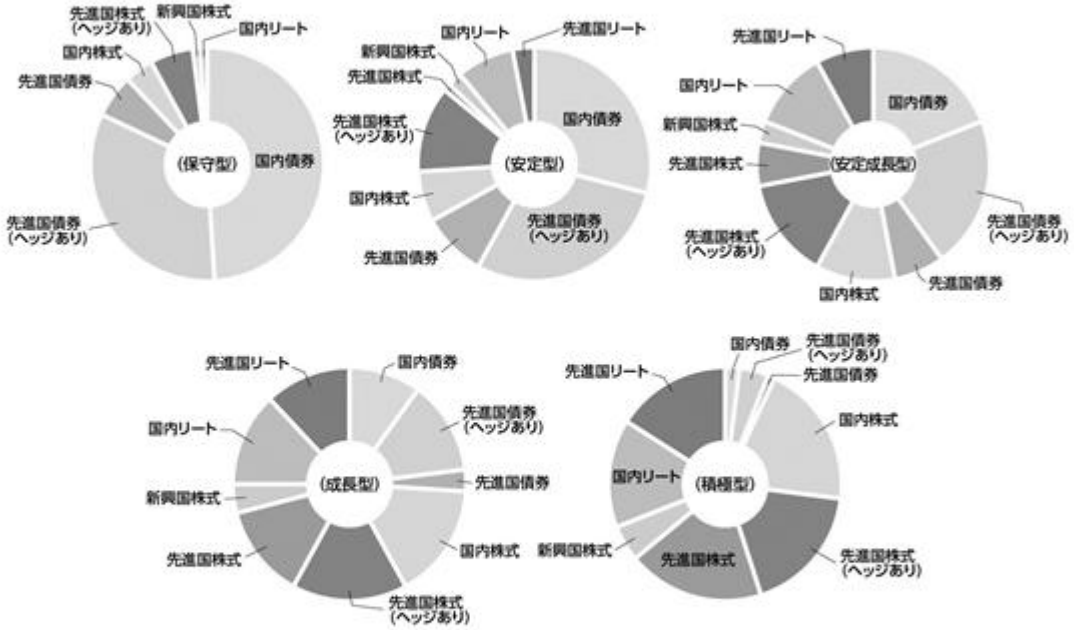
各ファンドにおける資産別の投資比率は、各資産に期待される収益率や過去一定期間における資産価格変動性(標準偏差)等、客観的に入手しうるデータに基づき、定量的に算出されます。
投資比率の見直しは原則として年2回行います。

みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社(FT社)について
・FT社は数理科学をベースとした総合リスク管理やデリバティブズおよび投資・運用手法などの金融技術の開発を総合的に行う会社です。
・資産運用に関連した業務としては、先端的な金融工学技術を活用し、精緻なリスク制御手法に基づいて資産運用商品の開発、コンサルティング、投資助言などを行なっています。

3 資産配分の組み合わせにより、運用方針*の異なる5つのファンドから選択できます。決定された投資比率に基づき、各マザーファンド受益証券への投資を行いポートフォリオを構築します。
なお、一部のマザーファンドへの投資配分比率がゼロとなる場合があります。

*ファンドの目的参照

〔各ファンドの投資比率〕



資産クラス	(保守型)	(安定型)	(安定成長型)	(成長型)	(積極型)
国内債券	49.0%	29.0%	19.0%	10.0%	2.0%
先進国債券(ヘッジあり)	33.0%	29.0%	21.0%	13.0%	4.0%
先進国債券	6.0%	9.0%	7.0%	3.0%	1.0%
国内株式	4.0%	7.0%	11.0%	16.0%	20.0%
先進国株式(ヘッジあり)	6.0%	12.0%	14.0%	16.0%	18.0%
先進国株式	0.0%	1.0%	6.0%	13.0%	19.0%
新興国株式	1.0%	2.0%	3.0%	4.0%	5.0%
国内リート	1.0%	8.0%	11.0%	13.0%	15.0%
先進国リート	0.0%	3.0%	8.0%	12.0%	16.0%

※2019年10月末現在のものであり、今後変更される可能性があります。

4 実質組入外貨建資産の一部について、対円での為替ヘッジを行います。

●実質組入外貨建資産のうち、先進国株式および先進国債券※については、その一部または全部につき為替ヘッジを行います。なお、先進国株式においては一部の通貨について委託会社がその通貨と相関が高いと判断する通貨を用いて、円に対する為替ヘッジを行う「代替ヘッジ」を行うことがあります。

※先進国債券についての為替ヘッジは、為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドへの投資を通じて行います。

運用プロセス

投資資産配分案の助言	みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社が、各資産の期待リターン、リスク等をもとに、資産配分案を助言
ポートフォリオの構築	委託会社は、助言された投資配分案をもとに各マザーファンド等への投資を行います。

■分配方針

年1回の決算時(毎年10月12日(休業日の場合は翌営業日))に、繰越分を含めた経費控除後の配当等収益および売買益(評価益を含みます。)等の全額を対象として、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して、分配金額を決定します。

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

＜商品分類＞

・商品分類表

各ファンド

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

（注）各ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

・商品分類定義

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

＜属性区分＞

・属性区分表

各ファンド

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

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

（注2）各ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

・属性区分定義

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

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

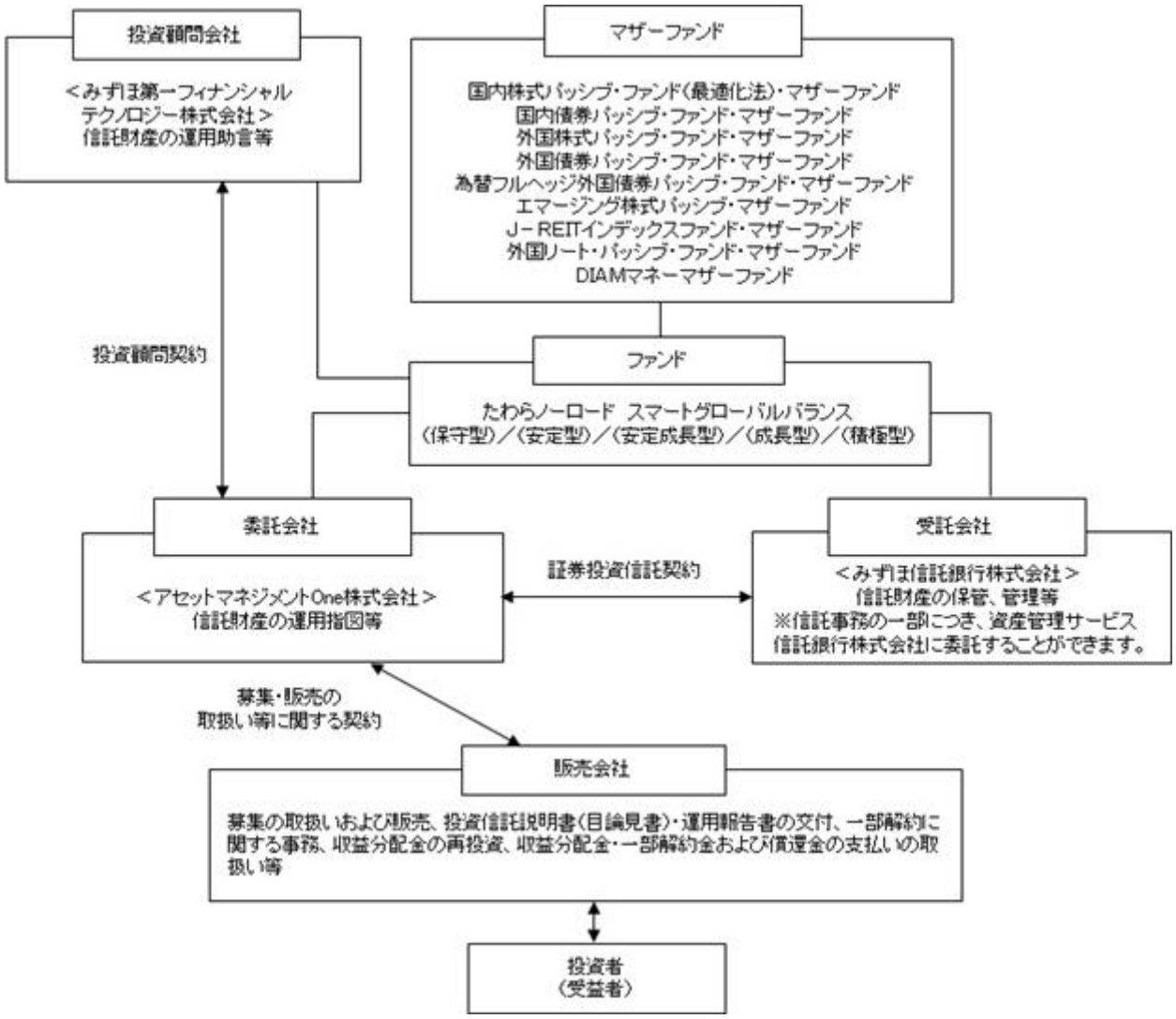
（注2）各ファンドが該当しない商品分類および属性区分の定義につきましては、一般社団法人投資信託協会のホームページ（https://www.toushin.or.jp/）でご覧いただけます。

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

（２）【ファンドの沿革】

2017年11月24日　　信託契約締結、ファンドの設定、ファンドの運用開始

（３）【ファンドの仕組み】



・「証券投資信託契約」の概要

委託会社と受託会社との間においては、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。

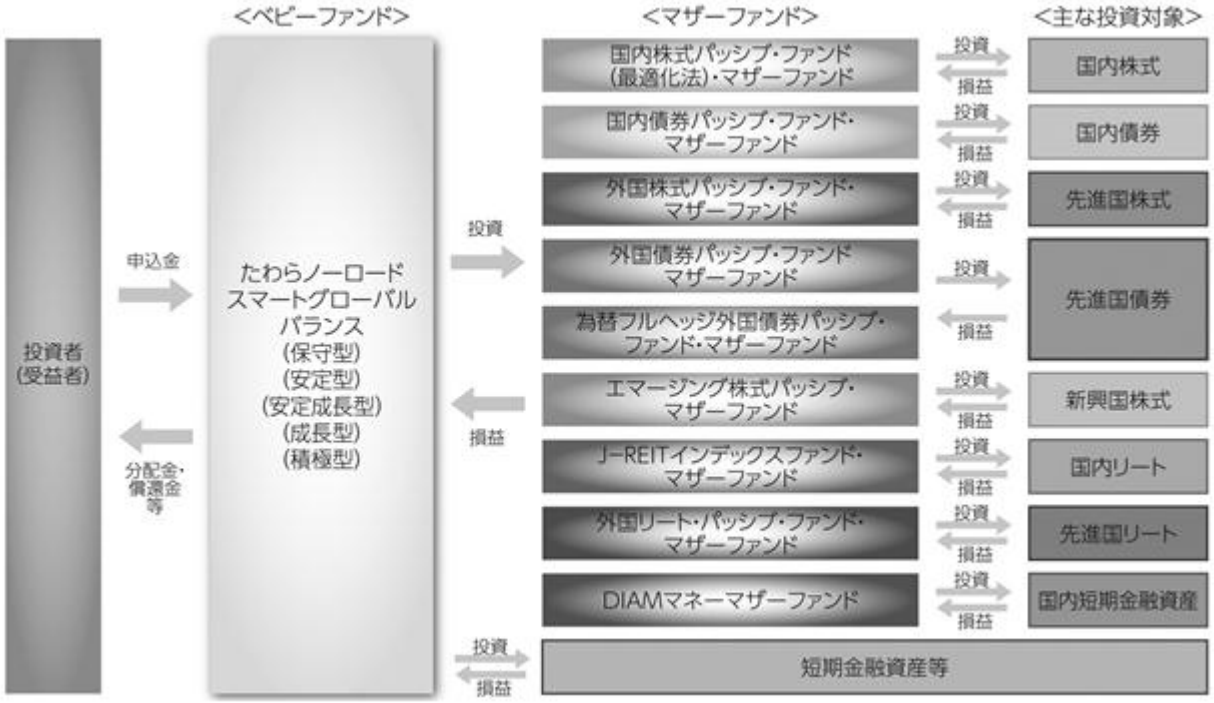
・「投資顧問契約」の概要

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、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受益証券に投資して、その実質的な運用を各マザーファンドにて行う仕組みです。



○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＞

（保守型）安定した収益の確保を図ることを目的として、運用を行います。
（安定型）安定した収益の確保と信託財産の着実な成長を図ることを目的として、運用を行います。
（安定成長型）信託財産の着実な成長と安定した収益の確保を図ることを目的として、運用を行います。
（成長型）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。
（積極型）信託財産の成長を図ることを目的として、積極的な運用を行います。

＜投資対象＞

「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」受益証券、「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「エマージング株式パッシブ・マザーファンド」受益証券、「Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド」受益証券、「外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券を主要投資対象とします。
なお、短期金融資産等に「ＤＩＡＭマネーマザーファンド」受益証券を通じてまたは直接投資する場合もあります。

＜投資態度＞

①主として次のマザーファンド受益証券への投資を通じて、各資産クラスの代表的な指数に連動する投資成果をめざして運用を行い、実質的に国内株式、国内債券、国内リート、先進国株式（除く日本）、先進国債券（除く日本）、先進国債券（除く日本、ヘッジあり）、先進国リート（除く日本）、新興国株式へ投資します。なお、先進国株式（除く日本）については、各ファンドにおいてその全部または一部の為替ヘッジ（注）を行う場合があります。
（注）一部の通貨については流動性の観点等から対円での為替ヘッジが困難であるため、主要国通貨で代替的にヘッジする場合があります。

マザーファンド	マザーファンドが 連動対象とする指数	資産クラス
国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	東証株価指数（TOPIX）（配当込み）	国内株式
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	NOMURA-BPI総合	国内債券
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	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）	先進国株式（除く日本）
		先進国株式（除く日本、ヘッジあり）
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	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）	先進国債券（除く日本）
為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジあり）	先進国債券（除く日本、ヘッジあり）
エマージング株式パッシブ・マザーファンド	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）	新興国株式
Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド	東証REIT指数（配当込み）	国内リート
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	S&P 先進国 REITインデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）	先進国リート（除く日本）

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

②各資産への投資比率を委託会社が決定するにあたっては、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。

③決定された投資比率に基づき、各マザーファンド受益証券への投資を行いポートフォリオを構築します。投資比率の見直しは原則として年２回行います。

なお、一部のマザーファンドへの投資配分比率がゼロとなる場合があります。

④ファンドの資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

（２）【投資対象】

①投資の対象とする資産の種類（約款第16条）

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ.有価証券

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

ハ.金銭債権

ニ.約束手形

2.次に掲げる特定資産以外の資産

イ.為替手形

②運用の指図範囲等（約款第17条第1項）

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

1．株券または新株引受権証書
2．国債証券
3．地方債証券
4．特別の法律により法人の発行する債券
5．社債券（新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。なお、社債券のうちで、新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの、ならびに会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を総称して以下「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）
6．資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
7．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。）
8．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。）
9．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。）
10.コマーシャル・ペーパー
11.新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
12.外国または外国の者の発行する証券または証書で、上記1.～11.の証券または証書の性質を有するもの
13.投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
14.投資証券、新投資口予約権証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいい、15.で定めるものを除きます。）
15.投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）または外国投資証券で投資法人債券に類する証券
16.外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）

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

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

19.外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

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

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

23.外国の者に対する権利で22.の有価証券の性質を有するもの

なお、1.の証券または証書、12.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6.までの証券ならびに15.の証券ならびに12.および18.の証券または証書のうち2.から6.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、13.の証券および14.の証券を以下「投資信託証券」といいます。

③運用の指図範囲等（約款第17条第2項）

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

1．預金

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

3．コール・ローン

4．手形割引市場において売買される手形

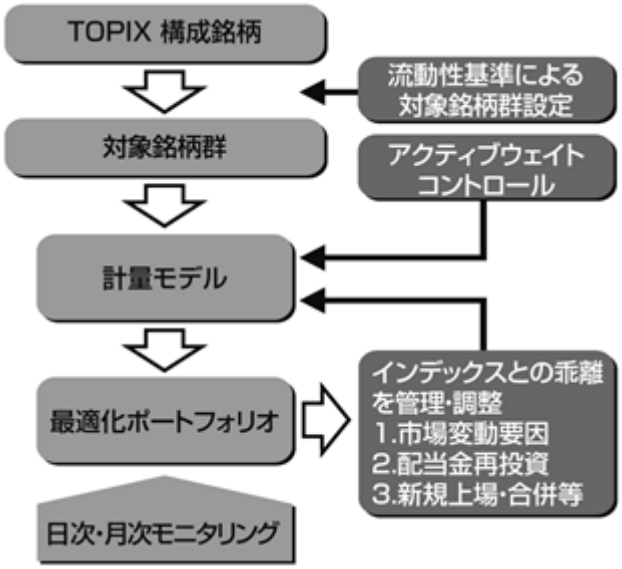
5．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

6．外国の者に対する権利で5.の権利の性質を有するもの

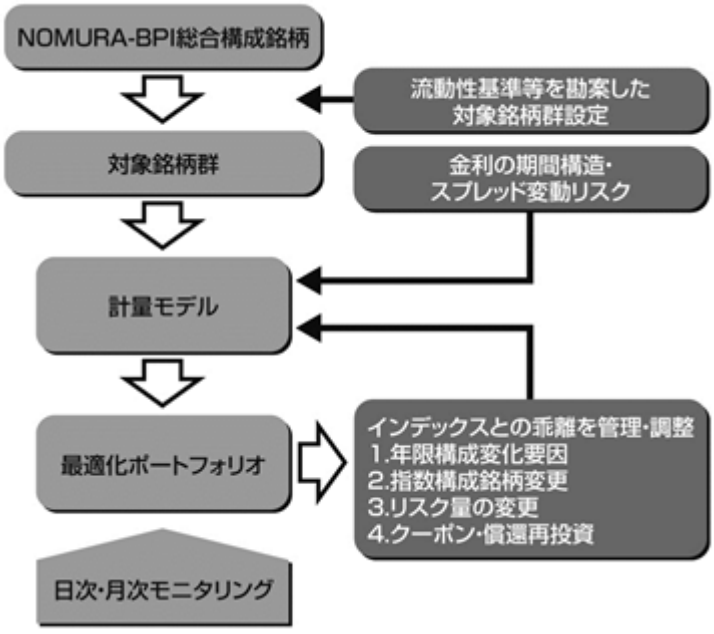
（参考）各ファンドが投資対象とするマザーファンドの概要

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

投資態度	1.主として東京証券取引所第1部に上場されている株式に投資し、「東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）（配当込み）」※に連動する投資成果をめざして運用を行います。 2.最適化法によるポートフォリオ構築を行い、運用コストの最小化と徹底したリスク管理を行います。 3.株式（株価指数先物取引を含みます。）の組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。 4.株式の組入比率の調整には、株価指数先物取引等を活用します。 5.非株式割合は原則として信託財産総額の50%以下とします。また、外貨建資産割合は原則として信託財産総額の10%以下とします。 ※①東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）の指数値およびＴＯＰＩＸの商標は、株式会社東京証券取引所（以下「㈱東京証券取引所」といいます。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）に関するすべての権利・ノウハウおよびＴＯＰＩＸの商標に関するすべての権利は㈱東京証券取引所が有しています。 ②㈱東京証券取引所は、東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）の指数値の算出もしくは公表の方法の変更、東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）の指数値の算出もしくは公表の停止またはＴＯＰＩＸの商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。 ③㈱東京証券取引所は、東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）の指数値およびＴＯＰＩＸの商標の使用に関して得られる結果ならびに特定日の東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）の指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。 ④㈱東京証券取引所は、東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）の指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、㈱東京証券取引所は、東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。 ⑤当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドは、㈱東京証券取引所により提供、保証または販売されるものではありません。 ⑥㈱東京証券取引所は、当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドの購入者または公衆に対し、当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を持ちません。 ⑦㈱東京証券取引所は、委託会社または当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドの購入者のニーズを、東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）の指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。 ⑧以上の項目に限らず、㈱東京証券取引所は当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドの発行または売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を負いません。

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

ファンド名	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

基本方針	この投資信託は、ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主な投資対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	1.主としてわが国の公社債に投資し、「ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合」※に連動する投資成果をめざして運用を行います。 2.公社債（債券先物取引等を含みます。）の組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。 3.公社債の組入比率の調整には、債券先物取引等を活用する場合があります。 ※ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合の知的財産権その他一切の権利は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。
運用プロセス	1.流動性基準等による対象銘柄群設定 ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合構成銘柄のうち、流動性基準等を勘案して投資対象銘柄群を設定します。 2.最適化法によるポートフォリオの構築 1）債券種別・格付けから発生するベンチマーク乖離要因 2）金利の期間構造、スプレッドの期間構造から発生するベンチマーク乖離要因 1）、2）が最小になると判断されるポートフォリオを構築します。 3.インデックスとの乖離を管理 日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。 インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。 ・年限構成変化要因　・指数構成銘柄変更 ・リスク量の変更　・クーポン、償還再投資 

主な投資制限	1.株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限ります。 2.株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 3.同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 4.同一銘柄の転換社債、ならびに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。

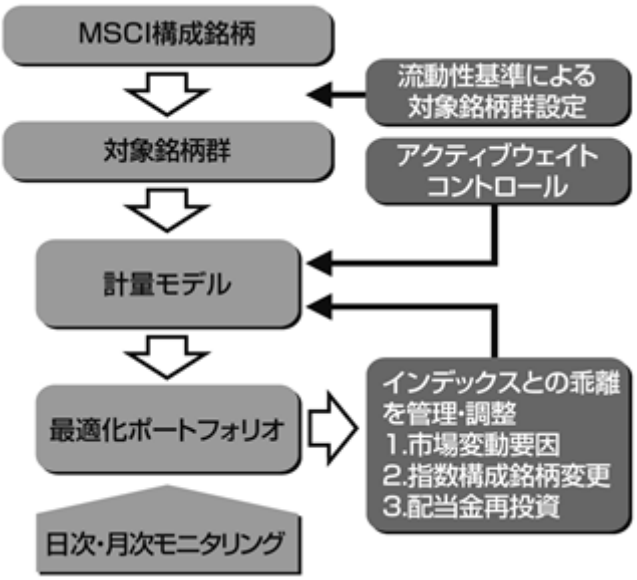
ファンド名	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。
主な投資対象	海外の株式を主要投資対象とします。

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

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

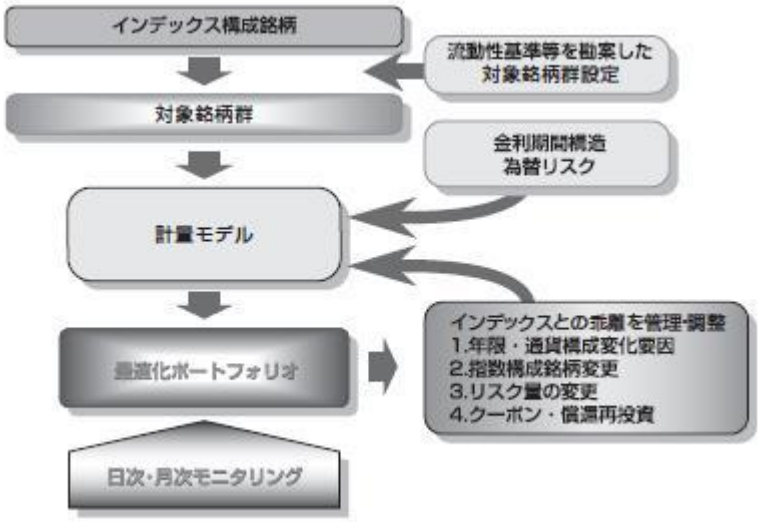
MSCIは、自らが信頼できると考える情報源からMSCI指数の計算に算入または使用するための情報を入手しますが、いかなるMSCI関係者も、MSCI指数またはそれに含まれるデータの独創性、正確性および／または完全性について保証するものではありません。いかなるMSCI関係者も、明示的か黙示的かを問わず、本ファンドの発行会社もしくは所有者、またはその他の者もしくは団体が、MSCI指数またはそれに含まれるデータを使用することにより得られる結果について保証を行いません。いかなるMSCI関係者も、MSCI指数またはそれに含まれるデータの、またはそれらに関連する過誤、脱漏または中断について責任を負いません。ま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

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

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

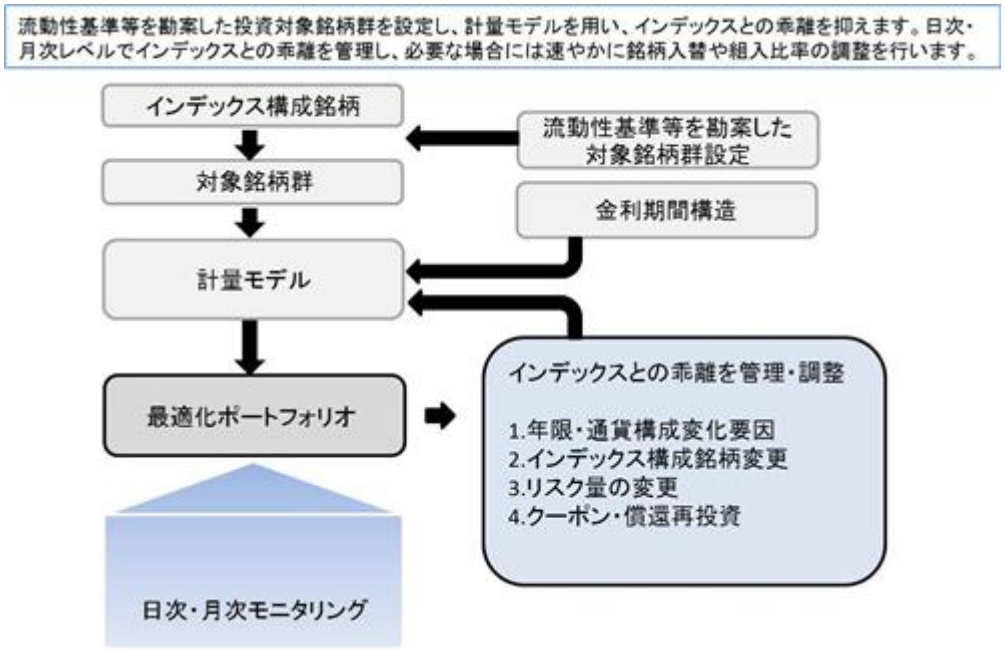
主な投資制限	1.株式への投資割合には、制限を設けません。 2.新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において、原則として信託財産の純資産総額の20%以下とします。 3.同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、原則として信託財産の純資産総額の10%以下とします。 4.外貨建資産への投資には、制限を設けません。 5.デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 6.外国為替予約取引は、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

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

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

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

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

運用プロセス	
主な投資制限	1.株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限ります。 2.株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 3.同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 4.同一銘柄の転換社債等への投資は、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割合には、制限を設けません。 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。

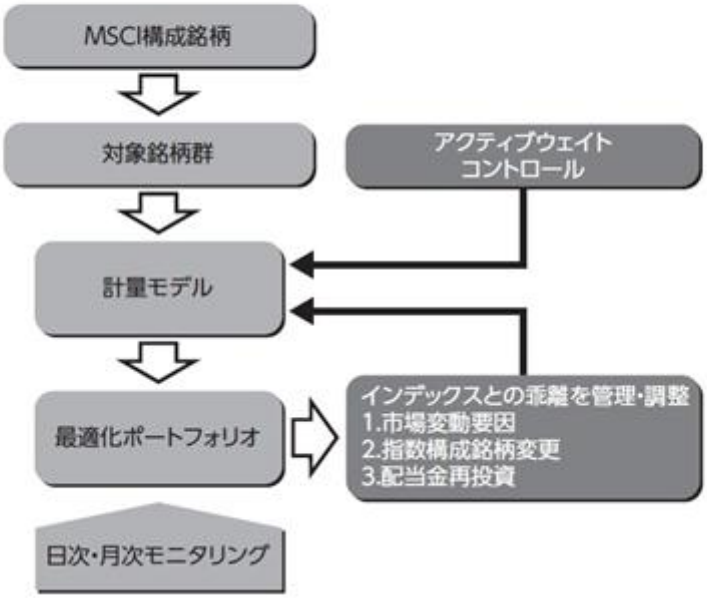
ファンド名	エマージング株式パッシブ・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、主として海外の証券取引所に上場している株式（＊）に投資し、ＭＳＣＩエマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。 （＊）ＤＲ（預託証券）もしくは株式と同等の投資効果が得られる権利を表示する証券および証書等を含みます。
主な投資対象	海外の証券取引所に上場している株式を主要投資対象とします。

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

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

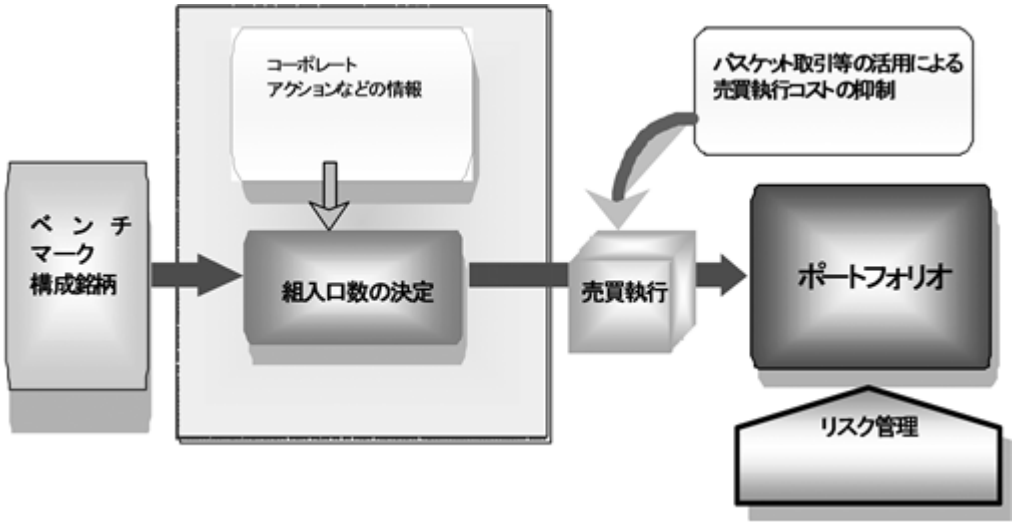
MSCIは、自らが信頼できると考える情報源からMSCI指数の計算に算入または使用するための情報を入手しますが、いかなるMSCI関係者も、MSCI指数またはそれに含まれるデータの独創性、正確性および／または完全性について保証するものではありません。いかなるMSCI関係者も、明示的か黙示的かを問わず、本ファンドの発行会社もしくは所有者、またはその他の者もしくは団体が、MSCI指数またはそれに含まれるデータを使用することにより得られる結果について保証を行いません。いかなるMSCI関係者も、MSCI指数またはそれに含まれるデータの、またはそれらに関連する過誤、脱漏または中断について責任を負いません。ま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

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

	たは団体も、事前にMSCIの書面による承認を得ることなくMSCIとの関係を主張することはできません。
運用プロセス	現地口座の開設可否、預託証券の利用可否を基準に投資対象銘柄群を設定し、インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差(アクティブウェイト)を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用いて、インデックスとの乖離を抑えます。 日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理して、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。 
主な投資制限	**1.株式への投資割合には、制限を設けません。** **2.外貨建資産への投資には、制限を設けません。** **3.投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。** **4.デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。** **5.外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。** **6.一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。**

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

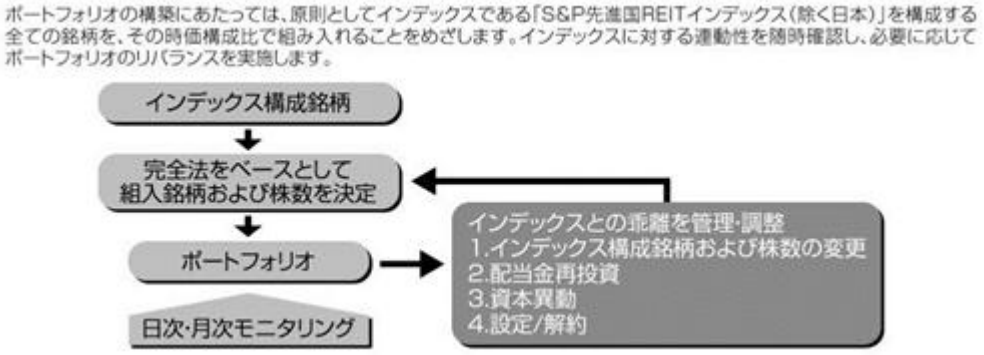
投資態度	1.東京証券取引所に上場し、東証ＲＥＩＴ指数※に採用されている（または採用予定の）不動産投資信託証券を主要投資対象とし、東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。 2.不動産投資信託証券への投資は、原則として高位を維持することをめざします。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。 3.但し、ファンドの資金動向、市況動向等に急激な変化が生じたとき、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときならびに東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）が改廃されたとき等、やむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。 ※①東証ＲＥＩＴ指数の指数値および東証ＲＥＩＴ指数の商標は、株式会社東京証券取引所（以下「㈱東京証券取引所」といいます。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など東証ＲＥＩＴ指数に関するすべての権利・ノウハウおよび東証ＲＥＩＴ指数の商標に関するすべての権利は㈱東京証券取引所が有しています。 ②㈱東京証券取引所は、東証ＲＥＩＴ指数の指数値の算出もしくは公表の方法の変更、東証ＲＥＩＴ指数の指数値の算出もしくは公表の停止または東証ＲＥＩＴ指数の商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。 ③㈱東京証券取引所は、東証ＲＥＩＴ指数の指数値および東証ＲＥＩＴ指数の商標の使用に関して得られる結果ならびに特定日の東証ＲＥＩＴ指数の指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。 ④㈱東京証券取引所は、東証ＲＥＩＴ指数の指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、㈱東京証券取引所は、東証ＲＥＩＴ指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。 ⑤当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドは、㈱東京証券取引所により提供、保証または販売されるものではありません。 ⑥㈱東京証券取引所は、当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドの購入者または公衆に対し、当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を持ちません。 ⑦㈱東京証券取引所は、委託会社または当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドの購入者のニーズを、東証ＲＥＩＴ指数の指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。 ⑧以上の項目に限らず、㈱東京証券取引所は当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドの発行または売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を負いません。

運用プロセス	・原則としてベンチマーク構成全銘柄をその構成比率で保有します。ベンチマーク構成銘柄および採用予定銘柄を投資対象銘柄とします。 ・新規上場、公募増資、第三者割当等ベンチマーク構成の変更情報を事前に取得し、最適な執行方法によりリバランスを実施します。 ・配当金入金等によりキャッシュ比率が上昇した場合にもリバランスを実施します。 
主な投資制限	1.投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 2.同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として信託財産の純資産総額の30%を超えないものとします。ただし、東証ＲＥＩＴ指数採用の不動産投資信託証券の上場時価総額の合計額に占める同一銘柄の不動産投資信託証券の時価総額の割合が30%を超えている場合、当該同一銘柄の不動産投資信託証券への投資割合は、原則として当該同一銘柄の不動産投資信託証券の時価総額が東証ＲＥＩＴ指数採用の不動産投資信託証券の上場時価総額の合計額に占める割合の範囲で投資することができるものとします。 3.株式への投資は行いません。 4.外貨建資産への投資は行いません。 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、価格変動および金利変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 6.一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

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

※Ｓ＆Ｐ 先進国 ＲＥＩＴインデックスは、S&P Globalの一部門であるS&Pダウ・ジョーンズ・インデックスLLCまたはその関連会社（「SPDJI」）の商品であり、これを利用するライセンスが委託会社に付与されています。Standard & Poor’s®およびS&P®は、S&P Globalの一部門であるスタンダード＆プアーズ・ファイナンシャル・サービシーズLLC（「S&P」）の登録商標で、Dow Jones®は、ダウ・ジョーンズ・トレードマーク・ホールディングズLLC（「Dow Jones」）の登録商標です。指数に直接投資することはできません。本商品は、SPDJI、Dow Jones、S&P、それらの各関連会社（総称して「S&P Dow Jones Indices」）によってスポンサー、保証、販売、または販売促進されているものではありません。S&P Dow Jones Indicesは、本商品の所有者またはいかなる一般人に対して、有価証券全般または具体的な商品への投資の妥当性、あるいは全般的な市場のパフォーマンスを追跡するＳ＆Ｐ 先進国 ＲＥＩＴインデックスの能力に関して、明示または黙示を問わず、いかなる表明または保証もしません。指数の過去のパフォーマンスは、将来の成績を示唆または保証するものでもありません。Ｓ＆Ｐ 先進国 ＲＥＩＴインデックスに関して、S&P Dow Jones Indicesと委託会社との間にある唯一の関係は、当指数とS&P Dow Jones Indicesおよび／または特定の商標、サービスマーク、および／または商標名のライセンス供与です。Ｓ＆Ｐ 先進国 ＲＥＩＴインデックスは委託会社または本商品に関係なく、S&P Dow Jones Indicesによって決定、構成、計算されます。S&P Dow Jones Indicesは、Ｓ＆Ｐ 先進国 ＲＥＩＴインデックスの決定、構成または計算において委託会社または本商品の所有者のニーズを考慮する義務を負いません。S&P Dow Jones Indicesは、本商品の価格および数量、または本商品の発行または販売のタイミングの決定、もしくは場合によっては本商品が将来換金、譲渡、または償還される計算式の決定または計算に関して、責任を負わず、またこれに関与したこともありません。S&P Dow Jones Indicesは、本商品の管理、マーケティング、または取引に関して、いかなる義務または責任も負いません。Ｓ＆Ｐ 先進国 ＲＥＩＴインデックスに基づく投資商品が、指数のパフォーマンスを正確に追跡する、またはプラスの投資収益率を提供する保証はありません。S&P Dow Jones Indices LLCは投資または税務の顧問会社ではありません。免税証券のポートフォリオへの影響や特定の投資決断の税効果の評価は、税務顧問会社に相談してください。指数に証券が含まれることは、S&P Dow Jones Indicesがかかる証券の売り、買い、またはホールドの推奨を意味するものではなく、投資アドバイスとして見なしてはなりません。

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

	して、委託会社、本商品の所有者、またはその他の人物や組織が得られる結果について、一切の保証を明示的に否認します。上記を制限することなく、いかなる場合においても、S&P Dow Jones Indicesは、利益の逸失、営業損失、時間または信用の喪失を含むがこれらに限定されない、間接的、特別、懲罰的、または派生的損害に対して、たとえその可能性について知らされていたとしても、契約の記述、不法行為、または厳格責任の有無を問わず、一切の責任を負わないものとします。S&P Dow Jones Indicesのライセンサーを除き、S&P Dow Jones Indicesと委託会社との間の契約または取り決めの第三者受益者は存在しません。
運用プロセス	
主な投資制限	1.投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 2.外貨建資産への投資割合には制限を設けません。 3.株式への直接投資は行いません。 4.同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として信託財産の純資産総額の30%以内とします。ただし、Ｓ＆Ｐ 先進国 ＲＥＩＴインデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）における時価の構成割合が30%を超える不動産投資信託証券がある場合には、指数との連動性を維持するために当該不動産投資信託証券をＳ＆Ｐ 先進国 ＲＥＩＴインデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）の構成割合の範囲で組入れることができるものとします。 5.デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 6.外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。 7.一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

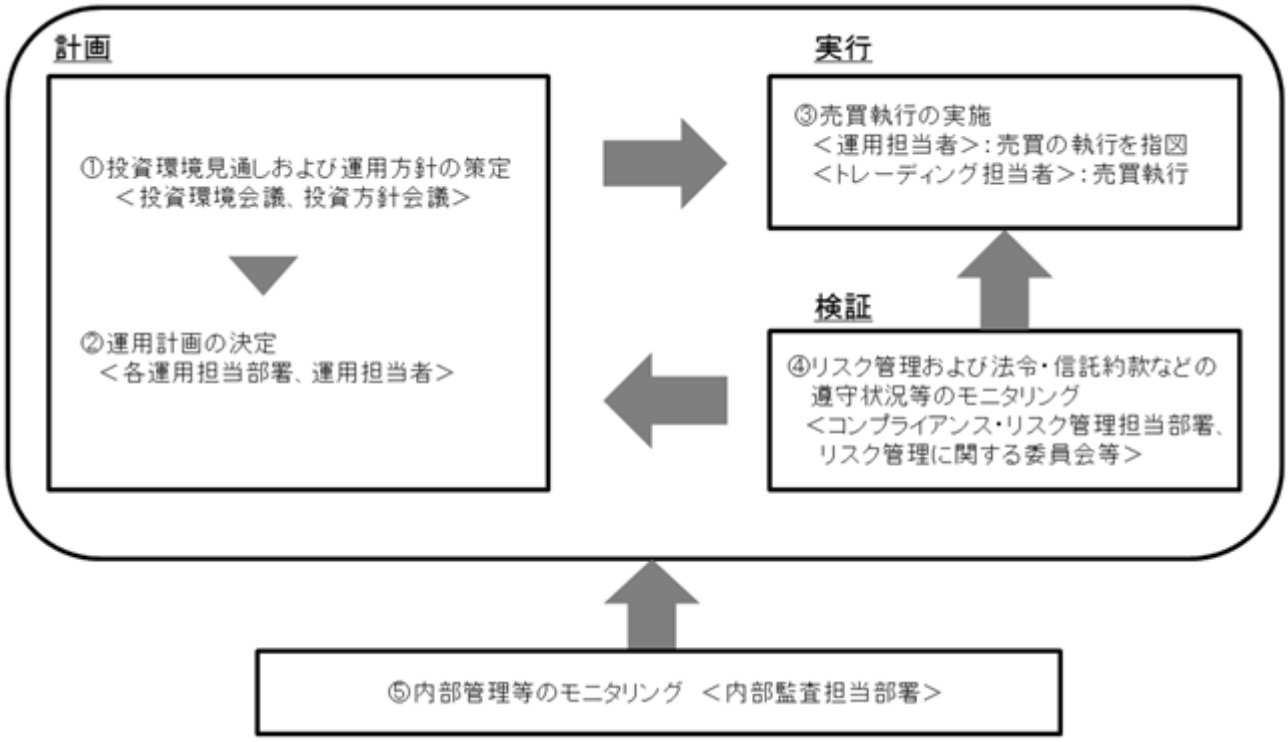
ファンド名	ＤＩＡＭマネーマザーファンド

基本方針	この投資信託は、安定した収益の確保をめざします。
主な投資対象	国内発行体の公社債、転換社債、ユーロ円債、資産担保証券ならびにＣＤ、ＣＰ、コールローン等の国内短期金融資産を主要投資対象とします。
投資態度	1.国内の国債、政府保証債、政府機関債、地方債等のほか、取得時において主要格付機関（＊）の長期発行体格付（複数の格付機関が付与している場合は高い方の格付）がＡＡ-格相当以上の社債、転換社債、ユーロ円債、資産担保証券、さらに、国内格付機関の短期格付がa-1格相当以上のＣＤ、ＣＰを主要投資対象とします。 （＊）主要格付機関とは、Ｒ＆Ｉ、ＪＣＲ、Ｍｏｏｄｙ’ｓ、Ｓ＆Ｐとします。 2.国債および政府保証債を除き、原則として、ファンドの元本総額に対する1発行体当たりの有価証券の額面総額の割合は5%以内とします。 3.ポートフォリオ全体の修正デュレーションは1年未満を基本として運用します。
運用プロセス	マクロ経済分析を主体としたファンダメンタルズ分析、投資家の需給動向等分析および信用リスク市場の分析等に基づき、短期金利の方向性見通し、セクター別のクレジットスプレッドの拡縮等を予測し、ファンドのデュレーションおよびセクター配分を決定します（トップダウンアプローチ）。
主な投資制限	1.株式への投資割合は、純資産総額の10%以下とします。 2.同一銘柄の株式への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。 3.同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 4.新株引受権証券及び新株予約権証券への投資割合は、取得時において、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 5.投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 6.外貨建て資産への投資は行いません。 7.デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動および金利変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 8.一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

資金動向、市況動向等によっては、上記の運用ができない場合があります。

（３）【運用体制】

ａ．ファンドの運用体制



①　投資環境見通しおよび運用方針の策定

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

②　運用計画の決定

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

③　売買執行の実施

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

④　モニタリング

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

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

⑤　内部管理等のモニタリング

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

ｂ．ファンドの関係法人に関する管理

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

ｃ．運用体制に関する社内規則

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

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

※運用体制は2019年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】

①収益分配方針

毎決算時（原則として毎年10月12日（休業日の場合は翌営業日））に、原則として以下の方針に基づき収益の分配を行います。

(1)分配対象額の範囲は、繰越分を含めた経費控除後の配当等収益（マザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち、信託財産に属するとみなした額（以下「みなし配当等収益」といいます。）を含みます。）および売買益（評価益を含み、みなし配当等収益を控除して得た額）等の全額とします。

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

(3)留保益の運用については、特に制限を設けず、運用の基本方針に基づいて運用を行います。

②収益の分配方式

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

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

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

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

(3)毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

③収益分配金の支払い

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

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

（５）【投資制限】

①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)

②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)

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

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。(約款「運用の基本方針」2.運用方法（3）投資制限)

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。(約款「運用の基本方針」2.運用方法（3）投資制限)

⑥一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。(約款「運用の基本方針」2.運用方法（3）投資制限)

⑦投資する株式等の範囲（約款第20条）

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

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

⑧信用取引の指図範囲（約款第22条）

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

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

1.信託財産に属する株券および新株引受権証書の権利行使により取得する株券

2.株式分割により取得する株券

3.有償増資により取得する株券

4.売出しにより取得する株券

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

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

⑨先物取引等の運用指図（約款第23条）

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

1.先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする有価証券（以下「ヘッジ対象有価証券」といいます。）の時価総額の範囲内とします。

2.先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象有価証券の組入可能額（信託財産の組入ヘッジ対象有価証券を差引いた額）に信託財産が限月ま

でに受取る組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券、組入貸付債権信託受益権、組入抵当証券および組入指定金銭信託の受益証券の利払金および償還金を加えた額を限度とし、かつ信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに上記(2)投資対象③運用の指図範囲等1.～4.に掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。

3.コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、⑨で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

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

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

2.先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の買予約と合せて、外貨建有価証券の買付代金等実需の範囲内とします。

3.コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点の保有外貨建資産の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ⑨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③運用の指図範囲等1.～4.に掲げる金融商品で運用されているものをいい、以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。）の時価総額の範囲内とします。

2.先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに上記(2)投資対象③運用の指図範囲等1.～4.に掲げる金融商品で運用している額（以下2.において「金融商品運用額等」といいます。）の範囲内とします。ただし、ヘッジ対象金利商品が外貨建で、信託財産の外貨建資産組入可能額（約款上の組入可能額から保有外貨建資産の時価総額を差引いた額をいいます。以下同じ。）に信託財産が限月までに受取る外貨建組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに外貨建組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額が当該金融商品運用額等の額より少ない場合には外貨建資産組入可能額に信託財産が限月までに受取る外貨建組入有価証券にかかる利払金および償還金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⑨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。

⑩スワップ取引の運用指図（約款第24条）

1)委託会社は、信託財産に属する資産の価格変動リスクや為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利、または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。

2)スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

3)スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。以下3）において同じ。）が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、当該純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。

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

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

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

⑪金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図（約款第25条）

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

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

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

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

るヘッジ対象金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

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

⑫デリバティブ取引等にかかる投資制限（約款第26条）

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

⑬有価証券の貸付の指図および範囲（約款第27条）

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

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

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

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

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

⑭公社債の空売りの指図および範囲（約款第28条）

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

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

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

⑮公社債の借入れの指図および範囲（約款第29条）

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

2)上記1)の指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

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

4)上記1)の借入れにかかる品借料は信託財産中から支弁します。

⑯特別な場合の外貨建有価証券への投資制限（約款第30条）

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

⑰外国為替予約取引の指図（約款第31条）

委託会社は、信託財産に属する外貨建資産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。）との合計額について、当該外貨建資産の為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約を指図することができます。

⑱資金の借入れ（約款第37条）

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

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

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

4)借入金の利息は信託財産中より支弁します。

⑲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。

投資に際して資産配分を行う場合には、一般に当該資産への資産配分の比率に応じて、投資全体の成果に影響をおよぼします。各ファンドは、公社債、株式およびリートに資産配分を行いますが、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には、基準価額が下落する要因となります。

○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。

株式の価格は、国内外の政治・経済・社会情勢の変化、発行企業の業績・経営状況の変化、市場の需給関係等の影響を受け変動します。株式市場や各ファンドが実質的に投資する企業の株価が下落した場合には、その影響を受け、基準価額が下落する要因となります。

○金利変動リスク

金利の上昇は、基準価額の下落要因となる可能性があります。

金利の変動は、公社債等の価格に影響をおよぼします。金利変動は、公社債・株式・リート等の各資産への投資の相対的魅力度を変化させるため、金利変動により各資産の市場の間で資金移動が起こる場合があり、基準価額を下落させる要因となる可能性があります。

○不動産投資信託証券（リート）の価格変動リスク

リートの価格の下落は、基準価額の下落要因となります。

リートの価格は、リートが投資対象とする不動産等の価値、当該不動産等による賃貸収入の増減、不動産市況の変動、景気や株式市況等の動向、関係法令・規制等の変更等の影響を受けます。また、老朽化・災害等の発生による保有不動産の滅失・損壊等が発生する可能性があります。各ファンドが実質的に投資するリートの市場価格が下落した場合には、基準価額が下落する要因となります。

○為替変動リスク

為替相場の円高は、基準価額の下落要因となります。

為替相場は、各国の政治情勢、経済状況等の様々な要因により変動し、外貨建資産の円換算価格に影響をおよぼします。各ファンドは一部の実質組入外貨建資産について、対円での為替ヘッジを行います。
為替ヘッジを行わない資産については、為替変動の影響を受けます。このため為替相場が当該実質組入資産の通貨に対して円高になった場合には基準価額が下がる要因となります。
為替ヘッジを行う資産については、為替リスクの低減をめざしますが、為替リスクを完全に排除できるものではなく為替相場の影響を受ける場合があります。また、為替ヘッジには円金利がヘッジ対象通貨の金利よりも低い場合、その金利差相当分程度のコストがかかることにご留意ください。

○信用リスク

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

有価証券等の価格は、その発行体に債務不履行等が発生または予想される場合には、その影響を受け変動します。各ファンドが実質的に投資する株式・債券の発行者が経営不安・倒産に陥った場合、各ファンドが実質的に投資するリートが収益性の悪化や資金繰り悪化等により清算される場合、またこうした状況に陥ると予想される場合等には、投資した資産の価格が下落したりその価値がなくなることがあり、基準価額が下落する要因となります。

○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。

有価証券等を売却または取得する際に市場規模や取引量、取引規制等により、その取引価格が影響を受ける場合があります。一般に市場規模が小さい場合や取引量が少ない場合には、市場実勢から期待できる価格どおりに取引できないことや、値動きが大きくなることがあり、基準価額に影響をおよぼす要因となります。

○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。

投資対象国・地域の政治経済情勢、通貨規制、資本規制、税制、また取引規制等の要因によって資産価格や通貨価値が大きく変動する場合があります。海外に投資する場合には、これらの影響を受け、基準価額が下落する要因となります。各ファンドが実質的に投資を行う株式や通貨の発行者が属する新興国の経済状況は、先進国経済と比較して一般的に脆弱である可能性があります。そのため、当該国のインフレ、国際収支、外貨準備高等の悪化等が株式市場や為替市場におよぼす影響は、先進国以上に大きいものになることが予想されます。さらに、政府当局による海外からの投資

規制や課徴的な税制、海外への送金規制等の種々な規制の導入や政策の変更等の要因も株式市場や為替市場に著しい影響をおよぼす可能性があります。

※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で、受益者毎に異なります。

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

○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。当該方式は、運用の効率化に資するものですが、一方で、各ファンドが主要投資対象とするマザーファンドに対し、他のベビーファンドにより多額の追加設定・一部解約等がなされた場合には、マザーファンドにおける売買ならびに組入比率の変化等により、各ファンドの基準価額や運用が影響を受ける場合があります。

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

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

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

○注意事項

・各ファンドは、実質的に債券、株式、不動産投資信託証券（リート）などの値動きのある有価証券（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、基準価額は変動します。

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

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

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

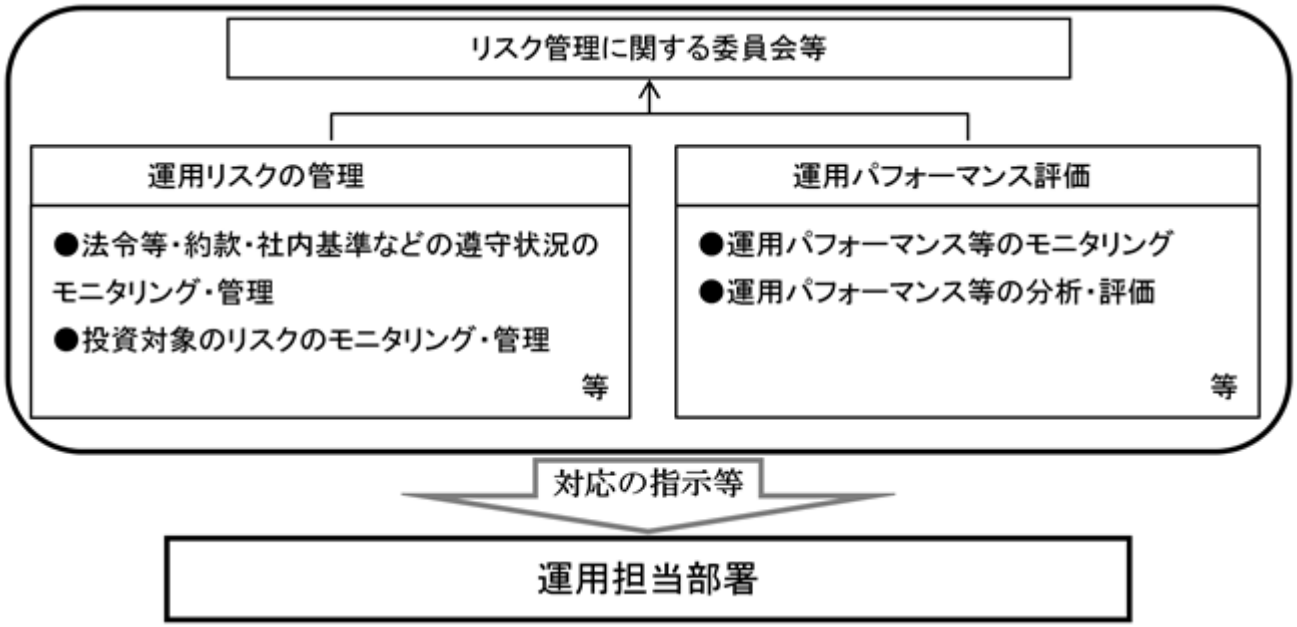
＜リスク管理体制＞

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

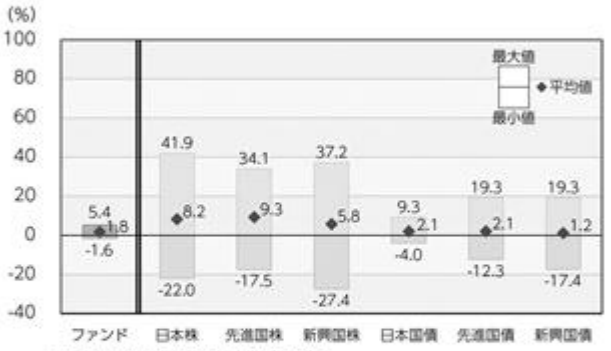
（保守型）

（安定型）

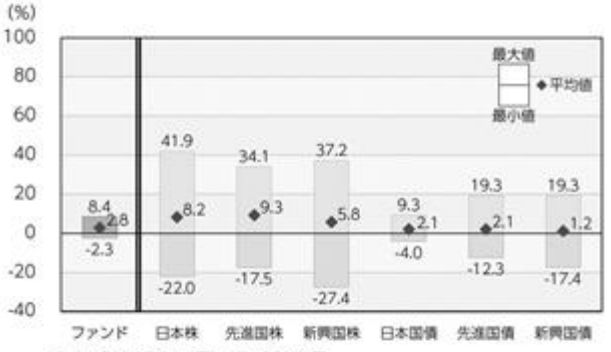
（安定成長型）

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

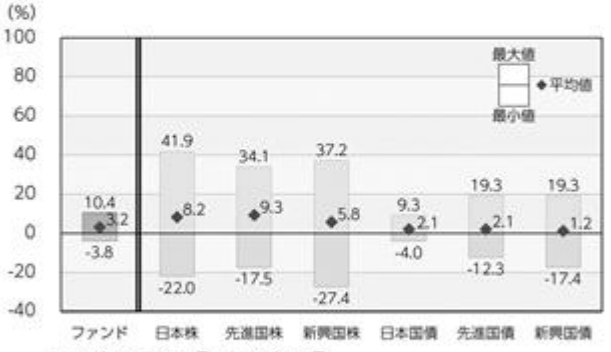
ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



ファンド:2018年11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:2018年11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:2018年11月～2019年10月
代表的な資産クラス:2014年11月～2019年10月

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

<参考情報>

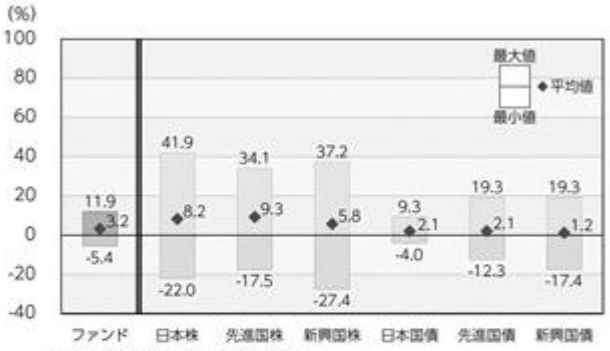
ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移

（成長型）

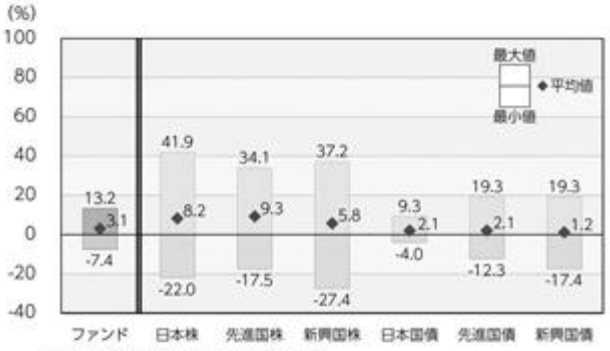
（積極型）

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

ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



ファンド:2018年11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:2018年11月～2019年10月
代表的な資産クラス:2014年11月～2019年10月

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

各資産クラスの指数

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

(注)海外の指数は為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

4【手数料等及び税金】

（1）【申込手数料】

ありません。

（2）【換金（解約）手数料】

ありません。

（3）【信託報酬等】

各ファンドの日々の純資産総額に対して年率0.55%（税抜0.50%）以内
※2020年1月15日現在は、年率0.55%（税抜0.50%）になります。
配分は以下の通りです。

支払先	内訳（税抜）	主な役務
委託会社	年率0.23%	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0.23%	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0.04%	運用財産の保管・管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価

※信託報酬＝運用期間中の基準価額×信託報酬率
※信託報酬は、毎日計上（ファンドの基準価額に反映）され、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日（休業日の場合は翌営業日）および毎計算期末または信託終了のときに信託報酬にかかる消費税等相当額とともに信託財産から支払われます。
※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（各ファンドの純資産総額に対して年率0.03795%（税抜0.0345%））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】

・信託財産留保額
ありません。
・その他の費用
その他費用・手数料として、お客様の保有期間中、以下の費用等を信託財産からご負担いただきます。
①信託財産に関する租税、特定資産の価格等の調査に要する費用および当該費用にかかる消費税等に相当する金額、信託事務の処理に要する諸費用ならびに受託会社の立て替えた立替金の利息および借入金の利息等は、受益者の負担とし、信託財産から支払われます。
②監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用は、受益者の負担とし、毎日計上（ファンドの基準価額に反映）され、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日（休業日の場合は翌営業日）および毎計算期末または信託終了のとき、当該監査に要する費用にかかる消費税等相当額とともに信託財産から支払われます。

③有価証券の売買時の売買委託手数料および有価証券取引にかかる手数料・税金、先物・オプション取引に要する費用、当該手数料にかかる消費税等相当額および外国での資産の保管等に要する費用は、受益者の負担とし、信託財産から支払われます。

④マザーファンドで負担する有価証券の売買時の売買委託手数料および有価証券取引にかかる手数料・税金、先物・オプション取引に要する費用、当該手数料にかかる消費税等相当額および外国での資産の保管等に要する費用は、間接的に各ファンドで負担することになります。

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

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

※税法が改正された場合等は、上記内容が変更になることがあります。

（５）【課税上の取扱い】

◇各ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

○個人の受益者に対する課税

①収益分配時

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

詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

②解約時および償還時

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

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

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

③損益通算について

解約（換金）時および償還時の差損(譲渡損)については、確定申告を行うことにより上場株式等（上場株式、上場投資信託（ETF）、上場不動産投資信託（REIT）、公募株式投資信託および特定公社債等（公募公社債投資信託を含みます。）など。以下同じ。）の譲渡益ならびに上場株式等の配当所得および利子所得の金額（配当所得については申告分離課税を選択したものに限ります。）との損益通算ならびに3年間の繰越控除の対象とすることができます。

また、特定口座（源泉徴収口座）をご利用の場合、その口座内において損益通算を行います（確定申告不要）。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

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

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

○法人の受益者に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに解約時および償還時の個別元本超過額については、15.315%（所得税15.315%（復興特別所得税を含みます。））の税率による源泉徴収が行われます。なお、地方税の源泉徴収は行われません。
買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。
なお、益金不算入制度の適用はありません。

※外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。
※受益者が確定拠出年金法に規定する資産管理機関および国民年金基金連合会等の場合は、所得税（復興特別所得税を含みます。）および地方税がかかりません。また、確定拠出年金制度の加入者については、確定拠出年金の積立金の運用にかかる税制が適用されます。

※上記は、2019年10月末現在のものです。税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。
※課税上の取扱いの詳細については税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

◇個別元本方式について

受益者毎の信託時の受益権の価額等を当該受益者の元本とする個別元本方式は次のとおりです。
＜個別元本について＞
①受益者毎の信託時の受益権の価額等（申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等に相当する金額は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）にあたります。
②受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。
ただし、同一ファンドの受益権を複数の販売会社で取得する場合については販売会社毎に個別元本の算出が行われます。また、同一販売会社であっても複数支店等で同一ファンドの受益権を取得する場合は当該支店等毎に、「分配金受取コース」と「分配金再投資コース」の両コースで同一ファンドの受益権を取得する場合はコース別に個別元本の算出が行われる場合があります。
③収益分配金に元本払戻金（特別分配金）が含まれる場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。
（「元本払戻金（特別分配金）」については、下記の＜収益分配金の課税について＞を参照。）

＜収益分配金の課税について＞

収益分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」（受益者毎の元本の一部払戻しに相当する部分）の区分があります。
収益分配の際、①当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本と同額の場合または当該受益者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となり、②当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、当該収益分配金から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。
なお、収益分配金に元本払戻金（特別分配金）が含まれる場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。

※税法が改正された場合等は、上記内容が変更になることがあります。

５【運用状況】

（１）【投資状況】

たわらノーロード　スマートグローバルバランス（保守型）

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		26,245,357	99.35
	内　日本	26,245,357	99.35
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		170,479	0.65
純資産総額		26,415,836	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。

たわらノーロード　スマートグローバルバランス（安定型）

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		1,515,839,062	99.67
	内　日本	1,515,839,062	99.67
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		5,029,902	0.33
純資産総額		1,520,868,964	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。

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）

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		2,398,557,226	99.68
	内　日本	2,398,557,226	99.68
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		7,722,533	0.32
純資産総額		2,406,279,759	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。

たわらノーロード　スマートグローバルバランス（成長型）

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		1,214,631,554	99.42
	内　日本	1,214,631,554	99.42
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		7,104,195	0.58
純資産総額		1,221,735,749	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。

たわらノーロード　スマートグローバルバランス（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		1,875,631,624	99.76
	内　日本	1,875,631,624	99.76
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		4,525,643	0.24
純資産総額		1,880,157,267	100.00

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

（参考）
国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

令和1年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。

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。

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　ジャージィー	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。

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。

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和1年10月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券		423,671,617,072	99.27
	内　アメリカ	203,317,840,008	47.64
	内　フランス	42,108,600,499	9.87
	内　イタリア	37,456,576,364	8.78
	内　イギリス	27,322,267,435	6.40
	内　ドイツ	26,718,300,024	6.26
	内　スペイン	24,251,734,038	5.68
	内　ベルギー	11,081,253,048	2.60
	内　オーストラリア	8,541,837,487	2.00
	内　オランダ	8,420,872,915	1.97
	内　カナダ	7,686,836,333	1.80
	内　オーストリア	6,185,518,669	1.45
	内　メキシコ	3,409,564,436	0.80
	内　アイルランド	3,299,927,256	0.77
	内　フィンランド	2,798,870,600	0.66
	内　ポーランド	2,371,382,834	0.56
	内　南アフリカ	2,201,310,624	0.52
	内　デンマーク	1,916,867,789	0.45
	内　シンガポール	1,664,563,882	0.39
	内　マレーシア	1,150,885,086	0.27
	内　スウェーデン	1,113,205,730	0.26
	内　ノルウェー	653,402,015	0.15
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		3,103,386,753	0.73
純資産総額		426,775,003,825	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　ジャージィー	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。

Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・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（%）
投資証券		44,389,083,280	97.93
	内　日本	44,389,083,280	97.93
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		937,558,368	2.07
純資産総額		45,326,641,648	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（%）
不動産投信指数先物取引（買建）		786,064,500	1.73
	内　日本	786,064,500	1.73

（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。

外国リート・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		229,709	0.00
	内　アメリカ	229,709	0.00
投資信託受益証券		5,532,917,665	10.31
	内　オーストラリア	3,469,418,558	6.46
	内　シンガポール	2,063,499,107	3.84
投資証券		47,931,809,251	89.30
	内　アメリカ	39,688,048,377	73.94
	内　イギリス	2,636,487,217	4.91
	内　香港	1,037,551,406	1.93
	内　フランス	1,019,243,592	1.90
	内　カナダ	1,001,202,871	1.87
	内　オランダ	977,644,269	1.82
	内　ベルギー	535,200,369	1.00
	内　スペイン	357,467,771	0.67
	内　ニュージーランド	221,030,652	0.41
	内　ドイツ	145,002,651	0.27
	内　アイルランド	125,139,388	0.23
	内　ガーンジィ	102,213,158	0.19
	内　イスラエル	45,163,486	0.08
	内　マン島	18,709,389	0.03
	内　イタリア	12,024,965	0.02
	内　韓国	9,679,690	0.02
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		212,408,877	0.40
純資産総額		53,677,365,502	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。
（注3）株式の保有は「権利割当」によるもので、有価証券届出日現在、売却が完了しています。

（２）【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

たわらノーロード　スマートグローバルバランス（保守型）

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	9,615,681	1.3275 12,765,388	1.3262 12,752,316	－ －	48.28
2	為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	6,140,582	1.4205 8,722,908	1.4134 8,679,098	－ －	32.86
3	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	457,369	3.6572 1,672,735	3.7786 1,728,214	－ －	6.54
4	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	824,366	1.8816 1,551,155	1.8937 1,561,101	－ －	5.91
5	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	391,591	2.5613 1,003,020	2.6349 1,031,803	－ －	3.91
6	Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	102,309	2.4485 250,511	2.4790 253,624	－ －	0.96
7	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	207,658	1.1165 231,870	1.1519 239,201	－ －	0.91

（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	99.35
合計	99.35

（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。

たわらノーロード　スマートグローバルバランス（安定型）

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	為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	310,931,962	1.4205 441,693,362	1.4134 439,471,235	－ －	28.90
2	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	326,293,587	1.3275 433,169,643	1.3262 432,730,555	－ －	28.45
3	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	51,545,840	3.6602 188,668,841	3.7786 194,771,111	－ －	12.81
4	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	72,286,125	1.8818 136,031,168	1.8937 136,888,234	－ －	9.00
5	Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	49,960,948	2.4493 122,370,406	2.4790 123,853,190	－ －	8.14
6	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	41,800,341	2.5614 107,069,579	2.6349 110,139,718	－ －	7.24
7	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	33,126,974	1.3687 45,344,142	1.4027 46,467,206	－ －	3.06
8	エマージング株式パッシブ・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	27,361,588	1.1171 30,567,403	1.1519 31,517,813	－ －	2.07

（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	99.67
合計	99.67

（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。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

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）

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	為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	356,165,584	1.4204 505,927,165	1.4134 503,404,436	－ －	20.92
2	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	127,176,798	3.6598 465,454,147	3.7786 480,550,248	－ －	19.97
3	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	333,874,372	1.3275 443,234,184	1.3262 442,784,192	－ －	18.40
4	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	102,773,153	2.5610 263,208,501	2.6349 270,796,980	－ －	11.25
5	Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	107,476,543	2.4489 263,205,284	2.4790 266,434,350	－ －	11.07
6	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	138,216,378	1.3682 189,119,573	1.4027 193,876,113	－ －	8.06
7	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	88,051,902	1.8816 165,684,292	1.8937 166,743,886	－ －	6.93
8	エマージング株式パッシブ・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	64,213,058	1.1168 71,714,296	1.1519 73,967,021	－ －	3.07

（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	99.68
合計	99.68

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

たわらノーロード　スマートグローバルバランス（成長型）

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	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	92,570,533	3.6600 338,817,378	3.7786 349,787,015	－ －	28.63
2	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	75,142,300	2.5611 192,449,283	2.6349 197,992,446	－ －	16.21
3	為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	112,404,498	1.4204 159,666,777	1.4134 158,872,517	－ －	13.00
4	Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	63,872,543	2.4490 156,424,324	2.4790 158,340,034	－ －	12.96
5	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	105,054,923	1.3686 143,782,126	1.4027 147,360,540	－ －	12.06
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	87,452,663	1.3275 116,094,078	1.3262 115,979,721	－ －	9.49
7	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	43,036,947	1.1169 48,069,826	1.1519 49,574,259	－ －	4.06
8	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	19,393,263	1.8818 36,496,078	1.8937 36,725,022	－ －	3.01

（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	99.42
合計	99.42

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

たわらノーロード　スマートグローバルバランス（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	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	184,194,563	3.6596 674,084,555	3.7786 695,997,575	－ －	37.02
2	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	144,622,662	2.5608 370,350,810	2.6349 381,066,252	－ －	20.27
3	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	214,336,803	1.3680 293,216,288	1.4027 300,650,233	－ －	15.99
4	Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	113,429,116	2.4485 277,739,535	2.4790 281,190,778	－ －	14.96
5	エマージング株式パッシブ・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	82,830,053	1.1166 92,490,499	1.1519 95,411,938	－ －	5.07
6	為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	52,766,241	1.4206 74,960,389	1.4134 74,579,805	－ －	3.97
7	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	21,126,303	1.3275 28,046,854	1.3262 28,017,703	－ －	1.49
8	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	9,884,005	1.8817 18,599,149	1.8937 18,717,340	－ －	1.00

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資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	99.76
合計	99.76

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

（参考）

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

令和1年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。

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。

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。

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。

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和1年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 3.125 11/15/28 アメリカ	国債証券	2,321,321,600	109.09 2,532,492,225	111.21 2,581,744,864	3.125 2028/11/15	0.60
2	US T N/B 2.25 04/15/22 アメリカ	国債証券	2,484,641,600	101.33 2,517,910,951	101.44 2,520,649,472	2.25 2022/4/15	0.59
3	US T N/B 2.5 05/15/24 アメリカ	国債証券	2,363,784,800	103.79 2,453,383,992	103.74 2,452,242,045	2.5 2024/5/15	0.57

4	US T N/B 2.125 05/31/21 アメリカ	国債証券	2,405,159,200	100.52 2,417,906,303	100.69 2,421,788,614	2.125 2021/5/31	0.57
5	US T N/B 2.0 02/15/25 アメリカ	国債証券	2,359,429,600	100.70 2,376,181,550	101.67 2,399,060,630	2 2025/2/15	0.56
6	US T N/B 2.375 05/15/29 アメリカ	国債証券	2,147,113,600	104.75 2,249,212,255	105.10 2,256,649,929	2.375 2029/5/15	0.53
7	US T N/B 2.125 03/31/24 アメリカ	国債証券	2,204,820,000	101.40 2,235,819,769	102.03 2,249,605,405	2.125 2024/3/31	0.53
8	US T N/B 1.625 02/15/26 アメリカ	国債証券	2,180,866,400	99.36 2,167,085,774	99.53 2,170,813,954	1.625 2026/2/15	0.51
9	US T N/B 1.5 08/15/26 アメリカ	国債証券	2,074,164,000	98.45 2,042,024,431	98.67 2,046,616,508	1.5 2026/8/15	0.48
10	US T N/B 1.625 11/15/22 アメリカ	国債証券	2,014,280,000	100.28 2,020,040,840	100.01 2,014,516,033	1.625 2022/11/15	0.47
11	US T N/B 2.5 01/31/21 アメリカ	国債証券	1,954,396,000	101.03 1,974,623,998	101.01 1,974,168,976	2.5 2021/1/31	0.46
12	US T N/B 2.875 10/31/20 アメリカ	国債証券	1,831,361,600	101.33 1,855,883,531	101.18 1,853,037,467	2.875 2020/10/31	0.43
13	US T N/B 2.625 07/15/21 アメリカ	国債証券	1,815,029,600	101.70 1,846,066,606	101.58 1,843,885,720	2.625 2021/7/15	0.43
14	FRANCE OAT 5.75 10/25/32 フランス	国債証券	1,037,268,400	172.29 1,787,203,080	173.56 1,800,364,979	5.75 2032/10/25	0.42
15	FRANCE OAT 2.25 10/25/22 フランス	国債証券	1,656,714,400	109.70 1,817,432,263	108.60 1,799,246,509	2.25 2022/10/25	0.42
16	US T N/B 2.625 06/15/21 アメリカ	国債証券	1,770,388,800	101.65 1,799,777,254	101.50 1,797,013,782	2.625 2021/6/15	0.42
17	FRANCE OAT 4.5 04/25/41 フランス	国債証券	980,182,200	183.48 1,798,532,417	182.88 1,792,574,850	4.5 2041/4/25	0.42
18	US T N/B 2.75 02/15/28 アメリカ	国債証券	1,626,667,200	105.78 1,720,769,897	107.70 1,751,971,407	2.75 2028/2/15	0.41
19	FRANCE OAT 3.0 04/25/22 フランス	国債証券	1,594,769,800	110.39 1,760,495,090	109.06 1,739,338,871	3 2022/4/25	0.41
20	US T N/B 2.5 02/28/21 アメリカ	国債証券	1,708,327,200	101.11 1,727,340,881	101.07 1,726,678,357	2.5 2021/2/28	0.40
21	US T N/B 2.25 02/15/27 アメリカ	国債証券	1,640,821,600	102.09 1,675,163,996	103.71 1,701,711,454	2.25 2027/2/15	0.40
22	US T N/B 1.75 07/31/21 アメリカ	国債証券	1,690,906,400	100.06 1,692,039,307	100.13 1,693,218,172	1.75 2021/7/31	0.40
23	US T N/B 2.375 03/15/22 アメリカ	国債証券	1,646,265,600	101.68 1,673,972,250	101.74 1,675,010,928	2.375 2022/3/15	0.39
24	US T N/B 2.0 12/31/21 アメリカ	国債証券	1,602,713,600	100.59 1,612,217,691	100.75 1,614,733,952	2 2021/12/31	0.38
25	US T N/B 2.875 05/15/28 アメリカ	国債証券	1,481,856,800	106.82 1,582,978,708	108.82 1,612,676,970	2.875 2028/5/15	0.38
26	FRANCE OAT 2.75 10/25/27 フランス	国債証券	1,283,832,200	124.44 1,597,613,628	124.31 1,595,988,296	2.75 2027/10/25	0.37
27	FRANCE OAT 4.25 10/25/23 フランス	国債証券	1,334,845,400	121.15 1,617,231,944	119.38 1,593,665,248	4.25 2023/10/25	0.37
28	US T N/B 2.5 01/15/22 アメリカ	国債証券	1,559,161,600	101.82 1,587,600,707	101.82 1,587,604,105	2.5 2022/1/15	0.37

29	US T N/B 2.5 12/31/20 アメリカ	国債証券	1,562,428,000	100.96 1,577,489,805	100.95 1,577,380,919	2.5 2020/12/31	0.37
30	US T N/B 2.0 04/30/24 アメリカ	国債証券	1,552,628,800	100.82 1,565,484,566	101.50 1,576,039,522	2 2024/4/30	0.37

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

令和1年10月31日現在

種類	投資比率（%）
国債証券	99.27
合計	99.27

（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。

Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・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	日本ビルファンド投資法人 日本	投資証券	3,768	776,183.93 2,924,661,049	820,000.00 3,089,760,000	－ －	6.82
2	ジャパンリアルエステイト投資法人 日本	投資証券	3,891	685,354.08 2,666,712,741	737,000.00 2,867,667,000	－ －	6.33
3	野村不動産マスターファンド投資法人 日本	投資証券	12,135	179,639.53 2,179,925,811	206,500.00 2,505,877,500	－ －	5.53
4	ユナイテッド・アーバン投資法人 日本	投資証券	8,737	191,984.53 1,677,368,840	218,000.00 1,904,666,000	－ －	4.20
5	オリックス不動産投資法人 日本	投資証券	7,753	212,467.34 1,647,259,297	244,400.00 1,894,833,200	－ －	4.18

6	日本リテールファンド投資法人 日本	投資証券	7,354	221,693.76 1,630,335,945	252,000.00 1,853,208,000	－ －	4.09
7	日本プロロジスリート投資法人 日本	投資証券	5,590	261,181.63 1,460,005,356	302,000.00 1,688,180,000	－ －	3.72
8	大和ハウスリート投資法人 日本	投資証券	5,246	276,942.99 1,452,842,945	314,500.00 1,649,867,000	－ －	3.64
9	ＧＬＰ投資法人 日本	投資証券	9,691	130,176.05 1,261,536,155	140,800.00 1,364,492,800	－ －	3.01
10	アドバンス・レジデンス投資法人 日本	投資証券	3,690	333,451.53 1,230,436,165	359,000.00 1,324,710,000	－ －	2.92
11	日本プライムリアルティ投資法人 日本	投資証券	2,463	484,226.47 1,192,649,814	519,000.00 1,278,297,000	－ －	2.82
12	インヴィンシブル投資法人 日本	投資証券	17,068	62,430.25 1,065,559,618	68,300.00 1,165,744,400	－ －	2.57
13	積水ハウス・リート投資法人 日本	投資証券	11,377	86,419.73 983,197,274	99,900.00 1,136,562,300	－ －	2.51
14	ジャパン・ホテル・リート投資法人 日本	投資証券	12,535	85,929.43 1,077,125,499	89,700.00 1,124,389,500	－ －	2.48
15	アクティビア・プロパティーズ投資法人 日本	投資証券	1,950	509,026.77 992,602,209	570,000.00 1,111,500,000	－ －	2.45
16	ケネディクス・オフィス投資法人 日本	投資証券	1,204	789,646.27 950,734,121	846,000.00 1,018,584,000	－ －	2.25
17	日本アコモデーションファンド投資法人 日本	投資証券	1,293	630,139.61 814,770,520	680,000.00 879,240,000	－ －	1.94
18	産業ファンド投資法人 日本	投資証券	4,787	142,733.53 683,265,415	169,300.00 810,439,100	－ －	1.79
19	森ヒルズリート投資法人 日本	投資証券	4,477	161,581.59 723,400,809	178,600.00 799,592,200	－ －	1.76
20	大和証券オフィス投資法人 日本	投資証券	898	790,519.18 709,886,225	861,000.00 773,178,000	－ －	1.71
21	日本ロジスティクスファンド投資法人 日本	投資証券	2,542	257,797.82 655,322,063	274,700.00 698,287,400	－ －	1.54
22	ヒューリックリート投資法人 日本	投資証券	3,309	190,453.84 630,211,778	206,200.00 682,315,800	－ －	1.51
23	フロンティア不動産投資法人 日本	投資証券	1,382	467,766.52 646,453,339	482,500.00 666,815,000	－ －	1.47
24	イオンリート投資法人 日本	投資証券	4,199	139,020.41 583,746,715	155,400.00 652,524,600	－ －	1.44

25	ジャパンエクセレント投資法人 日本	投資証券	3,484	167,203.77 582,537,952	185,900.00 647,675,600	－ －	1.43
26	日本リート投資法人 日本	投資証券	1,264	436,805.70 552,122,414	469,000.00 592,816,000	－ －	1.31
27	ラサールロジポート投資法人 日本	投資証券	3,618	140,604.67 508,707,702	160,900.00 582,136,200	－ －	1.28
28	ＭＣＵＢＳ　ＭｉｄＣｉｔｙ投資法人 日本	投資証券	4,616	111,205.97 513,326,764	125,400.00 578,846,400	－ －	1.28
29	コンフォリア・レジデンシャル投資法人 日本	投資証券	1,620	319,234.65 517,160,143	352,000.00 570,240,000	－ －	1.26
30	プレミア投資法人 日本	投資証券	3,514	147,033.79 516,676,763	162,100.00 569,619,400	－ －	1.26

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

令和1年10月31日現在

種類	投資比率（%）
投資証券	97.93
合計	97.93

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和1年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	PROLOGIS INC アメリカ	投資証券	227,541	9,143.12 2,080,436,152	9,546.59 2,172,242,546	－ －	4.05
2	EQUINIX INC アメリカ	投資証券	30,583	61,921.54 1,893,746,537	62,187.90 1,901,892,570	－ －	3.54
3	SIMON PROPERTY GROUP INC アメリカ	投資証券	111,061	17,041.48 1,892,644,661	16,460.47 1,828,117,191	－ －	3.41
4	WELLTOWER INC アメリカ	投資証券	146,156	9,482.79 1,385,966,706	9,849.28 1,439,532,069	－ －	2.68
5	PUBLIC STORAGE アメリカ	投資証券	54,155	26,703.99 1,446,155,036	24,308.54 1,316,429,460	－ －	2.45
6	EQUITY RESIDENTIAL アメリカ	投資証券	125,746	8,930.97 1,123,034,536	9,673.98 1,216,465,295	－ －	2.27
7	AVALONBAY COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	50,376	22,987.31 1,158,009,180	23,842.54 1,201,091,915	－ －	2.24
8	DIGITAL REALTY TRUST INC アメリカ	投資証券	75,161	13,630.95 1,024,516,571	14,090.16 1,059,030,575	－ －	1.97
9	REALTY INCOME CORP アメリカ	投資証券	114,814	8,080.82 927,792,404	8,921.62 1,024,327,705	－ －	1.91

10	VENTAS INC アメリカ	投資証券	134,434	7,776.05 1,045,366,044	7,066.31 949,952,587	－ －	1.77
11	LINK REIT 香港	投資証券	760,020	1,269.90 965,152,854	1,191.06 905,235,121	－ －	1.69
12	ESSEX PROPERTY TRUST INC アメリカ	投資証券	23,720	34,053.21 807,742,255	35,674.53 846,199,899	－ －	1.58
13	UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD オランダ	投資証券	49,671	15,996.55 794,564,776	16,834.35 836,179,296	－ －	1.56
14	BOSTON PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	51,887	14,392.09 746,762,719	15,126.69 784,878,999	－ －	1.46
15	HCP INC アメリカ	投資証券	177,291	3,732.83 661,798,171	4,016.58 712,104,052	－ －	1.33
16	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT アメリカ	投資証券	40,944	16,192.09 662,969,215	17,318.45 709,086,731	－ －	1.32
17	WP CAREY INC アメリカ	投資証券	61,670	9,540.15 588,341,092	10,036.55 618,954,556	－ －	1.15
18	GOODMAN GROUP オーストラリア	投資信託受益証券	575,995	1,118.88 644,473,812	1,073.49 618,326,485	－ －	1.15
19	MID AMERICA アメリカ	投資証券	41,182	13,599.48 560,053,973	14,890.42 613,217,638	－ －	1.14
20	UDR INC アメリカ	投資証券	105,763	5,120.64 541,574,967	5,483.19 579,919,343	－ －	1.08
21	INVITATION HOMES INC アメリカ	投資証券	172,820	3,116.61 538,612,729	3,316.48 573,154,903	－ －	1.07
22	SUN COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	32,748	15,298.61 500,998,958	17,461.08 571,815,631	－ －	1.07
23	EXTRA SPACE STORAGE INC アメリカ	投資証券	46,416	12,271.77 569,606,715	12,069.34 560,210,856	－ －	1.04
24	SCENTRE GROUP オーストラリア	投資信託受益証券	1,923,017	294.78 566,868,897	289.82 557,344,171	－ －	1.04
25	DUKE REALTY TRUST アメリカ	投資証券	130,588	3,563.30 465,325,227	3,864.15 504,611,776	－ －	0.94
26	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES アメリカ	投資証券	65,779	7,042.30 463,236,092	7,529.05 495,253,511	－ －	0.92
27	HOST HOTELS & RESORTS INC アメリカ	投資証券	263,729	1,879.40 495,653,964	1,813.94 478,388,793	－ －	0.89
28	SEGRO PLC イギリス	投資証券	389,311	1,086.76 423,088,432	1,195.96 465,604,104	－ －	0.87
29	REGENCY CENTERS CORP アメリカ	投資証券	60,315	7,448.78 449,273,705	7,594.37 458,055,029	－ －	0.85
30	CAMDEN PROPERTY TRUST アメリカ	投資証券	34,861	11,789.94 411,009,382	12,477.64 434,983,286	－ －	0.81

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

令和1年10月31日現在

種類	投資比率（%）

株式	0.00
投資信託受益証券	10.31
投資証券	89.30
合計	99.60

（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

令和1年10月31日現在

業種	国内／外国	投資比率（%）
資本市場	外国	0.00
合計		0.00

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

②【投資不動産物件】

たわらノーロード　スマートグローバルバランス（保守型）
該当事項はありません。

たわらノーロード　スマートグローバルバランス（安定型）
該当事項はありません。

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）
該当事項はありません。

たわらノーロード　スマートグローバルバランス（成長型）
該当事項はありません。

たわらノーロード　スマートグローバルバランス（積極型）
該当事項はありません。

（参考）
国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド
該当事項はありません。

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。

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。

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。

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
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。

Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド
該当事項はありません。

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド
該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

たわらノーロード　スマートグローバルバランス（保守型）
該当事項はありません。

たわらノーロード　スマートグローバルバランス（安定型）
該当事項はありません。

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）
該当事項はありません。

たわらノーロード　スマートグローバルバランス（成長型）
該当事項はありません。

たわらノーロード　スマートグローバルバランス（積極型）
該当事項はありません。

（参考）
国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

令和1年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。

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。

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。

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。

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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。

Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・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（%）
不動産投信指数先物取引	大阪取引所	ＴＲＥＩＴ先物　０１１２月	買建	351	748,239,408	786,064,500	1.73

（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。

外国リート・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。

（３）【運用実績】

①【純資産の推移】

たわらノーロード　スマートグローバルバランス（保守型）

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30年10月12日）	12	12	0.9814	0.9814
第2計算期間末（令和1年10月15日）	27	27	1.0340	1.0340
平成30年10月末日	13	－	0.9824	－
11月末日	12	－	0.9877	－
12月末日	12	－	0.9855	－
平成31年1月末日	13	－	0.9956	－
2月末日	14	－	1.0007	－
3月末日	20	－	1.0108	－
4月末日	20	－	1.0098	－
令和1年5月末日	21	－	1.0103	－
6月末日	22	－	1.0233	－
7月末日	24	－	1.0268	－
8月末日	26	－	1.0402	－
9月末日	27	－	1.0367	－
10月末日	26	－	1.0350	－

たわらノーロード　スマートグローバルバランス（安定型）

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30年10月12日)	313	313	0.9899	0.9899
第2計算期間末 (令和1年10月15日)	1,421	1,421	1.0662	1.0662
平成30年10月末日	343	－	0.9893	－
11月末日	406	－	0.9997	－
12月末日	400	－	0.9825	－
平成31年1月末日	470	－	1.0045	－
2月末日	528	－	1.0153	－
3月末日	588	－	1.0278	－
4月末日	646	－	1.0310	－
令和1年5月末日	687	－	1.0235	－
6月末日	767	－	1.0406	－
7月末日	911	－	1.0497	－
8月末日	1,119	－	1.0580	－
9月末日	1,327	－	1.0655	－
10月末日	1,520	－	1.0728	－

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）

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30年10月12日)	634	634	0.9926	0.9926
第2計算期間末 (令和1年10月15日)	2,259	2,259	1.0820	1.0820
平成30年10月末日	710	－	0.9914	－
11月末日	831	－	1.0065	－
12月末日	862	－	0.9721	－
平成31年1月末日	978	－	1.0064	－
2月末日	1,095	－	1.0230	－
3月末日	1,176	－	1.0369	－
4月末日	1,282	－	1.0442	－
令和1年5月末日	1,335	－	1.0274	－
6月末日	1,471	－	1.0470	－
7月末日	1,699	－	1.0605	－
8月末日	1,880	－	1.0598	－
9月末日	2,147	－	1.0780	－
10月末日	2,406	－	1.0948	－

たわらノーロード　スマートグローバルバランス（成長型）

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30年10月12日)	347	347	0.9972	0.9972
第2計算期間末 (令和1年10月15日)	1,136	1,136	1.0938	1.0938
平成30年10月末日	375	－	0.9947	－
11月末日	423	－	1.0137	－
12月末日	433	－	0.9596	－
平成31年1月末日	513	－	1.0060	－
2月末日	582	－	1.0297	－
3月末日	637	－	1.0441	－
4月末日	670	－	1.0573	－
令和1年5月末日	710	－	1.0285	－
6月末日	785	－	1.0515	－
7月末日	893	－	1.0695	－
8月末日	956	－	1.0576	－
9月末日	1,074	－	1.0864	－
10月末日	1,221	－	1.1133	－

たわらノーロード　スマートグローバルバランス（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30年10月12日)	654	654	0.9977	0.9977
第2計算期間末 (令和1年10月15日)	1,792	1,792	1.0997	1.0997
平成30年10月末日	734	－	0.9940	－
11月末日	853	－	1.0172	－
12月末日	890	－	0.9440	－
平成31年1月末日	1,054	－	1.0020	－
2月末日	1,158	－	1.0321	－
3月末日	1,232	－	1.0471	－
4月末日	1,349	－	1.0653	－
令和1年5月末日	1,375	－	1.0253	－
6月末日	1,526	－	1.0507	－
7月末日	1,614	－	1.0726	－
8月末日	1,640	－	1.0506	－
9月末日	1,751	－	1.0891	－
10月末日	1,880	－	1.1256	－

②【分配の推移】

たわらノーロード　スマートグローバルバランス（保守型）

	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

たわらノーロード　スマートグローバルバランス（安定型）

	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

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）

	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

たわらノーロード　スマートグローバルバランス（成長型）

	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

たわらノーロード　スマートグローバルバランス（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

③【収益率の推移】

たわらノーロード　スマートグローバルバランス（保守型）

	収益率（％）
第1計算期間	△1.9
第2計算期間	5.4

（注）収益率は期間騰落率です。

たわらノーロード　スマートグローバルバランス（安定型）

	収益率（％）
第1計算期間	△1.0
第2計算期間	7.7

（注）収益率は期間騰落率です。

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）

	収益率（％）
第1計算期間	△0.7
第2計算期間	9.0

（注）収益率は期間騰落率です。

たわらノーロード　スマートグローバルバランス（成長型）

	収益率（%）
第1計算期間	△0.3
第2計算期間	9.7

（注）収益率は期間騰落率です。

たわらノーロード　スマートグローバルバランス（積極型）

	収益率（%）
第1計算期間	△0.2
第2計算期間	10.2

（注）収益率は期間騰落率です。

（４）【設定及び解約の実績】

たわらノーロード　スマートグローバルバランス（保守型）

	設定口数	解約口数
第1計算期間	12,961,849	80,400
第2計算期間	15,716,315	1,931,793

（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。

たわらノーロード　スマートグローバルバランス（安定型）

	設定口数	解約口数
第1計算期間	334,817,753	17,718,711
第2計算期間	1,125,358,112	109,368,786

（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。

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）

	設定口数	解約口数
第1計算期間	652,826,108	13,246,144
第2計算期間	1,587,078,325	138,311,707

（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。

たわらノーロード　スマートグローバルバランス（成長型）

	設定口数	解約口数
第1計算期間	371,918,772	23,462,581
第2計算期間	779,749,231	89,002,552

（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。

たわらノーロード　スマートグローバルバランス（積極型）

	設定口数	解約口数
第1計算期間	698,135,986	42,147,897
第2計算期間	1,157,648,633	183,309,574

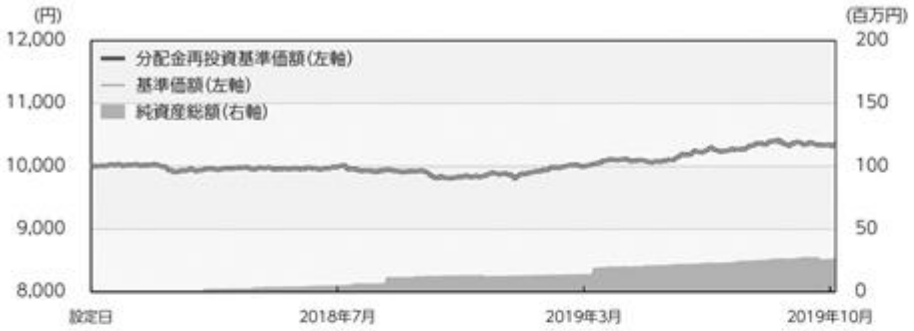
（注1）本邦外における設定及び解約はありません。
（注2）第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

＜＜参考情報＞＞

データの基準日:2019年10月31日

（保守型）

基準価額・純資産の推移 《2017年11月24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:2017年11月24日)

分配の推移(税引前)

2018年10月	0円
2019年10月	0円
設定来累計	0円

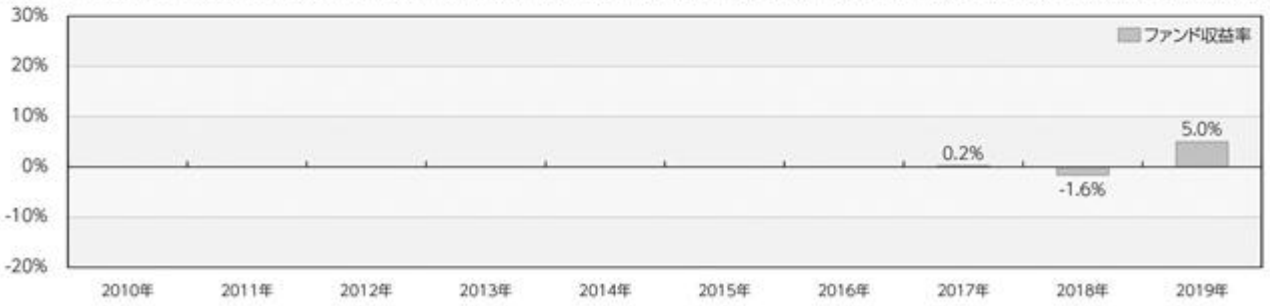
※分配金は1万口当たりです。

主要な資産の状況

■組入銘柄 ※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	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	48.28
2	為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	32.86
3	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	6.54
4	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	5.91
5	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	3.91
6	J-REITインデックスファンド・マザーファンド	0.96
7	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	0.91

年間収益率の推移(暦年ベース)



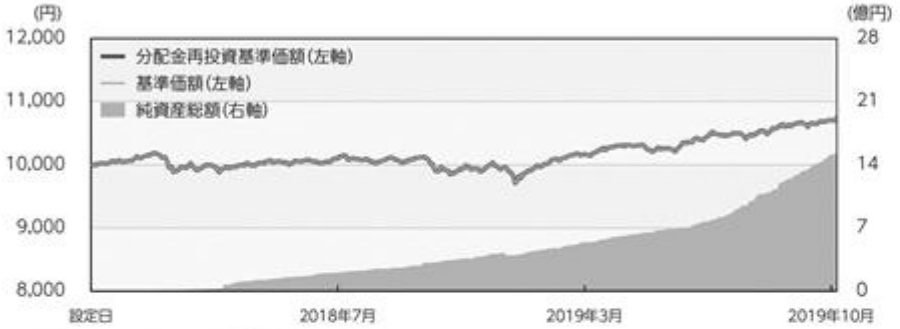
※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。
※2017年は設定日から年末までの収益率、および2019年については年初から基準日までの収益率を表示しています。
※当ファンドにはベンチマークはありません。

○掲載データ等はあくまでも過去の実績であり、将来の運用成果を示唆、保証するものではありません。
○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

データの基準日:2019年10月31日

（安定型）

基準価額・純資産の推移 《2017年11月24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:2017年11月24日）

分配の推移（税引前）

2018年10月	0円
2019年10月	0円
設定来累計	0円

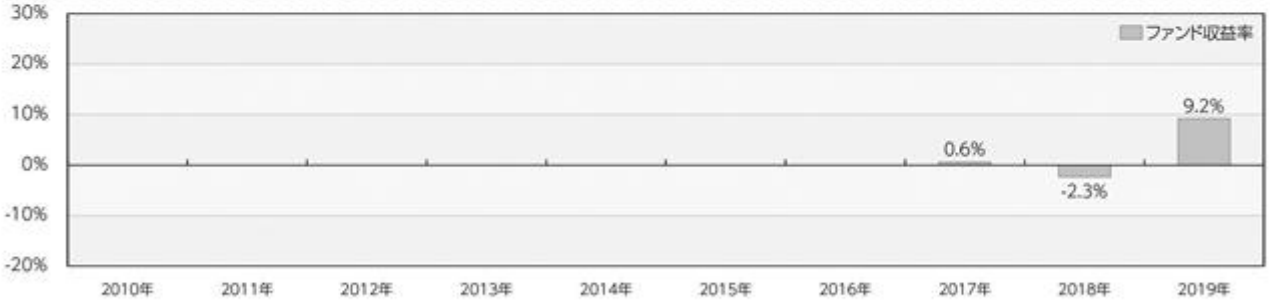
※分配金は1万口当たりです。

主要な資産の状況

■組入銘柄 ※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

順位	銘柄名	比率(%)
1	為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	28.90
2	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	28.45
3	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	12.81
4	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	9.00
5	J-REITインデックスファンド・マザーファンド	8.14
6	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	7.24
7	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	3.06
8	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	2.07

年間収益率の推移（暦年ベース）



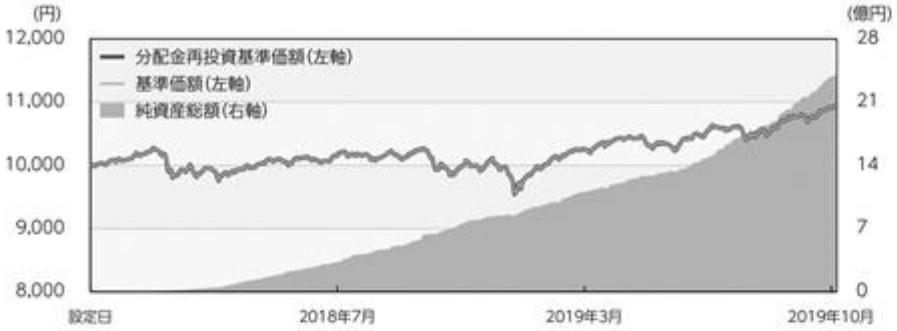
※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。
※2017年は設定日から年末までの収益率、および2019年については年初から基準日までの収益率を表示しています。
※当ファンドにはベンチマークはありません。

○掲載データ等はあくまでも過去の実績であり、将来の運用成果を示唆、保証するものではありません。
○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

データの基準日:2019年10月31日

（安定成長型）

基準価額・純資産の推移 〈2017年11月24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:2017年11月24日）

分配の推移（税引前）

2018年10月	0円
2019年10月	0円
設定来累計	0円

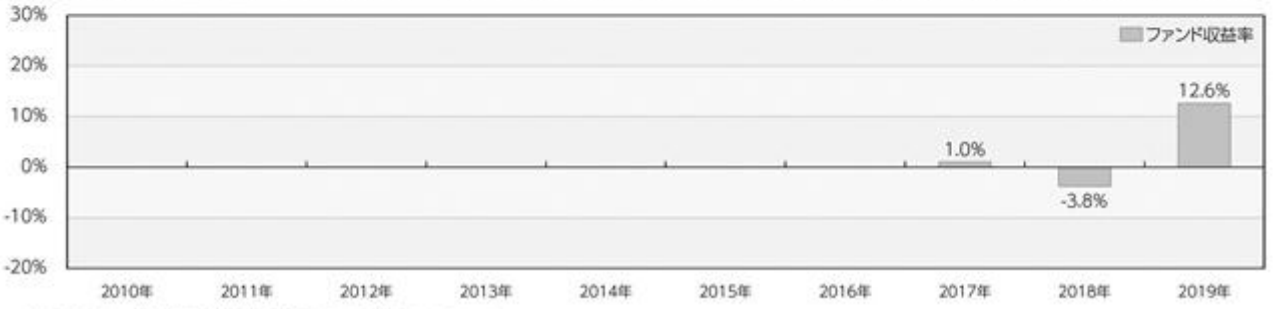
※分配金は1万口当たりです。

主要な資産の状況

■組入銘柄　※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

順位	銘柄名	比率(%)
1	為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	20.92
2	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	19.97
3	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	18.40
4	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	11.25
5	J-REITインデックスファンド・マザーファンド	11.07
6	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	8.06
7	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	6.93
8	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	3.07

年間収益率の推移（暦年ベース）



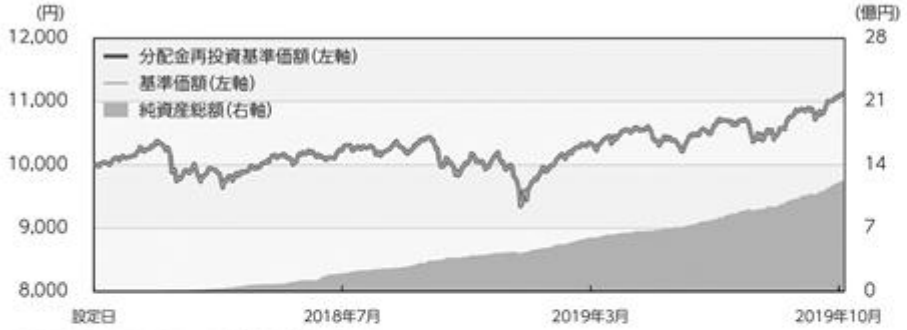
※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。
※2017年は設定日から年末までの収益率、および2019年については年初から基準日までの収益率を表示しています。
※当ファンドにはベンチマークはありません。

○掲載データ等はあくまでも過去の実績であり、将来の運用成果を示唆、保証するものではありません。
○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

データの基準日:2019年10月31日

（ 成 長 型 ）

基準価額・純資産の推移 〈2017年11月24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:2017年11月24日）

分配の推移（税引前）

2018年10月	0円
2019年10月	0円
設定来累計	0円

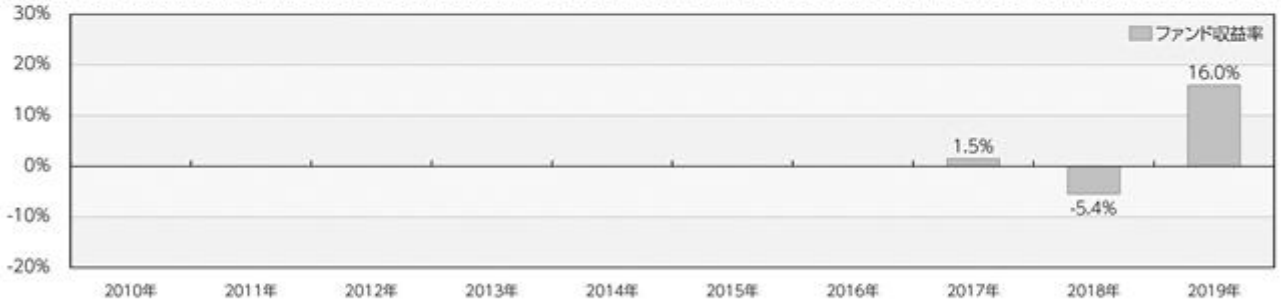
※分配金は1万口当たりです。

主要な資産の状況

■組入銘柄 ※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

順位	銘柄名	比率(%)
1	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	28.63
2	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	16.21
3	為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	13.00
4	J-REITインデックスファンド・マザーファンド	12.96
5	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	12.06
6	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	9.49
7	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	4.06
8	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	3.01

年間収益率の推移（暦年ベース）



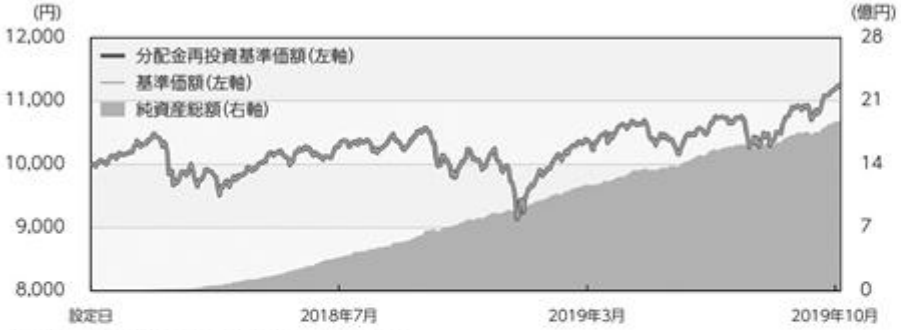
※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。
※2017年は設定日から年末までの収益率、および2019年については年初から基準日までの収益率を表示しています。
※当ファンドにはベンチマークはありません。

○掲載データ等はあくまでも過去の実績であり、将来の運用成果を示唆、保証するものではありません。
○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

データの基準日:2019年10月31日

（積極型）

基準価額・純資産の推移 〈2017年11月24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:2017年11月24日）

分配の推移（税引前）

2018年10月	0円
2019年10月	0円
設定来累計	0円

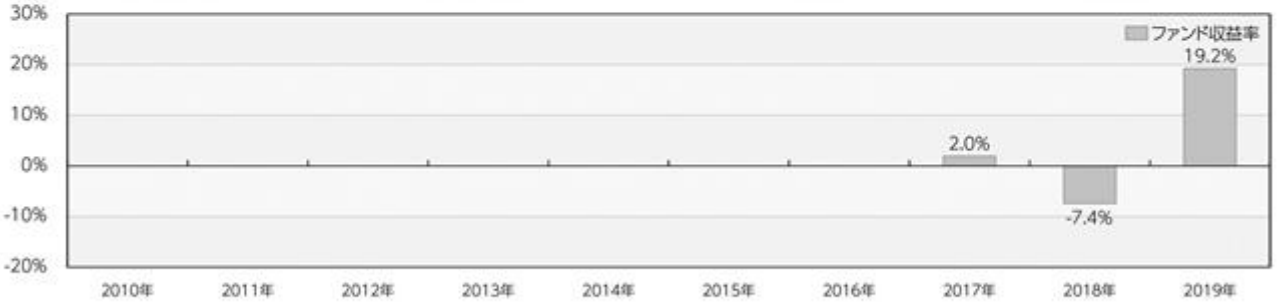
※分配金は1万口当たりです。

主要な資産の状況

■組入銘柄 ※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

順位	銘柄名	比率(%)
1	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	37.02
2	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	20.27
3	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	15.99
4	J-REITインデックスファンド・マザーファンド	14.96
5	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	5.07
6	為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	3.97
7	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	1.49
8	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	1.00

年間収益率の推移（暦年ベース）



※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。
※2017年は設定日から年末までの収益率、および2019年については年初から基準日までの収益率を表示しています。
※当ファンドにはベンチマークはありません。

○掲載データ等はあくまでも過去の実績であり、将来の運用成果を示唆、保証するものではありません。
○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

データの基準日:2019年10月31日

主要な資産の状況

■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

■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

■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

■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

○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。

■為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還日	比率(%)
1	US T N/B 3.125 11/15/28	国債証券	アメリカ	3.125	2028/11/15	0.60
2	US T N/B 2.25 04/15/22	国債証券	アメリカ	2.25	2022/4/15	0.59
3	US T N/B 2.5 05/15/24	国債証券	アメリカ	2.5	2024/5/15	0.57
4	US T N/B 2.125 05/31/21	国債証券	アメリカ	2.125	2021/5/31	0.57
5	US T N/B 2.0 02/15/25	国債証券	アメリカ	2	2025/2/15	0.56

■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

■J-REITインデックスファンド・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	比率(%)
1	日本ビルファンド投資法人	投資証券	日本	6.82
2	ジャパンリアルエステイト投資法人	投資証券	日本	6.33
3	野村不動産マスターファンド投資法人	投資証券	日本	5.53
4	ユナイテッド・アーバン投資法人	投資証券	日本	4.20
5	オリックス不動産投資法人	投資証券	日本	4.18

■外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	比率(%)
1	PROLOGIS INC	投資証券	アメリカ	4.05
2	EQUINIX INC	投資証券	アメリカ	3.54
3	SIMON PROPERTY GROUP INC	投資証券	アメリカ	3.41
4	WELLTOWER INC	投資証券	アメリカ	2.68
5	PUBLIC STORAGE	投資証券	アメリカ	2.45

○掲載データ等はあくまでも過去の実績であり、将来の運用成果を示唆、保証するものではありません。
○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

第２【管理及び運営】

１【申込（販売）手続等】

お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

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

確定拠出年金制度によるお申込みの場合は、取扱いが一部異なる場合があります。

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

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

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

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

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

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

・お申込価額

お申込日の翌営業日の基準価額※とします。

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

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

＜基準価額の照会方法等＞

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

※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

ありません。

・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「分配金再投資コース」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。

※「分配金再投資コース」により、収益分配金を再投資する場合は、1口単位となります。

※確定拠出年金制度によるお申込みの場合は、1円以上1円単位となります。

※当初元本は1口当たり1円です。

・払込期日

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

2【換金（解約）手続等】

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

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

※海外休業日には、解約の受付を行いません。

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

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

※委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、解約の受付を中止することおよびすでに受付けた解約の請求の受付を取り消すことができます。解約の受付が中止された場合には、受益者は当該受

付中止以前に行った当日の解約の請求を撤回できます。ただし、受益者がその解約の請求を撤回しない場合には、当該受益権の解約価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に解約の請求を受付けたものとして、下記に準じて計算した価額とします。

・解約価額

解約価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

※各ファンドの解約価額は、以下の方法でご確認ください。

・販売会社へのお問い合わせ

・委託会社への照会

ホームページ　URL　http://www.am-one.co.jp/

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

・解約単位

各販売会社が定める単位とします。

※解約単位は販売会社にお問い合わせください。

・解約代金の受渡日

解約代金は、原則として解約請求受付日より起算して6営業日目から販売会社の営業所等において支払います。

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

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

＜主な投資対象の時価評価方法の原則＞

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

※外国で取引されているものについては、計算時に知りうる直近の日

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

※各ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

・販売会社へのお問い合わせ

・委託会社への照会

ホームページ　URL　http://www.am-one.co.jp/

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

（２）【保管】

該当事項はありません。

（３）【信託期間】

信託期間は、2017年11月24日から原則として無期限です。

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

（４）【計算期間】

a.計算期間は、原則として毎年10月13日から翌年10月12日までとします。

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

（５）【その他】

イ.償還規定

a.委託会社は、信託期間中において、信託契約を解約することが受益者のために有利であると認める場合、各ファンドにおいて受益権口数が10億口を下回ることとなった場合、マザーファンドのベンチマークである対象インデックスが改廃された場合、またはやむを得ない事情が発生した場合は、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

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

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

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

e.上記b.からd.までの規定は、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、信託契約にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記b.からd.までの手続きを行うことが困難な場合にも適用しません。

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き継ぐことを命じたときは、下記「ロ．信託約款の変更等 b.」の書面決議が否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。

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

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

ロ.信託約款の変更等

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

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

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

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

e.書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。

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

g.上記a.からf.の規定にかかわらず、この投資信託において併合の書面決議が可決された場合にあっても、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信託約款を変更しようとするときは、上記a.からg.の規定にしたがいます。

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

ハ.関係法人との契約の更改

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

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。

ニ.公告

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

（URL　http://www.am-one.co.jp/）

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

ホ.運用報告書

・委託会社は、毎年10月12日（休業日の場合は翌営業日とします。）および償還時に交付運用報告書を作成し、販売会社を通じて受益者に対して交付します。

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

（URL　http://www.am-one.co.jp/）

4【受益者の権利等】

(1)収益分配金請求権

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

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

収益分配金は、決算日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため委託会社または販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）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、「分配金再投資コース」により収益分配金を再投資する受益者に対しては、委託会社は受託会社から受けた収益分配金を、原則として毎計算期間終了日の翌営業日に販売会社に交付します。販売会社は、受益者に対し遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の売付を行います。

再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

(2)償還金請求権

受益者は、持ち分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

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

(3)一部解約請求権

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

(4)帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

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

第３【ファンドの経理状況】

たわらノーロード　スマートグローバルバランス（保守型）
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（安定型）
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）
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（成長型）
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（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）当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第2期計算期間（平成30年10月13日から令和1年10月15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】

【たわらノーロード　スマートグローバルバランス（保守型）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第1期 平成30年10月12日現在	第2期 令和1年10月15日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	92,345	208,381
親投資信託受益証券	12,554,737	27,439,718
派生商品評価勘定	10,793	－
流動資産合計	12,657,875	27,648,099
資産合計	12,657,875	27,648,099
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	59	10,282
未払解約金	－	252
未払受託者報酬	1,262	5,172
未払委託者報酬	14,666	60,024
その他未払費用	46	397
流動負債合計	16,033	76,127
負債合計	16,033	76,127
純資産の部		
元本等		
元本	12,881,449	26,665,971
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△239,607	906,001
（分配準備積立金）	49,837	785,571
元本等合計	12,641,842	27,571,972
純資産合計	12,641,842	27,571,972
負債純資産合計	12,657,875	27,648,099

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期 自　平成29年11月24日 至　平成30年10月12日	第2期 自　平成30年10月13日 至　令和1年10月15日
営業収益		
有価証券売買等損益	△142,263	1,048,981
為替差損益	△12,212	20,100
営業収益合計	△154,475	1,069,081
営業費用		
支払利息	4	9
受託者報酬	1,626	8,209
委託者報酬	19,176	95,523
その他費用	46	609
営業費用合計	20,852	104,350
営業利益又は営業損失（△）	△175,327	964,731
経常利益又は経常損失（△）	△175,327	964,731
当期純利益又は当期純損失（△）	△175,327	964,731
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（△）	△139	25,259
期首剰余金又は期首欠損金（△）	－	△239,607
剰余金増加額又は欠損金減少額	389	206,136
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	389	29,201
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	－	176,935
剰余金減少額又は欠損金増加額	64,808	－
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	－	－
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	64,808	－
分配金	－	－
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△239,607	906,001

（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2期 自　平成30年10月13日 至　令和1年10月15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。
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	計算期間末日の取扱い 当ファンドは、原則として毎年10月12日を計算期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、当計算期間末日を令和1年10月15日としております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	第1期 平成30年10月12日現在	第2期 令和1年10月15日現在
１．　期首元本額	1,000,000円	12,881,449円
期中追加設定元本額	11,961,849円	15,716,315円
期中一部解約元本額	80,400円	1,931,793円
２．　受益権の総数	12,881,449口	26,665,971口
３．　元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は239,607円であります。	－

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	第1期 自　平成29年11月24日 至　平成30年10月12日	第2期 自　平成30年10月13日 至　令和1年10月15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（49,837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（8,726円）及び分配準備積立金（0円）より分配対象収益は58,563円（1万口当たり45.46円）でありますが、分配を行っておりません。なお、分配金の計算過程においては、親投資信託の配当等収益及び収益調整金相当額を充当する方法によっております。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（278,623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（463,158円）、信託約款に規定される収益調整金（120,430円）及び分配準備積立金（43,790円）より分配対象収益は906,001円（1万口当たり339.75円）でありますが、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1期 自　平成29年11月24日 至　平成30年10月12日	第2期 自　平成30年10月13日 至　令和1年10月15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、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、主要投資対象である親投資信託受益証券が保有する金融商品に係る、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。	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。	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1期 平成30年10月12日現在	第2期 令和1年10月15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 「（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。	(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。	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	第1期 平成30年10月12日現在	第2期 令和1年10月15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	△142,554	1,020,982
合計	△142,554	1,020,982

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	第1期 平成30年10月12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	753,213	－	742,479	10,734
アメリカ・ドル	531,764	－	524,355	7,409
イギリス・ポンド	52,195	－	52,254	△59
オーストラリア・ドル	19,853	－	19,316	537
カナダ・ドル	29,093	－	28,290	803
スイス・フラン	24,498	－	23,927	571
ユーロ	95,810	－	94,337	1,473
合計	753,213	－	742,479	10,734

種類	第2期 令和1年10月15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	1,659,083	－	1,669,365	△10,282
アメリカ・ドル	1,187,384	－	1,191,181	△3,797
イギリス・ポンド	103,095	－	106,076	△2,981
オーストラリア・ドル	44,655	－	44,896	△241
カナダ・ドル	65,820	－	66,052	△232
スイス・フラン	59,172	－	59,377	△205
ユーロ	198,957	－	201,783	△2,826
合計	1,659,083	－	1,669,365	△10,282

（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。

①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。

②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）

	第1期 平成30年10月12日現在	第2期 令和1年10月15日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	0.9814円 (9,814円)	1.0340円 (10,340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15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	439,655	1,125,736	
	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	10,065,933	13,364,539	
	Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド	116,050	284,102	
	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	457,369	1,672,735	
	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	882,203	1,659,688	
	為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	6,370,849	9,051,702	
	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	251,918	281,216	
親投資信託受益証券　合計		18,583,977	27,439,718	
合計			27,439,718	

（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

「（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。

【たわらノーロード　スマートグローバルバランス（安定型）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第1期 平成30年10月12日現在	第2期 令和1年10月15日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	2,811,448	21,095,111
親投資信託受益証券	310,924,708	1,406,171,764
派生商品評価勘定	640,393	1,508
流動資産合計	314,376,549	1,427,268,383
資産合計	314,376,549	1,427,268,383
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	3,327	995,525
未払解約金	－	2,398,407
未払受託者報酬	37,682	199,480
未払委託者報酬	433,691	2,294,619
その他未払費用	3,685	18,861
流動負債合計	478,385	5,906,892
負債合計	478,385	5,906,892
純資産の部		
元本等		
元本	317,099,042	1,333,088,368
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△3,200,878	88,273,123
（分配準備積立金）	1,826,717	47,500,642
元本等合計	313,898,164	1,421,361,491
純資産合計	313,898,164	1,421,361,491
負債純資産合計	314,376,549	1,427,268,383

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期 自　平成29年11月24日 至　平成30年10月12日	第2期 自　平成30年10月13日 至　令和1年10月15日
営業収益		
有価証券売買等損益	△2,720,292	55,791,056
為替差損益	△1,024,563	1,074,146
営業収益合計	△3,744,855	56,865,202
営業費用		
支払利息	766	5,419
受託者報酬	45,952	295,917
委託者報酬	529,185	3,404,146
その他費用	4,459	27,935
営業費用合計	580,362	3,733,417
営業利益又は営業損失（△）	△4,325,217	53,131,785
経常利益又は経常損失（△）	△4,325,217	53,131,785
当期純利益又は当期純損失（△）	△4,325,217	53,131,785
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（△）	40,670	2,070,880
期首剰余金又は期首欠損金（△）	－	△3,200,878
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,203,635	40,413,096
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	－	61,268
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,203,635	40,351,828
剰余金減少額又は欠損金増加額	38,626	－
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	38,626	－
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（△）	△3,200,878	88,273,123

（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2期 自　平成30年10月13日 至　令和1年10月15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。
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	計算期間末日の取扱い 当ファンドは、原則として毎年10月12日を計算期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、当計算期間末日を令和1年10月15日としております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	第1期 平成30年10月12日現在	第2期 令和1年10月15日現在
１．　期首元本額	1,000,000円	317,099,042円
期中追加設定元本額	333,817,753円	1,125,358,112円
期中一部解約元本額	17,718,711円	109,368,786円
２．　受益権の総数	317,099,042口	1,333,088,368口
３．　元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は3,200,878円であります。	－

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	第1期 自　平成29年11月24日 至　平成30年10月12日	第2期 自　平成30年10月13日 至　令和1年10月15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（1,826,717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（314,606円）及び分配準備積立金（0円）より分配対象収益は2,141,323円（1万口当たり67.53円）でありますが、分配を行っておりません。なお、分配金の計算過程においては、親投資信託の配当等収益及び収益調整金相当額を充当する方法によっております。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（13,539,608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（32,471,391円）、信託約款に規定される収益調整金（40,772,481円）及び分配準備積立金（1,489,643円）より分配対象収益は88,273,123円（1万口当たり662.17円）でありますが、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1期 自　平成29年11月24日 至　平成30年10月12日	第2期 自　平成30年10月13日 至　令和1年10月15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、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、主要投資対象である親投資信託受益証券が保有する金融商品に係る、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。	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。	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1期 平成30年10月12日現在	第2期 令和1年10月15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 「（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。	(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。	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	第1期 平成30年10月12日現在	第2期 令和1年10月15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	△2,786,100	54,147,945
合計	△2,786,100	54,147,945

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	第1期 平成30年10月12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	44,136,654	－	43,499,588	637,066
アメリカ・ドル	29,955,017	－	29,537,686	417,331
イギリス・ポンド	2,935,983	－	2,939,310	△3,327
イスラエル・シュケル	50,120	－	49,376	744
オーストラリア・ドル	1,123,934	－	1,093,534	30,400
カナダ・ドル	1,635,955	－	1,590,815	45,140
シンガポール・ドル	207,810	－	203,775	4,035
スイス・フラン	1,381,673	－	1,349,460	32,213
スウェーデン・クローナ	461,235	－	450,360	10,875
デンマーク・クローネ	280,047	－	275,552	4,495
ニュージーランド・ドル	37,612	－	36,545	1,067
ノルウェー・クローネ	131,294	－	128,404	2,890
ユーロ	5,391,842	－	5,308,896	82,946
香港・ドル	544,132	－	535,875	8,257
合計	44,136,654	－	43,499,588	637,066

種類	第2期 令和1年10月15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	160,644,567	－	161,638,584	△994,017
アメリカ・ドル	110,721,849	－	111,075,888	△354,039
イギリス・ポンド	9,619,626	－	9,897,700	△278,074
イスラエル・シュケル	205,118	－	203,610	1,508
オーストラリア・ドル	4,166,404	－	4,188,856	△22,452
カナダ・ドル	6,133,500	－	6,155,120	△21,620
シンガポール・ドル	741,844	－	751,640	△9,796
スイス・フラン	5,516,226	－	5,535,375	△19,149
スウェーデン・クローナ	1,503,750	－	1,510,007	△6,257
デンマーク・クローネ	1,040,369	－	1,055,059	△14,690
ニュージーランド・ドル	141,969	－	143,346	△1,377
ノルウェー・クローネ	383,045	－	384,047	△1,002
ユーロ	18,552,108	－	18,815,596	△263,488
香港・ドル	1,918,759	－	1,922,340	△3,581
合計	160,644,567	－	161,638,584	△994,017

（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。

①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。

②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）

	第1期 平成30年10月12日現在	第2期 令和1年10月15日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	0.9899円 (9,899円)	1.0662円 (10,662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15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	39,615,536	101,435,579	
	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	304,003,648	403,625,643	
	Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド	47,350,356	115,918,406	
	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	48,188,205	176,238,722	
	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	68,110,795	128,136,838	
	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	31,373,335	42,903,035	
	為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	287,768,579	408,861,597	
	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	26,025,212	29,051,944	
親投資信託受益証券　合計		852,435,666	1,406,171,764	
合計			1,406,171,764	

（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

「（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。

【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）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第1期 平成30年10月12日現在	第2期 令和1年10月15日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	7,105,324	31,927,086
親投資信託受益証券	627,873,536	2,235,847,442
派生商品評価勘定	1,490,987	2,810
流動資産合計	636,469,847	2,267,777,338
資産合計	636,469,847	2,267,777,338
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	7,745	1,855,581
未払解約金	734,868	1,861,102
未払受託者報酬	67,555	358,676
未払委託者報酬	777,328	4,125,255
その他未払費用	6,642	33,994
流動負債合計	1,594,138	8,234,608
負債合計	1,594,138	8,234,608
純資産の部		
元本等		
元本	639,579,964	2,088,346,582
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△4,704,255	171,196,148
（分配準備積立金）	3,896,386	106,230,378
元本等合計	634,875,709	2,259,542,730
純資産合計	634,875,709	2,259,542,730
負債純資産合計	636,469,847	2,267,777,338

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期 自　平成29年11月24日 至　平成30年10月12日	第2期 自　平成30年10月13日 至　令和1年10月15日
営業収益		
有価証券売買等損益	△8,356,464	124,511,906
為替差損益	△1,730,166	3,358,713
営業収益合計	△10,086,630	127,870,619
営業費用		
支払利息	1,243	9,701
受託者報酬	77,647	558,501
委託者報酬	893,668	6,423,693
その他費用	7,594	52,881
営業費用合計	980,152	7,044,776
営業利益又は営業損失（△）	△11,066,782	120,825,843
経常利益又は経常損失（△）	△11,066,782	120,825,843
当期純利益又は当期純損失（△）	△11,066,782	120,825,843
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（△）	101,787	4,613,075
期首剰余金又は期首欠損金（△）	－	△4,704,255
剰余金増加額又は欠損金減少額	6,499,231	60,330,843
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	6,499,231	60,330,843
剰余金減少額又は欠損金増加額	34,917	643,208
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	34,917	643,208
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（△）	△4,704,255	171,196,148

（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2期 自　平成30年10月13日 至　令和1年10月15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。
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	計算期間末日の取扱い 当ファンドは、原則として毎年10月12日を計算期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、当計算期間末日を令和1年10月15日としております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	第1期 平成30年10月12日現在	第2期 令和1年10月15日現在
１．　期首元本額	1,000,000円	639,579,964円
期中追加設定元本額	651,826,108円	1,587,078,325円
期中一部解約元本額	13,246,144円	138,311,707円
２．　受益権の総数	639,579,964口	2,088,346,582口
３．　元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は4,704,255円であります。	－

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	第1期 自　平成29年11月24日 至　平成30年10月12日	第2期 自　平成30年10月13日 至　令和1年10月15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（3,896,386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（672,289円）及び分配準備積立金（0円）より分配対象収益は4,568,675円（1万口当たり71.43円）でありますが、分配を行っておりません。なお、分配金の計算過程においては、親投資信託の配当等収益及び収益調整金相当額を充当する方法によっております。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（29,428,321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（73,319,508円）、信託約款に規定される収益調整金（64,965,770円）及び分配準備積立金（3,482,549円）より分配対象収益は171,196,148円（1万口当たり819.76円）でありますが、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1期 自　平成29年11月24日 至　平成30年10月12日	第2期 自　平成30年10月13日 至　令和1年10月15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、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、主要投資対象である親投資信託受益証券が保有する金融商品に係る、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。	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。	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1期 平成30年10月12日現在	第2期 令和1年10月15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 「（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。	(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。	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	第1期 平成30年10月12日現在	第2期 令和1年10月15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	△8,443,798	118,828,936
合計	△8,443,798	118,828,936

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	第1期 平成30年10月12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	102,767,475	－	101,284,233	1,483,242
アメリカ・ドル	69,743,638	－	68,771,974	971,664
イギリス・ポンド	6,835,800	－	6,843,545	△7,745
イスラエル・シュケル	115,904	－	114,182	1,722
オーストラリア・ドル	2,608,840	－	2,538,276	70,564
カナダ・ドル	3,820,176	－	3,714,768	105,408
シンガポール・ドル	490,431	－	480,909	9,522
スイス・フラン	3,204,553	－	3,129,840	74,713
スウェーデン・クローナ	1,072,372	－	1,047,087	25,285
デンマーク・クローネ	654,034	－	643,536	10,498
ニュージーランド・ドル	82,746	－	80,399	2,347
ノルウェー・クローネ	304,491	－	297,788	6,703
ユーロ	12,567,750	－	12,374,412	193,338
香港・ドル	1,266,740	－	1,247,517	19,223
合計	102,767,475	－	101,284,233	1,483,242

種類	第2期 令和1年10月15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	299,441,365	－	301,294,136	△1,852,771
アメリカ・ドル	206,381,556	－	207,041,472	△659,916
イギリス・ポンド	17,925,675	－	18,443,852	△518,177
イスラエル・シュケル	382,265	－	379,455	2,810
オーストラリア・ドル	7,763,667	－	7,805,504	△41,837
カナダ・ドル	11,435,062	－	11,475,370	△40,308
シンガポール・ドル	1,389,982	－	1,408,336	△18,354
スイス・フラン	10,284,673	－	10,320,375	△35,702
スウェーデン・クローナ	2,803,193	－	2,814,856	△11,663
デンマーク・クローネ	1,938,655	－	1,966,028	△27,373
ニュージーランド・ドル	263,657	－	266,214	△2,557
ノルウェー・クローネ	713,911	－	715,778	△1,867
ユーロ	34,581,884	－	35,073,036	△491,152
香港・ドル	3,577,185	－	3,583,860	△6,675
合計	299,441,365	－	301,294,136	△1,852,771

（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。

①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。

②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）

	第1期 平成30年10月12日現在	第2期 令和1年10月15日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	0.9926円 (9,926円)	1.0820円 (10,820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15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	98,667,253	252,637,501	
	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	312,756,786	415,247,184	
	Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド	103,188,303	252,615,284	
	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	119,692,163	437,750,147	
	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	83,961,246	157,956,292	
	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	132,600,785	181,331,573	
	為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	330,264,756	469,240,165	
	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	61,873,418	69,069,296	
親投資信託受益証券　合計		1,243,004,710	2,235,847,442	
合計			2,235,847,442	

（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

「（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。

【たわらノーロード　スマートグローバルバランス（成長型）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第1期 平成30年10月12日現在	第2期 令和1年10月15日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	2,669,242	18,628,584
親投資信託受益証券	344,531,320	1,121,582,896
派生商品評価勘定	852,347	1,599
流動資産合計	348,052,909	1,140,213,079
資産合計	348,052,909	1,140,213,079
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	7,175	1,049,112
未払解約金	83,933	147,206
未払受託者報酬	37,018	186,604
未払委託者報酬	426,131	2,146,510
その他未払費用	3,607	17,634
流動負債合計	557,864	3,547,066
負債合計	557,864	3,547,066
純資産の部		
元本等		
元本	348,456,191	1,039,202,870
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△961,146	97,463,143
（分配準備積立金）	2,510,555	62,634,750
元本等合計	347,495,045	1,136,666,013
純資産合計	347,495,045	1,136,666,013
負債純資産合計	348,052,909	1,140,213,079

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期 自　平成29年11月24日 至　平成30年10月12日	第2期 自　平成30年10月13日 至　令和1年10月15日
営業収益		
有価証券売買等損益	△4,453,680	72,244,576
為替差損益	△1,140,162	2,079,955
営業収益合計	△5,593,842	74,324,531
営業費用		
支払利息	787	5,145
受託者報酬	42,937	291,100
委託者報酬	494,722	3,348,668
その他費用	4,140	27,466
営業費用合計	542,586	3,672,379
営業利益又は営業損失（△）	△6,136,428	70,652,152
経常利益又は経常損失（△）	△6,136,428	70,652,152
当期純利益又は当期純損失（△）	△6,136,428	70,652,152
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（△）	342,248	2,411,244
期首剰余金又は期首欠損金（△）	－	△961,146
剰余金増加額又は欠損金減少額	5,599,574	30,865,609
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	5,599,574	30,865,609
剰余金減少額又は欠損金増加額	82,044	682,228
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	82,044	682,228
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（△）	△961,146	97,463,143

（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2期 自　平成30年10月13日 至　令和1年10月15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。
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	計算期間末日の取扱い 当ファンドは、原則として毎年10月12日を計算期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、当計算期間末日を令和1年10月15日としております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	第1期 平成30年10月12日現在	第2期 令和1年10月15日現在
１．　期首元本額	1,000,000円	348,456,191円
期中追加設定元本額	370,918,772円	779,749,231円
期中一部解約元本額	23,462,581円	89,002,552円
２．　受益権の総数	348,456,191口	1,039,202,870口
３．　元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は961,146円であります。	－

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	第1期 自　平成29年11月24日 至　平成30年10月12日	第2期 自　平成30年10月13日 至　令和1年10月15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（2,510,555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（427,720円）及び分配準備積立金（0円）より分配対象収益は2,938,275円（1万口当たり84.32円）でありますが、分配を行っておりません。なお、分配金の計算過程においては、親投資信託の配当等収益及び収益調整金相当額を充当する方法によっております。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（17,161,551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（43,300,762円）、信託約款に規定される収益調整金（34,828,393円）及び分配準備積立金（2,172,437円）より分配対象収益は97,463,143円（1万口当たり937.86円）でありますが、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1期 自　平成29年11月24日 至　平成30年10月12日	第2期 自　平成30年10月13日 至　令和1年10月15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、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、主要投資対象である親投資信託受益証券が保有する金融商品に係る、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。	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。	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1期 平成30年10月12日現在	第2期 令和1年10月15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 「（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。	(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。	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	第1期 平成30年10月12日現在	第2期 令和1年10月15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	△4,580,601	68,883,716
合計	△4,580,601	68,883,716

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	第1期 平成30年10月12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	61,669,305	－	60,824,133	845,172
アメリカ・ドル	41,951,455	－	41,395,309	556,146
イギリス・ポンド	4,107,304	－	4,112,065	△4,761
イスラエル・シュケル	65,783	－	64,806	977
オーストラリア・ドル	1,564,156	－	1,524,562	39,594
カナダ・ドル	2,295,731	－	2,235,740	59,991
シンガポール・ドル	282,621	－	277,134	5,487
スイス・フラン	1,925,330	－	1,882,440	42,890
スウェーデン・クローナ	611,137	－	596,727	14,410
デンマーク・クローネ	372,214	－	366,240	5,974
ニュージーランド・ドル	45,134	－	43,854	1,280
ノルウェー・クローネ	174,593	－	170,750	3,843
ユーロ	7,551,240	－	7,442,864	108,376
香港・ドル	722,607	－	711,642	10,965
合計	61,669,305	－	60,824,133	845,172

種類	第2期 令和1年10月15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	169,294,698	－	170,342,211	△1,047,513
アメリカ・ドル	116,677,653	－	117,050,736	△373,083
イギリス・ポンド	10,137,095	－	10,430,128	△293,033
イスラエル・シュケル	217,549	－	215,950	1,599
オーストラリア・ドル	4,385,304	－	4,408,936	△23,632
カナダ・ドル	6,467,906	－	6,490,705	△22,799
シンガポール・ドル	780,889	－	791,200	△10,311
スイス・フラン	5,819,673	－	5,839,875	△20,202
スウェーデン・クローナ	1,585,034	－	1,591,629	△6,595
デンマーク・クローネ	1,095,624	－	1,111,094	△15,470
ニュージーランド・ドル	148,729	－	150,172	△1,443
ノルウェー・クローネ	403,206	－	404,260	△1,054
ユーロ	19,553,969	－	19,831,686	△277,717
香港・ドル	2,022,067	－	2,025,840	△3,773
合計	169,294,698	－	170,342,211	△1,047,513

（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。

①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。

②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）

	第1期 平成30年10月12日現在	第2期 令和1年10月15日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	0.9972円 (9,972円)	1.0938円 (10,938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15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	71,981,755	184,309,283	
	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	80,557,414	106,956,078	
	Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド	61,167,977	149,745,324	
	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	87,032,560	318,304,181	
	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	18,048,156	33,953,995	
	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	99,760,749	136,422,824	
	為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	102,550,574	145,703,855	
	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	41,375,398	46,187,356	
親投資信託受益証券　合計		562,474,583	1,121,582,896	
合計			1,121,582,896	

（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

「（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。

【たわらノーロード　スマートグローバルバランス（積極型）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第1期 平成30年10月12日現在	第2期 令和1年10月15日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	13,010,425	20,504,061
親投資信託受益証券	644,444,302	1,778,765,033
派生商品評価勘定	1,846,835	2,924
未収入金	4,549,000	－
流動資産合計	663,850,562	1,799,272,018
資産合計	663,850,562	1,799,272,018
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	9,593	1,927,168
未払解約金	8,429,004	145,474
未払受託者報酬	71,792	338,583
未払委託者報酬	825,884	3,894,283
その他未払費用	7,059	32,079
流動負債合計	9,343,332	6,337,587
負債合計	9,343,332	6,337,587
純資産の部		
元本等		
元本	655,988,089	1,630,327,148
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△1,480,859	162,607,283
（分配準備積立金）	5,463,594	119,408,459
元本等合計	654,507,230	1,792,934,431
純資産合計	654,507,230	1,792,934,431
負債純資産合計	663,850,562	1,799,272,018

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期 自　平成29年11月24日 至　平成30年10月12日	第2期 自　平成30年10月13日 至　令和1年10月15日
営業収益		
有価証券売買等損益	△11,776,698	141,627,731
為替差損益	△2,314,787	5,342,237
営業収益合計	△14,091,485	146,969,968
営業費用		
支払利息	1,561	9,476
受託者報酬	82,452	547,436
委託者報酬	949,030	6,296,506
その他費用	8,068	51,837
営業費用合計	1,041,111	6,905,255
営業利益又は営業損失（△）	△15,132,596	140,064,713
経常利益又は経常損失（△）	△15,132,596	140,064,713
当期純利益又は当期純損失（△）	△15,132,596	140,064,713
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（△）	397,936	7,230,076
期首剰余金又は期首欠損金（△）	－	△1,480,859
剰余金増加額又は欠損金減少額	14,291,164	32,379,984
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	14,291,164	32,379,984
剰余金減少額又は欠損金増加額	241,491	1,126,479
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	241,491	1,126,479
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（△）	△1,480,859	162,607,283

（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2期 自　平成30年10月13日 至　令和1年10月15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。
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	計算期間末日の取扱い 当ファンドは、原則として毎年10月12日を計算期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、当計算期間末日を令和1年10月15日としております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	第1期 平成30年10月12日現在	第2期 令和1年10月15日現在
１．　期首元本額	1,000,000円	655,988,089円
期中追加設定元本額	697,135,986円	1,157,648,633円
期中一部解約元本額	42,147,897円	183,309,574円
２．　受益権の総数	655,988,089口	1,630,327,148口
３．　元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は1,480,859円であります。	－

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	第1期 自　平成29年11月24日 至　平成30年10月12日	第2期 自　平成30年10月13日 至　令和1年10月15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（5,463,594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（864,315円）及び分配準備積立金（0円）より分配対象収益は6,327,909円（1万口当たり96.46円）でありますが、分配を行っておりません。なお、分配金の計算過程においては、親投資信託の配当等収益及び収益調整金相当額を充当する方法によっております。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（34,888,190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（79,796,973円）、信託約款に規定される収益調整金（43,198,824円）及び分配準備積立金（4,723,296円）より分配対象収益は162,607,283円（1万口当たり997.39円）でありますが、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1期 自　平成29年11月24日 至　平成30年10月12日	第2期 自　平成30年10月13日 至　令和1年10月15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、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、主要投資対象である親投資信託受益証券が保有する金融商品に係る、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。	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。	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1期 平成30年10月12日現在	第2期 令和1年10月15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 「（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。	(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。	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	第1期 平成30年10月12日現在	第2期 令和1年10月15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	△11,841,826	130,813,832
合計	△11,841,826	130,813,832

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	第1期 平成30年10月12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	127,289,640	－	125,452,398	1,837,242
アメリカ・ドル	86,379,006	－	85,175,579	1,203,427
イギリス・ポンド	8,466,902	－	8,476,495	△9,593
イスラエル・シュケル	144,097	－	141,956	2,141
オーストラリア・ドル	3,232,336	－	3,144,908	87,428
カナダ・ドル	4,731,005	－	4,600,465	130,540
シンガポール・ドル	606,805	－	595,023	11,782
スイス・フラン	3,970,859	－	3,878,280	92,579
スウェーデン・クローナ	1,328,614	－	1,297,287	31,327
デンマーク・クローネ	810,009	－	797,008	13,001
ニュージーランド・ドル	105,313	－	102,326	2,987
ノルウェー・クローネ	378,519	－	370,186	8,333
ユーロ	15,567,623	－	15,328,136	239,487
香港・ドル	1,568,552	－	1,544,749	23,803
合計	127,289,640	－	125,452,398	1,837,242

種類	第2期 令和1年10月15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	311,015,906	－	312,940,150	△1,924,244
アメリカ・ドル	214,365,786	－	215,051,232	△685,446
イギリス・ポンド	18,615,635	－	19,153,756	△538,121
イスラエル・シュケル	397,804	－	394,880	2,924
オーストラリア・ドル	8,062,831	－	8,106,280	△43,449
カナダ・ドル	11,875,500	－	11,917,360	△41,860
シンガポール・ドル	1,444,644	－	1,463,720	△19,076
スイス・フラン	10,685,656	－	10,722,750	△37,094
スウェーデン・クローナ	2,911,937	－	2,924,053	△12,116
デンマーク・クローネ	2,014,433	－	2,042,876	△28,443
ニュージーランド・ドル	270,417	－	273,040	△2,623
ノルウェー・クローネ	741,187	－	743,125	△1,938
ユーロ	35,913,770	－	36,423,838	△510,068
香港・ドル	3,716,306	－	3,723,240	△6,934
合計	311,015,906	－	312,940,150	△1,924,244

（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。

①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。

②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）

	第1期 平成30年10月12日現在	第2期 令和1年10月15日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	0.9977円 (9,977円)	1.0997円 (10,997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15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	141,514,902	362,348,906	
	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	20,002,153	26,556,858	
	Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド	110,993,232	271,722,531	
	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	178,531,979	652,945,006	
	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	9,461,057	17,799,086	
	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	209,201,327	286,082,814	
	為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	49,619,557	70,499,466	
	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	81,349,428	90,810,366	
親投資信託受益証券　合計		800,673,635	1,778,765,033	
合計			1,778,765,033	

（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

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

（参考）

「たわらノーロード　スマートグローバルバランス（保守型）」、「たわらノーロード　スマートグローバルバランス（安定型）」、「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）」、「たわらノーロード　スマートグローバルバランス（成長型）」、「たわらノーロード　スマートグローバルバランス（積極型）」は、「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」受益証券、「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「エマージング株式パッシブ・マザーファンド」受益証券、「Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド」受益証券及び「外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同親投資信託の受益証券であります。
同親投資信託の状況は以下の通りであります。
なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド
貸借対照表

（単位：円）

	令和1年10月15日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	14,814,671,498
株式	235,064,669,820
派生商品評価勘定	113,365,540
未収入金	4,054,920
未収配当金	2,438,444,181
流動資産合計	252,435,205,959
資産合計	252,435,205,959
負債の部	
流動負債	
前受金	18,629,400
未払解約金	10,498,804,000
流動負債合計	10,517,433,400
負債合計	10,517,433,400
純資産の部	
元本等	
元本	94,478,900,732
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	147,438,871,827
元本等合計	241,917,772,559
純資産合計	241,917,772,559
負債純資産合計	252,435,205,959

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30年10月13日 至　令和1年10月15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15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	108,086,790,523円
同期中追加設定元本額	39,613,416,016円
同期中一部解約元本額	53,221,305,807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	13,557,054,991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	536,287,092円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	242,802,844円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	7,131,642円
たわらノーロード　バランス（標準型）	47,951,095円
たわらノーロード　バランス（積極型）	76,722,563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）	439,655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）	39,615,536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）	98,667,253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）	71,981,755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）	141,514,902円
たわらノーロード　最適化バランス（保守型）	306,468円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	1,069,329円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	2,189,432円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	1,269,841円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	3,404,163円
ＤＩＡＭ国内株式インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	37,459,396,713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	3,333,230,470円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型	3,397,377,148円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド	367,277,786円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド	1,238,641,595円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０インデックスファンド	1,147,484,958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	979,705,117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＞	260,845,688円
４資産分散投資・ハイクラス＜ＤＣ年金＞	306,098,519円
クルーズコントロール＜ＤＣ年金＞	849,520円
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（堅実型）	9,655,650円
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（積極型）	26,050,727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・イヤー２０４５）	4,395,592円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー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・イヤー２０３５）	6,304,861円
４資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	26,583,305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）	60,237,525円
ＤＩＡＭバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	928,321,228円
ＤＩＡＭバランスファンド３７．５ＶＡ（適格機関投資家限定）	907,917,604円
ＤＩＡＭバランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,565,608,873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）	163,896,231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）	555,009,537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）	374,027,228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）	8,236,052,727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	94,478,900,732円
２．	受益権の総数	94,478,900,732口
３．	差入代用有価証券	
	株式	3,692,500,000円

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

項目	自　平成30年10月13日 至　令和1年10月15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。
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15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15日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
株式	7,855,235,314
合計	7,855,235,314

（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15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15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 先物取引 買建	6,380,698,600	－	6,494,195,000	113,496,400
合計	6,380,698,600	－	6,494,195,000	113,496,400

（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15日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	2.5605円 (25,605円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

（１）株式

令和1年10月15日現在

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
極洋	4,500	2,902.00	13,059,000	
日本水産	137,700	622.00	85,649,400	
マルハニチロ	19,900	2,788.00	55,481,200	
ホウスイ	900	859.00	773,100	
カネコ種苗	4,300	1,309.00	5,628,700	
サカタのタネ	16,400	3,525.00	57,810,000	
ホクト	11,500	1,933.00	22,229,500	
ホクリヨウ	1,900	676.00	1,284,400	
ヒノキヤグループ	3,400	2,055.00	6,987,000	
ショーボンドホールディングス	19,700	4,080.00	80,376,000	
ミライト・ホールディングス	38,700	1,643.00	63,584,100	
タマホーム	6,700	1,509.00	10,110,300	
サンヨーホームズ	2,200	650.00	1,430,000	
日本アクア	4,000	672.00	2,688,000	
ファーストコーポレーション	4,500	639.00	2,875,500	
ベステラ	2,700	1,219.00	3,291,300	
ＴＡＴＥＲＵ	18,900	192.00	3,628,800	
スペースバリューホールディングス	17,000	528.00	8,976,000	
住石ホールディングス	31,300	134.00	4,194,200	
日鉄鉱業	3,200	4,230.00	13,536,000	

三井松島ホールディングス	5,900	1,222.00	7,209,800	
国際石油開発帝石	552,300	961.00	530,760,300	
石油資源開発	19,800	2,642.00	52,311,600	
Ｋ＆Ｏエナジーグループ	6,700	1,541.00	10,324,700	
ダイセキ環境ソリューション	3,000	793.00	2,379,000	
第一カッター興業	1,800	1,768.00	3,182,400	
安藤・間	88,300	813.00	71,787,900	
東急建設	40,300	842.00	33,932,600	
コムシスホールディングス	48,800	3,095.00	151,036,000	
ミサワホーム	10,800	1,140.00	12,312,000	
ビーアールホールディングス	12,800	425.00	5,440,000	
高松コンストラクショングループ	8,600	2,528.00	21,740,800	
東建コーポレーション	4,200	6,780.00	28,476,000	
ソネック	1,700	848.00	1,441,600	
ヤマウラ	5,500	905.00	4,977,500	
大成建設	113,100	4,160.00	470,496,000	
大林組	340,400	1,076.00	366,270,400	
清水建設	347,400	1,008.00	350,179,200	
飛島建設	9,800	1,282.00	12,563,600	
長谷工コーポレーション	142,000	1,307.00	185,594,000	
松井建設	12,500	795.00	9,937,500	
錢高組	1,400	3,920.00	5,488,000	
鹿島建設	266,100	1,450.00	385,845,000	
不動テトラ	7,900	1,436.00	11,344,400	
大末建設	4,100	950.00	3,895,000	
鉄建建設	6,900	2,864.00	19,761,600	
西松建設	24,500	2,108.00	51,646,000	
三井住友建設	82,100	585.00	48,028,500	
大豊建設	7,700	3,015.00	23,215,500	
前田建設工業	79,600	979.00	77,928,400	
佐田建設	7,500	429.00	3,217,500	
ナカノフドー建設	8,800	488.00	4,294,400	
奥村組	18,700	2,982.00	55,763,400	
東鉄工業	13,600	3,290.00	44,744,000	
イチケン	2,100	1,693.00	3,555,300	
富士ピー・エス	4,200	520.00	2,184,000	
淺沼組	3,800	3,895.00	14,801,000	
戸田建設	131,800	651.00	85,801,800	
熊谷組	16,200	3,115.00	50,463,000	
北野建設	2,400	2,667.00	6,400,800	
植木組	1,400	2,595.00	3,633,000	
矢作建設工業	15,400	732.00	11,272,800	
ピーエス三菱	12,100	759.00	9,183,900	
日本ハウスホールディングス	21,800	515.00	11,227,000	
大東建託	40,500	13,945.00	564,772,500	
新日本建設	13,700	818.00	11,206,600	
ＮＩＰＰＯ	30,000	2,167.00	65,010,000	
東亜道路工業	2,100	3,410.00	7,161,000	
前田道路	33,600	2,400.00	80,640,000	
日本道路	3,100	6,740.00	20,894,000	

東亜建設工業	10,000	1,393.00	13,930,000	
日本国土開発	18,600	584.00	10,862,400	
若築建設	5,800	1,604.00	9,303,200	
東洋建設	41,600	476.00	19,801,600	
五洋建設	135,100	618.00	83,491,800	
世紀東急工業	16,600	744.00	12,350,400	
福田組	3,700	4,390.00	16,243,000	
日本ドライケミカル	2,800	1,140.00	3,192,000	
住友林業	80,400	1,509.00	121,323,600	
日本基礎技術	11,800	403.00	4,755,400	
巴コーポレーション	14,300	430.00	6,149,000	
大和ハウス工業	314,500	3,573.00	1,123,708,500	
ライト工業	21,800	1,525.00	33,245,000	
積水ハウス	347,700	2,284.50	794,320,650	
日特建設	9,700	697.00	6,760,900	
北陸電気工事	5,600	915.00	5,124,000	
ユアテック	18,000	685.00	12,330,000	
四電工	1,700	2,787.00	4,737,900	
中電工	14,500	2,445.00	35,452,500	
関電工	51,500	1,022.00	52,633,000	
きんでん	75,300	1,618.00	121,835,400	
東京エネシス	11,600	948.00	10,996,800	
トーエネック	3,200	3,455.00	11,056,000	
住友電設	7,800	2,167.00	16,902,600	
日本電設工業	19,300	2,314.00	44,660,200	
協和エクシオ	44,500	2,637.00	117,346,500	
新日本空調	9,200	1,995.00	18,354,000	
日本工営	6,500	3,225.00	20,962,500	
九電工	22,300	3,545.00	79,053,500	
三機工業	24,800	1,305.00	32,364,000	
日揮ホールディングス	97,900	1,467.00	143,619,300	
中外炉工業	3,200	1,548.00	4,953,600	
ヤマト	10,300	738.00	7,601,400	
太平電業	7,700	2,575.00	19,827,500	
高砂熱学工業	27,500	1,838.00	50,545,000	
三晃金属工業	1,400	2,498.00	3,497,200	
ＮＥＣネッツエスアイ	11,000	3,110.00	34,210,000	
朝日工業社	2,400	3,080.00	7,392,000	
明星工業	20,500	799.00	16,379,500	
大氣社	15,400	3,350.00	51,590,000	
ダイダン	7,600	2,293.00	17,426,800	
日比谷総合設備	10,200	1,921.00	19,594,200	
東芝プラントシステム	24,500	1,974.00	48,363,000	
日本製粉	32,000	1,739.00	55,648,000	
日清製粉グループ本社	115,000	2,060.00	236,900,000	
日東富士製粉	700	6,450.00	4,515,000	
昭和産業	9,300	3,140.00	29,202,000	
鳥越製粉	9,100	902.00	8,208,200	
中部飼料	12,400	1,188.00	14,731,200	
フィード・ワン	68,800	164.00	11,283,200	

東洋精糖	1,700	1,079.00	1,834,300	
日本甜菜製糖	5,800	1,995.00	11,571,000	
三井製糖	8,000	2,294.00	18,352,000	
塩水港精糖	11,300	209.00	2,361,700	
日新製糖	4,700	1,960.00	9,212,000	
ＬＩＦＵＬＬ	34,000	682.00	23,188,000	
ジェイエイシーリクルートメント	6,600	2,002.00	13,213,200	
日本M&Aセンター	73,200	3,000.00	219,600,000	
メンバーズ	3,400	1,824.00	6,201,600	
中広	1,100	557.00	612,700	
タケエイ	10,200	1,089.00	11,107,800	
Ｅ・Ｊホールディングス	1,300	1,400.00	1,820,000	
トラスト・テック	10,700	1,276.00	13,653,200	
コシダカホールディングス	23,400	1,537.00	35,965,800	
アルトナー	2,000	736.00	1,472,000	
パソナグループ	11,900	1,436.00	17,088,400	
ＣＤＳ	2,500	1,346.00	3,365,000	
リンクアンドモチベーション	19,800	553.00	10,949,400	
ＧＣＡ	10,900	815.00	8,883,500	
エス・エム・エス	35,700	2,776.00	99,103,200	
パーソルホールディングス	96,900	1,996.00	193,412,400	
リニカル	5,600	982.00	5,499,200	
クックパッド	34,000	303.00	10,302,000	
エスクリ	2,800	859.00	2,405,200	
アイ・ケイ・ケイ	4,700	689.00	3,238,300	
森永製菓	25,600	5,360.00	137,216,000	
中村屋	2,700	4,585.00	12,379,500	
江崎グリコ	30,200	4,715.00	142,393,000	
名糖産業	4,900	1,247.00	6,110,300	
井村屋グループ	4,300	2,014.00	8,660,200	
不二家	5,600	2,096.00	11,737,600	
山崎製パン	76,300	1,947.00	148,556,100	
第一屋製パン	1,800	976.00	1,756,800	
モロゾフ	1,800	5,020.00	9,036,000	
亀田製菓	6,300	4,860.00	30,618,000	
寿スピリッツ	10,800	7,370.00	79,596,000	
カルビー	46,400	3,410.00	158,224,000	
森永乳業	20,400	4,345.00	88,638,000	
六甲バター	6,800	1,805.00	12,274,000	
ヤクルト本社	75,400	6,040.00	455,416,000	
明治ホールディングス	72,100	7,860.00	566,706,000	
雪印メグミルク	24,500	2,632.00	64,484,000	
プリマハム	14,300	2,489.00	35,592,700	
日本ハム	42,100	4,680.00	197,028,000	
林兼産業	3,600	609.00	2,192,400	
丸大食品	10,800	2,319.00	25,045,200	
Ｓ　Ｆｏｏｄｓ	9,100	3,030.00	27,573,000	
伊藤ハム米久ホールディングス	65,300	688.00	44,926,400	
学情	3,500	1,441.00	5,043,500	
スタジオアリス	4,900	1,863.00	9,128,700	

クロスキャット	2,700	996.00	2,689,200	
シミックホールディングス	5,400	1,736.00	9,374,400	
システナ	35,500	1,577.00	55,983,500	
ＮＪＳ	2,300	1,668.00	3,836,400	
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	3,625.00	54,012,500	
綜合警備保障	38,500	5,640.00	217,140,000	
キューブシステム	5,500	774.00	4,257,000	
いちご	127,200	444.00	56,476,800	
エイジア	2,100	1,222.00	2,566,200	
日本駐車場開発	110,400	159.00	17,553,600	
コア	4,300	1,343.00	5,774,900	
カカクコム	72,600	2,428.00	176,272,800	
アイロムグループ	3,900	1,588.00	6,193,200	
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	645.00	1,161,000	
ルネサンス	5,400	1,645.00	8,883,000	
ディップ	15,700	2,654.00	41,667,800	
ＳＢＳホールディングス	8,800	1,762.00	15,505,600	
オプトホールディング	5,400	1,536.00	8,294,400	
新日本科学	13,300	632.00	8,405,600	
ツクイ	23,000	425.00	9,775,000	
キャリアデザインセンター	2,600	1,325.00	3,445,000	
ベネフィット・ワン	26,600	2,096.00	55,753,600	
エムスリー	204,100	2,617.00	534,129,700	
ツカダ・グローバルホールディング	5,900	600.00	3,540,000	
ブラス	800	648.00	518,400	
アウトソーシング	55,500	1,074.00	59,607,000	
ウェルネット	9,500	709.00	6,735,500	
ワールドホールディングス	3,100	1,662.00	5,152,200	
ディー・エヌ・エー	52,300	1,916.00	100,206,800	
博報堂ＤＹホールディングス	134,700	1,564.00	210,670,800	
ぐるなび	13,900	715.00	9,938,500	
タカミヤ	10,500	658.00	6,909,000	
ジャパンベストレスキューシステム	6,700	1,079.00	7,229,300	
ファンコミュニケーションズ	26,900	517.00	13,907,300	
ライク	3,900	1,644.00	6,411,600	
ビジネス・ブレークスルー	4,700	360.00	1,692,000	
エスプール	18,800	559.00	10,509,200	
ＷＤＢホールディングス	4,500	2,826.00	12,717,000	
ティア	5,200	598.00	3,109,600	
ＣＤＧ	1,000	1,365.00	1,365,000	
バリューコマース	5,500	1,582.00	8,701,000	
インフォマート	53,100	1,573.00	83,526,300	
サッポロホールディングス	34,700	2,793.00	96,917,100	
アサヒグループホールディングス	213,100	5,490.00	1,169,919,000	
キリンホールディングス	431,500	2,304.00	994,176,000	
宝ホールディングス	76,200	1,110.00	84,582,000	
オエノンホールディングス	26,900	386.00	10,383,400	
養命酒製造	3,100	1,934.00	5,995,400	

コカ・コーラ　ボトラーズジャパンホールディングス	71,400	2,518.00	179,785,200	
サントリー食品インターナショナル	68,100	4,740.00	322,794,000	
ダイドーグループホールディングス	5,700	4,500.00	25,650,000	
伊藤園	30,900	5,270.00	162,843,000	
キーコーヒー	10,000	2,227.00	22,270,000	
ユニカフェ	2,700	1,010.00	2,727,000	
ジャパンフーズ	1,500	1,199.00	1,798,500	
日清オイリオグループ	13,100	3,605.00	47,225,500	
不二製油グループ本社	24,800	3,245.00	80,476,000	
かどや製油	1,100	3,665.00	4,031,500	
Ｊ－オイルミルズ	5,200	4,290.00	22,308,000	
ローソン	25,300	5,920.00	149,776,000	
サンエー	7,600	5,190.00	39,444,000	
カワチ薬品	7,700	2,154.00	16,585,800	
エービーシー・マート	15,600	7,490.00	116,844,000	
ハードオフコーポレーション	4,200	784.00	3,292,800	
高千穂交易	3,900	1,118.00	4,360,200	
アスクル	10,500	2,843.00	29,851,500	
ゲオホールディングス	15,200	1,314.00	19,972,800	
アダストリア	13,900	2,573.00	35,764,700	
ジーフット	5,900	616.00	3,634,400	
シー・ヴイ・エス・ベイエリア	1,500	678.00	1,017,000	
伊藤忠食品	2,400	4,630.00	11,112,000	
くら寿司	5,200	4,500.00	23,400,000	
キャンドゥ	4,800	1,627.00	7,809,600	
エレマテック	9,300	1,045.00	9,718,500	
パルグループホールディングス	5,100	3,560.00	18,156,000	
ＪＡＬＵＸ	2,900	2,432.00	7,052,800	
エディオン	42,200	1,048.00	44,225,600	
あらた	7,400	4,005.00	29,637,000	
サーラコーポレーション	20,100	619.00	12,441,900	
ワッツ	3,900	614.00	2,394,600	
トーメンデバイス	1,500	2,347.00	3,520,500	
ハローズ	3,800	2,369.00	9,002,200	
ＪＰホールディングス	28,000	283.00	7,924,000	
フジオフードシステム	4,200	3,025.00	12,705,000	
あみやき亭	2,100	3,415.00	7,171,500	
東京エレクトロン　デバイス	3,600	2,043.00	7,354,800	
ひらまつ	20,100	322.00	6,472,200	
フィールズ	8,800	518.00	4,558,400	
双日	550,900	335.00	184,551,500	
アルフレッサ　ホールディングス	110,900	2,409.00	267,158,100	
大黒天物産	2,400	3,445.00	8,268,000	
ハニーズホールディングス	8,800	1,360.00	11,968,000	
ファーマライズホールディングス	2,300	627.00	1,442,100	
キッコーマン	67,100	5,190.00	348,249,000	
味の素	224,700	2,049.00	460,410,300	
キユーピー	56,600	2,450.00	138,670,000	
ハウス食品グループ本社	38,000	4,120.00	156,560,000	

カゴメ	38,600	2,840.00	109,624,000	
焼津水産化学工業	5,000	1,044.00	5,220,000	
アリアケジャパン	9,300	8,550.00	79,515,000	
ピエトロ	1,400	1,608.00	2,251,200	
エバラ食品工業	2,500	2,137.00	5,342,500	
ニチレイ	52,900	2,507.00	132,620,300	
横浜冷凍	27,900	1,075.00	29,992,500	
東洋水産	52,300	4,465.00	233,519,500	
イートアンド	3,600	1,739.00	6,260,400	
大冷	1,200	1,994.00	2,392,800	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	2,900	956.00	2,772,400	
日清食品ホールディングス	43,200	8,270.00	357,264,000	
永谷園ホールディングス	5,400	2,094.00	11,307,600	
一正蒲鉾	4,000	1,056.00	4,224,000	
フジッコ	11,000	1,993.00	21,923,000	
ロック・フィールド	11,000	1,497.00	16,467,000	
日本たばこ産業	587,300	2,395.50	1,406,877,150	
ケンコーマヨネーズ	5,700	2,499.00	14,244,300	
わらべや日洋ホールディングス	6,700	1,917.00	12,843,900	
なとり	5,700	1,644.00	9,370,800	
イフジ産業	2,000	735.00	1,470,000	
ピックルスコーポレーション	2,500	2,705.00	6,762,500	
北の達人コーポレーション	40,100	781.00	31,318,100	
ユーグレナ	43,500	859.00	37,366,500	
スター・マイカ・ホールディングス	4,800	1,907.00	9,153,600	
片倉工業	14,500	1,374.00	19,923,000	
グンゼ	6,700	4,660.00	31,222,000	
ヒューリック	213,600	1,143.00	244,144,800	
神栄	1,500	742.00	1,113,000	
ラサ商事	5,500	848.00	4,664,000	
アルペン	7,600	1,727.00	13,125,200	
ハブ	3,300	1,114.00	3,676,200	
ラクーンホールディングス	5,100	705.00	3,595,500	
クオールホールディングス	14,700	1,469.00	21,594,300	
アルコニックス	10,700	1,317.00	14,091,900	
神戸物産	17,300	5,780.00	99,994,000	
ソリトンシステムズ	4,400	952.00	4,188,800	
ジンズホールディングス	5,300	6,440.00	34,132,000	
ビックカメラ	59,200	1,180.00	69,856,000	
ＤＣＭホールディングス	53,600	1,075.00	57,620,000	
ペッパーフードサービス	8,000	1,646.00	13,168,000	
ＭｏｎｏｔａＲＯ	71,000	2,935.00	208,385,000	
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	1,540.00	6,930,000	
あい　ホールディングス	14,300	1,843.00	26,354,900	
ディーブイエックス	4,000	865.00	3,460,000	
きちりホールディングス	2,800	786.00	2,200,800	
アークランドサービスホールディングス	7,300	1,914.00	13,972,200	
Ｊ．フロント　リテイリング	127,600	1,350.00	172,260,000	

ドトール・日レスホールディングス	17,500	2,124.00	37,170,000	
マツモトキヨシホールディングス	41,300	3,940.00	162,722,000	
ブロンコビリー	5,300	2,437.00	12,916,100	
ＺＯＺＯ	108,000	2,517.00	271,836,000	
トレジャー・ファクトリー	3,100	1,169.00	3,623,900	
物語コーポレーション	2,500	9,900.00	24,750,000	
ココカラファイン	11,200	6,070.00	67,984,000	
三越伊勢丹ホールディングス	186,800	878.00	164,010,400	
東洋紡	42,000	1,426.00	59,892,000	
ユニチカ	29,700	335.00	9,949,500	
富士紡ホールディングス	5,200	3,140.00	16,328,000	
日清紡ホールディングス	67,300	878.00	59,089,400	
倉敷紡績	9,400	2,413.00	22,682,200	
ダイワボウホールディングス	9,100	4,515.00	41,086,500	
シキボウ	5,100	932.00	4,753,200	
日東紡績	15,100	3,240.00	48,924,000	
トヨタ紡織	35,400	1,536.00	54,374,400	
マクニカ・富士エレホールディングス	27,700	1,500.00	41,550,000	
Ｈａｍｅｅ	3,200	1,153.00	3,689,600	
ラクト・ジャパン	3,700	3,685.00	13,634,500	
ウエルシアホールディングス	26,400	6,200.00	163,680,000	
クリエイトＳＤホールディングス	14,700	2,685.00	39,469,500	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	18,600	1,061.00	19,734,600	
八洲電機	7,900	850.00	6,715,000	
メディアスホールディングス	5,800	750.00	4,350,000	
レスターホールディングス	11,000	1,800.00	19,800,000	
ジューテックホールディングス	2,300	1,001.00	2,302,300	
丸善ＣＨＩホールディングス	11,200	372.00	4,166,400	
大光	3,100	665.00	2,061,500	
ＯＣＨＩホールディングス	3,000	1,312.00	3,936,000	
ＴＯＫＡＩホールディングス	52,700	1,059.00	55,809,300	
黒谷	1,900	448.00	851,200	
ミサワ	2,100	738.00	1,549,800	
ティーライフ	1,500	835.00	1,252,500	
Ｃｏｍｉｎｉｘ	1,900	844.00	1,603,600	
エー・ピーカンパニー	2,100	545.00	1,144,500	
三洋貿易	5,100	2,120.00	10,812,000	
チムニー	3,000	2,378.00	7,134,000	
シュッピン	6,900	1,024.00	7,065,600	
ビューティガレージ	1,700	1,693.00	2,878,100	
ウイン・パートナーズ	6,500	1,203.00	7,819,500	
ネクステージ	14,300	1,071.00	15,315,300	
ジョイフル本田	29,300	1,412.00	41,371,600	
鳥貴族	3,300	2,197.00	7,250,100	
キリン堂ホールディングス	4,000	2,121.00	8,484,000	
ホットランド	5,700	1,178.00	6,714,600	
すかいらーくホールディングス	111,900	1,910.00	213,729,000	
ＳＦＰホールディングス	4,300	2,143.00	9,214,900	
綿半ホールディングス	3,800	2,044.00	7,767,200	

日本毛織	32,500	1,077.00	35,002,500	
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	539.00	2,209,900	
ダイドーリミテッド	12,200	276.00	3,367,200	
ヨシックス	1,600	3,030.00	4,848,000	
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	948.00	27,397,200	
三栄建築設計	4,100	1,518.00	6,223,800	
野村不動産ホールディングス	66,700	2,484.00	165,682,800	
三重交通グループホールディングス	20,200	574.00	11,594,800	
サムティ	14,200	1,987.00	28,215,400	
ディア・ライフ	13,200	498.00	6,573,600	
コーセーアールイー	3,200	726.00	2,323,200	
エー・ディー・ワークス	180,500	31.00	5,595,500	
日本商業開発	6,500	1,487.00	9,665,500	
プレサンスコーポレーション	16,000	1,749.00	27,984,000	
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	469.00	2,485,700	
日本管理センター	6,700	1,481.00	9,922,700	
サンセイランディック	3,200	858.00	2,745,600	
エストラスト	1,500	787.00	1,180,500	
フージャースホールディングス	21,900	649.00	14,213,100	
オープンハウス	29,100	2,812.00	81,829,200	
東急不動産ホールディングス	269,100	727.00	195,635,700	
飯田グループホールディングス	83,300	1,744.00	145,275,200	
イーグランド	1,500	719.00	1,078,500	
ムゲンエステート	7,200	660.00	4,752,000	
帝国繊維	11,200	1,904.00	21,324,800	
日本コークス工業	85,500	82.00	7,011,000	
ゴルフダイジェスト・オンライン	4,500	662.00	2,979,000	
ミタチ産業	3,000	715.00	2,145,000	
ＢＥＥＮＯＳ	2,800	1,209.00	3,385,200	
あさひ	8,300	1,182.00	9,810,600	
日本調剤	3,500	3,875.00	13,562,500	
コスモス薬品	4,400	22,440.00	98,736,000	
シップヘルスケアホールディングス	20,800	4,660.00	96,928,000	
トーエル	5,000	790.00	3,950,000	
ソフトクリエイトホールディングス	4,400	1,643.00	7,229,200	
オンリー	1,900	799.00	1,518,100	
セブン&アイ・ホールディングス	418,400	4,391.00	1,837,194,400	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	26,900	1,941.00	52,212,900	
明治電機工業	3,200	1,371.00	4,387,200	
ツルハホールディングス	21,700	12,140.00	263,438,000	
デリカフーズホールディングス	3,700	714.00	2,641,800	
スターティアホールディングス	2,100	570.00	1,197,000	
サンマルクホールディングス	7,900	2,457.00	19,410,300	
フェリシモ	2,300	1,020.00	2,346,000	
トリドールホールディングス	12,400	2,417.00	29,970,800	
帝人	80,800	2,129.00	172,023,200	

東レ	770,100	832.60	641,185,260	
クラレ	156,300	1,350.00	211,005,000	
旭化成	706,200	1,152.00	813,542,400	
サカイオーベックス	2,500	1,826.00	4,565,000	
ＴＯＫＹＯ　ＢＡＳＥ	9,100	768.00	6,988,800	
稲葉製作所	5,600	1,436.00	8,041,600	
宮地エンジニアリンググループ	3,100	1,756.00	5,443,600	
トーカロ	26,000	953.00	24,778,000	
アルファ	3,600	1,222.00	4,399,200	
ＳＵＭＣＯ	120,100	1,697.00	203,809,700	
川田テクノロジーズ	2,200	6,950.00	15,290,000	
ＲＳ　Ｔｅｃｈｎｏｌｏｇｉｅｓ	2,300	4,015.00	9,234,500	
信和	5,500	966.00	5,313,000	
ビーロット	1,800	1,865.00	3,357,000	
ファーストブラザーズ	2,400	1,171.00	2,810,400	
ハウスドゥ	4,400	1,867.00	8,214,800	
シーアールイー	2,600	1,053.00	2,737,800	
プロパティエージェント	1,100	1,018.00	1,119,800	
ケイアイスター不動産	2,800	1,908.00	5,342,400	
アグレ都市デザイン	1,500	444.00	666,000	
グッドコムアセット	1,900	1,855.00	3,524,500	
ジェイ・エス・ビー	1,100	4,645.00	5,109,500	
住江織物	2,900	2,850.00	8,265,000	
日本フエルト	5,700	478.00	2,724,600	
イチカワ	1,500	1,497.00	2,245,500	
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	1,601.00	2,081,300	
芦森工業	2,100	1,437.00	3,017,700	
アツギ	8,100	822.00	6,658,200	
ウイルプラスホールディングス	1,100	761.00	837,100	
ジャパンミート	5,100	2,218.00	11,311,800	
コメダホールディングス	23,200	2,075.00	48,140,000	
サツドラホールディングス	1,500	1,745.00	2,617,500	
デファクトスタンダード	700	328.00	229,600	
アレンザホールディングス	5,400	802.00	4,330,800	
串カツ田中ホールディングス	1,600	2,220.00	3,552,000	
バロックジャパンリミテッド	8,100	944.00	7,646,400	
クスリのアオキホールディングス	9,900	7,790.00	77,121,000	
ダイニック	3,900	744.00	2,901,600	
共和レザー	6,200	725.00	4,495,000	
力の源ホールディングス	3,300	822.00	2,712,600	
スシローグローバルホールディングス	11,000	7,560.00	83,160,000	
ＬＩＸＩＬビバ	8,500	1,701.00	14,458,500	
セーレン	24,400	1,264.00	30,841,600	
ソトー	3,800	975.00	3,705,000	
東海染工	1,400	1,147.00	1,605,800	
小松マテーレ	16,200	825.00	13,365,000	
ワコールホールディングス	28,000	2,822.00	79,016,000	
ホギメディカル	12,300	3,165.00	38,929,500	
レナウン	30,900	115.00	3,553,500	

クラウディ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	594.00	21,681,000	
マツオカコーポレーション	3,200	2,013.00	6,441,600	
ワールド	13,000	2,398.00	31,174,000	
ＴＩＳ	33,200	6,680.00	221,776,000	
ネオス	4,100	752.00	3,083,200	
電算システム	3,800	3,005.00	11,419,000	
グリー	69,000	496.00	34,224,000	
コーエーテクモホールディングス	20,300	2,386.00	48,435,800	
三菱総合研究所	4,300	3,745.00	16,103,500	
ボルテージ	2,000	529.00	1,058,000	
電算	1,200	2,078.00	2,493,600	
ＡＧＳ	5,800	699.00	4,054,200	
ファインデックス	8,500	946.00	8,041,000	
ブレインパッド	1,900	6,200.00	11,780,000	
ＫＬａｂ	19,200	999.00	19,180,800	
ポールトゥウィン・ピットクルーホールディングス	13,300	1,030.00	13,699,000	
イーブックイニシアティブジャパン	1,700	1,741.00	2,959,700	
ネクソン	282,500	1,263.00	356,797,500	
アイスタイル	25,700	753.00	19,352,100	
エムアップ	3,500	1,960.00	6,860,000	
エイチーム	6,900	1,073.00	7,403,700	
エニグモ	7,100	945.00	6,709,500	
テクノスジャパン	8,900	530.00	4,717,000	
ｅｎｉｓｈ	4,100	881.00	3,612,100	
コロプラ	32,600	1,488.00	48,508,800	
オルトプラス	6,700	710.00	4,757,000	
ブロードリーフ	49,500	598.00	29,601,000	
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	907.00	4,262,900	
システム情報	5,200	961.00	4,997,200	
メディアドゥホールディングス	3,500	3,630.00	12,705,000	
じげん	12,000	558.00	6,696,000	
ブイキューブ	5,900	414.00	2,442,600	
サイバーリンクス	1,700	1,128.00	1,917,600	
ディー・エル・イー	7,300	174.00	1,270,200	
フィックスターズ	10,600	1,480.00	15,688,000	
ＣＡＲＴＡ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	4,900	1,006.00	4,929,400	
オプティム	4,400	2,790.00	12,276,000	
セレス	3,400	1,263.00	4,294,200	
特種東海製紙	6,300	3,885.00	24,475,500	
ティーガイア	7,100	2,236.00	15,875,600	
セック	1,700	2,935.00	4,989,500	
日本アジアグループ	10,800	345.00	3,726,000	
豆蔵ホールディングス	6,900	1,749.00	12,068,100	
テクマトリックス	7,100	2,255.00	16,010,500	
プロシップ	3,000	1,269.00	3,807,000	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	24,000	2,310.00	55,440,000	

GMOペイメントゲートウェイ	16,400	7,720.00	126,608,000	
ザッパラス	5,700	382.00	2,177,400	
システムリサーチ	2,700	1,798.00	4,854,600	
インターネットイニシアティブ	16,200	2,479.00	40,159,800	
さくらインターネット	12,200	622.00	7,588,400	
ヴィンクス	2,800	1,149.00	3,217,200	
GMOクラウド	1,900	2,570.00	4,883,000	
ＳＲＡホールディングス	5,300	2,469.00	13,085,700	
ＭＩＮＯＲＩソリューションズ	2,000	1,873.00	3,746,000	
システムインテグレータ	3,000	772.00	2,316,000	
朝日ネット	8,500	677.00	5,754,500	
ｅＢＡＳＥ	6,100	1,121.00	6,838,100	
アバント	3,300	2,094.00	6,910,200	
アドソル日進	3,600	2,305.00	8,298,000	
フリービット	6,000	912.00	5,472,000	
コムチュア	11,200	1,932.00	21,638,400	
サイバーコム	1,800	1,770.00	3,186,000	
アステリア	5,600	660.00	3,696,000	
アイル	1,800	2,549.00	4,588,200	
王子ホールディングス	446,800	546.00	243,952,800	
日本製紙	47,500	1,833.00	87,067,500	
三菱製紙	16,200	480.00	7,776,000	
北越コーポレーション	65,600	553.00	36,276,800	
中越パルプ工業	4,200	1,535.00	6,447,000	
巴川製紙所	3,400	926.00	3,148,400	
大王製紙	48,400	1,437.00	69,550,800	
阿波製紙	3,100	408.00	1,264,800	
マークラインズ	5,000	1,923.00	9,615,000	
メディカル・データ・ビジョン	7,600	1,165.00	8,854,000	
ｇｕｍｉ	12,900	683.00	8,810,700	
ショーケース	2,600	749.00	1,947,400	
モバイルファクトリー	2,300	1,666.00	3,831,800	
テラスカイ	1,400	1,926.00	2,696,400	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	4,500	1,702.00	7,659,000	
ＰＣＩホールディングス	1,900	2,003.00	3,805,700	
パイプドHD	1,600	1,855.00	2,968,000	
アイビーシー	1,900	1,110.00	2,109,000	
ネオジャパン	2,000	983.00	1,966,000	
ＰＲ　ＴＩＭＥＳ	700	2,677.00	1,873,900	
ランドコンピュータ	1,300	1,053.00	1,368,900	
ダブルスタンダード	700	5,140.00	3,598,000	
オープンドア	5,000	2,057.00	10,285,000	
マイネット	3,400	538.00	1,829,200	
アカツキ	3,500	6,450.00	22,575,000	
ベネフィットジャパン	600	1,630.00	978,000	
Ｕｂｉｃｏｍホールディングス	1,900	1,468.00	2,789,200	
ＬＩＮＥ	22,800	3,910.00	89,148,000	
カナミックネットワーク	5,100	584.00	2,978,400	
ノムラシステムコーポレーション	1,800	630.00	1,134,000	

レンゴー	102,300	784.00	80,203,200	
トーモク	6,100	1,575.00	9,607,500	
ザ・パック	7,500	3,855.00	28,912,500	
チェンジ	1,500	2,002.00	3,003,000	
シンクロ・フード	4,500	490.00	2,205,000	
オークネット	5,700	1,376.00	7,843,200	
ＡＯＩ　ＴＹＯ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	10,200	632.00	6,446,400	
マクロミル	18,000	882.00	15,876,000	
ビーグリー	2,100	971.00	2,039,100	
オロ	2,600	2,627.00	6,830,200	
サインポスト	1,600	2,092.00	3,347,200	
昭和電工	70,700	2,922.00	206,585,400	
住友化学	780,800	508.00	396,646,400	
住友精化	4,800	3,230.00	15,504,000	
日産化学	60,100	4,275.00	256,927,500	
ラサ工業	3,600	1,366.00	4,917,600	
クレハ	9,200	6,620.00	60,904,000	
多木化学	2,900	4,400.00	12,760,000	
テイカ	8,100	2,055.00	16,645,500	
石原産業	19,100	1,044.00	19,940,400	
片倉コープアグリ	2,900	1,151.00	3,337,900	
日本曹達	15,600	2,749.00	42,884,400	
東ソー	153,400	1,490.00	228,566,000	
トクヤマ	28,600	2,715.00	77,649,000	
セントラル硝子	21,600	2,441.00	52,725,600	
東亞合成	62,300	1,213.00	75,569,900	
大阪ソーダ	10,900	2,837.00	30,923,300	
関東電化工業	23,700	878.00	20,808,600	
デンカ	39,000	3,075.00	119,925,000	
イビデン	62,100	2,346.00	145,686,600	
信越化学工業	174,900	12,000.00	2,098,800,000	
日本カーバイド工業	3,400	1,286.00	4,372,400	
堺化学工業	6,600	2,641.00	17,430,600	
第一稀元素化学工業	10,800	818.00	8,834,400	
エア・ウォーター	81,200	1,998.00	162,237,600	
大陽日酸	81,800	2,431.00	198,855,800	
日本化学工業	3,400	2,973.00	10,108,200	
東邦アセチレン	1,500	1,329.00	1,993,500	
日本パーカライジング	54,100	1,213.00	65,623,300	
高圧ガス工業	15,700	829.00	13,015,300	
チタン工業	1,300	2,446.00	3,179,800	
四国化成工業	16,700	1,175.00	19,622,500	
戸田工業	2,100	2,129.00	4,470,900	
ステラ　ケミファ	5,900	2,694.00	15,894,600	
保土谷化学工業	3,500	3,480.00	12,180,000	
日本触媒	16,700	6,540.00	109,218,000	
大日精化工業	8,200	3,240.00	26,568,000	
カネカ	25,700	3,470.00	89,179,000	
協和キリン	102,000	2,005.00	204,510,000	
三菱瓦斯化学	100,900	1,505.00	151,854,500	

三井化学	90,000	2,551.00	229,590,000	
ＪＳＲ	99,600	1,797.00	178,981,200	
東京応化工業	17,000	4,285.00	72,845,000	
大阪有機化学工業	9,200	1,084.00	9,972,800	
三菱ケミカルホールディングス	663,300	821.70	545,033,610	
ＫＨネオケム	17,500	2,464.00	43,120,000	
ダイセル	146,200	937.00	136,989,400	
住友ベークライト	17,200	4,375.00	75,250,000	
積水化学工業	213,300	1,748.00	372,848,400	
日本ゼオン	89,500	1,355.00	121,272,500	
アイカ工業	29,800	3,400.00	101,320,000	
宇部興産	50,100	2,263.00	113,376,300	
積水樹脂	16,300	2,113.00	34,441,900	
タキロンシーアイ	21,400	635.00	13,589,000	
旭有機材	6,900	1,341.00	9,252,900	
日立化成	45,900	3,530.00	162,027,000	
ニチバン	5,300	1,732.00	9,179,600	
リケンテクノス	27,000	488.00	13,176,000	
大倉工業	4,700	1,761.00	8,276,700	
積水化成品工業	14,800	766.00	11,336,800	
群栄化学工業	2,600	2,413.00	6,273,800	
タイガースポリマー	5,600	623.00	3,488,800	
ミライアル	3,000	1,397.00	4,191,000	
ダイキアクシス	3,700	877.00	3,244,900	
ダイキョーニシカワ	21,000	820.00	17,220,000	
竹本容器	3,700	965.00	3,570,500	
森六ホールディングス	5,300	2,399.00	12,714,700	
日本化薬	61,400	1,322.00	81,170,800	
カーリットホールディングス	10,700	616.00	6,591,200	
ＥＰＳホールディングス	14,700	1,284.00	18,874,800	
ソルクシーズ	4,300	957.00	4,115,100	
レッグス	2,500	1,721.00	4,302,500	
プレステージ・インターナショナル	36,400	883.00	32,141,200	
フェイス	4,100	806.00	3,304,600	
プロトコーポレーション	9,000	1,188.00	10,692,000	
ハイマックス	1,300	1,829.00	2,377,700	
アミューズ	5,900	2,827.00	16,679,300	
野村総合研究所	189,800	2,296.00	435,780,800	
ドリームインキュベータ	3,000	1,550.00	4,650,000	
サイバネットシステム	7,400	704.00	5,209,600	
クイック	6,200	1,418.00	8,791,600	
ＴＡＣ	5,800	199.00	1,154,200	
ＣＥホールディングス	6,100	420.00	2,562,000	
ケネディクス	92,400	570.00	52,668,000	
日本システム技術	1,700	1,227.00	2,085,900	
電通	99,900	3,690.00	368,631,000	
インテージホールディングス	12,600	932.00	11,743,200	
テイクアンドギヴ・ニーズ	3,800	1,203.00	4,571,400	
東邦システムサイエンス	3,100	1,015.00	3,146,500	
ぴあ	2,800	4,610.00	12,908,000	

イオンファンタジー	3,100	3,360.00	10,416,000	
ソースネクスト	38,800	493.00	19,128,400	
シーティーエス	11,100	760.00	8,436,000	
ネクシィーズグループ	3,300	1,970.00	6,501,000	
インフォコム	10,900	2,402.00	26,181,800	
メディカルシステムネットワーク	10,700	521.00	5,574,700	
日本精化	8,000	1,233.00	9,864,000	
扶桑化学工業	10,100	2,537.00	25,623,700	
トリケミカル研究所	2,200	6,180.00	13,596,000	
ラクスル	5,300	3,490.00	18,497,000	
ＦＩＧ	10,000	320.00	3,200,000	
ＡＤＥＫＡ	48,900	1,458.00	71,296,200	
日油	37,400	3,595.00	134,453,000	
ミヨシ油脂	4,000	1,182.00	4,728,000	
新日本理化	18,200	200.00	3,640,000	
ハリマ化成グループ	8,200	1,262.00	10,348,400	
アルテリア・ネットワークス	11,100	1,457.00	16,172,700	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	2,300	1,730.00	3,979,000	
花王	242,700	8,324.00	2,020,234,800	
第一工業製薬	3,700	3,185.00	11,784,500	
石原ケミカル	2,500	1,623.00	4,057,500	
日華化学	3,500	892.00	3,122,000	
ニイタカ	1,600	1,575.00	2,520,000	
三洋化成工業	6,700	5,060.00	33,902,000	
武田薬品工業	884,900	3,786.00	3,350,231,400	
アステラス製薬	891,600	1,638.00	1,460,440,800	
大日本住友製薬	75,200	1,813.00	136,337,600	
塩野義製薬	129,600	5,867.00	760,363,200	
田辺三菱製薬	105,900	1,264.00	133,857,600	
わかもと製薬	12,900	257.00	3,315,300	
あすか製薬	12,600	1,108.00	13,960,800	
日本新薬	26,500	9,530.00	252,545,000	
ビオフェルミン製薬	1,700	2,176.00	3,699,200	
中外製薬	105,700	8,230.00	869,911,000	
科研製薬	17,300	5,020.00	86,846,000	
エーザイ	121,300	5,488.00	665,694,400	
理研ビタミン	4,800	3,585.00	17,208,000	
ロート製薬	52,000	3,080.00	160,160,000	
小野薬品工業	239,400	1,951.50	467,189,100	
久光製薬	29,900	5,100.00	152,490,000	
有機合成薬品工業	8,000	235.00	1,880,000	
持田製薬	15,300	4,155.00	63,571,500	
参天製薬	188,800	1,867.00	352,489,600	
扶桑薬品工業	3,600	1,992.00	7,171,200	
日本ケミファ	1,400	2,792.00	3,908,800	
ツムラ	31,400	2,966.00	93,132,400	
日医工	26,600	1,233.00	32,797,800	
テルモ	286,800	3,427.00	982,863,600	
みらかホールディングス	27,100	2,536.00	68,725,600	

キッセイ薬品工業	17,900	2,732.00	48,902,800	
生化学工業	19,700	1,191.00	23,462,700	
栄研化学	17,900	1,595.00	28,550,500	
日水製薬	4,200	1,210.00	5,082,000	
鳥居薬品	6,400	2,772.00	17,740,800	
ＪＣＲファーマ	7,200	8,190.00	58,968,000	
東和薬品	14,600	2,502.00	36,529,200	
富士製薬工業	6,900	1,339.00	9,239,100	
沢井製薬	20,800	5,550.00	115,440,000	
ゼリア新薬工業	20,000	1,930.00	38,600,000	
第一三共	290,100	6,939.00	2,013,003,900	
キョーリン製薬ホールディングス	22,300	1,810.00	40,363,000	
大幸薬品	4,600	2,684.00	12,346,400	
ダイト	5,900	2,965.00	17,493,500	
大塚ホールディングス	193,100	4,373.00	844,426,300	
大正製薬ホールディングス	21,400	7,930.00	169,702,000	
ペプチドリーム	51,300	4,910.00	251,883,000	
大日本塗料	11,200	1,098.00	12,297,600	
日本ペイントホールディングス	81,900	6,090.00	498,771,000	
関西ペイント	111,600	2,594.00	289,490,400	
神東塗料	8,700	188.00	1,635,600	
中国塗料	32,700	950.00	31,065,000	
日本特殊塗料	7,500	1,117.00	8,377,500	
藤倉化成	13,300	539.00	7,168,700	
太陽ホールディングス	8,200	3,765.00	30,873,000	
ＤＩＣ	41,800	3,110.00	129,998,000	
サカタインクス	21,700	1,169.00	25,367,300	
東洋インキＳＣホールディングス	20,900	2,568.00	53,671,200	
Ｔ＆Ｋ　ＴＯＫＡ	7,600	990.00	7,524,000	
アルプス技研	8,700	1,516.00	13,189,200	
サニックス	17,200	407.00	7,000,400	
ダイオーズ	2,300	1,393.00	3,203,900	
日本空調サービス	11,200	696.00	7,795,200	
オリエンタルランド	114,500	16,635.00	1,904,707,500	
フォーカスシステムズ	6,900	862.00	5,947,800	
ダスキン	24,800	2,861.00	70,952,800	
パーク２４	53,700	2,586.00	138,868,200	
明光ネットワークジャパン	11,500	960.00	11,040,000	
ファルコホールディングス	5,400	1,634.00	8,823,600	
クレスコ	3,000	3,180.00	9,540,000	
フジ・メディア・ホールディングス	103,100	1,415.00	145,886,500	
秀英予備校	2,300	434.00	998,200	
田谷	2,000	602.00	1,204,000	
ラウンドワン	30,100	1,402.00	42,200,200	
リゾートトラスト	41,000	1,767.00	72,447,000	
オービック	34,500	12,370.00	426,765,000	
ジャストシステム	14,200	4,300.00	61,060,000	
ＴＤＣソフト	8,900	839.00	7,467,100	
Ｚホールディングス	649,400	333.00	216,250,200	
ビー・エム・エル	12,500	3,030.00	37,875,000	

ワタベウェディング	1,700	561.00	953,700	
トレンドマイクロ	44,200	5,320.00	235,144,000	
りらいあコミュニケーションズ	17,600	1,368.00	24,076,800	
ＩＤホールディングス	3,400	1,264.00	4,297,600	
リソー教育	49,300	423.00	20,853,900	
日本オラクル	20,200	9,290.00	187,658,000	
早稲田アカデミー	2,900	888.00	2,575,200	
アルファシステムズ	3,100	2,800.00	8,680,000	
フューチャー	12,000	1,912.00	22,944,000	
ＣＡＣ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	6,500	1,306.00	8,489,000	
ＳＢテクノロジー	4,300	1,957.00	8,415,100	
トーセ	2,800	834.00	2,335,200	
ユー・エス・エス	118,400	2,037.00	241,180,800	
オービックビジネスコンサルタント	10,200	4,270.00	43,554,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	45,400	2,947.00	133,793,800	
アイティフォー	12,200	869.00	10,601,800	
東京個別指導学院	3,500	893.00	3,125,500	
東計電算	1,500	3,220.00	4,830,000	
サイバーエージェント	55,800	4,040.00	225,432,000	
楽天	451,700	1,007.00	454,861,900	
エックスネット	2,000	975.00	1,950,000	
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	760.00	6,688,000	
大塚商会	53,800	4,105.00	220,849,000	
サイボウズ	11,700	1,029.00	12,039,300	
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	1,783.00	8,558,400	
セントラルスポーツ	3,600	3,255.00	11,718,000	
パラカ	2,600	1,997.00	5,192,200	
電通国際情報サービス	6,200	3,480.00	21,576,000	
デジタルガレージ	19,400	3,445.00	66,833,000	
イーエムシステムズ	8,100	1,877.00	15,203,700	
ウェザーニューズ	3,400	3,350.00	11,390,000	
ＣＩＪ	7,600	832.00	6,323,200	
ビジネスエンジニアリング	1,100	2,927.00	3,219,700	
日本エンタープライズ	11,600	234.00	2,714,400	
WOWOW	4,700	2,586.00	12,154,200	
スカラ	7,200	947.00	6,818,400	
インテリジェント　ウェイブ	3,900	772.00	3,010,800	
フルキャストホールディングス	9,800	2,198.00	21,540,400	
エン・ジャパン	14,100	4,075.00	57,457,500	
富士フイルムホールディングス	210,500	4,719.00	993,349,500	
コニカミノルタ	221,400	764.00	169,149,600	
資生堂	201,400	8,707.00	1,753,589,800	
ライオン	131,800	2,174.00	286,533,200	
高砂香料工業	7,000	2,612.00	18,284,000	
マンダム	22,800	2,714.00	61,879,200	
ミルボン	13,600	5,650.00	76,840,000	
ファンケル	45,200	2,844.00	128,548,800	
コーセー	17,200	18,880.00	324,736,000	

コタ	5,400	1,269.00	6,852,600	
シーボン	1,200	2,423.00	2,907,600	
ポーラ・オルビスホールディングス	43,300	2,537.00	109,852,100	
ノエビアホールディングス	9,700	5,600.00	54,320,000	
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	1,549.00	11,152,800	
アグロ　カネショウ	3,200	1,539.00	4,924,800	
コニシ	17,900	1,526.00	27,315,400	
長谷川香料	13,400	1,982.00	26,558,800	
星光ＰＭＣ	5,900	800.00	4,720,000	
小林製薬	28,400	8,680.00	246,512,000	
荒川化学工業	9,100	1,581.00	14,387,100	
メック	7,000	1,664.00	11,648,000	
日本高純度化学	2,800	2,460.00	6,888,000	
タカラバイオ	26,600	2,158.00	57,402,800	
ＪＣＵ	13,200	2,408.00	31,785,600	
新田ゼラチン	6,600	680.00	4,488,000	
ＯＡＴアグリオ	1,500	1,628.00	2,442,000	
デクセリアルズ	26,200	831.00	21,772,200	
アース製薬	7,600	5,540.00	42,104,000	
北興化学工業	10,500	524.00	5,502,000	
大成ラミック	3,300	2,851.00	9,408,300	
クミアイ化学工業	42,000	1,005.00	42,210,000	
日本農薬	18,300	522.00	9,552,600	
富士興産	4,000	677.00	2,708,000	
ニチレキ	13,000	1,155.00	15,015,000	
ユシロ化学工業	5,300	1,351.00	7,160,300	
ビーピー・カストロール	3,600	1,435.00	5,166,000	
富士石油	24,700	249.00	6,150,300	
ＭＯＲＥＳＣＯ	3,700	1,306.00	4,832,200	
出光興産	117,000	3,100.00	362,700,000	
ＪＸＴＧホールディングス	1,676,500	491.50	823,999,750	
コスモエネルギーホールディングス	29,400	2,237.00	65,767,800	
横浜ゴム	58,600	2,261.00	132,494,600	
ＴＯＹＯ　ＴＩＲＥ	58,300	1,364.00	79,521,200	
ブリヂストン	311,500	4,294.00	1,337,581,000	
住友ゴム工業	90,900	1,343.00	122,078,700	
藤倉コンポジット	9,200	429.00	3,946,800	
オカモト	6,800	4,065.00	27,642,000	
アキレス	7,000	1,796.00	12,572,000	
フコク	4,500	707.00	3,181,500	
ニッタ	11,400	2,918.00	33,265,200	
クリエートメディック	3,400	977.00	3,321,800	
住友理工	19,600	915.00	17,934,000	
三ツ星ベルト	13,400	1,921.00	25,741,400	
バンドー化学	19,300	861.00	16,617,300	
ＡＧＣ	100,200	3,445.00	345,189,000	
日本板硝子	48,500	669.00	32,446,500	
石塚硝子	1,500	2,094.00	3,141,000	
有沢製作所	16,000	1,054.00	16,864,000	

日本山村硝子	4,300	1,268.00	5,452,400	
日本電気硝子	40,700	2,423.00	98,616,100	
オハラ	4,100	1,553.00	6,367,300	
住友大阪セメント	20,500	4,755.00	97,477,500	
太平洋セメント	64,000	2,909.00	186,176,000	
リソルホールディングス	1,000	3,970.00	3,970,000	
日本ヒューム	10,300	803.00	8,270,900	
日本コンクリート工業	22,300	314.00	7,002,200	
三谷セキサン	4,700	3,335.00	15,674,500	
アジアパイルホールディングス	14,600	538.00	7,854,800	
東海カーボン	106,300	1,104.00	117,355,200	
日本カーボン	5,200	3,975.00	20,670,000	
東洋炭素	6,000	2,419.00	14,514,000	
ノリタケカンパニーリミテド	6,100	4,160.00	25,376,000	
ＴＯＴＯ	78,000	4,145.00	323,310,000	
日本碍子	123,600	1,549.00	191,456,400	
日本特殊陶業	85,500	2,086.00	178,353,000	
ダントーホールディングス	9,200	115.00	1,058,000	
ＭＡＲＵＷＡ	3,500	7,450.00	26,075,000	
品川リフラクトリーズ	2,700	2,756.00	7,441,200	
黒崎播磨	2,000	5,900.00	11,800,000	
ヨータイ	9,000	665.00	5,985,000	
イソライト工業	5,400	462.00	2,494,800	
東京窯業	13,300	300.00	3,990,000	
ニッカトー	4,800	741.00	3,556,800	
フジミインコーポレーテッド	9,000	2,593.00	23,337,000	
クニミネ工業	4,000	947.00	3,788,000	
エーアンドエーマテリアル	2,000	1,066.00	2,132,000	
ニチアス	27,800	1,983.00	55,127,400	
日本製鉄	465,400	1,521.50	708,106,100	
神戸製鋼所	183,300	573.00	105,030,900	
中山製鋼所	13,800	460.00	6,348,000	
合同製鐵	4,900	2,252.00	11,034,800	
ジェイ　エフ　イー　ホールディングス	270,600	1,332.00	360,439,200	
東京製鐵	53,800	856.00	46,052,800	
共英製鋼	11,300	1,971.00	22,272,300	
大和工業	21,300	2,775.00	59,107,500	
東京鐵鋼	4,200	1,366.00	5,737,200	
大阪製鐵	6,600	1,349.00	8,903,400	
淀川製鋼所	13,500	2,090.00	28,215,000	
丸一鋼管	35,500	2,843.00	100,926,500	
モリ工業	3,100	2,133.00	6,612,300	
大同特殊鋼	16,400	4,650.00	76,260,000	
日本高周波鋼業	3,600	411.00	1,479,600	
日本冶金工業	8,300	2,347.00	19,480,100	
山陽特殊製鋼	12,600	1,474.00	18,572,400	
愛知製鋼	5,600	3,420.00	19,152,000	
日立金属	107,900	1,227.00	132,393,300	
日本金属	2,400	839.00	2,013,600	

大平洋金属	6,800	2,363.00	16,068,400	
新日本電工	65,000	181.00	11,765,000	
栗本鐵工所	5,000	1,609.00	8,045,000	
虹　技	1,600	1,402.00	2,243,200	
日本鋳鉄管	1,100	1,100.00	1,210,000	
日本製鋼所	30,400	2,208.00	67,123,200	
三菱製鋼	7,400	1,148.00	8,495,200	
日亜鋼業	15,100	321.00	4,847,100	
日本精線	1,500	2,424.00	3,636,000	
エンビプロ・ホールディングス	2,600	639.00	1,661,400	
大紀アルミニウム工業所	16,500	719.00	11,863,500	
日本軽金属ホールディングス	272,800	204.00	55,651,200	
三井金属鉱業	27,100	2,713.00	73,522,300	
東邦亜鉛	5,600	2,120.00	11,872,000	
三菱マテリアル	66,100	2,975.00	196,647,500	
住友金属鉱山	137,300	3,435.00	471,625,500	
ＤＯＷＡホールディングス	23,400	3,750.00	87,750,000	
古河機械金属	16,500	1,491.00	24,601,500	
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	1,683.00	19,522,800	
東邦チタニウム	18,000	857.00	15,426,000	
ＵＡＣＪ	15,200	1,889.00	28,712,800	
ＣＫサンエツ	1,900	2,838.00	5,392,200	
古河電気工業	28,900	2,794.00	80,746,600	
住友電気工業	374,400	1,415.50	529,963,200	
フジクラ	121,100	444.00	53,768,400	
昭和電線ホールディングス	11,700	921.00	10,775,700	
東京特殊電線	1,300	2,119.00	2,754,700	
タツタ電線	20,000	493.00	9,860,000	
カナレ電気	1,700	1,897.00	3,224,900	
平河ヒューテック	4,200	1,085.00	4,557,000	
リョービ	12,300	1,847.00	22,718,100	
アーレスティ	12,300	562.00	6,912,600	
アサヒホールディングス	18,800	2,256.00	42,412,800	
東洋製罐グループホールディングス	63,900	1,734.00	110,802,600	
ホッカンホールディングス	5,100	1,631.00	8,318,100	
コロナ	5,500	1,061.00	5,835,500	
横河ブリッジホールディングス	18,700	1,744.00	32,612,800	
ＯＳＪＢホールディングス	50,700	256.00	12,979,200	
駒井ハルテック	1,900	1,713.00	3,254,700	
高田機工	900	2,586.00	2,327,400	
三和ホールディングス	103,500	1,262.00	130,617,000	
文化シヤッター	29,500	939.00	27,700,500	
三協立山	13,900	1,197.00	16,638,300	
アルインコ	8,100	1,105.00	8,950,500	
東洋シヤッター	2,500	724.00	1,810,000	
ＬＩＸＩＬグループ	147,900	1,944.00	287,517,600	
日本フイルコン	7,800	500.00	3,900,000	
ノーリツ	20,700	1,313.00	27,179,100	
長府製作所	10,100	2,498.00	25,229,800	

リンナイ	17,900	7,510.00	134,429,000	
ユニプレス	19,600	1,724.00	33,790,400	
ダイニチ工業	5,400	685.00	3,699,000	
日東精工	14,000	576.00	8,064,000	
三洋工業	1,400	1,945.00	2,723,000	
岡部	20,200	885.00	17,877,000	
ジーテクト	11,000	1,745.00	19,195,000	
中国工業	1,700	489.00	831,300	
東プレ	18,700	1,785.00	33,379,500	
高周波熱錬	19,300	911.00	17,582,300	
東京製綱	6,200	1,047.00	6,491,400	
サンコール	5,700	461.00	2,627,700	
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	1,937.00	30,992,000	
エイチワン	9,900	666.00	6,593,400	
日本発条	99,800	847.00	84,530,600	
中央発條	1,200	2,782.00	3,338,400	
アドバネクス	1,300	1,708.00	2,220,400	
三浦工業	43,400	3,170.00	137,578,000	
タクマ	36,500	1,252.00	45,698,000	
テクノプロ・ホールディングス	19,400	6,560.00	127,264,000	
アトラ	2,300	376.00	864,800	
インターワークス	2,300	504.00	1,159,200	
アイ・アールジャパンホールディングス	3,500	3,700.00	12,950,000	
ＫｅｅＰｅｒ技研	3,700	1,513.00	5,598,100	
ファーストロジック	2,300	620.00	1,426,000	
三機サービス	1,900	922.00	1,751,800	
Ｇｕｎｏｓｙ	6,800	1,475.00	10,030,000	
デザインワン・ジャパン	2,300	312.00	717,600	
イー・ガーディアン	5,100	1,682.00	8,578,200	
リブセンス	6,000	263.00	1,578,000	
ジャパンマテリアル	26,600	1,472.00	39,155,200	
ベクトル	12,300	856.00	10,528,800	
ウチヤマホールディングス	5,100	490.00	2,499,000	
チャーム・ケア・コーポレーション	3,200	2,449.00	7,836,800	
ライクキッズ	2,400	893.00	2,143,200	
キャリアリンク	4,000	601.00	2,404,000	
ＩＢＪ	6,700	1,005.00	6,733,500	
アサンテ	4,000	2,030.00	8,120,000	
Ｎ・フィールド	6,900	613.00	4,229,700	
バリューＨＲ	1,900	3,330.00	6,327,000	
Ｍ＆Ａキャピタルパートナーズ	3,500	6,810.00	23,835,000	
ライドオンエクスプレスホールディングス	4,100	1,443.00	5,916,300	
ＥＲＩホールディングス	2,900	787.00	2,282,300	
アビスト	1,600	2,620.00	4,192,000	
シグマクシス	4,700	1,450.00	6,815,000	
ウィルグループ	6,500	981.00	6,376,500	
エスクロー・エージェント・ジャパン	14,000	219.00	3,066,000	

リクルートホールディングス	693,900	3,465.00	2,404,363,500	
エラン	5,800	1,723.00	9,993,400	
ツガミ	22,700	930.00	21,111,000	
オークマ	12,800	6,150.00	78,720,000	
東芝機械	11,300	2,302.00	26,012,600	
アマダホールディングス	150,400	1,181.00	177,622,400	
アイダエンジニアリング	27,000	880.00	23,760,000	
滝澤鉄工所	3,100	1,283.00	3,977,300	
ＦＵＪＩ	40,000	1,704.00	68,160,000	
牧野フライス製作所	11,700	4,845.00	56,686,500	
オーエスジー	46,300	2,142.00	99,174,600	
ダイジェット工業	1,200	1,535.00	1,842,000	
旭ダイヤモンド工業	26,300	640.00	16,832,000	
ＤＭＧ森精機	63,400	1,577.00	99,981,800	
ソディック	23,600	817.00	19,281,200	
ディスコ	13,600	21,800.00	296,480,000	
日東工器	5,500	2,241.00	12,325,500	
日進工具	3,000	2,006.00	6,018,000	
パンチ工業	7,100	483.00	3,429,300	
冨士ダイス	4,600	628.00	2,888,800	
土木管理総合試験所	4,500	465.00	2,092,500	
日本郵政	793,600	994.00	788,838,400	
ベルシステム２４ホールディングス	16,300	1,737.00	28,313,100	
鎌倉新書	7,300	1,433.00	10,460,900	
一蔵	1,300	641.00	833,300	
ＬＩＴＡＬＩＣＯ	2,300	2,104.00	4,839,200	
グローバルキッズＣＯＭＰＡＮＹ	1,400	853.00	1,194,200	
エボラブルアジア	4,400	1,954.00	8,597,600	
アトラエ	2,500	3,085.00	7,712,500	
ストライク	3,700	3,370.00	12,469,000	
ソラスト	23,800	1,205.00	28,679,000	
セラク	2,600	712.00	1,851,200	
インソース	4,500	2,659.00	11,965,500	
豊田自動織機	82,000	6,230.00	510,860,000	
豊和工業	5,600	753.00	4,216,800	
ＯＫＫ	4,100	714.00	2,927,400	
石川製作所	2,500	1,358.00	3,395,000	
東洋機械金属	7,200	579.00	4,168,800	
津田駒工業	2,000	1,242.00	2,484,000	
エンシュウ	2,700	1,120.00	3,024,000	
島精機製作所	13,800	2,605.00	35,949,000	
オプトラン	11,200	3,205.00	35,896,000	
ＮＣホールディングス	3,600	496.00	1,785,600	
イワキ	4,300	973.00	4,183,900	
フリュー	8,100	938.00	7,597,800	
ヤマシンフィルタ	17,600	883.00	15,540,800	
日阪製作所	12,300	895.00	11,008,500	
やまびこ	19,500	1,186.00	23,127,000	
平田機工	4,800	7,430.00	35,664,000	
ペガサスミシン製造	9,500	509.00	4,835,500	

マルマエ	3,300	968.00	3,194,400	
タツモ	3,700	1,187.00	4,391,900	
ナブテスコ	59,100	3,375.00	199,462,500	
三井海洋開発	10,700	2,724.00	29,146,800	
レオン自動機	9,900	1,548.00	15,325,200	
ＳＭＣ	29,700	46,560.00	1,382,832,000	
ヤマハモーターロボティクスホールディングス	7,800	494.00	3,853,200	
ホソカワミクロン	3,500	3,680.00	12,880,000	
ユニオンツール	3,700	3,435.00	12,709,500	
オイレス工業	14,100	1,613.00	22,743,300	
日精エー・エス・ビー機械	3,400	3,725.00	12,665,000	
サトーホールディングス	12,100	2,906.00	35,162,600	
技研製作所	8,800	3,645.00	32,076,000	
日本エアーテック	3,300	604.00	1,993,200	
カワタ	2,300	963.00	2,214,900	
日精樹脂工業	8,400	1,028.00	8,635,200	
オカダアイヨン	3,600	1,223.00	4,402,800	
ワイエイシイホールディングス	4,300	689.00	2,962,700	
小松製作所	458,900	2,480.00	1,138,072,000	
住友重機械工業	58,000	3,285.00	190,530,000	
日立建機	40,600	2,596.00	105,397,600	
日工	14,000	631.00	8,834,000	
巴工業	4,300	2,367.00	10,178,100	
井関農機	10,100	1,534.00	15,493,400	
ＴＯＷＡ	8,900	923.00	8,214,700	
丸山製作所	2,200	1,203.00	2,646,600	
北川鉄工所	4,500	1,985.00	8,932,500	
シンニッタン	15,800	434.00	6,857,200	
ローツェ	4,500	3,280.00	14,760,000	
タカキタ	3,700	555.00	2,053,500	
クボタ	542,900	1,644.50	892,799,050	
荏原実業	2,600	2,128.00	5,532,800	
東洋エンジニアリング	13,500	721.00	9,733,500	
三菱化工機	3,500	1,817.00	6,359,500	
月島機械	20,100	1,554.00	31,235,400	
帝国電機製作所	7,100	1,221.00	8,669,100	
東京機械製作所	4,200	373.00	1,566,600	
新東工業	23,900	997.00	23,828,300	
澁谷工業	8,900	2,910.00	25,899,000	
アイチコーポレーション	17,500	711.00	12,442,500	
小森コーポレーション	25,500	1,193.00	30,421,500	
鶴見製作所	7,900	2,078.00	16,416,200	
住友精密工業	1,700	3,145.00	5,346,500	
酒井重工業	1,900	2,875.00	5,462,500	
荏原製作所	44,900	2,903.00	130,344,700	
石井鐵工所	1,600	2,295.00	3,672,000	
酉島製作所	10,300	1,000.00	10,300,000	
北越工業	10,400	1,229.00	12,781,600	
ダイキン工業	138,400	14,440.00	1,998,496,000	

オルガノ	3,700	5,070.00	18,759,000	
トーヨーカネツ	3,900	1,966.00	7,667,400	
栗田工業	54,800	2,860.00	156,728,000	
椿本チエイン	13,200	3,545.00	46,794,000	
大同工業	4,700	813.00	3,821,100	
日機装	30,400	1,139.00	34,625,600	
木村化工機	8,500	396.00	3,366,000	
レイズネクスト	20,400	1,100.00	22,440,000	
アネスト岩田	15,800	1,028.00	16,242,400	
ダイフク	55,800	5,750.00	320,850,000	
サムコ	3,000	950.00	2,850,000	
加藤製作所	5,200	1,961.00	10,197,200	
油研工業	1,700	1,645.00	2,796,500	
タダノ	48,900	1,051.00	51,393,900	
フジテック	36,800	1,412.00	51,961,600	
ＣＫＤ	28,300	1,427.00	40,384,100	
キトー	7,700	1,610.00	12,397,000	
平和	28,200	2,189.00	61,729,800	
理想科学工業	8,900	1,715.00	15,263,500	
ＳＡＮＫＹＯ	25,300	3,775.00	95,507,500	
日本金銭機械	11,200	946.00	10,595,200	
マースグループホールディングス	6,400	2,015.00	12,896,000	
福島工業	6,300	3,245.00	20,443,500	
オーイズミ	4,500	534.00	2,403,000	
ダイコク電機	4,700	1,477.00	6,941,900	
竹内製作所	17,000	1,794.00	30,498,000	
アマノ	28,900	3,180.00	91,902,000	
ＪＵＫＩ	14,100	929.00	13,098,900	
サンデンホールディングス	12,700	653.00	8,293,100	
蛇の目ミシン工業	9,000	406.00	3,654,000	
ブラザー工業	132,000	2,004.00	264,528,000	
マックス	15,400	1,874.00	28,859,600	
モリタホールディングス	17,700	1,805.00	31,948,500	
グローリー	28,000	3,045.00	85,260,000	
新晃工業	9,500	1,802.00	17,119,000	
大和冷機工業	14,700	1,200.00	17,640,000	
セガサミーホールディングス	100,500	1,564.00	157,182,000	
日本ピストンリング	3,700	1,296.00	4,795,200	
リケン	4,700	3,905.00	18,353,500	
ＴＰＲ	13,600	1,791.00	24,357,600	
ツバキ・ナカシマ	20,700	1,665.00	34,465,500	
ホシザキ	29,600	8,640.00	255,744,000	
大豊工業	8,500	775.00	6,587,500	
日本精工	208,200	974.00	202,786,800	
ＮＴＮ	217,600	328.00	71,372,800	
ジェイテクト	97,100	1,283.00	124,579,300	
不二越	9,400	4,980.00	46,812,000	
ミネベアミツミ	188,200	1,877.00	353,251,400	
日本トムソン	30,300	465.00	14,089,500	
ＴＨＫ	59,000	2,843.00	167,737,000	

ユーシン精機	7,900	941.00	7,433,900	
前澤給装工業	4,000	2,046.00	8,184,000	
イーグル工業	12,400	1,030.00	12,772,000	
前澤工業	6,700	374.00	2,505,800	
日本ピラー工業	10,400	1,341.00	13,946,400	
キッツ	41,200	709.00	29,210,800	
日立製作所	456,300	4,109.00	1,874,936,700	
三菱電機	1,013,500	1,478.50	1,498,459,750	
富士電機	65,800	3,375.00	222,075,000	
東洋電機製造	4,000	1,611.00	6,444,000	
安川電機	117,500	3,940.00	462,950,000	
シンフォニア　テクノロジー	14,100	1,275.00	17,977,500	
明電舎	20,100	1,922.00	38,632,200	
オリジン	2,800	1,396.00	3,908,800	
山洋電気	4,900	4,970.00	24,353,000	
デンヨー	9,400	1,726.00	16,224,400	
ベイカレント・コンサルティング	6,900	4,930.00	34,017,000	
Ｏｒｃｈｅｓｔｒａ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	2,000	1,058.00	2,116,000	
アイモバイル	2,800	526.00	1,472,800	
キャリアインデックス	3,600	403.00	1,450,800	
ＭＳ－Ｊａｐａｎ	4,000	1,266.00	5,064,000	
船場	1,700	950.00	1,615,000	
グレイステクノロジー	3,100	2,995.00	9,284,500	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	7,700	2,677.00	20,612,900	
フルテック	1,200	1,288.00	1,545,600	
グリーンズ	2,700	1,303.00	3,518,100	
ツナググループ・ホールディングス	1,000	595.00	595,000	
ソウルドアウト	1,100	1,308.00	1,438,800	
日総工産	5,300	1,214.00	6,434,200	
キュービーネットホールディングス	6,000	2,241.00	13,446,000	
ＲＰＡホールディングス	4,100	1,264.00	5,182,400	
三櫻工業	13,000	881.00	11,453,000	
マキタ	123,400	3,245.00	400,433,000	
東芝テック	12,700	3,565.00	45,275,500	
芝浦メカトロニクス	1,800	3,030.00	5,454,000	
マブチモーター	28,000	4,010.00	112,280,000	
日本電産	122,000	14,620.00	1,783,640,000	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	5,600	492.00	2,755,200	
トレックス・セミコンダクター	4,000	1,375.00	5,500,000	
東光高岳	5,100	1,197.00	6,104,700	
ダブル・スコープ	13,900	565.00	7,853,500	
宮越ホールディングス	3,800	1,030.00	3,914,000	
ダイヘン	11,100	3,295.00	36,574,500	
ヤーマン	14,800	705.00	10,434,000	
ＪＶＣケンウッド	77,700	317.00	24,630,900	
ミマキエンジニアリング	9,200	525.00	4,830,000	
第一精工	3,700	2,552.00	9,442,400	
日新電機	23,800	1,366.00	32,510,800	

大崎電気工業	20,300	707.00	14,352,100	
オムロン	107,700	6,020.00	648,354,000	
日東工業	16,300	2,115.00	34,474,500	
ＩＤＥＣ	13,600	2,057.00	27,975,200	
不二電機工業	1,200	1,236.00	1,483,200	
ジーエス・ユアサ　コーポレーション	36,400	1,895.00	68,978,000	
サクサホールディングス	2,500	1,838.00	4,595,000	
メルコホールディングス	4,200	2,765.00	11,613,000	
テクノメディカ	2,300	2,091.00	4,809,300	
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	1,500	1,054.00	1,581,000	
日本電気	131,200	4,575.00	600,240,000	
富士通	97,700	8,781.00	857,903,700	
沖電気工業	43,800	1,457.00	63,816,600	
岩崎通信機	4,800	814.00	3,907,200	
電気興業	5,300	3,455.00	18,311,500	
サンケン電気	11,900	2,402.00	28,583,800	
ナカヨ	1,900	1,579.00	3,000,100	
アイホン	5,800	1,671.00	9,691,800	
ルネサスエレクトロニクス	483,200	735.00	355,152,000	
セイコーエプソン	125,600	1,487.00	186,767,200	
ワコム	73,600	365.00	26,864,000	
アルバック	20,200	4,715.00	95,243,000	
アクセル	4,400	607.00	2,670,800	
ＥＩＺＯ	9,300	3,830.00	35,619,000	
ジャパンディスプレイ	240,600	58.00	13,954,800	
日本信号	25,900	1,220.00	31,598,000	
京三製作所	22,000	404.00	8,888,000	
能美防災	13,400	2,056.00	27,550,400	
ホーチキ	6,500	1,444.00	9,386,000	
星和電機	4,100	537.00	2,201,700	
エレコム	9,600	4,010.00	38,496,000	
パナソニック	1,157,700	896.90	1,038,341,130	
シャープ	100,600	1,232.00	123,939,200	
アンリツ	65,300	2,114.00	138,044,200	
富士通ゼネラル	30,900	1,802.00	55,681,800	
ソニー	680,400	6,311.00	4,294,004,400	
ＴＤＫ	53,000	10,280.00	544,840,000	
帝国通信工業	4,500	1,190.00	5,355,000	
タムラ製作所	39,100	618.00	24,163,800	
アルプスアルパイン	105,500	2,102.00	221,761,000	
池上通信機	3,200	1,110.00	3,552,000	
日本電波工業	9,300	483.00	4,491,900	
鈴木	5,400	638.00	3,445,200	
日本トリム	1,900	4,680.00	8,892,000	
ローランド　ディー．ジー．	5,500	2,085.00	11,467,500	
フォスター電機	11,400	2,034.00	23,187,600	
ＳＭＫ	2,800	2,794.00	7,823,200	
ヨコオ	7,200	3,100.00	22,320,000	
ティアック	8,400	200.00	1,680,000	

ホシデン	29,900	1,066.00	31,873,400	
ヒロセ電機	14,500	13,530.00	196,185,000	
日本航空電子工業	23,200	1,696.00	39,347,200	
ＴＯＡ	10,900	1,229.00	13,396,100	
マクセルホールディングス	21,800	1,547.00	33,724,600	
古野電気	13,100	1,039.00	13,610,900	
ユニデンホールディングス	3,000	2,009.00	6,027,000	
スミダコーポレーション	7,800	1,083.00	8,447,400	
アイコム	5,600	2,362.00	13,227,200	
リオン	4,700	2,624.00	12,332,800	
本多通信工業	8,800	503.00	4,426,400	
船井電機	10,300	587.00	6,046,100	
横河電機	101,400	1,896.00	192,254,400	
新電元工業	3,600	3,600.00	12,960,000	
アズビル	64,000	2,923.00	187,072,000	
東亜ディーケーケー	5,100	853.00	4,350,300	
日本光電工業	44,700	3,100.00	138,570,000	
チノー	3,500	1,416.00	4,956,000	
共和電業	10,600	424.00	4,494,400	
日本電子材料	4,200	582.00	2,444,400	
堀場製作所	20,100	6,670.00	134,067,000	
アドバンテスト	69,100	5,110.00	353,101,000	
小野測器	4,200	514.00	2,158,800	
エスペック	9,000	1,894.00	17,046,000	
キーエンス	49,700	65,510.00	3,255,847,000	
日置電機	5,300	3,540.00	18,762,000	
シスメックス	79,000	6,999.00	552,921,000	
日本マイクロニクス	17,800	936.00	16,660,800	
メガチップス	8,000	1,773.00	14,184,000	
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	5,300	3,855.00	20,431,500	
ＩＭＡＧＩＣＡ　ＧＲＯＵＰ	8,500	541.00	4,598,500	
澤藤電機	1,300	1,803.00	2,343,900	
デンソー	223,200	4,861.00	1,084,975,200	
原田工業	3,700	855.00	3,163,500	
コーセル	12,400	1,120.00	13,888,000	
イリソ電子工業	9,300	5,090.00	47,337,000	
オプテックスグループ	16,700	1,678.00	28,022,600	
千代田インテグレ	4,500	2,258.00	10,161,000	
アイ・オー・データ機器	3,800	881.00	3,347,800	
レーザーテック	20,800	7,800.00	162,240,000	
スタンレー電気	71,500	2,961.00	211,711,500	
岩崎電気	4,000	1,357.00	5,428,000	
ウシオ電機	58,800	1,523.00	89,552,400	
岡谷電機産業	7,400	375.00	2,775,000	
ヘリオス　テクノ　ホールディング	9,500	590.00	5,605,000	
エノモト	2,500	1,048.00	2,620,000	
日本セラミック	10,200	2,749.00	28,039,800	
遠藤照明	5,200	676.00	3,515,200	
古河電池	7,400	627.00	4,639,800	
双信電機	5,200	426.00	2,215,200	

山一電機	7,400	1,332.00	9,856,800	
図研	6,600	1,872.00	12,355,200	
日本電子	20,000	2,696.00	53,920,000	
カシオ計算機	89,700	1,691.00	151,682,700	
ファナック	96,300	20,025.00	1,928,407,500	
日本シイエムケイ	25,900	639.00	16,550,100	
エンプラス	4,600	3,555.00	16,353,000	
大真空	3,800	1,054.00	4,005,200	
ローム	48,500	8,880.00	430,680,000	
浜松ホトニクス	72,700	4,110.00	298,797,000	
三井ハイテック	11,200	1,839.00	20,596,800	
新光電気工業	34,100	1,013.00	34,543,300	
京セラ	154,500	6,836.00	1,056,162,000	
協栄産業	1,200	1,346.00	1,615,200	
太陽誘電	45,100	2,727.00	122,987,700	
村田製作所	319,000	5,794.00	1,848,286,000	
双葉電子工業	15,900	1,355.00	21,544,500	
日東電工	69,900	5,479.00	382,982,100	
北陸電気工業	3,800	1,127.00	4,282,600	
東海理化電機製作所	26,600	1,900.00	50,540,000	
ニチコン	31,900	1,047.00	33,399,300	
日本ケミコン	7,200	1,685.00	12,132,000	
ＫＯＡ	15,300	1,399.00	21,404,700	
三井Ｅ＆Ｓホールディングス	36,700	1,012.00	37,140,400	
日立造船	80,300	355.00	28,506,500	
三菱重工業	169,800	4,318.00	733,196,400	
川崎重工業	78,800	2,499.00	196,921,200	
ＩＨＩ	77,900	2,503.00	194,983,700	
名村造船所	30,700	302.00	9,271,400	
サノヤスホールディングス	13,800	192.00	2,649,600	
スプリックス	3,200	1,433.00	4,585,600	
日本車輌製造	3,700	2,600.00	9,620,000	
三菱ロジスネクスト	16,800	1,026.00	17,236,800	
近畿車輌	1,700	1,444.00	2,454,800	
ＦＰＧ	31,500	1,080.00	34,020,000	
島根銀行	2,400	677.00	1,624,800	
じもとホールディングス	69,100	99.00	6,840,900	
全国保証	28,200	4,125.00	116,325,000	
めぶきフィナンシャルグループ	518,500	268.00	138,958,000	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	13,500	1,388.00	18,738,000	
九州フィナンシャルグループ	163,700	444.00	72,682,800	
かんぽ生命保険	35,400	1,668.00	59,047,200	
ゆうちょ銀行	282,700	1,047.00	295,986,900	
富山第一銀行	24,200	311.00	7,526,200	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	627,100	419.00	262,754,900	
ジェイリース	2,700	315.00	850,500	
西日本フィナンシャルホールディングス	62,900	780.00	49,062,000	
マーキュリアインベストメント	4,500	735.00	3,307,500	

イントラスト	3,000	717.00	2,151,000	
日本モーゲージサービス	1,500	1,215.00	1,822,500	
ＣＡＳＡ	4,000	1,208.00	4,832,000	
アルヒ	9,100	2,184.00	19,874,400	
プレミアグループ	5,800	1,851.00	10,735,800	
日産自動車	1,195,000	680.50	813,197,500	
いすゞ自動車	320,500	1,223.00	391,971,500	
トヨタ自動車	1,129,500	7,385.00	8,341,357,500	代用有価証券 500,000株
日野自動車	126,600	926.00	117,231,600	
三菱自動車工業	375,300	484.00	181,645,200	
エフテック	7,200	697.00	5,018,400	
レシップホールディングス	4,000	706.00	2,824,000	
ＧＭＢ	2,200	797.00	1,753,400	
ファルテック	1,900	775.00	1,472,500	
武蔵精密工業	24,700	1,411.00	34,851,700	
日産車体	19,800	922.00	18,255,600	
新明和工業	42,400	1,280.00	54,272,000	
極東開発工業	20,200	1,385.00	27,977,000	
日信工業	18,500	1,549.00	28,656,500	
トピー工業	8,400	2,059.00	17,295,600	
ティラド	3,700	1,970.00	7,289,000	
曙ブレーキ工業	56,100	231.00	12,959,100	
タチエス	16,700	1,355.00	22,628,500	
ＮＯＫ	54,300	1,674.00	90,898,200	
フタバ産業	28,300	753.00	21,309,900	
ＫＹＢ	10,500	3,260.00	34,230,000	
市光工業	15,200	812.00	12,342,400	
大同メタル工業	16,500	655.00	10,807,500	
プレス工業	50,200	472.00	23,694,400	
ミクニ	13,200	318.00	4,197,600	
太平洋工業	21,200	1,578.00	33,453,600	
ケーヒン	23,300	1,713.00	39,912,900	
河西工業	12,400	852.00	10,564,800	
アイシン精機	83,400	3,615.00	301,491,000	
マツダ	317,900	980.40	311,669,160	
今仙電機製作所	9,400	871.00	8,187,400	
本田技研工業	855,000	2,899.50	2,479,072,500	
スズキ	185,500	4,750.00	881,125,000	
ＳＵＢＡＲＵ	314,700	3,056.00	961,723,200	
安永	5,000	1,267.00	6,335,000	
ヤマハ発動機	132,200	2,081.00	275,108,200	
ショーワ	24,000	1,667.00	40,008,000	
小糸製作所	60,700	5,420.00	328,994,000	
ＴＢＫ	12,000	425.00	5,100,000	
エクセディ	13,700	2,161.00	29,605,700	
ミツバ	18,700	658.00	12,304,600	
豊田合成	32,700	2,214.00	72,397,800	
愛三工業	15,900	932.00	14,818,800	
盟和産業	1,600	1,104.00	1,766,400	

日本プラスト	7,900	708.00	5,593,200	
ヨロズ	9,500	1,379.00	13,100,500	
エフ・シー・シー	18,200	2,145.00	39,039,000	
新家工業	2,300	1,519.00	3,493,700	
シマノ	37,900	15,900.00	602,610,000	
テイ・エス　テック	23,500	3,395.00	79,782,500	
関西みらいフィナンシャルグループ	46,900	680.00	31,892,000	
三十三フィナンシャルグループ	8,700	1,611.00	14,015,700	
第四北越フィナンシャルグループ	17,300	2,738.00	47,367,400	
ジャムコ	5,100	1,502.00	7,660,200	
小野建	8,900	1,374.00	12,228,600	
はるやまホールディングス	4,500	811.00	3,649,500	
南陽	2,100	1,625.00	3,412,500	
ノジマ	17,800	1,867.00	33,232,600	
佐鳥電機	7,400	825.00	6,105,000	
カッパ・クリエイト	14,000	1,398.00	19,572,000	
エコートレーディング	2,300	528.00	1,214,400	
伯東	6,800	1,194.00	8,119,200	
コンドーテック	7,800	965.00	7,527,000	
中山福	5,700	534.00	3,043,800	
ライトオン	7,600	603.00	4,582,800	
ナガイレーベン	14,400	2,436.00	35,078,400	
ジーンズメイト	3,400	318.00	1,081,200	
三菱食品	10,800	2,795.00	30,186,000	
良品計画	141,400	2,276.00	321,826,400	
三城ホールディングス	12,600	282.00	3,553,200	
松田産業	7,300	1,446.00	10,555,800	
第一興商	14,800	5,090.00	75,332,000	
メディパルホールディングス	107,600	2,414.00	259,746,400	
アドヴァン	15,200	1,136.00	17,267,200	
ＳＰＫ	2,300	2,568.00	5,906,400	
萩原電気ホールディングス	3,700	2,764.00	10,226,800	
アルビス	3,800	2,390.00	9,082,000	
アズワン	7,200	8,870.00	63,864,000	
スズデン	3,500	1,337.00	4,679,500	
尾家産業	3,300	1,298.00	4,283,400	
シモジマ	6,100	1,167.00	7,118,700	
ドウシシャ	9,400	1,725.00	16,215,000	
小津産業	2,200	1,859.00	4,089,800	
コナカ	11,600	408.00	4,732,800	
高速	5,900	1,337.00	7,888,300	
ハウス　オブ　ローゼ	1,300	1,658.00	2,155,400	
Ｇ－７ホールディングス	3,000	3,645.00	10,935,000	
たけびし	3,500	1,395.00	4,882,500	
イオン北海道	9,700	772.00	7,488,400	
コジマ	16,700	442.00	7,381,400	
ヒマラヤ	3,500	823.00	2,880,500	
コーナン商事	13,000	2,502.00	32,526,000	
ネットワンシステムズ	35,200	2,919.00	102,748,800	
エコス	3,700	1,756.00	6,497,200	

ワタミ	13,200	1,412.00	18,638,400	
マルシェ	2,800	774.00	2,167,200	
リックス	2,300	1,560.00	3,588,000	
システムソフト	27,400	108.00	2,959,200	
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	1,742.00	416,860,600	
丸文	8,900	582.00	5,179,800	
西松屋チェーン	21,900	949.00	20,783,100	
ゼンショーホールディングス	48,500	2,370.00	114,945,000	
ハピネット	8,300	1,345.00	11,163,500	
幸楽苑ホールディングス	6,400	2,175.00	13,920,000	
ハークスレイ	2,000	1,019.00	2,038,000	
橋本総業ホールディングス	2,100	1,625.00	3,412,500	
日本ライフライン	29,600	1,719.00	50,882,400	
サイゼリヤ	16,500	2,603.00	42,949,500	
タカショー	5,000	470.00	2,350,000	
エクセル	3,800	1,204.00	4,575,200	
ＶＴホールディングス	45,200	456.00	20,611,200	
マルカ	3,600	2,158.00	7,768,800	
アルゴグラフィックス	8,500	2,578.00	21,913,000	
魚力	2,800	1,503.00	4,208,400	
ＩＤＯＭ	33,900	471.00	15,966,900	
日本エム・ディ・エム	5,900	1,868.00	11,021,200	
ポプラ	2,900	502.00	1,455,800	
フジ・コーポレーション	2,300	2,101.00	4,832,300	
ユナイテッドアローズ	11,400	3,230.00	36,822,000	
進和	5,900	2,276.00	13,428,400	
エスケイジャパン	2,600	435.00	1,131,000	
ダイトロン	4,300	1,379.00	5,929,700	
ハイデイ日高	14,400	2,114.00	30,441,600	
シークス	12,700	1,586.00	20,142,200	
京都きもの友禅	6,900	373.00	2,573,700	
コロワイド	33,200	2,121.00	70,417,200	
ピーシーデポコーポレーション	13,400	488.00	6,539,200	
田中商事	3,500	651.00	2,278,500	
オーハシテクニカ	5,700	1,422.00	8,105,400	
壱番屋	7,000	5,240.00	36,680,000	
白銅	3,300	1,317.00	4,346,100	
トップカルチャー	4,200	356.00	1,495,200	
ＰＬＡＮＴ	2,700	704.00	1,900,800	
スギホールディングス	21,900	6,050.00	132,495,000	
薬王堂ホールディングス	4,400	2,605.00	11,462,000	
島津製作所	130,400	2,695.00	351,428,000	
ＪＭＳ	9,400	650.00	6,110,000	
クボテック	2,400	419.00	1,005,600	
長野計器	8,000	689.00	5,512,000	
ブイ・テクノロジー	4,800	5,710.00	27,408,000	
スター精密	15,900	1,621.00	25,773,900	
東京計器	6,400	902.00	5,772,800	
愛知時計電機	1,300	4,030.00	5,239,000	

インターアクション	5,300	1,946.00	10,313,800	
オーバル	10,200	242.00	2,468,400	
東京精密	18,400	3,330.00	61,272,000	
マニー	40,400	2,600.00	105,040,000	
ニコン	176,600	1,378.00	243,354,800	
トプコン	54,400	1,402.00	76,268,800	
オリンパス	604,000	1,482.00	895,128,000	
理研計器	8,900	2,120.00	18,868,000	
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	17,600	7,000.00	123,200,000	
キヤノン電子	10,500	1,853.00	19,456,500	
タムロン	8,200	2,352.00	19,286,400	
ＨＯＹＡ	204,100	9,000.00	1,836,900,000	
シード	4,400	842.00	3,704,800	
ノーリツ鋼機	8,000	1,539.00	12,312,000	
エー・アンド・デイ	9,300	774.00	7,198,200	
朝日インテック	86,100	2,850.00	245,385,000	
キヤノン	545,500	2,908.50	1,586,586,750	
リコー	304,600	977.00	297,594,200	
シチズン時計	110,700	553.00	61,217,100	
リズム時計工業	3,600	1,029.00	3,704,400	
大研医器	8,300	510.00	4,233,000	
メニコン	13,900	3,815.00	53,028,500	
シンシア	1,200	625.00	750,000	
中本パックス	2,900	1,450.00	4,205,000	
スノーピーク	4,400	1,215.00	5,346,000	
パラマウントベッドホールディングス	11,600	4,010.00	46,516,000	
トランザクション	6,100	912.00	5,563,200	
ＳＨＯ‐ＢＩ	3,100	385.00	1,193,500	
ニホンフラッシュ	4,400	2,686.00	11,818,400	
前田工繊	11,200	1,688.00	18,905,600	
永大産業	13,300	337.00	4,482,100	
アートネイチャー	10,700	657.00	7,029,900	
バンダイナムコホールディングス	104,800	6,830.00	715,784,000	
アイフィスジャパン	2,800	802.00	2,245,600	
共立印刷	18,200	159.00	2,893,800	
ＳＨＯＥＩ	4,900	4,665.00	22,858,500	
フランスベッドホールディングス	14,200	1,011.00	14,356,200	
マーベラス	15,100	795.00	12,004,500	
パイロットコーポレーション	17,700	4,130.00	73,101,000	
萩原工業	5,700	1,625.00	9,262,500	
エイベックス	17,000	1,287.00	21,879,000	
トッパン・フォームズ	21,700	1,031.00	22,372,700	
フジシールインターナショナル	22,800	2,661.00	60,670,800	
タカラトミー	42,500	1,187.00	50,447,500	
廣済堂	9,500	719.00	6,830,500	
エステールホールディングス	2,700	648.00	1,749,600	
アーク	39,100	94.00	3,675,400	
レック	10,900	1,002.00	10,921,800	
タカノ	4,000	805.00	3,220,000	
三光合成	9,300	359.00	3,338,700	

プロネクサス	8,800	1,137.00	10,005,600	
ホクシン	7,500	171.00	1,282,500	
ウッドワン	3,500	1,124.00	3,934,000	
大建工業	7,700	1,935.00	14,899,500	
きもと	17,800	174.00	3,097,200	
凸版印刷	150,600	1,952.00	293,971,200	
大日本印刷	142,900	2,790.00	398,691,000	
共同印刷	3,100	2,639.00	8,180,900	
ＮＩＳＳＨＡ	20,900	1,155.00	24,139,500	
光村印刷	900	1,730.00	1,557,000	
藤森工業	9,100	3,400.00	30,940,000	
ヴィア・ホールディングス	12,300	649.00	7,982,700	
宝印刷	5,000	1,694.00	8,470,000	
前澤化成工業	6,900	1,124.00	7,755,600	
未来工業	5,500	2,097.00	11,533,500	
アシックス	83,700	1,773.00	148,400,100	
ツツミ	3,200	1,938.00	6,201,600	
ウェーブロックホールディングス	2,500	801.00	2,002,500	
ＪＳＰ	5,900	1,863.00	10,991,700	
ニチハ	14,100	3,000.00	42,300,000	
エフピコ	11,100	6,540.00	72,594,000	
小松ウオール工業	3,100	2,014.00	6,243,400	
ヤマハ	60,300	4,910.00	296,073,000	
河合楽器製作所	3,100	2,976.00	9,225,600	
クリナップ	9,400	564.00	5,301,600	
ピジョン	61,300	4,765.00	292,094,500	
天馬	6,700	1,987.00	13,312,900	
兼松サステック	700	1,752.00	1,226,400	
キングジム	8,300	862.00	7,154,600	
象印マホービン	29,700	1,502.00	44,609,400	
リンテック	24,100	2,242.00	54,032,200	
信越ポリマー	18,100	796.00	14,407,600	
東リ	25,200	258.00	6,501,600	
イトーキ	20,100	467.00	9,386,700	
任天堂	58,000	40,150.00	2,328,700,000	
三菱鉛筆	16,600	1,758.00	29,182,800	
松風	5,000	1,475.00	7,375,000	
タカラスタンダード	20,800	1,869.00	38,875,200	
コクヨ	48,500	1,547.00	75,029,500	
ナカバヤシ	9,900	529.00	5,237,100	
ニフコ	40,600	2,636.00	107,021,600	
立川ブラインド工業	4,400	1,370.00	6,028,000	
グローブライド	4,900	2,653.00	12,999,700	
オカムラ	35,300	1,058.00	37,347,400	
バルカー	8,300	2,215.00	18,384,500	
ＭＵＴＯＨホールディングス	1,400	1,701.00	2,381,400	
伊藤忠商事	698,300	2,264.50	1,581,300,350	
丸紅	984,300	746.10	734,386,230	
スクロール	15,600	333.00	5,194,800	
高島	1,600	1,681.00	2,689,600	

ヨンドシーホールディングス	11,000	2,635.00	28,985,000	
三陽商会	5,200	1,441.00	7,493,200	
長瀬産業	55,900	1,572.00	87,874,800	
ナイガイ	4,000	486.00	1,944,000	
蝶理	6,300	1,682.00	10,596,600	
豊田通商	111,400	3,530.00	393,242,000	
オンワードホールディングス	59,400	602.00	35,758,800	
三共生興	16,900	520.00	8,788,000	
兼松	39,800	1,249.00	49,710,200	
美津濃	10,000	2,876.00	28,760,000	
ツカモトコーポレーション	1,800	1,056.00	1,900,800	
ファミリーマート	111,700	2,761.00	308,403,700	
ルックホールディングス	3,400	1,103.00	3,750,200	
三井物産	822,500	1,774.50	1,459,526,250	
日本紙パルプ商事	5,600	3,840.00	21,504,000	
東京エレクトロン	67,600	21,805.00	1,474,018,000	
日立ハイテクノロジーズ	30,300	6,400.00	193,920,000	
カメイ	12,900	1,133.00	14,615,700	
東都水産	1,400	2,632.00	3,684,800	
ＯＵＧホールディングス	1,600	2,761.00	4,417,600	
スターゼン	3,700	4,560.00	16,872,000	
セイコーホールディングス	15,600	2,450.00	38,220,000	
山善	38,900	949.00	36,916,100	
椿本興業	2,300	3,920.00	9,016,000	
住友商事	590,300	1,696.50	1,001,443,950	
日本ユニシス	31,100	3,560.00	110,716,000	
内田洋行	4,300	4,180.00	17,974,000	
三菱商事	700,600	2,694.50	1,887,766,700	
第一実業	4,600	3,235.00	14,881,000	
キヤノンマーケティングジャパン	28,500	2,293.00	65,350,500	
西華産業	5,600	1,353.00	7,576,800	
佐藤商事	8,900	831.00	7,395,900	
菱洋エレクトロ	10,100	1,901.00	19,200,100	
東京産業	10,100	507.00	5,120,700	
ユアサ商事	10,200	3,225.00	32,895,000	
神鋼商事	2,200	2,380.00	5,236,000	
小林産業	6,700	325.00	2,177,500	
阪和興業	17,300	3,040.00	52,592,000	
正栄食品工業	6,500	3,305.00	21,482,500	
カナデン	9,000	1,255.00	11,295,000	
菱電商事	7,900	1,519.00	12,000,100	
ニプロ	70,000	1,236.00	86,520,000	
フルサト工業	5,500	1,577.00	8,673,500	
岩谷産業	22,100	3,695.00	81,659,500	
すてきナイスグループ	4,400	832.00	3,660,800	
昭光通商	3,600	637.00	2,293,200	
ニチモウ	1,600	1,864.00	2,982,400	
極東貿易	3,100	1,822.00	5,648,200	
イワキ	13,300	478.00	6,357,400	
兼松エレクトロニクス	5,400	3,160.00	17,064,000	

三愛石油	26,700	1,072.00	28,622,400	
稲畑産業	23,900	1,351.00	32,288,900	
ＧＳＩクレオス	2,700	1,068.00	2,883,600	
明和産業	9,400	514.00	4,831,600	
キムラタン	52,700	35.00	1,844,500	
ゴールドウイン	18,000	8,390.00	151,020,000	
ユニ・チャーム	195,400	3,500.00	683,900,000	
デサント	24,200	1,366.00	33,057,200	
キング	5,400	546.00	2,948,400	
ワキタ	21,200	1,076.00	22,811,200	
ヤマトインターナショナル	6,000	392.00	2,352,000	
東邦ホールディングス	29,500	2,534.00	74,753,000	
サンゲツ	29,300	2,030.00	59,479,000	
ミツウロコグループホールディングス	13,300	1,089.00	14,483,700	
シナネンホールディングス	4,100	1,858.00	7,617,800	
伊藤忠エネクス	21,700	830.00	18,011,000	
サンリオ	30,800	2,127.00	65,511,600	
サンワ　テクノス	6,200	906.00	5,617,200	
リョーサン	11,000	2,808.00	30,888,000	
新光商事	18,700	913.00	17,073,100	
トーホー	4,500	1,692.00	7,614,000	
三信電気	6,800	1,517.00	10,315,600	
東陽テクニカ	11,400	1,040.00	11,856,000	
モスフードサービス	13,100	2,686.00	35,186,600	
加賀電子	10,000	2,046.00	20,460,000	
三益半導体工業	9,000	1,936.00	17,424,000	
ソーダニッカ	10,500	593.00	6,226,500	
立花エレテック	7,300	1,735.00	12,665,500	
木曽路	12,200	2,750.00	33,550,000	
ＳＲＳホールディングス	11,700	1,030.00	12,051,000	
千趣会	18,300	279.00	5,105,700	
タカキュー	8,200	182.00	1,492,400	
ケーヨー	18,300	513.00	9,387,900	
上新電機	11,800	2,233.00	26,349,400	
日本瓦斯	15,800	3,295.00	52,061,000	
ロイヤルホールディングス	17,400	2,743.00	47,728,200	
東天紅	800	1,239.00	991,200	
いなげや	11,100	1,511.00	16,772,100	
島忠	21,100	2,900.00	61,190,000	
チヨダ	10,400	1,591.00	16,546,400	
ライフコーポレーション	7,500	2,596.00	19,470,000	
リンガーハット	12,300	2,487.00	30,590,100	
ＭｒＭａｘＨＤ	13,800	471.00	6,499,800	
テンアライド	9,600	433.00	4,156,800	
ＡＯＫＩホールディングス	19,800	1,095.00	21,681,000	
オークワ	14,200	1,337.00	18,985,400	
コメリ	15,400	2,281.00	35,127,400	
青山商事	17,300	1,920.00	33,216,000	
しまむら	11,600	9,320.00	108,112,000	
はせがわ	5,300	402.00	2,130,600	

高島屋	78,300	1,228.00	96,152,400	
松屋	20,200	888.00	17,937,600	
エイチ・ツー・オー　リテイリング	51,100	1,236.00	63,159,600	
近鉄百貨店	3,800	3,220.00	12,236,000	
パルコ	9,500	1,291.00	12,264,500	
丸井グループ	84,500	2,339.00	197,645,500	
クレディセゾン	70,100	1,484.00	104,028,400	
アクシアル　リテイリング	8,300	4,235.00	35,150,500	
井筒屋	5,700	259.00	1,476,300	
イオン	384,100	2,209.50	848,668,950	
イズミ	20,300	4,260.00	86,478,000	
フォーバル	4,400	993.00	4,369,200	
平和堂	20,200	2,083.00	42,076,600	
フジ	12,000	1,957.00	23,484,000	
ヤオコー	11,300	4,995.00	56,443,500	
ゼビオホールディングス	12,000	1,211.00	14,532,000	
ケーズホールディングス	103,800	1,211.00	125,701,800	
ＰＡＬＴＡＣ	18,000	5,350.00	96,300,000	
三谷産業	11,900	303.00	3,605,700	
Ｏｌｙｍｐｉｃグループ	5,900	602.00	3,551,800	
日産東京販売ホールディングス	14,800	299.00	4,425,200	
新生銀行	73,500	1,608.00	118,188,000	
あおぞら銀行	55,900	2,643.00	147,743,700	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	6,881,600	543.20	3,738,085,120	
りそなホールディングス	1,097,300	456.10	500,478,530	
三井住友トラスト・ホールディングス	196,500	3,797.00	746,110,500	
三井住友フィナンシャルグループ	704,500	3,721.00	2,621,444,500	
千葉銀行	343,800	557.00	191,496,600	
群馬銀行	199,800	358.00	71,528,400	
武蔵野銀行	14,800	1,862.00	27,557,600	
千葉興業銀行	27,800	302.00	8,395,600	
筑波銀行	42,400	191.00	8,098,400	
七十七銀行	31,400	1,637.00	51,401,800	
青森銀行	7,700	2,747.00	21,151,900	
秋田銀行	6,400	2,096.00	13,414,400	
山形銀行	11,200	1,436.00	16,083,200	
岩手銀行	7,000	2,485.00	17,395,000	
東邦銀行	89,000	252.00	22,428,000	
東北銀行	5,300	1,003.00	5,315,900	
みちのく銀行	6,400	1,618.00	10,355,200	
ふくおかフィナンシャルグループ	88,100	2,022.00	178,138,200	
静岡銀行	247,500	804.00	198,990,000	
十六銀行	13,400	2,406.00	32,240,400	
スルガ銀行	102,500	436.00	44,690,000	
八十二銀行	241,100	459.00	110,664,900	
山梨中央銀行	12,100	1,045.00	12,644,500	
大垣共立銀行	21,000	2,506.00	52,626,000	
福井銀行	8,600	1,421.00	12,220,600	
北國銀行	10,300	2,948.00	30,364,400	
清水銀行	4,100	1,879.00	7,703,900	

富山銀行	2,000	2,493.00	4,986,000	
滋賀銀行	20,000	2,547.00	50,940,000	
南都銀行	15,600	2,565.00	40,014,000	
百五銀行	89,800	346.00	31,070,800	
京都銀行	35,800	4,130.00	147,854,000	
紀陽銀行	35,400	1,719.00	60,852,600	
ほくほくフィナンシャルグループ	66,300	1,062.00	70,410,600	
広島銀行	147,300	547.00	80,573,100	
山陰合同銀行	59,200	664.00	39,308,800	
中国銀行	85,900	1,049.00	90,109,100	
鳥取銀行	3,500	1,414.00	4,949,000	
伊予銀行	132,100	568.00	75,032,800	
百十四銀行	10,600	2,144.00	22,726,400	
四国銀行	14,200	976.00	13,859,200	
阿波銀行	15,300	2,518.00	38,525,400	
大分銀行	6,100	2,842.00	17,336,200	
宮崎銀行	6,600	2,554.00	16,856,400	
佐賀銀行	6,100	1,517.00	9,253,700	
沖縄銀行	9,100	3,515.00	31,986,500	
琉球銀行	23,100	1,153.00	26,634,300	
セブン銀行	334,100	305.00	101,900,500	
みずほフィナンシャルグループ	13,582,600	164.40	2,232,979,440	
高知銀行	3,800	797.00	3,028,600	
山口フィナンシャルグループ	124,800	753.00	93,974,400	
芙蓉総合リース	11,400	6,680.00	76,152,000	
みずほリース	18,800	3,005.00	56,494,000	
東京センチュリー	20,100	5,010.00	100,701,000	
ＳＢＩホールディングス	119,100	2,292.00	272,977,200	
日本証券金融	44,000	511.00	22,484,000	
アイフル	153,500	247.00	37,914,500	
日本アジア投資	9,600	292.00	2,803,200	
長野銀行	3,300	1,631.00	5,382,300	
名古屋銀行	8,000	3,175.00	25,400,000	
北洋銀行	150,800	233.00	35,136,400	
愛知銀行	3,600	3,530.00	12,708,000	
中京銀行	4,000	2,128.00	8,512,000	
大光銀行	3,500	1,616.00	5,656,000	
愛媛銀行	13,900	1,089.00	15,137,100	
トマト銀行	3,900	1,048.00	4,087,200	
京葉銀行	42,500	659.00	28,007,500	
栃木銀行	52,600	198.00	10,414,800	
北日本銀行	3,200	1,774.00	5,676,800	
東和銀行	17,600	841.00	14,801,600	
福島銀行	9,800	218.00	2,136,400	
大東銀行	4,900	580.00	2,842,000	
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	1,605.00	102,399,000	
アコム	201,100	434.00	87,277,400	
ジャックス	11,000	2,291.00	25,201,000	
オリエントコーポレーション	270,800	147.00	39,807,600	

日立キャピタル	23,500	2,387.00	56,094,500	
アプラスフィナンシャル	49,300	77.00	3,796,100	
オリックス	666,900	1,660.00	1,107,054,000	
三菱ＵＦＪリース	225,200	656.00	147,731,200	
ジャフコ	16,400	4,240.00	69,536,000	
九州リースサービス	5,000	598.00	2,990,000	
トモニホールディングス	77,300	360.00	27,828,000	
大和証券グループ本社	801,400	496.60	397,975,240	
野村ホールディングス	1,759,200	489.00	860,248,800	
岡三証券グループ	84,600	386.00	32,655,600	
丸三証券	29,800	498.00	14,840,400	
東洋証券	37,400	176.00	6,582,400	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	114,800	311.00	35,702,800	
光世証券	2,700	663.00	1,790,100	
水戸証券	29,700	257.00	7,632,900	
いちよし証券	20,000	679.00	13,580,000	
松井証券	48,800	888.00	43,334,400	
ＳＯＭＰＯホールディングス	176,200	4,240.00	747,088,000	
だいこう証券ビジネス	4,100	557.00	2,283,700	
日本取引所グループ	270,100	1,780.00	480,778,000	
マネックスグループ	92,400	264.00	24,393,600	
極東証券	13,400	882.00	11,818,800	
岩井コスモホールディングス	10,100	1,124.00	11,352,400	
藍澤證券	17,900	717.00	12,834,300	
フィデアホールディングス	97,500	119.00	11,602,500	
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	4,000.00	33,200,000	
ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホールディングス	261,300	3,429.00	895,997,700	
ソニーフィナンシャルホールディングス	82,100	2,257.00	185,299,700	
マネーパートナーズグループ	11,900	253.00	3,010,700	
スパークス・グループ	39,900	255.00	10,174,500	
小林洋行	3,100	245.00	759,500	
第一生命ホールディングス	565,600	1,718.50	971,983,600	
東京海上ホールディングス	357,500	5,676.00	2,029,170,000	
アドバンテッジリスクマネジメント	4,100	833.00	3,415,300	
イー・ギャランティ	9,400	1,413.00	13,282,200	
アサックス	4,200	605.00	2,541,000	
ＮＥＣキャピタルソリューション	4,000	2,172.00	8,688,000	
Ｔ＆Ｄホールディングス	309,200	1,195.50	369,648,600	
アドバンスクリエイト	2,400	1,760.00	4,224,000	
三井不動産	530,500	2,738.50	1,452,774,250	
三菱地所	700,500	2,110.50	1,478,405,250	
平和不動産	18,400	2,682.00	49,348,800	
東京建物	109,400	1,520.00	166,288,000	
ダイビル	29,500	1,194.00	35,223,000	
京阪神ビルディング	17,600	1,303.00	22,932,800	
住友不動産	224,800	3,973.00	893,130,400	

太平洋興発	4,100	785.00	3,218,500	
テーオーシー	23,000	821.00	18,883,000	
東京楽天地	1,400	5,880.00	8,232,000	
レオパレス２１	123,500	273.00	33,715,500	
スターツコーポレーション	13,600	2,748.00	37,372,800	
フジ住宅	12,900	672.00	8,668,800	
空港施設	11,600	535.00	6,206,000	
明和地所	5,900	549.00	3,239,100	
ゴールドクレスト	7,900	2,190.00	17,301,000	
リログループ	53,000	2,610.00	138,330,000	
エスリード	4,000	1,693.00	6,772,000	
日神不動産	14,900	481.00	7,166,900	
日本エスコン	18,200	915.00	16,653,000	
タカラレーベン	46,000	423.00	19,458,000	
サンヨーハウジング名古屋	5,800	932.00	5,405,600	
イオンモール	50,200	1,783.00	89,506,600	
ファースト住建	4,200	1,355.00	5,691,000	
ランド	423,900	8.00	3,391,200	
カチタス	11,200	4,290.00	48,048,000	
東祥	6,100	2,204.00	13,444,400	
トーセイ	13,800	1,383.00	19,085,400	
穴吹興産	1,100	2,835.00	3,118,500	
サンフロンティア不動産	14,000	1,333.00	18,662,000	
エフ・ジェー・ネクスト	8,900	1,078.00	9,594,200	
インテリックス	3,000	750.00	2,250,000	
ランドビジネス	4,300	759.00	3,263,700	
日本社宅サービス	2,700	1,058.00	2,856,600	
グランディハウス	9,100	482.00	4,386,200	
東武鉄道	106,800	3,625.00	387,150,000	
相鉄ホールディングス	34,700	2,915.00	101,150,500	
東急	275,300	2,091.00	575,652,300	
京浜急行電鉄	138,900	2,166.00	300,857,400	
小田急電鉄	162,400	2,638.00	428,411,200	
京王電鉄	56,600	6,840.00	387,144,000	
京成電鉄	76,000	4,540.00	345,040,000	
富士急行	13,800	4,570.00	63,066,000	
新京成電鉄	2,600	2,126.00	5,527,600	
東日本旅客鉄道	178,400	10,485.00	1,870,524,000	
西日本旅客鉄道	90,300	9,213.00	831,933,900	
東海旅客鉄道	90,800	22,810.00	2,071,148,000	
西武ホールディングス	125,500	1,931.00	242,340,500	
鴻池運輸	16,100	1,651.00	26,581,100	
西日本鉄道	28,000	2,442.00	68,376,000	
ハマキョウレックス	7,800	3,530.00	27,534,000	
サカイ引越センター	5,300	6,530.00	34,609,000	
近鉄グループホールディングス	96,000	5,830.00	559,680,000	
阪急阪神ホールディングス	128,000	4,325.00	553,600,000	
南海電気鉄道	42,800	2,814.00	120,439,200	
京阪ホールディングス	42,800	4,970.00	212,716,000	
神戸電鉄	2,500	3,950.00	9,875,000	

名古屋鉄道	78,900	3,370.00	265,893,000	
山陽電気鉄道	7,400	2,183.00	16,154,200	
トランコム	2,700	6,170.00	16,659,000	
日本通運	37,000	5,670.00	209,790,000	
ヤマトホールディングス	168,300	1,712.50	288,213,750	
山九	26,700	5,880.00	156,996,000	
日新	8,300	1,594.00	13,230,200	
丸運	5,900	264.00	1,557,600	
丸全昭和運輸	7,800	3,010.00	23,478,000	
センコーグループホールディングス	52,800	858.00	45,302,400	
トナミホールディングス	2,300	4,615.00	10,614,500	
ニッコンホールディングス	36,400	2,563.00	93,293,200	
日本石油輸送	1,200	2,818.00	3,381,600	
福山通運	12,300	3,875.00	47,662,500	
セイノーホールディングス	71,800	1,385.00	99,443,000	
エスライン	3,000	906.00	2,718,000	
神奈川中央交通	2,400	3,865.00	9,276,000	
日立物流	21,100	3,245.00	68,469,500	
丸和運輸機関	10,100	2,799.00	28,269,900	
Ｃ＆Ｆロジホールディングス	9,700	1,261.00	12,231,700	
日本郵船	80,200	1,900.00	152,380,000	
商船三井	56,900	2,985.00	169,846,500	
川崎汽船	29,600	1,522.00	45,051,200	
ＮＳユナイテッド海運	5,300	2,394.00	12,688,200	
明治海運	10,200	323.00	3,294,600	
飯野海運	45,200	356.00	16,091,200	
共栄タンカー	800	1,464.00	1,171,200	
九州旅客鉄道	80,600	3,515.00	283,309,000	
ＳＧホールディングス	90,700	2,672.00	242,350,400	
日本航空	175,700	3,342.00	587,189,400	
ＡＮＡホールディングス	175,500	3,721.00	653,035,500	
パスコ	2,000	995.00	1,990,000	
西本Ｗｉｓｍｅｔｔａｃホールディングス	1,800	3,730.00	6,714,000	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	900	1,339.00	1,205,100	
Ｇｅｎｋｙ　ＤｒｕｇＳｔｏｒｅｓ	4,500	2,379.00	10,705,500	
国際紙パルプ商事	19,700	312.00	6,146,400	
総合メディカルホールディングス	8,700	1,680.00	14,616,000	
ブックオフグループホールディングス	5,300	1,132.00	5,999,600	
三菱倉庫	33,200	2,744.00	91,100,800	
三井倉庫ホールディングス	11,800	1,715.00	20,237,000	
住友倉庫	35,200	1,490.00	52,448,000	
澁澤倉庫	5,300	1,994.00	10,568,200	
ヤマタネ	5,000	1,393.00	6,965,000	
東陽倉庫	17,700	329.00	5,823,300	
乾汽船	8,700	1,156.00	10,057,200	
日本トランスシティ	21,200	514.00	10,896,800	
ケイヒン	1,800	1,269.00	2,284,200	
中央倉庫	5,900	1,143.00	6,743,700	
川西倉庫	2,000	1,115.00	2,230,000	

安田倉庫	7,900	960.00	7,584,000	
東洋埠頭	3,000	1,360.00	4,080,000	
宇徳	8,300	517.00	4,291,100	
上組	59,100	2,465.00	145,681,500	
サンリツ	2,300	664.00	1,527,200	
キムラユニティー	2,600	1,017.00	2,644,200	
キユーソー流通システム	2,400	1,834.00	4,401,600	
近鉄エクスプレス	18,100	1,617.00	29,267,700	
東海運	6,000	291.00	1,746,000	
エーアイテイー	6,400	971.00	6,214,400	
内外トランスライン	3,500	1,343.00	4,700,500	
日本コンセプト	3,100	1,425.00	4,417,500	
東京放送ホールディングス	66,000	1,762.00	116,292,000	
日本テレビホールディングス	91,200	1,411.00	128,683,200	
朝日放送グループホールディングス	9,600	722.00	6,931,200	
テレビ朝日ホールディングス	27,200	1,701.00	46,267,200	
スカパーＪＳＡＴホールディングス	65,000	447.00	29,055,000	
テレビ東京ホールディングス	8,200	2,234.00	18,318,800	
日本ＢＳ放送	3,500	1,079.00	3,776,500	
ビジョン	9,400	1,629.00	15,312,600	
スマートバリュー	3,200	750.00	2,400,000	
ＵＳＥＮ－ＮＥＸＴ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	3,800	966.00	3,670,800	
ワイヤレスゲート	5,000	699.00	3,495,000	
コネクシオ	7,000	1,408.00	9,856,000	
日本通信	87,400	191.00	16,693,400	
クロップス	2,000	625.00	1,250,000	
日本電信電話	680,300	5,418.00	3,685,865,400	
ＫＤＤＩ	815,400	2,970.00	2,421,738,000	
ソフトバンク	1,054,600	1,507.50	1,589,809,500	
光通信	11,700	23,240.00	271,908,000	
ＮＴＴドコモ	629,700	2,865.50	1,804,405,350	
エムティーアイ	9,800	723.00	7,085,400	
GMOインターネット	39,300	1,772.00	69,639,600	
ファイバーゲート	1,900	1,463.00	2,779,700	
アイドママーケティングコミュニケーション	2,600	600.00	1,560,000	
ＫＡＤＯＫＡＷＡ	29,100	1,504.00	43,766,400	
学研ホールディングス	3,300	5,550.00	18,315,000	
ゼンリン	19,900	1,795.00	35,720,500	
昭文社	5,200	396.00	2,059,200	
インプレスホールディングス	9,500	147.00	1,396,500	
東京電力ホールディングス	809,200	540.00	436,968,000	
中部電力	310,100	1,634.00	506,703,400	
関西電力	413,600	1,266.00	523,617,600	
中国電力	140,100	1,446.00	202,584,600	
北陸電力	99,400	748.00	74,351,200	
東北電力	237,300	1,104.00	261,979,200	
四国電力	91,300	1,056.00	96,412,800	
九州電力	208,900	1,079.00	225,403,100	

北海道電力	94,900	580.00	55,042,000	
沖縄電力	18,800	1,787.00	33,595,600	
電源開発	80,600	2,578.00	207,786,800	
エフオン	5,100	721.00	3,677,100	
イーレックス	17,700	1,302.00	23,045,400	
レノバ	16,800	931.00	15,640,800	
東京瓦斯	194,900	2,797.00	545,135,300	
大阪瓦斯	196,600	2,097.00	412,270,200	
東邦瓦斯	50,200	4,295.00	215,609,000	
北海道瓦斯	5,400	1,576.00	8,510,400	
広島ガス	20,500	345.00	7,072,500	
西部瓦斯	11,400	2,408.00	27,451,200	
静岡ガス	28,800	933.00	26,870,400	
メタウォーター	4,900	3,680.00	18,032,000	
アイネット	5,700	1,412.00	8,048,400	
松竹	6,600	14,600.00	96,360,000	
東宝	65,400	4,665.00	305,091,000	
エイチ・アイ・エス	15,100	2,709.00	40,905,900	
東映	4,200	15,200.00	63,840,000	
ラックランド	2,000	2,325.00	4,650,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	264,900	1,433.00	379,601,700	
共立メンテナンス	14,800	4,525.00	66,970,000	
イチネンホールディングス	10,300	1,270.00	13,081,000	
建設技術研究所	6,800	1,698.00	11,546,400	
スペース	6,200	1,267.00	7,855,400	
長　大	3,700	1,004.00	3,714,800	
アインホールディングス	13,400	6,120.00	82,008,000	
燦ホールディングス	4,300	1,090.00	4,687,000	
ピー・シー・エー	1,300	3,835.00	4,985,500	
スバル興業	700	7,070.00	4,949,000	
東京テアトル	3,900	1,387.00	5,409,300	
タナベ経営	2,000	1,253.00	2,506,000	
ビジネスブレイン太田昭和	1,700	2,637.00	4,482,900	
ナガワ	2,700	6,070.00	16,389,000	
よみうりランド	2,100	4,525.00	9,502,500	
東京都競馬	6,300	3,445.00	21,703,500	
常磐興産	3,900	1,686.00	6,575,400	
カナモト	15,900	2,871.00	45,648,900	
東京ドーム	36,300	986.00	35,791,800	
ＤＴＳ	22,300	2,290.00	51,067,000	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	46,300	5,060.00	234,278,000	
シーイーシー	10,700	2,058.00	22,020,600	
カプコン	42,700	2,819.00	120,371,300	
西尾レントオール	9,800	2,878.00	28,204,400	
アイ・エス・ビー	2,000	1,604.00	3,208,000	
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	5,140.00	163,966,000	
トランス・コスモス	10,800	2,675.00	28,890,000	

乃村工藝社	45,400	1,345.00	61,063,000	
ジャステック	6,200	1,105.00	6,851,000	
ＳＣＳＫ	26,200	5,200.00	136,240,000	
藤田観光	4,200	2,827.00	11,873,400	
ＫＮＴ－ＣＴホールディングス	5,200	1,599.00	8,314,800	
日本管財	10,400	1,896.00	19,718,400	
トーカイ	9,400	2,328.00	21,883,200	
白洋舎	1,100	2,901.00	3,191,100	
セコム	102,800	9,834.00	1,010,935,200	
日本システムウエア	3,300	2,390.00	7,887,000	
セントラル警備保障	4,700	6,080.00	28,576,000	
アイネス	12,700	1,165.00	14,795,500	
丹青社	18,300	1,168.00	21,374,400	
メイテック	12,000	5,380.00	64,560,000	
ＴＫＣ	8,400	4,580.00	38,472,000	
富士ソフト	12,800	4,605.00	58,944,000	
応用地質	10,400	1,193.00	12,407,200	
船井総研ホールディングス	20,100	2,515.00	50,551,500	
ＮＳＤ	16,400	3,165.00	51,906,000	
進学会ホールディングス	4,800	501.00	2,404,800	
丸紅建材リース	1,100	1,734.00	1,907,400	
オオバ	7,900	708.00	5,593,200	
コナミホールディングス	40,600	5,000.00	203,000,000	
いであ	2,000	1,387.00	2,774,000	
学究社	3,300	1,257.00	4,148,100	
ベネッセホールディングス	35,500	2,880.00	102,240,000	
イオンディライト	12,000	3,605.00	43,260,000	
ナック	6,200	982.00	6,088,400	
福井コンピュータホールディングス	3,300	2,502.00	8,256,600	
ニチイ学館	13,800	1,797.00	24,798,600	
ダイセキ	16,300	2,834.00	46,194,200	
ステップ	3,600	1,420.00	5,112,000	
日鉄物産	7,100	4,445.00	31,559,500	
泉州電業	3,100	2,806.00	8,698,600	
元気寿司	2,800	2,711.00	7,590,800	
トラスコ中山	20,800	2,618.00	54,454,400	
ヤマダ電機	303,900	509.00	154,685,100	
オートバックスセブン	39,600	1,776.00	70,329,600	
モリト	7,200	790.00	5,688,000	
アークランドサカモト	16,900	1,246.00	21,057,400	
ニトリホールディングス	43,200	15,880.00	686,016,000	
グルメ杵屋	7,100	1,176.00	8,349,600	
愛眼	8,200	245.00	2,009,000	
ケーユーホールディングス	5,200	850.00	4,420,000	
吉野家ホールディングス	34,900	2,670.00	93,183,000	
加藤産業	15,600	3,450.00	53,820,000	
北恵	2,000	1,027.00	2,054,000	
イノテック	6,000	909.00	5,454,000	
イエローハット	18,900	1,618.00	30,580,200	
松屋フーズホールディングス	4,800	4,035.00	19,368,000	

ＪＢＣＣホールディングス	7,900	1,521.00	12,015,900	
ＪＫホールディングス	9,100	543.00	4,941,300	
サガミホールディングス	13,300	1,361.00	18,101,300	
日伝	8,300	2,066.00	17,147,800	
関西スーパーマーケット	7,500	1,089.00	8,167,500	
ミロク情報サービス	9,900	2,915.00	28,858,500	
北沢産業	7,700	274.00	2,109,800	
杉本商事	5,400	1,977.00	10,675,800	
因幡電機産業	14,200	4,845.00	68,799,000	
王将フードサービス	7,300	6,750.00	49,275,000	
プレナス	11,000	1,840.00	20,240,000	
ミニストップ	7,300	1,480.00	10,804,000	
アークス	18,600	2,344.00	43,598,400	
バローホールディングス	21,500	1,859.00	39,968,500	
東テク	3,300	2,123.00	7,005,900	
ミスミグループ本社	125,100	2,451.00	306,620,100	
藤久	900	755.00	679,500	
アルテック	8,500	231.00	1,963,500	
ベルク	4,900	5,090.00	24,941,000	
大　庄	5,300	1,624.00	8,607,200	
タキヒヨー	3,000	1,854.00	5,562,000	
ファーストリテイリング	13,400	65,450.00	877,030,000	
ソフトバンクグループ	789,200	4,258.00	3,360,413,600	
蔵王産業	1,600	1,404.00	2,246,400	
スズケン	45,500	5,900.00	268,450,000	
サンドラッグ	37,600	3,475.00	130,660,000	
サックスバー　ホールディングス	8,500	897.00	7,624,500	
ジェコス	6,800	913.00	6,208,400	
ヤマザワ	2,000	1,705.00	3,410,000	
やまや	1,700	2,198.00	3,736,600	
グローセル	9,300	421.00	3,915,300	
ベルーナ	24,600	704.00	17,318,400	
合計	119,931,500		235,064,669,820	

（２）株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	令和1年10月15日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,746,912,166
国債証券	187,708,794,400
地方債証券	21,279,753,485
特殊債券	18,048,272,416
社債券	12,113,731,140
未収入金	7,716,024,000
未収利息	362,815,613
前払費用	16,760,136
流動資産合計	249,993,063,356
資産合計	249,993,063,356
負債の部	
流動負債	
未払解約金	1,443,567,000
流動負債合計	1,443,567,000
負債合計	1,443,567,000
純資産の部	
元本等	
元本	187,201,376,207
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	61,348,120,149
元本等合計	248,549,496,356
純資産合計	248,549,496,356
負債純資産合計	249,993,063,356

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30年10月13日 至　令和1年10月15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15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	265,980,959,111円
同期中追加設定元本額	132,316,634,046円
同期中一部解約元本額	211,096,216,950円
元本の内訳	
ファンド名	
ＤＩＡＭ国内債券パッシブ・ファンド	20,677,232,267円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	87,197,411円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	75,749,652円
ＭＩＴＯ　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	8,390,446,040円

たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	437,742,381円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	118,879,626円
たわらノーロード　バランス（標準型）	212,287,387円
たわらノーロード　バランス（積極型）	27,710,156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）	10,065,933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）	304,003,648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）	312,756,786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）	80,557,414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）	20,002,153円
たわらノーロード　最適化バランス（保守型）	6,406,475円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	6,172,568円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	6,190,295円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	971,652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＞	13,800,676,842円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型	6,425,377,955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）	3,377,236,410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	1,856,237,891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＞	316,263,016円
クルーズコントロール＜ＤＣ年金＞	1,604,592円
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（堅実型）	6,094,689円
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（積極型）	16,440,670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・イヤー２０４５）	3,177,875円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー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・イヤー２０３５）	4,689,945円
４資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	129,781,125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・イヤー２０４０）	443,512円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	406,339円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー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

ＯｎｅＩＩ収益追求型マルチアセット戦略ファンドⅡ（適格機関投資家限定）	4,974,701,827円
ＯｎｅＩＩＩ収益追求型マルチアセット戦略ファンドⅢ（適格機関投資家限定）	4,951,101,131円
ＯｎｅＩＶ収益追求型マルチアセット戦略ファンドⅣ（適格機関投資家限定）	4,993,014,716円
ＯｎｅＶ収益追求型マルチアセット戦略ファンドⅤ（適格機関投資家限定）	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）	170,407,799円
ＤＩＡＭバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	4,671,219,510円
ＤＩＡＭバランスファンド３７．５ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,568,971,765円
ＤＩＡＭバランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	4,838,643,553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）	309,042,063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）	2,787,879,698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）	938,764,080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）	25,887,679,916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	187,201,376,207円
２．　受益権の総数	187,201,376,207口

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

項目	自　平成30年10月13日 至　令和1年10月15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15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15日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
国債証券	2,309,029,600
地方債証券	△91,799,169
特殊債券	63,240,312
社債券	△59,308,160
合計	2,221,162,583

（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15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15日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.3277円 (13,277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15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	703,185,000	
	３９７回　利付国庫債券（２年）	800,000,000	803,896,000	
	３９８回　利付国庫債券（２年）	1,100,000,000	1,105,676,000	
	１２６回　利付国庫債券（５年）	1,300,000,000	1,305,759,000	
	１２７回　利付国庫債券（５年）	1,820,000,000	1,829,755,200	
	１２８回　利付国庫債券（５年）	2,200,000,000	2,213,882,000	
	１２９回　利付国庫債券（５年）	2,120,000,000	2,135,603,200	
	１３０回　利付国庫債券（５年）	650,000,000	655,408,000	
	１３１回　利付国庫債券（５年）	1,420,000,000	1,433,333,800	
	１３２回　利付国庫債券（５年）	1,200,000,000	1,212,456,000	
	１３３回　利付国庫債券（５年）	1,180,000,000	1,193,593,600	
	１３４回　利付国庫債券（５年）	1,180,000,000	1,194,950,600	
	１３５回　利付国庫債券（５年）	1,800,000,000	1,824,912,000	
	１３６回　利付国庫債券（５年）	1,250,000,000	1,268,587,500	
	１３７回　利付国庫債券（５年）	1,400,000,000	1,421,980,000	
	１３８回　利付国庫債券（５年）	1,450,000,000	1,474,215,000	
	１３９回　利付国庫債券（５年）	1,300,000,000	1,323,309,000	
	１４０回　利付国庫債券（５年）	1,300,000,000	1,324,661,000	
	２回　利付国庫債券（４０年）	380,000,000	572,116,600	
	３回　利付国庫債券（４０年）	380,000,000	578,067,400	
	４回　利付国庫債券（４０年）	490,000,000	751,958,900	
	５回　利付国庫債券（４０年）	480,000,000	713,745,600	
	６回　利付国庫債券（４０年）	500,000,000	734,105,000	
	７回　利付国庫債券（４０年）	480,000,000	679,080,000	

８回　利付国庫債券（４０年）	520,000,000	688,823,200	
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）	740,000,000	861,841,000	
１１回　利付国庫債券（４０年）	580,000,000	656,171,400	
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	1,830,310,800	
３１４回　利付国庫債券（１０年）	800,000,000	815,728,000	
３１５回　利付国庫債券（１０年）	1,500,000,000	1,537,260,000	
３１６回　利付国庫債券（１０年）	1,000,000,000	1,023,160,000	
３１７回　利付国庫債券（１０年）	600,000,000	615,996,000	
３１８回　利付国庫債券（１０年）	1,400,000,000	1,434,608,000	
３１９回　利付国庫債券（１０年）	800,000,000	824,096,000	
３２０回　利付国庫債券（１０年）	1,500,000,000	1,541,895,000	
３２１回　利付国庫債券（１０年）	800,000,000	824,992,000	
３２２回　利付国庫債券（１０年）	500,000,000	514,400,000	
３２３回　利付国庫債券（１０年）	750,000,000	773,970,000	
３２４回　利付国庫債券（１０年）	1,050,000,000	1,080,723,000	
３２５回　利付国庫債券（１０年）	1,300,000,000	1,341,652,000	
３２６回　利付国庫債券（１０年）	500,000,000	515,875,000	
３２７回　利付国庫債券（１０年）	1,200,000,000	1,241,952,000	
３２８回　利付国庫債券（１０年）	1,090,000,000	1,123,746,400	
３２９回　利付国庫債券（１０年）	1,770,000,000	1,841,685,000	
３３０回　利付国庫債券（１０年）	1,450,000,000	1,512,799,500	
３３１回　利付国庫債券（１０年）	650,000,000	672,984,000	
３３２回　利付国庫債券（１０年）	1,410,000,000	1,463,072,400	
３３３回　利付国庫債券（１０年）	1,250,000,000	1,300,150,000	

３３４回　利付国庫債券（１０年）	2,020,000,000	2,106,213,600	
３３５回　利付国庫債券（１０年）	2,000,000,000	2,080,040,000	
３３６回　利付国庫債券（１０年）	700,000,000	729,645,000	
３３７回　利付国庫債券（１０年）	940,000,000	969,920,200	
３３８回　利付国庫債券（１０年）	1,580,000,000	1,641,430,400	
３３９回　利付国庫債券（１０年）	1,640,000,000	1,706,780,800	
３４０回　利付国庫債券（１０年）	1,900,000,000	1,981,472,000	
３４１回　利付国庫債券（１０年）	1,910,000,000	1,983,993,400	
３４２回　利付国庫債券（１０年）	1,980,000,000	2,033,202,600	
３４３回　利付国庫債券（１０年）	2,080,000,000	2,138,136,000	
３４４回　利付国庫債券（１０年）	1,930,000,000	1,985,313,800	
３４５回　利付国庫債券（１０年）	1,960,000,000	2,018,976,400	
３４６回　利付国庫債券（１０年）	1,920,000,000	1,979,808,000	
３４７回　利付国庫債券（１０年）	1,950,000,000	2,012,068,500	
３４８回　利付国庫債券（１０年）	1,930,000,000	1,992,686,400	
３４９回　利付国庫債券（１０年）	1,760,000,000	1,817,481,600	
３５０回　利付国庫債券（１０年）	2,250,000,000	2,322,765,000	
３５１回　利付国庫債券（１０年）	1,610,000,000	1,661,439,500	
３５２回　利付国庫債券（１０年）	1,620,000,000	1,671,013,800	
３５３回　利付国庫債券（１０年）	1,650,000,000	1,701,051,000	
３５４回　利付国庫債券（１０年）	1,470,000,000	1,513,806,000	
３５５回　利付国庫債券（１０年）	1,450,000,000	1,492,180,500	
１回　利付国庫債券（３０年）	100,000,000	129,863,000	
２回　利付国庫債券（３０年）	100,000,000	126,670,000	
３回　利付国庫債券（３０年）	200,000,000	252,058,000	
４回　利付国庫債券（３０年）	200,000,000	267,322,000	
５回　利付国庫債券（３０年）	200,000,000	253,352,000	
６回　利付国庫債券（３０年）	200,000,000	259,946,000	
８回　利付国庫債券（３０年）	200,000,000	247,814,000	

１１回　利付国庫債券（３０年）	200,000,000	246,500,000	
１２回　利付国庫債券（３０年）	200,000,000	258,140,000	
１３回　利付国庫債券（３０年）	100,000,000	127,993,000	
１４回　利付国庫債券（３０年）	290,000,000	388,991,500	
１５回　利付国庫債券（３０年）	200,000,000	271,986,000	
１６回　利付国庫債券（３０年）	300,000,000	409,215,000	
１７回　利付国庫債券（３０年）	200,000,000	270,798,000	
１８回　利付国庫債券（３０年）	320,000,000	429,548,800	
１９回　利付国庫債券（３０年）	200,000,000	269,158,000	
２０回　利付国庫債券（３０年）	300,000,000	414,186,000	
２１回　利付国庫債券（３０年）	300,000,000	405,720,000	
２２回　利付国庫債券（３０年）	320,000,000	444,102,400	
２３回　利付国庫債券（３０年）	200,000,000	278,506,000	
２４回　利付国庫債券（３０年）	300,000,000	419,160,000	
２５回　利付国庫債券（３０年）	200,000,000	273,382,000	
２６回　利付国庫債券（３０年）	400,000,000	555,184,000	
２７回　利付国庫債券（３０年）	420,000,000	593,355,000	
２８回　利付国庫債券（３０年）	480,000,000	681,628,800	
２９回　利付国庫債券（３０年）	560,000,000	789,734,400	
３０回　利付国庫債券（３０年）	720,000,000	1,006,480,800	
３１回　利付国庫債券（３０年）	600,000,000	831,570,000	
３２回　利付国庫債券（３０年）	860,000,000	1,215,584,200	
３３回　利付国庫債券（３０年）	870,000,000	1,183,382,700	
３４回　利付国庫債券（３０年）	820,000,000	1,154,551,800	
３５回　利付国庫債券（３０年）	770,000,000	1,056,717,200	

３６回　利付国庫債券（３０年）	750,000,000	1,034,182,500	
３７回　利付国庫債券（３０年）	790,000,000	1,076,169,600	
３８回　利付国庫債券（３０年）	670,000,000	901,799,900	
３９回　利付国庫債券（３０年）	480,000,000	658,512,000	
４０回　利付国庫債券（３０年）	450,000,000	608,166,000	
４１回　利付国庫債券（３０年）	460,000,000	612,071,400	
４２回　利付国庫債券（３０年）	510,000,000	679,442,400	
４３回　利付国庫債券（３０年）	500,000,000	666,960,000	
４４回　利付国庫債券（３０年）	560,000,000	747,913,600	
４５回　利付国庫債券（３０年）	500,000,000	644,225,000	
４６回　利付国庫債券（３０年）	730,000,000	941,378,800	
４７回　利付国庫債券（３０年）	660,000,000	868,685,400	
４８回　利付国庫債券（３０年）	590,000,000	747,931,200	
４９回　利付国庫債券（３０年）	660,000,000	837,229,800	
５０回　利付国庫債券（３０年）	680,000,000	760,450,800	
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	638,808,000	
５４回　利付国庫債券（３０年）	550,000,000	614,234,500	
５５回　利付国庫債券（３０年）	590,000,000	658,652,400	
５６回　利付国庫債券（３０年）	680,000,000	758,812,000	
５７回　利付国庫債券（３０年）	650,000,000	725,952,500	
５８回　利付国庫債券（３０年）	860,000,000	960,043,800	
５９回　利付国庫債券（３０年）	580,000,000	631,254,600	
６０回　利付国庫債券（３０年）	500,000,000	571,485,000	

６１回　利付国庫債券（３０年）	600,000,000	652,998,000	
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	516,435,000	
７２回　利付国庫債券（２０年）	350,000,000	391,825,000	
７３回　利付国庫債券（２０年）	340,000,000	381,031,200	
７５回　利付国庫債券（２０年）	140,000,000	158,484,200	
７８回　利付国庫債券（２０年）	190,000,000	214,076,800	
８１回　利付国庫債券（２０年）	240,000,000	273,235,200	
８３回　利付国庫債券（２０年）	480,000,000	552,513,600	
８５回　利付国庫債券（２０年）	440,000,000	509,009,600	
８８回　利付国庫債券（２０年）	350,000,000	411,719,000	
９０回　利付国庫債券（２０年）	700,000,000	823,529,000	
９２回　利付国庫債券（２０年）	1,000,000,000	1,175,200,000	
９３回　利付国庫債券（２０年）	250,000,000	293,440,000	
９４回　利付国庫債券（２０年）	800,000,000	945,080,000	
９５回　利付国庫債券（２０年）	350,000,000	421,008,000	
９７回　利付国庫債券（２０年）	500,000,000	600,545,000	
９９回　利付国庫債券（２０年）	900,000,000	1,078,371,000	
１００回　利付国庫債券（２０年）	600,000,000	726,816,000	
１０２回　利付国庫債券（２０年）	360,000,000	444,214,800	
１０５回　利付国庫債券（２０年）	400,000,000	484,736,000	
１０６回　利付国庫債券（２０年）	350,000,000	427,336,000	
１０７回　利付国庫債券（２０年）	400,000,000	486,696,000	
１０８回　利付国庫債券（２０年）	400,000,000	479,208,000	

１０９回　利付国庫債券（２０年）	520,000,000	624,592,800	
１１０回　利付国庫債券（２０年）	630,000,000	768,814,200	
１１１回　利付国庫債券（２０年）	290,000,000	357,970,200	
１１２回　利付国庫債券（２０年）	550,000,000	673,497,000	
１１３回　利付国庫債券（２０年）	770,000,000	946,045,100	
１１４回　利付国庫債券（２０年）	550,000,000	677,902,500	
１１５回　利付国庫債券（２０年）	400,000,000	497,156,000	
１１６回　利付国庫債券（２０年）	450,000,000	561,100,500	
１１７回　利付国庫債券（２０年）	650,000,000	803,601,500	
１１８回　利付国庫債券（２０年）	310,000,000	381,281,400	
１１９回　利付国庫債券（２０年）	300,000,000	362,490,000	
１２０回　利付国庫債券（２０年）	400,000,000	474,664,000	
１２１回　利付国庫債券（２０年）	540,000,000	660,063,600	
１２２回　利付国庫債券（２０年）	250,000,000	302,817,500	
１２３回　利付国庫債券（２０年）	680,000,000	849,109,200	
１２４回　利付国庫債券（２０年）	200,000,000	247,478,000	
１２５回　利付国庫債券（２０年）	360,000,000	455,162,400	
１２６回　利付国庫債券（２０年）	450,000,000	558,562,500	
１２７回　利付国庫債券（２０年）	450,000,000	553,369,500	
１２８回　利付国庫債券（２０年）	550,000,000	678,353,500	
１２９回　利付国庫債券（２０年）	440,000,000	537,499,600	
１３０回　利付国庫債券（２０年）	580,000,000	710,465,200	
１３１回　利付国庫債券（２０年）	100,000,000	121,291,000	
１３２回　利付国庫債券（２０年）	540,000,000	656,591,400	
１３３回　利付国庫債券（２０年）	570,000,000	700,056,900	

１３４回　利付国庫債券（２０年）	270,000,000	332,448,300	
１３５回　利付国庫債券（２０年）	350,000,000	426,576,500	
１３６回　利付国庫債券（２０年）	200,000,000	241,256,000	
１３７回　利付国庫債券（２０年）	350,000,000	427,591,500	
１３８回　利付国庫債券（２０年）	280,000,000	334,938,800	
１３９回　利付国庫債券（２０年）	430,000,000	519,848,500	
１４０回　利付国庫債券（２０年）	940,000,000	1,151,058,200	
１４１回　利付国庫債券（２０年）	650,000,000	797,719,000	
１４２回　利付国庫債券（２０年）	400,000,000	496,188,000	
１４３回　利付国庫債券（２０年）	560,000,000	681,195,200	
１４４回　利付国庫債券（２０年）	510,000,000	613,519,800	
１４５回　利付国庫債券（２０年）	850,000,000	1,047,625,000	
１４６回　利付国庫債券（２０年）	850,000,000	1,049,801,000	
１４７回　利付国庫債券（２０年）	980,000,000	1,198,912,400	
１４８回　利付国庫債券（２０年）	880,000,000	1,066,551,200	
１４９回　利付国庫債券（２０年）	900,000,000	1,092,519,000	
１５０回　利付国庫債券（２０年）	950,000,000	1,140,883,500	
１５１回　利付国庫債券（２０年）	1,010,000,000	1,184,073,500	
１５２回　利付国庫債券（２０年）	990,000,000	1,161,596,700	
１５３回　利付国庫債券（２０年）	1,040,000,000	1,237,392,000	
１５４回　利付国庫債券（２０年）	850,000,000	998,945,500	
１５５回　利付国庫債券（２０年）	980,000,000	1,121,306,200	
１５６回　利付国庫債券（２０年）	930,000,000	973,505,400	
１５７回　利付国庫債券（２０年）	850,000,000	861,109,500	
１５８回　利付国庫債券（２０年）	860,000,000	913,457,600	

	１５９回　利付国庫債券（２０年）	870,000,000	937,912,200	
	１６０回　利付国庫債券（２０年）	850,000,000	930,962,500	
	１６１回　利付国庫債券（２０年）	710,000,000	765,017,900	
	１６２回　利付国庫債券（２０年）	650,000,000	699,842,000	
	１６３回　利付国庫債券（２０年）	770,000,000	829,112,900	
	１６４回　利付国庫債券（２０年）	1,010,000,000	1,068,580,000	
	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）	750,000,000	820,635,000	
	１６７回　利付国庫債券（２０年）	800,000,000	845,104,000	
	１６８回　利付国庫債券（２０年）	800,000,000	829,136,000	
	１６９回　利付国庫債券（２０年）	850,000,000	864,450,000	
国債証券　合計		167,960,000,000	187,708,794,400	
地方債証券	６９７回　東京都公募公債	500,000,000	509,170,000	
	７０１回　東京都公募公債	700,000,000	713,118,000	
	７０８回　東京都公募公債	500,000,000	511,715,000	
	７２０回　東京都公募公債	300,000,000	309,366,000	
	７２６回　東京都公募公債	400,000,000	411,864,000	
	５回　東京都公募公債　２０年	100,000,000	111,330,000	
	９回　東京都公募公債　２０年	200,000,000	232,040,000	
	１０回　東京都公募公債　２０年	300,000,000	347,568,000	
	２２年度１２回　北海道公募公債	200,000,000	203,244,000	
	３０年度１４回　北海道公募公債	300,000,000	303,702,000	
	１９４回　神奈川県公募公債	300,000,000	307,347,000	
	２０８回　神奈川県公募公債	300,000,000	307,449,000	
	３４５回　大阪府公募公債	300,000,000	304,461,000	
	３５６回　大阪府公募公債	200,000,000	204,594,000	
	３６４回　大阪府公募公債	300,000,000	306,813,000	
	３７４回　大阪府公募公債	300,000,000	310,407,000	
	２６年度１１回　京都府公募公債	350,000,000	358,256,500	
	２６年度１７回　兵庫県公募公債	200,000,000	204,718,000	
	１回　兵庫県公募公債（１２年）	300,000,000	315,204,000	
	２３年度９回　静岡県公募公債	200,000,000	204,348,000	
	８回　静岡県公募公債　１５年	200,000,000	215,552,000	
	１回　静岡県公募公債　２０年	100,000,000	112,789,000	

２３年度２０回　愛知県公募公債	500,000,000	513,070,000	
２５年度４回　愛知県公募公債	300,000,000	309,069,000	
３０年度１９回　愛知県公募公債	200,000,000	201,394,000	
２３年度２回　埼玉県公募公債	200,000,000	203,778,000	
２６年度５回　埼玉県公募公債	400,000,000	411,304,000	
１４回　埼玉県公募公債　２０年	300,000,000	359,907,000	
２５年度１１回　福岡県公募公債	200,000,000	205,882,000	
２４年度２回　福岡県公募公債（２０年）	300,000,000	356,991,000	
２４年度７回　千葉県公募公債	300,000,000	306,873,000	
２５年度５回　千葉県公募公債	200,000,000	206,324,000	
１４回　千葉県公募公債　２０年	100,000,000	113,205,000	
９４回　共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,567,000	
９９回　共同発行市場公募地方債	700,000,000	713,692,000	
１０６回　共同発行市場公募地方債	300,000,000	306,525,000	
１０９回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	513,065,000	
１１１回　共同発行市場公募地方債	700,000,000	716,471,000	
１１９回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	513,100,000	
１２１回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	509,680,000	
１２６回　共同発行市場公募地方債	793,900,000	818,629,985	
１２７回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	513,280,000	
１２８回　共同発行市場公募地方債	300,000,000	307,884,000	
１３７回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	513,245,000	
１３９回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	513,160,000	
１４２回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	508,565,000	
１４４回　共同発行市場公募地方債	400,000,000	409,784,000	
１４６回　共同発行市場公募地方債	400,000,000	411,936,000	
１４８回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	515,365,000	
１６６回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	505,265,000	

	２９年度４回　大阪市公募公債	200,000,000	201,820,000	
	４８８回　名古屋市公募公債　１０年	450,000,000	462,816,000	
	４回　京都市公募公債　２０年	100,000,000	117,101,000	
	３０年度７回　神戸市公募公債　３０年	300,000,000	305,988,000	
	２２年度５回　横浜市公募公債	200,000,000	202,878,000	
	２３年度４回　横浜市公募公債	450,000,000	459,621,000	
	２５年度２回　横浜市公募公債	400,000,000	412,984,000	
	２５年度４回　札幌市公募公債	200,000,000	205,728,000	
	第９１回　川崎市公募公債	200,000,000	202,762,000	
	１７回　北九州市公募公債　２０年	100,000,000	119,883,000	
	２３年度１回　千葉市公募公債	200,000,000	204,106,000	
地方債証券　合計		20,543,900,000	21,279,753,485	
特殊債券	７８回　日本政策投資銀行債券	200,000,000	202,160,000	
	１９回　高速道路機構債	150,000,000	235,666,500	
	２６回　高速道路機構債	200,000,000	284,782,000	
	９６回　高速道路機構債	700,000,000	715,813,000	
	１１６回　高速道路機構債	100,000,000	102,738,000	
	１７２回　高速道路機構債	200,000,000	201,214,000	
	９回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	102,824,000	
	１８回政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	312,690,000	
	１２１回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	596,745,000	
	１４９回政保日本高速道路保有・債務返済機構	400,000,000	408,976,000	
	１８０回政保日本高速道路保有・債務返済機構	1,000,000,000	1,025,130,000	
	１８９回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	510,455,000	
	１９３回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	517,290,000	
	１９５回政保日本高速道路保有・債務返済機構	330,000,000	342,041,700	
	２３９回政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	345,753,000	
	２４１回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	513,260,000	
	２６０回政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	246,410,000	
	３０９回政保日本高速道路保有・債務返済機構	800,000,000	810,584,000	
	３１９回政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	214,224,000	
	２８回　日本道路・機構承継債	400,000,000	548,564,000	
	１回　地方公共団体金融機構債券　２０年	200,000,000	236,720,000	

２０回　政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	304,767,000	
２４回　地方公共団体金融機構債券	300,000,000	305,784,000	
１９回　地方公共団体金融機構債券	200,000,000	242,222,000	
３６回　政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	307,449,000	
２４回　地方公共団体金融機構債券２０年	200,000,000	240,658,000	
４４回　政保地方公共団体金融機構債券	400,000,000	411,564,000	
５０回　政保地方公共団体金融機構債券	500,000,000	518,015,000	
５６回　政保地方公共団体金融機構債券	542,000,000	560,455,100	
６４回　政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	308,778,000	
４４回　地方公共団体金融機構債券　２０年	200,000,000	233,232,000	
８３回　地方公共団体金融機構債券　１０年	400,000,000	401,160,000	
１５回　日本政策金融公庫債券	200,000,000	240,064,000	
１０９回　都市再生機構債券	200,000,000	217,740,000	
３９回　住宅金融支援機構債券	200,000,000	241,048,000	
７５回　住宅金融支援機構債券	350,000,000	429,282,000	
２２２回　住宅金融支援機構債券	300,000,000	303,258,000	
２３０回　住宅金融支援機構債券	300,000,000	304,728,000	
６回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	39,417,000	41,051,622	
８回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	27,630,000	28,878,599	
９回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	41,373,000	43,314,221	
２回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	44,112,000	46,588,447	
１３回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	14,144,000	14,464,220	
１４回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	71,320,000	72,703,608	
４３回貸付債権担保住宅金融公庫債券	14,598,000	15,388,335	
４４回貸付債権担保住宅金融公庫債券	56,092,000	59,033,464	
５１回貸付債権担保住宅金融公庫債券	41,637,000	43,733,006	
１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	69,805,000	72,683,060	

	２９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	147,560,000	160,290,001	
	３６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	253,032,000	270,152,145	
	１１４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	262,665,000	266,410,602	
	１２６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	276,525,000	282,276,720	
	１２８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	277,098,000	282,767,425	
	１３１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	281,412,000	286,922,046	
	１３２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	281,142,000	286,559,606	
	１３７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	288,429,000	295,682,989	
	い第８２８号　利付商工債	100,000,000	100,391,000	
	３２５回　利附信金中金債	400,000,000	400,080,000	
	２２０号　利附商工債（３年）	300,000,000	300,411,000	
	１５回　国際協力機構債	100,000,000	120,256,000	
	５５回　鉄道建設運輸施設債	500,000,000	513,990,000	
特殊債券　合計		16,859,991,000	18,048,272,416	
社債券	１回　ＢＰＣＥ　ＳＡ円貨社債（ソーシャルボンド）	200,000,000	200,244,000	
	６回　クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	200,000,000	206,220,000	
	３３７回　東京交通債	200,000,000	206,250,000	
	３４回　西日本高速道路債券	200,000,000	203,648,000	
	１９回　三菱ケミカルホールディングス社債	100,000,000	101,111,000	
	６回　ＪＸホールディングス社債	100,000,000	103,702,000	
	１４回　ブリヂストン社債	200,000,000	202,472,000	
	２３回　ジェイ　エフ　イーホールディングス社債	100,000,000	99,881,000	
	１３回　パナソニック社債	100,000,000	101,055,000	
	１４回　トヨタ自動車社債	200,000,000	205,896,000	
	１６回　トヨタ自動車社債	200,000,000	204,622,000	
	９４回　丸紅社債	100,000,000	103,114,000	
	４５回　住友商事社債	100,000,000	102,495,000	
	４７回　住友商事社債	100,000,000	102,835,000	
	４８回　クレディセゾン社債	100,000,000	103,382,000	
	５７回　東京三菱銀行社債	200,000,000	212,982,000	
	２５回　三菱東京ＵＦＪ銀行劣後社債	200,000,000	202,580,000	
	２８回　三菱東京ＵＦＪ銀行劣後社債	200,000,000	203,664,000	
	３２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	102,398,000	

	１２回　住友信託銀行劣後債	100,000,000	101,380,000	
	１０回　三井住友信託銀行社債	200,000,000	204,574,000	
	１０回　セブン銀行社債	100,000,000	102,368,000	
	２３回　三井住友銀行劣後社債	400,000,000	407,040,000	
	４７回　日立キャピタル社債	200,000,000	204,974,000	
	５６回　三菱ＵＦＪリース社債	200,000,000	203,106,000	
	７２回　三菱地所社債	100,000,000	110,439,000	
	１０８回　住友不動産社債	200,000,000	202,174,000	
	８０回　東京急行電鉄社債	100,000,000	108,827,000	
	４３回　京浜急行電鉄社債	100,000,000	101,618,000	
	１９回　東日本旅客鉄道社債	100,000,000	105,454,000	
	２１回　東日本旅客鉄道社債	100,000,000	105,736,000	
	３９回　東日本旅客鉄道社債	300,000,000	333,141,000	
	４２回　東日本旅客鉄道社債	200,000,000	223,754,000	
	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	323,175,000	
	６回　東海旅客鉄道社債	100,000,000	105,461,000	
	１１回　東海旅客鉄道社債	300,000,000	310,377,000	
	１３回　東海旅客鉄道社債	200,000,000	216,220,000	
	１４回　東海旅客鉄道社債	100,000,000	109,374,000	
	４回　東京地下鉄社債	120,000,000	138,145,200	
	６０回　日本電信電話社債	300,000,000	304,386,000	
	５１８回　中部電力社債	200,000,000	200,650,000	
	３７７回　中国電力社債	400,000,000	415,620,000	
	３７９回　中国電力社債	300,000,000	302,163,000	
	３０１回　北陸電力社債	100,000,000	103,643,000	
	３０７回　北陸電力社債	100,000,000	105,712,000	
	４７１回　東北電力社債	400,000,000	417,496,000	
	４７３回　東北電力社債	300,000,000	302,448,000	
	２５３回　四国電力社債	200,000,000	206,606,000	
	４２４回　九州電力社債	200,000,000	209,018,000	
	４２６回　九州電力社債	400,000,000	416,016,000	
	３２０回　北海道電力社債	200,000,000	202,118,000	
	３２１回　北海道電力社債	161,000,000	166,721,940	
	３４０回　北海道電力社債	300,000,000	304,416,000	
	１３回　電源開発社債	200,000,000	221,064,000	
	３８回　電源開発社債	300,000,000	310,983,000	
	２３回　東京瓦斯社債	300,000,000	310,200,000	
	１８回　大阪ガス社債	100,000,000	104,475,000	
	２７回　ＮＴＴデータ社債	100,000,000	102,797,000	
	７回　ファーストリテイリング社債	200,000,000	203,006,000	
社債券　合計		11,681,000,000	12,113,731,140	
合計			239,150,551,441	

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	令和1年10月15日現在
資産の部	
流動資産	
預金	4,797,636,022
コール・ローン	4,065,778,000
株式	314,289,760,517
投資信託受益証券	729,863,175
投資証券	8,415,836,976
派生商品評価勘定	61,036,044
未収入金	4,206,175
未収配当金	350,852,877
差入委託証拠金	1,285,875,305
流動資産合計	334,000,845,091
資産合計	334,000,845,091
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	10,872,833
未払解約金	3,563,587,000
流動負債合計	3,574,459,833
負債合計	3,574,459,833
純資産の部	
元本等	
元本	90,346,412,964
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	240,079,972,294
元本等合計	330,426,385,258
純資産合計	330,426,385,258
負債純資産合計	334,000,845,091

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30年10月13日 至　令和1年10月15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。 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
２．　デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。 為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
３．　収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。
４．　その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、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15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	89,642,239,133円
同期中追加設定元本額	38,174,455,706円
同期中一部解約元本額	37,470,281,875円
元本の内訳	
ファンド名	
ＤＩＡＭ外国株式パッシブ・ファンド	3,128,729,146円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	3,040,723円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	8,048,839円
ＭＩＴＯ　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	10,805,919,724円
たわらノーロード　先進国株式＜ラップ向け＞	144,236,916円
たわらノーロード　先進国株式＜為替ヘッジあり＞	1,440,189,300円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	170,754,776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）	126,108,048円
たわらノーロード　バランス（積極型）	162,777,748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）	48,188,205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）	119,692,163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）	87,032,560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）	178,531,979円
たわらノーロード　最適化バランス（保守型）	84,600円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	553,388円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	1,373,679円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	876,261円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	2,685,538円
たわらノーロード　全世界株式	33,804,176円
ＤＩＡＭ外国株式インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	41,871,127,536円
Ｏｎｅ　ＤＣ　先進国株式インデックスファンド	121,715,466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）	158,910,873円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	275,837,407円
投資のソムリエ	430,532,316円
クルーズコントロール	342,827,033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＞	297,933円
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（堅実型）	2,253,916円
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（積極型）	6,093,835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・イヤー２０４５）	1,322,247円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー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・イヤー２０３５）	771,257円
４資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	9,349,473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
ＤＩＡＭ外国株式インデックスファンドＶＡ（適格機関投資家専用）	86,264,565円
ＤＩＡＭ外国株式パッシブ私募ファンド（適格機関投資家向け）	2,268,088,158円
ＤＩＡＭ先進国株式パッシブファンド（適格機関投資家限定）	9,256,352,765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
ＤＩＡＭワールドバランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	19,400,436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）	68,821,105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）	152,577,479円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	9,371,332円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	57,328,522円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	5,568,670円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	6,304,791円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	21,127,188円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	62,420,752円
ＤＩＡＭバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	427,385,249円
ＤＩＡＭバランスファンド３７．５ＶＡ（適格機関投資家限定）	548,725,522円
ＤＩＡＭバランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,771,905,476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）	633,584,646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）	104,437,597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）	692,184,610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）	37,770,237円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	10,310,184円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド３５ＶＡ（適格機関投資家限定）	10,887,190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）	255,254,837円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	33,806,318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）	113,287,716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）	171,990,277円
ＤＩＡＭバランス３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	4,394,580円
ＤＩＡＭバランス５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	333,901円
ＤＩＡＭバランス７０ＶＡ（適格機関投資家限定）	494,998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）	5,687,680,320円
ＤＩＡＭバランス２０ＶＡ（適格機関投資家限定）	53,515,759円
ＤＩＡＭバランス４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	225,774円
ＤＩＡＭバランス６０ＶＡ（適格機関投資家限定）	255,220円
計	90,346,412,964円
２．　受益権の総数	90,346,412,964口

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

項目	自　平成30年10月13日 至　令和1年10月15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15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15日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
株式	20,030,530,946
投資信託受益証券	48,573,677
投資証券	839,433,193
合計	20,918,537,816

（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15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15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	214,717,993	－	214,717,160	833
アメリカ・ドル	134,533,087	－	134,524,400	8,687
イギリス・ポンド	36,887,400	－	36,887,400	－
オーストラリア・ドル	4,551,606	－	4,551,420	186
カナダ・ドル	6,719,900	－	6,719,900	－
ユーロ	32,026,000	－	32,034,040	△8,040
買建	471,062,839	－	473,112,980	2,050,141
アメリカ・ドル	312,812,460	－	313,738,540	926,080
イギリス・ポンド	33,610,000	－	34,155,000	545,000
オーストラリア・ドル	13,977,762	－	14,021,310	43,548
カナダ・ドル	14,147,940	－	14,259,300	111,360
ユーロ	96,514,677	－	96,938,830	424,153
合計	685,780,832	－	687,830,140	2,050,974

（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。

①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。

②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15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 先物取引 買建	6,627,354,054	－	6,675,466,291	48,112,237
合計	6,627,354,054	－	6,675,466,291	48,112,237

（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15日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	3.6573円 (36,573円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

（１）株式

令和1年10月15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	1,736.430	57,395,957.220	
	ABBOTT LABORATORIES	139,517	79.820	11,136,246.940	
	AES CORP	55,631	15.990	889,539.690	
	ABIOMED INC	3,574	176.510	630,846.740	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	70,063	142.040	9,951,748.520	
	ADVANCED MICRO DEVICES	83,797	30.530	2,558,322.410	
	ADOBE INC	38,479	277.780	10,688,696.620	
	CHUBB LTD	36,631	155.440	5,693,922.640	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	17,359	213.860	3,712,395.740	
	ALLEGHANY CORP	1,094	765.800	837,785.200	
	SAREPTA THERAPEUTICS INC	6,052	85.700	518,656.400	
	RALPH LAUREN CORP	3,283	92.450	303,513.350	
	ALLSTATE CORP	25,832	108.230	2,795,797.360	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	57,633	162.980	9,393,026.340	
	AMGEN INC	48,063	202.890	9,751,502.070	
	HESS CORP	21,367	67.190	1,435,648.730	
	AMERICAN EXPRESS CO	55,876	116.390	6,503,407.640	

AMERICAN ELECTRIC POWER	39,277	92.030	3,614,662.310	
AFLAC INC	60,093	52.510	3,155,483.430	
AMERICAN INTL GROUP	68,037	54.210	3,688,285.770	
AMERCO	585	380.840	222,791.400	
ANALOG DEVICES	29,105	110.340	3,211,445.700	
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	18,192	101.340	1,843,577.280	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	61,876	42.240	2,613,642.240	
JONES LANG LASALLE INC	4,087	140.570	574,509.590	
VALERO ENERGY CORP	33,171	88.530	2,936,628.630	
APACHE CORP	31,470	21.940	690,451.800	
ANSYS INC	6,770	225.260	1,525,010.200	
APPLE INC	363,209	235.870	85,670,106.830	
APPLIED MATERIALS INC	74,621	51.935	3,875,441.630	
ALBEMARLE CORP	7,634	67.560	515,753.040	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	45,602	40.200	1,833,200.400	
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	9,600	94.530	907,488.000	
AMEREN CORP	19,487	76.290	1,486,663.230	
ARROW ELECTRONICS INC	7,754	73.890	572,943.060	
AUTOLIV INC	5,913	78.840	466,180.920	
AUTODESK INC	17,235	150.270	2,589,903.450	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	34,670	162.460	5,632,488.200	
AUTOZONE INC	1,917	1,086.640	2,083,088.880	
AVERY DENNISON CORP	6,549	112.900	739,382.100	
BALL CORP	25,262	72.920	1,842,105.040	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	102,604	207.910	21,332,397.640	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	66,637	43.910	2,926,030.670	
BAXTER INTERNATIONAL INC	37,658	87.200	3,283,777.600	
BECTON DICKINSON & CO	21,455	250.720	5,379,197.600	
AMETEK INC	17,821	88.360	1,574,663.560	
VERIZON COMM INC	326,283	59.600	19,446,466.800	
WR BERKLEY CORP	12,201	71.120	867,735.120	
BEST BUY CO INC	18,720	68.720	1,286,438.400	
YUM! BRANDS INC	24,852	112.820	2,803,802.640	
FIRSTENERGY CORP	43,584	47.410	2,066,317.440	
H&R BLOCK INC	16,114	23.610	380,451.540	
BOEING CO	42,262	373.180	15,771,333.160	
ROBERT HALF INTL INC	8,097	54.410	440,557.770	
BORGWARNER INC	17,210	37.070	637,974.700	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	110,194	37.970	4,184,066.180	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	9,988	85.320	852,176.160	

TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	8,766	121.160	1,062,088.560	
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	1,929	680.740	1,313,147.460	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	127,741	51.560	6,586,325.960	
AFFILIATED MANAGERS GROUP INC	3,426	75.290	257,943.540	
INGREDION INC	5,305	80.200	425,461.000	
ONEOK INC	32,427	69.140	2,242,002.780	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	5,900	102.520	604,868.000	
UNITED RENTALS INC	6,505	118.680	772,013.400	
SEMPRA ENERGY	21,599	145.430	3,141,142.570	
FEDEX CORP	19,368	146.780	2,842,835.040	
VERISIGN INC	8,048	185.750	1,494,916.000	
AMPHENOL CORP	23,150	96.910	2,243,466.500	
BROWN-FORMAN CORP	24,381	63.250	1,542,098.250	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	125,254	6.330	792,857.820	
CSX CORP	59,540	68.560	4,082,062.400	
CABOT OIL & GAS CORP	31,416	17.590	552,607.440	
CAMPBELL SOUP CO	14,050	46.830	657,961.500	
SEAGATE TECHNOLOGY	20,798	53.880	1,120,596.240	
CONSTELLATION BRANDS INC	12,871	192.970	2,483,716.870	
CARDINAL HEALTH INC	22,950	46.780	1,073,601.000	
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	31,962	42.040	1,343,682.480	
CATERPILLAR INC	44,868	128.380	5,760,153.840	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	9,865	108.740	1,072,720.100	
CELGENE CORP	56,106	100.390	5,632,481.340	
CITRIX SYSTEMS INC	10,886	98.290	1,069,984.940	
CENTURYLINK INC	80,424	11.810	949,807.440	
CERNER CORP	25,143	67.740	1,703,186.820	
JPMORGAN CHASE & CO	256,348	116.450	29,851,724.600	
CHURCH & DWIGHT CO INC	19,896	73.680	1,465,937.280	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	12,715	116.160	1,476,974.400	
CINTAS CORP	7,247	265.940	1,927,267.180	
CISCO SYSTEMS INC	338,608	46.050	15,592,898.400	
CLOROX COMPANY	9,876	148.720	1,468,758.720	
COCA-COLA CO/THE	320,243	53.300	17,068,951.900	
COPART INC	16,749	81.680	1,368,058.320	
COGNEX CORP	12,284	48.750	598,845.000	
COLGATE-PALMOLIVE CO	63,469	69.410	4,405,383.290	
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	22,145	120.100	2,659,614.500	
COMERICA INC	12,770	65.260	833,370.200	
NRG ENERGY, INC.	21,039	39.120	823,045.680	
COMCAST CORP-CL A	358,051	45.230	16,194,646.730	

CONAGRA BRANDS INC	40,573	27.780	1,127,117.940	
CONSOLIDATED EDISON INC	25,181	91.250	2,297,766.250	
CMS ENERGY CORP	22,937	63.480	1,456,040.760	
COOPER COS INC	3,936	292.510	1,151,319.360	
MOLSON COORS BREWING CO	16,200	56.240	911,088.000	
CORNING INC	63,750	29.010	1,849,387.500	
SEALED AIR CORP	13,870	40.620	563,399.400	
HEICO CORP-CL A	5,292	94.720	501,258.240	
CUMMINS INC	12,238	163.760	2,004,094.880	
DR HORTON INC	28,355	52.290	1,482,682.950	
DANAHER CORP	50,997	138.800	7,078,383.600	
MOODY'S CORP	13,582	214.470	2,912,931.540	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	44,962	60.380	2,714,805.560	
TARGET CORP	41,066	111.150	4,564,485.900	
DEERE & CO	24,182	168.930	4,085,065.260	
MORGAN STANLEY	100,406	42.250	4,242,153.500	
REPUBLIC SERVICES INC	18,081	86.110	1,556,954.910	
COSTAR GROUP INC	2,795	600.740	1,679,068.300	
THE WALT DISNEY CO	142,222	129.700	18,446,193.400	
DOLLAR TREE INC	18,697	115.020	2,150,528.940	
DOVER CORP	11,113	95.910	1,065,847.830	
OMNICOM GROUP	17,365	75.160	1,305,153.400	
DTE ENERGY CO	14,817	128.110	1,898,205.870	
DUKE ENERGY CORP	56,837	95.130	5,406,903.810	
FLOWSERVE CORP	9,882	44.880	443,504.160	
DARDEN RESTAURANTS INC	9,700	110.450	1,071,365.000	
EBAY INC	66,614	38.360	2,555,313.040	
BANK OF AMERICA CORP	713,639	29.140	20,795,440.460	
CITIGROUP INC	182,613	70.240	12,826,737.120	
EASTMAN CHEMICAL CO	11,935	72.290	862,781.150	
E*TRADE FINANCIAL CORP	17,663	39.330	694,685.790	
EATON CORP PLC	32,606	80.860	2,636,521.160	
EATON VANCE CORP	9,184	44.060	404,647.040	
CADENCE DESIGN SYS INC	22,628	66.510	1,504,988.280	
DISH NETWORK CORP	17,517	33.640	589,271.880	
ECOLAB INC	20,479	194.010	3,973,130.790	
PERKINELMER INC	8,338	81.860	682,548.680	
ELECTRONIC ARTS INC	23,975	93.880	2,250,773.000	
SALESFORCE.COM INC	65,596	149.370	9,798,074.520	
ERIE INDEMNITY CO	2,243	182.380	409,078.340	
EMERSON ELECTRIC CO	48,177	67.210	3,237,976.170	
ATMOS ENERGY CORP	8,650	111.360	963,264.000	
ENTERGY CORP	14,365	116.610	1,675,102.650	
EOG RESOURCES INC	45,209	68.190	3,082,801.710	
EQUIFAX INC	9,161	143.330	1,313,046.130	
ESTEE LAUDER COS INC/THE	17,346	192.830	3,344,829.180	
EXPEDITORS INTERNATIONAL	12,711	74.030	940,995.330	
EXXON MOBIL CORP	334,134	69.180	23,115,390.120	

FMC CORP	10,209	82.450	841,732.050	
NEXTERA ENERGY INC	37,460	228.900	8,574,594.000	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	2,875	244.020	701,557.500	
ASSURANT INC	4,594	125.710	577,511.740	
FASTENAL CO	45,891	35.425	1,625,688.670	
FIFTH THIRD BANCORP	58,144	26.990	1,569,306.560	
M&T BANK CORP	10,640	156.570	1,665,904.800	
FISERV INC	45,716	106.020	4,846,810.320	
FLIR SYSTEMS INC	11,623	53.015	616,193.340	
MACY'S INC	24,741	15.300	378,537.300	
FORD MOTOR CO	310,836	8.820	2,741,573.520	
FRANKLIN RESOURCES INC	23,713	26.970	639,539.610	
FREEPORT-MCMORAN INC	120,727	9.500	1,146,906.500	
FLEX LTD	34,372	9.790	336,501.880	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	14,270	88.190	1,258,471.300	
GAP INC/THE	18,295	17.030	311,563.850	
DENTSPLY SIRONA INC	18,386	53.490	983,467.140	
GENERAL DYNAMICS CORP	19,290	179.120	3,455,224.800	
GENERAL MILLS INC	46,468	54.010	2,509,736.680	
GENUINE PARTS CO	11,605	96.820	1,123,596.100	
GILEAD SCIENCES INC	101,430	64.510	6,543,249.300	
GARTNER INC	7,384	143.970	1,063,074.480	
MCKESSON CORP	14,558	134.100	1,952,227.800	
NVIDIA CORP	45,479	186.530	8,483,197.870	
GENERAL ELECTRIC CO	682,967	8.720	5,955,472.240	
WW GRAINGER INC	3,762	306.070	1,151,435.340	
HALLIBURTON CO	66,843	18.760	1,253,974.680	
MONSTER BEVERAGE CORP	33,500	56.550	1,894,425.000	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	25,659	205.820	5,281,135.380	
HARLEY-DAVIDSON INC	12,901	35.210	454,244.210	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	17,586	206.640	3,633,971.040	
HASBRO INC	9,473	120.900	1,145,285.700	
HENRY SCHEIN INC	11,516	61.360	706,621.760	
HEICO CORP	4,236	123.550	523,357.800	
HELMERICH & PAYNE INC	10,055	37.850	380,581.750	
HERSHEY FOODS CORP	11,330	155.380	1,760,455.400	
HP INC	121,318	16.540	2,006,599.720	
F5 NETWORKS INC	4,874	135.400	659,939.600	
CROWN HOLDINGS INC NPR	10,472	64.020	670,417.440	
JUNIPER NETWORKS INC	27,939	23.560	658,242.840	
HOLLYFRONTIER CORP	11,855	53.670	636,257.850	
HOLOGIC INC	20,210	48.500	980,185.000	
UNUM GROUP	15,185	28.310	429,887.350	
HOME DEPOT INC	86,872	234.180	20,343,684.960	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	15,079	67.240	1,013,911.960	
HORMEL FOODS CORP	24,161	40.970	989,876.170	

CENTERPOINT ENERGY INC	37,678	27.890	1,050,839.420	
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,913	240.610	700,896.930	
HUMANA INC	10,620	264.000	2,803,680.000	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	7,359	109.580	806,399.220	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	79,517	14.030	1,115,623.510	
NEKTAR THERAPEUTICS	15,689	15.870	248,984.430	
BIOGEN INC	15,267	225.760	3,446,677.920	
IDEX CORP	6,154	157.310	968,085.740	
ILLINOIS TOOL WORKS	26,049	153.940	4,009,983.060	
INTUIT INC	20,659	269.060	5,558,510.540	
IDEXX LABORATORIES INC	6,791	275.680	1,872,142.880	
IONIS PHARMACEUTICALS INC	11,699	62.530	731,538.470	
INGERSOLL-RAND PLC	19,439	115.330	2,241,899.870	
INTEL CORP	353,705	51.640	18,265,326.200	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	7,965	118.330	942,498.450	
INTERNATIONAL PAPER CO	29,411	41.130	1,209,674.430	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	28,862	20.340	587,053.080	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	10,108	91.350	923,365.800	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	6,019	141.980	854,577.620	
INCYTE CORP	13,798	77.460	1,068,793.080	
JOHNSON & JOHNSON	209,690	130.720	27,410,676.800	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	29,441	59.170	1,742,023.970	
KLA CORPORATION	12,724	159.000	2,023,116.000	
DEVON ENERGY CORP	33,312	20.950	697,886.400	
KELLOGG CO	19,160	62.390	1,195,392.400	
EAST WEST BANCORP INC	11,560	42.580	492,224.800	
KEYCORP	79,497	17.590	1,398,352.230	
KIMBERLY-CLARK CORP	27,296	135.100	3,687,689.600	
BLACKROCK INC/NEW YORK	9,066	434.210	3,936,547.860	
KOHLS CORP	11,910	50.730	604,194.300	
KROGER CO	66,610	24.100	1,605,301.000	
LAM RESEARCH CORP	11,854	236.280	2,800,863.120	
PACKAGING CORP OF AMERICA	7,143	107.260	766,158.180	
AKAMAI TECHNOLOGIES	13,254	89.840	1,190,739.360	
LEGGETT & PLATT INC	10,928	41.260	450,889.280	
LENNAR CORP	22,753	58.980	1,341,971.940	
JEFFERIES FINANCIAL GROUP INC	20,795	18.120	376,805.400	
ELI LILLY & CO	68,853	107.900	7,429,238.700	
L BRANDS INC	21,698	17.480	379,281.040	

LINCOLN NATIONAL CORP	16,387	58.620	960,605.940	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	54,529	115.870	6,318,275.230	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	25,544	75.180	1,920,397.920	
LOCKHEED MARTIN CORP	20,343	382.610	7,783,435.230	
LOEWS CORP	21,759	50.410	1,096,871.190	
LOWE'S COS INC	62,772	110.670	6,946,977.240	
DOMINION ENERGY INC	63,870	81.240	5,188,798.800	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	38,573	27.970	1,078,886.810	
MCCORMICK & CO INC	9,935	163.010	1,619,504.350	
MCDONALD'S CORPORATION	60,345	208.380	12,574,691.100	
S&P GLOBAL INC	19,821	251.370	4,982,404.770	
EVEREST RE GROUP LTD	3,114	250.610	780,399.540	
MANPOWERGROUP INC	4,555	84.830	386,400.650	
MARKEL CORPORATION	1,065	1,143.200	1,217,508.000	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	16,561	226.610	3,752,888.210	
MARSH & MCLENNAN COS	40,294	97.120	3,913,353.280	
MASCO CORP	24,537	42.510	1,043,067.870	
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	4,786	265.720	1,271,735.920	
METLIFE INC	61,857	45.750	2,829,957.750	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	21,386	57.680	1,233,544.480	
MEDTRONIC PLC	106,145	107.570	11,418,017.650	
ACTIVISION BLIZZARD INC	60,243	55.010	3,313,967.430	
CVS HEALTH CORP	101,372	62.990	6,385,422.280	
MERCK & CO.INC.	203,186	84.690	17,207,822.340	
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	32,686	18.870	616,784.820	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	8,049	165.450	1,331,707.050	
MICROSOFT CORP	575,002	139.550	80,241,529.100	
MICRON TECH INC	88,668	44.860	3,977,646.480	
MIDDLEBY CORP	4,188	112.910	472,867.080	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	18,473	95.680	1,767,496.640	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	48,715	24.050	1,171,595.750	
3M CO	45,183	160.510	7,252,323.330	
MOHAWK INDUSTRIES INC	4,976	123.260	613,341.760	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	12,680	167.340	2,121,871.200	
KANSAS CITY SOUTHERN	7,614	132.000	1,005,048.000	
MYLAN NV	43,574	18.520	806,990.480	
ILLUMINA INC	11,619	310.310	3,605,491.890	
XCEL ENERGY INC	41,501	63.280	2,626,183.280	
NATIONAL OILWELL VARCO INC	33,468	21.090	705,840.120	
NETAPP INC	17,963	52.200	937,668.600	

NEWELL BRANDS INC	33,317	19.230	640,685.910	
NEWMONT GOLDCORP CORP	63,869	38.000	2,427,022.000	
NVR INC	263	3,621.820	952,538.660	
NIKE INC-CL B	99,219	94.880	9,413,898.720	
NOBLE ENERGY INC	39,436	20.440	806,071.840	
NORDSTROM INC	9,487	34.680	329,009.160	
NORFOLK SOUTHERN CORP	21,266	178.540	3,796,831.640	
EVERSOURCE ENERGY	24,768	84.760	2,099,335.680	
NISOURCE INC	31,548	28.540	900,379.920	
TAPESTRY INC	21,790	25.250	550,197.500	
NORTHERN TRUST CORP	15,959	92.060	1,469,185.540	
NORTHROP GRUMMAN CORP	12,618	366.420	4,623,487.560	
WELLS FARGO & CO	337,198	49.270	16,613,745.460	
NUCOR CORP	25,192	51.730	1,303,182.160	
CHENIERE ENERGY INC	19,175	62.890	1,205,915.750	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	36,209	88.610	3,208,479.490	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	69,550	40.510	2,817,470.500	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	5,209	171.240	891,989.160	
OGE ENERGY CORP	16,028	42.760	685,357.280	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	6,185	401.390	2,482,597.150	
ORACLE CORP	188,971	56.460	10,669,302.660	
PACCAR INC	27,394	69.480	1,903,335.120	
PTC INC	7,766	65.430	508,129.380	
EXELON CORP	77,211	47.105	3,637,024.150	
PARKER HANNIFIN CORP	10,092	178.460	1,801,018.320	
PAYCHEX INC	25,329	84.695	2,145,239.650	
ALIGN TECHNOLOGY INC	6,375	205.150	1,307,831.250	
PPL CORPORATION	58,220	32.150	1,871,773.000	
PEPSICO INC	110,679	137.450	15,212,828.550	
PENTAIR PLC	12,511	37.170	465,033.870	
PFIZER INC	438,192	36.300	15,906,369.600	
CONOCOPHILLIPS	90,316	56.130	5,069,437.080	
PVH CORP	5,101	86.940	443,480.940	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	12,908	129.890	1,676,620.120	
ALTRIA GROUP INC	146,052	42.720	6,239,341.440	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	35,495	140.520	4,987,757.400	
POLARIS INC	4,095	87.980	360,278.100	
GARMIN LTD	10,774	86.615	933,190.010	
FLUOR CORP (NEW)	9,821	18.880	185,420.480	
PPG INDUSTRIES INC	19,031	117.210	2,230,623.510	
IPG PHOTONICS CORP	2,608	125.400	327,043.200	
COSTCO WHOLESALE CORP	34,711	297.520	10,327,216.720	
T ROWE PRICE GROUP INC	18,483	110.320	2,039,044.560	
QUEST DIAGNOSTICS	10,883	103.730	1,128,893.590	

PROCTER & GAMBLE CO	198,040	120.050	23,774,702.000	
PROGRESSIVE CORP	46,127	75.710	3,492,275.170	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	39,039	61.850	2,414,562.150	
PULTE GROUP INC	21,209	37.060	786,005.540	
GLOBAL PAYMENTS INC	23,692	164.140	3,888,804.880	
QUALCOMM INC	95,114	76.300	7,257,198.200	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	10,388	80.860	839,973.680	
EXACT SCIENCES CORP	9,418	94.850	893,297.300	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	3,161	191.600	605,647.600	
REGENERON PHARMACEUTICALS	6,547	305.440	1,999,715.680	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA INC	5,042	154.860	780,804.120	
RESMED INC	11,116	129.220	1,436,409.520	
US BANCORP	118,332	53.260	6,302,362.320	
SEATTLE GENETICS INC /WA	8,265	82.420	681,201.300	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	31,500	41.590	1,310,085.000	
ROSS STORES INC	28,814	111.400	3,209,879.600	
ROLLINS INC	12,378	35.060	433,972.680	
ROPER TECHNOLOGIES INC	8,404	338.700	2,846,434.800	
ROCKWELL AUTOMATION INC	9,251	164.130	1,518,366.630	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	14,075	107.960	1,519,537.000	
RAYTHEON COMPANY	21,972	199.380	4,380,777.360	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	3,848	122.540	471,533.920	
ACCENTURE PLC-CL A	50,417	185.500	9,352,353.500	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	114,749	54.220	6,221,690.780	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	10,190	187.640	1,912,051.600	
THE TRAVELERS COMPANIES INC	20,724	143.110	2,965,811.640	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	48,861	132.740	6,485,809.140	
BOOKING HOLDINGS INC	3,445	1,988.750	6,851,243.750	
SCHLUMBERGER LTD	108,486	32.570	3,533,389.020	
SCHWAB (CHARLES) CORP	97,212	37.720	3,666,836.640	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	16,659	135.240	2,252,963.160	
BUNGE LTD	10,622	56.550	600,674.100	
SEI INVESTMENTS CO	11,883	58.815	698,898.640	
ANTHEM INC	20,569	234.820	4,830,012.580	
AMERISOURCEBERGEN CORP	12,749	81.580	1,040,063.420	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	23,125	55.260	1,277,887.500	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	6,454	550.350	3,551,958.900	

CENTENE CORP	33,216	43.900	1,458,182.400	
SVB FINANCIAL GROUP	4,044	199.440	806,535.360	
IAC INTERACTIVE CORP	6,252	226.510	1,416,140.520	
SMITH (A.O.) CORP	11,351	47.730	541,783.230	
ACUITY BRANDS INC	3,087	122.040	376,737.480	
SNAP-ON INC	3,981	157.950	628,798.950	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	31,388	89.340	2,804,203.920	
ADVANCE AUTO PARTS	5,297	157.320	833,324.040	
EDISON INTERNATIONAL	28,779	70.060	2,016,256.740	
SOUTHERN CO	82,609	60.920	5,032,540.280	
BB&T CORP	61,315	51.980	3,187,153.700	
SOUTHWEST AIRLINES	11,352	54.030	613,348.560	
AT&T INC	575,875	37.470	21,578,036.250	
CHEVRON CORP	150,662	116.180	17,503,911.160	
STANLEY BLACK & DECKER INC	11,776	147.330	1,734,958.080	
STATE STREET CORP	30,100	58.490	1,760,549.000	
STARBUCKS CORP	95,691	86.620	8,288,754.420	
STEEL DYNAMICS INC	19,030	29.640	564,049.200	
STRYKER CORP	26,746	212.660	5,687,804.360	
NETFLIX INC	34,491	285.530	9,848,215.230	
SUNTRUST BANKS INC	35,828	66.920	2,397,609.760	
SYMANTEC CORP	48,955	23.415	1,146,281.320	
KNIGHT SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	9,793	36.020	352,743.860	
SYNOPSYS INC	11,855	138.850	1,646,066.750	
SYSCO CORP	38,229	78.990	3,019,708.710	
INTUITIVE SURGICAL INC	9,143	518.880	4,744,119.840	
TELEFLEX INC	3,456	324.740	1,122,301.440	
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	96,274	6.730	647,924.020	
TEXAS INSTRUMENTS INC	74,184	129.750	9,625,374.000	
TEXTRON INC	16,304	49.550	807,863.200	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	31,582	284.250	8,977,183.500	
TIFFANY & CO	8,733	90.260	788,240.580	
GLOBE LIFE INC	8,807	94.080	828,562.560	
DAVITA INC	8,159	55.670	454,211.530	
TRACTOR SUPPLY CO	9,573	93.750	897,468.750	
TRIMBLE INC	20,073	37.800	758,759.400	
TYSON FOODS INC	22,736	84.060	1,911,188.160	
UGI CORP	14,797	48.460	717,062.620	
MARATHON OIL CORP	58,418	11.780	688,164.040	
UNION PACIFIC CORP	56,020	159.550	8,937,991.000	
UNITED TECHNOLOGIES CORP	64,508	135.920	8,767,927.360	
UNITEDHEALTH GROUP INC	75,067	220.590	16,559,029.530	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	6,153	143.990	885,970.470	

VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	7,226	112.820	815,237.320	
VF CORP	26,750	90.940	2,432,645.000	
CBS CORP	27,306	37.940	1,035,989.640	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	20,059	173.590	3,482,041.810	
VULCAN MATERIALS CO	10,913	146.670	1,600,609.710	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	60,250	53.670	3,233,617.500	
WALMART INC	113,189	119.170	13,488,733.130	
WASTE MANAGEMENT INC	33,679	116.150	3,911,815.850	
WATERS CORP	5,468	213.870	1,169,441.160	
ALLERGAN PLC	26,094	168.940	4,408,320.360	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	9,176	106.900	980,914.400	
VAIL RESORTS INC	3,109	226.500	704,188.500	
WESTERN DIGITAL CORP	22,567	59.280	1,337,771.760	
WABTEC CORP	14,964	66.660	997,500.240	
WHIRLPOOL CORP	4,614	158.470	731,180.580	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	13,902	84.980	1,181,391.960	
WYNN RESORTS LTD	7,970	112.320	895,190.400	
NASDAQ INC	9,020	98.350	887,117.000	
CME GROUP INC	27,978	212.350	5,941,128.300	
WILLIAMS COS INC	97,461	23.120	2,253,298.320	
LKQ CORP	26,690	30.745	820,584.050	
ALLIANT ENERGY CORP	17,169	52.380	899,312.220	
WEC ENERGY GROUP INC	25,582	92.720	2,371,963.040	
TD AMERITRADE HOLDING CORP	21,820	35.490	774,391.800	
CARMAX INC	12,265	90.030	1,104,217.950	
XILINX INC	20,599	95.930	1,976,062.070	
CIMAREX ENERGY CO	9,253	44.660	413,238.980	
TJX COMPANIES INC	95,661	58.120	5,559,817.320	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP	3,937	193.580	762,124.460	
ZIONS BANCORP NA	13,142	44.150	580,219.300	
DAIRY FARM INTERNATIONAL HLDNGS	27,400	6.080	166,592.000	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	76,400	5.510	420,964.000	
JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	15,700	52.650	826,605.000	
JARDINE STRATEGIC HOLDINGS LTD	17,100	29.740	508,554.000	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	8,192	79.140	648,314.880	
SIGNATURE BANK	4,171	117.620	490,593.020	
CBRE GROUP INC	26,222	51.980	1,363,019.560	
LIBERTY GLOBAL PLC	12,732	24.740	314,989.680	
WELLCARE HEALTH PLANS INC	3,819	263.150	1,004,969.850	

REGIONS FINANCIAL CORP	76,480	15.390	1,177,027.200	
DOMINO'S PIZZA INC	3,256	252.200	821,163.200	
WESTLAKE CHEMICAL CORP	3,000	62.340	187,020.000	
T-MOBILE US INC	27,710	78.630	2,178,837.300	
LAS VEGAS SANDS CORP	27,759	57.010	1,582,540.590	
MOSAIC CO/THE	31,433	20.060	630,545.980	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	2,892	349.430	1,010,551.560	
CELANESE CORP	10,326	120.440	1,243,663.440	
DEXCOM INC	6,740	160.180	1,079,613.200	
DISCOVERY INC-A	10,423	27.750	289,238.250	
EXPEDIA GROUP INC	11,527	136.710	1,575,856.170	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	18,475	48.970	904,720.750	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	10,312	138.820	1,431,511.840	
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	34,023	23.660	804,984.180	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	44,248	93.500	4,137,188.000	
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	14,696	20.070	294,948.720	
VIACOM INC-CLASS B	30,282	22.730	688,309.860	
LIVE NATION	11,339	67.750	768,217.250	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,040	828.130	1,689,385.200	
UNITED AIRLINES HOLIDINGS INC	4,508	86.970	392,060.760	
TRANSDIGM GROUP INC	3,685	518.700	1,911,409.500	
MASTERCARD INC	71,792	276.380	19,841,872.960	
QURATE RETAIL INC	35,733	9.555	341,428.810	
HANESBRANDS INC	27,619	15.320	423,123.080	
WESTERN UNION CO	35,222	23.760	836,874.720	
OWENS CORNING	7,756	60.970	472,883.320	
LEIDOS HOLDINGS INC	11,113	82.460	916,377.980	
AERCAP HOLDINGS NV	8,807	54.200	477,339.400	
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLDINGS INC	7,384	83.180	614,201.120	
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT-ADR	17,350	20.290	352,031.500	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	9,176	123.600	1,134,153.600	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	31,119	15.630	486,389.970	
DELTA AIR LINES INC	13,898	52.990	736,455.020	
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	6,038	28.220	170,392.360	
DISCOVER FINANCIAL	26,157	77.750	2,033,706.750	
TE CONNECTIVITY LTD	25,992	90.420	2,350,196.640	
CONCHO RESOURCES INC/MIDLAND TX	15,970	65.820	1,051,145.400	
WABCO HOLDING INC	4,076	134.630	548,751.880	

LULULEMON ATHLETICA INC	8,939	203.040	1,814,974.560	
VMWARE INC	6,532	154.370	1,008,344.840	
MERCADOLIBRE INC	3,500	555.580	1,944,530.000	
ULTA BEAUTY INC	4,577	246.570	1,128,550.890	
INVESCO LTD	33,443	15.710	525,389.530	
MSCI INC	6,714	225.110	1,511,388.540	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	122,545	78.030	9,562,186.350	
VISA INC	137,469	177.360	24,381,501.840	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	14,536	121.730	1,769,467.280	
DISCOVERY INC-C	30,421	25.830	785,774.430	
MARATHON PETROLEUM CORP	51,474	63.140	3,250,068.360	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	11,624	56.100	652,106.400	
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	160,064	20.140	3,223,688.960	
XYLEM INC	13,160	77.010	1,013,451.600	
ALKERMES PLC	12,053	17.880	215,507.640	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	20,876	87.370	1,823,936.120	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,479	212.470	739,183.130	
SPLUNK INC	12,240	119.680	1,464,883.200	
EPAM SYSTEMS INC	4,003	188.200	753,364.600	
HCA HEALTHCARE INC	21,724	119.430	2,594,497.320	
VERISK ANALYTICS INC	12,320	155.380	1,914,281.600	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,273	117.650	502,718.450	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	6,885	290.650	2,001,125.250	
FIRST REPUBLIC BANK/SAN FRANCISCO CA	13,805	97.180	1,341,569.900	
CIT GROUP INC	9,287	44.050	409,092.350	
NXP SEMICONDUCTOR NV	22,652	111.240	2,519,808.480	
TARGA RESOURCES CORP	19,038	38.450	732,011.100	
LEAR CORP	4,681	117.820	551,515.420	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	8,622	115.180	993,081.960	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	17,268	50.435	870,911.580	
DOLLAR GENERAL CORP	20,252	161.210	3,264,824.920	
FORTINET INC	11,150	79.310	884,306.500	
AON PLC	19,041	191.280	3,642,162.480	
TESLA INC	10,304	256.960	2,647,715.840	
GENERAL MOTORS CO	100,695	35.500	3,574,672.500	
XPO LOGISTICS INC	8,181	74.680	610,957.080	
TRIPADVISOR INC	9,263	38.690	358,385.470	
ALLY FINANCIAL INC	33,215	31.340	1,040,958.100	
CAPRI HOLDINGS LTD	12,138	29.610	359,406.180	
VOYA FINANCIAL INC	10,273	52.700	541,387.100	

APTIV PLC	20,610	86.590	1,784,619.900	
PHILLIPS 66	35,701	106.650	3,807,511.650	
FACEBOOK INC	189,729	183.280	34,773,531.120	
IQVIA HOLDINGS INC	13,453	146.360	1,968,981.080	
DIAMONDBACK ENERGY INC	13,109	83.955	1,100,566.090	
SERVICENOW INC	14,548	269.440	3,919,813.120	
PALO ALTO NETWORKS INC	7,242	213.550	1,546,529.100	
WORKDAY INC	13,168	180.240	2,373,400.320	
ABBVIE INC	116,273	73.760	8,576,296.480	
ZOETIS INC	38,223	126.590	4,838,649.570	
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDINGS LTD	16,899	49.330	833,627.670	
COTY INC	23,813	10.650	253,608.450	
NEWS CORP/NEW-CL A	30,263	13.530	409,458.390	
HD SUPPLY HOLDINGS INC	14,075	39.040	549,488.000	
CDW CORP	11,406	123.330	1,406,701.980	
SPRINT CORP	63,882	6.350	405,650.700	
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	10,199	27.615	281,645.380	
ARCONIC INC	30,749	26.840	825,303.160	
TWILIO INC	8,128	116.590	947,643.520	
SNAP INC	51,731	13.760	711,818.560	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	14,304	41.110	588,037.440	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	5,006	42.585	213,180.510	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-C	14,205	43.130	612,661.650	
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	15,410	18.230	280,924.300	
OKTA INC	8,816	115.770	1,020,628.320	
BAKER HUGHES A GE CO	51,005	22.320	1,138,431.600	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	10,669	75.840	809,136.960	
ALTICE USA INC-A	13,887	28.330	393,418.710	
TECHNIPFMC LTD	31,257	23.260	727,037.820	
BROADCOM INC	31,228	281.660	8,795,678.480	
MONGODB INC	2,869	137.545	394,616.600	
BURLINGTON STORES INC	5,095	200.410	1,021,088.950	
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	9,985	36.500	364,452.500	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	29,578	26.640	787,957.920	
VEEVA SYSTEMS INC	9,780	153.230	1,498,589.400	
TWITTER INC	57,562	39.780	2,289,816.360	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING PLC	13,214	48.820	645,107.480	
EVERGY INC	18,388	63.810	1,173,338.280	
PLAINS GP HOLDINGS LP	14,935	19.350	288,992.250	
ALLEGION PLC	7,469	100.450	750,261.050	
STERIS PLC	6,658	140.080	932,652.640	
DOCUSIGN INC	9,325	67.090	625,614.250	
WIX.COM LTD	4,000	125.670	502,680.000	
DROPBOX INC	17,573	19.340	339,861.820	

KKR & CO INC	37,307	26.130	974,831.910	
PERRIGO CO PLC	10,553	53.050	559,836.650	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	22,290	91.530	2,040,203.700	
ARAMARK	18,144	43.920	796,884.480	
CIGNA CORP	30,329	151.580	4,597,269.820	
DELL TECHNOLOGIES INC	12,960	50.680	656,812.800	
DOW INC	59,468	46.820	2,784,291.760	
AMCOR PLC	130,000	9.590	1,246,700.000	
XEROX HOLDINGS CORP	17,455	29.260	510,733.300	
FOX CORP-A	30,595	31.390	960,377.050	
FOX CORP-B	13,009	31.010	403,409.090	
UBER TECHNOLOGIES INC	13,312	31.120	414,269.440	
CORTEVA INC	59,322	26.330	1,561,948.260	
GRUBHUB INC	8,158	54.410	443,876.780	
PAYCOM SOFTWARE INC	3,772	220.400	831,348.800	
SABRE CORP	19,809	21.340	422,724.060	
PARSLEY ENERGY INC	25,677	15.180	389,776.860	
ARISTA NETWORKS INC	4,441	234.770	1,042,613.570	
IHS MARKIT LTD	29,796	68.150	2,030,597.400	
FNF GROUP	21,372	44.790	957,251.880	
SYNCHRONY FINANCIAL	50,790	33.120	1,682,164.800	
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	35,820	34.560	1,237,939.200	
CYBERARK SOFTWARE LTD	3,457	103.030	356,174.710	
CDK GLOBAL INC	9,969	46.360	462,162.840	
WAYFAIR INC	5,091	106.320	541,275.120	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	15,515	95.480	1,481,372.200	
QORVO INC	8,871	77.340	686,083.140	
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	16,888	33.980	573,854.240	
LIBERTY BROADBAND CORP-C W/I	8,307	106.680	886,190.760	
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	17,018	28.970	493,011.460	
SPECTRUM BRANDS HOLDINGS INC	521	47.270	24,627.670	
GODADDY INC	14,641	62.280	911,841.480	
NIELSEN HOLDINGS PLC	26,204	20.560	538,754.240	
TRANSUNION	15,000	80.430	1,206,450.000	
SQUARE INC	26,487	61.830	1,637,691.210	
DUPONT DE NEMOURS INC	59,916	64.800	3,882,556.800	
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS PLC	19,321	56.820	1,097,819.220	
WESTROCK CO	18,059	36.030	650,665.770	
KRAFT HEINZ CO	51,163	27.320	1,397,773.160	
FORTIVE CORP	24,560	67.960	1,669,097.600	
WASTE CONNECTIONS INC	20,417	91.880	1,875,913.960	
ALPHABET INC-CL A	23,530	1,217.770	28,654,128.100	

	HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	104,040	14.950	1,555,398.000	
	PAYPAL HOLDINGS INC	87,864	101.750	8,940,162.000	
	AXA EQUITABLE HOLDINGS INC	23,220	21.300	494,586.000	
	DXC TECHNOLOGY CO	20,848	28.100	585,828.800	
	ZILLOW GROUP INC-C	11,723	30.120	353,096.760	
	ALPHABET INC-CL C	24,708	1,217.140	30,073,095.120	
	BEIGENE LTD ADR	3,159	122.500	386,977.500	
	LINDE PLC	43,407	192.530	8,357,149.710	
	ATHENE HOLDING LTD	11,847	39.520	468,193.440	
	ROKU INC	6,674	119.120	795,006.880	
	CHARTER COMMUNICATIONS INC	12,571	422.960	5,317,030.160	
	VISTRA ENERGY CORP	30,000	26.970	809,100.000	
アメリカ・ドル　小計		23,832,406		1,988,059,545.400 (215,545,415,912)	
イギリス・ポンド	ANTOFAGASTA PLC	31,798	8.668	275,625.060	
	ASHTEAD GROUP	36,689	21.340	782,943.260	
	SEVERN TRENT PLC	18,217	21.800	397,130.600	
	BHP GROUP PLC	168,058	16.750	2,814,971.500	
	BARCLAYS PLC	1,342,831	1.576	2,116,301.650	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	82,283	6.496	534,510.360	
	BT GROUP PLC	629,282	1.972	1,240,944.100	
	BUNZL PLC	27,838	19.840	552,305.920	
	EASYJET PLC	13,628	12.100	164,898.800	
	AVIVA PLC	314,691	3.968	1,248,693.880	
	CRODA INTERNATIONAL	10,391	47.380	492,325.580	
	DIAGEO PLC	187,608	32.305	6,060,676.440	
	SCHRODERS PLC	10,932	29.300	320,307.600	
	DCC PLC	7,898	68.420	540,381.160	
	NATIONAL GRID PLC	262,780	8.838	2,322,449.640	
	KINGFISHER PLC	165,680	2.141	354,720.880	
	BAE SYSTEMS PLC	248,672	5.586	1,389,081.790	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	182,423	27.170	4,956,432.910	
	HALMA PLC	27,812	18.970	527,593.640	
	NEXT PLC	10,018	65.840	659,585.120	
	IMPERIAL BRANDS PLC	77,987	18.410	1,435,740.670	
	JOHNSON MATTHEY PLC	15,017	29.820	447,806.940	
	ANGLO AMERICAN PLC	84,546	19.350	1,635,965.100	
	COMPASS GROUP PLC	125,998	20.020	2,522,479.960	
	HSBC HOLDINGS PLC	1,596,388	6.073	9,694,864.320	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	450,601	2.596	1,169,760.190	
	CENTRICA PLC	471,340	0.675	318,154.500	
	UNILEVER PLC	87,137	46.450	4,047,513.650	
	MEGGITT PLC	62,181	6.158	382,910.590	

MORRISON SUPERMARKETS	168,676	2.037	343,593.010	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	54,487	8.222	447,992.110	
RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	80,864	5.164	417,581.690	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	30,240	21.870	661,348.800	
PEARSON PLC	65,009	6.910	449,212.190	
PERSIMMON PLC	26,085	22.880	596,824.800	
PRUDENTIAL PLC	204,940	14.675	3,007,494.500	
RIO TINTO PLC	87,857	41.150	3,615,315.550	
VODAFONE GROUP PLC	2,125,994	1.610	3,422,850.340	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	56,430	60.930	3,438,279.900	
RELX PLC	153,894	18.165	2,795,484.510	
RENTOKIL INITIAL PLC	140,617	4.517	635,166.980	
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	139,268	7.524	1,047,852.430	
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	397,434	2.152	855,277.960	
ST JAMES'S PLACE PLC	48,466	9.938	481,655.100	
SSE PLC	83,105	12.815	1,064,990.570	
BP PLC	1,608,793	4.927	7,926,523.110	
SAGE GROUP PLC(THE)	87,111	6.956	605,944.110	
SMITHS GROUP PLC	31,720	15.870	503,396.400	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	5,518	76.200	420,471.600	
STANDARD CHARTERED PLC	218,329	6.548	1,429,618.290	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	5,606,356	0.577	3,234,867.410	
TAYLOR WIMPLEY PLC	252,287	1.625	409,966.370	
TESCO PLC	757,316	2.391	1,810,742.550	
3I GROUP PLC	76,643	10.710	820,846.530	
SMITH & NEPHEW PLC	68,027	18.605	1,265,642.330	
GLAXOSMITHKLINE PLC	393,231	16.842	6,622,796.500	
WEIR GROUP	19,161	13.815	264,709.210	
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	24,660	72.980	1,799,686.800	
WPP PLC	95,148	9.566	910,185.760	
ASTRAZENECA PLC	103,134	69.790	7,197,721.860	
WHITBREAD PLC	9,814	41.700	409,243.800	
CARNIVAL PLC	13,350	31.100	415,185.000	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	176,730	1.890	334,019.700	
JOHN WOOD GROUP PLC	48,988	3.448	168,910.620	
INTERTEK GROUP PLC	12,083	51.880	626,866.040	
BURBERRY GROUP PLC	31,686	19.935	631,660.410	
INVESTEC PLC	50,655	4.244	214,979.820	
INTERCONTINENTAL HOTELS	12,653	47.115	596,146.090	
ITV PLC	254,308	1.282	326,022.850	
SAINSBURY (J) PLC	137,215	2.138	293,365.670	

	G4S PLC	122,250	1.929	235,820.250	
	ADMIRAL GROUP PLC	15,893	20.380	323,899.340	
	THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	10,726	43.660	468,297.160	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	343,568	22.895	7,865,989.360	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	296,907	22.775	6,762,056.920	
	TUI AG-DI	29,824	10.020	298,836.480	
	STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	214,715	2.804	602,060.860	
	EXPERIAN PLC	70,598	24.550	1,733,180.900	
	MONDI PLC	39,767	16.000	636,272.000	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	20,927	17.900	374,593.300	
	FRESNILLO PLC NPR	15,639	6.344	99,213.810	
	OCADO GROUP PLC	40,627	13.025	529,166.670	
	INFORMA PLC	102,475	7.804	799,714.900	
	GLENCORE PLC	866,421	2.308	1,999,699.660	
	GVC HOLDINGS PLC	49,618	8.346	414,111.820	
	EVRAZ PLC	48,765	4.177	203,691.400	
	NMC HEALTH PLC	8,149	26.050	212,281.450	
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP PLC	112,694	2.840	320,050.960	
	COCA-COLA HBC AG	15,208	25.250	384,002.000	
	MERLIN ENTERTAINMENTS PLC	50,037	4.539	227,117.940	
	FERGUSON PLC	18,865	64.280	1,212,642.200	
	MICRO FOCUS INTERNATIONAL PLC	26,100	10.546	275,250.600	
	AUTO TRADER GROUP PLC	76,348	5.226	398,994.640	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	417,620	2.020	843,592.400	
イギリス・ポンド　小計		23,722,747		139,148,052.100 (19,011,798,358)	
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 (396,302,185)	
オーストラリア・ドル	RAMSAY HEALTH CARE LTD	11,115	66.460	738,702.900	
	AUST AND NZ BANKING GROUP LT	219,575	27.670	6,075,640.250	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	274,793	28.900	7,941,517.700	

BANK OF QUEENSLAND LTD	30,569	9.700	296,519.300	
FORTESCUE METALS GROUP LTD	115,662	8.950	1,035,174.900	
TELSTRA CORP LTD	360,654	3.510	1,265,895.540	
BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD	39,014	11.320	441,638.480	
AMP LTD	302,414	1.670	505,031.380	
ASX LTD	15,573	80.920	1,260,167.160	
BHP GROUP LTD	230,460	36.530	8,418,703.800	
CALTEX AUSTRALIA LTD	20,946	26.350	551,927.100	
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	70,363	4.220	296,931.860	
COMPUTERSHARE LT	38,040	15.960	607,118.400	
CSL LIMITED	36,126	243.740	8,805,351.240	
REA GROUP LTD	4,119	109.370	450,495.030	
TRANSURBAN GROUP	209,477	14.500	3,037,416.500	
COCA-COLA AMATIL LTD	48,601	10.440	507,394.440	
COCHLEAR LTD	4,381	208.520	913,526.120	
ORIGIN ENERGY LTD	132,860	8.010	1,064,208.600	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	137,350	79.070	10,860,264.500	
BORAL LIMITED	86,101	4.720	406,396.720	
RIO TINTO LIMITED	30,337	91.910	2,788,273.670	
APA GROUP	94,106	11.210	1,054,928.260	
ARISTOCRAT LEISU	45,323	31.680	1,435,832.640	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	180,573	7.820	1,412,080.860	
TPG TELECOM LTD	28,719	6.860	197,012.340	
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	3,275	41.530	136,010.750	
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	33,926	24.600	834,579.600	
ORICA LTD	27,865	23.130	644,517.450	
CIMIC GROUP LTD	8,709	32.700	284,784.300	
LEND LEASE CORP LTD	42,974	17.630	757,631.620	
BLUESCOPE STEEL LTD	36,941	12.270	453,266.070	
SYDNEY AIRPORT	85,130	8.190	697,214.700	
MACQUARIE GROUP LTD	26,417	131.240	3,466,967.080	
WORLEYPARSONS LTD	19,922	13.280	264,564.160	
SUNCORP GROUP LTD	104,783	13.470	1,411,427.010	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	226,421	28.360	6,421,299.560	
NEWCREST MINING LTD	62,080	33.560	2,083,404.800	
OIL SEARCH LTD	105,470	7.120	750,946.400	
INCITEC PIVOT LTD	136,426	3.330	454,298.580	
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	107,820	12.350	1,331,577.000	
CHALLENGER FINANCIAL SERVICES	45,707	6.940	317,206.580	

	SANTOS LTD	132,862	7.850	1,042,966.700	
	SONIC HEALTHCARE	34,684	28.650	993,696.600	
	WASHINGTON H SOUL PATTINSON & CO LTD	15,007	22.100	331,654.700	
	TABCORP HOLDINGS LTD	148,535	4.820	715,938.700	
	WESFARMERS LTD	91,516	39.660	3,629,524.560	
	ALUMINA LIMITED	184,613	2.240	413,533.120	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	69,115	32.000	2,211,680.000	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	101,937	37.270	3,799,191.990	
	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	9,995	48.550	485,257.250	
	SEEK LTD	25,899	21.190	548,799.810	
	AUSNET SERVICES	165,066	1.815	299,594.790	
	AGL ENERGY LTD	49,644	19.180	952,171.920	
	BRAMBLES LTD	126,693	11.410	1,445,567.130	
	CROWN RESORTS LTD	32,861	12.100	397,618.100	
	AURIZON HOLDINGS LTD	150,150	5.870	881,380.500	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	54,001	18.010	972,558.010	
	MEDIBANK PVT LTD	206,910	3.260	674,526.600	
	SOUTH32 LTD(AUD)	443,160	2.500	1,107,900.000	
	COLES GROUP LTD	96,821	15.190	1,470,710.990	
オーストラリア・ドル　小計		5,980,586		105,052,116.820 (7,712,926,417)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	19,876	68.960	1,370,648.960	
	ALIMENTATION COUCHE TARD INC	68,496	39.330	2,693,947.680	
	BARRICK GOLD CORP	140,953	22.440	3,162,985.320	
	ATCO LTD	7,193	48.500	348,860.500	
	BANK OF MONTREAL	50,286	96.980	4,876,736.280	
	BANK OF NOVA SCOTIA	97,707	75.150	7,342,681.050	
	NATIONAL BANK OF CANADA	25,548	66.390	1,696,131.720	
	BCE INC	11,673	64.530	753,258.690	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT	66,522	69.490	4,622,613.780	
	BAUSCH HEALTH COS INC	25,819	27.250	703,567.750	
	BOMBARDIER INC 'B'	151,615	1.570	238,035.550	
	SAPUTO INC	18,601	38.530	716,696.530	
	BLACKBERRY LTD	39,652	7.020	278,357.040	
	CGI INC	20,610	103.310	2,129,219.100	
	CCL INDUSTRIES INC	11,340	53.060	601,700.400	
	CAE INC	23,000	32.810	754,630.000	
	CAMECO CORP	32,627	12.360	403,269.720	
	ROGERS COMM-CL B	27,696	63.650	1,762,850.400	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	34,564	109.890	3,798,237.960	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	96,491	33.580	3,240,167.780	
	CANADIAN TIRE CORP-CL A	4,862	144.360	701,878.320	

CANADIAN UTILITIES LTD	9,119	39.120	356,735.280	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	57,704	114.780	6,623,265.120	
FIRST CAPITAL REALTY INC	17,676	22.250	393,291.000	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	15,911	45.980	731,587.780	
OPEN TEXT CORP	21,795	53.850	1,173,660.750	
EMPIRE CO LTD	15,093	35.130	530,217.090	
KINROSS GOLD CORP	99,741	6.080	606,425.280	
FORTIS INC	32,068	55.410	1,776,887.880	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	55,296	10.190	563,466.240	
TELUS CORP	15,945	47.700	760,576.500	
GREAT WEST LIFECO INC	20,722	30.710	636,372.620	
IMPERIAL OIL LTD	21,542	32.310	696,022.020	
ENBRIDGE INC	161,215	47.420	7,644,815.300	
IGM FINANCIAL INC	8,426	36.870	310,666.620	
MANULIFE FINANCIAL CORP	154,854	24.000	3,716,496.000	
LOBLAW CO LTD	15,354	73.010	1,120,995.540	
MAGNA INTERNATIONAL INC	25,247	68.460	1,728,409.620	
SUN LIFE FINANCIAL INC	47,728	58.130	2,774,428.640	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,072	560.480	1,161,314.560	
METRO INC	19,949	56.410	1,125,323.090	
HUSKY ENERGY INC	28,749	9.020	259,315.980	
EMERA INC	19,138	57.470	1,099,860.860	
METHANEX CORP	5,281	48.090	253,963.290	
ONEX CORP	6,646	78.830	523,904.180	
POWER CORP OF CANADA	23,792	30.190	718,280.480	
POWER FINANCIAL CORP	21,676	30.400	658,950.400	
QUEBECOR INC-B	17,548	30.600	536,968.800	
ROYAL BANK OF CANADA	113,038	106.330	12,019,330.540	
SNC-LAVALIN GROUP INC	13,134	18.020	236,674.680	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	10,747	285.350	3,066,656.450	
SHAW COMM INC-B	35,431	26.070	923,686.170	
SUNCOR ENERGY INC	123,985	39.360	4,880,049.600	
LUNDIN MINING CORP	43,480	6.820	296,533.600	
ENCANA CORP	96,391	5.840	562,923.440	
TECK RESOURCES LTD-CL B	41,016	22.140	908,094.240	
THOMSON REUTERS CORP	16,394	88.260	1,446,934.440	
TORONTO DOMINION BANK (THE) C$	143,825	73.760	10,608,532.000	
TC ENERGY CORP	72,907	67.580	4,927,055.060	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	5,696	51.160	291,407.360	
WESTON (GEORGE) LTD	6,184	110.240	681,724.160	
INTACT FINANCIAL CORP	10,989	134.420	1,477,141.380	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	34,963	34.610	1,210,069.430	

	CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,565	1,331.990	2,084,564.350	
	FRANCO-NEVADA CORP NPR	14,922	122.230	1,823,916.060	
	CI FINANCIAL CORP	20,695	18.860	390,307.700	
	TOURMALINE OIL CORP	13,354	12.330	164,654.820	
	KEYERA CORP	16,668	30.390	506,540.520	
	ALTAGAS LTD	23,944	19.280	461,640.320	
	PEMBINA PIPELINE CORP	38,119	47.150	1,797,310.850	
	DOLLARAMA INC	23,536	47.280	1,112,782.080	
	STARS GROUP INC	18,529	26.480	490,647.920	
	CENOVUS ENERGY INC W/I	80,721	11.330	914,568.930	
	VERMILION ENERGY INC	12,923	19.950	257,813.850	
	KIRKLAND LAKE GOLD LTD	14,127	59.140	835,470.780	
	INTER PIPELINE LTD	27,474	22.300	612,670.200	
	NUTRIEN LTD	44,453	67.200	2,987,241.600	
	CRONOS GROUP INC	16,000	10.370	165,920.000	
	WSP GLOBAL INC	8,400	77.600	651,840.000	
	IA FINANCIAL CORP INC	8,104	60.100	487,050.400	
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	14,961	16.600	248,352.600	
	AIR CANADA	10,722	45.550	488,387.100	
	RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	18,531	93.790	1,738,022.490	
	AURORA CANNABIS INC	66,562	4.860	323,491.320	
	SHOPIFY INC	7,998	434.980	3,478,970.040	
	CANOPY GROWTH CORP	18,634	25.670	478,334.780	
	HYDRO ONE LTD	27,340	24.550	671,197.000	
カナダ・ドル　小計		3,231,880		147,387,183.710 (12,079,853,577)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE TECH ENG	125,000	4.040	505,000.000	
	SEMBCORP INDUSTRIES	81,400	2.090	170,126.000	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	123,700	2.100	259,770.000	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	692,140	0.210	145,349.400	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	141,900	25.000	3,547,500.000	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	36,400	9.850	358,540.000	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	5,944	30.150	179,211.600	
	SINGAPORE AIRPORT TERMINAL SERVICES LTD	47,800	4.820	230,396.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	68,900	8.350	575,315.000	
	CAPITALAND LTD	204,515	3.570	730,118.550	
	GENTING SINGAPORE LTD	416,400	0.915	381,006.000	
	KEPPEL CORP LTD	100,200	5.970	598,194.000	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	177,900	2.420	430,518.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	251,553	10.780	2,711,741.340	

	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	670,722	3.160	2,119,481.520	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	47,500	9.090	431,775.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	103,200	26.120	2,695,584.000	
	UOL GROUP LIMITED	40,500	7.330	296,865.000	
	VENTURE CORP LTD	21,000	15.380	322,980.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	142,300	3.640	517,972.000	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	188,800	0.975	184,080.000	
シンガポール・ドル　小計		3,687,774		17,391,523.410 (1,377,930,400)	
スイス・フラン	CREDIT SUISSE GROUP AG	207,887	11.975	2,489,446.820	
	NESTLE SA-REGISTERED	241,926	106.060	25,658,671.560	
	CIE FINANC RICHEMONT	40,915	72.300	2,958,154.500	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	55,462	288.200	15,984,148.400	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2,930	221.600	649,288.000	
	SIKA INHABER	10,209	156.550	1,598,218.950	
	SGS SA-REG	424	2,438.000	1,033,712.000	
	NOVARTIS AG-REG SHS	169,630	85.960	14,581,394.800	
	BALOISE HOLDING AG -R	4,127	180.100	743,272.700	
	BARRY CALLEBAUT AG	157	2,086.000	327,502.000	
	CLARIANT AG-REG	19,496	20.730	404,152.080	
	SWISSCOM AG-REG	1,960	502.600	985,096.000	
	ABB LTD	144,013	18.475	2,660,640.170	
	ADECCO GROUP AG-REG	12,944	55.480	718,133.120	
	GEBERIT AG	2,901	471.200	1,366,951.200	
	LONZA GROUP AG-REG	5,793	332.700	1,927,331.100	
	LINDT & SPRUENGLI PART	79	7,225.000	570,775.000	
	LINDT & SPRUENGLI NAMEN	9	81,500.000	733,500.000	
	GIVAUDAN-REG	742	2,823.000	2,094,666.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	12,042	385.900	4,647,007.800	
	LAFARGEHOLCIM LTD	37,997	47.440	1,802,577.680	
	TEMENOS GROUP	4,730	169.300	800,789.000	
	SONOVA HOLDING AG	4,584	227.200	1,041,484.800	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG	4,018	148.000	594,664.000	
	STRAUMANN HOLDING AG	794	856.600	680,140.400	
	THE SWATCH GROUP AG-B	2,134	261.500	558,041.000	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	4,592	49.220	226,018.240	
	SCHINDLER NAMEN	1,663	220.400	366,525.200	
	SWISS LIFE HOLDING AG	2,774	480.200	1,332,074.800	
	VIFOR PHARMA AG	3,465	155.650	539,327.250	
	EMS-CHEMIE HOLDING	633	628.000	397,524.000	
	SWISS PRIME SITE AG	5,990	99.750	597,502.500	
	PARGESA HOLDING PORTEUR	3,000	76.500	229,500.000	
	DUFRY GROUP	3,138	82.500	258,885.000	

	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,505	762.000	1,146,810.000	
	JULIUS BAER GROUP LTD	17,849	43.990	785,177.510	
	SWISS RE LTD	24,816	101.300	2,513,860.800	
	ALCON INC	32,032	56.700	1,816,214.400	
	UBS GROUP AG	301,686	11.070	3,339,664.020	
スイス・フラン　小計		1,391,046		101,158,842.800 (10,997,989,389)	
スウェーデン・クローナ	ATLAS COPCO AB-A SHS	52,284	301.100	15,742,712.400	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	33,303	264.900	8,821,964.700	
	ERICSSON LM-B SHS	236,160	82.000	19,365,120.000	
	LUNDBERGS B	7,382	360.000	2,657,520.000	
	SKF AB-B SHS	28,812	168.450	4,853,381.400	
	SANDVIK AB	87,784	153.250	13,452,898.000	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	130,827	91.960	12,030,850.920	
	SKANSKA AB-B SHS	24,400	203.300	4,960,520.000	
	SWEDBANK AB	71,958	139.500	10,038,141.000	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	126,705	92.360	11,702,473.800	
	VOLVO AB-B SHS	119,227	138.300	16,489,094.100	
	SWEDISH MATCH AB	12,941	393.700	5,094,871.700	
	TELE2 AB-B SHS	34,618	137.800	4,770,360.400	
	INDUSTRIVARDEN C	11,403	201.300	2,295,423.900	
	ELECTROLUX AB-SER B	19,191	246.900	4,738,257.900	
	SECURITAS AB-B SHS	24,098	149.600	3,605,060.800	
	INVESTOR AB-B SHS	35,180	476.500	16,763,270.000	
	HENNES&MAURITZ AB-B SHS	60,283	203.950	12,294,717.850	
	ASSA ABLOY AB-B	81,088	213.400	17,304,179.200	
	TELIA CO AB	231,855	44.230	10,254,946.650	
	LUNDIN PETROLEUM AB	16,790	301.400	5,060,506.000	
	BOLIDEN AB	21,855	246.900	5,395,999.500	
	ALFA LAVAL AB	23,343	197.450	4,609,075.350	
	KINNEVIK AB-B	18,310	261.600	4,789,896.000	
	MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR SA	5,332	463.600	2,471,915.200	
	ICA GRUPPEN AB	5,920	445.300	2,636,176.000	
	HUSQVARNA AB-B SHS	33,692	73.340	2,470,971.280	
	HEXAGON AB	22,037	452.000	9,960,724.000	
	EPIROC AB-A	48,955	106.550	5,216,155.250	
	EPIROC AB-B	30,899	102.100	3,154,787.900	
	ESSITY AB-B	46,640	283.100	13,203,784.000	
	NORDEA BANK ABP	259,268	69.500	18,019,126.000	
スウェーデン・クローナ　小計		1,962,540		274,224,881.200 (3,027,442,688)	
デンマーク・クローネ	CARLSBERG AS-B	8,441	1,001.500	8,453,661.500	
	A P MOLLER A/S	604	7,874.000	4,755,896.000	

	AP MOLLER MAERSK A	273	7,395.000	2,018,835.000	
	DANSKE BANK A/S	51,034	95.980	4,898,243.320	
	GENMAB A/S	4,745	1,346.000	6,386,770.000	
	NOVOZYMES-B SHS	15,533	298.400	4,635,047.200	
	NOVO NORDISK A/S-B	140,645	354.450	49,851,620.250	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	15,604	540.600	8,435,522.400	
	COLOPLAST-B	9,729	794.000	7,724,826.000	
	DSV PANALPINA A/S	17,626	637.000	11,227,762.000	
	DEMANT A/S	7,244	172.150	1,247,054.600	
	H LUNDBECK A/S	4,840	224.600	1,087,064.000	
	TRYG A/S	11,107	187.400	2,081,451.800	
	PANDORA A/S	8,251	275.700	2,274,800.700	
	CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S	7,539	543.800	4,099,708.200	
	ISS A/S	11,107	162.850	1,808,774.950	
	ORSTED A/S	15,090	628.400	9,482,556.000	
デンマーク・クローネ　小計		329,412		130,469,593.920 (2,088,818,199)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	85,245	8.900	758,680.500	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	29,894	13.300	397,590.200	
	A2 MILK CO LTD	55,091	13.280	731,608.480	
	FISHER & PAYKEL	43,184	18.320	791,130.880	
	FLETCHER BUILDING LTD	64,104	4.680	300,006.720	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	159,623	4.510	719,899.730	
	MERIDIAN ENERGY LTD	90,173	5.225	471,153.920	
ニュージーランド・ドル　小計		527,314		4,170,070.430 (284,940,912)	
ノルウェー・クローネ	MOWI ASA	35,183	207.500	7,300,472.500	
	DNB ASA	79,858	157.350	12,565,656.300	
	NORSK HYDRO ASA	93,139	31.250	2,910,593.750	
	TELENOR ASA	54,766	180.350	9,877,048.100	
	ORKLA ASA	64,938	83.920	5,449,596.960	
	EQUINOR ASA	81,022	167.000	13,530,674.000	
	YARA INTERNATIONAL ASA	12,535	383.600	4,808,426.000	
	AKER BP ASA	8,552	243.400	2,081,556.800	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	16,683	181.650	3,030,466.950	
	SCHIBSTED ASA	7,445	249.000	1,853,805.000	
ノルウェー・クローネ　小計		454,121		63,408,296.360 (755,192,810)	
ユーロ	CRH PLC	61,990	31.180	1,932,848.200	
	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	6,246	86.920	542,902.320	
	KERRY GROUP PLC-A	12,258	106.600	1,306,702.800	
	KINGSPAN GROUP PLC	11,768	46.300	544,858.400	
	UMICORE	14,115	36.280	512,092.200	
	AIR LIQUIDE	34,252	118.500	4,058,862.000	

AIRBUS SE	46,450	118.300	5,495,035.000	
AXA	153,753	23.495	3,612,426.730	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	44,449	23.290	1,035,217.210	
ADIDAS AG	14,421	280.900	4,050,858.900	
ASSICURAZIONI GENERALI	87,030	17.965	1,563,493.950	
DASSAULT AVIATION SA	163	1,247.000	203,261.000	
DANONE	48,833	79.520	3,883,200.160	
SAFRAN SA	25,898	141.450	3,663,272.100	
INTESA SANPAOLO	1,154,007	2.180	2,515,735.260	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	25,603	64.910	1,661,890.730	
ACCOR SA	16,000	38.080	609,280.000	
BOUYGUES	17,572	38.330	673,534.760	
BNP PARIBAS	87,496	45.390	3,971,443.440	
THALES SA	8,549	96.720	826,859.280	
CAPGEMINI SA	12,515	108.300	1,355,374.500	
CASINO GUICHARD PERRACHON	4,264	42.390	180,750.960	
INGENICO GROUP	4,334	93.080	403,408.720	
UNICREDIT SPA	155,718	10.868	1,692,343.220	
NATIXIS	70,166	3.812	267,472.790	
KONINKLIJKE DSM NV	13,812	109.000	1,505,508.000	
COMMERZBANK AG	83,118	5.232	434,873.370	
EIFFAGE	6,461	94.340	609,530.740	
FRESENIUS SE & CO KGAA	34,325	42.210	1,448,858.250	
UNITED INTERNET	9,882	34.400	339,940.800	
FUCHS PETROLUB SE PREF	5,546	34.180	189,562.280	
PUBLICIS GROUPE	15,071	37.260	561,545.460	
FAURECIA	6,117	43.490	266,028.330	
IBERDROLA SA	475,457	9.254	4,399,879.070	
ENI SPA	197,346	13.744	2,712,323.420	
IMERYS SA	2,256	35.180	79,366.080	
JERONIMO MARTINS	19,517	14.980	292,364.660	
KBC GROUPE	18,480	60.840	1,124,323.200	
HANNOVER RUECK SE	4,868	156.400	761,355.200	
WARTSILA OYJ	34,935	10.205	356,511.670	
L'OREAL	19,882	243.800	4,847,231.600	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	21,883	379.250	8,299,127.750	
GEA GROUP AG	11,838	25.640	303,526.320	
BOLLORE	71,347	3.770	268,978.190	
MEDIOBANCA SPA	56,009	10.105	565,970.940	
MICHELIN(CGDE)-B	13,744	102.950	1,414,944.800	
CONTINENTAL AG	8,312	115.780	962,363.360	
DEUTSCHE POST AG-REG	77,008	29.760	2,291,758.080	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	15,885	12.170	193,320.450	
NOKIAN RENKAAT OYJ	9,399	27.440	257,908.560	
OMV AG	12,817	49.400	633,159.800	

VERBUND AG	4,095	48.400	198,198.000	
PERNOD-RICARD	16,719	168.650	2,819,659.350	
PEUGEOT SA	43,905	22.830	1,002,351.150	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	13,249	63.120	836,276.880	
RENAULT SA	14,917	53.770	802,087.090	
REPSOL SA	111,616	14.525	1,621,222.400	
REMY COINTREAU	1,860	127.000	236,220.000	
MERCK KGAA	9,875	104.150	1,028,481.250	
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	39,436	36.760	1,449,667.360	
RWE AG	41,119	27.230	1,119,670.370	
SEB SA	1,551	136.200	211,246.200	
SOCIETE GENERALE-A	58,575	25.215	1,476,968.620	
VINCI S.A.	40,007	99.160	3,967,094.120	
SODEXO	7,075	97.700	691,227.500	
SOLVAY SA	5,563	95.820	533,046.660	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	43,656	80.320	3,506,449.920	
VIVENDI SA	73,790	24.910	1,838,108.900	
SAP SE	77,393	114.760	8,881,620.680	
TELEFONICA S.A	367,755	6.985	2,568,768.670	
TOTAL SA	188,674	45.840	8,648,816.160	
VALEO	19,653	31.600	621,034.800	
E.ON SE	181,317	8.856	1,605,743.350	
VOEST-ALPINE AG	9,875	21.440	211,720.000	
HENKEL AG & CO KGAA	9,300	84.500	785,850.000	
SIEMENS AG-REG	61,207	99.180	6,070,510.260	
UPM-KYMMENE OYJ	44,548	27.820	1,239,325.360	
ING GROEP NV-CVA	304,508	9.831	2,993,618.140	
PUMA AG	7,351	71.250	523,758.750	
BAYER AG	74,253	65.610	4,871,739.330	
STORA ENSO OYJ-R SHS	41,234	11.470	472,953.980	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	13,759	93.480	1,286,191.320	
DAIMLER AG	70,984	47.065	3,340,861.960	
BASF SE	72,808	64.590	4,702,668.720	
BEIERSDORF AG	8,371	104.450	874,350.950	
HOCHTIEF AG	1,707	106.100	181,112.700	
HEIDELBERGCEMENT AG	12,031	63.580	764,930.980	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	16,214	59.820	969,921.480	
ORANGE	162,849	14.700	2,393,880.300	
SAMPO OYJ-A SHS	36,141	35.830	1,294,932.030	
RANDSTAD NV	9,074	45.800	415,589.200	
ALLIANZ SE	33,915	210.700	7,145,890.500	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	201,606	3.579	721,547.870	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	90,890	22.770	2,069,565.300	
HERMES INTL	2,483	634.200	1,574,718.600	

ENDESA S.A.	23,417	23.390	547,723.630	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	16,096	14.805	238,301.280	
ERSTE GROUP BANK AG	25,117	30.140	757,026.380	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	11,633	240.200	2,794,246.600	
ARCELOR MITTAL (NL)	46,739	13.106	612,561.330	
SOCIETE BIC SA	2,478	63.200	156,609.600	
DASSAULT SYSTEMES SA	10,913	137.700	1,502,720.100	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	20,137	36.140	727,751.180	
HEINEKEN NV	21,066	97.540	2,054,777.640	
AKZO NOBEL	17,491	82.840	1,448,954.440	
ASML HOLDING NV	33,749	236.100	7,968,138.900	
AEGON NV	150,349	3.837	576,889.110	
BANKINTER S.A.	57,960	5.964	345,673.440	
VOLKSWAGEN AG	2,645	162.350	429,415.750	
VOLKSWAGEN AG PFD	14,401	161.840	2,330,657.840	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	523,594	4.634	2,426,334.590	
KERING	5,915	471.700	2,790,105.500	
CNP ASSURANCES	13,987	17.890	250,227.430	
FORTUM OYJ	37,452	21.260	796,229.520	
AGEAS	14,365	50.460	724,857.900	
UCB SA	9,143	66.740	610,203.820	
THYSSENKRUPP AG	27,110	12.560	340,501.600	
CARREFOUR SA	51,094	15.260	779,694.440	
NATURGY ENERGY GROUP SA	23,612	24.130	569,757.560	
ATOS SE	6,718	65.380	439,222.840	
NOKIA OYJ	430,800	4.559	1,964,017.200	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	71,925	39.345	2,829,889.120	
WOLTERS KLUWER-CVA	22,865	63.920	1,461,530.800	
SANOFI	89,628	81.410	7,296,615.480	
STMICROELECTRONICS NV	55,611	19.030	1,058,277.330	
ELISA OYJ	10,787	47.260	509,793.620	
BANCO SANTANDER SA	1,337,561	3.754	5,021,203.990	
METSO OYJ	8,585	32.200	276,437.000	
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	34,596	18.070	625,149.720	
QIAGEN N.V.	17,974	24.750	444,856.500	
1&1 DRILLISCH AG	3,149	29.800	93,840.200	
DEUTSCHE BANK AG-REG	149,384	6.852	1,023,579.160	
BMW VORZUG	4,116	50.700	208,681.200	
ENEL SPA	652,089	6.779	4,420,511.330	
COLRUYT NV	4,673	49.990	233,603.270	
VOPAK (KON.)	5,364	48.270	258,920.280	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	263,592	15.496	4,084,621.630	
SARTORIUS AG	2,712	171.300	464,565.600	
LEONARDO SPA	28,316	10.395	294,344.820	
UBISOFT ENTERTAINMENT	5,935	57.500	341,262.500	

INFINEON TECHNOLOGIES AG	99,068	16.644	1,648,887.790	
CARL ZEISS MEDITEC AG	3,771	103.200	389,167.200	
KONINKLIJKE KPN NV	291,029	2.930	852,714.970	
EUROFINS SCIENTIFIC	794	467.000	370,798.000	
TELEPERFORMANCE	4,421	194.100	858,116.100	
DEUTSCHE BOERSE AG	14,705	143.850	2,115,314.250	
EURAZEO	2,748	68.650	188,650.200	
BANCO SABADELL	407,477	0.965	393,215.300	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	6,689	87.880	587,829.320	
FRAPORT AG	3,149	76.200	239,953.800	
HEINEKEN HOLDING NV-A	9,791	89.600	877,273.600	
INDITEX	84,992	28.410	2,414,622.720	
JC DECAUX SA	6,058	22.640	137,153.120	
ANDRITZ AG	6,265	36.680	229,800.200	
MAPFRE SA	84,474	2.472	208,819.720	
ESSILORLUXOTTICA	22,811	134.350	3,064,657.850	
SNAM SPA	169,163	4.566	772,398.250	
CREDIT AGRICOLE SA	85,432	11.245	960,682.840	
ENAGAS	18,095	20.710	374,747.450	
WENDEL	2,220	124.000	275,280.000	
WIRECARD AG	8,963	140.000	1,254,820.000	
TENARIS SA	36,959	9.380	346,675.420	
TELECOM ITALIA SPA	762,675	0.532	405,743.100	
TELECOM ITALIA-RNC	497,596	0.514	255,764.340	
ATLANTIA SPA	37,365	21.900	818,293.500	
ILIAD SA	2,102	86.040	180,856.080	
PROXIMUS	14,283	27.550	393,496.650	
SES FDR	25,070	17.400	436,218.000	
TERNA SPA	113,654	5.746	653,055.880	
BIOMERIEUX	3,248	75.250	244,412.000	
GRIFOLS SA	23,518	27.250	640,865.500	
FERROVIAL SA	38,062	25.950	987,708.900	
LANXESS AG	6,856	58.140	398,607.840	
NESTE OYJ	32,931	28.800	948,412.800	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	9,641	21.070	203,135.870	
RECORDATI SPA	6,859	37.470	257,006.730	
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	39,752	8.490	337,494.480	
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	4,168	244.300	1,018,242.400	
KONE OYJ	26,502	52.420	1,389,234.840	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,884	127.000	239,268.000	
ENGIE	148,970	15.100	2,249,447.000	
ALSTOM	15,712	37.950	596,270.400	
TELENET GROUP HOLDING NV	3,634	43.160	156,843.440	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	12,542	17.965	225,317.030	
ELECTRICITE DE FRANCE	53,800	9.424	507,011.200	

IPSEN SA	3,646	88.550	322,853.300	
DEUTSCHE WOHNEN	26,722	33.910	906,143.020	
ARKEMA SA	5,033	85.080	428,207.640	
LEGRAND SA	20,673	67.380	1,392,946.740	
UNILEVER NV	115,908	53.400	6,189,487.200	
ADP	2,313	164.300	380,025.900	
ORION OYJ	8,051	33.470	269,466.970	
RTL GROUP SA	3,446	43.100	148,522.600	
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	40,088	13.565	543,793.720	
SYMRISE AG	9,988	85.700	855,971.600	
SCOR SE	13,875	36.850	511,293.750	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	17,397	28.400	494,074.800	
PRYSMIAN SPA	21,452	19.975	428,503.700	
CAIXABANK	297,224	2.519	748,707.250	
BUREAU VERITAS SA	23,179	21.420	496,494.180	
GETLINK	37,646	14.280	537,584.880	
SUEZ SA	26,620	13.590	361,765.800	
AMADEUS IT GROUP SA	33,891	65.940	2,234,772.540	
BRENNTAG AG	12,353	44.370	548,102.610	
EVONIK INDUSTRIES AG	17,116	22.790	390,073.640	
EDENRED	19,188	42.730	819,903.240	
BANKIA SA	100,675	1.745	175,677.870	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	61,541	2.637	162,283.610	
HUGO BOSS AG -ORD	5,218	37.600	196,196.800	
KION GROUP AG	4,567	49.830	227,573.610	
VONOVIA SE	41,548	46.560	1,934,474.880	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	82,256	4.156	341,855.930	
KNORR-BREMSE AG	4,492	87.470	392,915.240	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	11,468	35.340	405,279.120	
FERRARI NV	9,887	140.250	1,386,651.750	
METRO AG	10,774	14.575	157,031.050	
CNH INDUSTRIAL NV	77,951	9.664	753,318.460	
AROUNDTOWN SA	71,783	7.376	529,471.400	
AIB GROUP PLC	86,464	3.090	267,173.760	
MONCLER SPA	14,353	34.200	490,872.600	
PROSUS NV	39,000	65.670	2,561,130.000	
CELLNEX TELECOM SA-RTS	14,116	3.030	42,771.480	
AXEL SPRINGER SE	4,978	62.500	311,125.000	
WORLDLINE SA	7,758	57.400	445,309.200	
NN GROUP NV	25,887	33.180	858,930.660	
FINECOBANK SPA	45,048	9.596	432,280.600	
ZALANDO SE	9,414	41.520	390,869.280	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	89,977	11.936	1,073,965.470	
AENA SME SA	5,338	167.950	896,517.100	
CELLNEX TELECOM SAU	14,116	39.110	552,076.760	

	ABN AMRO BANK NV	34,251	16.295	558,120.040	
	EXOR NV	7,971	61.140	487,346.940	
	COVESTRO AG	12,708	45.100	573,130.800	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	60,646	83.130	5,041,501.980	
	POSTE ITALIANE SPA	40,015	10.595	423,958.920	
	AMUNDI SA	4,119	63.000	259,497.000	
	ADYEN NV	706	638.400	450,710.400	
	PIRELLI & C SPA	34,086	5.428	185,018.800	
	UNIPER SE	14,252	27.570	392,927.640	
	DELIVERY HERO SE	8,081	39.900	322,431.900	
ユーロ　小計		15,438,067		312,176,640.550 (37,314,473,845)	
香港・ドル	ASM PACIFIC TECH	19,100	105.800	2,020,780.000	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	164,000	18.100	2,968,400.000	
	BANK OF EAST ASIA	103,860	18.560	1,927,641.600	
	CLP HOLDINGS LTD	136,000	80.800	10,988,800.000	
	PCCW LTD	331,000	4.480	1,482,880.000	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	49,500	55.200	2,732,400.000	
	HONG KONG EXCHANGES &CLEAR	94,440	237.200	22,401,168.000	
	MTR CORP	126,000	43.500	5,481,000.000	
	HANG SENG BANK LTD	58,500	164.300	9,611,550.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	115,450	37.250	4,300,512.500	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	101,500	54.250	5,506,375.000	
	(THE) WHARF HOLDINGS LTD	95,750	17.360	1,662,220.000	
	HONG KONG & CHINA GAS	774,755	15.280	11,838,256.400	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	50,000	29.800	1,490,000.000	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	178,000	51.250	9,122,500.000	
	KERRY PROPERTIES LTD	73,500	24.650	1,811,775.000	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	277,000	26.150	7,243,550.000	
	NWS HOLDINGS LTD	135,000	12.280	1,657,800.000	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HOLDINGS	50,500	21.100	1,065,550.000	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	484,266	10.360	5,016,995.760	
	SHANGRI-LA ASIA LTD	104,000	7.930	824,720.000	
	SINO LAND CO	255,400	11.980	3,059,692.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	125,000	112.400	14,050,000.000	
	SWIRE PACIFIC LTD A	47,500	72.650	3,450,875.000	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	113,500	57.050	6,475,175.000	
	VITASOY INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	70,000	32.400	2,268,000.000	
	WHEELOCK & CO LTD	64,000	45.850	2,934,400.000	
	SJM HOLDINGS LTD	156,000	7.910	1,233,960.000	

	WYNN MACAU LTD	124,400	15.980	1,987,912.000	
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	64,800	12.500	810,000.000	
	AIA GROUP LTD	949,427	73.800	70,067,712.600	
	HKT TRUST / HKT LTD	289,000	12.320	3,560,480.000	
	SANDS CHINA LTD	199,200	36.500	7,270,800.000	
	SWIRE PROPERTIES LTD	104,200	23.800	2,479,960.000	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT CO LTD	95,750	43.000	4,117,250.000	
	HK ELECTRIC INVESTMENTS & HK ELECTRIC INVESTMENTS LTD	230,000	7.470	1,718,100.000	
	WH GROUP LTD	706,500	7.720	5,454,180.000	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	208,832	71.550	14,941,929.600	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	198,332	52.700	10,452,096.400	
香港・ドル　小計		7,523,962		267,487,396.860 (3,696,675,825)	
合計		88,460,600		314,289,760,517 (314,289,760,517)	

（２）株式以外の有価証券

令和1年10月15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	997,985.000	
		GOODMAN GROUP	132,051.000	1,856,637.060	
		GPT GROUP	140,307.000	858,678.840	
		MIRVAC GROUP	290,474.000	885,945.700	
		SCENTRE GROUP	420,268.000	1,664,261.280	
		STOCKLAND	194,018.000	876,961.360	
		VICINITY CENTRES	270,443.000	700,447.370	
	オーストラリア・ドル　小計		1,532,136.000	7,840,916.610 (575,680,098)	
	シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	200,806.000	632,538.900	
		CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	206,300.000	427,041.000	
		CAPITALAND MALL TRUST	199,000.000	523,370.000	
		SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	192,100.000	363,069.000	
	シンガポール・ドル　小計		798,206.000	1,946,018.900 (154,183,077)	
投資信託受益証券　合計			2,330,342	729,863,175 (729,863,175)	
投資証券	アメリカ・ドル	AGNC INVESTMENT CORP	44,741.000	724,133.080	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	8,646.000	1,330,360.020	
		AMERICAN TOWER CORP	34,655.000	7,819,554.200	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	108,247.000	938,501.490	

	AVALONBAY COMMUNITIES INC	11,347.000	2,474,553.760	
	BOSTON PROPERTIES INC	12,027.000	1,534,284.390	
	CAMDEN PROPERTY TRUST	8,062.000	908,668.020	
	CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	32,699.000	4,451,314.870	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	16,931.000	2,198,490.350	
	DUKE REALTY TRUST	27,278.000	909,721.300	
	EQUINIX INC	6,638.000	3,767,065.000	
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	6,813.000	922,820.850	
	EQUITY RESIDENTIAL	30,415.000	2,663,745.700	
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	5,075.000	1,662,164.000	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	10,754.000	1,239,290.960	
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	6,000.000	815,940.000	
	HCP INC	40,162.000	1,471,937.300	
	HOST HOTELS & RESORTS INC	55,116.000	898,941.960	
	INVITATION HOMES INC	36,281.000	1,097,137.440	
	IRON MOUNTAIN INC	23,977.000	779,252.500	
	KIMCO REALTY	32,980.000	684,994.600	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	11,649.000	592,351.650	
	MID AMERICA	8,834.000	1,171,565.080	
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	13,649.000	778,402.470	
	PROLOGIS INC	49,995.000	4,312,568.700	
	PUBLIC STORAGE	12,188.000	2,990,082.040	
	REALTY INCOME CORP	26,099.000	2,034,939.030	
	REGENCY CENTERS CORP	12,096.000	827,850.240	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	8,778.000	2,114,269.080	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	23,931.000	3,557,343.150	
	SL GREEN	7,097.000	570,953.650	
	SUN COMMUNITIES INC	6,979.000	1,064,925.610	
	THE MACERICH COMPANY	9,014.000	249,056.820	
	UDR INC	22,345.000	1,083,955.950	
	VENTAS INC	27,669.000	2,010,152.850	
	VEREIT INC	69,822.000	677,273.400	
	VORNADO REALTY TRUST	12,472.000	775,633.680	
	WELLTOWER INC	31,541.000	2,895,148.390	
	WEYERHAEUSER CO	57,621.000	1,565,562.570	
	WP CAREY INC	13,039.000	1,179,768.720	
アメリカ・ドル　小計		983,662.000	69,744,674.870 (7,561,717,649)	
イギリス・ポンド	BRITISH LAND CO PLC	69,819.000	412,490.650	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	55,843.000	498,007.870	
	SEGRO PLC	87,247.000	705,828.230	

	イギリス・ポンド　小計		212,909.000	1,616,326.750 (220,838,724)	
	カナダ・ドル	H & R REAL ESTATE INVESTMENT	10,748.000	247,096.520	
		RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	13,467.000	356,606.160	
		SMARTCENTRES REIT	3,067.000	99,156.110	
	カナダ・ドル　小計		27,282.000	702,858.790 (57,606,306)	
	ユーロ	COVIVIO	4,265.000	421,595.250	
		GECINA SA	3,670.000	556,372.000	
		ICADE	2,234.000	189,331.500	
		KLEPIERRE	17,042.000	538,697.620	
		UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	10,898.000	1,455,972.800	
	ユーロ　小計		38,109.000	3,161,969.170 (377,950,175)	
	香港・ドル	LINK REIT	173,000.000	14,307,100.000	
	香港・ドル　小計		173,000.000	14,307,100.000 (197,724,122)	
投資証券　合計			1,434,962	8,415,836,976 (8,415,836,976)	
合計				9,145,700,151 (9,145,700,151)	

（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	65.23	－	－	68.98
	投資証券	40銘柄	－	－	2.29	
イギリス・ポンド	株式	94銘柄	5.75	－	－	5.95
	投資証券	3銘柄	－	－	0.07	
イスラエル・シュケル	株式	8銘柄	0.12	－	－	0.12
オーストラリア・ドル	株式	61銘柄	2.33	－	－	2.56
	投資信託受益証券	7銘柄	－	0.17	－	
カナダ・ドル	株式	87銘柄	3.66	－	－	3.75
	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	3.33	－	－	3.40
スウェーデン・クローナ	株式	32銘柄	0.92	－	－	0.94
デンマーク・クローネ	株式	17銘柄	0.63	－	－	0.65
ニュージーランド・ドル	株式	7銘柄	0.09	－	－	0.09
ノルウェー・クローネ	株式	10銘柄	0.23	－	－	0.23
ユーロ	株式	240銘柄	11.29	－	－	11.65
	投資証券	5銘柄	－	－	0.11	
香港・ドル	株式	39銘柄	1.12	－	－	1.20
	投資証券	1銘柄	－	－	0.06	

（注）「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

外国債券パッシブ・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15日現在
資産の部	
流動資産	
預金	1,748,898,289
コール・ローン	3,281,224,738
国債証券	147,596,557,211
派生商品評価勘定	7,582,422
未収入金	9,706,123
未収利息	1,180,002,158
前払費用	17,167,095
流動資産合計	153,841,138,036
資産合計	153,841,138,036
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	25,591
未払金	1,925,345,338
未払解約金	975,293,000
流動負債合計	2,900,663,929
負債合計	2,900,663,929
純資産の部	
元本等	
元本	80,233,922,435
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	70,706,551,672
元本等合計	150,940,474,107
純資産合計	150,940,474,107
負債純資産合計	153,841,138,036

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30年10月13日 至　令和1年10月15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15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	112,458,205,288円
同期中追加設定元本額	18,594,577,183円
同期中一部解約元本額	50,818,860,036円
元本の内訳	
ファンド名	
ＤＩＡＭ外国債券パッシブ・ファンド	8,734,932,395円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	7,244,109円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	25,014,704円
ＭＩＴＯ　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	5,265,551,247円
たわらノーロード　先進国債券＜ラップ向け＞	117,265,520円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	324,168,419円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	7,140,860円
たわらノーロード　バランス（標準型）	36,582,068円
たわらノーロード　バランス（積極型）	7,879,116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）	882,203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）	68,110,795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）	83,961,246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）	18,048,156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）	9,461,057円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	1,429,662円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	2,129,412円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	742,458円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	866,674円
ＤＩＡＭ外国債券インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	5,672,241,021円
Ｏｎｅ　ＤＣ　先進国債券インデックスファンド	536,470円
ＤＩＡＭ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	1,969,179,127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＞	1,705,490円
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（堅実型）	6,472,236円
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（積極型）	17,468,446円
４資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	26,615,064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）	80,590,450円
ＤＩＡＭバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,900,105,199円
ＤＩＡＭバランスファンド３７．５ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,974,963,755円
ＤＩＡＭバランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	3,433,437,917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）	802,412,633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）	494,271,753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）	666,181,739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
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）	14,694,204,228円
ＤＩＡＭ世界バランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	83,602,603円
ＤＩＡＭバランス２０ＶＡ（適格機関投資家限定）	104,003,990円
ＤＩＡＭバランス４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	365,068円
ＤＩＡＭバランス６０ＶＡ（適格機関投資家限定）	164,579円
計	80,233,922,435円
２．　受益権の総数	80,233,922,435口

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

項目	自　平成30年10月13日 至　令和1年10月15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15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15日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
国債証券	8,079,306,182
合計	8,079,306,182

（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15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15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	271,490,000	－	271,504,642	△14,642
アメリカ・ドル	169,550,000	－	169,539,051	10,949
ユーロ	101,940,000	－	101,965,591	△25,591
買建	2,113,830,000	－	2,121,401,473	7,571,473
アメリカ・ドル	1,239,950,000	－	1,243,620,866	3,670,866
イギリス・ポンド	5,090,000	－	5,172,537	82,537
ユーロ	868,790,000	－	872,608,070	3,818,070
合計	2,385,320,000	－	2,392,906,115	7,556,831

（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。

①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。

②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15日現在
1口当たり純資産額	1.8813円
（1万口当たり純資産額）	(18,813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15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	3,650,675.000	
		US T N/B 1.25 08/31/24	2,440,000.000	2,403,590.610	
		US T N/B 1.375 01/31/21	2,750,000.000	2,739,042.950	
		US T N/B 1.375 04/30/21	11,210,000.000	11,154,825.720	
		US T N/B 1.375 06/30/23	3,460,000.000	3,432,698.420	
		US T N/B 1.375 08/31/26	1,100,000.000	1,079,203.120	
		US T N/B 1.375 09/30/23	5,100,000.000	5,059,757.780	
		US T N/B 1.5 08/15/26	5,360,000.000	5,304,306.220	
		US T N/B 1.5 09/15/22	750,000.000	748,447.260	
		US T N/B 1.5 09/30/21	5,120,000.000	5,108,599.960	
		US T N/B 1.625 02/15/26	5,500,000.000	5,490,117.160	
		US T N/B 1.625 05/15/26	4,290,000.000	4,278,939.820	
		US T N/B 1.625 05/31/23	5,300,000.000	5,307,453.120	
		US T N/B 1.625 08/15/22	5,800,000.000	5,807,929.640	
		US T N/B 1.625 08/15/29	2,090,000.000	2,065,997.630	
		US T N/B 1.625 11/15/22	6,090,000.000	6,098,564.060	
		US T N/B 1.625 11/30/20	8,510,000.000	8,506,675.730	
		US T N/B 1.75 01/31/23	5,710,000.000	5,740,334.370	
		US T N/B 1.75 03/31/22	6,990,000.000	7,014,028.120	
		US T N/B 1.75 05/15/22	5,400,000.000	5,422,359.340	
		US T N/B 1.75 05/15/23	7,000,000.000	7,038,281.250	
		US T N/B 1.75 06/15/22	830,000.000	833,598.820	
		US T N/B 1.75 07/31/24	5,280,000.000	5,320,012.470	
		US T N/B 1.75 09/30/22	6,510,000.000	6,542,041.370	
		US T N/B 1.75 12/31/20	9,000,000.000	9,009,843.750	
		US T N/B 1.875 02/28/22	1,680,000.000	1,689,712.500	
		US T N/B 1.875 07/31/26	2,370,000.000	2,402,217.180	
		US T N/B 1.875 08/31/22	6,270,000.000	6,320,943.750	
		US T N/B 1.875 08/31/24	3,120,000.000	3,162,656.230	
		US T N/B 2.0 02/15/22	8,470,000.000	8,545,435.930	
		US T N/B 2.0 02/15/23	4,370,000.000	4,429,063.250	
		US T N/B 2.0 02/15/25	5,300,000.000	5,406,000.000	
		US T N/B 2.0 05/31/21	12,000,000.000	12,057,656.160	
		US T N/B 2.0 05/31/24	4,770,000.000	4,859,064.810	
		US T N/B 2.0 08/15/25	5,180,000.000	5,284,004.660	
		US T N/B 2.0 11/15/21	10,400,000.000	10,479,625.000	
		US T N/B 2.0 11/15/26	4,140,000.000	4,233,150.000	
		US T N/B 2.0 11/30/22	6,590,000.000	6,671,345.310	
		US T N/B 2.125 01/31/21	5,000,000.000	5,026,953.100	
		US T N/B 2.125 02/29/24	1,300,000.000	1,329,250.000	
		US T N/B 2.125 03/31/24	4,080,000.000	4,173,712.500	
		US T N/B 2.125 05/15/25	6,250,000.000	6,415,039.060	
		US T N/B 2.125 05/31/26	2,050,000.000	2,109,257.810	
		US T N/B 2.125 06/30/22	7,410,000.000	7,515,939.800	
		US T N/B 2.125 08/15/21	11,000,000.000	11,092,812.500	
		US T N/B 2.125 09/30/21	10,000,000.000	10,091,406.200	

		US T N/B 2.125 09/30/24	4,420,000.000	4,531,190.620	
		US T N/B 2.125 12/31/21	10,330,000.000	10,450,247.600	
		US T N/B 2.125 12/31/22	8,000,000.000	8,135,624.960	
		US T N/B 2.25 01/31/24	350,000.000	359,542.960	
		US T N/B 2.25 02/15/27	4,670,000.000	4,856,435.130	
		US T N/B 2.25 03/31/21	9,760,000.000	9,837,393.670	
		US T N/B 2.25 03/31/26	3,090,000.000	3,201,288.260	
		US T N/B 2.25 04/30/21	8,170,000.000	8,239,891.730	
		US T N/B 2.25 04/30/24	3,300,000.000	3,395,132.790	
		US T N/B 2.25 08/15/27	5,000,000.000	5,207,421.850	
		US T N/B 2.25 08/15/46	2,720,000.000	2,738,700.000	
		US T N/B 2.25 08/15/49	2,100,000.000	2,117,062.500	
		US T N/B 2.25 11/15/24	6,650,000.000	6,860,929.680	
		US T N/B 2.25 11/15/25	6,230,000.000	6,444,642.930	
		US T N/B 2.25 11/15/27	5,050,000.000	5,260,285.130	
		US T N/B 2.25 12/31/23	4,830,000.000	4,960,938.250	
		US T N/B 2.375 04/30/26	1,760,000.000	1,837,412.490	
		US T N/B 2.375 05/15/27	5,110,000.000	5,366,298.430	
		US T N/B 2.375 05/15/29	5,430,000.000	5,729,074.170	
		US T N/B 2.375 08/15/24	7,160,000.000	7,418,990.580	
		US T N/B 2.375 12/31/20	8,300,000.000	8,372,300.710	
		US T N/B 2.5 01/15/22	3,850,000.000	3,924,142.560	
		US T N/B 2.5 01/31/21	9,810,000.000	9,909,249.530	
		US T N/B 2.5 01/31/24	3,890,000.000	4,035,267.180	
		US T N/B 2.5 02/15/22	1,070,000.000	1,091,441.790	
		US T N/B 2.5 02/15/45	2,840,000.000	3,005,740.610	
		US T N/B 2.5 02/15/46	2,970,000.000	3,142,167.180	
		US T N/B 2.5 02/28/26	2,550,000.000	2,678,496.080	
		US T N/B 2.5 03/31/23	1,020,000.000	1,051,635.930	
		US T N/B 2.5 05/15/24	7,450,000.000	7,748,000.000	
		US T N/B 2.5 05/15/46	2,790,000.000	2,953,912.500	
		US T N/B 2.5 08/15/23	6,240,000.000	6,449,625.000	
		US T N/B 2.625 01/31/26	2,180,000.000	2,306,201.550	
		US T N/B 2.625 02/15/29	5,580,000.000	6,003,295.270	
		US T N/B 2.625 03/31/25	2,150,000.000	2,263,378.890	
		US T N/B 2.625 06/30/23	1,820,000.000	1,886,828.120	
		US T N/B 2.625 12/15/21	3,770,000.000	3,852,026.940	
		US T N/B 2.625 12/31/23	3,060,000.000	3,187,898.420	
		US T N/B 2.625 12/31/25	2,290,000.000	2,421,317.180	
		US T N/B 2.75 02/15/24	6,430,000.000	6,741,955.430	
		US T N/B 2.75 02/15/28	5,340,000.000	5,771,789.020	
		US T N/B 2.75 02/28/25	3,510,000.000	3,715,389.820	
		US T N/B 2.75 04/30/23	2,490,000.000	2,588,627.330	
		US T N/B 2.75 05/31/23	3,270,000.000	3,402,077.320	
		US T N/B 2.75 06/30/25	790,000.000	838,078.900	
		US T N/B 2.75 07/31/23	3,270,000.000	3,408,208.570	
		US T N/B 2.75 08/15/42	1,800,000.000	1,989,562.500	
		US T N/B 2.75 08/15/47	3,040,000.000	3,377,487.480	
		US T N/B 2.75 08/31/23	2,170,000.000	2,263,920.310	

		US T N/B 2.75 08/31/25	1,640,000.000	1,742,243.750	
		US T N/B 2.75 11/15/23	6,910,000.000	7,225,268.750	
		US T N/B 2.75 11/15/42	2,110,000.000	2,330,066.390	
		US T N/B 2.75 11/15/47	2,640,000.000	2,934,731.220	
		US T N/B 2.875 05/15/28	4,990,000.000	5,447,286.690	
		US T N/B 2.875 05/15/43	2,250,000.000	2,538,105.450	
		US T N/B 2.875 05/15/49	3,790,000.000	4,334,516.370	
		US T N/B 2.875 05/31/25	2,530,000.000	2,699,786.700	
		US T N/B 2.875 07/31/25	3,390,000.000	3,623,327.320	
		US T N/B 2.875 08/15/28	5,730,000.000	6,265,396.870	
		US T N/B 2.875 08/15/45	3,470,000.000	3,931,130.450	
		US T N/B 2.875 09/30/23	840,000.000	881,146.870	
		US T N/B 2.875 10/31/23	6,010,000.000	6,310,500.000	
		US T N/B 2.875 11/15/21	4,880,000.000	5,003,334.330	
		US T N/B 2.875 11/15/46	3,260,000.000	3,706,976.540	
		US T N/B 2.875 11/30/23	5,640,000.000	5,927,728.090	
		US T N/B 2.875 11/30/25	3,480,000.000	3,729,037.500	
		US T N/B 3.0 02/15/47	2,540,000.000	2,960,290.610	
		US T N/B 3.0 02/15/48	3,520,000.000	4,102,174.980	
		US T N/B 3.0 02/15/49	4,110,000.000	4,808,378.870	
		US T N/B 3.0 05/15/42	980,000.000	1,128,607.800	
		US T N/B 3.0 05/15/45	3,460,000.000	4,008,193.750	
		US T N/B 3.0 05/15/47	2,350,000.000	2,734,996.080	
		US T N/B 3.0 08/15/48	3,620,000.000	4,228,046.850	
		US T N/B 3.0 09/30/25	1,410,000.000	1,518,503.890	
		US T N/B 3.0 10/31/25	1,920,000.000	2,069,400.000	
		US T N/B 3.0 11/15/44	3,470,000.000	4,008,663.250	
		US T N/B 3.0 11/15/45	2,950,000.000	3,420,617.180	
		US T N/B 3.125 02/15/42	1,380,000.000	1,620,206.250	
		US T N/B 3.125 02/15/43	1,440,000.000	1,690,762.490	
		US T N/B 3.125 05/15/21	8,000,000.000	8,178,750.000	
		US T N/B 3.125 05/15/48	3,370,000.000	4,024,253.880	
		US T N/B 3.125 08/15/44	3,180,000.000	3,748,921.870	
		US T N/B 3.125 11/15/28	5,830,000.000	6,506,826.550	
		US T N/B 3.125 11/15/41	760,000.000	892,168.750	
		US T N/B 3.375 05/15/44	3,340,000.000	4,093,326.540	
		US T N/B 3.375 11/15/48	3,720,000.000	4,654,359.350	
		US T N/B 3.5 02/15/39	900,000.000	1,111,921.870	
		US T N/B 3.625 02/15/21	5,500,000.000	5,638,144.490	
		US T N/B 3.625 02/15/44	2,790,000.000	3,550,492.950	
		US T N/B 3.625 08/15/43	2,720,000.000	3,452,062.480	
		US T N/B 3.75 08/15/41	410,000.000	526,433.590	
		US T N/B 3.75 11/15/43	3,150,000.000	4,076,789.060	
		US T N/B 3.875 08/15/40	1,430,000.000	1,862,686.700	
		US T N/B 4.25 05/15/39	810,000.000	1,100,207.810	
		US T N/B 4.25 11/15/40	1,470,000.000	2,008,846.870	
		US T N/B 4.375 02/15/38	550,000.000	753,027.340	
		US T N/B 4.375 05/15/40	1,430,000.000	1,983,342.960	
		US T N/B 4.375 05/15/41	1,040,000.000	1,448,768.740	

		US T N/B 4.375 11/15/39	1,080,000.000	1,494,196.860	
		US T N/B 4.5 02/15/36	1,230,000.000	1,676,451.560	
		US T N/B 4.5 05/15/38	700,000.000	973,765.620	
		US T N/B 4.5 08/15/39	1,030,000.000	1,444,816.400	
		US T N/B 4.625 02/15/40	1,820,000.000	2,596,912.500	
		US T N/B 4.75 02/15/41	1,440,000.000	2,098,800.000	
		US T N/B 5.0 05/15/37	500,000.000	728,359.370	
		US T N/B 5.25 02/15/29	490,000.000	638,225.000	
		US T N/B 5.25 11/15/28	850,000.000	1,100,484.370	
		US T N/B 5.375 02/15/31	1,000,000.000	1,367,343.750	
		US T N/B 5.5 08/15/28	650,000.000	850,687.500	
		US T N/B 6.0 02/15/26	840,000.000	1,059,975.000	
		US T N/B 6.125 11/15/27	1,400,000.000	1,867,796.860	
		US T N/B 6.25 05/15/30	710,000.000	1,016,520.310	
		US T N/B 6.25 08/15/23	1,000,000.000	1,173,515.620	
		US T N/B 8.0 11/15/21	6,000,000.000	6,778,359.350	
アメリカ・ドル　小計			624,740,000.000 (67,734,310,800)	659,188,062.450 (71,469,169,733)	
イギリス・ポンド		UK TREASURY 0.5 07/22/22	2,350,000.000	2,349,765.000	
		UK TREASURY 0.75 07/22/23	1,560,000.000	1,578,030.940	
		UK TREASURY 0.875 10/22/29	150,000.000	153,496.500	
		UK TREASURY 1.0 04/22/24	820,000.000	838,277.800	
		UK TREASURY 1.25 07/22/27	1,090,000.000	1,148,020.700	
		UK TREASURY 1.5 07/22/26	1,040,000.000	1,109,804.800	
		UK TREASURY 1.5 07/22/47	1,720,000.000	1,850,204.000	
		UK TREASURY 1.625 10/22/28	2,150,000.000	2,352,559.210	
		UK TREASURY 1.625 10/22/54	510,000.000	592,390.500	
		UK TREASURY 1.625 10/22/71	750,000.000	947,314.190	
		UK TREASURY 1.75 01/22/49	790,000.000	901,706.000	
		UK TREASURY 1.75 07/22/57	1,300,000.000	1,564,290.000	
		UK TREASURY 1.75 09/07/22	2,080,000.000	2,154,152.000	
		UK TREASURY 1.75 09/07/37	1,540,000.000	1,707,706.000	
		UK TREASURY 2.0 09/07/25	950,000.000	1,038,939.000	
		UK TREASURY 2.25 09/07/23	1,810,000.000	1,936,532.750	
		UK TREASURY 2.5 07/22/65	1,280,000.000	1,978,969.600	
		UK TREASURY 2.75 09/07/24	1,380,000.000	1,534,841.520	

		UK TREASURY 3.25 01/22/44	1,540,000.000	2,214,674.000	
		UK TREASURY 3.5 01/22/45	1,680,000.000	2,533,104.000	
		UK TREASURY 3.5 07/22/68	1,090,000.000	2,089,530.000	
		UK TREASURY 3.75 07/22/52	1,340,000.000	2,297,028.000	
		UK TREASURY 3.75 09/07/21	720,000.000	764,137.440	
		UK TREASURY 4.0 01/22/60	1,200,000.000	2,342,400.000	
		UK TREASURY 4.0 03/07/22	1,040,000.000	1,126,673.600	
		UK TREASURY 4.25 03/07/36	1,480,000.000	2,208,604.000	
		UK TREASURY 4.25 06/07/32	1,340,000.000	1,891,142.000	
		UK TREASURY 4.25 09/07/39	920,000.000	1,440,536.000	
		UK TREASURY 4.25 12/07/27	1,160,000.000	1,503,510.800	
		UK TREASURY 4.25 12/07/40	1,340,000.000	2,130,064.000	
		UK TREASURY 4.25 12/07/46	1,330,000.000	2,280,019.000	
		UK TREASURY 4.25 12/07/49	1,140,000.000	2,031,822.000	
		UK TREASURY 4.25 12/07/55	1,170,000.000	2,262,663.000	
		UK TREASURY 4.5 09/07/34	1,070,000.000	1,602,325.000	
		UK TREASURY 4.5 12/07/42	1,450,000.000	2,439,770.000	
		UK TREASURY 4.75 12/07/30	1,120,000.000	1,604,064.000	
		UK TREASURY 4.75 12/07/38	1,230,000.000	2,018,676.000	
		UK TREASURY 5.0 03/07/25	1,610,000.000	1,994,661.200	
		UK TREASURY 6.0 12/07/28	980,000.000	1,450,929.200	
	イギリス・ポンド　小計		49,220,000.000 (6,724,928,600)	65,963,333.750 (9,012,570,290)	
	オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN 2.0 12/21/21	1,770,000.000	1,819,512.020	
		AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	1,950,000.000	2,150,070.000	
		AUSTRALIAN 2.25 11/21/22	890,000.000	932,285.410	
		AUSTRALIAN 2.5 05/21/30	1,200,000.000	1,373,103.710	
		AUSTRALIAN 2.75 04/21/24	1,980,000.000	2,157,435.720	
		AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	660,000.000	798,193.370	
		AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	2,240,000.000	2,543,811.200	
		AUSTRALIAN 2.75 11/21/28	2,390,000.000	2,745,938.630	
		AUSTRALIAN 2.75 11/21/29	1,560,000.000	1,816,776.000	
		AUSTRALIAN 3.0 03/21/47	1,010,000.000	1,317,296.830	
		AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	1,920,000.000	2,173,088.060	
		AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	2,820,000.000	3,384,348.550	
		AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	830,000.000	1,085,299.860	

	AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	990,000.000	1,358,818.750	
	AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	2,480,000.000	3,009,387.740	
	AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	1,310,000.000	1,856,827.010	
	AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	2,220,000.000	2,832,915.130	
	AUSTRALIAN 5.5 04/21/23	2,210,000.000	2,577,072.600	
	AUSTRALIAN 5.75 07/15/22	2,040,000.000	2,320,206.440	
オーストラリア・ドル　小計		32,470,000.000 (2,383,947,400)	38,252,387.030 (2,808,490,256)	
カナダ・ドル	CANADA 8.0 06/01/27	430,000.000	629,133.000	
	CANADA 0.75 03/01/21	2,300,000.000	2,269,893.000	
	CANADA 0.75 09/01/21	600,000.000	590,208.000	
	CANADA 1.0 06/01/27	800,000.000	771,144.000	
	CANADA 1.0 09/01/22	800,000.000	786,696.000	
	CANADA 1.5 06/01/23	1,840,000.000	1,836,632.800	
	CANADA 1.5 06/01/26	1,120,000.000	1,119,036.800	
	CANADA 1.75 03/01/23	1,160,000.000	1,166,809.200	
	CANADA 2.0 06/01/28	1,020,000.000	1,060,453.200	
	CANADA 2.0 09/01/23	740,000.000	752,313.600	
	CANADA 2.0 12/01/51	250,000.000	272,525.000	
	CANADA 2.25 03/01/24	530,000.000	546,016.600	
	CANADA 2.25 06/01/25	1,500,000.000	1,559,145.000	
	CANADA 2.25 06/01/29	610,000.000	650,168.500	
	CANADA 2.5 06/01/24	1,600,000.000	1,668,800.000	
	CANADA 2.75 06/01/22	2,240,000.000	2,306,348.800	
	CANADA 2.75 12/01/48	1,240,000.000	1,556,324.000	
	CANADA 2.75 12/01/64	460,000.000	624,574.200	
	CANADA 3.25 06/01/21	4,700,000.000	4,817,876.000	
	CANADA 3.5 12/01/45	1,210,000.000	1,681,900.000	
	CANADA 4.0 06/01/41	1,060,000.000	1,509,408.200	
	CANADA 5.0 06/01/37	870,000.000	1,318,015.200	
	CANADA 5.75 06/01/29	1,100,000.000	1,512,247.000	
	CANADA 5.75 06/01/33	1,040,000.000	1,566,208.800	
カナダ・ドル　小計		29,220,000.000 (2,394,871,200)	32,571,876.900 (2,669,591,031)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE 2.125 06/01/26	210,000.000	216,216.000	
	SINGAPORE 2.25 08/01/36	200,000.000	211,940.000	
	SINGAPORE 2.375 06/01/25	500,000.000	520,000.000	
	SINGAPORE 2.75 03/01/46	530,000.000	612,356.700	
	SINGAPORE 2.75 04/01/42	470,000.000	539,090.000	
	SINGAPORE 2.875 07/01/29	200,000.000	221,238.000	
	SINGAPORE 2.875 09/01/30	460,000.000	512,670.000	
	SINGAPORE 3.0 09/01/24	810,000.000	863,897.400	
	SINGAPORE 3.125 09/01/22	1,600,000.000	1,671,200.000	
	SINGAPORE 3.375 09/01/33	480,000.000	574,430.400	
	SINGAPORE 3.5 03/01/27	900,000.000	1,014,300.000	
シンガポール・ドル　小計		6,360,000.000 (503,902,800)	6,957,338.500 (551,229,929)	

スウェーデン・クローナ	SWEDEN 0.75 05/12/28	4,970,000.000	5,431,995.290	
	SWEDEN 0.75 11/12/29	2,170,000.000	2,380,001.750	
	SWEDEN 1.0 11/12/26	4,250,000.000	4,675,850.000	
	SWEDEN 2.5 05/12/25	7,300,000.000	8,537,312.040	
	SWEDEN 3.5 03/30/39	3,270,000.000	5,293,476.000	
	SWEDEN 3.5 06/01/22	13,360,000.000	14,808,958.800	
スウェーデン・クローナ　小計		35,320,000.000 (389,932,800)	41,127,593.880 (454,048,636)	
デンマーク・クローネ	DENMARK 0.5 11/15/27	7,130,000.000	7,768,028.050	
	DENMARK 1.5 11/15/23	5,500,000.000	6,014,525.000	
	DENMARK 1.75 11/15/25	7,750,000.000	8,914,205.000	
	DENMARK 4.5 11/15/39	9,980,000.000	19,741,298.280	
デンマーク・クローネ　小計		30,360,000.000 (486,063,600)	42,438,056.330 (679,433,282)	
ノルウェー・クローネ	NORWAY 1.5 02/19/26	6,000,000.000	6,126,000.000	
	NORWAY 1.75 02/17/27	3,970,000.000	4,129,991.000	
	NORWAY 1.75 03/13/25	3,800,000.000	3,917,678.400	
	NORWAY 2.0 04/26/28	2,070,000.000	2,201,652.000	
	NORWAY 3.0 03/14/24	6,200,000.000	6,688,252.480	
ノルウェー・クローネ　小計		22,040,000.000 (262,496,400)	23,063,573.880 (274,687,165)	
ポーランド・ズロチ	POLAND 2.25 04/25/22	4,000,000.000	4,068,574.000	
	POLAND 2.5 01/25/23	1,350,000.000	1,387,136.470	
	POLAND 2.5 04/25/24	2,290,000.000	2,367,832.740	
	POLAND 2.5 07/25/26	3,130,000.000	3,257,815.740	
	POLAND 2.5 07/25/27	3,000,000.000	3,126,660.000	
	POLAND 2.75 04/25/28	1,900,000.000	2,021,136.400	
	POLAND 3.25 07/25/25	3,300,000.000	3,558,060.000	
	POLAND 4.0 10/25/23	3,100,000.000	3,380,860.000	
	POLAND 5.75 04/25/29	1,440,000.000	1,934,388.000	
	POLAND 5.75 09/23/22	3,200,000.000	3,579,056.000	
ポーランド・ズロチ　小計		26,710,000.000 (743,072,200)	28,681,519.350 (797,919,868)	
マレーシア・リンギット	MALAYSIA 3.418 08/15/22	3,000,000.000	3,027,006.000	
	MALAYSIA 3.48 03/15/23	1,220,000.000	1,232,238.300	
	MALAYSIA 3.502 05/31/27	2,570,000.000	2,575,640.370	
	MALAYSIA 3.733 06/15/28	2,000,000.000	2,032,221.000	
	MALAYSIA 3.844 04/15/33	1,210,000.000	1,228,285.270	
	MALAYSIA 3.892 03/15/27	800,000.000	822,459.120	
	MALAYSIA 4.127 04/15/32	1,850,000.000	1,933,555.060	
	MALAYSIA 4.16 07/15/21	4,000,000.000	4,072,002.400	
	MALAYSIA 4.181 07/15/24	2,430,000.000	2,524,274.520	
	MALAYSIA 4.392 04/15/26	3,070,000.000	3,245,549.350	
	MALAYSIA 4.498 04/15/30	1,800,000.000	1,940,738.580	
	MALAYSIA 4.935 09/30/43	2,000,000.000	2,304,614.400	

	MALAYSIA 5.248 09/15/28	1,600,000.000	1,809,086.870	
マレーシア・リンギット　小計		27,550,000.000 (713,269,500)	28,747,671.240 (744,277,208)	
メキシコ・ペソ	MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	8,085,000.000	10,486,460.860	
	MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	27,596,000.000	31,635,632.180	
	MEXICAN BONDS 5.75 03/05/26	14,859,000.000	14,140,798.700	
	MEXICAN BONDS 6.5 06/09/22	26,000,000.000	25,909,602.160	
	MEXICAN BONDS 7.25 12/09/21	10,880,000.000	11,013,268.030	
	MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	18,071,000.000	18,915,508.420	
	MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	10,000,000.000	10,736,708.000	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	18,497,000.000	19,820,186.590	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	7,000,000.000	7,537,807.200	
	MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47	5,000,000.000	5,519,709.500	
	MEXICAN BONDS 8.0 12/07/23	14,000,000.000	14,681,717.400	
	MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	19,301,000.000	21,685,177.250	
	MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	11,125,000.000	12,776,870.030	
メキシコ・ペソ　小計		190,414,000.000 (1,072,030,820)	204,859,446.320 (1,153,358,683)	
ユーロ	AUSTRIA 0.5 02/20/29	340,000.000	363,082.600	
	AUSTRIA 0.5 04/20/27	520,000.000	554,075.080	
	AUSTRIA 0.75 02/20/28	820,000.000	892,715.140	
	AUSTRIA 0.75 10/20/26	580,000.000	627,232.060	
	AUSTRIA 07/15/23	350,000.000	357,875.000	
	AUSTRIA 09/20/22	470,000.000	479,096.380	
	AUSTRIA 1.2 10/20/25	640,000.000	705,465.600	
	AUSTRIA 1.5 02/20/47	370,000.000	477,137.200	
	AUSTRIA 1.5 11/02/86	290,000.000	398,518.000	
	AUSTRIA 1.65 10/21/24	950,000.000	1,054,706.430	
	AUSTRIA 1.75 10/20/23	950,000.000	1,040,862.750	
	AUSTRIA 2.1 09/20/17	300,000.000	530,676.300	
	AUSTRIA 2.4 05/23/34	670,000.000	900,618.690	
	AUSTRIA 3.15 06/20/44	540,000.000	907,744.320	
	AUSTRIA 3.4 11/22/22	740,000.000	833,725.440	
	AUSTRIA 3.5 09/15/21	1,420,000.000	1,533,032.000	
	AUSTRIA 3.65 04/20/22	860,000.000	953,740.000	
	AUSTRIA 3.8 01/26/62	430,000.000	959,032.260	
	AUSTRIA 4.15 03/15/37	1,010,000.000	1,709,021.000	

		AUSTRIA 4.85 03/15/26	790,000.000	1,062,642.430	
		AUSTRIA 6.25 07/15/27	670,000.000	1,017,683.100	
		BELGIUM 0.2 10/22/23	660,000.000	680,658.000	
		BELGIUM 0.5 10/22/24	830,000.000	871,916.660	
		BELGIUM 0.8 06/22/25	900,000.000	964,962.900	
		BELGIUM 0.8 06/22/27	1,100,000.000	1,194,402.000	
		BELGIUM 0.8 06/22/28	1,140,000.000	1,241,460.000	
		BELGIUM 0.9 06/22/29	500,000.000	552,198.000	
		BELGIUM 1.0 06/22/26	1,130,000.000	1,236,192.880	
		BELGIUM 1.0 06/22/31	810,000.000	908,034.300	
		BELGIUM 1.25 04/22/33	510,000.000	592,209.960	
		BELGIUM 1.45 06/22/37	440,000.000	527,855.680	
		BELGIUM 1.6 06/22/47	900,000.000	1,135,558.800	
		BELGIUM 1.7 06/22/50	390,000.000	501,735.000	
		BELGIUM 1.9 06/22/38	590,000.000	758,323.460	
		BELGIUM 2.15 06/22/66	410,000.000	601,593.000	
		BELGIUM 2.25 06/22/23	1,040,000.000	1,151,014.800	
		BELGIUM 2.25 06/22/57	380,000.000	558,699.940	
		BELGIUM 2.6 06/22/24	1,360,000.000	1,562,161.280	
		BELGIUM 3.0 06/22/34	570,000.000	810,822.720	
		BELGIUM 3.75 06/22/45	680,000.000	1,211,726.680	
		BELGIUM 4.0 03/28/22	1,080,000.000	1,204,486.200	
		BELGIUM 4.0 03/28/32	790,000.000	1,187,309.170	
		BELGIUM 4.25 03/28/41	1,140,000.000	2,036,049.120	
		BELGIUM 4.25 09/28/21	1,240,000.000	1,359,531.530	
		BELGIUM 4.25 09/28/22	1,190,000.000	1,364,108.900	
		BELGIUM 4.5 03/28/26	790,000.000	1,043,630.760	
		BELGIUM 5.0 03/28/35	1,380,000.000	2,398,816.460	
		BELGIUM 5.5 03/28/28	1,660,000.000	2,482,622.960	
		BUNDESOBL 04/05/24	630,000.000	650,446.020	
		BUNDESOBL 04/08/22	1,340,000.000	1,364,816.800	
		BUNDESOBL 04/09/21	2,200,000.000	2,223,364.000	
		BUNDESOBL 04/14/23	1,130,000.000	1,160,312.250	
		BUNDESOBL 10/07/22	1,400,000.000	1,431,890.040	
		BUNDESOBL 10/13/23	1,280,000.000	1,318,758.400	
		DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	240,000.000	235,040.160	
		DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27	2,090,000.000	2,226,393.400	
		DEUTSCHLAND 0.25 02/15/29	1,670,000.000	1,788,860.580	
		DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28	1,780,000.000	1,904,795.800	
		DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25	2,200,000.000	2,343,594.000	
		DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26	1,260,000.000	1,355,041.800	
		DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28	1,770,000.000	1,930,450.500	
		DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27	1,880,000.000	2,045,169.280	
		DEUTSCHLAND 08/15/26	1,960,000.000	2,048,282.320	
		DEUTSCHLAND 08/15/29	430,000.000	449,899.540	
		DEUTSCHLAND 1.0 08/15/24	1,340,000.000	1,453,059.820	

		DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25	1,880,000.000	2,068,507.600	
		DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48	1,280,000.000	1,724,546.560	
		DEUTSCHLAND 1.5 02/15/23	1,660,000.000	1,786,827.320	
		DEUTSCHLAND 1.5 05/15/23	1,650,000.000	1,785,125.100	
		DEUTSCHLAND 1.5 05/15/24	2,000,000.000	2,207,082.000	
		DEUTSCHLAND 1.5 09/04/22	1,650,000.000	1,759,494.000	
		DEUTSCHLAND 1.75 02/15/24	1,500,000.000	1,663,569.000	
		DEUTSCHLAND 1.75 07/04/22	1,540,000.000	1,646,315.440	
		DEUTSCHLAND 2.0 01/04/22	2,220,000.000	2,357,706.600	
		DEUTSCHLAND 2.0 08/15/23	1,500,000.000	1,660,455.000	
		DEUTSCHLAND 2.25 09/04/21	1,070,000.000	1,130,497.800	
		DEUTSCHLAND 2.5 01/04/21	2,200,000.000	2,288,770.000	
		DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	2,070,000.000	3,371,160.600	
		DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	2,100,000.000	3,503,730.300	
		DEUTSCHLAND 3.25 07/04/21	3,150,000.000	3,365,617.500	
		DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	900,000.000	1,590,705.000	
		DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	1,760,000.000	3,071,794.880	
		DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	990,000.000	1,867,456.800	
		DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	600,000.000	883,368.000	
		DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	1,280,000.000	2,258,508.800	
		DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	1,270,000.000	2,580,919.400	
		DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	1,240,000.000	2,090,268.000	
		DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	1,210,000.000	1,841,970.900	
		DEUTSCHLAND 6.25 01/04/24	840,000.000	1,091,605.200	
		DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	710,000.000	1,212,807.800	
		DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	710,000.000	1,108,302.900	
		FINLAND 0.5 04/15/26	500,000.000	530,348.000	
		FINLAND 0.5 09/15/27	300,000.000	320,061.300	
		FINLAND 0.5 09/15/28	450,000.000	481,646.700	
		FINLAND 0.5 09/15/29	270,000.000	289,330.650	
		FINLAND 0.75 04/15/31	450,000.000	495,820.350	
		FINLAND 0.875 09/15/25	300,000.000	324,174.900	
		FINLAND 04/15/22	320,000.000	325,215.680	
		FINLAND 09/15/23	230,000.000	235,448.930	
		FINLAND 1.125 04/15/34	370,000.000	430,335.160	
		FINLAND 1.375 04/15/47	80,000.000	102,586.400	
		FINLAND 1.5 04/15/23	170,000.000	182,801.000	

		FINLAND 1.625 09/15/22	400,000.000	426,771.200	
		FINLAND 2.0 04/15/24	480,000.000	536,400.480	
		FINLAND 2.625 07/04/42	370,000.000	569,844.770	
		FINLAND 2.75 07/04/28	380,000.000	482,173.260	
		FINLAND 3.5 04/15/21	700,000.000	743,838.900	
		FINLAND 4.0 07/04/25	430,000.000	543,206.140	
		FRANCE BTAN 8.5 04/25/23	1,280,000.000	1,698,705.920	
		FRANCE OAT 0.25 11/25/26	2,530,000.000	2,645,309.810	
		FRANCE OAT 0.5 05/25/25	3,240,000.000	3,423,371.040	
		FRANCE OAT 0.5 05/25/26	2,070,000.000	2,197,236.690	
		FRANCE OAT 0.5 05/25/29	1,970,000.000	2,101,276.860	
		FRANCE OAT 0.75 05/25/28	2,610,000.000	2,843,756.820	
		FRANCE OAT 0.75 11/25/28	2,140,000.000	2,333,199.200	
		FRANCE OAT 02/25/21	1,370,000.000	1,381,968.590	
		FRANCE OAT 03/25/23	1,900,000.000	1,942,212.300	
		FRANCE OAT 03/25/24	2,720,000.000	2,789,498.720	
		FRANCE OAT 03/25/25	470,000.000	482,207.780	
		FRANCE OAT 05/25/21	2,510,000.000	2,535,953.400	
		FRANCE OAT 05/25/22	3,000,000.000	3,052,319.400	
		FRANCE OAT 1.0 05/25/27	2,730,000.000	3,012,975.420	
		FRANCE OAT 1.0 11/25/25	1,720,000.000	1,874,763.880	
		FRANCE OAT 1.25 05/25/34	1,740,000.000	2,025,923.760	
		FRANCE OAT 1.25 05/25/36	1,990,000.000	2,320,141.000	
		FRANCE OAT 1.5 05/25/31	3,470,000.000	4,101,231.170	
		FRANCE OAT 1.5 05/25/50	1,430,000.000	1,761,554.080	
		FRANCE OAT 1.75 05/25/23	1,930,000.000	2,098,900.090	
		FRANCE OAT 1.75 05/25/66	790,000.000	1,070,075.540	
		FRANCE OAT 1.75 06/25/39	1,530,000.000	1,940,621.400	
		FRANCE OAT 1.75 11/25/24	3,090,000.000	3,453,350.010	
		FRANCE OAT 2.0 05/25/48	2,010,000.000	2,751,195.540	
		FRANCE OAT 2.25 05/25/24	1,980,000.000	2,240,532.360	
		FRANCE OAT 2.25 10/25/22	3,400,000.000	3,702,147.800	
		FRANCE OAT 2.5 05/25/30	3,140,000.000	4,022,449.900	
		FRANCE OAT 2.75 10/25/27	3,240,000.000	4,055,994.000	
		FRANCE OAT 3.0 04/25/22	4,200,000.000	4,593,666.000	
		FRANCE OAT 3.25 05/25/45	1,890,000.000	3,138,530.220	
		FRANCE OAT 3.25 10/25/21	2,980,000.000	3,218,781.440	
		FRANCE OAT 3.5 04/25/26	2,950,000.000	3,718,917.500	
		FRANCE OAT 3.75 04/25/21	4,000,000.000	4,270,104.000	
		FRANCE OAT 4.0 04/25/55	1,110,000.000	2,252,190.000	
		FRANCE OAT 4.0 04/25/60	920,000.000	1,957,528.160	
		FRANCE OAT 4.0 10/25/38	2,070,000.000	3,502,566.680	
		FRANCE OAT 4.25 10/25/23	3,910,000.000	4,688,410.620	
		FRANCE OAT 4.5 04/25/41	2,670,000.000	4,962,457.990	
		FRANCE OAT 4.75 04/25/35	2,260,000.000	3,864,667.800	
		FRANCE OAT 5.5 04/25/29	2,540,000.000	3,942,354.320	
		FRANCE OAT 5.75 10/25/32	2,340,000.000	4,102,159.220	
		FRANCE OAT 6.0 10/25/25	2,580,000.000	3,598,024.140	
		IRISH 0.8 03/15/22	370,000.000	382,119.450	

		IRISH 0.9 05/15/28	580,000.000	628,366.200	
		IRISH 1.0 05/15/26	840,000.000	907,074.000	
		IRISH 1.1 05/15/29	340,000.000	375,156.680	
		IRISH 1.3 05/15/33	340,000.000	383,404.060	
		IRISH 1.35 03/18/31	210,000.000	237,223.350	
		IRISH 1.5 05/15/50	320,000.000	371,630.270	
		IRISH 1.7 05/15/37	380,000.000	453,879.600	
		IRISH 10/18/22	220,000.000	223,468.380	
		IRISH 2.0 02/18/45	610,000.000	790,575.860	
		IRISH 2.4 05/15/30	1,010,000.000	1,254,147.300	
		IRISH 3.4 03/18/24	740,000.000	866,105.100	
		IRISH 3.9 03/20/23	240,000.000	276,524.400	
		IRISH 5.4 03/13/25	890,000.000	1,166,636.030	
		ITALY BTPS 0.35 11/01/21	1,700,000.000	1,717,916.300	
		ITALY BTPS 0.45 06/01/21	910,000.000	920,283.000	
		ITALY BTPS 0.65 10/15/23	1,590,000.000	1,625,191.470	
		ITALY BTPS 0.9 08/01/22	980,000.000	1,005,578.000	
		ITALY BTPS 0.95 03/01/23	920,000.000	947,416.000	
		ITALY BTPS 0.95 03/15/23	1,070,000.000	1,102,528.000	
		ITALY BTPS 1.2 04/01/22	770,000.000	794,255.000	
		ITALY BTPS 1.25 12/01/26	1,610,000.000	1,683,936.030	
		ITALY BTPS 1.35 04/15/22	1,660,000.000	1,718,598.000	
		ITALY BTPS 1.45 05/15/25	1,540,000.000	1,627,040.800	
		ITALY BTPS 1.45 09/15/22	1,500,000.000	1,565,199.000	
		ITALY BTPS 1.45 11/15/24	1,040,000.000	1,099,443.280	
		ITALY BTPS 1.5 06/01/25	2,010,000.000	2,129,962.220	
		ITALY BTPS 1.6 06/01/26	1,500,000.000	1,604,100.000	
		ITALY BTPS 1.65 03/01/32	1,880,000.000	1,986,013.200	
		ITALY BTPS 1.85 05/15/24	1,610,000.000	1,727,852.000	
		ITALY BTPS 2.0 02/01/28	2,090,000.000	2,304,300.240	
		ITALY BTPS 2.0 12/01/25	970,000.000	1,059,049.880	
		ITALY BTPS 2.05 08/01/27	1,600,000.000	1,763,252.800	
		ITALY BTPS 2.1 07/15/26	130,000.000	142,893.400	
		ITALY BTPS 2.15 12/15/21	1,680,000.000	1,763,832.000	
		ITALY BTPS 2.2 06/01/27	520,000.000	578,500.000	
		ITALY BTPS 2.25 09/01/36	1,020,000.000	1,134,954.000	
		ITALY BTPS 2.45 09/01/33	1,100,000.000	1,259,480.530	
		ITALY BTPS 2.5 11/15/25	550,000.000	615,635.620	
		ITALY BTPS 2.5 12/01/24	970,000.000	1,076,153.890	
		ITALY BTPS 2.7 03/01/47	800,000.000	940,720.000	
		ITALY BTPS 2.8 03/01/67	660,000.000	762,234.000	
		ITALY BTPS 2.8 12/01/28	1,400,000.000	1,643,628.000	
		ITALY BTPS 2.95 09/01/38	1,170,000.000	1,406,691.000	
		ITALY BTPS 3.0 08/01/29	780,000.000	932,654.580	
		ITALY BTPS 3.1 03/01/40	520,000.000	637,486.720	
		ITALY BTPS 3.25 09/01/46	1,250,000.000	1,602,663.750	
		ITALY BTPS 3.35 03/01/35	1,100,000.000	1,384,830.700	
		ITALY BTPS 3.45 03/01/48	1,280,000.000	1,696,701.690	
		ITALY BTPS 3.5 03/01/30	2,190,000.000	2,727,754.500	

		ITALY BTPS 3.75 03/01/21	3,300,000.000	3,483,262.200	
		ITALY BTPS 3.75 05/01/21	2,300,000.000	2,442,370.000	
		ITALY BTPS 3.75 08/01/21	3,200,000.000	3,425,376.000	
		ITALY BTPS 3.75 09/01/24	1,900,000.000	2,215,422.800	
		ITALY BTPS 3.85 09/01/49	740,000.000	1,042,269.280	
		ITALY BTPS 4.0 02/01/37	1,920,000.000	2,618,880.000	
		ITALY BTPS 4.5 03/01/24	2,390,000.000	2,833,189.650	
		ITALY BTPS 4.5 03/01/26	1,630,000.000	2,035,870.000	
		ITALY BTPS 4.5 05/01/23	1,400,000.000	1,618,296.400	
		ITALY BTPS 4.75 08/01/23	1,900,000.000	2,232,120.000	
		ITALY BTPS 4.75 09/01/21	2,470,000.000	2,697,734.000	
		ITALY BTPS 4.75 09/01/28	2,080,000.000	2,789,469.280	
		ITALY BTPS 4.75 09/01/44	1,330,000.000	2,072,679.980	
		ITALY BTPS 5.0 03/01/22	1,700,000.000	1,906,890.000	
		ITALY BTPS 5.0 03/01/25	2,400,000.000	2,988,765.600	
		ITALY BTPS 5.0 08/01/34	1,990,000.000	2,941,618.000	
		ITALY BTPS 5.0 08/01/39	1,690,000.000	2,621,866.000	
		ITALY BTPS 5.0 09/01/40	1,670,000.000	2,593,677.000	
		ITALY BTPS 5.25 11/01/29	2,480,000.000	3,500,520.000	
		ITALY BTPS 5.5 09/01/22	2,130,000.000	2,469,513.480	
		ITALY BTPS 5.5 11/01/22	1,960,000.000	2,286,277.280	
		ITALY BTPS 5.75 02/01/33	1,280,000.000	1,973,120.000	
		ITALY BTPS 6.0 05/01/31	2,330,000.000	3,562,337.000	
		ITALY BTPS 6.5 11/01/27	2,330,000.000	3,381,063.000	
		ITALY BTPS 7.25 11/01/26	1,080,000.000	1,572,696.000	
		ITALY BTPS 9.0 11/01/23	1,510,000.000	2,047,862.000	
		NETHERLANDS 0.25 07/15/25	1,020,000.000	1,068,450.000	
		NETHERLANDS 0.25 07/15/29	790,000.000	835,120.130	
		NETHERLANDS 0.5 01/15/40	430,000.000	470,940.300	
		NETHERLANDS 0.5 07/15/26	810,000.000	866,254.500	
		NETHERLANDS 0.75 07/15/27	1,150,000.000	1,258,621.520	
		NETHERLANDS 0.75 07/15/28	750,000.000	826,554.000	
		NETHERLANDS 01/15/22	460,000.000	467,251.440	
		NETHERLANDS 01/15/24	1,360,000.000	1,397,488.400	
		NETHERLANDS 1.75 07/15/23	1,440,000.000	1,573,894.080	
		NETHERLANDS 2.0 07/15/24	1,250,000.000	1,408,293.750	
		NETHERLANDS 2.25 07/15/22	880,000.000	952,978.400	
		NETHERLANDS 2.5 01/15/33	1,120,000.000	1,527,108.800	
		NETHERLANDS 2.75 01/15/47	1,090,000.000	1,880,538.850	
		NETHERLANDS 3.25 07/15/21	1,860,000.000	1,989,381.600	

	NETHERLANDS 3.75 01/15/23	300,000.000	344,190.000	
	NETHERLANDS 3.75 01/15/42	1,150,000.000	2,112,230.300	
	NETHERLANDS 4.0 01/15/37	1,160,000.000	1,984,064.000	
	NETHERLANDS 5.5 01/15/28	1,100,000.000	1,648,900.000	
	SPAIN 0.05 01/31/21	400,000.000	402,620.000	
	SPAIN 0.25 07/30/24	340,000.000	348,024.000	
	SPAIN 0.35 07/30/23	1,460,000.000	1,496,817.980	
	SPAIN 0.4 04/30/22	2,200,000.000	2,247,806.000	
	SPAIN 0.45 10/31/22	1,340,000.000	1,374,703.320	
	SPAIN 0.6 10/31/29	440,000.000	457,063.200	
	SPAIN 0.75 07/30/21	1,700,000.000	1,737,357.500	
	SPAIN 1.3 10/31/26	1,670,000.000	1,825,552.150	
	SPAIN 1.4 04/30/28	1,560,000.000	1,734,225.160	
	SPAIN 1.4 07/30/28	1,540,000.000	1,708,630.000	
	SPAIN 1.45 04/30/29	1,370,000.000	1,534,369.860	
	SPAIN 1.45 10/31/27	1,700,000.000	1,889,128.730	
	SPAIN 1.5 04/30/27	1,210,000.000	1,343,947.000	
	SPAIN 1.6 04/30/25	1,660,000.000	1,823,475.140	
	SPAIN 1.85 07/30/35	490,000.000	580,260.450	
	SPAIN 1.95 04/30/26	1,530,000.000	1,732,392.220	
	SPAIN 1.95 07/30/30	2,020,000.000	2,381,899.160	
	SPAIN 2.15 10/31/25	1,860,000.000	2,115,058.080	
	SPAIN 2.35 07/30/33	1,520,000.000	1,897,416.000	
	SPAIN 2.7 10/31/48	860,000.000	1,202,868.240	
	SPAIN 2.75 10/31/24	1,990,000.000	2,290,943.510	
	SPAIN 2.9 10/31/46	1,270,000.000	1,821,682.920	
	SPAIN 3.45 07/30/66	720,000.000	1,208,745.270	
	SPAIN 3.8 04/30/24	1,720,000.000	2,038,552.080	
	SPAIN 4.2 01/31/37	1,530,000.000	2,421,338.220	
	SPAIN 4.4 10/31/23	1,430,000.000	1,703,544.700	
	SPAIN 4.65 07/30/25	1,910,000.000	2,440,936.070	
	SPAIN 4.7 07/30/41	1,470,000.000	2,590,661.850	
	SPAIN 4.8 01/31/24	1,130,000.000	1,377,992.060	
	SPAIN 4.9 07/30/40	1,300,000.000	2,313,350.000	
	SPAIN 5.15 10/31/28	1,510,000.000	2,191,312.000	
	SPAIN 5.15 10/31/44	1,130,000.000	2,182,635.680	
	SPAIN 5.4 01/31/23	1,460,000.000	1,738,722.760	
	SPAIN 5.5 04/30/21	3,600,000.000	3,932,377.200	
	SPAIN 5.75 07/30/32	1,840,000.000	3,081,132.610	
	SPAIN 5.85 01/31/22	2,300,000.000	2,636,271.500	
	SPAIN 5.9 07/30/26	1,700,000.000	2,387,225.000	
	SPAIN 6.0 01/31/29	1,830,000.000	2,819,664.000	
ユーロ　小計		382,620,000.000 (45,734,568,600)	470,014,431.460 (56,180,824,992)	
南アフリカ・ランド	SOUTH AFRICA 10.5 12/21/26	19,290,000.000	21,643,993.420	

		SOUTH AFRICA 6.25 03/31/36	7,460,000.000	5,466,528.350	
		SOUTH AFRICA 6.5 02/28/41	7,840,000.000	5,567,767.290	
		SOUTH AFRICA 7.0 02/28/31	7,030,000.000	5,982,530.000	
		SOUTH AFRICA 7.75 02/28/23	3,600,000.000	3,650,126.040	
		SOUTH AFRICA 8.0 01/31/30	13,110,000.000	12,298,694.720	
		SOUTH AFRICA 8.25 03/31/32	6,590,000.000	6,113,194.520	
		SOUTH AFRICA 8.5 01/31/37	10,910,000.000	9,849,238.260	
		SOUTH AFRICA 8.75 01/31/44	10,000,000.000	8,990,286.100	
		SOUTH AFRICA 8.75 02/28/48	16,040,000.000	14,419,624.740	
		SOUTH AFRICA 8.875 02/28/35	8,410,000.000	7,987,694.030	
		SOUTH AFRICA 9.0 01/31/40	8,000,000.000	7,450,560.000	
	南アフリカ・ランド　小計		118,280,000.000 (865,809,600)	109,420,237.470 (800,956,138)	
国債証券　合計			130,009,204,320 (130,009,204,320)	147,596,557,211 (147,596,557,211)	
合計				147,596,557,211 (147,596,557,211)	

（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	47.35	48.42
イギリス・ポンド	国債証券	39銘柄	5.97	6.11
オーストラリア・ドル	国債証券	19銘柄	1.86	1.90
カナダ・ドル	国債証券	24銘柄	1.77	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	0.45	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・リンギット	国債証券	13銘柄	0.49	0.50
メキシコ・ペソ	国債証券	13銘柄	0.76	0.78
ユーロ	国債証券	282銘柄	37.22	38.06
南アフリカ・ランド	国債証券	12銘柄	0.53	0.54

（注）「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	令和1年10月15日現在
資産の部	
流動資産	
預金	4,709,207,099
コール・ローン	3,666,915,619
国債証券	454,493,752,289
未収入金	30,897,935
未収利息	3,053,280,504
前払費用	492,478,604
流動資産合計	466,446,532,050
資産合計	466,446,532,050
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	4,578,559,591
未払解約金	1,257,962,000
流動負債合計	5,836,521,591
負債合計	5,836,521,591
純資産の部	
元本等	
元本	324,187,486,528
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	136,422,523,931
元本等合計	460,610,010,459
純資産合計	460,610,010,459
負債純資産合計	466,446,532,050

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30年10月13日 至　令和1年10月15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15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	184,831,343,228円
同期中追加設定元本額	368,320,450,839円
同期中一部解約元本額	228,964,307,539円
元本の内訳	
ファンド名	

	たわらノーロード　先進国債券＜為替ヘッジあり＞	3,959,786,902円
	たわらノーロード　バランス（堅実型）	102,549,512円
	たわらノーロード　バランス（標準型）	274,604,682円
	たわらノーロード　バランス（積極型）	133,716,822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）	6,370,849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）	287,768,579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）	330,264,756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）	102,550,574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）	49,619,557円
	たわらノーロード　最適化バランス（保守型）	3,326,729円
	たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	7,265,369円
	たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	8,725,399円
	たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	2,365,510円
	たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	2,102,871円
	投資のソムリエ	49,631,385,632円
	投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	5,210,134,566円
	投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	3,631,638,821円
	リスク抑制世界８資産バランスファンド	42,000,288,215円
	ワールドアセットバランス（基本コース）	3,731,953,953円
	ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）	14,684,163,372円
	投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	21,149,115円
	投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	16,706,392円
	リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	26,432,514円
	投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	42,500,272円
	リスクコントロール世界資産分散ファンド	16,695,636,923円
	９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	2,546,771,933円
	投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	2,980,707円
	投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	2,702,727円
	投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	2,674,803円
	外国債券パッシブファンド２（為替フルヘッジ）（適格機関投資家限定）	20,001,101,200円
	先進国債券パッシブファンド（為替ヘッジあり）（適格機関投資家限定）	126,203,506,163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）	648,116,987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）	85,824,583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）	574,610,610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）	1,091,858,237円
	ＤＩＡＭバランス３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	6,713,737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）	24,063,504,093円
	ＤＩＡＭバランス２０ＶＡ（適格機関投資家限定）	136,281,033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）	2,171,946,629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）	2,392,050,786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）	3,166,832,839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）	127,001,575円
	計	324,187,486,528円
２．	受益権の総数	324,187,486,528口

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

項目	自　平成30年10月13日 至　令和1年10月15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15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15日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
国債証券	8,927,853,013
合計	8,927,853,013

（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（令和1年6月25日から令和1年10月15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15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	460,731,467,705	－	465,310,027,296	△4,578,559,591
アメリカ・ドル	222,199,741,062	－	223,072,247,200	△872,506,138
イギリス・ポンド	29,062,468,536	－	29,819,012,396	△756,543,860
オーストラリア・ドル	9,335,559,476	－	9,406,519,976	△70,960,500
カナダ・ドル	8,615,498,509	－	8,654,385,195	△38,886,686
シンガポール・ドル	1,587,833,154	－	1,610,701,224	△22,868,070
スウェーデン・クローナ	1,179,576,209	－	1,183,761,660	△4,185,451
デンマーク・クローネ	2,482,865,016	－	2,517,924,720	△35,059,704
ノルウェー・クローネ	724,557,948	－	725,556,336	△998,388
ポーランド・ズロチ	2,616,308,482	－	2,701,296,642	△84,988,160
マレーシア・リンギット	1,074,808,962	－	1,083,310,200	△8,501,238
メキシコ・ペソ	3,570,232,388	－	3,677,374,233	△107,141,845
ユーロ	175,803,239,958	－	178,308,266,754	△2,505,026,796
南アフリカ・ランド	2,478,778,005	－	2,549,670,760	△70,892,755
合計	460,731,467,705	－	465,310,027,296	△4,578,559,591

（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。

①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。

②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15日現在
1口当たり純資産額	1.4208円
（1万口当たり純資産額）	(14,208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15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	1,740,000.000	1,726,134.370	
		US T N/B 1.125 06/30/21	10,000,000.000	9,908,593.700	
		US T N/B 1.125 07/31/21	13,900,000.000	13,772,945.240	
		US T N/B 1.125 08/31/21	11,000,000.000	10,892,578.070	
		US T N/B 1.125 09/30/21	430,000.000	425,733.590	
		US T N/B 1.25 03/31/21	12,310,000.000	12,231,139.060	
		US T N/B 1.25 07/31/23	8,400,000.000	8,293,687.500	
		US T N/B 1.25 10/31/21	10,500,000.000	10,421,250.000	
		US T N/B 1.375 01/31/21	6,760,000.000	6,733,065.590	
		US T N/B 1.375 04/30/21	10,000,000.000	9,950,781.200	
		US T N/B 1.375 05/31/21	12,350,000.000	12,286,320.310	
		US T N/B 1.375 06/30/23	550,000.000	545,660.150	
		US T N/B 1.375 08/31/23	9,500,000.000	9,428,007.760	
		US T N/B 1.375 09/30/20	10,640,000.000	10,608,828.090	
		US T N/B 1.375 09/30/23	9,000,000.000	8,928,984.330	
		US T N/B 1.375 10/31/20	10,000,000.000	9,967,968.700	
		US T N/B 1.5 03/31/23	19,660,000.000	19,615,457.710	
		US T N/B 1.5 08/15/26	19,050,000.000	18,852,058.480	
		US T N/B 1.625 02/15/26	20,030,000.000	19,994,008.470	
		US T N/B 1.625 04/30/23	9,800,000.000	9,812,250.000	
		US T N/B 1.625 05/15/26	14,030,000.000	13,993,828.810	
		US T N/B 1.625 05/31/23	1,460,000.000	1,462,053.120	
		US T N/B 1.625 06/30/21	3,190,000.000	3,188,130.850	
		US T N/B 1.625 08/15/29	8,070,000.000	7,977,321.050	
		US T N/B 1.625 08/31/22	3,280,000.000	3,283,331.230	
		US T N/B 1.625 10/31/23	1,780,000.000	1,782,642.170	
		US T N/B 1.625 11/15/22	18,500,000.000	18,526,015.620	
		US T N/B 1.625 11/30/20	10,000,000.000	9,996,093.700	
		US T N/B 1.75 01/31/23	8,180,000.000	8,223,456.250	
		US T N/B 1.75 02/28/22	10,500,000.000	10,536,093.750	
		US T N/B 1.75 03/31/22	5,290,000.000	5,308,184.370	
		US T N/B 1.75 05/15/22	1,250,000.000	1,255,175.770	
		US T N/B 1.75 05/15/23	14,390,000.000	14,468,695.310	
		US T N/B 1.75 05/31/22	9,490,000.000	9,529,294.480	
		US T N/B 1.75 06/15/22	25,390,000.000	25,500,089.250	
		US T N/B 1.75 06/30/22	5,160,000.000	5,183,381.250	
		US T N/B 1.75 06/30/24	7,510,000.000	7,565,151.560	
		US T N/B 1.75 07/15/22	2,940,000.000	2,952,058.580	
		US T N/B 1.75 07/31/21	15,530,000.000	15,559,725.350	
		US T N/B 1.75 07/31/24	11,200,000.000	11,284,874.940	
		US T N/B 1.75 09/30/22	5,360,000.000	5,386,381.220	

		US T N/B 1.75 10/31/20	20,000.000	20,012.500	
		US T N/B 1.75 11/30/21	1,380,000.000	1,383,342.180	
		US T N/B 1.75 12/31/20	12,590,000.000	12,603,770.310	
		US T N/B 1.875 01/31/22	6,840,000.000	6,880,078.090	
		US T N/B 1.875 02/28/22	2,440,000.000	2,454,106.250	
		US T N/B 1.875 03/31/22	13,300,000.000	13,388,320.240	
		US T N/B 1.875 04/30/22	10,390,000.000	10,463,054.680	
		US T N/B 1.875 06/30/26	6,470,000.000	6,556,940.620	
		US T N/B 1.875 07/31/22	10,290,000.000	10,369,586.660	
		US T N/B 1.875 07/31/26	10,760,000.000	10,906,268.750	
		US T N/B 1.875 08/31/24	7,320,000.000	7,420,078.080	
		US T N/B 1.875 09/30/22	8,860,000.000	8,937,525.000	
		US T N/B 1.875 10/31/22	12,380,000.000	12,486,390.620	
		US T N/B 2.0 02/15/22	10,000,000.000	10,089,062.500	
		US T N/B 2.0 02/15/23	14,000,000.000	14,189,218.680	
		US T N/B 2.0 02/15/25	21,670,000.000	22,103,400.000	
		US T N/B 2.0 04/30/24	14,260,000.000	14,514,006.240	
		US T N/B 2.0 05/31/21	11,560,000.000	11,615,542.090	
		US T N/B 2.0 05/31/24	24,970,000.000	25,436,236.580	
		US T N/B 2.0 06/30/24	7,540,000.000	7,677,251.510	
		US T N/B 2.0 07/31/22	12,300,000.000	12,443,179.610	
		US T N/B 2.0 08/15/25	7,730,000.000	7,885,203.860	
		US T N/B 2.0 08/31/21	7,060,000.000	7,105,503.880	
		US T N/B 2.0 10/31/22	4,280,000.000	4,331,159.350	
		US T N/B 2.0 11/15/21	7,900,000.000	7,960,484.370	
		US T N/B 2.0 11/15/26	8,900,000.000	9,100,250.000	
		US T N/B 2.0 11/30/22	12,020,000.000	12,168,371.870	
		US T N/B 2.0 12/31/21	14,720,000.000	14,839,600.000	
		US T N/B 2.125 02/29/24	3,330,000.000	3,404,925.000	
		US T N/B 2.125 03/31/24	20,250,000.000	20,715,117.180	
		US T N/B 2.125 05/15/22	12,700,000.000	12,866,191.310	
		US T N/B 2.125 05/15/25	12,390,000.000	12,717,173.420	
		US T N/B 2.125 05/31/21	22,090,000.000	22,244,457.250	
		US T N/B 2.125 05/31/26	6,070,000.000	6,245,460.930	
		US T N/B 2.125 06/30/22	3,820,000.000	3,874,614.040	
		US T N/B 2.125 07/31/24	3,520,000.000	3,606,074.980	
		US T N/B 2.125 08/15/21	9,590,000.000	9,670,915.620	
		US T N/B 2.125 09/30/21	9,800,000.000	9,889,578.070	
		US T N/B 2.125 09/30/24	2,720,000.000	2,788,425.000	
		US T N/B 2.125 11/30/23	10,290,000.000	10,503,839.060	
		US T N/B 2.125 11/30/24	3,970,000.000	4,073,282.010	
		US T N/B 2.125 12/31/21	7,000,000.000	7,081,484.340	
		US T N/B 2.125 12/31/22	13,500,000.000	13,728,867.120	
		US T N/B 2.25 01/31/24	3,780,000.000	3,883,064.040	
		US T N/B 2.25 02/15/27	15,070,000.000	15,671,622.560	
		US T N/B 2.25 03/31/21	11,920,000.000	12,014,521.780	
		US T N/B 2.25 03/31/26	9,450,000.000	9,790,347.600	
		US T N/B 2.25 04/15/22	22,820,000.000	23,173,888.220	
		US T N/B 2.25 04/30/21	8,490,000.000	8,562,629.230	

		US T N/B 2.25 04/30/24	11,660,000.000	11,996,135.870	
		US T N/B 2.25 08/15/27	12,780,000.000	13,310,170.230	
		US T N/B 2.25 08/15/46	11,370,000.000	11,448,168.750	
		US T N/B 2.25 08/15/49	4,150,000.000	4,183,718.750	
		US T N/B 2.25 10/31/24	4,560,000.000	4,705,706.220	
		US T N/B 2.25 11/15/24	12,600,000.000	12,999,656.240	
		US T N/B 2.25 11/15/25	25,880,000.000	26,771,646.730	
		US T N/B 2.25 11/15/27	12,870,000.000	13,405,914.770	
		US T N/B 2.25 12/31/23	9,550,000.000	9,808,894.480	
		US T N/B 2.25 12/31/24	4,530,000.000	4,677,578.880	
		US T N/B 2.375 01/31/23	2,760,000.000	2,829,215.610	
		US T N/B 2.375 02/29/24	5,800,000.000	5,992,578.090	
		US T N/B 2.375 03/15/22	15,120,000.000	15,404,090.580	
		US T N/B 2.375 04/30/26	8,680,000.000	9,061,784.330	
		US T N/B 2.375 05/15/27	19,970,000.000	20,971,620.310	
		US T N/B 2.375 05/15/29	19,720,000.000	20,806,140.500	
		US T N/B 2.375 08/15/24	12,610,000.000	13,066,127.260	
		US T N/B 2.5 01/15/22	14,320,000.000	14,595,771.830	
		US T N/B 2.5 01/31/21	17,950,000.000	18,131,603.380	
		US T N/B 2.5 01/31/24	10,750,000.000	11,151,445.310	
		US T N/B 2.5 01/31/25	2,980,000.000	3,114,565.620	
		US T N/B 2.5 02/15/22	7,160,000.000	7,303,479.660	
		US T N/B 2.5 02/15/45	10,160,000.000	10,752,931.190	
		US T N/B 2.5 02/15/46	10,100,000.000	10,685,484.350	
		US T N/B 2.5 02/28/21	15,690,000.000	15,858,544.800	
		US T N/B 2.5 02/28/26	5,520,000.000	5,798,156.220	
		US T N/B 2.5 03/31/23	6,720,000.000	6,928,424.960	
		US T N/B 2.5 05/15/24	21,710,000.000	22,578,400.000	
		US T N/B 2.5 05/15/46	8,840,000.000	9,359,350.000	
		US T N/B 2.5 08/15/23	6,700,000.000	6,925,078.120	
		US T N/B 2.5 12/31/20	14,350,000.000	14,486,212.780	
		US T N/B 2.625 01/31/26	8,050,000.000	8,516,019.490	
		US T N/B 2.625 02/15/29	21,640,000.000	23,281,596.740	
		US T N/B 2.625 02/28/23	12,400,000.000	12,817,531.180	
		US T N/B 2.625 03/31/25	4,430,000.000	4,663,613.250	
		US T N/B 2.625 06/15/21	16,260,000.000	16,512,156.990	
		US T N/B 2.625 06/30/23	2,650,000.000	2,747,304.680	
		US T N/B 2.625 07/15/21	16,670,000.000	16,944,143.310	
		US T N/B 2.625 11/15/20	11,860,000.000	11,982,769.500	
		US T N/B 2.625 12/15/21	11,320,000.000	11,566,298.400	
		US T N/B 2.625 12/31/23	9,670,000.000	10,074,175.730	
		US T N/B 2.625 12/31/25	7,300,000.000	7,718,609.370	
		US T N/B 2.75 02/15/24	11,930,000.000	12,508,791.340	
		US T N/B 2.75 02/15/28	14,940,000.000	16,148,038.980	
		US T N/B 2.75 02/28/25	6,290,000.000	6,658,063.240	
		US T N/B 2.75 04/30/23	10,670,000.000	11,092,631.970	
		US T N/B 2.75 05/31/23	3,880,000.000	4,036,715.600	
		US T N/B 2.75 06/30/25	8,100,000.000	8,592,960.890	
		US T N/B 2.75 07/31/23	10,070,000.000	10,495,614.790	

		US T N/B 2.75 08/15/21	25,090,000.000	25,582,979.100	
		US T N/B 2.75 08/15/42	3,830,000.000	4,233,346.870	
		US T N/B 2.75 08/15/47	7,440,000.000	8,265,956.210	
		US T N/B 2.75 08/31/23	7,030,000.000	7,334,267.180	
		US T N/B 2.75 08/31/25	8,140,000.000	8,647,478.120	
		US T N/B 2.75 09/15/21	2,960,000.000	3,022,321.850	
		US T N/B 2.75 11/15/23	13,330,000.000	13,938,181.250	
		US T N/B 2.75 11/15/42	3,480,000.000	3,842,953.100	
		US T N/B 2.75 11/15/47	7,520,000.000	8,359,537.460	
		US T N/B 2.75 11/30/20	5,110,000.000	5,172,078.470	
		US T N/B 2.875 04/30/25	4,220,000.000	4,500,893.750	
		US T N/B 2.875 05/15/28	13,610,000.000	14,857,228.830	
		US T N/B 2.875 05/15/43	11,140,000.000	12,566,442.110	
		US T N/B 2.875 05/15/49	11,920,000.000	13,632,568.680	
		US T N/B 2.875 05/31/25	4,550,000.000	4,855,347.630	
		US T N/B 2.875 07/31/25	3,250,000.000	3,473,691.390	
		US T N/B 2.875 08/15/28	13,130,000.000	14,356,834.370	
		US T N/B 2.875 08/15/45	8,370,000.000	9,482,294.480	
		US T N/B 2.875 09/30/23	7,810,000.000	8,192,567.920	
		US T N/B 2.875 10/15/21	13,100,000.000	13,416,753.800	
		US T N/B 2.875 10/31/20	16,820,000.000	17,025,650.730	
		US T N/B 2.875 10/31/23	9,290,000.000	9,754,500.000	
		US T N/B 2.875 11/15/21	8,440,000.000	8,653,307.740	
		US T N/B 2.875 11/15/46	12,660,000.000	14,395,804.610	
		US T N/B 2.875 11/30/23	9,810,000.000	10,310,463.230	
		US T N/B 2.875 11/30/25	6,780,000.000	7,265,193.750	
		US T N/B 3.0 02/15/47	6,270,000.000	7,307,489.060	
		US T N/B 3.0 02/15/48	8,610,000.000	10,034,013.220	
		US T N/B 3.0 02/15/49	11,710,000.000	13,699,785.080	
		US T N/B 3.0 05/15/42	2,310,000.000	2,660,289.830	
		US T N/B 3.0 05/15/45	8,570,000.000	9,927,809.370	
		US T N/B 3.0 05/15/47	10,720,000.000	12,476,237.440	
		US T N/B 3.0 08/15/48	10,310,000.000	12,041,757.790	
		US T N/B 3.0 09/30/25	7,430,000.000	8,001,761.680	
		US T N/B 3.0 10/31/25	6,560,000.000	7,070,450.000	
		US T N/B 3.0 11/15/44	9,340,000.000	10,789,888.980	
		US T N/B 3.0 11/15/45	8,800,000.000	10,203,875.000	
		US T N/B 3.125 02/15/42	2,760,000.000	3,240,412.490	
		US T N/B 3.125 02/15/43	6,130,000.000	7,197,481.960	
		US T N/B 3.125 05/15/21	100,000.000	102,234.370	
		US T N/B 3.125 05/15/48	11,010,000.000	13,147,488.200	
		US T N/B 3.125 08/15/44	8,090,000.000	9,537,351.550	
		US T N/B 3.125 11/15/28	21,320,000.000	23,795,118.730	
		US T N/B 3.125 11/15/41	2,350,000.000	2,758,679.670	
		US T N/B 3.375 05/15/44	10,700,000.000	13,113,351.490	
		US T N/B 3.375 11/15/48	14,200,000.000	17,766,640.540	
		US T N/B 3.5 02/15/39	2,150,000.000	2,656,257.810	
		US T N/B 3.625 02/15/21	7,430,000.000	7,616,620.640	
		US T N/B 3.625 02/15/44	8,510,000.000	10,829,639.800	

		US T N/B 3.625 08/15/43	8,930,000.000	11,333,425.730	
		US T N/B 3.75 08/15/41	4,490,000.000	5,765,089.810	
		US T N/B 3.75 11/15/43	11,000,000.000	14,236,406.240	
		US T N/B 3.875 08/15/40	5,580,000.000	7,268,385.890	
		US T N/B 4.25 05/15/39	5,170,000.000	7,022,314.040	
		US T N/B 4.25 11/15/40	3,650,000.000	4,987,953.120	
		US T N/B 4.375 02/15/38	1,210,000.000	1,656,660.140	
		US T N/B 4.375 05/15/40	4,250,000.000	5,894,550.740	
		US T N/B 4.375 05/15/41	3,150,000.000	4,388,097.640	
		US T N/B 4.375 11/15/39	2,340,000.000	3,237,426.530	
		US T N/B 4.5 02/15/36	4,950,000.000	6,746,695.270	
		US T N/B 4.5 05/15/38	2,250,000.000	3,129,960.930	
		US T N/B 4.5 08/15/39	2,510,000.000	3,520,863.240	
		US T N/B 4.625 02/15/40	5,110,000.000	7,291,331.250	
		US T N/B 4.75 02/15/41	4,420,000.000	6,442,150.000	
		US T N/B 5.0 05/15/37	890,000.000	1,296,479.680	
		US T N/B 5.25 02/15/29	830,000.000	1,081,075.000	
		US T N/B 5.25 11/15/28	1,700,000.000	2,200,968.750	
		US T N/B 5.375 02/15/31	2,300,000.000	3,144,890.590	
		US T N/B 5.5 08/15/28	930,000.000	1,217,137.500	
		US T N/B 6.0 02/15/26	800,000.000	1,009,500.000	
		US T N/B 6.125 11/15/27	2,050,000.000	2,734,988.260	
		US T N/B 6.25 05/15/30	1,210,000.000	1,732,379.670	
		US T N/B 6.25 08/15/23	1,200,000.000	1,408,218.740	
		US T N/B 6.5 11/15/26	500,000.000	661,679.680	
		US T N/B 8.0 11/15/21	2,100,000.000	2,372,425.740	
	アメリカ・ドル　小計		1,926,060,000.000 (208,823,425,200)	2,027,551,817.010 (219,827,168,001)	
	イギリス・ポンド	UK TREASURY 0.5 07/22/22	5,710,000.000	5,709,429.000	
		UK TREASURY 0.75 07/22/23	7,430,000.000	7,515,878.150	
		UK TREASURY 0.875 10/22/29	1,990,000.000	2,036,386.900	
		UK TREASURY 1.0 04/22/24	6,690,000.000	6,839,120.100	
		UK TREASURY 1.25 07/22/27	4,480,000.000	4,718,470.400	
		UK TREASURY 1.5 07/22/26	2,240,000.000	2,390,348.800	
		UK TREASURY 1.5 07/22/47	4,620,000.000	4,969,734.000	
		UK TREASURY 1.625 10/22/28	6,410,000.000	7,013,909.150	
		UK TREASURY 1.625 10/22/54	1,420,000.000	1,649,401.000	
		UK TREASURY 1.625 10/22/71	2,560,000.000	3,233,499.120	
		UK TREASURY 1.75 01/22/49	2,520,000.000	2,876,328.000	
		UK TREASURY 1.75 07/22/57	4,190,000.000	5,041,827.000	

	UK TREASURY 1.75 09/07/22	5,920,000.000	6,131,048.000	
	UK TREASURY 1.75 09/07/37	4,350,000.000	4,823,715.000	
	UK TREASURY 2.0 09/07/25	4,440,000.000	4,855,672.800	
	UK TREASURY 2.25 09/07/23	3,820,000.000	4,087,047.030	
	UK TREASURY 2.5 07/22/65	3,940,000.000	6,091,515.800	
	UK TREASURY 2.75 09/07/24	2,500,000.000	2,780,510.000	
	UK TREASURY 3.25 01/22/44	5,770,000.000	8,297,837.000	
	UK TREASURY 3.5 01/22/45	5,480,000.000	8,262,744.000	
	UK TREASURY 3.5 07/22/68	4,110,000.000	7,878,870.000	
	UK TREASURY 3.75 07/22/52	3,670,000.000	6,291,114.000	
	UK TREASURY 3.75 09/07/21	6,840,000.000	7,259,305.680	
	UK TREASURY 4.0 01/22/60	3,560,000.000	6,949,120.000	
	UK TREASURY 4.0 03/07/22	2,350,000.000	2,545,849.000	
	UK TREASURY 4.25 03/07/36	4,590,000.000	6,849,657.000	
	UK TREASURY 4.25 06/07/32	4,750,000.000	6,703,675.000	
	UK TREASURY 4.25 09/07/39	3,560,000.000	5,574,248.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/27	3,290,000.000	4,264,267.700	
	UK TREASURY 4.25 12/07/40	4,770,000.000	7,582,392.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/46	3,750,000.000	6,428,625.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/49	2,310,000.000	4,117,113.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/55	3,870,000.000	7,484,193.000	
	UK TREASURY 4.5 09/07/34	3,920,000.000	5,870,200.000	
	UK TREASURY 4.5 12/07/42	3,420,000.000	5,754,492.000	
	UK TREASURY 4.75 12/07/30	2,700,000.000	3,866,940.000	
	UK TREASURY 4.75 12/07/38	3,470,000.000	5,694,964.000	
	UK TREASURY 5.0 03/07/25	4,180,000.000	5,178,685.600	
	UK TREASURY 6.0 12/07/28	1,450,000.000	2,146,783.000	
	UK TREASURY 8.0 06/07/21	1,520,000.000	1,705,500.800	
イギリス・ポンド　小計		158,560,000.000 (21,664,052,800)	209,470,416.030 (28,619,942,942)	
オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN 5.75 05/15/21	4,690,000.000	5,060,869.250	
	AUSTRALIAN 1.5 06/21/31	670,000.000	699,889.770	

	AUSTRALIAN 1.75 11/21/20	10,000.000	10,111.110	
	AUSTRALIAN 2.0 12/21/21	3,020,000.000	3,104,478.140	
	AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	5,770,000.000	6,362,002.000	
	AUSTRALIAN 2.25 11/21/22	3,730,000.000	3,907,218.630	
	AUSTRALIAN 2.5 05/21/30	5,650,000.000	6,465,030.010	
	AUSTRALIAN 2.75 04/21/24	6,850,000.000	7,463,855.900	
	AUSTRALIAN 2.75 05/21/41	1,050,000.000	1,284,315.150	
	AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	1,770,000.000	2,140,609.480	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	6,130,000.000	6,961,411.900	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/28	5,400,000.000	6,204,212.810	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/29	4,710,000.000	5,485,266.000	
	AUSTRALIAN 3.0 03/21/47	3,310,000.000	4,317,081.670	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	6,540,000.000	7,402,081.200	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	8,150,000.000	9,781,007.310	
	AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	2,090,000.000	2,732,863.500	
	AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	3,690,000.000	5,064,688.070	
	AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	5,310,000.000	6,443,487.460	
	AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	3,580,000.000	5,074,382.180	
	AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	8,580,000.000	10,948,834.130	
	AUSTRALIAN 5.5 04/21/23	6,120,000.000	7,136,508.730	
	AUSTRALIAN 5.75 07/15/22	7,000,000.000	7,961,492.670	
オーストラリア・ドル　小計		103,820,000.000 (7,622,464,400)	122,011,697.070 (8,958,098,799)	
カナダ・ドル	CANADA 8.0 06/01/27	900,000.000	1,316,790.000	
	CANADA 0.5 03/01/22	6,760,000.000	6,584,375.200	
	CANADA 0.75 09/01/21	5,860,000.000	5,764,364.800	
	CANADA 1.0 06/01/27	3,890,000.000	3,749,687.700	
	CANADA 1.0 09/01/22	4,670,000.000	4,592,337.900	
	CANADA 1.25 06/01/30	630,000.000	612,681.300	
	CANADA 1.5 06/01/23	3,690,000.000	3,683,247.300	
	CANADA 1.5 06/01/26	3,990,000.000	3,986,568.600	
	CANADA 1.5 08/01/21	2,740,000.000	2,732,876.000	
	CANADA 1.5 09/01/24	2,960,000.000	2,956,596.000	
	CANADA 1.75 03/01/23	3,740,000.000	3,761,953.800	
	CANADA 1.75 05/01/21	3,180,000.000	3,183,275.400	
	CANADA 2.0 06/01/28	2,970,000.000	3,087,790.200	
	CANADA 2.0 09/01/23	2,820,000.000	2,866,924.800	
	CANADA 2.0 12/01/51	1,840,000.000	2,005,784.000	
	CANADA 2.25 03/01/24	3,190,000.000	3,286,401.800	
	CANADA 2.25 06/01/25	3,110,000.000	3,232,627.300	
	CANADA 2.25 06/01/29	2,290,000.000	2,440,796.500	
	CANADA 2.5 06/01/24	3,600,000.000	3,754,800.000	
	CANADA 2.75 06/01/22	3,350,000.000	3,449,227.000	
	CANADA 2.75 12/01/48	3,140,000.000	3,941,014.000	
	CANADA 2.75 12/01/64	1,200,000.000	1,629,324.000	
	CANADA 3.25 06/01/21	2,400,000.000	2,460,192.000	
	CANADA 3.5 12/01/45	3,770,000.000	5,240,300.000	
	CANADA 4.0 06/01/41	3,540,000.000	5,040,853.800	
	CANADA 5.0 06/01/37	2,190,000.000	3,317,762.400	

	CANADA 5.75 06/01/29	3,000,000.000	4,124,310.000	
	CANADA 5.75 06/01/33	3,260,000.000	4,909,462.200	
カナダ・ドル　小計		88,680,000.000 (7,268,212,800)	97,712,324.000 (8,008,502,075)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE 1.75 02/01/23	1,700,000.000	1,710,030.000	
	SINGAPORE 1.75 04/01/22	260,000.000	261,196.000	
	SINGAPORE 2.0 02/01/24	580,000.000	590,291.170	
	SINGAPORE 2.125 06/01/26	930,000.000	957,528.000	
	SINGAPORE 2.25 08/01/36	830,000.000	879,551.000	
	SINGAPORE 2.375 06/01/25	920,000.000	956,800.000	
	SINGAPORE 2.375 07/01/39	470,000.000	508,571.200	
	SINGAPORE 2.625 05/01/28	1,020,000.000	1,096,602.000	
	SINGAPORE 2.75 03/01/46	1,630,000.000	1,883,285.700	
	SINGAPORE 2.75 04/01/42	1,140,000.000	1,307,580.000	
	SINGAPORE 2.75 07/01/23	1,610,000.000	1,677,781.000	
	SINGAPORE 2.875 07/01/29	620,000.000	685,837.800	
	SINGAPORE 2.875 09/01/30	900,000.000	1,003,050.000	
	SINGAPORE 3.0 09/01/24	1,970,000.000	2,101,083.800	
	SINGAPORE 3.125 09/01/22	1,330,000.000	1,389,185.000	
	SINGAPORE 3.375 09/01/33	1,490,000.000	1,783,127.700	
	SINGAPORE 3.5 03/01/27	1,900,000.000	2,141,300.000	
シンガポール・ドル　小計		19,300,000.000 (1,529,139,000)	20,932,800.370 (1,658,505,773)	
スウェーデン・クローナ	SWEDEN 0.75 05/12/28	11,190,000.000	12,230,186.570	
	SWEDEN 0.75 11/12/29	10,070,000.000	11,044,524.250	
	SWEDEN 1.0 11/12/26	15,310,000.000	16,844,062.000	
	SWEDEN 1.5 11/13/23	20,890,000.000	22,669,604.460	
	SWEDEN 2.5 05/12/25	15,290,000.000	17,881,575.470	
	SWEDEN 3.5 03/30/39	11,770,000.000	19,053,276.000	
スウェーデン・クローナ　小計		84,520,000.000 (933,100,800)	99,723,228.750 (1,100,944,445)	
デンマーク・クローネ	DENMARK 0.5 11/15/27	22,850,000.000	24,894,732.250	
	DENMARK 0.5 11/15/29	6,770,000.000	7,434,610.900	
	DENMARK 1.5 11/15/23	15,980,000.000	17,474,929.000	
	DENMARK 1.75 11/15/25	12,910,000.000	14,849,340.200	
	DENMARK 4.5 11/15/39	34,050,000.000	67,353,828.300	
デンマーク・クローネ　小計		92,560,000.000 (1,481,885,600)	132,007,440.650 (2,113,439,125)	
ノルウェー・クローネ	NORWAY 1.5 02/19/26	8,270,000.000	8,443,670.000	
	NORWAY 1.75 02/17/27	11,630,000.000	12,098,689.000	
	NORWAY 1.75 03/13/25	10,070,000.000	10,381,847.760	
	NORWAY 1.75 09/06/29	6,280,000.000	6,594,533.800	
	NORWAY 2.0 04/26/28	7,530,000.000	8,008,908.000	
	NORWAY 3.0 03/14/24	9,430,000.000	10,172,616.260	
ノルウェー・クローネ　小計		53,210,000.000 (633,731,100)	55,700,264.820 (663,390,154)	

ポーランド・ズロチ	POLAND 1.75 07/25/21	4,510,000.000	4,530,440.220	
	POLAND 2.0 04/25/21	9,120,000.000	9,196,881.600	
	POLAND 2.25 04/25/22	6,730,000.000	6,845,375.740	
	POLAND 2.25 10/25/24	310,000.000	317,329.110	
	POLAND 2.5 01/25/23	7,180,000.000	7,377,511.020	
	POLAND 2.5 04/25/24	8,470,000.000	8,757,879.180	
	POLAND 2.5 07/25/26	9,420,000.000	9,804,672.270	
	POLAND 2.5 07/25/27	8,370,000.000	8,723,381.400	
	POLAND 2.75 04/25/28	8,680,000.000	9,233,402.080	
	POLAND 2.75 10/25/29	3,250,000.000	3,476,683.900	
	POLAND 3.25 07/25/25	7,180,000.000	7,741,476.000	
	POLAND 4.0 10/25/23	10,380,000.000	11,320,428.000	
	POLAND 5.75 04/25/29	1,800,000.000	2,417,985.000	
	POLAND 5.75 09/23/22	4,570,000.000	5,111,339.350	
	POLAND 5.75 10/25/21	2,690,000.000	2,917,009.100	
ポーランド・ズロチ　小計		92,660,000.000 (2,577,801,200)	97,771,793.970 (2,720,011,308)	
マレーシア・リンギット	MALAYSIA 3.418 08/15/22	5,000,000.000	5,045,010.000	
	MALAYSIA 3.48 03/15/23	3,910,000.000	3,949,222.760	
	MALAYSIA 3.502 05/31/27	4,580,000.000	4,590,051.720	
	MALAYSIA 3.844 04/15/33	1,340,000.000	1,360,249.810	
	MALAYSIA 3.9 11/30/26	1,500,000.000	1,542,640.050	
	MALAYSIA 3.955 09/15/25	4,400,000.000	4,538,515.520	
	MALAYSIA 4.127 04/15/32	1,180,000.000	1,233,294.580	
	MALAYSIA 4.181 07/15/24	2,190,000.000	2,274,963.450	
	MALAYSIA 4.232 06/30/31	2,000,000.000	2,114,421.000	
	MALAYSIA 4.392 04/15/26	1,480,000.000	1,564,629.650	
	MALAYSIA 4.498 04/15/30	2,820,000.000	3,040,490.440	
	MALAYSIA 4.642 11/07/33	1,050,000.000	1,155,671.580	
	MALAYSIA 4.762 04/07/37	5,540,000.000	6,164,572.950	
	MALAYSIA 4.935 09/30/43	3,470,000.000	3,998,505.980	
	MALAYSIA 5.248 09/15/28	1,480,000.000	1,673,405.350	
マレーシア・リンギット　小計		41,940,000.000 (1,085,826,600)	44,245,644.840 (1,145,519,745)	
メキシコ・ペソ	MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	32,220,000.000	41,790,200.250	
	MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	66,505,000.000	76,240,314.460	
	MEXICAN BONDS 5.75 03/05/26	38,064,000.000	36,224,198.240	
	MEXICAN BONDS 6.5 06/09/22	57,079,000.000	56,880,545.440	
	MEXICAN BONDS 7.25 12/09/21	41,968,000.000	42,482,061.810	
	MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	72,017,000.000	75,382,556.030	
	MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	34,054,000.000	36,562,785.420	

		MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	44,721,000.000	47,920,125.650	
		MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	19,500,000.000	20,998,177.190	
		MEXICAN BONDS 8.0 09/05/24	24,740,000.000	26,110,348.600	
		MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47	33,666,000.000	37,165,307.990	
		MEXICAN BONDS 8.0 12/07/23	49,237,000.000	51,634,551.370	
		MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	42,703,000.000	47,977,935.030	
		MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	37,143,000.000	42,658,092.880	
	メキシコ・ペソ　小計		593,617,000.000 (3,342,063,710)	640,027,200.360 (3,603,353,138)	
	ユーロ	AUSTRIA 0.5 02/20/29	3,060,000.000	3,267,743.400	
		AUSTRIA 0.5 04/20/27	2,300,000.000	2,450,716.700	
		AUSTRIA 0.75 02/20/28	2,030,000.000	2,210,014.310	
		AUSTRIA 0.75 10/20/26	3,300,000.000	3,568,734.150	
		AUSTRIA 07/15/23	2,760,000.000	2,822,100.000	
		AUSTRIA 09/20/22	3,400,000.000	3,465,803.600	
		AUSTRIA 1.2 10/20/25	2,840,000.000	3,130,503.600	
		AUSTRIA 1.5 02/20/47	1,250,000.000	1,611,950.000	
		AUSTRIA 1.5 11/02/86	560,000.000	769,552.000	
		AUSTRIA 1.65 10/21/24	1,990,000.000	2,209,332.420	
		AUSTRIA 1.75 10/20/23	2,760,000.000	3,023,980.200	
		AUSTRIA 2.1 09/20/17	1,120,000.000	1,981,191.520	
		AUSTRIA 2.4 05/23/34	1,400,000.000	1,881,889.800	
		AUSTRIA 3.15 06/20/44	1,760,000.000	2,958,574.080	
		AUSTRIA 3.4 11/22/22	20,000.000	22,533.120	
		AUSTRIA 3.5 09/15/21	4,830,000.000	5,214,468.000	
		AUSTRIA 3.65 04/20/22	170,000.000	188,530.000	
		AUSTRIA 3.8 01/26/62	900,000.000	2,007,276.820	
		AUSTRIA 4.15 03/15/37	3,790,000.000	6,413,059.000	
		AUSTRIA 4.85 03/15/26	2,860,000.000	3,847,034.620	
		AUSTRIA 6.25 07/15/27	1,160,000.000	1,761,958.800	
		BELGIUM 0.2 10/22/23	2,020,000.000	2,083,226.000	
		BELGIUM 0.5 10/22/24	1,530,000.000	1,607,268.060	
		BELGIUM 0.8 06/22/25	2,430,000.000	2,605,399.830	
		BELGIUM 0.8 06/22/27	2,050,000.000	2,225,931.000	
		BELGIUM 0.8 06/22/28	3,390,000.000	3,691,710.000	
		BELGIUM 0.9 06/22/29	2,330,000.000	2,573,242.680	
		BELGIUM 1.0 06/22/26	3,770,000.000	4,124,289.520	
		BELGIUM 1.0 06/22/31	3,220,000.000	3,609,716.600	
		BELGIUM 1.25 04/22/33	700,000.000	812,837.200	
		BELGIUM 1.45 06/22/37	1,000,000.000	1,199,672.000	
		BELGIUM 1.6 06/22/47	2,230,000.000	2,813,662.360	
		BELGIUM 1.7 06/22/50	1,180,000.000	1,518,070.000	

		BELGIUM 1.9 06/22/38	1,220,000.000	1,568,058.680	
		BELGIUM 2.15 06/22/66	1,130,000.000	1,658,049.000	
		BELGIUM 2.25 06/22/23	2,950,000.000	3,264,897.750	
		BELGIUM 2.25 06/22/57	1,610,000.000	2,367,123.430	
		BELGIUM 2.6 06/22/24	4,580,000.000	5,260,807.840	
		BELGIUM 3.0 06/22/34	1,410,000.000	2,005,719.360	
		BELGIUM 3.75 06/22/45	1,530,000.000	2,726,385.030	
		BELGIUM 4.0 03/28/22	8,080,000.000	9,011,341.200	
		BELGIUM 4.0 03/28/32	1,550,000.000	2,329,530.650	
		BELGIUM 4.25 03/28/41	4,350,000.000	7,769,134.800	
		BELGIUM 4.25 09/28/21	7,470,000.000	8,190,081.100	
		BELGIUM 4.25 09/28/22	4,100,000.000	4,699,871.000	
		BELGIUM 4.5 03/28/26	2,220,000.000	2,932,734.550	
		BELGIUM 5.0 03/28/35	4,250,000.000	7,387,659.390	
		BELGIUM 5.5 03/28/28	8,260,000.000	12,353,292.560	
		BUNDESOBL 0.25 10/16/20	3,000,000.000	3,027,654.000	
		BUNDESOBL 04/05/24	5,990,000.000	6,184,399.460	
		BUNDESOBL 04/08/22	2,500,000.000	2,546,300.000	
		BUNDESOBL 04/09/21	2,870,000.000	2,900,479.400	
		BUNDESOBL 04/14/23	2,960,000.000	3,039,402.000	
		BUNDESOBL 10/07/22	3,000,000.000	3,068,335.800	
		BUNDESOBL 10/08/21	3,400,000.000	3,448,994.000	
		BUNDESOBL 10/13/23	4,800,000.000	4,945,344.000	
		BUNDESSCHAT 03/12/21	1,640,000.000	1,656,305.860	
		BUNDESSCHAT 06/11/21	1,040,000.000	1,052,230.400	
		BUNDESSCHAT 12/11/20	10,000.000	10,079.960	
		DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27	7,580,000.000	8,074,670.800	
		DEUTSCHLAND 0.25 02/15/29	4,420,000.000	4,734,589.080	
		DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28	3,890,000.000	4,162,727.900	
		DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25	3,440,000.000	3,664,528.800	
		DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26	6,250,000.000	6,721,437.500	
		DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28	6,940,000.000	7,569,111.000	
		DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27	4,490,000.000	4,884,473.440	
		DEUTSCHLAND 08/15/26	7,360,000.000	7,691,509.120	
		DEUTSCHLAND 1.0 08/15/24	3,100,000.000	3,361,556.300	
		DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25	7,080,000.000	7,789,911.600	
		DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48	4,460,000.000	6,008,966.920	
		DEUTSCHLAND 1.5 02/15/23	3,100,000.000	3,336,846.200	
		DEUTSCHLAND 1.5 05/15/23	3,070,000.000	3,321,414.580	
		DEUTSCHLAND 1.5 05/15/24	7,210,000.000	7,956,530.610	
		DEUTSCHLAND 1.5 09/04/22	3,300,000.000	3,518,988.000	
		DEUTSCHLAND 1.75 02/15/24	4,200,000.000	4,657,993.200	
		DEUTSCHLAND 1.75 07/04/22	9,530,000.000	10,187,913.080	

		DEUTSCHLAND 2.0 01/04/22	8,030,000.000	8,528,100.900	
		DEUTSCHLAND 2.0 08/15/23	2,900,000.000	3,210,213.000	
		DEUTSCHLAND 2.25 09/04/21	2,700,000.000	2,852,658.000	
		DEUTSCHLAND 2.5 01/04/21	2,200,000.000	2,288,770.000	
		DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	6,300,000.000	10,260,054.000	
		DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	7,120,000.000	11,879,314.160	
		DEUTSCHLAND 3.25 07/04/21	2,990,000.000	3,194,665.500	
		DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	1,950,000.000	3,446,527.500	
		DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	5,790,000.000	10,105,507.020	
		DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	3,740,000.000	7,054,836.800	
		DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	1,800,000.000	2,650,104.000	
		DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	4,120,000.000	7,269,575.200	
		DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	2,980,000.000	6,056,015.600	
		DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	7,900,000.000	13,317,030.000	
		DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	3,440,000.000	5,236,677.600	
		DEUTSCHLAND 6.25 01/04/24	1,180,000.000	1,533,445.400	
		DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	1,400,000.000	2,391,452.000	
		DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	1,670,000.000	2,606,853.300	
		FINLAND 0.5 04/15/26	910,000.000	965,233.360	
		FINLAND 0.5 09/15/27	1,160,000.000	1,237,570.360	
		FINLAND 0.5 09/15/28	830,000.000	888,370.580	
		FINLAND 0.5 09/15/29	880,000.000	943,003.600	
		FINLAND 0.75 04/15/31	990,000.000	1,090,804.770	
		FINLAND 0.875 09/15/25	780,000.000	842,854.740	
		FINLAND 04/15/22	4,620,000.000	4,695,301.380	
		FINLAND 09/15/23	2,090,000.000	2,139,514.190	
		FINLAND 1.125 04/15/34	750,000.000	872,301.000	
		FINLAND 1.375 04/15/47	470,000.000	602,695.100	
		FINLAND 1.5 04/15/23	10,000.000	10,753.000	
		FINLAND 1.625 09/15/22	3,580,000.000	3,819,602.240	
		FINLAND 2.0 04/15/24	1,770,000.000	1,977,976.770	
		FINLAND 2.625 07/04/42	870,000.000	1,339,905.270	
		FINLAND 2.75 07/04/28	1,180,000.000	1,497,274.860	
		FINLAND 3.5 04/15/21	2,470,000.000	2,624,688.690	
		FINLAND 4.0 07/04/25	1,860,000.000	2,349,682.360	
		FRANCE BTAN 8.5 04/25/23	1,480,000.000	1,964,128.720	
		FRANCE OAT 0.25 11/25/20	4,300,000.000	4,341,344.500	
		FRANCE OAT 0.25 11/25/26	6,490,000.000	6,785,794.730	
		FRANCE OAT 0.5 05/25/25	7,840,000.000	8,283,712.640	

		FRANCE OAT 0.5 05/25/26	10,560,000.000	11,209,091.520	
		FRANCE OAT 0.5 05/25/29	6,690,000.000	7,135,808.220	
		FRANCE OAT 0.75 05/25/28	5,470,000.000	5,959,904.140	
		FRANCE OAT 0.75 11/25/28	6,690,000.000	7,293,973.200	
		FRANCE OAT 02/25/21	7,080,000.000	7,141,852.280	
		FRANCE OAT 02/25/22	2,810,000.000	2,853,313.900	
		FRANCE OAT 03/25/23	5,720,000.000	5,847,081.240	
		FRANCE OAT 03/25/24	10,420,000.000	10,686,241.420	
		FRANCE OAT 03/25/25	6,250,000.000	6,412,337.500	
		FRANCE OAT 05/25/21	4,160,000.000	4,203,014.400	
		FRANCE OAT 05/25/22	5,500,000.000	5,595,918.900	
		FRANCE OAT 1.0 05/25/27	5,010,000.000	5,529,306.540	
		FRANCE OAT 1.0 11/25/25	8,080,000.000	8,807,030.320	
		FRANCE OAT 1.25 05/25/34	4,080,000.000	4,750,441.920	
		FRANCE OAT 1.25 05/25/36	8,740,000.000	10,189,966.000	
		FRANCE OAT 1.5 05/25/31	13,200,000.000	15,601,225.200	
		FRANCE OAT 1.5 05/25/50	3,780,000.000	4,656,415.680	
		FRANCE OAT 1.75 05/25/23	7,450,000.000	8,101,971.850	
		FRANCE OAT 1.75 05/25/66	2,710,000.000	3,670,765.460	
		FRANCE OAT 1.75 06/25/39	4,200,000.000	5,327,196.000	
		FRANCE OAT 1.75 11/25/24	9,220,000.000	10,304,170.580	
		FRANCE OAT 2.0 05/25/48	5,910,000.000	8,089,336.140	
		FRANCE OAT 2.25 05/25/24	8,220,000.000	9,301,604.040	
		FRANCE OAT 2.25 10/25/22	13,640,000.000	14,852,145.880	
		FRANCE OAT 2.5 05/25/30	8,110,000.000	10,389,193.850	
		FRANCE OAT 2.5 10/25/20	4,310,000.000	4,447,639.850	
		FRANCE OAT 2.75 10/25/27	10,570,000.000	13,232,054.500	
		FRANCE OAT 3.0 04/25/22	13,130,000.000	14,360,674.900	
		FRANCE OAT 3.25 05/25/45	6,110,000.000	10,146,253.780	
		FRANCE OAT 3.25 10/25/21	7,090,000.000	7,658,107.520	
		FRANCE OAT 3.5 04/25/26	7,840,000.000	9,883,496.000	
		FRANCE OAT 3.75 04/25/21	5,550,000.000	5,924,769.300	
		FRANCE OAT 4.0 04/25/55	3,480,000.000	7,060,920.000	
		FRANCE OAT 4.0 04/25/60	3,170,000.000	6,744,961.160	
		FRANCE OAT 4.0 10/25/38	4,100,000.000	6,937,450.910	
		FRANCE OAT 4.25 10/25/23	10,990,000.000	13,177,911.180	
		FRANCE OAT 4.5 04/25/41	8,070,000.000	14,998,889.890	
		FRANCE OAT 4.75 04/25/35	7,370,000.000	12,602,921.100	
		FRANCE OAT 5.5 04/25/29	10,630,000.000	16,498,908.040	
		FRANCE OAT 5.75 10/25/32	8,540,000.000	14,971,128.120	
		FRANCE OAT 6.0 10/25/25	2,220,000.000	3,095,974.260	
		IRISH 0.8 03/15/22	4,690,000.000	4,843,622.320	
		IRISH 0.9 05/15/28	1,970,000.000	2,134,278.300	
		IRISH 1.0 05/15/26	3,730,000.000	4,027,840.500	
		IRISH 1.1 05/15/29	1,740,000.000	1,919,919.480	
		IRISH 1.3 05/15/33	810,000.000	913,403.790	
		IRISH 1.35 03/18/31	400,000.000	451,854.000	
		IRISH 1.5 05/15/50	640,000.000	743,260.520	
		IRISH 1.7 05/15/37	1,140,000.000	1,361,638.800	

		IRISH 10/18/22	3,340,000.000	3,392,656.420	
		IRISH 2.0 02/18/45	1,890,000.000	2,449,489.140	
		IRISH 2.4 05/15/30	2,250,000.000	2,793,892.500	
		IRISH 3.4 03/18/24	2,720,000.000	3,183,521.450	
		IRISH 5.0 10/18/20	3,460,000.000	3,655,697.600	
		IRISH 5.4 03/13/25	1,700,000.000	2,228,405.900	
		ITALY BTPS 0.05 04/15/21	950,000.000	954,326.580	
		ITALY BTPS 0.35 11/01/21	10,200,000.000	10,307,497.800	
		ITALY BTPS 0.45 06/01/21	3,750,000.000	3,792,375.000	
		ITALY BTPS 0.65 10/15/23	1,870,000.000	1,911,388.710	
		ITALY BTPS 0.65 11/01/20	2,010,000.000	2,029,677.900	
		ITALY BTPS 0.9 08/01/22	3,000,000.000	3,078,300.000	
		ITALY BTPS 0.95 03/01/23	2,000,000.000	2,059,600.000	
		ITALY BTPS 0.95 03/15/23	2,700,000.000	2,782,080.000	
		ITALY BTPS 1.0 07/15/22	6,800,000.000	6,994,700.320	
		ITALY BTPS 1.2 04/01/22	2,700,000.000	2,785,050.000	
		ITALY BTPS 1.25 12/01/26	3,500,000.000	3,660,730.500	
		ITALY BTPS 1.35 04/15/22	3,000,000.000	3,105,900.000	
		ITALY BTPS 1.45 05/15/25	5,980,000.000	6,317,989.600	
		ITALY BTPS 1.45 09/15/22	4,140,000.000	4,319,949.240	
		ITALY BTPS 1.45 11/15/24	2,800,000.000	2,960,039.600	
		ITALY BTPS 1.5 06/01/25	7,430,000.000	7,873,442.460	
		ITALY BTPS 1.6 06/01/26	3,300,000.000	3,529,020.000	
		ITALY BTPS 1.65 03/01/32	4,320,000.000	4,563,604.800	
		ITALY BTPS 1.75 07/01/24	4,140,000.000	4,424,507.420	
		ITALY BTPS 1.85 05/15/24	2,800,000.000	3,004,960.000	
		ITALY BTPS 2.0 02/01/28	7,300,000.000	8,048,512.800	
		ITALY BTPS 2.0 12/01/25	2,900,000.000	3,166,231.600	
		ITALY BTPS 2.05 08/01/27	5,700,000.000	6,281,588.100	
		ITALY BTPS 2.1 07/15/26	20,000.000	21,983.600	
		ITALY BTPS 2.15 12/15/21	2,010,000.000	2,110,299.000	
		ITALY BTPS 2.2 06/01/27	2,500,000.000	2,781,250.000	
		ITALY BTPS 2.25 09/01/36	2,400,000.000	2,670,480.000	
		ITALY BTPS 2.3 10/15/21	3,300,000.000	3,461,541.600	
		ITALY BTPS 2.45 09/01/33	2,650,000.000	3,034,203.090	
		ITALY BTPS 2.45 10/01/23	3,030,000.000	3,302,715.150	
		ITALY BTPS 2.5 11/15/25	3,430,000.000	3,839,327.620	
		ITALY BTPS 2.5 12/01/24	5,290,000.000	5,868,921.730	
		ITALY BTPS 2.7 03/01/47	2,650,000.000	3,116,135.000	
		ITALY BTPS 2.8 03/01/67	1,100,000.000	1,270,390.000	
		ITALY BTPS 2.8 12/01/28	3,190,000.000	3,745,123.800	
		ITALY BTPS 2.95 09/01/38	2,130,000.000	2,560,899.000	
		ITALY BTPS 3.0 08/01/29	3,850,000.000	4,603,487.350	
		ITALY BTPS 3.1 03/01/40	2,130,000.000	2,611,243.680	
		ITALY BTPS 3.25 09/01/46	2,900,000.000	3,718,179.900	
		ITALY BTPS 3.35 03/01/35	3,370,000.000	4,242,617.690	
		ITALY BTPS 3.45 03/01/48	6,190,000.000	8,205,143.350	
		ITALY BTPS 3.5 03/01/30	5,100,000.000	6,352,305.000	
		ITALY BTPS 3.75 03/01/21	2,950,000.000	3,113,825.300	

		ITALY BTPS 3.75 05/01/21	3,000,000.000	3,185,700.000	
		ITALY BTPS 3.75 08/01/21	6,930,000.000	7,418,079.900	
		ITALY BTPS 3.75 09/01/24	6,380,000.000	7,439,156.560	
		ITALY BTPS 3.85 09/01/49	3,970,000.000	5,591,633.840	
		ITALY BTPS 4.0 02/01/37	10,530,000.000	14,362,920.000	
		ITALY BTPS 4.5 03/01/24	3,500,000.000	4,149,022.500	
		ITALY BTPS 4.5 03/01/26	10,660,000.000	13,314,340.000	
		ITALY BTPS 4.5 05/01/23	2,600,000.000	3,005,407.600	
		ITALY BTPS 4.75 08/01/23	4,010,000.000	4,710,948.000	
		ITALY BTPS 4.75 09/01/21	3,810,000.000	4,161,282.000	
		ITALY BTPS 4.75 09/01/28	8,450,000.000	11,332,218.950	
		ITALY BTPS 4.75 09/01/44	4,670,000.000	7,277,756.020	
		ITALY BTPS 5.0 03/01/22	2,500,000.000	2,804,250.000	
		ITALY BTPS 5.0 03/01/25	9,640,000.000	12,004,875.160	
		ITALY BTPS 5.0 08/01/34	5,450,000.000	8,056,190.000	
		ITALY BTPS 5.0 08/01/39	5,680,000.000	8,811,952.000	
		ITALY BTPS 5.0 09/01/40	4,630,000.000	7,190,853.000	
		ITALY BTPS 5.25 11/01/29	6,380,000.000	9,005,370.000	
		ITALY BTPS 5.5 09/01/22	2,960,000.000	3,431,812.160	
		ITALY BTPS 5.5 11/01/22	3,200,000.000	3,732,697.600	
		ITALY BTPS 5.75 02/01/33	3,870,000.000	5,965,605.000	
		ITALY BTPS 6.0 05/01/31	4,300,000.000	6,574,270.000	
		ITALY BTPS 6.5 11/01/27	3,400,000.000	4,933,740.000	
		ITALY BTPS 7.25 11/01/26	2,150,000.000	3,130,830.000	
		ITALY BTPS 9.0 11/01/23	1,700,000.000	2,305,540.000	
		NETHERLANDS 0.25 07/15/25	2,630,000.000	2,754,925.000	
		NETHERLANDS 0.25 07/15/29	2,260,000.000	2,389,077.850	
		NETHERLANDS 0.5 01/15/40	1,370,000.000	1,500,437.700	
		NETHERLANDS 0.5 07/15/26	3,140,000.000	3,358,073.000	
		NETHERLANDS 0.75 07/15/27	3,670,000.000	4,016,644.340	
		NETHERLANDS 0.75 07/15/28	2,340,000.000	2,578,848.480	
		NETHERLANDS 01/15/22	5,180,000.000	5,261,657.520	
		NETHERLANDS 01/15/24	3,980,000.000	4,089,708.700	
		NETHERLANDS 1.75 07/15/23	5,200,000.000	5,683,506.400	
		NETHERLANDS 2.0 07/15/24	3,600,000.000	4,055,886.000	
		NETHERLANDS 2.5 01/15/33	3,400,000.000	4,635,866.000	
		NETHERLANDS 2.75 01/15/47	3,170,000.000	5,469,090.050	
		NETHERLANDS 3.25 07/15/21	5,240,000.000	5,604,494.400	
		NETHERLANDS 3.75 01/15/23	1,670,000.000	1,915,991.000	
		NETHERLANDS 3.75 01/15/42	3,760,000.000	6,906,074.720	

		NETHERLANDS 4.0 01/15/37	3,080,000.000	5,268,032.000	
		NETHERLANDS 5.5 01/15/28	4,060,000.000	6,085,940.000	
		NETHERLANDS 7.5 01/15/23	590,000.000	749,477.000	
		SPAIN 0.05 01/31/21	2,510,000.000	2,526,440.500	
		SPAIN 0.05 10/31/21	6,080,000.000	6,143,067.840	
		SPAIN 0.35 07/30/23	3,270,000.000	3,352,462.200	
		SPAIN 0.4 04/30/22	3,300,000.000	3,371,709.000	
		SPAIN 0.45 10/31/22	9,820,000.000	10,074,318.360	
		SPAIN 0.6 10/31/29	6,020,000.000	6,253,455.600	
		SPAIN 0.75 07/30/21	10,940,000.000	11,180,406.500	
		SPAIN 1.3 10/31/26	7,220,000.000	7,892,506.900	
		SPAIN 1.4 04/30/28	3,760,000.000	4,179,927.320	
		SPAIN 1.4 07/30/28	4,280,000.000	4,748,660.000	
		SPAIN 1.45 04/30/29	5,320,000.000	5,958,282.960	
		SPAIN 1.45 10/31/27	3,470,000.000	3,856,045.130	
		SPAIN 1.5 04/30/27	2,700,000.000	2,998,890.000	
		SPAIN 1.6 04/30/25	3,110,000.000	3,416,269.690	
		SPAIN 1.85 07/30/35	2,770,000.000	3,280,247.850	
		SPAIN 1.95 04/30/26	3,000,000.000	3,396,847.490	
		SPAIN 1.95 07/30/30	4,840,000.000	5,707,124.720	
		SPAIN 2.15 10/31/25	4,650,000.000	5,287,645.200	
		SPAIN 2.35 07/30/33	3,400,000.000	4,244,220.000	
		SPAIN 2.7 10/31/48	2,560,000.000	3,580,631.040	
		SPAIN 2.75 10/31/24	6,960,000.000	8,012,546.180	
		SPAIN 2.9 10/31/46	4,820,000.000	6,913,788.720	
		SPAIN 3.45 07/30/66	2,350,000.000	3,945,210.300	
		SPAIN 3.8 04/30/24	5,600,000.000	6,637,146.290	
		SPAIN 4.2 01/31/37	5,190,000.000	8,213,559.060	
		SPAIN 4.4 10/31/23	4,080,000.000	4,860,463.200	
		SPAIN 4.65 07/30/25	4,820,000.000	6,159,849.140	
		SPAIN 4.7 07/30/41	5,690,000.000	10,027,799.950	
		SPAIN 4.8 01/31/24	3,000,000.000	3,658,386.000	
		SPAIN 4.85 10/31/20	2,640,000.000	2,787,588.910	
		SPAIN 4.9 07/30/40	4,360,000.000	7,758,620.000	
		SPAIN 5.15 10/31/28	4,410,000.000	6,399,792.000	
		SPAIN 5.15 10/31/44	3,000,000.000	5,794,608.000	
		SPAIN 5.4 01/31/23	6,210,000.000	7,395,526.260	
		SPAIN 5.5 04/30/21	3,710,000.000	4,052,533.170	
		SPAIN 5.75 07/30/32	4,390,000.000	7,351,180.530	
		SPAIN 5.85 01/31/22	4,160,000.000	4,768,212.800	
		SPAIN 5.9 07/30/26	4,440,000.000	6,234,870.000	
		SPAIN 6.0 01/31/29	3,500,000.000	5,392,800.000	
ユーロ　小計			1,188,880,000.000 (142,106,826,400)	1,452,239,874.540 (173,586,232,204)	
南アフリカ・ランド		SOUTH AFRICA 10.5 12/21/26	54,860,000.000	61,554,664.540	
		SOUTH AFRICA 6.25 03/31/36	17,630,000.000	12,918,886.710	

		SOUTH AFRICA 6.5 02/28/41	21,670,000.000	15,389,479.230	
		SOUTH AFRICA 7.0 02/28/31	17,190,000.000	14,628,690.000	
		SOUTH AFRICA 8.0 01/31/30	32,290,000.000	30,291,750.770	
		SOUTH AFRICA 8.25 03/31/32	63,370,000.000	58,784,997.990	
		SOUTH AFRICA 8.5 01/31/37	36,310,000.000	32,779,637.110	
		SOUTH AFRICA 8.75 01/31/44	33,480,000.000	30,099,477.840	
		SOUTH AFRICA 8.75 02/28/48	58,790,000.000	52,850,981.280	
		SOUTH AFRICA 8.875 02/28/35	13,250,000.000	12,584,654.690	
		SOUTH AFRICA 9.0 01/31/40	19,430,000.000	18,095,547.600	
	南アフリカ・ランド　小計		368,270,000.000 (2,695,736,400)	339,978,767.760 (2,488,644,580)	
国債証券　合計			401,764,266,010 (401,764,266,010)	454,493,752,289 (454,493,752,289)	
合計				454,493,752,289 (454,493,752,289)	

（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	214銘柄	47.73	48.37
イギリス・ポンド	国債証券	40銘柄	6.21	6.30
オーストラリア・ドル	国債証券	23銘柄	1.94	1.97
カナダ・ドル	国債証券	28銘柄	1.74	1.76
シンガポール・ドル	国債証券	17銘柄	0.36	0.36
スウェーデン・クローナ	国債証券	6銘柄	0.24	0.24
デンマーク・クローネ	国債証券	5銘柄	0.46	0.47
ノルウェー・クローネ	国債証券	6銘柄	0.14	0.15
ポーランド・ズロチ	国債証券	15銘柄	0.59	0.60
マレーシア・リンギット	国債証券	15銘柄	0.25	0.25
メキシコ・ペソ	国債証券	14銘柄	0.78	0.79
ユーロ	国債証券	295銘柄	37.69	38.19
南アフリカ・ランド	国債証券	11銘柄	0.54	0.55

（注）「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

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15日現在
資産の部	
流動資産	
預金	2,975,222,080
コール・ローン	1,156,739,558
株式	39,256,134,695
新株予約権証券	740,406
投資信託受益証券	367,211,533
投資証券	100,540,864
派生商品評価勘定	104,196,014
未収入金	798,011
未収配当金	70,469,761
差入委託証拠金	864,980,653
流動資産合計	44,897,033,575
資産合計	44,897,033,575
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,699,897
未払解約金	72,090,000
流動負債合計	73,789,897
負債合計	73,789,897
純資産の部	
元本等	
元本	40,153,656,121
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	4,669,587,557
元本等合計	44,823,243,678
純資産合計	44,823,243,678
負債純資産合計	44,897,033,575

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30年10月13日 至　令和1年10月15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。 新株予約権証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
２．　デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。 為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
３．　収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。
４．　その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、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15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	49,906,024,818円
同期中追加設定元本額	51,434,337,484円
同期中一部解約元本額	61,186,706,181円

元本の内訳	
ファンド名	
ＤＩＡＭ新興国株式インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	5,475,611,397円
ＤＩＡＭ新興国株式インデックスファンド＜為替ヘッジなし＞（ファンドラップ）	562,067,419円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	3,094,261円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	10,687,402円
ＭＩＴＯ　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	5,425,139,001円
たわらノーロード　新興国株式＜ラップ向け＞	2,032,330,797円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	563,429,273円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	4,136,627円
たわらノーロード　バランス（標準型）	15,895,775円
たわらノーロード　バランス（積極型）	27,390,923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）	26,025,212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）	61,873,418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）	41,375,398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）	81,349,428円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	306,727円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	914,585円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	364,427円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	1,118,379円
たわらノーロード　全世界株式	15,928,141円
Ｏｎｅ　ＤＣ　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
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	357,798,598円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	347,912,071円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	681,306,551円
投資のソムリエ	6,806,292,005円
クルーズコントロール	1,131,096,814円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	714,010,516円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	300,696,982円
クルーズコントロール＜ＤＣ年金＞	979,978円
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（堅実型）	18,537,357円
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（積極型）	50,145,185円
投資のソムリエ＜ＤＣ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・イヤー２０４５）	6,405,350円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	5,193,870円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	2,873,316円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー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＜ＤＣ年金＞	225,977,688円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	920,972円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	841,829円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	831,723円
エマージング株式パッシブファンドＶＡ（適格機関投資家専用）	184,637,230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）	423,767,599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）	285,475,529円
計	40,153,656,121円
２．　受益権の総数	40,153,656,121口

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

項目	自　平成30年10月13日 至　令和1年10月15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15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15日現在 当期の損益に含まれた評価差額（円）
株式	△1,072,521,704
新株予約権証券	382,722
投資信託受益証券	13,062,748
投資証券	757,506
合計	△1,058,318,728

（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15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15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	1,063,516,213	－	1,066,645,400	3,129,187
アメリカ・ドル	1,063,516,213	－	1,066,645,400	3,129,187
合計	1,063,516,213	－	1,066,645,400	3,129,187

（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。

①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。

②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15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				
先物取引				
買建	4,991,778,772	－	5,091,145,702	99,366,930
合計	4,991,778,772	－	5,091,145,702	99,366,930

（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15日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.1163円 (11,163円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

（１）株式

令和1年10月15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	4.260	26,326.800	
	CTRIP.COM INTERNATIONAL LTD ADR	29,012	30.540	886,026.480	
	CIA DE MINAS BUENAVENTURA SA ADR	14,930	14.320	213,797.600	
	SURGUTNEFTEGAZ SP ADR PREF	69,900	5.800	405,420.000	
	CREDICORP LTD	4,306	208.560	898,059.360	
	SINA CORP	3,696	40.720	150,501.120	
	MOBILE TELESYSTEMS PJSC ADR	28,464	8.190	233,120.160	
	NETEASE INC-ADR	4,646	276.590	1,285,037.140	
	GRUPO FINANCIERO GALICIA SA ADR	4,128	12.850	53,044.800	
	SOUTHERN COPPER CORP	5,523	34.910	192,807.930	
	TELECOM ARGENTINA SA SP ADR	7,366	10.500	77,343.000	
	TRANSPORTADORA DE GAS DEL SUR SP ADR	6,000	8.210	49,260.000	
	YPF SA ADR	8,927	9.130	81,503.510	
	LUKOIL SPON ADR	26,560	84.320	2,239,539.200	
	GAZPROM PAO ADR	361,911	6.962	2,519,624.380	
	COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK SP GDR	102,425	4.750	486,518.750	
	INNER MONGOLIA YITAI COAL CO	66,800	0.901	60,186.800	
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRADE	86,736	1.128	97,838.200	
	SURGUTNEFTEGAZ ADR	40,348	5.565	224,536.620	
	51JOB INC ADR	1,814	80.140	145,373.960	
	X5 RETAIL GROUP NV GDR	8,930	31.050	277,276.500	
	NOVATEK PJSC GDR	6,184	208.000	1,286,272.000	
	BAIDU INC -SPON ADR	18,625	105.460	1,964,192.500	
	NOVOLIPETSK STEEL GDR	12,150	20.120	244,458.000	
	BANCO MACRO SA ADR	3,717	26.400	98,128.800	
	MMC NORILSK NICKEL ADR	44,004	24.710	1,087,338.840	
	ROSNEFT OIL CO GDR	73,565	6.376	469,050.440	

	NEW ORIENTAL EDUCATION & TECH	9,695	112.880	1,094,371.600	
	SEVERSTAL GDR	17,178	13.640	234,307.920	
	TATNEFT ADR	17,571	64.900	1,140,357.900	
	MAGNITOGORSK IRON & STEEL SPON GDR	15,136	7.410	112,157.760	
	VTB BANK OJSC GDR	172,000	1.298	223,256.000	
	DP WORLD PLC	12,841	13.920	178,746.720	
	MAGNIT PJSC GDR	21,066	11.220	236,360.520	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD ADR	30,862	9.040	278,992.480	
	PAMPA ENERGIA SA ADR	5,773	16.390	94,619.470	
	TAL EDUCATION GROUP-ADR	26,298	38.120	1,002,479.760	
	NOAH HOLDINGS LTD ADR	407	27.940	11,371.580	
	SBERBANK ADR	185,668	14.265	2,648,554.020	
	PHOSAGRO PJSC GDR	13,784	12.890	177,675.760	
	HUAZHU GROUP LTD ADR	8,822	34.250	302,153.500	
	YY INC-ADR	4,178	56.750	237,101.500	
	GDS HOLDINGS LTD ADR	4,404	41.610	183,250.440	
	NIO INC ADR	62,042	1.530	94,924.260	
	TENCENT MUSIC ENTERTAINMENT GROUP ADR	6,256	13.310	83,267.360	
	58.COM INC ADR	6,955	49.090	341,420.950	
	AUTOHOME INC ADR	3,720	82.160	305,635.200	
	WEIBO CORP ADR	4,093	48.570	198,797.010	
	JD.COM INC ADR	48,777	29.830	1,455,017.910	
	GLOBANT SA	2,096	98.630	206,728.480	
	ALIBABA GROUP HOLDING LTD-ADR	95,541	171.160	16,352,797.560	
	MOMO INC SPON ADR	9,385	34.140	320,403.900	
	BAOZUN INC-SPN ADR	3,717	44.680	166,075.560	
	PINDUODUO INC ADR	12,456	32.840	409,055.040	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	23,227	43.200	1,003,406.400	
	IQIYI INC ADR	9,440	16.190	152,833.600	
	POLYUS PJSC GDR	4,556	56.050	255,363.800	
	HUTCHISON CHINA MEDITECH LTD ADR	1,538	18.200	27,991.600	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC ADR	19,971	20.480	409,006.080	
アメリカ・ドル　小計		1,906,300		45,691,064.530 (4,953,825,216)	
アラブ首長国連邦・ディルハム	DUBAI ISLAMIC BANK PJSC	136,145	5.340	727,014.300	
	EMIRATES TELECOMMUNICATIONS GROUP CO PJSC	118,789	16.440	1,952,891.160	
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK PJSC	177,861	7.520	1,337,514.720	

	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	176,159	15.300	2,695,232.700	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	193,358	4.600	889,446.800	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	194,346	2.150	417,843.900	
	EMAAR DEVELOPMENT PJSC	77,463	4.110	318,372.930	
	EMAAR MALLS PJSC	178,166	1.900	338,515.400	
アラブ首長国連邦・ディルハム　小計		1,252,287		8,676,831.910 (256,573,920)	
イギリス・ポンド	POLYMETAL INTERNATIONAL PLC	15,843	11.545	182,907.430	
イギリス・ポンド　小計		15,843		182,907.430 (24,990,642)	
インド・ルピー	RELIANCE INDUSTRIES LTD	194,344	1,358.000	263,919,152.000	
	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	39,255	485.950	19,075,967.250	
	ASIAN PAINTS LTD	18,318	1,798.700	32,948,586.600	
	EICHER MOTORS LTD	813	18,327.950	14,900,623.350	
	GRASIM INDUSTRIES LTD	18,384	698.650	12,843,981.600	
	MAHINDRA & MAHINDRA LTD	49,933	568.650	28,394,400.450	
	SHREE CEMENT LTD	702	18,695.600	13,124,311.200	
	ICICI BANK LTD	159,611	428.850	68,449,177.350	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP LTD	46,395	310.500	14,405,647.500	
	STATE BANK OF INDIA LTD	116,610	255.450	29,788,024.500	
	CONTAINER CORP OF INDIA LTD	12,991	578.250	7,512,045.750	
	LIC HOUSING FINANCE LTD	26,242	361.900	9,496,979.800	
	TATA STEEL LTD	30,106	344.850	10,382,054.100	
	TATA MOTORS LTD	111,599	127.850	14,267,932.150	
	JSW STEEL LTD	47,195	221.450	10,451,332.750	
	TATA POWER CO LTD	100,483	59.800	6,008,883.400	
	BRITANNIA INDUSTRIES LTD	3,615	3,109.650	11,241,384.750	
	NESTLE INDIA LTD	1,484	14,169.000	21,026,796.000	
	GAIL INDIA LTD	96,058	125.850	12,088,899.300	
	VEDANTA LTD	133,208	147.800	19,688,142.400	
	AXIS BANK LTD	127,655	683.500	87,252,192.500	
	TITAN COMPANY LTD	20,828	1,248.950	26,013,130.600	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	157,916	135.250	21,358,139.000	
	LUPIN LTD	18,852	716.400	13,505,572.800	
	BAJAJ FINANCE LTD	11,110	3,883.300	43,143,463.000	
	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP	108,853	2,014.750	219,311,581.750	
	ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISES LTD	30,410	242.900	7,386,589.000	
	INFOSYS LTD	228,666	786.100	179,754,342.600	
	WIPRO LTD	82,231	243.450	20,019,136.950	

INDIAN OIL CORP LTD	115,396	144.750	16,703,571.000	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	43,350	2,014.250	87,317,737.500	
HCL TECHNOLOGIES LTD	38,459	1,086.800	41,797,241.200	
DABUR INDIA LTD	31,309	455.000	14,245,595.000	
HERO MOTOCORP LTD	7,538	2,609.200	19,668,149.600	
DR REDDYS LABORATORIES LTD	7,489	2,651.900	19,860,079.100	
BHARTI AIRTEL LTD	145,571	393.550	57,289,467.050	
UNITED SPIRITS LTD	24,162	616.650	14,899,497.300	
SUN PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD	57,096	394.650	22,532,936.400	
DIVI'S LABORATORIES LTD	5,865	1,683.700	9,874,900.500	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	6,831	6,821.100	46,594,934.100	
GLENMARK PHARMACEUTICALS LTD	9,463	280.200	2,651,532.600	
AUROBINDO PHARMA LTD	22,361	459.250	10,269,289.250	
HAVELLS INDIA LTD	18,543	653.900	12,125,267.700	
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	40,483	99.000	4,007,817.000	
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE CO LTD	14,479	1,044.650	15,125,487.350	
PETRONET LNG LTD	40,593	258.850	10,507,498.050	
CIPLA LTD/INDIA	26,157	440.900	11,532,621.300	
LARSEN & TOUBRO LTD	33,228	1,423.950	47,315,010.600	
ULTRATECH CEMENT LTD	6,693	4,170.300	27,911,817.900	
ASHOK LEYLAND LTD	64,420	67.600	4,354,792.000	
BOSCH LTD	529	13,345.450	7,059,743.050	
TATA CONSULTANCY SERVICES LTD	60,539	2,021.000	122,349,319.000	
NTPC LTD	159,661	117.750	18,800,082.750	
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	5,293	1,376.500	7,285,814.500	
YES BANK LTD	104,338	40.100	4,183,953.800	
AMBUJA CEMENTS LTD	33,112	194.050	6,425,383.600	
BHARAT FORGE LTD	8,492	430.350	3,654,532.200	
HINDALCO INDUSTRIES LTD	73,359	188.700	13,842,843.300	
ITC LTD	236,170	244.100	57,649,097.000	
PIDILITE INDUSTRIES LTD	9,127	1,362.250	12,433,255.750	
UNITED PHOSPHORUS LTD	35,623	586.650	20,898,232.950	
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	22,088	690.700	15,256,181.600	
TECH MAHINDRA LTD	29,546	720.750	21,295,279.500	
VODAFONE IDEA LTD	248,533	6.400	1,590,611.200	
MARICO LTD	37,213	384.950	14,325,144.350	
PAGE INDUSTRIES LTD	355	21,009.350	7,458,319.250	
POWER GRID CORP OF INDIA LTD	111,822	198.400	22,185,484.800	
ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	46,478	407.450	18,937,461.100	
REC LTD	55,173	124.950	6,893,866.350	

	BAJAJ FINSERV LTD	2,733	8,082.250	22,088,789.250	
	BAJAJ AUTO LTD	6,471	2,958.050	19,141,541.550	
	COAL INDIA LTD	78,544	190.100	14,931,214.400	
	MAHINDRA & MAHINDRA FINANCIAL SERVICES LTD	11,467	320.700	3,677,466.900	
	BHARTI INFRATEL LTD	32,296	259.450	8,379,197.200	
	INDIABULLS HOUSING FINANCE LTD	14,918	197.800	2,950,780.400	
	TATA STEEL LTD-PARTLY PAID	2,333	34.850	81,305.050	
	HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	32,930	582.300	19,175,139.000	
	AVENUE SUPERMARTS LTD	8,108	1,828.050	14,821,829.400	
	ICICI LOMBARD GENERAL INSURANCE CO LTD	8,255	1,241.250	10,246,518.750	
	INTERGLOBE AVIATION LTD	5,373	1,766.750	9,492,747.750	
インド・ルピー　小計		4,234,232		2,241,854,848.600 (3,430,037,918)	
インドネシア・ルピア	BARITO PACIFIC TBK PT	1,499,800	915.000	1,372,317,000.000	
	UNITED TRACTORS TBK PT	143,901	20,625.000	2,967,958,125.000	
	INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK PT	347,600	7,700.000	2,676,520,000.000	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	92,100	44,500.000	4,098,450,000.000	
	PT ASTRA INTERNATIONAL TBK	1,318,300	6,425.000	8,470,077,500.000	
	TELEKOMUNIKASI INDONESIA PERSERO TBK	3,243,700	4,190.000	13,591,103,000.000	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA TBK PT	364,900	5,500.000	2,006,950,000.000	
	GUDANG GARAM TBK PT	32,000	53,875.000	1,724,000,000.000	
	HANJAYA MANDALA SAMPOERNA TBK	795,500	2,270.000	1,805,785,000.000	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA TBK PT	94,000	18,950.000	1,781,300,000.000	
	INDAH KIAT PULP AND PAPER CORP TBK PT	256,700	6,275.000	1,610,792,500.000	
	BUKIT ASAM TBK PT	230,000	2,250.000	517,500,000.000	
	BANK MANDIRI	1,246,000	6,600.000	8,223,600,000.000	
	PABRIK KERTAS TJIWI KIMIA TBK PT	86,800	9,925.000	861,490,000.000	
	BANK RAKYAT INDONESIA	3,700,600	3,920.000	14,506,352,000.000	
	PERUSAHAAN GAS NEGARA TBK PT	806,800	2,180.000	1,758,824,000.000	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSERO TBK PT	491,500	6,925.000	3,403,637,500.000	
	KALBE FARMA TBK PT	1,024,700	1,670.000	1,711,249,000.000	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK PT	219,900	12,100.000	2,660,790,000.000	

	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	651,500	31,000.000	20,196,500,000.000	
	JASA MARGA PERSERO TBK PT	145,625	5,625.000	819,140,625.000	
	BUMI SERPONG DAMAI PT	746,500	1,390.000	1,037,635,000.000	
	ADARO ENERGY PT	1,016,200	1,295.000	1,315,979,000.000	
	PAKUWON JATI TBK	1,659,900	635.000	1,054,036,500.000	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR TBK PT	165,800	11,600.000	1,923,280,000.000	
	BANK TABUNGAN NEGARA TBK PT	526,900	1,905.000	1,003,744,500.000	
	PT SURYA CITRA MEDIA TBK	450,000	1,100.000	495,000,000.000	
インドネシア・ルピア　小計		21,357,226		103,594,011,250.000 (797,673,887)	
オフショア・人民元	LUZHOU LAOJIAO CO LTD	7,700	87.660	674,982.000	
	LUXSHARE PRECISION INDUSTRY CO LTD	29,450	28.400	836,380.000	
	FOCUS MEDIA INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD	120,200	5.450	655,090.000	
	NEW HOPE LIUHE CO LTD	30,900	18.630	575,667.000	
	IFLYTEK CO LTD	11,600	33.940	393,704.000	
	BANK OF NINGBO CO LTD	29,400	27.400	805,560.000	
	YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD	8,500	83.680	711,280.000	
	EAST MONEY INFORMATION CO LTD	40,200	15.480	622,296.000	
	JIANGSU YANGHE BREWERY JOINT-STOCK CO LTD	5,300	103.770	549,981.000	
	WULIANGYE YIBIN CO LTD	14,300	130.860	1,871,298.000	
	SUNING.COM CO LTD	56,100	10.480	587,928.000	
	BOE TECHNOLOGY GROUP CO LTD	168,300	3.800	639,540.000	
	CHINA MERCHANTS SHEKOU INDUSTRIAL ZONE HOLDINGS CO LTD	33,200	20.200	670,640.000	
	GREE ELECTRIC APPLIANCES INC OF ZHUHAI	13,500	58.700	792,450.000	
	MIDEA GROUP CO LTD	14,500	53.450	775,025.000	
	HANGZHOU HIKVISION DIGITAL TECHNOLOGY CO LTD	38,800	30.970	1,201,636.000	
	GUOSEN SECURITIES CO LTD	17,200	12.640	217,408.000	
	PING AN BANK CO LTD	63,800	17.220	1,098,636.000	
	WENS FOODSTUFFS GROUP CO LTD	20,200	37.600	759,520.000	

SHENWAN HONGYUAN GROUP CO LTD	125,700	4.910	617,187.000	
CHINA VANKE CO LTD	41,800	27.120	1,133,616.000	
ZTE CORP	9,700	32.960	319,712.000	
WEICHAI POWER CO LTD	42,000	12.210	512,820.000	
XINJIANG GOLDWIND SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	26,200	13.250	347,150.000	
BANK OF SHANGHAI CO LTD	71,690	9.760	699,694.400	
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO LTD	16,120	24.970	402,516.400	
PETROCHINA CO LTD	46,100	6.160	283,976.000	
INDUSTRIAL & COMMERCIAL BANK OF CHINA LTD	184,100	5.720	1,053,052.000	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA LTD	220,200	3.560	783,912.000	
BANK OF CHINA LTD	84,000	3.670	308,280.000	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL CORP	131,200	5.080	666,496.000	
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	75,300	36.830	2,773,299.000	
PING AN INSURANCE GROUP CO OF CHINA LTD	38,500	90.450	3,482,325.000	
INDUSTRIAL BANK CO LTD	85,600	19.010	1,627,256.000	
SHANGHAI PUDONG DEVELOPMENT BANK CO LTD	121,200	12.940	1,568,328.000	
CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	161,800	6.270	1,014,486.000	
SAIC MOTOR CORP LTD	32,200	24.390	785,358.000	
KWEICHOW MOUTAI CO LTD	4,400	1,180.000	5,192,000.000	
BANK OF COMMUNICATIONS CO LTD	149,500	5.700	852,150.000	
CITIC SECURITIES CO LTD	45,200	23.090	1,043,668.000	
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	24,800	37.090	919,832.000	
CHINA YANGTZE POWER CO LTD	85,200	18.230	1,553,196.000	
DAQIN RAILWAY CO LTD	80,000	7.680	614,400.000	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD	197,700	4.600	909,420.000	
CHINA STATE CONSTRUCTION ENGINEERING CORP LTD	128,800	5.560	716,128.000	
CHINA SHIPBUILDING INDUSTRY CO LTD	39,100	5.610	219,351.000	
HAITONG SECURITIES CO LTD	44,200	15.160	670,072.000	
INNER MONGOLIA YILI INDUSTRIAL GROUP CO LTD	25,000	28.530	713,250.000	
BANK OF BEIJING CO LTD	119,400	5.640	673,416.000	

CHINA UNITED NETWORK COMMUNICATIONS LTD	140,700	6.150	865,305.000	
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	20,600	43.150	888,890.000	
CHINA MERCHANTS SECURITIES CO LTD	30,700	17.240	529,268.000	
POLY DEVELOPMENTS AND HOLDINGS GROUP CO LTD	50,800	15.600	792,480.000	
CRRC CORP LTD	116,500	7.430	865,595.000	
JIANGSU HENGRUI MEDICINE CO LTD	15,100	83.560	1,261,756.000	
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION CORP LTD	64,400	9.740	627,256.000	
HUATAI SECURITIES CO LTD	34,700	19.080	662,076.000	
CHINA RAILWAY GROUP LTD	108,500	6.080	659,680.000	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	6,100	25.520	155,672.000	
GEMDALE CORP	40,600	13.100	531,860.000	
WANHUA CHEMICAL GROUP CO LTD	18,100	45.120	816,672.000	
CHINA FORTUNE LAND DEVELOPMENT CO LTD	21,900	28.510	624,369.000	
SDIC POWER HOLDINGS CO LTD	63,000	9.050	570,150.000	
CHINA INTERNATIONAL TRAVEL SERVICE CORP LTD	8,400	94.630	794,892.000	
METALLURGICAL CORP OF CHINA LTD	69,300	2.870	198,891.000	
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS CO LTD	21,700	24.850	539,245.000	
SICHUAN CHUANTOU ENERGY CO LTD	23,700	10.170	241,029.000	
AECC AVIATION POWER CO LTD	17,300	22.120	382,676.000	
JOINTOWN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	16,000	14.320	229,120.000	
CHINA MOLYBDENUM CO LTD	131,800	3.650	481,070.000	
INDUSTRIAL SECURITIES CO LTD	53,200	6.480	344,736.000	
SHANDONG GOLD MINING CO LTD	11,200	34.000	380,800.000	
YONGHUI SUPERSTORES CO LTD	60,800	9.130	555,104.000	
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC	2,000	77.160	154,320.000	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD	82,700	6.940	573,938.000	

	FANGDA CARBON NEW MATERIAL CO LTD	34,000	11.790	400,860.000	
	ZHANGZHOU PIENTZEHUANG PHARMACEUTICAL CO LTD	5,000	109.090	545,450.000	
	SHANXI XINGHUACUN FEN WINE FACTORY CO LTD	3,700	79.900	295,630.000	
	LONGI GREEN ENERGY TECHNOLOGY CO LTD	24,000	26.690	640,560.000	
	SHAANXI COAL INDUSTRY CO LTD	72,351	8.920	645,370.920	
	FOSHAN HAITIAN FLAVOURING & FOOD CO LTD	10,700	110.350	1,180,745.000	
	GUOTAI JUNAN SECURITIES CO LTD	39,500	18.080	714,160.000	
	ORIENT SECURITIES CO LTD/CHINA	60,300	10.430	628,929.000	
	EVERBRIGHT SECURITIES CO LTD	24,000	12.000	288,000.000	
オフショア・人民元　小計		4,683,211		66,961,922.720 (1,027,195,895)	
カタール・リアル	QATAR INSURANCE CO SAQ	144,170	3.180	458,460.600	
	QATAR NATIONAL BANK	295,265	19.310	5,701,567.150	
	COMMERCIAL BANK OF QATAR QSC	107,617	4.500	484,276.500	
	OOREDOO QSC	67,600	7.370	498,212.000	
	QATAR FUEL QSC	25,420	22.990	584,405.800	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	46,760	15.500	724,780.000	
	INDUSTRIES QATAR QSC	137,470	10.950	1,505,296.500	
	QATAR ISLAMIC BANK SAQ	65,575	15.600	1,022,970.000	
	MASRAF AL RAYAN	218,064	3.720	811,198.080	
	BARWA REAL ESTATE CO	167,630	3.430	574,970.900	
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDING CO	266,928	2.840	758,075.520	
カタール・リアル　小計		1,542,499		13,124,213.050 (389,395,401)	
コロンビア・ペソ	INTERCONEXION ELECTRICA SA ESP	26,028	19,000.000	494,532,000.000	
	ECOPETROL SA	301,511	2,995.000	903,025,445.000	
	GRUPO DE INVERSIONES SURAMERICANA SA-PREF	10,138	29,300.000	297,043,400.000	
	GRUPO AVAL ACCIONES Y VALORES SA-PREF	341,831	1,310.000	447,798,610.000	
	CEMENTOS ARGOS SA	37,720	7,510.000	283,277,200.000	
	GRUPO ARGOS SA	11,705	17,480.000	204,603,400.000	
	BANCOLOMBIA SA	17,386	40,000.000	695,440,000.000	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	26,080	42,920.000	1,119,353,600.000	

	GRUPO DE INVERSIONES SURAMERICANA SA	18,835	33,140.000	624,191,900.000	
コロンビア・ペソ　小計		791,234		5,069,265,555.000 (160,188,792)	
サウジアラビア・リアル	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL CO	16,490	53.200	877,268.000	
	JARIR MARKETING CO	4,309	152.000	654,968.000	
	CO FOR COOPERATIVE INSURANCE	4,489	71.000	318,719.000	
	ETIHAD ETISALAT CO	27,652	23.200	641,526.400	
	SAUDI BRITISH BANK	27,107	30.000	813,210.000	
	AL RAJHI BANK	79,173	58.000	4,592,034.000	
	BANK ALBILAD	26,934	23.600	635,642.400	
	BANK AL-JAZIRA	29,448	12.760	375,756.480	
	BANQUE SAUDI FRANSI	39,754	29.550	1,174,730.700	
	RIYAD BANK	87,949	21.860	1,922,565.140	
	SAMBA FINANCIAL GROUP	59,210	26.050	1,542,420.500	
	SAUDI TELECOM CO	25,005	99.600	2,490,498.000	
	SAUDI ARABIAN FERTILIZER CO	12,215	78.800	962,542.000	
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	48,259	88.200	4,256,443.800	
	SAUDI CEMENT CO	5,494	63.100	346,671.400	
	SAUDI ELECTRICITY CO	61,075	20.420	1,247,151.500	
	SAUDI INDUSTRIAL INVESTMENT GROUP	16,160	21.680	350,348.800	
	SAVOLA GROUP	19,176	27.200	521,587.200	
	NATIONAL INDUSTRIALIZATION CO	24,022	12.600	302,677.200	
	ALMARAI CO JSC	18,322	46.600	853,805.200	
	EMAAR ECONOMIC CITY	28,034	9.250	259,314.500	
	SAHARA INTERNATIONAL PETROCHEMICAL CO	26,336	16.660	438,757.760	
	ADVANCED PETROCHEMICAL CO	7,773	47.300	367,662.900	
	SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	53,869	10.160	547,309.040	
	DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEVELOPMENT CO	38,785	11.580	449,130.300	
	RABIGH REFINING & PETROCHEMICAL CO	16,050	19.720	316,506.000	
	BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE INSURANCE CO	2,022	104.000	210,288.000	
	ALINMA BANK	40,244	20.000	804,880.000	
	SAUDI ARABIAN MINING CO	29,973	41.500	1,243,879.500	
	SAUDI AIRLINES CATERING CO	2,944	85.100	250,534.400	
	NATIONAL COMMERCIAL BANK	76,336	42.000	3,206,112.000	

サウジアラビア・リアル　小計		954,609		32,974,940.120 (954,624,516)	
タイ・バーツ	BANGKOK BANK PCL	38,300	171.000	6,549,300.000	
	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	72.250	1,856,825.000	
	ROBINSON PCL-NVDR	38,800	65.000	2,522,000.000	
	SIAM COMMERCIAL BANK PCL NVDR	68,700	115.000	7,900,500.000	
	TRUE CORP PCL NVDR	711,055	5.300	3,768,591.500	
	KASIKORNBANK PCL NVDR	55,300	147.500	8,156,750.000	
	TMB BANK PCL -NVDR	1,010,000	1.490	1,504,900.000	
	IRPC PCL NVDR	679,600	3.640	2,473,744.000	
	BANPU PCL PUBLIC CO LTD NVDR	384,200	12.300	4,725,660.000	
	ELECTRICITY GENERATING PCL NVDR	17,900	360.000	6,444,000.000	
	SHIN CORP PCL	153,900	66.500	10,234,350.000	
	CHAROEN POKPHAND FOODS PCL	231,800	26.500	6,142,700.000	
	ADVANCED INFO SERVICE PCL	72,500	229.000	16,602,500.000	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	300,620	16.900	5,080,478.000	
	PTT PCL	761,200	45.250	34,444,300.000	
	THAI UNION GROUP PCL-NVDR	315,400	15.500	4,888,700.000	
	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	75.000	20,880,000.000	
	KASIKORNBANK PCL - FOREIGN	79,100	147.500	11,667,250.000	
	CENTRAL PATTANA PCL NVDR	151,000	63.000	9,513,000.000	
	BANGKOK DUSIT MEDICAL SERVICES NVDR	622,800	23.400	14,573,520.000	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR	34,200	124.000	4,240,800.000	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	177,210	36.000	6,379,560.000	
	THAI OIL PCL NVDR	72,200	70.000	5,054,000.000	
	CP ALL PCL NVDR	375,500	81.000	30,415,500.000	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL	531,300	13.500	7,172,550.000	
	PTT EXPLORATION & PRODUCTION PCL NVDR	96,945	122.500	11,875,762.500	

	TOTAL ACCESS COMMUNICATION PCL	66,700	60.250	4,018,675.000	
	INDORAMA VENTURES PCL NVDR	85,422	33.000	2,818,926.000	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	148,408	52.750	7,828,522.000	
	ENERGY ABSOLUTE PCL NVDR	89,800	51.250	4,602,250.000	
	BANGKOK EXPRESSWAY & METRO PCL NVDR	612,500	10.800	6,615,000.000	
	GULF ENERGY DEVELOPMENT PCL NVDR	34,900	167.000	5,828,300.000	
	MUANGTHAI CAPITAL PCL NVDR	59,400	58.500	3,474,900.000	
タイ・バーツ　小計		9,224,610		314,368,319.000 (1,122,294,899)	
チェコ・コルナ	KOMERCNI BANKA AS	5,669	737.000	4,178,053.000	
	CEZ	8,401	514.500	4,322,314.500	
	MONETA MONEY BANK AS	39,312	74.500	2,928,744.000	
チェコ・コルナ　小計		53,382		11,429,111.500 (52,916,786)	
チリ・ペソ	BANCO SANTANDER CHILE	5,043,748	51.490	259,702,584.520	
	BANCO DE CREDITO E INVERSIONES	2,485	45,500.000	113,067,500.000	
	BANCO DE CHILE	2,676,799	102.950	275,576,457.050	
	EMPRESAS CMPC SA	55,525	1,840.000	102,166,000.000	
	EMPRESAS COPEC SA	21,456	7,275.000	156,092,400.000	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	13,024	7,860.100	102,369,942.400	
	ENTEL CHILE SA	13,572	6,609.900	89,709,562.800	
	ENEL AMERICAS SA	2,616,813	138.730	363,030,467.490	
	COLBUN SA	554,294	137.810	76,387,256.140	
	AGUAS ANDINAS SA	224,014	389.100	87,163,847.400	
	EMBOTELLADORA ANDINA SA	35,748	2,338.100	83,582,398.800	
	LATAM AIRLINES GROUP SA	23,621	8,200.000	193,692,200.000	
	SOCIEDAD QUIMICA Y MINERA DE CHILE SA	9,147	19,800.000	181,110,600.000	
	SACI FALABELLA	43,443	4,195.000	182,243,385.000	
	ITAU CORPBANCA	13,236,977	5.370	71,082,566.490	
	CENCOSUD SA	64,086	1,136.100	72,808,104.600	
	ENEL CHILE SA	2,205,539	67.800	149,535,544.200	
チリ・ペソ　小計		26,840,291		2,559,320,816.890 (389,272,696)	
トルコ・リラ	AKBANK TAS	186,045	6.600	1,227,897.000	
	ANADOLU EFES BIRACILIK VE MALT SANAYII AS	1,860	18.840	35,042.400	
	ARCELIK	16,000	17.510	280,160.000	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	31,766	17.030	540,974.980	

	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIKALARI TAS	56,434	6.670	376,414.780	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	5,000	59.450	297,250.000	
	KOC HOLDING AS	49,560	17.600	872,256.000	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI AS	54,397	4.010	218,131.970	
	TURK HAVA YOLLARI	57,854	10.860	628,294.440	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	93,118	12.220	1,137,901.960	
	TURKIYE GARANTI BANKASI AS	142,362	8.350	1,188,722.700	
	TURKIYE IS BANKASI	151,063	5.600	845,952.800	
	TUPRAS TURKIYE PETROL RAFINE	7,949	121.700	967,393.300	
	HACI OMER SABANCI HOLDING AS	50,427	8.460	426,612.420	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	23,201	47.900	1,111,327.900	
	TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	13,735	24.140	331,562.900	
トルコ・リラ　小計		940,771		10,485,895.550 (191,787,030)	
ハンガリー・フォリント	RICHTER GEDEON NYRT	10,134	4,842.000	49,068,828.000	
	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NYRT	28,765	2,890.000	83,130,850.000	
	OTP BANK NYRT	13,775	13,200.000	181,830,000.000	
ハンガリー・フォリント　小計		52,674		314,029,678.000 (113,144,893)	
パキスタン・ルピー	MCB BANK LTD	33,000	169.850	5,605,050.000	
	OIL & GAS DEVELOPMENT CO LTD	74,500	130.130	9,694,685.000	
	HABIB BANK LTD	45,000	132.950	5,982,750.000	
パキスタン・ルピー　小計		152,500		21,282,485.000 (14,897,740)	
フィリピン・ペソ	AYALA LAND INC	461,400	48.000	22,147,200.000	
	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	85,530	53.550	4,580,131.500	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAND	89,510	93.400	8,360,234.000	
	AYALA CORP	16,883	877.500	14,814,832.500	
	ALLIANCE GLOBAL GROUP INC	52,000	11.060	575,120.000	
	DMCI HOLDINGS INC	50	8.820	441.000	
	GLOBE TELECOM INC	2,785	1,844.000	5,135,540.000	
	INTERNATIONAL CONTAINER TERM SERVICES INC	62,790	121.000	7,597,590.000	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	162,710	72.000	11,715,120.000	

	JOLLIBEE FOODS CORP	36,330	234.600	8,523,018.000	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	143,447	68.300	9,797,430.100	
	BDO UNIBANK INC	149,133	147.300	21,967,290.900	
	MEGAWORLD CORP	962,000	4.760	4,579,120.000	
	PLDT INC	6,525	1,116.000	7,281,900.000	
	ROBINSONS LAND CORP	214,900	25.450	5,469,205.000	
	SECURITY BANK CORP	23,420	197.500	4,625,450.000	
	SM PRIME HOLDINGS INC	634,975	39.200	24,891,020.000	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	58,300	158.500	9,240,550.000	
	SM INVESTMENTS CORP	17,403	1,010.000	17,577,030.000	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CORP	1,148,900	5.060	5,813,434.000	
	ABOITIZ POWER CORP	153,700	38.600	5,932,820.000	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	12,630	365.000	4,609,950.000	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	3,651	849.000	3,099,699.000	
フィリピン・ペソ　小計		4,498,972		208,334,126.000 (437,501,665)	
ブラジル・レアル	BRF SA	34,292	36.380	1,247,542.960	
	VALE SA	208,621	47.990	10,011,721.790	
	RAIA DROGASIL SA	16,500	101.050	1,667,325.000	
	TIM PARTICIPACOES SA	41,300	11.470	473,711.000	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	19,250	36.100	694,925.000	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	16,400	34.340	563,176.000	
	BANCO DO BRASIL SA	60,300	45.000	2,713,500.000	
	INVESTIMENTOS ITAU SA	303,860	12.910	3,922,832.600	
	LOJAS AMERICANAS SA	40,374	20.900	843,816.600	
	GERDAU SA	70,630	13.250	935,847.500	
	CIA BRASILEIRA DE DISTRIBUICAO GRUPO PAO DE ACUCAR	8,706	81.490	709,451.940	
	PETROLEO BRASILEIRO SA	198,210	29.670	5,880,890.700	
	PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	43,200	27.480	1,187,136.000	
	PETROLEO BRASILEIRO SA	286,112	27.310	7,813,718.720	
	COGNA EDUCACAO	82,068	10.670	875,665.560	
	CCR SA	71,820	17.430	1,251,822.600	
	WEG SA	55,072	23.750	1,307,960.000	
	BANCO BRADESCO SA PREF	269,450	34.490	9,293,330.500	
	BANCO BRADESCO SA	83,641	31.860	2,664,802.260	
	NATURA COSMETICOS SA	24,600	31.900	784,740.000	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	47,606	13.240	630,303.440	
	SUZANO SA	36,775	34.820	1,280,505.500	
	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	332,247	34.450	11,445,909.150	

	PORTO SEGURO SA	8,800	56.700	498,960.000	
	B2W CIA DIGITAL	17,000	54.000	918,000.000	
	BRASKEM SA	15,730	29.330	461,360.900	
	ENGIE BRASIL SA	15,487	43.820	678,640.340	
	LOCALIZA RENT A CAR	36,180	44.060	1,594,090.800	
	TELEFONICA BRASIL S.A.	31,928	53.320	1,702,400.960	
	LOJAS RENNER SA	57,737	50.730	2,928,998.010	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	41,004	19.290	790,967.160	
	COSAN SA	12,000	56.140	673,680.000	
	EQUATORIAL ENERGIA SA	10,900	102.950	1,122,155.000	
	EMBRAER SA	50,960	17.350	884,156.000	
	M DIAS BRANCO SA	10,400	34.190	355,576.000	
	BR MALLS PARTICIPACOES SA	63,965	14.390	920,456.350	
	JBS SA	72,200	29.000	2,093,800.000	
	CIA ENERGETICA DE MINAS GERAIS	51,849	13.870	719,145.630	
	CIA DE SANEAMENTO BASICO DO ESTADO DE SAO PAULO	19,798	50.160	993,067.680	
	MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS IMOBILIARIOS SA	23,340	28.390	662,622.600	
	HYPERA SA	29,600	34.110	1,009,656.000	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BAICAO	135,216	45.160	6,106,354.560	
	MAGAZINE LUIZA SA	40,900	42.170	1,724,753.000	
	CIELO SA	84,907	7.780	660,576.460	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	45,700	34.260	1,565,682.000	
	NOTRE DAME INTERMEDICA PARTICIPACOES SA	23,600	59.550	1,405,380.000	
	ATACADAO DISTRIBUICAO COMERCIO E INDUSTRIA LTDA	27,000	19.320	521,640.000	
	AMBEV SA	305,895	18.720	5,726,354.400	
	RUMO SA	69,000	24.250	1,673,250.000	
	IRB BRASIL RESSEGUROS S/A	42,600	36.860	1,570,236.000	
ブラジル・レアル　小計		3,694,730		108,162,594.670 (2,840,349,736)	
ポーランド・ズロチ	BANK MILLENNIUM SA	49,782	5.735	285,499.770	
	MBANK	1,047	364.200	381,317.400	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	7,166	78.580	563,104.280	
	BANK PEKAO SA	11,985	103.500	1,240,447.500	
	ORANGE POLSKA SA	58,600	5.740	336,364.000	
	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	19,130	101.100	1,934,043.000	

	LPP SA	110	8,100.000	891,000.000	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	2,258	300.000	677,400.000	
	CD PROJEKT RED SA	4,504	243.000	1,094,472.000	
	POWSZECHNA KASA OSZCZEDNOSCI BANK POLSKI SA	60,904	36.700	2,235,176.800	
	CCC SA	2,025	129.100	261,427.500	
	GRUPA LOTOS SA	6,865	92.200	632,953.000	
	POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I GAZOWNICTWO SA	75,839	4.656	353,106.380	
	CYFROWY POLSAT SA	23,495	27.820	653,630.900	
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	70,529	8.018	565,501.520	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZEN SA	36,949	37.110	1,371,177.390	
	JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA SA	4,000	21.500	86,000.000	
	ALIOR BANK SA	2,278	36.420	82,964.760	
	DINO POLSKA SA	3,444	146.000	502,824.000	
ポーランド・ズロチ　小計		440,910		14,148,410.200 (393,608,772)	
マレーシア・リンギット	AMMB HOLDINGS BHD	134,500	3.840	516,480.000	
	GENTING PLANTATIONS BHD	13,100	9.840	128,904.000	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	332,800	4.920	1,637,376.000	
	DIGI.COM BHD	161,500	4.720	762,280.000	
	MALAYSIA AIRPORTS HOLDINGS BHD	48,320	8.740	422,316.800	
	RHB BANK BHD	67,480	5.690	383,961.200	
	HAP SENG CONSOLIDATED BHD	41,300	9.850	406,805.000	
	TOP GLOVE CORP BHD	148,100	4.270	632,387.000	
	GAMUDA BHD	124,000	3.770	467,480.000	
	GENTING BHD	125,600	5.650	709,640.000	
	YTL CORP BHD	283,710	0.960	272,361.600	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP BHD	20,256	16.320	330,577.920	
	HONG LEONG BANK BHD	50,408	16.500	831,732.000	
	IJM CORP BHD	153,360	2.270	348,127.200	
	IOI CORP BHD	106,413	4.200	446,934.600	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	35,400	21.420	758,268.000	
	FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	3,400	34.460	117,164.000	
	MALAYAN BANKING BHD	268,675	8.530	2,291,797.750	
	ALLIANCE BANK MALAYSIA BHD	88,400	2.820	249,288.000	
	MISC BHD	90,280	8.400	758,352.000	
	NESTLE MALAYSIA BHD	4,700	144.300	678,210.000	

	PPB GROUP BHD	47,560	17.940	853,226.400	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	19,600	23.300	456,680.000	
	PETRONAS GAS BHD	34,600	16.680	577,128.000	
	GENTING MALAYSIA BHD	203,700	3.050	621,285.000	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD	7,700	17.600	135,520.000	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	110,300	3.720	410,316.000	
	SP SETIA BHD	130,000	1.330	172,900.000	
	TENAGA NASIONAL BHD	219,350	13.800	3,027,030.000	
	QL RESOURCES BHD	53,800	7.200	387,360.000	
	DIALOG GROUP BHD	231,044	3.410	787,860.040	
	PUBLIC BANK BHD(LOCAL)	197,630	19.160	3,786,590.800	
	AIRASIA GROUP BHD	199,300	1.750	348,775.000	
	SIME DARBY BERHAD	259,100	2.280	590,748.000	
	HARTALEGA HOLDINGS BHD	117,100	5.240	613,604.000	
	AXIATA GROUP BERHAD	173,500	4.300	746,050.000	
	MAXIS BHD	116,200	5.410	628,642.000	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	156,600	7.280	1,140,048.000	
	IHH HEALTHCARE BHD	182,000	5.770	1,050,140.000	
	WESTPORTS HOLDINGS BHD	64,500	4.190	270,255.000	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDINGS BHD	51,900	4.710	244,449.000	
	SIME DARBY PROPERTY BHD	190,000	0.805	152,950.000	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	114,000	4.800	547,200.000	
マレーシア・リンギット　小計		5,181,186		30,699,200.310 (794,802,296)	
メキシコ・ペソ	ALFA SAB DE CV	264,100	17.640	4,658,724.000	
	EL PUERTO DE LIVERPOOL SAB DE CV	13,600	108.840	1,480,224.000	
	GRUPO BIMBO SAB DE CV	124,900	34.830	4,350,267.000	
	GRUMA SAB DE CV	10,340	198.030	2,047,630.200	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INFRAESTRUCTURA	20,260	179.840	3,643,558.400	
	GRUPO CARSO SAB DE CV	37,600	60.310	2,267,656.000	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE SAB DE CV	167,800	110.650	18,567,070.000	
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	94,025	39.290	3,694,242.250	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	9,655	237.720	2,295,186.600	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO SAB DE CV	99,000	39.630	3,923,370.000	
	ALSEA SAB DE CV	19,900	48.980	974,702.000	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL SURESTE SAB DE CV	12,300	303.200	3,729,360.000	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV	239,052	46.720	11,168,509.440	

	AMERICA MOVIL SAB DE CV	2,314,678	14.790	34,234,087.620	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA SA	176,800	24.990	4,418,232.000	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	31,600	108.540	3,429,864.000	
	WAL-MART DE MEXICO SAB DE CV	345,600	55.870	19,308,672.000	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL PACIFICO SAB DE CV	19,500	197.950	3,860,025.000	
	INFRAESTRUCTURA ENERGETICA NOVA SAB DE CV	24,800	84.900	2,105,520.000	
メキシコ・ペソ　小計		4,025,510		130,156,900.510 (732,783,350)	
ユーロ	ALPHA BANK A.E.	86,619	1.719	148,898.060	
	NATIONAL BANK OF GREECE	35,020	2.734	95,744.680	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	14,304	13.040	186,524.160	
	FF GROUP	3,130	0.000	0.000	
	EUROBANK ERGASIAS	178,915	0.881	157,624.110	
	MOTOR OIL HELLAS CORINTH REFIN	3,854	21.140	81,473.560	
	OPAP SA	19,846	9.500	188,537.000	
	JUMBO SA	6,853	17.100	117,186.300	
	TITAN CEMENT INTERNATIONAL SA	2,700	18.300	49,410.000	
ユーロ　小計		351,241		1,025,397.870 (122,565,807)	
韓国・ウォン	CHEIL WORLDWIDE INC	5,553	24,800.000	137,714,400.000	
	HANMI SCIENCE CO LTD	1,187	39,500.000	46,886,500.000	
	HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	3,124	81,100.000	253,356,400.000	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANC	1,975	222,000.000	438,450,000.000	
	DB INSURANCE CO LTD	4,376	53,200.000	232,803,200.000	
	WOONGJIN COWAY CO LTD	3,865	82,200.000	317,703,000.000	
	KT&G CORP	7,884	102,500.000	808,110,000.000	
	S-1 CORPORATION	1,444	96,600.000	139,490,400.000	
	KOREA GAS CORP	1,737	40,600.000	70,522,200.000	
	CJ CORP	197	82,100.000	16,173,700.000	
	KAKAO CORP	3,350	134,500.000	450,575,000.000	
	CJ ENM CO LTD	563	166,400.000	93,683,200.000	
	DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE	2,634	30,300.000	79,810,200.000	
	SK TELECOM CO LTD	1,341	236,500.000	317,146,500.000	
	DAELIM INDUSTRIAL CO	1,323	97,300.000	128,727,900.000	
	MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD	33,940	7,440.000	252,513,600.000	
	NCSOFT CORPORATION	1,142	518,000.000	591,556,000.000	
	LG UPLUS CORP	9,656	13,900.000	134,218,400.000	

DAEWOO ENGINEERING & CONSTRUCT	13,540	4,645.000	62,893,300.000	
POSCO INTERNATIONAL CORP	3,600	18,300.000	65,880,000.000	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD	586	1,262,000.000	739,532,000.000	
LG CHEM LTD	2,952	304,000.000	897,408,000.000	
LG CHEM LTD	726	167,000.000	121,242,000.000	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD	201	736,000.000	147,936,000.000	
SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD	29,147	42,500.000	1,238,747,500.000	
S-OIL CORP	2,872	102,500.000	294,380,000.000	
HANWHA CHEMICAL CORPORATION	8,289	18,250.000	151,274,250.000	
MERITZ SECURITIES CO LTD	11,739	4,885.000	57,345,015.000	
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	4,354	35,000.000	152,390,000.000	
POSCO CHEMICAL CO LTD	2,126	42,750.000	90,886,500.000	
LOTTE CHEMICAL CORPORATION	1,085	246,500.000	267,452,500.000	
HOTEL SHILLA CO LTD	2,355	79,100.000	186,280,500.000	
KOREA SHIPBUILDING & OFFSHORE ENGINEERING CO LTD	2,508	129,500.000	324,786,000.000	
HYUNDAI MOBIS	4,618	240,500.000	1,110,629,000.000	
SK HYNIX INC	35,926	80,500.000	2,892,043,000.000	
HYUNDAI ENGINEERING & CONSTRUCTION CO LTD	4,701	45,500.000	213,895,500.000	
HYUNDAI MOTOR CO	744	72,900.000	54,237,600.000	
HYUNDAI MOTOR CO	9,785	122,000.000	1,193,770,000.000	
HYUNDAI STEEL CO	6,974	37,000.000	258,038,000.000	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	14,942	12,750.000	190,510,500.000	
KCC CORP	109	218,500.000	23,816,500.000	
KIA MOTORS CORP	17,752	40,800.000	724,281,600.000	
KOREA ZINC CO LTD	519	447,000.000	231,993,000.000	
KOREA ELECTRIC POWER CORP	19,519	25,550.000	498,710,450.000	
HANWHA CORP	137	25,100.000	3,438,700.000	
KOREAN AIR CO LTD	2,656	24,500.000	65,072,000.000	
OCI COMPANY LTD	1,315	69,900.000	91,918,500.000	
CJ LOGISTICS	985	145,500.000	143,317,500.000	
KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	1,509	71,200.000	107,440,800.000	
HLB INC	2,106	122,300.000	257,563,800.000	
LG ELECTRONICS INC	7,254	68,900.000	499,800,600.000	
LOTTE CORP	2,810	37,450.000	105,234,500.000	
LG CORP	6,170	69,200.000	426,964,000.000	

NH INVESTMENT & SECURITIES CO LTD	4,435	12,600.000	55,881,000.000	
GS ENGINEERING & CONSTRUCTION	4,436	31,600.000	140,177,600.000	
NAVER CORP	9,164	156,000.000	1,429,584,000.000	
HYUNDAI DEPARTMENT STORE CO LTD	121	76,000.000	9,196,000.000	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO LTD	2,236	73,100.000	163,451,600.000	
OTTOGI CORP	100	569,000.000	56,900,000.000	
AMOREPACIFIC GROUP	2,018	67,900.000	137,022,200.000	
KANGWON LAND INC	8,336	30,200.000	251,747,200.000	
POSCO	5,251	229,000.000	1,202,479,000.000	
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	11,773	17,100.000	201,318,300.000	
SAMSUNG SDI CO LTD	3,821	226,500.000	865,456,500.000	
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO LTD	3,670	110,000.000	403,700,000.000	
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	322,130	50,000.000	16,106,500,000.000	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES CO LTD	27,888	8,140.000	227,008,320.000	
SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	55,914	40,600.000	2,270,108,400.000	
SHINSEGAE CO LTD	725	247,000.000	179,075,000.000	
YUHAN CORP	750	223,000.000	167,250,000.000	
HANON SYSTEMS	13,526	11,600.000	156,901,600.000	
HYUNDAI MARINE & FIRE INSURANCE CO LTD	5,667	26,650.000	151,025,550.000	
GS HOLDINGS CORP	2,933	50,700.000	148,703,100.000	
LG DISPLAY CO LTD	14,911	14,250.000	212,481,750.000	
CELLTRION INC	6,232	182,500.000	1,137,340,000.000	
HELIXMITH CO LTD	1,305	101,300.000	132,196,500.000	
HANA FINANCIAL GROUP	21,628	35,000.000	756,980,000.000	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	1,420	151,000.000	214,420,000.000	
CELLTRION PHARM INC	683	38,950.000	26,602,850.000	
LOTTE SHOPPING CO	301	125,000.000	37,625,000.000	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LTD	4,580	71,400.000	327,012,000.000	
AMOREPACIFIC CORP	2,030	152,500.000	309,575,000.000	
AMOREPACIFIC CORP-PREF	1,184	75,600.000	89,510,400.000	
SAMSUNG CARD CO	2,877	34,650.000	99,688,050.000	
SK INNOVATION CO LTD	3,938	169,000.000	665,522,000.000	
CJ CHEILJEDANG CORP	705	219,000.000	154,395,000.000	
STX PAN OCEAN CO LTD	18,395	4,715.000	86,732,425.000	
LG INNOTEK CO LTD	999	115,500.000	115,384,500.000	
SK HOLDINGS CO LTD	2,286	230,500.000	526,923,000.000	
KB FINANCIAL GROUP INC	25,851	42,800.000	1,106,422,800.000	
MEDY-TOX INC	320	364,900.000	116,768,000.000	

	KOREA AEROSPACE INDUSTRIES LTD	6,602	38,400.000	253,516,800.000	
	BNK FINANCIAL GROUP INC	9,460	7,080.000	66,976,800.000	
	HANMI PHARM CO LTD	250	291,000.000	72,750,000.000	
	HANWHA LIFE INSURANCE CO LTD	11,369	2,340.000	26,603,460.000	
	FILA KOREA LTD	2,826	58,700.000	165,886,200.000	
	E-MART CO LTD	1,295	113,500.000	146,982,500.000	
	GS RETAIL CO LTD	2,482	41,000.000	101,762,000.000	
	HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO LTD	4,090	31,250.000	127,812,500.000	
	HDC HYUNDAI DEVELOPMENT CO-ENGINEERING & CONSTRUCTION	1,233	31,650.000	39,024,450.000	
	HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOLDIMGS CO LTD	644	355,500.000	228,942,000.000	
	BGF RETAIL CO LTD	631	195,500.000	123,360,500.000	
	ORION CORP REPUBLIC OF KOREA	1,298	102,000.000	132,396,000.000	
	ORANGE LIFE INSURANCE LTD	2,763	27,150.000	75,015,450.000	
	NETMARBLE CORP	2,378	92,100.000	219,013,800.000	
	WOORI FINANCIAL GROUP INC	28,543	11,800.000	336,807,400.000	
	CJ CORP-PREFERENCE	176	60,800.000	10,700,800.000	
	SAMSUNG SDS CO LTD	2,403	197,000.000	473,391,000.000	
	SAMSUNG C&T CORP	6,199	91,700.000	568,448,300.000	
	SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	1,066	329,500.000	351,247,000.000	
	PEARL ABYSS CORP	534	199,600.000	106,586,400.000	
	DOOSAN BOBCAT INC	3,636	32,450.000	117,988,200.000	
	SILLAJEN INC	5,857	13,700.000	80,240,900.000	
	CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	3,789	54,400.000	206,121,600.000	
韓国・ウォン　小計		1,005,965		52,871,188,420.000 (4,843,000,859)	
香港・ドル	JIANGXI COPPER CO LTD	124,000	8.900	1,103,600.000	
	JIANGSU EXPRESS	124,000	10.320	1,279,680.000	
	CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD	66,000	4.870	321,420.000	
	ANGANG STEEL CO LTD-H	1,200	2.790	3,348.000	
	CHINA MOBILE LIMITED	408,500	66.400	27,124,400.000	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	74,000	47.850	3,540,900.000	
	DATANG INTERNATIONAL POWER GEN	430,000	1.600	688,000.000	
	BEIJING ENTERPRISES	43,000	36.450	1,567,350.000	
	HUANENG POWER INTERNATIONAL IN	328,000	3.710	1,216,880.000	

ALIBABA HEALTH INFORMATION TECHNOLOGY	218,000	7.110	1,549,980.000	
YANZHOU COAL MINING CO LTD	112,000	8.110	908,320.000	
HENGAN INTERNATIONAL GROUP	49,500	50.000	2,475,000.000	
HUADIAN POWER INTL CORP-H	144,000	3.040	437,760.000	
CHINA EASTERN AIRLINES CORP LT	124,000	3.870	479,880.000	
CNOOC LTD	1,171,000	11.960	14,005,160.000	
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	212,000	8.620	1,827,440.000	
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LTD	328,000	16.700	5,477,600.000	
CHINA OVERSEAS LAND & INVESTME	241,120	26.000	6,269,120.000	
CHINA RESOURCES LAND LTD	178,888	35.250	6,305,802.000	
CITIC LTD	416,000	10.140	4,218,240.000	
BEIJING CAPITAL INTERNATIONAL	130,000	8.110	1,054,300.000	
LENOVO GROUP LTD	554,000	5.450	3,019,300.000	
PETRO CHINA CO LTD	1,416,000	4.130	5,848,080.000	
CHINA UNICOM HONG KONG LTD	428,742	8.640	3,704,330.880	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS CO LTD	111,190	17.940	1,994,748.600	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL COR	1,671,200	4.700	7,854,640.000	
TONG REN TANG TECHNOLOGIES CO	86,000	7.350	632,100.000	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	72,000	17.080	1,229,760.000	
KINGDEE INTERNATIONAL SOFTWARE GROUP CO LTD	167,000	8.510	1,421,170.000	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	51,900	87.000	4,515,300.000	
KUNLUN ENERGY COMPANY LTD	232,000	6.590	1,528,880.000	
TOWNGAS CHINA CO LTD	80,000	5.930	474,400.000	
COSCO SHIPPING PORTS LTD	152,000	6.400	972,800.000	
YUEXIU PROPERTY CO LTD	634,000	1.770	1,122,180.000	
CHINA MERCHANTS PORT HOLDINGS CO LTD	76,000	12.300	934,800.000	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	374,000	2.530	946,220.000	
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	15.320	857,920.000	
CHINA EVERBRIGHT LTD	38,000	10.720	407,360.000	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	121,200	31.850	3,860,220.000	
KINGBOARD HOLDINGS LTD	33,500	20.900	700,150.000	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LTD	352,000	13.660	4,808,320.000	
SHENZHEN INVESTMENT LTD	138,000	3.050	420,900.000	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LTD	56,000	42.350	2,371,600.000	
BYD CO LTD	48,000	39.000	1,872,000.000	
CHINA TELECOM CORP LTD	840,000	3.640	3,057,600.000	
CHINA OILFIELD SERVICES LTD	134,000	9.960	1,334,640.000	
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	860,000	1.290	1,109,400.000	
SINOTRANS LTD	160,000	2.500	400,000.000	
MAANSHAN IRON & STEEL	140,000	2.950	413,000.000	
CHINA EVERBRIGHT INTERNATIONAL	241,592	6.090	1,471,295.280	
MMG LTD	180,000	1.680	302,400.000	
LEE & MAN PAPER MANUFACTURING LTD	84,000	4.430	372,120.000	
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	429,788	9.450	4,061,496.600	
AVICHINA INDUSTRY & TECHNOLOGY	189,000	3.860	729,540.000	
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS	159,200	9.500	1,512,400.000	
GREAT WALL MOTOR COMPANY LTD	246,000	5.280	1,298,880.000	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	520,000	18.680	9,713,600.000	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD	401,000	2.720	1,090,720.000	
CHINA ORIENTAL GROUP CO LTD	70,000	2.850	199,500.000	
SHANDONG WEIGAO GROUP MEDICAL-H	176,000	8.460	1,488,960.000	
SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	193,700	9.870	1,911,819.000	
WEICHAI POWER CO LTD	125,440	12.440	1,560,473.600	
CHINA SHIPPING DEVELOPMENT CO	100,000	4.070	407,000.000	
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEMICAL	287,000	2.270	651,490.000	
SHANGHAI INDUSTRIAL	58,000	14.920	865,360.000	

TINGYI HOLDING CORP	122,000	10.560	1,288,320.000	
TSINGTAO BREWERY CO LTD	22,000	46.450	1,021,900.000	
GUANGDONG INVESTMENTS LTD	186,000	16.320	3,035,520.000	
CHINA TRADITIONAL CHINESE MEDICINE HOLDINGS CO LTD	208,000	3.780	786,240.000	
CHINA RESOURCES BEER HOLDINGS	103,333	41.500	4,288,319.500	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO LTD	48,000	6.770	324,960.000	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	431,500	11.160	4,815,540.000	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	191,000	31.300	5,978,300.000	
TENCENT HOLDINGS LTD	384,200	328.200	126,094,440.000	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	371,000	94.600	35,096,600.000	
LI NING CO LTD	119,000	25.850	3,076,150.000	
BEIJING ENTERPRISES WATER GROUP LTD	338,000	4.150	1,402,700.000	
GOME RETAIL HOLDINGS LTD	970,240	0.710	688,870.400	
CHINA POWER INTERNATIONAL	210,000	1.690	354,900.000	
AIR CHINA / HONG KONG	86,000	7.140	614,040.000	
ZTE CORP	47,288	21.350	1,009,598.800	
SHANGHAI ELECTRIC GROUP CO LTD	70,000	2.510	175,700.000	
CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD	239,000	15.920	3,804,880.000	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO LTD	98,500	3.000	295,500.000	
BANK OF COMMUNICATIONS	506,205	5.250	2,657,576.250	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT HOLDINGS LTD	150,250	7.160	1,075,790.000	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	44,500	45.600	2,029,200.000	
CHINA CONSTRUCTION BANK	6,504,530	6.220	40,458,176.600	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP HOLDINGS LTD	54,200	106.100	5,750,620.000	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	142,000	7.600	1,079,200.000	
AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	80,000	10.160	812,800.000	
SSY GROUP LTD	104,000	6.380	663,520.000	
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS LTD	80,000	6.850	548,000.000	
CHINA NATIONAL BLDG MATERIAL	206,000	7.080	1,458,480.000	
BANK OF CHINA LTD	5,329,200	3.160	16,840,272.000	

SHUI ON LAND LTD	300,000	1.580	474,000.000	
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	77,000	25.100	1,932,700.000	
GUANGZHOU R&F PROPERTIES CO LTD	60,000	12.420	745,200.000	
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	253,470	38.550	9,771,268.500	
IND & COMM BK OF CHINA - H	4,336,235	5.430	23,545,756.050	
ZHAOJIN MINING INDUSTRY CO LTD	24,000	8.830	211,920.000	
KINGBOARD LAMINATES HOLDING	104,000	7.340	763,360.000	
CHINA COMMUNICATIONS SERVICES	179,600	4.640	833,344.000	
CHINA COMMUNICATIONS CONSTRUCTION CO LTD	290,000	6.160	1,786,400.000	
CHINA COAL ENERGY CO	160,000	3.220	515,200.000	
HAITIAN INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	54,000	16.760	905,040.000	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC CO LTD	48,500	31.650	1,535,025.000	
HAIER ELECTRONICS GROUP CO LTD	83,000	21.050	1,747,150.000	
CHINA AGRI-INDUSTRIES HOLDINGS LTD	191,000	2.670	509,970.000	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD	539,142	10.520	5,671,773.840	
CHINA MOLYBDENUM CO LTD	216,000	2.640	570,240.000	
CHINA CITIC BANK-H	588,800	4.350	2,561,280.000	
KWG GROUP HOLDINGS LTD	61,000	7.420	452,620.000	
SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	50,200	115.000	5,773,000.000	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	77,000	70.050	5,393,850.000	
FOSUN INTERNATIONAL	173,028	10.080	1,744,122.240	
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP LTD	318,000	5.020	1,596,360.000	
CHINA AOYUAN GROUP LTD	34,000	9.890	336,260.000	
SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD	133,500	2.760	368,460.000	
BOSIDENG INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	150,000	3.670	550,500.000	
SOHO CHINA LTD	170,000	2.320	394,400.000	
KINGSOFT CORP LTD	58,000	18.940	1,098,520.000	
SINOTRUK HONG KONG LTD	70,000	12.200	854,000.000	
CHINA RAILWAY GROUP LTD	288,000	4.800	1,382,400.000	
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS LTD	53,000	8.360	443,080.000	

BYD ELECTRONIC INTERNATIONAL CO LTD	52,500	11.560	606,900.000	
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION CORP	165,000	8.770	1,447,050.000	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	321,000	6.340	2,035,140.000	
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	168,600	29.550	4,982,130.000	
CHINA EVERGRANDE GROUP	104,000	18.440	1,917,760.000	
CRRC CORP LTD - H	342,450	5.420	1,856,079.000	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDINGS LTD	67,000	10.180	682,060.000	
SUN ART RETAIL GROUP LTD	211,500	8.400	1,776,600.000	
BBMG CORP	222,000	2.350	521,700.000	
CHINA ZHONGWANG HOLDINGS LTD	130,000	3.270	425,100.000	
SINOPHARM GROUP CO	96,800	25.850	2,502,280.000	
CHINA RESOURCES CEMENT	190,000	8.310	1,578,900.000	
METALLURGICAL CORP OF CHINA LTD	189,000	1.740	328,860.000	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD	190,527	8.200	1,562,321.400	
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	84,500	4.900	414,050.000	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL BANK	181,000	4.290	776,490.000	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP CORP	272,000	4.070	1,107,040.000	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD	48,200	14.460	696,972.000	
HUANENG RENEWABLES CORP LTD	330,000	2.950	973,500.000	
SIHUAN PHARMACEUTICAL HOLDINGS GROUP LTD	260,000	1.110	288,600.000	
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	172,000	34.800	5,985,600.000	
YUZHOU PROPERTIES CO LTD	130,000	3.260	423,800.000	
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	128,500	32.100	4,124,850.000	
NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	50,800	31.750	1,612,900.000	
CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	555,656	5.480	3,044,994.880	
KAISA GROUP HOLDINGS LTD	203,000	3.640	738,920.000	

XINJIANG GOLDWIND SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	55,200	9.530	526,056.000	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD	322,000	3.660	1,178,520.000	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA	1,928,000	3.180	6,131,040.000	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS LTD	39,500	25.450	1,005,275.000	
FAR EAST HORIZON LTD	146,000	7.070	1,032,220.000	
CITIC SECURITIES CO LTD	133,000	15.460	2,056,180.000	
FUTURE LAND DEVELOPMENT HOLDINGS LTD	132,000	7.510	991,320.000	
HAITONG SECURITIES CO LTD	177,200	8.540	1,513,288.000	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROUP OF CHINA LTD	509,000	3.220	1,638,980.000	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	31,000	21.750	674,250.000	
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	142,000	5.040	715,680.000	
SINOPEC ENGINEERING GROUP CO LTD	121,500	4.800	583,200.000	
CHINA GALAXY SECURITIES CO LTD	306,000	4.300	1,315,800.000	
HANERGY THIN FILM POWER GROUP	986,000	0.000	0.000	
NEXTEER AUTOMOTIVE GROUP LTD	120,000	6.500	780,000.000	
CHINA HUISHAN DAIRY HOLDINGS CO LTD	323,000	0.000	0.000	
GREENTOWN SERVICE GROUP CO LTD	96,000	7.700	739,200.000	
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO LTD	59,800	12.800	765,440.000	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA CO LTD	474,000	4.770	2,260,980.000	
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING LTD	35,000	48.000	1,680,000.000	
GENSCRIPT BIOTECH CORP	54,000	15.620	843,480.000	
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLDINGS CO LTD	93,000	25.050	2,329,650.000	
CHINA FIRST CAPITAL GROUP LTD	188,000	2.230	419,240.000	
CHINA EDUCATION GROUP HOLDINGS LTD	19,000	12.240	232,560.000	
CHINA TOWER CORP LTD	2,744,000	1.740	4,774,560.000	
XIAOMI CORP	502,400	8.930	4,486,432.000	
WUXI APPTEC CO LTD	11,400	88.400	1,007,760.000	

	MEITUAN DIANPING	66,700	88.000	5,869,600.000	
	HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDING LTD	32,000	36.200	1,158,400.000	
	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	158,000	4.730	747,340.000	
	CHINA CINDA ASSET MANAGEMENT CO LTD	516,000	1.630	841,080.000	
	LOGAN PROPERTY HOLDINGS CO LTD	102,000	11.620	1,185,240.000	
	CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS LTD	95,000	30.850	2,930,750.000	
	CHINA VANKE CO LTD-H	85,261	28.950	2,468,305.950	
	LUYE PHARMA GROUP LTD	143,000	5.980	855,140.000	
	HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	39,000	16.160	630,240.000	
	CGN POWER CO LTD	749,000	2.050	1,535,450.000	
	BAIC MOTOR CORP LTD	175,000	5.010	876,750.000	
	GF SECURITIES CO LTD	112,000	8.640	967,680.000	
	FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD	24,400	22.350	545,340.000	
	HUATAI SECURITIES CO LTD	124,800	12.600	1,572,480.000	
	3SBIO INC	64,500	13.900	896,550.000	
	LEGEND HOLDINGS CORP	13,500	17.320	233,820.000	
	CHINA RESOURCES PHARMACEUTICAL GROUP LTD	93,000	7.470	694,710.000	
	CHINA HUARONG ASSET MANAGEMENT CO LTD	604,000	1.230	742,920.000	
	CHINA LITERATURE LTD	15,600	28.600	446,160.000	
	DALI FOODS GROUP CO LTD	188,000	5.270	990,760.000	
	CHINA RAILWAY SIGNAL & COMMUNICATION CORP LTD	141,000	4.820	679,620.000	
	CHINA REINSURANCE GROUP CORP	525,000	1.270	666,750.000	
	MEITU INC	152,500	1.760	268,400.000	
	BOC AVIATION LTD	8,800	73.350	645,480.000	
	ZHONGAN ONLINE P&C INSURANCE CO LTD	23,000	19.500	448,500.000	
	CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CORP LTD	96,000	15.560	1,493,760.000	
	WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	36,500	81.750	2,983,875.000	
	HENGTEN NETWORKS GROUP LTD	2,096,000	0.120	251,520.000	
香港・ドル　小計		65,284,675		625,997,856.370 (8,651,290,376)	
台湾・ドル	ACER INC	220,532	17.700	3,903,416.400	
	ASUSTEK COMPUTER INC	51,554	200.000	10,310,800.000	

REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	32,616	228.000	7,436,448.000	
ASIA CEMENT CORP	164,928	42.900	7,075,411.200	
WALSIN TECHNOLOGY CORP	29,000	185.000	5,365,000.000	
TAIWAN BUSINESS BANK	300,779	12.600	3,789,815.400	
VANGUARD INTERNATIONAL SEMICONDUCTOR CORP	66,000	62.600	4,131,600.000	
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO LTD	51,000	90.000	4,590,000.000	
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	54,975	91.400	5,024,715.000	
QUANTA COMPUTER INC	160,858	53.900	8,670,246.200	
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	58,070	45.650	2,650,895.500	
EVA AIRWAYS CORP	202,125	13.900	2,809,537.500	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	39,760	257.500	10,238,200.000	
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	416,771	21.850	9,106,446.350	
CHINA AIRLINES	156	9.060	1,413.360	
CHENG SHIN RUBBER INDUSTRY CO	161,169	46.050	7,421,832.450	
CHINA STEEL CORP	721,058	23.150	16,692,492.700	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD/TAIWAN	190,994	24.600	4,698,452.400	
ADVANTECH CO LTD	17,889	279.500	4,999,975.500	
COMPAL ELECTRONICS INC	199,304	17.900	3,567,541.600	
DELTA ELECTRONICS INC	142,663	133.000	18,974,179.000	
NANYA TECHNOLOGY CORP	68,000	71.700	4,875,600.000	
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	250,327	112.000	28,036,624.000	
AU OPTRONICS CORP	742,194	8.190	6,078,568.860	
TAIWAN MOBILE CO LTD	96,800	113.500	10,986,800.000	
EVERGREEN MARINE CORP	198,276	12.900	2,557,760.400	
FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	243,824	28.800	7,022,131.200	
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	27,307	220.000	6,007,540.000	
ECLAT TEXTILE CO LTD	15,322	409.500	6,274,359.000	
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	40,285	185.500	7,472,867.500	
FORMOSA PLASTICS CORP	296,633	93.300	27,675,858.900	
FORMOSA TAFFETA CO LTD	8,000	34.600	276,800.000	
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE CO	232,594	88.000	20,468,272.000	
GIANT MANUFACTURING	24,151	212.000	5,120,012.000	
MEDIATEK INC	102,507	370.500	37,978,843.500	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD	426,936	44.800	19,126,732.800	

HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	589,459	21.200	12,496,530.800	
HOTAI MOTOR CO LTD	22,000	478.000	10,516,000.000	
FAR EASTONE TELECOMMUNICATIONS CO LTD	122,000	72.100	8,796,200.000	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	702,141	18.650	13,094,929.650	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	494,920	40.650	20,118,498.000	
CHINA DEPT FINANCIAL HOLDING	834,403	9.270	7,734,915.810	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO LTD	638,545	26.300	16,793,733.500	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	832,225	74.500	62,000,762.500	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LTD	701,495	29.150	20,448,579.250	
LARGAN PRECISION CO LTD	7,220	4,460.000	32,201,200.000	
TAISHIN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	576,593	13.900	8,014,642.700	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING CO	795,061	9.590	7,624,634.990	
INVENTEC CO LTD	206,005	21.300	4,387,906.500	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	156,845	49.000	7,685,405.000	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	805,443	12.300	9,906,948.900	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,165,048	20.900	24,349,503.200	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO LTD	593,852	22.050	13,094,436.600	
POWERTECH TECHNOLOGY INC	61,560	88.500	5,448,060.000	
NAN YA PLASTICS CORP	347,828	70.000	24,347,960.000	
WISTRON CORP	213,916	26.300	5,625,990.800	
POU CHEN CORP	111,990	39.350	4,406,806.500	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CORP	303,297	71.600	21,716,065.200	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	42,392	289.000	12,251,288.000	
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	92,480	97.500	9,016,800.000	
PHISON ELECTRONICS CORP	12,658	277.000	3,506,266.000	
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	73,393	43.300	3,177,916.900	
RUENTEX INDUSTRIES LTD	829	69.200	57,366.800	
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	37,588	63.900	2,401,873.200	
STANDARD FOODS CORP	34,639	62.000	2,147,618.000	

	SYNNEX TECHNOLOGY INTERNATIONAL CORP	46,899	35.900	1,683,674.100	
	TAIWAN CEMENT CORP	363,684	39.950	14,529,175.800	
	TATUNG CO LTD	120,000	16.950	2,034,000.000	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR	1,663,083	290.000	482,294,070.000	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	713,525	13.500	9,632,587.500	
	WINBOND ELECTRONICS CORP	219,000	17.650	3,865,350.000	
	YAGEO CORP	14,160	314.500	4,453,320.000	
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	163,000	35.050	5,713,150.000	
	INNOLUX CORPORATION	666,345	6.930	4,617,770.850	
	WPG HOLDINGS CO LTD	109,203	37.000	4,040,511.000	
	HIWIN TECHNOLOGIES CORP	19,645	262.500	5,156,812.500	
	TAIMED BIOLOGICS INC	11,000	138.500	1,523,500.000	
	PEGATRON CORP	105,554	55.000	5,805,470.000	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	9,000	414.500	3,730,500.000	
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	22,000	294.000	6,468,000.000	
	CHAILEASE HOLDING CO LTD	69,029	128.000	8,835,712.000	
	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING LTD	25,385	124.000	3,147,740.000	
	TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL HOLDING	677,674	20.550	13,926,200.700	
	SHANGHAI COMMERCIAL & SAVINGS BANK LTD	233,000	51.900	12,092,700.000	
	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	220,903	76.800	16,965,350.400	
	GLOBALWAFERS CO LTD	19,000	357.500	6,792,500.000	
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	10,000	260.500	2,605,000.000	
台湾・ドル　小計		22,132,271		1,324,699,122.370 (4,689,434,893)	
南アフリカ・ランド	BIDVEST GROUP LTD	18,432	198.940	3,666,862.080	
	CLICKS GROUP LTD	19,827	249.190	4,940,690.130	
	TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	37,135	51.650	1,918,022.750	
	DISCOVERY LTD	26,029	122.080	3,177,620.320	
	GOLD FIELDS LTD	54,414	83.760	4,557,716.640	
	REMGRO LTD	36,309	170.280	6,182,696.520	
	THE FOSCHINI GROUP LTD	12,960	163.460	2,118,441.600	
	MOMENTUM METROPOLITAN HOLDINGS LTD	31,809	19.730	627,591.570	
	EXXARO RESOURCES LTD	19,729	116.400	2,296,455.600	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	2,681	1,342.970	3,600,502.570	
	LIBERTY HOLDINGS LTD	3,907	117.980	460,947.860	

	MTN GROUP LTD	116,247	93.890	10,914,430.830	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	28,905	301.010	8,700,694.050	
	TELKOM SA SOC LTD	22,080	68.820	1,519,545.600	
	FIRSTRAND LTD	234,367	66.690	15,629,935.230	
	PSG GROUP LTD	11,126	227.900	2,535,615.400	
	NASPERS LTD	29,527	2,268.200	66,973,141.400	
	NEDBANK GROUP LTD	25,563	237.120	6,061,498.560	
	NETCARE LTD	39,220	18.240	715,372.800	
	PICK'N PAY STORES LTD	11,458	59.890	686,219.620	
	RMB HOLDINGS LTD	48,890	79.650	3,894,088.500	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	4,377	1,076.810	4,713,197.370	
	SAPPI LTD	50,570	37.800	1,911,546.000	
	SASOL LTD	36,985	274.620	10,156,820.700	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	33,217	132.660	4,406,567.220	
	MR PRICE GROUP LTD	13,831	156.980	2,171,190.380	
	STANDARD BANK GROUP LTD	87,634	179.470	15,727,673.980	
	SPAR GROUP LTD/THE	12,986	187.650	2,436,822.900	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	72,051	54.430	3,921,735.930	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LTD	28,788	96.720	2,784,375.360	
	ABSA GROUP LTD	48,353	157.280	7,604,959.840	
	TIGER BRANDS LTD	15,965	207.600	3,314,334.000	
	SANLAM LTD	121,412	77.620	9,423,999.440	
	INVESTEC LTD	21,242	79.170	1,681,729.140	
	KUMBA IRON ORE LTD	5,327	364.500	1,941,691.500	
	LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDINGS LTD	61,447	24.220	1,488,246.340	
	RMI HOLDINGS	55,570	29.960	1,664,877.200	
	VODACOM GROUP PTY LTD	41,031	123.640	5,073,072.840	
	NEPI ROCKCASTLE PLC	28,593	129.280	3,696,503.040	
	OLD MUTUAL LTD	339,931	19.750	6,713,637.250	
	REINET INVESTMENTS SCA	11,346	264.000	2,995,344.000	
	MULTICHOICE GROUP LTD	28,769	118.800	3,417,757.200	
	BID CORP LTD	21,757	336.000	7,310,352.000	
南アフリカ・ランド　小計		1,971,797		255,734,523.260 (1,871,976,710)	
合計		182,588,926		39,256,134,695 (39,256,134,695)	

（２）株式以外の有価証券

令和1年10月15日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
新株予約権証券	タイ・バーツ	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	59,033.000	172,376.360	
		MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	9,465.000	35,020.500	
	タイ・バーツ　小計		68,498.000	207,396.860 (740,406)	
新株予約権証券　合計			68,498	740,406 (740,406)	
投資信託受益証券	ブラジル・レアル	BANCO BTG PACTUAL SA	12,400.000	691,052.000	
		BANCO SANTANDER BRASIL SA	27,800.000	1,298,538.000	
		ENERGISA SA	16,000.000	787,360.000	
		KLABIN SA	62,000.000	956,660.000	
		SUL AMERICA SA	17,869.000	873,794.100	
	ブラジル・レアル　小計		136,069.000	4,607,404.100 (120,990,432)	
	メキシコ・ペソ	CEMEX SAB DE CV	923,875.000	7,252,418.750	
		COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	39,700.000	4,723,903.000	
		FOMENTO ECONOMICO MEXICANO SAB DE CV	132,100.000	23,170,340.000	
		GRUPO TELEVISA SAB	147,200.000	6,294,272.000	
		MEGACABLE HOLDINGS SAB DE CV	27,400.000	2,292,832.000	
	メキシコ・ペソ　小計		1,270,275.000	43,733,765.750 (246,221,101)	
投資信託受益証券　合計			1,406,344	367,211,533 (367,211,533)	
投資証券	メキシコ・ペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	207,200.000	6,419,056.000	
	メキシコ・ペソ　小計		207,200.000	6,419,056.000 (36,139,285)	
	南アフリカ・ランド	FORTRESS REIT LTD	117,482.000	2,414,255.100	
		GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	184,218.000	4,194,643.860	
		REDEFINE PROPERTIES LTD	279,940.000	2,189,130.800	
	南アフリカ・ランド　小計		581,640.000	8,798,029.760 (64,401,579)	
投資証券　合計			788,840	100,540,864 (100,540,864)	
合計				468,492,803 (468,492,803)	

（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	11.05	－	－	－	12.47
アラブ首長国連邦・ディルハム	株式 8銘柄	0.57	－	－	－	0.65
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	7.65	－	－	－	8.63
インドネシア・ルピア	株式 27銘柄	1.78	－	－	－	2.01
オフショア・人民元	株式 84銘柄	2.29	－	－	－	2.59
カタール・リアル	株式 11銘柄	0.87	－	－	－	0.98
コロンビア・ペソ	株式 9銘柄	0.36	－	－	－	0.40
サウジアラビア・リアル	株式 31銘柄	2.13	－	－	－	2.40
タイ・バーツ	株式 37銘柄	2.50	－	－	－	2.83
	新株予約権証券 2銘柄	－	0.00	－	－	
チェコ・コルナ	株式 3銘柄	0.12	－	－	－	0.13
チリ・ペソ	株式 17銘柄	0.87	－	－	－	0.98
トルコ・リラ	株式 16銘柄	0.43	－	－	－	0.48
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	0.98	－	－	－	1.10
ブラジル・レアル	株式 50銘柄	6.34	－	－	－	7.45
	投資信託受益証券 5銘柄	－	－	0.27	－	
ポーランド・ズロチ	株式 19銘柄	0.88	－	－	－	0.99
マレーシア・リンギット	株式 43銘柄	1.77	－	－	－	2.00
メキシコ・ペソ	株式 19銘柄	1.63	－	－	－	2.56
	投資信託受益証券 5銘柄	－	－	0.55	－	
	投資証券 1銘柄	－	－	－	0.08	
ユーロ	株式 9銘柄	0.27	－	－	－	0.31
韓国・ウォン	株式 114銘柄	10.80	－	－	－	12.19
香港・ドル	株式 208銘柄	19.30	－	－	－	21.78
台湾・ドル	株式 87銘柄	10.46	－	－	－	11.80
南アフリカ・ランド	株式 43銘柄	4.18	－	－	－	4.87
	投資証券 3銘柄	－	－	－	0.14	

（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。

Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	令和1年10月15日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	9,023,839,336
投資証券	34,877,048,440
派生商品評価勘定	28,172,592
未収配当金	280,212,826
差入委託証拠金	11,583,000
流動資産合計	44,220,856,194
資産合計	44,220,856,194
負債の部	
流動負債	
前受金	29,263,500
未払金	99,006,930
未払解約金	8,313,058,000
流動負債合計	8,441,328,430
負債合計	8,441,328,430
純資産の部	
元本等	
元本	14,615,034,288
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	21,164,493,476
元本等合計	35,779,527,764
純資産合計	35,779,527,764
負債純資産合計	44,220,856,194

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30年10月13日 至　令和1年10月15日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
２．　デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。
３．　収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	令和1年10月15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	18,823,627,962円
	同期中追加設定元本額	24,076,335,464円
	同期中一部解約元本額	28,284,929,138円
	元本の内訳	
	ファンド名	
	ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	314,422円
	ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	835,854円
	ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	1,327,875円
	グローバル８資産ラップファンド（安定型）	3,319,378円
	グローバル８資産ラップファンド（中立型）	2,722,940円
	グローバル８資産ラップファンド（積極型）	1,674,781円
	たわらノーロード　国内リート	3,819,644,681円
	たわらノーロード　国内リート＜ラップ向け＞	605,292,896円
	たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	247,669,657円
	たわらノーロード　バランス（堅実型）	3,670,964円
	たわらノーロード　バランス（標準型）	70,435,878円
	たわらノーロード　バランス（積極型）	79,380,123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）	116,050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）	47,350,356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）	103,188,303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）	61,167,977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）	110,993,232円
	たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	1,397,662円
	たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	2,706,300円
	たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	1,410,903円
	たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	3,220,762円
	マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	12,006,018円
	マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	330,488,599円
	マネックス資産設計ファンド　エボリューション	3,869,053円
	ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	106,650,889円
	ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	99,542,953円
	ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	188,644,726円
	投資のソムリエ	1,493,561,835円
	投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	156,697,050円
	ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	81,681,089円
	投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	64,884,664円
	リスク抑制世界８資産バランスファンド	746,647,872円
	投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	1,712,157円
	投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	1,388,738円
	リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	470,336円
	投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	2,887,352円
	リスクコントロール世界資産分散ファンド	610,242,383円
	９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	60,782,474円
	投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	245,666円
	投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	223,923円
	投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	223,800円
	Ｊリートインデックスファンド（ＤＣ）	21,094,661円
	ＤＩＡＭ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックス私募ファンド２０１２１２（適格機関投資家限定）	87,465,300円
	ＤＩＡＭ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックス私募ファンド２０１４０１（適格機関投資家限定）	790,298,069円
	ＤＩＡＭ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド（適格機関投資家向け）	3,446,797,381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）	425,469,752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）	713,216,554円
	計	14,615,034,288円
２．	受益権の総数	14,615,034,288口

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

項目	自　平成30年10月13日 至　令和1年10月15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、不動産投信指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、不動産投資信託証券の価格の変動によるリスクを有しております。
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15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15日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
投資証券	3,766,030,936
合計	3,766,030,936

（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（令和1年6月7日から令和1年10月15日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

不動産投信関連

種類	令和1年10月15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 不動産投信指数先物取引 買建	748,201,500	－	776,412,000	28,210,500
合計	748,201,500	－	776,412,000	28,210,500

（注）時価の算定方法

不動産投信指数先物取引

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15日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	2.4481円 (24,481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15日現在

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
投資証券	ＣＲＥロジスティクスファンド投資法人	434	60,846,800	
	ＧＬＰ投資法人	7,701	1,177,482,900	
	ＭＣＵＢＳ　ＭｉｄＣｉｔｙ投資法人	3,668	460,334,000	
	Ｏｎｅリート投資法人	482	153,999,000	
	いちごオフィスリート投資法人	2,394	276,267,600	
	いちごホテルリート投資法人	512	67,020,800	
	さくら総合リート投資法人	669	66,164,100	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	1,549	882,930,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人	2,933	1,061,746,000	
	イオンリート投資法人	3,337	499,882,600	
	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	19,864	432,240,640	
	インヴィンシブル投資法人	13,563	916,858,800	

エスコンジャパンリート投資法人	317	40,322,400	
オリックス不動産投資法人	6,161	1,445,370,600	
グローバル・ワン不動産投資法人	2,147	313,247,300	
ケネディクス・オフィス投資法人	956	816,424,000	
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	1,924	428,282,400	
ケネディクス商業リート投資法人	1,133	326,643,900	
コンフォリア・レジデンシャル投資法人	1,287	448,519,500	
サムティ・レジデンシャル投資法人	619	74,960,900	
サンケイリアルエステート投資法人	448	54,297,600	
ザイマックス・リート投資法人	449	60,345,600	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	9,961	831,743,500	
ジャパンエクセレント投資法人	2,769	499,804,500	
ジャパンリアルエステイト投資法人	3,092	2,229,332,000	
スターアジア不動産投資法人	1,026	121,991,400	
スターツプロシード投資法人	481	101,779,600	
タカラレーベン不動産投資法人	878	107,291,600	
トーセイ・リート投資法人	569	79,318,600	
ヒューリックリート投資法人	2,630	541,780,000	
フロンティア不動産投資法人	1,098	528,138,000	
プレミア投資法人	2,793	463,638,000	
ヘルスケア＆メディカル投資法人	659	91,271,500	
マリモ地方創生リート投資法人	266	35,298,200	
ユナイテッド・アーバン投資法人	6,942	1,492,530,000	
ラサールロジポート投資法人	2,875	464,887,500	
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	478	59,367,600	
阪急阪神リート投資法人	1,397	242,938,300	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	761	343,972,000	
三菱地所物流リート投資法人	609	217,717,500	
産業ファンド投資法人	3,804	626,518,800	
森トラスト・ホテルリート投資法人	725	105,270,000	
森トラスト総合リート投資法人	2,210	434,265,000	
森ヒルズリート投資法人	3,557	633,501,700	
星野リゾート・リート投資法人	470	282,470,000	
積水ハウス・リート投資法人	9,041	902,291,800	
大江戸温泉リート投資法人	525	49,612,500	
大和ハウスリート投資法人	4,169	1,300,728,000	

	大和証券オフィス投資法人	714	594,048,000	
	投資法人みらい	3,354	214,656,000	
	東急リアル・エステート投資法人	2,073	427,452,600	
	日本アコモデーションファンド投資法人	1,027	704,522,000	
	日本ビルファンド投資法人	2,994	2,458,074,000	
	日本プライムリアルティ投資法人	1,957	1,003,941,000	
	日本プロロジスリート投資法人	4,442	1,350,368,000	
	日本ヘルスケア投資法人	150	31,305,000	
	日本リート投資法人	1,004	467,864,000	
	日本リテールファンド投資法人	5,844	1,362,236,400	
	日本ロジスティクスファンド投資法人	2,020	552,066,000	
	日本賃貸住宅投資法人	3,478	361,712,000	
	福岡リート投資法人	1,599	298,693,200	
	平和不動産リート投資法人	1,925	280,472,500	
	野村不動産マスターファンド投資法人	9,643	1,917,992,700	
投資証券　合計		178,556	34,877,048,440	
合計			34,877,048,440	

（注）投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

外国リート・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15日現在
資産の部	
流動資産	
預金	751,335,778
コール・ローン	12,576,544,872
投資信託受益証券	4,066,160,791
投資証券	35,334,170,618
未収入金	22,688,163
未収配当金	166,717,716
流動資産合計	52,917,617,938
資産合計	52,917,617,938
負債の部	
流動負債	
未払金	687,040,909
未払解約金	12,516,994,000
流動負債合計	13,204,034,909
負債合計	13,204,034,909
純資産の部	
元本等	
元本	29,040,623,650
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	10,672,959,379
元本等合計	39,713,583,029
純資産合計	39,713,583,029
負債純資産合計	52,917,617,938

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30年10月13日 至　令和1年10月15日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
２．　デリバティブ等の評価基準及び評価方法	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．　収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。
４．　その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、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15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	42,461,597,968円
同期中追加設定元本額	53,808,599,904円
同期中一部解約元本額	67,229,574,222円
元本の内訳	
ファンド名	
ＤＩＡＭ先進国ＲＥＩＴインデックスファンド＜為替ヘッジなし＞（ファンドラップ）	153,817,514円
ＤＩＡＭ先進国ＲＥＩＴインデックスファンド＜為替ヘッジあり＞（ファンドラップ）	101,701,069円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	5,090,202円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	13,387,480円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	21,097,276円
グローバル８資産ラップファンド（安定型）	53,756,848円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	43,891,862円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	26,614,512円
たわらノーロード　先進国リート	4,445,157,928円
たわらノーロード　先進国リート＜ラップ向け＞	417,678,339円
たわらノーロード　先進国リート＜為替ヘッジあり＞	174,929,624円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	450,379,483円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	3,306,771円

	たわらノーロード　バランス（標準型）	63,531,522円
	たわらノーロード　バランス（積極型）	131,365,317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）	31,373,335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）	132,600,785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）	99,760,749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）	209,201,327円
	たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	987,573円
	たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	2,574,493円
	たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	1,906,241円
	たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	5,392,312円
	Ｏｎｅ　ＤＣ　先進国リートインデックスファンド	2,223,848円
	マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	19,044,200円
	マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	524,477,732円
	マネックス資産設計ファンド　エボリューション	52,604,724円
	ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	177,352,318円
	ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	169,079,923円
	ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	329,747,809円
	投資のソムリエ	5,586,588,612円
	投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	586,106,519円
	ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	143,245,142円
	投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	161,867,846円
	リスク抑制世界８資産バランスファンド	1,863,358,181円
	ワールドアセットバランス（基本コース）	920,645,180円
	ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）	3,652,934,929円
	投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	6,298,404円
	投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	4,940,605円
	リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	1,171,984円
	投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	10,294,905円
	リスクコントロール世界資産分散ファンド	1,440,086,159円
	９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	108,258,813円
	投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	878,623円
	投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	801,041円
	投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	792,603円
	ＤＩＡＭパッシブ資産分散ファンド	797,351,587円
	ＤＩＡＭ外国リートインデックスファンド＜ＤＣ年金＞	59,914,124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）	202,026,788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）	341,485,454円
	ＤＩＡＭグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンド（適格機関投資家限定）	1,268,852,570円
	Ｐ－Ｏｎｅマルチアセット戦略ファンド（適格機関投資家限定）	3,461,256,521円
	ＤＩＡＭ海外リートインデックスファンド（適格機関投資家限定）	557,433,944円
	計	29,040,623,650円
２．	受益権の総数	29,040,623,650口

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

項目	自　平成30年10月13日 至　令和1年10月15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15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15日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
投資信託受益証券	△15,372,245
投資証券	1,004,850,512
合計	989,478,267

（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（令和1年6月25日から令和1年10月15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15日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.3675円 (13,675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15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	アメリカ・ドル	ARA US HOSPITALITY TRUST	127,800.000	111,825.000	
		MANULIFE US REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	408,700.000	371,917.000	
	アメリカ・ドル　小計		536,500.000	483,742.000 (52,447,308)	
	オーストラリア・ドル	ABACUS PROPERTY GROUP	92,483.000	363,458.190	
		APN INDUSTRIA REIT	32,694.000	97,755.060	
		ARENA REIT	75,293.000	214,585.050	
		BWP TRUST	126,123.000	523,410.450	
		CENTURIA METROPOLITAN REIT	104,274.000	305,522.820	
		CHARTER HALL EDUCATION TRUST	64,224.000	240,197.760	
		CHARTER HALL GROUP	122,761.000	1,431,393.260	
		CHARTER HALL LONG WALE REIT	80,548.000	467,178.400	
		CHARTER HALL RETAIL REIT	92,347.000	398,015.570	
		CROMWELL PROPERTY GROUP	493,029.000	621,216.540	
		DEXUS	296,179.000	3,494,912.200	
		GDI PROPERTY GROUP	179,630.000	272,139.450	
		GOODMAN GROUP	437,350.000	6,149,141.000	
		GPT GROUP	526,794.000	3,223,979.280	
		GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA	71,888.000	310,556.160	
		HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD	51,054.000	163,372.800	
		INGENIA COMMUNITIES GROUP	58,022.000	235,569.320	
		MIRVAC GROUP	1,082,091.000	3,300,377.550	
		NATIONAL STORAGE REIT	192,674.000	352,593.420	
		RURAL FUNDS GROUP	116,459.000	201,474.070	
		SCENTRE GROUP	1,453,200.000	5,754,672.000	
		SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	231,194.000	624,223.800	
		STOCKLAND	665,882.000	3,009,786.640	
		VICINITY CENTRES	854,835.000	2,214,022.650	
		VIVA ENERGY REIT	118,900.000	350,755.000	
	オーストラリア・ドル　小計		7,619,928.000	34,320,308.440 (2,519,797,043)	

シンガポール・ドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	140,795.000	206,968.650	
	ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	210,500.000	239,970.000	
	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	707,060.000	2,227,239.000	
	ASCOTT RESIDENCE TRUST	310,415.000	425,268.550	
	CACHE LOGISTICS TRUST	242,780.000	179,657.200	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	782,879.000	1,620,559.530	
	CAPITALAND MALL TRUST	777,760.000	2,045,508.800	
	CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST	192,680.000	298,654.000	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	208,800.000	340,344.000	
	ESR REIT	525,930.000	284,002.200	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	302,500.000	211,750.000	
	FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	205,100.000	209,202.000	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	189,700.000	525,469.000	
	FRASERS COMMERCIAL TRUST	172,480.000	279,417.600	
	FRASERS HOSPITALITY TRUST	238,200.000	170,313.000	
	FRASERS LOGISTICS & INDUSTRIAL TRUST	405,550.000	510,993.000	
	KEPPEL DC REIT	320,600.000	647,612.000	
	KEPPEL REIT	509,500.000	636,875.000	
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST	611,400.000	143,679.000	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	516,800.000	1,214,480.000	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	401,320.000	1,031,392.400	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	790,620.000	1,328,241.600	
	MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL TRUST	559,200.000	710,184.000	
	OUE COMMERCIAL REIT	649,755.000	360,614.020	
	PARKWAY LIFE REIT	101,400.000	327,522.000	
	SABANA SHARIAH COMP IND REIT	295,000.000	132,750.000	
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	147,600.000	118,080.000	
	SOILBUILD BUSINESS SPACE REIT	329,900.000	176,496.500	
	SPH REIT	203,300.000	233,795.000	
	STARHILL GLOBAL REIT	345,300.000	257,248.500	
	SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	626,890.000	1,184,822.100	

	シンガポール・ドル　小計		12,021,714.000	18,279,108.650 (1,448,253,778)	
	香港・ドル	FORTUNE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	370,000.000	3,304,100.000	
	香港・ドル　小計		370,000.000	3,304,100.000 (45,662,662)	
投資信託受益証券　合計			20,548,142	4,066,160,791 (4,066,160,791)	
投資証券	アメリカ・ドル	ACADIA REALTY TRUST	22,290.000	640,168.800	
		AGREE REALTY CORP	11,110.000	834,361.000	
		ALEXANDER'S INC.	733.000	258,697.690	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	30,943.000	4,761,199.410	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	12,594.000	592,673.640	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	37,601.000	1,814,624.260	
		AMERICAN FINANCE TRUST INC	27,794.000	385,780.720	
		AMERICAN HOMES 4 RENT	69,745.000	1,818,949.600	
		AMERICOLD REALTY TRUST	52,430.000	1,959,833.400	
		APARTMENT INVT & MGMT CO-A	40,712.000	2,188,270.000	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	55,758.000	894,358.320	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	25,699.000	71,186.230	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	38,070.000	8,302,305.600	
		BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH REIT INC	8,367.000	100,320.330	
		BOSTON PROPERTIES INC	39,214.000	5,002,529.980	
		BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	11,492.000	103,657.840	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	46,545.000	671,178.900	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	81,552.000	1,674,262.560	
		BROOKFIELD PROPERTY REIT INC	19,206.000	367,794.900	
		BRT APARTMENTS CORP	2,813.000	43,629.630	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	26,446.000	2,980,728.660	
		CARETRUST REIT INC	25,198.000	593,916.860	
		CBL & ASSOCIATES	47,062.000	66,828.040	
		CEDAR REALTY TRUST INC	27,397.000	92,053.920	
		CHATHAM LODGING TRUST	14,681.000	256,183.450	
		CITY OFFICE REIT INC	14,045.000	185,394.000	
		CLIPPER REALTY INC	5,169.000	46,159.170	
		COLONY CAPITAL INC	128,715.000	702,783.900	
		COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	30,850.000	623,478.500	

COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	6,246.000	282,069.360	
CORECIVIC INC	31,308.000	490,596.360	
COREPOINT LODGING INC	14,852.000	145,252.560	
CORESITE REALTY CORP	9,797.000	1,156,535.850	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	29,649.000	858,931.530	
COUSINS PROPERTIES INC	40,213.000	1,464,155.330	
CUBESMART	52,663.000	1,825,826.210	
CYRUSONE INC	30,939.000	2,336,203.890	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	52,666.000	518,233.440	
DIGITAL REALTY TRUST INC	56,801.000	7,375,609.850	
DOUGLAS EMMETT INC	45,071.000	1,893,883.420	
DUKE REALTY TRUST	98,691.000	3,291,344.850	
EAST GROUP	9,980.000	1,265,763.400	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	18,649.000	402,072.440	
EMPIRE STATE REALTY TRUST INC	38,850.000	534,576.000	
EPR PROPERTIES	21,235.000	1,641,465.500	
EQUINIX INC	23,112.000	13,116,060.000	
EQUITY COMMONWEALTH	32,341.000	1,003,217.820	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	24,855.000	3,366,609.750	
EQUITY RESIDENTIAL	95,028.000	8,322,552.240	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY TRUST INC	20,059.000	475,799.480	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	17,925.000	5,870,796.000	
EXTRA SPACE STORAGE INC	35,073.000	4,041,812.520	
FARMLAND PARTNERS INC	9,630.000	63,943.200	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	19,048.000	2,590,337.520	
FIRST INDUSTRIAL RT	34,671.000	1,374,358.440	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST INC	18,001.000	509,788.320	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	27,641.000	236,606.960	
FRONT YARD RESIDENTIAL CORP	17,285.000	202,061.650	
GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	55,770.000	2,138,221.800	
GEO GROUP INC	31,871.000	499,737.280	
GETTY REALTY CORP	8,861.000	288,336.940	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	10,604.000	244,210.120	
GLADSTONE LAND CORP	7,339.000	86,893.760	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	9,983.000	115,303.650	
GLOBAL NET LEASE INC	22,153.000	420,242.410	

		HCP INC	133,978.000	4,910,293.700	
		HEALTHCARE REALTY TRUST INC	34,323.000	1,153,939.260	
		HEALTHCARE TRUST OF AMERICA INC	56,169.000	1,646,313.390	
		HERSHA HOSPITALITY TRUST	13,669.000	189,178.960	
		HIGHWOODS PROPERTIES INC	27,552.000	1,189,144.320	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	199,304.000	3,250,648.240	
		HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	42,311.000	1,401,763.430	
		INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	23,530.000	343,302.700	
		INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES TRUST	17,002.000	359,592.300	
		INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES INC	2,922.000	227,360.820	
		INVESTORS REAL ESTATE TRUST	2,992.000	222,395.360	
		INVITATION HOMES INC	130,606.000	3,949,525.440	
		IRON MOUNTAIN INC	78,464.000	2,550,080.000	
		JBG SMITH PROPERTIES	31,355.000	1,217,514.650	
		KILROY REALTY CORP	25,412.000	1,974,512.400	
		KIMCO REALTY	115,379.000	2,396,421.830	
		KITE REALTY GROUP TRUST	21,919.000	361,444.310	
		LEXINGTON REALTY TRUST	65,439.000	685,146.330	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	43,140.000	2,193,669.000	
		LIFE STORAGE INC	12,565.000	1,344,957.600	
		LTC PROPERTIES INC	10,464.000	534,082.560	
		MACK CALI	23,819.000	516,157.730	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST	121,984.000	2,393,326.080	
		MID AMERICA	31,122.000	4,127,399.640	
		MONMOUTH RE INVEST CP - CL A	24,936.000	359,577.120	
		NATIONAL HEALTH INVS INC	11,496.000	949,799.520	
		NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	46,896.000	2,674,478.880	
		NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUST	15,607.000	534,071.540	
		NEW SENIOR INVESTMENT GROUP INC	29,202.000	199,157.640	
		NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	5,569.000	273,048.070	
		OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST	12,583.000	382,900.690	
		OMEGA HEALTHCARE INVS INC	59,182.000	2,546,009.640	
		ONE LIBERTY PROPERTIES INC	5,334.000	144,978.120	

		PARAMOUNT GROUP INC	53,182.000	680,197.780	
		PARK HOTELS & RESORTS INC	65,668.000	1,533,347.800	
		PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	34,621.000	920,918.600	
		PENN REAL ESTATE INVEST TST	21,989.000	113,023.460	
		PHYSICIANS REALTY TRUST	49,085.000	858,005.800	
		PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC	33,223.000	678,413.660	
		PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	3,324.000	61,992.600	
		PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES INC	15,295.000	220,553.900	
		PROLOGIS INC	171,964.000	14,833,614.640	
		PS BUSINESS PARKS	5,310.000	969,606.000	
		PUBLIC STORAGE	40,924.000	10,039,884.920	
		QTS REALTY TRUST INC	14,626.000	769,327.600	
		REALTY INCOME CORP	86,770.000	6,765,456.900	
		REGENCY CENTERS CORP	45,759.000	3,131,745.960	
		RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	30,104.000	554,666.200	
		RETAIL PROPERTIES OF AMERICA INC	56,465.000	722,187.350	
		RETAIL VALUE INC	5,575.000	200,588.500	
		REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	29,170.000	1,329,860.300	
		RLJ LODGING TRUST	45,523.000	752,495.190	
		RPT REALTY	20,837.000	284,425.050	
		RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	13,656.000	1,119,518.880	
		SABRA HEALTH CARE REIT INC	50,320.000	1,148,302.400	
		SAFEHOLD INC	3,465.000	118,780.200	
		SAUL CENTERS INC	4,102.000	222,287.380	
		SENIOR HOUSING PPTYS TRUST	62,661.000	577,734.420	
		SERITAGE GROWTH PROPERTIES	8,760.000	380,534.400	
		SERVICE PROPERTIES TRUST	43,649.000	1,094,716.920	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	83,935.000	12,476,937.750	
		SITE CENTERS CORP	36,601.000	548,648.990	
		SL GREEN	22,555.000	1,814,549.750	
		SPIRIT REALTY CAPITAL INC	23,928.000	1,154,526.000	
		STAG INDUSTRIAL INC	33,729.000	1,018,615.800	
		STORE CAPITAL CORP	57,473.000	2,160,984.800	
		SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	27,350.000	324,918.000	
		SUN COMMUNITIES INC	24,749.000	3,776,449.910	

	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	59,504.000	806,279.200	
	TANGER FACTORY OUTLET	24,422.000	379,517.880	
	TAUBMAN CENTERS INC	16,140.000	590,078.400	
	TERRENO REALTY CORP	17,369.000	917,256.890	
	THE MACERICH COMPANY	29,164.000	805,801.320	
	UDR INC	79,928.000	3,877,307.280	
	UMH PROPERTIES INC	13,782.000	197,082.600	
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	3,301.000	344,063.230	
	URBAN EDGE PROPERTIES	30,347.000	599,049.780	
	URSTADT BIDDLE PROPERTIES	10,510.000	250,032.900	
	VENTAS INC	101,578.000	7,379,641.700	
	VEREIT INC	288,311.000	2,796,616.700	
	VICI PROPERTIES INC	125,927.000	2,895,061.730	
	VORNADO REALTY TRUST	43,270.000	2,690,961.300	
	WASHINGTON PRIME GROUP INC	65,686.000	255,518.540	
	WASHINGTON REIT	21,112.000	594,302.800	
	WEINGARTEN REALTY INVST	32,056.000	927,700.640	
	WELLTOWER INC	110,449.000	10,138,113.710	
	WHITESTONE REIT	14,179.000	193,117.980	
	WP CAREY INC	46,605.000	4,216,820.400	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	29,712.000	613,255.680	
アメリカ・ドル　小計		5,999,015.000	270,510,308.900 (29,328,727,691)	
イギリス・ポンド	AEW UK REIT PLC	43,260.000	41,356.560	
	ASSURA PLC	632,730.000	469,485.660	
	BIG YELLOW GROUP PLC	40,787.000	455,182.920	
	BRITISH LAND CO PLC	257,759.000	1,522,840.170	
	CAPITAL & REGIONAL PLC	135,437.000	26,681.080	
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	157,985.000	134,287.250	
	DERWENT LONDON PLC	28,896.000	997,489.920	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	153,412.000	144,974.340	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	69,309.000	525,362.220	
	HAMMERSON PLC	203,431.000	610,496.430	
	HANSTEEN HOLDINGS PLC	145,379.000	137,237.770	
	INTU PROPERTIES PLC	310,885.000	138,343.820	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	205,468.000	1,832,363.620	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	221,387.000	488,822.490	
	LXI REIT PLC	133,928.000	171,159.980	
	NEWRIVER REIT PLC	78,127.000	161,722.890	

	PICTON PROPERTY INCOME LTD	138,324.000	123,108.360	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC	336,197.000	458,572.700	
	RDI REIT PLC	64,453.000	75,667.820	
	REGIONAL REIT LTD	144,064.000	149,826.560	
	SAFESTORE HOLDINGS LTD	54,896.000	380,154.800	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT TRUST LTD	222,860.000	124,801.600	
	SEGRO PLC	296,241.000	2,396,589.690	
	SHAFTESBURY PLC	58,363.000	534,313.260	
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING REIT PLC	136,136.000	123,883.760	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	451,796.000	687,181.710	
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT LTD	217,277.000	184,250.890	
	UNITE GROUP PLC	79,734.000	911,359.620	
	WORKSPACE GROUP PLC	33,429.000	330,111.370	
イギリス・ポンド　小計		5,051,950.000	14,337,629.260 (1,958,950,286)	
イスラエル・シュケル	REIT 1 LTD	64,513.000	1,451,542.500	
イスラエル・シュケル　小計		64,513.000	1,451,542.500 (44,794,602)	
カナダ・ドル	ALLIED PROPERTIES REIT	15,737.000	844,132.680	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	17,551.000	219,387.500	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	5,805.000	267,262.200	
	CANADIAN APT PPTYS REIT	21,536.000	1,195,032.640	
	CHOICE PROPERTIES REIT	39,788.000	570,957.800	
	COMINAR REAL ESTATE INVT TR	23,017.000	312,340.690	
	CROMBIE REAL ESTATE INV	11,028.000	176,668.560	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	17,503.000	261,319.790	
	DREAM GLOBAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	24,752.000	411,873.280	
	DREAM INDUSTRIAL REIT	19,652.000	263,729.840	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV TRUST	7,040.000	208,102.400	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	6,306.000	414,682.560	
	H & R REAL ESTATE INVESTMENT	38,682.000	889,299.180	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	15,142.000	240,909.220	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	11,445.000	235,423.650	

	MINTO APARTMENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	5,088.000	115,497.600	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT	6,453.000	130,737.780	
	NORTHVIEW APARTMENT REIT	7,498.000	223,290.440	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	22,311.000	265,054.680	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	41,066.000	1,087,427.680	
	SLATE OFFICE REIT	12,079.000	75,372.960	
	SLATE RETAIL REIT	6,406.000	82,701.460	
	SMARTCENTRES REIT	18,400.000	594,872.000	
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	14,652.000	191,648.160	
	TRUE NORTH COMMERCIAL REIT	10,465.000	74,510.800	
カナダ・ドル　小計		419,402.000	9,352,235.550 (766,509,226)	
ニュージーランド・ドル	ARGOSY PROPERTY LTD	259,877.000	379,420.420	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	305,703.000	680,189.170	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	378,055.000	623,790.750	
	PRECINCT PROPERTIES	280,667.000	508,007.270	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	85,582.000	231,927.220	
ニュージーランド・ドル　小計		1,309,884.000	2,423,334.830 (165,586,469)	
ユーロ	AEDIFICA	6,502.000	684,010.400	
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	42,653.000	690,978.600	
	ALTAREA	1,088.000	201,715.200	
	BEFIMMO	5,979.000	345,586.200	
	COFINIMMO SA	6,750.000	880,200.000	
	COVIVIO	11,809.000	1,167,319.650	
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	11,252.000	303,804.000	
	GECINA SA	14,988.000	2,272,180.800	
	GREEN REIT PLC	178,771.000	337,877.190	
	HAMBORNER REIT AG	19,617.000	187,773.920	
	HIBERNIA REIT PLC	179,669.000	247,583.880	
	ICADE	7,417.000	628,590.750	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE	12,992.000	74,054.400	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA	64,547.000	741,645.030	
	INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	7,838.000	210,058.400	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES REIT PLC	103,723.000	180,685.460	
	KLEPIERRE	56,788.000	1,795,068.680	

		LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA	19,023.000	152,374.230	
		MERCIALYS	7,686.000	94,998.960	
		MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	100,370.000	1,329,902.500	
		MONTEA SCA	2,831.000	226,196.900	
		NSI NV	4,270.000	174,856.500	
		RETAIL ESTATES	1,947.000	167,052.600	
		UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	37,542.000	5,015,611.200	
		VASTNED RETAIL	6,007.000	170,899.150	
		WAREHOUSES DE PAUW	4,774.000	800,122.400	
		WERELDHAVE NV	10,363.000	218,452.040	
	ユーロ　小計		927,196.000	19,299,599.040 (2,306,881,073)	
	韓国・ウォン	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	9,768.000	78,046,320.000	
	韓国・ウォン　小計		9,768.000	78,046,320.000 (7,149,043)	
	香港・ドル	CHAMPION REIT	519,070.000	2,605,731.400	
		LINK REIT	574,520.000	47,512,804.000	
		PROSPERITY REIT	416,000.000	1,206,400.000	
		SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	272,000.000	1,379,040.000	
		YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	380,000.000	1,968,400.000	
	香港・ドル　小計		2,161,590.000	54,672,375.400 (755,572,228)	
投資証券　合計			15,943,318	35,334,170,618 (35,334,170,618)	
合計				39,400,331,409 (39,400,331,409)	

（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 投資信託受益証券 時価比率 (%)	組入 投資証券 時価比率 (%)	有価証券の合計金額に 対する比率 (%)
アメリカ・ドル	投資信託受益証券	2銘柄	0.13	－	74.57
	投資証券	154銘柄	－	73.85	
イギリス・ポンド	投資証券	29銘柄	－	4.93	4.97
イスラエル・シュケル	投資証券	1銘柄	－	0.11	0.11
オーストラリア・ドル	投資信託受益証券	25銘柄	6.34	－	6.40
カナダ・ドル	投資証券	25銘柄	－	1.93	1.95
シンガポール・ドル	投資信託受益証券	31銘柄	3.65	－	3.68
ニュージーランド・ドル	投資証券	5銘柄	－	0.42	0.42
ユーロ	投資証券	27銘柄	－	5.81	5.85
韓国・ウォン	投資証券	1銘柄	－	0.02	0.02
香港・ドル	投資信託受益証券	1銘柄	0.11	－	2.03
	投資証券	5銘柄	－	1.90	

（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

該当事項はありません。

２【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

たわらノーロード　スマートグローバルバランス（保守型）

令和1年10月31日現在

Ⅰ　資産総額	26,917,533円
Ⅱ　負債総額	501,697円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	26,415,836円
Ⅳ　発行済数量	25,522,497口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.0350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）

令和1年10月31日現在

Ⅰ　資産総額	1,523,827,795円
Ⅱ　負債総額	2,958,831円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	1,520,868,964円
Ⅳ　発行済数量	1,417,716,391口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.0728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）

令和1年10月31日現在

Ⅰ　資産総額	2,415,149,537円
Ⅱ　負債総額	8,869,778円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	2,406,279,759円
Ⅳ　発行済数量	2,197,898,094口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.0948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）

令和1年10月31日現在

Ⅰ　資産総額	1,224,890,817円
Ⅱ　負債総額	3,155,068円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	1,221,735,749円
Ⅳ　発行済数量	1,097,365,250口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.1133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）

令和1年10月31日現在

Ⅰ　資産総額	1,886,553,843円
Ⅱ　負債総額	6,396,576円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	1,880,157,267円
Ⅳ　発行済数量	1,670,329,348口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.1256円

（参考）

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

令和1年10月31日現在

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

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

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

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

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

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和1年10月31日現在

Ⅰ　資産総額	**437,654,544,738円**
Ⅱ　負債総額	**10,879,540,913円**
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	**426,775,003,825円**
Ⅳ　発行済数量	**301,946,305,504口**
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	**1.4134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

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

Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド

令和1年10月31日現在

Ⅰ　資産総額	**45,824,616,302円**
Ⅱ　負債総額	**497,974,654円**
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	**45,326,641,648円**
Ⅳ　発行済数量	**18,284,433,846口**
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	**2.4790円**

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和1年10月31日現在

Ⅰ　資産総額	**53,711,875,785円**
Ⅱ　負債総額	**34,510,283円**
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	**53,677,365,502円**
Ⅳ　発行済数量	**38,266,709,684口**
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	**1.4027円**

第４【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1)受益証券の名義書換

該当事項はありません。

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

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

(2)受益者等名簿

該当事項はありません。

(3)受益者に対する特典

該当事項はありません。

(4)受益権の譲渡制限

譲渡制限はありません。

①受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等に振替の申請をするものとします。

②上記①の申請のある場合には、上記①の振替機関等は、当該譲渡にかかる譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、上記①の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行われるよう通知するものとします。

③上記①の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めたときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

(5)受益権の譲渡の対抗要件

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

(6)受益権の再分割

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

(7)質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

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

第二部【委託会社等の情報】

第１【委託会社等の概況】

１【委託会社等の概況】

（1）資本金の額（2019年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）

①　会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。

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

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

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

また、取締役会の決議によって、取締役社長を定めることができます。

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

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

②　投資運用の意思決定機構

1.投資環境見通しおよび運用方針の策定

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

2.運用計画、売買計画の決定

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

2【事業の内容及び営業の概況】

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

2019年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		1,643,826		1,461,316
建物	※1	1,156,953	※1	1,096,916
器具備品	※1	476,504	※1	364,399
建設仮勘定		10,368		―
無形固定資産		1,934,700		2,411,540
ソフトウエア		1,026,319		885,545
ソフトウエア仮勘定		904,389		1,522,040
電話加入権		3,931		3,931
電信電話専用施設利用権		60		23
投資その他の資産		8,270,313		9,269,808
投資有価証券		1,721,433		1,611,931
関係会社株式		3,229,196		4,499,196
長期差入保証金		1,518,725		1,312,328
繰延税金資産		1,699,533		1,748,459
その他		101,425		97,892
固定資産計		11,848,840		13,142,665
資産合計		90,745,010		90,339,861

（単位：千円）

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

（２）【損益計算書】

（単位：千円）

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

（単位：千円）

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

（３）【株主資本等変動計算書】

第33期（自　2017年4月1日　至　2018年3月31日）

（単位：千円）

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

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

第34期（自　2018年4月1日　至　2019年3月31日）

（単位：千円）

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

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

重要な会計方針

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

表示方法の変更

第34期（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）
「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」（企業会計基準第28号　平成30年2月16日）を当事業年度から適用し、繰延税金資産は投資その他の資産の区分に表示し、繰延税金負債は固定負債の区分に表示する方法に変更しました。 この結果、前事業年度の貸借対照表において、「流動資産」の「繰延税金資産」842,996千円は、「投資その他の資産」の「繰延税金資産」1,699,533千円に含めて表示しております。

注記事項

（貸借対照表関係）

※1. 有形固定資産の減価償却累計額

（千円）

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

（損益計算書関係）

※1. 関係会社に対する事項

（千円）

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

※2. 固定資産除却損の内訳

（千円）

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

（株主資本等変動計算書関係）

第33期（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

（1）配当金支払額

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

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

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

第34期（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

（1）配当金支払額

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

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

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

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

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

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

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

（2）金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

営業債務である未払手数料は、１年以内の支払期日であります。

（3）金融商品に係るリスク管理体制

①信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

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

②市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

（4）金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

第33期（2018年3月31日現在）

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

第34期（2019年3月31日現在）

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

（注1）金融商品の時価の算定方法

資　産

（1）現金・預金

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

（2）金銭の信託

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

（3）未収委託者報酬及び（4）未収運用受託報酬

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

（5）有価証券及び投資有価証券

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

負　債

（1）未払手数料

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

（注2）時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

（千円）

区分	第33期 （2018年3月31日現在）	第34期 （2019年3月31日現在）
①非上場株式	272,464	276,764
②関係会社株式	3,229,196	4,499,196

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

（注3）金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第33期（2018年3月31日現在）

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

第34期（2019年3月31日現在）

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

（有価証券関係）

1．子会社株式及び関連会社株式

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

2．その他有価証券

第33期（2018年3月31日現在）

（千円）

区分	貸借対照表日における貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
①株式	1,267,157	146,101	1,121,055
②投資信託	177,815	153,000	24,815
小計	1,444,972	299,101	1,145,870
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
①株式	―	―	―
②投資信託	3,995	4,000	△ 4
小計	3,995	4,000	△ 4
合計	1,448,968	303,101	1,145,866

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

第34期（2019年3月31日現在）

（千円）

区分	貸借対照表日における貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
①株式	1,326,372	111,223	1,215,148
②投資信託	158,321	153,000	5,321
小計	1,484,694	264,223	1,220,470
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
①株式	―	―	―
②投資信託	3,990	4,000	△ 9
小計	3,990	4,000	△ 9
合計	1,488,684	268,223	1,220,460

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

3．当該事業年度中に売却したその他有価証券

第33期（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

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

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

第34期（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

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

（退職給付関係）

1. 採用している退職給付制度の概要

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

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

2. 確定給付制度

（1）退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

（千円）

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

（2）年金資産の期首残高と期末残高の調整表

（千円）

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

（3）退職給付債務の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

（千円）

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

（4）退職給付費用及びその内訳項目の金額

（千円）

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

（注）特別損失に計上しております。

（5）数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎

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

3.簡便法を適用した確定給付制度

（1）簡便法を適用した制度の、退職給付引当金の期首残高と期末残高の調整表

（千円）

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

（2）退職給付費用

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

4. 確定拠出制度

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

（税効果会計関係）

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主要な項目別の内訳

法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため、注記を省略しております。

（企業結合等関係）

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

1. 結合当事企業

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

2. 企業結合日

2016年10月1日

3. 企業結合の方法

①MHAMを吸収合併存続会社、新光投信を吸収合併消滅会社とする吸収合併、②TBを吸収分割会社、吸収合併後のMHAMを吸収分割承継会社とし、同社がTB資産運用部門に係る権利義務を承継する吸収分割、③DIAMを吸収合併存続会社、MHAMを吸収合併消滅会社とする吸収合併の順に実施しております。

4. 結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

5. 企業結合の主な目的

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

6. 合併比率

「3. 企業結合の方法」③の吸収合併における合併比率は以下の通りであります。

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

（*）普通株式と種類株式を合算して算定しております。

7. 交付した株式数

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

8. 経済的持分比率（議決権比率）

MHFGが企業結合直前に所有していた当社に対する経済的持分比率　50.00%
MHFGが企業結合日に追加取得した当社に対する経済的持分比率　20.00%
MHFGの追加取得後の当社に対する経済的持分比率　70.00%
なお、MHFGが所有する議決権比率については50.00%から51.00%に異動しております。

9. 取得企業を決定するに至った主な根拠

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

10. 会計処理

「企業結合に関する会計基準」（企業結合会計基準第21号　平成25年9月13日公表分）及び「企業結合会計基準及び事業分離等会計基準に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第10号　平成25年9月13日公表分）に基づき、「3. 企業結合の方法」①の吸収合併及び②の吸収分割については共通支配下の取引として処理し、③の吸収合併については逆取得として処理しております。

11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

（1）被取得企業の取得原価及びその内訳

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

（2）発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

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

（3）企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

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

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

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

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

12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

（1）貸借対照表項目

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

（2）損益計算書項目

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

（資産除去債務関係）

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

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

（セグメント情報等）

1. セグメント情報

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

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

（1）サービスごとの情報

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

（2）地域ごとの情報

①営業収益

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

②有形固定資産

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

（3）主要な顧客ごとの情報

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

（関連当事者情報）

1. 関連当事者との取引

（1）親会社及び法人主要株主等

第33期（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

該当はありません。

第34期（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

該当はありません。

（2）子会社及び関連会社等

第33期（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

該当はありません。

第34期（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

該当はありません。

（3）兄弟会社等

第33期（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関係内容		取引の内容	取引金額（千円）	科目	期末残高（千円）
						役員の兼任等	事業上の関係				
親会社の子会社	株式会社みずほ銀行	東京都千代田区	14,040億円	銀行業	―	―	当社設定投資信託の販売	投資信託の販売代行手数料	6,470,802	未払手数料	894,336
	みずほ証券株式会社	東京都千代田区	1,251億円	証券業	―	―	当社設定投資信託の販売	投資信託の販売代行手数料	9,079,083	未払手数料	1,549,208

第34期（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関係内容		取引の内容	取引金額（千円）	科目	期末残高（千円）
						役員の兼任等	事業上の関係				
親会社の子会社	株式会社みずほ銀行	東京都千代田区	14,040億円	銀行業	―	―	当社設定投資信託の販売	投資信託の販売代行手数料	6,048,352	未払手数料	915,980
								子会社株式の取得	1,270,000	―	―
	みずほ証券株式会社	東京都千代田区	1,251億円	証券業	―	―	当社設定投資信託の販売	投資信託の販売代行手数料	10,215,017	未払手数料	1,670,194

取引条件及び取引条件の決定方針等

（注1）投資信託の販売代行手数料は、一般的取引条件を勘案した個別契約により決定しております。

（注2）子会社株式の取得は、独立した第三者機関により算定された価格を基礎として協議の上、合理的に決定しております。

（注3）上記の取引金額には消費税等が含まれておりません。期末残高には、消費税等が含まれております。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

（1）親会社情報

株式会社みずほフィナンシャルグループ

(東京証券取引所及びニューヨーク証券取引所に上場)

（2）重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません。

（1株当たり情報）

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

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

（注2）1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

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

(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		1,362,999
建物	※1	1,051,855
器具備品	※1	311,144
無形固定資産		3,541,152
ソフトウエア		3,323,996
ソフトウエア仮勘定		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		8,896,987
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	(1) 子会社株式及び関連会社株式 ：移動平均法による原価法 (2) その他有価証券 時価のあるもの：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
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
3. 固定資産の減価償却の方法	(1) 有形固定資産 定率法を採用しております。 ただし、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 (2) 無形固定資産 定額法を採用しております。 なお、自社利用のソフトウエアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。
4. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、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	(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。 (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。 (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。 ①退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当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。 ②数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 過去勤務費用については、その発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を費用処理しております。 数理計算上の差異については、各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年または10年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌事業年度から費用処理しております。 (4) 時効後支払損引当金は、時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。
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

区分	中間貸借対照表計上額 （千円）
①非上場株式	259,369
②関係会社株式	4,499,196

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

②関係会社株式は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載しておりません。

(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			
①株式	691,010	58,146	632,863
②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			
①株式	-	-	-
②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

①MHAMを吸収合併存続会社、新光投信を吸収合併消滅会社とする吸収合併、②TBを吸収分割会社、吸収合併後のMHAMを吸収分割承継会社とし、同社がTB資産運用部門に係る権利義務を承継する吸収分割、③DIAMを吸収合併存続会社、MHAMを吸収合併消滅会社とする吸収合併の順に実施しております。

4.結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

5.企業結合の主な目的

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

6.合併比率

「3. 企業結合の方法」③の吸収合併における合併比率は以下の通りであります。

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

（*）普通株式と種類株式を合算して算定しております。

7.交付した株式数

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

8.経済的持分比率（議決権比率）

MHFGが企業結合直前に所有していた当社に対する経済的持分比率　50.00%
MHFGが企業結合日に追加取得した当社に対する経済的持分比率　20.00%
MHFGの追加取得後の当社に対する経済的持分比率　70.00%
なお、MHFGが所有する議決権比率については50.00%から51.00%に異動しております。

9.取得企業を決定するに至った主な根拠

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

10.会計処理

「企業結合に関する会計基準」（企業結合会計基準第21号　平成25年9月13日公表分）及び「企業結合会計基準及び事業分離等会計基準に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第10号　平成25年9月13日公表分）に基づき、「3. 企業結合の方法」①の吸収合併及び②の吸収分割については共通支配下の取引として処理し、③の吸収合併については逆取得として処理しております。

11.被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

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

(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

①営業収益

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

②有形固定資産

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

（３）主要な顧客ごとの情報

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

（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おりません。

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

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

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

５【その他】

(1) 定款の変更、事業譲渡又は事業譲受、出資の状況その他の重要事項

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月末日現在　247,369百万円

ｃ．事業の内容

日本において銀行業務および信託業務を営んでいます。

(2)販売会社

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

名　　称	資本金の額 (単位:百万円)	事 業 の 内 容
株式会社みずほ銀行	1,404,065	日本において銀行業務を営んでおります。
損保ジャパン日本興亜ＤＣ証券株式会社	3,000	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。

（注）資本金の額は2019年3月末日現在

（注）確定拠出年金向けの取扱販売会社を含みます。

(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1月11日
半期報告書	2019年7月12日
有価証券届出書	2019年1月11日、2019年7月12日

独立監査人の監査報告書

２０１９年5月３０日

アセットマネジメントOne株式会社
取　締　役　会　　御　中

EY新日本有限責任監査法人

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

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

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

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

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

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

以　上

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

（注２）ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

令和１年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
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、「ファンドの経理状況」に掲げられているたわらノーロード　スマートグローバルバランス（保守型）の平成３０年１０月１３日から令和１年１０月１５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、たわらノーロード　スマートグローバルバランス（保守型）の令和１年１０月１５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
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、「ファンドの経理状況」に掲げられているたわらノーロード　スマートグローバルバランス（安定型）の平成３０年１０月１３日から令和１年１０月１５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、たわらノーロード　スマートグローバルバランス（安定型）の令和１年１０月１５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
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、「ファンドの経理状況」に掲げられているたわらノーロード　スマートグローバルバランス（安定成長型）の平成３０年１０月１３日から令和１年１０月１５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、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）の令和１年１０月１５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
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、「ファンドの経理状況」に掲げられているたわらノーロード　スマートグローバルバランス（成長型）の平成３０年１０月１３日から令和１年１０月１５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、たわらノーロード　スマートグローバルバランス（成長型）の令和１年１０月１５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
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、「ファンドの経理状況」に掲げられているたわらノーロード　スマートグローバルバランス（積極型）の平成３０年１０月１３日から令和１年１０月１５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、たわらノーロード　スマートグローバルバランス（積極型）の令和１年１０月１５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）ＸＢＲＬデータは中間監査の対象には含まれておりません。