

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2020年2月7日提出
【発行者名】	アセットマネジメントOne株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 菅野 暁
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目8番2号
【事務連絡者氏名】	酒井 隆
【電話番号】	03-6774-5100
【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】	動的パッケージファンド<DC年金>
【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】	5,000億円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

(1)【ファンドの名称】

動的パッケージファンド<DC年金>(以下「当ファンド」といいます。)

(2)【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託の振替内国投資信託受益権(以下「受益権」と称することがあります。)です。

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

また、当ファンドについて、委託会社の依頼により、信用格付業者から提供され、若しくは閲覧に供された信用格付けまたは信用格付業者から提供され、若しくは閲覧に供される予定の信用格付けはありません。

(3)【発行(売出)価額の総額】

5,000億円を上限とします。

(4)【発行(売出)価格】

取得申込日の翌営業日の基準価額とします。

「基準価額」とは、ファンドの資産総額から負債総額を控除して求めた金額(純資産総額)を、計算日における受益権総口数で除した価額をいいます。ただし、便宜上1万口あたりに換算した価額で表示されることがあります。

基準価額については、委託会社にお問い合わせください。なお、委託会社に対する照会は下記においてできます。

照会先の名称	ホームページアドレス	電話番号
アセットマネジメントOne株式会社	http://www.am-one.co.jp/	0120-104-694

注：電話番号はコールセンターのもので(以下同じ)。

電話によるお問い合わせは、営業日の午前9時～午後5時までとさせていただきます。(以下同じ。)

(5)【申込手数料】

ありません。

(6)【申込単位】

1円以上1円単位

当初元本は1口当たり1円です。

(7) 【申込期間】

2020年2月8日から2020年8月7日まで

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

(8) 【申込取扱場所】

当ファンドの申込取扱場所（以下「販売会社」といいます。）については、下記の委託会社の照会先までお問い合わせください。

照会先の名称	ホームページアドレス	電話番号
アセットマネジメントOne株式会社	http://www.am-one.co.jp/	0120-104-694

(9) 【払込期日】

取得申込金額は、販売会社が定める期日までに、販売会社にお支払いいただきます。なお、取得申込金額には利息は付されません。

各取得申込日の発行価額の総額は、追加信託が行われる日に、販売会社により、アセットマネジメントOne株式会社（「委託者」または「委託会社」といいます。）の指定する口座を経由して、みずほ信託銀行株式会社（「受託者」または「受託会社」といいます。）の指定するファンド口座（受託会社が再信託している場合は、当該再信託受託会社の指定するファンド口座）に払い込まれます。

(10) 【払込取扱場所】

取得申込金額は、お申込みの販売会社にお支払いください。なお、払込取扱場所については、下記の委託会社の照会先までお問い合わせください。

照会先の名称	ホームページアドレス	電話番号
アセットマネジメントOne株式会社	http://www.am-one.co.jp/	0120-104-694

(11) 【振替機関に関する事項】

ファンドの受益権にかかる振替機関は以下の通りです。

株式会社証券保管振替機構

(12) 【その他】

投資信託振替制度における振替受益権について

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

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

投資信託振替制度（以下「振替制度」といいます。）においては、ファンドの受益権の発生、消滅、移転をコンピュータシステムにて管理します。ファンドの設定、解約、償還等がコンピュータシステム上の帳簿（「振替口座簿」といいます。）への記載・記録によって行われます。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

（1）【ファンドの目的及び基本的性格】

MHAM日本債券インデックスマザーファンド受益証券、MHAM外国債券インデックスマザーファンド受益証券、MHAM TOPIXマザーファンド受益証券およびMHAM外国株式インデックスマザーファンド受益証券（以下、各々を「主要投資対象マザーファンド受益証券」といいます。）への投資を通じて、国内外の公社債および株式に投資を行い、安定した収益の確保と信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

<ファンドの特色>

国内外の公社債・株式へ分散投資を行い、安定した収益の獲得を目指します。

国内債券、外国債券、国内株式および外国株式を主要投資対象とし、各資産のリスク（価格変動性）や、投資環境分析を勘案して配分比率を決定します。

資産配分比率は、リスク均等配分を基本としつつ、投資環境分析による各資産の魅力度判定に応じた機動的な変更を行うことで、安定した収益の獲得を目指します。

* ファンドの特色における「リスク」とは、各資産の価格変動やファンドの基準価額の振れ幅の大きさのことをいいます。

各資産およびファンド全体のリスクの状況を管理し、配分比率を調整することにより、基準価額の変動を抑制することを目指します。

各資産のリスク水準の変化に応じて、各資産への配分比率の変更を行います。また、ファンド全体での価格変動リスクが高いと判断した場合には、MHAM国内短期債券マザーファンド受益証券（以下、各主要投資対象マザーファンド受益証券を含め「マザーファンド受益証券」といいます。）への投資を通じて国内短期債券に投資することや、短期金融商品に直接投資することがあります。

外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

5,000億円を上限に信託金を追加することができます。なお、信託金の上限額については、受託会社と合意のうえ、変更することができます。

一般社団法人投資信託協会が定める分類方法において、以下のように分類・区分されます。

<商品分類>

・商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

・商品分類定義

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

< 属性区分 >

・ 属性区分表

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

1 当ファンドが投資信託証券への投資を通じて実質的な投資対象とする資産は、「資産複合(株式・債券)/資産配分変更型」です。

2 「為替ヘッジ」は、対円での為替変動リスクに対するヘッジの有無を記載しております。

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

・属性区分定義

その他資産 (投資信託証券)	目論見書又は投資信託約款において、主として「株式」、「債券」及び「不動産投信」以外の資産に投資する旨の記載があるものをいい、括弧内の記載はその該当資産を表す。
資産複合 (株式・債券) 資産配分変更型	目論見書又は投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行う旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないものをいう。なお、括弧内の記載はその該当複数資産を表す。 当ファンドは、主としてマザーファンド受益証券（投資信託証券）への投資を通じて、株式および債券に投資を行います。
年1回	目論見書又は投資信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいう。
グローバル (日本を含む)	目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が、日本を含む世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
ファミリーファンド	目論見書又は投資信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。）を投資対象として投資するものをいう。
為替ヘッジなし	目論見書又は投資信託約款において、為替のヘッジを行わない旨の記載があるもの又は為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいう。

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

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

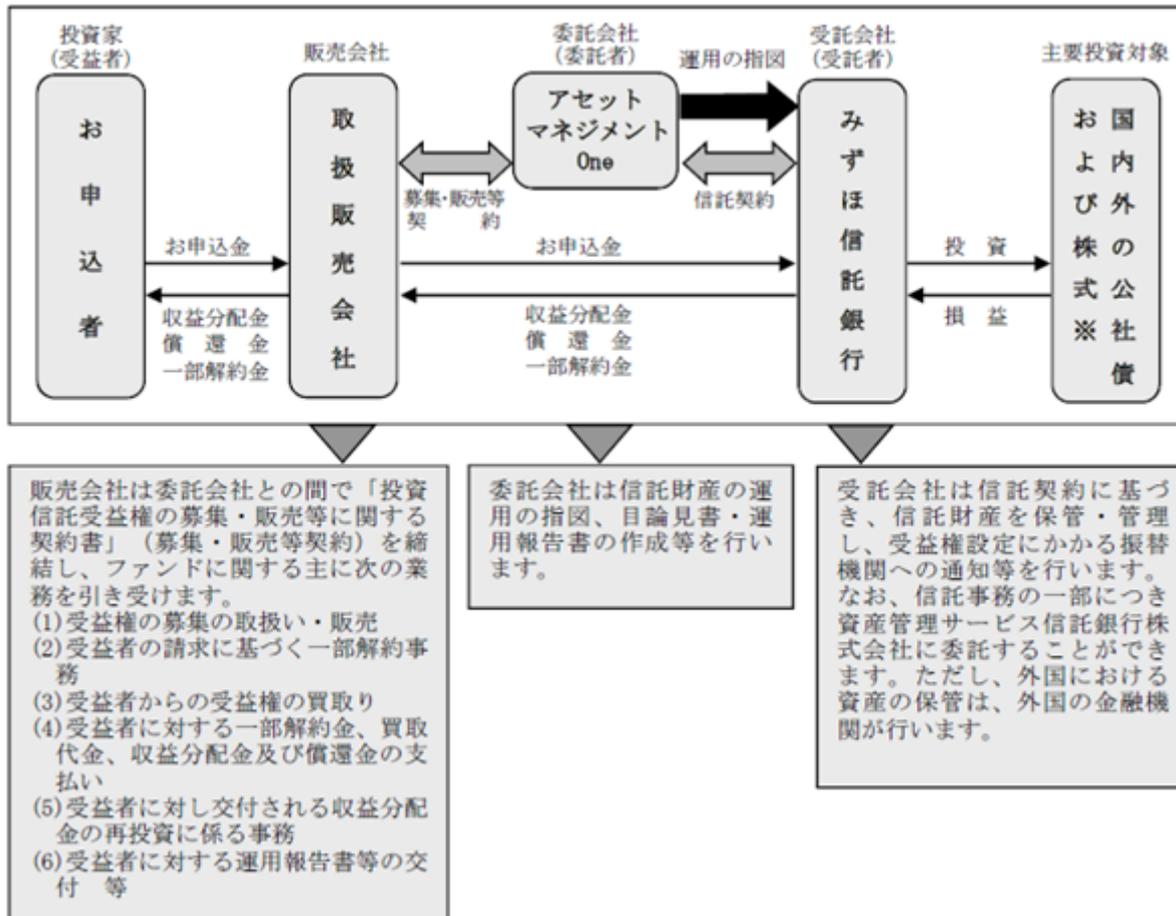
(注3) 当ファンドはマザーファンド受益証券（投資信託証券）への投資を通じて、株式および債券を主要投資対象とします。したがって、「商品分類」における投資対象資産と、「属性区分」における投資対象資産の分類・区分は異なります。

（２）【ファンドの沿革】

- 2015年11月30日 信託契約締結、当ファンドの設定・運用開始
- 2016年10月1日 ファンドの委託会社としての業務をみずほ投信投資顧問株式会社からアセットマネジメントOne株式会社に承継

（３）【ファンドの仕組み】

当ファンドの運営の仕組み

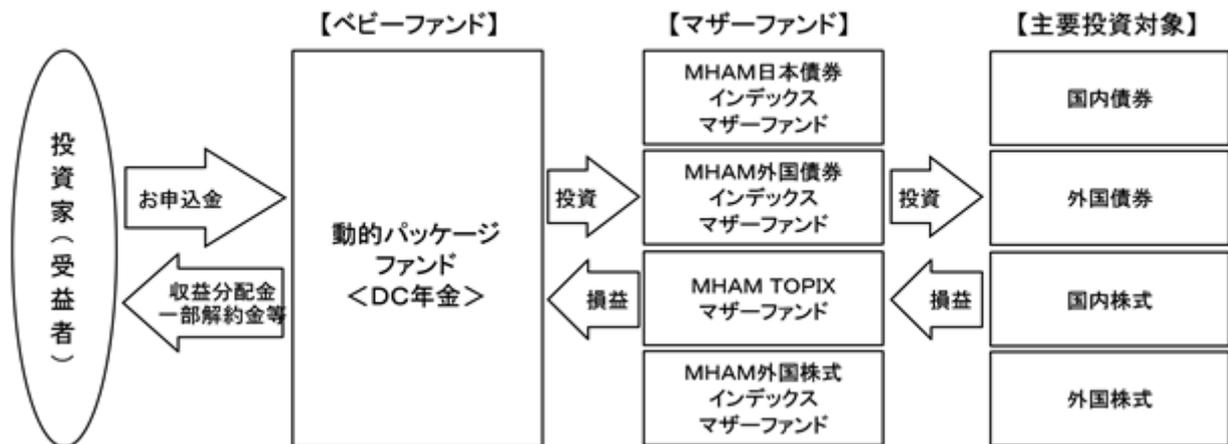


主要投資対象である国内外の公社債および株式には、主として、各マザーファンドを通じて投資を行います。

ファミリーファンド方式の仕組み

当ファンドは、下図のマザーファンドを通じて各資産への投資を行う「ファミリーファンド方式」で運用を行います。

ファミリーファンド方式



ファミリーファンド方式とは、投資家の皆様からお預かりした資金をまとめてベビーファンドとし、その資金をマザーファンドに投資することにより、その実質的な運用をマザーファンドにて行う仕組みです。

資産配分の決定の際、一部のマザーファンド受益証券への投資を行わない場合があります。また、ファンド全体のリスクの状況によっては、上記のマザーファンドを通じた投資のほか、MHAM国内短期債券マザーファンドを通じて国内短期債券に投資する場合や、信託財産の純資産総額の50%を上限に短期金融商品等へ直接投資する場合があります。

マザーファンドのほかに、株式、公社債等に直接投資する場合があります。

委託会社の概況

名称：アセットマネジメントOne株式会社

本店の所在の場所：東京都千代田区丸の内一丁目8番2号

資本金の額

20億円（2019年11月29日現在）

委託会社の沿革

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

大株主の状況

(2019年11月29日現在)

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

1：A種種類株式（15,510株）を含みます。

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

基本方針

この投資信託は、安定した収益の確保と信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

運用方法

1．主要投資対象

MHAM日本債券インデックスマザーファンド受益証券、MHAM外国債券インデックスマザーファンド受益証券、MHAM TOPIXマザーファンド受益証券およびMHAM外国株式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ます。

2. 投資態度

- a. 主として、各主要投資対象マザーファンド受益証券への投資を通じて、国内外の公社債および株式に投資を行います。
- b. 各主要投資対象マザーファンド受益証券への投資割合については、各マザーファンドが主要投資対象とする資産のリスク(価格変動性)や、投資環境分析等を勘案のうえ配分比率を決定します。ただし、ファンドの価格変動リスクを勘案し、MHAM国内短期債券マザーファンド受益証券への投資を行う場合、および信託財産の純資産総額の50%を上限に預金等の短期金融商品への直接投資を行う場合があります。
- c. 実質組入 外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。
「実質組入」とは、投資対象である当該資産につき、当ファンドの信託財産に属する当該資産の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該資産のうち当ファンドの信託財産に属するとみなした額との合計額をいいます。(以下同じ。)
- d. マザーファンド受益証券の組入比率は、高位を維持することを基本とします。
- e. 市況動向やファンドの資金事情等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

ファンドの投資プロセス

1. 当ファンドの投資プロセス

当ファンドは、以下の投資プロセスにより、各資産への投資割合を決定し、当ファンドを管理します。

各資産への配分比率は、特定の資産へのリスク集中回避を意図した「リスク均等配分」をベースに、投資環境分析やリスクの状況を踏まえて機動的に変更します。

STEP1

各資産のリスクを計測
⇒リスク均等配分となる
ベース配分比率を決定

STEP2

投資環境分析を実施
⇒ベース配分比率から
機動的に配分比率を変更

STEP3

リスクの管理
⇒リスクの状況により、
各資産の配分比率を変更

STEP4

ポートフォリオの構築

STEP1 各資産のリスクを計測

「国内債券」、「外国債券」、「国内株式」および「外国株式」の各資産について、リスクを計測し、ポートフォリオに対するリスク寄与度が均等（リスク均等配分）となるよう、ベース配分比率を決定します。

☞ 下記「[リスク均等配分とは](#)」をご参照ください。

STEP2 投資環境分析を実施

マクロ経済の各種指標から世界景気の状態（景気サイクル）を判定する「経済環境分析」と、金融市場の各種指標から金融市場の状態を判定する「市場環境分析」により、投資環境を分析します。この結果をもとに各資産の魅力度を判定し、魅力度に応じて各資産への配分比率をベース配分比率から機動的に変更します。

STEP3 リスクの管理

各資産およびファンド全体のリスクの状況を管理します。資産別のリスク水準の変化に応じて、配分比率の変更を行います。また、ファンド全体での価格変動リスクが高いと判断した場合には、各資産への配分比率を引き下げます[※]。

STEP4 ポートフォリオの構築

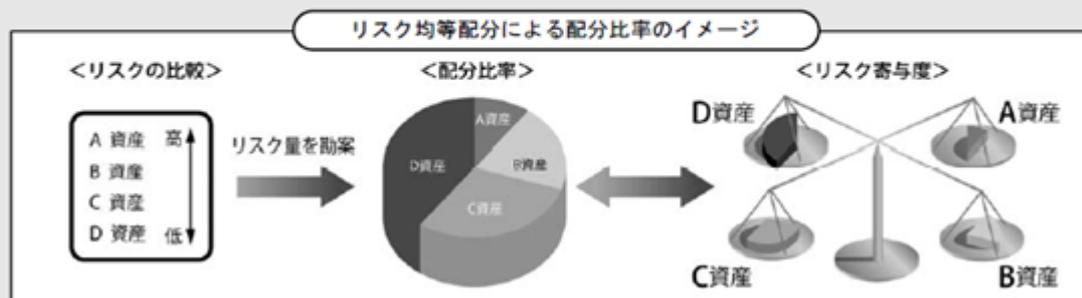
STEP1～3で決定した配分比率に従って、各資産への投資を行います。

※STEP3において各資産への配分比率の引き下げを行った場合、国内短期債券や短期金融商品への投資を行います。

上記のプロセスは、今後変更される場合があります。

☞ リスク均等配分とは

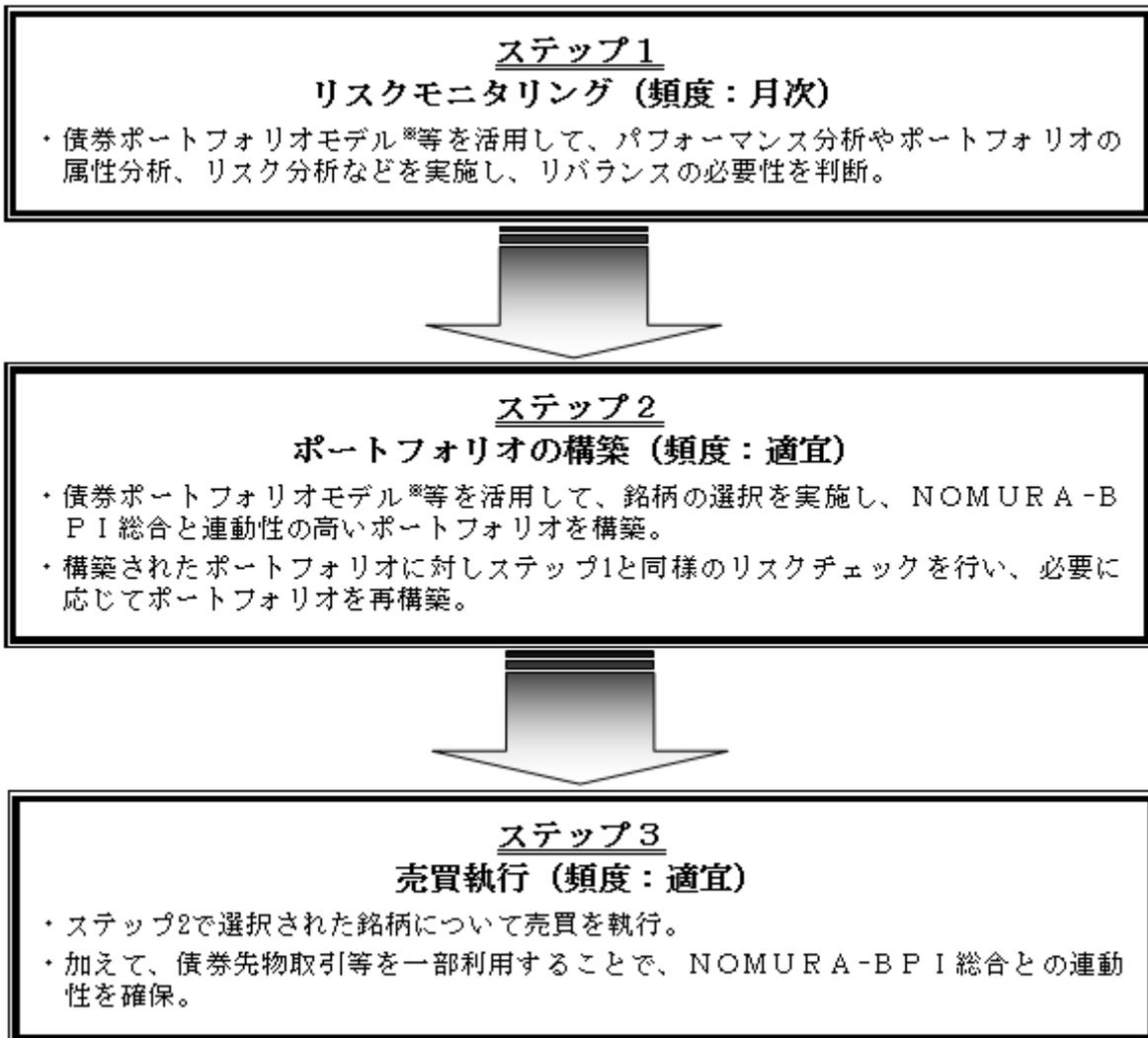
「リスク均等配分」とは、各資産のリスク（価格変動性）の大きさに着目した分散投資の方法で、リスクが相対的に高い資産の配分比率を低くし、リスクが相対的に低い資産の配分比率を高くすることにより、ファンドに対する各資産のリスク寄与度を均等にすることを旨とする投資手法です。これにより、リスクが高い資産の値動きがファンド全体の値動きに与える影響を抑える効果が期待されます。



※上記はイメージ図です。

2. 各マザーファンドの投資プロセス

<MHAM日本債券インデックスマザーファンドの投資プロセス>

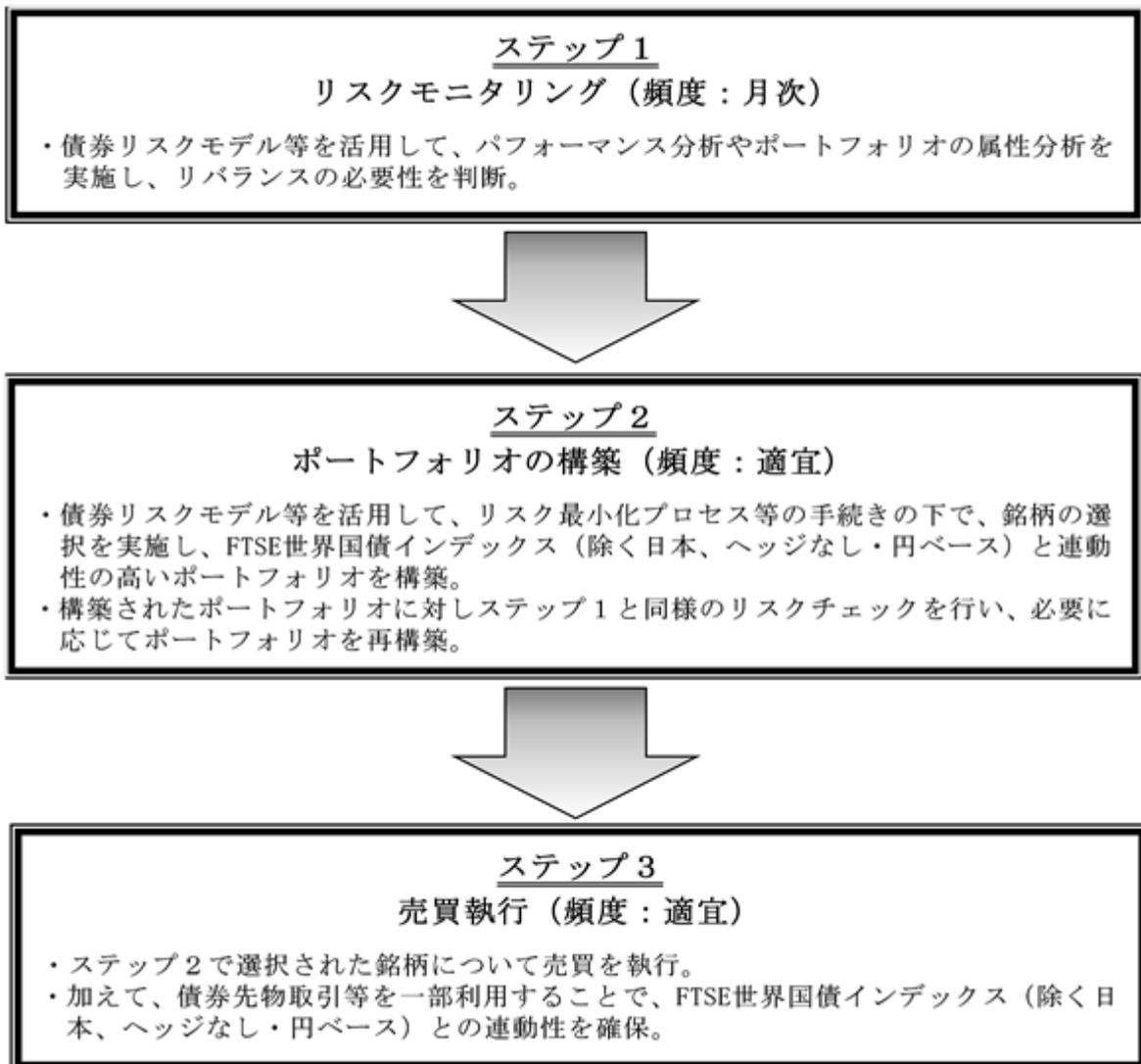


市況動向、設定・解約状況によっては弾力的に対処することがあります。また、モデルおよび使用するファクターについては、市場や経済の構造変化等に対応して、適宜見直しをすることがあります。

< 債券ポートフォリオモデルとは... >

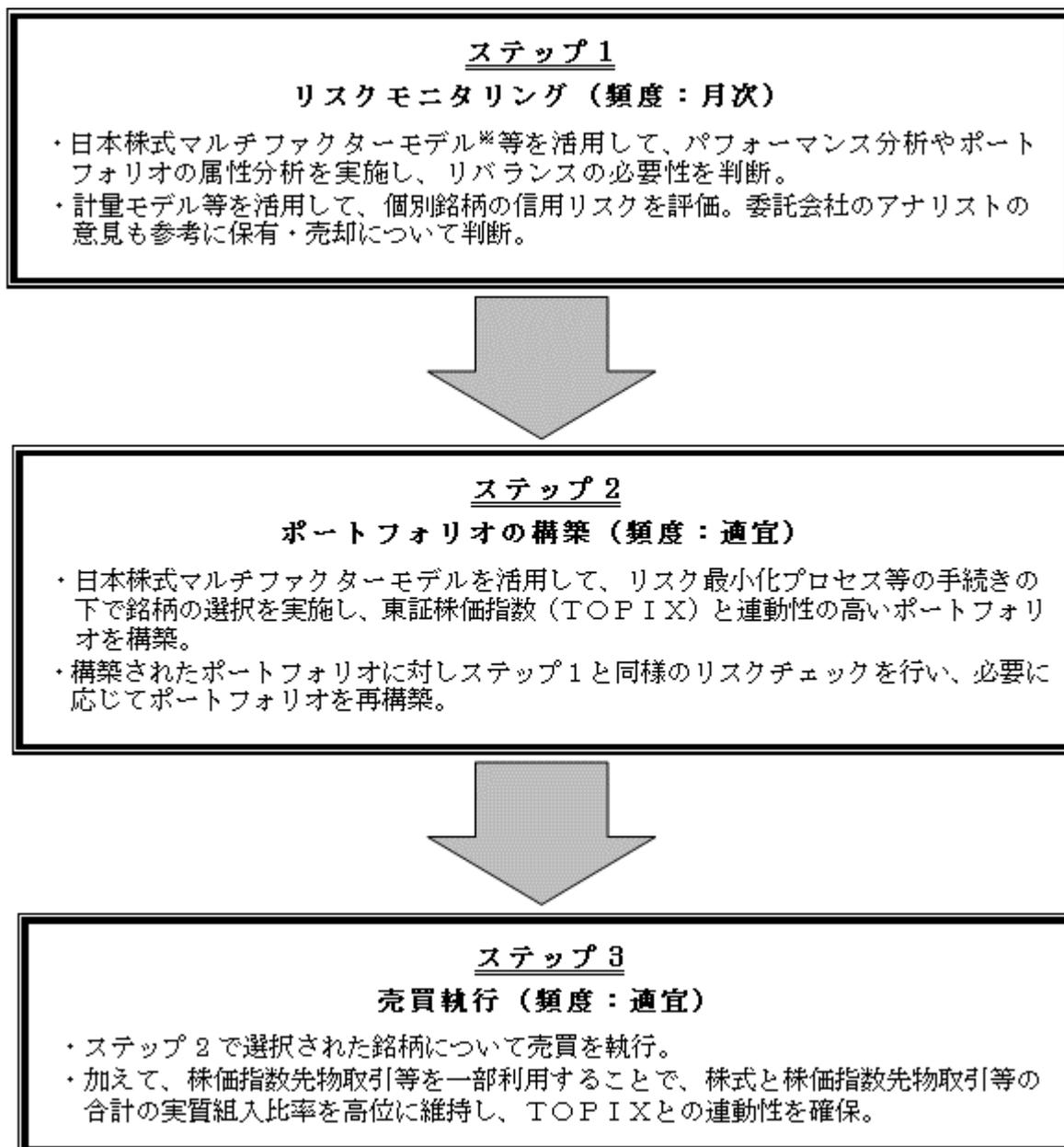
デュレーション、残存期間構成、コンベクシティ等の属性をコントロールしながら、対象指数に連動する銘柄群を効率的に選びだします。

< M H A M外国債券インデックスマザーファンドの投資プロセス >



市況動向、設定・解約状況によっては弾力的に対処することがあります。また、使用するモデル等については、市場や経済の構造変化等に対応して、適宜見直しをすることがあります。

<MHAM TOPIXマザーファンドの投資プロセス>



市況動向、設定・解約状況によっては弾力的に対処することがあります。また、使用するモデル等については、市場や経済の構造変化等に対応して、適宜見直しをすることがあります。

< 日本株式マルチファクターモデルとは... >

1988年に構築以来随時改良を加えている、アセットマネジメントOneが独自に開発した複数のリスクファクターによって株式のリターンを分解・説明するモデルです。これにより、TOPIX（東証株価指数）に連動する銘柄群を効率的に選び、定期的に銘柄群の見直しをすることによりTOPIXに対する連動性を高めます。

< M H A M外国株式インデックスマザーファンドの投資プロセス >

ステップ1**リスクモニタリング（頻度：月次）**

- ・ B A R R Aモデル*等を活用して、パフォーマンス分析やポートフォリオの属性分析を実施し、リバランスの必要性を判断。

**ステップ2****ポートフォリオの構築（頻度：適宜）**

- ・ B A R R Aモデル等を活用して、リスク最小化プロセス等の手続きの下で銘柄の選択を実施し、MSCIコクサイ・インデックス（円ベース・為替ヘッジなし）と連動性の高いポートフォリオを構築。
- ・ 構築されたポートフォリオに対しステップ1と同様のリスクチェックを行い、必要に応じてポートフォリオを再構築。

**ステップ3****売買執行（頻度：適宜）**

- ・ ステップ2で選択された銘柄について売買を執行。
- ・ 加えて、株価指数先物取引等を一部利用することで、MSCIコクサイ・インデックス（円ベース・為替ヘッジなし）との連動性を確保。

市況動向、設定・解約状況によっては弾力的に対処することがあります。また、使用するモデル等については、市場や経済の構造変化等に対応して、適宜見直しをすることがあります。

< B A R R Aモデルとは... >

米国バーラ社（現MSCI Inc.）が開発した、株価・債券価格の変動要因を説明する統計的モデルにより、ポートフォリオのリスク管理やパフォーマンス分析を行う投資分析ツールです。

< M H A M国内短期債券マザーファンドの投資プロセス >

ステップ1**ポートフォリオモニタリング（頻度：日次）**

有価証券比率や組入債券の残存期間等を確認し、売買の必要性を判断。

**ステップ2****ポートフォリオ構築（頻度：適宜）**

残存期間が1年以下の国債等の組入が高位となるように銘柄選択を実施。

なお、投資する個別債券の格付については、S&P グローバル・レーティング（S&P 社）、ムーディーズ・インベスターズ・サービス・インク（Moody's 社）、格付投資情報センター（R&I）、日本格付研究所（JCR）のいずれかの長期信用格付が「AA マイナス」格以上のものとする。

**ステップ3****売買執行（頻度：適宜）**

ステップ2で選択された銘柄について売買を執行。

市況動向、設定・解約状況によっては弾力的に対処することがあります。

（２）【投資対象】

投資の対象とする資産の種類

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- 1．次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。）
 - a．有価証券
 - b．デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第25条、第26条および第27条に定めるものに限りません。）
 - c．金銭債権
 - d．約束手形（a．に掲げるものに該当するものを除きます。）
- 2．次に掲げる特定資産以外の資産
 - a．為替手形

有価証券の指図範囲

委託会社は、信託金を、主として下記1．から下記5．までのアセットマネジメントOne株式会社を委託会社とし、みずほ信託銀行株式会社を受託会社として締結された親投資信託の受益証券を含む下記6．から下記27．までの有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

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

16. 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。)および新株予約権証券
 17. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前記1.から前記16.の証券または証書の性質を有するもの(外国の者の発行する証券または証書で、前記6.から前記11.の証券または証書の性質を有するプリファードセキュリティーズ(ハイブリッド型のプリファードセキュリティーズを含みます。)およびこれらに類するものを含みます。)
 18. 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
 19. 投資証券、投資法人債券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいい、プリファードセキュリティーズ(投資証券および投資法人債券のハイブリッド型のものを含みます。)に該当するものを含みます。)
 20. 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
 21. オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。)
 22. 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
 23. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 24. 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
 25. 抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)
 26. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
 27. 外国の者に対する権利で前記26.の有価証券の性質を有するもの
- なお、前記6.の証券または証書、前記17.および前記22.の証券または証書のうち前記6.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、前記7.から前記11.までの証券および前記17.ならびに前記22.の証券または証書のうち前記7.から前記11.までの証券の性質を有するものならびに前記19.の証券のうち投資法人債券および外国投資証券で投資法人債券に類する証券を以下「公社債」といい、前記18.の証券および前記19.の証券(投資法人債券および外国投資証券で投資法人債券に類する証券を除きます。)を以下「投資信託証券」といいます。

金融商品の指図範囲

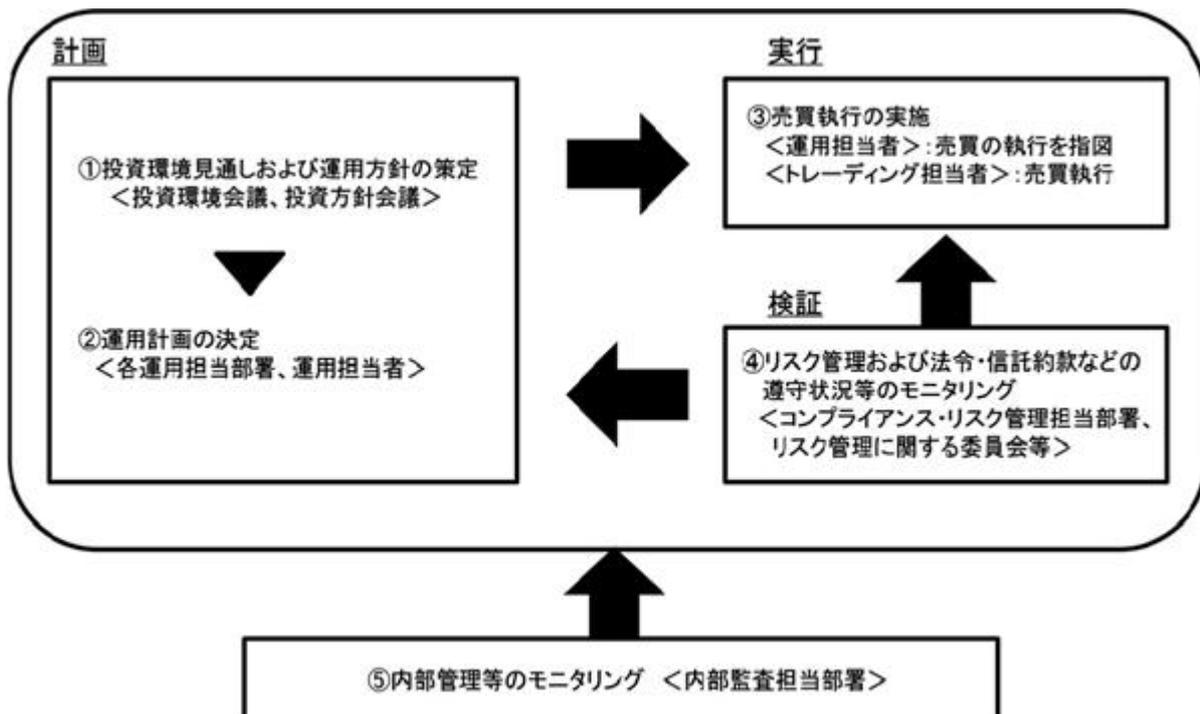
委託会社は、信託金を、 に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。)により運用することを指図することができます。また、 の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときには、委託会社は、信託金を、下記1.から下記4.までに掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

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

7. 金銭債権(ただし、流動性のあるプリファードセキュリティーズに該当するものに限り、前記1.から前記6.で該当するものならびに「有価証券の指図範囲」の17.および19.に定める証券または証書を除きます。)
8. 投資事業有限責任組合契約または有限責任事業組合契約に基づく権利その他の権利(金融商品取引法第2条第2項第5号に定めるものをいいます。)
9. 外国の法律に基づく権利であって前記8.に掲げる権利に類するもの(リミテッド・パートナーシップ(LP)(マスター・リミテッド・パートナーシップ(MLP)に該当するものを含みます。))を含みます。)
10. 合名会社もしくは合資会社の社員権または合同会社の社員権(金融商品取引法第2条第2項第3号で定めるものをいいます。)
11. 外国法人の社員権で前記10.に掲げる権利の性質を有するもの(リミテッド・ライアビリティ・カンパニー(LLC)(マスター・リミテッド・パートナーシップ(MLP)に該当するものを含みます。))を含みます。)
- なお、前記5.、前記6.および前記8.から前記11.までの権利等を以下「みなし有価証券」といいます。

(3) 【運用体制】

a. ファンドの運用体制



投資環境見通しおよび運用方針の策定

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

運用計画の決定

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

売買執行の実施

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

モニタリング

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

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

内部管理等のモニタリング

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

b. ファンドの関係法人に関する管理

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

c. 運用体制に関する社内規則

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

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

運用体制は2019年11月29日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

上記体制は、マザーファンドを通じた実質的な運用体制を記載しております。

(4) 【分配方針】

収益分配方針

毎計算期末(原則として5月8日。ただし、休業日の場合は翌日以降の最初の営業日)に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。

1. 分配対象額の範囲は、経費控除後の配当等収益（繰越分およびマザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち、信託財産に属するとみなした額（以下「みなし配当等収益」といいます。）を含みます。）および売買益（評価益を含み、みなし配当等収益を控除して得た額）等の全額とします。
2. 分配金額は、委託会社が基準価額の水準や市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。

3. 収益分配に充てなかった利益については、運用の基本方針に基づいて運用を行います。
将来の収益分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

収益分配金の再投資

1. 収益分配金は、原則として毎計算期間終了日の翌営業日に、受託会社が委託会社の指定する預金口座等に払い込むことにより、販売会社に交付されます。
2. 販売会社は、分配金自動けいぞく投資に関する契約に基づき、受益者に対し遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の売付けを行い、当該再投資にかかる売付けにより増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

(5) 【投資制限】

a. 約款で定める投資制限

株式、新株引受権証券および新株予約権証券(約款 運用の基本方針 運用方法(3) 投資制限、約款第17条および約款第20条)

1. 株式への実質投資割合 には制限を設けません。
「実質投資割合」とは、投資対象である当該資産につき、当ファンドの信託財産に属する当該資産の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該資産のうち当ファンドの信託財産に属するとみなした額との合計額の当ファンドの信託財産の純資産総額に対する割合をいいます。(以下同じ。)
2. 委託会社は、新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合が、信託財産の純資産総額の100分の20を超えることとなる投資の指図をしません。
3. 同一銘柄の株式への実質投資割合には制限を設けません。
4. 同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合には制限を設けません。
5. 委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、取引所(金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号に規定する外国金融商品市場をいいます。以下同じ。)に上場されている株式の発行会社の発行するものおよび取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとし、ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。なお、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、委託会社が投資することを指図することができるものとします。

みなし有価証券(約款第17条)

委託会社は、みなし有価証券への実質投資割合が、信託財産の純資産総額の100分の50以上となる投資の指図をしません。

投資信託証券(約款第17条)

委託会社は、投資信託証券(マザーファンド受益証券および取引所金融商品市場(金融商品取引法第2条第17項に規定する金融商品市場をいいます。)または外国金融商品市場に上場等(不動産投資信託証券については、予定を含みます。以下同じ。)され、かつこれらの市場において常時売却可能(市場の急変等により一時的に流動性が低下している場合を除きます。)な投資信託証券(以下「上場投資信託証券」といいます。)を除きます。)への実質投資割合が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

転換社債等（約款第21条）

委託会社は、同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合が、信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

外貨建資産（約款 運用の基本方針 運用方法(3)投資制限および約款第31条）

外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。ただし、外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

外国為替予約（約款第32条）

委託会社は、信託財産に属する外貨建資産とマザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額（信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。）との合計額について、当該外貨建資産の為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約を指図することができます。

信用リスク集中回避のための投資制限（約款第22条）

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

デリバティブ取引等（約款 運用の基本方針 運用方法(3)投資制限、約款第23条）

委託会社は、デリバティブ取引等（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、新株予約権証券、新投資口予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引、選択権付債券売買および商品投資等取引（投資信託及び投資法人に関する法律施行令第3条第10号に規定するものをいいます。）を含みます。（ただし、この信託において取引可能なものに限り、以下同じ。））について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

信用取引（約款第24条）

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

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

有価証券先物取引等(約款第25条)

1. 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。)ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします(以下同じ。)
2. 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに為替変動リスクを回避するため、わが国の取引所における通貨に係る先物取引ならびに外国の取引所における通貨に係る先物取引およびオプション取引を行うことの指図をすることができます。
3. 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における金利に係る先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

スワップ取引(約款第26条)

1. 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行うことの指図をすることができます。
2. スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として当ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
3. スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
4. 委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供または受入れが必要と認めるときは、担保の提供または担保の受入れの指図を行うものとします。

金利先渡取引および為替先渡取引(約款第27条)

1. 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。
2. 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として当ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
3. 金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
4. 委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供または受入れが必要と認めるときは、担保の提供または担保の受入れの指図を行うものとします。

有価証券の貸付（約款第28条）

1. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を以下の範囲内で貸付の指図をすることができます。
 - a. 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
 - b. 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
2. 前記1. に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかにその超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
3. 委託会社は、有価証券の貸付にあたって必要と認めたときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

公社債の空売り（約款第29条）

1. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、公社債（信託財産により借入れた公社債を含みます。）の引き渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
2. 前記1. の売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
3. 信託財産の一部解約等の事由により、前記2. の売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかにその超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。

公社債の借入れ（約款第30条）

1. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めたときは、担保の提供の指図を行うものとします。
2. 前記1. の指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
3. 信託財産の一部解約等の事由により、前記2. の借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。
4. 前記1. の借入れにかかる品借料は信託財産中から支弁します。

資金の借入れ（約款第38条）

1. 委託会社は、信託財産の効率的な運用および運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
2. 一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から

信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金等および償還金の合計額を限度とします。ただし、資金借入額は、借入指図を行う日における信託財産の純資産総額の10%を上回らない範囲内とします。

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

4. 借入金の利息は信託財産中より支弁します。

b. 法令で定める投資制限

同一の法人の発行する株式の取得割合(投資信託及び投資法人に関する法律第9条)

委託会社は、同一の法人の発行する株式を、運用の指図を行うすべての委託者指図型投資信託につき投資信託財産として有する当該株式にかかる議決権の総数が、当該株式にかかる議決権の総数に100分の50の率を乗じて得た数を超えることとなる場合においては、信託財産をもって取得することを受託会社に指図しないものとします。

<各マザーファンドの投資方針および主な投資制限>

「MHAM日本債券インデックスマザーファンド」

1. 基本方針

この投資信託は、NOMURA-BPI総合の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

NOMURA-BPI総合とは、野村證券株式会社が、国内で発行された公募利付債券の流通市場全体の動向を的確に表すために開発した経過利子込時価総額加重型の投資収益指数です。NOMURA-BPI総合は、銘柄種別・残存年数別に分類した各セクターポートフォリオに対して、それぞれの投資収益指数が用意され、一定の組入基準にもとづいて構成されたインデックス・ポートフォリオのパフォーマンスをもとに計算され、機関投資家に広く認知されています。NOMURA-BPI総合の知的財産権その他一切の権利は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。

2. 運用方法

(1) 投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

（２）投資態度

主として、わが国の公社債に投資を行い、NOMURA-BPI総合の動きに連動する投資成果を目指します。

公社債の組入比率は、高位を維持することを基本とします。

運用の効率化をはかるため、債券先物取引等を活用することがあります。このため、公社債の組入時価総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が信託財産の純資産総額を超えることがあります。

市況動向やファンドの資金事情等によっては、上記のような運用が行えない場合があります。

（３）投資制限

株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限り、）の行使、株主割当または社債権者割当により取得したものに限り行えるものとし、その投資割合は信託財産の純資産総額の10%以下とします。

同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資は行いません。

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

「MHAM外国債券インデックスマザーファンド」

1．基本方針

この投資信託は、FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）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。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

2．運用方法

（１）投資対象

FTSE世界国債インデックス（除く日本）に採用されている国・地域の公社債を主要投資対象とします。

（２）投資態度

主として、FTSE世界国債インデックス（除く日本）に採用されている国・地域の公社債に投資を行い、FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の動きに連動する投資成果を目指します。

公社債の組入比率は、高位を維持することを基本とします。

運用の効率化をはかるため、債券先物取引等を活用することがあります。このため、公社債の組入時価総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が信託財産の純資産総額を超えることがあります。

外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

市況動向やファンドの資金事情等によっては、上記のような運用が行えない場合があります。

(3) 投資制限

株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権(転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限り、)の行使、株主割当または社債権者割当により取得したものに限り行えるものとし、その投資割合は信託財産の純資産総額の10%以下とします。

同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

外国為替の売買の予約取引は、約款第30条の範囲で行います。

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

「MHAM TOPIXマザーファンド」

1. 基本方針

この投資信託は、わが国の株式を中心に投資を行い、東証株価指数(TOPIX)と連動する投資成果を目標として運用を行います。

東証株価指数(TOPIX=Tokyo Stock Price Index)とは、東京証券取引所第一部全銘柄を対象とした株価指数で、基準時(1968年1月4日終値)の時価総額を100として、その後の時価総額を指数化したものです。

- *1 TOPIXの指数値およびTOPIXの商標は、株式会社東京証券取引所(以下「株東京証券取引所」といいます。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利・ノウハウおよびTOPIXの商標に関するすべての権利は株東京証券取引所が有しています。
- *2 株東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出もしくは公表の方法の変更、TOPIXの指数値の算出もしくは公表の停止またはTOPIXの商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。
- *3 株東京証券取引所は、TOPIXの指数値およびTOPIXの商標の使用に関して得られる結果ならびに特定日のTOPIXの指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。
- *4 株東京証券取引所は、TOPIXの指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、株東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。
- *5 MHAM TOPIXマザーファンドおよびMHAM TOPIXマザーファンドに投資するファンドは、株東京証券取引所により提供、保証または販売されるものではありません。
- *6 株東京証券取引所は、MHAM TOPIXマザーファンドおよびMHAM TOPIXマザーファンドに投資するファンドの購入者または公衆に対し、MHAM TOPIXマザーファンドおよびMHAM TOPIXマザーファンドに投資するファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を持ちません。
- *7 株東京証券取引所は、委託会社またはMHAM TOPIXマザーファンドおよびMHAM TOPIXマザーファンドに投資するファンドの購入者のニーズを、TOPIXの指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。
- *8 以上の項目に限らず、株東京証券取引所はMHAM TOPIXマザーファンドおよびMHAM TOPIXマザーファンドに投資するファンドの発行または売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を負いません。

2. 運用方法

（１）投資対象

東京証券取引所第一部に上場されている株式を主要投資対象とします。

（２）投資態度

現物株への投資よりＴＯＰＩＸ先物等を活用する方が有利と認められるときは、ＴＯＰＩＸ先物等を活用することがあります。

株価指数等の先物取引を含む株式の実質組入比率は、原則信託財産の純資産総額の範囲内となるよう運用を行います。一時的に株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が信託財産の純資産総額を超えることがあります。

組入対象銘柄は、東京証券取引所第一部上場株式とします。ただし、流動性に著しく欠ける銘柄や信用リスクが高いと判断される銘柄等は組入れません。

上記 から について、市況動向、設定・解約状況によっては弾力的に対処することがあります。

（３）投資制限

株式の組入比率には、制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行いません。

新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。

同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

有価証券先物取引等は約款第15条の範囲で行います。

スワップ取引は約款第16条の範囲で行います。

金利先渡取引は約款第17条の範囲で行います。

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

「MHAM外国株式インデックスマザーファンド」

1．基本方針

この投資信託は、MSCIコクサイ・インデックス（円ベース・為替ヘッジなし）^{1、2}の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

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

ファンドの換算対価の決定もしくは計算について責任を負うものではなく、また、関与もしていません。

また、MSCI関係者は、本ファンドの発行会社もしくは所有者、またはその他の者もしくは団体に対して、本ファンドの管理、マーケティングまたは募集に関するいかなる義務または責任も負いません。

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

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

2 税引き前配当再投資ベースとします（以下同じ。）。

2. 運用方法

(1) 投資対象

MSCIコクサイ・インデックスを構成している国（地域を含みます。）の株式を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

主として、MSCIコクサイ・インデックスを構成している国（地域を含みます。）の株式に投資を行い、MSCIコクサイ・インデックス（円ベース・為替ヘッジなし）の動きに連動する投資成果を目指します。

株式の組入比率は、高位を維持することを基本とします。

運用の効率化をはかるため、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の組入時価総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が信託財産の純資産総額を超えることがあります。

外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

市況動向やファンドの資金事情等によっては、上記のような運用が行えない場合があります。

(3) 投資制限

株式への投資割合には、制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以下とします。

同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。（ただし、MSCIコクサイ・インデックスを構成している株式を除きます。）

同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外国為替の売買の予約取引は、約款第29条の範囲で行います。

みなし有価証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の50%未満とします。

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

「MHAM国内短期債券マザーファンド」

1. 基本方針

この投資信託は、主としてわが国の短期の国債、地方債、政府保証債、金融債等(以下「国債等」といいます。)に投資を行い、安定した収益の確保と信託財産の着実な成長を目指して運用を行います。

2. 運用方法

(1) 投資対象

この投資信託は、わが国の短期の国債等を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

わが国の短期の国債等を主要投資対象とし、安定した収益の確保と信託財産の着実な成長を目指します。

投資する個別債券の格付については、S&Pグローバル・レーティング(S&P社)、ムーディーズ・インベスターズ・サービス・インク(Moody's社)、格付投資情報センター(R&I)、日本格付研究所(JCR)のいずれかの長期信用格付が「AAマイナス」格以上のものとします。

投資する個別債券の残存期間については、原則として1年以下とします。

市場動向および資金動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、通貨に係る先物オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。

(3) 投資制限

株式(新株引受権証券を含みます。)への投資は行いません。

同一発行体が発行する有価証券への投資割合は、国債、地方債、特別の法律により法人の発行する債券を除き、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

同一銘柄の転換社債等への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

外貨建資産への投資は行いません。

有価証券先物取引等は、約款第19条の範囲で行います。

スワップ取引は、約款第20条の範囲で行います。

金利先渡取引は、約款第21条の範囲で行います。

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

た場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

3【投資リスク】

(1) 当ファンドにおける主として想定されるリスクと収益性に与える影響度合い

- ・当ファンドは、主として各マザーファンド受益証券への投資を通じて値動きのある有価証券等（外貨建資産には為替変動リスクもあります。）に投資しますので、ファンドの基準価額は変動します。したがって、元本や一定の投資成果が保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被ることがあります。
- ・運用により信託財産に生じた利益および損失は、すべて受益者の皆様に帰属します。
- ・投資信託は預金商品や保険商品ではなく、預金保険、保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。
- ・登録金融機関が取扱う投資信託は、投資者保護基金の対象ではありません。
- ・投資信託は預貯金とは異なります。
- ・当ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用はありません。

当ファンドにおいて主として想定されるリスクは以下の通りですが、基準価額の変動要因はこれらに限定されるものではありません。

なお、以下のリスクは、主にマザーファンドを通じて当ファンドが行う有価証券等への投資により発生します。

資産配分リスク

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

資産配分リスクとは、複数資産への投資（資産配分）を行った場合に、投資成果の悪い資産への配分が大きかったため、投資全体の成果も悪くなってしまうリスクをいいます。

一般に、投資に際して資産配分を行う場合には、そのうちの1資産の価値変動が投資全体の成果に及ぼす影響度合いを小さくする効果が期待されますが、その場合にも、それぞれの資産の価値変動は、当該資産への資産配分の比率に応じて、投資全体の成果に影響を及ぼします。当ファンドは、国内外の公社債および株式に資産配分を行いますが、配分比率が高い資産の価値が下落した場合や、複数の資産の価値が同時に下落した場合等には、当ファンドの基準価額が下落する可能性があります。

金利変動リスク

金利の上昇（公社債の価格の下落）は、基準価額の下落要因となります。

金利変動リスクとは、金利変動により公社債の価格が下落するリスクをいいます。

一般に金利が上昇した場合には、既に発行されて流通している公社債の価格は下落します。金利上昇は、当ファンドが投資する公社債の価格に影響を及ぼし、当ファンドの基準価額を下落させる要因となります。また、金利変動により株式市場と公社債市場の間で資金シフトが起こる場合があり、その場合、金利変動の影響は株式市場にも及びます。

株価変動リスク

投資する企業の株価の下落は、基準価額の下落要因となります。

株価変動リスクとは、株式市場および投資先となっている企業の株価が下落するリスクをいいます。

当ファンドが投資する企業の株価が下落した場合には、当ファンドの基準価額が下落する要因となります。また、当ファンドが投資する企業が業績悪化や倒産等に陥った場合には、当該企業の株価が大きく下落することや無くなることもあり、当ファンドの基準価額に大きな影響を及ぼすことがあります。

為替変動リスク

為替相場の円高は、基準価額の下落要因となります。

為替変動リスクとは、為替変動により外貨建資産の円換算価格が下落するリスクをいいます。当ファンドでは、外貨建資産への投資にあたり、原則として為替ヘッジを行わないため、投資対象通貨と円との外国為替相場が円高となった場合には、当ファンドの基準価額が下落する要因となります。

信用リスク

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

信用リスクとは、公社債等の発行体が財政難、経営不振、その他の理由により、利息や償還金をあらかじめ決められた条件で支払うことができなくなる（債務不履行）リスクをいいます。

一般に債務不履行が生じた場合、またはその可能性が高まった場合には、当該発行体が発行する公社債および短期金融商品（コマーシャル・ペーパー等）の価格は下落します。また、当該発行体が企業の場合には、一般にその企業の株価が下落する要因となります。当ファンドが投資する公社債等の発行体や株式の発行企業がこうした状況に陥った場合には、当ファンドの基準価額が下落する要因となる可能性があります。

流動性リスク

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

流動性リスクとは、有価証券を売却（または購入）しようとする際に、需要（または供給）がないため、有価証券を希望する時期に、希望する価格で売却（または購入）することができなくなるリスクをいいます。

一般に規模が小さい市場での売買や、取引量の少ない有価証券の売買にあたっては、流動性リスクへの留意が特に必要とされます。また、一般に市場を取り巻く外部環境の急変があった場合には、市

場実勢価格での売買ができなくなる可能性が高まります。当ファンドが投資する株式・公社債等の流動性が損なわれた場合には、当ファンドの基準価額が下落する要因となる可能性があります。

カントリーリスク

投資する国・地域の政治・経済の不安定化等は、基準価額の下落要因となります。

カントリーリスクとは、投資先となっている国(地域)の政治・経済・社会・国際関係等が不安定な状態、あるいは混乱した状態等に陥った場合に、当該国における資産価値や当該国通貨の価値が下落するリスクをいいます。

当ファンドの投資先となっている国(地域)がこうした状態に陥った場合には、当ファンドの基準価額が下落する要因となる可能性があります。

<その他>

- ・有価証券の貸付等においては、取引相手先の倒産等による決済不履行リスクを伴います。
- ・投資対象国において、税制、決済ルールの変更などにより税金や費用が新たに発生した場合や、外国為替取引規制や外国からの投資規制の実施などがあった場合は、当ファンドの基準価額に影響を与える場合があります。
- ・当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行います。当該方式は、運用の効率化に資するものですが、一方で、当ファンドが投資対象とするマザーファンドに対し、他のベビーファンドにより多額の追加設定・一部解約等がなされた場合には、マザーファンドにおける売買ならびに組入比率の変化等により、当ファンドの基準価額や運用に影響を受ける場合があります。
- ・当ファンドは、一部解約の実行の請求金額が多額な場合や取引所等における取引の停止等があるときには、一部解約の実行の請求の受け付けを中止すること、およびすでに受け付けた一部解約の実行の請求の受け付けを取り消すことがあります。

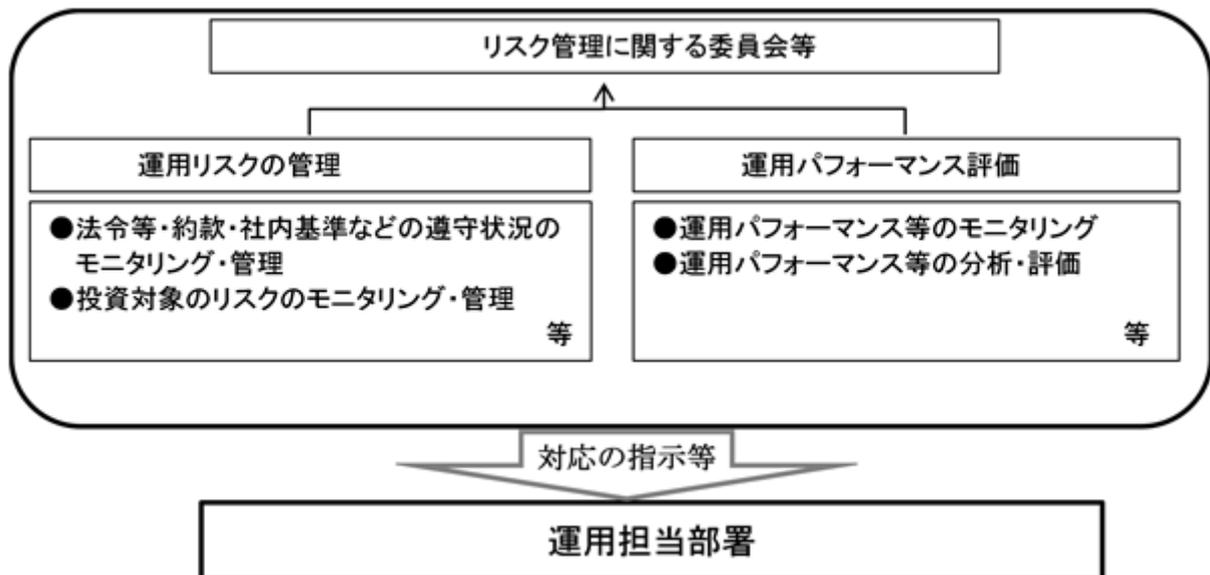
<収益分配金に関する留意点>

- ・投資信託の分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。
- ・分配金は、計算期間中に発生した収益(経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益)を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。
- ・投資家(受益者)のファンドの取得価額によっては、分配金の一部または全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド取得後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりが小さかった場合も同様です。

(2) リスク管理体制

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

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



リスク管理体制は2019年11月29日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

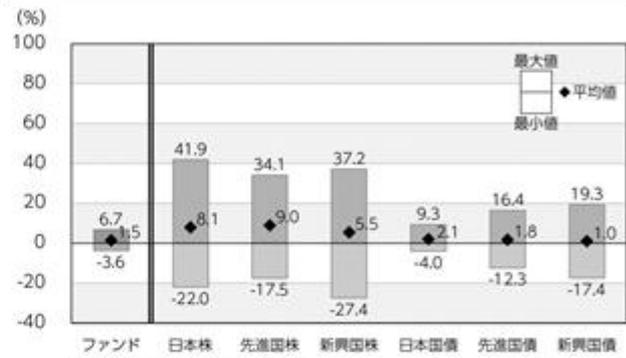
<参考情報>

ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



2014年12月 2015年12月 2016年12月 2017年12月 2018年12月 2019年11月

ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



ファンド:2016年11月~2019年11月

代表的な資産クラス:2014年12月~2019年11月

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

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

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

*全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

各資産クラスの指数

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

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

ありません。

(2)【換金（解約）手数料】

ありません。

(3)【信託報酬等】

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年0.649%（税抜0.59%）の率を乗じて得た額とします。

信託報酬の配分（税抜）については、以下の通りとします。

委託会社	販売会社	受託会社
0.38%	0.18%	0.03%

信託報酬は、毎日計上（ファンドの基準価額に反映）され、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日および毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁するものとします。なお、信託報酬にかかる消費税ならびに地方消費税に相当する金額（以下「消費税等相当額」といいます。）を信託報酬支弁の時に信託財産中から支弁します。

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率

< 信託報酬等を対価とする役務の内容 >

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

(4)【その他の手数料等】

信託財産に関する租税、特定資産の価格等の調査に要する費用および当該費用に係る消費税等相当額、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産の財務諸表の監査に要する費用および当該費用に係る消費税等相当額、外国における資産の保管等に要する費用、信託財産に属する資産のデフォルト等の発生に伴う諸費用、受託会社の立替えた立替金の利息および資金の借入れを行った際の当該借入金の利息は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。なお、信託財産の財務諸表の監査に要する費用は、毎日計上（ファンドの基準価額に反映）され、当該費用に係る消費税等相当額とともに毎計算期間の最初の6ヵ月終了日および毎計算期末または信託終了のとき、信託財産中から支弁します。

当ファンドの組入有価証券の売買時の売買委託手数料、先物・オプション取引等に要する費用およびこれら手数料ならびに費用にかかる消費税等相当額は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

上記、 の手数料等（借入金の利息および財務諸表の監査に要する費用を除きます。）については、当ファンドが投資対象とするマザーファンドにおいて発生する場合、マザーファンドの信託財産

中から支弁されます。これらはマザーファンドの基準価額に反映されるため、結果として当ファンドの受益者が間接的に負担することとなります。

(5) 【課税上の取扱い】

当ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

個人の受益者に対する課税

収益分配時

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

詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

解約時および償還時

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

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

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

損益通算について

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

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

法人の受益者に対する課税

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

なお、益金不算入制度の適用はありません。

外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。

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

上記は、2019年11月末現在のもので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。

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

個別元本方式について

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

< 個別元本について >

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

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

ただし、同一ファンドの受益権を複数の販売会社で取得する場合には販売会社毎に個別元本の算出が行われます。また、同一販売会社であっても複数支店等で同一ファンドの受益権を取得する場合は当該支店等毎に、個別元本の算出が行われる場合があります。

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

< 収益分配金の課税について >

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

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

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

税法が改正された場合等は、上記内容が変更になることがあります。

5【運用状況】

(1)【投資状況】

令和1年11月29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	456,509,099	98.51
内 日本	456,509,099	98.51
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	6,897,014	1.49
純資産総額	463,406,113	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）

MHAM日本債券インデックスマザーファンド

令和1年11月29日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	103,203,946,450	82.84
内 日本	103,203,946,450	82.84
地方債証券	7,308,438,581	5.87
内 日本	7,308,438,581	5.87
特殊債券	8,456,615,054	6.79
内 日本	8,456,615,054	6.79
社債券	5,205,251,600	4.18
内 日本	4,904,584,600	3.94
内 フランス	300,667,000	0.24
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	403,124,508	0.32
純資産総額	124,577,376,193	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。

MHAM外国債券インデックスマザーファンド

令和1年11月29日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	27,514,246,075	96.55
内 アメリカ	13,528,106,131	47.47
内 フランス	2,772,208,497	9.73
内 イタリア	2,291,164,051	8.04
内 イギリス	1,695,046,768	5.95
内 ドイツ	1,650,941,562	5.79
内 スペイン	1,509,973,678	5.30
内 ベルギー	672,208,574	2.36
内 オーストラリア	551,691,425	1.94
内 オランダ	520,374,337	1.83
内 カナダ	502,347,093	1.76
内 オーストリア	434,076,375	1.52
内 メキシコ	219,457,371	0.77
内 フィンランド	211,588,026	0.74
内 アイルランド	209,947,854	0.74
内 南アフリカ	149,989,233	0.53
内 デンマーク	132,332,527	0.46
内 ポーランド	131,366,992	0.46
内 シンガポール	109,625,922	0.38
内 マレーシア	88,460,191	0.31
内 スウェーデン	73,641,890	0.26
内 ノルウェー	59,697,578	0.21
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	981,716,948	3.45
純資産総額	28,495,963,023	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。

MHAM TOPIXマザーファンド

令和1年11月29日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	48,197,315,080	97.67
内 日本	48,197,315,080	97.67
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	1,151,038,256	2.33
純資産総額	49,348,353,336	100.00

その他資産の投資状況

令和1年11月29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）	1,153,960,000	2.34
内 日本	1,153,960,000	2.34

（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。

MHAM外国株式インデックスマザーファンド

令和1年11月29日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	35,493,069,895	92.84
内 アメリカ	23,343,737,670	61.06
内 イギリス	2,091,639,877	5.47
内 カナダ	1,361,259,932	3.56
内 フランス	1,341,781,154	3.51
内 スイス	1,329,886,395	3.48
内 ドイツ	1,148,225,373	3.00
内 オーストラリア	824,015,502	2.16
内 オランダ	696,669,930	1.82
内 アイルランド	675,648,733	1.77
内 スペイン	370,877,360	0.97
内 香港	329,706,374	0.86
内 スウェーデン	323,857,668	0.85
内 イタリア	256,854,202	0.67
内 デンマーク	240,370,207	0.63
内 シンガポール	156,691,042	0.41
内 フィンランド	146,018,628	0.38
内 バミューダ	140,411,869	0.37
内 ベルギー	124,560,410	0.33
内 ジャージー	121,035,003	0.32
内 ケイマン諸島	83,314,554	0.22
内 ノルウェー	82,499,021	0.22
内 イスラエル	79,083,468	0.21
内 オランダ領キュラソー	44,785,070	0.12
内 ルクセンブルグ	35,742,633	0.09
内 ニュージーランド	35,468,747	0.09
内 オーストリア	29,435,531	0.08
内 ポルトガル	19,930,364	0.05
内 パナマ	19,534,817	0.05
内 リベリア	17,954,287	0.05
内 パプアニューギニア	7,929,891	0.02
内 マン島	7,233,686	0.02
内 イギリス領バージン諸島	6,910,497	0.02
投資信託受益証券	94,333,697	0.25
内 オーストラリア	74,577,422	0.20
内 シンガポール	19,756,275	0.05
投資証券	912,597,571	2.39
内 アメリカ	821,363,747	2.15
内 イギリス	25,189,420	0.07
内 フランス	22,785,888	0.06
内 香港	20,089,944	0.05
内 オランダ	18,273,093	0.05
内 カナダ	4,895,479	0.01
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	1,731,487,674	4.53
純資産総額	38,231,488,837	100.00

その他資産の投資状況

令和1年11月29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)	1,716,730,852	4.49
内 アメリカ	1,226,613,217	3.21
内 ドイツ	290,018,950	0.76
内 イギリス	94,396,657	0.25
内 カナダ	67,490,272	0.18
内 オーストラリア	38,211,756	0.10

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

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

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

(2) 【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

令和1年11月29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	MHAM日本債券インデックス マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	195,428,393	1.2599 246,236,781	1.2628 246,786,974	- -	53.26
2	MHAM外国債券インデックス マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	95,958,877	1.2816 122,987,579	1.3119 125,888,450	- -	27.17
3	MHAM TOPIXマ ザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	21,448,660	1.8759 40,236,579	2.0393 43,740,252	- -	9.44
4	MHAM外国株式インデックス マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	19,346,373	1.9181 37,109,109	2.0724 40,093,423	- -	8.65

(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11月29日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	98.51
合計	98.51

(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)

MHAM日本債券インデックスマザーファンド

令和1年11月29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	130回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	1,250,000,000	100.69 1,258,700,000	100.58 1,257,325,000	0.1 2021/12/20	1.01
2	328回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	1,190,000,000	102.99 1,225,581,000	102.63 1,221,380,300	0.6 2023/3/20	0.98
3	339回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	1,170,000,000	103.48 1,210,716,000	103.36 1,209,382,200	0.4 2025/6/20	0.97
4	350回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	1,170,000,000	102.03 1,193,832,500	102.27 1,196,570,700	0.1 2028/3/20	0.96
5	132回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	1,160,000,000	100.84 1,169,802,000	100.75 1,168,758,000	0.1 2022/6/20	0.94
6	129回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	1,160,000,000	100.62 1,167,192,000	100.51 1,165,962,400	0.1 2021/9/20	0.94
7	332回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	1,120,000,000	103.58 1,160,096,000	103.22 1,156,097,600	0.6 2023/12/20	0.93
8	340回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	1,110,000,000	103.60 1,150,009,000	103.52 1,149,072,000	0.4 2025/9/20	0.92
9	333回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	1,080,000,000	104.01 1,123,366,000	103.42 1,116,946,800	0.6 2024/3/20	0.90
10	330回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	1,060,000,000	104.26 1,105,230,200	103.78 1,100,163,400	0.8 2023/9/20	0.88
11	131回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	1,050,000,000	100.78 1,058,255,000	100.66 1,057,014,000	0.1 2022/3/20	0.85
12	334回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	1,010,000,000	104.07 1,051,177,000	103.60 1,046,360,000	0.6 2024/6/20	0.84
13	137回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	1,010,000,000	101.18 1,021,988,700	101.11 1,021,211,000	0.1 2023/9/20	0.82
14	135回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	1,010,000,000	101.04 1,020,541,000	101.01 1,020,221,200	0.1 2023/3/20	0.82
15	138回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	1,000,000,000	101.25 1,012,560,000	101.18 1,011,830,000	0.1 2023/12/20	0.81

16	136回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	1,000,000,000	101.13 1,011,390,000	101.09 1,010,900,000	0.1 2023/6/20	0.81
17	405回 利付国庫債券 (2年) 日本	国債証券	1,000,000,000	100.57 1,005,740,000	100.52 1,005,230,000	0.1 2021/10/1	0.81
18	344回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	960,000,000	102.31 982,259,000	102.03 979,507,200	0.1 2026/9/20	0.79
19	127回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	960,000,000	100.49 964,752,000	100.35 963,360,000	0.1 2021/3/20	0.77
20	329回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	930,000,000	104.01 967,293,000	103.55 963,052,200	0.8 2023/6/20	0.77
21	313回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	940,000,000	102.72 965,643,200	101.89 957,813,000	1.3 2021/3/20	0.77
22	325回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	930,000,000	103.36 961,332,000	102.78 955,909,800	0.8 2022/9/20	0.77
23	338回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	920,000,000	103.37 951,004,000	103.21 949,541,200	0.4 2025/3/20	0.76
24	348回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	920,000,000	102.60 943,929,000	102.29 941,123,200	0.1 2027/9/20	0.76
25	349回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	910,000,000	102.58 933,541,000	102.28 930,802,600	0.1 2027/12/20	0.75
26	342回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	900,000,000	102.23 920,091,000	101.91 917,208,000	0.1 2026/3/20	0.74
27	140回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	900,000,000	101.89 917,033,000	101.30 911,763,000	0.1 2024/6/20	0.73
28	343回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	890,000,000	102.28 910,358,000	101.99 907,711,000	0.1 2026/6/20	0.73
29	335回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	870,000,000	103.62 901,494,000	103.34 899,075,400	0.5 2024/9/20	0.72
30	346回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	860,000,000	101.94 876,684,000	102.22 879,100,600	0.1 2027/3/20	0.71

（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11月29日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	82.84
地方債証券	5.87
特殊債証券	6.79
社債券	4.18
合計	99.68

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

MHAM外国債券インデックスマザーファンド

令和1年11月29日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (％) 償還日	投資 比率 (％)
1	US T N/B 2.25 03/31/21 アメリカ	国債証券	447,004,800	100.69 450,101,658	100.73 450,270,025	2.25 2021/3/31	1.58
2	US T N/B 2.25 04/30/21 アメリカ	国債証券	375,790,800	100.75 378,615,290	100.76 378,682,625	2.25 2021/4/30	1.33
3	US T N/B 2.625 11/15/20 アメリカ	国債証券	237,745,200	100.41 238,743,729	100.87 239,834,756	2.625 2020/11/15	0.84
4	US T N/B 2.625 12/15/21 アメリカ	国債証券	227,884,800	102.18 232,854,967	101.98 232,415,789	2.625 2021/12/15	0.82
5	US T N/B 1.5 10/31/21 アメリカ	国債証券	225,693,600	99.71 225,050,734	99.72 225,067,651	1.5 2021/10/31	0.79
6	US T N/B 2.875 09/30/23 アメリカ	国債証券	186,252,000	104.90 195,390,662	104.60 194,837,052	2.875 2023/9/30	0.68
7	US T N/B 2.75 08/31/23 アメリカ	国債証券	184,060,800	104.42 192,212,852	104.06 191,538,270	2.75 2023/8/31	0.67
8	US T N/B 2.375 02/29/24 アメリカ	国債証券	181,869,600	102.76 186,899,450	103.01 187,354,104	2.375 2024/2/29	0.66
9	US T N/B 2.75 11/15/23 アメリカ	国債証券	177,487,200	104.33 185,179,407	104.24 185,016,537	2.75 2023/11/15	0.65
10	US T N/B 2.875 10/31/23 アメリカ	国債証券	174,200,400	104.92 182,781,708	104.70 182,393,261	2.875 2023/10/31	0.64
11	FRANCE OAT 4.25 10/25/23 フランス	国債証券	152,546,350	120.99 184,576,607	118.96 181,472,951	4.25 2023/10/25	0.64
12	US T N/B 2.75 07/31/23 アメリカ	国債証券	174,200,400	104.33 181,753,729	103.99 181,154,805	2.75 2023/7/31	0.64
13	US T N/B 2.375 08/15/24 アメリカ	国債証券	170,913,600	102.03 174,383,644	103.33 176,615,169	2.375 2024/8/15	0.62
14	US T N/B 2.125 05/15/25 アメリカ	国債証券	172,009,200	100.79 173,380,598	102.40 176,148,170	2.125 2025/5/15	0.62
15	US T N/B 1.375 10/15/22 アメリカ	国債証券	161,053,200	99.13 159,662,771	99.31 159,952,249	1.375 2022/10/15	0.56

16	DEUTSCHLAND 2.0 08/15/23 ドイツ	国債証券	144,708,000	111.57 161,464,805	109.95 159,119,411	2 2023/8/15	0.56
17	US T N/B 2.0 08/15/25 アメリカ	国債証券	153,384,000	101.32 155,420,325	101.77 156,104,167	2 2025/8/15	0.55
18	US T N/B 2.875 05/15/28 アメリカ	国債証券	142,428,000	107.14 152,598,520	108.88 155,079,610	2.875 2028/5/15	0.54
19	FRANCE OAT 6.0 10/25/25 フランス	国債証券	109,736,900	140.72 154,423,057	137.99 151,432,532	6 2025/10/25	0.53
20	US T N/B 1.5 09/15/22 アメリカ	国債証券	151,192,800	99.55 150,518,303	99.69 150,738,038	1.5 2022/9/15	0.53
21	US T N/B 2.875 08/15/28 アメリカ	国債証券	136,950,000	106.85 146,331,535	109.05 149,350,393	2.875 2028/8/15	0.52
22	US T N/B 2.25 02/15/27 アメリカ	国債証券	142,428,000	101.87 145,097,620	103.64 147,613,268	2.25 2027/2/15	0.52
23	US T N/B 2.375 05/15/29 アメリカ	国債証券	134,758,800	103.43 139,393,242	105.23 141,812,578	2.375 2029/5/15	0.50
24	US T N/B 3.125 11/15/28 アメリカ	国債証券	123,802,800	108.87 134,791,032	111.30 137,798,317	3.125 2028/11/15	0.48
25	US T N/B 2.5 02/15/22 アメリカ	国債証券	130,376,400	100.67 131,262,551	101.85 132,795,491	2.5 2022/2/15	0.47
26	US T N/B 1.625 06/30/21 アメリカ	国債証券	132,567,600	99.48 131,891,505	99.91 132,448,495	1.625 2021/6/30	0.46
27	US T N/B 1.75 07/15/22 アメリカ	国債証券	130,376,400	100.15 130,585,002	100.33 130,809,289	1.75 2022/7/15	0.46
28	DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25 ドイツ	国債証券	118,178,200	110.86 131,020,864	109.12 128,961,960	1 2025/8/15	0.45
29	ITALY BTPS 4.75 09/01/28 イタリア	国債証券	97,677,900	128.43 125,455,096	130.24 127,220,092	4.75 2028/9/1	0.45
30	US T N/B 2.375 05/15/27 アメリカ	国債証券	118,324,800	102.94 121,805,967	104.63 123,806,564	2.375 2027/5/15	0.43

（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11月29日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	96.55
合計	96.55

（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。

MHAM TOPIXマザーファンド

令和1年11月29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	223,600	6,731.68 1,505,205,399	7,638.00 1,707,856,800	- -	3.46
2	ソニー 日本	株式 電気機器	127,000	5,297.71 672,809,954	6,904.00 876,808,000	- -	1.78
3	三菱UFJフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	1,364,000	559.45 763,102,211	578.10 788,528,400	- -	1.60
4	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	167,100	4,398.95 735,064,572	4,455.00 744,430,500	- -	1.51
5	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	131,600	4,836.18 636,441,675	5,527.00 727,353,200	- -	1.47
6	キーエンス 日本	株式 電気機器	18,200	33,034.87 601,234,808	37,440.00 681,408,000	- -	1.38
7	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	156,400	5,163.19 807,523,228	4,253.00 665,169,200	- -	1.35
8	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	136,900	3,839.27 525,596,707	3,989.00 546,094,100	- -	1.11
9	リクルートホールディングス 日本	株式 サービス業	137,500	3,053.99 419,923,660	3,962.00 544,775,000	- -	1.10
10	任天堂 日本	株式 その他製品	12,300	32,607.56 401,073,016	42,350.00 520,905,000	- -	1.06
11	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	158,000	2,986.99 471,945,276	3,067.00 484,586,000	- -	0.98
12	KDDI 日本	株式 情報・通信業	146,900	2,645.63 388,644,281	3,139.00 461,119,100	- -	0.93
13	みずほフィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	2,694,300	168.82 454,859,801	169.20 455,875,560	- -	0.92
14	NTTドコモ 日本	株式 情報・通信業	145,500	2,599.32 378,202,003	3,003.00 436,936,500	- -	0.89
15	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	70,800	5,380.87 380,966,198	5,952.00 421,401,600	- -	0.85
16	日立製作所 日本	株式 電気機器	96,500	3,551.99 342,767,252	4,300.00 414,950,000	- -	0.84
17	花王 日本	株式 化学	48,100	8,555.77 411,532,718	8,612.00 414,237,200	- -	0.84

18	HOYA 日本	株式 精密機器	40,400	7,438.02 300,496,287	9,990.00 403,596,000	- -	0.82
19	ダイキン工業 日本	株式 機械	25,600	12,839.23 328,684,320	15,745.00 403,072,000	- -	0.82
20	ファナック 日本	株式 電気機器	19,100	18,677.90 356,748,040	20,905.00 399,285,500	- -	0.81
21	三菱商事 日本	株式 卸売業	138,600	3,055.96 423,556,906	2,866.00 397,227,600	- -	0.80
22	信越化学工業 日本	株式 化学	33,800	9,438.84 319,033,070	11,710.00 395,798,000	- -	0.80
23	第一三共 日本	株式 医薬品	57,500	4,868.40 279,933,326	6,862.00 394,565,000	- -	0.80
24	日本電産 日本	株式 電気機器	24,200	13,489.74 326,451,919	16,190.00 391,798,000	- -	0.79
25	村田製作所 日本	株式 電気機器	59,000	5,507.58 324,947,284	6,344.00 374,296,000	- -	0.76
26	東海旅客鉄道 日本	株式 陸運業	16,700	24,391.50 407,338,054	22,095.00 368,986,500	- -	0.75
27	東日本旅客鉄道 日本	株式 陸運業	35,300	10,542.94 372,165,814	10,070.00 355,471,000	- -	0.72
28	三井物産 日本	株式 卸売業	173,400	1,767.54 306,491,900	1,939.50 336,309,300	- -	0.68
29	アステラス製薬 日本	株式 医薬品	176,800	1,667.40 294,797,471	1,867.50 330,174,000	- -	0.67
30	伊藤忠商事 日本	株式 卸売業	138,200	2,046.79 282,866,946	2,388.00 330,021,600	- -	0.67

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

令和1年11月29日現在

種類	投資比率(%)
株式	97.67
合計	97.67

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

令和1年11月29日現在

業種	国内 / 外国	投資比率 (%)
電気機器	国内	13.89
情報・通信業		8.35
輸送用機器		7.65
化学		6.98
医薬品		5.88
銀行業		5.72
サービス業		5.02
機械		5.00
卸売業		4.84
小売業		4.56
陸運業		4.45
食料品		3.82
建設業		2.72
不動産業		2.36
精密機器		2.29
その他製品		2.27
保険業		2.24
電気・ガス業		1.51
その他金融業		1.14
ガラス・土石製品		0.83
証券、商品先物取引業		0.82
鉄鋼		0.75
非鉄金属		0.75
ゴム製品		0.74
繊維製品		0.58
金属製品		0.57
空運業		0.50
石油・石炭製品		0.49
鉱業		0.27
パルプ・紙		0.24
倉庫・運輸関連業		0.18
海運業	0.17	
水産・農林業	0.10	
合計		97.67

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

MHAM外国株式インデックスマザーファンド

令和1年11月29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	37,695	22,663.88 854,315,325	29,344.55 1,106,142,827	- -	2.89

2	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフト ウェア	60,547	14,132.28 855,667,742	16,688.17 1,010,419,186	- -	2.64
3	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 インター ネット販 売・通信 販売	3,509	207,800.68 729,172,605	199,235.95 699,118,968	- -	1.83
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	20,027	20,666.77 413,893,444	22,131.11 443,219,940	- -	1.16
5	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	26,721	12,502.17 334,070,651	14,468.49 386,612,617	- -	1.01
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	2,574	129,490.19 333,307,758	143,851.18 370,272,948	- -	0.97
7	ALPHABET INC-CL A アメリカ	株式 インタラ クティ ブ・メ ディアお よびサー ビス	2,532	129,794.95 328,640,833	143,756.96 363,992,629	- -	0.95
8	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	21,889	15,062.24 329,697,382	15,091.88 330,346,380	- -	0.86
9	VISA INC アメリカ	株式 情報技術 サービス	14,444	18,121.50 261,747,014	20,199.57 291,762,693	- -	0.76
10	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	24,788	11,061.88 274,202,124	11,439.62 283,565,399	- -	0.74
11	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品	20,975	12,015.89 252,033,312	13,340.02 279,807,036	- -	0.73
12	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 銀行	73,927	3,254.40 240,588,163	3,661.49 270,683,355	- -	0.71
13	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 石油・ガ ス・消耗 燃料	35,676	8,259.12 294,652,710	7,526.77 268,525,117	- -	0.70
14	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 各種金融 サービス	10,993	22,957.61 252,373,033	24,157.97 265,568,674	- -	0.69

15	AT&T INC アメリカ	株式 各種電気 通信サー ビス	60,878	3,570.54 217,367,786	4,126.02 251,184,429	- -	0.66
16	THE WALT DISNEY CO アメリカ	株式 娯楽	15,076	14,787.81 222,941,136	16,596.14 250,203,539	- -	0.65
17	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	7,937	25,949.41 205,960,490	30,750.20 244,064,378	- -	0.64
18	MASTERCARD INC アメリカ	株式 情報技術 サービス	7,577	27,845.08 210,982,188	31,958.65 242,150,706	- -	0.63
19	INTEL CORP アメリカ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	36,967	5,558.56 205,483,391	6,410.35 236,971,615	- -	0.62
20	VERIZON COMM INC アメリカ	株式 各種電気 通信サー ビス	34,596	6,317.31 218,553,739	6,584.55 227,799,299	- -	0.60
21	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 専門小売 り	9,214	22,498.44 207,300,668	24,431.87 225,115,342	- -	0.59
22	WELLS FARGO & CO アメリカ	株式 銀行	34,943	5,193.87 181,489,593	5,953.49 208,032,815	- -	0.54
23	CHEVRON CORP アメリカ	株式 石油・ガ ス・消耗 燃料	15,942	13,073.42 208,416,535	12,935.74 206,221,713	- -	0.54
24	MERCK & CO. INC. アメリカ	株式 医薬品	21,025	8,723.61 183,413,965	9,598.55 201,809,547	- -	0.53
25	COCA-COLA CO/THE アメリカ	株式 飲料	34,057	5,480.29 186,642,338	5,910.76 201,302,821	- -	0.53
26	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN スイス	株式 医薬品	5,864	29,402.52 172,416,434	33,891.11 198,737,527	- -	0.52
27	PFIZER INC アメリカ	株式 医薬品	45,707	4,388.69 200,594,113	4,232.30 193,445,864	- -	0.51
28	COMCAST CORP-CL A アメリカ	株式 メディア	38,167	4,796.39 183,063,891	4,866.65 185,745,629	- -	0.49
29	NOVARTIS AG-REG SHS スイス	株式 医薬品	17,876	9,282.70 165,937,697	10,127.85 181,045,468	- -	0.47
30	BOEING CO アメリカ	株式 航空宇 宙・防衛	4,454	39,554.65 176,176,428	40,318.07 179,576,728	- -	0.47

(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11月29日現在

種類	投資比率（％）
株式	92.84
投資信託受益証券	0.25
投資証券	2.39
合計	95.47

（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11月29日現在

業種	国内／外国	投資比率（％）
銀行	外国	7.46
ソフトウェア		5.29
医薬品		5.19
石油・ガス・消耗燃料		4.72
情報技術サービス		4.05
保険		3.68
インタラクティブ・メディアおよびサービス		3.27
コンピュータ・周辺機器		3.16
半導体・半導体製造装置		3.12
資本市場		2.85
ヘルスケア機器・用品		2.74
インターネット販売・通信販売		2.34
航空宇宙・防衛		2.29
化学		2.15
各種電気通信サービス		2.01
ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス		1.96
電力		1.93
飲料		1.90
食品		1.86
バイオテクノロジー		1.79
ホテル・レストラン・レジャー		1.72
専門小売り		1.65
機械		1.58
食品・生活必需品小売り		1.47
繊維・アパレル・贅沢品		1.41
娯楽		1.36
家庭用品		1.30
コングロマリット		1.27
金属・鉱業		1.25
メディア		1.20
総合公益事業		1.05
陸運・鉄道		0.96
各種金融サービス		0.95
タバコ		0.81
自動車		0.79
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
通信機器	0.71
パーソナル用品	0.67
電子装置・機器・部品	0.53
航空貨物・物流サービス	0.52
不動産管理・開発	0.49
複合小売り	0.49
消費者金融	0.46
商業サービス・用品	0.44
建設関連製品	0.38
家庭用耐久財	0.35
建設・土木	0.33
建設資材	0.30
自動車部品	0.28
容器・包装	0.28
無線通信サービス	0.27
商社・流通業	0.26
エネルギー設備・サービス	0.25
運送インフラ	0.20
ガス	0.20
旅客航空輸送業	0.12
水道	0.11
ヘルスケア・テクノロジー	0.11
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.10
紙製品・林産品	0.09
販売	0.07
海運業	0.07
レジャー用品	0.05
合計	92.84

(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)

MHAM日本債券インデックスマザーファンド

該当事項はありません。

MHAM外国債券インデックスマザーファンド

該当事項はありません。

MHAM TOPIXマザーファンド

該当事項はありません。

MHAM外国株式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）

MHAM日本債券インデックスマザーファンド

該当事項はありません。

MHAM外国債券インデックスマザーファンド

該当事項はありません。

MHAM TOPIXマザーファンド

令和1年11月29日現在

種類	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	大阪取引所	TOPIX 先物 0112月	買建	68	1,129,207,514	1,153,960,000	2.34

（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。

MHAM外国株式インデックスマザーファンド

令和1年11月29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	71	1,176,226,299	1,226,613,217	3.21
	EUREX取引所	DJ EURO STOXX 50 Dec19	買建	65	280,085,951	290,018,950	0.76
	ICE-EU	FTSE 100 INDEX FUTURE Dec19	買建	9	93,295,469	94,396,657	0.25
	モントリオール取引所	S&P/TSE 60 IX FUT Dec19	買建	4	66,063,062	67,490,272	0.18
	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTURES Dec19	買建	3	37,290,566	38,211,756	0.10

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

直近日(令和1年11月末)、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 (分配落) (百万円)	純資産総額 (分配付) (百万円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (平成28年 5月 9日)	1	1	0.9860	0.9860
第2計算期間末 (平成29年 5月 8日)	217	217	1.0039	1.0039
第3計算期間末 (平成30年 5月 8日)	289	289	1.0266	1.0266
第4計算期間末 (令和 1年 5月 8日)	397	397	1.0208	1.0208
平成30年11月末日	351	-	1.0100	-
12月末日	350	-	1.0044	-
平成31年1月末日	366	-	1.0093	-
2月末日	377	-	1.0168	-
3月末日	388	-	1.0247	-
4月末日	392	-	1.0236	-
令和1年5月末日	407	-	1.0210	-
6月末日	422	-	1.0305	-
7月末日	432	-	1.0339	-
8月末日	444	-	1.0370	-
9月末日	448	-	1.0353	-
10月末日	461	-	1.0423	-
11月末日	463	-	1.0452	-

【分配の推移】

	1口当たりの分配金(円)
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
令和1年5月9日～令和1年11月8日	-

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	1.40
第2計算期間	1.82
第3計算期間	2.26
第4計算期間	0.56
令和1年5月9日～令和1年11月8日	1.9

(注1) 収益率は期間騰落率です。

(注2) 計算期間末が令和1年8月29日以前の収益率については、小数点第2位で表示しています。

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数
第1計算期間	3,049,848	1,969,584
第2計算期間	251,804,976	35,891,119
第3計算期間	84,136,037	18,864,592
第4計算期間	138,378,667	31,183,232
令和1年5月9日～ 令和1年11月8日	68,403,957	15,110,837

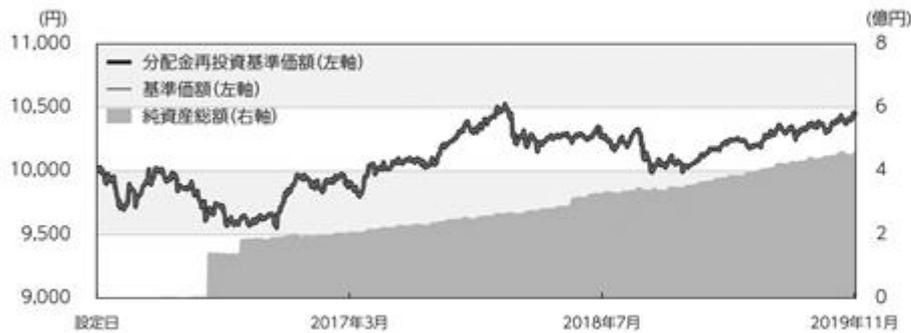
(注1) 本邦外における設定及び解約はありません。

(注2) 第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

参考情報

データの基準日:2019年11月29日

基準価額・純資産の推移 (2015年11月30日～2019年11月29日)



※基準価額は1万口当たり-信託報酬控除後の価額です。

※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額とは異なります。
(設定日:2015年11月30日)

分配の推移(税引前)

2016年 5月	0円
2017年 5月	0円
2018年 5月	0円
2019年 5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	MHAM日本債券インデックスマザーファンド	53.26
2	MHAM外国債券インデックスマザーファンド	27.17
3	MHAM TOPIXマザーファンド	9.44
4	MHAM外国株式インデックスマザーファンド	8.65

■MHAM日本債券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	利率(%)	償還日	比率(%)
1	130回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.1	2021/12/20	1.01
2	328回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.6	2023/3/20	0.98
3	339回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.4	2025/6/20	0.97
4	350回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.1	2028/3/20	0.96
5	132回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.1	2022/6/20	0.94

■MHAM外国債券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	利率(%)	償還日	比率(%)
1	US T N/B 2.25 03/31/21	国債証券	アメリカ	2.25	2021/3/31	1.58
2	US T N/B 2.25 04/30/21	国債証券	アメリカ	2.25	2021/4/30	1.33
3	US T N/B 2.625 11/15/20	国債証券	アメリカ	2.625	2020/11/15	0.84
4	US T N/B 2.625 12/15/21	国債証券	アメリカ	2.625	2021/12/15	0.82
5	US T N/B 1.5 10/31/21	国債証券	アメリカ	1.5	2021/10/31	0.79

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

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

■MHAM TOPIXマザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	業種	比率(%)
1	トヨタ自動車	株式	日本	輸送用機器	3.46
2	ソニー	株式	日本	電気機器	1.78
3	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	日本	銀行業	1.60
4	武田薬品工業	株式	日本	医薬品	1.51
5	日本電信電話	株式	日本	情報・通信業	1.47

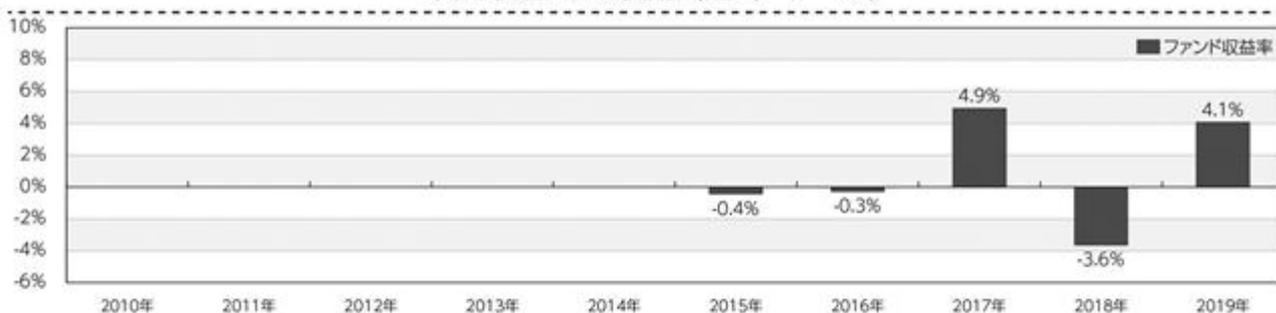
■MHAM外国株式インデックスマザーファンド

※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	APPLE INC	株式	アメリカ	コンピュータ・周辺機器	2.89
2	MICROSOFT CORP	株式	アメリカ	ソフトウェア	2.64
3	AMAZON.COM INC	株式	アメリカ	インターネット販売・通信販売	1.83
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	1.16
5	JPMORGAN CHASE & CO	株式	アメリカ	銀行	1.01

年間収益率の推移(暦年ベース)



※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。

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

※当ファンドにはベンチマークはありません。

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

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

- (1)当ファンドのお申込みは、原則として委託会社および販売会社の営業日の午後3時までにお買付けのお申込みが行われ、かつ当該お申込みの受付にかかる販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日分のお申込みといたします。この時間を過ぎてのお申込みおよび所定の事務手続き完了分については翌営業日のお取扱いとなります。ただし、取得申込日が、ニューヨーク証券取引所、ロンドン証券取引所、ニューヨークの銀行、ロンドンの銀行のいずれかの休業日にあたる場合には、お申込みの受付はいたしません。
- (2)取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時にまたはあらかじめ、自己のために開設されたファンドの受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録が行われます。なお、販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引換えに、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録を行うことができます。委託会社は、追加信託により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとします。
- (3)受益権の取得のお申込みは、確定拠出年金制度による取得のお申込みのみを対象といたします。確定拠出年金制度を通じての取得のお申込みについては、確定拠出年金制度の定めにしたがうものとします。
- (4)当ファンドは、収益分配がなされた場合、分配金を自動的に無手数料で再投資する「自動けいぞく投資」専用ファンドです。このためお申込みの際、受益権の取得申込者は販売会社との間で別に定める「自動けいぞく投資約款」にしたがって、分配金自動けいぞく投資に関する契約を締結します。なお、販売会社によっては、当該契約または規定については、同様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約または規定を使用することがあり、この場合、当該別の名称に読み替えるものとします。
- (5)取得申込者は、販売会社において、1円以上1円単位をもって購入することができます。
- (6)取得申込みにかかる受益権の価額は、取得申込日の翌営業日の基準価額とします。
- (7)分配金自動けいぞく投資に関する契約に基づき、収益分配金を再投資する際は、1口単位で購入できるものとします。なお、その際の受益権の価額は、原則として各計算期間終了日の基準価額とします。
- (8)信託財産の効率的な運用または受益者に対する公平性を期する運用が妨げられると委託会社が合理的に判断する場合、取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、販売会社は、受益権の取得申込みの受付を中止すること、およびすでに受付けた取得申込みの受付を取り消すことができます。

2【換金（解約）手続等】

- (1)受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託会社に対し、1口単位をもって解約を請求することができます。
- (2)解約の請求を行う受益者は、振替制度にかかる口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求にかかるこの信託契約の一部解約を委託会社が行うのと引換えに、当該一部解約にかかる受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。なお、解約の請求を受益者が行う際は、販売会社に対し振替受益権をもって行うものとします。
- (3)解約請求の受付については、原則として委託会社および販売会社の営業日の午後3時までには解約のお申込みが行われ、かつ当該お申込みの受付にかかる販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日分のお申込みとします。この時間を過ぎてのお申込みおよび所定の事務手続き完了分については、

翌営業日のお取扱いとなります。ただし、解約請求受付日が、ニューヨーク証券取引所、ロンドン証券取引所、ニューヨークの銀行、ロンドンの銀行のいずれかの休業日にあたる場合には、解約請求の受けはいたしません。

- (4)解約の価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。詳しくは、委託会社にお問い合わせください。なお、委託会社に対する照会は下記においてできます。

照会先の名称	電話番号
アセットマネジメントOne株式会社	0120-104-694

電話によるお問い合わせは、営業日の午前9時～午後5時までとさせていただきます。（以下同じ。）

- (5)解約代金は、受益者の解約請求を受付けた日から起算して、原則として、6営業日目から受益者に支払われます。
- (6)信託財産の資金管理を円滑に行うために、大口の解約請求には制限を設ける場合があります。
- (7)委託会社は、信託財産の効率的な運用または受益者に対する公平性を期する運用が妨げられると委託会社が合理的に判断する場合（一部解約の実行の請求金額が多額な場合を含みます。）、取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受け付けを中止すること、およびすでに受付けた一部解約の実行の請求の受け付けを取り消すことができます。この場合、受益者は当該受付中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日（この日が前記(3)に規定する一部解約の実行の請求を受け付けない日であるときは、この計算日以降の最初の一部解約の実行の請求を受け付けることができる日とします。）に一部解約の実行の請求を受け付けたものとして、前記(4)の規定に準じて算出した価額とします。

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

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

< 主な投資対象の時価評価方法の原則 >

投資対象	評価方法
マザーファンド受益証券	計算日の基準価額
株式	計算日における取引所の最終相場
公社債等	計算日における以下のいずれかの価額 <ul style="list-style-type: none"> ・日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値） ・金融商品取引業者、銀行などの提示する価額（売り気配相場を除きます。） ・価格情報会社の提供する価額
外貨建資産の円換算	計算日の国内における対顧客電信売買相場の仲値

外国で取引されているものについては、計算日の直近の日とします。

当ファンドの基準価額は、委託会社の毎営業日(土曜日、日曜日、「国民の祝日に関する法律」に定める休日ならびに12月31日、1月2日および1月3日以外の日とします。)に計算されます。基準価額については、委託会社にお問い合わせください。なお、委託会社に対する照会は下記においてできます。基準価額は1万口単位で表示されたものが発表されます。

照会先の名称	ホームページアドレス	電話番号
アセットマネジメントOne株式会社	http://www.am-one.co.jp/	0120-104-694

(2) 【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

2015年11月30日から無期限とします。

(4) 【計算期間】

原則として毎年5月9日から翌年5月8日までとします。ただし、第1計算期間は2015年11月30日から2016年5月8日までとします。

上記の規定にかかわらず、計算期間終了日に該当する日(以下「当該日」といいます。)が休業日のとき、計算期間終了日は、当該日の翌日以降の最初の営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。

(5) 【その他】

信託契約の解約

1. 委託会社は、次のいずれかに該当する場合、受託会社と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了(繰上償還)させることがあります。この場合、委託会社は書面による決議(以下「書面決議」といいます。)を行います。ただし、当該信託契約の解約についての委託会社による提案につき、この信託契約に係るすべての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには書面決議は行いません。また、信託財産の状況に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、書面決議の手続きを行うことが困難な場合にも書面決議は行いません。

a. この信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるとき。

b. やむを得ない事情が発生したとき。

c. 信託契約の一部解約により、受益権の口数が10億口を下回ることとなるとき。

2. 前記1.により信託契約を解約する場合には、委託会社はあらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

3. 委託会社は、次の事象が起きた場合、信託契約を解約し、信託を終了(繰上償還)させます。

a. 委託会社が監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたとき。

b. 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したとき、または業務を廃止したとき。ただし、監督官庁が、この信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、この信託は、「信託約款の変更等」の書面決議が否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。

c. 受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合において、委託会社が新受託会社を選任できないとき。

信託約款の変更等

1. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、この信託約款を変更することまたはこの信託と他の信託との併合(投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。)を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。なお、この信託約款は「信託約款の変更等」および「書面決議」に定める以外の方法によって変更することができないものとし、
2. 委託会社は、前記1.の事項(前記1.の変更事項にあつては、その変更の内容が重大なものに該当する場合に限り、前記1.の併合事項にあつては、その併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下、「重大な約款の変更等」といいます。)について、書面決議を行います。ただし、当該重大な約款の変更等についての委託会社による提案につき、この信託約款に係るすべての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには書面決議は行いません。
3. この投資信託において併合の書面決議が可決された場合にあつても、当該併合にかかる一又は複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。
4. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、上記の規定にしたがいます。

書面決議

1. 委託会社は、信託契約の解約または重大な約款の変更等に係る書面決議を行う場合には、あらかじめ、書面決議の日および当該決議の内容に応じて次の事項をそれぞれ定め、当該決議の日の2週間前までに、この信託契約または信託約款に係る知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
 - a. 信託契約の解約の場合 信託契約の解約の理由など
 - b. 重大な約款の変更等の場合 重大な約款の変更等の内容およびその理由など
2. 書面決議において、受益者(委託会社およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託会社を除きます。以下この2.において同じ。)は受益権の口数に応じて議決権を有し、これを行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
3. 書面決議は、議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
4. 書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。
5. この信託は、受益者が一部解約の実行の請求を行ったときは、委託会社が信託契約の一部の解約をすることにより当該請求に応じ、当該受益権の公正な価格が当該受益者に一部解約金として支払われることとなる委託者指図型投資信託に該当するため、信託契約の解約または重大な約款の変更等を行う場合において、投資信託及び投資法人に関する法律第18条第1項に定める反対受益者による受益権の買取請求の規定の適用を受けません。

委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い

1. 委託会社は、事業の全部または一部を譲渡することがあり、これに伴ない、この信託契約に関する事業を譲渡することがあります。
2. 委託会社は、分割により事業の全部または一部を承継させることがあり、これに伴ない、この信託契約に関する事業を承継させることがあります。

関係法人との契約の更改ならびに受託会社の辞任または解任に伴う取扱い

1. 委託会社と販売会社との間の募集・販売等契約は、締結日から原則1年間とし、期間終了の3ヵ月前までに別段の意思表示のない時は、同一条件にて継続されます。
2. 受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。また、受託会社はその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を申し立てることができます。受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は、「信託約款の変更等」の規定にしたがい、新受託会社を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託会社を解任することはできないものとします。委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。

信託事務処理の再信託

受託会社は、当ファンドにかかる信託事務処理の一部について、資産管理サービス信託銀行株式会社と再信託契約を締結し、これを委託することがあります。その場合には、再信託にかかる契約書類に基づいて所定の事務を行います。

公告

委託会社が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行い、次のアドレスに掲載します。

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

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

運用報告書

委託会社は、決算時および信託終了時に期中の運用経過のほか、信託財産の内容、有価証券売買状況などを記載した「運用報告書」を作成します。

- ・ 交付運用報告書は、販売会社を通じて交付いたします。
- ・ 運用報告書(全体版)は、次のアドレスに掲載します。ただし、受益者から運用報告書(全体版)の交付の請求があった場合には、交付いたします。

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

4【受益者の権利等】

(1) 収益分配金請求権

収益分配金は、原則として毎計算期間終了日の翌営業日に、販売会社に交付され、販売会社により自動的に再投資されます。

販売会社は、自動けいぞく投資約款に基づき、毎計算期間の末日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者としします。）に対し遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の売付けを行います。当該売付けにより増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

(2) 償還金請求権

受益者は、持ち分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

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

(3) 一部解約請求権

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

(4) 帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

動的パッケージファンド<DC年金>

(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)ならびに同規則第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4期計算期間の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

【動的パッケージファンド<DC年金>】

(1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第3期計算期間 (平成30年 5月 8日現在)	第4期計算期間 (令和 1年 5月 8日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	4,096,833	15,558,237
親投資信託受益証券	286,522,396	383,175,283
未収利息	-	8
流動資産合計	290,619,229	398,733,528
資産合計		
290,619,229		
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	43,272	58,877
未払委託者報酬	807,772	1,098,975
未払利息	9	-
その他未払費用	5,700	7,409
流動負債合計	856,753	1,165,261
負債合計		
856,753		
純資産の部		
元本等		
元本	282,265,566	389,461,001
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	7,496,910	8,107,266
(分配準備積立金)	12,139,939	13,183,819
元本等合計	289,762,476	397,568,267
純資産合計		
289,762,476		
負債純資産合計		
290,619,229		
398,733,528		

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第3期計算期間 (自 平成29年 5月 9日 至 平成30年 5月 8日)	第4期計算期間 (自 平成30年 5月 9日 至 令和 1年 5月 8日)
営業収益		
受取利息	30	29
有価証券売買等損益	6,827,091	647,887
その他収益	2,296	-
営業収益合計	6,829,417	647,916
営業費用		
支払利息	24,120	5,984
受託者報酬	81,532	112,607
委託者報酬	1,521,858	2,101,808
その他費用	10,744	14,423
営業費用合計	1,638,254	2,234,822
営業利益又は営業損失()	5,191,163	1,586,906
経常利益又は経常損失()	5,191,163	1,586,906
当期純利益又は当期純損失()	5,191,163	1,586,906
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()	323,037	336,163
期首剰余金又は期首欠損金()	846,259	7,496,910
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,876,046	2,665,913
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,876,046	2,665,913
剰余金減少額又は欠損金増加額	93,521	804,814
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	93,521	804,814
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金()	7,496,910	8,107,266

(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4期計算期間 (自平成30年5月9日 至令和1年5月8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 基準価額で評価しております。
2 収益・費用の計上基準	有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

第3期計算期間 (平成30年5月8日現在)		第4期計算期間 (令和1年5月8日現在)	
1	計算期間末における受益権の総数 282,265,566口	1	計算期間末における受益権の総数 389,461,001口
2	計算期間末における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産の額 1.0266円 (1万口当たり純資産の額) (10,266円)	2	計算期間末における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産の額 1.0208円 (1万口当たり純資産の額) (10,208円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第3期計算期間 (自平成29年5月9日 至平成30年5月8日)	第4期計算期間 (自平成30年5月9日 至令和1年5月8日)
1 分配金の計算過程 計算期間末における費用控除後の配当等収益(2,263,442円)、有価証券売買等損益(2,604,684円)、収益調整金(4,442,704円)、分配準備積立金(7,271,813円)より、分配対象収益は16,582,643円(1万口当たり587円)であります。当期の収益分配金につきましては、見送りとなりました。	1 分配金の計算過程 計算期間末における費用控除後の配当等収益(2,115,147円)、有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(11,936,760円)、分配準備積立金(11,068,672円)より、分配対象収益は25,120,579円(1万口当たり644円)であります。当期の収益分配金につきましては、見送りとなりました。

(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3期計算期間 (自平成29年5月9日 至平成30年5月8日)	第4期計算期間 (自平成30年5月9日 至令和1年5月8日)
1 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める投資を目的とする証券投資信託であり、証券投資信託約款および投資ガイドラインに基づいて運用しております。	同左

2 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>なお、詳細は附属明細表をご参照下さい。</p> <p>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>	同左
3 金融商品に係るリスク管理体制	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>なお、具体的には以下のリスクの管理を行っております。</p> <p>市場リスクの管理</p> <p>市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。</p> <p>信用リスクの管理</p> <p>信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。</p> <p>流動性リスクの管理</p> <p>流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。</p>	同左
4 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には、合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。</p>	同左

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第3期計算期間 (平成30年 5月 8日現在)	第4期計算期間 (令和 1年 5月 8日現在)
1 貸借対照表日における貸借対照表の科目ごとの計上額・時価・時価との差額	貸借対照表に計上している金融商品は、原則として時価評価としているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。	同左
2 貸借対照表の科目ごとの時価の算定方法	(1)有価証券	(1)有価証券

	親投資信託受益証券	親投資信託受益証券
	原則として、親投資信託受益証券の基準価額で評価しております。	同左
	(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務	(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務
	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、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

第3期計算期間(自 平成29年 5月 9日 至 平成30年 5月 8日)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額 (円)
親投資信託受益証券	3,729,484
合計	3,729,484

第4期計算期間(自 平成30年 5月 9日 至 令和 1年 5月 8日)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額 (円)
親投資信託受益証券	5,866,934
合計	5,866,934

(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)

第3期計算期間 (自 平成29年 5月 9日 至 平成30年 5月 8日)	第4期計算期間 (自 平成30年 5月 9日 至 令和 1年 5月 8日)
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はありません。	同左

(その他の注記)

項目	期別 第3期計算期間 (平成30年 5月 8日現在)	第4期計算期間 (令和 1年 5月 8日現在)
期首元本額	216,994,121円	282,265,566円
期中追加設定元本額	84,136,037円	138,378,667円
期中一部解約元本額	18,864,592円	31,183,232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 5月 8日現在）

種類	通貨	銘柄	口数	評価額	備考
親投資信託受益証券	日本・円	MHAM日本債券インデックスマザーファンド	217,986,766	273,246,411	
		MHAM外国株式インデックスマザーファンド	7,990,649	15,267,733	
		MHAM外国債券インデックスマザーファンド	65,134,556	82,336,592	
		MHAM TOPIXマザーファンド	6,609,754	12,324,547	
	小計	銘柄数：4 組入時価比率：96.4%	297,721,725	383,175,283 100.0%	
合計				383,175,283	

（注１）比率は左より組入時価の純資産総額に対する比率、及び各小計欄の合計金額に対する比率であります。

第２ 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

当ファンドは、「MHAM日本債券インデックスマザーファンド」受益証券、「MHAM外国債券インデックスマザーファンド」受益証券、「MHAM TOPIXマザーファンド」受益証券、及び「MHAM外国株式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、すべて同マザーファンドの受益証券です。なお、同マザーファンドの状況は次の通りです。

MHAM日本債券インデックスマザーファンド

なお、以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

（単位：円）

(令和 1年 5月 8日現在)

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	275,889,604
国債証券	130,316,654,100
地方債証券	7,894,879,435
特殊債券	8,713,826,211
社債券	5,708,106,200
未収入金	200,639,000
未収利息	286,005,332
前払費用	8,583,825
流動資産合計	153,404,583,707
資産合計	153,404,583,707
負債の部	
流動負債	
未払解約金	19,990,000
流動負債合計	19,990,000
負債合計	19,990,000
純資産の部	
元本等	
元本	122,368,202,545
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	31,016,391,162
元本等合計	153,384,593,707
純資産合計	153,384,593,707
負債純資産合計	153,404,583,707

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	(自 平成30年 5月 9日 至 令和 1年 5月 8日)
1 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券 原則として時価で評価しております。
2 収益・費用の計上基準	有価証券売買等損益及び派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	(令和 1年 5月 8日現在)	
1 計算期間末日における受益権の総数		122,368,202,545口
2 計算期間末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産の額	1.2535円
	(1万口当たり純資産の額)	(12,535円)

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	(自 平成30年 5月 9日 至 令和 1年 5月 8日)
1 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める投資を目的とする証券投資信託であり、証券投資信託約款および投資ガイドラインに基づいて運用しております。
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。 なお、詳細は附属明細表をご参照下さい。 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	また、当ファンドは信託財産に属する資産の効率的な運用に資することを目的として、債券先物取引を行っており、当該デリバティブ取引は対象とする株価指数等に係る価格変動リスクを有しております。 運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。 リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。 なお、具体的には以下のリスクの管理を行っております。 市場リスクの管理 市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。 信用リスクの管理 信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。
4 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	流動性リスクの管理 流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には、合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	(令和 1年 5月 8日現在)
1 貸借対照表日における貸借対照表の科目ごとの計上額・時価・時価との差額	貸借対照表に計上している金融商品は、原則として時価評価としているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

2 貸借対照表の科目ごとの時価の算定方法	<p>(1) 有価証券</p> <p>国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券</p> <p>わが国の金融商品取引所または海外取引所に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）（外貨建証券を除く）、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除く）または価格情報会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できない場合または入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認められた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認められた価額で評価しております。</p> <p>(2) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>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、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
----------------------	--

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

（自 平成30年 5月 9日 至 令和 1年 5月 8日）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	1,356,480,000
地方債証券	7,213,175
特殊債券	56,508,714
社債券	16,551,300
合計	1,403,650,589

（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。

（その他の注記）

項目	期別 (令和 1年 5月 8日現在)
期首	平成30年 5月 9日
親投資信託の期首における元本額	123,838,085,315円
期中追加設定元本額	43,654,866,864円
期中一部解約元本額	45,124,749,634円
期末元本額及びその内訳として当該親投資信託受益証券を投資対象とする委託者指図型投資信託ごとの元本額	
期末元本額	122,368,202,545円
動的パッケージファンド<DC年金>	217,986,766円
コア資産形成ファンド	216,545,399円
MHAM日本債券インデックスファンド（ファンドラップ）	61,057,155,338円

MHAM日本債券インデックスファンド	195,492,207円
MHAM動的パッケージファンド[適格機関投資家限定]	44,075,376,760円
MHAM日本債券パッシブファンド[適格機関投資家限定]	9,464,112,662円
MHAM動的パッケージ4資産ファンド[適格機関投資家限定]	7,141,533,413円

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

(令和1年5月8日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	日本・円	第391回利付国債(2年)	750,000,000	752,445,000	
		第392回利付国債(2年)	950,000,000	953,315,500	
		第393回利付国債(2年)	500,000,000	501,855,000	
		第394回利付国債(2年)	400,000,000	401,572,000	
		第395回利付国債(2年)	430,000,000	431,784,500	
		第398回利付国債(2年)	600,000,000	602,832,000	
		第124回利付国債(5年)	1,370,000,000	1,374,055,200	
		第125回利付国債(5年)	1,230,000,000	1,234,464,900	
		第126回利付国債(5年)	1,360,000,000	1,365,834,400	
		第127回利付国債(5年)	960,000,000	964,752,000	
		第128回利付国債(5年)	1,280,000,000	1,287,193,600	
		第129回利付国債(5年)	1,560,000,000	1,569,812,400	
		第130回利付国債(5年)	1,250,000,000	1,258,700,000	
		第131回利付国債(5年)	1,340,000,000	1,350,210,800	
		第132回利付国債(5年)	1,160,000,000	1,169,802,000	
		第133回利付国債(5年)	1,360,000,000	1,372,661,600	
		第134回利付国債(5年)	1,390,000,000	1,403,900,000	
		第135回利付国債(5年)	1,410,000,000	1,425,072,900	
		第136回利付国債(5年)	1,000,000,000	1,011,390,000	
		第137回利付国債(5年)	1,010,000,000	1,021,988,700	
第138回利付国債(5年)	1,000,000,000	1,012,560,000			

第139回利付国債(5年)	350,000,000	354,630,500	
第1回利付国債(40年)	110,000,000	165,852,500	
第2回利付国債(40年)	230,000,000	336,400,300	
第3回利付国債(40年)	250,000,000	368,557,500	
第4回利付国債(40年)	300,000,000	445,680,000	
第5回利付国債(40年)	310,000,000	445,646,700	
第6回利付国債(40年)	310,000,000	438,860,800	
第7回利付国債(40年)	320,000,000	435,292,800	
第8回利付国債(40年)	360,000,000	457,135,200	
第9回利付国債(40年)	500,000,000	471,235,000	
第10回利付国債(40年)	530,000,000	588,130,400	
第11回利付国債(40年)	340,000,000	365,459,200	
第308回利付国債(10年)	360,000,000	365,889,600	
第309回利付国債(10年)	1,000,000,000	1,014,130,000	
第310回利付国債(10年)	820,000,000	833,087,200	
第311回利付国債(10年)	350,000,000	354,627,000	
第312回利付国債(10年)	1,290,000,000	1,318,534,800	
第313回利付国債(10年)	940,000,000	965,643,200	
第314回利付国債(10年)	670,000,000	685,771,800	
第315回利付国債(10年)	830,000,000	854,045,100	
第316回利付国債(10年)	480,000,000	492,883,200	
第317回利付国債(10年)	410,000,000	422,324,600	
第318回利付国債(10年)	850,000,000	873,528,000	
第319回利付国債(10年)	480,000,000	495,955,200	
第320回利付国債(10年)	1,360,000,000	1,401,629,600	
第321回利付国債(10年)	590,000,000	609,770,900	
第322回利付国債(10年)	500,000,000	515,315,000	
第323回利付国債(10年)	560,000,000	578,760,000	
第324回利付国債(10年)	750,000,000	772,777,500	
第325回利付国債(10年)	1,480,000,000	1,528,603,200	
第326回利付国債(10年)	520,000,000	536,458,000	

第327回利付国債(10年)	1,220,000,000	1,263,053,800	
第328回利付国債(10年)	1,390,000,000	1,431,616,600	
第329回利付国債(10年)	1,430,000,000	1,487,471,700	
第330回利付国債(10年)	1,060,000,000	1,105,230,200	
第331回利付国債(10年)	500,000,000	516,935,000	
第332回利付国債(10年)	1,420,000,000	1,470,864,400	
第333回利付国債(10年)	1,480,000,000	1,535,870,000	
第334回利付国債(10年)	1,410,000,000	1,466,019,300	
第335回利付国債(10年)	1,270,000,000	1,316,088,300	
第336回利付国債(10年)	640,000,000	664,313,600	
第337回利付国債(10年)	920,000,000	944,518,000	
第338回利付国債(10年)	1,220,000,000	1,261,175,000	
第339回利付国債(10年)	1,370,000,000	1,418,251,400	
第340回利付国債(10年)	1,310,000,000	1,357,618,500	
第341回利付国債(10年)	1,260,000,000	1,299,186,000	
第342回利付国債(10年)	1,400,000,000	1,425,746,000	
第343回利付国債(10年)	1,390,000,000	1,416,006,900	
第344回利付国債(10年)	1,310,000,000	1,334,890,000	
第345回利付国債(10年)	1,130,000,000	1,151,763,800	
第346回利付国債(10年)	1,160,000,000	1,182,596,800	
第347回利付国債(10年)	1,220,000,000	1,243,521,600	
第348回利付国債(10年)	1,030,000,000	1,049,590,600	
第349回利付国債(10年)	1,160,000,000	1,181,703,600	
第350回利付国債(10年)	1,520,000,000	1,547,861,600	
第351回利付国債(10年)	1,160,000,000	1,180,253,600	
第352回利付国債(10年)	960,000,000	976,300,800	
第353回利付国債(10年)	770,000,000	782,666,500	
第354回利付国債(10年)	200,000,000	203,074,000	
第1回利付国債(30年)	10,000,000	12,916,100	
第11回利付国債(30年)	50,000,000	61,007,500	
第12回利付国債(30年)	30,000,000	38,389,200	

第13回利付国債(30年)	50,000,000	63,411,500	
第14回利付国債(30年)	50,000,000	66,452,500	
第15回利付国債(30年)	60,000,000	80,899,200	
第16回利付国債(30年)	90,000,000	121,677,300	
第17回利付国債(30年)	70,000,000	93,817,500	
第18回利付国債(30年)	80,000,000	106,238,400	
第19回利付国債(30年)	80,000,000	106,476,800	
第20回利付国債(30年)	130,000,000	177,667,100	
第21回利付国債(30年)	110,000,000	147,149,200	
第22回利付国債(30年)	70,000,000	96,106,500	
第23回利付国債(30年)	150,000,000	206,578,500	
第24回利付国債(30年)	80,000,000	110,419,200	
第25回利付国債(30年)	130,000,000	175,262,100	
第26回利付国債(30年)	220,000,000	301,136,000	
第27回利付国債(30年)	200,000,000	278,534,000	
第28回利付国債(30年)	290,000,000	405,710,000	
第29回利付国債(30年)	300,000,000	415,692,000	
第30回利付国債(30年)	410,000,000	562,659,400	
第31回利付国債(30年)	360,000,000	489,409,200	
第32回利付国債(30年)	440,000,000	609,787,200	
第33回利付国債(30年)	520,000,000	691,948,400	
第34回利付国債(30年)	520,000,000	716,097,200	
第35回利付国債(30年)	500,000,000	670,435,000	
第36回利付国債(30年)	550,000,000	740,536,500	
第37回利付国債(30年)	580,000,000	770,854,800	
第38回利付国債(30年)	370,000,000	484,951,600	
第39回利付国債(30年)	300,000,000	400,731,000	
第40回利付国債(30年)	280,000,000	368,261,600	
第41回利付国債(30年)	280,000,000	362,381,600	
第42回利付国債(30年)	280,000,000	362,723,200	
第43回利付国債(30年)	300,000,000	389,007,000	

第44回利付国債(30年)	370,000,000	480,774,300	
第45回利付国債(30年)	360,000,000	450,964,800	
第46回利付国債(30年)	430,000,000	538,966,300	
第47回利付国債(30年)	390,000,000	498,888,000	
第48回利付国債(30年)	400,000,000	492,468,000	
第49回利付国債(30年)	420,000,000	517,297,200	
第50回利付国債(30年)	430,000,000	464,950,400	
第51回利付国債(30年)	390,000,000	372,262,800	
第52回利付国債(30年)	400,000,000	401,932,000	
第53回利付国債(30年)	370,000,000	380,826,200	
第54回利付国債(30年)	440,000,000	475,772,000	
第55回利付国債(30年)	430,000,000	464,658,000	
第56回利付国債(30年)	400,000,000	431,956,000	
第57回利付国債(30年)	370,000,000	399,285,500	
第58回利付国債(30年)	490,000,000	528,406,200	
第59回利付国債(30年)	330,000,000	346,773,900	
第60回利付国債(30年)	330,000,000	364,267,200	
第61回利付国債(30年)	300,000,000	314,664,000	
第62回利付国債(30年)	50,000,000	49,613,000	
第46回利付国債(20年)	40,000,000	41,064,000	
第59回利付国債(20年)	10,000,000	10,680,400	
第64回利付国債(20年)	30,000,000	32,724,900	
第65回利付国債(20年)	60,000,000	65,763,600	
第67回利付国債(20年)	50,000,000	55,048,000	
第70回利付国債(20年)	50,000,000	56,615,500	
第71回利付国債(20年)	40,000,000	44,880,000	
第72回利付国債(20年)	110,000,000	123,491,500	
第73回利付国債(20年)	40,000,000	44,909,200	
第74回利付国債(20年)	40,000,000	45,136,000	
第75回利付国債(20年)	40,000,000	45,363,600	
第76回利付国債(20年)	70,000,000	78,557,500	

第77回利付国債(20年)	40,000,000	45,126,800	
第78回利付国債(20年)	60,000,000	67,653,600	
第79回利付国債(20年)	50,000,000	56,687,000	
第80回利付国債(20年)	90,000,000	102,591,900	
第81回利付国債(20年)	160,000,000	182,230,400	
第82回利付国債(20年)	140,000,000	160,351,800	
第83回利付国債(20年)	70,000,000	80,579,100	
第84回利付国債(20年)	170,000,000	194,554,800	
第85回利付国債(20年)	150,000,000	173,463,000	
第86回利付国債(20年)	120,000,000	140,434,800	
第87回利付国債(20年)	120,000,000	139,603,200	
第88回利付国債(20年)	240,000,000	282,285,600	
第89回利付国債(20年)	10,000,000	11,690,000	
第90回利付国債(20年)	170,000,000	199,685,400	
第91回利付国債(20年)	110,000,000	130,027,700	
第92回利付国債(20年)	290,000,000	340,007,600	
第93回利付国債(20年)	120,000,000	140,360,400	
第94回利付国債(20年)	220,000,000	259,076,400	
第95回利付国債(20年)	200,000,000	239,760,000	
第96回利付国債(20年)	120,000,000	141,889,200	
第97回利付国債(20年)	160,000,000	191,292,800	
第98回利付国債(20年)	160,000,000	189,940,800	
第99回利付国債(20年)	300,000,000	357,516,000	
第100回利付国債(20年)	230,000,000	277,179,900	
第101回利付国債(20年)	130,000,000	158,990,000	
第102回利付国債(20年)	140,000,000	171,957,800	
第103回利付国債(20年)	160,000,000	195,054,400	
第104回利付国債(20年)	110,000,000	132,078,100	
第105回利付国債(20年)	240,000,000	289,240,800	
第106回利付国債(20年)	150,000,000	182,190,000	
第107回利付国債(20年)	200,000,000	241,900,000	

第108回利付国債(20年)	390,000,000	464,158,500	
第109回利付国債(20年)	280,000,000	334,283,600	
第110回利付国債(20年)	360,000,000	436,932,000	
第111回利付国債(20年)	170,000,000	208,780,400	
第112回利付国債(20年)	390,000,000	475,004,400	
第113回利付国債(20年)	600,000,000	733,284,000	
第114回利付国債(20年)	400,000,000	490,476,000	
第115回利付国債(20年)	160,000,000	197,894,400	
第116回利付国債(20年)	210,000,000	260,610,000	
第117回利付国債(20年)	370,000,000	455,144,400	
第118回利付国債(20年)	295,000,000	360,779,100	
第119回利付国債(20年)	280,000,000	336,204,400	
第120回利付国債(20年)	250,000,000	294,622,500	
第121回利付国債(20年)	390,000,000	473,959,200	
第122回利付国債(20年)	330,000,000	397,293,600	
第123回利付国債(20年)	380,000,000	471,876,400	
第124回利付国債(20年)	200,000,000	246,036,000	
第125回利付国債(20年)	330,000,000	414,892,500	
第126回利付国債(20年)	300,000,000	370,080,000	
第127回利付国債(20年)	220,000,000	268,789,400	
第128回利付国債(20年)	450,000,000	551,245,500	
第129回利付国債(20年)	250,000,000	303,230,000	
第130回利付国債(20年)	400,000,000	486,336,000	
第131回利付国債(20年)	310,000,000	373,097,400	
第132回利付国債(20年)	350,000,000	422,138,500	
第133回利付国債(20年)	350,000,000	426,520,500	
第134回利付国債(20年)	420,000,000	512,954,400	
第135回利付国債(20年)	190,000,000	229,626,400	
第136回利付国債(20年)	260,000,000	310,910,600	
第137回利付国債(20年)	250,000,000	302,760,000	
第138回利付国債(20年)	260,000,000	308,115,600	

第139回利付国債(20年)	270,000,000	323,473,500	
第140回利付国債(20年)	640,000,000	776,608,000	
第141回利付国債(20年)	440,000,000	534,930,000	
第142回利付国債(20年)	380,000,000	467,092,200	
第143回利付国債(20年)	490,000,000	590,092,300	
第144回利付国債(20年)	240,000,000	285,746,400	
第145回利付国債(20年)	710,000,000	866,306,500	
第146回利付国債(20年)	630,000,000	770,042,700	
第147回利付国債(20年)	580,000,000	701,788,400	
第148回利付国債(20年)	620,000,000	742,226,800	
第149回利付国債(20年)	570,000,000	683,224,800	
第150回利付国債(20年)	750,000,000	888,817,500	
第151回利付国債(20年)	640,000,000	739,718,400	
第152回利付国債(20年)	620,000,000	716,974,200	
第153回利付国債(20年)	690,000,000	809,121,600	
第154回利付国債(20年)	660,000,000	763,989,600	
第155回利付国債(20年)	590,000,000	664,298,700	
第156回利付国債(20年)	560,000,000	574,985,600	
第157回利付国債(20年)	650,000,000	644,663,500	
第158回利付国債(20年)	630,000,000	655,666,200	
第159回利付国債(20年)	620,000,000	654,955,600	
第160回利付国債(20年)	580,000,000	622,496,600	
第161回利付国債(20年)	480,000,000	506,044,800	
第162回利付国債(20年)	500,000,000	526,570,000	
第163回利付国債(20年)	600,000,000	631,176,000	
第164回利付国債(20年)	630,000,000	650,745,900	
第165回利付国債(20年)	490,000,000	505,430,100	
第166回利付国債(20年)	500,000,000	533,675,000	
第167回利付国債(20年)	500,000,000	514,235,000	
第168回利付国債(20年)	100,000,000	100,834,000	
小計	銘柄数: 237	119,175,000,000	130,316,654,100

		組入時価比率：85.0%		85.4%
	合計			130,316,654,100
地方債証券	日本・円	第1回東京都公募公債(20年)	100,000,000	106,299,000
		第7回東京都公募公債(20年)	100,000,000	113,609,000
		第18回東京都公募公債(20年)	100,000,000	120,823,000
		第21回東京都公募公債(20年)	100,000,000	121,775,000
		第687回東京都公募公債	100,000,000	101,514,000
		第719回東京都公募公債	200,000,000	206,568,000
		第760回東京都公募公債	100,000,000	100,110,000
		平成28年度第6回北海道公募公債	100,000,000	100,255,000
		平成30年度第14回北海道公募公債	100,000,000	100,858,000
		第29回1号宮城県公募公債(10年)	100,000,000	102,989,000
		第3回神奈川県公募公債(30年)	100,000,000	137,572,000
		第176回神奈川県公募公債	100,000,000	101,569,000
		第213回神奈川県公募公債	100,000,000	103,010,000
		第13回大阪府公募公債(20年)	100,000,000	112,697,000
		第368回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	102,981,000
		第413回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	99,858,000
		第419回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	101,118,000
		平成29年度第13回京都府公募公債	109,330,000	110,580,735
		第2回兵庫県公募公債(30年)	100,000,000	135,256,000
		第5回兵庫県公募公債(12年)	100,000,000	105,136,000
		第2回静岡県公募公債(15年)	100,000,000	111,116,000
		第4回静岡県公募公債(15年)	100,000,000	111,397,000
		平成24年度第12回愛知県公募公債(30年)	100,000,000	133,326,000
		平成27年度第15回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	102,885,000
		平成30年度第3回広島県公募公債	100,000,000	101,525,000
		第13回埼玉県公募公債(20年)	100,000,000	118,056,000

第15回埼玉県公募公債(20年)	100,000,000	112,545,000	
平成25年度第8回埼玉県公募公債	100,000,000	103,209,000	
平成24年度第1回福岡県公募公債(15年)	100,000,000	110,903,000	
平成28年度第8回福岡県公募公債	100,000,000	101,634,000	
第21回千葉県公募公債(20年)	100,000,000	100,148,000	
平成25年度第6回千葉県公募公債	100,000,000	103,459,000	
平成27年度第9回千葉県公募公債	100,000,000	100,446,000	
平成25年度第2回新潟県公募公債	100,000,000	103,173,000	
第7回群馬県公募公債(10年)	100,000,000	101,659,000	
第87回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,449,000	
第94回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,113,000	
第97回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,683,000	
第100回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,649,000	
第105回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,788,000	
第115回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,737,000	
第118回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,084,000	
第127回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,989,000	
第132回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,170,000	
第146回共同発行市場公募地方債	200,000,000	206,432,000	
第153回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,906,000	
第157回共同発行市場公募地方債	120,000,000	120,416,400	
第159回共同発行市場公募地方債	200,000,000	200,568,000	
第174回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,792,000	
第178回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,430,000	
平成23年度第2回堺市公募公債	100,000,000	102,742,000	
平成26年度第1回長崎県公募公債	100,000,000	102,879,000	
平成25年度第2回島根県公募公債	106,000,000	109,185,300	
平成22年度第1回栃木県公募公債	100,000,000	101,627,000	
平成23年度第1回新潟市公募公債(10年)	100,000,000	102,757,000	
平成27年度第1回奈良県公募公債	100,000,000	100,142,000	
平成26年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	102,746,000	

		平成26年度第1回浜松市公募公債	100,000,000	101,799,000
		第6回大阪市公募公債(20年)	200,000,000	240,320,000
		第16回名古屋市公募公債(20年)	100,000,000	117,690,000
		平成26年度第4回神戸市公募公債	100,000,000	103,040,000
		平成23年度第5回横浜市公募公債	100,000,000	102,728,000
		第29回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	117,762,000
		平成26年度第4回札幌市公募公債(10年)	100,000,000	102,658,000
		第6回北九州市公募公債(20年)	100,000,000	118,331,000
		平成26年度第3回広島市公募公債	100,000,000	102,371,000
		第8回さいたま市公募公債	100,000,000	101,956,000
		平成26年度第1回相模原市公募公債	100,000,000	102,730,000
		平成26年度第1回三重県公募公債	100,000,000	102,455,000
		第7回広島県・広島市折半保証広島高速道路債券	100,000,000	102,696,000
	小計	銘柄数:70 組入時価比率:5.1%	7,435,330,000	7,894,879,435 5.2%
	合計			7,894,879,435
特殊債券	日本・円	第19回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	102,751,000
		第78回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	101,142,000
		第28回道路債券	100,000,000	135,707,000
		第75回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	120,877,000
		第97回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	121,320,000
		第101回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	205,504,000
		第116回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	126,004,000
		第124回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	101,000,000	103,064,440
		第124回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	117,607,000
		第133回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	116,000,000	119,089,080

第139回日本高速道路保有・債務 返済機構債券	100,000,000	102,382,000	
第142回政府保証日本高速道路保 有・債務返済機構債券	100,000,000	102,421,000	
第147回政府保証日本高速道路保 有・債務返済機構債券	100,000,000	102,591,000	
第153回政府保証日本高速道路保 有・債務返済機構債券	100,000,000	120,164,000	
第155回日本高速道路保有・債務 返済機構債券	100,000,000	114,420,000	
第159回日本高速道路保有・債務 返済機構債券	100,000,000	122,319,000	
第162回日本高速道路保有・債務 返済機構債券	100,000,000	131,169,000	
第170回政府保証日本高速道路保 有・債務返済機構債券	100,000,000	102,808,000	
第177回政府保証日本高速道路保 有・債務返済機構債券	100,000,000	103,034,000	
第188回政府保証日本高速道路保 有・債務返済機構債券	100,000,000	115,923,000	
第195回政府保証日本高速道路保 有・債務返済機構債券	100,000,000	104,050,000	
第202回政府保証日本高速道路保 有・債務返済機構債券	105,000,000	108,507,000	
第211回政府保証日本高速道路保 有・債務返済機構債券	100,000,000	103,398,000	
第218回政府保証日本高速道路保 有・債務返済機構債券	100,000,000	103,577,000	
第220回政府保証日本高速道路保 有・債務返済機構債券	200,000,000	207,098,000	
第250回政府保証日本高速道路保 有・債務返済機構債券	100,000,000	115,158,000	
第254回政府保証日本高速道路保 有・債務返済機構債券	100,000,000	103,068,000	
第268回政府保証日本高速道路保 有・債務返済機構債券	100,000,000	117,285,000	
第300回政府保証日本高速道路保 有・債務返済機構債券	100,000,000	101,240,000	
第337回政府保証日本高速道路保 有・債務返済機構債券	100,000,000	103,509,000	
第1回地方公共団体金融機構債券 (20年)	100,000,000	121,261,000	
第13回地方公共団体金融機構債券 (20年)	100,000,000	122,281,000	
第15回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,401,000	
第23回地方公共団体金融機構債券 (20年)	100,000,000	118,230,000	

第24回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,345,000	
第29回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,486,000	
第36回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,871,000	
第36回地方公共団体金融機構債券(20年)	100,000,000	117,882,000	
第38回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,819,000	
第40回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,728,000	
第44回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,868,000	
第59回地方公共団体金融機構債券(20年)	100,000,000	104,249,000	
第71回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,607,000	
第91回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,991,000	
第98回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,601,000	
第103回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,509,000	
第113回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,923,000	
F147回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	219,096,000	
第40回政府保証日本政策金融公庫債券	103,000,000	103,459,380	
第23回国際協力銀行債券	100,000,000	113,490,000	
第93回都市再生債券	100,000,000	109,488,000	
第21回政府保証中部国際空港債券	100,000,000	102,907,000	
第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	15,779,000	16,639,744	
第27回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	26,086,000	28,086,274	
第38回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	36,551,000	38,839,458	
第44回貸付債権担保住宅金融公庫債券	14,847,000	15,678,580	
第49回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	33,874,000	36,159,817	
第52回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	40,290,000	42,782,742	
第53回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	41,815,000	44,392,894	

第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	49,289,000	52,226,131	
第64回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	106,204,000	111,641,644	
第76回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	46,490,000	48,903,760	
第82回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	54,787,000	57,153,250	
第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	56,431,000	58,900,420	
第86回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	59,852,000	62,468,130	
第90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	62,561,000	64,886,392	
第93回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	67,926,000	69,476,071	
第96回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	76,739,000	79,134,791	
第99回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	77,946,000	81,069,296	
第117回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,121,000	92,438,609	
第118回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,369,000	92,759,636	
第119回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,426,000	92,752,591	
第124回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	111,253,000	
第130回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	191,020,000	193,440,223	
第137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	196,142,000	199,276,349	
第142回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,873,000	100,258,509	
第159回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	111,691,000	
第172回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,670,000	
第233回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,414,000	
い第785号商工債	100,000,000	100,264,000	
第326回信金中金債(5年)	100,000,000	100,014,000	
第331回信金中金債(5年)	100,000,000	100,092,000	
第342回信金中金債(5年)	100,000,000	100,222,000	
第18回国際協力機構債券	100,000,000	103,488,000	

小計		第78回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	106,674,000	
		銘柄数：85 組入時価比率：5.7%	8,153,418,000	8,713,826,211	5.7%
	合計			8,713,826,211	
社債券	日本・円	第26回フランス相互信用連合銀行(BFCM)円貨社債(2018)	100,000,000	100,666,000	
		第8回ノルデア・バンク・アクツイエボラーク・プブリクト円貨社債(2015)	100,000,000	100,212,000	
		第2回ピー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債(2017)	100,000,000	99,804,000	
		第11回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債(2016)	100,000,000	99,707,000	
		第344回東京交通債券	100,000,000	106,173,000	
		第16回成田国際空港株式会社社債	100,000,000	102,699,000	
		第37回東日本高速道路株式会社社債	200,000,000	199,914,000	
		第56回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	103,267,000	
		第26回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	103,085,000	
		第22回清水建設株式会社無担保社債	100,000,000	100,385,000	
		第10回キリンホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	102,470,000	
		第9回日本たばこ産業株式会社社債	100,000,000	100,209,000	
		第49回住友化学株式会社無担保社債	100,000,000	103,688,000	
		第65回新日鐵住金株式会社無担保社債	100,000,000	101,070,000	
		第23回株式会社豊田自動織機無担保社債	100,000,000	100,659,000	
		第36回富士通株式会社無担保社債	100,000,000	100,870,000	
		第17回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	101,203,000	
		第29回三菱重工株式会社無担保社債	100,000,000	102,298,000	
		第5回三井住友トラスト・パナソニックファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	101,014,000	
		第58回日産自動車株式会社無担保社債	100,000,000	101,935,000	

第26回豊田通商株式会社無担保社債	100,000,000	102,980,000	
第79回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	102,803,000	
第53回株式会社クレディセゾン無担保社債	100,000,000	100,660,000	
第57回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	107,408,000	
第88回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	116,565,000	
第12回株式会社りそな銀行無担保社債	100,000,000	115,379,000	
第31回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	100,723,000	
第81回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	100,041,000	
第56回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	101,160,000	
第16回株式会社大和証券グループ本社無担保社債	100,000,000	100,956,000	
第50回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,066,000	
第112回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	100,826,000	
第106回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	100,427,000	
第71回東京急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	101,540,000	
第65回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	119,780,000	
第107回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	116,987,000	
第21回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	119,578,000	
第7回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	106,547,000	
第9回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	110,000,000	116,371,200	
第32回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	117,449,000	
第62回日本電信電話株式会社電信電話債券	100,000,000	102,251,000	
第527回中部電力株式会社社債	100,000,000	102,490,000	
第484回関西電力株式会社社債	100,000,000	101,262,000	
第497回関西電力株式会社社債	100,000,000	104,061,000	
第382回中国電力株式会社社債	100,000,000	100,821,000	

	第311回北陸電力株式会社社債	100,000,000	103,961,000	
	第488回東北電力株式会社社債	100,000,000	99,636,000	
	第428回九州電力株式会社社債	100,000,000	103,291,000	
	第321回北海道電力株式会社社債	100,000,000	102,821,000	
	第54回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	99,811,000	
	第34回東京瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	102,478,000	
	第30回大阪瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	102,605,000	
	第27回株式会社エヌ・ティ・ティ・データ無担保社債	100,000,000	103,280,000	
	第5回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	100,000,000	99,764,000	
小計	銘柄数：54 組入時価比率：3.7%	5,510,000,000	5,708,106,200	3.7%
合計			5,708,106,200	
	合計		152,633,465,946	

（注1）比率は左より組入時価の純資産総額に対する比率、及び各小計欄の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

MHAM外国債券インデックスマザーファンド

なお、以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

（単位：円）

（令和1年5月8日現在）

資産の部	
流動資産	
預金	267,601,669
コール・ローン	25,441,143
国債証券	22,546,902,805

未収入金	195,158,040
未収利息	146,966,878
前払費用	40,260,643
差入委託証拠金	48,146,714
流動資産合計	23,270,477,892
資産合計	23,270,477,892
負債の部	
流動負債	
未払金	193,216,183
未払解約金	951,100
流動負債合計	194,167,283
負債合計	194,167,283
純資産の部	
元本等	
元本	18,254,512,323
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	4,821,798,286
元本等合計	23,076,310,609
純資産合計	23,076,310,609
負債純資産合計	23,270,477,892

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	(自 平成30年 5月 9日 至 令和 1年 5月 8日)
1 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 原則として時価で評価しております。
2 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算し、為替予約の評価は計算期間末日に残高がある場合、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
3 収益・費用の計上基準	有価証券売買等損益、派生商品取引等損益及び為替差損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	(令和 1年 5月 8日現在)
1 計算期間末日における受益権の総数	18,254,512,323口

2	計算期間末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産の額 (1万口当たり純資産の額)	1.2641円 (12,641円)
---	------------------------	---------------------------------	--------------------------

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	(自平成30年5月9日 至令和1年5月8日)
1 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める投資を目的とする証券投資信託であり、証券投資信託約款および投資ガイドラインに基づいて運用しております。
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。 なお、詳細は附属明細表をご参照下さい。
3 金融商品に係るリスク管理体制	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。 当ファンドは信託財産に属する資産の効率的な運用に資することを目的として、債券先物取引を行っており、当該デリバティブ取引は対象とする株価指数等に係る価格変動リスクを有しております。 また、外貨建証券の売買等の決済に伴い必要となる外貨の売買のために、為替予約取引を行っております。 運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。 リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。 なお、具体的には以下のリスクの管理を行っております。
4 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	市場リスクの管理 市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。 信用リスクの管理 信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。 流動性リスクの管理 流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には、合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	(令和1年5月8日現在)
1 貸借対照表日における貸借対照表の科目ごとの計上額・時価・時価との差額	貸借対照表に計上している金融商品は、原則として時価評価としているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2 貸借対照表の科目ごとの時価の算定方法	(1)有価証券

	<p>国債証券</p> <p>わが国の金融商品取引所または海外取引所に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）（外貨建証券を除く）、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除く）または価格情報会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できない場合または入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認められた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認められた価額で評価しております。</p> <p>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>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、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
--	--

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

（自 平成30年 5月 9日 至 令和 1年 5月 8日）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	372,622,843
合計	372,622,843

（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。

（その他の注記）

項目	期別 (令和 1年 5月 8日現在)
期首	平成30年 5月 9日
親投資信託の期首における元本額	12,804,000,846円
期中追加設定元本額	20,582,426,286円
期中一部解約元本額	15,131,914,809円
期末元本額及びその内訳として当該親投資信託受益証券を投資対象とする委託者指図型投資信託ごとの元本額	
期末元本額	18,254,512,323円
動的パッケージファンド<DC年金>	65,134,556円
コア資産形成ファンド	63,318,242円
MHAM外国債券インデックスファンド（ファンドラップ）	693,810,769円
MHAM外国債券インデックスファンド	70,516,829円
MHAM外国債券インデックスファンド<為替ヘッジあり>（ファンドラップ）	974,835,555円
MHAM動的パッケージファンド〔適格機関投資家限定〕	12,870,608,306円
MHAM外国債券パッシブファンド〔適格機関投資家限定〕	3,516,288,066円

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

(令和1年5月8日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	米・ドル	US TREASURY N/B 1.125%	140,000.00	138,293.75	
		US TREASURY N/B 1.125%	220,000.00	215,359.37	
		US TREASURY N/B 1.125%	340,000.00	331,925.00	
		US TREASURY N/B 1.125%	140,000.00	136,510.93	
		US TREASURY N/B 1.125%	380,000.00	370,196.00	
		US TREASURY N/B 1.125%	40,000.00	38,936.00	
		US TREASURY N/B 1.25%	2,140,000.00	2,098,537.50	
		US TREASURY N/B 1.25%	300,000.00	292,710.93	
		US TREASURY N/B 1.25%	150,000.00	143,895.00	
		US TREASURY N/B 1.375%	300,000.00	297,000.00	
		US TREASURY N/B 1.375%	300,000.00	296,765.62	
		US TREASURY N/B 1.375%	250,000.00	246,796.87	
		US TREASURY N/B 1.375%	190,000.00	187,387.50	
		US TREASURY N/B 1.375%	610,000.00	601,231.25	
		US TREASURY N/B 1.375%	110,000.00	108,221.09	
		US TREASURY N/B 1.375%	160,000.00	157,162.50	
		US TREASURY N/B 1.375%	310,000.00	304,260.15	
		US TREASURY N/B 1.375%	370,000.00	357,050.00	
		US TREASURY N/B 1.375%	170,000.00	163,864.06	
		US TREASURY N/B 1.375%	230,000.00	221,421.00	
		US TREASURY N/B 1.5%	100,000.00	99,085.93	
		US TREASURY N/B 1.5%	250,000.00	247,675.78	
		US TREASURY N/B 1.5%	210,000.00	205,865.62	
US TREASURY N/B 1.5%	240,000.00	233,437.50			
US TREASURY N/B 1.5%	440,000.00	427,556.25			

US TREASURY N/B 1.5%	1,030,000.00	970,453.12	
US TREASURY N/B 1.625%	250,000.00	247,832.03	
US TREASURY N/B 1.625%	270,000.00	267,532.03	
US TREASURY N/B 1.625%	280,000.00	276,893.75	
US TREASURY N/B 1.625%	150,000.00	147,082.03	
US TREASURY N/B 1.625%	1,070,000.00	1,048,934.37	
US TREASURY N/B 1.625%	230,000.00	225,202.34	
US TREASURY N/B 1.625%	320,000.00	312,375.00	
US TREASURY N/B 1.625%	230,000.00	224,447.65	
US TREASURY N/B 1.625%	300,000.00	291,540.00	
US TREASURY N/B 1.625%	610,000.00	582,407.03	
US TREASURY N/B 1.625%	1,040,000.00	990,843.75	
US TREASURY N/B 1.75%	200,000.00	198,250.00	
US TREASURY N/B 1.75%	140,000.00	138,687.50	
US TREASURY N/B 1.75%	160,000.00	158,000.00	
US TREASURY N/B 1.75%	200,000.00	197,359.37	
US TREASURY N/B 1.75%	180,000.00	177,454.68	
US TREASURY N/B 1.75%	250,000.00	246,445.31	
US TREASURY N/B 1.75%	290,000.00	285,763.28	
US TREASURY N/B 1.75%	260,000.00	256,260.47	
US TREASURY N/B 1.75%	210,000.00	206,653.12	
US TREASURY N/B 1.75%	260,000.00	255,389.06	
US TREASURY N/B 1.75%	390,000.00	382,413.28	
US TREASURY N/B 1.875%	120,000.00	119,306.25	
US TREASURY N/B 1.875%	250,000.00	248,222.65	
US TREASURY N/B 1.875%	250,000.00	247,695.31	
US TREASURY N/B 1.875%	370,000.00	366,328.90	
US TREASURY N/B 1.875%	320,000.00	316,704.00	
US TREASURY N/B 1.875%	1,340,000.00	1,325,461.00	
US TREASURY N/B 1.875%	200,000.00	197,859.37	
US TREASURY N/B 1.875%	100,000.00	98,921.87	

US TREASURY N/B 1.875%	290,000.00	286,735.23	
US TREASURY N/B 1.875%	210,000.00	207,555.46	
US TREASURY N/B 1.875%	960,000.00	948,825.00	
US TREASURY N/B 1.875%	200,000.00	197,531.25	
US TREASURY N/B 1.875%	120,000.00	117,609.37	
US TREASURY N/B 2.125%	210,000.00	209,327.34	
US TREASURY N/B 2.125%	200,000.00	199,343.75	
US TREASURY N/B 2.125%	190,000.00	189,391.40	
US TREASURY N/B 2.125%	280,000.00	279,146.87	
US TREASURY N/B 2.125%	250,000.00	249,121.09	
US TREASURY N/B 2.125%	250,000.00	249,238.28	
US TREASURY N/B 2.125%	220,000.00	219,243.75	
US TREASURY N/B 2.125%	400,000.00	398,375.00	
US TREASURY N/B 2.125%	260,000.00	258,310.00	
US TREASURY N/B 2.125%	150,000.00	149,027.34	
US TREASURY N/B 2.125%	760,000.00	754,224.00	
US TREASURY N/B 2.125%	180,000.00	178,681.84	
US TREASURY N/B 2.125%	180,000.00	178,509.37	
US TREASURY N/B 2.125%	180,000.00	178,509.37	
US TREASURY N/B 2.125%	1,270,000.00	1,255,712.50	
US TREASURY N/B 2.25%	90,000.00	89,901.56	
US TREASURY N/B 2.25%	170,000.00	169,840.62	
US TREASURY N/B 2.25%	180,000.00	179,845.31	
US TREASURY N/B 2.25%	300,000.00	299,859.37	
US TREASURY N/B 2.25%	280,000.00	279,737.50	
US TREASURY N/B 2.25%	160,000.00	159,776.00	
US TREASURY N/B 2.25%	250,000.00	249,550.78	
US TREASURY N/B 2.25%	420,000.00	419,015.62	
US TREASURY N/B 2.25%	220,000.00	219,587.50	
US TREASURY N/B 2.25%	1,220,000.00	1,213,423.43	
US TREASURY N/B 2.25%	490,000.00	485,214.84	

US TREASURY N/B 2.25%	690,000.00	681,967.97	
US TREASURY N/B 2.25%	810,000.00	799,621.87	
US TREASURY N/B 2.25%	300,000.00	265,335.93	
US TREASURY N/B 2.375%	190,000.00	189,955.46	
US TREASURY N/B 2.375%	200,000.00	200,171.87	
US TREASURY N/B 2.375%	300,000.00	300,375.00	
US TREASURY N/B 2.375%	230,000.00	230,305.46	
US TREASURY N/B 2.375%	340,000.00	341,487.50	
US TREASURY N/B 2.375%	170,000.00	170,956.25	
US TREASURY N/B 2.375%	580,000.00	582,764.06	
US TREASURY N/B 2.375%	460,000.00	459,496.87	
US TREASURY N/B 2.5%	290,000.00	290,339.84	
US TREASURY N/B 2.5%	1,110,000.00	1,111,387.50	
US TREASURY N/B 2.5%	560,000.00	563,543.75	
US TREASURY N/B 2.5%	1,190,000.00	1,198,088.28	
US TREASURY N/B 2.5%	330,000.00	333,093.75	
US TREASURY N/B 2.5%	300,000.00	303,000.00	
US TREASURY N/B 2.5%	690,000.00	696,091.40	
US TREASURY N/B 2.5%	1,270,000.00	1,283,791.40	
US TREASURY N/B 2.5%	220,000.00	222,475.00	
US TREASURY N/B 2.5%	620,000.00	580,135.94	
US TREASURY N/B 2.5%	610,000.00	569,301.55	
US TREASURY N/B 2.5%	290,000.00	270,311.72	
US TREASURY N/B 2.625%	540,000.00	541,603.12	
US TREASURY N/B 2.625%	3,720,000.00	3,731,915.64	
US TREASURY N/B 2.625%	2,460,000.00	2,470,378.12	
US TREASURY N/B 2.625%	290,000.00	291,880.47	
US TREASURY N/B 2.625%	1,020,000.00	1,027,251.56	
US TREASURY N/B 2.625%	230,000.00	231,689.06	
US TREASURY N/B 2.625%	1,450,000.00	1,464,046.87	
US TREASURY N/B 2.625%	250,000.00	253,398.43	

US TREASURY N/B 2.625%	230,000.00	233,378.12	
US TREASURY N/B 2.625%	470,000.00	477,527.34	
US TREASURY N/B 2.625%	240,000.00	244,162.50	
US TREASURY N/B 2.625%	310,000.00	315,425.00	
US TREASURY N/B 2.625%	370,000.00	374,740.62	
US TREASURY N/B 2.625%	750,000.00	761,425.77	
US TREASURY N/B 2.75%	430,000.00	432,250.78	
US TREASURY N/B 2.75%	230,000.00	231,437.50	
US TREASURY N/B 2.75%	200,000.00	202,109.37	
US TREASURY N/B 2.75%	2,220,000.00	2,245,148.44	
US TREASURY N/B 2.75%	230,000.00	234,312.50	
US TREASURY N/B 2.75%	1,190,000.00	1,213,521.09	
US TREASURY N/B 2.75%	1,160,000.00	1,183,471.88	
US TREASURY N/B 2.75%	1,170,000.00	1,194,496.87	
US TREASURY N/B 2.75%	910,000.00	930,048.43	
US TREASURY N/B 2.75%	320,000.00	327,750.00	
US TREASURY N/B 2.75%	250,000.00	255,996.09	
US TREASURY N/B 2.75%	190,000.00	194,646.09	
US TREASURY N/B 2.75%	600,000.00	615,468.75	
US TREASURY N/B 2.75%	250,000.00	247,089.84	
US TREASURY N/B 2.75%	506,000.00	499,477.33	
US TREASURY N/B 2.75%	500,000.00	488,828.12	
US TREASURY N/B 2.75%	590,000.00	576,494.52	
US TREASURY N/B 2.875%	340,000.00	342,576.56	
US TREASURY N/B 2.875%	220,000.00	223,162.50	
US TREASURY N/B 2.875%	340,000.00	345,126.56	
US TREASURY N/B 2.875%	1,180,000.00	1,210,329.69	
US TREASURY N/B 2.875%	1,120,000.00	1,149,225.00	
US TREASURY N/B 2.875%	870,000.00	893,517.18	
US TREASURY N/B 2.875%	330,000.00	340,338.28	
US TREASURY N/B 2.875%	380,000.00	391,934.37	

US TREASURY N/B 2.875%	240,000.00	247,556.25	
US TREASURY N/B 2.875%	650,000.00	670,871.09	
US TREASURY N/B 2.875%	1,070,000.00	1,108,536.72	
US TREASURY N/B 2.875%	1,050,000.00	1,087,980.47	
US TREASURY N/B 2.875%	570,000.00	573,963.27	
US TREASURY N/B 2.875%	370,000.00	371,821.09	
US TREASURY N/B 2.875%	260,000.00	261,096.87	
US TREASURY N/B 2%	210,000.00	209,064.84	
US TREASURY N/B 2%	150,000.00	149,238.28	
US TREASURY N/B 2%	180,000.00	179,114.06	
US TREASURY N/B 2%	110,000.00	109,407.03	
US TREASURY N/B 2%	300,000.00	298,382.81	
US TREASURY N/B 2%	120,000.00	119,325.00	
US TREASURY N/B 2%	210,000.00	208,769.53	
US TREASURY N/B 2%	210,000.00	208,687.50	
US TREASURY N/B 2%	360,000.00	357,834.37	
US TREASURY N/B 2%	190,000.00	188,857.03	
US TREASURY N/B 2%	250,000.00	248,437.50	
US TREASURY N/B 2%	250,000.00	248,125.00	
US TREASURY N/B 2%	320,000.00	317,350.00	
US TREASURY N/B 2%	1,430,000.00	1,417,822.65	
US TREASURY N/B 2%	390,000.00	386,465.62	
US TREASURY N/B 2%	160,000.00	157,768.00	
US TREASURY N/B 2%	130,000.00	128,344.53	
US TREASURY N/B 2%	90,000.00	88,740.00	
US TREASURY N/B 2%	650,000.00	639,285.15	
US TREASURY N/B 2%	1,130,000.00	1,108,194.53	
US TREASURY N/B 2%	1,110,000.00	1,081,382.81	
US TREASURY N/B 3.125%	300,000.00	304,992.18	
US TREASURY N/B 3.125%	960,000.00	1,015,274.99	
US TREASURY N/B 3.125%	105,000.00	110,824.21	

US TREASURY N/B 3.125%	180,000.00	189,759.37	
US TREASURY N/B 3.125%	200,000.00	210,265.62	
US TREASURY N/B 3.125%	550,000.00	578,101.56	
US TREASURY N/B 3.125%	630,000.00	661,992.18	
US TREASURY N/B 3.375%	530,000.00	580,846.87	
US TREASURY N/B 3.375%	620,000.00	683,646.86	
US TREASURY N/B 3.5%	215,000.00	217,368.36	
US TREASURY N/B 3.5%	110,000.00	123,741.40	
US TREASURY N/B 3.625%	270,000.00	276,096.09	
US TREASURY N/B 3.625%	500,000.00	569,570.31	
US TREASURY N/B 3.625%	610,000.00	695,495.31	
US TREASURY N/B 3.75%	110,000.00	127,677.34	
US TREASURY N/B 3.75%	385,000.00	447,622.65	
US TREASURY N/B 3.875%	130,000.00	153,785.93	
US TREASURY N/B 3%	160,000.00	166,300.00	
US TREASURY N/B 3%	150,000.00	155,941.40	
US TREASURY N/B 3%	110,000.00	113,609.37	
US TREASURY N/B 3%	600,000.00	617,109.37	
US TREASURY N/B 3%	570,000.00	586,565.62	
US TREASURY N/B 3%	360,000.00	370,406.25	
US TREASURY N/B 3%	310,000.00	319,033.59	
US TREASURY N/B 3%	460,000.00	472,829.68	
US TREASURY N/B 3%	600,000.00	615,656.25	
US TREASURY N/B 3%	630,000.00	646,537.50	
US TREASURY N/B 3%	510,000.00	523,985.15	
US TREASURY N/B 4.25%	310,000.00	384,860.15	
US TREASURY N/B 4.25%	130,000.00	161,728.12	
US TREASURY N/B 4.375%	50,000.00	62,789.06	
US TREASURY N/B 4.375%	90,000.00	113,610.93	
US TREASURY N/B 4.375%	340,000.00	429,462.50	
US TREASURY N/B 4.375%	100,000.00	126,625.00	

	US TREASURY N/B 4.5%	180,000.00	226,251.56	
	US TREASURY N/B 4.5%	60,000.00	76,560.93	
	US TREASURY N/B 4.5%	175,000.00	224,246.09	
	US TREASURY N/B 4.625%	420,000.00	547,410.93	
	US TREASURY N/B 4.75%	220,000.00	292,153.12	
	US TREASURY N/B 5.25%	65,000.00	80,396.87	
	US TREASURY N/B 5.25%	120,000.00	149,025.00	
	US TREASURY N/B 5.375%	80,000.00	103,412.50	
	US TREASURY N/B 5.5%	50,000.00	62,628.90	
	US TREASURY N/B 5%	55,000.00	73,798.82	
	US TREASURY N/B 6.125%	80,000.00	102,712.50	
	US TREASURY N/B 6.25%	70,000.00	81,331.25	
	US TREASURY N/B 6.25%	49,000.00	66,735.70	
	US TREASURY N/B 6.5%	50,000.00	64,093.75	
	US TREASURY N/B 6%	60,000.00	73,570.31	
	US TREASURY N/B 8%	35,000.00	39,867.18	
小計	銘柄数：227	95,520,000.00	96,682,342.17 (10,653,427,283)	
	組入時価比率：46.2%		47.3%	
カナダ・ドル	CANADIAN GOVT 0.5%	110,000.00	106,788.00	
	CANADIAN GOVT 0.75%	260,000.00	256,926.80	
	CANADIAN GOVT 0.75%	240,000.00	236,424.00	
	CANADIAN GOVT 0.75%	240,000.00	235,562.40	
	CANADIAN GOVT 1.5%	100,000.00	99,767.00	
	CANADIAN GOVT 1.5%	140,000.00	138,878.60	
	CANADIAN GOVT 1.75%	180,000.00	180,369.00	
	CANADIAN GOVT 1.75%	160,000.00	161,147.20	
	CANADIAN GOVT 1%	180,000.00	176,704.20	
	CANADIAN GOVT 1%	150,000.00	142,662.00	
	CANADIAN GOVT 2.25%	580,000.00	586,513.40	
	CANADIAN GOVT 2.25%	70,000.00	72,282.00	

	CANADIAN GOVT 2.25%	110,000.00	114,165.70	
	CANADIAN GOVT 2.25%	70,000.00	73,703.00	
	CANADIAN GOVT 2.5%	120,000.00	125,480.40	
	CANADIAN GOVT 2.75%	110,000.00	113,865.40	
	CANADIAN GOVT 2.75%	220,000.00	259,820.00	
	CANADIAN GOVT 2.75%	50,000.00	62,841.50	
	CANADIAN GOVT 2%	150,000.00	150,808.50	
	CANADIAN GOVT 2%	450,000.00	458,500.50	
	CANADIAN GOVT 2%	330,000.00	339,444.60	
	CANADIAN GOVT 2%	40,000.00	40,574.00	
	CANADIAN GOVT 3.25%	85,000.00	87,879.80	
	CANADIAN GOVT 3.5%	190,000.00	250,672.70	
	CANADIAN GOVT 4%	140,000.00	191,340.80	
	CANADIAN GOVT 5.75%	100,000.00	137,286.00	
	CANADIAN GOVT 5.75%	120,000.00	178,687.20	
	CANADIAN GOVT 5%	150,000.00	220,572.00	
	CANADIAN GOVT 8%	40,000.00	59,100.40	
小計	銘柄数：29	4,885,000.00	5,258,767.10	
			(430,061,973)	
	組入時価比率：1.9%		1.9%	
メキシコ・ペソ	MEX BONOS DESARR 10%	2,394,000.00	2,610,479.84	
	MEX BONOS DESARR 10%	911,000.00	1,040,999.70	
	MEX BONOS DESARR 5.75%	1,429,000.00	1,258,804.67	
	MEX BONOS DESARR 6.5%	5,718,000.00	5,545,316.40	
	MEX BONOS DESARR 6.5%	2,434,000.00	2,333,962.60	
	MEX BONOS DESARR 7.25%	1,510,000.00	1,481,461.00	
	MEX BONOS DESARR 7.5%	4,577,000.00	4,403,485.93	
	MEX BONOS DESARR 7.75%	705,000.00	676,447.50	
	MEX BONOS DESARR 7.75%	915,000.00	864,217.50	
	MEX BONOS DESARR 7.75%	2,393,000.00	2,208,978.30	
	MEX BONOS DESARR 8.5%	840,000.00	857,472.00	

小計	MEX BONOS DESARR 8.5%	2,895,000.00	2,895,579.00	
	MEX BONOS DESARR 8%	4,571,000.00	4,581,280.17	
	MEX BONOS DESARR 8%	869,000.00	817,285.81	
	銘柄数：14 組入時価比率：0.8%	32,161,000.00	31,575,770.42 (182,823,710) 0.8%	
ユーロ	BELGIUM KINGDOM 0.2%	90,000.00	91,674.00	
	BELGIUM KINGDOM 0.5%	80,000.00	82,876.00	
	BELGIUM KINGDOM 0.8%	130,000.00	136,994.00	
	BELGIUM KINGDOM 0.8%	80,000.00	83,968.00	
	BELGIUM KINGDOM 0.8%	190,000.00	197,638.00	
	BELGIUM KINGDOM 0.9%	160,000.00	167,456.00	
	BELGIUM KINGDOM 1.25%	40,000.00	42,360.00	
	BELGIUM KINGDOM 1.45%	40,000.00	42,308.00	
	BELGIUM KINGDOM 1.6%	100,000.00	103,930.00	
	BELGIUM KINGDOM 1.7%	50,000.00	52,195.00	
	BELGIUM KINGDOM 1.9%	50,000.00	56,600.00	
	BELGIUM KINGDOM 1%	90,000.00	95,751.00	
	BELGIUM KINGDOM 1%	80,000.00	83,528.00	
	BELGIUM KINGDOM 2.15%	40,000.00	45,008.00	
	BELGIUM KINGDOM 2.25%	110,000.00	122,001.00	
	BELGIUM KINGDOM 2.25%	110,000.00	127,776.00	
	BELGIUM KINGDOM 2.6%	150,000.00	171,240.00	
	BELGIUM KINGDOM 3.75%	150,000.00	158,940.00	
	BELGIUM KINGDOM 3.75%	100,000.00	153,130.00	
	BELGIUM KINGDOM 3%	70,000.00	91,126.00	
	BELGIUM KINGDOM 4.25%	870,000.00	966,570.00	
	BELGIUM KINGDOM 4.25%	150,000.00	173,520.00	
BELGIUM KINGDOM 4.25%	145,000.00	229,056.50		
BELGIUM KINGDOM 4.5%	70,000.00	91,714.00		
BELGIUM KINGDOM 4%	90,000.00	101,722.50		

BELGIUM KINGDOM 4%	60,000.00	84,546.00	
BELGIUM KINGDOM 5.5%	495,000.00	722,700.00	
BELGIUM KINGDOM 5%	330,000.00	530,013.00	
BONOS Y OBLIG DEL 0.05%	190,000.00	191,187.50	
BONOS Y OBLIG DEL 0.35%	60,000.00	61,026.00	
BONOS Y OBLIG DEL 0.4%	130,000.00	132,489.50	
BONOS Y OBLIG DEL 0.45%	180,000.00	183,996.00	
BONOS Y OBLIG DEL 0.75%	160,000.00	163,776.00	
BONOS Y OBLIG DEL 1.15%	120,000.00	122,221.20	
BONOS Y OBLIG DEL 1.3%	210,000.00	221,550.00	
BONOS Y OBLIG DEL 1.4%	200,000.00	210,600.00	
BONOS Y OBLIG DEL 1.4%	180,000.00	188,352.00	
BONOS Y OBLIG DEL 1.45%	200,000.00	211,940.00	
BONOS Y OBLIG DEL 1.45%	130,000.00	135,986.50	
BONOS Y OBLIG DEL 1.5%	120,000.00	127,740.00	
BONOS Y OBLIG DEL 1.6%	800,000.00	861,680.00	
BONOS Y OBLIG DEL 1.95%	250,000.00	275,325.00	
BONOS Y OBLIG DEL 1.95%	220,000.00	239,668.00	
BONOS Y OBLIG DEL 2.15%	230,000.00	256,162.50	
BONOS Y OBLIG DEL 2.35%	160,000.00	178,832.00	
BONOS Y OBLIG DEL 2.7%	90,000.00	101,007.00	
BONOS Y OBLIG DEL 2.75%	630,000.00	719,019.00	
BONOS Y OBLIG DEL 2.9%	240,000.00	281,323.20	
BONOS Y OBLIG DEL 3.45%	120,000.00	152,196.00	
BONOS Y OBLIG DEL 3.8%	500,000.00	592,200.00	
BONOS Y OBLIG DEL 4.2%	120,000.00	168,096.00	
BONOS Y OBLIG DEL 4.4%	230,000.00	275,482.50	
BONOS Y OBLIG DEL 4.65%	215,000.00	272,587.75	
BONOS Y OBLIG DEL 4.7%	410,000.00	622,011.00	
BONOS Y OBLIG DEL 4.8%	140,000.00	171,486.00	
BONOS Y OBLIG DEL 4.85%	120,000.00	127,446.00	

BONOS Y OBLIG DEL 4.9%	60,000.00	92,682.00	
BONOS Y OBLIG DEL 4%	220,000.00	229,145.40	
BONOS Y OBLIG DEL 5.15%	300,000.00	416,430.00	
BONOS Y OBLIG DEL 5.15%	130,000.00	211,913.00	
BONOS Y OBLIG DEL 5.4%	290,000.00	350,291.00	
BONOS Y OBLIG DEL 5.5%	350,000.00	390,152.00	
BONOS Y OBLIG DEL 5.75%	245,000.00	379,064.00	
BONOS Y OBLIG DEL 5.85%	445,000.00	519,359.50	
BONOS Y OBLIG DEL 5.9%	330,000.00	455,994.00	
BONOS Y OBLIG DEL 6%	400,000.00	591,560.00	
BUNDES OBLIGATION 0.25%	140,000.00	141,741.60	
BUNDES OBLIGATION 0%	1,030,000.00	1,042,349.70	
BUNDES OBLIGATION 0%	210,000.00	213,185.70	
BUNDES OBLIGATION 0%	100,000.00	101,838.00	
BUNDES OBLIGATION 0%	170,000.00	173,736.60	
BUNDES OBLIGATION 0%	140,000.00	143,214.40	
BUNDESREPUB. DEUT 0.25%	600,000.00	623,160.00	
BUNDESREPUB. DEUT 0.25%	480,000.00	495,038.40	
BUNDESREPUB. DEUT 0.25%	80,000.00	82,224.80	
BUNDESREPUB. DEUT 0.5%	240,000.00	252,806.40	
BUNDESREPUB. DEUT 0.5%	240,000.00	253,612.80	
BUNDESREPUB. DEUT 0.5%	210,000.00	222,180.00	
BUNDESREPUB. DEUT 0.5%	230,000.00	243,105.40	
BUNDESREPUB. DEUT 0%	230,000.00	234,807.00	
BUNDESREPUB. DEUT 1.25%	170,000.00	198,524.30	
BUNDESREPUB. DEUT 1.5%	130,000.00	139,159.80	
BUNDESREPUB. DEUT 1.5%	110,000.00	118,673.50	
BUNDESREPUB. DEUT 1.5%	120,000.00	129,992.40	
BUNDESREPUB. DEUT 1.5%	130,000.00	143,026.00	
BUNDESREPUB. DEUT 1.75%	610,000.00	655,780.50	
BUNDESREPUB. DEUT 1.75%	130,000.00	144,107.60	

BUNDESREPUB. DEUT 1%	150,000.00	161,619.00	
BUNDESREPUB. DEUT 1%	90,000.00	97,843.50	
BUNDESREPUB. DEUT 2.25%	100,000.00	103,815.00	
BUNDESREPUB. DEUT 2.25%	120,000.00	128,072.40	
BUNDESREPUB. DEUT 2.5%	300,000.00	315,927.00	
BUNDESREPUB. DEUT 2.5%	360,000.00	524,710.80	
BUNDESREPUB. DEUT 2.5%	230,000.00	340,786.40	
BUNDESREPUB. DEUT 2%	170,000.00	181,976.50	
BUNDESREPUB. DEUT 2%	830,000.00	920,992.90	
BUNDESREPUB. DEUT 3.25%	140,000.00	151,750.20	
BUNDESREPUB. DEUT 3.25%	250,000.00	401,470.00	
BUNDESREPUB. DEUT 3%	200,000.00	208,368.00	
BUNDESREPUB. DEUT 4.25%	120,000.00	209,106.00	
BUNDESREPUB. DEUT 4.75%	100,000.00	145,054.00	
BUNDESREPUB. DEUT 4.75%	310,000.00	519,677.80	
BUNDESREPUB. DEUT 4.75%	130,000.00	243,792.90	
BUNDESREPUB. DEUT 4%	340,000.00	554,091.20	
BUNDESREPUB. DEUT 5.5%	240,000.00	393,468.00	
BUNDESREPUB. DEUT 5.625%	150,000.00	226,210.50	
BUNDESREPUB. DEUT 6.25%	70,000.00	92,260.70	
BUNDESREPUB. DEUT 6.25%	70,000.00	117,219.90	
BUNDESREPUB. DEUT 6.5%	70,000.00	108,796.80	
BUNDESSCHATZANW 0%	240,000.00	241,581.60	
BUONI POLIENNALI 0.2%	350,000.00	350,028.00	
BUONI POLIENNALI 0.35%	110,000.00	110,330.00	
BUONI POLIENNALI 0.35%	70,000.00	69,426.00	
BUONI POLIENNALI 0.45%	60,000.00	59,940.00	
BUONI POLIENNALI 0.65%	100,000.00	100,590.00	
BUONI POLIENNALI 0.65%	110,000.00	106,590.00	
BUONI POLIENNALI 0.7%	70,000.00	70,441.00	
BUONI POLIENNALI 0.9%	520,000.00	517,348.00	

BUONI POLIENNALI 0.95%	50,000.00	49,425.00	
BUONI POLIENNALI 0.95%	220,000.00	217,492.00	
BUONI POLIENNALI 1.2%	160,000.00	161,152.00	
BUONI POLIENNALI 1.25%	90,000.00	85,194.00	
BUONI POLIENNALI 1.35%	160,000.00	161,760.00	
BUONI POLIENNALI 1.45%	160,000.00	161,872.00	
BUONI POLIENNALI 1.45%	130,000.00	126,958.00	
BUONI POLIENNALI 1.5%	190,000.00	186,200.00	
BUONI POLIENNALI 1.6%	110,000.00	107,184.00	
BUONI POLIENNALI 1.65%	200,000.00	177,000.00	
BUONI POLIENNALI 1.85%	140,000.00	141,638.00	
BUONI POLIENNALI 2.05%	600,000.00	592,200.00	
BUONI POLIENNALI 2.15%	140,000.00	144,830.00	
BUONI POLIENNALI 2.2%	220,000.00	220,066.00	
BUONI POLIENNALI 2.25%	170,000.00	153,680.00	
BUONI POLIENNALI 2.45%	50,000.00	52,075.00	
BUONI POLIENNALI 2.45%	130,000.00	123,838.00	
BUONI POLIENNALI 2.5%	107,000.00	111,237.20	
BUONI POLIENNALI 2.5%	310,000.00	319,951.00	
BUONI POLIENNALI 2.7%	400,000.00	356,600.00	
BUONI POLIENNALI 2.8%	140,000.00	144,452.00	
BUONI POLIENNALI 2.8%	70,000.00	59,402.00	
BUONI POLIENNALI 2.95%	80,000.00	77,216.00	
BUONI POLIENNALI 2%	130,000.00	130,559.00	
BUONI POLIENNALI 2%	650,000.00	637,195.00	
BUONI POLIENNALI 3.25%	110,000.00	108,163.00	
BUONI POLIENNALI 3.35%	120,000.00	124,704.00	
BUONI POLIENNALI 3.45%	130,000.00	130,858.00	
BUONI POLIENNALI 3.5%	270,000.00	291,843.00	
BUONI POLIENNALI 3.75%	390,000.00	413,489.70	
BUONI POLIENNALI 3.75%	150,000.00	159,555.00	

BUONI POLIENNALI 3.75%	220,000.00	235,114.00	
BUONI POLIENNALI 3.75%	160,000.00	176,304.00	
BUONI POLIENNALI 3.85%	120,000.00	126,756.00	
BUONI POLIENNALI 4.5%	120,000.00	134,712.00	
BUONI POLIENNALI 4.5%	380,000.00	431,110.00	
BUONI POLIENNALI 4.5%	180,000.00	208,368.00	
BUONI POLIENNALI 4.75%	180,000.00	196,650.00	
BUONI POLIENNALI 4.75%	190,000.00	216,296.00	
BUONI POLIENNALI 4.75%	180,000.00	216,180.00	
BUONI POLIENNALI 4.75%	170,000.00	206,839.00	
BUONI POLIENNALI 4%	180,000.00	188,982.00	
BUONI POLIENNALI 4%	540,000.00	605,610.00	
BUONI POLIENNALI 5.25%	360,000.00	447,300.00	
BUONI POLIENNALI 5.5%	170,000.00	194,242.00	
BUONI POLIENNALI 5.5%	130,000.00	149,136.00	
BUONI POLIENNALI 5.75%	160,000.00	210,992.00	
BUONI POLIENNALI 5%	155,000.00	172,515.00	
BUONI POLIENNALI 5%	990,000.00	1,162,557.00	
BUONI POLIENNALI 5%	390,000.00	484,653.00	
BUONI POLIENNALI 5%	440,000.00	549,296.00	
BUONI POLIENNALI 5%	220,000.00	273,086.00	
BUONI POLIENNALI 6.5%	300,000.00	397,080.00	
BUONI POLIENNALI 6%	310,000.00	412,579.00	
BUONI POLIENNALI 7.25%	60,000.00	81,162.00	
BUONI POLIENNALI 9%	80,000.00	106,120.00	
FINNISH GOVT 0.5%	40,000.00	41,616.00	
FINNISH GOVT 0.5%	310,000.00	320,881.00	
FINNISH GOVT 0.75%	50,000.00	51,935.00	
FINNISH GOVT 0.875%	30,000.00	31,984.50	
FINNISH GOVT 0%	150,000.00	152,122.50	
FINNISH GOVT 0%	50,000.00	50,782.50	

FINNISH GOVT 1.125%	40,000.00	42,976.00	
FINNISH GOVT 1.375%	10,000.00	11,207.00	
FINNISH GOVT 1.5%	50,000.00	53,812.50	
FINNISH GOVT 1.625%	50,000.00	53,527.50	
FINNISH GOVT 2.625%	50,000.00	69,855.00	
FINNISH GOVT 2.75%	30,000.00	37,122.00	
FINNISH GOVT 2%	140,000.00	156,170.00	
FINNISH GOVT 4%	50,000.00	63,055.00	
FRANCE (GOVT OF) 0.25%	250,000.00	252,225.00	
FRANCE (GOVT OF) 0.25%	220,000.00	222,706.00	
FRANCE (GOVT OF) 0.5%	70,000.00	72,261.00	
FRANCE (GOVT OF) 0.5%	340,000.00	351,152.00	
FRANCE (GOVT OF) 0.75%	230,000.00	239,752.00	
FRANCE (GOVT OF) 0%	150,000.00	150,865.50	
FRANCE (GOVT OF) 0%	90,000.00	90,558.00	
FRANCE (GOVT OF) 0%	250,000.00	251,825.00	
FRANCE (GOVT OF) 0%	180,000.00	181,728.00	
FRANCE (GOVT OF) 0%	240,000.00	242,496.00	
FRANCE (GOVT OF) 0%	230,000.00	231,978.00	
FRANCE (GOVT OF) 1.25%	140,000.00	149,436.00	
FRANCE (GOVT OF) 1.25%	330,000.00	349,305.00	
FRANCE (GOVT OF) 1.5%	610,000.00	680,272.00	
FRANCE (GOVT OF) 1.5%	30,000.00	30,774.00	
FRANCE (GOVT OF) 1.75%	300,000.00	326,220.00	
FRANCE (GOVT OF) 1.75%	320,000.00	353,664.00	
FRANCE (GOVT OF) 1.75%	190,000.00	214,738.00	
FRANCE (GOVT OF) 1.75%	110,000.00	115,951.00	
FRANCE (GOVT OF) 1%	240,000.00	257,388.00	
FRANCE (GOVT OF) 1%	300,000.00	320,460.00	
FRANCE (GOVT OF) 2.25%	230,000.00	250,516.00	
FRANCE (GOVT OF) 2.25%	480,000.00	539,472.00	

FRANCE (GOVT OF) 2.5%	230,000.00	238,694.00	
FRANCE (GOVT OF) 2.5%	580,000.00	708,180.00	
FRANCE (GOVT OF) 2.75%	500,000.00	609,550.00	
FRANCE (GOVT OF) 2%	370,000.00	427,942.00	
FRANCE (GOVT OF) 3.25%	300,000.00	328,155.00	
FRANCE (GOVT OF) 3.25%	360,000.00	523,152.00	
FRANCE (GOVT OF) 3.5%	260,000.00	323,986.00	
FRANCE (GOVT OF) 3.75%	930,000.00	1,009,059.30	
FRANCE (GOVT OF) 3%	1,220,000.00	1,337,974.00	
FRANCE (GOVT OF) 4.25%	875,000.00	1,056,956.25	
FRANCE (GOVT OF) 4.5%	450,000.00	753,840.00	
FRANCE (GOVT OF) 4.75%	400,000.00	640,200.00	
FRANCE (GOVT OF) 4%	370,000.00	571,021.00	
FRANCE (GOVT OF) 4%	200,000.00	342,580.00	
FRANCE (GOVT OF) 4%	160,000.00	281,904.00	
FRANCE (GOVT OF) 5.5%	340,000.00	512,992.00	
FRANCE (GOVT OF) 5.75%	450,000.00	747,450.00	
FRANCE (GOVT OF) 6%	650,000.00	903,370.00	
FRANCE (GOVT OF) 8.5%	120,000.00	161,880.00	
FRANCE(GOVT OF) 0.75%	580,000.00	605,346.00	
IRISH TSY 0.8%	90,000.00	93,006.00	
IRISH TSY 0.9%	70,000.00	73,143.00	
IRISH TSY 0%	80,000.00	80,908.00	
IRISH TSY 1.1%	70,000.00	74,046.00	
IRISH TSY 1.3%	50,000.00	52,575.00	
IRISH TSY 1.7%	50,000.00	54,535.00	
IRISH TSY 1%	90,000.00	95,211.00	
IRISH TSY 2.4%	110,000.00	131,010.00	
IRISH TSY 2%	150,000.00	171,180.00	
IRISH TSY 3.4%	50,000.00	58,752.50	
IRISH TSY 3.9%	60,000.00	69,831.00	

IRISH TSY 5.4%	140,000.00	184,009.00	
IRISH TSY 5%	60,000.00	64,760.40	
NETHERLANDS GOVT 0.25%	120,000.00	123,846.00	
NETHERLANDS GOVT 0.5%	500,000.00	524,300.00	
NETHERLANDS GOVT 0.75%	120,000.00	127,212.00	
NETHERLANDS GOVT 0.75%	140,000.00	148,330.00	
NETHERLANDS GOVT 0%	170,000.00	172,414.00	
NETHERLANDS GOVT 1.75%	110,000.00	119,801.00	
NETHERLANDS GOVT 2.25%	1,060,000.00	1,155,400.00	
NETHERLANDS GOVT 2.5%	180,000.00	231,408.00	
NETHERLANDS GOVT 2.75%	120,000.00	183,360.00	
NETHERLANDS GOVT 2%	400,000.00	447,760.00	
NETHERLANDS GOVT 3.25%	140,000.00	151,872.00	
NETHERLANDS GOVT 3.5%	110,000.00	115,335.00	
NETHERLANDS GOVT 3.75%	40,000.00	46,388.00	
NETHERLANDS GOVT 3.75%	130,000.00	217,815.00	
NETHERLANDS GOVT 4%	160,000.00	256,144.00	
NETHERLANDS GOVT 5.5%	100,000.00	148,450.00	
NETHERLANDS GOVT 7.5%	70,000.00	90,923.00	
REP OF AUSTRIA 0.5%	50,000.00	50,975.00	
REP OF AUSTRIA 0.75%	540,000.00	569,430.00	
REP OF AUSTRIA 0.75%	70,000.00	73,465.00	
REP OF AUSTRIA 0%	50,000.00	50,815.00	
REP OF AUSTRIA 0%	90,000.00	91,350.00	
REP OF AUSTRIA 1.2%	90,000.00	97,947.00	
REP OF AUSTRIA 1.5%	20,000.00	20,678.00	
REP OF AUSTRIA 1.5%	40,000.00	44,360.00	
REP OF AUSTRIA 1.65%	70,000.00	77,238.00	
REP OF AUSTRIA 1.75%	90,000.00	98,055.00	
REP OF AUSTRIA 2.1%	90,000.00	117,045.00	
REP OF AUSTRIA 2.4%	80,000.00	99,760.00	

小計	REP OF AUSTRIA 3.15%	70,000.00	104,573.00	
	REP OF AUSTRIA 3.4%	120,000.00	136,488.00	
	REP OF AUSTRIA 3.5%	175,000.00	191,765.00	
	REP OF AUSTRIA 3.65%	30,000.00	33,693.00	
	REP OF AUSTRIA 3.8%	40,000.00	74,432.00	
	REP OF AUSTRIA 3.9%	680,000.00	715,564.00	
	REP OF AUSTRIA 4.15%	130,000.00	203,489.00	
	REP OF AUSTRIA 6.25%	85,000.00	127,993.00	
	銘柄数：281	60,552,000.00	70,465,155.90	(8,687,649,070)
	組入時価比率：37.6%			38.5%
英・ポンド	UK TSY 0.5%	240,000.00	237,768.00	
	UK TSY 0.75%	700,000.00	697,270.00	
	UK TSY 1.25%	270,000.00	273,483.00	
	UK TSY 1.5%	300,000.00	303,810.00	
	UK TSY 1.5%	170,000.00	175,865.00	
	UK TSY 1.5%	130,000.00	123,981.00	
	UK TSY 1.625%	100,000.00	102,735.00	
	UK TSY 1.625%	290,000.00	302,049.50	
	UK TSY 1.75%	200,000.00	206,320.00	
	UK TSY 1.75%	100,000.00	101,950.00	
	UK TSY 1.75%	30,000.00	30,498.00	
	UK TSY 1.75%	230,000.00	238,464.00	
	UK TSY 1%	110,000.00	110,561.00	
	UK TSY 2.25%	120,000.00	127,188.00	
	UK TSY 2.5%	210,000.00	273,808.50	
	UK TSY 2.75%	90,000.00	98,730.00	
	UK TSY 2%	160,000.00	170,560.00	
	UK TSY 3.25%	330,000.00	434,131.50	
	UK TSY 3.5%	300,000.00	413,355.00	
	UK TSY 3.5%	210,000.00	348,169.50	

	UK TSY 3.75%	150,000.00	155,955.00	
	UK TSY 3.75%	110,000.00	117,656.00	
	UK TSY 3.75%	210,000.00	323,977.50	
	UK TSY 4.25%	135,000.00	170,491.50	
	UK TSY 4.25%	170,000.00	228,777.50	
	UK TSY 4.25%	180,000.00	252,765.00	
	UK TSY 4.25%	130,000.00	189,338.50	
	UK TSY 4.25%	130,000.00	191,795.50	
	UK TSY 4.25%	250,000.00	391,012.50	
	UK TSY 4.25%	197,000.00	319,090.75	
	UK TSY 4.25%	232,000.00	401,278.80	
	UK TSY 4.5%	310,000.00	438,851.50	
	UK TSY 4.5%	225,000.00	350,021.25	
	UK TSY 4.75%	125,000.00	172,031.25	
	UK TSY 4.75%	285,000.00	436,862.25	
	UK TSY 4%	110,000.00	120,032.00	
	UK TSY 4%	190,000.00	327,550.50	
	UK TSY 5%	165,000.00	203,230.50	
	UK TSY 6%	120,000.00	173,010.00	
	UK TSY 8%	470,000.00	540,782.00	
小計	銘柄数：40	8,184,000.00	10,275,206.80	
			(1,479,629,779)	
	組入時価比率：6.4%		6.6%	
スウェーデン・クローナ	SWEDISH GOVT 0.75%	560,000.00	591,539.20	
	SWEDISH GOVT 0.75%	420,000.00	441,079.80	
	SWEDISH GOVT 1.5%	1,400,000.00	1,518,650.00	
	SWEDISH GOVT 1%	740,000.00	796,254.80	
	SWEDISH GOVT 2.5%	520,000.00	604,125.60	
	SWEDISH GOVT 3.5%	890,000.00	999,114.00	
	SWEDISH GOVT 3.5%	680,000.00	1,024,352.00	
小計	銘柄数：7	5,210,000.00	5,975,115.40	

			(68,594,324)	
	組入時価比率：0.3%		0.3%	
ノルウェー・ク ローネ	NORWEGIAN GOVT 1.5%	840,000.00	836,220.00	
	NORWEGIAN GOVT 1.75%	290,000.00	293,871.50	
	NORWEGIAN GOVT 1.75%	350,000.00	352,380.00	
	NORWEGIAN GOVT 2%	500,000.00	511,400.00	
	NORWEGIAN GOVT 2%	430,000.00	441,524.00	
	NORWEGIAN GOVT 3%	1,000,000.00	1,072,900.00	
小計	銘柄数：6	3,410,000.00	3,508,295.50	
			(44,169,440)	
	組入時価比率：0.2%		0.2%	
デンマーク・ク ローネ	KINGDOM OF DENMARK 0.5%	1,010,000.00	1,064,439.00	
	KINGDOM OF DENMARK 1.5%	770,000.00	839,069.00	
	KINGDOM OF DENMARK 1.75%	770,000.00	874,258.00	
	KINGDOM OF DENMARK 3%	1,250,000.00	1,364,875.00	
	KINGDOM OF DENMARK 4.5%	1,520,000.00	2,746,184.00	
小計	銘柄数：5	5,320,000.00	6,888,825.00	
			(113,734,500)	
	組入時価比率：0.5%		0.5%	
ポーランド・ズロ チ	POLAND GOVT 1.75%	230,000.00	230,000.00	
	POLAND GOVT 2.25%	960,000.00	964,800.00	
	POLAND GOVT 2.5%	180,000.00	181,800.00	
	POLAND GOVT 2.5%	430,000.00	431,720.00	
	POLAND GOVT 2.5%	340,000.00	335,240.00	
	POLAND GOVT 2.5%	750,000.00	735,000.00	
	POLAND GOVT 2.75%	170,000.00	168,130.00	
	POLAND GOVT 3.25%	250,000.00	259,000.00	
	POLAND GOVT 4%	420,000.00	453,516.00	
	POLAND GOVT 5.75%	200,000.00	218,900.00	
	POLAND GOVT 5.75%	230,000.00	257,140.00	
	POLAND GOVT 5.75%	100,000.00	124,910.00	

小計	銘柄数：12	4,260,000.00	4,360,156.00	
			(125,310,883)	
	組入時価比率：0.5%		0.6%	
オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN GOVT 1.75%	240,000.00	241,360.80	
	AUSTRALIAN GOVT 2.25%	190,000.00	196,022.24	
	AUSTRALIAN GOVT 2.25%	580,000.00	604,144.82	
	AUSTRALIAN GOVT 2.5%	100,000.00	107,110.00	
	AUSTRALIAN GOVT 2.75%	560,000.00	596,960.00	
	AUSTRALIAN GOVT 2.75%	210,000.00	227,107.86	
	AUSTRALIAN GOVT 2.75%	240,000.00	260,339.28	
	AUSTRALIAN GOVT 2.75%	140,000.00	153,132.00	
	AUSTRALIAN GOVT 2.75%	60,000.00	66,048.00	
	AUSTRALIAN GOVT 2.75%	40,000.00	43,097.96	
	AUSTRALIAN GOVT 2%	300,000.00	305,400.00	
	AUSTRALIAN GOVT 3.25%	245,000.00	269,794.00	
	AUSTRALIAN GOVT 3.25%	390,000.00	443,430.00	
	AUSTRALIAN GOVT 3.25%	80,000.00	93,872.00	
	AUSTRALIAN GOVT 3.75%	190,000.00	236,208.00	
	AUSTRALIAN GOVT 3%	170,000.00	190,639.53	
	AUSTRALIAN GOVT 4.25%	370,000.00	435,268.00	
	AUSTRALIAN GOVT 4.5%	180,000.00	237,150.00	
	AUSTRALIAN GOVT 4.75%	330,000.00	406,032.00	
	AUSTRALIAN GOVT 5.5%	200,000.00	232,000.00	
AUSTRALIAN GOVT 5.75%	270,000.00	293,571.00		
AUSTRALIAN GOVT 5.75%	240,000.00	273,024.00		
小計	銘柄数：22	5,325,000.00	5,911,711.49	
			(456,797,946)	
	組入時価比率：2.0%		2.0%	
シンガポール・ドル	SINGAPORE GOVT 1.25%	20,000.00	19,662.00	
	SINGAPORE GOVT 1.75%	40,000.00	39,664.76	
	SINGAPORE GOVT 2.125%	30,000.00	30,024.00	

	SINGAPORE GOVT 2.25%	60,000.00	60,320.40	
	SINGAPORE GOVT 2.25%	30,000.00	28,956.00	
	SINGAPORE GOVT 2.625%	30,000.00	31,047.00	
	SINGAPORE GOVT 2.75%	200,000.00	206,020.00	
	SINGAPORE GOVT 2.75%	80,000.00	81,704.00	
	SINGAPORE GOVT 2.75%	50,000.00	50,950.50	
	SINGAPORE GOVT 2.875%	10,000.00	10,534.80	
	SINGAPORE GOVT 2.875%	30,000.00	31,587.90	
	SINGAPORE GOVT 2%	50,000.00	49,984.00	
	SINGAPORE GOVT 3.125%	60,000.00	62,193.00	
	SINGAPORE GOVT 3.375%	100,000.00	111,240.00	
	SINGAPORE GOVT 3.5%	200,000.00	219,336.00	
	SINGAPORE GOVT 3%	40,000.00	41,940.00	
小計	銘柄数：16	1,030,000.00	1,075,164.36	
			(86,970,045)	
	組入時価比率：0.4%		0.4%	
マレーシア・リングgit	MALAYSIA GOVT 3.844%	1,200,000.00	1,155,360.00	
	MALAYSIA GOVT 3.955%	1,200,000.00	1,211,040.00	
	MALAYSIA GOVT 4.181%	150,000.00	153,353.70	
	MALAYSIA GOVT 4.498%	600,000.00	625,908.00	
	MALAYSIA GOVT 4.762%	440,000.00	463,086.80	
小計	銘柄数：5	3,590,000.00	3,608,748.50	
			(95,812,272)	
	組入時価比率：0.4%		0.4%	
南アフリカ・ランド	REP SOUTH AFRICA 10.5%	3,040,000.00	3,350,688.00	
	REP SOUTH AFRICA 6.25%	3,530,000.00	2,550,072.00	
	REP SOUTH AFRICA 6.5%	720,000.00	505,944.00	
	REP SOUTH AFRICA 7%	1,290,000.00	1,077,924.00	
	REP SOUTH AFRICA 8.25%	700,000.00	639,310.00	
	REP SOUTH AFRICA 8.5%	1,090,000.00	976,313.00	
	REP SOUTH AFRICA 8.75%	1,410,000.00	1,267,731.00	

		REP SOUTH AFRICA 8.75%	1,660,000.00	1,494,498.00	
		REP SOUTH AFRICA 8.875%	560,000.00	524,832.00	
		REP SOUTH AFRICA 8%	3,270,000.00	3,005,784.00	
		REP SOUTH AFRICA 9%	610,000.00	565,226.00	
	小計	銘柄数：11	17,880,000.00	15,958,322.00	
				(121,921,580)	
		組入時価比率：0.5%		0.5%	
合計				22,546,902,805	
				(22,546,902,805)	

(注1) 比率は左より組入時価の純資産総額に対する比率、及び各小計欄の合計金額に対する比率であります。

(注2) 通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額であります。

(注3) 合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係わるもので、内書であります。

有価証券明細表注記

外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
米・ドル	国債証券 227銘柄	100.0%	47.3%
カナダ・ドル	国債証券 29銘柄	100.0%	1.9%
メキシコ・ペソ	国債証券 14銘柄	100.0%	0.8%
ユーロ	国債証券 281銘柄	100.0%	38.5%
英・ポンド	国債証券 40銘柄	100.0%	6.6%
スウェーデン・クローナ	国債証券 7銘柄	100.0%	0.3%
ノルウェー・クローネ	国債証券 6銘柄	100.0%	0.2%
デンマーク・クローネ	国債証券 5銘柄	100.0%	0.5%
ポーランド・ズロチ	国債証券 12銘柄	100.0%	0.6%
オーストラリア・ドル	国債証券 22銘柄	100.0%	2.0%
シンガポール・ドル	国債証券 16銘柄	100.0%	0.4%
マレーシア・リンギット	国債証券 5銘柄	100.0%	0.4%
南アフリカ・ランド	国債証券 11銘柄	100.0%	0.5%

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。

MHAM TOPIXマザーファンド

なお、以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

(単位：円)

(令和 1年 5月 8日現在)

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	489,246,132
株式	39,228,101,520
未収配当金	449,749,681
未収利息	264
前払金	2,041,500
差入委託証拠金	26,100,000
流動資産合計	40,195,239,097
資産合計	40,195,239,097
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	19,719,644
未払金	601,296
未払解約金	5,130,000
流動負債合計	25,450,940
負債合計	25,450,940
純資産の部	
元本等	
元本	21,543,095,659
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	18,626,692,498
元本等合計	40,169,788,157
純資産合計	40,169,788,157
負債純資産合計	40,195,239,097

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	(自 平成31年 3月12日 至 令和 1年 5月 8日)
----	----------------------------------

1 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 原則として時価で評価しております。
2 派生商品等の評価基準及び評価方法	先物取引 原則として時価で評価しております。
3 収益・費用の計上基準	受取配当金 受取配当金は、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。 有価証券売買等損益及び派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	(令和 1年 5月 8日現在)	
1 計算期間末日における受益権の総数		21,543,095,659口
2 計算期間末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産の額	1.8646円
	(1万口当たり純資産の額)	(18,646円)

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	(自 平成31年 3月12日 至 令和 1年 5月 8日)
1 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める投資を目的とする証券投資信託であり、証券投資信託約款および投資ガイドラインに基づいて運用しております。
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。 なお、詳細は附属明細表をご参照下さい。 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、当ファンドは信託財産に属する資産の効率的な運用に資することを目的として、株価指数先物取引を行っており、当該デリバティブ取引は対象とする株価指数等に係る価格変動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	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>なお、具体的には以下のリスクの管理を行っております。</p> <p>市場リスクの管理</p> <p>市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。</p> <p>信用リスクの管理</p> <p>信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。</p> <p>流動性リスクの管理</p> <p>流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。</p>
4 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には、合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。</p>

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	(令和 1年 5月 8日現在)
1 貸借対照表日における貸借対照表の科目ごとの計上額・時価・時価との差額	貸借対照表に計上している金融商品は、原則として時価評価としているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2 貸借対照表の科目ごとの時価の算定方法	<p>(1)有価証券</p> <p>株式</p> <p>わが国の金融商品取引所または海外取引所に上場されている有価証券 当該有価証券については、原則として上記の取引所における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）で評価しております。</p> <p>時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できない場合または入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認められた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認められた価額で評価しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引</p> <p>先物取引</p> <p>デリバティブ取引等に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>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、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

（自 平成31年 3月12日 至 令和 1年 5月 8日）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	257,231,263
合計	257,231,263

（デリバティブ取引等に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（株式関連）

（令和 1年 5月 8日現在）

区分	種類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	898,919,644	-	879,200,000	19,719,644
合計		898,919,644	-	879,200,000	19,719,644

（注）時価の算定方法

株価指数先物取引の時価の算定方法については、取引所の発表する計算日の清算値段により評価しております。

（その他の注記）

項目	期別 (令和 1年 5月 8日現在)
期首	平成31年 3月12日
親投資信託の期首における元本額	21,352,396,579円
期中追加設定元本額	407,416,862円
期中一部解約元本額	216,717,782円
期末元本額及びその内訳として当該親投資信託受益証券を投資対象とする委託者指図型投資信託ごとの元本額	
期末元本額	21,543,095,659円
MHAMスリーウェイオープン	864,954,698円
MHAM TOPIXオープン	4,477,099,364円
MHAM日本株式インデックスファンド（ファンドラップ）	12,598,074,288円
動的パッケージファンド＜DC年金＞	6,609,754円
コア資産形成ファンド	6,344,750円
MHAM TOPIXファンドVA（適格機関投資家専用）	161,877,050円
MHAM動的パッケージファンド [適格機関投資家限定]	1,296,074,237円
MHAM日本株式パッシブファンド [適格機関投資家限定]	2,132,061,518円

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
日本・円	極洋	800	2,774.00	2,219,200	
	日本水産	23,700	753.00	17,846,100	
	マルハニチロ	3,400	3,525.00	11,985,000	
	カネコ種苗	600	1,332.00	799,200	
	サカタのタネ	2,800	3,570.00	9,996,000	
	ホクト	2,000	1,897.00	3,794,000	
	ホクリヨウ	300	611.00	183,300	
	住石ホールディングス	5,500	115.00	632,500	
	日鉄鉱業	500	4,165.00	2,082,500	
	三井松島ホールディングス	1,000	1,231.00	1,231,000	
	国際石油開発帝石	94,900	1,021.00	96,892,900	
	石油資源開発	3,400	2,275.00	7,735,000	
	K&Oエナジーグループ	1,100	1,593.00	1,752,300	
	ヒノキヤグループ	500	2,237.00	1,118,500	
	ショーボンドホールディングス	1,700	7,320.00	12,444,000	
	ミライト・ホールディングス	6,700	1,575.00	10,552,500	
	タマホーム	1,200	1,128.00	1,353,600	
	サンヨーホームズ	400	753.00	301,200	
	日本アクア	700	591.00	413,700	
	ファーストコーポレーション	700	915.00	640,500	
	ベステラ	500	1,329.00	664,500	
	TATERU	3,000	257.00	771,000	
	スペースバリューホールディングス	2,900	564.00	1,635,600	
	ダイセキ環境ソリューション	600	611.00	366,600	
	第一カッター興業	300	1,751.00	525,300	
	安藤・間	15,200	737.00	11,202,400	
	東急建設	7,000	767.00	5,369,000	
	コムシスホールディングス	8,400	2,847.00	23,914,800	
	ミサワホーム	2,000	801.00	1,602,000	
	ピーアールホールディングス	2,000	321.00	642,000	
	高松コンストラクショングループ	1,500	2,308.00	3,462,000	
	東建コーポレーション	700	6,270.00	4,389,000	
ソネック	300	736.00	220,800		
ヤマウラ	1,000	889.00	889,000		
大成建設	19,400	4,750.00	92,150,000		

大林組	58,600	1,037.00	60,768,200
清水建設	59,700	927.00	55,341,900
飛島建設	1,700	1,392.00	2,366,400
長谷工コーポレーション	24,400	1,312.00	32,012,800
松井建設	2,100	686.00	1,440,600
銭高組	200	5,160.00	1,032,000
鹿島建設	45,700	1,605.00	73,348,500
不動テトラ	1,400	1,451.00	2,031,400
大末建設	700	937.00	655,900
鉄建建設	1,200	2,802.00	3,362,400
西松建設	4,200	2,338.00	9,819,600
三井住友建設	14,200	700.00	9,940,000
大豊建設	1,300	2,897.00	3,766,100
前田建設工業	14,100	1,038.00	14,635,800
佐田建設	1,400	356.00	498,400
ナカノフドー建設	1,500	454.00	681,000
奥村組	3,200	3,620.00	11,584,000
東鉄工業	2,400	3,190.00	7,656,000
イチケン	400	1,838.00	735,200
富士ピー・エス	800	395.00	316,000
浅沼組	700	2,353.00	1,647,100
戸田建設	22,800	651.00	14,842,800
熊谷組	2,800	3,150.00	8,820,000
青木あすなろ建設	1,000	844.00	844,000
北野建設	400	2,901.00	1,160,400
植木組	200	2,291.00	458,200
矢作建設工業	2,800	732.00	2,049,600
ピーエス三菱	2,100	629.00	1,320,900
日本ハウスホールディングス	3,800	429.00	1,630,200
大東建託	6,900	14,600.00	100,740,000
新日本建設	2,300	902.00	2,074,600
NIPPO	5,200	2,141.00	11,133,200
東亜道路工業	400	2,754.00	1,101,600
前田道路	6,200	2,121.00	13,150,200
日本道路	500	6,240.00	3,120,000
東亜建設工業	1,800	1,551.00	2,791,800
若築建設	1,000	1,364.00	1,364,000
東洋建設	7,300	393.00	2,868,900

五洋建設	23,500	488.00	11,468,000
世紀東急工業	2,900	568.00	1,647,200
福田組	600	4,300.00	2,580,000
住友林業	14,000	1,470.00	20,580,000
日本基礎技術	2,400	364.00	873,600
巴コーポレーション	2,700	347.00	936,900
大和ハウス工業	54,000	3,081.00	166,374,000
ライト工業	3,800	1,402.00	5,327,600
積水ハウス	59,700	1,765.00	105,370,500
日特建設	1,700	558.00	948,600
北陸電気工事	900	885.00	796,500
ユアテック	3,200	772.00	2,470,400
四電工	300	2,666.00	799,800
中電工	2,500	2,329.00	5,822,500
関電工	9,000	911.00	8,199,000
きんでん	13,100	1,705.00	22,335,500
東京エネシス	2,100	950.00	1,995,000
トーエネック	600	3,075.00	1,845,000
住友電設	1,400	1,874.00	2,623,600
日本電設工業	3,400	2,344.00	7,969,600
協和エクシオ	7,700	2,948.00	22,699,600
新日本空調	1,600	1,719.00	2,750,400
九電工	3,800	3,335.00	12,673,000
三機工業	4,500	1,200.00	5,400,000
日揮	16,900	1,481.00	25,028,900
中外炉工業	600	1,778.00	1,066,800
ヤマト	1,800	514.00	925,200
太平電業	1,300	2,442.00	3,174,600
高砂熱学工業	4,800	1,733.00	8,318,400
三晃金属工業	200	2,602.00	520,400
朝日工業社	400	2,922.00	1,168,800
明星工業	3,600	721.00	2,595,600
大気社	2,700	3,175.00	8,572,500
ダイダン	1,300	2,460.00	3,198,000
日比谷総合設備	1,800	1,817.00	3,270,600
東芝プラントシステム	4,300	1,969.00	8,466,700
OSJBホールディングス	8,700	260.00	2,262,000
新興プランテック	3,500	1,132.00	3,962,000

日本製粉	5,500	1,831.00	10,070,500
日清製粉グループ本社	19,700	2,536.00	49,959,200
日東富士製粉	100	5,940.00	594,000
昭和産業	1,600	2,977.00	4,763,200
鳥越製粉	1,500	753.00	1,129,500
中部飼料	2,100	1,161.00	2,438,100
フィード・ワン	12,100	168.00	2,032,800
東洋精糖	200	971.00	194,200
日本甜菜製糖	1,000	1,886.00	1,886,000
三井製糖	1,400	2,642.00	3,698,800
塩水港精糖	2,200	229.00	503,800
日新製糖	800	1,927.00	1,541,600
森永製菓	4,400	4,465.00	19,646,000
中村屋	400	4,405.00	1,762,000
江崎グリコ	5,300	5,760.00	30,528,000
名糖産業	800	1,442.00	1,153,600
井村屋グループ	700	2,345.00	1,641,500
不二家	1,100	2,045.00	2,249,500
山崎製パン	14,300	1,707.00	24,410,100
第一屋製パン	500	996.00	498,000
モロゾフ	300	5,030.00	1,509,000
亀田製菓	1,100	5,100.00	5,610,000
寿スピリッツ	1,800	4,715.00	8,487,000
カルビー	8,000	2,946.00	23,568,000
森永乳業	3,500	3,775.00	13,212,500
六甲バター	1,300	2,130.00	2,769,000
ヤクルト本社	12,900	7,290.00	94,041,000
明治ホールディングス	12,400	8,550.00	106,020,000
雪印メグミルク	4,200	2,397.00	10,067,400
プリマハム	2,500	1,969.00	4,922,500
日本ハム	7,600	4,485.00	34,086,000
丸大食品	1,900	1,903.00	3,615,700
S Foods	1,600	3,880.00	6,208,000
伊藤ハム米久ホールディングス	11,300	673.00	7,604,900
サッポロホールディングス	6,500	2,205.00	14,332,500
アサヒグループホールディングス	36,500	4,738.00	172,937,000
キリンホールディングス	78,900	2,346.00	185,099,400
宝ホールディングス	13,100	1,227.00	16,073,700

オエノンホールディングス	5,200	392.00	2,038,400
養命酒製造	500	2,009.00	1,004,500
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	13,400	2,704.00	36,233,600
サントリー食品インターナショナル	11,700	4,615.00	53,995,500
ダイドグループホールディングス	1,000	4,795.00	4,795,000
伊藤園	5,300	5,400.00	28,620,000
キーコーヒー	1,800	2,073.00	3,731,400
ユニカフェ	500	992.00	496,000
ジャパンフーズ	300	1,143.00	342,900
日清オイリオグループ	2,200	3,135.00	6,897,000
不二製油グループ本社	4,300	3,525.00	15,157,500
かどや製油	200	5,100.00	1,020,000
J - オイルミルズ	900	3,905.00	3,514,500
キッコーマン	11,500	5,010.00	57,615,000
味の素	38,600	1,771.00	68,360,600
キューピー	9,800	2,523.00	24,725,400
ハウス食品グループ本社	6,700	4,425.00	29,647,500
カゴメ	7,000	2,956.00	20,692,000
焼津水産化学工業	800	1,123.00	898,400
アリアケジャパン	1,600	6,420.00	10,272,000
ピエトロ	200	1,630.00	326,000
エバラ食品工業	400	2,149.00	859,600
ニチレイ	9,100	2,557.00	23,268,700
東洋水産	9,000	4,145.00	37,305,000
イートアンド	600	1,617.00	970,200
大冷	200	1,731.00	346,200
ヨシムラ・フード・ホールディングス	500	901.00	450,500
日清食品ホールディングス	7,400	7,190.00	53,206,000
永谷園ホールディングス	900	2,171.00	1,953,900
一正蒲鉾	700	1,154.00	807,800
フジッコ	1,900	2,175.00	4,132,500
ロック・フィールド	1,900	1,613.00	3,064,700
日本たばこ産業	100,700	2,512.00	252,958,400
ケンコーマヨネーズ	1,000	2,208.00	2,208,000
わらべや日洋ホールディングス	1,200	1,723.00	2,067,600
なとり	1,000	1,643.00	1,643,000
イフジ産業	200	649.00	129,800
ピクルスコーポレーション	400	1,982.00	792,800

北の達人コーポレーション	6,900	522.00	3,601,800
ユーグレナ	7,500	735.00	5,512,500
ミヨシ油脂	700	1,127.00	788,900
理研ビタミン	800	3,560.00	2,848,000
片倉工業	2,200	1,261.00	2,774,200
ゲンゼ	1,200	4,545.00	5,454,000
東洋紡	7,400	1,357.00	10,041,800
ユニチカ	5,400	416.00	2,246,400
富士紡ホールディングス	900	2,703.00	2,432,700
倉敷紡績	1,600	1,994.00	3,190,400
シキボウ	900	988.00	889,200
日本毛織	5,700	871.00	4,964,700
トーア紡コーポレーション	800	447.00	357,600
ダイドーリミテッド	3,000	323.00	969,000
帝国繊維	1,900	2,379.00	4,520,100
帝人	13,900	1,835.00	25,506,500
東レ	132,500	730.30	96,764,750
サカイオーベックス	400	1,649.00	659,600
住江織物	500	2,884.00	1,442,000
日本フェルト	800	451.00	360,800
イチカワ	100	1,323.00	132,300
日東製網	200	1,370.00	274,000
アツギ	1,400	918.00	1,285,200
ダイニック	600	714.00	428,400
セーレン	4,200	1,598.00	6,711,600
ソトー	600	933.00	559,800
東海染工	200	1,070.00	214,000
小松マテーレ	2,800	852.00	2,385,600
ワコールホールディングス	5,000	2,637.00	13,185,000
ホギメディカル	2,100	3,615.00	7,591,500
クラウドシアホールディングス	600	471.00	282,600
T S Iホールディングス	6,400	662.00	4,236,800
マツオカコーポレーション	500	3,380.00	1,690,000
ワールド	1,700	2,128.00	3,617,600
三陽商会	1,100	1,794.00	1,973,400
ナイガイ	800	512.00	409,600
オンワードホールディングス	10,700	579.00	6,195,300
ルックホールディングス	600	1,411.00	846,600

ゴールドウイン	1,500	17,810.00	26,715,000
デサント	4,200	2,246.00	9,433,200
キング	900	632.00	568,800
ヤマトインターナショナル	1,200	413.00	495,600
特種東海製紙	1,100	4,000.00	4,400,000
王子ホールディングス	76,900	635.00	48,831,500
日本製紙	8,200	2,150.00	17,630,000
三菱製紙	3,300	537.00	1,772,100
北越コーポレーション	11,500	587.00	6,750,500
中越パルプ工業	700	1,383.00	968,100
大王製紙	8,400	1,286.00	10,802,400
阿波製紙	500	471.00	235,500
レンゴー	17,700	955.00	16,903,500
トーモク	1,000	1,787.00	1,787,000
ザ・パック	1,300	3,635.00	4,725,500
クラレ	28,700	1,402.00	40,237,400
旭化成	121,100	1,155.00	139,870,500
共和レザー	900	779.00	701,100
昭和電工	11,300	3,625.00	40,962,500
住友化学	134,100	520.00	69,732,000
住友精化	800	4,175.00	3,340,000
日産化学	10,500	4,760.00	49,980,000
ラサ工業	600	1,461.00	876,600
クレハ	1,600	6,170.00	9,872,000
多木化学	500	4,965.00	2,482,500
テイカ	1,400	2,384.00	3,337,600
石原産業	3,400	1,163.00	3,954,200
片倉コープアグリ	500	1,130.00	565,000
日東エフシー	1,100	1,022.00	1,124,200
日本曹達	2,700	2,835.00	7,654,500
東ソー	26,300	1,667.00	43,842,100
トクヤマ	4,900	2,564.00	12,563,600
セントラル硝子	3,700	2,471.00	9,142,700
東亜合成	10,600	1,173.00	12,433,800
大阪ソーダ	1,800	2,615.00	4,707,000
関東電化工業	4,100	774.00	3,173,400
デンカ	6,700	3,155.00	21,138,500
信越化学工業	30,000	9,757.00	292,710,000

日本カーバイド工業	600	1,482.00	889,200
堺化学工業	1,200	2,540.00	3,048,000
第一稀元素化学工業	1,400	821.00	1,149,400
エア・ウォーター	14,000	1,598.00	22,372,000
大陽日酸	14,100	1,860.00	26,226,000
日本化学工業	600	2,031.00	1,218,600
東邦アセチレン	200	1,347.00	269,400
日本パーカライジング	9,300	1,344.00	12,499,200
高压ガス工業	2,600	786.00	2,043,600
チタン工業	200	2,292.00	458,400
四国化成工業	2,800	1,113.00	3,116,400
戸田工業	400	2,178.00	871,200
ステラ ケミファ	1,000	2,871.00	2,871,000
保土谷化学工業	600	2,996.00	1,797,600
日本触媒	2,900	7,120.00	20,648,000
大日精化工業	1,400	2,958.00	4,141,200
カネカ	4,600	4,115.00	18,929,000
三菱瓦斯化学	17,500	1,503.00	26,302,500
三井化学	15,400	2,598.00	40,009,200
J S R	17,100	1,585.00	27,103,500
東京応化工業	2,900	3,395.00	9,845,500
大阪有機化学工業	1,500	1,063.00	1,594,500
三菱ケミカルホールディングス	113,600	753.50	85,597,600
K Hネオケム	2,600	2,974.00	7,732,400
ダイセル	26,500	1,193.00	31,614,500
住友ベークライト	3,000	3,960.00	11,880,000
積水化学工業	37,200	1,719.00	63,946,800
日本ゼオン	15,400	1,077.00	16,585,800
アイカ工業	5,100	3,635.00	18,538,500
宇部興産	8,600	2,218.00	19,074,800
積水樹脂	2,800	2,038.00	5,706,400
タキロンシーアイ	3,600	648.00	2,332,800
旭有機材	1,200	1,669.00	2,002,800
日立化成	7,900	2,926.00	23,115,400
ニチバン	900	2,208.00	1,987,200
リケンテクノス	4,800	527.00	2,529,600
大倉工業	900	1,737.00	1,563,300
積水化成品工業	2,500	750.00	1,875,000

群栄化学工業	400	2,549.00	1,019,600
タイガースポリマー	800	635.00	508,000
ミライアル	500	1,141.00	570,500
ダイキアクシス	600	851.00	510,600
ダイキョーニシカワ	3,600	1,033.00	3,718,800
竹本容器	600	1,294.00	776,400
森六ホールディングス	900	2,534.00	2,280,600
日本化薬	10,900	1,234.00	13,450,600
カーリットホールディングス	1,900	801.00	1,521,900
日本精化	1,300	1,269.00	1,649,700
扶桑化学工業	1,700	1,923.00	3,269,100
トリケミカル研究所	400	5,440.00	2,176,000
A D E K A	8,400	1,577.00	13,246,800
日油	6,600	3,885.00	25,641,000
新日本理化	3,300	198.00	653,400
ハリマ化成グループ	1,300	1,044.00	1,357,200
花王	42,200	8,603.00	363,046,600
第一工業製薬	600	3,335.00	2,001,000
石原ケミカル	400	1,650.00	660,000
日華化学	600	919.00	551,400
ニイタカ	300	1,562.00	468,600
三洋化成工業	1,100	5,410.00	5,951,000
有機合成薬品工業	2,100	229.00	480,900
大日本塗料	1,900	1,000.00	1,900,000
日本ペイントホールディングス	14,100	4,105.00	57,880,500
関西ペイント	19,200	2,022.00	38,822,400
神東塗料	1,500	165.00	247,500
中国塗料	5,700	1,017.00	5,796,900
日本特殊塗料	1,300	1,135.00	1,475,500
藤倉化成	2,300	575.00	1,322,500
太陽ホールディングス	1,400	3,755.00	5,257,000
D I C	7,700	3,050.00	23,485,000
サカタインクス	3,800	946.00	3,594,800
東洋インキ S C ホールディングス	3,600	2,503.00	9,010,800
T & K T O K A	1,300	935.00	1,215,500
富士フイルムホールディングス	36,100	5,051.00	182,341,100
資生堂	34,600	8,505.00	294,273,000
ライオン	24,200	2,255.00	54,571,000

高砂香料工業	1,200	3,225.00	3,870,000
マンダム	3,900	2,753.00	10,736,700
ミルボン	2,200	5,210.00	11,462,000
ファンケル	7,800	3,160.00	24,648,000
コーセー	2,900	18,640.00	54,056,000
コタ	800	1,222.00	977,600
シーボン	200	2,501.00	500,200
ポーラ・オルビスホールディングス	7,400	3,145.00	23,273,000
ノエビアホールディングス	1,100	5,830.00	6,413,000
アジュバンコスメジャパン	600	888.00	532,800
エステー	1,300	1,766.00	2,295,800
アグロ カネショウ	700	2,223.00	1,556,100
コニシ	3,100	1,544.00	4,786,400
長谷川香料	2,100	1,728.00	3,628,800
星光PMC	1,300	767.00	997,100
小林製薬	4,900	8,690.00	42,581,000
荒川化学工業	1,500	1,398.00	2,097,000
メック	1,200	1,078.00	1,293,600
日本高純度化学	500	2,210.00	1,105,000
タカラバイオ	4,600	2,398.00	11,030,800
JCU	2,300	1,842.00	4,236,600
新田ゼラチン	1,200	669.00	802,800
OATアグリオ	300	1,596.00	478,800
デクセリアルズ	4,500	705.00	3,172,500
アース製薬	1,300	4,965.00	6,454,500
北興化学工業	1,700	503.00	855,100
大成ラミック	600	2,742.00	1,645,200
クミアイ化学工業	7,300	781.00	5,701,300
日本農薬	4,400	442.00	1,944,800
アキレス	1,300	1,920.00	2,496,000
有沢製作所	2,800	825.00	2,310,000
日東電工	13,100	5,349.00	70,071,900
レック	1,900	1,393.00	2,646,700
三光合成	1,600	340.00	544,000
きもと	3,500	167.00	584,500
藤森工業	1,600	3,000.00	4,800,000
前澤化成工業	1,200	1,006.00	1,207,200
未来工業	900	2,254.00	2,028,600

ウェーブロックホールディングス	400	780.00	312,000
J S P	1,000	2,087.00	2,087,000
エフピコ	1,500	6,640.00	9,960,000
天馬	1,200	1,995.00	2,394,000
信越ポリマー	3,200	812.00	2,598,400
東リ	4,500	261.00	1,174,500
ニフコ	7,000	3,040.00	21,280,000
バルカー	1,400	2,222.00	3,110,800
ユニ・チャーム	36,900	3,538.00	130,552,200
ショーエイコーポレーション	100	761.00	76,100
協和発酵キリン	20,400	2,076.00	42,350,400
武田薬品工業	151,800	4,119.00	625,264,200
アステラス製薬	160,300	1,438.50	230,591,550
大日本住友製薬	12,900	2,478.00	31,966,200
塩野義製薬	22,200	6,550.00	145,410,000
田辺三菱製薬	18,200	1,390.00	25,298,000
わかもと製薬	2,900	276.00	800,400
あすか製薬	2,200	1,144.00	2,516,800
日本新薬	4,600	7,750.00	35,650,000
ビオフェルミン製薬	300	2,272.00	681,600
中外製薬	18,100	7,160.00	129,596,000
科研製薬	3,100	4,760.00	14,756,000
エーザイ	20,800	6,314.00	131,331,200
ロート製薬	9,000	3,010.00	27,090,000
小野薬品工業	41,100	2,021.00	83,063,100
久光製薬	5,200	4,640.00	24,128,000
持田製薬	2,600	5,200.00	13,520,000
参天製薬	33,000	1,732.00	57,156,000
扶桑薬品工業	600	2,461.00	1,476,600
日本ケミファ	200	2,943.00	588,600
ツムラ	5,400	3,375.00	18,225,000
日医工	4,600	1,341.00	6,168,600
キッセイ薬品工業	3,100	2,632.00	8,159,200
生化学工業	3,400	1,194.00	4,059,600
栄研化学	3,100	2,167.00	6,717,700
日水製薬	700	1,168.00	817,600
鳥居薬品	1,000	2,342.00	2,342,000
J C R ファーマ	1,200	6,460.00	7,752,000

東和薬品	2,500	2,743.00	6,857,500
富士製薬工業	1,200	1,609.00	1,930,800
沢井製薬	3,600	5,940.00	21,384,000
ゼリア新薬工業	3,500	1,915.00	6,702,500
第一三共	49,800	5,753.00	286,499,400
キョーリン製薬ホールディングス	3,900	2,058.00	8,026,200
大幸薬品	800	1,786.00	1,428,800
ダイト	1,000	3,570.00	3,570,000
大塚ホールディングス	33,100	3,887.00	128,659,700
大正製薬ホールディングス	3,900	10,090.00	39,351,000
ペプチドリーム	8,700	6,080.00	52,896,000
日本コークス工業	15,500	98.00	1,519,000
ニチレキ	2,200	1,000.00	2,200,000
ユシロ化学工業	800	1,262.00	1,009,600
ビーピー・カストロール	600	1,448.00	868,800
富士石油	4,500	258.00	1,161,000
MORESCO	600	1,455.00	873,000
出光興産	20,100	3,310.00	66,531,000
JXTGホールディングス	292,400	518.10	151,492,440
コスモエネルギーホールディングス	5,100	2,127.00	10,847,700
横浜ゴム	10,100	1,991.00	20,109,100
TOYO TIRE	9,000	1,210.00	10,890,000
ブリヂストン	53,300	4,269.00	227,537,700
住友ゴム工業	15,800	1,319.00	20,840,200
藤倉コンポジット	1,600	453.00	724,800
オカモト	1,200	5,610.00	6,732,000
フコク	800	778.00	622,400
ニッタ	2,000	3,405.00	6,810,000
住友理工	3,600	918.00	3,304,800
三ツ星ベルト	2,300	1,955.00	4,496,500
バンドー化学	3,300	992.00	3,273,600
日東紡績	2,600	2,153.00	5,597,800
A G C	17,200	3,575.00	61,490,000
日本板硝子	8,500	867.00	7,369,500
石塚硝子	300	1,970.00	591,000
日本山村硝子	800	1,412.00	1,129,600
日本電気硝子	7,500	2,821.00	21,157,500
オハラ	700	1,336.00	935,200

住友大阪セメント	3,500	4,320.00	15,120,000
太平洋セメント	11,000	3,425.00	37,675,000
日本ヒューム	1,800	748.00	1,346,400
日本コンクリート工業	3,900	275.00	1,072,500
三谷セキサン	800	2,955.00	2,364,000
アジアパイルホールディングス	2,500	577.00	1,442,500
東海カーボン	15,800	1,318.00	20,824,400
日本カーボン	800	4,740.00	3,792,000
東洋炭素	1,000	2,027.00	2,027,000
ノリタケカンパニーリミテド	1,000	5,200.00	5,200,000
TOTO	13,400	4,195.00	56,213,000
日本碍子	21,300	1,578.00	33,611,400
日本特殊陶業	14,700	1,904.00	27,988,800
MARUWA	600	5,190.00	3,114,000
品川リフラクトリーズ	400	3,160.00	1,264,000
黒崎播磨	300	5,690.00	1,707,000
ヨータイ	1,600	497.00	795,200
イソライト工業	900	481.00	432,900
東京窯業	2,200	359.00	789,800
ニッカトー	800	800.00	640,000
フジインコーポレーテッド	1,500	2,405.00	3,607,500
クニミネ工業	600	808.00	484,800
エーアンドエーマテリアル	300	989.00	296,700
ニチアス	4,800	1,790.00	8,592,000
ニチハ	2,400	2,899.00	6,957,600
日本製鉄	79,600	1,918.00	152,672,800
神戸製鋼所	31,800	813.00	25,853,400
中山製鋼所	2,500	493.00	1,232,500
合同製鐵	800	1,678.00	1,342,400
ジェイ エフ イー ホールディングス	46,400	1,834.00	85,097,600
東京製鐵	9,300	927.00	8,621,100
共英製鋼	2,000	1,909.00	3,818,000
大和工業	3,700	3,075.00	11,377,500
東京鐵鋼	700	1,298.00	908,600
大阪製鐵	1,100	1,909.00	2,099,900
淀川製鋼所	2,300	2,057.00	4,731,100
丸一鋼管	6,100	2,946.00	17,970,600
モリ工業	500	2,442.00	1,221,000

大同特殊鋼	2,800	4,280.00	11,984,000
日本高周波鋼業	800	494.00	395,200
日本冶金工業	14,500	238.00	3,451,000
山陽特殊製鋼	2,200	2,095.00	4,609,000
愛知製鋼	1,000	3,310.00	3,310,000
日立金属	18,600	1,214.00	22,580,400
日本金属	400	1,139.00	455,600
大平洋金属	1,200	2,148.00	2,577,600
新日本電工	10,700	217.00	2,321,900
栗本鐵工所	900	1,463.00	1,316,700
虹技	200	1,349.00	269,800
三菱製鋼	1,300	1,567.00	2,037,100
日亜鋼業	2,500	333.00	832,500
日本精線	200	2,808.00	561,600
エンビプロ・ホールディングス	500	633.00	316,500
シンニッタン	2,500	362.00	905,000
新家工業	300	1,523.00	456,900
大紀アルミニウム工業所	2,800	623.00	1,744,400
日本軽金属ホールディングス	47,000	237.00	11,139,000
三井金属鉱業	4,700	2,556.00	12,013,200
東邦亜鉛	1,000	2,740.00	2,740,000
三菱マテリアル	11,400	2,736.00	31,190,400
住友金属鉱山	23,600	3,224.00	76,086,400
DOWAホールディングス	4,000	3,485.00	13,940,000
古河機械金属	2,900	1,307.00	3,790,300
大阪チタニウムテクノロジーズ	2,000	1,550.00	3,100,000
東邦チタニウム	3,200	1,010.00	3,232,000
UACJ	2,700	2,167.00	5,850,900
CKサンエツ	300	2,812.00	843,600
古河電気工業	5,000	2,747.00	13,735,000
住友電気工業	64,200	1,411.00	90,586,200
フジクラ	21,200	422.00	8,946,400
昭和電線ホールディングス	2,200	725.00	1,595,000
東京特殊電線	200	1,854.00	370,800
タツタ電線	3,500	464.00	1,624,000
カナレ電気	200	1,898.00	379,600
平河ヒューテック	700	1,334.00	933,800
リョービ	2,100	2,386.00	5,010,600

アーレスティ	2,200	602.00	1,324,400
アサヒホールディングス	3,200	2,162.00	6,918,400
稲葉製作所	1,000	1,424.00	1,424,000
宮地エンジニアリンググループ	500	1,825.00	912,500
トーカロ	4,400	844.00	3,713,600
アルファC o	600	1,239.00	743,400
SUMCO	19,000	1,330.00	25,270,000
川田テクノロジーズ	400	6,950.00	2,780,000
RS Technologies	300	2,921.00	876,300
東洋製罐グループホールディングス	11,000	2,151.00	23,661,000
ホッカンホールディングス	800	1,759.00	1,407,200
コロナ	900	1,021.00	918,900
横河ブリッジホールディングス	3,200	1,726.00	5,523,200
駒井ハルテック	300	1,780.00	534,000
高田機工	100	2,517.00	251,700
三和ホールディングス	17,800	1,287.00	22,908,600
文化シャッター	5,100	790.00	4,029,000
三協立山	2,500	1,177.00	2,942,500
アルインコ	1,300	959.00	1,246,700
東洋シャッター	400	705.00	282,000
LIXILグループ	25,500	1,424.00	36,312,000
日本ファイルコン	1,300	501.00	651,300
ノーリツ	3,900	1,600.00	6,240,000
長府製作所	1,800	2,245.00	4,041,000
リンナイ	3,100	7,310.00	22,661,000
ダイニチ工業	900	652.00	586,800
日東精工	2,300	622.00	1,430,600
三洋工業	200	1,845.00	369,000
岡部	3,600	1,008.00	3,628,800
ジーテクト	1,900	1,490.00	2,831,000
中国工業	600	526.00	315,600
東プレ	3,200	1,977.00	6,326,400
高周波熱錬	3,200	921.00	2,947,200
東京製網	1,100	1,066.00	1,172,600
サンコール	1,000	579.00	579,000
モリテック スチール	1,500	381.00	571,500
パイオラックス	2,700	1,954.00	5,275,800
エイチワン	1,700	894.00	1,519,800

日本発條	17,200	938.00	16,133,600
中央発條	100	2,862.00	286,200
アドバネクス	300	1,584.00	475,200
立川ブラインド工業	700	1,224.00	856,800
三益半導体工業	1,500	1,579.00	2,368,500
日本ドライケミカル	500	1,102.00	551,000
日本製鋼所	5,300	1,941.00	10,287,300
三浦工業	7,500	2,767.00	20,752,500
タクマ	6,300	1,294.00	8,152,200
ツガミ	4,000	902.00	3,608,000
オークマ	2,200	6,120.00	13,464,000
東芝機械	2,000	2,326.00	4,652,000
アマダホールディングス	26,500	1,174.00	31,111,000
アイダエンジニアリング	4,800	809.00	3,883,200
滝澤鉄工所	500	1,511.00	755,500
F U J I	5,200	1,594.00	8,288,800
牧野フライス製作所	2,000	4,170.00	8,340,000
オーエスジー	8,500	2,125.00	18,062,500
ダイジェット工業	200	1,684.00	336,800
旭ダイヤモンド工業	4,800	768.00	3,686,400
D M G 森精機	11,000	1,526.00	16,786,000
ソディック	3,800	939.00	3,568,200
ディスコ	2,300	17,530.00	40,319,000
日東工器	900	2,163.00	1,946,700
日進工具	500	2,460.00	1,230,000
パンチ工業	1,200	594.00	712,800
富士ダイス	700	611.00	427,700
豊和工業	1,000	924.00	924,000
O K K	700	781.00	546,700
東洋機械金属	1,300	587.00	763,100
津田駒工業	400	1,835.00	734,000
島精機製作所	2,400	3,585.00	8,604,000
オプトラン	1,700	2,614.00	4,443,800
N C ホールディングス	700	548.00	383,600
フリュー	1,400	998.00	1,397,200
ヤマシンフィルタ	3,000	664.00	1,992,000
日阪製作所	2,200	948.00	2,085,600
やまびこ	3,400	1,018.00	3,461,200

平田機工	800	7,310.00	5,848,000
ベガススミシン製造	1,600	602.00	963,200
マルマエ	500	894.00	447,000
タツモ	500	819.00	409,500
ナブテスコ	9,500	3,100.00	29,450,000
三井海洋開発	1,900	3,220.00	6,118,000
レオン自動機	1,700	1,631.00	2,772,700
S M C	5,100	41,570.00	212,007,000
新川	1,800	464.00	835,200
ホソカワミクロン	600	5,170.00	3,102,000
ユニオンツール	800	2,827.00	2,261,600
オイレス工業	2,400	1,750.00	4,200,000
日精エー・エス・ピー機械	500	3,710.00	1,855,000
サトーホールディングス	2,100	2,556.00	5,367,600
技研製作所	1,200	3,465.00	4,158,000
日本エアーテック	500	614.00	307,000
カワタ	400	1,486.00	594,400
日精樹脂工業	1,400	898.00	1,257,200
オカダアイヨン	600	1,278.00	766,800
ワイエイシイホールディングス	700	801.00	560,700
小松製作所	78,700	2,490.00	195,963,000
住友重機械工業	10,000	3,615.00	36,150,000
日立建機	7,000	2,696.00	18,872,000
日工	500	2,413.00	1,206,500
巴工業	700	2,368.00	1,657,600
井関農機	1,800	1,640.00	2,952,000
T O W A	1,600	838.00	1,340,800
丸山製作所	400	1,319.00	527,600
北川鉄工所	700	2,218.00	1,552,600
ローツェ	800	2,322.00	1,857,600
タカキタ	600	533.00	319,800
クボタ	93,200	1,592.50	148,421,000
荏原実業	500	2,023.00	1,011,500
三菱化工機	600	1,499.00	899,400
月島機械	3,500	1,377.00	4,819,500
帝国電機製作所	1,300	1,073.00	1,394,900
新東工業	4,100	982.00	4,026,200
澁谷工業	1,500	3,445.00	5,167,500

アイチ コーポレーション	3,000	707.00	2,121,000
小森コーポレーション	4,700	1,227.00	5,766,900
鶴見製作所	1,300	1,932.00	2,511,600
住友精密工業	300	2,931.00	879,300
酒井重工業	300	2,877.00	863,100
荏原製作所	7,700	3,210.00	24,717,000
石井鐵工所	300	1,933.00	579,900
西島製作所	1,800	961.00	1,729,800
北越工業	1,800	1,196.00	2,152,800
ダイキン工業	23,700	13,400.00	317,580,000
オルガノ	600	3,205.00	1,923,000
トーヨーカネツ	700	2,003.00	1,402,100
栗田工業	9,400	2,795.00	26,273,000
椿本チエイン	2,300	3,870.00	8,901,000
大同工業	900	838.00	754,200
木村化工機	1,500	368.00	552,000
アネスト岩田	2,700	912.00	2,462,400
ダイフク	9,600	6,360.00	61,056,000
サムコ	600	860.00	516,000
加藤製作所	900	2,645.00	2,380,500
油研工業	300	1,737.00	521,100
タダノ	8,500	1,160.00	9,860,000
フジテック	6,300	1,309.00	8,246,700
C K D	5,000	1,117.00	5,585,000
キトー	1,300	1,609.00	2,091,700
平和	4,900	2,164.00	10,603,600
理想科学工業	1,500	1,735.00	2,602,500
S A N K Y O	4,400	4,495.00	19,778,000
日本金銭機械	2,000	1,140.00	2,280,000
マースグループホールディングス	1,100	2,088.00	2,296,800
福島工業	1,100	3,740.00	4,114,000
オーイズミ	900	382.00	343,800
ダイコク電機	800	1,487.00	1,189,600
竹内製作所	2,900	1,980.00	5,742,000
アマノ	5,000	2,830.00	14,150,000
J U K I	2,500	1,133.00	2,832,500
蛇の目ミシン工業	1,700	445.00	756,500
マックス	2,600	1,596.00	4,149,600

グローリー	4,900	2,698.00	13,220,200
新晃工業	1,600	1,533.00	2,452,800
大和冷機工業	2,500	1,232.00	3,080,000
セガサミーホールディングス	17,300	1,407.00	24,341,100
日本ピストンリング	600	1,537.00	922,200
リケン	800	5,020.00	4,016,000
T P R	2,300	1,999.00	4,597,700
ツバキ・ナカシマ	2,600	1,997.00	5,192,200
ホシザキ	5,100	7,230.00	36,873,000
大豊工業	1,400	876.00	1,226,400
日本精工	35,800	1,062.00	38,019,600
N T N	37,800	339.00	12,814,200
ジェイテクト	16,800	1,302.00	21,873,600
不二越	1,700	4,940.00	8,398,000
日本トムソン	5,300	512.00	2,713,600
T H K	10,900	2,575.00	28,067,500
ユーシン精機	1,500	1,151.00	1,726,500
前澤給装工業	600	1,880.00	1,128,000
イーグル工業	2,200	1,194.00	2,626,800
前澤工業	1,300	358.00	465,400
日本ピラー工業	1,700	1,213.00	2,062,100
キット	7,100	812.00	5,765,200
マキタ	21,200	3,635.00	77,062,000
日立造船	14,500	336.00	4,872,000
三菱重工業	29,200	4,557.00	133,064,400
I H I	13,400	2,537.00	33,995,800
スター精密	3,000	1,701.00	5,103,000
日清紡ホールディングス	9,800	903.00	8,849,400
イビデン	10,700	1,901.00	20,340,700
コニカミノルタ	38,100	1,104.00	42,062,400
ブラザー工業	22,600	2,072.00	46,827,200
ミネベアミツミ	32,300	1,801.00	58,172,300
日立製作所	78,300	3,700.00	289,710,000
三菱電機	173,900	1,495.50	260,067,450
富士電機	11,300	3,740.00	42,262,000
東洋電機製造	700	1,432.00	1,002,400
安川電機	20,200	3,805.00	76,861,000
シンフォニアテクノロジー	2,400	1,469.00	3,525,600

明電舎	3,500	1,500.00	5,250,000
オリジン	500	2,008.00	1,004,000
山洋電気	800	4,425.00	3,540,000
デンヨー	1,600	1,378.00	2,204,800
東芝テック	2,200	2,948.00	6,485,600
芝浦メカトロニクス	300	3,625.00	1,087,500
マブチモーター	4,800	3,715.00	17,832,000
日本電産	20,900	15,215.00	317,993,500
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	1,000	1,392.00	1,392,000
トレックス・セミコンダクター	600	1,259.00	755,400
東光高岳	900	1,221.00	1,098,900
ダブル・スコープ	2,500	1,700.00	4,250,000
ダイヘン	1,900	2,916.00	5,540,400
ヤーマン	2,500	1,029.00	2,572,500
JVCケンウッド	13,600	249.00	3,386,400
ミマキエンジニアリング	1,600	595.00	952,000
第一精工	800	1,081.00	864,800
日新電機	4,100	1,017.00	4,169,700
大崎電気工業	3,600	706.00	2,541,600
オムロン	18,500	5,580.00	103,230,000
日東工業	2,800	2,085.00	5,838,000
I D E C	2,300	2,016.00	4,636,800
正興電機製作所	300	777.00	233,100
不二電機工業	300	1,288.00	386,400
ジーエス・ユアサ コーポレーション	6,300	2,077.00	13,085,100
サクサホールディングス	400	1,705.00	682,000
メルコホールディングス	700	3,240.00	2,268,000
テクノメディカ	400	2,103.00	841,200
日本電気	22,500	3,890.00	87,525,000
富士通	16,800	7,351.00	123,496,800
沖電気工業	7,600	1,312.00	9,971,200
岩崎通信機	900	788.00	709,200
電気興業	900	3,135.00	2,821,500
サンケン電気	2,100	2,220.00	4,662,000
ナカヨ	300	1,404.00	421,200
アイホン	1,000	1,663.00	1,663,000
ルネサスエレクトロニクス	18,200	575.00	10,465,000
セイコーエプソン	21,600	1,686.00	36,417,600

ワコム	12,700	419.00	5,321,300
アルバック	3,500	3,530.00	12,355,000
アクセル	1,100	506.00	556,600
E I Z O	1,600	4,055.00	6,488,000
日本信号	4,500	1,172.00	5,274,000
京三製作所	3,800	402.00	1,527,600
能美防災	2,300	1,980.00	4,554,000
ホーチキ	1,100	1,300.00	1,430,000
星和電機	800	497.00	397,600
エレコム	1,600	3,600.00	5,760,000
パナソニック	198,800	980.50	194,923,400
シャープ	17,400	1,130.00	19,662,000
アンリツ	11,300	1,736.00	19,616,800
富士通ゼネラル	5,400	1,550.00	8,370,000
ソニー	116,700	5,368.00	626,445,600
T D K	9,100	9,250.00	84,175,000
帝国通信工業	600	1,206.00	723,600
タムラ製作所	6,800	637.00	4,331,600
アルプスアルパイン	18,100	2,095.00	37,919,500
池上通信機	600	1,136.00	681,600
日本電波工業	2,100	469.00	984,900
鈴木	1,000	667.00	667,000
日本トリム	300	5,290.00	1,587,000
ローランド ディー . ジー .	900	2,354.00	2,118,600
フォスター電機	2,000	1,565.00	3,130,000
S M K	500	2,498.00	1,249,000
ヨコオ	1,200	1,696.00	2,035,200
ホシデン	5,200	1,002.00	5,210,400
ヒロセ電機	2,500	11,990.00	29,975,000
日本航空電子工業	4,100	1,719.00	7,047,900
T O A	1,900	1,195.00	2,270,500
マクセルホールディングス	3,800	1,821.00	6,919,800
古野電気	2,300	894.00	2,056,200
ユニデンホールディングス	500	2,433.00	1,216,500
スミダコーポレーション	1,500	1,318.00	1,977,000
アイコム	1,000	2,070.00	2,070,000
リオン	800	1,902.00	1,521,600
本多通信工業	1,500	525.00	787,500

船井電機	1,900	747.00	1,419,300
横河電機	17,400	2,202.00	38,314,800
新電元工業	600	4,165.00	2,499,000
アズビル	11,200	2,582.00	28,918,400
東亜ディーケーケー	900	808.00	727,200
日本光電工業	7,700	3,240.00	24,948,000
チノー	600	1,237.00	742,200
共和電業	1,800	417.00	750,600
日本電子材料	800	643.00	514,400
堀場製作所	3,500	6,110.00	21,385,000
アドバンテスト	11,900	3,005.00	35,759,500
小野測器	900	597.00	537,300
エスベック	1,500	2,084.00	3,126,000
キーエンス	8,500	67,440.00	573,240,000
日置電機	900	3,765.00	3,388,500
シスメックス	13,600	6,157.00	83,735,200
日本マイクロニクス	2,800	860.00	2,408,000
メガチップス	1,400	1,487.00	2,081,800
OBARA GROUP	1,000	4,080.00	4,080,000
澤藤電機	200	1,706.00	341,200
原田工業	600	814.00	488,400
コーセル	2,300	1,149.00	2,642,700
イリソ電子工業	1,600	5,310.00	8,496,000
オプテックスグループ	3,100	1,725.00	5,347,500
千代田インテグレ	700	2,000.00	1,400,000
アイ・オー・データ機器	600	1,204.00	722,400
レーザーテック	3,600	4,705.00	16,938,000
スタンレー電気	12,300	2,839.00	34,919,700
岩崎電気	700	1,355.00	948,500
ウシオ電機	10,100	1,289.00	13,018,900
岡谷電機産業	1,600	361.00	577,600
ヘリオス テクノ ホールディング	1,600	617.00	987,200
エノモト	300	903.00	270,900
日本セラミック	1,800	3,060.00	5,508,000
遠藤照明	900	759.00	683,100
古河電池	1,300	641.00	833,300
双信電機	900	515.00	463,500
山一電機	1,300	1,125.00	1,462,500

図研	1,100	1,593.00	1,752,300
日本電子	3,500	2,260.00	7,910,000
カシオ計算機	15,400	1,354.00	20,851,600
ファナック	16,500	19,655.00	324,307,500
日本シイエムケイ	4,500	699.00	3,145,500
エンプラス	800	3,040.00	2,432,000
大真空	800	999.00	799,200
ローム	8,400	7,380.00	61,992,000
浜松ホトニクス	12,500	4,280.00	53,500,000
三井ハイテック	2,000	1,162.00	2,324,000
新光電気工業	6,000	968.00	5,808,000
京セラ	26,500	6,855.00	181,657,500
太陽誘電	7,800	2,228.00	17,378,400
村田製作所	54,700	5,144.00	281,376,800
双葉電子工業	2,800	1,693.00	4,740,400
北陸電気工業	700	1,038.00	726,600
ニチコン	5,600	960.00	5,376,000
日本ケミコン	1,300	2,033.00	2,642,900
K O A	2,700	1,381.00	3,728,700
市光工業	2,600	635.00	1,651,000
小糸製作所	10,400	6,140.00	63,856,000
ミツバ	3,400	669.00	2,274,600
S C R E E Nホールディングス	3,000	4,890.00	14,670,000
キャノン電子	1,500	1,763.00	2,644,500
キャノン	93,500	3,015.00	281,902,500
リコー	52,400	1,113.00	58,321,200
象印マホービン	3,200	1,122.00	3,590,400
M U T O Hホールディングス	300	1,846.00	553,800
東京エレクトロン	11,600	16,780.00	194,648,000
トヨタ紡織	6,100	1,488.00	9,076,800
芦森工業	400	1,551.00	620,400
ユニプレス	3,400	1,616.00	5,494,400
豊田自動織機	14,100	5,920.00	83,472,000
モリタホールディングス	3,000	1,820.00	5,460,000
三櫻工業	2,500	500.00	1,250,000
デンソー	38,300	4,535.00	173,690,500
東海理化電機製作所	4,600	1,789.00	8,229,400
三井E & Sホールディングス	6,500	1,025.00	6,662,500

川崎重工業	13,600	2,571.00	34,965,600
名村造船所	5,500	342.00	1,881,000
日本車輛製造	700	2,307.00	1,614,900
三菱ロジスネクスト	2,100	1,189.00	2,496,900
近畿車輛	300	2,023.00	606,900
日産自動車	205,000	873.70	179,108,500
いすゞ自動車	55,000	1,505.50	82,802,500
トヨタ自動車	193,600	6,759.00	1,308,542,400
日野自動車	22,000	971.00	21,362,000
三菱自動車工業	64,600	606.00	39,147,600
エフテック	1,300	840.00	1,092,000
レシップホールディングス	700	773.00	541,100
G M B	400	843.00	337,200
ファルテック	400	805.00	322,000
武蔵精密工業	4,300	1,609.00	6,918,700
日産車体	3,700	979.00	3,622,300
新明和工業	7,300	1,247.00	9,103,100
極東開発工業	3,500	1,496.00	5,236,000
日信工業	3,300	1,386.00	4,573,800
トピー工業	1,400	2,325.00	3,255,000
ティラド	600	2,214.00	1,328,400
タチエス	3,000	1,583.00	4,749,000
N O K	9,400	1,668.00	15,679,200
フタバ産業	5,100	643.00	3,279,300
K Y B	1,800	2,797.00	5,034,600
大同メタル工業	2,900	681.00	1,974,900
プレス工業	8,700	562.00	4,889,400
ミクニ	2,300	451.00	1,037,300
太平洋工業	3,600	1,610.00	5,796,000
ケーヒン	4,000	1,735.00	6,940,000
河西工業	2,100	828.00	1,738,800
アイシン精機	14,300	3,830.00	54,769,000
マツダ	54,800	1,298.50	71,157,800
今仙電機製作所	1,600	999.00	1,598,400
本田技研工業	146,600	2,989.50	438,260,700
スズキ	31,800	4,914.00	156,265,200
S U B A R U	54,000	2,599.00	140,346,000
安永	800	1,639.00	1,311,200

ヤマハ発動機	24,600	1,950.00	47,970,000
ショーワ	4,100	1,568.00	6,428,800
T B K	2,000	396.00	792,000
エクセディ	2,400	2,343.00	5,623,200
豊田合成	5,700	2,158.00	12,300,600
愛三工業	2,800	711.00	1,990,800
盟和産業	200	1,045.00	209,000
日本プラスト	1,400	736.00	1,030,400
ヨロズ	1,600	1,575.00	2,520,000
エフ・シー・シー	3,200	2,345.00	7,504,000
シマノ	7,000	15,700.00	109,900,000
テイ・エス テック	4,100	3,000.00	12,300,000
ジャムコ	900	2,209.00	1,988,100
テルモ	49,200	3,307.00	162,704,400
クリエートメディック	500	970.00	485,000
日機装	5,700	1,315.00	7,495,500
島津製作所	22,400	2,906.00	65,094,400
J M S	1,600	644.00	1,030,400
長野計器	1,400	762.00	1,066,800
ブイ・テクノロジー	400	14,200.00	5,680,000
東京計器	1,200	1,068.00	1,281,600
愛知時計電機	200	4,105.00	821,000
インターアクション	800	1,791.00	1,432,800
オーバル	1,800	264.00	475,200
東京精密	3,100	3,010.00	9,331,000
マニー	2,100	6,570.00	13,797,000
ニコン	30,300	1,521.00	46,086,300
トプコン	9,400	1,340.00	12,596,000
オリンパス	103,700	1,269.00	131,595,300
理研計器	1,500	1,984.00	2,976,000
タムロン	1,600	2,147.00	3,435,200
H O Y A	35,000	7,685.00	268,975,000
シード	800	1,114.00	891,200
ノーリツ鋼機	1,400	2,091.00	2,927,400
エー・アンド・デイ	1,600	891.00	1,425,600
朝日インテック	7,400	5,590.00	41,366,000
シチズン時計	19,300	589.00	11,367,700
リズム時計工業	600	1,243.00	745,800

大研医器	1,500	566.00	849,000
メニコン	2,400	3,200.00	7,680,000
シンシア	300	617.00	185,100
松風	800	1,219.00	975,200
セイコーホールディングス	2,700	2,411.00	6,509,700
ニプロ	12,100	1,366.00	16,528,600
中本パックス	500	1,519.00	759,500
スノーピーク	700	1,586.00	1,110,200
パラマウントベッドホールディングス	2,000	5,040.00	10,080,000
トランザクション	1,000	789.00	789,000
S H O - B I	700	342.00	239,400
ニホンフラッシュ	700	2,071.00	1,449,700
前田工織	1,900	2,007.00	3,813,300
永大産業	2,200	410.00	902,000
アートネイチャー	1,900	620.00	1,178,000
バンダイナムコホールディングス	18,000	5,120.00	92,160,000
アイフィスジャパン	400	606.00	242,400
共立印刷	3,200	203.00	649,600
S H O E I	800	4,715.00	3,772,000
フランスベッドホールディングス	2,500	912.00	2,280,000
パイロットコーポレーション	3,000	4,300.00	12,900,000
萩原工業	1,000	1,392.00	1,392,000
トッパン・フォームズ	3,900	911.00	3,552,900
フジシールインターナショナル	3,900	3,795.00	14,800,500
タカラトミー	7,400	1,156.00	8,554,400
エステールホールディングス	500	619.00	309,500
アーク	7,600	100.00	760,000
タカノ	700	812.00	568,400
プロネクサス	1,500	1,262.00	1,893,000
ホクシン	1,600	131.00	209,600
ウッドワン	600	1,064.00	638,400
大建工業	1,300	2,022.00	2,628,600
凸版印刷	24,600	1,714.00	42,164,400
大日本印刷	24,500	2,540.00	62,230,000
図書印刷	1,700	963.00	1,637,100
共同印刷	500	2,490.00	1,245,000
N I S S H A	3,600	1,201.00	4,323,600
光村印刷	200	2,199.00	439,800

宝印刷	800	1,703.00	1,362,400
アシックス	16,500	1,307.00	21,565,500
ツツミ	600	1,811.00	1,086,600
小松ウオール工業	500	1,816.00	908,000
ヤマハ	10,300	5,500.00	56,650,000
河合楽器製作所	600	2,748.00	1,648,800
クリナップ	1,800	607.00	1,092,600
ビジョン	10,500	4,515.00	47,407,500
兼松サステック	100	1,527.00	152,700
キングジム	1,600	870.00	1,392,000
リンテック	4,100	2,253.00	9,237,300
イトーキ	3,300	519.00	1,712,700
任天堂	9,900	37,130.00	367,587,000
三菱鉛筆	2,900	2,151.00	6,237,900
タカラスタンダード	3,600	1,656.00	5,961,600
コクヨ	8,300	1,373.00	11,395,900
ナカバヤシ	1,600	496.00	793,600
グローブライド	900	3,060.00	2,754,000
オカムラ	6,100	1,144.00	6,978,400
美津濃	1,800	2,441.00	4,393,800
東京電力ホールディングス	139,000	605.00	84,095,000
中部電力	53,100	1,614.50	85,729,950
関西電力	70,800	1,294.00	91,615,200
中国電力	24,200	1,361.00	32,936,200
北陸電力	17,500	790.00	13,825,000
東北電力	40,700	1,194.00	48,595,800
四国電力	15,700	1,083.00	17,003,100
九州電力	35,900	1,069.00	38,377,100
北海道電力	16,800	618.00	10,382,400
沖縄電力	3,200	1,690.00	5,408,000
電源開発	13,800	2,337.00	32,250,600
エフオン	800	825.00	660,000
イーレックス	3,000	978.00	2,934,000
レノバ	2,200	1,016.00	2,235,200
東京瓦斯	34,100	2,706.00	92,274,600
大阪瓦斯	33,700	1,982.00	66,793,400
東邦瓦斯	8,600	4,440.00	38,184,000
北海道瓦斯	900	1,448.00	1,303,200

広島ガス	3,400	348.00	1,183,200
西部瓦斯	1,900	2,277.00	4,326,300
静岡ガス	5,300	864.00	4,579,200
メタウォーター	800	3,295.00	2,636,000
SBSホールディングス	1,700	1,796.00	3,053,200
東武鉄道	18,400	3,140.00	57,776,000
相鉄ホールディングス	6,000	3,000.00	18,000,000
東京急行電鉄	47,300	1,775.00	83,957,500
京浜急行電鉄	23,900	1,854.00	44,310,600
小田急電鉄	27,900	2,638.00	73,600,200
京王電鉄	9,700	6,900.00	66,930,000
京成電鉄	13,100	3,800.00	49,780,000
富士急行	2,400	4,120.00	9,888,000
新京成電鉄	300	2,034.00	610,200
東日本旅客鉄道	30,900	10,005.00	309,154,500
西日本旅客鉄道	15,600	8,355.00	130,338,000
東海旅客鉄道	15,600	22,420.00	349,752,000
西武ホールディングス	22,200	1,776.00	39,427,200
鴻池運輸	2,800	1,762.00	4,933,600
西日本鉄道	4,900	2,577.00	12,627,300
ハマキョウレックス	1,300	3,980.00	5,174,000
サカイ引越センター	900	6,430.00	5,787,000
近鉄グループホールディングス	16,500	4,930.00	81,345,000
阪急阪神ホールディングス	21,900	4,015.00	87,928,500
南海電気鉄道	7,400	2,788.00	20,631,200
京阪ホールディングス	7,300	4,695.00	34,273,500
神戸電鉄	500	4,005.00	2,002,500
名古屋鉄道	13,400	2,968.00	39,771,200
山陽電気鉄道	1,300	2,180.00	2,834,000
日本通運	6,500	5,680.00	36,920,000
ヤマトホールディングス	28,900	2,384.00	68,897,600
山九	4,600	5,130.00	23,598,000
丸運	900	279.00	251,100
丸全昭和運輸	1,300	2,918.00	3,793,400
センコーグループホールディングス	9,100	873.00	7,944,300
トナミホールディングス	400	6,000.00	2,400,000
ニッコンホールディングス	6,200	2,516.00	15,599,200
日本石油輸送	200	2,838.00	567,600

福山通運	2,100	4,030.00	8,463,000
セイノーホールディングス	12,400	1,433.00	17,769,200
エスライン	500	1,004.00	502,000
神奈川中央交通	400	3,955.00	1,582,000
日立物流	3,700	3,120.00	11,544,000
丸和運輸機関	900	3,985.00	3,586,500
C & F ロジホールディングス	1,600	1,212.00	1,939,200
九州旅客鉄道	13,800	3,460.00	47,748,000
S Gホールディングス	15,600	2,911.00	45,411,600
日本郵船	14,100	1,797.00	25,337,700
商船三井	9,800	2,675.00	26,215,000
川崎汽船	5,400	1,589.00	8,580,600
N S ユナイテッド海運	900	2,321.00	2,088,900
飯野海運	7,600	375.00	2,850,000
共栄タンカー	100	1,516.00	151,600
乾汽船	1,500	856.00	1,284,000
日本航空	30,100	3,685.00	110,918,500
A N Aホールディングス	30,100	3,734.00	112,393,400
パスコ	500	983.00	491,500
トランコム	500	6,490.00	3,245,000
日新	1,400	1,857.00	2,599,800
三菱倉庫	5,800	3,045.00	17,661,000
三井倉庫ホールディングス	2,100	1,685.00	3,538,500
住友倉庫	6,100	1,372.00	8,369,200
澁澤倉庫	900	1,709.00	1,538,100
東陽倉庫	3,000	306.00	918,000
日本トランスシティ	3,500	431.00	1,508,500
ケイヒン	300	1,282.00	384,600
中央倉庫	900	1,039.00	935,100
川西倉庫	300	1,229.00	368,700
安田倉庫	1,400	858.00	1,201,200
ファイズ	200	897.00	179,400
東洋埠頭	500	1,446.00	723,000
宇徳	1,400	522.00	730,800
上組	10,200	2,590.00	26,418,000
サンリツ	400	668.00	267,200
キムラユニティー	400	1,081.00	432,400
キューソー流通システム	400	2,017.00	806,800

近鉄エクスプレス	3,200	1,564.00	5,004,800
東海運	1,400	260.00	364,000
エーアイティー	1,100	1,068.00	1,174,800
内外トランスライン	500	1,305.00	652,500
日本コンセプト	400	1,073.00	429,200
NEC ネットエスアイ	1,900	2,774.00	5,270,600
クロスキャット	400	1,164.00	465,600
システナ	6,100	1,314.00	8,015,400
デジタルアーツ	900	9,140.00	8,226,000
日鉄ソリューションズ	2,600	3,195.00	8,307,000
キューブシステム	900	813.00	731,700
エイジア	300	1,190.00	357,000
コア	800	1,345.00	1,076,000
ソリトンシステムズ	1,000	1,000.00	1,000,000
ソフトクリエイトホールディングス	700	1,549.00	1,084,300
T I S	5,700	4,970.00	28,329,000
ネオス	600	800.00	480,000
電算システム	700	3,165.00	2,215,500
グリー	12,000	486.00	5,832,000
コーエーテックモホールディングス	3,500	2,020.00	7,070,000
三菱総合研究所	700	3,075.00	2,152,500
ボルテージ	400	560.00	224,000
電算	200	1,952.00	390,400
A G S	1,000	688.00	688,000
ファインデックス	1,500	853.00	1,279,500
ブレインパッド	300	6,170.00	1,851,000
K L a b	3,100	763.00	2,365,300
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	2,300	972.00	2,235,600
イーブックイニシアティブジャパン	300	2,389.00	716,700
ネクソン	43,500	1,582.00	68,817,000
アイスタイル	4,400	794.00	3,493,600
エムアップ	600	2,601.00	1,560,600
エイチーム	1,100	1,594.00	1,753,400
テクノスジャパン	1,400	654.00	915,600
コロプラ	4,900	619.00	3,033,100
ブロードリーフ	8,600	569.00	4,893,400
クロス・マーケティンググループ	600	391.00	234,600
デジタルハーツホールディングス	800	1,224.00	979,200

メディアドゥホールディングス	500	2,969.00	1,484,500
じげん	1,900	600.00	1,140,000
ブイキューブ	1,100	508.00	558,800
サイバーリンクス	300	1,056.00	316,800
フィックスターズ	1,600	1,491.00	2,385,600
CARTA HOLDINGS	900	1,173.00	1,055,700
オブティム	800	2,115.00	1,692,000
セレス	600	2,064.00	1,238,400
ティーガイア	1,700	1,808.00	3,073,600
セック	300	3,575.00	1,072,500
豆蔵ホールディングス	1,200	1,094.00	1,312,800
テクマトリックス	1,200	2,016.00	2,419,200
プロシップ	500	1,159.00	579,500
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	41,200	341.00	14,049,200
GMOペイメントゲートウェイ	2,800	8,700.00	24,360,000
ザッパラス	1,200	415.00	498,000
システムリサーチ	200	2,610.00	522,000
インターネットイニシアティブ	2,800	2,213.00	6,196,400
さくらインターネット	2,100	505.00	1,060,500
ヴィンクス	600	1,091.00	654,600
GMOクラウド	400	4,215.00	1,686,000
SRAホールディングス	900	2,381.00	2,142,900
Minorityソリューションズ	300	1,552.00	465,600
システムインテグレータ	500	659.00	329,500
朝日ネット	1,500	599.00	898,500
eBASE	1,000	1,098.00	1,098,000
アバント	600	1,671.00	1,002,600
アドソル日進	600	1,690.00	1,014,000
フリービット	1,000	1,104.00	1,104,000
コムチュア	1,000	3,860.00	3,860,000
サイバーコム	300	2,248.00	674,400
アステリア	900	809.00	728,100
マークライnz	600	1,710.00	1,026,000
メディカル・データ・ビジョン	1,500	977.00	1,465,500
gumi	2,300	617.00	1,419,100
ショーケース	400	660.00	264,000
モバイルファクトリー	500	1,476.00	738,000
テラスカイ	200	1,791.00	358,200

デジタル・インフォメーション・テクノロジー	800	1,593.00	1,274,400
P C Iホールディングス	300	2,296.00	688,800
パイブドHD	300	1,263.00	378,900
アイビーシー	300	1,299.00	389,700
ネオジャパン	300	915.00	274,500
P R T I M E S	100	2,354.00	235,400
ランドコンピュータ	200	1,124.00	224,800
ダブルスタンダード	100	5,370.00	537,000
オーブンドア	800	3,040.00	2,432,000
マイネット	600	924.00	554,400
アカツキ	600	5,390.00	3,234,000
ベネフィットジャパン	100	912.00	91,200
U b i c o mホールディングス	300	1,499.00	449,700
L I N E	5,200	3,740.00	19,448,000
カナミックネットワーク	300	1,949.00	584,700
ノムラシステムコーポレーション	100	775.00	77,500
チェンジ	200	3,810.00	762,000
シンクロ・フード	700	576.00	403,200
オークネット	900	1,311.00	1,179,900
A O I T Y O H o l d i n g s	1,900	762.00	1,447,800
マクロミル	3,100	1,247.00	3,865,700
ビーグリー	400	1,068.00	427,200
オロ	200	6,850.00	1,370,000
ソルクシーズ	800	838.00	670,400
フェイス	700	876.00	613,200
ハイマックス	200	1,800.00	360,000
野村総合研究所	10,900	5,250.00	57,225,000
サイバネットシステム	1,400	531.00	743,400
C Eホールディングス	500	857.00	428,500
日本システム技術	300	1,392.00	417,600
インテージホールディングス	2,200	910.00	2,002,000
東邦システムサイエンス	500	911.00	455,500
ソースネクスト	6,700	534.00	3,577,800
インフォコム	1,400	2,202.00	3,082,800
F I G	1,600	313.00	500,800
アルテリア・ネットワークス	1,400	1,061.00	1,485,400
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	400	1,840.00	736,000

フォーカスシステムズ	1,200	921.00	1,105,200
クレスコ	500	3,360.00	1,680,000
フジ・メディア・ホールディングス	17,800	1,450.00	25,810,000
オービック	5,900	12,590.00	74,281,000
ジャストシステム	2,400	3,095.00	7,428,000
TDCソフト	1,400	823.00	1,152,200
ヤフー	111,800	309.00	34,546,200
トレンドマイクロ	9,100	5,340.00	48,594,000
IDホールディングス	500	1,190.00	595,000
日本オラクル	3,500	7,430.00	26,005,000
アルファシステムズ	500	2,689.00	1,344,500
フューチャー	2,300	2,076.00	4,774,800
CAC Holdings	1,200	1,578.00	1,893,600
ソフトバンク・テクノロジー	700	2,349.00	1,644,300
トーセ	500	841.00	420,500
オービックビジネスコンサルタント	1,800	4,410.00	7,938,000
伊藤忠テクノソリューションズ	7,800	2,755.00	21,489,000
アイティフォー	2,100	909.00	1,908,900
東計電算	200	3,065.00	613,000
エクスネット	400	924.00	369,600
大塚商会	9,300	4,270.00	39,711,000
サイボウズ	2,000	1,063.00	2,126,000
ソフトブレーン	1,400	439.00	614,600
電通国際情報サービス	1,100	3,750.00	4,125,000
デジタルガレージ	3,300	3,155.00	10,411,500
EMシステムズ	1,400	1,512.00	2,116,800
ウェザーニューズ	600	3,380.00	2,028,000
C I J	1,400	924.00	1,293,600
東洋ビジネスエンジニアリング	200	2,092.00	418,400
日本エンタープライズ	2,100	166.00	348,600
WOWOW	800	2,855.00	2,284,000
スカラ	1,200	839.00	1,006,800
IMAGICA GROUP	1,600	546.00	873,600
ネットワンシステムズ	6,100	2,931.00	17,879,100
システムソフト	4,500	100.00	450,000
アルゴグラフィックス	1,400	2,277.00	3,187,800
マーベラス	2,600	841.00	2,186,600
エイベックス	3,000	1,418.00	4,254,000

日本ユニシス	5,400	2,835.00	15,309,000
兼松エレクトロニクス	900	3,220.00	2,898,000
東京放送ホールディングス	11,400	2,019.00	23,016,600
日本テレビホールディングス	15,700	1,576.00	24,743,200
朝日放送グループホールディングス	1,700	752.00	1,278,400
テレビ朝日ホールディングス	4,700	1,853.00	8,709,100
スカパーJ S A Tホールディングス	13,200	434.00	5,728,800
テレビ東京ホールディングス	1,400	2,301.00	3,221,400
日本BS放送	600	1,086.00	651,600
ビジョン	500	5,260.00	2,630,000
スマートバリュー	400	807.00	322,800
USEN-NEXT HOLDINGS	700	834.00	583,800
ワイヤレスゲート	900	411.00	369,900
コネクシオ	1,200	1,469.00	1,762,800
クロップス	400	644.00	257,600
日本電信電話	116,600	4,705.00	548,603,000
KDDI	150,400	2,539.50	381,940,800
ソフトバンク	180,700	1,311.00	236,897,700
光通信	2,000	20,050.00	40,100,000
NTTドコモ	107,800	2,397.00	258,396,600
エムティーアイ	2,000	646.00	1,292,000
GMOインターネット	6,200	1,689.00	10,471,800
アイドママーケティングコミュニケーション	400	538.00	215,200
カドカワ	5,000	1,387.00	6,935,000
学研ホールディングス	600	5,040.00	3,024,000
ゼンリン	3,400	2,291.00	7,789,400
昭文社	1,200	414.00	496,800
インプレスホールディングス	1,700	150.00	255,000
アイネット	900	1,296.00	1,166,400
松竹	1,100	13,310.00	14,641,000
東宝	11,300	4,520.00	51,076,000
東映	700	14,390.00	10,073,000
エヌ・ティ・ティ・データ	45,600	1,261.00	57,501,600
ピー・シー・エー	200	3,380.00	676,000
ビジネスブレイン太田昭和	300	1,971.00	591,300
D T S	1,900	4,240.00	8,056,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	8,000	3,785.00	30,280,000

シーイーシー	1,800	2,084.00	3,751,200
カプコン	7,400	2,375.00	17,575,000
アイ・エス・ビー	400	1,823.00	729,200
ジャステック	1,000	918.00	918,000
S C S K	4,500	4,955.00	22,297,500
日本システムウエア	600	2,155.00	1,293,000
アイネス	2,200	1,271.00	2,796,200
T K C	1,400	4,265.00	5,971,000
富士ソフト	2,600	4,250.00	11,050,000
N S D	2,800	2,763.00	7,736,400
コナミホールディングス	7,000	4,930.00	34,510,000
福井コンピュータホールディングス	600	2,254.00	1,352,400
J B C Cホールディングス	1,300	1,380.00	1,794,000
ミロク情報サービス	1,700	2,925.00	4,972,500
ソフトバンクグループ	71,300	11,470.00	817,811,000
ハウスイ	400	814.00	325,600
高千穂交易	700	908.00	635,600
伊藤忠食品	400	4,585.00	1,834,000
エレマテック	800	2,081.00	1,664,800
J A L U X	500	2,737.00	1,368,500
あらた	1,000	3,825.00	3,825,000
トーメンデバイス	300	2,392.00	717,600
東京エレクトロン デバイス	700	1,907.00	1,334,900
フィールズ	1,600	786.00	1,257,600
双日	94,700	372.00	35,228,400
アルフレッサ ホールディングス	19,100	2,997.00	57,242,700
横浜冷凍	4,700	876.00	4,117,200
ラサ商事	800	811.00	648,800
ラクーンホールディングス	800	691.00	552,800
アルコニックス	1,800	1,222.00	2,199,600
神戸物産	2,600	4,575.00	11,895,000
あい ホールディングス	2,500	1,745.00	4,362,500
ディービーエックス	700	898.00	628,600
ダイワボウホールディングス	1,600	5,470.00	8,752,000
マクニカ・富士エレホールディングス	4,800	1,459.00	7,003,200
ラクト・ジャパン	800	4,370.00	3,496,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	3,300	1,045.00	3,448,500
八洲電機	1,300	827.00	1,075,100

メディアスホールディングス	1,100	746.00	820,600
レスターホールディングス	1,900	1,726.00	3,279,400
ジューテックホールディングス	400	980.00	392,000
大光	600	687.00	412,200
OCHIホールディングス	500	1,225.00	612,500
TOKAIホールディングス	9,000	908.00	8,172,000
黒谷	400	448.00	179,200
Cominix	300	851.00	255,300
三洋貿易	800	2,203.00	1,762,400
ビューティガレージ	300	1,381.00	414,300
ウイン・パートナーズ	1,100	1,172.00	1,289,200
ミタチ産業	500	738.00	369,000
シップヘルスケアホールディングス	3,600	4,515.00	16,254,000
明治電機工業	500	1,801.00	900,500
デリカフーズホールディングス	300	1,409.00	422,700
スターティアホールディングス	400	625.00	250,000
コメダホールディングス	4,000	2,012.00	8,048,000
富士興産	800	671.00	536,800
協栄産業	200	1,530.00	306,000
小野建	1,500	1,507.00	2,260,500
南陽	300	2,005.00	601,500
佐鳥電機	1,300	964.00	1,253,200
エコートレーディング	800	535.00	428,000
伯東	1,200	1,156.00	1,387,200
コンドーテック	1,300	964.00	1,253,200
中山福	1,100	503.00	553,300
ナガイレーベン	2,500	2,413.00	6,032,500
三菱食品	1,900	2,843.00	5,401,700
松田産業	1,300	1,380.00	1,794,000
第一興商	2,600	5,410.00	14,066,000
メディパルホールディングス	18,500	2,445.00	45,232,500
SPK	300	2,403.00	720,900
萩原電気ホールディングス	600	3,010.00	1,806,000
アズワン	1,200	8,860.00	10,632,000
スズデン	600	1,490.00	894,000
尾家産業	600	1,274.00	764,400
シモジマ	1,100	1,177.00	1,294,700
ドウシシャ	1,600	1,752.00	2,803,200

小津産業	400	1,906.00	762,400
高速	1,000	1,174.00	1,174,000
たけびし	500	1,284.00	642,000
リックス	300	1,471.00	441,300
丸文	1,600	614.00	982,400
ハピネット	1,500	1,310.00	1,965,000
橋本総業ホールディングス	300	1,368.00	410,400
日本ライフライン	5,400	1,876.00	10,130,400
タカショー	1,200	450.00	540,000
エクセル	600	1,886.00	1,131,600
マルカ	600	2,051.00	1,230,600
I D O M	6,200	270.00	1,674,000
日本エム・ディ・エム	1,000	1,292.00	1,292,000
進和	1,000	2,248.00	2,248,000
エスケイジャパン	500	557.00	278,500
ダイترون	800	1,631.00	1,304,800
シークス	2,200	1,648.00	3,625,600
田中商事	500	597.00	298,500
オーハシテクニカ	900	1,418.00	1,276,200
白銅	500	1,483.00	741,500
伊藤忠商事	119,600	1,948.00	232,980,800
丸紅	168,700	750.80	126,659,960
高島	300	1,685.00	505,500
長瀬産業	9,600	1,687.00	16,195,200
蝶理	1,100	1,592.00	1,751,200
豊田通商	19,100	3,350.00	63,985,000
三共生興	2,800	496.00	1,388,800
兼松	6,800	1,155.00	7,854,000
ツカモトコーポレーション	300	1,141.00	342,300
三井物産	140,700	1,673.50	235,461,450
日本紙パルプ商事	1,000	4,125.00	4,125,000
日立ハイテクノロジーズ	5,200	4,705.00	24,466,000
カメイ	2,200	1,100.00	2,420,000
東都水産	300	2,494.00	748,200
O U Gホールディングス	300	2,600.00	780,000
スターゼン	700	4,095.00	2,866,500
山善	6,700	1,100.00	7,370,000
椿本興業	300	3,420.00	1,026,000

住友商事	100,900	1,516.50	153,014,850
内田洋行	800	3,485.00	2,788,000
三菱商事	120,000	2,929.00	351,480,000
第一実業	800	3,330.00	2,664,000
キヤノンマーケティングジャパン	4,900	2,253.00	11,039,700
西華産業	1,000	1,291.00	1,291,000
佐藤商事	1,400	886.00	1,240,400
菱洋エレクトロ	1,700	1,616.00	2,747,200
東京産業	1,800	500.00	900,000
ユアサ商事	1,700	2,981.00	5,067,700
神鋼商事	400	2,493.00	997,200
小林産業	1,200	330.00	396,000
阪和興業	3,000	3,010.00	9,030,000
正栄食品工業	900	3,065.00	2,758,500
カナデン	1,500	1,236.00	1,854,000
菱電商事	1,300	1,512.00	1,965,600
フルサト工業	900	1,576.00	1,418,400
岩谷産業	3,900	3,415.00	13,318,500
すてきナイスグループ	900	968.00	871,200
昭光通商	1,100	633.00	696,300
極東貿易	500	1,512.00	756,000
イワキ	2,100	454.00	953,400
三愛石油	4,700	878.00	4,126,600
稲畑産業	4,100	1,432.00	5,871,200
G S Iクレオス	500	1,125.00	562,500
明和産業	1,700	446.00	758,200
ワキタ	3,700	1,096.00	4,055,200
東邦ホールディングス	5,100	2,542.00	12,964,200
サンゲツ	5,100	2,043.00	10,419,300
ミツウロコグループホールディングス	2,500	883.00	2,207,500
シナネンホールディングス	700	1,998.00	1,398,600
伊藤忠エネクス	3,900	893.00	3,482,700
サンリオ	5,300	2,508.00	13,292,400
サンワテクノス	1,200	831.00	997,200
リョーサン	1,900	2,872.00	5,456,800
新光商事	1,600	1,849.00	2,958,400
トーホー	900	2,169.00	1,952,100
三信電気	1,100	1,770.00	1,947,000

東陽テクニカ	2,000	887.00	1,774,000
モスフードサービス	2,300	2,619.00	6,023,700
加賀電子	1,700	1,942.00	3,301,400
ソーダニッカ	1,900	559.00	1,062,100
立花エレテック	1,200	1,670.00	2,004,000
フォーバル	700	949.00	664,300
PALTA C	3,100	6,120.00	18,972,000
三谷産業	2,200	295.00	649,000
太平洋興発	800	698.00	558,400
西本Wismettacホールディングス	400	4,000.00	1,600,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	300	1,237.00	371,100
国際紙パルプ商事	3,300	283.00	933,900
ヤマタネ	800	1,557.00	1,245,600
丸紅建材リース	100	1,820.00	182,000
日鉄物産	1,200	4,460.00	5,352,000
泉州電業	500	2,505.00	1,252,500
トラスコ中山	3,600	2,741.00	9,867,600
オートバックスセブン	6,800	1,922.00	13,069,600
モリト	1,200	808.00	969,600
加藤産業	2,700	3,530.00	9,531,000
北恵	400	900.00	360,000
イノテック	1,000	957.00	957,000
イエローハット	3,200	1,369.00	4,380,800
JKホールディングス	1,600	551.00	881,600
日伝	1,400	1,641.00	2,297,400
北沢産業	1,900	284.00	539,600
杉本商事	800	1,888.00	1,510,400
因幡電機産業	2,400	4,270.00	10,248,000
東テク	500	2,159.00	1,079,500
ミスミグループ本社	21,500	2,644.00	56,846,000
アルテック	1,600	219.00	350,400
タキヒヨー	600	1,783.00	1,069,800
蔵王産業	200	1,305.00	261,000
スズケン	7,800	6,410.00	49,998,000
ジェコス	1,100	954.00	1,049,400
ルネサスイーストン	1,800	402.00	723,600
ローソン	4,300	5,160.00	22,188,000
サンエー	1,300	4,375.00	5,687,500

カワチ薬品	1,400	1,895.00	2,653,000
エービーシー・マート	2,700	6,780.00	18,306,000
ハードオフコーポレーション	600	748.00	448,800
アスクル	1,800	2,835.00	5,103,000
ゲオホールディングス	2,600	1,480.00	3,848,000
アダストリア	2,400	2,771.00	6,650,400
ジーフット	1,100	643.00	707,300
くら寿司	1,000	4,645.00	4,645,000
キャンドウ	900	1,728.00	1,555,200
パルグループホールディングス	900	3,500.00	3,150,000
エディオン	7,300	924.00	6,745,200
サーラコーポレーション	3,500	596.00	2,086,000
ワッツ	700	669.00	468,300
ハローズ	600	2,219.00	1,331,400
フジオフードシステム	700	2,911.00	2,037,700
あみやき亭	400	3,420.00	1,368,000
ひらまつ	3,600	348.00	1,252,800
大黒天物産	400	3,770.00	1,508,000
ハニーズホールディングス	1,500	1,008.00	1,512,000
ファーマライズホールディングス	600	568.00	340,800
アルペン	1,400	1,698.00	2,377,200
ハブ	600	1,254.00	752,400
クオールホールディングス	2,500	1,690.00	4,225,000
ジーンズ	1,200	6,090.00	7,308,000
ビックカメラ	9,200	1,159.00	10,662,800
D C Mホールディングス	9,300	1,092.00	10,155,600
ペッパーフードサービス	1,300	2,168.00	2,818,400
MonotaRO	10,800	2,392.00	25,833,600
東京一番フーズ	400	604.00	241,600
DDホールディングス	400	1,975.00	790,000
きちりホールディングス	500	751.00	375,500
アークランドサービスホールディングス	1,300	2,072.00	2,693,600
J.フロント リテイリング	21,900	1,294.00	28,338,600
ドトール・日レスホールディングス	3,000	2,098.00	6,294,000
マツモトキヨシホールディングス	7,100	3,540.00	25,134,000
ブロンコビリー	900	2,300.00	2,070,000
ZOZO	18,500	2,273.00	42,050,500
トレジャー・ファクトリー	500	725.00	362,500

物語コーポレーション	400	8,620.00	3,448,000
ココカラファイン	1,900	4,955.00	9,414,500
三越伊勢丹ホールディングス	32,200	1,010.00	32,522,000
H a m e e	500	789.00	394,500
ウエルシアホールディングス	4,500	4,335.00	19,507,500
クリエイトSDホールディングス	2,500	2,534.00	6,335,000
丸善CHIホールディングス	2,200	372.00	818,400
ミサワ	500	403.00	201,500
ティーライフ	200	875.00	175,000
エー・ピーカンパニー	500	459.00	229,500
チムニー	500	2,645.00	1,322,500
シュッピン	1,200	859.00	1,030,800
ネクステージ	2,700	1,190.00	3,213,000
ジョイフル本田	5,000	1,245.00	6,225,000
鳥貴族	600	1,826.00	1,095,600
キリン堂ホールディングス	700	1,690.00	1,183,000
ホットランド	900	1,520.00	1,368,000
すかいらーくホールディングス	16,000	1,828.00	29,248,000
SFPホールディングス	700	1,806.00	1,264,200
綿半ホールディングス	600	2,269.00	1,361,400
ヨシックス	300	2,989.00	896,700
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	5,100	990.00	5,049,000
ゴルフダイジェスト・オンライン	700	643.00	450,100
B E E N O S	400	1,640.00	656,000
あさひ	1,500	1,344.00	2,016,000
日本調剤	600	3,780.00	2,268,000
コスモス薬品	800	17,630.00	14,104,000
トーエル	800	712.00	569,600
オンリー	200	838.00	167,600
セブン&アイ・ホールディングス	71,800	3,750.00	269,250,000
薬王堂	700	2,684.00	1,878,800
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	4,600	1,343.00	6,177,800
ツルハホールディングス	3,700	9,170.00	33,929,000
サンマルクホールディングス	1,400	2,464.00	3,449,600
フェリシモ	400	970.00	388,000
トリドールホールディングス	2,100	2,480.00	5,208,000
T O K Y O B A S E	1,500	989.00	1,483,500

ウイルプラスホールディングス	200	915.00	183,000
ジャパンミート	700	1,668.00	1,167,600
サツドラホールディングス	300	1,960.00	588,000
デファクトスタンダード	200	384.00	76,800
アレンザホールディングス	900	821.00	738,900
パロックジャパンリミテッド	1,400	905.00	1,267,000
クスリのアオキホールディングス	1,700	7,630.00	12,971,000
力の源ホールディングス	500	760.00	380,000
スシローグローバルホールディングス	1,900	7,440.00	14,136,000
LIXILピバ	1,500	1,271.00	1,906,500
メディカルシステムネットワーク	1,900	513.00	974,700
はるやまホールディングス	800	817.00	653,600
ノジマ	3,000	1,846.00	5,538,000
カッパ・クリエイト	2,500	1,409.00	3,522,500
ライトオン	1,500	765.00	1,147,500
ジーンズメイト	600	375.00	225,000
良品計画	2,400	20,560.00	49,344,000
三城ホールディングス	2,200	383.00	842,600
アドヴァン	2,600	1,001.00	2,602,600
アルビス	600	2,196.00	1,317,600
コナカ	2,200	438.00	963,600
ハウス オブ ローゼ	200	1,707.00	341,400
G - 7ホールディングス	500	2,535.00	1,267,500
イオン北海道	1,800	732.00	1,317,600
コジマ	2,600	542.00	1,409,200
ヒマラヤ	600	842.00	505,200
コーナン商事	2,200	2,422.00	5,328,400
エコス	600	1,420.00	852,000
マルシェ	700	766.00	536,200
パン・パシフィック・インターナショナル ホールディングス	10,300	7,100.00	73,130,000
西松屋チェーン	3,800	856.00	3,252,800
ゼンショーホールディングス	8,100	2,527.00	20,468,700
幸楽苑ホールディングス	1,100	3,215.00	3,536,500
ハークスレイ	300	1,046.00	313,800
サイゼリヤ	2,900	2,482.00	7,197,800
V Tホールディングス	5,900	451.00	2,660,900
魚力	500	1,475.00	737,500
フジ・コーポレーション	300	2,171.00	651,300

ユニテッドアローズ	2,000	3,455.00	6,910,000
ハイデイ日高	2,500	2,004.00	5,010,000
京都きもの友禅	1,600	390.00	624,000
コロワイド	5,700	2,244.00	12,790,800
ピーシーデポコーポレーション	2,400	401.00	962,400
壱番屋	1,200	4,595.00	5,514,000
P L A N T	400	865.00	346,000
スギホールディングス	3,800	5,400.00	20,520,000
スクロール	2,700	387.00	1,044,900
ヨンドシーホールディングス	1,900	2,368.00	4,499,200
ユニー・ファミリーマートホールディングス	19,200	2,802.00	53,798,400
木曽路	2,100	2,599.00	5,457,900
S R Sホールディングス	2,200	1,010.00	2,222,000
千趣会	4,700	237.00	1,113,900
タカキュー	2,200	183.00	402,600
ケーヨー	3,400	485.00	1,649,000
上新電機	2,000	2,362.00	4,724,000
日本瓦斯	2,800	2,746.00	7,688,800
ロイヤルホールディングス	3,000	2,694.00	8,082,000
東天紅	200	1,238.00	247,600
いなげや	2,000	1,305.00	2,610,000
島忠	3,900	2,626.00	10,241,400
チヨダ	1,800	1,698.00	3,056,400
ライフコーポレーション	1,300	2,139.00	2,780,700
リンガーハット	2,100	2,336.00	4,905,600
M r M a x H D	2,300	477.00	1,097,100
テンアライド	2,000	413.00	826,000
A O K Iホールディングス	3,400	1,107.00	3,763,800
オークワ	2,500	1,093.00	2,732,500
コメリ	2,700	2,230.00	6,021,000
青山商事	3,000	2,296.00	6,888,000
しまむら	2,000	8,140.00	16,280,000
はせがわ	1,000	386.00	386,000
高島屋	13,700	1,205.00	16,508,500
松屋	3,500	931.00	3,258,500
エイチ・ツー・オー リテイリング	8,900	1,344.00	11,961,600
近鉄百貨店	700	3,205.00	2,243,500
パルコ	1,700	1,050.00	1,785,000

丸井グループ	14,500	2,167.00	31,421,500
アクシアル リテイリング	1,400	3,115.00	4,361,000
イオン	66,000	2,009.50	132,627,000
イズミ	3,500	4,930.00	17,255,000
平和堂	3,500	2,015.00	7,052,500
フジ	2,100	1,803.00	3,786,300
ヤオコー	1,900	5,240.00	9,956,000
ゼビオホールディングス	2,200	1,131.00	2,488,200
ケーズホールディングス	17,900	961.00	17,201,900
Olympicグループ	1,200	723.00	867,600
日産東京販売ホールディングス	2,600	282.00	733,200
Genky DrugStores	900	2,593.00	2,333,700
総合メディカルホールディングス	1,500	1,954.00	2,931,000
ブックオフグループホールディングス	900	870.00	783,000
アインホールディングス	2,300	8,830.00	20,309,000
元気寿司	500	4,520.00	2,260,000
ヤマダ電機	52,400	520.00	27,248,000
アーランドサカモト	2,800	1,415.00	3,962,000
ニトリホールディングス	7,400	13,055.00	96,607,000
グルメ杵屋	1,200	1,167.00	1,400,400
愛眼	1,700	262.00	445,400
ケーユーホールディングス	800	870.00	696,000
吉野家ホールディングス	6,100	1,721.00	10,498,100
松屋フーズホールディングス	800	3,620.00	2,896,000
サガミホールディングス	2,300	1,315.00	3,024,500
関西スーパーマーケット	1,300	1,009.00	1,311,700
王将フードサービス	1,200	7,220.00	8,664,000
プレナス	2,000	1,801.00	3,602,000
ミニストップ	1,400	1,698.00	2,377,200
アークス	3,200	2,224.00	7,116,800
パローホールディングス	3,700	2,641.00	9,771,700
藤久	400	784.00	313,600
ベルク	800	4,855.00	3,884,000
大庄	1,000	1,564.00	1,564,000
ファーストリテイリング	2,300	64,150.00	147,545,000
サンドラッグ	6,500	2,875.00	18,687,500
サックスパー ホールディングス	1,500	1,082.00	1,623,000
ヤマザワ	400	1,619.00	647,600

やまや	300	2,157.00	647,100
ペルーナ	4,200	841.00	3,532,200
島根銀行	500	776.00	388,000
じもとホールディングス	11,700	100.00	1,170,000
めぶきフィナンシャルグループ	89,200	269.00	23,994,800
東京きらぼしフィナンシャルグループ	2,300	1,518.00	3,491,400
九州フィナンシャルグループ	28,300	434.00	12,282,200
ゆうちょ銀行	48,500	1,214.00	58,879,000
富山第一銀行	3,900	365.00	1,423,500
コンコルディア・フィナンシャルグループ	109,300	409.00	44,703,700
西日本フィナンシャルホールディングス	11,000	899.00	9,889,000
関西みらいフィナンシャルグループ	8,200	732.00	6,002,400
三十三フィナンシャルグループ	1,500	1,455.00	2,182,500
第四北越フィナンシャルグループ	3,000	3,085.00	9,255,000
新生銀行	12,700	1,528.00	19,405,600
あおぞら銀行	9,600	2,645.00	25,392,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,180,000	536.30	632,834,000
りそなホールディングス	188,200	459.90	86,553,180
三井住友トラスト・ホールディングス	33,700	3,799.00	128,026,300
三井住友フィナンシャルグループ	120,800	3,967.00	479,213,600
千葉銀行	61,100	554.00	33,849,400
群馬銀行	34,600	417.00	14,428,200
武蔵野銀行	2,500	2,057.00	5,142,500
千葉興業銀行	5,000	280.00	1,400,000
筑波銀行	7,800	191.00	1,489,800
七十七銀行	5,400	1,543.00	8,332,200
青森銀行	1,300	2,839.00	3,690,700
秋田銀行	1,000	2,111.00	2,111,000
山形銀行	2,000	1,759.00	3,518,000
岩手銀行	1,200	3,070.00	3,684,000
東邦銀行	15,600	274.00	4,274,400
東北銀行	800	1,043.00	834,400
みちのく銀行	1,200	1,580.00	1,896,000
ふくおかフィナンシャルグループ	15,100	2,514.00	37,961,400
静岡銀行	43,500	828.00	36,018,000
十六銀行	2,300	2,193.00	5,043,900
スルガ銀行	18,000	481.00	8,658,000
八十二銀行	31,500	450.00	14,175,000

山梨中央銀行	2,100	1,262.00	2,650,200
大垣共立銀行	2,700	2,395.00	6,466,500
福井銀行	1,400	1,570.00	2,198,000
北國銀行	1,800	3,350.00	6,030,000
清水銀行	700	1,694.00	1,185,800
富山銀行	300	3,010.00	903,000
滋賀銀行	3,500	2,571.00	8,998,500
南都銀行	2,000	2,030.00	4,060,000
百五銀行	15,400	343.00	5,282,200
京都銀行	6,200	4,510.00	27,962,000
紀陽銀行	6,100	1,463.00	8,924,300
ほくほくフィナンシャルグループ	11,400	1,164.00	13,269,600
広島銀行	25,400	571.00	14,503,400
山陰合同銀行	10,100	717.00	7,241,700
中国銀行	11,400	1,071.00	12,209,400
鳥取銀行	500	1,368.00	684,000
伊予銀行	23,000	597.00	13,731,000
百十四銀行	1,800	2,230.00	4,014,000
四国銀行	2,300	1,001.00	2,302,300
阿波銀行	2,800	2,690.00	7,532,000
大分銀行	1,000	3,330.00	3,330,000
宮崎銀行	1,100	2,596.00	2,855,600
佐賀銀行	900	1,681.00	1,512,900
沖縄銀行	1,600	3,275.00	5,240,000
琉球銀行	4,000	1,158.00	4,632,000
セブン銀行	58,300	304.00	17,723,200
みずほフィナンシャルグループ	2,330,400	170.40	397,100,160
高知銀行	600	757.00	454,200
山口フィナンシャルグループ	21,500	784.00	16,856,000
長野銀行	500	1,633.00	816,500
名古屋銀行	1,400	3,520.00	4,928,000
北洋銀行	26,000	268.00	6,968,000
愛知銀行	600	3,445.00	2,067,000
中京銀行	700	2,129.00	1,490,300
大光銀行	500	1,579.00	789,500
愛媛銀行	2,300	1,051.00	2,417,300
トマト銀行	500	1,056.00	528,000
京葉銀行	7,600	652.00	4,955,200

栃木銀行	9,300	216.00	2,008,800
北日本銀行	500	1,848.00	924,000
東和銀行	2,900	706.00	2,047,400
福島銀行	1,900	298.00	566,200
大東銀行	700	609.00	426,300
トモニホールディングス	13,300	392.00	5,213,600
フィデアホールディングス	16,700	128.00	2,137,600
池田泉州ホールディングス	18,400	271.00	4,986,400
F P G	5,400	959.00	5,178,600
マーキュリアインベストメント	700	682.00	477,400
S B Iホールディングス	20,400	2,502.00	51,040,800
ジャフコ	2,800	4,100.00	11,480,000
大和証券グループ本社	137,400	502.60	69,057,240
野村ホールディングス	302,900	395.10	119,675,790
岡三証券グループ	14,800	388.00	5,742,400
丸三証券	5,200	616.00	3,203,200
東洋証券	7,100	126.00	894,600
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	21,000	344.00	7,224,000
光世証券	600	685.00	411,000
水戸証券	5,300	210.00	1,113,000
いちよし証券	3,600	748.00	2,692,800
松井証券	8,500	1,011.00	8,593,500
だいこう証券ビジネス	800	447.00	357,600
マネックスグループ	16,300	324.00	5,281,200
カブドットコム証券	12,700	558.00	7,086,600
極東証券	2,300	1,001.00	2,302,300
岩井コスモホールディングス	1,700	1,192.00	2,026,400
藍澤證券	3,100	694.00	2,151,400
マネーパートナーズグループ	2,100	297.00	623,700
かんぽ生命保険	6,500	2,177.00	14,150,500
S O M P Oホールディングス	30,200	4,190.00	126,538,000
アニコムホールディングス	1,400	3,380.00	4,732,000
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	44,800	3,351.00	150,124,800
ソニーフィナンシャルホールディングス	14,200	2,284.00	32,432,800
第一生命ホールディングス	97,100	1,555.00	150,990,500
東京海上ホールディングス	62,100	5,524.00	343,040,400
T & Dホールディングス	53,200	1,187.50	63,175,000

アドバンスクリエイト	400	1,788.00	715,200
全国保証	4,800	3,690.00	17,712,000
ジェイリース	400	347.00	138,800
イントラスト	500	487.00	243,500
日本モーゲージサービス	200	1,157.00	231,400
C a s a	600	1,021.00	612,600
アルヒ	1,600	1,520.00	2,432,000
プレミアグループ	800	1,906.00	1,524,800
クレディセゾン	12,100	1,338.00	16,189,800
芙蓉総合リース	2,000	5,320.00	10,640,000
興銀リース	3,200	2,529.00	8,092,800
東京センチュリー	3,500	4,970.00	17,395,000
日本証券金融	7,600	559.00	4,248,400
アイフル	26,500	269.00	7,128,500
リコーリース	1,300	3,200.00	4,160,000
イオンフィナンシャルサービス	11,000	2,220.00	24,420,000
アコム	34,700	383.00	13,290,100
ジャックス	1,900	1,750.00	3,325,000
オリエントコーポレーション	47,100	114.00	5,369,400
日立キャピタル	4,000	2,571.00	10,284,000
アプラスフィナンシャル	9,100	85.00	773,500
オリックス	114,300	1,574.00	179,908,200
三菱UFJリース	38,700	533.00	20,627,100
九州リースサービス	800	674.00	539,200
日本取引所グループ	46,300	1,768.00	81,858,400
イー・ギャランティ	1,600	1,155.00	1,848,000
アサックス	700	539.00	377,300
NECキャピタルソリューション	700	1,761.00	1,232,700
いちご	21,900	333.00	7,292,700
日本駐車場開発	20,900	172.00	3,594,800
ヒューリック	35,800	960.00	34,368,000
三栄建築設計	700	1,546.00	1,082,200
スター・マイカ	800	1,335.00	1,068,000
野村不動産ホールディングス	11,400	2,343.00	26,710,200
三重交通グループホールディングス	3,500	586.00	2,051,000
サムティ	2,400	1,453.00	3,487,200
ディア・ライフ	2,100	418.00	877,800
コーセーアールイー	500	733.00	366,500

日本商業開発	1,100	1,474.00	1,621,400
プレサンスコーポレーション	2,700	1,347.00	3,636,900
ユニゾホールディングス	2,600	1,836.00	4,773,600
THEグローバル社	900	553.00	497,700
日本管理センター	1,100	925.00	1,017,500
サンセイランディック	500	745.00	372,500
エストラスト	200	705.00	141,000
フージャースホールディングス	3,700	649.00	2,401,300
オープンハウス	2,800	3,910.00	10,948,000
東急不動産ホールディングス	46,500	598.00	27,807,000
飯田グループホールディングス	14,300	1,828.00	26,140,400
イーグランド	300	658.00	197,400
ムゲンエステート	1,200	578.00	693,600
ビーロッド	300	1,684.00	505,200
ファーストブラザーズ	500	1,124.00	562,000
ハウズドゥ	900	1,344.00	1,209,600
シーアールイー	600	971.00	582,600
プロパティエージェント	200	1,132.00	226,400
ケイアイスター不動産	400	1,631.00	652,400
アグレ都市デザイン	200	515.00	103,000
グッドコムアセット	300	1,476.00	442,800
ジェイ・エス・ビー	100	3,640.00	364,000
テンポイノベーション	100	1,612.00	161,200
グローバル・リンク・マネジメント	200	696.00	139,200
パーク24	10,100	2,215.00	22,371,500
パラカ	400	1,951.00	780,400
三井不動産	91,200	2,542.50	231,876,000
三菱地所	120,500	1,853.50	223,346,750
平和不動産	3,300	2,132.00	7,035,600
東京建物	18,900	1,171.00	22,131,900
ダイビル	5,100	986.00	5,028,600
京阪神ビルディング	3,000	1,010.00	3,030,000
住友不動産	38,600	4,047.00	156,214,200
テーオーシー	4,000	676.00	2,704,000
東京楽天地	300	4,980.00	1,494,000
スターツコーポレーション	2,300	2,425.00	5,577,500
フジ住宅	2,200	822.00	1,808,400
空港施設	2,000	536.00	1,072,000

明和地所	900	544.00	489,600
ゴールドクレスト	1,400	1,406.00	1,968,400
日本エスリード	600	1,491.00	894,600
日神不動産	2,400	438.00	1,051,200
日本エスコン	3,100	782.00	2,424,200
タカラレーベン	8,100	339.00	2,745,900
サンヨーハウジング名古屋	900	925.00	832,500
イオンモール	8,700	1,691.00	14,711,700
毎日コムネット	300	773.00	231,900
ファースト住建	600	1,164.00	698,400
カチタス	1,900	3,590.00	6,821,000
トーセイ	2,300	882.00	2,028,600
穴吹興産	200	2,931.00	586,200
サンフロンティア不動産	2,400	1,106.00	2,654,400
エフ・ジェー・ネクスト	1,400	888.00	1,243,200
インテリックス	500	731.00	365,500
グランディハウス	1,400	468.00	655,200
日本空港ビルデング	5,500	4,635.00	25,492,500
日本工営	1,100	2,455.00	2,700,500
L I F U L L	6,500	592.00	3,848,000
ジェイエイシーリクルートメント	1,300	2,734.00	3,554,200
日本M&Aセンター	12,400	2,850.00	35,340,000
メンバーズ	600	1,724.00	1,034,400
中広	200	554.00	110,800
タケエイ	1,800	784.00	1,411,200
E・Jホールディングス	200	1,198.00	239,600
トラスト・テック	900	3,810.00	3,429,000
コシダカホールディングス	4,500	1,545.00	6,952,500
アルトナー	300	843.00	252,900
パソナグループ	2,100	1,747.00	3,668,700
C D S	400	1,292.00	516,800
リンクアンドモチベーション	3,100	808.00	2,504,800
G C A	1,700	806.00	1,370,200
エス・エム・エス	6,100	2,510.00	15,311,000
サニーサイドアップ	200	2,097.00	419,400
パーソルホールディングス	16,700	2,049.00	34,218,300
リニカル	900	1,236.00	1,112,400
クックパッド	5,500	270.00	1,485,000

エスクリ	500	633.00	316,500
アイ・ケイ・ケイ	900	707.00	636,300
学情	700	1,151.00	805,700
スタジオアリス	800	2,093.00	1,674,400
シミックホールディングス	1,000	1,916.00	1,916,000
N J S	300	1,481.00	444,300
総合警備保障	6,600	4,890.00	32,274,000
カカクコム	12,500	2,300.00	28,750,000
アイロムグループ	600	1,841.00	1,104,600
セントケア・ホールディング	1,000	493.00	493,000
サイネックス	300	670.00	201,000
ルネサンス	900	2,079.00	1,871,100
ディップ	2,700	1,631.00	4,403,700
オプトホールディング	1,000	1,818.00	1,818,000
ツクイ	4,000	673.00	2,692,000
キャリアデザインセンター	400	1,556.00	622,400
ベネフィット・ワン	4,600	2,343.00	10,777,800
エムスリー	35,000	2,017.00	70,595,000
ツカダ・グローバルホールディング	1,100	598.00	657,800
プラス	200	629.00	125,800
アウトソーシング	8,800	1,416.00	12,460,800
ウェルネット	1,600	1,005.00	1,608,000
ワールドホールディングス	500	1,893.00	946,500
ディー・エヌ・エー	9,000	1,736.00	15,624,000
博報堂DYホールディングス	23,100	1,781.00	41,141,100
ぐるなび	2,500	604.00	1,510,000
タカミヤ	1,800	673.00	1,211,400
ジャパンベストレスキューシステム	1,300	1,675.00	2,177,500
ファンコミュニケーションズ	4,700	663.00	3,116,100
ライク	700	1,290.00	903,000
ビジネス・ブレークスルー	700	365.00	255,500
W D Bホールディングス	800	3,335.00	2,668,000
ティア	900	678.00	610,200
C D G	200	1,309.00	261,800
パリュウコマース	1,100	2,731.00	3,004,100
インフォマート	9,100	1,591.00	14,478,100
J Pホールディングス	5,000	282.00	1,410,000
E P Sホールディングス	2,500	2,001.00	5,002,500

レッグス	400	1,284.00	513,600
プレステージ・インターナショナル	3,100	1,564.00	4,848,400
アミューズ	1,000	2,527.00	2,527,000
ドリームインキュベータ	500	1,540.00	770,000
クイック	1,000	1,715.00	1,715,000
T A C	1,200	225.00	270,000
ケネディクス	14,700	527.00	7,746,900
電通	20,300	4,485.00	91,045,500
テイクアンドギヴ・ニーズ	700	1,417.00	991,900
ぴあ	500	4,690.00	2,345,000
イオンファンタジー	500	2,462.00	1,231,000
シーティーエス	1,900	672.00	1,276,800
ネクシィーズグループ	500	2,433.00	1,216,500
みらかホールディングス	4,700	2,760.00	12,972,000
アルプス技研	1,400	1,867.00	2,613,800
ダイオーズ	400	1,395.00	558,000
日本空調サービス	1,700	683.00	1,161,100
オリエンタルランド	19,600	12,325.00	241,570,000
ダスキン	4,500	2,726.00	12,267,000
明光ネットワークジャパン	2,200	1,045.00	2,299,000
ファルコホールディングス	900	1,354.00	1,218,600
田谷	800	603.00	482,400
ラウンドワン	5,200	1,444.00	7,508,800
リゾートトラスト	7,100	1,496.00	10,621,600
ビー・エム・エル	2,200	3,160.00	6,952,000
ワタベウェディング	400	660.00	264,000
りらいあコミュニケーションズ	3,100	1,147.00	3,555,700
リソー教育	8,400	431.00	3,620,400
早稲田アカデミー	500	718.00	359,000
ユー・エス・エス	20,300	2,052.00	41,655,600
東京個別指導学院	600	995.00	597,000
サイバーエージェント	10,300	4,630.00	47,689,000
楽天	77,600	1,201.00	93,197,600
クリーク・アンド・リバー社	1,000	1,258.00	1,258,000
テー・オー・ダブリュー	1,400	705.00	987,000
山田コンサルティンググループ	800	2,432.00	1,945,600
セントラルスポーツ	600	3,105.00	1,863,000
フルキャストホールディングス	1,700	2,401.00	4,081,700

エン・ジャパン	1,800	3,405.00	6,129,000
リソルホールディングス	200	4,040.00	808,000
テクノプロ・ホールディングス	3,300	6,280.00	20,724,000
アトラ	400	382.00	152,800
インターワークス	300	675.00	202,500
アイ・アールジャパンホールディングス	500	1,910.00	955,000
KeepPer 技研	600	1,326.00	795,600
ファーストロジック	400	581.00	232,400
三機サービス	300	1,279.00	383,700
Gunosy	1,200	1,639.00	1,966,800
デザインワン・ジャパン	400	329.00	131,600
イー・ガーディアン	800	2,143.00	1,714,400
リブセンス	1,100	275.00	302,500
ジャパンマテリアル	4,500	1,557.00	7,006,500
ベクトル	2,100	1,251.00	2,627,100
ウチヤマホールディングス	1,000	516.00	516,000
チャーム・ケア・コーポレーション	400	1,617.00	646,800
ライクキッズネクスト	400	826.00	330,400
キャリアリンク	700	433.00	303,100
I B J	1,100	916.00	1,007,600
アサンテ	600	2,165.00	1,299,000
N・フィールド	1,100	715.00	786,500
バリューHR	400	2,472.00	988,800
M&Aキャピタルパートナーズ	400	5,520.00	2,208,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	700	1,175.00	822,500
ERIホールディングス	600	926.00	555,600
アビスト	200	3,090.00	618,000
シグマクシス	800	1,234.00	987,200
ウィルグループ	1,100	1,130.00	1,243,000
エスクロー・エージェント・ジャパン	2,300	290.00	667,000
日本ビューホテル	600	1,145.00	687,000
リクルートホールディングス	119,100	3,327.00	396,245,700
エラン	1,200	1,676.00	2,011,200
土木管理総合試験所	700	450.00	315,000
日本郵政	136,100	1,233.00	167,811,300
ベルシステム24ホールディングス	2,800	1,551.00	4,342,800
鎌倉新書	1,200	1,465.00	1,758,000
一蔵	300	533.00	159,900

LITALICO	400	1,789.00	715,600
グローバルキッズCOMPANY	200	1,034.00	206,800
エボラブルアジア	500	2,031.00	1,015,500
アトラエ	300	3,375.00	1,012,500
ストライク	400	2,014.00	805,600
ソラスト	4,100	1,151.00	4,719,100
セラク	400	643.00	257,200
インソース	500	2,612.00	1,306,000
ベイカレント・コンサルティング	900	3,945.00	3,550,500
Orchestra Holdings	200	918.00	183,600
アイモバイル	400	843.00	337,200
キャリアインデックス	600	851.00	510,600
MS-Japan	700	1,728.00	1,209,600
船場	300	1,002.00	300,600
グレイステクノロジー	500	1,915.00	957,500
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	1,000	2,208.00	2,208,000
フルテック	200	1,115.00	223,000
グリーンズ	500	1,522.00	761,000
ツナググループ・ホールディングス	200	624.00	124,800
MS&Consulting	300	1,030.00	309,000
日総工産	800	1,277.00	1,021,600
キュービーネットホールディングス	800	2,531.00	2,024,800
スプリックス	500	2,528.00	1,264,000
アドバンテッジリスクマネジメント	700	922.00	645,400
リログループ	9,100	2,968.00	27,008,800
東祥	1,000	2,933.00	2,933,000
エイチ・アイ・エス	3,000	3,555.00	10,665,000
ラックランド	300	2,160.00	648,000
共立メンテナンス	2,600	5,680.00	14,768,000
イチネンホールディングス	1,700	1,177.00	2,000,900
建設技術研究所	1,100	1,469.00	1,615,900
スペース	1,000	1,257.00	1,257,000
長大	700	758.00	530,600
燦ホールディングス	300	2,450.00	735,000
スバル興業	100	5,760.00	576,000
東京テアトル	700	1,306.00	914,200
タナベ経営	300	1,202.00	360,600
ナガワ	500	6,090.00	3,045,000

	よみうりランド	400	4,335.00	1,734,000	
	東京都競馬	1,100	3,355.00	3,690,500	
	常磐興産	700	1,639.00	1,147,300	
	カナモト	2,500	2,487.00	6,217,500	
	東京ドーム	6,400	1,078.00	6,899,200	
	西尾レントオール	1,700	2,911.00	4,948,700	
	トランス・コスモス	1,900	2,551.00	4,846,900	
	乃村工藝社	3,900	3,060.00	11,934,000	
	藤田観光	700	2,711.00	1,897,700	
	KNT - CTホールディングス	1,000	1,368.00	1,368,000	
	日本管財	1,700	1,964.00	3,338,800	
	トーカイ	1,600	2,470.00	3,952,000	
	白洋舎	200	2,970.00	594,000	
	セコム	17,600	9,225.00	162,360,000	
	セントラル警備保障	800	5,320.00	4,256,000	
	丹青社	3,100	1,215.00	3,766,500	
	メイテック	2,100	5,140.00	10,794,000	
	応用地質	1,800	1,163.00	2,093,400	
	船井総研ホールディングス	3,400	2,817.00	9,577,800	
	進学会ホールディングス	700	572.00	400,400	
	オオバ	1,300	688.00	894,400	
	いであ	300	1,321.00	396,300	
	学究社	500	1,258.00	629,000	
	ベネッセホールディングス	6,200	2,948.00	18,277,600	
	イオンディライト	2,100	3,695.00	7,759,500	
	ナック	1,200	971.00	1,165,200	
	ニチイ学館	2,400	1,342.00	3,220,800	
	ダイセキ	2,800	2,844.00	7,963,200	
	ステップ	500	1,467.00	733,500	
小計	銘柄数：2,074	20,195,200		39,228,101,520	
	組入時価比率：97.7%			100.0%	
合計		20,195,200		39,228,101,520	

（注1）比率は左より組入時価の純資産総額に対する比率、及び各小計欄の合計金額に対する比率であります。

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。

MHAM外国株式インデックスマザーファンド

なお、以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

(単位：円)

(令和1年5月8日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	1,101,436,438
コール・ローン	29,077,926
株式	26,539,596,011
投資信託受益証券	3,754,336
投資証券	704,303,564
派生商品評価勘定	33,949,990
未収入金	3,028,124
未収配当金	38,874,661
未収利息	15
差入委託証拠金	239,576,258
流動資産合計	28,693,597,323
資産合計	28,693,597,323
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,387,515
未払解約金	1,219,100
流動負債合計	2,606,615
負債合計	2,606,615
純資産の部	
元本等	
元本	15,015,808,427
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金()	13,675,182,281
元本等合計	28,690,990,708
純資産合計	28,690,990,708

負債純資産合計

28,693,597,323

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	(自 平成30年 5月 9日 至 令和 1年 5月 8日)
1 有価証券の評価基準及び評価方法	株式、投資信託受益証券、投資証券 原則として時価で評価しております。
2 派生商品等の評価基準及び評価方法	先物取引、為替予約取引 原則として時価で評価しております。
3 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算し、為替予約の評価は計算期間末日に残高がある場合、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
4 収益・費用の計上基準	受取配当金 受取配当金は、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。 有価証券売買等損益、派生商品取引等損益及び為替差損益 約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	(令和 1年 5月 8日現在)
1 計算期間末日における受益権の総数	15,015,808,427口
2 計算期間末日における1単位当たりの純資産の額	1口当たり純資産の額 1.9107円 (1万口当たり純資産の額) (19,107円)

（金融商品に関する注記）

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	(自 平成30年 5月 9日 至 令和 1年 5月 8日)
1 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める投資を目的とする証券投資信託であり、証券投資信託約款および投資ガイドラインに基づいて運用しております。

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。</p> <p>なお、詳細は附属明細表をご参照下さい。</p> <p>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>
3 金融商品に係るリスク管理体制	<p>当ファンドは信託財産に属する資産の効率的な運用に資することを目的として、株価指数先物取引を行っており、当該デリバティブ取引は対象とする株価指数等に係る価格変動リスクを有しております。</p> <p>また、外貨建証券の売買等の決済に伴い必要となる外貨の売買のために、為替予約取引を行っております。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>なお、具体的には以下のリスクの管理を行っております。</p>
4 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>市場リスクの管理</p> <p>市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。</p> <p>信用リスクの管理</p> <p>信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。</p> <p>流動性リスクの管理</p> <p>流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には、合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。</p>

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	(令和 1年 5月 8日現在)
1 貸借対照表日における貸借対照表の科目ごとの計上額・時価・時価との差額	貸借対照表に計上している金融商品は、原則として時価評価としているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2 貸借対照表の科目ごとの時価の算定方法	<p>(1) 有価証券</p> <p>株式、投資信託受益証券、投資証券</p> <p>わが国の金融商品取引所または海外取引所に上場されている有価証券 当該有価証券については、原則として上記の取引所における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）で評価しております。</p> <p>時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できない場合または入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認められた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認められた価額で評価しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引</p>

	先物取引、為替予約取引 デリバティブ取引等に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 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、時価は帳簿価額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。
--	--

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

（自 平成30年 5月 9日 至 令和 1年 5月 8日）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	1,168,553,319
投資信託受益証券	531,450
投資証券	62,533,146
合計	1,231,617,915

（デリバティブ取引等に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（株式関連）

（令和 1年 5月 8日現在）

区分	種類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	1,392,849,482	-	1,425,472,357	32,622,875
合計		1,392,849,482	-	1,425,472,357	32,622,875

（注）時価の算定方法

株価指数先物取引の時価の算定方法については、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により評価しております。

（通貨関連）

（令和 1年 5月 8日現在）

区分	種類	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	19,719,444	-	19,651,500	67,944
	米・ドル	17,582,820	-	17,518,320	64,500
	カナダ・ドル	411,680	-	408,850	2,830

	英・ポンド	719,905	-	719,950	45
	オーストラリア・ドル	1,005,039	-	1,004,380	659
	売建	10,219,794	-	10,212,250	7,544
	カナダ・ドル	81,774	-	81,770	4
	ユーロ	9,992,929	-	9,986,490	6,439
	英・ポンド	145,091	-	143,990	1,101
	合計	29,939,238	-	29,863,750	60,400

（注）時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

（その他の注記）

項目	期別 (令和 1年 5月 8日現在)
期首	平成30年 5月 9日
親投資信託の期首における元本額	13,855,813,168円
期中追加設定元本額	7,925,650,641円
期中一部解約元本額	6,765,655,382円
期末元本額及びその内訳として当該親投資信託受益証券を投資対象とする委託者指図型投資信託ごとの元本額	
期末元本額	15,015,808,427円
動的パッケージファンド<DC年金>	7,990,649円
コア資産形成ファンド	7,884,983円
MHAM外国株式インデックスファンド(ファンドラップ)	10,028,954,741円
MHAM外国株式インデックスファンド	305,064,007円
MHAM外国株式インデックスファンド<為替ヘッジあり>(ファンドラップ)	53,704,489円
MHAM動的パッケージファンド[適格機関投資家限定]	1,591,728,064円
MHAM外国株式パッシブファンド[適格機関投資家限定]	3,020,481,494円

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

(令和 1年 5月 8日現在)

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	

米・ドル	ANADARKO PETROLEUM CORP	3,440	75.82	260,820.80
	APACHE CORPORATION	2,787	30.51	85,031.37
	BAKER HUGHES A GE CO	2,950	23.21	68,469.50
	CABOT OIL & GAS CORP	2,582	25.50	65,841.00
	CHENIERE ENERGY INC	1,509	65.24	98,447.16
	CHEVRON CORP	12,728	118.27	1,505,340.56
	CIMAREX ENERGY CO	556	66.02	36,707.12
	CONCHO RESOURCES INC	1,350	106.20	143,370.00
	CONOCOPHILLIPS	7,756	61.00	473,116.00
	CONTINENTAL RESOURCES INC	578	41.74	24,125.72
	DEVON ENERGY CORPORATION	3,189	31.05	99,018.45
	DIAMONDBACK ENERGY INC	1,084	98.23	106,481.32
	EOG RESOURCES INC	3,904	91.78	358,309.12
	EXXON MOBIL CORPORATION	28,132	76.72	2,158,287.04
	HALLIBURTON CO	6,196	26.94	166,920.24
	HELMERICH & PAYNE	630	57.13	35,991.90
	HESS CORP	1,940	62.30	120,862.00
	HOLLY FRONTIER CORP	984	45.47	44,742.48
	KINDER MORGAN INC	13,257	19.56	259,306.92
	MARATHON OIL CORP	6,143	15.51	95,277.93
	MARATHON PETROLEUM CORP	4,674	59.43	277,775.82
	NATIONAL OILWELL VARCO INC	2,826	25.35	71,639.10
	NOBLE ENERGY INC	2,825	24.28	68,591.00
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	5,164	59.69	308,239.16
	ONEOK INC	2,800	66.33	185,724.00
	PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	1,537	19.55	30,048.35
PHILLIPS 66	2,998	86.55	259,476.90	
PIONEER NATURAL RESOURCES COMPANY	1,159	147.97	171,497.23	
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	943	23.79	22,433.97	
SCHLUMBERGER LTD	9,411	40.60	382,086.60	
TARGA RESOURCES CORP	1,322	40.80	53,937.60	

TECHNIPFMC PLC	2,524	22.81	57,572.44
VALERO ENERGY CORP	2,873	84.36	242,366.28
WILLIAMS COS INC	8,167	27.52	224,755.84
AIR PRODUCTS & CHEMICAL INC	1,477	201.17	297,128.09
ALBEMARLE CORP	639	75.85	48,468.15
AVERY DENNISON CORP	513	106.83	54,803.79
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	1,274	26.04	33,174.96
BALL CORP	2,296	61.97	142,283.12
CELANESE CORP-SERIES A	987	105.90	104,523.30
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	1,376	41.52	57,131.52
CHEMOURS CO/THE	1,096	29.09	31,882.64
CROWN HOLDINGS	795	59.49	47,294.55
DOW INC	5,125	52.95	271,368.75
DOWDUPONT INC	15,376	32.14	494,184.64
EASTMAN CHEMICAL CO	1,087	76.46	83,112.02
ECOLAB INC	1,713	179.61	307,671.93
FMC CORP	985	78.51	77,332.35
FREEMONT-MCMORAN INC	9,642	11.44	110,304.48
INTERNATIONAL FLAV&F	501	135.00	67,635.00
INTERNATIONAL PAPER CO	2,710	46.02	124,714.20
LINDE PLC	3,663	174.57	639,449.91
LYONDELLBASELL INDU-CL A	2,217	83.25	184,565.25
MARTIN MARIETTA MATERIALS	370	220.24	81,488.80
MOSAIC CO/THE	2,158	23.25	50,173.50
NEWMONT GOLDCORP	3,251	30.72	99,870.72
NUCOR CORPORATION	2,242	56.18	125,955.56
PACKAGING CORP OF AMERICA	555	99.08	54,989.40
PPG INDUSTRIES INC	1,638	114.46	187,485.48
SEALED AIR CORP	933	43.93	40,986.69
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	572	446.98	255,672.56
STEEL DYNAMICS INC	1,385	32.19	44,583.15

VULCAN MATERIALS CO	947	129.78	122,901.66
WESTLAKE CHEMICAL CORP	236	60.61	14,303.96
WESTROCK CO	1,904	38.30	72,923.20
3M CO	3,904	179.12	699,284.48
ACUITY BRANDS INC	237	143.80	34,080.60
AERCAP HOLDINGS NV	738	50.26	37,091.88
ALLEGION PLC	558	99.36	55,442.88
AMETEK INC	1,678	85.46	143,401.88
ARCONIC INC	2,563	22.29	57,129.27
BOEING CO	3,577	357.23	1,277,811.71
CATERPILLAR INC	3,984	133.67	532,541.28
CUMMINS INC	1,069	165.61	177,037.09
DEERE & COMPANY	2,057	157.76	324,512.32
DOVER CORP	1,075	97.24	104,533.00
EATON CORP PLC	2,964	81.03	240,172.92
EMERSON ELECTRIC CO	4,262	67.53	287,812.86
FASTENAL CO	1,991	66.50	132,401.50
FLOWSERVE CORP	811	49.63	40,249.93
FLUOR CORP	872	29.53	25,750.16
FORTIVE CORP	2,092	83.48	174,640.16
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	839	54.43	45,666.77
GENERAL DYNAMICS CORP	1,665	170.48	283,849.20
GENERAL ELECTRIC CO	58,137	10.11	587,765.07
HARRIS CORP	799	176.69	141,175.31
HD SUPPLY HOLDINGS INC	1,026	45.78	46,970.28
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	4,915	169.85	834,812.75
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES	255	208.55	53,180.25
IDEX CORP	581	153.72	89,311.32
ILLINOIS TOOL WORKS	2,039	151.64	309,193.96
INGERSOLL-RAND PLC	1,663	122.00	202,886.00
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	751	78.23	58,750.73

JARDINE MATHESON HLDGS LTD	1,628	64.88	105,624.64
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	1,661	38.00	63,118.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL	6,195	39.25	243,153.75
L3 TECHNOLOGIES INC	548	228.62	125,283.76
LENNOX INTERNATIONAL INC	213	265.75	56,604.75
LOCKHEED MARTIN CORP	1,709	330.90	565,508.10
MASCO CORP	2,349	38.89	91,352.61
MIDDLEBY CORP	328	136.83	44,880.24
NORTHROP GRUMMAN CORP	1,091	288.38	314,622.58
OWENS CORNING	653	51.68	33,747.04
PACCAR INC	2,437	68.85	167,787.45
PARKER HANNIFIN CORP	930	173.38	161,243.40
PENTAIR PLC	978	37.90	37,066.20
RAYTHEON COMPANY	1,877	178.47	334,988.19
ROCKWELL AUTOMATION INC	859	173.00	148,607.00
ROPER TECHNOLOGIES INC	704	352.97	248,490.88
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	999	49.45	49,400.55
SMITH (A.O.)CORP	851	51.39	43,732.89
SNAP-ON INC	331	168.57	55,796.67
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	627	84.53	53,000.31
STANLEY BLACK & DECKER INC	1,069	143.63	153,540.47
TEXTRON INC	1,775	51.76	91,874.00
TRANSDIGM GROUP INC	330	469.05	154,786.50
UNITED RENTALS INC	488	134.27	65,523.76
UNITED TECHNOLOGIES CORP	5,444	135.44	737,335.36
WABCO HOLDINGS INC	311	132.95	41,347.45
WABTEC CORPORATION	823	72.92	60,013.16
WW GRAINGER INC	281	276.46	77,685.26
XYLEM INC	1,296	79.17	102,604.32
CINTAS CORP	650	218.85	142,252.50
COPART INC	1,231	66.00	81,246.00

COSTAR GROUP INC	268	495.31	132,743.08
EQUIFAX INC	709	121.23	85,952.07
IHS MARKIT LTD	2,758	56.08	154,668.64
MANPOWERGROUP INC	381	93.30	35,547.30
NIELSEN HOLDINGS PLC	2,090	24.16	50,494.40
REPUBLIC SERVICES INC	1,568	82.66	129,610.88
ROBERT HALF INTL INC	721	59.41	42,834.61
ROLLINS INC	906	36.75	33,295.50
TRANSUNION	1,347	65.99	88,888.53
VERISK ANALYTICS INC	1,111	140.50	156,095.50
WASTE CONNECTIONS INC	1,816	91.13	165,492.08
WASTE MANAGEMENT INC	2,872	104.72	300,755.84
AMERCO	51	386.21	19,696.71
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	695	33.91	23,567.45
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	1,000	82.55	82,550.00
CSX CORP	5,471	78.27	428,215.17
DELTA AIR LINES INC	1,035	57.17	59,170.95
EXPEDITORS INTL WASH INC	1,264	75.73	95,722.72
FEDEX CORP	1,707	180.66	308,386.62
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	513	95.99	49,242.87
KANSAS CITY SOUTHERN	748	122.59	91,697.32
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	843	32.04	27,009.72
NORFOLK SOUTHERN CORP	1,883	201.19	378,840.77
OLD DOMINION FREIGHT LINE	362	147.73	53,478.26
SOUTHWEST AIRLINES CO	857	52.21	44,743.97
UNION PACIFIC CORP	4,912	174.75	858,372.00
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS	408	85.68	34,957.44
UNITED PARCEL SERVICE -CL B	4,632	102.09	472,880.88
XPO LOGISTICS INC	748	62.51	46,757.48
APTIV PLC	1,860	79.43	147,739.80
AUTOLIV INC	510	75.32	38,413.20

BORGWARNER INC	1,226	39.77	48,758.02
FORD MOTOR CO	25,323	10.38	262,852.74
GENERAL MOTORS CO	8,523	38.53	328,391.19
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	1,390	17.68	24,575.20
HARLEY-DAVIDSON INC	978	36.30	35,501.40
LEAR CORP	498	141.36	70,397.28
TESLA INC	843	247.06	208,271.58
CAPRI HOLDINGS LTD	879	41.97	36,891.63
D R HORTON INC	2,614	43.75	114,362.50
GARMIN LTD	665	78.37	52,116.05
HANESBRANDS INC	2,121	17.75	37,647.75
HASBRO INC	709	101.19	71,743.71
LEGGETT & PLATT INC	765	39.27	30,041.55
LENNAR CORP	2,115	51.75	109,451.25
LULULEMON ATHLETICA INC	696	173.98	121,090.08
MATTEL INC	2,146	11.47	24,614.62
MOHAWK INDUSTRIES INC	374	136.46	51,036.04
NEWELL BRANDS INC	2,782	15.96	44,400.72
NIKE INC CLASS-B	8,542	82.54	705,056.68
NVR INC	20	3,251.41	65,028.20
POLARIS INDUSTRIES INC	348	93.02	32,370.96
PULTE GROUP INC	1,587	31.47	49,942.89
PVH CORP	454	121.82	55,306.28
RALPH LAUREN CORP	325	123.91	40,270.75
TAPESTRY INC	1,694	30.72	52,039.68
UNDER ARMOUR INC -CLASS C	1,200	19.51	23,412.00
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	1,033	21.88	22,602.04
VF CORP	2,282	93.64	213,686.48
WHIRLPOOL CORP	380	137.75	52,345.00
ARAMARK	1,449	29.53	42,788.97
CARNIVAL CORP	2,902	53.68	155,779.36

CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	147	706.52	103,858.44
DARDEN RESTAURANTS INC	872	119.46	104,169.12
DOMINO'S PIZZA INC	234	277.39	64,909.26
H&R BLOCK INC	1,208	26.85	32,434.80
HILTON WORLDWIDE HOLDING	2,022	90.49	182,970.78
LAS VEGAS SANDS CORP	2,694	64.45	173,628.30
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	2,023	135.15	273,408.45
MCDONALD'S CORP	5,154	198.04	1,020,698.16
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT	2,100	23.75	49,875.00
MGM RESORTS INTERNATIONAL	3,620	24.87	90,029.40
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDINGS	1,294	57.19	74,003.86
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	1,165	127.28	148,281.20
STARBUCKS CORP	8,245	77.96	642,780.20
VAIL RESORTS INC	237	225.32	53,400.84
WYNN RESORTS LTD	576	135.70	78,163.20
YUM! BRANDS INC	2,175	101.47	220,697.25
ACTIVISION BLIZZARD INC	4,804	46.68	224,250.72
ALPHABET INC-CL A	1,994	1,178.86	2,350,646.84
ALPHABET INC-CL C	2,094	1,174.10	2,458,565.40
ALTICE USA INC - A	2,330	23.95	55,803.50
CBS CORP-CLASS B NON VOTING	2,355	48.49	114,193.95
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	1,099	374.74	411,839.26
COMCAST CORP CL-A	30,471	42.76	1,302,939.96
DISCOVERY INC-A	957	28.69	27,456.33
DISCOVERY INC-C	1,761	27.10	47,723.10
DISH NETWORK CORP-A	1,351	34.59	46,731.09
ELECTRONIC ARTS INC	2,046	92.73	189,725.58
FACEBOOK INC-A	16,078	189.77	3,051,122.06
FOX CORP-CLASS A	2,350	37.26	87,561.00
FOX CORP-CLASS B	950	36.70	34,865.00
IAC/INTERACTIVECORP	542	225.65	122,302.30

INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	2,256	22.78	51,391.68
LIBERTY BROADBAND-C	629	99.71	62,717.59
LIBERTY GLOBAL PLC-A	1,182	25.96	30,684.72
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	3,744	25.31	94,760.64
LIBERTY MEDIA CORP LIBERTY FORMULA	1,194	37.80	45,133.20
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY SIRIUSXM	1,460	38.85	56,721.00
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	521	38.59	20,105.39
LIVE NATION ENTERTAINMENT INC	862	63.83	55,021.46
NETFLIX INC	2,910	370.46	1,078,038.60
NEWS CORP-CL A	2,251	11.57	26,044.07
OMNICOM GROUP	1,547	79.11	122,383.17
SIRIUS XM HOLDINGS INC	9,254	5.72	52,932.88
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	670	99.88	66,919.60
THE WALT DISNEY COMPANY	11,994	133.44	1,600,479.36
TRIPADVISOR INC	625	54.94	34,337.50
TWITTER INC	4,548	38.62	175,643.76
VIACOM INC-CLASS B	2,078	28.44	59,098.32
ZILLOW GROUP INC-C	728	33.81	24,613.68
ADVANCE AUTO PARTS INC	436	160.66	70,047.76
AMAZON.COM INC	2,770	1,921.00	5,321,170.00
AUTOZONE INC	180	1,015.36	182,764.80
BEST BUY CO INC	1,761	73.29	129,063.69
BOOKING HOLDINGS INC	310	1,785.00	553,350.00
BURLINGTON STORES INC	397	167.69	66,572.93
CARMAX INC	1,039	77.68	80,709.52
DOLLAR GENERAL CORP	1,788	122.25	218,583.00
DOLLAR TREE INC	1,616	105.45	170,407.20
EBAY INC	6,388	37.68	240,699.84
EXPEDIA GROUP INC	861	122.87	105,791.07
GAP INC/THE	1,363	24.92	33,965.96
GENUINE PARTS CO	1,045	99.09	103,549.05

GRUBHUB INC	533	69.78	37,192.74
HOME DEPOT INC	7,513	194.77	1,463,307.01
KOHL'S CORP	983	67.53	66,381.99
L BRANDS INC	1,387	24.34	33,759.58
LKQ CORP	1,870	27.98	52,322.60
LOWE'S COS INC	5,444	107.12	583,161.28
MACYS INC	1,806	22.79	41,158.74
MERCADOLIBRE INC	293	539.41	158,047.13
NORDSTROM INC	689	39.37	27,125.93
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	540	368.87	199,189.80
QURATE RETAIL INC	2,534	16.97	43,001.98
ROSS STORES INC	2,534	95.76	242,655.84
TARGET CORP	3,336	75.04	250,333.44
TIFFANY & CO	648	103.97	67,372.56
TJX COMPANIES INC	8,354	53.42	446,270.68
TRACTOR SUPPLY COMPANY	716	100.65	72,065.40
ULTA BEAUTY INC	396	342.36	135,574.56
WAYFAIR INC CLASS A	334	145.94	48,743.96
COSTCO WHOLESALE CORP	2,931	240.18	703,967.58
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	2,000	7.97	15,940.00
KROGER CO	5,310	25.77	136,838.70
SYSCO CORP	3,298	72.90	240,424.20
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	5,381	52.94	284,870.14
WALMART INC	9,604	101.30	972,885.20
ALTRIA GROUP INC	12,590	52.94	666,514.60
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	3,811	42.71	162,767.81
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	1,560	52.46	81,837.60
BUNGE LTD	828	49.98	41,383.44
CAMPBELL SOUP CO	1,059	38.23	40,485.57
COCA-COLA COMPANY	26,763	48.00	1,284,624.00
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	1,283	54.10	69,410.30

CONAGRA BRANDS INC	3,399	29.20	99,250.80
CONSTELLATION BRNDS INC-A	1,123	207.87	233,438.01
GENERAL MILLS INC	4,041	51.19	206,858.79
HERSHEY CO/THE	995	124.31	123,688.45
HORMEL FOODS CORP	1,712	38.80	66,425.60
INGREDION INC	417	85.43	35,624.31
JM SMUCKER CO/THE	817	125.09	102,198.53
KELLOGG CO	1,830	57.15	104,584.50
KRAFT HEINZ CO/THE	4,049	32.50	131,592.50
LAMB WESTON HOLDINGS INC	862	68.25	58,831.50
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	833	153.09	127,523.97
MOLSON COORS BREWING CO	1,382	60.08	83,030.56
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	9,850	51.01	502,448.50
MONSTER BEVERAGE CORP	2,810	61.60	173,096.00
PEPSICO INC	9,393	125.98	1,183,330.14
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	10,368	84.43	875,370.24
TYSON FOODS INC	2,035	76.85	156,389.75
CHURCH & DWIGHT CO INC	1,681	72.88	122,511.28
CLOROX COMPANY	867	148.46	128,714.82
COLGATE-PALMOLIVE CO	5,521	70.51	389,285.71
COTY INC-CL A	3,069	12.25	37,595.25
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	1,489	167.29	249,094.81
KIMBERLY-CLARK CORP	2,331	126.18	294,125.58
PROCTER & GAMBLE CO	16,496	104.70	1,727,131.20
ABBOTT LABORATORIES	11,644	76.91	895,540.04
ABIOMED INC	299	261.98	78,332.02
ALIGN TECHNOLOGY INC	527	325.51	171,543.77
AMERISOURCEBERGEN CORP	1,148	77.46	88,924.08
ANTHEM INC	1,728	264.89	457,729.92
BAXTER INTERNATIONAL INC	3,436	76.69	263,506.84
BECTON DICKINSON	1,788	232.55	415,799.40

BOSTON SCIENTIFIC CORP	9,302	36.77	342,034.54
CARDINAL HEALTH INC	2,124	48.94	103,948.56
CENTENE CORP	2,760	55.85	154,146.00
CERNER CORP	2,058	67.75	139,429.50
CIGNA CORP	2,503	155.16	388,365.48
COOPER COS INC/THE	352	289.23	101,808.96
CVS HEALTH CORP	8,622	55.35	477,227.70
DANAHER CORPORATION	4,189	130.73	547,627.97
DAVITA INC	785	56.60	44,431.00
DENTSPLY SIRONA INC	1,305	54.83	71,553.15
DEXCOM INC	520	119.61	62,197.20
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	1,399	178.33	249,483.67
HCA HEALTHCARE INC	1,854	126.51	234,549.54
HENRY SCHEIN INC	900	66.71	60,039.00
HOLOGIC INC	1,969	45.65	89,884.85
HUMANA INC	930	245.28	228,110.40
IDEXX LABORATORIES INC	606	245.45	148,742.70
INTUITIVE SURGICAL INC	766	491.31	376,343.46
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	724	162.22	117,447.28
MCKESSON CORP	1,353	125.68	170,045.04
MEDTRONIC PLC	8,942	89.27	798,252.34
QUEST DIAGNOSTICS	980	97.67	95,716.60
RESMED INC	994	112.34	111,665.96
STRYKER CORP	2,252	187.53	422,317.56
TELEFLEX INC	269	294.33	79,174.77
UNITEDHEALTH GROUP INC	6,389	238.05	1,520,901.45
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	505	122.95	62,089.75
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	661	134.02	88,587.22
VEEVA SYSTEMS INC CLASS A	842	139.62	117,560.04
WELLCARE HEALTH PLANS INC	294	257.56	75,722.64
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	1,381	123.39	170,401.59

ABBVIE INC	10,090	77.95	786,515.50
AGILENT TECHNOLOGIES INC	2,206	76.67	169,134.02
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	1,516	134.52	203,932.32
ALKERMES PLC	965	27.60	26,634.00
ALLERGAN PLC	2,243	141.36	317,070.48
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	533	70.82	37,747.06
AMGEN INC	4,319	173.87	750,944.53
BEIGENE LTD-ADR	192	123.47	23,706.24
BIOGEN INC	1,351	229.02	309,406.02
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	1,246	82.00	102,172.00
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	10,895	47.22	514,461.90
CELGENE CORP	4,745	95.46	452,957.70
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	1,899	31.12	59,096.88
ELI LILLY & CO	6,189	114.94	711,363.66
GILEAD SCIENCES INC	8,667	66.40	575,488.80
ILLUMINA INC	996	320.51	319,227.96
INCYTE CORP	1,063	83.23	88,473.49
IQVIA HOLDINGS INC	1,121	134.37	150,628.77
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	355	128.65	45,670.75
JOHNSON & JOHNSON	17,820	139.97	2,494,265.40
MERCK & CO. INC	17,204	77.90	1,340,191.60
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL INC	182	742.30	135,098.60
MYLAN NV	3,557	21.53	76,582.21
NEKTAR THERAPEUTICS	1,061	32.08	34,036.88
PERRIGO CO PLC	763	48.94	37,341.22
PFIZER INC	38,237	40.83	1,561,216.71
REGENERON PHARMACEUTICALS	536	322.40	172,806.40
SEATTLE GENETICS INC	654	67.58	44,197.32
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	6,528	14.61	95,374.08
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	2,688	271.70	730,329.60
UNITED THERAPEUTICS CORP	255	99.49	25,369.95

VERTEX PHARMACEUTICALS INC	1,721	170.28	293,051.88
WATERS CORP	552	213.21	117,691.92
ZOETIS INC	3,270	101.37	331,479.90
BANK OF AMERICA CORP	61,804	29.92	1,849,175.68
BB & T CORP	5,215	49.82	259,811.30
CIT GROUP INC	660	52.32	34,531.20
CITIGROUP INC	16,199	68.16	1,104,123.84
CITIZENS FINANCIAL GROUP	3,465	35.90	124,393.50
COMERICA INC	1,116	76.49	85,362.84
EAST WEST BANCORP INC	1,210	51.25	62,012.50
FIFTH THIRD BANCORP	4,757	28.08	133,576.56
FIRST REPUBLIC BANK/CA	1,143	103.60	118,414.80
HUNTINGTON BANCSHARES INC	8,025	13.65	109,541.25
JPMORGAN CHASE & CO	21,997	113.21	2,490,280.37
KEYCORP	7,369	17.35	127,852.15
M & T BANK CORP	926	167.55	155,151.30
PEOPLES UNITED FINANCIAL INC	2,212	17.20	38,046.40
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	3,108	132.95	413,208.60
REGIONS FINANCIAL CORP	7,044	15.11	106,434.84
SIGNATURE BANK	324	130.26	42,204.24
SUNTRUST BANKS INC	3,183	63.87	203,298.21
SVB FINAMCIAL GROUP	314	251.35	78,923.90
US BANCORP	10,225	52.56	537,426.00
WELLS FARGO & COMPANY	29,591	47.17	1,395,807.47
ZIONS BANCORPORATION NA	1,532	48.71	74,623.72
AFFILIATED MANAGERS GROUP	316	94.09	29,732.44
ALLY FINANCIAL INC	3,096	29.53	91,424.88
AMERICAN EXPRESS COMPANY	4,865	118.22	575,140.30
AMERIPRISE FINANCIAL INC	1,009	144.27	145,568.43
AXA EQUITABLE HOLDINGS INC	1,400	22.28	31,192.00
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	6,694	48.14	322,249.16

BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	8,588	209.43	1,798,584.84
BLACKROCK INC	805	463.77	373,334.85
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	3,236	91.60	296,417.60
CBOE GLOBAL MARKETS INC	659	101.78	67,073.02
CME GROUP INC	2,350	178.11	418,558.50
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	2,350	80.47	189,104.50
E*TRADE FINANCIAL CORP	1,904	49.83	94,876.32
EATON VANCE CORP	699	39.92	27,904.08
FRANKLIN RESOURCES INC	2,358	33.59	79,205.22
GOLDMAN SACHS GROUP INC	2,230	202.63	451,864.90
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	3,801	80.02	304,156.02
INVESCO LTD	3,248	21.32	69,247.36
JEFFERIES FINANCIAL GROUP INC	1,774	19.91	35,320.34
KKR & CO INC	3,303	23.91	78,974.73
MOODYS CORP	1,172	192.64	225,774.08
MORGAN STANLEY	8,798	46.71	410,954.58
MSCI INC	640	221.93	142,035.20
NASDAQ INC	679	90.90	61,721.10
NORTHERN TRUST CORPORATION	1,481	97.48	144,367.88
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	989	88.04	87,071.56
S&P GLOBAL INC	1,691	214.60	362,888.60
SCHWAB CHARLES CORP	8,180	45.68	373,662.40
SEI INVESTMENTS COMPANY	786	53.17	41,791.62
STATE STREET CORP	2,588	64.99	168,194.12
SYNCHRONY FINANCIAL	4,348	34.00	147,832.00
T ROWE PRICE GROUP INC	1,711	103.30	176,746.30
TD AMERITRADE HOLDING CORP	1,954	52.56	102,702.24
VOYA FINANCIAL INC	949	53.65	50,913.85
AFLAC INC	5,032	50.11	252,153.52
ALLEGHANY CORP	88	652.75	57,442.00
ALLSTATE CORP	2,321	95.66	222,026.86

AMERICAN FINANCIAL GROUP	441	102.42	45,167.22
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	6,006	50.30	302,101.80
AON PLC	1,584	176.79	280,035.36
ARCH CAPITAL GROUP	2,373	33.63	79,803.99
ARTHUR J GALLAGHER & CO	1,280	82.26	105,292.80
ASSURANT INC	327	96.18	31,450.86
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	917	43.29	39,696.93
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	674	40.16	27,067.84
CHUBB LTD	3,034	142.79	433,224.86
CINCINNATI FINL CORP	1,105	95.01	104,986.05
EVEREST RE GROUP LTD	240	246.89	59,253.60
FNF GROUP	1,613	39.32	63,423.16
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	2,505	52.30	131,011.50
LINCOLN NATIONAL CORP	1,611	65.38	105,327.18
LOEWS CORP	1,956	50.16	98,112.96
MARKEL CORP	98	1,052.47	103,142.06
MARSH & MCLENNAN COS	3,281	93.27	306,018.87
METLIFE INC	5,699	47.29	269,505.71
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	2,070	56.45	116,851.50
PROGRESSIVE CORP	3,852	72.79	280,387.08
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	2,838	100.87	286,269.06
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	373	148.58	55,420.34
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	235	155.49	36,540.15
TORCHMARK CORP	845	86.56	73,143.20
TRAVELERS COS INC/THE	1,793	141.71	254,086.03
UNUM GROUP	1,285	35.64	45,797.40
WILLIS TOWERS WATSON PLC	892	174.41	155,573.72
WR BERKLEY CORP	853	60.96	51,998.88
CBRE GROUP INC	2,337	50.03	116,920.11
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	6,849	7.06	48,353.94
JONES LANG LASALLE INC	282	143.04	40,337.28

ACCENTURE PLC-CL A	4,247	173.94	738,723.18
ADOBE INC	3,266	277.07	904,910.62
AKAMAI TECHNOLOGIES	1,230	77.31	95,091.30
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	291	150.91	43,914.81
ANSYS INC	607	188.92	114,674.44
AUTODESK INC	1,469	170.72	250,787.68
AUTOMATIC DATA PROCESSING	2,926	158.35	463,332.10
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	842	115.23	97,023.66
CADENCE DESIGN SYS INC	2,003	68.60	137,405.80
CDK GLOBAL INC	720	53.97	38,858.40
CHECK POINT SOFTWARE TECH	882	116.42	102,682.44
CITRIX SYSTEMS INC	961	97.54	93,735.94
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	3,917	58.51	229,183.67
DXC TECHNOLOGY CO	1,924	60.87	117,113.88
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	2,214	115.89	256,580.46
FIRST DATA CORP	3,155	25.47	80,357.85
FISERV INC	2,743	85.54	234,636.22
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	617	248.66	153,423.22
FORTINET INC	846	81.78	69,185.88
GARTNER INC	645	155.19	100,097.55
GLOBAL PAYMENTS INC	1,128	144.20	162,657.60
GODADDY INC-CLASS A	1,022	78.59	80,318.98
INTL BUSINESS MACHINES CORP	6,071	137.64	835,612.44
INTUIT INC	1,644	244.41	401,810.04
JACK HENRY & ASSOCIATES	452	135.01	61,024.52
LEIDOS HOLDINGS INC	837	73.53	61,544.61
MASTERCARD INC-CLASS A	6,123	245.06	1,500,502.38
MICROSOFT CORP	48,412	125.52	6,076,674.24
ORACLE CORPORATION	17,469	54.00	943,326.00
PALO ALTO NETWORKS INC	637	238.21	151,739.77
PAYCHEX INC	2,225	83.48	185,743.00

PAYPAL HOLDINGS INC	7,507	108.95	817,887.65
PTC INC	659	86.37	56,917.83
RED HAT INC	1,175	184.07	216,282.25
SABRE CORP	1,617	20.92	33,827.64
SALESFORCE.COM INC	5,063	156.90	794,384.70
SERVICENOW INC	1,213	264.81	321,214.53
SPLUNK INC	1,007	131.29	132,209.03
SQUARE INC - A	2,045	68.42	139,918.90
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	1,511	58.92	89,028.12
SYMANTEC CORP	4,318	22.37	96,593.66
SYNOPSYS INC	904	119.57	108,091.28
TABLEAU SOFTWARE INC	476	121.85	58,000.60
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	1,160	99.48	115,396.80
VERISIGN INC	789	193.18	152,419.02
VISA INC-CLASS A SHARES	11,782	160.21	1,887,594.22
VMWARE INC-CLASS A	534	195.13	104,199.42
WESTERN UNION CO	2,612	19.20	50,150.40
WIX.COM LTD	256	137.22	35,128.32
WORKDAY INC	989	198.54	196,356.06
WORLDPAY INC-CLASS A	2,031	117.55	238,744.05
AMPHENOL CORP-CL A	2,093	96.27	201,493.11
APPLE INC	31,609	202.86	6,412,201.74
ARISTA NETWORKS INC	364	265.67	96,703.88
ARROW ELECTRONICS INC	512	73.41	37,585.92
CDW CORP/DE	1,080	106.77	115,311.60
CISCO SYSTEMS INC	29,861	53.45	1,596,070.45
COGNEX CORP	1,014	47.50	48,165.00
COMMSCOPE HOLDING CO INC	1,219	23.48	28,622.12
CORNING INC	5,470	31.16	170,445.20
DELL TECHNOLOGIES-C	982	67.49	66,275.18
F5 NETWORKS INC	356	151.67	53,994.52

FLEX LTD	3,305	10.96	36,222.80
FLIR SYSTEMS INC	850	52.11	44,293.50
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	10,032	15.43	154,793.76
HP INC	10,792	19.61	211,631.12
IPG PHOTONICS CORP	233	158.56	36,944.48
JUNIPER NETWORKS INC	2,624	26.68	70,008.32
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	1,341	86.42	115,889.22
MOTOROLA SOLUTIONS INC	1,174	141.75	166,414.50
NETAPP INC	1,802	69.14	124,590.28
SEAGATE TECHNOLOGY	1,606	48.56	77,987.36
TE CONNECTIVITY LTD	2,421	92.05	222,853.05
TRIMBLE INC	1,470	42.65	62,695.50
WESTERN DIGITAL CORP	1,715	47.21	80,965.15
XEROX CORP	1,347	32.67	44,006.49
AT & T INC	48,231	30.53	1,472,492.43
CENTURYLINK INC	6,760	11.41	77,131.60
SPRINT CORP	5,051	5.79	29,245.29
T-MOBILE US INC	2,274	74.00	168,276.00
VERIZON COMMUNICATIONS	27,384	56.63	1,550,755.92
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	1,241	30.62	37,999.42
AES CORP	3,902	16.53	64,500.06
ALLIANT ENERGY CORP	1,759	46.88	82,461.92
AMEREN CORPORATION	1,662	72.70	120,827.40
AMERICAN ELECTRIC POWER	3,214	84.63	272,000.82
AMERICAN WATER WORKS CO INC	1,245	107.08	133,314.60
ATMOS ENERGY CORP	818	102.23	83,624.14
CENTERPOINT ENERGY INC	3,520	30.81	108,451.20
CMS ENERGY CORP	2,029	54.94	111,473.26
CONSOLIDATED EDISON INC	2,061	85.21	175,617.81
DOMINION ENERGY INC	4,957	75.04	371,973.28
DTE ENERGY COMPANY	1,217	124.57	151,601.69

DUKE ENERGY CORP	4,675	89.26	417,290.50
EDISON INTERNATIONAL	2,213	61.22	135,479.86
ENERGY CORP	1,244	96.51	120,058.44
EVERGY INC	1,880	57.61	108,306.80
EVERSOURCE ENERGY	2,163	71.51	154,676.13
EXELON CORP	6,366	49.08	312,443.28
FIRSTENERGY CORP	3,306	42.03	138,951.18
NEXTERA ENERGY INC	3,098	189.75	587,845.50
NISOURCE INC	2,134	27.74	59,197.16
NRG ENERGY INC	1,788	38.65	69,106.20
OGE ENERGY CORP	1,169	41.84	48,910.96
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	656	93.35	61,237.60
PPL CORPORATION	4,711	30.96	145,852.56
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	3,335	58.84	196,231.40
SEMPRA ENERGY	1,796	125.71	225,775.16
SOUTHERN CO	6,555	52.86	346,497.30
UGI CORP	1,021	53.92	55,052.32
VISTRA ENERGY CORP	1,987	26.15	51,960.05
WEC ENERGY GROUP INC	2,100	78.36	164,556.00
XCEL ENERGY INC	3,451	56.58	195,257.58
ADVANCED MICRO DEVICES	6,314	26.66	168,331.24
ANALOG DEVICES INC	2,540	113.68	288,747.20
APPLIED MATERIALS INC	6,581	42.05	276,731.05
BROADCOM INC	2,747	307.29	844,125.63
INTEL CORP	30,322	50.48	1,530,654.56
KLA-TENCOR CORP	1,088	116.96	127,252.48
LAM RESEARCH CORP	1,068	199.94	213,535.92
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	3,650	23.85	87,052.50
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS INC	1,947	58.27	113,451.69
MICROCHIP TECHNOLOGY	1,623	94.15	152,805.45
MICRON TECHNOLOGY INC	7,691	40.26	309,639.66

	NVIDIA CORPORATION	3,872	173.11	670,281.92	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	2,295	102.46	235,145.70	
	ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	2,510	22.12	55,521.20	
	QORVO INC	738	73.68	54,375.84	
	QUALCOMM INC	8,070	85.20	687,564.00	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	1,051	83.55	87,811.05	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	6,491	113.93	739,519.63	
	XILINX INC	1,700	117.81	200,277.00	
小計	銘柄数：597	2,011,505		164,521,728.11	
				(18,128,649,220)	
	組入時価比率：63.2%			68.3%	
カナダ・ドル	ARC RESOURCES LTD	2,228	7.94	17,690.32	
	CAMECO CORP	2,459	14.16	34,819.44	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	8,397	37.29	313,124.13	
	CENOVUS ENERGY INC	6,171	11.97	73,866.87	
	ENBRIDGE INC	13,564	49.29	668,569.56	
	ENCANA CORP	10,505	9.19	96,540.95	
	HUSKY ENERGY INC	2,214	13.66	30,243.24	
	IMPERIAL OIL LTD	1,669	38.11	63,605.59	
	INTER PIPELINE LTD	2,300	21.05	48,415.00	
	KEYERA CORP	1,234	30.56	37,711.04	
	PEMBINA PIPELINE CORP	3,644	47.20	171,996.80	
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	1,335	18.55	24,764.25	
	SEVEN GENERATIONS ENERGY-A	1,705	8.80	15,004.00	
	SUNCOR ENERGY INC	11,137	42.95	478,334.15	
	TOURMALINE OIL CORP	1,633	19.21	31,369.93	
	TRANSCANADA CORP	6,242	62.80	391,997.60	
	VERMILION ENERGY INC	912	30.90	28,180.80	
	AGNICO EAGLE MINES	1,389	56.15	77,992.35	
	BARRICK GOLD CORP	12,655	17.12	216,653.60	
	CCL INDUSTRIES INC CL B	886	55.56	49,226.16	

FRANCO-NEVADA CORP	1,392	95.78	133,325.76
KINROSS GOLD CORP	7,963	4.06	32,329.78
LUNDIN MINING CORP	4,452	6.67	29,694.84
METHANEX CORP	401	67.50	27,067.50
NEWMONT GOLDCORP CORP	1,696	41.49	70,367.04
NUTRIEN LTD	4,168	69.17	288,300.56
TECK RESOURCES LTD-CLS B	3,060	29.48	90,208.80
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	6,590	1.92	12,652.80
WEST FRASER TIMBER CO LTD	375	64.22	24,082.50
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	2,657	28.30	75,193.10
CAE INC	1,603	31.47	50,446.41
FINNING INTERNATIONAL INC	1,076	23.36	25,135.36
SNC-LAVALIN GROUP INC	1,046	27.83	29,110.18
WSP GLOBAL INC	623	68.67	42,781.41
THOMSON REUTERS CORP	1,224	82.20	100,612.80
CANADIAN NATL RAILWAY CO	4,935	123.94	611,643.90
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	992	294.71	292,352.32
MAGNA INTERNATIONAL INC	2,350	72.24	169,764.00
GILDAN ACTIVEWEAR INC	1,235	50.96	62,935.60
RESTAURANT BRANDS INERNATIONAL INC	1,770	90.64	160,432.80
STARS GROUP INC/THE	1,053	23.70	24,956.10
SHAW COMMUNICATIONS INC	3,585	27.32	97,942.20
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	364	150.40	54,745.60
DOLLARAMA INC	1,838	40.23	73,942.74
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	2,976	79.24	235,818.24
EMPIRE CO LTD	1,076	30.57	32,893.32
GEORGE WESTON LTD	738	99.63	73,526.94
LOBLAW COMPANIES LTD	1,113	67.43	75,049.59
METRO INC	1,892	49.05	92,802.60
SAPUTO INC	1,386	45.38	62,896.68
AURORA CANNABIS INC	3,928	11.58	45,486.24

BAUSCH HEALTH COS INC	1,858	34.34	63,803.72
CANOPY GROWTH CORP	1,191	64.03	76,259.73
BANK OF MONTREAL	4,212	105.55	444,576.60
BANK OF NOVA SCOTIA	8,220	72.93	599,484.60
CANADIAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	2,942	111.98	329,445.16
NATIONAL BANK OF CANADA	2,558	63.52	162,484.16
ROYAL BANK OF CANADA	9,541	106.32	1,014,399.12
TORONTO DOMINION BK	12,115	75.53	915,045.95
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	5,773	63.41	366,065.93
CI FINANCIAL CORP	1,599	19.22	30,732.78
IGM FINANCIAL INC	536	36.43	19,526.48
ONEX CORPORATION	521	75.17	39,163.57
FAIRFAX FINANCIAL HOLDINGS LTD	200	632.65	126,530.00
GREAT-WEST LIFE CO INC	1,787	31.96	57,112.52
IA FINANCIAL CORP INC	660	51.65	34,089.00
INTACT FINANCIAL CORP	1,056	108.29	114,354.24
MANULIFE FINANCIAL CORP	13,812	24.18	333,974.16
POWER CORP OF CANADA	3,005	30.15	90,600.75
POWER FINANCIAL CORP	1,514	31.21	47,251.94
SUN LIFE FINANCIAL INC	4,221	54.88	231,648.48
FIRST CAPITAL REALTY INC	1,227	21.42	26,282.34
BLACKBERRY LIMITED	3,184	12.11	38,558.24
CGI INC	1,855	96.69	179,359.95
CONSTELLATION SOFTWARE	144	1,139.06	164,024.64
OPEN TEXT CORP	2,038	52.99	107,993.62
SHOPIFY INC-CLASS A	622	348.07	216,499.54
BCE INC	944	59.71	56,366.24
ROGERS COMMUNICATIONS-CL B	2,559	69.35	177,466.65
TELUS CORP	600	49.41	29,646.00
ALTAGAS LTD	1,677	18.61	31,208.97
ATCO LTD/CANADA	468	45.19	21,148.92

小計	CANADIAN UTILITIES LTD	789	37.04	29,224.56
	EMERA INC	365	50.60	18,469.00
	FORTIS INC	3,074	49.72	152,839.28
	HYDRO ONE LTD	1,982	21.91	43,425.62
	銘柄数：86	260,685		12,457,665.95 (1,018,787,921)
	組入時価比率：3.6%			3.8%
ユーロ	ENAGAS	1,312	24.92	32,695.04
	ENI SPA	17,190	14.49	249,083.10
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	2,914	14.19	41,349.66
	KONINKLIJKE VOPAK NV	432	38.26	16,528.32
	NESTE OYJ	2,253	28.75	64,773.75
	OMV AG	860	44.27	38,072.20
	REPSOL SA	9,398	14.37	135,049.26
	SNAM SPA	16,686	4.49	75,070.31
	TENARIS SA	2,870	11.80	33,880.35
	TOTAL SA	15,945	46.70	744,711.22
	AIR LIQUIDE	2,866	115.70	331,596.20
	AKZO NOBEL	1,526	74.68	113,961.68
	ARCELORMITTAL(NA)	4,885	17.80	86,992.08
	ARKEMA	600	83.18	49,908.00
	BASF SE	6,201	66.45	412,056.45
	COVESTRO AG	1,134	45.31	51,381.54
	CRH PLC(IE)	5,881	29.44	173,136.64
	EVONIK INDUSTRIES AG	962	25.58	24,607.96
	FUCHS PETROLUB SE-PREF	409	35.54	14,535.86
	HEIDELBERGCEMENT AG	1,130	69.78	78,851.40
	IMERYS SA	223	40.40	9,009.20
	KONINKLIJKE DSM NV	1,361	103.30	140,591.30
LANXESS	514	47.69	24,512.66	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	1,335	26.76	35,724.60	

SOLVAY SA	462	96.72	44,684.64
STORA ENSO OYJ-R SHS	3,224	10.74	34,641.88
SYMRISE AG	914	83.04	75,898.56
THYSSENKRUPP AG	2,581	11.56	29,849.26
UMICORE	1,233	32.64	40,245.12
UPM-KYMMENE OYJ	3,932	24.35	95,744.20
VOESTALPINE AG	718	27.26	19,572.68
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERVICIOS,S.A.	1,923	38.39	73,823.97
AIRBUS SE	3,897	117.54	458,053.38
ALSTOM	906	39.10	35,424.60
ANDRITZ AG	442	37.20	16,442.40
BOUYGUES	1,287	32.78	42,187.86
BRENTAG AG	908	46.32	42,058.56
CNH INDUSTRIAL NV	7,474	9.13	68,252.56
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	3,557	34.70	123,427.90
DASSAULT AVIATION SA	15	1,281.00	19,215.00
EIFFAGE	465	89.92	41,812.80
FERROVIAL SA	3,615	21.55	77,903.25
GEA GROUP AG	998	23.40	23,353.20
HOCHTIEF AG	125	122.40	15,300.00
KINGSPAN GROUP PLC	910	45.80	41,678.00
KION GROUP AG	418	56.92	23,792.56
KONE OYJ-B	2,332	48.64	113,428.48
LEGRAND SA	1,986	61.40	121,940.40
LEONARDO SPA	2,496	9.77	24,395.90
METSO OYJ	647	31.36	20,289.92
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	306	204.30	62,515.80
OSRAM LICHT AG	577	29.65	17,108.05
PRYSMIAN SPA	1,486	16.98	25,232.28
REXEL SA	1,880	11.27	21,187.60
SAFRAN SA	2,219	124.55	276,376.45

SCHNEIDER ELECTRIC SE	3,750	72.54	272,025.00
SIEMENS AG	5,099	102.48	522,545.52
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENER	1,460	15.12	22,082.50
THALES SA	623	102.40	63,795.20
VINCI S.A	3,428	86.62	296,933.36
WARTSILA OYJ	2,598	13.66	35,488.68
BUREAU VERITAS SA	2,410	21.45	51,694.50
EDENRED	1,404	41.16	57,788.64
RANDSTAD NV	695	49.48	34,388.60
SOCIETE BIC SA	157	76.45	12,002.65
TELEPERFORMANCE	339	168.00	56,952.00
WOLTERS KLUWER	2,083	60.58	126,188.14
ADP	173	179.70	31,088.10
AENA SME SA	395	164.40	64,938.00
ATLANTIA SPA	2,899	23.40	67,836.60
BOLLORE	5,461	4.14	22,630.38
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	1,422	20.37	28,966.14
DEUTSCHE POST AG-REG	6,651	29.49	196,137.99
FRAPORT AG	244	73.20	17,860.80
GETLINK	2,720	14.31	38,923.20
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	2,268	72.28	163,931.04
BAYERISCHE MOTOREN WERKE(PFD)	314	62.65	19,672.10
CONTINENTAL AG	766	140.60	107,699.60
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	6,136	56.62	347,420.32
FAURECIA	475	41.32	19,627.00
FERRARI NV	872	123.00	107,256.00
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	7,417	13.67	101,405.22
MICHELIN(CGDE)-B	1,218	110.75	134,893.50
NOKIAN RENKAAT OYJ	737	28.18	20,768.66
PEUGEOT SA	4,095	21.76	89,107.20
PIRELLI & C SPA	2,542	5.88	14,946.96

PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	899	61.14	54,964.86
RENAULT SA	1,391	58.29	81,081.39
VALEO SA	1,413	30.17	42,630.21
VOLKSWAGEN AG	186	156.50	29,109.00
VOLKSWAGEN AG-PFD	1,262	154.42	194,878.04
ADIDAS AG	1,257	250.00	314,250.00
ESSILORLUXOTTICA	1,960	105.80	207,368.00
HERMES INTERNATIONAL	219	611.60	133,940.40
HUGO BOSS AG	372	61.30	22,803.60
KERING	517	507.20	262,222.40
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON	1,861	335.05	623,528.05
MONCLER SPA	1,103	35.57	39,233.71
PUMA SE	48	549.00	26,352.00
SEB SA	143	157.20	22,479.60
ACCOR SA	1,539	36.49	56,158.11
PADDY POWER BETFAIR PLC	486	72.64	35,303.04
SODEXO	530	102.00	54,060.00
AXEL SPRINGER SE	284	49.66	14,103.44
EUTELSAT COMMUNICATIONS	1,087	15.74	17,114.81
JC DECAUX SA	467	28.60	13,356.20
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	1,378	14.22	19,602.05
PUBLICIS GROUPE	1,527	52.76	80,564.52
RTL GROUP	189	46.78	8,841.42
SES	2,139	14.82	31,699.98
TELENET GROUP HOLDING NV	340	46.14	15,687.60
UBISOFT ENTERTAINMENT	483	81.10	39,171.30
VIVENDI	7,109	25.12	178,578.08
DELIVERY HERO SE	516	41.34	21,331.44
INDITEX	7,280	25.48	185,494.40
ZALANDO SE	652	40.05	26,112.60
CARREFOUR SA	3,475	17.58	61,090.50

CASINO GUICHARD PERRACHON	336	35.50	11,928.00
COLRUYT SA	357	65.00	23,205.00
JERONIMO MARTINS	1,509	14.01	21,141.09
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	8,338	21.22	176,932.36
METRO AG	985	14.85	14,632.17
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	5,178	75.75	392,233.50
DANONE	4,228	69.86	295,368.08
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	3,580	9.05	32,399.00
HEINEKEN HOLDING NV	861	89.85	77,360.85
HEINEKEN NV	1,761	95.68	168,492.48
KERRY GROUP PLC-A(IE)	1,123	102.00	114,546.00
PERNOD-RICARD SA	1,454	154.90	225,224.60
REMY COINTREAU	139	118.80	16,513.20
BEIERSDORF AG	591	98.24	58,059.84
HENKEL AG & CO KGAA	607	82.65	50,168.55
HENKEL AG & KGAA VORZUG	1,259	86.86	109,356.74
L'OREAL	1,671	236.10	394,523.10
UNILEVER NV-CVA	10,258	53.31	546,853.98
BIOMERIEUX	258	70.90	18,292.20
FRESENIUS MEDICAL CARE AG	1,530	73.20	111,996.00
FRESENIUS SE & CO KGAA	2,831	49.37	139,780.62
KONINKLIJKE PHILIPS NV	6,595	36.99	243,949.05
SARTORIUS AG-VORZUG	207	163.50	33,844.50
SIEMENS HEALTHINEERS AG	881	36.76	32,385.56
BAYER AG	6,279	59.61	374,291.19
EUROFINS SCIENTIFIC	67	389.80	26,116.60
GRIFOLS SA	1,749	24.70	43,200.30
IPSEN	220	101.00	22,220.00
MERCK KGAA	919	96.40	88,591.60
ORION OYJ	646	29.65	19,153.90
QIAGEN N.V.	1,811	33.11	59,962.21

RECORDATI SPA	656	35.66	23,392.96
SANOFI	7,517	76.23	573,020.91
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	161	120.80	19,448.80
UCB SA	740	69.28	51,267.20
ABN AMRO GROUP NV-CVA	2,481	20.08	49,818.48
AIB GROUP PLC	5,183	4.07	21,094.81
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA	45,223	5.14	232,627.11
BANCO DE SABADELL SA	32,993	1.03	33,982.79
BANCO SANTANDER SA	108,621	4.24	461,584.93
BANK OF IRELAND GROUP PLC	5,770	5.61	32,398.55
BANKIA SA	7,806	2.34	18,312.87
BANKINTER SA	3,911	6.84	26,751.24
BNP PARIBAS	7,538	46.87	353,343.75
CAIXABANK	25,406	2.79	70,933.55
COMMERZBANK AG	5,918	7.74	45,823.07
CREDIT AGRICOLE SA	8,132	12.08	98,275.22
ERSTE GROUP BANK AG	2,222	33.91	75,348.02
ING GROEP NV-CVA	26,683	10.81	288,443.23
INTESA SANPAOLO	99,825	2.24	223,807.65
KBC GROEP NV	1,717	60.88	104,530.96
MEDIOBANCA SPA	3,594	9.20	33,086.36
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	915	23.30	21,319.50
SOCIETE GENERALE	5,207	27.08	141,031.59
UNICREDIT SPA	13,536	11.44	154,960.12
AMUNDI SA	368	63.05	23,202.40
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	13,730	7.01	96,343.41
DEUTSCHE BOERSE AG	1,300	121.05	157,365.00
EURAZEO SE	289	69.80	20,172.20
EXOR NV	636	57.36	36,480.96
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	474	83.22	39,446.28
NATIXIS	5,580	5.10	28,458.00

WENDEL SA	173	120.80	20,898.40
AEGON NV	13,647	4.46	60,920.20
AGEAS	1,066	45.81	48,833.46
ALLIANZ SE-REG	2,841	210.10	596,894.10
ASSICURAZIONI GENERALI	7,950	17.09	135,865.50
AXA	12,598	22.50	283,517.99
CNP ASSURANCES	982	20.24	19,875.68
HANNOVER RUECK SE	354	133.60	47,294.40
MAPFRE SA	6,736	2.64	17,823.45
MUNCHENER RUECKVER AG-REG	1,001	210.50	210,710.50
NN GROUP NV	1,783	37.33	66,559.39
POSTE ITALIANE SPA	3,215	9.41	30,278.87
SAMPO OYJ-A SHS	2,939	40.13	117,942.07
SCOR SE	953	35.60	33,926.80
AROUNDTOWN SA	4,574	7.33	33,564.01
DEUTSCHE WOHNEN SE	2,511	41.48	104,156.28
VONOVIA SE	3,346	47.10	157,596.60
ADYEN NV	51	659.40	33,629.40
AMADEUS IT GROUP SA	3,000	65.34	196,020.00
ATOS SE	564	66.30	37,393.20
CAPGEMINI SA	1,130	104.15	117,689.50
DASSAULT SYSTEMES SA	907	134.25	121,764.75
SAP SE	6,536	110.06	719,352.16
WIRECARD AG	805	133.50	107,467.50
WORLDLINE SA	225	52.05	11,711.25
INGENICO GROUP	367	73.50	26,974.50
NOKIA OYJ	37,799	4.46	168,791.43
1&1 DRILLISCH AG	286	32.92	9,415.12
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	22,311	14.86	331,586.08
ELISA OYJ	837	37.98	31,789.26
ILIAD SA	166	98.82	16,404.12

	KONINKLIJKE KPN NV	25,910	2.70	70,086.55
	ORANGE S.A	13,647	13.91	189,829.77
	PROXIMUS	901	24.95	22,479.95
	TELECOM ITALIA SPA	67,963	0.48	32,900.88
	TELECOM ITALIA-RSP	34,357	0.45	15,460.65
	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	4,447	2.86	12,722.86
	TELEFONICA SA	31,813	7.22	229,721.67
	UNITED INTERNET AG	732	34.92	25,561.44
	E.ON SE	14,895	9.50	141,532.29
	EDP - ENERGIAS DE PORTUGAL SA	20,043	3.30	66,141.90
	ELECTRICITE DE FRANCE	3,548	12.55	44,545.14
	ENDESA SA	1,857	22.43	41,652.51
	ENEL SPA	54,090	5.60	303,012.18
	ENGIE	12,321	13.15	162,082.75
	FORTUM OYJ	2,610	18.69	48,780.90
	IBERDROLA SA	41,587	8.02	333,610.91
	INNOGY SE	818	40.54	33,161.72
	NATURGY ENERGY GROUP SA	2,057	26.06	53,605.42
	RED ELECTRICA CORP	3,283	18.53	60,833.99
	RWE AG	3,057	21.99	67,223.43
	SUEZ	2,186	12.76	27,893.36
	TERNA SPA	8,428	5.42	45,696.61
	UNIPER SE	1,184	26.31	31,151.04
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	3,936	21.60	85,017.60
	VERBUND AG	404	43.88	17,727.52
	ASML HOLDING NV	2,758	179.48	495,005.84
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	7,972	19.76	157,542.66
	STMICROELECTRONICS NV	4,015	15.33	61,570.02
小計	銘柄数：238	1,290,615		25,456,012.11
				(3,138,471,733)
	組入時価比率：10.9%			11.8%

英・ボンド	BP PLC	132,874	5.33	708,484.16
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	30,389	23.75	721,738.75
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	25,010	23.76	594,362.65
	WOOD GROUP (JOHN) PLC	4,158	4.38	18,212.04
	ANGLO AMERICAN PLC	7,266	19.43	141,221.97
	ANTOFAGASTA PLC	2,587	8.53	22,072.28
	BHP GROUP PLC	14,509	17.64	256,054.83
	CRODA INTERNATIONAL PLC	753	50.35	37,913.55
	FRESNILLO PLC	1,363	7.36	10,039.85
	GLENCORE PLC	78,101	2.89	226,102.39
	JOHNSON MATTHEY PLC	1,137	32.22	36,634.14
	MONDI PLC	2,840	16.41	46,618.60
	RIO TINTO PLC	7,927	44.10	349,580.70
	ASHTREAD GROUP PLC	3,630	20.37	73,943.10
	BAE SYSTEMS PLC	21,896	4.71	103,327.22
	BUNZL PLC	2,472	22.32	55,175.04
	DCC PLC	777	66.12	51,375.24
	FERGUSON PLC	1,686	53.96	90,976.56
	MEGGITT PLC	4,775	5.45	26,042.85
	MELROSE INDUSTRIES PLC	35,812	1.88	67,613.05
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	11,413	9.12	104,155.03
	ROLLS-ROYCE-C SHARE	810,323	0.001	810.32
	SMITHS GROUP PLC	2,320	15.00	34,800.00
	WEIR GROUP PLC/THE	1,481	16.14	23,903.34
	BABCOCK INTL GROUP PLC	1,585	5.08	8,051.80
	EXPERIAN PLC	6,391	21.81	139,387.71
G4S PLC	9,712	2.10	20,395.20	
INTERTEK GROUP PLC	1,234	51.26	63,254.84	
RELX PLC	13,272	17.16	227,747.52	
EASYJET PLC	1,034	10.83	11,198.22	
ROYAL MAIL PLC	5,604	2.42	13,567.28	

BARRATT DEVELOPMENTS PLC	5,921	5.83	34,566.79
BERKELEY GROUP HOLDINGS	729	37.04	27,002.16
BURBERRY GROUP PLC	2,434	19.25	46,854.50
PERSIMMON PLC	2,395	21.54	51,588.30
TAYLOR WIMPEY PLC	26,759	1.80	48,259.85
CARNIVAL PLC	1,017	39.88	40,557.96
COMPASS GROUP PLC	10,578	17.17	181,624.26
GVC HOLDINGS PLC	3,383	6.17	20,900.17
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP	1,075	49.82	53,561.87
MERLIN ENTERTAINMENTS	4,501	3.64	16,424.14
TUI AG-DI	2,576	8.51	21,937.21
WHITBREAD PLC	1,078	45.25	48,779.50
AUTO TRADER GROUP PLC	5,559	5.74	31,919.77
INFORMA PLC	9,313	7.60	70,778.80
ITV PLC	21,241	1.31	27,953.15
PEARSON PLC	4,589	8.07	37,042.40
WPP PLC	8,834	9.65	85,248.10
KINGFISHER PLC	12,465	2.52	31,461.66
MARKS & SPENCER GROUP PLC	9,460	2.77	26,204.20
NEXT PLC	820	57.10	46,822.00
J SAINSBURY PLC	10,278	2.13	21,984.64
TESCO PLC	66,257	2.47	163,654.79
WM MORRISON SUPERMARKETS	13,082	2.14	28,113.21
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	2,088	25.33	52,889.04
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC(GB)	15,349	28.73	441,053.51
COCA-COLA HBC AG-CDI	1,189	27.32	32,483.48
DIAGEO PLC	16,401	32.12	526,800.12
IMPERIAL BRANDS PLC	6,391	23.27	148,750.52
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	4,397	59.99	263,776.03
UNILEVER PLC	7,530	45.93	345,852.90
CONVATEC GROUP PLC	8,641	1.40	12,097.40

NMC HEALTH PLC	650	27.27	17,725.50
SMITH & NEPHEW PLC	6,186	15.82	97,862.52
ASTRAZENECA PLC	8,430	57.63	485,820.90
GLAXOSMITHKLINE PLC	33,034	15.17	501,390.05
BARCLAYS PLC	113,628	1.59	181,145.75
HSBC HOLDINGS PLC	131,312	6.62	869,548.06
LLOYDS BANKING GROUP PLC	465,019	0.61	287,428.24
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	28,333	2.35	66,582.55
STANDARD CHARTERED PLC	19,194	6.92	132,937.64
3I GROUP PLC	7,169	10.57	75,812.17
HARGREAVES LANSDOWN PLC	1,683	22.72	38,237.76
INVESTEC PLC	4,212	4.81	20,259.72
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	2,165	51.12	110,674.80
SCHRODERS PLC	743	31.04	23,062.72
ST JAMES'S PLACE PLC	3,222	11.18	36,038.07
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	13,715	2.73	37,483.09
ADMIRAL GROUP PLC	1,238	21.40	26,493.20
AVIVA PLC	27,152	4.17	113,332.44
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	7,912	3.17	25,112.68
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	41,261	2.72	112,229.92
PRUDENTIAL PLC	17,406	16.75	291,550.50
RSA INSURANCE GROUP PLC	5,975	5.30	31,703.35
MICRO FOCUS INTERNATIONAL	2,561	19.20	49,184.00
SAGE GROUP PLC/THE	6,344	7.07	44,877.45
BT GROUP PLC	56,331	2.24	126,688.41
VODAFONE GROUP PLC	180,097	1.40	252,135.80
CENTRICA PLC	33,197	1.06	35,222.01
NATIONAL GRID PLC	22,470	8.34	187,512.15
SEVERN TRENT	1,392	19.98	27,819.12
SSE PLC	7,132	11.56	82,445.92
UNITED UTILITIES GROUP PLC	4,005	8.10	32,440.50

小計	銘柄数：93 組入時価比率：5.9%	2,783,829		11,692,459.65 (1,683,714,189) 6.3%	
スイス・フラン	CLARIANT AG	1,179	19.69	23,220.40	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG	48	607.50	29,160.00	
	GIVAUDAN-REG	62	2,631.00	163,122.00	
	LAFARGEHOLCIM LTD	3,392	51.04	173,127.68	
	SIKA AG-REG	931	154.30	143,653.30	
	ABB LTD-REG	12,678	19.57	248,171.85	
	GEBERIT AG-REG	261	458.60	119,694.60	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	115	210.00	24,150.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	332	214.20	71,114.40	
	ADECCO GROUP AG-REG	1,327	57.92	76,859.84	
	SGS SA-REGB	39	2,569.00	100,191.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	316	143.20	45,251.20	
	CIE FINANCIERE RICHEMON	3,621	72.04	260,856.84	
	SWATCH GROUP AG/THE	344	55.55	19,109.20	
	THE SWATCH GROUP AG-B	238	288.70	68,710.60	
	DUFREY AG-REG	205	97.74	20,036.70	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	13	1,856.00	24,128.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT	1	76,900.00	76,900.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	6	6,790.00	40,740.00	
	NESTLE SA-REG	20,295	97.52	1,979,168.40	
	ALCON INC	2,874	59.79	171,836.46	
	SONOVA HOLDING AG-REG	327	207.00	67,689.00	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	61	831.20	50,703.20	
	LONZA GROUP AG-REG	517	312.30	161,459.10	
NOVARTIS AG-REG	14,371	82.95	1,192,074.45		
ROCHE HOLDING AG-GENUSS CHEIN	4,658	266.45	1,241,124.10		
VIFOR PHARMA AG	281	132.10	37,120.10		
CREDIT SUISSE GROUP AG	17,813	12.78	227,739.20		

	JULIUS BAER GROUP LTD	1,773	46.79	82,958.67
	PARGESA HOLDING SA	229	78.80	18,045.20
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	131	762.40	99,874.40
	UBS GROUP AG	26,169	12.51	327,374.19
	BALOISE-HOLDING AG	285	166.90	47,566.50
	SWISS LIFE HOLDING	241	454.40	109,510.40
	SWISS RE LTD	1,991	91.34	181,857.94
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	980	318.10	311,738.00
	SWISS PRIME SITE	449	82.15	36,885.35
	TEMENOS AG	356	164.45	58,544.20
	SWISSCOM AG-REG	187	473.60	88,563.20
小計	銘柄数：39	119,096		8,220,029.67 (888,338,606)
	組入時価比率：3.1%			3.3%
スウェーデン・ クローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	1,158	273.40	316,597.20
	BOLIDEN AB	1,663	241.30	401,281.90
	ALFA LAVAL AB	1,793	213.50	382,805.50
	ASSA ABLOY AB-B	6,822	199.45	1,360,647.90
	ATLAS COPCO AB-A SHS	4,918	281.60	1,384,908.80
	ATLAS COPCO AB-B SHS	2,294	257.10	589,787.40
	EPIROC AB-A	3,901	95.38	372,077.38
	EPIROC AB-B	2,262	91.19	206,271.78
	SANDVIK AB	7,977	164.80	1,314,609.60
	SKANSKA AB-B SHS	2,080	160.45	333,736.00
	SKF AB-B SHARES	2,215	164.20	363,703.00
	VOLVO AB-B SHS	10,728	141.00	1,512,648.00
	SECURITAS AB-B SHS	1,811	162.65	294,559.15
	ELECTROLUX AB-SER B	1,406	228.30	320,989.80
	HUSQVARNA AB-B SHS	2,611	86.50	225,851.50
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	5,151	166.44	857,332.44
	ICA GRUPPEN AB	474	360.50	170,877.00

	SWEDISH MATCH AB	1,033	466.30	481,687.90	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	4,234	277.80	1,176,205.20	
	NORDEA BANK ABP	20,116	74.62	1,501,055.92	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB	11,170	88.64	990,108.80	
	SVENSKA HANDELSBANKEN AB-SHS	10,446	101.95	1,064,969.70	
	SWEDBANK AB - A SHARES	6,048	148.30	896,918.40	
	INDUSTRIVARDEN AB	1,007	207.10	208,549.70	
	INVESTOR AB-B SHS	3,132	439.30	1,375,887.60	
	KINNEVIK AB	1,415	271.00	383,465.00	
	LUNDBERGS AB-B SHS	477	314.00	149,778.00	
	ERICSSON LM-B SHS	20,531	89.14	1,830,133.34	
	HEXAGON AB-B SHS	1,517	481.30	730,132.10	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	390	548.50	213,915.00	
	TELE2 AB-B SHS	2,944	122.45	360,492.80	
	TELIA COMPANY AB	20,070	40.34	809,623.80	
小計	銘柄数：32	163,794		22,581,607.61	
				(259,236,855)	
	組入時価比率：0.9%			1.0%	
ノルウェー・ク ローネ	AKER BP ASA	668	255.60	170,740.80	
	EQUINOR ASA	7,840	185.45	1,453,928.00	
	NORSK HYDRO ASA	8,167	34.73	283,639.91	
	YARA INTERNATIONAL ASA	1,041	379.00	394,539.00	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	613	210.60	129,097.80	
	MOWI ASA	3,165	189.05	598,343.25	
	ORKLA ASA	4,743	72.76	345,100.68	
	DNB ASA	6,693	155.00	1,037,415.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	1,253	166.45	208,561.85	
	TELENOR ASA	5,174	178.15	921,748.10	
小計	銘柄数：10	39,357		5,543,114.39	
				(69,787,810)	
	組入時価比率：0.2%			0.3%	

デンマーク・ク ローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	583	692.80	403,902.40	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	1,390	309.40	430,066.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	1,360	588.20	799,952.00	
	ISS A/S	980	208.90	204,722.00	
	A P MOELLER-MAERSK A/S-B	39	8,402.00	327,678.00	
	AP MOLLER - MAERSK A/S	36	7,865.00	283,140.00	
	DSV A/S	1,383	611.00	845,013.00	
	PANDORA A/S	647	281.60	182,195.20	
	CARLSBERG AS-B	672	868.40	583,564.80	
	COLOPLAST-B	888	726.20	644,865.60	
	DEMANT A/S	628	220.50	138,474.00	
	GENMAB A/S	362	1,098.50	397,657.00	
	H LUNDBECK A/S	434	290.30	125,990.20	
	NOVO NORDISK A/S-B	12,221	317.80	3,883,833.80	
	DANSKE BANK A/S	5,174	113.05	584,920.70	
	TRYG A/S	737	203.00	149,611.00	
	ORSTED A/S	1,360	511.80	696,048.00	
小計	銘柄数：17	28,894		10,681,633.70	(176,353,772)
	組入時価比率：0.6%				0.7%
オーストラリ ア・ドル	CALTEX AUSTRALIA LTD	1,582	25.84	40,878.88	
	OIL SEARCH LIMITED	7,928	7.44	58,984.32	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	10,293	7.52	77,403.36	
	SANTOS LTD	10,294	6.90	71,028.60	
	WASHINGTON H.SOULPATTINSON & COMPANY LTD	617	22.46	13,857.82	
	WOODSIDE PETROLEUM LIMITED	6,354	34.90	221,754.60	
	WORLEYPARSONS LTD	1,865	13.51	25,196.15	
	ALUMINA LTD	15,775	2.19	34,547.25	
	AMCOR LTD	8,458	16.30	137,865.40	
	BHP GROUP LIMITED	19,854	37.30	740,554.20	

BLUESCOPE STEEL LTD	3,379	13.51	45,650.29
BORAL LTD	7,124	4.95	35,263.80
FORTESCUE METALS GROUP LTD	9,605	7.60	72,998.00
INCITEC PIVOT LTD	9,850	3.34	32,899.00
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	2,687	18.84	50,623.08
NEWCREST MINING LIMITED	5,697	24.86	141,627.42
ORICA LIMITED	2,209	18.67	41,242.03
RIO TINTO LIMITED	2,664	96.05	255,877.20
SOUTH32 LTD	37,094	3.36	124,635.84
CIMIC GROUP LIMITED	569	45.00	25,605.00
BRAMBLES LIMITED	11,377	12.06	137,206.62
SEEK LTD	1,933	19.74	38,157.42
AURIZON HOLDINGS LTD	16,472	4.88	80,383.36
SYDNEY AIRPORT CO LTD	6,782	7.59	51,475.38
TRANSURBAN GROUP	17,827	13.48	240,307.96
ARISTOCRAT LEISURE LTD	4,272	25.69	109,747.68
CROWN RESORTS LTD	2,284	13.45	30,719.80
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES	366	41.48	15,181.68
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	334	37.88	12,651.92
TABCORP HOLDINGS LIMITED	11,170	4.62	51,605.40
REA GROUP LTD	322	81.44	26,223.68
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	3,640	4.05	14,742.00
WESFARMERS LTD	7,901	36.00	284,436.00
COLES GROUP LIMITED	6,648	12.81	85,160.88
WOOLWORTHS GROUP LTD	9,017	32.35	291,699.95
COCA-COLA AMATIL LIMITED	3,091	8.79	27,169.89
TREASURY WINE ESTATES LTD	4,210	16.17	68,075.70
COCHLEAR LTD	454	191.00	86,714.00
RAMSAY HEALTH CARE LTD	821	64.16	52,675.36
SONIC HEALTHCARE LTD	2,865	26.35	75,492.75
CSL LIMITED	3,038	198.59	603,316.42

	AUST AND NZ BANKING GROUP LTD	18,773	27.50	516,257.50	
	BANK OF QUEENSLAND LTD	2,471	8.83	21,818.93	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK	2,995	10.44	31,267.80	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	11,600	74.61	865,476.00	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LIMITED	17,771	25.84	459,202.64	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	22,298	27.06	603,383.88	
	AMP LTD	18,037	2.19	39,501.03	
	ASX LTD	1,188	75.11	89,230.68	
	CHALLENGER LTD	3,359	7.80	26,200.20	
	MACQUARIE GROUP LTD	2,211	124.89	276,131.79	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	13,749	7.91	108,754.59	
	MEDIABANK PRIVATE LTD	15,980	2.89	46,182.20	
	QBE INSURANCE GROUP LIMITED	9,826	12.80	125,772.80	
	SUNCORP GROUP LTD	9,423	13.61	128,247.03	
	LENDLEASE GROUP	3,490	13.11	45,753.90	
	COMPUTERSHARE LTD	2,829	17.92	50,695.68	
	TELSTRA CORP LTD	24,506	3.36	82,340.16	
	TPG TELECOM LTD	2,243	7.02	15,745.86	
	AGL ENERGY LTD	4,862	22.36	108,714.32	
	APA GROUP	9,187	9.77	89,756.99	
	AUSNET SERVICES	11,262	1.80	20,271.60	
小計	銘柄数：62	486,782		8,382,341.67	
				(647,703,540)	
	組入時価比率：2.3%			2.4%	
ニュージーランド・ドル	FLETCHER BUILDING LIMITED	5,350	5.23	27,980.50	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	5,550	8.00	44,400.00	
	A2 MILK CO LTD	4,503	16.44	74,029.32	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	3,335	15.60	52,026.00	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	2,319	12.00	27,828.00	
	SPARK NEW ZEALAND LIMITED	10,816	3.61	39,099.84	
	MERIDIAN ENERGY LTD	7,995	4.18	33,419.10	

小計	銘柄数：7	39,868		298,782.76	
				(21,730,470)	
	組入時価比率：0.1%			0.1%	
香港・ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	18,613	81.60	1,518,820.80	
	NWS HOLDINGS LTD	9,000	16.72	150,480.00	
	MTR CORP	8,941	47.30	422,909.30	
	MINTH GROUP LTD	4,000	25.10	100,400.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	8,156	55.90	455,920.40	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	4,500	25.50	114,750.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	16,904	57.05	964,373.20	
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	5,800	14.90	86,420.00	
	SANDS CHINA LTD	18,200	42.25	768,950.00	
	SHANGRI-LA ASIA LTD	8,000	10.70	85,600.00	
	SJM HOLDINGS LTD	12,000	10.08	120,960.00	
	WYNN MACAU LTD	9,553	20.90	199,657.70	
	WH GROUP LIMITED	51,500	8.35	430,025.00	
	BANK OF EAST ASIA	7,657	24.75	189,510.75	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	25,995	34.60	899,427.00	
	HANG SENG BANK LTD	4,696	206.00	967,376.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	7,851	265.20	2,082,085.20	
	AIA GROUP LTD	80,889	81.80	6,616,720.20	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	18,363	62.55	1,148,605.65	
	HANG LUNG GROUP LTD	5,000	21.90	109,500.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	12,000	17.60	211,200.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	10,475	47.75	500,181.25	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	4,000	43.90	175,600.00	
	KERRY PROPERTIES LIMITED	3,500	32.80	114,800.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	48,000	12.96	622,080.00	
	SINO LAND CO	19,800	13.54	268,092.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	11,065	135.10	1,494,881.50	
	SWIRE PACIFIC LTD 'A'	3,520	97.05	341,616.00	

	SWIRE PROPERTIES LTD	6,800	32.50	221,000.00	
	WHARF HOLDINGS LTD	7,385	23.05	170,224.25	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	7,385	60.05	443,469.25	
	WHEELOCK AND COMPANY LTD	5,144	55.90	287,549.60	
	PCCW LTD	25,000	4.74	118,500.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	3,814	63.65	242,761.10	
	CLP HOLDINGS LIMITED	11,296	88.35	998,001.60	
	HK ELECTRIC INVESTMENTS AND HK ELECTRIC	16,500	7.69	126,885.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	62,984	18.82	1,185,358.88	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	8,320	55.20	459,264.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	1,800	87.70	157,860.00	
小計	銘柄数：39	594,406		25,571,815.63	
				(359,028,291)	
	組入時価比率：1.3%			1.4%	
シンガポール・ ドル	KEPPEL CORP LTD	8,600	6.72	57,792.00	
	SEBNCORP INDUSTRIES LTD	6,234	2.63	16,395.42	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	9,200	3.91	35,972.00	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING	14,400	1.53	22,032.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	13,318	2.61	34,759.98	
	SATS LTD	4,200	5.25	22,050.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	3,500	9.64	33,740.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	36,993	0.95	35,143.35	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	10,100	2.44	24,644.00	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	604	35.05	21,170.20	
	GOLDEN AGRI RESOURCES LIMITED	41,029	0.29	12,103.55	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	11,800	3.53	41,654.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	11,710	26.77	313,476.70	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	20,745	11.57	240,019.65	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	8,866	26.00	230,516.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	7,900	7.36	58,144.00	
	CAPITALAND LTD	15,275	3.57	54,531.75	

	CITY DEVELOPMENTS LTD	2,500	9.00	22,500.00	
	UOL GROUP LTD	3,100	7.31	22,661.00	
	VENTURE CORP LTD	1,700	16.96	28,832.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	55,608	3.16	175,721.28	
小計	銘柄数：21	287,382		1,503,858.88	
				(121,647,144)	
	組入時価比率：0.4%			0.5%	
イスラエル・新 シェケル	ISRAEL CHEMICALS LTD	4,209	19.45	81,865.05	
	ELBIT SYSTEMS LTD	145	493.60	71,572.00	
	BANK HAPOALIM LTD	6,188	26.84	166,085.92	
	BANK LEUMI LE- ISRAEL	8,782	24.45	214,719.90	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	794	78.17	62,066.98	
	AZRIELI GROUP	258	200.00	51,600.00	
	NICE LTD	358	476.10	170,443.80	
	BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	13,300	2.58	34,433.70	
	小計	銘柄数：8	34,034		852,787.35
				(26,146,460)	
	組入時価比率：0.1%			0.1%	
合計		8,140,247		26,539,596,011	
				(26,539,596,011)	

（注1）比率は左より組入時価の純資産総額に対する比率、及び各小計欄の合計金額に対する比率であります。

（注2）通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額であります。

（注3）合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係わるもので、内書であります。

(2) 株式以外の有価証券

（令和1年5月8日現在）

種類	通貨	銘柄	口数	評価額	備考
投資信託受益証券	香港・ドル	HKT TRUST AND HKT LTD	22,136	267,402.88	
		小計	22,136	267,402.88	
		銘柄数：1			(3,754,336)
		組入時価比率：0.0%		0.5%	

	合計			3,754,336	
				(3,754,336)	
投資証券	米・ドル	AGNC INVESTMENT CORP	3,021	53,169.60	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES	762	106,306.62	
		AMERICAN TOWER CORP	2,909	552,273.65	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT (REIT)	9,229	89,059.85	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	920	181,046.80	
		BOSTON PROPERTIES INC	1,060	139,474.80	
		BROOKFIELD PROPERTY REIT I-A	945	19,032.30	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	546	54,092.22	
		CROWN CASTLE INTL CORP	2,760	340,114.80	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	1,400	164,388.00	
		DUKE REALTY CORP	2,102	63,690.60	
		EQUINIX INC	530	251,712.90	
		EQUITY RESIDENTIAL	2,494	186,476.38	
		ESSEX PROPERTY TRUST	451	125,788.41	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	745	77,599.20	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST(REIT)	433	56,186.08	
		HCP INC	2,768	82,486.40	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	5,314	102,879.04	
		INVITATION HOMES INC	1,839	45,257.79	
		IRON MOUNTAIN INC	1,603	49,468.58	
		KIMCO REALTY CORP	2,480	44,540.80	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	869	42,224.71	
		MACERICH CO/THE	623	25,237.73	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	830	89,623.40	
		NATIONAL RETAIL PROPERTIES	923	48,235.98	
		PROLOGIS INC	4,214	313,184.48	
		PUBLIC STORAGE	1,014	225,746.82	
		REALTY INCOME CORP	1,984	132,193.92	
		REGENCY CENTERS CORP	897	58,412.64	

	SBA COMMUNICATIONS CORP	783	160,006.05	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	2,003	348,582.09	
	SL GREEN REALTY CORP	701	59,276.56	
	UDR INC	1,994	86,838.70	
	VENTAS INC	2,365	144,194.05	
	VEREIT INC	5,694	46,633.86	
	VORNADO REALTY TRUST	1,271	84,674.02	
	WELLTOWER INC	2,472	186,339.36	
	WEYERHAEUSER CO	5,271	137,204.13	
	WP CAREY INC	947	73,581.90	
小計	銘柄数：39	79,166	5,047,235.22	
			(556,154,848)	
	組入時価比率：1.9%		78.5%	
カナダ・ドル	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	890	20,470.00	
	RIOCAN REIT	957	24,901.14	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INVESTMENT	439	14,794.30	
小計	銘柄数：3	2,286	60,165.44	
			(4,920,329)	
	組入時価比率：0.0%		0.7%	
ユーロ	COVIVIO	403	39,191.75	
	GECINA SA	267	35,884.80	
	ICADE	206	15,810.50	
	KLEPIERRE	1,688	53,053.84	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	985	147,306.75	
小計	銘柄数：5	3,549	291,247.64	
			(35,907,921)	
	組入時価比率：0.1%		5.1%	
英・ポンド	BRITISH LAND CO PLC	8,045	48,125.19	
	HAMMERSON PLC	4,940	14,913.86	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	6,057	55,784.97	
	SEGRO PLC	8,155	55,405.07	

小計	銘柄数：4 組入時価比率：0.1%	27,197	174,229.09 (25,088,988) 3.5%
オーストラリア・ドル	DEXUS	7,954	98,629.60
	GOODMAN GROUP	11,687	152,632.22
	GPT GROUP	14,397	81,774.96
	MIRVAC GROUP	21,484	61,014.56
	SCENTRE GROUP	37,083	136,836.27
	STOCKLAND	20,553	77,073.75
	VICINITY CENTRES	19,022	47,364.78
小計	銘柄数：7 組入時価比率：0.2%	132,180	655,326.14 (50,637,050) 7.2%
香港・ドル	LINK REIT	13,716	1,298,905.20
小計	銘柄数：1 組入時価比率：0.1%	13,716	1,298,905.20 (18,236,629) 2.6%
シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TR	25,072	74,463.84
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	15,981	30,683.52
	CAPITALAND MALL TRUST	14,700	36,015.00
	SUNTEC REIT	13,100	23,973.00
小計	銘柄数：4 組入時価比率：0.0%	68,853	165,135.36 (13,357,799) 1.9%
合計			704,303,564 (704,303,564)
合計			708,057,900 (708,057,900)

(注1) 比率は左より組入時価の純資産総額に対する比率、及び各小計欄の合計金額に対する比率であります。

(注2) 通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額であります。

(注3) 合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係わるもので、内書であります。

有価証券明細表注記

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	合計金額に 対する比率
米・ドル	株式 597銘柄	97.0%			66.5%
	投資証券 39銘柄			3.0%	2.0%
カナダ・ドル	株式 86銘柄	99.5%			3.7%
	投資証券 3銘柄			0.5%	0.0%
ユーロ	株式 238銘柄	98.9%			11.5%
	投資証券 5銘柄			1.1%	0.1%
英・ポンド	株式 93銘柄	98.5%			6.2%
	投資証券 4銘柄			1.5%	0.1%
スイス・フラン	株式 39銘柄	100.0%			3.3%
スウェーデン・ク ローナ	株式 32銘柄	100.0%			1.0%
ノルウェー・クロー ネ	株式 10銘柄	100.0%			0.3%
デンマーク・クロー ネ	株式 17銘柄	100.0%			0.6%
オーストラリア・ド ル	株式 62銘柄	92.7%			2.4%
	投資証券 7銘柄			7.3%	0.2%
ニュージーランド・ ドル	株式 7銘柄	100.0%			0.1%
香港・ドル	株式 39銘柄	94.2%			1.3%
	投資信託受益 証券 1銘柄		1.0%		0.0%
	投資証券 1銘柄			4.8%	0.1%
シンガポール・ドル	株式 21銘柄	90.1%			0.4%
	投資証券 4銘柄			9.9%	0.0%
イスラエル・新シェ ケル	株式 8銘柄	100.0%			0.1%

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」に記載しております。

- (1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。
なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第5期中間計算期間(令和1年5月9日から令和1年11月8日まで)の中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による中間監査を受けております。

【中間財務諸表】

【動的パッケージファンド<DC年金>】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第4期 令和1年5月8日現在	第5期中間計算期間末 令和1年11月8日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	15,558,237	6,151,978
親投資信託受益証券	383,175,283	456,062,343
未収利息	8	-
流動資産合計	398,733,528	462,214,321
資産合計	398,733,528	462,214,321
負債の部		
流動負債		
未払解約金	-	377,651
未払受託者報酬	58,877	70,199
未払委託者報酬	1,098,975	1,310,442
その他未払費用	7,409	8,818
流動負債合計	1,165,261	1,767,110
負債合計	1,165,261	1,767,110
純資産の部		
元本等		
元本	389,461,001	442,754,121
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	8,107,266	17,693,090
(分配準備積立金)	13,183,819	12,716,203
元本等合計	397,568,267	460,447,211
純資産合計	397,568,267	460,447,211
負債純資産合計	398,733,528	462,214,321

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第4期中間計算期間 自 平成30年5月9日 至 平成30年11月8日	第5期中間計算期間 自 令和1年5月9日 至 令和1年11月8日
営業収益		
受取利息	17	4
有価証券売買等損益	4,805,622	9,287,060
営業収益合計	4,805,605	9,287,064
営業費用		
支払利息	3,382	1,873
受託者報酬	53,730	70,199
委託者報酬	1,002,833	1,310,442
その他費用	7,014	8,818
営業費用合計	1,066,959	1,391,332
営業利益又は営業損失()	5,872,564	7,895,732
経常利益又は経常損失()	5,872,564	7,895,732
中間純利益又は中間純損失()	5,872,564	7,895,732
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額()	280,291	165,182
期首剰余金又は期首欠損金()	7,496,910	8,107,266
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,862,158	2,180,276
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,862,158	2,180,276
剰余金減少額又は欠損金増加額	632,439	325,002
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	632,439	325,002
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金()	3,134,356	17,693,090

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第5期中間計算期間	
	自	至
	令和1年5月9日	令和1年11月8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。	

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第4期	第5期中間計算期間末
	令和1年5月8日現在	令和1年11月8日現在
1. 期首元本額	282,265,566円	389,461,001円
期中追加設定元本額	138,378,667円	68,403,957円
期中一部解約元本額	31,183,232円	15,110,837円
2. 受益権の総数	389,461,001口	442,754,121口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	第4期 令和1年5月8日現在	第5期中間計算期間末 令和1年11月8日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表に計上している金融商品は、原則として時価評価としているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 親投資信託受益証券</p> <p>原則として、親投資信託受益証券の基準価額で評価しております。</p> <p>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>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、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	<p>(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 該当事項はありません。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には、合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。</p>	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	第4期 令和1年5月8日現在	第5期中間計算期間末 令和1年11月8日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0208円 (10,208円)	1.0400円 (10,400円)

（参考）

当ファンドは、「MHAM日本債券インデックスマザーファンド」受益証券、「MHAM外国債券インデックスマザーファンド」受益証券、「MHAM TOPIXマザーファンド」受益証券及び「MHAM外国株式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、中間貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同親投資信託の受益証券であります。

同親投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

MHAM日本債券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11月8日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	846,523,837
国債証券	95,399,538,250
地方債証券	7,600,194,579
特殊債券	8,543,168,256
社債券	5,292,041,400
未収入金	3,938,064,100
未収利息	232,258,362
前払費用	5,830,170
流動資産合計	121,857,618,954
資産合計	121,857,618,954
負債の部	
流動負債	
未払解約金	246,383,000
流動負債合計	246,383,000
負債合計	246,383,000
純資産の部	
元本等	
元本	96,629,718,420
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	24,981,517,534
元本等合計	121,611,235,954
純資産合計	121,611,235,954
負債純資産合計	121,857,618,954

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5月9日 至 令和1年11月8日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	令和1年11月8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	122,368,202,545円
同期中追加設定元本額	10,598,107,589円
同期中一部解約元本額	36,336,591,714円
元本の内訳	
ファンド名	
動的パッケージファンド<DC年金>	203,399,039円
コア資産形成ファンド	188,176,881円
MHAM日本債券インデックスファンド（ファンドラップ）	47,449,008,604円
MHAM動的パッケージファンド [適格機関投資家限定]	36,253,059,979円
MHAM日本債券パッシブファンド [適格機関投資家限定]	7,593,590,131円
MHAM動的パッケージ4資産ファンド [適格機関投資家限定]	4,942,483,786円
計	96,629,718,420円
2. 受益権の総数	96,629,718,420口

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	令和1年11月8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。

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	令和1年11月8日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1,2585円 (12,585円)

MHAM外国債券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11月8日現在

資産の部	
流動資産	
預金	1,088,056,873
コール・ローン	17,741,324
国債証券	24,863,829,594
未収利息	148,714,890
前払費用	35,540,785
差入委託証拠金	47,475,889
流動資産合計	26,201,359,355
資産合計	26,201,359,355
負債の部	
流動負債	
未払金	351,059,696
未払解約金	11,102,700
流動負債合計	362,162,396
負債合計	362,162,396
純資産の部	
元本等	
元本	19,841,056,583
剰余金	
剰余金又は欠損金()	5,998,140,376
元本等合計	25,839,196,959
純資産合計	25,839,196,959
負債純資産合計	26,201,359,355

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5月9日 至 令和1年11月8日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	令和1年11月8日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	18,254,512,323円
同期中追加設定元本額	8,206,700,528円
同期中一部解約元本額	6,620,156,268円
元本の内訳	
ファンド名	
動的パッケージファンド<DC年金>	90,543,577円
コア資産形成ファンド	83,318,562円
MHAM外国債券インデックスファンド（ファンドラップ）	707,824,129円
MHAM外国債券インデックスファンド<為替ヘッジあり>（ファンドラップ）	850,327,489円
MHAM動的パッケージファンド [適格機関投資家限定]	15,084,136,922円
MHAM外国債券パッシブファンド [適格機関投資家限定]	3,024,905,904円
計	19,841,056,583円
2. 受益権の総数	19,841,056,583口

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	令和1年11月8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。

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

令和1年11月8日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1,3023円 (13,023円)

MHAM TOPIXマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

令和1年11月8日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	723,756,190
株式	51,812,474,610
派生商品評価勘定	50,731,476
未収入金	3,757,384
未収配当金	490,369,981
差入委託証拠金	30,240,000
流動資産合計	53,111,329,641
資産合計	53,111,329,641
負債の部	
流動負債	
前受金	54,335,700
未払解約金	161,039,000
流動負債合計	215,374,700
負債合計	215,374,700
純資産の部	
元本等	
元本	25,886,857,270
剰余金	
剰余金又は欠損金()	27,009,097,671
元本等合計	52,895,954,941
純資産合計	52,895,954,941
負債純資産合計	53,111,329,641

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5月9日 至 令和1年11月8日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	令和1年11月8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	21,543,095,659円
同期中追加設定元本額	6,371,280,535円
同期中一部解約元本額	2,027,518,924円
元本の内訳	
ファンド名	
MHAMスリーウェイオープン	864,954,698円
MHAM TOPIXオープン	4,302,613,296円
MHAM日本株式インデックスファンド（ファンドラップ）	15,110,133,924円
動的パッケージファンド＜DC年金＞	20,964,363円
コア資産形成ファンド	19,123,366円
MHAM TOPIXファンドVA（適格機関投資家専用）	155,995,890円
MHAM動的パッケージファンド〔適格機関投資家限定〕	3,583,940,692円
MHAM日本株式パッシブファンド〔適格機関投資家限定〕	1,829,131,041円
計	25,886,857,270円
2. 受益権の総数	25,886,857,270口

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	令和1年11月8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	<p>(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、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。

(デリバティブ取引等に関する注記)

株式関連

種類	令和1年11月8日現在				
	契約額等(円)	うち		時価(円)	評価損益(円)
		1年超			
市場取引 先物取引 買建	954,904,300	-		1,005,655,000	50,750,700
合計	954,904,300	-		1,005,655,000	50,750,700

(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。

(1口当たり情報に関する注記)

	令和1年11月8日現在
1口当たり純資産額	2.0434円
(1万口当たり純資産額)	(20,434円)

MHAM外国株式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11月8日現在

資産の部	
流動資産	
預金	976,453,708
コール・ローン	95,113,692
株式	38,631,185,821
投資信託受益証券	96,752,770
投資証券	958,489,650
派生商品評価勘定	42,881,211
未収入金	2,909,179
未収配当金	40,793,170
差入委託証拠金	383,513,066
流動資産合計	41,228,092,267
資産合計	41,228,092,267
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	14,713
未払解約金	82,717,000
流動負債合計	82,731,713
負債合計	82,731,713
純資産の部	
元本等	
元本	20,239,989,549
剰余金	
剰余金又は欠損金()	20,905,371,005
元本等合計	41,145,360,554
純資産合計	41,145,360,554
負債純資産合計	41,228,092,267

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5月9日 至 令和1年11月8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11月8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	15,015,808,427円
同期中追加設定元本額	7,098,922,949円
同期中一部解約元本額	1,874,741,827円
元本の内訳	
ファンド名	
動的パッケージファンド<DC年金>	19,347,324円
コア資産形成ファンド	17,658,410円
MHAM外国株式インデックスファンド（ファンドラップ）	13,812,008,862円
MHAM外国株式インデックスファンド	283,950,905円
MHAM外国株式インデックスファンド<為替ヘッジあり>（ファンドラップ）	63,125,103円
MHAM動的パッケージファンド [適格機関投資家限定]	3,296,491,002円
MHAM外国株式パッシブファンド [適格機関投資家限定]	2,747,407,943円
計	20,239,989,549円
2. 受益権の総数	20,239,989,549口

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	令和1年11月8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	<p>(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、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。

(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11月8日現在			
	契約額等(円)	うち 1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引 為替予約取引 売建	39,629,865	-	39,626,180	3,685
アメリカ・ドル	29,421,068	-	29,417,840	3,228
イギリス・ポンド	420,312	-	420,300	12
ユーロ	9,788,485	-	9,788,040	445
合計	39,629,865	-	39,626,180	3,685

(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11月8日現在			
	契約額等(円)	うち 1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引 先物取引 買建	1,347,935,833	-	1,390,798,646	42,862,813
合計	1,347,935,833	-	1,390,798,646	42,862,813

(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。

(1口当たり情報に関する注記)

	令和1年11月8日現在
1口当たり純資産額	2.0329円
(1万口当たり純資産額)	(20,329円)

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

令和1年11月29日現在

資産総額	463,797,511円
負債総額	391,398円
純資産総額(-)	463,406,113円
発行済数量	443,361,643口
1口当たり純資産額(/)	1.0452円

(参考)

MHAM日本債券インデックスマザーファンド

令和1年11月29日現在

資産総額	126,487,271,693円
負債総額	1,909,895,500円
純資産総額(-)	124,577,376,193円
発行済数量	98,651,870,746口
1口当たり純資産額(/)	1.2628円

MHAM外国債券インデックスマザーファンド

令和1年11月29日現在

資産総額	28,507,416,872円
負債総額	11,453,849円
純資産総額(-)	28,495,963,023円
発行済数量	21,721,939,003口
1口当たり純資産額(/)	1.3119円

MHAM TOPIXマザーファンド

令和1年11月29日現在

資産総額	49,418,895,356円
負債総額	70,542,020円
純資産総額(-)	49,348,353,336円
発行済数量	24,198,430,642口
1口当たり純資産額(/)	2.0393円

MHAM外国株式インデックスマザーファンド

令和1年11月29日現在

資産総額	38,587,008,805円
負債総額	355,519,968円
純資産総額(-)	38,231,488,837円
発行済数量	18,448,301,498口
1口当たり純資産額(/)	2.0724円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 受益証券の名義書換

該当事項はありません。

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

なお、受益者は、委託会社がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、受益証券の再発行の請求を行わないものとします。

(2) 受益者等名簿

該当事項はありません。

(3) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

(4) 受益権の譲渡制限

譲渡制限はありません。

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

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

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

(5) 受益権の譲渡の対抗要件

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

(6) 受益権の再分割

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

(7) 質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額(2019年11月29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11月29日現在)

会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。

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

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

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

また、取締役会の決議によって、取締役社長を定めることができます。

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

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

投資運用の意思決定機構

1. 投資環境見直しおよび運用方針の策定

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

2. 運用計画、売買計画の決定

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

2【事業の内容及び営業の概況】

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

2019年11月29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	1,307,813,983,101
追加型株式投資信託	866	13,978,029,979,702
単位型公社債投資信託	38	109,040,425,205
単位型株式投資信託	174	1,301,538,068,752
合計	1,104	16,696,422,456,760

3【委託会社等の経理状況】

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

(1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

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

(単位:千円)

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

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

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

(単位:千円)

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

(3)【株主資本等変動計算書】

第33期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

(単位:千円)

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

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

第34期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

(単位:千円)

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

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

重要な会計方針

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

表示方法の変更

第34期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

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

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

注記事項

(貸借対照表関係)

1. 有形固定資産の減価償却累計額

(千円)

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

(損益計算書関係)

1. 関係会社に対する事項

(千円)

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

2. 固定資産除却損の内訳

(千円)

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

(株主資本等変動計算書関係)

第33期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

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

第34期（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

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

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

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

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

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

（2）金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

営業債務である未払手数料は、1年以内の支払期日であります。

（3）金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

（4）金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

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

第33期(2018年3月31日現在)

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

第34期(2019年3月31日現在)

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

(注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3) 未収委託者報酬及び(4) 未収運用受託報酬

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

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

負 債

(1) 未払手数料

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

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(千円)

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

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

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

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第33期(2018年3月31日現在)

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

第34期(2019年3月31日現在)

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

(有価証券関係)

1. 子会社株式及び関連会社株式

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

2. その他有価証券

第33期（2018年3月31日現在）

（千円）

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

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

第34期（2019年3月31日現在）

（千円）

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

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

3. 当該事業年度中に売却したその他有価証券

第33期（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

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

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

第34期(自2018年4月1日至2019年3月31日)

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

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

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

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(千円)

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

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

(千円)

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

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

(千円)

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

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(千円)

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

(注) 特別損失に計上しております。

(5) 数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎

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

3. 簡便法を適用した確定給付制度

(1) 簡便法を適用した制度の、退職給付引当金の期首残高と期末残高の調整表

(千円)

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

(2) 退職給付費用

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

4. 確定拠出制度

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

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

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

(企業結合等関係)

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

1. 結合当事企業

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

2. 企業結合日

2016年10月1日

3. 企業結合の方法

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

4. 結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

5. 企業結合の主な目的

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

6. 合併比率

「3. 企業結合の方法」の吸収合併における合併比率は以下の通りであります。

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

(*) 普通株式と種類株式を合算して算定しております。

7. 交付した株式数

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

8. 経済的持分比率（議決権比率）

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

MHFGが企業結合日に追加取得した当社に対する経済的持分比率 20.00%

MHFGの追加取得後の当社に対する経済的持分比率 70.00%

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

9. 取得企業を決定するに至った主な根拠

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

10. 会計処理

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

11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

(1) 被取得企業の取得原価及びその内訳

取得の対価 MHAMの普通株式 144,212,500千円

取得原価 144,212,500千円

(2) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

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

(3) 企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

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

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

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

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

12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

(1) 貸借対照表項目

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

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

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

(2) 損益計算書項目

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

(注) 営業利益には、のれん及び顧客関連資産の償却額が含まれております。

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

(資産除去債務関係)

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

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

(セグメント情報等)

1. セグメント情報

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

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

(1) サービスごとの情報

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

(2) 地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

(1) 親会社及び法人主要株主等

第33期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

該当はありません。

第34期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

該当はありません。

(2) 子会社及び関連会社等

第33期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

該当はありません。

第34期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

該当はありません。

(3) 兄弟会社等

第33期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

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

第34期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

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

4【利害関係人との取引制限】

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

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

5【その他】

- (1) 定款の変更、事業譲渡又は事業譲受、出資の状況その他の重要事項
該当事項はありません。
- (2) 訴訟事件その他の重要事項
委託会社およびファンドに重要な影響を与えた事実、または与えると予想される事実はありません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

名称	みずほ信託銀行株式会社
資本金の額	247,369百万円（2019年3月末日現在）
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通りです。

名称	資本金の額 (単位：百万円)	事業の内容
株式会社みずほ銀行	1,404,065	日本において銀行業務を営んでおります。

(注) 資本金の額は2019年3月末日現在

2【関係業務の概要】

(1) 受託会社

当ファンドの受託会社として、信託財産を保管・管理し、受益権設定にかかる振替機関への通知等を行います。

(2) 販売会社

当ファンドの販売会社として、受益権の募集の取扱い、販売、一部解約の実行の請求の受付けならびに収益分配金の再投資、償還金および一部解約金の支払い等を行います。

3【資本関係】

該当事項はありません。

持株比率5%以上を記載します。

第3【その他】

(1)目論見書の表紙等にロゴ・マーク、図案を使用し、ファンドの基本的性格を記載する場合があります。また、以下の内容を記載することがあります。

- ・金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書である旨
- ・委託会社の金融商品取引業者登録番号
- ・詳細情報の入手方法
委託会社のホームページアドレス、電話番号および受付時間など
請求目論見書の入手方法およびファンドの投資信託約款の全文が請求目論見書に掲載されている旨
- ・目論見書の使用開始日
- ・届出の効力に関する事項について、次に掲げるいずれかの内容を記載することがあります。
届出をした日および当該届出の効力の発生の有無を確認する方法
届出をした日、届出が効力を生じている旨および効力発生日
- ・ファンドの内容に関して重大な変更を行う場合には、投資信託及び投資法人に関する法律（昭和26年法律第198号）に基づき事前に受益者の意向を確認する旨
- ・投資信託の財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されている旨
- ・請求目論見書は投資者の請求により販売会社から交付される旨および当該請求を行った場合にはその旨の記録をしておくべきである旨
- ・「ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください」との趣旨を示す記載

(2)有価証券届出書第一部「証券情報」、第二部「ファンド情報」に記載の内容について、投資家の理解を助けるため、その内容を説明した図表等を付加して目論見書のその内容に関する箇所に記載することがあります。また、第二部「ファンド情報」第1「ファンドの状況」5「運用状況」について、有価証券届出書提出後の随時入手可能な直近の情報および同情報についての表での表示に加えて、グラフで表示した情報を目論見書に記載することがあります。

(3)投資信託説明書（請求目論見書）に約款の全文を掲載します。

(4)目論見書は電子媒体等として使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。

(5)目論見書は目論見書の別称として「投資信託説明書」と称して使用することがあります。

(6)投信評価機関、投信評価会社などによる評価を取得・使用することがあります。

独立監査人の監査報告書

2019年5月30日

アセットマネジメントOne株式会社
取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

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

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

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

利害関係

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

以上

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

(注2) XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

令和1年7月4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 山野 浩 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」に掲げられている動的パッケージファンド<DC年金>の平成30年5月9日から令和1年5月8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、動的パッケージファンド<DC年金>の令和1年5月8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、当社が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。

2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2019年11月28日

アセットマネジメントOne株式会社
取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

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

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

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

利害関係

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

以上

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

(注2) XBR Lデータは中間監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の中間監査報告書

令和1年12月13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」に掲げられている動的パッケージファンド<DC年金>の令和1年5月9日から令和1年11月8日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な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、動的パッケージファンド<DC年金>の令和1年11月8日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（令和1年5月9日から令和1年11月8日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

(注2) XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。