

**【表紙】**

<b>【提出書類】</b>	有価証券届出書の訂正届出書
<b>【提出先】</b>	関東財務局長殿
<b>【提出日】</b>	2020年1月15日提出
<b>【発行者名】</b>	アセットマネジメントOne株式会社
<b>【代表者の役職氏名】</b>	取締役社長 菅野 暁
<b>【本店の所在の場所】</b>	東京都千代田区丸の内一丁目8番2号
<b>【事務連絡者氏名】</b>	酒井 隆
<b>【電話番号】</b>	03-6774-5100
<b>【届出の対象とした募集（売 出）内国投資信託受益証券 に係るファンドの名称】</b>	たわらノーロード 全世界株式
<b>【届出の対象とした募集（売 出）内国投資信託受益証券 の金額】</b>	当初自己設定：100万円を上限とします。 継続申込期間：1兆円を上限とします。
<b>【縦覧に供する場所】</b>	該当事項はありません。

**1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】**

有価証券報告書の提出に伴い、2019年7月5日付をもって提出した有価証券届出書(以下「原届出書」といいます。)について記載事項の一部に変更が生じるため、また関係情報を訂正するため、本訂正届出書を提出するものです。

**2【訂正の内容】**

\_\_\_\_\_の部分は訂正部分を示します。

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

#### (2)【ファンドの沿革】

<訂正前>

2019年7月22日 信託契約締結、ファンドの設定、ファンドの運用開始(予定)

<訂正後>

2019年7月22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】

<訂正前>

(略)

委託会社の概況

(略)

資本金の額

20億円(2019年4月26日現在)

(略)

委託会社の沿革

(略)

大株主の状況

(2019年4月26日現在)

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

1：A種種類株式(15,510株)を含みます。

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

<訂正後>

(略)

委託会社の概況

(略)

資本金の額

20億円(2019年10月31日現在)

(略)

委託会社の沿革

(略)

## 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 <sup>1</sup>	70.0% <sup>2</sup>
第一生命ホールディングス株式会社	東京都千代田区有楽町一丁目13番1号	12,000株	30.0% <sup>2</sup>

1：A種種類株式（15,510株）を含みます。

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

## 2【投資方針】

## (3)【運用体制】

&lt;訂正前&gt;

a. ファンドの運用体制

(略)

運用体制は2019年4月26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。

&lt;訂正後&gt;

a. ファンドの運用体制

(略)

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。

## 3【投資リスク】

&lt;訂正前&gt;

(略)

&lt;リスク管理体制&gt;

(略)

リスク管理体制は2019年4月26日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

&lt;訂正後&gt;

(略)

&lt;リスク管理体制&gt;

(略)

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」につきましては、以下の内容に更新・訂正いたします。

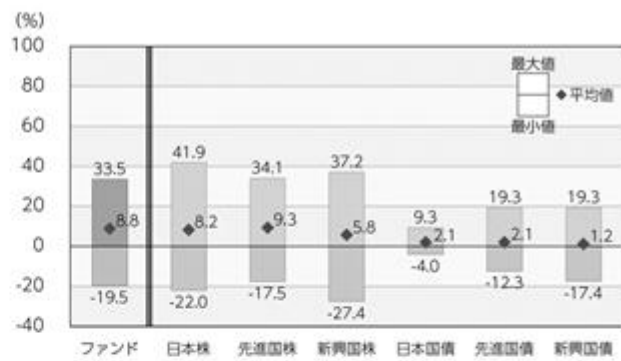
&lt;更新・訂正後&gt;

## &lt;参考情報&gt;

## ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



## ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



2014年11月～2019年10月

- \*ファンドの分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した基準価額が記載されていますので、実際の基準価額とは異なる場合があります。
- \*ファンドの年間騰落率がない期間については、連動する投資成果を目指す対象インデックスの年間騰落率を表示しており、ファンドの実績ではありません。
- \*対象インデックス算出の月末時点はファンドの騰落率算出の月末時点とは異なる場合があります。
- \*ファンドの対象インデックスはMSCIオール・カンントリー・ワールド・インデックス(円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)です。

- \*上記期間の各月末における直近1年間の騰落率の平均値・最大値・最小値を、ファンドおよび代表的な資産クラスについて表示し、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。
- \*ファンドは2019年10月末現在、設定後1年を経過していないため、ファンドの年間騰落率に代えて対象インデックスの年間騰落率を用いて算出・表示しています。
- \*対象インデックス算出の月末時点はファンドの騰落率算出の月末時点とは異なる場合があります。
- \*全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

## 各資産クラスの指数

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

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

## 4【手数料等及び税金】

## (3)【信託報酬等】

&lt;訂正前&gt;

ファンドの日々の純資産総額に対して年率0.1296%<sup>\*</sup>（税抜0.12%）以内

有価証券届出書提出日（2019年7月5日）現在は、年率0.1296%<sup>\*</sup>（税抜0.12%）になります。配分は以下の通りです。

\*消費税率が10%になった場合は、年率0.132%となります。

支払先	内訳（税抜）	主な役務
委託会社	年率0.05%	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0.05%	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0.02%	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

(略)

&lt;訂正後&gt;

ファンドの日々の純資産総額に対して年率0.132%（税抜0.12%）以内

2020年1月15日現在は、年率0.132%（税抜0.12%）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0.05%	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0.05%	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0.02%	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

(略)

## (5)【課税上の取扱い】

&lt;訂正前&gt;

当ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

(略)

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

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

(略)

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4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。

(略)

<訂正後>

当ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

(略)

公募株式投資信託は税法上、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)」の適用対象です。また、販売会社によっては非課税累積投資契約に係る少額投資非課税制度「愛称：つみたてNISA(つみたてニーサ)」の適用対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

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

(略)

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。

(略)

## 5【運用状況】

原届出書の第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 5 運用状況につきましては、以下の記載内容に更新・訂正いたします。

<更新・訂正後>

## (1)【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（％）
親投資信託受益証券	144,191,795	99.73
内 日本	144,191,795	99.73
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	392,445	0.27
純資産総額	144,584,240	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）

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和1年10月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	324,775,238,883	94.98
内 アメリカ	211,742,282,728	61.92
内 イギリス	19,607,760,256	5.73
内 フランス	12,567,143,955	3.68
内 カナダ	12,477,271,939	3.65
内 スイス	12,429,518,907	3.63
内 ドイツ	10,683,484,545	3.12
内 オーストラリア	7,863,680,056	2.30
内 オランダ	6,377,451,873	1.87
内 アイルランド	6,167,534,694	1.80
内 スペイン	3,488,606,267	1.02
内 スウェーデン	3,025,239,794	0.88
内 香港	3,023,792,676	0.88
内 イタリア	2,380,269,775	0.70
内 デンマーク	2,185,841,195	0.64
内 シンガポール	1,461,706,300	0.43
内 フィンランド	1,388,420,187	0.41
内 バミューダ	1,313,746,591	0.38
内 ジャージー	1,179,534,129	0.34
内 ベルギー	1,144,529,329	0.33
内 ケイマン諸島	804,296,205	0.24
内 ノルウェー	773,469,206	0.23
内 イスラエル	707,597,243	0.21
内 オランダ領キュラソー	390,975,733	0.11
内 ルクセンブルグ	328,367,538	0.10
内 オーストリア	289,413,533	0.08
内 ニュージーランド	288,472,391	0.08
内 ポルトガル	195,308,612	0.06
内 リベリア	167,684,618	0.05
内 パナマ	150,371,774	0.04
内 マン島	61,001,619	0.02



	内 パプアニューギニア	57,007,631	0.02
	内 イギリス領バージン諸島	41,828,179	0.01
	内 モーリシャス	11,629,405	0.00
投資信託受益証券		754,762,701	0.22
	内 オーストラリア	600,813,789	0.18
	内 シンガポール	153,948,912	0.05
投資証券		8,550,930,737	2.50
	内 アメリカ	7,651,105,632	2.24
	内 イギリス	239,614,983	0.07
	内 フランス	213,507,836	0.06
	内 香港	206,054,677	0.06
	内 オランダ	183,460,811	0.05
	内 カナダ	57,186,798	0.02
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		7,861,683,529	2.30
純資産総額		341,942,615,850	100.00

## その他資産の投資状況

令和1年10月31日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引(買建)	7,660,720,921	2.24
内 アメリカ	5,408,976,026	1.58
内 ドイツ	1,311,027,094	0.38
内 イギリス	462,373,386	0.14
内 カナダ	277,497,375	0.08
内 オーストラリア	200,847,040	0.06

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

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

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

## エマージング株式パッシブ・マザーファンド

令和1年10月31日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	40,498,535,634	86.01
内 ケイマン諸島	6,678,898,511	14.19
内 韓国	5,004,563,727	10.63
内 台湾	4,837,552,492	10.27
内 中国	4,672,510,762	9.92
内 インド	3,654,402,636	7.76
内 ブラジル	3,060,004,903	6.50
内 南アフリカ	1,790,597,176	3.80
内 ロシア	1,623,059,068	3.45
内 香港	1,280,260,807	2.72
内 タイ	1,119,618,613	2.38
内 サウジアラビア	986,534,795	2.10
内 インドネシア	846,370,348	1.80
内 マレーシア	805,081,877	1.71
内 メキシコ	759,356,938	1.61
内 フィリピン	453,872,316	0.96
内 ポーランド	419,783,176	0.89

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

## その他資産の投資状況

令和1年10月31日現在

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

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

## MSCIジャパン・インデックス・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		325,545,050	97.21
	内 日本	325,545,050	97.21
投資証券		5,075,000	1.52
	内 日本	5,075,000	1.52
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		4,280,381	1.28
純資産総額		334,900,431	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

## （2）【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

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	30,903,934	3.6618 113,164,093	3.7786 116,773,605	- -	80.77
2	エマージング株式パッシ ブ・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	14,570,904	1.1177 16,286,335	1.1519 16,784,224	- -	11.61
3	MSCIジャパン・イン デックス・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	9,835,337	1.0525 10,352,370	1.0812 10,633,966	- -	7.35

（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	99.73
合計	99.73

（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)

## 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和1年10月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	APPLE INC アメリカ	株式 コン ピュー タ・周辺 機器	363,209	18,610.42 6,759,475,519	26,486.14 9,620,007,619	- -	2.81
2	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフト ウェア	575,002	11,728.09 6,743,680,652	15,745.13 9,053,485,150	- -	2.65
3	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 インター ネット販 売・通信 販売	33,054	177,581.65 5,869,783,919	193,805.31 6,406,040,756	- -	1.87
4	FACEBOOK INC アメリカ	株式 インタラ クティ ブ・メ ディアお よびサー ビス	189,729	17,925.81 3,401,047,773	20,496.65 3,888,810,805	- -	1.14
5	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	256,348	11,160.95 2,861,087,388	13,689.48 3,509,271,434	- -	1.03
6	ALPHABET INC-CL C アメリカ	株式 インタラ クティ ブ・メ ディアお よびサー ビス	24,708	122,177.43 3,018,760,028	137,329.25 3,393,131,237	- -	0.99
7	ALPHABET INC-CL A アメリカ	株式 インタラ クティ ブ・メ ディアお よびサー ビス	23,530	123,027.15 2,894,828,911	137,265.01 3,229,845,826	- -	0.94
8	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	209,690	14,614.88 3,064,594,543	14,463.61 3,032,876,310	- -	0.89
9	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	241,926	9,764.48 2,362,281,711	11,663.65 2,821,741,351	- -	0.83
10	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品	198,040	10,775.97 2,134,074,164	13,603.46 2,694,030,644	- -	0.79
11	VISA INC アメリカ	株式 情報技術 サービス	137,469	15,656.42 2,152,273,769	19,516.73 2,682,946,731	- -	0.78

12	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 石油・ガス・消耗燃料	334,134	8,281.50 2,767,131,947	7,373.35 2,463,688,131	- -	0.72
13	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 銀行	713,639	3,090.24 2,205,319,701	3,442.78 2,456,906,072	- -	0.72
14	AT&T INC アメリカ	株式 各種電気通信サービス	575,875	3,259.35 1,876,981,128	4,159.21 2,395,188,514	- -	0.70
15	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 各種金融サービス	102,604	22,060.26 2,263,471,661	23,218.65 2,382,327,390	- -	0.70
16	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 専門小売り	86,872	20,447.78 1,776,339,819	25,721.81 2,234,505,182	- -	0.65
17	INTEL CORP アメリカ	株式 半導体・半導体製造装置	353,705	5,518.06 1,951,768,137	6,162.60 2,179,745,262	- -	0.64
18	MASTERCARD INC アメリカ	株式 情報技術サービス	71,792	24,058.77 1,727,227,549	30,176.09 2,166,401,996	- -	0.63
19	VERIZON COMM INC アメリカ	株式 各種電気通信サービス	326,283	5,902.31 1,925,824,606	6,622.08 2,160,672,650	- -	0.63
20	UNITEDHEALTH GROUP INC アメリカ	株式 ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	75,067	28,818.69 2,163,333,091	27,742.62 2,082,555,555	- -	0.61
21	THE WALT DISNEY CO アメリカ	株式 娯楽	142,222	12,197.12 1,734,700,150	14,110.84 2,006,873,024	- -	0.59
22	WELLS FARGO & CO アメリカ	株式 銀行	337,198	5,277.94 1,779,711,237	5,665.02 1,910,235,572	- -	0.56
23	CHEVRON CORP アメリカ	株式 石油・ガス・消耗燃料	150,662	12,861.48 1,937,737,238	12,669.27 1,908,778,581	- -	0.56
24	MERCK & CO. INC. アメリカ	株式 医薬品	203,186	8,604.28 1,748,269,910	9,387.63 1,907,435,720	- -	0.56
25	COCA-COLA CO/THE アメリカ	株式 飲料	320,243	4,982.73 1,595,686,074	5,872.98 1,880,783,039	- -	0.55
26	PFIZER INC アメリカ	株式 医薬品	438,192	4,558.90 1,997,673,569	4,189.70 1,835,894,074	- -	0.54

27	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN スイス	株式 医薬品	55,462	29,812.80 1,653,477,592	32,684.89 1,812,769,757	- -	0.53
28	CISCO SYSTEMS INC アメリカ	株式 通信機器	338,608	5,274.37 1,785,943,929	5,178.33 1,753,424,912	- -	0.51
29	COMCAST CORP-CL A アメリカ	株式 メディア	358,051	4,078.85 1,460,437,938	4,865.84 1,742,221,455	- -	0.51
30	PEPSICO INC アメリカ	株式 飲料	110,679	12,319.94 1,363,558,688	14,905.67 1,649,744,871	- -	0.48

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

令和1年10月31日現在

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

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資株式の業種別投資比率

令和1年10月31日現在

業種	国内/外国	投資比率(%)
銀行	外国	7.76
医薬品		5.35
ソフトウェア		5.18
石油・ガス・消耗燃料		4.99
情報技術サービス		4.04
保険		3.80
インタラクティブ・メディアおよびサービス		3.25
半導体・半導体製造装置		3.13
コンピュータ・周辺機器		3.09
資本市場		2.79
ヘルスケア機器・用品		2.74
インターネット販売・通信販売		2.46
航空宇宙・防衛		2.30
化学		2.19
各種電気通信サービス		2.13
電力		2.08
飲料		1.99
食品		1.96
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス		1.89
バイオテクノロジー		1.88
ホテル・レストラン・レジャー		1.77
専門小売り		1.72
機械		1.61
食品・生活必需品小売り		1.52
繊維・アパレル・贅沢品		1.45
家庭用品		1.40
金属・鉱業		1.32

コングロマリット	1.28
娯楽	1.26
メディア	1.26
総合公益事業	1.08
陸運・鉄道	0.98
各種金融サービス	0.95
自動車	0.83
タバコ	0.81
通信機器	0.77
ライフサイエンス・ツール/サービス	0.75
専門サービス	0.74
電気設備	0.72
パーソナル用品	0.72
電子装置・機器・部品	0.53
不動産管理・開発	0.53
航空貨物・物流サービス	0.53
複合小売り	0.52
商業サービス・用品	0.48
消費者金融	0.48
家庭用耐久財	0.41
建設関連製品	0.41
建設・土木	0.34
自動車部品	0.29
建設資材	0.29
無線通信サービス	0.29
容器・包装	0.29
商社・流通業	0.28
エネルギー設備・サービス	0.27
運送インフラ	0.21
ガス	0.20
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.11
旅客航空輸送業	0.11
ヘルスケア・テクノロジー	0.10
紙製品・林産品	0.10
水道	0.09
販売	0.07
海運業	0.06
レジャー用品	0.04
各種消費者サービス	0.01
合計	94.98

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## エマージング株式パッシブ・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。

### M S C I ジャパン・インデックス・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	2,000	7,385.00 14,770,000	7,542.00 15,084,000	- -	4.50
2	ソニー 日本	株式 電気機器	1,100	6,311.00 6,942,100	6,625.00 7,287,500	- -	2.18
3	キーエンス 日本	株式 電気機器	100	65,510.00 6,551,000	68,820.00 6,882,000	- -	2.05
4	ファーストリテイリング 日本	株式 小売業	100	65,450.00 6,545,000	67,050.00 6,705,000	- -	2.00
5	三菱UFJフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	10,600	543.20 5,757,920	569.80 6,039,880	- -	1.80
6	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	1,400	4,258.00 5,961,200	4,190.00 5,866,000	- -	1.75
7	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	1,300	3,786.00 4,921,800	3,928.00 5,106,400	- -	1.52
8	KDDI 日本	株式 情報・通信業	1,500	2,970.00 4,455,000	2,999.00 4,498,500	- -	1.34
9	リクルートホールディングス 日本	株式 サービス業	1,200	3,465.00 4,158,000	3,611.00 4,333,200	- -	1.29
10	ファナック 日本	株式 電気機器	200	20,025.00 4,005,000	21,600.00 4,320,000	- -	1.29
11	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	1,100	3,721.00 4,093,100	3,880.00 4,268,000	- -	1.27
12	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	1,400	2,899.50 4,059,300	2,942.00 4,118,800	- -	1.23
13	任天堂 日本	株式 その他製品	100	40,150.00 4,015,000	38,620.00 3,862,000	- -	1.15
14	信越化学工業 日本	株式 化学	300	12,000.00 3,600,000	12,160.00 3,648,000	- -	1.09
15	第一三共 日本	株式 医薬品	500	6,939.00 3,469,500	7,140.00 3,570,000	- -	1.07
16	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	600	5,676.00 3,405,600	5,868.00 3,520,800	- -	1.05

17	みずほフィナンシャルグループ	株式	20,800	164.40	168.80	-	1.05
	日本	銀行業		3,419,520	3,511,040	-	
18	花王	株式	400	8,324.00	8,744.00	-	1.04
	日本	化学		3,329,600	3,497,600	-	
19	三菱商事	株式	1,200	2,694.50	2,764.00	-	0.99
	日本	卸売業		3,233,400	3,316,800	-	
20	NTTドコモ	株式	1,100	2,865.50	2,975.00	-	0.98
	日本	情報・通信業		3,152,050	3,272,500	-	
21	日立製作所	株式	800	4,109.00	4,069.00	-	0.97
	日本	電気機器		3,287,200	3,255,200	-	
22	日本電信電話	株式	600	5,418.00	5,376.00	-	0.96
	日本	情報・通信業		3,250,800	3,225,600	-	
23	日本電産	株式	200	14,620.00	16,085.00	-	0.96
	日本	電気機器		2,924,000	3,217,000	-	
24	オリエンタルランド	株式	200	16,635.00	15,885.00	-	0.95
	日本	サービス業		3,327,000	3,177,000	-	
25	ダイキン工業	株式	200	14,440.00	15,230.00	-	0.91
	日本	機械		2,888,000	3,046,000	-	
26	アステラス製薬	株式	1,600	1,638.00	1,858.50	-	0.89
	日本	医薬品		2,620,800	2,973,600	-	
27	東日本旅客鉄道	株式	300	10,485.00	9,849.00	-	0.88
	日本	陸運業		3,145,500	2,954,700	-	
28	村田製作所	株式	500	5,794.00	5,863.00	-	0.88
	日本	電気機器		2,897,000	2,931,500	-	
29	HOYA	株式	300	9,000.00	9,603.00	-	0.86
	日本	精密機器		2,700,000	2,880,900	-	
30	伊藤忠商事	株式	1,200	2,264.50	2,271.00	-	0.81
	日本	卸売業		2,717,400	2,725,200	-	

(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	97.21
投資証券	1.52
合計	98.72

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 投資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	16.44
輸送用機器		9.32
情報・通信業		7.71
化学		6.51
医薬品		6.06
銀行業		5.50
小売業		5.03
サービス業		4.81
卸売業		4.47
陸運業		4.44
機械		3.66
食料品		3.54
保険業		2.59
精密機器		2.42
建設業		2.22
その他製品		2.16
不動産業		2.12
電気・ガス業		1.66
その他金融業		0.97
ゴム製品		0.79
証券、商品先物取引業		0.76
ガラス・土石製品		0.69
鉄鋼		0.63
石油・石炭製品		0.62
非鉄金属		0.58
繊維製品		0.41
金属製品		0.28
鋳業		0.27
空運業		0.21
海運業		0.15
パルプ・紙		0.12
倉庫・運輸関連業		0.07
合計		97.21

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

(参考)

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

MSCIジャパン・インデックス・マザーファンド  
該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（参考）

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
	E U R E X 取引所	DJ EURO STOXX 50 Dec19	買建	299	1,281,660,495	1,311,027,094	0.38
	I C E - E U	FTSE 100 INDEX FUTURE Dec19	買建	45	453,741,685	462,373,386	0.14
	モントリ オール取引 所	S&P/TSE 60 IX FUT Dec19	買建	17	275,330,292	277,497,375	0.08
	シドニー先 物取引所	SPI 200 FUTURES Dec19	買建	16	199,175,824	200,847,040	0.06

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

エマージング株式パッシブ・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	I C E - U S	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。

MSCIジャパン・インデックス・マザーファンド  
該当事項はありません。

## (3) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

直近日(令和1年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 (令和1年10月15日)	153	153	0.9974	0.9974
令和1年7月末日	35	-	1.0067	-
8月末日	116	-	0.9545	-
9月末日	125	-	0.9886	-
10月末日	144	-	1.0298	-

## 【分配の推移】

	1口当たりの分配金(円)
第1計算期間	0.0000

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	0.3

(注) 収益率は期間騰落率です。

## (4) 【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数
第1計算期間	174,512,764	20,930,253

(注1) 本邦外における設定及び解約はありません。

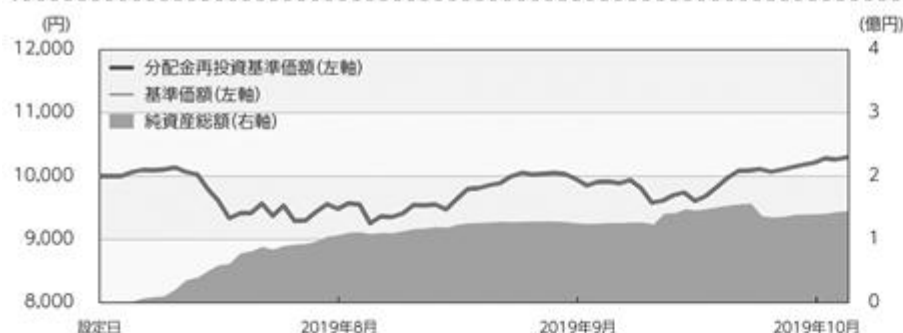
(注2) 第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。



&lt;&lt; 参考情報 &gt;&gt;

データの基準日:2019年10月31日

## 基準価額・純資産の推移 (2019年7月22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:2019年7月22日)

## 分配の推移(税引前)

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	80.77
2	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	11.61
3	MSCIジャパン・インデックス・マザーファンド	7.35

## ■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

## ■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

## ■MSCIジャパン・インデックス・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	4.50
2	ソニー	株式	日本	電気機器	2.18
3	キーエンス	株式	日本	電気機器	2.05
4	ファーストリテイリング	株式	日本	小売業	2.00
5	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	日本	銀行業	1.80

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

○ベンチマークの情報はあくまで参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。

○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。

## 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。

※2019年は設定日から基準日までの収益率を表示しています。

※2018年以前は、ベンチマークの収益率を表示しています。当ファンドのベンチマークは「MSCIオール・カンントリー・ワールド・インデックス(円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)」です。

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

○ベンチマークの情報はあくまで参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。

○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3【ファンドの経理状況】

原届出書の第二部 ファンド情報 第3 ファンドの経理状況につきましては、以下の記載内容に更新・訂正いたします。

<更新・訂正後>

(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1期計算期間(令和1年7月22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 全世界株式】

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第1期 令和1年10月15日現在
<b>資産の部</b>	
流動資産	
コール・ローン	1,033,670
親投資信託受益証券	152,718,677
流動資産合計	153,752,347
資産合計	153,752,347
<b>負債の部</b>	
流動負債	
未払解約金	533,863
未払受託者報酬	5,101
未払委託者報酬	25,595
その他未払費用	825
流動負債合計	565,384
負債合計	565,384
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	153,582,511
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金( )	395,548
(分配準備積立金)	4,225,914
元本等合計	153,186,963
純資産合計	153,186,963
負債純資産合計	153,752,347

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第1期 自 令和1年7月22日 至 令和1年10月15日
営業収益	
有価証券売買等損益	4,240,577
営業収益合計	4,240,577
営業費用	
支払利息	156
受託者報酬	5,101
委託者報酬	25,595
その他費用	825
営業費用合計	31,677
営業利益又は営業損失( )	4,208,900
経常利益又は経常損失( )	4,208,900
当期純利益又は当期純損失( )	4,208,900
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( )	17,014
期首剰余金又は期首欠損金( )	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	530,852
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	530,852
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	5,152,314
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	5,152,314
分配金	-
期末剰余金又は期末欠損金( )	395,548

## (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1期
	自 令和1年7月22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. 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
	令和1年10月15日現在
1. 期首元本額	1,000,000円
期中追加設定元本額	173,512,764円
期中一部解約元本額	20,930,253円
2. 受益権の総数	153,582,511口
3. 元本の欠損	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は395,548円でありませ

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第1期
	自 令和1年7月22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（605,938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（3,619,976円）、信託約款に規定される収益調整金（181,177円）及び分配準備積立金（0円）より分配対象収益は4,407,091円（1万口当たり286.95円）であります。分配を行っておりませ

## (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 令和1年7月22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	第1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。
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	第1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）
親投資信託受益証券	4,202,789
合計	4,202,789

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	第1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)	0.9974円 (9,974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	M S C I ジャパン・インデック ス・マザーファンド	10,752,337	11,306,082	
	外国株式パッシブ・ファンド・ マザーファンド	33,804,176	123,632,012	
	エマージング株式パッシブ・マ ザーファンド	15,928,141	17,780,583	
親投資信託受益証券	合計	60,484,654	152,718,677	
合計			152,718,677	

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。



（参考）

当ファンドは、「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「エマージング株式パッシブ・マザーファンド」受益証券及び「MSCIジャパン・インデックス・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。

#### 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	
<b>資産の部</b>	
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
<b>資産合計</b>	
334,000,845,091	
<b>負債の部</b>	
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
<b>負債合計</b>	
3,574,459,833	
<b>純資産の部</b>	
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
<b>純資産合計</b>	
330,426,385,258	
<b>負債純資産合計</b>	
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 令和1年7月22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	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>為替予約取引</p> <p>原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	令和1年10月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	94,654,100,957円
同期中追加設定元本額	5,075,009,377円
同期中一部解約元本額	9,382,697,370円
元本の内訳	
ファンド名	
D I A M外国株式パッシブ・ファンド	3,128,729,146円
M I T O ラップ型ファンド(安定型)	3,040,723円
M I T O ラップ型ファンド(中立型)	8,048,839円
M I T O ラップ型ファンド(積極型)	12,770,438円

グローバル8資産ラップファンド(安定型)	31,940,591円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	26,142,373円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	16,107,724円
たわらノーロード 先進国株式	10,805,919,724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
D I A M外国株式インデックスファンドV A (適格機関投資家専用)	86,264,565円
D I A M外国株式パッシブ私募ファンド(適格機関投資家向け)	2,268,088,158円
D I A M先進国株式パッシブファンド(適格機関投資家限定)	9,256,352,765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
D I A Mワールドバランス25V A(適格機関投資家限定)	19,400,436円
D I A Mグローバル・バランスファンド25V A(適格機関投資家限定)	68,821,105円
D I A Mグローバル・バランスファンド50V A(適格機関投資家限定)	152,577,479円
D I A M国際分散バランスファンド30V A(適格機関投資家限定)	9,371,332円
D I A M国際分散バランスファンド50V A(適格機関投資家限定)	57,328,522円
D I A M国内重視バランスファンド30V A(適格機関投資家限定)	5,568,670円
D I A M国内重視バランスファンド50V A(適格機関投資家限定)	6,304,791円
D I A M世界バランスファンド40V A(適格機関投資家限定)	21,127,188円
D I A M世界バランスファンド50V A(適格機関投資家限定)	62,420,752円
D I A Mバランスファンド25V A(適格機関投資家限定)	427,385,249円
D I A Mバランスファンド37.5V A(適格機関投資家限定)	548,725,522円
D I A Mバランスファンド50V A(適格機関投資家限定)	1,771,905,476円
D I A Mグローバル・アセット・バランスV A(適格機関投資家限定)	633,584,646円
D I A Mグローバル・アセット・バランスV A 2(適格機関投資家限定)	104,437,597円
D I A M アクサ グローバル バランスファンド30V A(適格機関投資家限定)	692,184,610円
D I A M世界アセットバランスファンドV A(適格機関投資家向け)	37,770,237円
D I A M世界バランスファンド55V A(適格機関投資家限定)	10,310,184円
D I A M世界バランスファンド35V A(適格機関投資家限定)	10,887,190円
D I A M世界アセットバランスファンド2V A(適格機関投資家限定)	255,254,837円
D I A M世界アセットバランスファンド40V A(適格機関投資家限定)	33,806,318円
D I A M世界アセットバランスファンド25V A(適格機関投資家限定)	113,287,716円
D I A M世界アセットバランスファンド3V A(適格機関投資家限定)	171,990,277円
D I A Mバランス30V A(適格機関投資家限定)	4,394,580円
D I A Mバランス50V A(適格機関投資家限定)	333,901円
D I A Mバランス70V A(適格機関投資家限定)	494,998円
D I A M世界アセットバランスファンド4V A(適格機関投資家限定)	5,687,680,320円
D I A Mバランス20V A(適格機関投資家限定)	53,515,759円
D I A Mバランス40V A(適格機関投資家限定)	225,774円
D I A Mバランス60V A(適格機関投資家限定)	255,220円
計	90,346,412,964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 令和1年7月22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ぬ。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	令和1年10月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		時価（円）
		1年超		
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。

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

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

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

・計算日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

## 株式関連

種類	令和1年10月15日現在			
	契約額等（円）	うち		時価（円）
		1年超		
市場取引				
先物取引				
買建	6,627,354,054	-	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ではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

令和1年10月15日現在	
1口当たり純資産額	3.6573円
（1万口当たり純資産額）	（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 SOFTWARE	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	
FLOWERVE 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	
KOHL'S 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	
SYNOPSIS 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	
	ASHTED 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	
SEBACORP 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	
	YANGZIJANG 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-GENUSSSCHEIN	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		
DUFREY 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	
BRENTAG 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	
	WHEELLOCK & 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。

## 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 令和1年7月22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	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>新株予約権証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>為替予約取引</p> <p>原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	令和1年10月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	52,022,664,102円
同期中追加設定元本額	16,501,394,041円
同期中一部解約元本額	28,370,402,022円

元本の内訳	
ファンド名	
D I A M新興国株式インデックスファンド< D C 年金>	5,475,611,397円
D I A M新興国株式インデックスファンド<為替ヘッジなし>(ファンドラップ)	562,067,419円
M I T O ラップ型ファンド(安定型)	3,094,261円
M I T O ラップ型ファンド(中立型)	10,687,402円
M I T O ラップ型ファンド(積極型)	13,414,994円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	32,675,047円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	34,044,227円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	16,922,877円
たわらノーロード 新興国株式	5,425,139,001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
O n e D C 新興国株式インデックスファンド	870,210円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	453,215,866円
D I A M D C 8資産バランスファンド(新興国10)	357,798,598円
D I A M D C 8資産バランスファンド(新興国20)	347,912,071円
D I A M D C 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< D C 年金>	714,010,516円
D I A M 8資産バランスファンドN< D C 年金>	300,696,982円
クルーズコントロール< D C 年金>	979,978円
D I A Mコア資産設計ファンド(堅実型)	18,537,357円
D I A Mコア資産設計ファンド(積極型)	50,145,185円
投資のソムリエ< D C 年金>リスク抑制型	393,981,509円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	4,554,666,539円
ワールドアセットバランス(基本コース)	1,555,716,267円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	6,220,771,292円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー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(D C)	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< D C 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V A(適格機関投資家専用)	184,637,230円

D I A M世界アセットバランスファンド2 V A (適格機関投資家限定)	423,767,599円
D I A M世界アセットバランスファンド3 V A (適格機関投資家限定)	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 令和1年7月22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	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。</p> <p>また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	令和1年10月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)		時価(円)	評価損益(円)
		うち 1年超		
市場取引以外の取引 為替予約取引 買建 アメリカ・ドル	1,063,516,213	-	1,066,645,400	3,129,187
	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。

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

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

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

・計算日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

## 株式関連

種類	令和1年10月15日現在			
	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
		うち 1年超		
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 PEF	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・ボンド	POLYMETAL INTERNATIONAL PLC	15,843	11.545	182,907.430	
イギリス・ボンド 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	
WEICHAJ 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 PIENZHEHUANG 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・ペン	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・パーツ	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・パーツ 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・ フォロント	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・フォロント 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・リアル	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・リアル 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 HOLDINGS 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	
WEICHAJ 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	
CRRG 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 HUIZHAN 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	
	HENGTEEN 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	
	TAI MED 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・パーツ	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	59,033.000	172,376.360	
		MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	9,465.000	35,020.500	
	タイ・パーツ 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 TELEVISIA 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 新株予約権証 券 2銘柄	2.50 -	- 0.00	- -	- -	2.83
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 投資信託受益 証券 5銘柄	6.34 -	- -	- 0.27	- -	7.45
ポーランド・ズロチ	株式 19銘柄	0.88	-	-	-	0.99
マレーシア・リングgit	株式 43銘柄	1.77	-	-	-	2.00
メキシコ・ペソ	株式 19銘柄 投資信託受益 証券 5銘柄 投資証券 1銘柄	1.63 - -	- - -	- 0.55 -	- - 0.08	2.56
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 投資証券 3銘柄	4.18 -	- -	- -	- 0.14	4.87

(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。

## MSCIジャパン・インデックス・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	923,704
株式	317,340,780
投資証券	5,193,800
未収配当金	3,215,291
流動資産合計	326,673,575
資産合計	326,673,575
負債の部	
流動負債	
流動負債合計	-
負債合計	-
純資産の部	
元本等	
元本	310,673,209
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	16,000,366
元本等合計	326,673,575
純資産合計	326,673,575
負債純資産合計	326,673,575

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自 令和1年7月22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. 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	- 円
同期中追加設定元本額	311,211,716円
同期中一部解約元本額	538,507円
元本の内訳	
ファンド名	
たわらノーロード 全世界株式	10,752,337円
MSCIジャパン・インデックス・ファンド（適格機関投資家限定）	299,920,872円
計	310,673,209円
2. 受益権の総数	310,673,209口

## （金融商品に関する注記）

## 1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 令和1年7月22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)
株式	12,422,048
投資証券	501,190
合計	12,923,238

## (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)	1.0515円 (10,515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	
国際石油開発帝石	900	961.00	864,900	
大成建設	200	4,160.00	832,000	
大林組	600	1,076.00	645,600	
清水建設	500	1,008.00	504,000	
鹿島建設	400	1,450.00	580,000	
大東建託	100	13,945.00	1,394,500	
大和ハウス工業	500	3,573.00	1,786,500	
積水ハウス	500	2,284.50	1,142,250	
日揮ホールディングス	200	1,467.00	293,400	
日清製粉グループ本社	200	2,060.00	412,000	
パーソルホールディングス	200	1,996.00	399,200	
山崎製パン	100	1,947.00	194,700	
カルビー	100	3,410.00	341,000	
ヤクルト本社	100	6,040.00	604,000	
明治ホールディングス	100	7,860.00	786,000	
日本ハム	100	4,680.00	468,000	
総合警備保障	100	5,640.00	564,000	
カカクコム	100	2,428.00	242,800	
エムスリー	400	2,617.00	1,046,800	
博報堂DYホールディングス	200	1,564.00	312,800	
アサヒグループホールディングス	300	5,490.00	1,647,000	
キリンホールディングス	700	2,304.00	1,612,800	
コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールディングス	100	2,518.00	251,800	
サントリー食品インターナショナル	100	4,740.00	474,000	
日本マクドナルドホールディングス	100	5,370.00	537,000	
アルFRESSA ホールディングス	200	2,409.00	481,800	
キッコーマン	100	5,190.00	519,000	
味の素	400	2,049.00	819,600	
東洋水産	100	4,465.00	446,500	
日清食品ホールディングス	100	8,270.00	827,000	
日本たばこ産業	1,000	2,395.50	2,395,500	
ヒューリック	300	1,143.00	342,900	
MonotaRO	100	2,935.00	293,500	
J.フロント リテイリング	200	1,350.00	270,000	
ZOZO	200	2,517.00	503,400	
三越伊勢丹ホールディングス	300	878.00	263,400	
野村不動産ホールディングス	100	2,484.00	248,400	
東急不動産ホールディングス	500	727.00	363,500	
飯田グループホールディングス	100	1,744.00	174,400	
セブン&アイ・ホールディングス	700	4,391.00	3,073,700	
帝人	200	2,129.00	425,800	
東レ	1,200	832.60	999,120	
クラレ	300	1,350.00	405,000	

旭化成	1,100	1,152.00	1,267,200
SUMCO	200	1,697.00	339,400
ネクソン	400	1,263.00	505,200
王子ホールディングス	700	546.00	382,200
LINE	100	3,910.00	391,000
昭和電工	100	2,922.00	292,200
住友化学	1,300	508.00	660,400
日産化学	100	4,275.00	427,500
東ソー	200	1,490.00	298,000
信越化学工業	300	12,000.00	3,600,000
エア・ウォーター	100	1,998.00	199,800
大陽日酸	100	2,431.00	243,100
協和キリン	200	2,005.00	401,000
三菱瓦斯化学	100	1,505.00	150,500
三井化学	200	2,551.00	510,200
JSR	200	1,797.00	359,400
三菱ケミカルホールディングス	1,100	821.70	903,870
ダイセル	200	937.00	187,400
積水化学工業	300	1,748.00	524,400
日立化成	100	3,530.00	353,000
野村総合研究所	300	2,296.00	688,800
電通	200	3,690.00	738,000
メルカリ	100	2,257.00	225,700
花王	400	8,324.00	3,329,600
武田薬品工業	1,300	3,786.00	4,921,800
アステラス製薬	1,600	1,638.00	2,620,800
大日本住友製薬	100	1,813.00	181,300
塩野義製薬	200	5,867.00	1,173,400
田辺三菱製薬	200	1,264.00	252,800
中外製薬	200	8,230.00	1,646,000
エーザイ	200	5,488.00	1,097,600
小野薬品工業	300	1,951.50	585,450
参天製薬	300	1,867.00	560,100
テルモ	600	3,427.00	2,056,200
第一三共	500	6,939.00	3,469,500
大塚ホールディングス	300	4,373.00	1,311,900
ペプチドリーム	100	4,910.00	491,000
日本ペイントホールディングス	100	6,090.00	609,000
関西ペイント	200	2,594.00	518,800
オリエンタルランド	200	16,635.00	3,327,000
パーク24	100	2,586.00	258,600
オービック	100	12,370.00	1,237,000
Zホールディングス	2,300	333.00	765,900
トレンドマイクロ	100	5,320.00	532,000
ユー・エス・エス	200	2,037.00	407,400
伊藤忠テクノソリューションズ	100	2,947.00	294,700
サイバーエージェント	100	4,040.00	404,000
楽天	700	1,007.00	704,900
大塚商会	100	4,105.00	410,500
富士フイルムホールディングス	300	4,719.00	1,415,700

コニカミノルタ	400	764.00	305,600
資生堂	300	8,707.00	2,612,100
ライオン	200	2,174.00	434,800
ポーラ・オルビスホールディングス	100	2,537.00	253,700
出光興産	200	3,100.00	620,000
JXTGホールディングス	2,800	491.50	1,376,200
横浜ゴム	100	2,261.00	226,100
ブリヂストン	500	4,294.00	2,147,000
住友ゴム工業	100	1,343.00	134,300
AGC	200	3,445.00	689,000
日本電気硝子	100	2,423.00	242,300
太平洋セメント	100	2,909.00	290,900
TOTO	100	4,145.00	414,500
日本碍子	200	1,549.00	309,800
日本特殊陶業	100	2,086.00	208,600
日本製鉄	700	1,521.50	1,065,050
神戸製鋼所	300	573.00	171,900
ジェイエフイーホールディングス	400	1,332.00	532,800
日立金属	200	1,227.00	245,400
三菱マテリアル	100	2,975.00	297,500
住友金属鉱山	200	3,435.00	687,000
住友電気工業	700	1,415.50	990,850
東洋製罐グループホールディングス	100	1,734.00	173,400
LIXILグループ	200	1,944.00	388,800
リクルートホールディングス	1,200	3,465.00	4,158,000
アマダホールディングス	300	1,181.00	354,300
日本郵政	1,400	994.00	1,391,600
豊田自動織機	100	6,230.00	623,000
ナブテスコ	100	3,375.00	337,500
小松製作所	800	2,480.00	1,984,000
住友重機械工業	100	3,285.00	328,500
日立建機	100	2,596.00	259,600
クボタ	900	1,644.50	1,480,050
ダイキン工業	200	14,440.00	2,888,000
栗田工業	100	2,860.00	286,000
ダイフク	100	5,750.00	575,000
ブラザー工業	200	2,004.00	400,800
セガサミーホールディングス	100	1,564.00	156,400
日本精工	300	974.00	292,200
ジェイテクト	200	1,283.00	256,600
ミネベアミツミ	300	1,877.00	563,100
THK	100	2,843.00	284,300
日立製作所	800	4,109.00	3,287,200
東芝	400	3,650.00	1,460,000
三菱電機	1,600	1,478.50	2,365,600
富士電機	100	3,375.00	337,500
安川電機	200	3,940.00	788,000
マキタ	200	3,245.00	649,000
日本電産	200	14,620.00	2,924,000



オムロン	200	6,020.00	1,204,000
日本電気	200	4,575.00	915,000
富士通	200	8,781.00	1,756,200
ルネサスエレクトロニクス	700	735.00	514,500
セイコーエプソン	200	1,487.00	297,400
パナソニック	1,900	896.90	1,704,110
シャープ	200	1,232.00	246,400
ソニー	1,100	6,311.00	6,942,100
T D K	100	10,280.00	1,028,000
アルプスアルパイン	200	2,102.00	420,400
横河電機	200	1,896.00	379,200
アドバンテスト	200	5,110.00	1,022,000
キーエンス	100	65,510.00	6,551,000
シスメックス	100	6,999.00	699,900
デンソー	400	4,861.00	1,944,400
スタンレー電気	100	2,961.00	296,100
カシオ計算機	200	1,691.00	338,200
ファナック	200	20,025.00	4,005,000
ローム	100	8,880.00	888,000
浜松ホトニクス	100	4,110.00	411,000
京セラ	300	6,836.00	2,050,800
村田製作所	500	5,794.00	2,897,000
日東電工	100	5,479.00	547,900
三菱重工業	300	4,318.00	1,295,400
川崎重工業	100	2,499.00	249,900
I H I	100	2,503.00	250,300
めぶきフィナンシャルグループ	800	268.00	214,400
ゆうちょ銀行	300	1,047.00	314,100
コンコルディア・フィナンシャルグループ	900	419.00	377,100
日産自動車	2,000	680.50	1,361,000
いすゞ自動車	500	1,223.00	611,500
トヨタ自動車	2,000	7,385.00	14,770,000
日野自動車	200	926.00	185,200
三菱自動車工業	600	484.00	290,400
アイシン精機	100	3,615.00	361,500
マツダ	500	980.40	490,200
本田技研工業	1,400	2,899.50	4,059,300
スズキ	300	4,750.00	1,425,000
S U B A R U	500	3,056.00	1,528,000
ヤマハ発動機	200	2,081.00	416,200
小糸製作所	100	5,420.00	542,000
豊田合成	100	2,214.00	221,400
シマノ	100	15,900.00	1,590,000
良品計画	200	2,276.00	455,200
メディカルホールディングス	200	2,414.00	482,800
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	400	1,742.00	696,800
島津製作所	200	2,695.00	539,000
ニコン	300	1,378.00	413,400

オリンパス	1,000	1,482.00	1,482,000
H O Y A	300	9,000.00	2,700,000
朝日インテック	200	2,850.00	570,000
キヤノン	900	2,908.50	2,617,650
リコー	600	977.00	586,200
バンダイナムコホールディングス	200	6,830.00	1,366,000
凸版印刷	200	1,952.00	390,400
大日本印刷	200	2,790.00	558,000
ヤマハ	100	4,910.00	491,000
ビジョン	100	4,765.00	476,500
任天堂	100	40,150.00	4,015,000
伊藤忠商事	1,200	2,264.50	2,717,400
丸紅	1,300	746.10	969,930
豊田通商	200	3,530.00	706,000
ファミリーマート	200	2,761.00	552,200
三井物産	1,400	1,774.50	2,484,300
東京エレクトロン	100	21,805.00	2,180,500
日立ハイテクノロジーズ	100	6,400.00	640,000
住友商事	1,000	1,696.50	1,696,500
三菱商事	1,200	2,694.50	3,233,400
ユニ・チャーム	300	3,500.00	1,050,000
丸井グループ	200	2,339.00	467,800
クレディセゾン	100	1,484.00	148,400
イオン	600	2,209.50	1,325,700
新生銀行	200	1,608.00	321,600
あおぞら銀行	100	2,643.00	264,300
三菱UFJフィナンシャル・グループ	10,600	543.20	5,757,920
りそなホールディングス	1,800	456.10	820,980
三井住友トラスト・ホールディングス	300	3,797.00	1,139,100
三井住友フィナンシャルグループ	1,100	3,721.00	4,093,100
千葉銀行	500	557.00	278,500
ふくおかフィナンシャルグループ	100	2,022.00	202,200
静岡銀行	400	804.00	321,600
セブン銀行	500	305.00	152,500
みずほフィナンシャルグループ	20,800	164.40	3,419,520
S B Iホールディングス	200	2,292.00	458,400
イオンフィナンシャルサービス	100	1,605.00	160,500
アコム	300	434.00	130,200
オリックス	1,100	1,660.00	1,826,000
三菱UFJリース	300	656.00	196,800
大和証券グループ本社	1,300	496.60	645,580
野村ホールディングス	2,900	489.00	1,418,100
S O M P Oホールディングス	300	4,240.00	1,272,000
日本取引所グループ	400	1,780.00	712,000
M S & A Dインシュアランスグループ ホールディングス	400	3,429.00	1,371,600
ソニーフィナンシャルホールディング ス	100	2,257.00	225,700
第一生命ホールディングス	900	1,718.50	1,546,650
東京海上ホールディングス	600	5,676.00	3,405,600

T & Dホールディングス	500	1,195.50	597,750	
三井不動産	800	2,738.50	2,190,800	
三菱地所	1,000	2,110.50	2,110,500	
住友不動産	300	3,973.00	1,191,900	
イオンモール	100	1,783.00	178,300	
東武鉄道	200	3,625.00	725,000	
東急	400	2,091.00	836,400	
京浜急行電鉄	200	2,166.00	433,200	
小田急電鉄	300	2,638.00	791,400	
京王電鉄	100	6,840.00	684,000	
京成電鉄	100	4,540.00	454,000	
東日本旅客鉄道	300	10,485.00	3,145,500	
西日本旅客鉄道	100	9,213.00	921,300	
東海旅客鉄道	100	22,810.00	2,281,000	
西武ホールディングス	200	1,931.00	386,200	
近鉄グループホールディングス	100	5,830.00	583,000	
阪急阪神ホールディングス	200	4,325.00	865,000	
京阪ホールディングス	100	4,970.00	497,000	
名古屋鉄道	200	3,370.00	674,000	
日本通運	100	5,670.00	567,000	
ヤマトホールディングス	300	1,712.50	513,750	
日本郵船	100	1,900.00	190,000	
商船三井	100	2,985.00	298,500	
九州旅客鉄道	100	3,515.00	351,500	
S Gホールディングス	100	2,672.00	267,200	
日本航空	100	3,342.00	334,200	
A N Aホールディングス	100	3,721.00	372,100	
上組	100	2,465.00	246,500	
日本電信電話	600	5,418.00	3,250,800	
K D D I	1,500	2,970.00	4,455,000	
ソフトバンク	1,400	1,507.50	2,110,500	
N T T ドコモ	1,200	2,865.50	3,438,600	
東京電力ホールディングス	1,300	540.00	702,000	
中部電力	600	1,634.00	980,400	
関西電力	600	1,266.00	759,600	
中国電力	200	1,446.00	289,200	
東北電力	400	1,104.00	441,600	
九州電力	300	1,079.00	323,700	
電源開発	100	2,578.00	257,800	
東京瓦斯	300	2,797.00	839,100	
大阪瓦斯	300	2,097.00	629,100	
東邦瓦斯	100	4,295.00	429,500	
東宝	100	4,665.00	466,500	
エヌ・ティ・ティ・データ	500	1,433.00	716,500	
セコム	200	9,834.00	1,966,800	
コナミホールディングス	100	5,000.00	500,000	
ベネッセホールディングス	100	2,880.00	288,000	
ヤマダ電機	500	509.00	254,500	
ニトリホールディングス	100	15,880.00	1,588,000	
ミスミグループ本社	200	2,451.00	490,200	

ファーストリテイリング	100	65,450.00	6,545,000	
ソフトバンクグループ	1,400	4,258.00	5,961,200	
スズケン	100	5,900.00	590,000	
サンドラッグ	100	3,475.00	347,500	
合計	146,000		317,340,780	

## (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	ジャパンリアルエステイト投資法人	1	721,000	
	ユナイテッド・アーバン投資法人	3	645,000	
	大和ハウスリート投資法人	2	624,000	
	日本ビルファンド投資法人	1	821,000	
	日本プライムリアルティ投資法人	1	513,000	
	日本プロロジスリート投資法人	2	608,000	
	日本リテールファンド投資法人	2	466,200	
	野村不動産マスターファンド投資法人	4	795,600	
投資証券 合計		16	5,193,800	
合計			5,193,800	

(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

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】

令和1年10月31日現在

資産総額	147,800,467円
負債総額	3,216,227円
純資産総額( - )	144,584,240円
発行済数量	140,396,882口
1口当たり純資産額( / )	1.0298円

(参考)

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和1年10月31日現在

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

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

令和1年10月31日現在

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

MSCIジャパン・インデックス・マザーファンド

令和1年10月31日現在

資産総額	334,900,431円
負債総額	0円
純資産総額( - )	334,900,431円
発行済数量	309,739,276口
1口当たり純資産額( / )	1.0812円

## 第三部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

<訂正前>

##### (1) 資本金の額（2019年4月26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4月26日現在）

###### 会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。

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

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

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

また、取締役会の決議によって、取締役社長を定めることができます。

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

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

###### 投資運用の意思決定機構

###### 1. 投資環境見直しおよび運用方針の策定

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

###### 2. 運用計画、売買計画の決定

各ファンドの運用は「投資環境会議」および「投資方針会議」における協議の内容を踏まえ、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。

<訂正後>

(1) 資本金の額(2019年10月31日現在)

資本金の額	20億円
発行する株式総数	100,000株 (普通株式 上限100,000株、A種種類株式 上限30,000株)
発行済株式総数	40,000株 (普通株式24,490株、A種種類株式15,510株)
種類株式の発行が可能	

直近5カ年の資本金の増減：該当事項はありません。

(2) 会社の機構(2019年10月31日現在)

会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。

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

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

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

また、取締役会の決議によって、取締役社長を定めることができます。

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

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

投資運用の意思決定機構

1. 投資環境見直しおよび運用方針の策定

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

2. 運用計画、売買計画の決定



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

## 2【事業の内容及び営業の概況】

### <訂正前>

「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4月26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	1,146,595,911,916
追加型株式投資信託	871	13,561,034,565,287
単位型公社債投資信託	46	176,328,445,456
単位型株式投資信託	161	1,240,583,444,476
合計	1,104	16,124,542,367,135

### <訂正後>

「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】

原届出書の第三部 委託会社等の情報 第1 委託会社等の概況 3 委託会社等の経理状況につきましては、以下の記載内容に更新・訂正いたします。

<更新・訂正後>

1. 委託会社であるアセットマネジメントOne株式会社(以下「委託会社」という。)の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年8月6日内閣府令第52号)により作成しております。  
また、中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)、ならびに同規則第38条及び第57条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年8月6日内閣府令第52号)により作成しております。
2. 財務諸表及び中間財務諸表の金額は、千円未満の端数を切り捨てて記載しております。
3. 委託会社は、第34期事業年度(自2018年4月1日至2019年3月31日)の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の監査を受け、第35期中間会計期間(自2019年4月1日至2019年9月30日)の中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の中間監査を受けております。

## (1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

	第33期 (2018年3月31日現在)	第34期 (2019年3月31日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金	49,071,217	41,087,475
金銭の信託	12,083,824	18,773,228
有価証券	-	153,518
未収委託者報酬	11,769,015	12,438,085
未収運用受託報酬	4,574,225	3,295,109
未収投資助言報酬	341,689	327,064
未収収益	59,526	56,925
前払費用	569,431	573,874
その他	427,238	491,914
流動資産計	78,896,169	77,197,195
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 1,156,953	1 1,096,916
器具備品	1 476,504	1 364,399
建設仮勘定	10,368	-
無形固定資産		
ソフトウェア	1,934,700	2,411,540
ソフトウェア仮勘定	1,026,319	885,545
電話加入権	904,389	1,522,040
電信電話専用施設利用権	3,931	3,931
	60	23
投資その他の資産		
投資有価証券	8,270,313	9,269,808
関係会社株式	1,721,433	1,611,931
長期差入保証金	3,229,196	4,499,196
繰延税金資産	1,518,725	1,312,328
その他	1,699,533	1,748,459
	101,425	97,892
固定資産計	11,848,840	13,142,665
資産合計	90,745,010	90,339,861

(単位:千円)

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

## (2) 【損益計算書】

(単位：千円)

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

(単位:千円)

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

## (3) 【株主資本等変動計算書】

第33期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

(単位:千円)

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

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

第34期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

(単位:千円)

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

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



## 重要な会計方針

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

## 表示方法の変更

第34期（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

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

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

## 注記事項

（貸借対照表関係）

1. 有形固定資産の減価償却累計額

（千円）

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

（損益計算書関係）

1. 関係会社に対する事項

（千円）

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

2. 固定資産除却損の内訳

（千円）

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

（株主資本等変動計算書関係）

第33期（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2. 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

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

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

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

## 第34期（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2. 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

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

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

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

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

## （金融商品関係）

### 1. 金融商品の状況に関する事項

#### （1）金融商品に対する取組方針

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

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

#### （2）金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

営業債務である未払手数料は、1年以内の支払期日であります。

#### （3）金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

#### （4）金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは含まれておりません(注2)参照)。

第33期(2018年3月31日現在)

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

第34期(2019年3月31日現在)

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

(注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3) 未収委託者報酬及び(4) 未収運用受託報酬

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

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

負 債

(1) 未払手数料

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

## (注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(千円)

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

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

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

## (注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

## 第33期(2018年3月31日現在)

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

## 第34期(2019年3月31日現在)

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

## (有価証券関係)

## 1. 子会社株式及び関連会社株式

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

## 2. その他有価証券

第33期(2018年3月31日現在)

(千円)

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

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

第34期(2019年3月31日現在)

(千円)

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

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

## 3. 当該事業年度中に売却したその他有価証券

第33期(自2017年4月1日至2018年3月31日)

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

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

## 第34期(自2018年4月1日至2019年3月31日)

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

## (退職給付関係)

## 1. 採用している退職給付制度の概要

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

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

## 2. 確定給付制度

## (1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(千円)

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

## (2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

(千円)

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

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

(千円)

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



## (4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(千円)

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

(注) 特別損失に計上しております。

## (5) 数理計算上の計算基礎に関する事項

## 主要な数理計算上の計算基礎

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

## 3. 簡便法を適用した確定給付制度

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

(千円)

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

## (2) 退職給付費用

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

## 4. 確定拠出制度

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

## (税効果会計関係)

## 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

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

## (企業結合等関係)

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

## 1. 結合当事企業

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

## 2. 企業結合日

2016年10月1日

## 3. 企業結合の方法

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

## 4. 結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

## 5. 企業結合の主な目的

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

## 6. 合併比率

「3. 企業結合の方法」の吸収合併における合併比率は以下の通りであります。

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

(\*) 普通株式と種類株式を合算して算定しております。

## 7. 交付した株式数

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

## 8. 経済的持分比率（議決権比率）

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

MHFGが企業結合日に追加取得した当社に対する経済的持分比率 20.00%

MHFGの追加取得後の当社に対する経済的持分比率 70.00%

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

## 9. 取得企業を決定するに至った主な根拠

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

## 10. 会計処理

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

## 11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

## (1) 被取得企業の取得原価及びその内訳

取得の対価 MHAMの普通株式 144,212,500千円

取得原価 144,212,500千円

## (2) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

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

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

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

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

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

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

## 12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

## (1) 貸借対照表項目

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

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

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

## (2) 損益計算書項目

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

(注) 営業利益には、のれん及び顧客関連資産の償却額が含まれております。

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

## (資産除去債務関係)

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

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

## (セグメント情報等)

### 1. セグメント情報

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

### 2. 関連情報

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

#### (1) サービスごとの情報

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

#### (2) 地域ごとの情報

##### 営業収益

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

##### 有形固定資産

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

#### (3) 主要な顧客ごとの情報

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

## (関連当事者情報)

### 1. 関連当事者との取引

#### (1) 親会社及び法人主要株主等

第33期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

該当はありません。

第34期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

該当はありません。

#### (2) 子会社及び関連会社等

第33期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

該当はありません。

第34期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

該当はありません。

## (3) 兄弟会社等

## 第33期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

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

## 第34期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

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

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

## 2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

## (1) 親会社情報

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

## (2) 重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません。

## (1株当たり情報)

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

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

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

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

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

## (1) 中間貸借対照表

(単位:千円)

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



(単位:千円)

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

## (2) 中間損益計算書

(単位：千円)

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

(単位:千円)

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

## (3) 中間株主資本等変動計算書

第35期中間会計期間（自 2019年4月1日 至 2019年9月30日）

	株主資本						
	資本金	資本剰余金			利益剰余金		
		資本準備金	その他 資本剰余金	資本剰余金 合計	利益 準備金	その他利益剰余金	
						別途 積立金	繰越利益 剰余金
当期首残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	31,680,000	14,146,079
当中間期変動額							
剰余金の配当							11,280,000
中間純利益							7,197,308
株主資本以外の項目の 当中間期変動額(純額)							
当中間期変動額 合計	-	-	-	-	-	-	4,082,691
当中間期末残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	31,680,000	10,063,387

	株主資本		評価・換算差額等		純資産 合計
	利益剰余金	株主資本 合計	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
	利益剰余金 合計				
当期首残高	45,949,372	67,502,329	846,755	846,755	68,349,085
当中間期変動額					
剰余金の配当	11,280,000	11,280,000			11,280,000
中間純利益	7,197,308	7,197,308			7,197,308
株主資本以外の項目の 当中間期変動額(純額)			405,643	405,643	405,643
当中間期変動額 合計	4,082,691	4,082,691	405,643	405,643	4,488,335
当中間期末残高	41,866,681	63,419,638	441,111	441,111	63,860,750

## 重要な会計方針

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 子会社株式及び関連会社株式 ：移動平均法による原価法</p> <p>(2) その他有価証券 時価のあるもの：中間決算日の市場価格等に基づく時価法 （評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定） 時価のないもの：移動平均法による原価法</p>
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
3. 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産 定率法を採用しております。 ただし、平成28年4月1日以降に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。 なお、主な耐用年数は次のとおりであります。 建物 … 6～18年 器具備品 … 2～20年</p> <p>(2) 無形固定資産 定額法を採用しております。 なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。</p>
4. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、中間決算日の直物等為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
5. 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金は、従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当中間会計期間に見合う分を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金は、役員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当中間会計期間に見合う分を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金は、従業員の退職給付に備えるため、退職一時金制度について、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。 退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 過去勤務費用については、その発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を費用処理しております。 数理計算上の差異については、各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年または10年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生の日翌事業年度から費用処理しております。</p> <p>(4) 時効後支払損引当金は、時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。</p>
6. 消費税等の会計処理	消費税及び地方消費税の会計処理は税抜き方式によっております。

## 注記事項

## （中間貸借対照表関係）

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

## （中間損益計算書関係）

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

## （中間株主資本等変動計算書関係）

第35期中間会計期間（自 2019年4月1日 至 2019年9月30日）

## 1.発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2.配当に関する事項

## （1）配当金支払額

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

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

## (金融商品関係)

第35期中間会計期間末(2019年9月30日現在)

## 金融商品の時価等に関する事項

2019年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは含まれておりません(注2)参照)。

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

## (注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

## (1) 現金・預金

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

## (2) 金銭の信託

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

## (3) 未収委託者報酬及び(4) 未収運用受託報酬

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

## (5) 有価証券及び投資有価証券

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

## 負債

## (1) 未払手数料

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

## (注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

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

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

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

## (有価証券関係)

第35期中間会計期間末

(2019年9月30日現在)

## 1. 子会社株式

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

## 2. その他有価証券

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

(注) 非上場株式(中間貸借対照表計上額259,369千円)については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。



## （企業結合等関係）

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

## 1. 結合当事企業

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

## 2. 企業結合日

2016年10月1日

## 3. 企業結合の方法

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

## 4. 結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

## 5. 企業結合の主な目的

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

## 6. 合併比率

「3. 企業結合の方法」の吸収合併における合併比率は以下の通りであります。

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

(\*) 普通株式と種類株式を合算して算定しております。

## 7. 交付した株式数

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

## 8. 経済的持分比率（議決権比率）

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

MHFGが企業結合日に追加取得した当社に対する経済的持分比率 20.00%

MHFGの追加取得後の当社に対する経済的持分比率 70.00%

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

## 9. 取得企業を決定するに至った主な根拠

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

## 10. 会計処理

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

## 11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

## (1) 中間財務諸表に含まれる被取得企業の業績の期間

2019年4月1日から2019年9月30日まで

## (2) 被取得企業の取得原価及びその内訳

取得の対価 MHAMの普通株式 144,212,500千円

取得原価 144,212,500千円

## (3) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

a. 発生したのれん金額 76,224,837千円

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

c. のれんの償却方法及び償却期間 20年間の均等償却

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

a. 資産の額 資産合計 40,451,657千円

うち現金・預金 11,605,537千円

うち金銭の信託 11,792,364千円

b. 負債の額 負債合計 9,256,209千円

うち未払手数料及び未払費用 4,539,592千円

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

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

a. 無形固定資産に配分された金額 53,030,000千円

## b. 主要な種類別の内訳

顧客関連資産 53,030,000千円

## c. 全体及び主要な種類別の加重平均償却期間

顧客関連資産 16.9年

## 12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

## (1) 貸借対照表項目

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

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

## (2) 損益計算書項目

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

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

## (資産除去債務関係)

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

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

## (セグメント情報等)

第35期中間会計期間(自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)

## 1.セグメント情報

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

## 2.関連情報

## (1)サービスごとの情報

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

## (2)地域ごとの情報

## 営業収益

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

## 有形固定資産

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

## (3)主要な顧客ごとの情報

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

## (1株当たり情報)

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

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

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。

## 5【その他】

## &lt;訂正前&gt;

## (1) 定款の変更、事業譲渡又は事業譲受、出資の状況その他の重要事項

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

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

## (2) 訴訟事件その他の重要事項

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

## &lt;訂正後&gt;

## (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】

&lt;訂正前&gt;

## (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

2018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SBI証券( )	48,323	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
楽天証券株式会社	7,495	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。

(注) 資本金の額は2018年3月末日現在

( ) 2019年7月26日より、募集の取扱いおよび販売を開始いたします。

&lt;訂正後&gt;

## (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SBI証券	48,323	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
楽天証券株式会社	7,495	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
マネックス証券株式会社	12,200	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。

松井証券株式会社	11,945	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
----------	--------	----------------------------------

(注) 資本金の額は2019年3月末日現在



## 独立監査人の監査報告書

令和1年11月21日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 長谷川 敬 印  
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているたわらノーロード 全世界株式の令和1年7月22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 全世界株式の令和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) XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。

[次へ](#)

## 独立監査人の監査報告書

2019年5月30日

アセットマネジメントOne株式会社  
取締役会 御中

## EY新日本有限責任監査法人

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

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

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

## 監査人の責任

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

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

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

## 監査意見

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

## 利害関係

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

以上

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

(注2) XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。

[次へ](#)

## 独立監査人の中間監査報告書

2019年11月28日

アセットマネジメントOne株式会社  
取締役会 御中

### EY新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	山野 浩 印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	長谷川 敬 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているアセットマネジメントOne株式会社の2019年4月1日から2020年3月31日までの第35期事業年度の中間会計期間(2019年4月1日から2019年9月30日まで)に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

#### 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

#### 監査人の責任

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

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

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

#### 中間監査意見

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

#### 利害関係

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

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

(注2) XBR Lデータは中間監査の対象には含まれておりません。